

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สน. 9/2550

เรื่อง การลงทุนและการมีไว้เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุน

(ฉบับที่ 2)

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 126(4) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ประกอบกับข้อ 11 และข้อ 16 โดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และข้อ 18(6) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กน.30/2547 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการกองทุน ลงวันที่ 10 มิถุนายน พ.ศ. 2547 สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น (ข/1) ใน (3) ของข้อ 2 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 28/2549 เรื่อง การลงทุนและการมีไว้เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุน ลงวันที่ 17 กรกฎาคม พ.ศ. 2549

“(ข/1) “บริษัทเครดิตฟองซิเออร์” หมายความว่า บริษัทเครดิตฟองซิเออร์ตามกฎหมายว่าด้วยการประกอบธุรกิจเงินทุน ธุรกิจหลักทรัพย์ และธุรกิจเครดิตฟองซิเออร์”

ข้อ 2 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ 6/1 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 28/2549 เรื่อง การลงทุนและการมีไว้เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุน ลงวันที่ 17 กรกฎาคม พ.ศ. 2549

“ข้อ 6/1 ในกรณีที่กองทุนเป็นกองทุนรวมคุ้มครองเงินต้น หรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ หรือกองทุนส่วนบุคคลรายย่อยที่มีนโยบายการลงทุนประเภทเดียวกับกองทุนรวมดังกล่าว หากกองทุนดังกล่าวมีการลงทุนในต่างประเทศ บริษัทจัดการต้องเข้าเป็นคู่สัญญาในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีตัวแปรเป็นอัตราแลกเปลี่ยนเงิน โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อการลดความเสี่ยง (hedging) จากอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมดที่มีอยู่ ทั้งนี้ ตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดไว้ในส่วนที่ 9 ข้อ 36(4) และข้อ 37”

ข้อ 3 ให้ยกเลิกความในหมวด 3 หลักเกณฑ์อัตราส่วนเพิ่มเติมสำหรับกองทุนรวมคุ้มครองเงินต้นและกองทุนส่วนบุคคลที่มีนโยบายการลงทุนลักษณะเดียวกัน ข้อ 80 และข้อ 81 ในภาค 2 หลักเกณฑ์เกี่ยวกับอัตราส่วนการลงทุนของกองทุน แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์

และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 28/2549 เรื่อง การลงทุนและการมีไว้เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุน ลงวันที่ 17 กรกฎาคม พ.ศ. 2549 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“หมวด 3

หลักเกณฑ์อัตราส่วนเพิ่มเติมสำหรับกองทุนรวมคุ้มครองเงินต้น
และกองทุนส่วนบุคคลที่มีนโยบายการลงทุนลักษณะเดียวกัน

ข้อ 80 มิให้นำอัตราส่วนที่กำหนดไว้ในข้อ 57 ข้อ 58 และข้อ 59 มาใช้บังคับกับการลงทุนหรือมีไว้ซึ่งค้ำสัญญาใช้เงินที่บริษัทเงินทุนหรือบริษัทเครดิตฟองซิเอร์เป็นผู้ออก หรือเงินฝากในธนาคารพาณิชย์ โดยบริษัทจัดการอาจลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังกล่าวที่บุคคลใดเป็นผู้ออกหรือค้ำสัญญา แล้วแต่กรณี มีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นเมื่อคำนวณเฉพาะผู้ออกหรือค้ำสัญญารายนั้น ไม่เกินร้อยละตามสิบของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน

การคำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามวรรคหนึ่ง ให้นับทรัพย์สินตามวรรคหนึ่งและทรัพย์สินอื่นที่บุคคลดังกล่าวเป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือค้ำสัญญา ซึ่งกองทุนได้ลงทุนหรือมีไว้รวมในอัตราส่วนดังกล่าวด้วย”

ข้อ 4 ในกรณีของกองทุนรวมคุ้มครองเงินต้นที่ได้ขายหน่วยลงทุนครั้งแรก หรือในกรณีของกองทุนส่วนบุคคลที่มีนโยบายการลงทุนลักษณะเดียวกันซึ่งได้มีการทำสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคลแล้ว ก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ ให้บริษัทจัดการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) มิให้นำความในข้อ 107 และข้อ 108 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 28/2549 เรื่อง การลงทุนและการมีไว้เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุน ลงวันที่ 17 กรกฎาคม พ.ศ. 2549 มาใช้บังคับ

(2) ในกรณีที่บริษัทจัดการลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินเพื่อกองทุน เป็นไปตามประเภทและอัตราส่วน โดยชอบก่อนการแก้ไขเพิ่มเติมตามประกาศนี้ แต่ไม่เป็นไปตามประเภทหรือเกินอัตราส่วนที่แก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศนี้ บริษัทจัดการจะยังคงมีไว้ซึ่งทรัพย์สินดังกล่าวเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนต่อไปได้ แต่หากทรัพย์สินนั้นเป็นตราสารที่มีกำหนดอายุซึ่งได้หมดอายุลง หรือได้มีการจำหน่ายทรัพย์สินนั้นไปเท่าใด บริษัทจัดการอาจคงทรัพย์สินอื่นนั้นไว้ได้เพียงจำนวนที่เหลือ

(3) ในกรณีของกองทุนรวมคุ้มครองเงินต้นที่จดทะเบียนกองทรัพย์สินเป็นกองทุนรวมในวันที่หรือภายหลังจากวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ บริษัทจัดการกองทุนรวมอาจเลือกที่จะลงทุนสำหรับการลงทุนครั้งแรกให้เป็นไปตามประเภทที่กำหนดไว้ใน ในโครงการจัดการกองทุนรวมที่ได้รับอนุมัติจากสำนักงานได้ ทั้งนี้ การลงทุนครั้งต่อไปของกองทุนรวมดังกล่าวต้องอยู่ภายใต้บังคับ (4)

(4) ห้ามมิให้บริษัทจัดการลงทุนเพิ่มเติมในทรัพย์สินใด ๆ เว้นแต่เป็นกรณีตาม (6) หรือ ได้มีการแก้ไขเพิ่มเติมโครงการจัดการกองทุนรวม หรือสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคล แล้วแต่กรณี ให้เป็นไปตามข้อ 26 หรือข้อ 46 วรรคหนึ่ง แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 23/2547 เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมและการเข้าทำสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 11 มิถุนายน พ.ศ. 2547 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยข้อ 1 และข้อ 2 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 8/2550 เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมและการเข้าทำสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคล (ฉบับที่ 7) ลงวันที่ 22 มิถุนายน พ.ศ. 2550

(5) อัตราส่วนการลงทุนในทรัพย์สินตาม (2) หรือ (3) ให้เป็นไปตามอัตราส่วนที่กำหนด สำหรับกองทุนรวมคุ้มครองเงินต้น และกองทุนส่วนบุคคลที่มีนโยบายการลงทุนลักษณะเดียวกัน ก่อนที่จะมีการแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศฉบับนี้

(6) ในกรณีที่ทรัพย์สินตาม (2) หรือ (3) ถูกปรับลดอันดับความน่าเชื่อถือจนเป็นเหตุให้ไม่เป็นไปตามอัตราส่วนการลงทุนตาม (5) ให้บริษัทจัดการดำเนินการแก้ไขอัตราส่วนให้เป็นไปตาม (5) ภายในสามสิบวันนับแต่วันที่ทรัพย์สินดังกล่าวถูกปรับลดอันดับความน่าเชื่อถือ

ข้อ 5 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม พ.ศ. 2550 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 22 มิถุนายน พ.ศ. 2550

(นายธีระชัย ภูวนาถนรานุบาล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

หมายเหตุ : เหตุผลในการออกประกาศฉบับนี้ คือ เพื่อปรับปรุงหลักเกณฑ์การลงทุนหรือแสวงหาประโยชน์จากหลักทรัพย์ สัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือทรัพย์สินอื่น รวมทั้งการหาดอกเบี้ยโดยวิธีอื่น ตลอดจนวิธีการคำนวณอัตราส่วนการลงทุน สำหรับกองทุนรวมคุ้มครองเงินต้น และกองทุนส่วนบุคคลที่มีนโยบายในลักษณะเดียวกัน ให้เป็นไปอย่างเหมาะสมยิ่งขึ้นและสอดคล้องกับนโยบายการลงทุนและวัตถุประสงค์ทั้งของกองทุนดังกล่าว