



A Prudential plc company 

ประกาศบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ইসต์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด

เรื่อง แจ้งผลการอนุมัติ เพื่อแก้ไขโครงการจัดการกองทุน และรายละเอียดต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้อง ของ กองทุนเปิดรสนชาติ Prime Plus ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

ตามที่ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ইসต์สปริง (ประเทศไทย) จำกัด (บริษัทจัดการ) ได้ส่งหนังสือเพื่ออนุมัติ (ครั้งที่ 2) ไปยังผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนเพื่อแก้ไขโครงการ และรายละเอียดต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้อง โดยปิดรับมติเมื่อวันที่ 23 กรกฎาคม 2567 ที่ผ่านมานั้น

บริษัทจัดการ ได้ตรวจนับมติเสร็จสิ้นเป็นที่เรียบร้อยแล้ว โดยได้รับมติเห็นชอบ คิดเป็นร้อยละ 99.73 ของจำนวนหน่วยลงทุนทั้งหมดของผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนที่แจ้งมติดกลับมาและมีสิทธิออกเสียงลงคะแนน ซึ่งการอนุมัติในครั้งนี้ต้องได้รับความเห็นชอบ เกิน 3 ใน 4 (ร้อยละ 75)

ทั้งนี้ บริษัทจัดการขอเรียนให้ท่านผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนทราบว่า กองทุนรวมดังกล่าวจะมีการแก้ไขโครงการโดยเปลี่ยนแปลงลักษณะโครงการ เป็นกองทุนเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป เปลี่ยนชื่อกองทุน เป็น กองทุนเปิดอีสต์สปริง HealthPlus (ES-HEALTHPLUS) รวมถึงแก้ไขรายละเอียดต่าง ๆ โดยท่านสามารถพิจารณารายละเอียดการแก้ไขเพิ่มเติมดังกล่าวได้ตามตารางที่แนบท้ายประกาศฉบับนี้

อนึ่ง บริษัทจัดการได้แจ้งการแก้ไขเพิ่มเติมโครงการจัดการกองทุน และรายละเอียดต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้อง ตามมติที่ได้รับจากผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน ไปยังสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต.) แล้วเมื่อวันที่ 1 สิงหาคม 2567 ดังนั้น บริษัทจัดการจะดำเนินการแก้ไขโครงการ และรายละเอียดต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้อง โดยให้มีผลตั้งแต่วันที่ 16 กันยายน 2567 เป็นต้นไป

หากต้องการสอบถามข้อมูลเพิ่มเติม กรุณาติดต่อศูนย์ที่ปรึกษาการลงทุน โทร.1725 ในวันทำการ เวลา 8.30 - 17.00 น.

ประกาศ ณ วันที่ 2 สิงหาคม 2567

ทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทนและความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน

ตารางเปรียบเทียบหัวข้อเรื่องและรายละเอียดที่จะรวมตี
เพื่อแก้ไขโครงการจัดการกองทุน และรายละเอียดต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้อง ของ กองทุนเปิดคนชาติ Prime Plus ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย

ส่วนโครงการกองทุนรวม

หัวข้อเรื่อง	ปัจจุบัน	รายละเอียดที่จะรวมตีแก้ไขใหม่	หมายเหตุ
ชื่อโครงการจัดการ (ไทย)	กองทุนเปิดคนชาติ Prime Plus ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย	กองทุนเปิดอีสท์สปริง HealthPlus	สอดคล้องกับการรวมตีเพื่อแก้ไขโครงการจัดการกองทุนจากกองทุนรวมที่เสนอขายผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อยและผู้มีเงินลงทุนสูง ให้เป็นกองทุนเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป
ชื่อโครงการจัดการ (อังกฤษ)	Thanachart Prime Plus Fund Not for Retail Investors	Eastspring HealthPlus Fund	
ชื่อย่อโครงการ	T-PrimePlusAI	ES-HEALTHPLUS	
ลักษณะโครงการ	กองทุนรวมที่เสนอขายผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อยและผู้มีเงินลงทุนสูง	กองทุนเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป	
ทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้	ระบุรายละเอียดทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ <ul style="list-style-type: none"> • ประเภทของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น หรือการขาดโอกาสโดยวิธีอื่นที่จะลงทุนในประเทศ: ส่วนที่ 1 : ประเภทและคุณสมบัติของตราสารทางการเงินทั่วไป <ol style="list-style-type: none"> 1. ประเภทของตราสาร ได้แก่ <ol style="list-style-type: none"> 1.1 ตราสารทุน <ol style="list-style-type: none"> 1.1.1 หุ้น 1.1.2 ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น (share warrants) 1.1.3 ใบแสดงสิทธิในการซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้ (Transferable Subscription Right: TRS) 1.1.4 ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่มี underlying เป็นหุ้นหรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น (share warrants) 1.1.5 ตราสารทุนอื่นที่มีลักษณะทำนองเดียวกับตราสารทุนตามข้อ 1.1.1 – 1.1.4 ตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด 1.2 ตราสารหนี้ <ol style="list-style-type: none"> 1.2.1 พันธบัตร 1.2.2 ตั๋วเงินคลัง 1.2.3 หุ้นกู้ (ไม่รวมหุ้นกู้แปลงสภาพ หุ้นกนูพันธบัตร และตราสาร Basel III) 1.2.4 ตั๋วแลกเงิน 1.2.5 ตั๋วสัญญาใช้เงิน 1.2.6 ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้ 1.2.7 ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่มี underlying เป็นพันธบัตรหรือหุ้นกู้ 	<p>ไม่มีระบุหัวข้อ ทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ ในโครงการ</p> <p>กำหนดหลักทรัพย์ที่กองทุนไม่สามารถลงทุนได้ ดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. ทรัพย์สินประเภทหน่วย private equity 2. ทรัพย์สินประเภททองคำแท่ง (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนเพื่อกองทุนรวมทองคำ) <p>ทั้งนี้ การระบุว่ากองทุนจะไม่สามารถลงทุนในหลักทรัพย์ตามข้อ 1 และ 2 ดังกล่าวข้างต้น นั้น กองทุนจะระบุไว้ที่หัวข้อ นโยบายการลงทุน ของโครงการฉบับใหม่</p>	<ul style="list-style-type: none"> - เป็นไปตามรูปแบบใหม่ของระบบบริหารจัดการกองทุนรวมของ ก.ล.ต. (MF on Cloud) ซึ่งไม่มีระบุหัวข้อเรื่องทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ - ไม่เปลี่ยนแปลง เป็นไปตามข้อจำกัดการลงทุนเดิมของกองทุน <p>ดังนั้น นอกเหนือจากหลักทรัพย์ตามข้อ 1 และ 2 ดังกล่าว รายละเอียดทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้จะเป็นไปตาม ภาคผนวก 3 [แบบท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ กน. 87/2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติม โดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ กน. 42/2566 (ฉบับที่ 26)]</p>

หัวข้อเรื่อง	ปัจจุบัน	รายละเอียดที่จะขอแก้ไขใหม่	หมายเหตุ
	<p>1.2.8 ตราสารหนี้อื่นที่มีลักษณะกำหนดเดียวกับตราสารหนี้ตามข้อ 1.2.1 - 1.2.7 ตามที่สำนักงานกำหนดเพิ่มเติม</p> <p>1.3 ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน (ไม่รวมตราสาร Basel III)</p> <p>1.4 ตราสาร Basel III</p> <p>1.5 ศุภก</p> <p>1.6 ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants)</p> <p>1.7 ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note)</p> <p>2. คุณสมบัติของตราสารและหลักเกณฑ์ในการลงทุน</p> <p>ทรัพย์สินที่ บลจ. จะสามารถลงทุนได้ตาม 1. ต้องมีคุณสมบัติของตราสารตามหลักเกณฑ์ที่ครบถ้วน ดังนี้</p> <p>2.1 ไม่มีข้อกำหนดหรือเงื่อนไขที่ทำให้ผู้ลงทุนมีการระงับมากกว่ามูลค่าเงินลงทุนในตราสาร</p> <p>2.2 สามารถเปลี่ยนมือได้ (รวมถึงกรณีที่เป็น ตัวแลกเปลี่ยน หรือตัวสัญญาใช้เงิน หรือตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง ที่มีเงื่อนไขห้ามเปลี่ยนมือแต่ลงทุนได้ดำเนินการให้มีการรับโอนสิทธิเรียกร้องในตราสารได้ตามวิธีการที่กฎหมายกำหนด หรือมีเงื่อนไขให้กองทุนสามารถขายคืนผู้ออกตราสารได้)</p> <p>2.3 มีข้อมูลเกี่ยวกับตราสารที่ บลจ. สามารถเข้าถึงได้เพื่อนำมาประกอบการพิจารณาตัดสินใจลงทุนได้อย่างสม่ำเสมอ และมีข้อมูลราคาที่เกี่ยวข้องมูลค่ายุติธรรม โดยข้อมูลดังกล่าวต้องอ้างอิงจากแหล่งข้อมูลที่เชื่อถือได้ซึ่งจัดทำตามหลักวิชาการอันเป็นที่ยอมรับในระดับสากล</p> <p>2.4 ในกรณีที่เป็นการลงทุนในตัวแลกเปลี่ยน หรือตัวสัญญาใช้เงิน ที่ออกตราสารดังกล่าวเพื่อชำระหนี้การค้าตัวแลกเปลี่ยน หรือตัวสัญญาใช้เงิน ดังกล่าวต้องมีการรับอาวัลหรือรับรองโดยบุคคลดังนี้</p> <p>2.4.1 สป. บง. หรือ บค. ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน</p> <p>2.4.2 ธนาคารออมสิน</p> <p>2.4.3 ธนาคารอาคารสงเคราะห์</p> <p>2.4.4 ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร</p> <p>2.4.5 ธนาคารพัฒนาวิสาหกิจขนาดกลางและขนาดย่อมแห่งประเทศไทย</p> <p>2.4.6 ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย</p> <p>2.4.7 ธนาคารอิสลามแห่งประเทศไทย</p> <p>2.4.8 สถาบันการเงินต่างประเทศที่มีลักษณะกำหนดเดียวกับผู้รับฝากตาม 2.4.1 - 2.4.7</p> <p>ทั้งนี้ การอาวัลหรือการรับรองดังกล่าวต้องเป็นการอาวัลหรือการรับรองผู้สั่งจ่าย หรือผู้ออกตัว กึ่งจำนวนรวมถึงดอกเบี้ย (ถ้ามี) ตามที่ระบุไว้ในตัวแลกเปลี่ยน หรือตัวสัญญาใช้เงินด้วย</p>		<p>โดยมีรายละเอียดตามสิ่งที่ส่งมาด้วย 2</p>

หัวข้อเรื่อง	ปัจจุบัน	รายละเอียดที่จะขอแก้ไขใหม่	หมายเหตุ
	<p>ส่วนที่ 2 ถึง ส่วนที่ 6 เป็นไปตามประกาศ</p> <p>ส่วนที่ 2: ทรัพย์สินประเภทหน่วย CIS หน่วย infra และหน่วย property</p> <p>ส่วนที่ 3 : ทรัพย์สินประเภทเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก</p> <p>ส่วนที่ 4 : ธุรกิจประเภทการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (reverse repo)</p> <p>ส่วนที่ 5 : ธุรกิจประเภทการให้ยืมหลักทรัพย์ (securities lending)</p> <p>ส่วนที่ 6 : ธุรกิจประเภทสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (derivatives)</p> <p>• ประเภทของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น หรือการหาผลตอบแทนโดยวิธีอื่นที่จะลงทุน</p> <p>ในต่างประเทศ : ไม่มี</p>		
<p>อัตราส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวม</p>	<p>อัตราส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมในประเทศและต่างประเทศ : เป็นไปตามประกาศ และกรณีที่มีการลงทุนไม่เป็นไปตามข้อนี้จะดำเนินการให้เป็นไปตามที่ประกาศกำหนด</p> <p>เนื่องจากปัจจุบันเป็นกองทุนรวมที่เสนอขายผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อยและผู้มีเงินลงทุนสูง ดังนั้น อัตราส่วนการลงทุนของกองทุนรวม จึงเป็นไปตามภาคผนวก 4-AI [แบบท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ กน. 87/2558 และประกาศที่มีการแก้ไขเพิ่มเติม]</p>	<p>อัตราส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมในประเทศและต่างประเทศ : เป็นไปตามประกาศ และกรณีที่มีการลงทุนไม่เป็นไปตามข้อนี้จะดำเนินการให้เป็นไปตามที่ประกาศกำหนด</p> <p>แก้ไขเป็นกองทุนเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป ดังนั้น อัตราส่วนการลงทุนของกองทุนรวม จึงเป็นไปตามภาคผนวก 4-retail MF [แบบท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ กน. 87/2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ กน. 21/2566 (ฉบับที่ 23)]</p>	<p>เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงลักษณะโครงการกองทุน เป็น กองทุนเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป (จากเดิมเป็นกองทุนรวมที่เสนอขายผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อยและผู้มีเงินลงทุนสูง)</p> <p><u>โดยท่านสามารถพิจารณาเปรียบเทียบอัตราส่วนการลงทุน ได้ที่ส่วนข้อมูลกองทุนรวม หัวข้อเรื่อง “ตารางสรุปอัตราส่วนการลงทุนของกองทุนรวม”</u></p>
<p>ระยะเวลาในการรับซื้อคืน</p>	<p>ทุก 5 วันทำการแรกของเดือนมกราคม เมษายน กรกฎาคม และตุลาคม โดยการลงทุนแต่ละครั้ง ผู้ถือหน่วยลงทุนต้องมีระยะเวลาการถือครองหน่วยลงทุนไม่น้อยกว่า 1 ปี</p>	<p>ทุกวันที่ 1 ถึง วันที่ 5 ของเดือน ทั้งนี้ หากวันที่ 5 ของเดือนเป็นวันหยุดทำการให้เลื่อนออกเป็นวันทำการถัดไป</p>	<p>ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถทำรายการขายคืน/สับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกได้ทุกเดือนจากเดิมทำรายการได้ทุกไตรมาส และยกเลิกระยะเวลาการถือครองหน่วยลงทุน ซึ่งจะเป็นการเพิ่มความคล่องตัวของเงินลงทุนของกองทุน</p>

ส่วนข้อมูลกองทุนรวม

หัวข้อเรื่อง	รายละเอียด		หมายเหตุ	
มูลค่าขั้นต่ำในการซื้อครั้งแรก	เดิม : 500,000 บาท	ใหม่ : 50,000 บาท	จำนวนเงินขั้นต่ำที่น้อยลง ซึ่งจะเป็นการเพิ่มความคล่องตัวของเงินลงทุน	
การเสนอขายหน่วยลงทุน	เดิม : ทุก 5 วันทำการแรกของเดือนมกราคม เมษายน กรกฎาคม และ ตุลาคม ระหว่างเวลาเริ่มทำการถึง 15:30 น. โดยการลงทุนแต่ละครั้ง ผู้ถือหน่วยลงทุนต้องมีระยะเวลาการถือครองหน่วยลงทุนไม่น้อยกว่า 1 ปี	ใหม่ : ทุกวันทำการ ระหว่างเวลาเริ่มทำการถึง 15:30 น.	ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถทำรายการลงทุนได้ทุกวันทำการ และยกเลิกระยะเวลาการถือครองหน่วยลงทุน ซึ่งจะเป็นการเพิ่มความคล่องตัวของเงินลงทุน	
ตารางสรุปอัตราส่วนการลงทุนของกองทุนรวม	ส่วนที่ 1 : อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สินหรือคู่สัญญา (single entity limit)		เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงลักษณะโครงการกองทุนเป็น กองทุนเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป (จากเดิมเป็นกองทุนรวมที่เสนอขายผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อยและผู้มีเงินลงทุนสูง)	
ข้อ	ประเภททรัพย์สิน	อัตราส่วน (% ของ NAV)		
		ปัจจุบัน (กรณีเสนอขายต่อผู้มีเงินลงทุนสูง)		แก้ไขใหม่ (กรณีเสนอขายต่อผู้ลงทุนทั่วไป)
1	ตราสารภาครัฐไทย	ไม่จำกัดอัตราส่วน	ไม่จำกัดอัตราส่วน	
2	หน่วย CIS มีคุณสมบัติและหลักเกณฑ์ในการลงทุนดังนี้ 2.1 มีคุณสมบัติและเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการลงทุน เช่นเดียวกับข้อกำหนดสำหรับตราสารทางการเงินทั่วไป 2.2 ในกรณีที่กองทุนไปลงทุนในหน่วย CIS ของ MF โดย MF ดังกล่าวต้องมีนโยบายการลงทุนดังนี้ (ไม่ใช้กับการลงทุนในหน่วย CIS ของกองทุนรวมทองคำที่ลงทุนในทองคำแท่ง) 2.3 มีการลงทุนในทรัพย์สินซึ่งเป็นประเภทและชนิดเดียวกับที่กองทุนสามารถลงทุนได้ 2.4 มีการลงทุนในทรัพย์สินเมื่อใช้วิธีคำนวณตามสัดส่วน (pro rata) แล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ single entity limit ของกองทุนนั้น 2.5 มีการลงทุนในทรัพย์สินเมื่อใช้วิธีคำนวณตามสัดส่วน (pro rata) แล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ product limit สำหรับทรัพย์สินที่เป็น SIP ของกองทุนนั้น 2.6 มีการลงทุนใน derivatives ที่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ global exposure limit ของกองทุนนั้น	ไม่จำกัดอัตราส่วน	ไม่จำกัดอัตราส่วน	

หัวข้อเรื่อง	รายละเอียด				หมายเหตุ
	ข้อ	ประเภททรัพย์สิน	อัตราส่วน (% ของ NAV)		
			ปัจจุบัน (กรณีเสนอขายต่อผู้มีเงินลงทุนสูง)	แก้ไขใหม่ (กรณีเสนอขายต่อผู้ลงทุนทั่วไป)	
	3	เงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก	ไม่เกิน 20%	ไม่เกิน 20% (ที่ผู้รับฝากหรือผู้ออก ตราสารมีลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้ 1. มี credit rating อยู่ในระดับ investment grade 2. เป็นธนาคารออมสิน ทั้งนี้ เฉพาะเงินฝากหรือตราสาร ที่รัฐบาลเป็นประกัน)	
	4	<p>ตราสารที่มีลักษณะครบถ้วนดังนี้</p> <p>4.1 เป็นตราสารหนี้ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง หรือสัญญาที่ผู้ออกจัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย หรือสาขาของธนาคารพาณิชย์ ต่างประเทศที่ได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจธนาคารพาณิชย์ในประเทศไทย</p> <p>4.2 เป็นตราสารที่มีลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้</p> <p>4.2.1 ผู้ออกเป็นบริษัทจดทะเบียน</p> <p>4.2.2 ผู้ออกมีการเปิดเผยข้อมูลเป็นการทั่วไป โดยมีรายละเอียดตามแบบ filing</p> <p>4.2.3 ในกรณีที่ตราสารที่มีกำหนดวันชำระหนี้สั้นกว่าหรือเท่ากับ 397 วัน นับแต่วันที่ลงทุน และไม่ได้มีลักษณะตาม 4.2.1 หรือ 4.2.2 ผู้มีการผูกพันตามตราสารดังกล่าวต้องเป็นบุคคลดังนี้</p> <p>4.2.3.1 ธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน หรือบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน</p>	<p>ไม่เกินอัตราดังนี้ แล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า</p> <p>(1) 20% หรือ</p> <p>(2) น้ำหนักของตราสารที่ลงทุนใน benchmark + 5%</p> <p>ทั้งนี้ ข้อ 4.2 ไม่มีระบุ คุณลักษณะเรื่อง ต้องมี credit rating อยู่ในระดับ investment grade</p>	<p>ไม่เกินอัตราดังนี้ แล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า</p> <p>(1) 10% หรือ</p> <p>(2) น้ำหนักของตราสารที่ลงทุนใน benchmark + 5%</p> <p>ทั้งนี้ ข้อ 4.2 มีระบุ คุณลักษณะเรื่อง ต้องมี credit rating อยู่ในระดับ investment grade</p>	

หัวข้อเรื่อง	รายละเอียด				หมายเหตุ
	ข้อ	ประเภททรัพย์สิน	อัตราส่วน (% ของ NAV)		
			ปัจจุบัน (กรณีเสนอขายต่อผู้มีเงินลงทุนสูง)	แก้ไขใหม่ (กรณีเสนอขายต่อผู้ลงทุนทั่วไป)	
		4.2.3.2 ธนาคารออมสิน 4.2.3.3 ธนาคารอาคารสงเคราะห์ 4.2.3.4 ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร 4.2.3.5 บริษัทตลาดรองสินเชื่อกี้อยู่อาศัย 4.2.3.6 ธนาคารพัฒนาวิสาหกิจขนาดกลางและขนาดย่อม แห่งประเทศไทย 4.2.3.7 ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย 4.2.3.8 ธนาคารอิสลามแห่งประเทศไทย 4.2.3.9 บริษัทหลักทรัพย์ 4.3 เสนอขายในประเทศไทย 4.4 ในกรณีที่เป็ตราสารที่มีกำหนดวันชำระหนี้มากกว่า 397 วัน นับแต่วันที่ลงทุน ต้องขึ้นทะเบียนหรืออยู่ในระบบของ regulated market			
	5	ทรัพย์สินดังนี้ 5.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนซื้อขายใน SET (แต่ไม่รวมถึงตรา สารทุนที่ผู้ออกตราสารอยู่ระหว่างดำเนินการแก้ไขเหตุที่ อาจทำให้มีการเพิกถอนการเป็นหลักทรัพย์ซื้อขายใน SET) 5.2 ตราสารทุนที่ออกโดยบริษัทที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย ซึ่งหุ้นของบริษัทดังกล่าวซื้อขายใน SET (แต่ไม่รวมถึง ตราสารทุนที่ผู้ออกตราสารอยู่ระหว่างดำเนินการแก้ไข เหตุที่อาจทำให้มีการเพิกถอนการเป็นหลักทรัพย์ซื้อขาย ใน SET) 5.3 หุ้นที่อยู่ในระหว่าง IPO เพื่อการจดทะเบียนซื้อขายตาม ข้อ 5.1	รวมกันไม่เกินอัตราดังนี้ แล้วแต่อัตรา ใดจะสูงกว่า (1) 15% หรือ (2) น้ำหนักของทรัพย์สินที่ลงทุนใน benchmark + 5% ไม่ต้องกำหนด ตราสารทุนในกระดาน ซื้อขายหลักทรัพย์สำหรับผู้ลงทุน ทั่วไป	รวมกันไม่เกินอัตราดังนี้ แล้วแต่ อัตราใดจะสูงกว่า (1) 10% หรือ (2) น้ำหนักของทรัพย์สินที่ลงทุนใน benchmark + 5% ต้องกำหนด ตราสารทุนในกระดาน ซื้อขายหลักทรัพย์สำหรับผู้ลงทุน ทั่วไป	

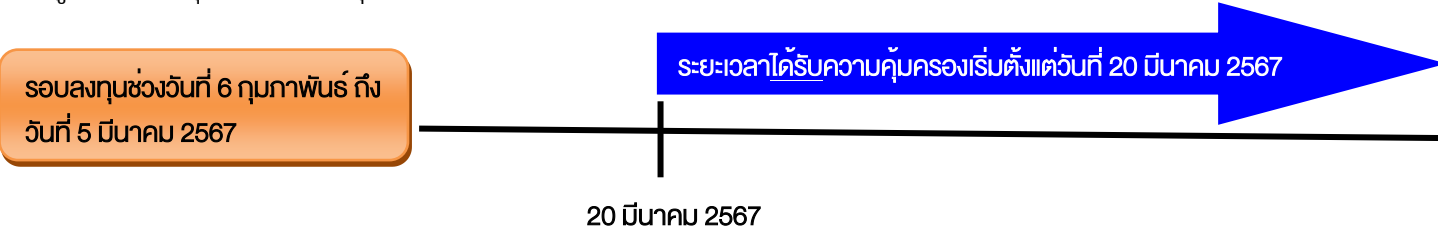
หัวข้อเรื่อง	รายละเอียด			หมายเหตุ	
	ข้อ	ประเภททรัพย์สิน	อัตราส่วน (% ของ NAV)		
			ปัจจุบัน (กรณีเสนอขายต่อผู้มีเงินลงทุนสูง)	แก้ไขใหม่ (กรณีเสนอขายต่อผู้ลงทุนทั่วไป)	
		<p>5.4 เป็นตราสารที่มีลักษณะครบถ้วนดังนี้</p> <p>5.4.1 เป็นตราสารหนี้ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง หรือสัญญาที่ผู้ออกจัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย หรือ ตราสาร Basel III</p> <p>5.4.2 เป็นตราสารที่มีลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้</p> <p>5.4.2.1 ผู้ออกเป็นบริษัทจดทะเบียนใน SET</p> <p>5.4.2.2 ผู้ออกมีการเปิดเผยข้อมูลเป็นการทั่วไปโดยมีรายละเอียดตามแบบ filing</p> <p>5.4.2.3 ในกรณีที่ตราสารที่มีกำหนดวันชำระหนี้สั้นกว่าหรือเท่ากับ 397 วัน นับแต่วันที่ลงทุน และไม่ได้มีลักษณะตาม 5.4.2.1 หรือ 5.4.2.2 ผู้มีการะผูกพันตามตราสารดังกล่าวต้องเป็น บุคคลดังนี้</p> <p>5.4.2.3.1 บุคคลตามข้อ 4.2.3.1 – 4.2.3.9</p> <p>5.4.2.3.2 สถาบันการเงินระหว่างประเทศที่ประเทศไทยเป็นสมาชิก</p> <p>5.4.2.3.3 สถาบันการเงินต่างประเทศที่มีลักษณะทำนองเดียวกับบุคคลตามข้อ 5.4.2.3.1 – 5.4.2.3.2</p> <p>5.4.3 ในกรณีที่ตราสารที่มีกำหนดวันชำระหนี้มากกว่า 397 วันนับแต่วันที่ลงทุน ต้องขึ้นทะเบียนหรืออยู่ในระบบของ regulated market</p> <p>5.5 ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrant)</p> <p>5.6 reverse repo</p> <p>5.7 OTC derivatives</p>	<p>ไม่ต้องกำหนดให้คู่สัญญาของ ธุรกรรม ข้อ 5.6-5.7 ต้องมี credit rating อยู่ในระดับ investment grade</p>	<p>ต้องกำหนดให้คู่สัญญาของ ธุรกรรม ข้อ 5.6-5.7 ต้องมี credit rating อยู่ในระดับ investment grade</p>	

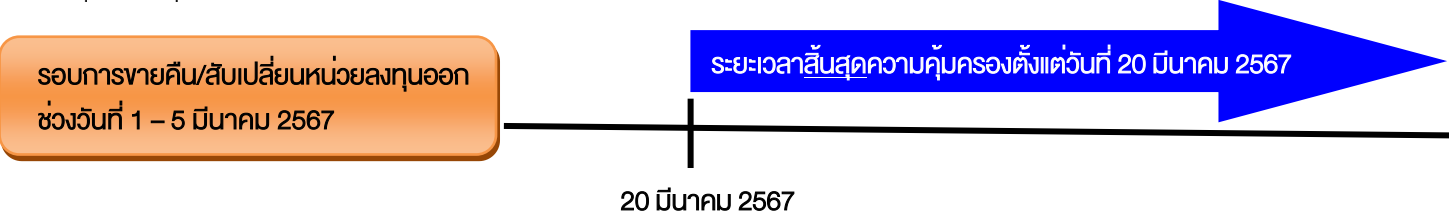
หัวข้อเรื่อง	รายละเอียด			หมายเหตุ
			อัตราส่วน (% ของ NAV)	
	ข้อ	ประเภททรัพย์สิน	ปัจจุบัน (กรณีเสนอขายต่อผู้มีเงินลงทุนสูง)	แก้ไขใหม่ (กรณีเสนอขายต่อผู้ลงทุนทั่วไป)
		<p>5.8 หน่วย infra หรือหน่วย property ที่มีลักษณะครบถ้วน ดังนี้</p> <p>5.8.1 จัดทะเบียนซื้อขายหรืออยู่ในระหว่าง IPO เพื่อการจดทะเบียนซื้อขายในกระดานซื้อขาย ใน SET (แต่ไม่รวมถึงหน่วยดังกล่าวที่อยู่ระหว่างดำเนินการแก้ไขเหตุที่อาจทำให้มีการเพิกถอนหน่วยดังกล่าวออกจากการซื้อขายใน SET)</p> <p>5.8.2 เป็นหน่วยของกองทุนที่ไม่ได้มีลักษณะกระจายการลงทุนในกิจการโครงสร้างพื้นฐาน อสังหาริมทรัพย์ หรือสิทธิการเช่า แล้วแต่กรณี (diversified fund) ตามแนวทางที่สำนักงานกำหนด</p> <p>5.9 หน่วย CIS ที่นอกเหนือจากที่กำหนดในข้อ 2 โดยมีคุณสมบัติและเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการลงทุน เช่นเดียวกับข้อกำหนดสำหรับตราสารทางการเงินทั่วไป และจดทะเบียนซื้อขายใน SET หรือ ที่จดทะเบียนซื้อขายหรืออยู่ในระหว่าง IPO เพื่อการจดทะเบียนซื้อขายในกระดานซื้อขายหลักทรัพ์ของ SET (แต่ไม่รวมถึงหน่วยดังกล่าวที่อยู่ระหว่าง ดำเนินการแก้ไขเหตุที่อาจทำให้มีการเพิกถอนหน่วยดังกล่าวออกจากการซื้อขายใน SET)</p>		
	6	<p>หน่วย infra หรือหน่วย property ของกองทุนที่มีลักษณะกระจายการลงทุนในกิจการโครงสร้างพื้นฐาน อสังหาริมทรัพย์ หรือสิทธิการเช่า แล้วแต่กรณี (diversified fund) ตามแนวทางที่สำนักงานกำหนด และมีลักษณะตาม 5.8.1</p>	ไม่จำกัดอัตราส่วน	ไม่จำกัดอัตราส่วน
	7	<p>ทรัพย์สินอื่นนอกเหนือจากที่ระบุในข้อ 1 - ข้อ 6 (SIP)</p>	รวมกันไม่เกิน 5%	รวมกันไม่เกิน 5%

หัวข้อเรื่อง	รายละเอียด	หมายเหตุ									
	<p><u>ส่วนที่ 2</u> : อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามกลุ่มกิจการ (group limit) <u>ไม่แตกต่างกัน</u></p> <p><u>ส่วนที่ 3</u> : อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามประเภททรัพย์สิน (product limit) <u>แตกต่างกัน</u> ใน total SIP ดังนี้</p> <table border="1" data-bbox="353 416 1850 1007"> <thead> <tr> <th data-bbox="353 416 472 507">ข้อ</th> <th data-bbox="472 416 1608 507">ประเภททรัพย์สิน</th> <th data-bbox="1608 416 1850 507">อัตราส่วน (% ของ NAV)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="353 507 472 644">4 (ปัจจุบัน)</td> <td data-bbox="472 507 1608 644"> <u>ปัจจุบัน</u> : total SIP ซึ่งได้แก่ ทรัพย์สินตามข้อ 7 ของส่วนที่ 1: อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สินหรือ คู่สัญญา (single entity limit) </td> <td data-bbox="1608 507 1850 644">รวมกันไม่เกิน 15%</td> </tr> <tr> <td data-bbox="353 644 472 1007">4 (แก้ไขใหม่)</td> <td data-bbox="472 644 1608 1007"> <u>แก้ไขใหม่</u> : total SIP ซึ่งได้แก่ ทรัพย์สินตามข้อ 7 ของส่วนที่ 1: อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สินหรือ คู่สัญญา (single entity limit) <u>แต่ไม่รวมถึงตราสารหนี้ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง สกุลเงิน หรือตราสาร Basel III ที่มีลักษณะครบถ้วนดังนี้</u> 4.1 มีลักษณะตาม 5.4.2 และ 5.4.3 ของข้อ 5 ในส่วนที่ 1: อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สิน หรือคู่สัญญา (single entity limit) 4.2 มี credit rating อยู่ในระดับต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี credit rating </td> <td data-bbox="1608 644 1850 1007">รวมกันไม่เกิน 15%</td> </tr> </tbody> </table> <p><u>ส่วนที่ 4</u> : อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามความมีส่วนได้เสียในกิจการที่ลงทุน (concentration limit) <u>ไม่แตกต่างกัน</u></p>	ข้อ	ประเภททรัพย์สิน	อัตราส่วน (% ของ NAV)	4 (ปัจจุบัน)	<u>ปัจจุบัน</u> : total SIP ซึ่งได้แก่ ทรัพย์สินตามข้อ 7 ของส่วนที่ 1: อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สินหรือ คู่สัญญา (single entity limit)	รวมกันไม่เกิน 15%	4 (แก้ไขใหม่)	<u>แก้ไขใหม่</u> : total SIP ซึ่งได้แก่ ทรัพย์สินตามข้อ 7 ของส่วนที่ 1: อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สินหรือ คู่สัญญา (single entity limit) <u>แต่ไม่รวมถึงตราสารหนี้ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง สกุลเงิน หรือตราสาร Basel III ที่มีลักษณะครบถ้วนดังนี้</u> 4.1 มีลักษณะตาม 5.4.2 และ 5.4.3 ของข้อ 5 ในส่วนที่ 1: อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สิน หรือคู่สัญญา (single entity limit) 4.2 มี credit rating อยู่ในระดับต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี credit rating	รวมกันไม่เกิน 15%	
ข้อ	ประเภททรัพย์สิน	อัตราส่วน (% ของ NAV)									
4 (ปัจจุบัน)	<u>ปัจจุบัน</u> : total SIP ซึ่งได้แก่ ทรัพย์สินตามข้อ 7 ของส่วนที่ 1: อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สินหรือ คู่สัญญา (single entity limit)	รวมกันไม่เกิน 15%									
4 (แก้ไขใหม่)	<u>แก้ไขใหม่</u> : total SIP ซึ่งได้แก่ ทรัพย์สินตามข้อ 7 ของส่วนที่ 1: อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สินหรือ คู่สัญญา (single entity limit) <u>แต่ไม่รวมถึงตราสารหนี้ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง สกุลเงิน หรือตราสาร Basel III ที่มีลักษณะครบถ้วนดังนี้</u> 4.1 มีลักษณะตาม 5.4.2 และ 5.4.3 ของข้อ 5 ในส่วนที่ 1: อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สิน หรือคู่สัญญา (single entity limit) 4.2 มี credit rating อยู่ในระดับต่ำกว่า investment grade หรือไม่มี credit rating	รวมกันไม่เกิน 15%									

ส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ (Fund Fact Sheet) : สิทธิประโยชน์ของประกันชีวิตและประกันสุขภาพ [ซึ่งเป็นเอกสารแนบท้ายส่วนสรุปข้อมูลสำคัญ (Fund Fact Sheet)]

หัวข้อเรื่อง	รายละเอียด					หมายเหตุ												
สิทธิประโยชน์ของประกันชีวิตและประกันสุขภาพ	<p>เดิม : แผนประกันตามช่วงเงินลงทุน มีจำนวน 4 แผน ดังนี้</p> <table border="1" style="width: 100%; text-align: center;"> <thead> <tr style="background-color: #ff0000; color: white;"> <th></th> <th>แผนที่ 1</th> <th>แผนที่ 2</th> <th>แผนที่ 3</th> <th>แผนที่ 4</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="background-color: #ff0000; color: white;">เงินลงทุน</td> <td>ลงทุน 500,000 บาท แต่ไม่ถึง 1,500,000 บาท</td> <td>ลงทุน 1,500,000 บาท แต่ไม่ถึง 5,000,000 บาท</td> <td>ลงทุน 5,000,000 บาท แต่ไม่ถึง 10,000,000 บาท</td> <td>ลงทุน 10,000,000 บาท ขึ้นไป</td> </tr> </tbody> </table> <p>ผู้ถือหน่วยลงทุนที่ลงทุน ทุก 5 วันทำการแรกของเดือนมกราคม เมษายน กรกฎาคม และตุลาคม ระหว่างเวลาเริ่มทำการถึง 15:30 น. สำหรับความคุ้มครองเริ่มต้นตั้งแต่วันที่กรมธรรม์มีผลบังคับ คือ ทุกวันที่ 15 ของเดือนถัดจากเดือนที่ลงทุน</p> <p>ผู้ถือหน่วยลงทุนที่ขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก ทุก 5 วันทำการแรกของเดือนมกราคม เมษายน กรกฎาคม และตุลาคม ระหว่างเวลาเริ่มทำการถึง 15:30 น. สำหรับความคุ้มครองของกรมธรรม์จะสิ้นสุด ทุกวันที่ 15 ของเดือนถัดจากเดือนที่ขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก</p>						แผนที่ 1	แผนที่ 2	แผนที่ 3	แผนที่ 4	เงินลงทุน	ลงทุน 500,000 บาท แต่ไม่ถึง 1,500,000 บาท	ลงทุน 1,500,000 บาท แต่ไม่ถึง 5,000,000 บาท	ลงทุน 5,000,000 บาท แต่ไม่ถึง 10,000,000 บาท	ลงทุน 10,000,000 บาท ขึ้นไป	<p>มีการเพิ่มเติมแผนประกันจำนวน 2 แผน ตามช่วงเงินลงทุนที่ต่ำกว่าแผนประกันเดิม (จากเดิมมีจำนวน 4 แผน) โดยแผนการประกันจำนวน 4 แผนเดิม ยังคงสิทธิประโยชน์ของประกันชีวิตและประกันสุขภาพของแต่ละแผนไว้ตามเดิม</p>		
		แผนที่ 1	แผนที่ 2	แผนที่ 3	แผนที่ 4													
	เงินลงทุน	ลงทุน 500,000 บาท แต่ไม่ถึง 1,500,000 บาท	ลงทุน 1,500,000 บาท แต่ไม่ถึง 5,000,000 บาท	ลงทุน 5,000,000 บาท แต่ไม่ถึง 10,000,000 บาท	ลงทุน 10,000,000 บาท ขึ้นไป													
<p>แก้ไขใหม่ : แผนประกันตามช่วงเงินลงทุน มีจำนวน 6 แผน ดังนี้</p> <table border="1" style="width: 100%; text-align: center;"> <thead> <tr style="background-color: #ff0000; color: white;"> <th></th> <th>แผนที่ 1 (เพิ่มเติม)</th> <th>แผนที่ 2 (เพิ่มเติม)</th> <th>แผนที่ 3 (แผนเดิม)</th> <th>แผนที่ 4 (แผนเดิม)</th> <th>แผนที่ 5 (แผนเดิม)</th> <th>แผนที่ 6 (แผนเดิม)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="background-color: #ff0000; color: white;">เงินลงทุน</td> <td>ลงทุน 50,000 บาท แต่ไม่ถึง 150,000 บาท</td> <td>ลงทุน 150,000 บาท แต่ไม่ถึง 500,000 บาท</td> <td>ลงทุน 500,000 บาท แต่ไม่ถึง 1,500,000 บาท</td> <td>ลงทุน 1,500,000 บาท แต่ไม่ถึง 5,000,000 บาท</td> <td>ลงทุน 5,000,000 บาท แต่ไม่ถึง 10,000,000 บาท</td> <td>ลงทุน 10,000,000 บาท ขึ้นไป</td> </tr> </tbody> </table> <p>เพิ่มเติมแผนประกันจำนวน 2 แผน ตามช่วงเงินลงทุนที่ต่ำกว่าแผนประกันเดิม (เดิมมีจำนวน 4 แผน) ทั้งนี้ แผนการประกันจำนวน 4 แผนเดิม ยังคงได้รับสิทธิประโยชน์ของประกันชีวิตและประกันสุขภาพของแต่ละแผนไว้ตามเดิม ในส่วนของแผนประกันที่เพิ่มเติมจะเป็นไปตามเงื่อนไขที่บริษัทจัดการกำหนด</p>						แผนที่ 1 (เพิ่มเติม)	แผนที่ 2 (เพิ่มเติม)	แผนที่ 3 (แผนเดิม)	แผนที่ 4 (แผนเดิม)	แผนที่ 5 (แผนเดิม)	แผนที่ 6 (แผนเดิม)	เงินลงทุน	ลงทุน 50,000 บาท แต่ไม่ถึง 150,000 บาท	ลงทุน 150,000 บาท แต่ไม่ถึง 500,000 บาท	ลงทุน 500,000 บาท แต่ไม่ถึง 1,500,000 บาท	ลงทุน 1,500,000 บาท แต่ไม่ถึง 5,000,000 บาท	ลงทุน 5,000,000 บาท แต่ไม่ถึง 10,000,000 บาท	ลงทุน 10,000,000 บาท ขึ้นไป
	แผนที่ 1 (เพิ่มเติม)	แผนที่ 2 (เพิ่มเติม)	แผนที่ 3 (แผนเดิม)	แผนที่ 4 (แผนเดิม)	แผนที่ 5 (แผนเดิม)	แผนที่ 6 (แผนเดิม)												
เงินลงทุน	ลงทุน 50,000 บาท แต่ไม่ถึง 150,000 บาท	ลงทุน 150,000 บาท แต่ไม่ถึง 500,000 บาท	ลงทุน 500,000 บาท แต่ไม่ถึง 1,500,000 บาท	ลงทุน 1,500,000 บาท แต่ไม่ถึง 5,000,000 บาท	ลงทุน 5,000,000 บาท แต่ไม่ถึง 10,000,000 บาท	ลงทุน 10,000,000 บาท ขึ้นไป												

หัวข้อเรื่อง	รายละเอียด	หมายเหตุ										
	<p>ทั้งนี้ ผู้ที่สนใจลงทุนสามารถลงทุนได้ทุกวันทำการ ระหว่างเวลาเริ่มทำการถึง 15:30 น. <u>สำหรับความคุ้มครองจากกรมธรรม์เป็นไปตามรอบการลงทุน</u> โดยรอบการลงทุนของกองทุนที่มีผล ภายในวันที่ 5 ของเดือน จะได้รับความคุ้มครองจากกรมธรรม์ตั้งแต่วันที่ 20 ของเดือน (ทั้งนี้ หากวันที่ 5 ของเดือน เป็นวันหยุดทำการให้เลื่อนออกเป็นวันทำการถัดไป)</p> <p><u>ตัวอย่าง</u> ผู้ถือหน่วยลงทุนที่ซื้อ/ สับเปลี่ยนเข้ากองทุน ในช่วงรอบการลงทุนวันที่ 6 กุมภาพันธ์ ถึง วันที่ 5 มีนาคม 2567 โดยผู้ถือหน่วยลงทุนจะได้รับความคุ้มครองตั้งแต่วันที่ 20 มีนาคม 2567 เป็นต้นไป</p>  <p>รอบลงทุนช่วงวันที่ 6 กุมภาพันธ์ ถึง วันที่ 5 มีนาคม 2567</p> <p>ระยะเวลาได้รับความคุ้มครองเริ่มตั้งแต่วันที่ 20 มีนาคม 2567</p> <p>20 มีนาคม 2567</p> <p><u>ตัวอย่างเพิ่มเติม</u></p> <table border="1" data-bbox="400 837 1812 1069"> <thead> <tr> <th>ผู้ลงทุนที่เข้าลงทุนและรายการลงทุนมีผล ในรอบวันที่</th> <th>ได้รับความคุ้มครองจากกรมธรรม์ตั้งแต่วันที่</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>ตัวอย่างที่ 1: วันอังคารที่ 6 กุมภาพันธ์ ถึง วันอังคารที่ 5 มีนาคม 2567</td> <td>วันพุธที่ 20 มีนาคม 2567</td> </tr> <tr> <td>ตัวอย่างที่ 2: วันพุธที่ 6 มีนาคม 2567 ถึง วันศุกร์ที่ 5 เมษายน 2567</td> <td>วันเสาร์ที่ 20 เมษายน 2567</td> </tr> <tr> <td>ตัวอย่างที่ 3: วันอังคารที่ 9 เมษายน 2567 ถึง วันอังคารที่ 7 พฤษภาคม 2567</td> <td>วันจันทร์ที่ 20 พฤษภาคม 2567</td> </tr> <tr> <td>ตัวอย่างที่ 4: วันพุธที่ 8 พฤษภาคม 2567 ถึง วันพุธที่ 5 มิถุนายน 2567</td> <td>วันพฤหัสบดีที่ 20 มิถุนายน 2567</td> </tr> </tbody> </table> <p>หมายเหตุ : วันจันทร์ที่ 8 เมษายน เป็นวันหยุดชดเชยวันจักรี และเนื่องจากวันที่ 5 พฤษภาคม เป็นวันอาทิตย์ วันจันทร์ที่ 6 พฤษภาคม เป็นวันหยุดชดเชยวันวิตรมงคล</p>	ผู้ลงทุนที่เข้าลงทุนและรายการลงทุนมีผล ในรอบวันที่	ได้รับความคุ้มครองจากกรมธรรม์ตั้งแต่วันที่	ตัวอย่างที่ 1: วันอังคารที่ 6 กุมภาพันธ์ ถึง วันอังคารที่ 5 มีนาคม 2567	วันพุธที่ 20 มีนาคม 2567	ตัวอย่างที่ 2: วันพุธที่ 6 มีนาคม 2567 ถึง วันศุกร์ที่ 5 เมษายน 2567	วันเสาร์ที่ 20 เมษายน 2567	ตัวอย่างที่ 3: วันอังคารที่ 9 เมษายน 2567 ถึง วันอังคารที่ 7 พฤษภาคม 2567	วันจันทร์ที่ 20 พฤษภาคม 2567	ตัวอย่างที่ 4: วันพุธที่ 8 พฤษภาคม 2567 ถึง วันพุธที่ 5 มิถุนายน 2567	วันพฤหัสบดีที่ 20 มิถุนายน 2567	
ผู้ลงทุนที่เข้าลงทุนและรายการลงทุนมีผล ในรอบวันที่	ได้รับความคุ้มครองจากกรมธรรม์ตั้งแต่วันที่											
ตัวอย่างที่ 1: วันอังคารที่ 6 กุมภาพันธ์ ถึง วันอังคารที่ 5 มีนาคม 2567	วันพุธที่ 20 มีนาคม 2567											
ตัวอย่างที่ 2: วันพุธที่ 6 มีนาคม 2567 ถึง วันศุกร์ที่ 5 เมษายน 2567	วันเสาร์ที่ 20 เมษายน 2567											
ตัวอย่างที่ 3: วันอังคารที่ 9 เมษายน 2567 ถึง วันอังคารที่ 7 พฤษภาคม 2567	วันจันทร์ที่ 20 พฤษภาคม 2567											
ตัวอย่างที่ 4: วันพุธที่ 8 พฤษภาคม 2567 ถึง วันพุธที่ 5 มิถุนายน 2567	วันพฤหัสบดีที่ 20 มิถุนายน 2567											

หัวข้อเรื่อง	รายละเอียด	หมายเหตุ										
	<p>ทั้งนี้ ผู้ถือหน่วยลงทุนสามารถขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออกได้ ทุกวันที่ 1 ถึง วันที่ 5 ของเดือน ระหว่างเวลาเริ่มทำการถึง 15:30 น. (หากวันที่ 5 ของเดือนเป็นวันหยุดทำการให้เลื่อนออกเป็นวันทำการถัดไป)</p> <p>สำหรับการสิ้นสุดความคุ้มครองของกรมธรรม์จะเป็นไปตามรอบการขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก โดยรอบการขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก ที่มีผล ทุกวันที่ 1 ถึง วันที่ 5 ของเดือน จะสิ้นสุดความคุ้มครองจากกรมธรรม์ตั้งแต่วันที่ 20 ของเดือน (ทั้งนี้ หากวันที่ 5 ของเดือนเป็นวันหยุดทำการให้เลื่อนออกเป็นวันทำการถัดไป)</p> <p>ตัวอย่าง ผู้ถือหน่วยลงทุนที่ขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก ในช่วงวันที่ 1- 5 มีนาคม 2567 โดยความคุ้มครองจากกรมธรรม์ จะสิ้นสุดความคุ้มครองตั้งแต่วันที่ 20 มีนาคม 2567 เป็นต้นไป</p>  <p>ตัวอย่างเพิ่มเติม</p> <table border="1" data-bbox="400 954 1827 1185"> <thead> <tr> <th>ผู้ถือหน่วยลงทุนที่ขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก และรายการมีผล ในช่วงวันที่</th> <th>สิ้นสุดความคุ้มครองจากกรมธรรม์ตั้งแต่วันที่</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>ตัวอย่างที่ 1: วันที่ 1- 5 มีนาคม 2567</td> <td>วันพุธที่ 20 มีนาคม 2567</td> </tr> <tr> <td>ตัวอย่างที่ 2: วันที่ 1- 5 เมษายน 2567</td> <td>วันเสาร์ที่ 20 เมษายน 2567</td> </tr> <tr> <td>ตัวอย่างที่ 3: วันที่ 1- 7* พฤษภาคม 2567</td> <td>วันจันทร์ที่ 20 พฤษภาคม 2567</td> </tr> <tr> <td>ตัวอย่างที่ 4: วันที่ 1- 5 มิถุนายน 2567</td> <td>วันพฤหัสบดีที่ 20 มิถุนายน 2567</td> </tr> </tbody> </table> <p>หมายเหตุ : * เนื่องจากวันที่ 5 พฤษภาคม เป็นวันอาทิตย์ และ วันจันทร์ที่ 6 พฤษภาคม เป็นวันหยุดชดเชยวันฉัตรมงคล จึงเลื่อนออกเป็นวันทำการถัดไป</p>	ผู้ถือหน่วยลงทุนที่ขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก และรายการมีผล ในช่วงวันที่	สิ้นสุดความคุ้มครองจากกรมธรรม์ตั้งแต่วันที่	ตัวอย่างที่ 1: วันที่ 1- 5 มีนาคม 2567	วันพุธที่ 20 มีนาคม 2567	ตัวอย่างที่ 2: วันที่ 1- 5 เมษายน 2567	วันเสาร์ที่ 20 เมษายน 2567	ตัวอย่างที่ 3: วันที่ 1- 7* พฤษภาคม 2567	วันจันทร์ที่ 20 พฤษภาคม 2567	ตัวอย่างที่ 4: วันที่ 1- 5 มิถุนายน 2567	วันพฤหัสบดีที่ 20 มิถุนายน 2567	
ผู้ถือหน่วยลงทุนที่ขายคืนหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก และรายการมีผล ในช่วงวันที่	สิ้นสุดความคุ้มครองจากกรมธรรม์ตั้งแต่วันที่											
ตัวอย่างที่ 1: วันที่ 1- 5 มีนาคม 2567	วันพุธที่ 20 มีนาคม 2567											
ตัวอย่างที่ 2: วันที่ 1- 5 เมษายน 2567	วันเสาร์ที่ 20 เมษายน 2567											
ตัวอย่างที่ 3: วันที่ 1- 7* พฤษภาคม 2567	วันจันทร์ที่ 20 พฤษภาคม 2567											
ตัวอย่างที่ 4: วันที่ 1- 5 มิถุนายน 2567	วันพฤหัสบดีที่ 20 มิถุนายน 2567											

ทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้

สาระตามภาคผนวกนี้เป็นการกำหนดประเภทและคุณสมบัติ และเงื่อนไขของตราสารและสัญญาที่กองทุนสามารถลงทุนได้ ไม่ว่าจะผู้ออกตราสารหรือคู่สัญญาจะเป็นกิจการที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยหรือกฎหมายต่างประเทศ และไม่ว่าการลงทุนของกองทุนจะเกิดขึ้นในประเทศหรือต่างประเทศ ทั้งนี้ หากเป็นการลงทุนในตราสารหรือสัญญาในต่างประเทศ ตราสารหรือสัญญาดังกล่าวต้องเสนอขายหรือเป็นการทำสัญญาในประเทศที่มีหน่วยงานกำกับดูแลด้านหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกสามัญของ IOSCO หรือที่มีการซื้อขายในตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศที่เป็นสมาชิกของ WFE หรือเป็นตราสารของบริษัทที่จัดตั้งและเสนอขายใน GMS

ส่วนที่ 1 : ตราสาร TS (transferable securities)

1. ตราสาร TS หมายความว่า ตราสารทางการเงินใด ๆ นอกเหนือจากทรัพย์สินในส่วนอื่นของภาคผนวกนี้ ซึ่งมีคุณสมบัติตามหลักเกณฑ์ที่ครบถ้วน ดังนี้

1.1 ไม่มีข้อกำหนดหรือเงื่อนไขที่ทำให้ผู้ลงทุนมีภาระผูกพันมากกว่ามูลค่าเงินลงทุนในตราสาร

1.2 สามารถเปลี่ยนมือได้ (รวมถึงกรณีที่เป็น B/E P/N หรือ SN ที่มีเงื่อนไขห้ามเปลี่ยนมือแต่กองทุนได้ดำเนินการให้มีการรับโอนสิทธิเรียกร้องในตราสารได้ตามวิธีการที่กฎหมายกำหนด หรือมีเงื่อนไขให้กองทุนสามารถขายคืนผู้ออกตราสารได้)

1.3 มีข้อมูลเกี่ยวกับตราสารที่ถูกต้องครบถ้วนและมีการปรับปรุงเป็นประจำอย่างสม่ำเสมอ บลจ. สามารถเข้าถึงได้เพื่อนำมาประกอบการพิจารณาตัดสินใจลงทุนได้อย่างสม่ำเสมอ และมีข้อมูลราคาที่สะท้อนมูลค่ายุติธรรม โดยข้อมูลดังกล่าวต้องอ้างอิงจากแหล่งข้อมูลที่เชื่อถือได้ซึ่งจัดทำตามหลักวิชาการอันเป็นที่ยอมรับในระดับสากล

2. คุณสมบัติและหลักเกณฑ์ในการลงทุนของตราสารเพิ่มเติมจากที่กำหนดในข้อ 1.

2.1 ในกรณีที่เป็นการลงทุนใน B/E หรือ P/N ที่ออกตราสารดังกล่าวเพื่อชำระหนี้การค้า B/E หรือ P/N ดังกล่าวต้องมีการรับอาวัลหรือรับรองโดยบุคคลดังนี้

2.1.1 ธพ. บง. หรือ บค. ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน

2.1.2 ธนาคารออมสิน

2.1.3 ธนาคารอาคารสงเคราะห์

2.1.4 ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร

2.1.5 ธนาคารพัฒนาวิสาหกิจขนาดกลางและขนาดย่อมแห่งประเทศไทย

2.1.6 ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย

2.1.7 ธนาคารอิสลามแห่งประเทศไทย

2.1.8 สถาบันการเงินต่างประเทศที่มีลักษณะทำนองเดียวกับผู้รับฝากตาม 2.1.1 - 2.1.7

ทั้งนี้ การอาวัลหรือการรับรองดังกล่าวต้องเป็นการอาวัลหรือการรับรองผู้ส่งจ่ายหรือผู้ออกตัว ทั้งจำนวนรวมถึงดอกเบี้ย (ถ้ามี) ตามที่ระบุไว้ใน B/E หรือ P/N ด้วย

2.2 การลงทุนใน SN ต้องเป็นไปตามเงื่อนไขเพิ่มเติมดังนี้

2.2.1 SN มีการจ่ายผลตอบแทนโดยอ้างอิงกับ underlying ประเภทเดียวกับ underlying ของ derivatives ตามที่ระบุในส่วนที่ 6 ข้อ 1

2.2.2 หากการลงทุนใน SN จะมีผลทำให้กองทุนต้องรับมอบทรัพย์สินใด ๆ ทรัพย์สินนั้นต้องเป็นทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ เว้นแต่เป็นไปตามมาตรฐานสากลซึ่งกำหนดโดย International Swaps and Derivatives Association (ISDA) และเป็นทรัพย์สินที่สามารถเปลี่ยนมือได้ โดยก่อนการลงทุน บลจ. ต้องจัดให้มีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการลงทุนที่อาจทำให้กองทุนต้องรับมอบทรัพย์สินดังกล่าวไว้ในหนังสือชี้ชวนด้วย

2.2.3 ในกรณีที่ SN ซึ่งมีข้อกำหนดห้ามเปลี่ยนมือ ผู้ออก SN ต้องยินยอมให้กองทุนสามารถไถ่ถอน SN ดังกล่าวก่อนครบอายุ เมื่อ บลจ. ร้องขอได้

2.2.4 ในกรณีที่ SN ซึ่งเสนอขายในประเทศ บลจ. ต้องดำเนินการจัดให้มีข้อตกลงกับผู้ออก SN ดังต่อไปนี้ก่อนการลงทุน

2.2.4.1 ให้ผู้ออก SN คำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมของ SN ไปยัง TBMA ทุกวันที่ 15 และวันสุดท้ายของแต่ละเดือน ทั้งนี้ ในกรณีที่วันดังกล่าวเป็นวันหยุดทำการของ บลจ. ให้คำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมภายในวันทำการถัดไป

2.2.4.2 ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อราคาของ SN อย่างมีนัยสำคัญ ให้ผู้ออก SN คำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมของ SN ไปยัง TBMA ทันที

ความในวรรคหนึ่งไม่นำมาใช้บังคับกับกรณีที่เป็น SN ซึ่งขึ้นทะเบียนกับ TBMA และมีการเสนอขายตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่

2.2.5 ในกรณีที่ SN ซึ่งเสนอขายในต่างประเทศ ต้องปรากฏว่า SN นั้นมีราคาปรากฏในระบบข้อมูลที่นำเชื่อถือได้ซึ่งเป็นที่ยอมรับโดยทั่วไปของธรรมเนียมปฏิบัติสากล และ บลจ. ต้องดำเนินการให้มีข้อตกลงกับผู้ออก SN ดังต่อไปนี้ก่อนการลงทุน

2.2.5.1 ให้ผู้ออก SN ส่งราคาที่เป็นมูลค่ายุติธรรมของ SN ซึ่งเกิดจากวิธีการคำนวณเดียวกับที่ใช้ในการคำนวณราคาที่แสดงในระบบข้อมูลที่นำเชื่อถือดังกล่าว ให้ บลจ. ทุกวันที่ 15 และวันสุดท้ายของแต่ละเดือน ทั้งนี้ ในกรณีที่วันดังกล่าวเป็นวันหยุดทำการของ บลจ. ให้คำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมภายในวันทำการถัดไป

2.2.5.2 ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อราคาของ SN อย่างมีนัยสำคัญ ให้ผู้ออก SN ส่งราคาที่เป็นมูลค่ายุติธรรมของ SN มายัง บลจ. ทันที

2.3 ในกรณีที่เป็นการลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงของกองทุนรวมทั้งเน้นลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงเพื่อแก้ปัญหาสภาพคล่อง เนื่องจากสถานการณ์โรคโควิด 19 ตราสารหนี้ดังกล่าวต้องมีคุณสมบัติตามหลักเกณฑ์ที่ครบถ้วน ดังนี้

2.3.1 เป็นตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงที่มียอดคงค้าง ณ วันที่ประกาศมีผลใช้บังคับ และมีลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่ง ดังนี้

2.3.1.1 มี issue rating หรือ issuer rating ต่ำกว่าอันดับที่ลงทุนได้ (non-investment grade) ณ วันที่ประกาศมีผลใช้บังคับ

2.3.1.2 มี issue rating หรือ issuer rating อยู่ในอันดับ investment grade และต่อมาถูกปรับลด credit rating ต่ำกว่าอันดับที่ลงทุนได้ (non-investment grade) ภายในวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2564

2.3.1.3 ตราสารหนี้และผู้ออกตราสารหนี้ไม่มี credit rating (unrated) ณ วันที่ประกาศมีผลใช้บังคับ

2.3.2 ไม่เป็นตราสารหนี้ ดังนี้

2.3.2.1 ตราสารหนี้ที่เสนอขายต่อผู้ลงทุนโดยเฉพาะเจาะจงซึ่งมีจำนวนไม่เกิน 10 ราย ในรอบระยะเวลา 4 เดือนใด ๆ

2.3.2.2 ตราสารหนี้ที่ออก ณ ขณะใดขณะหนึ่ง เมื่อนับรวมตราสารหนี้ ที่ออกก่อนหน้านั้นและยังไม่ครบกำหนดชำระเงินมีจำนวนไม่เกิน 10 ฉบับ

2.3.3 มีอายุของตราสารต้องไม่เกินอายุของกองทุนรวม

2.3.4 เสนอขายในประเทศไทย

2.3.5 ไม่ใช่ตราสารหนี้ด้อยคุณภาพ ณ วันที่มีการลงทุน

2.3.6 ผู้ออกตราสารหนี้ต้องมีลักษณะครบถ้วนดังนี้

2.3.6.1 ไม่เป็นบริษัทที่ ธพ. หรือ บล. ถือหุ้นเกินกว่า 50%

2.3.6.2 ไม่อยู่ระหว่างการดำเนินการในเรื่องใดเรื่องหนึ่งดังนี้ เว้นแต่ได้รับการผ่อนผันจากสำนักงาน

2.3.6.2.1 ค้างการนำส่งงบการเงินหรือรายงานที่มีหน้าที่ต้องจัดทำตามมาตรา 56

2.3.6.2.2 ค้างส่งรายงานที่มีหน้าที่ต้องจัดทำและจัดส่งต่อสำนักงานหรือตลาดหลักทรัพย์ตามมาตรา 57

2.3.6.2.3 ปรับปรุงแก้ไขงบการเงิน หรือรายงานที่มีหน้าที่ต้องจัดทำตามมาตรา 56 หรือมาตรา 57 ตามที่สำนักงานหรือ SET แล้วแต่กรณี แจ้งให้ดำเนินการปรับปรุงแก้ไข

2.3.6.2.4 ปฏิบัติตามคำสั่งของสำนักงานหรือ SET ตามมาตรา 58 หรือมาตรา 199 ประกอบมาตรา 58 แล้วแต่กรณี

2.3.6.3 มีกรรมการและผู้บริหารที่มีรายชื่ออยู่ในระบบข้อมูลรายชื่อกรรมการและผู้บริหารของบริษัทที่ออกหลักทรัพย์ตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์การแสดงชื่อบุคคลในระบบข้อมูลรายชื่อกรรมการและผู้บริหารของบริษัทที่ออกหลักทรัพย์

2.3.6.4 ไม่มีลักษณะดังต่อไปนี้

2.3.6.4.1 ภายในระยะเวลา 10 ปีก่อนวันเสนอขายตราสารหนี้ ผู้ออกตราสารหนี้เคยต้องคำพิพากษาถึงที่สุดให้ลงโทษในความผิดเกี่ยวกับทรัพย์สินเฉพาะในมูลเหตุเนื่องจากการดำเนินการที่มีลักษณะหลอกลวง ฉ้อโกง หรือทุจริต อันเป็นเหตุที่ทำให้เกิดความเสียหายในวงกว้าง ทั้งนี้ ไม่ว่าตามกฎหมายไทยหรือกฎหมายต่างประเทศ

2.3.6.4.2 อยู่ระหว่างถูกกล่าวโทษหรือถูกดำเนินคดีในความผิดเกี่ยวกับทรัพย์สินโดยหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง เฉพาะในมูลเหตุเนื่องจากการดำเนินการที่มีลักษณะหลอกลวง ฉ้อโกง หรือทุจริตอันเป็นเหตุที่ทำให้เกิดความเสียหายในวงกว้าง ทั้งนี้ ไม่ว่าตามกฎหมายไทยหรือกฎหมายต่างประเทศ

2.3.7 มีวัตถุประสงค์ในการนำเงินที่ได้จากการขายตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงไปไถ่ถอนตราสารหนี้เดิมที่จะครบกำหนดไถ่ถอนภายใน 6 เดือนนับแต่วันที่ออกตราสารหนี้ ก่อนนำไปใช้เพื่อวัตถุประสงค์อื่น ทั้งนี้ ในกรณีที่เป็นการลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงที่ออกใหม่

ส่วนที่ 2 : ทรัพย์สินประเภทหน่วย CIS หน่วย infra และหน่วย property

ต้องมีคุณสมบัติและหลักเกณฑ์ในการลงทุนดังนี้

1. กรณีเป็นหน่วยที่การออกอยู่ภายใต้บังคับกฎหมายไทย

1.1 กรณีเป็นหน่วย CIS หน่วย infra และหน่วย property

1.1.1 มีคุณสมบัติและเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการลงทุนเช่นเดียวกับข้อกำหนดสำหรับตราสาร TS ในส่วนที่ 1 ข้อ 1.1 ข้อ 1.2 และข้อ 1.3

1.1.2 ในกรณีที่กองทุนไปลงทุนในหน่วย CIS ของ MF MF ดังกล่าวต้องมีนโยบายการลงทุนดังนี้ (ไม่ใช้กับการลงทุนในหน่วย CIS ของกองทุนรวมทองคำที่ลงทุนในทองคำแท่ง)

1.1.2.1 มีการลงทุนในทรัพย์สินซึ่งเป็นประเภทและชนิดเดียวกับที่กองทุนสามารถลงทุนได้

1.1.2.2 มีการลงทุนในทรัพย์สินเมื่อใช้วิธีคำนวณตามสัดส่วน (pro rata) แล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ single entity limit ของกองทุนนั้น

1.1.2.3 มีการลงทุนในทรัพย์สินเมื่อใช้วิธีคำนวณตามสัดส่วน (pro rata) แล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ product limit สำหรับทรัพย์สินที่เป็น SIP ของกองทุนนั้น

1.1.2.4 มีการลงทุนใน derivatives ที่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ global exposure limit¹ ของกองทุนนั้น

1.1.3 ในกรณีที่กองทุนรวมปิดเคอร์ไปลงทุนในหน่วย CIS ของ MF MF ดังกล่าวต้องไม่ใช่กองทุนรวมปิดเคอร์

1.2 กรณีเป็นหน่วย CIS นอกเหนือจากที่กำหนดในส่วนที่ 2 ข้อ 1.1

1.2.1 มีคุณสมบัติและเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการลงทุนเช่นเดียวกับข้อกำหนดสำหรับตราสาร TS ในส่วนที่ 1 ข้อ 1.1 ข้อ 1.2 และข้อ 1.3

1.2.2 จัดทะเบียนซื้อขายใน SET

2. กรณีเป็นหน่วยที่การออกอยู่ภายใต้บังคับกฎหมายต่างประเทศ

2.1 กรณีเป็นหน่วย CIS หน่วย infra และหน่วย property

2.1.1 มีคุณสมบัติและเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการลงทุนเช่นเดียวกับข้อกำหนดสำหรับตราสาร TS ในส่วนที่ 1 ข้อ 1.1 ข้อ 1.2 และข้อ 1.3

2.1.2 เป็นหน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศที่มีลักษณะดังนี้

2.1.2.1 การออกและการเสนอขายอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของหน่วยงานต่างประเทศที่กำกับดูแลด้านหลักทรัพย์และตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ซึ่งเป็นสมาชิกสามัญของ IOSCO หรือเป็นหน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศที่มีการซื้อขายในตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศที่เป็นสมาชิกของ WFE

2.1.2.2 CIS operator ของกองทุนดังกล่าวอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของหน่วยงานกำกับดูแลที่เป็นสมาชิกสามัญของ IOSCO

¹ อัตราส่วนการลงทุนใน derivatives ที่คำนวณตามประเภททรัพย์สิน (product limit) ซึ่งเป็นการเข้าทำธุรกรรม derivatives ที่มีใช้เพื่อการลดความเสี่ยง (non-hedging) ที่กำหนดในภาคผนวก 4-retail MF ภาคผนวก 4-AI ภาคผนวก 4-PVD และภาคผนวก 4-VAYU แล้วแต่กรณี

2.1.2.3 ในกรณีที่ MF หรือ PVD ไปลงทุนในหน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศกองทุน CIS ต่างประเทศดังกล่าวต้องอยู่ภายใต้หลักเกณฑ์การกำกับดูแล การออก การเสนอขาย และการจัดการสำหรับกองทุนเพื่อผู้ลงทุนรายย่อยของประเทศนั้น

2.1.3 ประเทศที่กำกับดูแลการเสนอขายหน่วยดังกล่าวมีมาตรการให้ความคุ้มครองผู้ลงทุนอย่างเพียงพอ ทั้งนี้ ตามรายชื่อประเทศที่สำนักงานกำหนด เว้นแต่เป็นหน่วยของกองทุน ETF ต่างประเทศที่มีการบริหารจัดการกองทุนในลักษณะ passive management ซึ่งสร้างผลตอบแทนให้แก่ผู้ลงทุนตามการเคลื่อนไหวของดัชนีราคาหรือดัชนีกลุ่มใด ๆ ดัชนีดังกล่าวต้องมีลักษณะเช่นเดียวกับข้อ 2.9.1.1 ในส่วนที่ 2 ของภาคผนวก 2

2.1.4 ในกรณีเป็นการลงทุนของ MF หรือ PVD ในหน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศ กองทุนดังกล่าวต้องมีการจำกัดการกู้ยืมไว้เฉพาะกรณีมีเหตุจำเป็นในการบริหารสภาพคล่องเป็นการชั่วคราวเท่านั้น และมีนโยบายการลงทุนดังนี้ (ไม่ใช้กับการลงทุนในหน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศซึ่งเป็นกองทุนรวมทองคำที่ลงทุนในทองคำแท่ง)

2.1.4.1 มีการลงทุนในทรัพย์สินเมื่อใช้วิธีคำนวณตามสัดส่วน (pro rata) แล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ single entity limit ของ MF หรือ PVD นั้น ทั้งนี้ หลักเกณฑ์ดังกล่าวไม่ใช้กับกรณีทรัพย์สินที่เป็น SIP

2.1.4.2 มีการลงทุนในทรัพย์สินเมื่อใช้วิธีคำนวณตามสัดส่วน (pro rata) แล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ product limit สำหรับทรัพย์สินที่เป็น SIP ของ MF หรือ PVD นั้น

2.1.4.3 มีการลงทุนใน derivatives ที่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ global exposure limit² ของ MF หรือ PVD นั้น

ในกรณีกองทุน CIS ต่างประเทศที่ MF หรือ PVD ลงทุน ต้องเป็นกองทุนที่มุ่งเน้นลงทุนในทรัพย์สินซึ่งเป็นประเภทและชนิดเดียวกับที่ MF หรือ PVD สามารถลงทุนได้ และเมื่อนำทรัพย์สินที่ไม่สามารถลงทุนได้มาคำนวณตามสัดส่วน (pro rata) แล้วจะต้องไม่เกินร้อยละ 20 ของ NAV ของ MF หรือ PVD ดังกล่าว

2.1.5 ในกรณีที่กองทุนรวมฟีดเดอร์ไปลงทุนในหน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศ กองทุน CIS ต่างประเทศดังกล่าวต้องไม่ใช่กองทุนที่มีลักษณะทำนองเดียวกับกองทุนรวมฟีดเดอร์ เว้นแต่เป็นกรณีที่มีความจำเป็นและเป็นประโยชน์ต่อผู้ถือหน่วยลงทุน ทั้งนี้ โดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน โดยก่อนการลงทุน บลจ. ต้องจัดให้มีการเปิดเผยข้อมูล เหตุผลความจำเป็นและค่าธรรมเนียมที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนในลักษณะดังกล่าวไว้ในหนังสือชี้ชวนด้วย

2.1.6 ในกรณีเป็นการลงทุนของ MF หรือ PVD ในหน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศ และกองทุน CIS ดังกล่าวมีนโยบายการลงทุนซึ่งสร้างผลตอบแทนให้แก่ผู้ลงทุนตามการเคลื่อนไหวของดัชนีราคาหรือดัชนีกลุ่มใด ๆ ดัชนีดังกล่าวต้องมีลักษณะเช่นเดียวกับดัชนีที่กำหนดไว้ในข้อ 2.9.1 ของส่วนที่ 2 ในภาคผนวก 2

2.2 กรณีเป็นหน่วย CIS นอกเหนือจากที่กำหนดในส่วนที่ 2 ข้อ 2.1

2.2.1 มีคุณสมบัติและเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการลงทุนเช่นเดียวกับข้อกำหนดสำหรับตราสาร TS ในส่วนที่ 1 ข้อ 1.1 ข้อ 1.2 และข้อ 1.3

2.2.2 จดทะเบียนในตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศที่เป็นสมาชิกของ WFE

² เหมือนเชิงอรรถ 1

ส่วนที่ 3 : ทรัพย์สินประเภทเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝาก

ต้องเป็นเงินฝากหรือตราสารเทียบเท่าเงินฝากของผู้รับฝากดังนี้

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.

ส่วนที่ 4 : ธุรกรรมประเภทการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (reverse repo)

การลงทุนใน reverse repo ต้องเป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังนี้

1. คู่สัญญา ต้องเป็นนิติบุคคลดังนี้ที่สามารถเข้าเป็นคู่สัญญาใน reverse repo ได้ตามกฎหมายไทย
 - 1.1 ธพ.
 - 1.2 บง.
 - 1.3 บค.
 - 1.4 บล.
 - 1.5 บริษัทประกันภัย
 - 1.6 ธปท.
 - 1.7 กองทุนฟื้นฟู
 - 1.8 นิติบุคคลที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น
 - 1.9 ส่วนราชการและรัฐวิสาหกิจตามกฎหมายว่าด้วยวิธีการงบประมาณ
2. ตราสารที่ใช้ในการทำ reverse repo ต้องเป็นตราสารดังนี้
 - 2.1 ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ โดยกรณีเป็นตราสารภาครัฐต่างประเทศ ต้องมี credit rating อยู่ในอันดับ investment grade
 - 2.2 B/E P/N บัตรเงินฝาก สุกุก หรือหุ้นกู้ระยะสั้น ที่ ธพ. บง. หรือธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น เป็นผู้มีการระดมทุน ซึ่งมีอายุคงเหลือไม่เกิน 1 ปี
 - 2.3 B/E หรือ P/N ที่ TSFC เป็นผู้ออก ที่มีกำหนดวันใช้เงินตามตัวไม่เกิน 270 วันนับแต่วันออกตัว และเป็นตัวที่ถึงกำหนดใช้เงินเมื่อทวงถามหรือเมื่อได้เห็น
 - 2.4 B/E P/N หรือสุกุก ที่มีอายุไม่เกิน 90 วันนับแต่วันที่ออก ซึ่งมี credit rating อย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้
 - 2.4.1 มี issue rating หรือ issuer rating อยู่ในอันดับแรก โดยกรณีที่เป็น issuer rating ต้องเป็น credit rating ที่ได้มาจากการจัด credit rating ระยะสั้นด้วย

2.4.2 มี guarantor rating อยู่ในอันดับ investment grade

2.5 ตราสารหนี้ซึ่งมีอายุคงเหลือไม่เกิน 1 ปี ที่ขึ้นทะเบียนในตลาดซื้อขายตราสารหนี้ หรือที่มีข้อมูลราคาที่น่าเชื่อถือและอ้างอิงได้ซึ่งมีการเปิดเผยต่อสาธารณชน โดยตราสารหนี้ดังกล่าวต้องมี credit rating อย่างใดอย่างหนึ่ง ดังนี้

2.5.1 มี credit rating ระยะสั้นอยู่ใน 2 อันดับแรก หรือ credit rating ระยะยาวที่เทียบเคียงได้กับ credit rating ระยะสั้นดังกล่าวตามที่ CRA ได้เปรียบเทียบไว้

2.5.2 มี credit rating ระยะยาวอยู่ใน 3 อันดับแรก

2.6 ตราสารหนี้ซึ่งมีอายุคงเหลือไม่เกิน 1 เดือนที่ขึ้นทะเบียนในตลาดซื้อขายตราสารหนี้ หรือที่มีข้อมูลราคาที่น่าเชื่อถือและอ้างอิงได้ซึ่งมีการเปิดเผยต่อสาธารณชน โดยตราสารหนี้ดังกล่าวต้องมี credit rating อย่างใดอย่างหนึ่ง ดังนี้

2.6.1 มี credit rating ระยะสั้นอยู่ใน 3 อันดับแรก หรือ credit rating ระยะยาวที่เทียบเคียงได้กับ credit rating ระยะสั้นดังกล่าวตามที่ CRA ได้เปรียบเทียบไว้

2.6.2 มี credit rating ระยะยาวอยู่ใน 4 อันดับแรก

2.7 ทรัพย์สินอื่นตามที่สำนักงานกำหนดเพิ่มเติมโดยอาศัยอำนาจตามข้อ 10 วรรคหนึ่ง (3) ของประกาศ

3. ระยะเวลาการรับชำระหนี้ของ reverse repo ต้องไม่เกิน 90 วัน

4. ข้อกำหนดเพิ่มเติมที่ บลจ. ต้องปฏิบัติสำหรับการลงทุนใน reverse repo

4.1 ต้องใช้สัญญามาตรฐานตามที่กำหนดโดย TBMA หรือ TSFC

4.2 ห้ามนำหลักทรัพย์หรือตราสารที่ซื้อไปขายหรือโอนต่อ เว้นแต่เข้าลักษณะดังนี้

4.2.1 เป็นการขายหรือโอนตามข้อกำหนดใน reverse repo ดังกล่าว

4.2.2 เป็นการขายตาม repo ที่เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการกู้ยืมเงินในนามของกองทุนรวมและการก่อภาระผูกพันแก่ทรัพย์สินของกองทุนรวม

4.3 มูลค่าของหลักทรัพย์หรือตราสารที่ซื้อ ณ วันเริ่มต้นสัญญา ต้องมีมูลค่าเป็นไปตามสมการการคำนวณตามวิธีการดังนี้

$$\text{มูลค่าของหลักทรัพย์หรือตราสารที่ซื้อ} > (\text{ราคาซื้อ} \times (1 + \text{discount rate}))$$

ทั้งนี้ $\text{ราคาซื้อ} = \text{ราคาที่กองทุนชำระให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งเป็นค่าซื้อหลักทรัพย์หรือตราสารตาม reverse repo}$

4.4 การดำรงมูลค่าของหลักทรัพย์หรือตราสารที่ซื้อ ณ สิ้นวัน ให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังนี้

4.4.1 $\text{มูลค่าของหลักทรัพย์หรือตราสารที่ซื้อ} > (\text{มูลค่า reverse repo} \times (1 + \text{discount rate}))$

4.4.2 ในกรณีที่มูลค่าหลักทรัพย์หรือตราสารที่ซื้อ ณ สิ้นวัน ไม่เป็นไปตามสมการใน 4.4.1 บลจ. ต้องเรียกให้คู่สัญญาโอนกรรมสิทธิ์ในเงิน หรือหลักทรัพย์หรือตราสารที่สามารถใช้ในการทำ reverse repo ให้แก่กองทุน เพื่อให้มูลค่ารวมของหลักทรัพย์หรือตราสารที่ซื้อและทรัพย์สินที่โอนมาดังกล่าวเป็นไปตามวิธีการดังกล่าว ภายในวันทำการถัดจากวันที่มูลค่าหลักทรัพย์หรือตราสารที่ซื้อลดลงกว่าสมการใน 4.4.1 เว้นแต่เป็นกรณีตาม 4.4.3

4.4.3 ในกรณีที่ผลลัพธ์ตามสมการใน 4.4.1 แสดงผลว่ามูลค่าของหลักทรัพย์หรือตราสารที่ซื้อ ณ สิ้นวัน มีมูลค่าน้อยกว่ามูลค่า $reverse\ repo \times (1 + discount\ rate)$ เป็นจำนวนไม่เกิน 5 ล้านบาท หรือไม่เกิน 5% ของราคาซื้อ แล้วแต่จำนวนใดจะต่ำกว่า และมีการกำหนดเรื่องดังกล่าวไว้ในสัญญาซึ่งได้กำหนดโดยพิจารณาถึงปัจจัยความเสี่ยงของคู่สัญญา (counterparty risk) แล้ว บลจ. จะไม่ดำเนินการตาม 4.4.2 ก็ได้

4.5 การคำนวณมูลค่า reverse repo ตาม 4.4 ให้คำนวณดังนี้

4.5.1 จำนวนจากราคาซื้อรวมกับผลประโยชน์ที่กองทุนพึงได้รับจาก reverse repo จนถึงวันที่มีการคำนวณ

4.5.2 จำนวนเป็นรายการธุรกรรม หรือจำนวนรวมเป็นยอดสุทธิของ reverse repo ทุกธุรกรรมที่กองทุนมีอยู่กับคู่สัญญารายเดียวกันและมีข้อตกลงกำหนดให้สามารถบังคับชำระหนี้ตามธุรกรรมใดธุรกรรมหนึ่งจากหลักทรัพย์หรือตราสารที่ซื้อหรือทรัพย์สินที่โอนตาม 4.4.2 (ถ้ามี) ของธุรกรรมที่เกิดจาก reverse repo รายการอื่นได้

4.6 discount rate ที่นำมาใช้ในการคำนวณ ต้องเป็นการกำหนดขึ้นโดยคำนึงถึงปัจจัยความเสี่ยงของคู่สัญญา หลักทรัพย์ หรือตราสารที่ซื้อแล้ว

ส่วนที่ 5 : ธุรกรรมประเภทการให้ยืมหลักทรัพย์ (securities lending)

ต้องเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการลงทุนดังนี้

1. คู่สัญญา ต้องมีคู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งเป็นผู้ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจ SBL โดยในกรณีที่คู่สัญญาดังกล่าวกระทำการในฐานะตัวแทนของผู้ยืม ผู้ยืมต้องเป็นบุคคลดังนี้ที่สามารถประกอบธุรกิจหรือดำเนินกิจการได้ตามกฎหมายไทย

1.1 ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจ SBL

1.2 สปท.

1.3 กองทุนฟื้นฟู

1.4 ธนาคารเพื่อการนำเข้าและการส่งออกแห่งประเทศไทย

1.5 ธพ.

1.6 บง.

1.7 บล.

1.8 บริษัทประกันชีวิต

1.9 กองทุนส่วนบุคคลที่มีมูลค่าทรัพย์สินของผู้ลงทุนแต่ละรายตั้งแต่ 1 ล้านบาทขึ้นไป

1.10 กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ

1.11 นิติบุคคลอื่นตามที่สำนักงานกำหนดเพิ่มเติมโดยอาศัยอำนาจตามข้อ 10 วรรคหนึ่ง (4) ของประกาศ

2. หลักทรัพย์ที่ให้ยืม ต้องเป็นหลักทรัพย์ที่อยู่ในระบบรับฝากหลักทรัพย์ของศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ หรือหลักทรัพย์ที่ สปท. ทำหน้าที่เป็นนายทะเบียนหลักทรัพย์

3. การวางหรือเรียกหลักประกัน บลจ. ต้องดำเนินการดังนี้

3.1 ดำเนินการให้มีการวางหรือเรียกหลักประกันจากผู้ยืมเพื่อเป็นประกันการให้ยืมหลักทรัพย์ โดยต้องเป็นหลักประกันดังนี้

3.1.1 เงินสด

3.1.2 ตราสารภาครัฐไทย

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 วันนับแต่วันออกตัว และเป็นตัวที่ถึงกำหนดใช้เงินเมื่อทวงถามหรือเมื่อได้เห็น

3.1.5 B/E P/N หรือศุภก ที่มีอายุไม่เกิน 90 วันนับแต่วันที่ออก ซึ่งมี credit rating อย่างใดอย่างหนึ่ง ดังนี้

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 ในกรณีที่กองทุนไม่มีนโยบายการลงทุนในตราสารทุน กองทุนจะรับหลักประกันดังกล่าวไม่ได้

3.1.9 หน่วยลงทุนของ MMF

3.2 ดำเนินการให้กองทุนมีกรรมสิทธิ์หรือครอบครองหลักประกันตาม 3.1 หรือดำเนินการโดยวิธีอื่นซึ่งจะมีผลให้ บลจ. สามารถบังคับชำระหนี้เอาจากหลักประกันดังกล่าวได้โดยพลัน

3.3 ห้ามนำหลักประกันตาม 3.1 ที่กองทุนมีกรรมสิทธิ์ไปโอนหรือขายต่อหรือทำให้ไม่สามารถบังคับตามหลักประกันนั้นได้ เว้นแต่เป็นการบังคับชำระหนี้ตามข้อตกลงในธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์นั่นเอง

3.4 ดำรงมูลค่าหลักประกัน ณ สิ้นวัน $\geq 100\%$ ของมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม

3.5 ในกรณีที่หลักประกันเป็นเงินสดให้นำเงินสดดังกล่าวไปลงทุนโดยทันทีในทรัพย์สินดังนี้

3.5.1 เงินฝากใน ธพ. หรือธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น

3.5.2 บัตรเงินฝากหรือ P/N ดังนี้

3.5.2.1 บัตรเงินฝาก หรือ P/N ที่ ธพ. บง. หรือธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น เป็นผู้มีการผูกพัน

3.5.2.2 P/N ที่ TSFC เป็นผู้ออก ที่มีกำหนดวันใช้เงินตามตัวไม่เกิน 270 วันนับแต่วันออกตัว และเป็นตัวที่ถึงกำหนดใช้เงินเมื่อทวงถามหรือเมื่อได้เห็น

3.5.2.3 P/N ที่มีอายุไม่เกิน 90 วันนับแต่วันที่ออก ซึ่งมี credit rating อย่างหนึ่งอย่างใดดังนี้

3.5.2.3.1 มี issue rating หรือ issuer rating อยู่ในอันดับแรก โดยกรณีที่เป็น issuer rating ต้องเป็น credit rating ที่ได้มาจากการจัด credit rating ระยะสั้นด้วย

3.5.2.3.2 มี guarantor rating อยู่ในอันดับ investment grade

3.5.3 ตราสารภาครัฐไทย

3.5.4 reverse repo สำหรับตราสารภาครัฐไทย

4. ลักษณะและสาระสำคัญของสัญญา ให้ใช้สัญญาที่มีลักษณะและสาระสำคัญของสัญญาตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยข้อกำหนดเกี่ยวกับระบบงาน สัญญาเืมและให้เืมหลักทรัพย์และหลักประกันในธุรกรรมการเืมและให้เืมหลักทรัพย์

ส่วนที่ 6 : ธุรกรรมประเภท derivatives ตามหลักเกณฑ์การลงทุนดังนี้

1. ประเภท underlying derivatives ที่กองทุนจะเข้าเป็นคู่สัญญาได้ต้องมี underlying อย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังนี้

1.1 ทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ตามภาคผนวกนี้

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 ดัชนีเงินเพื่อ ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นสินค้าหรือตัวแปรตาม 1.1 - 1.6 หรือ 1.9

1.8 ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นดัชนีตาม 1.7

1.9 underlying อื่นตามที่สำนักงานกำหนดเพิ่มเติมโดยอาศัยอำนาจตามข้อ 10 วรรคหนึ่ง (5) (ก) ของประกาศ

ในกรณีที่ derivatives อ้างอิงกับราคาของ underlying ช่างต้น ราคาที่อ้างอิงดังกล่าวต้องเป็นราคาปัจจุบัน (spot price) หรือราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (futures price) เท่านั้น ทั้งนี้ ราคาของ underlying อื่นที่ไม่ใช่ดัชนี หรือ underlying ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีดังกล่าว ต้องเป็นที่ยอมรับอย่างกว้างขวาง และเปิดเผยไว้อย่างแพร่หลายด้วย

2. เงื่อนไขการลงทุน บลจ. จะดำเนินการลงทุนใน derivatives ได้ต่อเมื่อ

2.1 กรณี MF ได้ระบุเกี่ยวกับการลงทุนใน derivatives และ underlying ของ derivatives ที่จะลงทุนไว้ อย่างชัดเจนในโครงการ

2.2 กรณี PVD บลจ. ได้รับความยินยอมเป็นลายลักษณ์อักษรจากคณะกรรมการ PVD ก่อนการลงทุน โดยในการขอความยินยอมดังกล่าว บลจ. ต้องอธิบายให้คณะกรรมการ PVD เข้าใจถึงลักษณะและความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการลงทุนดังกล่าว รวมทั้งแนวทางการบริหารความเสี่ยงก่อนขอรับความยินยอมด้วย

2.3 เป็นการเข้าเป็นคู่สัญญาใน derivatives อย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้

2.3.1 derivatives on organized exchange

2.3.2 OTC derivatives ดังนี้

2.3.2.1 กรณีเป็น OTC derivatives ในประเทศไทย ต้องมีคู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งเป็น ธพ. ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ตัวแทนซื้อขาย derivatives หรือผู้ค้า derivatives

2.3.2.2 กรณีเป็น OTC derivatives ในต่างประเทศ ต้องมีคู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งเป็นนิติบุคคลที่ได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจ derivatives ที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลโดยหน่วยงานกำกับดูแลด้านหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกสามัญของ IOSCO หรือที่เป็นสมาชิกของ WFE

2.4 ในกรณีที่จะต้องมีการชำระหนี้ด้วยการส่งมอบสินค้าเมื่อ derivatives สิ้นสุดลง สินค้านั้นต้องเป็นทรัพย์สินที่กองทุนสามารถลงทุนได้ ทั้งนี้ ไม่ว่ากองทุนจะเป็นผู้มีสิทธิรับมอบหรือมีหน้าที่ส่งมอบสินค้านั้นก็ตาม

3. หลักเกณฑ์เพิ่มเติมกรณี underlying เป็นดัชนี

ในกรณีที่ derivatives มี underlying เป็นดัชนีตาม 1.7 – 1.8 ดัชนีดังกล่าวต้องมีลักษณะดังนี้

3.1 เป็นดัชนีที่มีการกำหนดวิธีการคำนวณไว้อย่างชัดเจน โดยมีการระบุแหล่งข้อมูลของ underlying หรือปัจจัยต่าง ๆ ที่นำมาใช้ในการคำนวณ และมีการคำนวณดัชนีให้เป็นปัจจุบันตามความเหมาะสมขององค์ประกอบของดัชนี ทั้งนี้ underlying หรือปัจจัยดังกล่าวต้องมีการเคลื่อนไหวตามสภาวะตลาดอย่างเป็นอิสระด้วย

3.2 เป็นดัชนีที่มีลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้

3.2.1 ดัชนีที่มีการกระจายตัวอย่างเพียงพอ โดยเป็นดัชนีที่มีลักษณะใดลักษณะหนึ่งดังนี้

3.2.1.1 ดัชนีที่องค์ประกอบแต่ละตัวมีน้ำหนัก $\leq 20\%$ ของน้ำหนักทั้งหมด

3.2.1.2 ดัชนีที่องค์ประกอบตัวใดตัวหนึ่งมีน้ำหนัก $\leq 35\%$ ของน้ำหนักทั้งหมดในกรณีที่เป็นการไปตามสภาวะตลาด โดยองค์ประกอบตัวอื่นต้องมีน้ำหนักไม่เกินอัตราที่กำหนดใน 3.2.1.1

การพิจารณาการกระจายน้ำหนักตาม 3.2.1.1 และ 3.2.1.2 ไม่ต้องนำองค์ประกอบที่เกี่ยวข้องกับทองคำหรือน้ำมันดิบมาพิจารณา

3.2.2 ดัชนีที่มีองค์ประกอบทั้งหมดเป็นหรือเกี่ยวข้องกับทองคำหรือน้ำมันดิบ หรือเป็น ดัชนีราคาทองคำหรือน้ำมันดิบ

3.2.3 ดัชนีอื่นใดนอกจาก 3.2.1 และ 3.2.2 ที่เป็นไปตามเงื่อนไขครบถ้วนดังนี้

3.2.3.1 เป็นดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นตราสารหรือสัญญาที่กองทุนสามารถลงทุนได้โดยตรง

3.2.3.2 เมื่อคำนวณเงินลงทุนตามสัดส่วน (pro rata) เสมือนหนึ่งว่ากองทุนลงทุนในตราสารหรือสัญญานั้นโดยตรงแล้วได้ผลเป็นไปตามหลักเกณฑ์ single entity limit ของกองทุนนั้น

3.3 เป็นดัชนีที่ได้รับการพัฒนาโดยสถาบันที่มีความน่าเชื่อถือและทำหน้าที่ได้อย่างอิสระจาก บลจ. ทั้งนี้ หากปรากฏว่าสถาบันดังกล่าวเป็นบริษัทในเครือของ บลจ. บลจ. นั้นต้องจัดให้มีมาตรการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์อย่างมีประสิทธิภาพด้วย

3.4 มีการแสดงดัชนีนั้น ๆ อย่างต่อเนื่องเป็นประจำทุกวันทำการผ่านสื่อที่มีการเสนอข้อมูลอย่างทันเหตุการณ์

3.5 ในกรณีที่เป็นดัชนีกลุ่มสินค้าโภคภัณฑ์ ดัชนีดังกล่าวต้องคำนวณจากตัวแปรอย่างหนึ่งอย่างใดหรือหลายอย่างดังนี้

3.5.1 ราคาปัจจุบัน (spot price) หรือราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (futures price) ของสินค้าโภคภัณฑ์

3.5.2 ดัชนีสินค้าโภคภัณฑ์ที่คำนวณจากราคาปัจจุบัน (spot price) หรือราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (futures price) ของสินค้าโภคภัณฑ์สินค้าใดสินค้าหนึ่ง

3.5.3 ราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อ้างอิงกับดัชนีสินค้าโภคภัณฑ์ตาม 3.5.2

3.6 ในกรณีที่เป็นดัชนีเงินเพื่อ ดัชนีดังกล่าวต้องคำนวณโดยใช้แหล่งข้อมูลอ้างอิงจากรายงานของหน่วยงานราชการของประเทศไทยหรือต่างประเทศ หรือคำนวณจากราคาสินค้าและบริการที่ บลจ. แสดงให้เห็นได้ว่าวิธีการคำนวณของผู้พัฒนาดัชนีดังกล่าวสามารถสะท้อนอัตราเงินเฟ้อได้อย่างเหมาะสม

4. หลักเกณฑ์การจัดให้มีทรัพย์สินที่เพียงพอต่อการชำระหนี้ตามภาระผูกพัน (cover rule)

บลจ. ต้องจัดให้มีทรัพย์สินของกองทุนที่มีคุณภาพและมีสภาพคล่องในจำนวนที่เพียงพอต่อภาระที่กองทุนอาจต้องชำระหนี้ตามข้อตกลงเมื่อ derivatives สิ้นสุดลงไว้ตลอดเวลาที่ได้ลงทุนใน derivatives นั้น และเป็นไปตามที่สำนักงานกำหนดโดยอาศัยอำนาจตามข้อ 10 วรรคหนึ่ง (5) (ข) ของประกาศ

5. หลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับการลงทุนที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการลดความเสี่ยง

ในกรณีที่ บลจ. ลงทุนใน derivatives ที่ underlying ไม่ใช่สิ่งเดียวกับทรัพย์สินที่จะลดความเสี่ยง การลงทุนใน derivatives ดังกล่าวต้องเป็นไปตามที่สำนักงานกำหนดโดยอาศัยอำนาจตามข้อ 10 วรรคหนึ่ง (5) (ค) ของประกาศ

6. หลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับการลงทุนใน OTC derivatives

6.1 บลจ. ต้องจัดให้มีข้อตกลงใน OTC derivatives ดังนี้

6.1.1 ให้คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งคำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมของ derivatives ให้ บลจ. ทราบทุกวันที่ 15 และวันสุดท้ายของแต่ละเดือน ทั้งนี้ ในกรณีที่วันดังกล่าวเป็นวันหยุดทำการของ บลจ. ให้คำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมภายในวันทำการถัดไป

6.1.2 ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อราคาของ derivatives อย่างมีนัยสำคัญให้คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งคำนวณและแจ้งมูลค่ายุติธรรมของ derivatives ให้ บลจ. ทราบทันที

6.1.3 คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งยินยอมให้มีการล้างฐานะ derivatives เมื่อ บลจ. ร้องขอได้

6.2 กรณี PVD ที่มีนโยบายการลงทุนใน OTC derivatives เกินกว่า 20% ของ NAV ให้ บลจ. แจ้งเป็นลายลักษณ์อักษรให้คณะกรรมการ PVD ทราบถึงนโยบายการลงทุนดังกล่าวและอัตราส่วนการลงทุนที่อาจเกิดขึ้นได้สูงสุดใน OTC derivatives นั้นตามนโยบายการลงทุน ในการขอรับความยินยอมตาม 2.2 ด้วย

7. หลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับการเข้าเป็นคู่สัญญาใน credit derivatives

บลจ. ต้องปฏิบัติตามเงื่อนไขดังนี้

7.1 เข้าเป็นคู่สัญญาใน credit derivatives ได้เฉพาะเพื่อการลดความเสี่ยงเท่านั้น

7.2 เข้าเป็นคู่สัญญาได้เฉพาะ credit derivatives ที่มีลักษณะของธุรกรรมหรือเทียบเคียงกับธุรกรรมอย่างหนึ่งอย่างใด ดังนี้

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 ซึ่งจะมีการชำระราคากันเฉพาะในส่วน of สินทรัพย์รายนั้น แต่

ข้อตกลงจะครบกำหนดเมื่อเกิด credit event ขึ้นกับ obligation ทุกรายการในกลุ่ม (Proportionate Credit Default Swap)

7.2.2 Total Rate of Return Swap : ซึ่งได้แก่ การตกลงในฐานะผู้ซื้อประกันความเสี่ยงของสินทรัพย์อ้างอิงที่เกิดจากการลดลงของผลตอบแทนที่จะได้รับจากสินทรัพย์อ้างอิง โดยผู้ขายประกันความเสี่ยงมีภาระผูกพันที่จะจ่ายผลตอบแทนในอัตราดอกเบี้ยที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ยตามที่จะตกลงกัน และส่วนที่ลดลง (ถ้ามี) ของมูลค่ายุติธรรมของสินทรัพย์อ้างอิง เพื่อแลกกับการที่ผู้ซื้อประกันความเสี่ยงจะโอนผลตอบแทนและส่วนที่เพิ่มขึ้น (ถ้ามี) ของมูลค่ายุติธรรมของสินทรัพย์อ้างอิงให้กับผู้ขายประกันความเสี่ยง จนกว่าจะเกิด credit event หรือครบกำหนดสัญญา (กรณีไม่เกิด credit event)

7.3 ต้องใช้สัญญามาตรฐานตามที่กำหนดโดย International Swaps and Derivatives Association (ISDA) หรือสัญญามาตรฐานอื่นตามที่สำนักงานยอมรับ ซึ่งมีข้อตกลงที่มีลักษณะดังนี้

7.3.1 มีผลใช้บังคับได้ตามกฎหมาย และไม่ขัดหรือแย้งกับกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์หรือกฎหมายอื่น

7.3.2 ไม่มีข้อกำหนดที่ทำให้สิทธิที่กำหนดไว้ในตราสารหนี้หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็น credit derivatives นั้นอ้างอิงเสื่อมเสียไป

7.3.3 ไม่มีข้อกำหนดให้กองทุนต้องชดใช้ความเสียหายให้แก่คู่สัญญา

ส่วนที่ 7 : หลักทรัพย์ประเภททองคำแท่ง (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนเพื่อกองทุนรวมทองคำ)

การลงทุนในทองคำแท่งต้องเป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังนี้

1. ทองคำแท่งที่ลงทุนต้องมีมาตรฐานและผ่านการรับรองจากหน่วยงานซึ่งเป็นที่ยอมรับในอุตสาหกรรมผู้ค้าทองคำในประเทศไทยหรือในระดับสากล ทั้งนี้ การรับรองดังกล่าวอาจเป็นการรับรองที่ทองคำแท่งหรือที่ผู้ผลิตทองคำแท่งก็ได้
2. มีราคาที่เปิดเผยไว้อย่างแพร่หลายโดยหน่วยงานซึ่งเป็นที่ยอมรับในอุตสาหกรรมในประเทศไทยหรือในระดับสากล

ส่วนที่ 8 : หลักทรัพย์ประเภทหน่วย private equity

การลงทุนในหน่วย private equity ต้องเป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังนี้

1. กรณีที่เป็นการลงทุนเพื่อกองทุนรวมวายุภักษ์ ให้ บลจ. กำหนดคุณสมบัติของหน่วย private equity ให้สอดคล้องกับวัตถุประสงค์ของกองทุนรวมวายุภักษ์ไว้อย่างชัดเจน โดยระบุในโครงการและเปิดเผยข้อมูลไว้ในหนังสือชี้ชวนด้วย
2. กรณีที่เป็นการลงทุนเพื่อกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีไชรายย่อยหรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้ บลจ. ลงทุนในหน่วย private equity ที่มีคุณสมบัติและเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการลงทุนเช่นเดียวกับข้อกำหนดสำหรับตราสาร TS ในส่วนที่ 1 ข้อ 1.1 ข้อ 1.2 และข้อ 1.3

ในกรณีกองทุนรวมเข้าผูกพันตามข้อตกลงกับกิจการเงินร่วมลงทุน (private equity) ให้ บลจ. ลงทุนในหน่วย private equity ได้ โดยต้องไม่มีข้อกำหนดหรือเงื่อนไขที่ทำให้ผู้ลงทุนเข้าผูกพันมากกว่าข้อตกลงจำนวนเงินขั้นต่ำที่จะลงทุน

ส่วนที่ 9 : ทรัพย์สินประเภทโทเคนดิจิทัล (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนเพื่อกองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน)

การลงทุนในโทเคนดิจิทัลต้องเป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

1. ต้องเป็นโทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุน (investment token) หรือโทเคนดิจิทัลเพื่อการใช้ประโยชน์ (utility token) ไม่พร้อมใช้ ที่ออกตามพระราชกำหนดว่าด้วยการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล
2. โทเคนดิจิทัลตาม 1. ต้องมีลักษณะเป็นโทเคนดิจิทัลดังนี้
 - 2.1 โทเคนดิจิทัลสำหรับโครงการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (green-project token)
 - 2.2 โทเคนดิจิทัลสำหรับโครงการที่เกี่ยวข้องด้านความยั่งยืน (sustainability-project token)
 - 2.3 โทเคนดิจิทัลเพื่อส่งเสริมความยั่งยืน (sustainability-linked token)
3. ต้องมีการเปิดเผยข้อมูลในแบบแสดงรายการแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายโทเคนดิจิทัลในเรื่อง ดังนี้
 - 3.1 กรณีเป็นโทเคนดิจิทัลสำหรับโครงการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือโทเคนดิจิทัลสำหรับโครงการที่เกี่ยวข้องด้านความยั่งยืน ต้องมีการเปิดเผยวัตถุประสงค์การใช้เงินที่ได้จากการระดมทุน (use of proceeds) ว่าเป็นไปเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมหรือเพื่อโครงการที่เกี่ยวข้องกับความยั่งยืนของประเทศไทย แล้วแต่กรณี
 - 3.2 กรณีเป็นโทเคนดิจิทัลเพื่อส่งเสริมความยั่งยืนต้องมีการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการกำหนดตัวชี้วัดและเป้าหมายด้านความยั่งยืนเพื่อส่งเสริมความยั่งยืนของผู้ออกโทเคนดิจิทัลดังกล่าวในประเทศไทย
4. หลักเกณฑ์เกี่ยวกับลักษณะของโทเคนดิจิทัลตาม 2. เพิ่มเติม ทั้งนี้ ตามที่สำนักงานประกาศกำหนดโดยความเห็นชอบของคณะกรรมการกำกับตลาดทุน