

เอกสารรับฟังความคิดเห็น

เลขที่ อนจ. 7/2563

เรื่อง ร่างประกาศเกี่ยวกับการจัดทำและจัดส่งข้อมูลการจัดการกองทุนรวม

เผยแพร่เมื่อวันที่ 21 กุมภาพันธ์ 2563

สำนักงานได้จัดทำเอกสารฉบับนี้ขึ้นเพื่อสำรวจความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้อง
ท่านสามารถ download เอกสารเผยแพร่ฉบับนี้ได้จาก www.sec.or.th

ท่านสามารถส่งความเห็นหรือข้อเสนอแนะให้สำนักงานได้
ตามที่ติดต่อด้านล่าง หรือ e-mail: arthipha@sec.or.th หรือ kunpatu@sec.or.th

วันสุดท้ายของการแสดงความคิดเห็น วันที่ 6 มีนาคม 2563

ท่านสามารถติดต่อสอบถามข้อมูลเพิ่มเติมได้จากเจ้าหน้าที่ของสำนักงาน ดังนี้

- | | |
|--------------------------|----------------------|
| 1. นายอิทธิกร พูลถนอมสุข | โทรศัพท์ 0-2263-6039 |
| 2. นางสาวกุลพฐ ศรคุปต์ | โทรศัพท์ 0-2263-6071 |

สำนักงานขอขอบคุณทุกท่านที่เข้าร่วมแสดงความคิดเห็น
และให้ข้อเสนอแนะมา ณ โอกาสนี้

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
เลขที่ 333/3 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900
โทรศัพท์ 1207 หรือ 0-2033-9999 โทรสาร: 0-2033-9660

I. บทนำ

ตามที่สำนักงานมีแนวทางที่จะปรับปรุงแบบรายงานการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ เพื่อให้มีข้อมูลฐานะการลงทุน การดำรงสินทรัพย์สภาพคล่อง และความเสี่ยงของกองทุนที่เพียงพอต่อติดตามความเสี่ยงเชิงระบบ (“systemic risk”) ของธุรกิจจัดการลงทุน และมีมาตรการรองรับได้อย่างทันต่อเหตุการณ์ ซึ่งจะช่วยยับยั้งผลกระทบที่อาจเกิดต่อเศรษฐกิจ ตลาดทุน และผู้ลงทุนรวมทั้งเพื่อเป็นการช่วยลดภาระของผู้ประกอบธุรกิจในการจัดทำและนำเสนอข้อมูลที่มีความซ้ำซ้อน¹ ซึ่งสำนักงานได้จัดให้มีการรับฟังความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้องระหว่างวันที่ 18 ตุลาคม 2561 ถึงวันที่ 19 พฤศจิกายน 2561² และระหว่างวันที่ 6 สิงหาคม 2562 ถึงวันที่ 9 กันยายน 2562³ นั้น

จากการเปิดรับฟังความคิดเห็น สำนักงานพบว่าผู้ประกอบธุรกิจส่วนใหญ่เห็นด้วยกับแนวทางที่สำนักงานเสนอ โดยมีสรุปรายละเอียดการปรับปรุงแบบรายงานตามเอกสารแนบ 1 รวมทั้งได้รับความเห็นและข้อเสนอแนะบางส่วนมาประกอบการพิจารณา โดยเฉพาะอย่างยิ่งในประเด็นที่เกี่ยวข้องกับระยะเวลาที่มีผลใช้บังคับ เพื่อให้ผู้ประกอบธุรกิจมีระยะเวลาที่เพียงพอในการเตรียมความพร้อมด้านระบบงานสำหรับการจัดทำและนำเสนอรายงานที่ปรับปรุงใหม่ดังกล่าวก่อนกำหนดให้มีผลใช้บังคับต่อไป

ดังนั้น เพื่อให้หลักเกณฑ์ของสำนักงานเป็นไปตามแนวทางการปรับปรุงแบบรายงานข้างต้น สำนักงานจึงได้พิจารณาหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง ซึ่งพบว่าหลักเกณฑ์ส่วนใหญ่มีความสอดคล้องกับแนวทางการปรับปรุงแบบรายงานแล้ว ยกเว้นเพียงหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องกับการจัดทำและจัดส่งข้อมูลการจัดการกองทุนรวมและการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวม จึงเห็นควรร่างประกาศเพื่อปรับปรุงหลักเกณฑ์ดังกล่าว ในการนี้ สำนักงานได้จัดทำเอกสารฉบับนี้ขึ้นเพื่อขอรับฟังความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้องเกี่ยวกับร่างประกาศดังกล่าว ซึ่งจะเปิดรับฟังความคิดเห็นไปจนถึงวันที่ 6 มีนาคม 2563

II. เป้าหมายที่ต้องการบรรลุ

เพื่อปรับปรุงหลักเกณฑ์ให้สอดคล้องกับแนวทางการปรับปรุงแบบรายงานของสำนักงานที่มีวัตถุประสงค์เพื่อลดความซ้ำซ้อนและภาระของผู้ประกอบธุรกิจในการจัดทำและจัดส่ง โดยสำนักงานยังคงมีข้อมูลเพียงพอต่อการติดตาม systemic risk ของธุรกิจจัดการลงทุน

¹ ได้แก่ ข้อมูลการลงทุนในต่างประเทศและตราสารอนุพันธ์ของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่ต้องนำเสนอให้ทั้งสำนักงานและธนาคารแห่งประเทศไทย (“อปท.”) และข้อมูลการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่ต้องนำเสนอให้สำนักงาน ทั้งข้อมูลรายเดือนและข้อมูลรายวัน

² เอกสารรับฟังความคิดเห็น เลขที่ อนจ. 42/2561 เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานกองทุน

³ เอกสารรับฟังความคิดเห็น เลขที่ อนจ. 23/2562 เรื่อง หลักการปรับปรุงแนวทางการดำรงสภาพคล่องของกองทุนรวมที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ และเอกสารรับฟังความคิดเห็นเลขที่ อนจ. 24/2562 เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

III. สรุปสาระสำคัญของร่างประกาศ

สำนักงานได้ยกร่างประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. /2563 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนประเภทสถาบัน และกองทุนส่วนบุคคล (ฉบับที่) ซึ่งเนื้อหาของประกาศดังกล่าวเป็นการปรับปรุงข้อกำหนดเกี่ยวกับการจัดทำและจัดส่งแบบรายงานกองทุนรวมของบริษัทจัดการกองทุนรวม โดยยกเลิกรายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนรายเดือน เพื่อลดความซ้ำซ้อนและภาระของผู้ประกอบธุรกิจ คงเหลือเฉพาะรายงานที่ต้องจัดส่งสำนักงาน คือ

1. กำหนดให้บริษัทจัดการจัดทำและจัดส่งรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมเป็นรายเดือน ตามรูปแบบและวิธีการที่สำนักงานกำหนด ซึ่งประกอบด้วยรายละเอียดของหลักทรัพย์และทรัพย์สิน ที่ทุกกองทุนรวมลงทุนหรือมีไว้ และสถานะและการลงทุนของแต่ละกองทุนรวม โดยให้จัดส่งภายใน วันที่ 20 ของเดือนถัดไป

2. กำหนดให้บริษัทจัดการจัดทำและจัดส่งรายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของแต่ละกองทุนรวมเปิดเป็นรายวัน ตามรูปแบบและวิธีการที่สำนักงานกำหนด โดยให้จัดส่งภายในวันทำการถัดไป

อนึ่ง สำนักงานได้จัดทำรายละเอียดเกี่ยวกับรูปแบบ เงื่อนไข และวิธีการจัดทำและจัดส่งข้อมูล ตามหลักเกณฑ์ของร่างประกาศฉบับนี้ รวมทั้งข้อมูลอื่น ๆ ที่ผู้ประกอบธุรกิจต้องดำเนินการตามแนวทางการปรับปรุงแบบรายงานของสำนักงาน เพื่ออำนวยความสะดวกให้ผู้ประกอบธุรกิจในการเตรียมความพร้อมด้านระบบการจัดส่งข้อมูล โดยแสดงไว้ในเอกสารแนบเอกสารรับฟังความคิดเห็นฉบับนี้ กล่าวคือ

- รูปแบบรายงานที่ส่งผ่านระบบ OFAR และ Validation Message (เอกสารแนบ 2)
- วิธีการจัดทำและส่งรายงาน (เอกสารแนบ 3)

IV. ช่วงเวลาที่คาดว่าจะมีผลใช้บังคับ

กำหนดให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2563 เป็นต้นไป

แบบสำรวจความคิดเห็น

เรื่อง ร่างประกาศเกี่ยวกับการจัดทำและจัดส่งข้อมูลการจัดการกองทุนรวม

ข้อมูลทั่วไป

ชื่อผู้ตอบ _____ ตำแหน่ง _____

ชื่อบริษัท _____

โทรศัพท์ _____ โทรสาร _____

อีเมล _____

สถานะของผู้ให้ข้อคิดเห็น (ตอบได้มากกว่า 1 ข้อ)

- บริษัทหลักทรัพย์
- บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน
- ธนาคารพาณิชย์
- อื่น ๆ (ระบุ) _____

กรุณาส่งแบบสำรวจความคิดเห็นกลับไปที่ ฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน สำนักงาน ก.ล.ต.
เลขที่ 333/3 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900 โทรศัพท์ 1207
หรือ email : arhipha@sec.or.th หรือ kunpatu@sec.or.th

*** สำนักงานขอขอบคุณท่านที่ได้ให้ความร่วมมือในการแสดงความคิดเห็นในครั้งนี้ ***

