

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สน. 13/2548

เรื่อง อัตราส่วนการลงทุนของกองทุนในตราสารต่างประเทศ
ที่ได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้เสนอขายในประเทศไทย

ตามที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. ได้มีมติในการประชุมครั้งที่ 1/2548 เมื่อวันที่ 14 มกราคม 2548 เห็นชอบให้บริษัทจัดการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในต่างประเทศ ตามประเภทที่สำนักงานเสนอ โดยให้อัตราส่วนเป็นไปตามประกาศว่าด้วยการกำหนดอัตราส่วนการลงทุนของกองทุนนั้น แต่เพื่อให้การลงทุนของกองทุนในตราสารที่ผู้ออกเป็นบุคคลหรือหน่วยงานต่างประเทศ ซึ่งได้ออกตราสารดังกล่าวในคราวเดียวกัน โดยได้เสนอขายทั้งในประเทศไทย และต่างประเทศยังคงอยู่ภายใต้อัตราส่วนเดียวกันไม่ว่าบริษัทจัดการจะได้ลงทุนในตราสารดังกล่าว จากการซื้อในประเทศไทยหรือในต่างประเทศก็ตาม

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 126(4) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ประกอบข้อ 11 โดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการ ก.ล.ต. และข้อ 19 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กน. 30/2547 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการกองทุน ลงวันที่ 10 มิถุนายน พ.ศ. 2547 สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“กองทุน” หมายความว่า กองทุนรวม หรือกองทุนส่วนบุคคล

“กองทุนส่วนบุคคลรายย่อย” หมายความว่า กองทุนส่วนบุคคลที่มีใช้กองทุนสำรองเลี้ยงชีพซึ่งมีมูลค่าหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินของผู้ลงทุนรายย่อยต่ำกว่าหนึ่งล้านบาท

“ตราสารต่างประเทศ” หมายความว่า พันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งหรือหลายแห่งที่รัฐบาลต่างประเทศ องค์การระหว่างประเทศ หรือรัฐวิสาหกิจตามกฎหมายต่างประเทศ เป็นผู้ออก โดยพันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งดังกล่าวได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (investment grade) จากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงาน ทั้งนี้ ในกรณีที่เป็นพันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งที่รัฐบาลต่างประเทศหรือองค์การระหว่างประเทศ เป็นผู้ออก การจัดอันดับความน่าเชื่อถือดังกล่าวอาจเป็นการจัดอันดับที่ตัวผู้ออกก็ได้

“บริษัทจัดการ” หมายความว่า บริษัทจัดการกองทุนรวม และบริษัทจัดการกองทุนส่วนบุคคล

“บริษัทจัดการกองทุนรวม” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวม

“บริษัทจัดการกองทุนส่วนบุคคล” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนส่วนบุคคล

“ประกาศ ที่ สน. 7/2548” หมายความว่า ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 7/2548 เรื่อง การลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในต่างประเทศเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุน และการกำหนดอัตราส่วนการลงทุนลงวันที่ 15 มีนาคม พ.ศ. 2548 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

“สำนักงาน” หมายความว่า สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 2 ให้บริษัทจัดการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารต่างประเทศที่ได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้เสนอขายในประเทศไทย เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวม กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ หรือกองทุนส่วนบุคคลรายย่อย มีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้น ไม่เกินร้อยละสามสิบห้าของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนดังกล่าว ทั้งนี้ ในกรณีที่เป็นกองทุนรวมเปิด มูลค่าของตราสารต่างประเทศที่ลงทุนในหรือมีไว้ดังกล่าวต้องไม่เกินร้อยละยี่สิบของมูลค่าตราสารต่างประเทศทั้งหมดที่ออกในคราวเดียวกัน เว้นแต่เป็นกองทุนรวมเปิดที่มีการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนตามคำสั่งล่วงหน้าซึ่งระยะเวลาแน่นอน (auto redemption)

ในกรณีที่บริษัทจัดการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารต่างประเทศที่เสนอขายในต่างประเทศตามที่กำหนดไว้ในประกาศที่ สน. 7/2548 ด้วย ให้นำอัตราส่วนการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารที่เสนอขายในต่างประเทศดังกล่าวรวมเข้ากับอัตราส่วนการลงทุนตามวรรคหนึ่งด้วย

ข้อ 3 การจัดการกองทุนส่วนบุคคลในกรณีอื่นใดที่มีใช้กรณีตามข้อ 2 ให้บริษัทจัดการกองทุนส่วนบุคคลสามารถลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารต่างประเทศที่ได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้เสนอขายในประเทศไทย เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนส่วนบุคคลดังกล่าวได้โดยไม่จำกัดอัตราส่วนการลงทุน

ข้อ 4 ในกรณีที่ตราสารต่างประเทศในขณะที่ลงทุนหรือในขณะที่ได้มาเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวม กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ หรือกองทุนส่วนบุคคลรายย่อย มีมูลค่าไม่เกินอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดในข้อ 2 หากต่อมามีมูลค่าเกินอัตราส่วนดังกล่าวโดยเหตุดังต่อไปนี้ บริษัทจัดการจะยังคงมีไว้ซึ่งตราสารต่างประเทศนั้นต่อไปก็ได้

(1) การรับชำระหนี้ด้วยทรัพย์สินอื่นตามประกาศที่กำหนดให้บริษัทจัดการสามารถรับชำระหนี้ดังกล่าวได้

(2) เหตุอื่นใดที่มีใช้การลงทุนหรือได้ทรัพย์สินมาเพิ่มเติม

ให้บริษัทจัดการจัดทำรายงานโดยระบุชื่อ จำนวน อัตราส่วนการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารต่างประเทศตามวรรคหนึ่ง และวันที่ตราสารต่างประเทศนั้นมีมูลค่าเกินอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดพร้อมสาเหตุ และส่งรายงานดังกล่าวให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวม คณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ หรือลูกค้ากองทุนส่วนบุคคลรายย่อย แล้วแต่กรณี ทราบภายในสามวันทำการนับแต่วันที่ตราสารต่างประเทศนั้นมีมูลค่าเกินอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนด พร้อมทั้งจัดทำสำเนารายงานดังกล่าวไว้ที่บริษัทจัดการเพื่อให้สำนักงานสามารถตรวจสอบได้

ข้อ 5 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 18 พฤษภาคม พ.ศ. 2548 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 18 พฤษภาคม พ.ศ. 2548

(นายธีระชัย ภูวนาถนรานุบาล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์