

นโยบายการลงทุน ปี 2556

สำหรับตราสารทุน (EGAT 2)

กองทุนสำรองเลี้ยงชีพพนักงานการไฟฟ้าฝ่ายผลิตแห่งประเทศไทย ซึ่งจดทะเบียนแล้ว

หลักการและวัตถุประสงค์

1. สร้างความเจริญเติบโตของเงินลงทุนในระยะยาว แต่มีค่าความผันผวนในระดับสูง
2. มีความเสี่ยงในการลงทุนสูง เพื่อให้ได้ผลตอบแทนในระดับที่สูงในระยะยาว
3. ลงทุนโดยอิงการวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานทั้งเชิงคุณภาพและเชิงปริมาณของหลักทรัพย์/ทรัพย์สิน รวมทั้งภาวะเศรษฐกิจและปัจจัยแวดล้อมอื่นๆ
4. บริหารงานอย่างมีประสิทธิภาพและโปร่งใส เพื่อประโยชน์สูงสุดของสมาชิก

ประเภทหลักทรัพย์ อายุตราสาร และสัดส่วนการลงทุน

ประเภทหลักทรัพย์กลุ่มที่ 1

1. พันธบัตรรัฐบาล , ตัวเงินคลัง
2. พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย
3. พันธบัตรกองทุนฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน
4. พันธบัตรที่กระทรวงการคลังเป็นผู้รับอาวัล หรือผู้ค้ำประกัน
5. พันธบัตรรัฐวิสาหกิจไทย
 - สัดส่วนการลงทุน : แต่ละรัฐวิสาหกิจไม่เกินร้อยละ 5 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
6. พันธบัตรธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น
 - ผู้ออก : ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร ธนาคารอาคารสงเคราะห์ ธนาคารออมสิน ธนาคารพัฒนาวิสาหกิจขนาดกลางและขนาดย่อม ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย
 - สัดส่วนการลงทุน : แต่ละธนาคารไม่เกินร้อยละ 5 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

ประเภทหลักทรัพย์กลุ่มที่ 2

เงินฝาก บัตรเงินฝาก ตั๋วสัญญาใช้เงินและตั๋วแลกเงิน

1. ผู้ออก : ธนาคารพาณิชย์ ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้
อาวัล หรือผู้สลักหลัง โดยไม่มีข้อจำกัดความรับผิด
 - อายุ : อายุไม่เกิน 1 ปี
 - สัดส่วนการลงทุน : แต่ละธนาคารไม่เกินร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
2. ผู้ออก : รัฐวิสาหกิจไทย
 - อายุ : อายุไม่เกิน 1 ปี
 - สัดส่วนการลงทุน : แต่ละรัฐวิสาหกิจไม่เกินร้อยละ 5 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
3. ผู้ออก : สหกรณ์ออมทรัพย์การไฟฟ้าฝ่ายผลิตแห่งประเทศไทย
 - อายุ : อายุไม่เกิน 1 ปี
 - สัดส่วนการลงทุน : ไม่เกินร้อยละ 5 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

ประเภทหลักทรัพย์กลุ่มที่ 3

1. หุ้นกู้ ต้องได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือใน 4 อันดับแรก (Category) จากสถาบันจัด
อันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงาน ก.ล.ต. ยกเว้นหุ้นกู้อนุพันธ์ (Structured Note) ต้องขอ
อนุมัติคณะกรรมการกองทุนก่อนการลงทุน
 - 1.1 ผู้ออก : ธนาคารพาณิชย์
 - สัดส่วนการลงทุน : แต่ละธนาคารไม่เกินร้อยละ 5 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
 - 1.2 ผู้ออก : บริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ บริษัทมหาชนจำกัด
 - สัดส่วนการลงทุน : ไม่เกินร้อยละ 3 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
2. ตั๋วสัญญาใช้เงินและตั๋วแลกเงินบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์
 - ผู้ออก : บริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ซึ่งได้รับการจัด
อันดับความน่าเชื่อถือใน 4 อันดับแรก (Category) จากสถาบันจัดอันดับความ
น่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงาน ก.ล.ต.
 - อายุ : อายุไม่เกิน 270 วัน
 - สัดส่วนการลงทุน : แต่ละบริษัทไม่เกินร้อยละ 3 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

สัดส่วนการลงทุนรวมของประเภทหลักทรัพย์กลุ่มที่ 1 กลุ่มที่ 2 และกลุ่มที่ 3

ลงทุนในหลักทรัพย์และทรัพย์สิน กลุ่มที่ 1 กลุ่มที่ 2 และกลุ่มที่ 3 รวมกันโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่เกินกว่าร้อยละ 35 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

Duration เฉลี่ยกลุ่มที่ 1 ถึงกลุ่มที่ 3 ไม่เกิน 1 ปี

ประเภทหลักทรัพย์กลุ่มที่ 4

1. หุ้นสามัญ

- สัดส่วนการลงทุน : หุ้นแต่ละบริษัทไม่เกินร้อยละ 15 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

2. ใบสำคัญแสดงสิทธิซื้อหุ้นสามัญของบริษัทที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

- สัดส่วนการลงทุน : ใบสำคัญแสดงสิทธิซื้อหุ้นสามัญแต่ละบริษัทไม่เกินร้อยละ 0.5 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ และใบสำคัญแสดงสิทธิซื้อหุ้นสามัญของทุกบริษัทรวมกันไม่เกินร้อยละ 3 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

3. หน่วยลงทุนกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ให้ลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และมีส่วนลดจากราคา NAV เท่านั้น

- สัดส่วนการลงทุน : แต่ละกองทุนรวมไม่เกินร้อยละ 2 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ และรวมกันทุกกองทุนรวมไม่เกินร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

4. หน่วยลงทุนกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐานที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

- สัดส่วนการลงทุน : แต่ละกองทุนรวมไม่เกินร้อยละ 2 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ และรวมกันทุกกองทุนรวมไม่เกินร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ

สัดส่วนการลงทุนรวมของประเภทหลักทรัพย์กลุ่มที่ 4

ลงทุนในหลักทรัพย์และทรัพย์สิน กลุ่มที่ 4 ข้อ 1 และข้อ 2 โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ โดยกองทุนอาจลงทุนในหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในกลุ่มที่ 4 ในข้อดังกล่าว เฉลี่ยในรอบปีบัญชีต่ำกว่าร้อยละ 65 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิได้ ในกรณีเหตุการณ์ดังนี้

1. วิกฤตการณ์ทางเศรษฐกิจที่มีนัยสำคัญต่อการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์
2. ภาวะสงคราม
3. ราคาตลาดของหลักทรัพย์ลดลงอย่างรุนแรงในช่วงที่ใกล้กับวันสิ้นรอบปีบัญชี เป็นเหตุให้บริษัทจัดการไม่สามารถปรับการลงทุนได้ทันก่อนสิ้นปีบัญชี

ทั้งนี้จะรายงานเหตุผลให้คณะกรรมการกองทุนทราบ

สัดส่วนการลงทุนในแต่ละสถาบันหรือแต่ละบริษัท รวมทุกประเภทหลักทรัพย์ของกลุ่มที่ 1 ถึงกลุ่มที่ 4

สถาบัน/บริษัท	สัดส่วนการลงทุนต่อมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ
รัฐบาลไทย	ไม่เกินร้อยละ 20
ธนาคารแห่งประเทศไทย	ไม่เกินร้อยละ 20
กองทุนฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน	ไม่เกินร้อยละ 20
ธนาคารพาณิชย์ไทยและต่างประเทศ	ไม่เกินร้อยละ 15
ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น	ไม่เกินร้อยละ 15
รัฐวิสาหกิจไทย	ไม่เกินร้อยละ 15
บริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์	ไม่เกินร้อยละ 15
สหกรณ์ออมทรัพย์การไฟฟ้าฝ่ายผลิตแห่งประเทศไทย	ไม่เกินร้อยละ 5

ข้อกำหนดเพิ่มเติม

- ◆ การลงทุนในหลักทรัพย์อื่นหรือเงื่อนไขอื่นใดนอกเหนือจากที่กำหนดไว้ในนโยบายการลงทุนนี้ ต้องได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการกองทุนก่อนการลงทุน
- ◆ การลงทุนในหลักทรัพย์ที่คณะกรรมการได้อนุมัติให้มีการลงทุนไว้ก่อนหน้า ซึ่งไม่ได้กำหนดประเภทหลักทรัพย์ไว้ในนโยบายการลงทุนฉบับปัจจุบัน ให้ถือว่าเป็นการลงทุนที่ถูกต้องแล้ว
- ◆ กรณีที่อัตราส่วนการลงทุนไม่เป็นไปตามนโยบายการลงทุน บริษัทจัดการจะต้องรายงานเหตุการณ์ดังกล่าวให้คณะกรรมการทราบ และปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานกต. ประกาศกำหนด
- ◆ บริษัทจัดการจะต้องได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการและปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานกต. ประกาศกำหนด ในกรณี หลักทรัพย์ใดที่กองทุนได้รับมาโดยมิได้เกิดจากการตัดสินใจลงทุน เช่น การแปลงหนี้เป็นทุน การรับชำระหนี้ที่ผู้ออกตราสารผิดนัดชำระหนี้ ให้ถือเป็นหลักทรัพย์เพื่อการลงทุน จนกว่าจะจำหน่ายหลักทรัพย์ดังกล่าวได้ในราคาที่เหมาะสมเพื่อประโยชน์ของกองทุน