

-ร่าง-

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทน. /๒๕๖

เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไปและผู้ลงทุน

ที่มีใช้รายย่อย และการเข้าทำสัญญา

รับจัดการกองทุนส่วนบุคคล

(ฉบับที่)

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา ๑๖/๖ วรรคสอง (๑) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. ๒๕๓๕ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ ๔) พ.ศ. ๒๕๕๑ และมาตรา ๑๑๗ แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. ๒๕๓๕ คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น (๗) ในข้อ ๙ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน. ๘๘/๒๕๕๘ เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไปและผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย และการเข้าทำสัญญาจัดการกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ ๑๗ ธันวาคม พ.ศ. ๒๕๕๘ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน. ๓๕/๒๕๖๖ เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไปและผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย และการเข้าทำสัญญาจัดการกองทุนส่วนบุคคล (ฉบับที่ ๑๒) ลงวันที่ ๒๓ พฤศจิกายน พ.ศ. ๒๕๖๖

“(๗) กรณีที่เป็นกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management) ตามประกาศการลงทุน บริษัทจัดการกองทุนรวมต้องระบุชื่อของกองทุนรวมให้สะท้อนถึงลักษณะเฉพาะของกลยุทธ์ดังกล่าวดังนี้

(ก) การมุ่งหวังผลตอบแทนเป็นรายวัน (daily)

(ข) การมุ่งหวังผลตอบแทนแบบทวีคูณ (leveraged) หรือตรงกันข้าม (inverse)

กับดัชนีที่ใช้อ้างอิง

ชื่อ L&I ETFs
ต้องมีคำว่า
“daily”
“leveraged” หรือ
“inverse” และ
อัตราทวีคูณ
ได้แก่ “(2x)”
“(-1x)” หรือ
“(-2x)” ไว้ในชื่อ
กองทุนรวม

(ค) จำนวนผลตอบแทนที่มุ่งหวังเมื่อเทียบกับดัชนีที่ใช้อ้างอิง เช่น หนึ่งเท่า (๑x) หรือสองเท่า (๒x)”

ข้อ ๒ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่
ประกาศ ณ วันที่ เป็นต้นไป

(นางพรอนงค์ บุชราตระกูล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน