

## 5. รางวัลบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนยอดเยี่ยม (Best Asset Management Company Award)

### กรอบในการคัดเลือก

รางวัลบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนยอดเยี่ยมมอบให้แก่บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน (บลจ.) ที่มีผลงานโดยรวมยอดเยี่ยมโดยพิจารณาจากผลตอบแทนจากการดำเนินงานในการบริหารกองทุนอย่างน้อยจาก 2 ประเภทของกองทุน คือ กองทุนตราสารทุนและกองทุนตราสารหนี้ ในกรณีที่บริษัทมีกองทุนผสมก็จะนำมาพิจารณาด้วย ซึ่งวิธีการพิจารณาดังกล่าวจะดูจากผลตอบแทนที่เหนือกว่าค่าเฉลี่ยโดยรวมเมื่อเทียบกับความเสี่ยง (Composite of Relative Risk Adjusted Return) ของกองทุนแต่ละประเภทแล้วนำมาเรียงลำดับปรับปรุง และหากค่าเฉลี่ยผลตอบแทนของทุกกองทุนในแต่ละบริษัท นอกจากประเด็นดังกล่าวข้างต้นแล้วจะมีการพิจารณาเกี่ยวกับจำนวนกองทุนที่มีอยู่ให้เป็นทางเลือกกับนักลงทุน ความสามารถในการระดมเงินจากการขายหน่วยลงทุน และการที่บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนปฏิบัติตามกฎเกณฑ์หรือข้อบังคับต่างๆ ที่วางไว้ได้อย่างเหมาะสม

### การแบ่งประเภทและจำนวนรางวัล

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนยอดเยี่ยม (Best Asset Management Company) จำนวน 1 รางวัล

### ระบบการให้คะแนน

ใช้ระบบการให้คะแนนที่ทำการแปลงเกณฑ์วัดเชิงปริมาณและเชิงคุณภาพให้อยู่รูปคะแนนตั้งแต่ 1 ถึง 5 ซึ่งการจัดอันดับจะอ้างอิงจากระดับคะแนนเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของเกณฑ์ย่อยแต่ละปัจจัยตามน้ำหนักที่ระบุไว้

### ขั้นตอนการพิจารณา

#### 1. การคัดกรองคุณสมบัติ

- เป็นบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนที่มีกองทุนตราสารทุนและกองทุนตราสารหนี้

#### 2. การคัดเลือก

- พิจารณาคัดเลือกด้วยเกณฑ์เชิงปริมาณและเชิงคุณภาพ ตามรายละเอียดเกณฑ์การคัดเลือก
- ประมวลผลข้อมูล สรุปเป็นผลคะแนนและจัดอันดับ
- คัดเลือกบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนที่มีผลคะแนนสูงสุด 5 อันดับ

#### 3. การพิจารณาตัดสินรางวัล

คณะกรรมการผู้ทรงคุณวุฒิพิจารณาประเด็นอื่นๆ ประกอบผลการจัดอันดับคะแนน เพื่อคัดเลือกผู้ที่มีความเหมาะสมที่สุดในการได้รับรางวัลบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนยอดเยี่ยม

รายละเอียดเกณฑ์การคัดเลือก

● เกณฑ์เชิงปริมาณ

เกณฑ์	รายละเอียดการพิจารณา
ค่าเฉลี่ยผลตอบแทน กองทุนของแต่ละบริษัท (น้ำหนักร้อยละ: 65)	พิจารณาจากผลตอบแทนของปีล่าสุด <u>ขั้นตอนที่ 1</u> ภา Relative Risk Adjusted Return ในกองทุนแต่ละประเภทของแต่ละบริษัท ณ สิ้นปีล่าสุด โดยวิธีการพิจารณาคงจากผลตอบแทนที่เหนือกว่าค่าเฉลี่ยโดยรวมเมื่อเทียบกับความเสี่ยง (Composite of Relative Risk Adjusted Return) ของกองทุนแต่ละประเภท <u>ขั้นตอนที่ 2</u> ภา Adjusted Mean Score ของแต่ละบริษัท ในขั้นนี้เป็นการรวมคะแนนจากกองทุนแต่ละประเภทเข้าด้วยกันโดยการนำค่า Relative Risk Adjusted Return ที่ได้ของแต่ละกองทุนในแต่ละประเภทผ่านกระบวนการจัดอันดับและกระบวนการทางสถิติจนได้ค่า Adjusted Mean Score จากนั้นจัดอันดับบริษัทตามคะแนน Adjusted Mean Score ที่ได้
จำนวนกองทุน (น้ำหนักร้อยละ: 10)	พิจารณาจากจำนวนกองทุนที่มีอยู่ ณ สิ้นปี (3 ปีล่าสุด) ซึ่งเป็นตัวบ่งชี้ถึงทางเลือกที่มีให้กับนักลงทุน
ความสามารถในการระดมเงินลงทุน (น้ำหนักร้อยละ: 10)	พิจารณาจากจำนวนเงินลงทุนสุทธิที่ระดมทุนได้ (3 ปีล่าสุด) ซึ่งเป็นตัวบ่งชี้ถึงความไว้วางใจและชื่อเสียงของบริษัท

● เกณฑ์เชิงคุณภาพ

เกณฑ์	รายละเอียดการพิจารณา
การปฏิบัติและดำเนินการอย่างเหมาะสมตามกฎหมาย (น้ำหนักร้อยละ: 15)	พิจารณาจากอัตราส่วนของจำนวนเงินเปรียบเทียบตามความผิดที่ถูกลงโทษโดยคณะกรรมการเปรียบเทียบ เทียบกับจำนวนเงินที่มีการเปรียบเทียบปรับในปีนั้นๆ ทั้งหมดรวมทุก บลจ.

ทั้งนี้การพิจารณางจะไม่รวมกองทุนดังต่อไปนี้

- กองทุนที่ดำเนินการไม่ครบรอบปี ในปีล่าสุด
- กองทุนที่มีการเปลี่ยนประเภทในช่วงปีที่พิจารณารางวัล
- กองทุนปิด
- กองทุนเปิด ประเภทกองทุนรวมเพื่อแก้ไขปัญหาในระบบสถาบันการเงิน (RE) ประเภทกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (PR) ประเภทกองทุนรวมตลาดเงิน (MO, SPMO) ประเภทกองทุนรวมที่ลงทุนในต่างประเทศ (FIF) ประเภทกองทุนรวมหน่วยลงทุน (FOF) ประเภทกองทุนรวมวายุภักษ์ (VAYU) ประเภทกองทุนเพื่อพัฒนาและฟื้นฟูกิจการที่ได้รับผลกระทบจากสึนามิ (TSU) ประเภทกองทุนรวมอิตีเอฟ (ETF) ประเภทกองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพที่มีตลาดลงทุนในตราสารทุนหรือตราสารหนี้ (RMFOTH) ประเภทกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (IFF) ประเภทกองทุนรวมคอมโมดิตี (COM) และทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REIT)