

รายงาน

ผลการติดตามดูแลการกระทำที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์
การกระทำที่อาจมีลักษณะไม่เป็นธรรมหรือการกระทำที่อาจทำให้ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน
เสียประโยชน์อันพึงได้รับ

สำหรับ

กองทุนรวมภายใต้การจัดการของบริษัทหลักทรัพย์จัดการ กองทุนไทยพาณิชย์ จำกัด
ประจำปี 2565



เรียน ท่านผู้ถือหุ้นลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด (“บริษัทจัดการ”) ได้แต่งตั้งคณะทำงาน Independent Oversight Entity (IOE) ซึ่งประกอบด้วยกำกับและควบคุมร่วมกับสายตรวจสอบ ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) ร่วมกันจัดทำแผนการตรวจสอบและแนวทางในการดำเนินการ เพื่อติดตามดูแลการปฏิบัติงานของบริษัทจัดการที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์แก่ผู้ถือหุ้นลงทุน และอาจมีลักษณะไม่เป็นธรรมหรืออาจทำให้ผู้ถือหุ้นเสียประโยชน์อันพึงได้รับ รวมทั้ง ทบทวนนโยบายการป้องกันและจัดการความขัดแย้งทางผลประโยชน์ เพื่อให้สอดคล้องกับหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์กำหนด สำหรับระยะเวลาตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2565 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2565 โดยมีคณะกรรมการตรวจสอบช่วยพิจารณากลับกรอง และนำเสนอต่อคณะกรรมการบริษัทต่อไป

ขอบเขตและผลการติดตามการดูแลการจัดการความขัดแย้งทางผลประโยชน์ 6 เรื่อง ประกอบด้วย

1. การซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงินกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจ และการซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงินที่ไม่มีราคาตลาดหรือที่ไม่มีสภาพคล่อง
2. วิธีการบริหารจัดการกองทุนรวม
3. การคัดเลือกและติดตามการให้บริการของผู้ให้บริการ
4. การส่งคำสั่งซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงิน
5. การเก็บค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายจากกองทุนรวมหรือผู้ถือหุ้นลงทุน
6. การใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นหลักทรัพย์

ผลการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม

สำหรับผลการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม ประจำปี 2565 ผ่านการพิจารณาจากคณะกรรมการตรวจสอบ และนำเสนอต่อคณะกรรมการบริษัทในการประชุมคณะกรรมการบริษัท ครั้งที่ 1/2566 เมื่อวันที่ 13 มกราคม 2566 โดยผลการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม พบว่าบริษัทมีการปฏิบัติงานเป็นไปตามหลักเกณฑ์และขั้นตอนที่กำหนด และไม่พบประเด็นข้อสังเกตที่มีนัยสำคัญ รวมทั้ง ไม่พบประเด็นการกระทำของบริษัทจัดการที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ ไม่เป็นธรรม หรืออาจทำให้ผู้ถือหุ้นเสียผลประโยชน์อันพึงได้รับ พบเพียงประเด็นที่ควรปรับปรุงให้กระบวนการทำงานมีประสิทธิภาพเพิ่มขึ้น (process enhancement) เท่านั้น โดยมีสาระสำคัญสรุปได้ ดังนี้

สรุปขอบเขต ผลการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม

ขอบเขตการติดตามดูแล	ผลการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม
1. การซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงินกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจ และการซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงินไม่มีราคาตลาดหรือที่ไม่มีสภาพคล่อง โดยมีรายละเอียดขอบเขตที่สำคัญในการติดตามดูแล ดังนี้ ■ สอบทานการกำหนดหลักเกณฑ์และกระบวนการในการคัดเลือกหลักทรัพย์ ■ สอบทานการทำธุรกรรม Cross-Trade ว่า เป็นไปตามกฎเกณฑ์ที่กำหนด ■ สอบทานการลงทุนในหลักทรัพย์ที่ธนาคาร SCB เป็น underwriter ว่ามีความเหมาะสมและมีเหตุผลที่เหมาะสมในการทำธุรกรรม	การทำรายการซื้อขายหลักทรัพย์ระหว่างกองทุนและบุคคลที่เกี่ยวข้องเป็นธุรกรรมที่สมเหตุสมผลและเป็นประโยชน์ต่อกองทุน ราคาที่ใช้เป็นราคาทางการค้าปกติ มีความเหมาะสมสอดคล้องตามเกณฑ์ที่สำนักงาน ก.ล.ต. ได้กำหนด
2. บริหารจัดการกองทุนรวม โดยมีรายละเอียดขอบเขตที่สำคัญในการติดตามดูแล ดังนี้ ■ สอบทานการลงทุนว่าเป็นไปตามข้อกำหนดในหนังสือชี้ชวน ■ สอบทานกลยุทธ์การลงทุนแบบ active/passive fund โดยการใช้ข้อมูลค่า portfolio turnover ratio (PTR) ในการวิเคราะห์ ■ สอบทานการใช้เครื่องมือการบริหารความเสี่ยงหรือการลงทุนตามที่ได้ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวน	บริษัทมีการติดตามวิธีการบริหารจัดการกองทุนรวมทั้งวัตถุประสงค์ นโยบาย และกลยุทธ์การลงทุน เพื่อให้มั่นใจว่าเป็นไปตามที่ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวนเสนอขายหน่วยลงทุน

ขอบเขตการติดตามดูแล	ผลการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม
3. การคัดเลือกและติดตามการให้บริการของผู้ให้บริการ โดยมีรายละเอียดขอบเขตที่สำคัญในการติดตามดูแล ดังนี้ ■ สอบทานหลักเกณฑ์ และวิธีการในการคัดเลือกผู้ให้บริการ เช่น มีการเทียบเคียงกับราคาตลาด/เปรียบเทียบราคาอ้างอิงจากอย่างน้อย 3 ราย ■ สอบทานวิธีการติดตามการให้บริการ การประเมินคุณภาพการให้บริการ	บริษัทมีหลักเกณฑ์ในการคัดเลือก Service Provider ที่เหมาะสม และมีการดำเนินการคัดเลือกให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ อีกทั้งยังมีการประเมินคุณภาพการให้บริการและรายงานอย่างเหมาะสม
4. การส่งคำสั่งซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงิน โดยมีรายละเอียดขอบเขตที่สำคัญในการติดตามดูแล ดังนี้ ■ สอบทานหลักเกณฑ์คัดเลือก Broker ■ สอบทานวิธีการติดตามการให้บริการ การประเมินคุณภาพการให้บริการ ■ สอบทานกระบวนการติดตามดูแลการ Churning	บริษัทมีหลักเกณฑ์ในการคัดเลือก Broker และ Dealers อย่างชัดเจนและเหมาะสม และมีปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์ต่อคู่ค้าเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด รวมทั้งมีการประเมินคุณภาพการให้บริการของ Broker และ Dealer อย่างสม่ำเสมอ
5. การเก็บค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายจากกองทุนรวมหรือผู้ถือหน่วยลงทุน โดยมีรายละเอียดขอบเขตที่สำคัญในการติดตามดูแล ดังนี้ ■ สอบทานการคิดค่า Management Fee ที่เรียกเก็บจากกองทุนว่าเหมาะสมกับนโยบาย และกลยุทธ์การลงทุน ■ สอบทานการเรียกเก็บค่าใช้จ่ายจากกองทุนว่าเป็นไปตามที่หนังสือชี้ชวนกำหนด	บริษัทมีการกำหนดค่าธรรมเนียมเรียกเก็บจากกองทุนอย่างเหมาะสม รวมทั้งมีการจัดเก็บค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายเป็นไปตามที่กำหนดและเปิดเผยไว้ในโครงการ

ขอบเขตการติดตามดูแล	ผลการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม
6. การใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นหลักทรัพย์ โดยมีรายละเอียดขอบเขตที่สำคัญในการติดตามดูแล ดังนี้ ■ สอบทานหลักเกณฑ์/กระบวนการตัดสินใจที่ควรพิจารณาในการใช้สิทธิออกเสียงของกองทุน ■ สอบทานวิธีการติดตามการใช้สิทธิออกเสียงแทนกองทุน ■ สอบทานการเปิดเผยข้อมูลแนวทางในการใช้สิทธิออกเสียงและการดำเนินการใช้สิทธิออกเสียงต่อผู้ลงทุน	บริษัทมีการกำหนดหลักเกณฑ์ในการพิจารณาใช้สิทธิออกเสียงอย่างเหมาะสมและเป็นประโยชน์ต่อกองทุน มีการดำเนินการไปใช้สิทธิตามที่เกณฑ์กำหนด รวมทั้งมีการเปิดเผยข้อมูลการใช้สิทธิออกเสียงอย่างครบถ้วน

คณะทำงาน Independent Oversight Entity (IOE)

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด