

-ร่าง-

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สน. /๒๕๖

เรื่อง รายละเอียดของโครงการจัดการกองทุนรวม

(ฉบับที่)

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา ๑๑๘ (๑) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. ๒๕๓๕ สำนักงานออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น (๓/๑) และ (๓/๒) ในข้อ ๕ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. ๒๙/๒๕๖๔ เรื่อง รายละเอียดของโครงการจัดการกองทุนรวม ลงวันที่ ๑๐ พฤษภาคม พ.ศ. ๒๕๖๔

“(๓/๑) กรณีที่เป็นกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management) ต้องมีรายละเอียดตามข้อ ๗/๑

(๓/๒) กรณีที่เป็นกองทุนรวมที่จะมีการลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management) หรือหน่วยลงทุนต่างประเทศที่มีลักษณะในทำนองเดียวกัน ต้องระบุนโยบายการลงทุนในทรัพย์สินดังกล่าวด้วย”

ข้อ ๒ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ ๗/๑ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. ๒๙/๒๕๖๔ เรื่อง รายละเอียดของโครงการจัดการกองทุนรวม ลงวันที่ ๑๐ พฤษภาคม พ.ศ. ๒๕๖๔

“ข้อ ๗/๑ รายการนโยบายการลงทุนเพิ่มเติมของกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management) ตามประกาศการลงทุน ให้ระบุข้อมูลซึ่งแสดงรายละเอียดอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(๑) นโยบายการลงทุน ได้แก่ วิธีการลงทุน และเครื่องมือที่ใช้

นโยบาย L&I
ETFs ต้องมี
รายละเอียดตาม
ข้อ 7/1

retail-MF / AI /
UI fund ที่จะลงทุน
ใน L&I ETFs ต้อง
ระบุในนโยบาย
การลงทุนว่ามี
การลงทุนใน
L&I ETFs

นโยบาย L&I ETFs
ต้องมีรายละเอียด
เพิ่มเติม อย่างน้อย
เกี่ยวกับ วิธีการ
ลงทุน เครื่องมือ
ที่ใช้ กลยุทธ์
และค่าธรรมเนียม

(๒) กลยุทธ์การลงทุนซึ่งต้องระบุอย่างชัดเจนว่าเป็นการมุ่งหวังผลตอบแทนแบบทวีคูณกับดัชนีที่ใช้อ้างอิง หรือแบบตรงกันข้ามกับดัชนีที่ใช้อ้างอิง

(๓) ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอื่นที่เกี่ยวข้องกับการทำธุรกรรมเพื่อให้เป็นไปตามกลยุทธ์การลงทุน”

ข้อ ๓ ในกรณีกองทุนรวมที่มีการลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management) หรือหน่วยของกองทุนต่างประเทศที่มีลักษณะในทำนองเดียวกันไว้แล้วโดยชอบในวันก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ ให้บริษัทจัดการแก้ไขโครงการให้เป็นไปตามข้อ ๕ (๓/๒) แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. ๒๙/๒๕๖๔ เรื่อง รายละเอียดของโครงการจัดการกองทุนรวม ลงวันที่ ๑๐ พฤษภาคม พ.ศ. ๒๕๖๔ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศนี้ ภายใน ๙๐ วัน นับแต่วันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ

ข้อ ๔ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่
เป็นต้นไป
ประกาศ ณ วันที่

(นางพรอนงค์ บุชราตระกูล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

กองทุนที่ลงทุน
ใน L&I ETFs
ก่อนวันที่ประกาศ
นี้มีผลใช้บังคับ
ให้ปฏิบัติตาม
ประกาศใหม่
ภายใน 90 วัน