

ประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ กธ. 10/2550

เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 14 และมาตรา 98(5) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535
คณะกรรมการ ก.ล.ด. ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่ กธ./น.บ. 33/2548 เรื่อง การอนุญาตให้
บริษัทหลักทรัพย์ขายหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ โดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง
ลงวันที่ 22 สิงหาคม พ.ศ. 2548

ข้อ 2 ในประกาศนี้

“กองทุนรวมอีทีเอฟ” หมายความว่า กองทุนรวมอีทีเอฟตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และ
ตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการจัดตั้งกองทุนรวมและการเข้าทำสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคล

“การขายชอร์ต” หมายความว่า การขายหลักทรัพย์โดยที่ยังไม่มีหลักทรัพย์อยู่ในครอบครอง

“ตลาดหลักทรัพย์” หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

“บริษัทจัดการกองทุนรวม” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภท
การจัดการกองทุนรวม

“สำนักหักบัญชี” หมายความว่า สำนักหักบัญชีตามตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“สำนักหักบัญชี” หมายความว่า สำนักหักบัญชีตามตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 3 ให้บริษัทหลักทรัพย์ขายชอร์ตได้ในกรณีดังต่อไปนี้

(1) การขายชอร์ตหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ในนามบริษัท
หลักทรัพย์เองหรือตามคำสั่งของลูกค้า โดยการยืมหน่วยลงทุนดังกล่าวมาเพื่อส่งมอบ หรือซื้อหน่วยลงทุนดังกล่าวจากบริษัทจัดการ
กองทุนรวมมาเพื่อส่งมอบ

(2) การขายชอร์ตหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์และเป็นองค์ประกอบของดัชนีที่กองทุนรวมอีทีเอฟนั้น
อ้างอิงในนามของบริษัทหลักทรัพย์เองหรือตามคำสั่งของลูกค้า โดยการยืมหุ้นนั้นมาส่งมอบ หรือโดยการขายคืนหน่วยลงทุนของกองทุน
รวมอีทีเอฟกับบริษัทจัดการกองทุนรวมเพื่อนำหุ้นที่ได้รับชำระเป็นค่าขายคืนหน่วยลงทุนนั้นมาส่งมอบ

ข้อ 4 การขายชอร์ตหน่วยลงทุนตามข้อ 3(1) หรือหุ้นตามข้อ 3(2) ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ที่
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยประกาศกำหนดด้วยความเห็นชอบของสำนักงาน

ข้อ 5² ในการขายชอร์ตหน่วยลงทุนตามข้อ 3(1) ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์
ดังต่อไปนี้

(1)³ การขายชอร์ตหน่วยลงทุนโดยการยืมหน่วยลงทุนนั้นมาส่งมอบ ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตในนามของบริษัท
หลักทรัพย์เอง ให้บริษัทหลักทรัพย์ดำเนินการจัดหาแหล่งยืมหน่วยลงทุนไว้ให้พร้อมเพื่อให้สามารถส่งมอบหน่วยลงทุนตามรายการ

¹ถูกยกเลิกเพื่อแก้ไข โดย ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. ที่ กธ. 12/2550 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัท
หลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 11/10/2550

²ถูกยกเลิกเพื่อแก้ไข โดย ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. ที่ กธ. 12/2550 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัท
หลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 11/10/2550

ดังกล่าวได้ภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนดหรือภายในเวลาที่คู่สัญญาซื้อขายหลักทรัพย์ตกลงกัน แล้วแต่กรณี ทั้งนี้ บริษัทหลักทรัพย์ต้องดำเนินการข้างต้นก่อนการขายชอร์ตหน่วยลงทุนนั้น และในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตตามคำสั่งของลูกค้า ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขที่สำนักงานประกาศกำหนด

(2)⁴ การขายชอร์ตหน่วยลงทุน โดยการซื้อหน่วยลงทุนนั้นจากบริษัทจัดการกองทุนรวม ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขที่สำนักงานประกาศกำหนด”

ข้อ 6 ในการขายชอร์ตหุ้นตามข้อ 3(2) ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) การขายชอร์ตหุ้นโดยการยืมหุ้นนั้นมาส่งมอบ ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการขายหลักทรัพย์โดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์อยู่ในครอบครอง

(2) การขายคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟกับบริษัทจัดการกองทุนรวมเพื่อนำหุ้นที่ได้รับชำระเป็นค่าขายคืนหน่วยลงทุนนั้นมาส่งมอบ ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติดังนี้

(ก) ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตหุ้นเพื่อบัญชีตัวเอง บริษัทหลักทรัพย์ต้องมีหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับดัชนีที่มีหุ้นนั้นเป็นองค์ประกอบอยู่ในความครอบครองในขณะที่มีคำสั่งขายชอร์ต และบริษัทหลักทรัพย์มั่นใจว่าตนเองสามารถส่งมอบหุ้นตามรายการที่ขายชอร์ตด้วยการขายคืนหน่วยลงทุนดังกล่าวและรับชำระค่าขายคืนเป็นหุ้นที่ต้องส่งมอบได้ ภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือภายในระยะเวลาที่คู่สัญญาซื้อขายหลักทรัพย์ตกลงกัน แล้วแต่กรณี

(ข) ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตหุ้นตามคำสั่งลูกค้า บริษัทหลักทรัพย์ต้องให้ลูกค้าแสดงว่าลูกค้ามีหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับดัชนีที่มีหุ้นนั้นเป็นองค์ประกอบอยู่ในความครอบครองในขณะที่มีคำสั่งขายชอร์ต และแสดงว่าลูกค้าสามารถส่งมอบหุ้นตามรายการที่ขายชอร์ตด้วยการขายคืนหน่วยลงทุนดังกล่าวและรับชำระค่าขายคืนเป็นหุ้นที่ต้องส่งมอบได้ ภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือภายในระยะเวลาที่คู่สัญญาซื้อขายหลักทรัพย์ตกลงกัน แล้วแต่กรณี

ข้อ 7 ให้บริษัทหลักทรัพย์เก็บรักษาข้อมูลและจัดทำรายงานเกี่ยวกับการขายชอร์ตตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานประกาศกำหนด

ข้อ 8 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กันยายน พ.ศ. 2550 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 24 สิงหาคม พ.ศ. 2550

(นายฉลองภพ สุตังศรีกาญจน์)

รัฐมนตรีว่าการกระทรวงการคลัง

ประธานกรรมการ คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

หมายเหตุ:

ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. ที่ กธ. 10/2550 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง ลงวันที่ 24/08/2550 ประกาศในราชกิจจานุเบกษา เมื่อ

ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. ที่ กธ. 12/2550 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 11/10/2550 ประกาศในราชกิจจานุเบกษา เมื่อ

³ถูกเพิ่ม โดย ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. ที่ กธ. 12/2550 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 11/10/2550

⁴ถูกเพิ่ม โดย ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ด. ที่ กธ. 12/2550 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 11/10/2550