

11 มกราคม 2565

เรียน นายกสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวม  
ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวม

ที่ นจ. (ว) 1/2565 เรื่อง ชักซ้อมความเข้าใจเกี่ยวกับการแก้ไขโครงการ  
จัดการกองทุนรวมเพื่อจัดให้มีเครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่อง

ตามที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“สำนักงาน ก.ล.ต.”) ได้ออกประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน. 49/2564 ลงวันที่ 22 มิถุนายน พ.ศ. 2564 (“ประกาศที่ ทน. 49/2564”) และประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน. 69/2564 ลงวันที่ 14 ธันวาคม พ.ศ. 2564 (“ประกาศที่ ทน. 69/2564”) เรื่อง หลักเกณฑ์การจัดการกองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย กองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุนประเภทสถาบัน และกองทุนส่วนบุคคล รวมทั้งได้ให้ความเห็นชอบประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุนว่าด้วยแนวปฏิบัติการใช้เครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่อง (Liquidity Risk Management Tools Guideline) (“ประกาศสมาคมฯ”) มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 30 ธันวาคม พ.ศ. 2564 ซึ่งทำให้หลักเกณฑ์ที่กำหนดเกี่ยวกับเครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่องมีความครบถ้วนและบริษัทหลักทรัพย์ที่ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวม (“บริษัทจัดการ”) สามารถกำหนดรายละเอียดเกี่ยวกับเครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่องได้ นั้น

สำนักงาน ก.ล.ต. จึงขอชักซ้อมความเข้าใจเพื่อให้บริษัทจัดการมีความเข้าใจตรงกันเกี่ยวกับการระบุรายละเอียดของเครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่องในโครงการจัดการกองทุนรวม (“โครงการ”) ทั้งกองทุนรวมที่ต้องแก้ไขโครงการและกองทุนรวมที่จัดตั้งใหม่ ในช่วงที่สำนักงาน ก.ล.ต. อยู่ระหว่างปรับปรุงระบบอนุมัติจัดตั้งและจัดการกองทุน (“ระบบ OFAM”) ดังนี้

1. กรณีแก้ไขโครงการหรือจัดตั้งกองทุนรวมก่อนวันที่สำนักงาน ก.ล.ต. ปรับปรุงระบบ OFAM แล้วเสร็จ ให้บริษัทจัดการระบุรายละเอียดเกี่ยวกับเครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่องไว้ในหัวข้อ “การไม่ขายไม่รับซื้อคืนไม่สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนของโครงการ”

2. กรณีแก้ไขโครงการหรือจัดตั้งกองทุนรวมหลังจากวันที่สำนักงาน ก.ล.ต. ปรับปรุงระบบ OFAM แล้วเสร็จ ให้บริษัทจัดการระบุนายละเอียดเครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่องในหัวข้อ “เครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่องของกองทุนรวม”

ทั้งนี้ บริษัทจัดการสามารถระบุนายละเอียดเครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่องไว้ในโครงการได้ตั้งแต่วันที่จัดตั้งกองทุนรวม หากมีเหตุจำเป็นให้ไม่สามารถระบุได้ตั้งแต่วันที่จัดตั้งกองทุนรวม ให้บริษัทจัดการแก้ไขโครงการในภายหลัง ภายในวันที่ 1 กรกฎาคม พ.ศ. 2565 ตามประกาศที่ ทน.69/2564 กำหนด ซึ่งจัดเป็นการแก้ไขโครงการโดยสำนักงาน ก.ล.ต. ให้ความเห็นชอบเป็นการทั่วไป ยกเว้นการแก้ไขโครงการเกี่ยวกับการไม่ขายหรือไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งที่รับไว้แล้วหรือจะหยุดรับคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายคืนหน่วยลงทุน (suspension of dealings) ให้บริษัทจัดการแนบเอกสารแสดงมติเสียงข้างมากจากผู้ถือหน่วยลงทุนประกอบด้วย

อนึ่ง รายละเอียดเกี่ยวกับเครื่องมือในข้อ 1 และ 2 นั้น ต้องเป็นไปตามหลักการที่ประกาศที่ ทน.49/2564 และประกาศสมาคมฯ กำหนด โดยให้บริษัทจัดการระบุนายละเอียดดังกล่าวตามรูปแบบ เงื่อนไข และรายละเอียดการระบุเครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่องในโครงการ (สิ่งที่ส่งมาด้วย)

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ ทั้งนี้ สำนักงาน ก.ล.ต. ขอเสนอชื่อเจ้าหน้าที่สำหรับติดต่อสอบถามคือ นายพิศุทธิ์ บุญวิวัฒนสุนทร เจ้าหน้าที่บริหาร ฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน โทรศัพท์ 0-2033-9914 อีเมล pisut@sec.or.th และ นายพรพงษ์ ศักดาพัฒน์ ผู้ช่วยผู้อำนวยการ ฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน โทรศัพท์ 0-2033-4652 อีเมล pornpong@sec.or.th

ขอแสดงความนับถือ

(นายพงศ์พิชญ์ พิณสาย)

ผู้อำนวยการฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน

เลขาธิการแทน

สิ่งที่ส่งมาด้วย รูปแบบ เงื่อนไข และรายละเอียดการระบุเครื่องมือบริหารความเสี่ยงสภาพคล่อง  
ในโครงการจัดการกองทุนรวม

ฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน

โทรศัพท์/โทรสาร 0-2033-4652