

ตารางสรุปการแก้ไขเพิ่มเติมโครงการจัดการกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ โกลบอล อินฟราสตรัคเจอร์ อีควิตี้ (SCBGIF)

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การแก้ไข |
|---|---|---|---|
| คำจำกัดความ | | <u>เพิ่มเติม</u> คำอธิบายศัพท์เรื่องการลงทุนของกองทุนเพื่อประกอบการอธิบายคำย่อและความหมายของคำย่อ รวมถึงคำศัพท์ที่ปรากฏในหัวข้อประเภทและอัตราส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์ | เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม |
| รายละเอียดเกี่ยวกับนโยบายการลงทุนและลักษณะพิเศษ | <p>กองทุนมีนโยบายเน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว (Feeder Fund) <u>โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</u> ได้แก่ Deutsche Invest I Global Infrastructure (กองทุนหลัก) ชนิดหน่วยลงทุน (share class) IDH (P) ในสกุลเงินยูโร (EUR) กองทุนหลักบริหารโดย Deutsche Asset & Wealth Management จดทะเบียนภายใต้กฎหมายของประเทศลักเซมเบิร์ก และอยู่ภายใต้ UCITS กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างให้เงินลงทุนสกุลเงินยูโรเติบโตในระยะยาวโดยได้ผลตอบแทนจากราคาหลักทรัพย์ที่เพิ่มขึ้น (capital gain) ผ่านการลงทุนในตราสารทุนของบริษัทที่ทำธุรกิจเกี่ยวกับโครงสร้างพื้นฐานทั่วโลก (Global Infrastructure sector) โดยกองทุนหลักจะลงทุนอย่างน้อยร้อยละ 70 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุนหลังจากหักสินทรัพย์เพื่อสภาพคล่องแล้ว ในตราสารทุน หลักทรัพย์ตราสารทุนอื่น ๆ และตราสารทุนประเภท uncertificated equity instruments ของผู้ออกที่อยู่ในภาคธุรกิจโครงสร้างพื้นฐานทั่วโลก</p> <p>....</p> <p>ในกรณีสถานการณ์ปกติ กองทุนจะลงทุนในต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนหรือตามอัตราส่วนที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด ทั้งนี้</p> <p>....</p> <p>ในกรณีที่กองทุนหลักมีการลงทุนในตราสารที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (Unrated securities) และ/หรือ ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับที่ต่ำกว่าอันดับความน่าเชื่อถือที่สามารถลงทุนได้ (Non-investment grade) และ/หรือตราสารทุนที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ (unlisted securities) ในอัตราส่วนที่มากกว่าร้อยละ 15 ของ</p> | <p>กองทุนมีนโยบายเน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียว (Feeder Fund) ได้แก่ Deutsche Invest I Global Infrastructure (กองทุนหลัก) ชนิดหน่วยลงทุน (share class) IDH (P) ในสกุลเงินยูโร (EUR) กองทุนหลักบริหารโดย Deutsche Asset & Wealth Management จดทะเบียนภายใต้กฎหมายของประเทศลักเซมเบิร์ก และอยู่ภายใต้ UCITS กองทุนหลักมีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างให้เงินลงทุนสกุลเงินยูโรเติบโตในระยะยาวโดยได้ผลตอบแทนจากราคาหลักทรัพย์ที่เพิ่มขึ้น (capital gain) ผ่านการลงทุนในตราสารทุนของบริษัทที่ทำธุรกิจเกี่ยวกับโครงสร้างพื้นฐานทั่วโลก (Global Infrastructure sector) โดยกองทุนหลักจะลงทุนอย่างน้อยร้อยละ 70 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุนหลังจากหักสินทรัพย์เพื่อสภาพคล่องแล้ว ในตราสารทุน หลักทรัพย์ตราสารทุนอื่น ๆ และตราสารทุนประเภท uncertificated equity instruments ของผู้ออกที่อยู่ในภาคธุรกิจโครงสร้างพื้นฐานทั่วโลกโดยกองทุนมี <u>net exposure</u> ในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศดังกล่าวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน และมีการลงทุนที่ส่งผลให้มี <u>net exposure</u> ที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>....</p> <p>ในกรณีสถานการณ์ปกติ กองทุนจะลงทุนในต่างประเทศ ซึ่งจะส่งผลให้มี <u>net exposure</u> ที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนหรือตามอัตราส่วนที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด ทั้งนี้</p> <p>....</p> <p>กองทุนหลักอาจมีการลงทุนในตราสาร SIP เกินกว่าอัตราส่วนการลงทุนที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด ในกรณีที่กองทุนหลักมีการลงทุนในตราสาร SIP เกินกว่าอัตราส่วนการลงทุนที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด บริษัทจัดการจะปรับลดสัดส่วนการลงทุนในกองทุนหลัก เพื่อให้อัตราส่วนการลงทุนในตราสารดังกล่าว มีอัตราส่วนไม่เกินกว่าหลักเกณฑ์การลงทุนที่สำนักงานคณะกรรมการ</p> | <p>-เพื่อให้เป็นไปตามภาคผนวก 2 (label fund) ของประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม</p> <p>-เพื่อให้เป็นไปประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ที่ สน.64/2558 เรื่อง การลงทุนและการมีไว้เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุน</p> |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|---|---|--|
| | <p>มูลค่าทรัพย์สินของกองทุนหลัก บริษัทจัดการจะปรับลดสัดส่วนการลงทุนในกองทุนหลัก เพื่อให้อัตราส่วนการลงทุนในตราสารดังกล่าว มีอัตราส่วนไม่เกินร้อยละ 15 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ โกลบอล อินฟราสตรัคเจอร์ อีควิตี้ ดังนี้</p> <p>1)บริษัทจัดการจะปรับลดสัดส่วนการลงทุนในกองทุนหลัก ภายใน 15 วันทำการนับแต่วันที่รับทราบข้อมูลการลงทุนในตราสารดังกล่าวเกินร้อยละ 15 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุนหลัก ยกเว้นกรณีที่เกิดจากปัจจัยที่ควบคุมไม่ได้ หรือกรณีจำเป็นและสมควร ที่ทำให้ไม่สามารถดำเนินการได้ภายในระยะเวลาข้างต้น บริษัทจัดการจะดำเนินการให้เสร็จสิ้นโดยไม่ชักช้า ทั้งนี้ เพื่อให้อัตราส่วนการลงทุนในตราสารดังกล่าวเกินกว่าร้อยละ 15 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ โกลบอล อินฟราสตรัคเจอร์ อีควิตี้</p> <p>2)หากการดำเนินการปรับสัดส่วนการลงทุนในกองทุนหลัก มีผลทำให้การลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินในต่างประเทศ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน บริษัทจัดการจะดำเนินการพิจารณาคัดเลือกกองทุนต่างประเทศกองทุนใหม่แทนกองทุนเดิม โดยกองทุนต่างประเทศดังกล่าวจะมีนโยบายการลงทุนสอดคล้องกับวัตถุประสงค์ และ/หรือนโยบายการลงทุนของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ โกลบอล อินฟราสตรัคเจอร์ อีควิตี้ และมีคุณสมบัติตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะดำเนินการให้เสร็จสิ้นโดยไม่ชักช้า และจะแจ้งให้สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด.และผู้ถือหุ้นลงทุนทราบต่อไป</p> <p>3)หากเกิดกรณีใดๆที่ทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถดำเนินการคัดเลือกกองทุนรวมในต่างประเทศกองทุนใหม่แทนกองทุนเดิมได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะดำเนินการเลิกกองทุน โดยจะดำเนินการจำหน่ายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินที่เหลืออยู่ของกองทุน เพื่อคืนเงินตามจำนวนที่รวบรวมได้หลังหักค่าใช้จ่ายและสำรองค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องของกองทุน (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นลงทุนตามสัดส่วนจำนวนหน่วยลงทุนที่ถือต่อจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด</p> <p>...</p> <p>ในกรณีที่บริษัทจัดการอยู่ระหว่างการดำเนินการเปลี่ยน/โอนย้าย กองทุนจะยกเว้นไม่นำเรื่องการลงทุนหรือมีไว้ซึ่ง</p> | <p>ก.ล.ด. กำหนดดังนี้</p> <p>1) <u>บริษัทจัดการจะปรับลดสัดส่วนการลงทุนในกองทุนหลัก ภายใน 15 วันทำการนับแต่วันที่รับทราบข้อมูลการลงทุนในตราสารดังกล่าวเกินกว่าอัตราส่วนการลงทุนที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด ยกเว้นกรณีที่เกิดจากปัจจัยที่ควบคุมไม่ได้ หรือกรณีจำเป็นและสมควร ที่ทำให้ไม่สามารถดำเนินการได้ภายในระยะเวลาข้างต้น บริษัทจัดการจะดำเนินการให้เสร็จสิ้นโดยไม่ชักช้า</u></p> <p>2) <u>หากการดำเนินการปรับสัดส่วนการลงทุนในกองทุนหลัก มีผลทำให้การลงทุนซึ่งส่งผลให้มี net exposure ที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน บริษัทจัดการจะดำเนินการพิจารณาคัดเลือกกองทุนต่างประเทศกองทุนใหม่แทนกองทุนเดิม โดยกองทุนต่างประเทศดังกล่าวจะมีนโยบายการลงทุนสอดคล้องกับวัตถุประสงค์ และ/หรือนโยบายการลงทุนของกองทุนเปิดไทยพาณิชย์ ยูเอสสมอลแคปและมีคุณสมบัติตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด ทั้งนี้ บริษัทจัดการจะดำเนินการให้เสร็จสิ้นโดยไม่ชักช้า และจะแจ้งให้สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด.และผู้ถือหุ้นลงทุนทราบต่อไป</u></p> <p>3) <u>หากเกิดกรณีใดๆที่ทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถดำเนินการคัดเลือกกองทุนรวมในต่างประเทศกองทุนใหม่แทนกองทุนเดิมได้ บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิที่จะดำเนินการเลิกกองทุน โดยจะดำเนินการจำหน่ายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินที่เหลืออยู่ของกองทุน เพื่อคืนเงินตามจำนวนที่รวบรวมได้หลังหักค่าใช้จ่ายและสำรองค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องของกองทุน (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นลงทุนตามสัดส่วนจำนวนหน่วยลงทุนที่ถือต่อจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายแล้วทั้งหมด</u></p> <p>....</p> <p>ในกรณีที่บริษัทจัดการอยู่ระหว่างการดำเนินการเปลี่ยน/โอนย้าย กองทุนจะยกเว้นไม่นำเรื่องการลงทุนซึ่งจะส่งผลให้มี net exposure ที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยง</p> | |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|---|--|---|--|
| | <p>หลักทรัพย์ในต่างประเทศ โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนมาบังคับใช้ในช่วงดำเนินการคัดเลือกและเตรียมการลงทุน เพื่อเป็นกองทุนหลักแทนกองทุนเดิม ซึ่งจะใช้ระยะเวลาภายใน 30 วันทำการ</p> <p>....</p> <p>บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในกรณีที่มีการดำเนินการเปลี่ยน/โอนย้าย กองทุนจะยกเว้นไม่นำเรื่องการลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินในต่างประเทศ (offshore investment) โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน มาบังคับใช้ในช่วงดำเนินการคัดเลือกและเตรียมการลงทุน</p> | <p>ต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน มาบังคับใช้ในช่วงดำเนินการคัดเลือกและเตรียมการลงทุน เพื่อเป็นกองทุนหลักแทนกองทุนเดิม ซึ่งจะใช้ระยะเวลาภายใน 30 วันทำการ</p> <p>....</p> <p>บริษัทจัดการขอสงวนสิทธิในกรณีที่มีการดำเนินการเปลี่ยน/โอนย้าย กองทุนจะยกเว้นไม่นำเรื่องการลงทุนซึ่งจะส่งผลให้มี net exposure ที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนมาบังคับใช้ในช่วงดำเนินการคัดเลือกและเตรียมการลงทุน</p> | |
| รายละเอียดการลงทุนในต่างประเทศ | เน้นลงทุนในต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ไม่เกินวงเงินที่ได้รับการจัดสรร | มีนโยบายการลงทุนซึ่งส่งผลให้มี net exposure ที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน | -เพื่อให้เป็นไปตามภาคผนวก 2 (label fund) ของประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม |
| ประเภทของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นหรือการหาดอกผลโดยวิธีอื่นที่จะลงทุน | <p>3.13.1. ประเภทของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น หรือการหาดอกผลโดยวิธีอื่นที่จะลงทุนในประเทศ:</p> <p>บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือแสวงหาประโยชน์เฉพาะจากหลักทรัพย์ ทรัพย์สินอื่น หรือหาดอกผลโดยวิธีอื่นอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างตามที่ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด เว้นแต่ในกรณีที่คณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. มีประกาศแก้ไขหรือเพิ่มเติมประเภทหรือลักษณะของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินหรือการหาดอกผลโดยวิธีอื่น ทั้งนี้ การลงทุนหรือแสวงหาประโยชน์ดังกล่าวจะลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นที่มีอายุของสัญญา อายุของตราสาร หรือระยะเวลาการฝากเงินไม่เกิน 1 ปี โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อสำรองเงินไว้สำหรับการดำเนินงาน รอคการลงทุน หรือรักษาสภาพคล่อง ดังต่อไปนี้</p> <p>3.13.1.1 ตราสารแห่งหนึ่งในประเทศ ได้แก่ หลักทรัพย์ ตราสารหรือสัญญาที่เสนอขายในประเทศ หรือมีผู้ออกหรือคู่สัญญาเป็นนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย ดังต่อไปนี้</p> <p>(1) ตราสารแห่งหนึ่งที่มีลักษณะคล้ายเงินฝาก ได้แก่</p> <p>(1.1) ตัวแลกเงิน ตัวสัญญาใช้เงิน บัตรเงินฝาก หรือหุ้นกู้ระยะ</p> | <p>ประเภทของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น หรือการหาดอกผลโดยวิธีอื่นที่จะลงทุนในประเทศ :</p> <p><u>บริษัทจัดการจะลงทุนหรือแสวงหาประโยชน์เฉพาะจากหลักทรัพย์ ทรัพย์สินอื่น หรือหาดอกผลโดยวิธีอื่นอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างตามที่ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดดังต่อไปนี้ เว้นแต่ในกรณีที่คณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ให้ความเห็นชอบหรือมีประกาศแก้ไขหรือเพิ่มเติมประเภทหรือลักษณะของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินหรือการหาดอกผลโดยวิธีอื่น</u></p> <p><u>ส่วนที่ 1</u> : ประเภทและคุณสมบัติของตราสารทางการเงินทั่วไป</p> <p>1. <u>ประเภทของตราสาร</u> ได้แก่</p> <p>1.1 ตราสารทุน</p> <p>1.1.1 หุ้น</p> <p>1.1.2 share warrants</p> <p>1.1.3 TSR</p> <p>1.1.4 ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่มี underlying เป็นหุ้นหรือ share warrants</p> <p>1.1.5 ตราสารทุนอื่นที่มีลักษณะทำนองเดียวกับตราสารทุนตาม 1.1.1 - 1.1.4 ตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดเพิ่มเติม</p> | <p>- เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม</p> <p>- เพิ่มการลงทุนในตราสาร Basel III ศึกุก</p> |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|--|---|--|
| | <p>สิ้น ที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือ บริษัทเงินทุน เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัล ผู้สลับ หลัง หรือผู้ค้ำประกัน</p> <p>(1.2) ตัวแลกเงินหรือตัวสัญญาใช้เงินที่บริษัทหลักทรัพย์ที่ ประกอบธุรกิจประเภทการให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์เป็นผู้ ออก ซึ่งกำหนดวันใช้เงินตามตัวไม่เกิน 270 วันนับแต่วันออกตัว และเป็นตัวเมื่อทวงถามหรือเมื่อได้เห็น</p> <p>(1.3) ตัวแลกเงินหรือตัวสัญญาใช้เงิน ที่มีอายุไม่เกิน 90 วัน นับแต่วันที่ออก ซึ่งมีอันดับความน่าเชื่อถือดังต่อไปนี้</p> <p>(ก) อันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหรือของผู้ออกตราสารอยู่ในอันดับแรก ทั้งนี้ ในกรณีที่ เป็นอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ ออกตราสาร ต้องเป็นอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้มาจากการจัด อันดับความน่าเชื่อถือระยะสั้น (short-term rating) ด้วย หรือ</p> <p>(ข) อันดับความน่าเชื่อถือของผู้รับรอง ผู้รับอ่าวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน อยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) ทั้งนี้ โดยการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของสถาบันจัด อันดับความน่าเชื่อถือภายใต้ชื่อ Standard & Poor หรือ Moody's หรือ Fitch หรือสถาบันอื่นที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด.กำหนดเพิ่มเติม</p> <p>(2) ตราสารแห่งหนึ่งทั่วไป ได้แก่</p> <p>(2.1) ตราสารภาครัฐไทย อันได้แก่</p> <p>(ก) ตัวเงินคลัง</p> <p>(ข) พันธบัตรรัฐบาล หรือพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย</p> <p>(ค) พันธบัตร ตัวแลกเงิน ตัวสัญญาใช้เงิน หุ้นกู้ หรือใบสำคัญ แสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้ที่กระทรวงการคลังหรือกองทุนเพื่อการ พัฒนาและพัฒนาระบบสถาบันการเงินเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้ รับรอง ผู้รับอ่าวัล หรือ ผู้ค้ำประกัน</p> <p>(2.2) ตราสารภาครัฐต่างประเทศ อันได้แก่ ตราสารที่มีรูปแบบ ทำนองเดียวกับตราสารภาครัฐไทยที่รัฐบาลต่างประเทศ องค์การหรือหน่วยงานของรัฐบาลต่างประเทศ รัฐวิสาหกิจตาม กฎหมายต่างประเทศ หรือองค์การระหว่างประเทศ เป็นผู้ออก หรือผู้ค้ำประกัน ทั้งนี้ ตราสารดังกล่าวต้องมีลักษณะตาม เงื่อนไขท้ายข้อ 3.13.1.1 ด้วย</p> <p>(2.3) ตราสารที่เปลี่ยนมือได้ ซึ่งหมายถึง พันธบัตร ตัวแลก เงิน ตัวสัญญาใช้เงิน หรือหุ้นกู้ที่ไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพและ</p> | <p>1.2 ตราสารหนี้</p> <p>1.2.1 พันธบัตร</p> <p>1.2.2 ตัวเงินคลัง</p> <p>1.2.3 หุ้นกู้ (ไม่รวมหุ้นกู้แปลงสภาพ หุ้นกู้อนุพันธ์ และตราสาร Basel III)</p> <p>1.2.4 B/E</p> <p>1.2.5 P/N</p> <p>1.2.6 ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้</p> <p>1.2.7 ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่มี underlying เป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้</p> <p>1.2.8 ตราสารหนี้อื่นที่มีลักษณะทำนองเดียวกับตราสารหนี้ตาม 1.2.1 - 1.2.7 ตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด.กำหนดเพิ่มเติม</p> <p>1.3 ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน (ไม่รวมตราสาร Basel III)</p> <p>1.4 <u>ตราสาร Basel III</u></p> <p>1.5 <u>ศกุก</u></p> <p>1.6 DW</p> <p>2. <u>คุณสมบัติของตราสารและหลักเกณฑ์ในการลงทุน</u></p> <p>ทรัพย์สินที่บริษัทจัดการจะสามารถลงทุนได้ตาม 1. ต้องมีคุณสมบัติของตราสารตาม หลักเกณฑ์ที่ครบถ้วน ดังนี้</p> <p>2.1 ไม่มีข้อกำหนดหรือเงื่อนไขที่ทำให้ผู้ลงทุนมีภาระผูกพันมากกว่ามูลค่าเงินลงทุน ในตราสาร</p> <p>2.2 สามารถเปลี่ยนมือได้ (รวมถึงกรณีที่เป็น B/E P/N ที่มีเงื่อนไขห้ามเปลี่ยนมือแต่ กองทุนได้ดำเนินการให้มีการรับ โอนสิทธิเรียกร้องในตราสารได้ตามวิธีการที่กฎหมาย กำหนด หรือมีเงื่อนไขให้กองทุนสามารถขายคืนผู้ออกตราสารได้)</p> <p>2.3 มีข้อมูลเกี่ยวกับตราสารที่บริษัทจัดการสามารถเข้าถึงได้เพื่อนำมาประกอบการ พิจารณาตัดสินใจลงทุนได้อย่างสม่ำเสมอ และมีข้อมูลราคาที่สะท้อนมูลค่ายุติธรรม โดยข้อมูลดังกล่าวต้องอ้างอิงจากแหล่งข้อมูลที่เชื่อถือได้ซึ่งจัดทำตามหลักวิชาการ อันเป็นที่ยอมรับในระดับสากล</p> | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|--|------------------------------|--|
| | <p>หุ้นกู้อนุพันธ์ที่สำนักงาน ก.ล.ต. อนุญาตให้เสนอขายในลักษณะทั่วไปหรือในลักษณะจำกัด หรือที่ออกภายใต้ข้อผูกพันที่กำหนดและอนุญาตโดยกระทรวงการคลัง หรือที่นิติบุคคลที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นเป็นผู้ออก หรือที่เป็นหลักทรัพย์ที่ออกใหม่ซึ่งผู้ออกหลักทรัพย์ได้เสนอขายหลักทรัพย์ที่ออกใหม่นั้นทั้งหมดต่อผู้ถือหุ้นโดยได้รับชำระราคาเต็มมูลค่าที่เสนอขายจากผู้ถือหุ้น ทั้งนี้ ตราสารที่เปลี่ยนมือได้ต้องมีลักษณะตามเงื่อนไขท้ายข้อ 3.13.1.1 ด้วย</p> <p>(2.4) ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทยที่มีหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นพันธบัตร หรือหุ้นกู้ที่ไม่ใช่หุ้นกู้อนุพันธ์</p> <p>(2.5) ตัวแลกเงิน ตัวสัญญาใช้เงิน หุ้นกู้ หรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้ที่เสนอขายในต่างประเทศโดยมีผู้ออกเป็นนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย ทั้งนี้ หุ้นกู้นี้จะไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพและหุ้นกู้อนุพันธ์</p> <p>.....</p> <p>ในกรณีที่ตราสารแห่งนี้ตามข้อ 3.13.1.1 เป็นตัวแลกเงินหรือตัวสัญญาใช้เงินที่มีการจ่ายผลตอบแทน ผลตอบแทนนั้นต้องอยู่ในรูปอัตราดอกเบี้ยคงที่หรืออัตราดอกเบี้ยลอยตัวเท่านั้น</p> <p>การรับรอง รับอวัล สลักหลัง หรือค่าประกันของบุคคลที่กำหนดไว้ในข้อ 3.13.1.1 ต้องเป็นการรับรองตลอดไป รับอวัลทั้งจำนวน สลักหลัง โอนประเภทมีสิทธิไล่เบียดโดยไม่มีข้อกำหนดลบล้างหรือจำกัดความรับผิดชอบของผู้สลักหลัง หรือค่าประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนแบบไม่มีเงื่อนไข</p> <p>เงื่อนไข : ตราสารภาครัฐต่างประเทศตามข้อ (2.2) และตราสารที่เปลี่ยนมือได้ตามข้อ (2.3) ต้องมีลักษณะดังต่อไปนี้</p> <p>(1) เป็นตราสารขึ้นทะเบียนในสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย</p> <p>(2) มีราคาที่เหมาะสมตามที่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยกำหนด หรือมีผู้แสดงตนต่อบุคคลทั่วไปว่าพร้อมจะเสนอราคาซื้อและรับซื้อตราสารนั้นในราคาตั้งกล่าว (bid price แบบ firm quote) ตามจำนวนและวิธีการที่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยกำหนดอยู่เสมอ โดยได้ส่งสำเนาราคาแก่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยตลอดอายุของตราสารนั้น</p> <p>(3) เป็นตราสารที่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้</p> <p>(ก) ในกรณีที่เป็ตราสารภาครัฐต่างประเทศ ตราสารดังกล่าวต้องเป็นตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหรือของ</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|---|------------------------------|--|
| | <p>ผู้ออกตราสารอยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) เว้นแต่ผู้ออกตราสารดังกล่าวเป็นรัฐวิสาหกิจตามกฎหมายต่างประเทศ ตราสารนั้นต้องมีอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารอยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) เท่านั้น</p> <p>(ข) ในกรณีที่ผู้ออกตราสารเป็นนิติบุคคลต่างประเทศ ตราสารนั้นต้องมีอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารอยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade)</p> <p>(ค) ในกรณีที่กองทุนลงทุนในตราสารอื่นนอกเหนือจาก (ก) และ (ข) ในการเสนอขายครั้งแรก หากตราสารดังกล่าวไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหรือของผู้ออกตราสารอยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) ตราสารนั้นต้องมีบริษัทจัดการไม่ต่ำกว่า 3 รายเป็นผู้ซื้อตราสารดังกล่าวเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนภายใต้การจัดการ</p> <p>.....</p> <p>3.13.1.4 ตราสารแห่งทุนในประเทศ ได้แก่ ตราสารหรือสัญญาที่เสนอขายในประเทศหรือมีผู้ออกหรือคู่สัญญาเป็นนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย ดังต่อไปนี้</p> <p>(1) หุ้น</p> <p>(2) หน่วยลงทุนหรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารแห่งทุนหรือของกองทุนรวมอื่นที่มีนโยบายการลงทุนในตราสารแห่งทุน เช่น กองทุนรวมผสม เป็นต้น</p> <p>(3) ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นหรือใบสำคัญแสดงสิทธิในการซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้ โดยต้องเป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้</p> <p>(ก) การลงทุนในตราสารดังกล่าวต้องเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (efficient portfolio management)</p> <p>(ข) บริษัทจัดการต้องดำเนินการให้มีการกั้นหรือแยกทรัพย์สินของกองทุนที่มีคุณภาพซึ่งมีสภาพคล่องในจำนวนที่เพียงพอต่อมูลค่าการใช้สิทธิตามตราสารดังกล่าว (fully covered) ไว้ตลอดเวลาที่ได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งตราสารนั้น ทั้งนี้ ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด</p> <p>(4) ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย ที่มีหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นหุ้นหรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะ</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|--|---|--|
| | <p>ชื่อหุ้น 3.13.1.5 ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ได้แก่ หุ้นกู้แปลงสภาพ ดังต่อไปนี้ (1) หุ้นกู้แปลงสภาพที่เสนอขายในประเทศ ซึ่งต้องมีลักษณะ ตามเงื่อนไขในท้ายข้อ 3.13.1.5 (1) และ (2) ทั้งนี้ ในกรณีที่ กองทุนลงทุนในหุ้นกู้แปลงสภาพดังกล่าวในการเสนอขายครั้งแรก หุ้นกู้แปลงสภาพนั้นต้องมีลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่ง ดังต่อไปนี้ (ก) เป็นหุ้นกู้แปลงสภาพที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่ สามารถลงทุนได้ (investment grade) หรือ(ข) เป็นหุ้นกู้แปลง สภาพที่มีบริษัทจัดการไม่ต่ำกว่าสามรายเป็นผู้ซื้อตราสาร ดังกล่าวเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนภายใต้การจัดการ ในกรณีที่หุ้นกู้แปลงสภาพตามวรรคหนึ่งมีการค้าประกัน การค้า ประกันดังกล่าวต้องเป็นการค้าประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็ม จำนวนแบบไม่มีเงื่อนไข (2) หุ้นกู้แปลงสภาพที่เสนอขายในต่างประเทศโดยมีผู้ ออกเป็นนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมาย 3.13.1.6 ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ซึ่งเป็นไปตามเกณฑ์ข้อ 3.13.1.4 (3) 3.13.1.7 ทรัพย์สินอื่นที่มีลักษณะทำนองเดียวกับข้อ 3.13.1.1 ถึงข้อ 3.13.1.6 โดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน คณะกรรมการ ก.ล.ด.</p> | | |
| | <p>- (จากข้อ 3.12.1.1 ตราสารแห่งหนึ่งในประเทศ (2) ตราสาร แห่งหนึ่งทั่วไป) (2.6) หน่วยลงทุนหรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุน ของกองทุนรวมตราสารแห่งหนึ่ง หรือของกองทุนรวมอื่นที่มี นโยบายการลงทุนเฉพาะเงินฝาก ตราสารแห่งหนึ่ง หรือการหา ดอกเบี้ยโดยวิธีอื่นที่สำนักงานกำหนดหรือให้ความเห็นชอบ เช่น กองทุนรวมตลาดเงิน เป็นต้น</p> | <p>ส่วนที่ 2 : ทรัพย์สินประเภทหน่วย CIS กรณีเป็นหน่วยที่การออกอยู่ภายใต้บังคับกฎหมายไทย ต้องมีคุณสมบัติและหลักเกณฑ์ในการลงทุนดังนี้ 1. มีคุณสมบัติและเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการลงทุนเช่นเดียวกับข้อกำหนดสำหรับ ตราสารทางการเงินทั่วไปในส่วนที่ 1 ข้อ 2.1 - 2.3 2. ในกรณีเป็นการลงทุนในหน่วย CIS กองทุนรวมซึ่งถูกลงทุน (invested MF) ต้องมี นโยบายการลงทุนดังนี้ (ไม่ใช้กับการลงทุนในหน่วย CIS ของกองทุนรวมทองคำที่ ลงทุนในทองคำแท่ง) 2.1 มีการลงทุนในทรัพย์สินซึ่งเป็นประเภทและชนิดเดียวกับที่ MF (investing fund) สามารถลงทุนได้ 2.2 มีการลงทุนในทรัพย์สินเมื่อใช้วิธีคำนวณตามสัดส่วน (pro rata) แล้วได้ผล</p> | <p>เพื่อให้เป็นไปตาม ประกาศคณะกรรมการ กำกับตลาดทุน ที่ ทท.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน รวม</p> |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|--|--|--|
| | | <p>เป็นไปตามหลักเกณฑ์ single entity limit ของ MF (investing fund) นั้น</p> <p>2.3 มีการลงทุนในทรัพย์สินเมื่อใช้วิธีคำนวณตามสัดส่วน (pro rata) แล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ product limit สำหรับทรัพย์สินที่เป็น SIP ของ MF (investing fund) นั้น</p> <p>2.4 มีการลงทุนใน derivatives ที่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ global exposure limit ของ MF (investing fund) นั้น</p> <p>3. กรณีที่กองทุนที่ไปลงทุน (investing fund) เป็นกองทุนรวมฟีดเดอร์ กองทุนรวมซึ่งถูกลงทุน (invested MF) ต้องไม่ใช่กองทุนรวมฟีดเดอร์</p> | |
| | 3.13.1.2 เงินฝากในสถาบันการเงินตามกฎหมายไทย | <p>ส่วนที่ 3 : ทรัพย์สินประเภทเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก ต้องเป็นเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากของผู้รับฝากดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. ธพ. บง. หรือ บค. ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน 2. ธนาคารออมสิน 3. ธนาคารอาคารสงเคราะห์ 4. ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร 5. บริษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย 6. ธนาคารพัฒนาวิสาหกิจขนาดกลางและขนาดย่อมแห่งประเทศไทย 7. ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย 8. ธนาคารอิสลามแห่งประเทศไทย 9. สถาบันการเงินระหว่างประเทศที่ประเทศไทยเป็นสมาชิก 10. สถาบันการเงินต่างประเทศที่มีลักษณะทำนองเดียวกับผู้รับฝากตาม 1. - 9. | เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม |
| | (2.7) ธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน ทั้งนี้ ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด.กำหนด | <p>ส่วนที่ 4 : ธุรกรรมประเภทการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (reverse repo) การลงทุนใน reverse repo ต้องเป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. คู่สัญญา ต้องเป็นนิติบุคคลดังนี้ที่สามารถเข้าเป็นคู่สัญญาใน reverse repo ได้ตามกฎหมายไทย <ol style="list-style-type: none"> 1.1 ธพ. 1.2 บง. 1.3 บค. 1.4 บล. 1.5 บริษัทประกันภัย 1.6 ธปท. 1.7 กองทุนฟื้นฟู 1.8 นิติบุคคลที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น | ปรับข้อความให้ เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|--|---|---|
| | | <p>1.9 ส่วนราชการและรัฐวิสาหกิจตามกฎหมายว่าด้วยวิธีการงบประมาณ</p> <p>2. <u>ตราสารที่ใช้ในการทำ reverse repo</u> ต้องเป็นตราสารดังนี้</p> <p>2.1 ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ โดยกรณีเป็นตราสารภาครัฐต่างประเทศต้องมี credit rating อยู่ในอันดับ investment grade</p> <p>2.2 B/E P/N บัตรเงินฝาก ศกฺก หรือหุ้นกู้ระยะสั้น ที่ ธพ. บง. หรือธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น เป็นผู้มีภาระผูกพัน ซึ่งมีอายุคงเหลือไม่เกิน 1 ปี</p> <p>2.3 B/E หรือ P/N ที่ TSFC เป็นผู้ออก ที่มีกำหนดวันใช้เงินตามตัวไม่เกิน 270 วันนับแต่วันออกตัว และเป็นตัวที่ถึงกำหนดใช้เงินเมื่อทวงถามหรือเมื่อได้เห็น</p> <p>2.4 B/E P/N หรือศกฺก ที่มีอายุไม่เกิน 90 วันนับแต่วันที่ออก ซึ่งมี credit rating อย่างไม่อย่างหนึ่งดังนี้</p> <p>2.4.1 มี issue rating หรือ issuer rating อยู่ในอันดับแรก โดยกรณีที่เป็น issuer rating ต้องเป็น credit rating ที่ได้มาจากการจัด credit rating ระยะสั้นด้วย</p> <p>2.4.2 มี guarantor rating อยู่ในอันดับ investment grade</p> <p>2.5 ตราสารหนี้ซึ่งมีอายุคงเหลือไม่เกิน 1 ปี ที่ขึ้นทะเบียนในตลาดซื้อขายตราสารหนี้ หรือที่มีข้อมูลราคาที่น่าเชื่อถือและอ้างอิงได้ซึ่งมีการเปิดเผยต่อสาธารณชน โดยตราสารหนี้ดังกล่าวต้องมี credit rating อย่างไม่อย่างหนึ่งดังนี้</p> <p>2.5.1 มี credit rating ระยะสั้นอยู่ใน 2 อันดับแรก หรือ credit rating ระยะยาวที่เทียบเคียงได้กับ credit rating ระยะสั้นดังกล่าวตามที่ CRA ได้เปรียบเทียบไว้</p> <p>2.5.2 มี credit rating ระยะยาวอยู่ใน 3 อันดับแรก</p> <p>2.6 ตราสารหนี้ซึ่งมีอายุคงเหลือไม่เกิน 1 เดือนที่ขึ้นทะเบียนในตลาดซื้อขายตราสารหนี้หรือที่มีข้อมูลราคาที่น่าเชื่อถือและอ้างอิงได้ซึ่งมีการเปิดเผยต่อสาธารณชน โดยตราสารหนี้ดังกล่าวต้องมี credit rating อย่างไม่อย่างหนึ่งดังนี้</p> <p>2.6.1 มี credit rating ระยะสั้นอยู่ใน 3 อันดับแรก หรือ credit rating ระยะยาวที่เทียบเคียงได้กับ credit rating ระยะสั้นดังกล่าวตามที่ CRA ได้เปรียบเทียบไว้</p> <p>2.6.2 มี credit rating ระยะยาวอยู่ใน 4 อันดับแรก</p> <p>2.7 ทรัพย์สินอื่นตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดเพิ่มเติม</p> <p>3. <u>ระยะเวลาการรับชำระหนี้ของ reverse repo</u> ต้องไม่เกิน 90 วัน</p> <p>4. <u>ข้อกำหนดเพิ่มเติมที่บริษัทจัดการต้องปฏิบัติสำหรับการลงทุนใน reverse repo</u> ตามเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด</p> | |
| | (2.8) ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์โดยหลักทรัพย์ที่ให้ยืมเป็นตราสารแห่งหนึ่งตาม (1.1) (1.2) (1.3) (2.1) (2.2) (2.3) (2.4) หรือ (2.6) ทั้งนี้ บริษัทจัดการต้องปฏิบัติให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด | <p>ส่วนที่ 5 : ธุรกรรมประเภทการให้ยืมหลักทรัพย์ (securities lending) ต้องเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการลงทุนดังนี้</p> <p>1. <u>คู่สัญญา</u> ต้องมีคู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งเป็นผู้ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจ SBL โดยในกรณีที่คู่สัญญาดังกล่าวกระทำการในฐานะตัวแทนของผู้ยืม ผู้ยืมต้องเป็น</p> | เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุน |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|-----------------------|---|--|
| | | <p>บุคคลดังนี้ที่สามารถประกอบธุรกิจหรือดำเนินกิจการได้ตามกฎหมายไทย</p> <ol style="list-style-type: none"> 1.1 ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจ SBL 1.2 ธปท. 1.3 กองทุนฟื้นฟู 1.4 ธนาคารเพื่อการนำเข้าและการส่งออกแห่งประเทศไทย 1.5 ธพ. 1.6 บง. 1.7 บล. 1.8 บริษัทประกันชีวิต 1.9 Non-retail PF 1.10 กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ 1.11 นิติบุคคลอื่นตามที่สำนักงานกำหนดเพิ่มเติม <p>2. <u>หลักทรัพย์ที่ให้ยืม</u> ต้องเป็นหลักทรัพย์ที่อยู่ในระบบรับฝากหลักทรัพย์ของศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ หรือหลักทรัพย์ที่ ธปท. ทำหน้าที่เป็นนายทะเบียนหลักทรัพย์</p> <p>3. <u>การวางหรือเรียกหลักประกัน</u> บลจ. ต้องดำเนินการดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 3.1 ดำเนินการให้มีการวางหรือเรียกหลักประกันจากผู้ยืมเพื่อเป็นประกันการให้ยืมหลักทรัพย์ โดยต้องเป็นหลักประกันดังนี้ <ol style="list-style-type: none"> 3.1.1 เงินสด 3.1.2 ตราสารภาครัฐไทย <ol style="list-style-type: none"> 3.1.3 B/E P/N บัตรเงินฝาก ศุภก หรือหุ้นกู้ระยะสั้น ที่ ธพ. บง. หรือธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น เป็นผู้มีการผูกพัน 3.1.4 B/E หรือ P/N ที่ TSFC เป็นผู้ออก ที่มีกำหนดวันใช้เงินตามตัวไม่เกิน 270 วัน นับแต่วันออกตัวและเป็นตัวที่ถึงกำหนดใช้เงินเมื่อทวงถามหรือเมื่อได้เห็น 3.1.5 B/E P/N หรือศุภก ที่มีอายุไม่เกิน 90 วันนับแต่วันที่ออก ซึ่งมี credit rating อย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้ <ol style="list-style-type: none"> 3.1.5.1 มี issue rating หรือ issuer rating อยู่ในอันดับแรก โดยกรณีที่เป็น issuer rating ต้องเป็น credit rating ที่ได้มาจากการจัด credit rating ระยะสั้นด้วย 3.1.5.2 มี guarantor rating อยู่ในอันดับ investment grade 3.1.6 ตราสารหนี้ที่มี credit rating อยู่ในอันดับ investment grade 3.1.7 หนังสือค้ำประกันที่ ธพ. เป็นผู้ออกให้แก่กองทุนเพื่อเป็นประกันการคืนหลักทรัพย์ให้แก่กองทุน 3.1.8 หุ้นจดทะเบียนใน SET ที่มีรายชื่ออยู่ในดัชนี SET50 ทั้งนี้ ในกรณีที่กองทุน | รวม |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|---|---|--|
| | | <p>ไม่มีนโยบายการลงทุนในตราสารทุน กองทุนจะรับหลักประกันดังกล่าวไม่ได้</p> <p>3.1.9 หน่วยลงทุนของ MMF</p> <p>3.2 ดำเนินการให้กองทุนมีกรรมสิทธิ์หรือครอบครองหลักประกันตาม 3.1 หรือดำเนินการโดยวิธีอื่นซึ่งจะมีผลให้ บริษัทจัดการสามารถบังคับชำระหนี้เอาจากหลักประกันดังกล่าวได้โดยพลัน</p> <p>3.3 ห้ามนำหลักประกันตาม 3.1 ที่กองทุนมีกรรมสิทธิ์ไปโอนหรือขายต่อหรือทำให้ไม่สามารถบังคับตามหลักประกันนั้นได้ เว้นแต่เป็นการบังคับชำระหนี้ตามข้อตกลงในธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ นั้นเอง</p> <p>3.4 ค่ารวมมูลค่าหลักประกัน ณ สิ้นวัน $\geq 100\%$ ของมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม</p> <p>3.5 ในกรณีที่หลักประกันเป็นเงินสด ให้นำเงินสดดังกล่าวไปลงทุนโดยทันทีในทรัพย์สินดังนี้</p> <p>3.5.1 เงินฝากใน ธพ. หรือธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น</p> <p>3.5.2 บัตรเงินฝากหรือ P/N ดังนี้</p> <p>3.5.2.1 บัตรเงินฝาก หรือ P/N ที่ ธพ. บง. หรือธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นเป็นผู้มีภาระผูกพัน</p> <p>3.5.2.2 P/N ที่ TSFC เป็นผู้ออก ที่มีกำหนดวันใช้เงินตามตัวไม่เกิน 270 วันนับแต่วันออกตัว และเป็นตัวที่ถึงกำหนดใช้เงินเมื่อทางถามหรือเมื่อได้เห็น</p> <p>3.5.2.3 P/N ที่มีอายุไม่เกิน 90 วันนับแต่วันที่ออก ซึ่งมี credit rating อย่างหนึ่งอย่างใดดังนี้</p> <p>3.5.2.3.1 มี issue rating หรือ issuer rating อยู่ในอันดับแรก โดยกรณีที่เป็น issuer rating ต้องเป็น credit rating ที่ได้มาจากการจัด credit rating ระยะสั้นด้วย</p> <p>3.5.2.3.2 มี guarantor rating อยู่ในอันดับ investment grade</p> <p>3.5.3 ตราสารภาครัฐไทย</p> <p>3.5.4 reverse repo สำหรับตราสารภาครัฐไทย</p> <p>4. ลักษณะและสาระสำคัญของสัญญา ให้ใช้สัญญาที่มีลักษณะและสาระสำคัญของสัญญาตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยข้อกำหนดเกี่ยวกับระบบงานสัญญาเืมและให้ยืมหลักทรัพย์และหลักประกันในธุรกรรมการเืมและให้ยืมหลักทรัพย์</p> | |
| | <p>3.13.1.3 สัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (efficient portfolio management) ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานกำหนด สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่กองทุนจะเข้าเป็นคู่สัญญาได้ต้องมีสินค้าหรือตัวแปรอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังต่อไปนี้</p> <p>(1) หลักทรัพย์</p> | <p>ส่วนที่ 6 : ธุรกรรมประเภท derivatives ตามหลักเกณฑ์การลงทุนดังนี้</p> <p>1. ประเภท underlying derivatives ที่กองทุนจะเข้าเป็นคู่สัญญาได้ต้องมี underlying อย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังนี้</p> <p>1.1 ทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้</p> <p>1.2 อัตราดอกเบี้ย</p> | <p>เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน.87/2558 เรื่องการลงทุนของกองทุนรวม</p> |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|---|---|---------------------------------------|
| | <p>(2) อัตราดอกเบี้ย</p> <p>(3) อัตราแลกเปลี่ยนเงิน</p> <p>(4) อันดับความน่าเชื่อถือหรือเหตุการณ์ที่มีผลต่อการชำระหนี้ของตราสารแห่งหนึ่ง หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือของผู้ออกตราสารหรือคู่สัญญาดังกล่าว</p> <p>(5) ทองคำ</p> <p>(6) น้ำมันดิบ</p> <p>(7) ดัชนีกลุ่มสินค้าโภคภัณฑ์ ดัชนีเงินเฟ้อ ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นสินค้าหรือตัวแปรตาม (1) (2) (3) (4) (5) (6) หรือ (9)</p> <p>(8) ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นดัชนีตามข้อ (7)</p> <p>(9) สินค้าหรือตัวแปรอื่นใดที่สำนักงานกำหนด</p> <p>ในกรณีที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงกับราคาของสินค้าหรือตัวแปรตามวรรคหนึ่ง ราคาที่อ้างอิงดังกล่าวต้องเป็นราคาปัจจุบันหรือราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเท่านั้น ทั้งนี้ ราคาของสินค้าตัวแปรอื่นที่ไม่ใช่ดัชนี หรือสินค้าหรือตัวแปรที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีดังกล่าวต้องเป็นที่ยอมรับอย่างกว้างขวางและเปิดเผยไว้อย่างแพร่หลายด้วย</p> | <p>1.3 อัตราแลกเปลี่ยนเงิน</p> <p>1.4 เครดิต เช่น credit rating หรือ credit event เป็นต้น</p> <p>1.5 ทองคำ</p> <p>1.6 น้ำมันดิบ</p> <p>1.7 ดัชนีกลุ่มสินค้าโภคภัณฑ์ ดัชนีเงินเฟ้อ ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นสินค้าหรือตัวแปรตาม 1.1 - 1.6 หรือ 1.9</p> <p>1.8 ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นดัชนีตาม 1.7</p> <p>1.9 underlying อื่นตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดเพิ่มเติม</p> <p>ในกรณีที่ derivatives อ้างอิงกับราคาของ underlying ข้างต้น ราคาที่อ้างอิงดังกล่าวต้องเป็นราคาปัจจุบันหรือราคาของ derivatives เท่านั้น ทั้งนี้ ราคาของ underlying อื่นที่ไม่ใช่ดัชนี หรือ underlying ที่ เป็นองค์ประกอบของดัชนีดังกล่าว ต้องเป็นที่ยอมรับอย่างกว้างขวางและเปิดเผยไว้อย่างแพร่หลายด้วย</p> <p>2. <u>เงื่อนไขการลงทุน</u> บลจ. จะดำเนินการลงทุนใน derivatives ได้ต่อเมื่อ</p> <p>2.1 กรณี MF ใต้ระบุเกี่ยวกับการลงทุนใน derivatives และ underlying ของ derivatives ที่จะลงทุนไว้อย่างชัดเจนในโครงการ</p> <p>2.2 เป็นการเข้าเป็นคู่สัญญาใน derivatives ใดๆอย่างหนึ่งดังนี้</p> <p>2.2.1 derivatives on organized exchange</p> <p>2.2. OTC derivatives ดังนี้</p> <p>2.2.2.1 กรณีเป็น OTC derivatives ในประเทศไทย ต้องมีคู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งเป็น ธพ. ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ตัวแทนซื้อขาย derivatives หรือผู้ค้า derivatives</p> <p>2.3 ในกรณีที่จะต้องมีการชำระหนี้ด้วยการส่งมอบสินค้าเมื่อ derivatives สิ้นสุดลงสินค้านั้นต้องเป็นทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ ทั้งนี้ ไม่ว่ากองทุนจะเป็นผู้มีสิทธิรับมอบหรือมีหน้าที่ส่งมอบสินค้านั้นก็ตาม</p> <p>3. <u>หลักเกณฑ์เพิ่มเติมกรณี underlying เป็นดัชนี</u></p> <p>ในกรณีที่ derivatives มี underlying เป็นดัชนีตาม 1.7 – 1.8 ดัชนีดังกล่าวต้องมีลักษณะ ดังนี้</p> <p>3.1 เป็นดัชนีที่มีการกำหนดวิธีการคำนวณไว้อย่างชัดเจน โดยมีการระบุแหล่งข้อมูลของ underlying หรือปัจจัยต่างๆที่นำมาใช้ในการคำนวณ และมีการคำนวณดัชนีให้เป็นปัจจุบันตามความเหมาะสมขององค์ประกอบของดัชนี ทั้งนี้ underlying หรือปัจจัยดังกล่าวต้องมีการเคลื่อนไหวตามสภาวะตลาดอย่างเป็นอิสระด้วย</p> <p>3.2 เป็นดัชนีที่มีลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่ง ดังนี้</p> <p>3.2.1 ดัชนีที่มีการกระจายตัวอย่างเพียงพอ โดยเป็นดัชนีที่มีลักษณะใดลักษณะหนึ่ง</p> | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|-----------------------|---|--|
| | | <p>ดังนี้</p> <p>3.2.1.1 ดัชนีที่องค์ประกอบแต่ละตัวมีน้ำหนัก $\leq 20\%$ ของน้ำหนักทั้งหมด</p> <p>3.2.1.2 ดัชนีที่องค์ประกอบตัวใดตัวหนึ่งมีน้ำหนัก $\leq 35\%$ ของน้ำหนักทั้งหมด</p> <p>ในกรณีที่ขึ้นไปตามสภาวะตลาด โดยองค์ประกอบตัวอื่นต้องมีน้ำหนักไม่เกินอัตราที่กำหนดใน 3.2.1.1</p> <p>การพิจารณาการกระจายน้ำหนักตาม 3.2.1.1 และ 3.2.1.2 ไม่ต้องนำองค์ประกอบที่เกี่ยวข้องกับทองคำหรือน้ำมันดิบมาพิจารณา</p> <p>3.2.2 ดัชนีที่มีองค์ประกอบทั้งหมดเป็นหรือเกี่ยวข้องกับทองคำหรือน้ำมันดิบ หรือเป็นดัชนีราคาทองคำหรือน้ำมันดิบ</p> <p>3.2.3 ดัชนีอื่นใดนอกจาก 3.2.1 และ 3.2.2 ที่ขึ้นไปตามเงื่อนไขครบถ้วน ดังนี้</p> <p>3.2.3.1 เป็นดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นตราสารหรือสัญญาที่กองทุนสามารถลงทุนได้โดยตรง</p> <p>3.2.3.2 เมื่อคำนวณเงินลงทุนตามสัดส่วน (pro rata) เสมือนหนึ่งว่ากองทุนลงทุนในตราสารหรือสัญญานั้นโดยตรงแล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ single entity limit ของกองทุนนั้น</p> <p>3.3 เป็นดัชนีที่ได้รับการพัฒนาโดยสถาบันที่มีความน่าเชื่อถือและทำหน้าที่ได้อย่างอิสระจาก บลจ. ทั้งนี้ หากปรากฏว่าสถาบันดังกล่าวเป็นบริษัทในเครือของบลจ. บลจ. นั้นต้องจัดให้มีมาตรการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์อย่างมีประสิทธิภาพด้วย</p> <p>3.4 มีการแสดงดัชนีนั้นๆอย่างต่อเนื่องเป็นประจำทุกวันทำการผ่านสื่อที่มีการเสนอข้อมูลอย่างทันเหตุการณ์</p> <p>3.5 ในกรณีที่เป็นการจัดกลุ่มสินค้าโภคภัณฑ์ ดัชนีดังกล่าวต้องคำนวณจากตัวแปรอย่างหนึ่งอย่างใดหรือหลายอย่าง ดังนี้</p> <p>3.5.1 ราคาปัจจุบัน (spot price) หรือราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (futures price) ของสินค้าโภคภัณฑ์</p> <p>3.5.2 ดัชนีสินค้าโภคภัณฑ์ที่คำนวณจากราคาปัจจุบันหรือราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสินค้าโภคภัณฑ์สินค้าใดสินค้าหนึ่ง</p> <p>3.5.3 ราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อ้างอิงกับดัชนีสินค้าโภคภัณฑ์ตาม 3.5.2</p> <p>3.6 ในกรณีที่เป็นการจัดดัชนีเงินเฟ้อ ดัชนีดังกล่าวต้องคำนวณโดยใช้แหล่งข้อมูลอ้างอิงจากรายงานของหน่วยงานราชการของประเทศไทยหรือต่างประเทศ หรือคำนวณจากราคาสินค้าและบริการที่ บลจ. แสดงให้เห็นได้ว่าวิธีการคำนวณของผู้พัฒนาดัชนีดังกล่าวสามารถสะท้อนอัตราเงินเฟ้อได้อย่างเหมาะสม</p> <p>4. <u>หลักเกณฑ์การจัดให้มีทรัพย์สินที่เพียงพอต่อการชำระหนี้ตามภาระผูกพัน (cover rule)</u></p> | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|-----------------------|--|--|
| | | <p>บลจ.ต้องจัดให้มีทรัพย์สินของกองทุนที่มีคุณภาพและมีสภาพคล่องในจำนวนที่เพียงพอต่อภาระที่กองทุนอาจต้องชำระหนี้ตามข้อตกลงเมื่อ derivatives สิ้นสุดลงไว้ตลอดเวลาที่ได้ลงทุนใน derivatives นั้น และเป็นไปตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด</p> <p>5. <u>หลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับการลงทุนที่มีวัตถุประสงค์เพื่อลดความเสี่ยง</u> ในกรณีที่ บลจ.ลงทุนใน derivatives ที่ underlying ไม่ใช่สิ่งเดียวกับทรัพย์สินที่จะลดความเสี่ยงการลงทุนใน derivatives ดังกล่าวต้องเป็นไปตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด</p> <p>6. <u>หลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับการลงทุนใน OTC derivatives</u> บริษัทจัดการต้องจัดให้มีข้อตกลงใน OTC derivatives ดังนี้</p> <p>6.1 ให้คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งคำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมของ derivatives ให้ บลจ. ทราบทุกวันที่ 15 และวันสุดท้ายของแต่ละเดือน ทั้งนี้ ในกรณีที่วันดังกล่าวเป็นวันหยุดทำการของ บลจ. ให้คำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมภายในวันทำการถัดไป</p> <p>6.2 ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อราคาของ derivatives อย่างมีนัยสำคัญ ให้คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งคำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมของ derivatives ให้ บลจ. ทราบทันที</p> <p>6.3 คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งยินยอมให้มีการล้างฐานะ derivatives เมื่อ บลจ. ร้องขอได้</p> <p>7. <u>หลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับการเข้าเป็นคู่สัญญาใน credit derivatives</u> บลจ.จะปฏิบัติตามเงื่อนไขดังนี้</p> <p>7.1 เข้าเป็นคู่สัญญาใน credit derivatives ได้เฉพาะเพื่อการลดความเสี่ยงเท่านั้น</p> <p>7.2 เข้าเป็นคู่สัญญาได้เฉพาะ credit derivatives ที่มีลักษณะของธุรกรรมหรือเทียบเคียงกับธุรกรรมอย่างหนึ่งอย่างใด ดังนี้</p> <p>7.2.1 Credit Default Swap : ซึ่งได้แก่ การตกลงในฐานะผู้ซื้อประกันความเสี่ยงด้านเครดิตที่เกี่ยวข้องกับความสามารถในการชำระหนี้ตาม obligation ของผู้ผูกพันตาม obligation นั้น โดยคู่สัญญาที่อยู่ในฐานะผู้ขายประกันความเสี่ยงมีภาระผูกพันที่จะต้องชำระเงินตามข้อตกลงซื้อประกันความเสี่ยงเมื่อเกิด credit event ขึ้นโดยจะมีผลให้ข้อตกลงซื้อประกันความเสี่ยงครบกำหนดทันที (ในกรณีที่ไม่มีเกิด credit event ข้อตกลงจะสิ้นสุดในวันครบกำหนดตามปกติ) ทั้งนี้ ไม่ว่า obligation จะมีเพียงรายการเดียว (Single Name Credit Default Swap) หรือ obligation มีหลายรายการซึ่งกำหนดให้ผู้ขายประกันความเสี่ยงมีหน้าที่ชำระหนี้เมื่อเกิด credit event ขึ้นกับ obligation รายการใดรายการหนึ่งเป็นรายแรก (First to Default Swap) หรือเมื่อเกิด credit event ขึ้นกับ obligation รายการใดรายการหนึ่งในกลุ่ม obligation ซึ่งจะมีการชำระราคากันเฉพาะในส่วนของสินทรัพย์รายนั้น แต่ข้อตกลงจะครบกำหนดเมื่อเกิด credit event ขึ้นกับ obligation ทุกรายการในกลุ่ม (Proportionate Credit Default Swap)</p> | |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|--|--|--|
| | | <p>7.2.2 Total Rate of Return Swap : ซึ่งได้แก่ การตกลงในฐานะผู้ซื้อประกันความเสี่ยงของสินทรัพย์อ้างอิงที่เกิดจากการลดลงของผลตอบแทนที่จะได้รับจากสินทรัพย์อ้างอิง โดยผู้ขายประกันความเสี่ยงมีภาระผูกพันที่จะจ่ายผลตอบแทนในอัตราคงที่หรืออัตราลอยตัวที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ยตามที่จะตกลงกัน และส่วนที่ลดลง (ถ้ามี) ของมูลค่ายุติธรรมของสินทรัพย์อ้างอิง เพื่อแลกกับการที่ผู้ซื้อประกันความเสี่ยงจะโอนผลตอบแทนและส่วนที่เพิ่มขึ้น (ถ้ามี) ของมูลค่ายุติธรรมของสินทรัพย์อ้างอิงให้กับผู้ขายประกันความเสี่ยง จนกว่าจะเกิด credit event หรือครบกำหนดสัญญา (กรณีไม่เกิด credit event)</p> <p>7.3 ต้องใช้สัญญามาตรฐานตามที่กำหนดโดย International Swaps and Derivatives Association (ISDA) หรือสัญญามาตรฐานอื่นตามที่สำนักงานยอมรับ ซึ่งมีข้อตกลงที่มีลักษณะดังนี้</p> <p>7.3.1 มีผลใช้บังคับได้ตามกฎหมาย และไม่ขัดหรือแย้งกับกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์หรือกฎหมายอื่น</p> <p>7.3.2 ไม่มีข้อกำหนดที่ทำให้สิทธิที่กำหนดไว้ในตราสารแห่งนั้นหรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มี credit derivatives นั้นอ้างอิงเสื่อมเสียไป</p> <p>7.3.3 ไม่มีข้อกำหนดให้กองทุนต้องชดใช้ความเสียหายให้แก่คู่สัญญา</p> | |
| | <p>3.13.2. ประเภทของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น หรือการหาดอกผลโดยวิธีอื่นที่จะลงทุนในต่างประเทศ</p> <p>บริษัทจัดการจะลงทุนหรือแสวงหาประโยชน์เฉพาะจากหลักทรัพย์ ทรัพย์สินอื่น หรือหาดอกผลโดยวิธีอื่นอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างตามที่ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดดังต่อไปนี้ เว้นแต่ในกรณีที่คณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ให้ความเห็นชอบหรือมีประกาศแก้ไขหรือเพิ่มเติมประเภทหรือลักษณะของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินหรือการหาดอกผลโดยวิธีอื่น</p> <p>บริษัทจัดการอาจลงทุนในทรัพย์สินในต่างประเทศเพื่อกองทุนได้เทียบเท่ากับประเภททรัพย์สินในประเทศ โดยครอบคลุมที่ลงทุนต้องมีคุณสมบัติ ดังนี้</p> <p>(1) มีการเสนอขายในประเทศที่มีหน่วยงานกำกับดูแลเป็นสมาชิกสามัญของ IOSCO หรือประเทศที่มีตลาดหลักทรัพย์เป็นสมาชิกของ WFE</p> <p>(2) การลงทุนนั้นต้องไม่ทำให้การจัดการกองทุนเบี่ยงเบนไปจากวัตถุประสงค์ หรือนโยบายการลงทุนของกองทุนและไม่ทำให้กองทุนขาดทุนเป็นมูลค่าสูงกว่ามูลค่าลงทุน</p> | <p>3.13.ประเภทของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น หรือการหาดอกผลโดยวิธีอื่นที่จะลงทุนในต่างประเทศ :</p> <p><u>บริษัทจัดการจะลงทุนหรือแสวงหาประโยชน์เฉพาะจากหลักทรัพย์ ทรัพย์สินอื่น หรือหาดอกผลโดยวิธีอื่นอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างตามที่ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดดังต่อไปนี้ เว้นแต่ในกรณีที่คณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ให้ความเห็นชอบหรือมีประกาศแก้ไขหรือเพิ่มเติมประเภทหรือลักษณะของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินหรือการหาดอกผลโดยวิธีอื่น</u></p> <p><u>ทั้งนี้ การลงทุนในตราสารหรือสัญญาในต่างประเทศ ตราสารหรือสัญญาดังกล่าวต้องเสนอขายหรือเป็นการทำสัญญาในประเทศที่มีหน่วยงานกำกับดูแลด้านหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกสามัญของ IOSCO หรือที่มีการซื้อขายในตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศที่เป็นสมาชิกของ WFE หรือเป็นตราสารของบริษัทที่จัดตั้งและเสนอขายใน GMS</u></p> <p>ส่วนที่ 1 : ประเภทและคุณสมบัติของตราสารทางการเงินทั่วไป</p> <p>1. <u>ประเภทของตราสารต่างประเทศ</u> ได้แก่</p> <p>1.1 <u>ตราสารทุนต่างประเทศ</u></p> <p>1.1.1 หุ้น</p> <p>1.1.2 share warrants</p> | <p>- เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม</p> <p>- เพิ่มการลงทุนใน Basel III และศก</p> |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|---|--|---------------------------------------|
| | <p>(3) บริษัทจัดการต้องสามารถเข้าถึงข้อมูลเกี่ยวกับหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินดังกล่าวเป็นภาษาอังกฤษผ่านระบบอินเทอร์เน็ตได้</p> <p>(4) มีข้อมูลทางด้านราคาที่จะสะท้อนมูลค่ายุติธรรม โดยเป็นราคาที่น่าเชื่อถือ อ้างอิงได้ และสอดคล้องตามหลักวิชาการอันเป็นที่ยอมรับในระดับสากล</p> <p>(5) มีการคุ้มครองประโยชน์ของผู้ลงทุน (Investor protection) ที่ถือได้ว่าเทียบเท่ากับการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินที่มีลักษณะคล้ายกันในประเทศไทย</p> <p>(6) มีลักษณะอื่นใดที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. อาจกำหนดเพิ่มเติม</p> <p>.....</p> <p>3.13.2.2 ตราสารแห่งทุนต่างประเทศ ได้แก่ หุ้นหรือหน่วยลงทุนที่เสนอขายในต่างประเทศ ดังต่อไปนี้</p> <p>(1) หุ้นที่ซื้อขายในตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของหน่วยงานที่เป็นสมาชิกสามัญของ International Organizations of Securities Commission (IOSCO) หรือที่มีการซื้อขายในตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศที่เป็นสมาชิกของ World Federations of Exchange (WFE)</p> <p>(2) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศที่เป็นกองทุนรวมตราสารแห่งทุน หรือที่เป็นกองทุนรวมอื่นที่มีนโยบายการลงทุนในตราสารแห่งทุน เช่น กองทุนรวมผสม เป็นต้น ซึ่งเป็นไปตามเงื่อนไขตามข้อ 3.13.2.1 ด้วย</p> <p>3.13.2.3 ตราสารแห่งหนี้ต่างประเทศ ได้แก่ หลักทรัพย์หรือตราสารที่ออกโดยบุคคลต่างประเทศและเสนอขายในต่างประเทศ ดังต่อไปนี้</p> <p>(1) ตราสารภาครัฐต่างประเทศ อันได้แก่</p> <p>(ก) พันธบัตรหรือตราสารแห่งหนี้ที่รัฐบาลต่างประเทศ องค์การหรือหน่วยงานของรัฐบาลต่างประเทศ หรือองค์การระหว่างประเทศเป็นผู้ออกหรือผู้ค้ำประกัน ซึ่งมีอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหรือของ ผู้ออกตราสารอยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade)</p> <p>(ข) พันธบัตรหรือตราสารแห่งหนี้ที่รัฐวิสาหกิจตามกฎหมายต่างประเทศเป็นผู้ออกหรือผู้ค้ำประกัน ซึ่งมีอันดับความ</p> | <p>1.1.3 TSR</p> <p>1.1.4 ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่มี underlying เป็นหุ้นหรือ share warrants</p> <p>1.1.5 ตราสารทุนอื่นที่มีลักษณะทำนองเดียวกับตราสารทุนตาม 1.1.1 - 1.1.4 ตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดเพิ่มเติม</p> <p>1.2 ตราสารหนี้ต่างประเทศ</p> <p>1.2.1 พันธบัตร</p> <p>1.2.2 ตัวเงินคลัง</p> <p>1.2.3 หุ้นกู้ (ไม่รวมหุ้นกู้แปลงสภาพ หุ้นกู้อนุพันธ์ และตราสาร Basel III)</p> <p>1.2.4 B/E</p> <p>1.2.5 P/N</p> <p>1.2.6 ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้</p> <p>1.2.7 ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่มี underlying เป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้</p> <p>1.2.8 ตราสารหนี้อื่นที่มีลักษณะทำนองเดียวกับตราสารหนี้ตาม 1.2.1 - 1.2.7 ตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด.กำหนดเพิ่มเติม</p> <p>1.3 ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุนต่างประเทศ (ไม่รวมตราสาร Basel III)</p> <p>1.4 ตราสาร Basel III ต่างประเทศ</p> <p>1.5 ศกฺก ต่างประเทศ</p> <p>1.6 DW ต่างประเทศ</p> <p>2. คุณสมบัติของตราสารและหลักเกณฑ์ในการลงทุน</p> <p>หลักทรัพย์ที่บริษัทจัดการจะสามารถลงทุนได้ตาม 1. ต้องมีคุณสมบัติของตราสารตามหลักเกณฑ์ที่ครบถ้วน ดังนี้</p> <p>2.1 ไม่มีข้อกำหนดหรือเงื่อนไขที่ทำให้ผู้ลงทุนมีภาระผูกพันมากกว่ามูลค่าเงินลงทุนในตราสาร</p> <p>2.2 สามารถเปลี่ยนมือได้ (รวมถึงกรณีที่เป็น B/E P/N ที่มีเงื่อนไขห้ามเปลี่ยนมือแต่กองทุนได้ดำเนินการให้มีการรับโอนสิทธิเรียกร้องในตราสารได้ตามวิธีการที่กฎหมายกำหนด หรือมีเงื่อนไขให้กองทุนสามารถขายคืนผู้ออกตราสารได้)</p> <p>2.3 มีข้อมูลเกี่ยวกับตราสารที่บริษัทจัดการสามารถเข้าถึงได้เพื่อนำมาประกอบการพิจารณาตัดสินใจลงทุนได้อย่างสม่ำเสมอ และมีข้อมูลราคาที่จะสะท้อนมูลค่ายุติธรรมโดยข้อมูลดังกล่าวต้องอ้างอิงจากแหล่งข้อมูลที่เชื่อถือได้ซึ่งจัดทำตามหลักวิชาการอันเป็นที่ยอมรับในระดับสากล</p> | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|--|------------------------------|--|
| | <p>นำเชื่อถือของตราสารที่อยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade)</p> <p>(2) ตราสารแห่งหนึ่งภาคเอกชน อันได้แก่</p> <p>(ก) ตราสารแห่งหนึ่งที่ออกโดยนิติบุคคลต่างประเทศ ซึ่งมีอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารอยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) และได้รับการคัดเลือกให้ใช้ในการคำนวณดัชนีตราสารแห่งหนึ่ง (benchmark bond index) ที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ทั้งนี้ผู้ลงทุนต้องสามารถเข้าถึงข้อมูลเกี่ยวกับตราสารแห่งหนึ่งดังกล่าวเป็นภาษาอังกฤษผ่านระบบอินเทอร์เน็ตด้วย</p> <p>(ข) ตราสารแห่งหนึ่งที่ออกโดยนิติบุคคลต่างประเทศที่มีอายุของตราสารคงเหลือไม่เกิน 1 ปีนับแต่วันที่ลงทุน ซึ่งนิติบุคคลดังกล่าวมีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ใน 2 อันดับแรก ทั้งนี้ผู้ลงทุนต้องสามารถเข้าถึงข้อมูลเกี่ยวกับตราสารแห่งหนึ่งดังกล่าวเป็นภาษาอังกฤษผ่านระบบอินเทอร์เน็ตด้วย</p> <p>.....</p> <p>(3) ตราสารแห่งหนึ่งอื่น อันได้แก่ หน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศที่เป็นกองทุนรวมตราสารแห่งหนึ่ง หรือของกองทุนรวมอื่นที่มีนโยบายการลงทุนเฉพาะเงินฝาก ตราสารแห่งหนึ่ง หรือการขาดดอกผลโดยวิธีอื่นที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดหรือให้ความเห็นชอบ เช่น กองทุนรวมตลาดเงิน เป็นต้น ซึ่งเป็นไปตามเงื่อนไขข้อ 3.13.2.1</p> <p>.....</p> <p>3.13.2.4 ตัวแลกเงิน ตัวสัญญาใช้เงิน หุ้นกู้ หรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้ ที่เสนอขายในต่างประเทศ โดยมีผู้ออกเป็นนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย ทั้งนี้ หุ้นกู้ดังกล่าวไม่รวมถึงหุ้นกู้แปลงสภาพและหุ้นกู้อนุพันธ์</p> <p>ในกรณีที่ตราสารแห่งหนึ่งดังกล่าวเป็นตัวแลกเงินหรือตัวสัญญาใช้เงินที่มีการจ่ายผลตอบแทน ผลตอบแทนนั้นต้องอยู่ในรูปอัตราดอกเบี้ยคงที่หรืออัตราดอกเบี้ยลอยตัวเท่านั้น</p> <p>การรับรอง รับอาวัล สลากหลัง หรือค้ำประกันของบุคคลที่กำหนดไว้ดังกล่าว ต้องเป็นการรับรองตลอดไป รับอาวัลทั้งจำนวน สลากหลัง โอนประเภทมีสิทธิไล่เบียดโดยไม่มีข้อกำหนดลบล้างหรือจำกัดความรับผิดชอบของผู้สลักหลัง หรือค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนแบบไม่มีเงื่อนไข</p> <p>.....</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|---|---|---|
| | <p>3.13.2.7 ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ได้แก่ หุ้นกู้แปลงสภาพ</p> <p>3.13.2.8 ทรัพย์สินอื่นที่มีลักษณะทำนองเดียวกับข้อ 3.13.2.1 ถึงข้อ 3.13.2.7 โดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด.</p> | | |
| | <p>3.13.2.1 หน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศที่กองทุนจะลงทุนหรือมีไว้ได้ ต้องเป็นไปตามเงื่อนไขดังต่อไปนี้</p> <p>(ก) ต้องเป็นหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของหน่วยงานกำกับดูแลด้านหลักทรัพย์และตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกสามัญของ International Organizations of Securities Commission (IOSCO) หรือหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศที่มีการซื้อขายในตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกของ World Federations of Exchange (WFE)</p> <p>(ข) ต้องเป็นหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศที่มีทรัพย์สินที่ลงทุนเป็นประเภทและชนิดเดียวกับทรัพย์สินที่กองทุนอาจลงทุนหรือมีไว้ได้ เว้นแต่เป็นหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศที่มีนโยบายการลงทุนในทองคำโดยตรง</p> <p>(ค) ในกรณีที่เป็นการลงทุนหรือมีไว้เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป (retail fund) หน่วยลงทุนที่จะลงทุนหรือมีไว้ได้ ต้องเป็นหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศที่จัดตั้งขึ้นเพื่อผู้ลงทุนทั่วไปเช่นกัน</p> <p>(ง) ต้องไม่ใช่หน่วยลงทุนของกองทุนรวมประเภทเฮ็ดจ์ฟันด์ (hedge fund)</p> | <p>ส่วนที่ 2 : ทรัพย์สินประเภทหน่วย CIS</p> <p>กรณีเป็นหน่วยที่การออกอยู่ภายใต้บังคับกฎหมายในต่างประเทศ ต้องมีคุณสมบัติและหลักเกณฑ์ในการลงทุนดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. มีคุณสมบัติและเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการลงทุนเช่นเดียวกับข้อกำหนดสำหรับตราสารทางการเงินทั่วไปในส่วนที่ 1 ข้อ 2.1 - 2.3 2. เป็นหน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศ (invested fund) ที่เป็นดังนี้ <ol style="list-style-type: none"> 2.1 การออกและการเสนอขายอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของหน่วยงานต่างประเทศที่กำกับดูแลด้านหลักทรัพย์และตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ซึ่งเป็นสมาชิกสามัญของ IOSCO หรือเป็นหน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศ (invested fund) ที่มีการซื้อขายในตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศที่เป็นสมาชิกของ WFE 2.2 CIS operator ของกองทุนดังกล่าวอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของหน่วยงานกำกับดูแลที่เป็นสมาชิกสามัญของ IOSCO 2.3 ประเทศที่กำกับดูแลการเสนอขายหน่วยดังกล่าวมีมาตรการให้ความคุ้มครองผู้ลงทุนอย่างเพียงพอทั้งนี้ ตามรายชื่อประเทศที่สำนักงานกำหนด 2.4 ในกรณีเป็นการลงทุนในหน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศ กองทุนดังกล่าวต้องมีการจำกัดการกู้ยืมไว้เฉพาะกรณีมีเหตุจำเป็นในการบริหารสภาพคล่องเป็นการชั่วคราวเท่านั้น และมีนโยบายการลงทุนดังนี้ (ไม่ใช้กับการลงทุนในหน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศซึ่งเป็นกองทุนรวมทองคำที่ลงทุนในทองคำแท่ง) <ol style="list-style-type: none"> 2.4.1 มีการลงทุนในทรัพย์สินซึ่งเป็นประเภทและชนิดเดียวกับที่ MF (investing fund) สามารถลงทุนได้ในสัดส่วน $\geq 80\%$ ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน CIS ต่างประเทศนั้น 2.4.2 มีการลงทุนในทรัพย์สินเมื่อใช้วิธีคำนวณตามสัดส่วน (pro rata) แล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ single entity limit ของ MF (investing fund) นั้น 2.4.3 มีการลงทุนในทรัพย์สินเมื่อใช้วิธีคำนวณตามสัดส่วน (pro rata) แล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ product limit สำหรับทรัพย์สินที่เป็น SIP ของ MF (investing fund) นั้น 2.4.4 มีการลงทุนใน derivatives ที่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ global exposure limit ของ MF (investing fund) นั้น 2.5 กรณีที่ MF ที่ไปลงทุน (investing fund) เป็นกองทุนรวมฟีดเดอร์ กองทุน CIS ต่างประเทศซึ่งถูกลงทุน (invested MF) ต้องไม่ใช่กองทุนที่มีลักษณะทำนอง | <p>เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม</p> |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|---|--|---|
| | | เดียวกับกองทุนรวมฟีดเดอร์ เว้นแต่เป็นกรณีที่มีความจำเป็นและเป็นประโยชน์ต่อผู้ถือหน่วยลงทุน ทั้งนี้ โดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานโดยก่อนการลงทุน บลจ. ต้องจัดให้มีการเปิดเผยข้อมูล เหตุผลความจำเป็น และค่าธรรมเนียมที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนในลักษณะดังกล่าวไว้ในหนังสือชี้ชวนด้วย | |
| | 3.13.2.5 เงินฝากในสถาบันการเงินต่างประเทศที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) | ส่วนที่ 3 : ทรัพย์สินประเภทเงินฝากในสถาบันการเงินต่างประเทศหรือตราสารต่างประเทศที่เทียบเท่าเงินฝาก ต้องเป็นเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากของผู้รับฝากดังนี้ 1. ธพ. บง. หรือ บค. ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน 2. สถาบันการเงินระหว่างประเทศที่ประเทศไทยเป็นสมาชิก 3. สถาบันการเงินต่างประเทศที่มีลักษณะทำนองเดียวกับผู้รับฝากตาม 1. - 2. | เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม |
| | 3.13.2.3 ตราสารแห่งหนึ่งต่างประเทศ (4) ธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด | ส่วนที่ 4 : ธุรกรรมประเภทการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (reverse repo) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด | เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม |
| | - | ส่วนที่ 5 : ธุรกรรมประเภทการให้ยืมหลักทรัพย์ (securities lending) โดยเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด | เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม |
| | 3.13.2.6 สัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (efficient portfolio management) ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานกำหนด สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่กองทุนจะเข้าเป็นคู่สัญญาได้ต้องมีสินค้าหรือตัวแปรอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังต่อไปนี้ (1) หลักทรัพย์ (2) อัตราดอกเบี้ย (3) อัตราแลกเปลี่ยนเงิน (4) อันดับความน่าเชื่อถือหรือเหตุการณ์ที่มีผลต่อการชำระหนี้ของตราสารแห่งหนึ่ง หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือของผู้ออกตราสารหรือคู่สัญญาดังกล่าว (5) ทองคำ | ส่วนที่ 6 : ธุรกรรมประเภท derivatives ในต่างประเทศ ตามหลักเกณฑ์การลงทุนดังนี้ 1. ประเภท underlying derivatives ที่กองทุนจะเข้าเป็นคู่สัญญาได้ต้องมี underlying อย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังนี้ 1.1 ทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ 1.2 อัตราดอกเบี้ย 1.3 อัตราแลกเปลี่ยนเงิน 1.4 เครดิต เช่น credit rating หรือ credit event เป็นต้น 1.5 ทองคำ 1.6 น้ำมันดิบ 1.7 ดัชนีกลุ่มสินค้าโภคภัณฑ์ ดัชนีเงินเฟ้อ ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นสินค้าหรือตัว | เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทน.87/2558 เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|--|--|---------------------------------------|
| | <p>(6) น้ำมันดิบ</p> <p>(7) ดัชนีกลุ่มสินค้าโภคภัณฑ์ ดัชนีเงินเฟ้อ ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นสินค้าหรือตัวแปรตาม (1) (2) (3) (4) (5) (6) หรือ (9)</p> <p>(8) ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นดัชนีตามข้อ (7)</p> <p>(9) สินค้าหรือตัวแปรอื่นใดที่สำนักงานกำหนด</p> <p>ในกรณีที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงกับราคาของสินค้าหรือตัวแปรตามวรรคหนึ่ง ราคาที่อ้างอิงดังกล่าวต้องเป็นราคาปัจจุบันหรือราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเท่านั้น ทั้งนี้ ราคาของสินค้าตัวแปรอื่นที่ไม่ใช่ดัชนี หรือสินค้าหรือตัวแปรที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีดังกล่าวต้องเป็นที่ยอมรับอย่างกว้างขวางและเปิดเผยไว้อย่างแพร่หลายด้วย</p> | <p>แปรตาม 1.1 - 1.6 หรือ 1.9</p> <p>1.8 ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นดัชนีตาม 1.7</p> <p>1.9 underlying อื่นตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดเพิ่มเติม</p> <p>ในกรณีที่ derivatives อ้างอิงกับราคาของ underlying ข้างต้น ราคาที่อ้างอิงดังกล่าวต้องเป็นราคาปัจจุบันหรือราคาของ derivatives เท่านั้น ทั้งนี้ ราคาของ underlying อื่นที่ไม่ใช่ดัชนี หรือ underlying ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีดังกล่าว ต้องเป็นที่ยอมรับอย่างกว้างขวางและเปิดเผยไว้อย่างแพร่หลายด้วย</p> <p>2. <u>เงื่อนไขการลงทุน</u> บลจ. จะดำเนินการลงทุนใน derivatives ได้ต่อเมื่อ</p> <p>2.1 กรณี MF ได้รับความเกี่ยวข้องกับการลงทุนใน derivatives และ underlying ของ derivatives ที่จะลงทุนไว้อย่างชัดเจนในโครงการ</p> <p>2.2 เป็นการเข้าเป็นคู่สัญญาใน derivatives ใดๆ อย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้</p> <p>2.2.1 derivatives on organized exchange</p> <p>2.2.2 OTC derivatives ดังนี้</p> <p>2.2.2.1 กรณีเป็น OTC derivatives ในต่างประเทศ ต้องมีคู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งเป็นนิติบุคคลที่ได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจ derivatives ที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลโดยหน่วยงานกำกับดูแลด้านหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกสามัญของ IOSCO หรือที่เป็นสมาชิกของ WFE</p> <p>2.3 ในกรณีที่จำเป็นต้องมีการชำระหนี้ด้วยการส่งมอบสินค้าเมื่อ derivatives สิ้นสุดลงสินค้านั้นต้องเป็นทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ ทั้งนี้ ไม่ว่ากองทุนจะเป็นผู้มีสิทธิรับมอบหรือมีหน้าที่ส่งมอบสินค้านั้นก็ตาม</p> <p>3. <u>หลักเกณฑ์เพิ่มเติมกรณี underlying เป็นดัชนี</u></p> <p>ในกรณีที่ derivatives มี underlying เป็นดัชนีตาม 1.7 -1.8 ดัชนีดังกล่าวต้องมีลักษณะ ดังนี้</p> <p>3.1 เป็นดัชนีที่มีการกำหนดวิธีการคำนวณไว้อย่างชัดเจน โดยมีการระบุแหล่งข้อมูลของ underlying หรือปัจจัยต่างๆที่นำมาใช้ในการคำนวณ และมีการคำนวณดัชนีให้เป็นปัจจุบันตามความเหมาะสมขององค์ประกอบของดัชนี ทั้งนี้ underlying หรือปัจจัยดังกล่าวต้องมีการเคลื่อนไหวตามสภาวะตลาดอย่างเป็นอิสระด้วย</p> <p>3.2 เป็นดัชนีที่มีลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่ง ดังนี้</p> <p>3.2.1 ดัชนีที่มีการกระจายตัวอย่างเพียงพอ โดยเป็นดัชนีที่มีลักษณะใดลักษณะหนึ่ง ดังนี้</p> <p>3.2.1.1 ดัชนีที่องค์ประกอบแต่ละตัวมีน้ำหนัก $\leq 20\%$ ของน้ำหนักทั้งหมด</p> <p>3.2.1.2 ดัชนีที่องค์ประกอบตัวใดตัวหนึ่งมีน้ำหนัก $\leq 35\%$ ของน้ำหนักทั้งหมด</p> <p>ในกรณีที่เป็นไปตามสภาวะตลาด โดยองค์ประกอบตัวอื่นต้องมีน้ำหนักไม่เกินอัตราที่กำหนดใน 3.2.1.1</p> | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|-----------------------|---|--|
| | | <p>การพิจารณาการกระจายน้ำหนักตาม 3.2.1.1 และ 3.2.1.2 ไม่ต้องนำองค์ประกอบที่เกี่ยวข้องกับทองคำหรือน้ำมันดิบมาพิจารณา</p> <p>3.2.2 ดัชนีที่มีองค์ประกอบทั้งหมดเป็นหรือเกี่ยวข้องกับทองคำหรือน้ำมันดิบ หรือเป็นดัชนีราคาทองคำหรือน้ำมันดิบ</p> <p>3.2.3 ดัชนีอื่นใดนอกจาก 3.2.1 และ 3.2.2 ที่เป็นไปตามเงื่อนไขครบถ้วน ดังนี้</p> <p>3.2.3.1 เป็นดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นตราสารหรือสัญญาที่กองทุนสามารถลงทุนได้โดยตรง</p> <p>3.2.3.2 เมื่อคำนวณเงินลงทุนตามสัดส่วน (pro rata) เสมือนหนึ่งว่ากองทุนลงทุนในตราสารหรือสัญญานั้นโดยตรงแล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ single entity limit ของกองทุนนั้น</p> <p>3.3 เป็นดัชนีที่ได้รับการพัฒนาโดยสถาบันที่มีความน่าเชื่อถือและทำหน้าที่ได้อย่างอิสระจาก บลจ. ทั้งนี้ หากปรากฏว่าสถาบันดังกล่าวเป็นบริษัทในเครือของบลจ. บลจ. นั้นต้องจัดให้มีมาตรการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์อย่างมีประสิทธิภาพด้วย</p> <p>3.4 มีการแสดงดัชนีนั้นๆอย่างต่อเนื่องเป็นประจำทุกวันทำการผ่านสื่อที่มีการเสนอข้อมูลอย่างทันเหตุการณ์</p> <p>3.5 ในกรณีที่ เป็นดัชนีกลุ่มสินค้าโภคภัณฑ์ ดัชนีดังกล่าวต้องคำนวณจากตัวแปรอย่างหนึ่งอย่างใดหรือหลายอย่าง ดังนี้</p> <p>3.5.1 ราคาปัจจุบัน (spot price) หรือราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (futures price) ของสินค้าโภคภัณฑ์</p> <p>3.5.2 ดัชนีสินค้าโภคภัณฑ์ที่คำนวณจากราคาปัจจุบันหรือราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสินค้าโภคภัณฑ์สินค้าใดสินค้าหนึ่ง</p> <p>3.5.3 ราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อ้างอิงกับดัชนีสินค้าโภคภัณฑ์ตาม 3.5.2</p> <p>3.6 ในกรณีที่ เป็นดัชนีเงินเพื่อ ดัชนีดังกล่าวต้องคำนวณโดยใช้แหล่งข้อมูลอ้างอิงจากรายงานของหน่วยงานราชการของประเทศไทยหรือต่างประเทศ หรือคำนวณจากราคาสินค้าและบริการที่ บลจ. แสดงให้เห็นได้ว่าวิธีการคำนวณของผู้พัฒนาดัชนีดังกล่าวสามารถสะท้อนอัตราเงินเฟ้อได้อย่างเหมาะสม</p> <p>4. หลักเกณฑ์การจัดให้มีทรัพย์สินที่เพียงพอต่อการชำระหนี้ตามภาระผูกพัน (cover rule)</p> <p>บลจ. ต้องจัดให้มีทรัพย์สินของกองทุนที่มีคุณภาพและมีสภาพคล่องในจำนวนที่เพียงพอต่อภาระที่กองทุนอาจต้องชำระหนี้ตามข้อตกลงเมื่อ derivatives สิ้นสุดลงไว้ตลอดเวลาที่ได้ลงทุนใน derivatives นั้น และเป็นไปตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด</p> | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|-----------------------|---|--|
| | | <p>5. <u>หลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับการลงทุนที่มีวัตถุประสงค์เพื่อลดความเสี่ยง</u> ในกรณีที่ บลจ.ลงทุนใน derivatives ที่ underlying ไม่ใช่สิ่งเดียวกับทรัพย์สินที่จะ ลดความเสี่ยงการลงทุนใน derivatives ดังกล่าวต้องเป็นไปตามที่สำนักงาน คณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด</p> <p>6. <u>หลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับการลงทุนใน OTC derivatives</u> บริษัทจัดการต้องจัดให้มีข้อตกลงใน OTC derivatives ดังนี้</p> <p>6.1 ให้คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งคำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมของ derivatives ให้ บลจ. ทราบทุกวันที่ 15 และวันสุดท้ายของแต่ละเดือน ทั้งนี้ ในกรณีที่วันดังกล่าวเป็น วันหยุดทำการของ บลจ. ให้คำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมภายในวันทำการถัดไป</p> <p>6.2 ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อราคาของ derivatives อย่างมีนัยสำคัญ ให้คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งคำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมของ derivatives ให้ บลจ. ทราบทันที</p> <p>6.3 คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งยินยอมให้มีการล้างฐานะ derivatives เมื่อ บลจ. ร้องขอได้</p> <p>7. <u>หลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับการเข้าเป็นคู่สัญญาใน credit derivatives</u> บลจ. จะปฏิบัติตามเงื่อนไขดังนี้</p> <p>7.1 เข้าเป็นคู่สัญญาใน credit derivatives ได้เฉพาะเพื่อการลดความเสี่ยงเท่านั้น</p> <p>7.2 เข้าเป็นคู่สัญญาได้เฉพาะ credit derivatives ที่มีลักษณะของธุรกรรมหรือ เทียบเคียงกับธุรกรรมอย่างหนึ่งอย่างใด ดังนี้</p> <p>7.2.1 Credit Default Swap : ซึ่งได้แก่ การตกลงในฐานะผู้ซื้อประกันความเสี่ยง ด้านเครดิตที่เกี่ยวข้องกับความสามารถในการชำระหนี้ตาม obligation ของผู้ผูกพัน ตาม obligation นั้น โดยคู่สัญญาที่อยู่ในฐานะผู้ขายประกันความเสี่ยงมีภาระผูกพันที่ จะต้องชำระเงินตามข้อตกลงซื้อประกันความเสี่ยงเมื่อเกิด credit event ขึ้นโดยจะมี ผลให้ข้อตกลงซื้อประกันความเสี่ยงครบกำหนดทันที (ในกรณีที่ไม่มีเกิด credit event ข้อตกลงจะสิ้นสุดในวันครบกำหนดตามปกติ) ทั้งนี้ ไม่ว่า obligation จะมีเพียง รายการเดียว (Single Name Credit Default Swap) หรือ obligation มีหลายรายการ ซึ่งกำหนดให้ผู้ขายประกันความเสี่ยงมีหน้าที่ชำระหนี้เมื่อเกิด credit event ขึ้นกับ obligation รายการใดรายการหนึ่งเป็นรายแรก (First to Default Swap) หรือเมื่อเกิด credit event ขึ้นกับ obligation รายการใดรายการหนึ่งในกลุ่ม obligation ซึ่งจะมี การชำระราคากันเฉพาะในส่วนของสินทรัพย์รายนั้น แต่ข้อตกลงจะครบกำหนดเมื่อ เกิด credit event ขึ้นกับ obligation ทุกรายการในกลุ่ม (Proportionate Credit Default Swap)</p> <p>7.2.2 Total Rate of Return Swap : ซึ่งได้แก่ การตกลงในฐานะผู้ซื้อประกันความ เสี่ยงของสินทรัพย์อ้างอิงที่เกิดจากการลดลงของผลตอบแทนที่จะได้รับจาก สินทรัพย์อ้างอิง โดยผู้ขายประกันความเสี่ยงมีภาระผูกพันที่จะจ่ายผลตอบแทนใน อัตราคงที่หรืออัตราลอยตัวที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ยตามที่จะตกลงกัน และส่วนที่</p> | |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การแก้ไข | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|--|--|-----------------------------------|-----------------|-----------------------|---|-----------------|-------------------|---|------------------------|--|---|-------------------|--|--|-------------|---|-----------|-------------------|---|---|--|--|
| | | <p>ลดลง (ถ้ามี) ของมูลค่ายุติธรรมของสินทรัพย์อ้างอิง เพื่อแลกกับการที่ผู้ซื้อประกันความเสี่ยงจะโอนผลตอบแทนและส่วนที่เพิ่มขึ้น (ถ้ามี) ของมูลค่ายุติธรรมของสินทรัพย์อ้างอิงให้กับผู้ขายประกันความเสี่ยง จนกว่าจะเกิด credit event หรือครบกำหนดสัญญา (กรณีไม่เกิด credit event)</p> <p>7.3 ต้องใช้สัญญามาตรฐานตามที่กำหนดโดย International Swaps and Derivatives Association (ISDA) หรือสัญญามาตรฐานอื่นตามที่สำนักงานยอมรับ ซึ่งมีข้อตกลงที่มีลักษณะดังนี้</p> <p>7.3.1 มีผลใช้บังคับได้ตามกฎหมาย และไม่ขัดหรือแย้งกับกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์หรือกฎหมายอื่น</p> <p>7.3.2 ไม่มีข้อกำหนดที่ทำให้สิทธิที่กำหนดไว้ในตราสารแห่งหนึ่งหรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มี credit derivatives นั้นอ้างอิงเสื่อมเสียไป</p> <p>7.3.3 ไม่มีข้อกำหนดให้กองทุนต้องชดใช้ความเสียหายให้แก่คู่สัญญา</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>อัตราส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น</p> | <p>3.14.1. อัตราส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นในประเทศ:</p> <p>บริษัทจัดการจะลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์ หรือทรัพย์สินอื่น หรือการขาดอกผลโดยวิธีอื่นเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวม ตามที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ซึ่งบางอัตราส่วนการลงทุนหรือทั้งหมดจะไม่เป็นไปตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนดไว้สำหรับอัตราส่วนการลงทุนที่เป็นไปตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด ในกรณีที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศแก้ไขเปลี่ยนแปลงอัตราส่วนการลงทุน บริษัทจัดการจะลงทุนให้เป็นไปตามประกาศที่แก้ไขด้วย</p> <p>3.14.1.1 บริษัทจัดการอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังต่อไปนี้ เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวม โดยไม่จำกัดอัตราส่วน</p> <p>(1) ตราสารภาครัฐไทยตามข้อ 3.13.1.1 (2.1)</p> <p>(2) ตราสารภาครัฐต่างประเทศตามข้อ 3.13.1.1 (2.2) ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในสองอันดับแรก หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสินค้าเป็นตราสารดังกล่าว</p> <p>ในกรณีของกองทุนรวมเปิด มูลค่าของตราสารภาครัฐต่างประเทศตามวรรคหนึ่งเมื่อรวมกันแล้วต้องไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าตราสารนั้นในแต่ละวัน เว้นแต่เป็นกองทุนรวมเปิดที่มีการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งล่วงหน้าซึ่งระบุเวลาแน่นอน (auto redemption)</p> | <p>อัตราส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมในประเทศและต่างประเทศ</p> <p><u>บริษัทจัดการจะลงทุนหรือแสวงหาประโยชน์เฉพาะจากหลักทรัพย์ ทรัพย์สินอื่น หรือขาดอกผลโดยวิธีอื่นอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างตามที่ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดดังต่อไปนี้ เว้นแต่ในกรณีที่คณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ให้ความเห็นชอบหรือมีประกาศแก้ไขหรือเพิ่มเติมประเภทหรือลักษณะของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินหรือการขาดอกผลโดยวิธีอื่น</u></p> <p>ส่วนที่ 1 : อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สินหรือคู่สัญญา (single entity limit)</p> <table border="1" data-bbox="996 959 1850 1437"> <thead> <tr> <th>ข้อ</th> <th>ประเภททรัพย์สิน</th> <th>อัตราส่วน (% ของ NAV)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1</td> <td>ตราสารภาครัฐไทย</td> <td>ไม่จำกัดอัตราส่วน</td> </tr> <tr> <td rowspan="2">2</td> <td>ตราสารภาครัฐต่างประเทศ</td> <td></td> </tr> <tr> <td>2.1 กรณีมี credit rating อยู่ใน 2 อันดับแรกขึ้นไป</td> <td>ไม่จำกัดอัตราส่วน</td> </tr> <tr> <td></td> <td>2.2 กรณีมี credit rating อยู่ในระดับ investment grade แต่ต่ำกว่า 2 อันดับแรก</td> <td>ไม่เกิน 35%</td> </tr> <tr> <td>3</td> <td>หน่วย CIS</td> <td>ไม่จำกัดอัตราส่วน</td> </tr> <tr> <td>4</td> <td>เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่ผู้รับฝากหรือผู้ออกตราสารมี</td> <td>ไม่เกิน 20% หรือไม่เกิน 10% เมื่อเป็นการ</td> </tr> </tbody> </table> | ข้อ | ประเภททรัพย์สิน | อัตราส่วน (% ของ NAV) | 1 | ตราสารภาครัฐไทย | ไม่จำกัดอัตราส่วน | 2 | ตราสารภาครัฐต่างประเทศ | | 2.1 กรณีมี credit rating อยู่ใน 2 อันดับแรกขึ้นไป | ไม่จำกัดอัตราส่วน | | 2.2 กรณีมี credit rating อยู่ในระดับ investment grade แต่ต่ำกว่า 2 อันดับแรก | ไม่เกิน 35% | 3 | หน่วย CIS | ไม่จำกัดอัตราส่วน | 4 | เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่ผู้รับฝากหรือผู้ออกตราสารมี | ไม่เกิน 20% หรือไม่เกิน 10% เมื่อเป็นการ | <p>- เพื่อให้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. เรื่อง การลงทุนของกองทุนรวม</p> <p>- เพิ่มเติม single fund limit กรณีการลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่นเป็นไม่จำกัดอัตราส่วน</p> |
| ข้อ | ประเภททรัพย์สิน | อัตราส่วน (% ของ NAV) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1 | ตราสารภาครัฐไทย | ไม่จำกัดอัตราส่วน | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2 | ตราสารภาครัฐต่างประเทศ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 2.1 กรณีมี credit rating อยู่ใน 2 อันดับแรกขึ้นไป | ไม่จำกัดอัตราส่วน | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 2.2 กรณีมี credit rating อยู่ในระดับ investment grade แต่ต่ำกว่า 2 อันดับแรก | ไม่เกิน 35% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3 | หน่วย CIS | ไม่จำกัดอัตราส่วน | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 4 | เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่ผู้รับฝากหรือผู้ออกตราสารมี | ไม่เกิน 20% หรือไม่เกิน 10% เมื่อเป็นการ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|--|--|--|--|
| | <p>3.14.1.2 บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งตราสารภาครัฐต่างประเทศที่นอกเหนือจากข้อ 3.14.1.1 (2) หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสินค้าเป็นตราสารดังกล่าว เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนได้ โดยมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นเมื่อคำนวณเฉพาะผู้ออกหรือผู้เป็นคู่สัญญารายนั้น ไม่เกินร้อยละ 35 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>ในกรณีของกองทุนรวมเปิด มูลค่าของตราสารภาครัฐต่างประเทศตามวรรคหนึ่ง ต้องไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าตราสารนั้นในแต่ละวัน เว้นแต่เป็นกองทุนรวมเปิดที่มีการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งล่วงหน้าซึ่งระบุเวลาแน่นอน (auto redemption)</p> <p>การคำนวณอัตราส่วนตามวรรคหนึ่งให้นับตราสารตามวรรคหนึ่งและทรัพย์สินทุกประเภทที่ผู้ออกหรือผู้เป็นคู่สัญญารายดังกล่าวเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญา ซึ่งกองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินเหล่านั้นรวมในอัตราส่วนการลงทุนดังกล่าวด้วย</p> <p>3.14.1.3 บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ดังต่อไปนี้ ซึ่งธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุน เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญา เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนได้ โดยมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นเมื่อคำนวณเฉพาะธนาคารหรือบริษัทเงินทุนรายนั้น ไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>(1) ตราสารแห่งหนึ่งในประเทศ ตามข้อ 3.13.1.1 แต่ไม่รวมถึงตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุน</p> <p>(2) เงินฝากในสถาบันการเงินตามกฎหมายไทย ตามข้อ 3.13.1.2</p> <p>(3) สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตามข้อ 3.13.1.3</p> <p>(4) ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตามข้อ 3.13.1.5</p> <p>การคำนวณอัตราส่วนสำหรับทรัพย์สินข้างต้น ให้นับมูลค่าของทรัพย์สินซึ่งกองทุนรวมลงทุนหรือมีไว้ดังต่อไปนี้ ซึ่งธนาคารหรือบริษัทเงินทุนรายเดียวกันเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญา รวมในอัตราส่วนดังกล่าว</p> <p>(1) ทรัพย์สินตามข้อ 3.14.1.4(1) (2) หรือ (5)</p> | <p>ลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้</p> <p>4.1 มี credit rating อยู่ในระดับ investment grade</p> <p>4.2 เป็นธนาคารออมสิน ทั้งนี้เฉพาะเงินฝากหรือตราสารที่รัฐบาลเป็นประกัน</p> <p>(ไม่รวมเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการดำเนินงานของกองทุน)</p> | <p>ลงทุนในต่างประเทศหรือผู้มีภาวะผูกพันมีภูมิลาเนาอยู่ต่างประเทศ โดยเลือกใช้ credit rating แบบ national scale ซึ่งเป็นไปตามเกณฑ์ที่สำนักงาน ก.ล.ด. ประกาศกำหนด</p> | |
| | | 5 | <p>ตราสารที่มีลักษณะครบถ้วนดังนี้</p> <p>5.1 เป็นตราสารหนี้ <u>ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน หรือศกก</u> ที่ผู้ออกจัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย หรือสาขาของ ธพ.ต่างประเทศที่ได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจ ธพ. ในประเทศไทย</p> <p>5.2 เสนอขายในประเทศไทย</p> <p>5.3 มี credit rating อยู่ในระดับ investment grade</p> <p>5.4 เป็นตราสารที่อยู่ในระบบ organized market หรือเทียบเท่า</p> | <p>ไม่เกินอัตราดังนี้ แล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า</p> <p>(1) 20% หรือ</p> <p>(2) นำหนักของตราสารที่ลงทุนใน benchmark + 5%</p> |
| | | 6 | <p>ทรัพย์สินดังนี้</p> <p>6.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนซื้อขายใน <u>กระดานซื้อขายหลักทรัพย์สินสำหรับผู้ลงทุนทั่วไปของ SET</u> หรือของตลาดซื้อขายหลักทรัพย์สินต่างประเทศ (แต่ไม่รวมถึงตราสารทุนที่ผู้ออกตราสารอยู่ระหว่างดำเนินการแก้ไขเหตุอาจทำให้มีการเพิกถอนการเป็นหลักทรัพย์สินซื้อขายใน SET หรือในตลาดซื้อขายหลักทรัพย์สินต่างประเทศ)</p> <p>6.2 ตราสารทุนที่ออกโดยบริษัทที่จัดตั้งขึ้นไม่ว่าตามกฎหมาย</p> | <p>ไม่เกินอัตราดังนี้ แล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า</p> <p>(1) 15% (หรือไม่เกิน 10% เมื่อเป็นการลงทุนในต่างประเทศหรือผู้มีภาวะผูกพันมีภูมิลาเนาอยู่ต่างประเทศ โดยเลือกใช้ credit rating แบบ national scale ซึ่งเป็นไปตามเกณฑ์ที่สำนักงาน ก.ล.ด. ประกาศกำหนด) หรือ</p> <p>(2) นำหนักของทรัพย์สินที่ลงทุนใน benchmark + 5%</p> |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|---|---|---------------------------------------|
| | <p>(2) ทรัพย์สินตามข้อ 3.14.1.5(1) ในกรณีที่กองทุนรวมมีเงินฝากในนิติบุคคลข้างต้น โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อการดำเนินงานของกองทุนรวม มิให้นำมูลค่าของเงินฝากดังกล่าวรวมในอัตราส่วนนี้</p> <p>3.14.1.4 บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังต่อไปนี้ ที่บุคคลใดเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญา เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนได้ โดยมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นเมื่อคำนวณเฉพาะผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญารายนั้น ไม่เกินร้อยละ 15 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ได้แก่</p> <p>(1) ตราสารแห่งทุนในประเทศ ตามข้อ 3.13.1.4 ที่บริษัทจดทะเบียนเป็นผู้ออกหรือคู่สัญญา ทั้งนี้ ไม่รวมถึงตราสารแห่งทุนของบริษัทจดทะเบียนที่อยู่ระหว่างดำเนินการให้เหตุแห่งการเพิกถอนหมดไป</p> <p>(2) หุ้นที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์สั่งรับเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ซึ่งผู้ถือหุ้นดังกล่าวอยู่ระหว่างการดำเนินการกระจายการถือหุ้นรายย่อยตามข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับหุ้นสามัญหรือหุ้นบริมสิทธิเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน</p> <p>(3) ตราสารแห่งหนี้ในประเทศ ตามข้อ 3.13.1.1 หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุนตามข้อ 3.13.1.5 ทั้งนี้ เฉพาะที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade)</p> <p>(4) สัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามข้อ 3.13.1.3 ที่คู่สัญญามีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade)</p> <p>(5) ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารอยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade)</p> <p>ตราสารแห่งทุนตามข้อ (1) ตราสารแห่งหนี้ตามข้อ (3) มิให้หมายความถึงหน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่ถูกจัดให้เป็นตราสารแห่งทุนตามข้อ 3.13.1.4 หรือถูกจัดให้เป็นตราสารแห่งหนี้ตามข้อ 3.13.1.1(2.6)</p> <p>การคำนวณอัตราส่วนตามวรรคหนึ่ง ให้นำทรัพย์สินตามวรรคหนึ่งและทรัพย์สินตามข้อ 3.14.1.5 (1) ที่บุคคลดังกล่าวเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือ</p> | <p>ไทยหรือกฎหมายต่างประเทศ ซึ่งหุ้นของบริษัทดังกล่าวซื้อขายในกระดานซื้อขายหลักทรัพย์สำหรับ ผู้ลงทุนทั่วไปของ SET หรือของตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศ (แต่ไม่รวมถึงบริษัทที่อยู่ระหว่างดำเนินการแก้ไขเหตุที่อาจทำให้มีการเพิกถอนหุ้นออกจากการซื้อขายใน SET หรือในตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศ)</p> <p>6.3 หุ้นที่อยู่ระหว่าง IPO เพื่อการจดทะเบียนซื้อขายตาม 6.1</p> <p>6.4 ตราสารที่มีลักษณะครบถ้วนดังนี้</p> <p>6.4.1 เป็นตราสารหนี้ <u>ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน หรือศกฏ</u></p> <p>6.4.2 มี credit rating อยู่ในระดับ investment grade</p> <p>6.4.3 เป็นตราสารที่ผู้ออกจัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยและเสนอขายตราสารนั้นในต่างประเทศ หรือผู้ออกจัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศ</p> <p>(แต่ไม่รวมสาขาของ ธพ. ต่างประเทศที่ได้รับ อนุญาตให้ประกอบธุรกิจ ธพ. ในประเทศไทย)</p> <p>6.4.4 เป็นตราสารที่อยู่ในระบบของ organized market หรือเทียบเท่า</p> <p>6.5 ตราสาร Basel III ที่มี <u>credit rating อยู่ในระดับ investment grade และอยู่ในระบบของ organized market หรือเทียบเท่า</u></p> | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------------|---|--|--|--|--|---|--|------------|-----|-----------------|-----------------------|---|---|---|-----|-----------------|-----------------------|---|---|--|--|
| | <p>คู่สัญญา ซึ่งกองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้รวมในอัตราส่วนดังกล่าวด้วย</p> <p>3.14.1.5 บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินอื่นนอกเหนือจากกรณีที่กำหนดไว้ในข้อ 3.14.1.2 ข้อ 3.14.1.3 และข้อ 3.14.1.4 เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมตามอัตราส่วนดังต่อไปนี้</p> <p>(1) การลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังกล่าวซึ่งบุคคลใดเป็นผู้ ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือ คู่สัญญา ต้องมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นเมื่อคำนวณเฉพาะผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือ คู่สัญญารายนั้น ไม่เกินร้อยละ 5 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>(2) การลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินตาม (1) เมื่อคำนวณรวมทุกบุคคลที่เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญาแล้ว ต้องมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นไม่เกินร้อยละ 15 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>ความในวรรคหนึ่งมิให้นำมาใช้บังคับกับหน่วยลงทุนและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่จัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535</p> <p>3.14.1.6 บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินที่กลุ่มกิจการใดเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญา เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนได้ โดยมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นของกลุ่มกิจการนั้นไม่เกินอัตราอย่างใดอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้ แล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า</p> <p>(1) ร้อยละ 30 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุน</p> <p>(2) อัตราที่คำนวณได้จากน้ำหนักของกลุ่มกิจการดังกล่าวในตัวชี้วัด (benchmark) ของกองทุนนั้นรวมกับร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนนั้น ทั้งนี้ ตัวชี้วัดดังกล่าวต้องเป็นดัชนีหรือองค์ประกอบของดัชนี ที่มีการเผยแพร่อย่างกว้างขวางและสอดคล้องกับนโยบายการลงทุนของกองทุนนั้น</p> <p>3.14.1.7 การลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินที่บริษัทในกลุ่มกิจการใดเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย หรือคู่สัญญา เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุน หากทรัพย์สินดังกล่าวเป็นองค์ประกอบที่ใช้ในการคำนวณตัวชี้วัด (benchmark) ของกองทุนนั้น บริษัทจัดการจะลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินนั้นโดยมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นเมื่อ</p> | <table border="1" data-bbox="996 188 1848 534"> <tr> <td data-bbox="996 188 1070 448"></td> <td data-bbox="1070 188 1473 448">6.6 DW ที่มี issuer rating อยู่ในระดับ investment grade 6.7 ธุรกรรมดังนี้ ที่คู่สัญญามี credit rating อยู่ในระดับ investment grade 6.7.1 reverse repo 6.7.2 OTC derivatives</td> <td data-bbox="1473 188 1848 448"></td> </tr> <tr> <td data-bbox="996 448 1070 534">7</td> <td data-bbox="1070 448 1473 534">ทรัพย์สินอื่นนอกเหนือจากที่ระบุในข้อ 1 - ข้อ 6 (SIP)</td> <td data-bbox="1473 448 1848 534">ไม่เกิน 5%</td> </tr> </table> <p>หมายเหตุ : สำหรับการลงทุนใน derivatives on organized exchange ไม่มีข้อกำหนดเกี่ยวกับ (single entity limit) ของคู่สัญญา</p> <p>ส่วนที่ 2 : อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามกลุ่มกิจการ (group limit)</p> <table border="1" data-bbox="996 662 1870 933"> <thead> <tr> <th data-bbox="996 662 1070 710">ข้อ</th> <th data-bbox="1070 662 1489 710">ประเภททรัพย์สิน</th> <th data-bbox="1489 662 1870 710">อัตราส่วน (% ของ NAV)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="996 710 1070 933">1</td> <td data-bbox="1070 710 1489 933">การลงทุนในทรัพย์สินของบริษัททุกบริษัทที่อยู่ในกลุ่มกิจการเดียวกัน หรือการเข้าเป็นคู่สัญญาในธุรกรรมทางการเงินกับบริษัทดังกล่าว</td> <td data-bbox="1489 710 1870 933">ไม่เกินอัตราใดอัตราหนึ่งดังนี้ แล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า (1) 25% หรือ (2) น้ำหนักของทรัพย์สินที่ลงทุนใน benchmark + 10%</td> </tr> </tbody> </table> <p>หมายเหตุ : สำหรับการลงทุนใน derivatives on organized exchange ไม่มีข้อกำหนดเกี่ยวกับ group limit ของคู่สัญญา</p> <p>ส่วนที่ 3 : อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามประเภททรัพย์สิน (product limit)</p> <table border="1" data-bbox="996 1061 1870 1431"> <thead> <tr> <th data-bbox="996 1061 1070 1109">ข้อ</th> <th data-bbox="1070 1061 1489 1109">ประเภททรัพย์สิน</th> <th data-bbox="1489 1061 1870 1109">อัตราส่วน (% ของ NAV)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="996 1109 1070 1431">1</td> <td data-bbox="1070 1109 1489 1431">เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก B/E หรือ P/N ที่นิติบุคคล ตามกฎหมายไทย (ไม่รวมถึงสาขาในต่างประเทศของนิติบุคคลดังกล่าว) เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย หรือ คู่สัญญา ดังนี้ 1.1 ธนาคารหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น</td> <td data-bbox="1489 1109 1870 1431">- ทุกประเภทรวมกันไม่เกิน 45% เฉลี่ยในรอบปีบัญชี (หรือในรอบอายุกองทุนสำหรับกองทุนที่มีอายุโครงการ < 1 ปี) - อัตราข้างต้นไม่ใช้กับกองทุนที่อายุโครงการหรืออายุสัญญาคงเหลือ ≤ 6 เดือน ทั้งนี้เฉพาะกองทุนที่มีอายุทั้งโครงการหรือ</td> </tr> </tbody> </table> | | 6.6 DW ที่มี issuer rating อยู่ในระดับ investment grade 6.7 ธุรกรรมดังนี้ ที่คู่สัญญามี credit rating อยู่ในระดับ investment grade 6.7.1 reverse repo 6.7.2 OTC derivatives | | 7 | ทรัพย์สินอื่นนอกเหนือจากที่ระบุในข้อ 1 - ข้อ 6 (SIP) | ไม่เกิน 5% | ข้อ | ประเภททรัพย์สิน | อัตราส่วน (% ของ NAV) | 1 | การลงทุนในทรัพย์สินของบริษัททุกบริษัทที่อยู่ในกลุ่มกิจการเดียวกัน หรือการเข้าเป็นคู่สัญญาในธุรกรรมทางการเงินกับบริษัทดังกล่าว | ไม่เกินอัตราใดอัตราหนึ่งดังนี้ แล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า (1) 25% หรือ (2) น้ำหนักของทรัพย์สินที่ลงทุนใน benchmark + 10% | ข้อ | ประเภททรัพย์สิน | อัตราส่วน (% ของ NAV) | 1 | เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก B/E หรือ P/N ที่นิติบุคคล ตามกฎหมายไทย (ไม่รวมถึงสาขาในต่างประเทศของนิติบุคคลดังกล่าว) เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย หรือ คู่สัญญา ดังนี้ 1.1 ธนาคารหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น | - ทุกประเภทรวมกันไม่เกิน 45% เฉลี่ยในรอบปีบัญชี (หรือในรอบอายุกองทุนสำหรับกองทุนที่มีอายุโครงการ < 1 ปี) - อัตราข้างต้นไม่ใช้กับกองทุนที่อายุโครงการหรืออายุสัญญาคงเหลือ ≤ 6 เดือน ทั้งนี้เฉพาะกองทุนที่มีอายุทั้งโครงการหรือ | <p>- เพิ่มเติม product limit กรณีลงทุนในหน่วย CIS ที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย เป็นไม่จำกัดอัตราส่วนตามหนังสือเวียนสำนักงาน ก.ล.ด. ที่ 29/2559</p> |
| | 6.6 DW ที่มี issuer rating อยู่ในระดับ investment grade 6.7 ธุรกรรมดังนี้ ที่คู่สัญญามี credit rating อยู่ในระดับ investment grade 6.7.1 reverse repo 6.7.2 OTC derivatives | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7 | ทรัพย์สินอื่นนอกเหนือจากที่ระบุในข้อ 1 - ข้อ 6 (SIP) | ไม่เกิน 5% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ข้อ | ประเภททรัพย์สิน | อัตราส่วน (% ของ NAV) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1 | การลงทุนในทรัพย์สินของบริษัททุกบริษัทที่อยู่ในกลุ่มกิจการเดียวกัน หรือการเข้าเป็นคู่สัญญาในธุรกรรมทางการเงินกับบริษัทดังกล่าว | ไม่เกินอัตราใดอัตราหนึ่งดังนี้ แล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า (1) 25% หรือ (2) น้ำหนักของทรัพย์สินที่ลงทุนใน benchmark + 10% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ข้อ | ประเภททรัพย์สิน | อัตราส่วน (% ของ NAV) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1 | เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก B/E หรือ P/N ที่นิติบุคคล ตามกฎหมายไทย (ไม่รวมถึงสาขาในต่างประเทศของนิติบุคคลดังกล่าว) เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย หรือ คู่สัญญา ดังนี้ 1.1 ธนาคารหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น | - ทุกประเภทรวมกันไม่เกิน 45% เฉลี่ยในรอบปีบัญชี (หรือในรอบอายุกองทุนสำหรับกองทุนที่มีอายุโครงการ < 1 ปี) - อัตราข้างต้นไม่ใช้กับกองทุนที่อายุโครงการหรืออายุสัญญาคงเหลือ ≤ 6 เดือน ทั้งนี้เฉพาะกองทุนที่มีอายุทั้งโครงการหรือ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|---|--|---|--|
| | <p>คำนวณเฉพาะผู้ออก ผู้ส่งจ่าย หรือคู่สัญญารายนั้น ไม่เกินผลรวมของน้ำหนักของทรัพย์สินดังกล่าวในตัวชี้วัดและร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>ทั้งนี้ แทนอัตราส่วนที่กำหนดไว้ในข้อ 3.14.1.2 ข้อ 3.14.1.3 ข้อ 3.14.1.4 หรือข้อ 3.14.1.5 แล้วแต่กรณี</p> <p>บริษัทจัดการพิจารณาความเป็นกลุ่มกิจการตามข้อ 3.14.1.6 และข้อ 3.14.1.7 ตามงบการเงินรวมที่มีการจัดทำและเปิดเผยล่าสุด เว้นแต่ในกรณีที่ไม่มีงบการเงินรวม ให้พิจารณาตามสัดส่วนการถือหุ้นที่ปรากฏในบัญชีรายชื่อผู้ถือหุ้นล่าสุดที่ส่งต่อกระทรวงพาณิชย์</p> <p>3.14.1.8 บริษัทจัดการกองทุนรวมอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งเงินฝาก บัตรเงินฝาก ตัวแลกเงิน หรือตัวสัญญาใช้เงิน ที่บุคคลดังต่อไปนี้ เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย หรือคู่สัญญา เป็นจำนวนที่มีมูลค่ารวมโดยเฉลี่ยไม่เกินร้อยละ 45 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวมในรอบระยะเวลาบัญชี หรือในรอบอายุกองทุนรวมสำหรับกองทุนรวมที่มีอายุน้อยกว่า 1 ปี</p> <p>(1) ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น</p> <p>(2) ธนาคารพาณิชย์</p> <p>(3) บริษัทเงินทุน</p> <p>(4) บริษัทเครดิตฟองซิเอร์</p> <p>(5) บริษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย</p> <p>(6) สถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น</p> <p>(7) ธนาคารต่างประเทศ</p> <p>การคำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามวรรคหนึ่ง มิให้นำมูลค่าของทรัพย์สินดังต่อไปนี้รวมในอัตราส่วนดังกล่าว</p> <p>(1) เงินฝากในบัญชีเงินฝากเพื่อการดำเนินงานของกองทุนรวม</p> <p>(2) ทรัพย์สินที่คู่สัญญาในธุรกรรมการซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืน โอนกรรมสิทธิ์ให้แก่กองทุนรวม เพื่อดำรงมูลค่าธุรกรรมตามประกาศกำหนด</p> <p>อัตราส่วนตามวรรคหนึ่งมิให้นำมาใช้บังคับในช่วงระยะเวลา 6 เดือนก่อนวันครบกำหนดอายุโครงการของกองทุนรวมที่มีอายุโครงการตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป</p> <p>ในกรณีที่เงินฝากหรือตราสารแห่งหนึ่งที่มีลักษณะคล้ายเงินฝากที่กองทุนรวมลงทุนในหรือมีไว้เกินอัตราส่วนที่กำหนดตามวรรค</p> | <p>1.2 ธพ.</p> <p>1.3 บง.</p> <p>1.4 บค.</p> <p>1.5 บริษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย</p> <p>(ไม่รวมถึงเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการดำเนินงานของกองทุน และทรัพย์สินที่กองทุนได้รับโอนกรรมสิทธิ์มาจากคู่สัญญาตาม reverse repo หรือ securities lending หรือ derivatives)</p> | <p>อายุทั้งสัญญา ≥ 1 ปี</p> | |
| | | <p>2 ทรัพย์สินดังนี้</p> <p>2.1 B/E P/N ที่มีเงื่อนไขห้ามเปลี่ยนมือแต่กองทุนได้ดำเนินการให้มีการรับโอนสิทธิเรียกร้องในตราสารได้ตามวิธีการที่กฎหมายกำหนด หรือมีเงื่อนไขให้กองทุนสามารถขายคืนผู้ออกตราสารได้</p> <p>2.2 เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากที่มีระยะเวลาการฝากเกิน 12 เดือน</p> <p>2.3 total SIP ตามข้อ 5 ของส่วนนี้</p> | <p>ทุกประเภทรวมกันไม่เกิน 25%</p> | |
| | | <p>3 reverse repo</p> | <p>ไม่เกิน 25%</p> | |
| | | <p>4 securities lending</p> | <p>ไม่เกิน 25%</p> | |
| | | <p>5 ตราสารดังนี้ (total SIP)</p> <p>5.1 ตราสารที่ไม่ได้จดทะเบียนเป็นหลักทรัพย์สินซื้อขายใน SET และในตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศ</p> | <p>ทุกประเภทรวมกันไม่เกิน 15%</p> | |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข | | | | | | |
|--|--|---|--|--|----------------------------------|--|---|--|--|--|
| | <p>หนึ่ง ให้บริษัทจัดการกองทุนรวมลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังกล่าวให้มีมูลค่ารวมโดยเฉลี่ยไม่เกินร้อยละ 45 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวมภายใน 30 วันนับแต่วันสิ้นรอบปีบัญชีนั้น ทั้งนี้ ให้คำนวณอัตราส่วนการลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังกล่าวโดยเฉลี่ยตั้งแต่วันแรกของรอบปีบัญชีนั้น จนถึงวันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่าเป็นไปตามอัตราส่วนดังกล่าว</p> <p>เมื่อบริษัทจัดการได้ปฏิบัติตามวรรคสี่แล้ว ให้บริษัทจัดการรายงานให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมทราบภายในวันทำการถัดจากวันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่ารวมโดยเฉลี่ยไม่เกินร้อยละ 45 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม เพื่อให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวม ตรวจสอบการปฏิบัติตามดังกล่าว ทั้งนี้ บริษัทจัดการต้องดำเนินการให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมแจ้งให้สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ทราบภายใน 5 วันนับแต่วันที่ได้รับรายงานจากบริษัทจัดการด้วย</p> <p>หากบริษัทจัดการไม่สามารถปฏิบัติตามวรรคสี่ได้ สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. อาจสั่งให้บริษัทเลิกกองทุนรวมนั้น</p> <p>ทั้งนี้ อัตราส่วนดังกล่าวข้างต้นให้นับรวมการลงทุนทั้งในและต่างประเทศ</p> <p>3.14.1.9 ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควร เพื่อคุ้มครองประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนอันเนื่องมาจากปัญหาความผันผวน (fluctuation) ของตลาดเงินและตลาดทุนในวงกว้างในรอบปีบัญชีใด บริษัทจัดการกองทุนรวมอาจขอผ่อนผันต่อสำนักงานเพื่อไม่ต้องนำการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งเงินฝาก บัตรเงินฝาก ตัวแลกเงิน หรือตัวสัญญาใช้เงิน ในช่วงเวลาที่เกิดความผันผวนดังกล่าวมารวมคำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามข้อ 3.14.1.8 ได้สำหรับรอบระยะเวลาบัญชีนั้น</p> <p>3.14.1.10 บริษัทจัดการกองทุนรวมอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมได้ไม่เกินอัตราส่วนดังต่อไปนี้</p> <p>(1) ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของแต่ละกองทุนรวมที่บริษัทจัดการอื่นเป็นผู้รับผิดชอบดำเนินการ ไม่เกินร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของแต่ละกองทุนรวมที่บริษัทจัดการเป็นผู้รับผิดชอบดำเนินการ</p> <p>(2) ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของทุกกองทุนรวมที่บริษัทจัดการอื่นเป็นผู้</p> | <p>5.2 ตราสารที่ไม่ได้ซื้อขายอยู่ในกระดานซื้อขายหลักทรัพ์สำหรับผู้ลงทุนทั่วไปของ SET และของตลาดซื้อขายหลักทรัพ์ต่างประเทศ</p> <p>5.3 ตราสารที่ซื้อขายในกระดานซื้อขายหลักทรัพ์สำหรับผู้ลงทุนทั่วไปซึ่งอยู่ระหว่างแก้ไขเหตุที่อาจทำให้มีการเพิกถอนตราสารดังกล่าวออกจากกระดานซื้อขายใน SET หรือในตลาดซื้อขายหลักทรัพ์ต่างประเทศ</p> <p>5.4 ตราสารหนี้ <u>ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน</u> <u>ศก</u> หรือตราสาร Basel III ที่ไม่ได้อยู่ในระบบของ organized market หรือเทียบเท่า แต่ไม่รวม B/E และ P/N</p> | | | | | | | | |
| | | <p>6 derivatives ดังนี้</p> <table border="1" data-bbox="1070 815 1868 1433"> <tr> <td data-bbox="1070 815 1339 1007">6.1 hedging limit : การเข้าทำธุรกรรม derivatives ที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการลดความเสี่ยง</td> <td colspan="2" data-bbox="1339 815 1868 1007">ไม่เกินมูลค่าความเสี่ยงที่มีอยู่</td> </tr> <tr> <td data-bbox="1070 1007 1339 1433">6.2 non-hedging limit : การเข้าทำธุรกรรม derivatives ที่มีไว้เพื่อการลดความเสี่ยง</td> <td data-bbox="1339 1007 1615 1433"> <u>global exposure limit</u> 6.2.1 <u>กรณีกองทุนไม่มี</u> <u>การลงทุนแบบซับซ้อน</u> จำกัด net exposure ที่เกิดจากการลงทุนใน derivatives โดยต้องไม่เกิน 100% ของ NAV </td> <td data-bbox="1615 1007 1868 1433"> <u>OTC derivatives limit</u> ไม่เกิน 25% ของ NAV (ไม่ใช้กับการลงทุนของกองทุน ดังนี้) (1) กองทุนรวมปิด (2) กองทุน buy & hold (3) กองทุนที่มีการบริหารจัดการเพื่อ </td> </tr> </table> | | 6.1 hedging limit : การเข้าทำธุรกรรม derivatives ที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการลดความเสี่ยง | ไม่เกินมูลค่าความเสี่ยงที่มีอยู่ | | 6.2 non-hedging limit : การเข้าทำธุรกรรม derivatives ที่มีไว้เพื่อการลดความเสี่ยง | <u>global exposure limit</u> 6.2.1 <u>กรณีกองทุนไม่มี</u> <u>การลงทุนแบบซับซ้อน</u> จำกัด net exposure ที่เกิดจากการลงทุนใน derivatives โดยต้องไม่เกิน 100% ของ NAV | <u>OTC derivatives limit</u> ไม่เกิน 25% ของ NAV (ไม่ใช้กับการลงทุนของกองทุน ดังนี้) (1) กองทุนรวมปิด (2) กองทุน buy & hold (3) กองทุนที่มีการบริหารจัดการเพื่อ | |
| 6.1 hedging limit : การเข้าทำธุรกรรม derivatives ที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการลดความเสี่ยง | ไม่เกินมูลค่าความเสี่ยงที่มีอยู่ | | | | | | | | | |
| 6.2 non-hedging limit : การเข้าทำธุรกรรม derivatives ที่มีไว้เพื่อการลดความเสี่ยง | <u>global exposure limit</u> 6.2.1 <u>กรณีกองทุนไม่มี</u> <u>การลงทุนแบบซับซ้อน</u> จำกัด net exposure ที่เกิดจากการลงทุนใน derivatives โดยต้องไม่เกิน 100% ของ NAV | <u>OTC derivatives limit</u> ไม่เกิน 25% ของ NAV (ไม่ใช้กับการลงทุนของกองทุน ดังนี้) (1) กองทุนรวมปิด (2) กองทุน buy & hold (3) กองทุนที่มีการบริหารจัดการเพื่อ | | | | | | | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|---|------------------------------|---|---|
| | <p>ผู้รับผิดชอบดำเนินการ ไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของแต่ละกองทุนรวมที่บริษัทจัดการเป็นผู้รับผิดชอบดำเนินการ</p> <p>หน่วยลงทุนตามวรรคหนึ่ง หมายความว่า หน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่จัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 เท่านั้น แต่ไม่รวมถึงหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์</p> <p>3.14.1.11 บริษัทจัดการอาจทำธุรกรรมการซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืนในนามกองทุนได้โดยมีมูลค่าธุรกรรมรวมกันทั้งสิ้นไม่เกินร้อยละ 25 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>3.14.1.12 การลงทุนหรือมีไว้ซึ่งธุรกรรมการซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืนให้บริษัทจัดการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามข้อ 3.14.1.3 และข้อ 3.14.1.4 ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้</p> <p>(1) ในกรณีที่มูลค่ารวมของหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งที่ซื้อและที่โอนมาเพื่อดำรงมูลค่าธุรกรรมตามประกาศกำหนด (ถ้ามี) ณ สิ้นวันไม่น้อยกว่ามูลค่าธุรกรรมให้นำหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งดังกล่าวมาคำนวณอัตราส่วนการลงทุนเท่ากับมูลค่าธุรกรรม ทั้งนี้ บริษัทจัดการไม่ต้องนำธุรกรรมการซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืนมาคำนวณอัตราส่วนการลงทุนที่คู่สัญญา</p> <p>(2) ในกรณีมูลค่ารวมของหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งที่ซื้อและที่โอนมา เพื่อดำรงมูลค่าธุรกรรมตามประกาศกำหนด (ถ้ามี) ณ สิ้นวันน้อยกว่ามูลค่าธุรกรรม ให้คำนวณอัตราส่วนการลงทุนดังต่อไปนี้</p> <p>(ก) นำหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งดังกล่าวมาคำนวณอัตราส่วนการลงทุน เท่ากับมูลค่าหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งนั้นตามราคาตลาด และ</p> <p>(ข) นำธุรกรรมการซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืนมาคำนวณอัตราส่วนการลงทุนที่คู่สัญญา เท่ากับส่วนต่างของมูลค่าธุรกรรมกับมูลค่าหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งนั้นตามราคาตลาด</p> <p>(3) ในกรณีเป็นธุรกรรมซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืนตามสัญญาที่มีข้อกำหนดให้คำนวณมูลค่าหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งที่ซื้อและมูลค่าธุรกรรมรวมเป็นยอดสุทธิของธุรกรรมทั้งหมดตามที่ประกาศกำหนดให้คำนวณอัตราส่วนการลงทุนดังนี้</p> <p>(ก) ในกรณีที่มูลค่ารวมของหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งที่ซื้อและที่โอนมาตาม เพื่อดำรงมูลค่าธุรกรรมตามประกาศกำหนด (ถ้ามี) ณ สิ้นวันของแต่ละธุรกรรม มีมูลค่าไม่น้อยกว่า</p> | | <p>6.2.2 กรณีกองทุนมีการลงทุนแบบซับซ้อนจำกัด net exposure ที่เกิดจากการลงทุนใน derivatives โดยมูลค่าความเสียหายสูงสุด (value-at-risk : VaR) ของกองทุนต้องเป็นดังนี้</p> <p>(1) absolute VaR \leq 20% ของ NAV</p> <p>(2) relative VaR \leq 2 เท่า ของ VaR ของ benchmark</p> <p>หมายเหตุ : "การลงทุนแบบซับซ้อน" หมายความว่า การลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีกลยุทธ์แบบซับซ้อน (complex strategic investment) หรือ การลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีความซับซ้อน (exotic</p> | <p>ไม่ให้เกิดความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง เช่น ได้จัดให้มีข้อตกลงกับคู่สัญญาในการล้างฐานะของสัญญาได้ทุกขณะตามราคายุติธรรม (fair value)</p> |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข | | | | | | | | | | | | |
|---|--|---|---|---------------------------------------|-----|-----------------|-----------------------|---|----------------------------|--|---|---|---|---|----------------------------------|---|
| | <p>มูลค่าธุรกรรมแต่ละธุรกรรมนั้น ให้คำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามหลักเกณฑ์ใน (1)</p> <p>(ข) ในกรณีที่มูลค่ารวมของหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งหรือสองที่โอนมา เพื่อดำรงมูลค่าธุรกรรมตามประกาศกำหนด (3) (ถ้ามี) ณ สิ้นวันของแต่ละธุรกรรม มีมูลค่าน้อยกว่ามูลค่าธุรกรรมแต่ละธุรกรรม ให้คำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามหลักเกณฑ์ใน (2)</p> <p>(ค) ในกรณีที่มิมีบางธุรกรรมที่มูลค่ารวมของหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งหรือสองที่โอนมา เพื่อดำรงมูลค่าธุรกรรมตามประกาศกำหนด (ถ้ามี) ณ สิ้นวันน้อยกว่ามูลค่าธุรกรรม ให้บริษัทจัดการนำหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งหรือสองที่โอนมา เพื่อดำรงมูลค่าธุรกรรมตามประกาศกำหนด (ถ้ามี) ณ สิ้นวันไม่น้อยกว่ามูลค่าธุรกรรม มาคำนวณอัตราส่วนการลงทุนเพิ่มเติมเพื่อชดเชยส่วนต่างของมูลค่าธุรกรรมกับมูลค่ารวมของหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งหรือสองที่โอนมา เพื่อดำรงมูลค่าธุรกรรมตามประกาศกำหนด (ถ้ามี) ณ สิ้นวันของธุรกรรมแรกทั้งนี้ หากภายหลังการชดเชยส่วนต่างข้างต้นมูลค่าสุทธิของทุกหลักทรัพย์หรือตราสารแห่งหนึ่งหรือสองโดยมีสัญญาขายคืนยังคงน้อยกว่ามูลค่าสุทธิของทุกธุรกรรม ให้นำธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืนมาคำนวณอัตราส่วนการลงทุนที่คู่สัญญาเท่ากับส่วนต่างดังกล่าว</p> <p>3.14.1.13 บริษัทจัดการอาจทำธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ของกองทุนได้ โดยมีมูลค่าธุรกรรมรวมกันทั้งสิ้นไม่เกินร้อยละ 25 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน ทั้งนี้ การคำนวณมูลค่าธุรกรรมดังกล่าว ให้บริษัทจัดการคำนวณโดยใช้มูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม รวมผลประโยชน์ที่พึงได้รับจนถึงวันที่คำนวณมูลค่าธุรกรรมดังกล่าว</p> <p>ในกรณีที่ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ในขณะที่กองทุนเข้าทำธุรกรรม มีมูลค่าไม่เกินอัตราส่วนที่กำหนดในวรรคหนึ่ง หากต่อมาธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์นั้นมีมูลค่าเกินอัตราส่วนดังกล่าวโดยมิได้เกิดจากการทำธุรกรรมเพิ่มเติม บริษัทจัดการจะยังคงมีไว้ซึ่งธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ดังกล่าวต่อไปก็ได้</p> <p>ให้บริษัทจัดการจัดทำรายงานโดยระบุวันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่าเกินอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดพร้อมสาเหตุ และส่งรายงานดังกล่าวให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมทราบภายในสามวันทำการนับแต่วันที่ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์นั้นมี</p> | | <p>derivatives)</p> <p>6 <u>ตราสาร Non-investment grade / Unrated ทั้งที่อยู่ในระบบของ organized market และไม่ได้ อยู่ในระบบของ organized market หรือเทียบเท่าในข้อ 5.4 ด้วย</u></p> <p>7 <u>หน่วย CIS ที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย (โดยหน่วย CIS ดังกล่าวจะมีนโยบายสอดคล้องกับกองทุนรวม และไม่ทำให้ความเสี่ยงของกองทุนรวมเปลี่ยนแปลงไปอย่างมีนัยสำคัญ)</u></p> | | | | | | | | | | | | | |
| <p>ส่วนที่ 4 : อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามความมีส่วนได้ส่วนเสียในกิจการที่ลงทุน (concentration limit)</p> | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <table border="1"> <thead> <tr> <th data-bbox="994 675 1070 722">ข้อ</th> <th data-bbox="1070 675 1339 722">ประเภททรัพย์สิน</th> <th data-bbox="1339 675 1868 722">อัตราส่วน (% ของ NAV)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="994 722 1070 914">1</td> <td data-bbox="1070 722 1339 914">หุ้นของบริษัทรายใดรายหนึ่ง</td> <td data-bbox="1339 722 1868 914">ทุกกองทุนรวมกันภายใต้การจัดการของ บลจ. รายเดียวกันต้องมีจำนวนหุ้นของบริษัทรวมกัน < 25% ของจำนวนสิทธิออกเสียงทั้งหมดของบริษัทนั้น (ไม่นับรวมการถือหุ้นของกองทุนวอยเก้ท)</td> </tr> <tr> <td data-bbox="994 914 1070 1273">2</td> <td data-bbox="1070 914 1339 1273">ตราสารหนี้ <u>ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสาร Basel III และศก</u> ของผู้ออกรายใดรายหนึ่ง (ไม่รวมถึงตราสารหนี้ภาครัฐไทย หรือตราสารหนี้ภาครัฐต่างประเทศ)</td> <td data-bbox="1339 914 1868 1273">ไม่เกิน 1 ใน 3 ของมูลค่าหนี้สินรวม (total liability) ของผู้ออกรายนั้น (ตามที่เปิดเผยไว้ในงบการเงินล่าสุด) หมายเหตุ: มูลค่าหนี้สินรวม (total liability) ไม่ให้นับรวมรายการเจ้าหนี้การค้า รายได้รับล่วงหน้า ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย และหนี้สินของเจ้าหนี้ที่มีความเกี่ยวข้องกับบริษัท เช่น เงินกู้ยืมจากกิจการที่เกี่ยวข้องกัน เป็นต้น</td> </tr> <tr> <td data-bbox="994 1273 1070 1433">3</td> <td data-bbox="1070 1273 1339 1433">หน่วย CIS ของกองทุนใดกองทุนหนึ่ง</td> <td data-bbox="1339 1273 1868 1433">ไม่เกิน 25% ของจำนวนหน่วย CIS ทั้งหมดของ MF หรือกองทุน CIS ต่างประเทศ ที่ออกหน่วยนั้น เว้นแต่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ด. โดยต้องเป็นหน่วย CIS</td> </tr> </tbody> </table> | | | | | ข้อ | ประเภททรัพย์สิน | อัตราส่วน (% ของ NAV) | 1 | หุ้นของบริษัทรายใดรายหนึ่ง | ทุกกองทุนรวมกันภายใต้การจัดการของ บลจ. รายเดียวกันต้องมีจำนวนหุ้นของบริษัทรวมกัน < 25% ของจำนวนสิทธิออกเสียงทั้งหมดของบริษัทนั้น (ไม่นับรวมการถือหุ้นของกองทุนวอยเก้ท) | 2 | ตราสารหนี้ <u>ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสาร Basel III และศก</u> ของผู้ออกรายใดรายหนึ่ง (ไม่รวมถึงตราสารหนี้ภาครัฐไทย หรือตราสารหนี้ภาครัฐต่างประเทศ) | ไม่เกิน 1 ใน 3 ของมูลค่าหนี้สินรวม (total liability) ของผู้ออกรายนั้น (ตามที่เปิดเผยไว้ในงบการเงินล่าสุด) หมายเหตุ: มูลค่าหนี้สินรวม (total liability) ไม่ให้นับรวมรายการเจ้าหนี้การค้า รายได้รับล่วงหน้า ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย และหนี้สินของเจ้าหนี้ที่มีความเกี่ยวข้องกับบริษัท เช่น เงินกู้ยืมจากกิจการที่เกี่ยวข้องกัน เป็นต้น | 3 | หน่วย CIS ของกองทุนใดกองทุนหนึ่ง | ไม่เกิน 25% ของจำนวนหน่วย CIS ทั้งหมดของ MF หรือกองทุน CIS ต่างประเทศ ที่ออกหน่วยนั้น เว้นแต่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ด. โดยต้องเป็นหน่วย CIS |
| ข้อ | ประเภททรัพย์สิน | อัตราส่วน (% ของ NAV) | | | | | | | | | | | | | | |
| 1 | หุ้นของบริษัทรายใดรายหนึ่ง | ทุกกองทุนรวมกันภายใต้การจัดการของ บลจ. รายเดียวกันต้องมีจำนวนหุ้นของบริษัทรวมกัน < 25% ของจำนวนสิทธิออกเสียงทั้งหมดของบริษัทนั้น (ไม่นับรวมการถือหุ้นของกองทุนวอยเก้ท) | | | | | | | | | | | | | | |
| 2 | ตราสารหนี้ <u>ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสาร Basel III และศก</u> ของผู้ออกรายใดรายหนึ่ง (ไม่รวมถึงตราสารหนี้ภาครัฐไทย หรือตราสารหนี้ภาครัฐต่างประเทศ) | ไม่เกิน 1 ใน 3 ของมูลค่าหนี้สินรวม (total liability) ของผู้ออกรายนั้น (ตามที่เปิดเผยไว้ในงบการเงินล่าสุด) หมายเหตุ: มูลค่าหนี้สินรวม (total liability) ไม่ให้นับรวมรายการเจ้าหนี้การค้า รายได้รับล่วงหน้า ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย และหนี้สินของเจ้าหนี้ที่มีความเกี่ยวข้องกับบริษัท เช่น เงินกู้ยืมจากกิจการที่เกี่ยวข้องกัน เป็นต้น | | | | | | | | | | | | | | |
| 3 | หน่วย CIS ของกองทุนใดกองทุนหนึ่ง | ไม่เกิน 25% ของจำนวนหน่วย CIS ทั้งหมดของ MF หรือกองทุน CIS ต่างประเทศ ที่ออกหน่วยนั้น เว้นแต่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ด. โดยต้องเป็นหน่วย CIS | | | | | | | | | | | | | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ | | | |
|-----------------|---|--|--|--|---|---|
| | <p>มูลค่าเกินอัตราส่วนที่กำหนด พร้อมทั้งจัดทำสำเนารายงานดังกล่าวไว้ที่บริษัทจัดการเพื่อให้สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด.สามารถตรวจสอบได้</p> <p>3.14.1.14 บริษัทจัดการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนหรือมีไว้ซึ่งใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น ใบแสดงสิทธิในการซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้ ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้</p> <p>(1) ในกรณีของใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย ให้นับมูลค่าของหลักทรัพย์อ้างอิงของใบแสดงสิทธิดังกล่าว รวมในอัตราส่วนสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวที่กำหนดในโครงการนี้ โดยถือเสมือนหนึ่งว่ากองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นโดยตรง ทั้งนี้บริษัทจัดการอาจไม่นับมูลค่าของใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทยรวมในอัตราส่วนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สินหรือคู่สัญญาที่กำหนดตามข้อ 3.14.1.2 ข้อ 3.14.1.3 ข้อ 3.14.1.4 และข้อ 3.14.1.5 ก็ได้</p> <p>มูลค่าของหลักทรัพย์อ้างอิงที่นำมาคำนวณรวมในอัตราส่วนตามวรรคหนึ่ง ให้มีมูลค่าเท่ากับมูลค่าใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทยที่กองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้</p> <p>(2) ในกรณีของใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น หรือใบแสดงสิทธิในการซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้ ให้บริษัทจัดการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนดังต่อไปนี้</p> <p>(ก) นับมูลค่าที่ผู้ออกตราสารดังกล่าวมีหน้าที่ต้องชำระตามตราสารนั้น รวมในอัตราส่วนที่ผู้ออกตราสารดังกล่าว</p> <p>(ข) นับมูลค่าของหุ้นที่รองรับรวมในอัตราส่วนที่ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง โดยถือเสมือนหนึ่งว่ากองทุนลงทุนในหุ้นที่รองรับนั้นโดยตรง ทั้งนี้ มูลค่าของหุ้นที่รองรับให้ใช้มูลค่าตามราคาตลาดของหุ้นนั้นซึ่งคุณกับค่าเฉลี่ยของใบสำคัญแสดงสิทธิหรือใบแสดงสิทธิดังกล่าว แล้วแต่กรณี</p> <p>(3) ในกรณีของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้ ให้บริษัทจัดการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนดังต่อไปนี้</p> <p>(ก) นับมูลค่าที่ผู้ออกตราสารดังกล่าวมีหน้าที่ต้องชำระตามตราสารนั้นรวมในอัตราส่วนที่ผู้ออกตราสารดังกล่าว</p> | <table border="1" data-bbox="996 188 1890 268"> <tr> <td data-bbox="996 188 1075 268"></td> <td data-bbox="1075 188 1335 268"></td> <td data-bbox="1335 188 1890 268">ของ กองทุนที่จัดตั้งขึ้นใหม่ที่มีขนาดเล็ก และมีการเสนอขายต่อผู้ลงทุนในวงกว้าง</td> </tr> </table> <p>ส่วนที่ 5 : การดำเนินการเมื่อทรัพย์สินที่ลงทุนขาดคุณสมบัติหรือการลงทุนไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุน</p> <p>1. ในกรณีที่กองทุนมีการลงทุนเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดแต่ต่อมาทรัพย์สินที่ลงทุนมีคุณสมบัติที่เปลี่ยนแปลงไปจนเป็นเหตุให้ขาดคุณสมบัติในการเป็นทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้อีกต่อไป บริษัทจัดการจะดำเนินการดังต่อไปนี้</p> <p>(1) จัดทำรายงานโดยระบุรายละเอียดเกี่ยวกับชื่อ จำนวน อัตราส่วนการลงทุนและวันที่ทรัพย์สินขาดคุณสมบัติ และจัดส่งรายงานต่อสำนักงาน รวมทั้งจัดส่งต่อผู้ดูแลผลประโยชน์ ภายในวันทำการถัดจากวันที่เกิดกรณีดังกล่าว ตลอดจนจัดเก็บสำเนารายงานไว้ที่บริษัทจัดการ</p> <p>(2) จำหน่ายทรัพย์สินที่ขาดคุณสมบัติภายในโอกาสแรกโดยคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ แต่ไม่เกินกว่า 90 วันนับแต่วันที่ทรัพย์สินนั้นขาดคุณสมบัติเว้นแต่เป็นกรณีตามข้อ 4.</p> <p>(3) เมื่อบริษัทจัดการสามารถจำหน่ายทรัพย์สินที่ขาดคุณสมบัติ หรือทรัพย์สินที่ขาดคุณสมบัติมีคุณสมบัติเปลี่ยนแปลงไปจนเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดแล้ว บริษัทจัดการจะจัดทำรายงานข้อมูลเกี่ยวกับชื่อ จำนวน อัตราส่วนการลงทุนในทรัพย์สินดังกล่าว รวมถึงวันที่ได้จำหน่ายทรัพย์สินนั้นออกไปหรือวันที่ทรัพย์สินมีการเปลี่ยนแปลงคุณสมบัติ แล้วแต่กรณี และให้จัดส่งรายงานต่อสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. รวมทั้งจัดส่งให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ ภายในวันทำการถัดจากวันที่เกิดกรณีดังกล่าว</p> <p>2. ในกรณีที่ทรัพย์สินในขณะที่กองทุนมีการลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนด แต่ต่อมาการลงทุนไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนเป็นเวลา 5 วันทำการติดต่อกัน โดยมีได้เกิดจากการลงทุนเพิ่ม บริษัทจัดการจะดำเนินการดังต่อไปนี้</p> <p>(1) จัดทำรายงานโดยระบุรายละเอียดเกี่ยวกับประเภท จำนวน อัตราส่วนการลงทุนและวันที่การลงทุนไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุน และจัดส่งรายงานต่อสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. รวมทั้งจัดส่งต่อผู้ดูแลผลประโยชน์ภายในวันทำการถัดจากวันที่ทำการสุดท้ายของระยะเวลา 5 วันทำการดังกล่าว ตลอดจนจัดเก็บสำเนารายงานไว้ที่บริษัทจัดการ</p> <p>(2) ไม่ลงทุนเพิ่มเติมในทรัพย์สินที่เกินอัตราส่วนการลงทุนจนกว่าจะสามารถแก้ไขให้เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนด</p> <p>(3) แก้ไขให้เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดภายในโอกาสแรกโดยคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ แต่ต้องไม่เกินระยะเวลาดังนี้ เว้นแต่เป็นกรณีตาม</p> | | | ของ กองทุนที่จัดตั้งขึ้นใหม่ที่มีขนาดเล็ก และมีการเสนอขายต่อผู้ลงทุนในวงกว้าง | <p>- เพิ่มเติมหัวข้อเรื่องกรณีทรัพย์สินที่ลงทุนไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนและกรณีการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนตามการจัดแบ่งประเภทของกองทุน</p> |
| | | ของ กองทุนที่จัดตั้งขึ้นใหม่ที่มีขนาดเล็ก และมีการเสนอขายต่อผู้ลงทุนในวงกว้าง | | | | |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|---|--|---------------------------------------|
| | <p>(ข) นับมูลค่าของหลักทรัพย์อ้างอิงรวมในอัตราส่วนที่ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง โดยถือเสมือนหนึ่งว่ากองทุนลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นโดยตรง ทั้งนี้ มูลค่าของหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวให้ใช้มูลค่าตามราคาตลาดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นซึ่งคุณกับค่าเฉลี่ยของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้ แล้วแต่กรณี</p> <p>(4) ในกรณีของธุรกรรมให้ยืมหลักทรัพย์ บริษัทจัดการจะคำนวณอัตราส่วนการลงทุนใน หรือมีไว้ซึ่งการให้ยืมหลักทรัพย์ โดยให้นับมูลค่าทรัพย์สินที่ให้ยืมรวมในอัตราส่วนสำหรับหลักทรัพย์ที่กำหนดไว้ในข้อ 3.14.1.2 ข้อ 3.14.1.3 ข้อ 3.14.1.4 และข้อ 3.14.1.5 โดยไม่ถือเสมือนหนึ่งว่ากองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์นั้นอยู่ ทั้งนี้ บริษัทจัดการอาจไม่นับรวมในอัตราส่วนที่คำนวณตามคู่สัญญาที่กำหนดตามข้อ 3.14.1.2 ข้อ 3.14.1.3 ข้อ 3.14.1.4 และข้อ 3.14.1.5 ก็ได้</p> <p>3.14.1.15 บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการลดความเสี่ยง (Hedging) เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนได้ โดยไม่เกินมูลค่าความเสี่ยงทั้งหมดที่กองทุนมีอยู่</p> <p>3.14.1.16 ในกรณีที่กองทุนเข้าเป็นคู่สัญญาในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยมิได้มีวัตถุประสงค์เพื่อการลดความเสี่ยง (hedging) ให้บริษัทจัดการดำเนินการให้มีการกันหรือแยกทรัพย์สินของกองทุนที่มีคุณภาพซึ่งมีสภาพคล่องในจำนวนที่เพียงพอต่อมูลค่าสุทธิที่กองทุนอาจมีภาระต้องชำระหนี้หรือชำระค่าสินค่าเมื่อสิ้นสุดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (fully covered) ไว้ตลอดเวลาที่ได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญานั้น ทั้งนี้ ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด</p> <p>3.14.1.17 การคำนวณมูลค่าการลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามข้อ 3.14.1.3 ข้อ 3.14.1.4 และข้อ 3.14.1.5 (1) ให้นับมูลค่าที่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง มีหน้าที่ต้องชำระตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า รวมคำนวณในอัตราส่วนของบุคคลที่เป็นคู่สัญญาดังกล่าว เว้นแต่กรณีที่กองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญานั้นในศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า บริษัทจัดการไม่ต้องคำนวณมูลค่าและอัตราส่วนตามที่กำหนดในข้อดังกล่าว</p> <p>3.14.1.18 นอกจากการคำนวณตามข้อ 3.14.1.17 แล้วให้บริษัทจัดการคำนวณอัตราส่วนการลงทุน ในกรณีที่การเข้าเป็นคู่สัญญาในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นผลหรืออาจเป็นผลให้</p> | <p>ข้อ 4</p> <p>(ก) 30 วันนับแต่วันสิ้นรอบระยะเวลาบัญชี ในกรณีที่ไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามประเภททรัพย์สิน สำหรับการลงทุนในเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก ตัวแลกเงินหรือตัวสัญญาใช้เงิน</p> <p>(ข) 90 วันนับแต่วันสุดท้ายของระยะเวลา 5 วันทำการดังกล่าว สำหรับกรณีอื่นใด นอกเหนือจากกรณีตาม (3) (ก)</p> <p>(4) เมื่อบริษัทจัดการสามารถแก้ไขจนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดแล้ว บริษัทจัดการจะจัดทำรายงานข้อมูลเกี่ยวกับชื่อ จำนวน อัตราส่วนการลงทุนในทรัพย์สินดังกล่าว รวมถึงวันที่สามารถแก้ไขให้เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนแล้วแต่กรณี และจัดส่งรายงานต่อสำนักงาน รวมทั้งจัดส่งต่อผู้ดูแลผลประโยชน์ ภายในวันทำการถัดจากวันที่มีการแก้ไขจนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนนั้น</p> <p>(5) ในกรณีที่กองทุนมีหุ้นของบริษัทใดโดยไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามความมีส่วนได้เสียในกิจการที่ลงทุน (concentration limit) นอกจากการปฏิบัติตามส่วนที่ 5 ข้อ 2 (1) (2) (3) และ (4) แล้ว บริษัทจัดการต้องดำเนินการดังนี้ด้วย</p> <p>(ก) งดเว้นการใช้สิทธิออกเสียงในหุ้นจำนวนที่เกินอัตราส่วนการลงทุน เว้นแต่กรณีจำเป็นและสมควรโดยได้รับการผ่อนผันจากสำนักงาน</p> <p>(ข) ลดสัดส่วนการถือหุ้นหรือลดการมีอำนาจควบคุม หรือยื่นคำขอผ่อนผันการทำค่าเสนอซื้อ ในกรณีที่ทรัพย์สินเป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียน และการได้มาซึ่งหุ้นของบริษัทดังกล่าวเป็นผลให้กองทุนได้มาหรือเป็นผู้ถือหุ้นของบริษัทนั้นจนถึงหรือข้ามจุดที่ต้องทำค่าเสนอซื้อ</p> <p>3. ในกรณีที่กองทุนมีการลงทุนเป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดแต่ต่อมามีกรณีดังต่อไปนี้ จนเป็นเหตุให้ไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุน บริษัทจัดการจะปฏิบัติให้เป็นไปตามข้อ 2 โดยอนุโลม</p> <p>(1) กรณีที่กองทุนมีการลงทุนหรือได้สิทธิจากการเป็นผู้ถือหลักทรัพย์ตามสัดส่วนที่มีอยู่เดิมนั้น</p> <p>(2) กรณีที่กองทุนได้รับทรัพย์สินมาจากการบริจาค</p> <p>4. ในกรณีที่มิเหตุสุดวิสัยหรือเหตุจำเป็นอื่นใดทำให้บริษัทจัดการไม่สามารถดำเนินการแก้ไขเพื่อให้การลงทุนเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในข้อ 1(2) หรือข้อ 2(3) หรือบริษัทจัดการมีความเห็นว่า การดำเนินการดังกล่าวจะไม่เป็นประโยชน์ต่อผู้ลงทุน บริษัทจัดการสามารถใช้ดุลยพินิจดำเนินการตามความเหมาะสมได้ โดยต้องคำนึงถึงประโยชน์ของผู้ลงทุนเป็นสำคัญ และจะส่งรายงานเกี่ยวกับการดำเนินการของบริษัทจัดการในเรื่องดังกล่าวต่อสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ผู้ถือหุ้นรายย่อย</p> | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|--|--|--|
| | <p>กองทุนมีความเสี่ยงต่อเครดิตของผู้ออกสินค้า หรือผู้ที่ต้องชำระหนี้ตามข้อผูกพันของสินค้าที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้า อ้างอิง ให้บริษัทจัดการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนสำหรับสินค้าดังกล่าวที่กำหนดไว้ในประกาศนี้ โดยถือเสมือนหนึ่งว่ากองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสินค้านั้นโดยตรง ทั้งนี้ ให้บริษัทจัดการใช้มูลค่าตามขนาดของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นมูลค่าที่ใช้ในการคำนวณ เว้นแต่ในกรณีที่ เป็นสัญญาออพชัน ให้นำมูลค่าตามขนาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าคูณกับค่าเดลต้าของสัญญาออพชันแทน</p> <p>3.14.1.19 นอกจากการคำนวณตามข้อ 3.14.1.18 แล้วให้บริษัทจัดการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนดังต่อไปนี้ด้วย</p> <p>(1) ในกรณีที่การเข้าเป็นคู่สัญญาในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นผลหรืออาจเป็นผลให้กองทุนมีความเสี่ยงต่อเครดิตของผู้ออกสินค้า หรือผู้ที่ต้องชำระหนี้ตามข้อผูกพันของสินค้าที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิง ให้บริษัทจัดการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนสำหรับสินค้าดังกล่าวที่กำหนดไว้ในประกาศนี้ โดยถือเสมือนหนึ่งว่ากองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสินค้านั้นโดยตรง ทั้งนี้ ให้บริษัทจัดการใช้มูลค่าตามขนาดของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นมูลค่าที่ใช้ในการคำนวณ เว้นแต่ในกรณีที่ เป็นสัญญาออพชัน ให้นำมูลค่าตามขนาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าคูณกับค่าเดลต้าของสัญญาออพชันแทน</p> <p>(2) ในกรณีที่กองทุนลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่อ้างอิงกับดัชนีที่ระบุไว้ในประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ว่าด้วยเรื่อง การลงทุนและการมีไว้เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุน ให้คำนวณอัตราส่วนสำหรับองค์ประกอบดังกล่าวที่กำหนดไว้ในประกาศดังกล่าว โดยถือเสมือนหนึ่งว่ากองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งองค์ประกอบนั้นโดยตรง เว้นแต่ในกรณีที่องค์ประกอบดังกล่าวเป็นหรือเกี่ยวข้องกับทองคำหรือน้ำมันดิบ</p> <p>3.14.1.20 ในการคำนวณอัตราส่วนตามข้อ 3.14.1.2 ข้อ 3.14.1.3 ข้อ 3.14.1.4 และข้อ 3.14.1.5 (1) ให้บริษัทจัดการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้ รวมทั้งเงื่อนไขตามข้อ 3.14.1.21 ด้วย</p> <p>(1) ในกรณีที่ทรัพย์สินดังกล่าวมีผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน บริษัทจัดการจะคำนวณอัตราส่วนที่ผู้ออกทรัพย์สินหรือผู้ที่เป็นคู่สัญญาดังกล่าว หรือคำนวณอัตราส่วนผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน แล้วแต่กรณี ก็</p> | <p>และผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมก่อนครบระยะเวลาที่ต้องแก้ไขให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังกล่าว ทั้งนี้ ในการจัดส่งรายงานดังกล่าวให้กับผู้ถือหน่วยลงทุน บริษัทจัดการสามารถดำเนินการโดยวิธีการเผยแพร่บนเว็บไซต์ของบริษัทจัดการแทนได้</p> <p>ส่วนที่ 6 : การลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนตามการจัดแบ่งประเภทของกองทุน</p> <p>1. ในกรณีที่กองทุนมีสัดส่วนการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนตามการจัดแบ่งประเภทของกองทุน บริษัทจัดการต้องดำเนินการดังต่อไปนี้</p> <p>(1) จัดทำรายงานเกี่ยวกับการลงทุนที่ไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน พร้อมทั้งเหตุผลที่ทำให้มีการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน และจัดส่งรายงานต่อสำนักงานรวมทั้งจัดส่งต่อผู้ดูแลผลประโยชน์ภายในวันทำการถัดจากวันที่ไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน ตลอดจนจัดเก็บสำเนารายงานไว้ที่บริษัทจัดการ</p> <p>(2) ดำเนินการแก้ไขให้สัดส่วนการลงทุนของกองทุนเป็นไปตามนโยบายการลงทุนหรือดำเนินการเปลี่ยนแปลงประเภทของกองทุน ทั้งนี้ ตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในข้อ 2</p> <p>2. ในกรณีที่การลงทุนของกองทุนรวมไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุนตามการจัดแบ่งประเภทของกองทุน ให้บริษัทจัดการดำเนินการแก้ไขสัดส่วนการลงทุนของกองทุนรวมให้เป็นไปตามนโยบายการลงทุนภายใน 90 วันนับแต่วันที่สัดส่วนการลงทุนของกองทุนรวมไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน เว้นแต่บริษัทจัดการจะได้รับมติจากผู้ถือหน่วยลงทุนให้เปลี่ยนแปลงประเภทของกองทุนรวมภายในกำหนดเวลาดังกล่าว</p> <p>ในการเปลี่ยนแปลงประเภทของกองทุนรวมตามวรรคหนึ่ง บริษัทจัดการต้องจัดให้มีวิธีการในการให้สิทธิแก่ผู้ถือหน่วยลงทุนเดิมในการที่จะออกจากกองทุนรวมก่อนที่การเปลี่ยนแปลงประเภทของกองทุนรวมจะมีผลใช้บังคับ โดยวิธีการดังกล่าวต้องมีระยะเวลาเพียงพอและเป็นธรรมต่อผู้ถือหน่วยลงทุน รวมทั้งเมื่อได้รับมติจากผู้ถือหน่วยลงทุนให้เปลี่ยนแปลงประเภทของกองทุนรวมแล้ว บริษัทจัดการต้องงดเก็บค่าธรรมเนียมการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนจากผู้ถือหน่วยลงทุนทุกรายจนกว่าการเปลี่ยนแปลงดังกล่าวจะมีผลใช้บังคับ และในกรณีที่ครบกำหนด 90 วันนับแต่วันที่สัดส่วนการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน แต่การเปลี่ยนแปลงประเภทของกองทุนรวมยังไม่มีผลใช้บังคับ บริษัทจัดการต้องไม่เสนอขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมนั้นเพิ่มเติม</p> | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|--|------------------------------|--|
| | <p>ได้</p> <p>(2) ในกรณีที่ทรัพย์สินมีบุคคลมากกว่าหนึ่งรายเป็นผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน บริษัทจัดการจะเลือก คำนวณอัตราส่วนที่ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำ ประกันรายใดรายหนึ่งก็ได้</p> <p>3.14.1.21 การคำนวณอัตราส่วนที่ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับ หลัง หรือผู้ค้ำประกันตามข้อ 3.14.1.20 จะทำได้ต่อเมื่อบุคคล ดังกล่าวได้ทำการรับรองตลอดไป รับอวัลทั้งจำนวน สลับหลัง โอนประเภทมีสิทธิไล่เบี่ยโดยไม่มีข้อกำหนดดลบล้างหรือจำกัด ความรับผิดชอบของผู้สลับหลัง หรือค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ย เต็มจำนวนแบบไม่มีเงื่อนไข</p> <p>3.14.1.22 ในกรณีที่ตราสารแห่งทุน ตราสารแห่งหนี้หรือตรา สารกึ่งหนี้กึ่งทุนในขณะที่ยังลงทุนหรือในขณะที่ได้มาเป็น ทรัพย์สินของกองทุนมีมูลค่าไม่เกินอัตราส่วนที่กำหนดใน ข้างต้น หากต่อมาตราสารดังกล่าวนั้นมีมูลค่าเกินอัตราส่วนโดย สาเหตุถูกปรับลดอันดับความน่าเชื่อถือให้บริษัทดำเนินการ แก้ไขอัตราส่วนให้เป็นไปตามที่กำหนดภายใน 30 วันนับแต่ วันที่มีการประกาศให้ทราบถึงเหตุดังกล่าว เว้นแต่ในกรณีที่มี เหตุจำเป็นและสมควรโดยได้รับผ่อนผันจากสำนักงาน คณะกรรมการ ก.ล.ด.</p> <p>3.14.1.23 ในกรณีที่ทรัพย์สินในขณะที่ยังลงทุนหรือในขณะ ที่ได้มาเป็นทรัพย์สินของกองทุน มีมูลค่าไม่เกินอัตราส่วนที่ กำหนดในข้างต้น หากต่อมามีมูลค่าเกินอัตราส่วนดังกล่าวจาก การรับชำระหนี้ด้วยทรัพย์สินอื่น บริษัทจัดการจะยังคงมีไว้ซึ่ง ทรัพย์สินดังกล่าวต่อไปก็ได้</p> <p>บริษัทจัดการจะจัดทำรายงานโดยระบุชื่อ จำนวน อัตราส่วนการ ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินตามวรรคหนึ่ง และวันที่ทรัพย์สินนั้น มีมูลค่าเกินอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดพร้อมสาเหตุ และส่ง รายงานดังกล่าวให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวม ทราบ ภายใน 3 วันทำการนับแต่วันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่าเกิน อัตราส่วนที่กำหนด พร้อมทั้งจัดทำสำเนารายงานดังกล่าวไว้ที่ บริษัทจัดการเพื่อให้สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. สามารถ ตรวจสอบได้</p> <p>3.14.1.24 ในกรณีที่การรับชำระหนี้ด้วยทรัพย์สินอื่นเป็นผลให้ กองทุนรวมเป็นผู้ถือหุ้นที่บริษัทใดเป็นผู้ออก เพื่อเป็นทรัพย์สิน ของกองทุนรวม เมื่อรวมกันทุกกองทุนรวมที่บริษัทจัดการเป็น ผู้รับผิดชอบดำเนินการเกินกว่าร้อยละ 25 ของจำนวนหุ้นที่</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|--|------------------------------|--|
| | <p>จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น บริษัทจัดการจะดำเนินการตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนดดังนี้คือ</p> <p>(1) ปฏิบัติให้เป็นไปตามประกาศที่กำหนดให้บริษัทจัดการสามารถรับชำระหนี้ด้วยทรัพย์สินอื่นได้</p> <p>(2) งดเว้นการใช้สิทธิออกเสียงในหุ้นจำนวนที่เกินอัตราส่วนการลงทนต์ดังกล่าว เว้นแต่กรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควรโดยได้รับการผ่อนผันจากสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. และ</p> <p>(3) กรณีที่เป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียน และการได้มาซึ่งหุ้นของบริษัทดังกล่าว เป็นผลให้กองทุนได้มา หรือเป็นผู้ถือหุ้นของบริษัทนั้นจนถึงหรือข้ามจุดที่ต้องทำค่าเสนอซื้อ บริษัทจัดการต้องดำเนินการเพื่อให้ได้รับการยกเว้นการทำค่าเสนอซื้อโดยการลดสัดส่วนการถือหุ้นหรือลดการมีอำนาจควบคุมหรือยื่นคำขอผ่อนผันการทำค่าเสนอซื้อ ตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการเข้าถือหลักทรัพย์เพื่อครอบงำกิจการ ทั้งนี้ การลดสัดส่วนการถือหุ้นดังกล่าว ให้บริษัทจัดการลดสัดส่วนตามสัดส่วนของหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่แต่ละกองทุนได้มาจากการรับชำระหนี้ด้วยทรัพย์สินอื่น</p> <p>3.14.1.25 ในกรณีที่กองทุนมีสิทธิในการซื้อหุ้นเพิ่มทุนของบริษัทใดตามสัดส่วนจำนวนหุ้นที่กองทุนถืออยู่ (right issue) หากการใช้สิทธินั้นจะเป็นเหตุให้กองทุนลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินของบริษัทดังกล่าวมีมูลค่าเกินอัตราส่วนที่กำหนดในข้างต้นนี้ บริษัทจัดการอาจซื้อหุ้นเพิ่มทุนนั้นโดยได้รับยกเว้นไม่ต้องปฏิบัติตามอัตราส่วนที่เกี่ยวกับเรื่องดังกล่าว ทั้งนี้ เฉพาะภายในช่วงระยะเวลา 30 วันนับแต่วันแรกของผู้ถือหุ้นหมดสิทธิของซื้อหุ้นเพิ่มทุนนั้น</p> <p>3.14.1.26 ในกรณีที่ทรัพย์สินในขณะที่ลงทุนหรือในขณะที่ได้มาเป็นทรัพย์สินของกองทุน มีมูลค่าไม่เกินอัตราส่วนที่กำหนดในข้างต้น หากต่อมามีมูลค่าเกินอัตราส่วนดังกล่าวโดยไม่เข้าลักษณะตามข้อ 3.14.1.8 ข้อ 3.14.1.13 ข้อ 3.14.1.22 ข้อ 3.14.1.23 ข้อ 3.14.1.24 และข้อ 3.14.1.25 และการเกินอัตราส่วนดังกล่าวมิได้เกิดจากการลงทุนหรือได้ทรัพย์สินมาเพิ่มเติม บริษัทจัดการจะยังคงมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังกล่าวต่อไปก็ได้</p> <p>ให้บริษัทจัดการจัดทำรายงานโดยระบุชื่อ จำนวน อัตราส่วน</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|---|------------------------------|--|
| | <p>การลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินตามวรรคหนึ่ง และวันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่าเกินอัตราส่วนที่กำหนดพร้อมสาเหตุ และส่งรายงานดังกล่าวให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมทราบภายใน 3 วันทำการนับแต่วันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่าเกินอัตราส่วนที่กำหนด พร้อมทั้งจัดทำสำเนารายงานดังกล่าวไว้ที่บริษัทจัดการเพื่อให้สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด.สามารถตรวจสอบได้</p> <p>3.14.1.27 ข้อจำกัดการลงทุนข้างต้นจะไม่นำมาบังคับใช้ในกรณีที่ปรากฏเหตุตามหัวข้อ "การเลิกโครงการจัดการกองทุนรวม" และบริษัทจัดการต้องดำเนินการเพื่อเลิกกองทุนตามหัวข้อ "การดำเนินการของบริษัทจัดการเมื่อเลิกกองทุนรวม"</p> <p>3.14.2. อัตราส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นในต่างประเทศ:</p> <p>บริษัทจัดการลงทุนหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์ หรือทรัพย์สินอื่นหรือหาดอกผลโดยวิธีอื่นเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมตามที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนดดังต่อไปนี้ เว้นแต่ในกรณีที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. หรือกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศแก้ไขเปลี่ยนแปลงอัตราส่วนการลงทุน บริษัทขอสงวนสิทธิในการพิจารณาลงทุนภายใต้แนวทางที่แก้ไขเปลี่ยนแปลงของสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ดังกล่าวได้ โดยไม่ถือว่าการดำเนินการผิดไปจากรายละเอียดโครงการแต่อย่างใด</p> <p>3.14.2.1 กองทุนมีนโยบายลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพียงกองทุนเดียวโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>3.14.2.2 บริษัทจัดการอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารภาครัฐต่างประเทศตามข้อ 3.13.2.3 (1) ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ใน 2 อันดับแรก หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสินค้าเป็นตราสารดังกล่าวเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวม โดยไม่จำกัดอัตราส่วน</p> <p>ในกรณีของกองทุนเปิด มูลค่าของตราสารภาครัฐต่างประเทศตามวรรคหนึ่ง เมื่อรวมกันแล้วต้องไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าตราสารนั้นในแต่ละรุ่น เว้นแต่เป็นกองทุนรวมเปิดที่มีการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งซื้อล่วงหน้าซึ่งระยะเวลาแน่นอน (auto redemption)</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไข | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไข | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไข |
|----------------|---|-----------------------------|---------------------------------------|
| | <p>3.14.2.3 บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งตราสารภาครัฐต่างประเทศที่นอกเหนือจากข้อ 3.14.2.2 หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสินค้าเป็นตราสารดังกล่าว เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนได้ โดยมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นเมื่อคำนวณเฉพาะรายผู้ออกหรือผู้เป็นคู่สัญญารายนั้น ไม่เกินร้อยละ 35 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>ในกรณีของกองทุนรวมเปิด มูลค่าของตราสารภาครัฐต่างประเทศดังกล่าว ต้องไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าตราสารนั้นในแต่ละรุ่น เว้นแต่เป็นกองทุนรวมเปิดที่มีการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งล่วงหน้าซึ่งระยะเวลาแน่นอน (auto redemption)</p> <p>การคำนวณอัตราส่วนตามวรรคหนึ่ง ให้นับตราสารตามวรรคหนึ่งและทรัพย์สินทุกประเภทที่ผู้ออกหรือ ผู้เป็นคู่สัญญารายดังกล่าวเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญา ซึ่งกองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินเหล่านั้นรวมในอัตราส่วนการลงทุนดังกล่าวด้วย</p> <p>3.14.2.4 บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินดังต่อไปนี้ ที่บุคคลใดเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญา เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนได้ โดยมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นเมื่อคำนวณเฉพาะผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญารายนั้น ไม่เกินร้อยละ 15 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม</p> <p>(1) ตราสารแห่งทุนต่างประเทศ ตามข้อ 3.13.2.2</p> <p>(2) ตราสารแห่งหนี้ต่างประเทศ ตามข้อ 3.13.2.3 ที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade)</p> <p>(3) สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตามข้อ 3.13.2.6 ที่คู่สัญญาที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade)</p> <p>(4) ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน เฉพาะที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade)</p> <p>3.14.2.5 บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินอื่นนอกเหนือจากกรณีที่กำหนดไว้ในข้อ 3.14.2.3 และข้อ 3.14.2.4 เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมตามอัตราส่วนดังต่อไปนี้</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|--|------------------------------|--|
| | <p>(1) การลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังกล่าวซึ่งบุคคลใดเป็นผู้ ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือ คู่สัญญา ต้องมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นเมื่อคำนวณเฉพาะผู้ ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือ คู่สัญญารายนั้น ไม่เกินร้อยละ 5 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของ กองทุน</p> <p>(2) การลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินตาม (1) เมื่อคำนวณรวม ทุกบุคคลที่เป็นผู้ ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญาแล้ว ต้องมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นไม่เกิน ร้อยละ 15 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>ความในวรรคหนึ่งมิให้นำมาใช้บังคับกับหน่วยลงทุนและ ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่จัดตั้ง ขึ้นตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535</p> <p>3.14.2.6 บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินที่กลุ่ม กิจการใดเป็นผู้ ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ ค้ำประกัน หรือคู่สัญญา เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนได้ โดย มีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นของกลุ่มกิจการนั้นไม่เกินอัตราอย่างใด อย่างหนึ่งดังต่อไปนี้ แล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า</p> <p>(1) ร้อยละ 30 ของมูลค่าทรัพย์สินของกองทุน</p> <p>(2) อัตราที่คำนวณได้จากน้ำหนักของกลุ่มกิจการดังกล่าวใน ตัวชี้วัด (benchmark) ของกองทุนนั้นรวมทั้งร้อยละ 10 ของ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนนั้น ทั้งนี้ ตัวชี้วัดดังกล่าวต้อง เป็นดัชนีหรือองค์ประกอบของดัชนี ที่มีการเผยแพร่อย่าง กว้างขวางและสอดคล้องกับนโยบายการลงทุนของกองทุนนั้น</p> <p>3.14.2.7 การลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินที่บริษัทในกลุ่มกิจการ ใดเป็นผู้ ออก ผู้ส่งจ่าย หรือคู่สัญญา เพื่อเป็นทรัพย์สินของ กองทุน หากทรัพย์สินดังกล่าวเป็นองค์ประกอบที่ใช้ในการ คำนวณตัวชี้วัด (benchmark) ของกองทุนนั้น บริษัทจัดการจะ ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินนั้นโดยมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นเมื่อ คำนวณเฉพาะผู้ ออก ผู้ส่งจ่าย หรือคู่สัญญารายนั้น ไม่เกิน ผลรวมของน้ำหนักของทรัพย์สินดังกล่าวในตัวชี้วัดและร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>ทั้งนี้ แทนอัตราส่วนที่กำหนดไว้ในข้อ 3.14.2.3 ข้อ 3.14.2.4 ข้อ 3.14.2.5 หรือข้อ 3.14.2.10 แล้วแต่กรณี ก็ได้</p> <p>บริษัทจัดการพิจารณาความเป็นกลุ่มกิจการตามข้อ 3.14.2.6</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|---|------------------------------|--|
| | <p>และข้อ 3.14.2.7 ตามงบการเงินรวมที่มีการจัดทำและเปิดเผยล่าสุด เว้นแต่ในกรณีที่ไม่มีการจัดทำงบการเงินรวม ให้พิจารณาตามสัดส่วนการถือหุ้นที่ปรากฏในบัญชีรายชื่อผู้ถือหุ้นล่าสุดที่ส่งต่อกระทรวงพาณิชย์</p> <p>3.14.2.8 บริษัทจัดการกองทุนรวมอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งเงินฝาก บัตรเงินฝาก ตัวแลกเงิน หรือตัวสัญญาใช้เงิน ที่บุคคลดังต่อไปนี้ เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย หรือคู่สัญญา เป็นจำนวนที่มีมูลค่ารวมโดยเฉลี่ยไม่เกินร้อยละ 45 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวมในรอบระยะเวลาบัญชี หรือในรอบอายุกองทุนรวมสำหรับกองทุนรวมที่มีอายุน้อยกว่าหนึ่งปี</p> <ol style="list-style-type: none"> (1) ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น (2) ธนาคารพาณิชย์ (3) บริษัทเงินทุน (4) บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ (5) บรรษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย (6) สถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น (7) ธนาคารต่างประเทศ <p>การคำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามวรรคหนึ่ง มิให้นำมูลค่าของทรัพย์สินดังต่อไปนี้ รวมในอัตราส่วนดังกล่าว</p> <ol style="list-style-type: none"> (1) เงินฝากในบัญชีเงินฝากเพื่อการดำเนินงานของกองทุนรวม (2) ทรัพย์สินที่คู่สัญญาในธุรกรรมการซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืนโอนกรรมสิทธิ์ให้แก่กองทุนรวมเพื่อดำรงมูลค่าธุรกรรมตามประกาศกำหนด <p>อัตราส่วนตามวรรคหนึ่งมิให้นำมาใช้บังคับในช่วงระยะเวลา 6 เดือนก่อนวันครบกำหนดอายุโครงการของกองทุนรวมที่มีอายุโครงการตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป</p> <p>ในกรณีที่เงินฝากหรือตราสารแห่งหนึ่งที่มีลักษณะคล้ายเงินฝากที่กองทุนรวมลงทุนในหรือมีไว้เกินอัตราส่วนที่กำหนดตามวรรคหนึ่ง ให้บริษัทจัดการกองทุนรวมลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังกล่าวให้มีมูลค่ารวมโดยเฉลี่ยไม่เกินร้อยละ 45 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวมภายใน 30 วันนับแต่วันสิ้นรอบปีบัญชีนั้น ทั้งนี้ ให้คำนวณอัตราส่วนการลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังกล่าวโดยเฉลี่ยตั้งแต่วันแรกของรอบปีบัญชีนั้น จนถึงวันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่าเป็นไปตามอัตราส่วนดังกล่าว</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|--|------------------------------|--|
| | <p>เมื่อบริษัทจัดการกองทุนรวมได้ปฏิบัติตามวรรคสี่แล้ว ให้บริษัทรายงานให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมทราบภายในวันทำการถัดจากวันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่ารวมโดยเฉลี่ยไม่เกินร้อยละ 45 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวมเพื่อให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวม ตรวจสอบการปฏิบัติดังกล่าว ทั้งนี้ บริษัทต้องดำเนินการให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมแจ้งให้สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ทราบภายใน 5 วันนับแต่วันที่ได้รับรายงานจากบริษัทด้วย</p> <p>หากบริษัทจัดการกองทุนรวมไม่สามารถปฏิบัติตามวรรคสี่ได้ สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. อาจสั่งให้บริษัทเลิกกองทุนรวมนั้น</p> <p>ทั้งนี้ อัตราส่วนดังกล่าวข้างต้นให้นับรวมการลงทุนทั้งในและต่างประเทศ</p> <p>3.14.2.9 ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควร เพื่อคุ้มครองประโยชน์ของผู้ถือหน่วยลงทุนอันเนื่องมาจากปัญหาความผันผวน (fluctuation) ของตลาดเงินและตลาดทุนในวงกว้างในรอบปีบัญชีใด บริษัทจัดการกองทุนรวมอาจขอผ่อนผันต่อสำนักงานฯ เพื่อไม่ต้องนำการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งเงินฝาก บัตรเงินฝาก ตัวแลกเงิน หรือตัวสัญญาใช้เงิน ในช่วงเวลาที่เกิดความผันผวนดังกล่าวมารวมคำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามข้อ 3.14.2.8 ได้สำหรับรอบระยะเวลาบัญชีนั้น</p> <p>3.14.2.10 บริษัทจัดการอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งเงินฝากในสถาบันการเงินต่างประเทศที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ โดยมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นเมื่อคำนวณเฉพาะสถาบันการเงินต่างประเทศรายนั้น ไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>การคำนวณอัตราส่วนตามวรรคหนึ่ง ให้นับมูลค่าของทรัพย์สินที่กองทุนลงทุนหรือมีไว้ดังต่อไปนี้ รวมในอัตราส่วนดังกล่าว</p> <p>(1) ทรัพย์สินตามข้อ 3.14.2.4 และข้อ 3.14.2.5 (1) ที่สถาบันการเงินต่างประเทศรายเดียวกันเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญา</p> <p>(2) ทรัพย์สินตามข้อ 3.14.2.4 และข้อ 3.14.2.5 (1) ที่ธนาคารพาณิชย์ซึ่งเป็นสาขาของสถาบันการเงินต่างประเทศรายนั้นเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือคู่สัญญา</p> <p>ในกรณีที่กองทุนมีเงินฝากตามวรรคหนึ่งหรือวรรคสอง โดยมี</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|---|------------------------------|--|
| | <p>วัตถุประสงค์เพื่อการดำเนินงานของกองทุน มิให้นำมูลค่าของเงินฝากดังกล่าวรวมในอัตราส่วนตามวรรคหนึ่ง</p> <p>3.14.2.11 บริษัทจัดการอาจทำธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืนในนามกองทุนได้ โดยมีมูลค่าธุรกรรมรวมกันทั้งสิ้นไม่เกินร้อยละ 25 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน</p> <p>3.14.2.12 การลงทุนหรือมีไว้ซึ่งธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน ให้บริษัทจัดการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามข้อ 3.14.2.4 ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ประกาศกำหนด</p> <p>3.14.2.13 ในการคำนวณอัตราส่วนตามข้อ 3.14.2.3 ข้อ 3.14.2.4 ข้อ 3.14.2.5 และข้อ 3.14.2.10 ให้บริษัทจัดการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้ รวมทั้งเงื่อนไขตามข้อ 3.14.2.14 ด้วย</p> <p>(1) ในกรณีที่ทรัพย์สินดังกล่าวมีผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน บริษัทจัดการจะคำนวณอัตราส่วนที่ผู้ออกทรัพย์สินหรือผู้ที่เป็นผู้สัญญาดังกล่าวหรือคำนวณอัตราส่วนผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน แล้วแต่กรณี ก็ได้</p> <p>(2) ในกรณีที่ทรัพย์สินมีบุคคลมากกว่าหนึ่งรายเป็นผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน บริษัทจัดการจะเลือกคำนวณอัตราส่วนที่ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกันรายใดรายหนึ่งก็ได้</p> <p>3.14.2.14 การคำนวณอัตราส่วนที่ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกันตามข้อ 3.14.2.13 จะทำได้ต่อเมื่อบุคคลดังกล่าวได้ทำการรับรองตลอดไป รับอวัลทั้งจำนวน สลับหลังโอนประเภทมีสิทธิไล่เบี้ยโดยไม่มีข้อกำหนดดลบล้างหรือจำกัดความรับผิดชอบของผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนแบบไม่มีเงื่อนไข</p> <p>3.14.2.15 บริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อล่วงหน้าที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการลดความเสี่ยง (Hedging) เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนได้ โดยไม่เกินมูลค่าความเสี่ยงทั้งหมดที่กองทุนมีอยู่</p> <p>3.14.2.16 ในกรณีที่กองทุนเข้าเป็นผู้สัญญาในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยมิได้มีวัตถุประสงค์เพื่อการลดความเสี่ยง (hedging) ให้บริษัทจัดการดำเนินการให้มีการกันหรือแยกทรัพย์สินของกองทุนที่มีคุณภาพซึ่งมีสภาพคล่องในจำนวนที่</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|---|------------------------------|--|
| | <p>เพียงพอต่อมูลค่าสุทธิที่กองทุนอาจมีภาระต้องชำระหนี้หรือชำระค่าสินค้าเมื่อสิ้นสุดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (fully covered) ไร้อัตราดอกเบี้ยที่ได้อิงต้นทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญานั้น ทั้งนี้ ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. กำหนด</p> <p>3.14.2.17 การคำนวณมูลค่าการลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามข้อ 3.14.2.2 ข้อ 3.14.2.3 และข้อ 3.14.2.4 และข้อ 3.14.2.5 (1) ให้นำมูลค่าที่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง มีหน้าที่ต้องชำระตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า รวมคำนวณในอัตราส่วนของบุคคลที่เป็นคู่สัญญาดังกล่าว เว้นแต่กรณีที่กองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญานั้นในศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า บริษัทจัดการไม่ต้องคำนวณมูลค่าและอัตราส่วนตามที่กำหนดในข้อดังกล่าว</p> <p>3.14.2.18 นอกจากการคำนวณตามข้อ 3.14.2.17 แล้ว ให้บริษัทจัดการคำนวณอัตราส่วนการลงทุน ในกรณีที่การเข้าเป็นคู่สัญญาในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นผลหรืออาจเป็นผลให้กองทุนมีความเสี่ยงต่อเครดิตของผู้ออกสินค้า หรือผู้ที่ต้องชำระหนี้ตามข้อผูกพันของสินค้าที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้า อ้างอิง ให้บริษัทจัดการคำนวณอัตราส่วนการลงทุนสำหรับสินค้านี้ที่กำหนดไว้ในประกาศนี้ โดยถือเสมือนหนึ่งว่ากองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสินค้านั้นโดยตรง ทั้งนี้ ให้บริษัทจัดการใช้มูลค่าตามขนาดของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นมูลค่าที่ใช้ในการคำนวณ เว้นแต่ในกรณีที่สัญญาออกป้อน ให้นำมูลค่าตามขนาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าคูณกับค่าเฉลี่ยของสัญญาออกป้อนแทน</p> <p>3.14.2.19 ในกรณีที่ตราสารแห่งทุน ตราสารแห่งนี้หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ในขณะที่ลงทุนหรือในขณะที่ได้มาเป็นทรัพย์สินของกองทุนมีมูลค่าไม่เกินอัตราส่วนที่กำหนดในข้างต้น หากต่อมาตราสารดังกล่าวมีมูลค่าเกินอัตราส่วน เนื่องจากมีคุณสมบัติไม่ตรงตามประกาศ บริษัทจัดการจะดำเนินการแก้ไขอัตราส่วนให้เป็นไปตามที่กำหนดภายใน 30 วันนับแต่วันที่มีการประกาศให้ทราบถึงเหตุดังกล่าว เว้นแต่ในกรณีที่มิได้แจ้งว่าเป็นและสมควรโดยได้รับพยานจากสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด.</p> <p>3.14.2.20 ในกรณีที่ทรัพย์สินในขณะที่ลงทุนหรือในขณะที่ได้มาเป็นทรัพย์สินของกองทุน มีมูลค่าไม่เกินอัตราส่วนที่กำหนดในข้างต้น หากต่อมามีมูลค่าเกินอัตราส่วนดังกล่าวจาก</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|--|------------------------------|--|
| | <p>การรับชำระหนี้ด้วยทรัพย์สินอื่น บริษัทจัดการจะยังคงมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังกล่าวต่อไปก็ได้</p> <p>ให้บริษัทจัดการจัดทำรายงานโดยระบุชื่อ จำนวน อัตราส่วน การลงทุน หรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินตามวรรคหนึ่ง และวันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่าเกินอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดพร้อมสาเหตุ และส่งรายงานดังกล่าวให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวม ทราบภายในสามวันทำการนับแต่วันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่าเกินอัตราส่วนที่กำหนด พร้อมทั้งจัดทำสำเนารายงานดังกล่าวไว้ที่บริษัทจัดการเพื่อให้สำนักงานสามารถตรวจสอบได้</p> <p>3.14.2.21 ในกรณีการรับชำระหนี้ด้วยทรัพย์สินอื่นเป็นผลให้กองทุนรวมเป็นผู้ถือหุ้นที่บริษัทใดเป็นผู้ออก เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวม เมื่อรวมกันทุกกองทุนรวมที่บริษัทจัดการเป็นผู้รับผิดชอบดำเนินการเกินกว่าร้อยละ 25 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น บริษัทจัดการจะดำเนินการดังนี้ คือ</p> <p>(1) ปฏิบัติให้เป็นไปตามประกาศที่กำหนดให้บริษัทจัดการสามารถรับชำระหนี้ด้วยทรัพย์สินอื่นได้</p> <p>(2) งดเว้นการใช้สิทธิออกเสียงในหุ้นจำนวนที่เกินอัตราส่วนการลงทุนดังกล่าว เว้นแต่กรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควรโดยได้รับการผ่อนผันจากสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด และ</p> <p>(3) กรณีที่เป็นหุ้นของบริษัทจดทะเบียน และการได้มาซึ่งหุ้นของบริษัทดังกล่าว เป็นผลให้กองทุนได้มาหรือเป็นผู้ถือหุ้นของบริษัทนั้นจนถึงหรือข้ามจุดที่ต้องทำข้อเสนอซื้อ บริษัทจัดการต้องดำเนินการเพื่อให้ได้รับการยกเว้นการทำข้อเสนอซื้อโดยการลดสัดส่วนการถือหุ้นหรือลดการมีอำนาจควบคุมหรือยื่นคำขอผ่อนผันการทำข้อเสนอซื้อ ตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการเข้าถือหลักทรัพย์เพื่อครอบงำกิจการ ทั้งนี้ การลดสัดส่วนการถือหุ้นดังกล่าว ให้บริษัทจัดการลดสัดส่วนตามสัดส่วนของหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่แต่ละกองทุนได้มาจากการรับชำระหนี้ด้วยทรัพย์สินอื่น</p> <p>3.14.2.22 ในกรณีที่ทรัพย์สินในขณะลงทุนหรือในขณะที่ได้มาเป็นทรัพย์สินของกองทุน มีมูลค่าไม่เกินอัตราส่วนที่กำหนดในช่วงต้น หากต่อมามีมูลค่าเกินอัตราส่วนดังกล่าวโดยไม่เข้าลักษณะตามข้อ 3.14.2.19 ข้อ 3.14.2.20 และข้อ</p> | | |

| เรื่องที่แก้ไขฯ | รายละเอียดโครงการเดิม | รายละเอียดโครงการที่ขอแก้ไขฯ | หมายเหตุ: วัตถุประสงค์การ แก้ไขฯ |
|-----------------|---|------------------------------|--|
| | <p>3.14.2.21 และการเกินอัตราส่วนดังกล่าวมิได้เกิดจากการลงทุนหรือได้ทรัพย์สินมาเพิ่มเติม บริษัทจัดการจะยังคงมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังกล่าวต่อไปก็ได้</p> <p>ให้บริษัทจัดการจัดทำรายงานโดยระบุชื่อ จำนวน อัตราส่วนการลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินตามวรรคหนึ่ง และวันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่าเกินอัตราส่วนที่กำหนดพร้อมสาเหตุ และส่งรายงานดังกล่าวให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมทราบภายในสามวันทำการนับแต่วันที่ทรัพย์สินนั้นมีมูลค่าเกินอัตราส่วนที่กำหนด พร้อมทั้งจัดทำสำเนารายงานดังกล่าวไว้ที่บริษัทจัดการเพื่อให้สำนักงานสามารถตรวจสอบได้</p> <p>3.14.2.23 ข้อจำกัดการลงทุนข้างต้นจะไม่นำมาบังคับใช้ในกรณีที่ปรากฏเหตุตามหัวข้อ "การเลิกโครงการจัดการกองทุนรวม" และบริษัทจัดการต้องดำเนินการเพื่อเลิกกองทุนตามหัวข้อ "การดำเนินการของบริษัทจัดการเมื่อเลิกกองทุนรวม"</p> | | |