

การปฏิบัติที่ไม่เป็นไปตามโครงการ

กองทุนเปิดไทยทวิตราสารหนี้ (TSA)

วันที่ 30 มีนาคม 2550

กองทุนเปิดไทยทวิตราสารหนี้ (TSA) ลงทุนไม่เป็นไปตามโครงการกำหนด

1. ลักษณะความผิด

ในวันที่ 27 มีนาคม 2550 กองทุน TSA ได้ลงทุนในบัญชีเงินฝากออมทรัพย์ของธนาคารทีสโก้ จำกัด (มหาชน) ชั่วคราวเพื่อรอการลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น ทำให้อัตราส่วนการลงทุนคิดเป็นร้อยละ 25.09 ของ NAV (ตามโครงการกำหนดให้ลงทุนได้ไม่เกินร้อยละ 25 ของ NAV)

2. สาเหตุ

เกิดจากกองทุนอยู่ในช่วงการขายคืนหน่วยลงทุน ทำให้ NAV ของกองทุนเคลื่อนไหวต่างไปจากที่ผู้จัดการกองทุนใช้ประมาณการในการคำนวณอัตราส่วนการลงทุน ซึ่งต้องส่งคำสั่งการลงทุนล่วงหน้า 1 วัน ตามวิธีปฏิบัติโดยปกติ

3. การแก้ไขของบริษัท

ผู้จัดการกองทุนได้ปรับลดการลงทุนดังกล่าวให้อยู่ภายใต้อัตราส่วนตามที่โครงการกำหนดในทันทีที่พบความผิดพลาดโดยคำนึงถึงผลประโยชน์ต่อกองทุนและผู้ถือหน่วยลงทุนเป็นสำคัญ โดยได้ปรับลดอัตราส่วนดังกล่าวเหลือร้อยละ 1.02 ของ NAV เรียบร้อยแล้วในวันที่ 28 มีนาคม 2550 บริษัทได้เพิ่มมาตรการป้องกันและปรับปรุงหลักปฏิบัติภายในในการลงทุนเพื่อป้องกันและเป็นการสอบทานไม่ให้เกิดการเกินอัตราส่วนดังกล่าวข้างต้นขึ้นอีก

4. จำนวนผลกำไรหรือค่าชดเชยที่จ่ายให้

บริษัทได้ดำเนินการตรวจสอบผลกระทบที่อาจเกิดขึ้นจากความผิดพลาดที่เกิดขึ้น พบว่าไม่เกิดผลกระทบต่อกองทุนและผู้ถือหน่วยลงทุน รวมทั้งไม่เกิดผลกระทบต่อมูลค่าหน่วยลงทุนอย่างมีนัยสำคัญ