

ผลการรับฟังความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้อง (hearing) เกี่ยวกับ การผ่อนคลายให้กองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุน AI (“AI Fund”) สามารถลงทุนใน derivatives ได้โดยไม่จำกัดอัตราส่วนการลงทุน

1. การรับฟังความคิดเห็น จำนวน 1 ครั้ง
2. เมื่อวันที่ 8 เมษายน 2557 – 30 เมษายน 2557
3. ผู้จัดส่งความคิดเห็น รวม 8 ราย โดยเป็นบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม 7 ราย และบุคคลทั่วไป 1 ราย

4. ประเด็นสำคัญ

ตามที่สำนักงานมีแนวคิดที่จะผ่อนคลายให้กองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุน AI (“AI Fund”) สามารถลงทุนใน derivatives ได้โดยไม่จำกัดอัตราส่วนการลงทุนนั้น มีประเด็นสำคัญที่เกี่ยวข้องกับการปรับปรุงหลักเกณฑ์ในครั้งนี้นี้ที่สำนักงานเห็นด้วยและไม่เห็นด้วยกับผู้ให้ความเห็น ดังนี้

4.1 ประเด็นที่มีการแก้ไขหรือเพิ่มเติมจากการรับฟังความคิดเห็น

I. ข้อกำหนดเพิ่มเติมที่ต้องดำเนินการเพื่อรองรับการผ่อนคลายหลักเกณฑ์ดังกล่าว

(1) ควรกำหนดให้มีการอธิบายกลยุทธ์หรือเหตุผลในการลงทุนใน derivatives สำหรับรอบปีที่ผ่านมารายงานประจำปีด้วย เพื่อช่วยให้ผู้ถือหุ้นสามารถประเมินผลตอบแทนและความเสี่ยงของกลยุทธ์การลงทุนใน derivatives ของกองทุนได้อย่างมีประสิทธิภาพมากขึ้น

การแก้ไข/เพิ่มเติม สำนักงานจะพิจารณาแก้ไขร่างหลักเกณฑ์ให้ บลจ. ต้องเปิดเผยเป็นอย่างน้อยในรายงานประจำปีข้อมูลดังต่อไปนี้ (1) maximum limit ที่กำหนดไว้ (2) exposure ที่มีอยู่จริง และ (3) การวิเคราะห์และคำอธิบายผลตอบแทนที่กองทุนได้รับจากกลยุทธ์หรือการลงทุนใน derivatives สำหรับปีที่ผ่านมา

4.2 ประเด็นที่สำนักงานไม่เห็นด้วยกับผู้ให้ความเห็น จึงไม่ได้แก้ไขเพิ่มเติม

I. ข้อกำหนดเพิ่มเติมที่ต้องดำเนินการเพื่อรองรับการผ่อนคลายหลักเกณฑ์ดังกล่าว

-- ไม่มี --