

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สน. 9/2545

เรื่อง การกำหนดประเภทหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นที่บริษัทจัดการสามารถลงทุน
เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนส่วนบุคคลได้เพิ่มเติม

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 5(7) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กน. 14/2543 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการจัดการกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 4 เมษายน พ.ศ. 2543 และข้อ 6 (6) ข้อ 6/4 ข้อ 6/5 ข้อ 6/6 ข้อ 6/7 ข้อ 6/8 และข้อ 6/9 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กน. 14/2543 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการจัดการกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 4 เมษายน พ.ศ. 2543 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กน. 4/2544 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการจัดการกองทุนส่วนบุคคล (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 2 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2544 สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“บริษัทจัดการ” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนส่วนบุคคล

“สัญญาฟิวเจอร์” หมายความว่า สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกิดขึ้นในตลาดหรือศูนย์กลางในการซื้อขายหลักทรัพย์หรือหลักทรัพย์ล่วงหน้า ซึ่งบริษัทจัดการเข้าผูกพันตนในสัญญาดังกล่าว โดยมีข้อกำหนดให้บริษัทจัดการต้องส่งมอบสินค้าอ้างอิงหรือชำระราคาของสินค้าอ้างอิงให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง ณ เวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคต หรือมีข้อกำหนดให้บริษัทจัดการได้รับชำระเงินหรือต้องชำระเงินให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งเท่ากับจำนวนเงินที่คำนวณได้จากส่วนต่างระหว่างราคาหรือมูลค่าของสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรอ้างอิงที่กำหนดไว้ในสัญญากับราคาหรือมูลค่าของสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรอ้างอิงที่เป็นอยู่ ณ เวลาใดเวลาหนึ่งหรือช่วงเวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคตตามที่กำหนดไว้ในสัญญา

“สินค้าอ้างอิง” หมายความว่า หลักทรัพย์หรือเงินตราสกุลใด ๆ

“ตัวแปรอ้างอิง” หมายความว่า ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์หรืออัตราดอกเบี้ย

“สัญญาฟอร์เวิร์ด” หมายความว่า สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกิดขึ้นนอกตลาดหรือศูนย์กลางในการซื้อขายหลักทรัพย์หรือหลักทรัพย์ล่วงหน้า ซึ่งบริษัทจัดการเข้าผูกพันตนในสัญญาดังกล่าว โดยมีข้อกำหนดให้บริษัทจัดการต้องส่งมอบสินค้าอ้างอิงหรือชำระราคาของสินค้าอ้างอิง

ให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง ณ เวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคต หรือมีข้อกำหนดให้บริษัทจัดการได้รับชำระเงินหรือต้องชำระเงินให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งเท่ากับจำนวนเงินที่คำนวณได้จากส่วนต่างระหว่างราคาหรือมูลค่าของสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรอ้างอิงที่กำหนดไว้ในสัญญากับราคาหรือมูลค่าของสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรอ้างอิงที่เป็นอยู่ ณ เวลาใดเวลาหนึ่งหรือช่วงเวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคตตามที่กำหนดไว้ในสัญญา

“สัญญาสวอป” หมายความว่า สัญญาที่บริษัทจัดการเข้าผูกพันแลกเปลี่ยนผลตอบแทนซึ่งมีมูลค่าผลตอบแทนอย่างน้อยข้างใดข้างหนึ่งของสัญญาผูกกับสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรอ้างอิง ทั้งนี้ ตามระยะเวลาและวิธีการที่กำหนดไว้ล่วงหน้าในสัญญา

“สถาบันการเงิน” หมายความว่า สถาบันการเงินตามกฎหมายว่าด้วยดอกเบี้ยเงินให้กู้ยืมของสถาบันการเงิน

“กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์” หมายความว่า กองทุนรวมที่จัดตั้งขึ้นตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์

“กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์เพื่อแก้ไขปัญหาในระบบสถาบันการเงิน” หมายความว่า กองทุนรวมที่จัดตั้งขึ้นตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและการจัดการกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์เพื่อแก้ไขปัญหาในระบบสถาบันการเงิน

“กองทุนรวมเพื่อแก้ไขปัญหาในระบบสถาบันการเงิน” หมายความว่า กองทุนรวมที่จัดตั้งขึ้นตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการกองทุนรวมเพื่อแก้ไขปัญหาในระบบสถาบันการเงิน

“กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์และสิทธิเรียกร้อง” หมายความว่า กองทุนรวมที่จัดตั้งขึ้นตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์และสิทธิเรียกร้อง

ข้อ 2 ในการจัดการกองทุนส่วนบุคคลที่มีใช้กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ บริษัทจัดการอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งสัญญาฟิวเจอร์ สัญญาฟอร์เวิร์ด หรือสัญญาสวอปได้

ข้อ 3 ในการจัดการกองทุนส่วนบุคคลที่เป็นกองทุนสำรองเลี้ยงชีพทุกนโยบายการลงทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยงในอัตราดอกเบี้ยหรืออัตราแลกเปลี่ยนเงินตราที่อาจเกิดขึ้นจากการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ หรือเพื่อป้องกันความเสี่ยงในอัตราดอกเบี้ยหรืออัตราแลกเปลี่ยนเงินตราที่อาจเกิดขึ้นจากค่าใช้จ่ายในการ

จัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ บริษัทจัดการอาจทำสัญญาฟิวเจอร์ที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ยหรืออัตราแลกเปลี่ยนเงินตรา หรือสัญญาฟอว์เวิร์ดหรือสัญญาสวอปที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ยหรืออัตราแลกเปลี่ยนเงินตรากับสถาบันการเงินได้ โดยมีมูลค่าของสัญญาที่ไม่รวมค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายในการทำสัญญานั้นต้องไม่เกินมูลค่าของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นที่บริษัทจัดการลงทุนในหรือมีไว้เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ รวมทั้งดอกผลที่เกิดหรืออาจเกิดจากหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น หรือค่าใช้จ่ายในการจัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่บริษัทจัดการมีภาระต้องชำระ และมีระยะเวลาของสัญญาไม่เกินระยะเวลาที่บริษัทจัดการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น หรือมีภาระต้องชำระค่าใช้จ่ายในการจัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพดังกล่าว

ข้อ 4 ในการจัดการกองทุนส่วนบุคคลที่เป็นกองทุนสำรองเลี้ยงชีพตามนโยบายการลงทุนที่มีเช่น นโยบายการลงทุนในทรัพย์สินที่มีความเสี่ยงต่ำและนโยบายการลงทุนในตลาดเงิน บริษัทจัดการอาจลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนของกองทุนรวมดังต่อไปนี้ได้

- (1) กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์
- (2) กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์เพื่อแก้ไขปัญหาในระบบสถาบันการเงิน
- (3) กองทุนรวมเพื่อแก้ไขปัญหาในระบบสถาบันการเงิน
- (4) กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์และสิทธิเรียกร้อง

ข้อ 5 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 16 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2545 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 15 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2545

(นายประสาร ไตรรัตน์วรกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์