

รายงานการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม ประจำปี 2566

เพื่อให้เป็นไป ตามมาตรา 124/1 แห่ง พ.ร.บ. หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมในปี 2562 และ ทธ. 35/2566 ทางบริษัทได้จัดทำแนวทางในการดำเนินการเพื่อใช้ในการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวมในเรื่อง การกระทำที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ การกระทำที่อาจมีลักษณะไม่เป็นธรรม และการกระทำที่อาจ ทำให้ผู้ถือหน่วยลงทุนเสียประโยชน์อันพึงได้รับ ซึ่งได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการบริษัทในการประชุมครั้งที่ 1/2565 เมื่อวันที่ 24 กุมภาพันธ์ 2565 โดยได้มอบหมายให้ส่วนกำกับและควบคุมภายใน ซึ่งมีความเป็นอิสระจากฝ่ายจัดการ เป็นผู้ติดตามดูแล ดังกล่าว

บริษัทได้จัดทำรายงานการติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม ประจำปี 2566 โดยมีหัวข้อดังต่อไปนี้

1. การซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงินกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง การซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาด ทุนและ ตราสารทางการเงินที่ไม่มีราคาตลาดหรือไม่มีสภาพคล่อง

- วิธีการติดตามดูแล

ตรวจสอบรายการซื้อขายกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง และเหตุผลในการทำธุรกรรม ตรวจสอบการ ซื้อขายระหว่างบริษัทในเครือกับกองทุน หรือ ระหว่างกองทุนภายใต้การจัดการ รวมถึงตรวจสอบความ เหมาะสมของราคาที่ใช้ในการทำธุรกรรมและการซื้อขายที่ไม่มีราคาตลาดหรือไม่มีสภาพคล่องกับ บุคคลที่เกี่ยวข้อง

- ผลการติดตามดูแล และแนวทางการแก้ไข

การทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง และตราสารทางการเงินที่ไม่มีราคาตลาดหรือไม่มีสภาพ คล่อง เป็นไปตามเกณฑ์ที่กำหนดไว้ เป็นธุรกรรมที่เป็นประโยชน์และจำเป็นสำหรับกองทุน ทั้งนี้ราคาที่ใช้ ในการทำธุรกรรมเป็นราคาที่เหมาะสมตามเกณฑ์ที่กำหนดไว้

2. วิธีการบริหารจัดการกองทุนเป็นไปตามที่เปิดเผยแก่ผู้ลงทุน

- วิธีการติดตามดูแล

ตรวจสอบการลงทุนว่าเป็นไปตามนโยบายและวัตถุประสงค์การลงทุนที่เปิดเผยในโครงการ และ ตรวจสอบการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน รวมถึงการตรวจ portfolio turnover ว่าสอดคล้องกับ management style ที่ได้เปิดเผยไว้

- ผลการติดตามดูแล และแนวทางการแก้ไข

จากการสอบทานนโยบายการลงทุนของกองทุนกับพอร์ตการลงทุนพบว่าการลงทุนของ กองทุนเป็นไปตามวัตถุประสงค์ นโยบาย และกลยุทธ์ การลงทุนที่ระบุในหนังสือชี้ชวน

3. การคัดเลือกและติดตามการให้บริการของผู้ให้บริการ

- วิธีการติดตามดูแล

สอบทานการคัดเลือกและคุณสมบัติของผู้ให้บริการให้เป็นไปตามที่ประกาศกำหนดและตามสัญญาที่ได้ตกลงกันได้ และสอบทานการประเมินคุณภาพการให้บริการตามรอบระยะเวลา รวมไปถึงการตรวจสอบความเหมาะสมของผู้ชำระบัญชีของกองทุนทั้งในด้านคุณสมบัติและค่าใช้จ่าย

- ผลการติดตามดูแล และแนวทางการแก้ไข

จากการตรวจสอบพบว่าทางผู้ให้บริการในการลงทุนต่างประเทศ มีคุณสมบัติเป็นไปตามที่กำหนดและมีการปฏิบัติเป็นไปตามสัญญา และบริษัทได้รับเป็นผู้ชำระบัญชีของกองทุนภายใต้การจัดการโดยมีคุณสมบัติในการเป็นผู้ชำระบัญชีและมีค่าใช้จ่ายในการชำระบัญชีที่เหมาะสม

4. การส่งคำสั่งซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนและตราสารทางการเงิน

- วิธีการติดตามดูแล

สอบทานการคัดเลือก Broker/Dealer ให้เป็นไปตามเกณฑ์ และอยู่ในสัดส่วนที่ได้รับการอนุมัติ รวมทั้งติดตามการ churning ของกองทุน

- ผลการติดตามดูแล และแนวทางการแก้ไข

จากการตรวจสอบพบว่าบริษัทมีการคัดเลือก/ประเมินผลบริษัทนายหน้าค้าหลักทรัพย์และคู่ค้าตราสารหนี้เป็นไปตามที่กำหนดในนโยบายที่เกี่ยวกับการบริหารจัดการกองทุน รวมถึงการส่งคำสั่งผ่านบริษัทนายหน้าค้าหลักทรัพย์/คู่ค้า เป็นไปตามเกณฑ์ที่กำหนด

5. การจัดเก็บค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายของกองทุนรวมและผู้ถือหน่วยลงทุน

- วิธีการติดตามดูแล

ตรวจสอบค่าใช้จ่ายที่เรียกเก็บจากกองทุน ว่าเกินอัตราสูงสุดที่กำหนดในโครงหรือไม่และตรวจสอบการเปิดเผยค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายให้ผู้ถือหน่วย

- ผลการติดตามดูแล และแนวทางการแก้ไข

จากการตรวจสอบพบว่าบริษัทเก็บค่าธรรมเนียมเป็นไปตามที่ระบุในโครงการและมีการเปิดเผยค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายอย่างครบถ้วนและถูกต้อง

6. การใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นหลักทรัพย์

- วิธีการติดตามดูแล

สอบทานแนวทางในการไปใช้สิทธิออกเสียงแทนกองทุน และตรวจสอบการใช้สิทธิออกเสียงว่าครบถ้วนทุกหลักทรัพย์หรือไม่ และมีการพิจารณาการใช้สิทธิออกเสียงตามแนวทางที่กำหนด รวมถึงการตรวจสอบการเปิดเผยข้อมูล แนวทางในการใช้สิทธิออกเสียงและการรายงานการใช้สิทธิออกเสียงต่อผู้ลงทุน

- ผลการติดตามดูแล และแนวทางการแก้ไข

จากการตรวจสอบพบว่าบริษัทมิได้มอบฉันทะให้ไปใช้สิทธิออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นหลักทรัพย์จำนวน 10 หลักทรัพย์ ซึ่งได้มีการรายงานในที่ประชุมคณะกรรมการลงทุนรับทราบ โดยฝ่ายบริหารความเสี่ยงได้มีการกำชับให้มีการปฏิบัติงานด้วยความระมัดระวัง และปฏิบัติให้เป็นไปตามแนวปฏิบัติที่กำหนดไว้ อย่างไรก็ตาม หลักทรัพย์ที่มิได้มีการมอบฉันทะไปใช้สิทธิออกเสียงเหล่านั้น ไม่ได้มีผลมติที่ขัดแย้งกับนโยบายการใช้สิทธิออกเสียงของบริษัทแต่อย่างใด ส่วนหลักทรัพย์ที่มีการมอบฉันทะมีการใช้สิทธิเป็นไปตามนโยบายฯ ของบริษัทและมีการเปิดเผยแนวทางการใช้สิทธิออกเสียงและการดำเนินการให้สิทธิออกเสียงที่เว็บไซต์ของบริษัท

7. การทำหน้าที่ของผู้ติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม ในกรณีที่มีการขอมติพิเศษจากผู้ถือหุ้นรายละ

- วิธีการติดตามดูแล

บริษัทมีการกำหนดให้ผู้ติดตามดูแลการจัดการกองทุนรวม ต้องให้ความเห็นในกรณีที่มีการขอมติพิเศษ (เกินกว่าร้อยละ 75 ของจำนวนสิทธิออกเสียงของผู้ถือหุ้นรายละ) จากผู้ถือหุ้นรายละ เช่น กรณีที่มีการขอแก้ไขเพิ่มเติมโครงการจัดการกองทุนรวม เป็นต้น เพื่อเป็นข้อมูลประกอบการตัดสินใจให้กับผู้ถือหุ้นรายละ

- ผลการติดตามดูแล และแนวทางการแก้ไข

ปี 2566 ส่วนกำกับและควบคุมภายใน ซึ่งทำหน้าที่ผู้ติดตามดูแล ได้มีการระบุความเห็นในกรณีที่มีการขอมติพิเศษจากผู้ถือหุ้นรายละ จำนวน 2 ครั้ง ดังนี้

1. เป็นการให้ความเห็นในการแก้ไขเพิ่มเติมโครงการจัดการกองทุน ให้กองทุนสามารถเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้ เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารจัดการกองทุน (efficient portfolio management (EPM)) จำนวน 10 กองทุน
2. เป็นการให้ความเห็นในการขอมติเพื่อรวมกองทุนและแก้ไขโครงการจัดการกองทุน และขอมติเพื่อรวมกองทุนและเลิกกองทุน

จัดทำโดย	ส่วนกำกับและควบคุมภายใน ฝ่ายตรวจสอบและบริหารความเสี่ยง บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน อีเอสเอสปริง (ประเทศไทย) จำกัด
นำเสนอ	คณะกรรมการบริษัทฯ ในการประชุมครั้งที่ 1/2567
วันที่	27 กุมภาพันธ์ 2567