-ร่าง-

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทน. /๒๕๖๙

เรื่อง การลงทุนของกองทุน

(ฉบับที่)

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

ข้อ ๑ ให้ยกเลิกความใน (ข/๑) ของ (๑) ในวรรคหนึ่งของข้อ ๙ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. ๘๗/๒๕๕๘ เรื่อง การลงทุนของกองทุน ลงวันที่ ๑๗ ธันวาคม พ.ศ. ๒๕๕๘ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. ๙/๒๕๖๘ เรื่อง การลงทุนของกองทุน (ฉบับที่ ๓๐) ลงวันที่ ๒๘ กุมภาพันธ์ พ.ศ. ๒๕๖๘ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“(ข/๑) กรณีเป็นกองทุนรวมตาม (ก) หรือ (ข) จะลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ หรือหน่วยของกองทุนต่างประเทศที่มีลักษณะในทำนองเดียวกันที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management) ให้กระทำได้ต่อเมื่อได้กำหนดนโยบายการลงทุนของกองทุนรวมไว้ในโครงการว่าบริษัทจัดการกองทุนรวมสามารถลงทุนในทรัพย์สินดังกล่าวเพื่อเป็นเครื่องมือในการบริหารจัดการลงทุนของกองทุนรวม (portfolio management)

กรณีกองทุนรวมตามวรรคหนึ่งเป็นกองทุนรวมฟีดเดอร์หรือกองทุนรวมหน่วยลงทุน ให้ดำเนินการเพิ่มเติมดังนี้

๑. กรณีเป็นกองทุนรวมอีทีเอฟ ห้ามกำหนดนโยบายการลงทุนที่มุ่งเน้นลงทุนในหน่วยของกองทุนต่างประเทศที่มีลักษณะในทำนองเดียวกับกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนดังกล่าวใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management)

๒. กรณีไม่เป็นกองทุนรวมอีทีเอฟ ห้ามกำหนดนโยบายการลงทุนที่มุ่งเน้นลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟหรือหน่วยของกองทุนต่างประเทศที่มีลักษณะในทำนองเดียวกันที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนดังกล่าวใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management)”

ข้อ ๒ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่

(นางพรอนงค์ บุษราตระกูล)
เลขาธิการ
สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ประธานกรรมการ
คณะกรรมการกำกับตลาดทุน