

ผลการรับฟังความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้อง (hearing) เรื่อง ร่างประกาศการปรับปรุงหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการดำรงเงินกองทุน (on-going capital requirement) ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน (บลจ.) และบริษัทหลักทรัพย์นายหน้าซื้อขายหน่วยลงทุน (บลน.) และแนวทางดำเนินการเมื่อไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ตามที่ประกาศกำหนด

1. การรับฟังความคิดเห็น จำนวน 1 ครั้ง
2. เมื่อวันที่ 18 ตุลาคม - 17 พฤศจิกายน 2560
3. ผู้จัดส่งความคิดเห็น จำนวน 8 ราย จำนวนผู้เข้าชม 32 คน
4. ประเด็นสำคัญ : ผู้แสดงความคิดเห็นส่วนใหญ่เห็นด้วย โดยมีประเด็นเสนอแนะเพิ่มเติม ดังนี้

4.1 การรายงานข้อมูลฐานะการเงินตามแบบรายงานการดำรงเงินกองทุนเป็นประจำทุกเดือน

ผู้แสดงความคิดเห็นเสนอให้เปลี่ยนการกำหนดให้ดำรงความเพียงพอของเงินกองทุน จากทุกวันทำการสุดท้ายของเดือน เป็น กำหนดให้ดำรงความเพียงพอของเงินกองทุนทุกวันสุดท้ายของเดือน เนื่องจากงบการเงินจะเกิดขึ้น ณ สิ้นเดือนของทุกเดือน

ความเห็นสำนักงาน

สำนักงานขอเรียนว่า การกำหนดให้เป็นวันทำการสุดท้ายของเดือนเป็นข้อกำหนดมาตรฐานในการดำรงเงินกองทุนเช่นเดียวกับผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทอื่น และผู้ประกอบการธุรกิจส่วนใหญ่เห็นว่าเหมาะสมแล้ว สำนักงานจึงเห็นควรคงหลักการตามที่เสนอ

4.2 การรายงานมูลค่าความเสียหายที่เกิดจาก operational risk

ผู้แสดงความคิดเห็นเห็นว่า การกำหนดให้มูลค่าความเสียหายหมายถึงความเสียหายที่เกิดจาก opportunity loss ด้วย จะเป็นการเปิดให้ผู้ประกอบการธุรกิจสามารถใช้ดุลพินิจ ทำให้ไม่สามารถเปรียบเทียบข้อมูลระหว่างผู้ประกอบการธุรกิจได้ โดยเสนอให้สำนักงานกำหนดสูตรให้ชัดเจน

ความเห็นสำนักงาน

เนื่องจากการประเมินมูลค่า opportunity loss เป็นการประเมินความเสียหายอันเนื่องมาจากการประกอบการธุรกิจของแต่ละผู้ประกอบการธุรกิจซึ่งมีความแตกต่างกัน จึงไม่สามารถกำหนดเป็นสูตรตายตัวได้

ขอขอบคุณผู้เข้าร่วมแสดงความคิดเห็นตามรายชื่อดังต่อไปนี้

- (1) บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด
- (2) บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด
- (3) บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทหารไทย จำกัด
- (4) บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน แคปปิตอล ลีจิ้ง จำกัด
- (5) บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ยูโอบี (ประเทศไทย) จำกัด
- (6) บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ทิสโก้ จำกัด
- (7) บริษัทหลักทรัพย์นายหน้าซื้อขายหน่วยลงทุน เว็ลธ์ เมจิก จำกัด
- (8) บริษัทหลักทรัพย์นายหน้าซื้อขายหน่วยลงทุน เซ็นทรัล เวลธ์ โซลูชั่น จำกัด