

เรียน เลขานุการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ ผกค.(31) 358/2548 เรื่อง การผ่อนผันระเบียบควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน

ตามหนังสือคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กลต.น.1880/2547 ลงวันที่ 3 พฤศจิกายน 2547 ที่ กลต.น. 575/2548 ลงวันที่ 15 มีนาคม 2548 และที่ กลต.น. 775/2548 ลงวันที่ 19 เมษายน 2548 แจ้งให้รพท.ทราบถึงแนวทางการจัดสรรวงเงินลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศให้แก่กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป (retail fund) และกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และประเภทตราสารที่อนุญาตให้ลงทุน รวมทั้งความคืบหน้าในการดำเนินการจัดสรรวงเงินดังกล่าว สืบเนื่องจากที่ รพท.ได้มีหนังสือที่ รพท.สกก.(03)1324/2547 ลงวันที่ 29 กรกฎาคม 2547 เห็นชอบในหลักการให้ สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ก.ล.ต.) จัดสรรวงเงินลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศแก่กองทุนรวม กองทุนส่วนบุคคล และกองทุนสำรองเลี้ยงชีพจำนวน 500 ล้านดอลลาร์สหรัฐ. ความละเอียดแจ้งแล้ว นั้น

เจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน ขอเรียนดังนี้

1. วงเงินที่อนุญาตให้ลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ

อนุญาตให้กองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการจำนวน 17 บริษัทตามรายละเอียดแนบ (ผู้ลงทุน) ลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศได้ภายในวงเงินที่ได้รับจัดสรรจาก ก.ล.ต.

2. ประเภทหลักทรัพย์ต่างประเทศที่อนุญาตให้ลงทุน

อนุญาตให้ผู้ลงทุนที่ได้รับจัดสรรวงเงินลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศตามข้อ 1 ลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศได้ตามขอบเขตที่ ก.ล.ต. กำหนด

3. วิธีปฏิบัติในการลงทุนและการนับวงเงิน

3.1 การซื้อหลักทรัพย์ต่างประเทศ ไม่ว่าจะเป็นการซื้อโดยตรงจากต่างประเทศ หรือซื้อต่อจากนิติบุคคลรับอนุญาตในประเทศ หรือผู้ลงทุนประเภทสถาบันที่ได้รับอนุญาตวงเงินลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศจากเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน ผู้ลงทุนจะต้องแสดงรูปถ่ายหนังสือฉบับนี้ พร้อมหลักฐานที่ได้รับจัดสรรวงเงินลงทุนจาก ก.ล.ต. ต่อผู้ที่เกี่ยวข้องทุกครั้ง

3.2 การซื้อหลักทรัพย์ต่างประเทศต่อจากนิติบุคคลรับอนุญาตหรือผู้ลงทุนประเภทสถาบันที่ได้รับอนุญาตวงเงินลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศจากเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน ให้นับเป็นการลงทุนตามวงเงินที่ผู้ลงทุนได้รับจัดสรรจาก ก.ล.ต.ตามข้อ 1 ด้วย โดยจะชำระค่าหลักทรัพย์ด้วยเงินบาทหรือเงินตราต่างประเทศก็ได้

3.3 เมื่อผู้ลงทุนจะซื้อเงินตราต่างประเทศเพื่อชำระค่าหลักทรัพย์ต่างประเทศดังกล่าว ให้ผู้ลงทุนแสดงรูปถ่ายหนังสือฉบับนี้ หลักฐานที่ได้รับจัดสรรวงเงินลงทุนจาก ก.ล.ต. และเอกสารอื่นที่เกี่ยวข้องต่อนิติบุคคลรับอนุญาต หากเป็นการชำระเงินมีมูลค่าตั้งแต่ 20,000 ดอลลาร์สหรัฐ หรือเทียบเท่าตามอัตราตลาด ให้ผู้ลงทุนยื่นแบบการทำธุรกรรมเงินตราต่างประเทศที่ระบุเลขที่หนังสือฉบับนี้ต่อนิติบุคคลรับอนุญาตด้วย และเมื่อนิติบุคคลรับอนุญาตได้ตรวจสอบจนเป็นที่พอใจว่าเอกสารหลักฐานนั้นแท้จริงและถูกต้องครบถ้วนเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดไว้ ให้นิติบุคคลรับอนุญาตขายเงินได้ และให้นิติบุคคลรับอนุญาตเก็บเอกสารหลักฐานนั้นไว้ไม่น้อยกว่า 3 ปี เพื่อให้เจ้าพนักงานตรวจสอบเมื่อต้องการ

3.4 ผู้ลงทุนสามารถขายหลักทรัพย์เงินตราต่างประเทศที่ลงทุนไว้ดังกล่าวข้างต้นให้แก่นิติบุคคลรับอนุญาต หรือผู้ลงทุนประเภทสถาบันที่ได้รับอนุญาตวงเงินลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศจากเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน และหากได้รับชำระค่าหลักทรัพย์เป็นเงินตราต่างประเทศ ผู้ลงทุนจะต้องขายเงินตราต่างประเทศนั้นกับนิติบุคคลรับอนุญาตภายใน 7 วันนับจากวันที่ได้รับชำระเงิน เว้นแต่จะได้รับการผ่อนผันจากเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน

4. การกำกับและการคุ้มครองความเสี่ยง

4.1 การลงทุนในหลักทรัพย์เงินตราต่างประเทศมีความเสี่ยงสูง ทั้งที่เกิดจากตราสารที่ลงทุนผู้ออกตราสารนั้น ๆ และความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดตราสารตลอดจนความเสี่ยงที่เกิดจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน ดังนั้น คณะกรรมการและผู้บริหารระดับสูงของผู้ลงทุนต้องตระหนักและประเมินอย่างรอบคอบถึงความเสี่ยงที่จะเกิดขึ้นและมีมาตรการลดจนการบริหารจัดการและกำกับความเสี่ยงด้านต่าง ๆ อย่างรัดกุมและมีประสิทธิภาพ พร้อมทั้งกำชับให้ผู้บริหารการลงทุนของผู้ลงทุนถือปฏิบัติตามนโยบายของหน่วยงานที่กำกับดูแลและคณะกรรมการหรือผู้มีอำนาจบริหารของผู้ลงทุนที่กำหนดไว้โดยเคร่งครัด

4.2 การทำสัญญาคุ้มครองความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนต้องทำกับนิติบุคคลรับอนุญาตในประเทศไทยเท่านั้น และต้องมีใช้เพื่อการเก็งกำไรจากอัตราแลกเปลี่ยน

5. บัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ

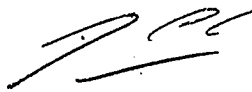
การขอผ่อนผันในการฝากเงินตราต่างประเทศ ที่ได้รับจากการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศเข้าบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศที่เปิดไว้กับนิติบุคคลรับอนุญาตในประเทศโดยยกเว้นการยื่นเอกสารแสดงภาระผูกพันที่จะต้องชำระเงินให้แก่บุคคลในต่างประเทศ หรือการเปิดบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศในต่างประเทศเพื่ออำนวยความสะดวกเกี่ยวกับการลงทุน ให้ผู้ลงทุนยื่นขออนุญาตเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน โดยยื่นผ่านก.ล.ต.ที่กำกับดูแลอยู่

6. การรายงาน

เพื่อประโยชน์ในการติดตามการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศดังกล่าว ขอให้ ก.ล.ต. แจ้งผู้ลงทุนจัดทำกรรายงานข้อมูลการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ ในแต่ละเดือนตามแบบที่แนบ และขอความอนุเคราะห์ ก.ล.ต. รวบรวมข้อมูลจัดส่งให้แก่เจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน ฝ่ายกลยุทธ์และกำกับการแลกเปลี่ยนเงิน สายตลาดการเงิน ภายใน 10 วันของเดือนถัดไป

จึงเรียนมาเพื่อ โปรดพิจารณาอนุเคราะห์ และดำเนินการแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบด้วย

ขอแสดงความนับถือ



(นายสุชาติ สักการโกศล)

เจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน

- สิ่งที่ส่งมาด้วย
1. รายงานยอดคงค้างการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ
 2. รายงานผลประโยชน์จากการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ
 3. รายงานการซื้อขายเงินตราต่างประเทศเพื่อลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ

ส่วนกำกับการแลกเปลี่ยนเงิน

ฝ่ายกลยุทธ์และกำกับการแลกเปลี่ยนเงิน

สายตลาดการเงิน

โทร. 0-2356-7636

รายงานยอดคงค้างการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ

ชื่อผู้ลงทุน

ประจำเดือน พ.พ. ที่

รายการ	รายละเอียดหลักทรัพย์		อันดับ	มูลค่าซื้อขายหลักทรัพย์ (ราคาทุน)		หมายเหตุ
	ประเภทหลักทรัพย์	ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์		จำนวนเงิน	เทียบเท่า USD	
หลักทรัพย์ไทย						
- ครุฑสารทน์ 1/				xxx	xxx	
- อื่น ๆ 2/						
ด้านรับมอบหลักทรัพย์อ้างอิง :-				xxx	xxx	
- ระบุชื่อธุรกรรม						
มีด ด้านส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง :-				(xxx)	(xxx)	
- ระบุชื่อธุรกรรม				xxx	xxx	
ยอดซื้อ(ขาย)สุทธิครั้งถึง				xxxx	xxxx	
รวม						
หลักทรัพย์ต่างประเทศ						
- ครุฑสารทน์ 1/				xxx	xxx	
- ฟูม				xxx	xxx	
- หน่วยลงทุนของกองทุนรวม				xxx	xxx	
- สัญญาซื้อขายล่วงหน้า (derivatives exchange)				xxx	xxx	
- อื่น ๆ 2/				xxx	xxx	
ด้านรับมอบหลักทรัพย์อ้างอิง :-						
- ระบุชื่อธุรกรรม				xxx	xxx	
มีด ด้านส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง :-				(xxx)	(xxx)	
- ระบุชื่อธุรกรรม				xxx	xxx	
ยอดซื้อ(ขาย)สุทธิครั้งถึง				xxxx	xxxx	
รวม						

หมายเหตุ 1/ ให้นำรวมการซื้อหลักทรัพย์ต่างประเทศตามสัญญา Forward ด้วย

2/ หมายถึง Credit Derivatives ธุรกรรมอนุพันธ์ทางการเงิน (เช่น Bond option) ที่ทำกับผลิตภัณฑ์อนุภาค ในประเทศที่มีผล ให้ผู้ทำธุรกรรมดังกล่าวอาจต้องส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ไทยที่ออกจำหน่ายในต่างประเทศ หรือธุรกรรมที่ปล่อยหุ้นรับทุนการเงินแห่งกับผลิตภัณฑ์อนุภาค ในประเทศที่ให้สิทธิสัญญาในการชำระคืนหรือรับชำระคืนเงินต้นหรือผลตอบแทนเป็นหลักทรัพย์ไทย ที่ออกจำหน่ายในต่างประเทศ หรือหลักทรัพย์ต่างประเทศ

ขอรับรองว่ารายการข้างต้นถูกต้องและตรงตามความจริง

(ลงชื่อผู้ยื่นรายงาน)

เอกสารประกอบหนังสือที่ ผกท.(31) 358 /2548 ลงวันที่ 16 มิถุนายน 2548

รายงานผลประโยชน์จากการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ

ชื่อผู้ลงทุน.....

ประจำเดือน ณ วันที่

รายการ	จำนวนเงิน (เทียบเท่า USD)		
	หลักทรัพย์ไทย	หลักทรัพย์ต่างประเทศ	รวม
ผลประโยชน์สุทธิสะสมยกมา			
บวก ดอกเบี้ยรับสุทธิ			
เงินปันผลรับสุทธิ			
กำไรจากการขายหลักทรัพย์สุทธิ			
หัก ขาดทุนจากการขายหลักทรัพย์			
รายจ่ายอื่น ๆ ที่เกิดจากการลงทุน			
ผลประโยชน์สุทธิสะสมยกไป			

ขอรับรองว่ารายการข้างต้นถูกต้องและตรงตามความจริง

.....
(ลงชื่อผู้มีอำนาจลงนาม)

เอกสารประกอบหนังสือที่ ผกท.(31) 358 /2548 ลงวันที่ 16 มิถุนายน 2548

รายงานการซื้อขายเงินตราต่างประเทศเพื่อลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ

ชื่อผู้ลงทุน

ประจำเดือน

หน่วย : ดอลลาร์สหรัฐ.

ยอดยกมาจาก เดือนก่อน (1)	การซื้อเงินตรา ต่างประเทศเดือนนี้ (2)	การขายเงินตรา ต่างประเทศเดือนนี้ (3)	ยอดสุทธิยกไป (1) + (2) - (3)

ขอรับรองว่ารายการข้างต้นถูกต้องและตรงตามความจริง

.....

(ลงชื่อผู้มีอำนาจลงนาม)