



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สช. 31/2550

เรื่อง หลักเกณฑ์ และเงื่อนไขในการขายชอร์ตหน่วยลงทุนอีทีเอฟ

โดยการยืมหรือซื้อหน่วยลงทุนนั้นมาเพื่อส่งมอบ

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 5(1) และ (2) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กช. 10/2550 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟ โดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง ลงวันที่ 24 สิงหาคม พ.ศ. 2550 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กช. 12/2550 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 11 ตุลาคม 2550 สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ออกข้อกำหนดไว้ ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตหน่วยลงทุนอีทีเอฟตามคำสั่งของลูกค้าโดยการยืมหน่วยลงทุนนั้นมาส่งมอบ ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ในประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการขายหลักทรัพย์โดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง ที่กำหนดไว้สำหรับการขายชอร์ตตามคำสั่งของลูกค้า โดยอนุโลม

ข้อ 2 ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตหน่วยลงทุนอีทีเอฟโดยการซื้อหน่วยลงทุนดังกล่าวจากบริษัทจัดการกองทุนรวมมาเพื่อส่งมอบ ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามดังต่อไปนี้

(1) ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตเพื่อบัญชีตัวเอง บริษัทหลักทรัพย์ต้องมีหุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีที่กองทุนรวมอีทีเอฟดังกล่าวอ้างอิงอยู่ในความครอบครองในขณะที่มีคำสั่งขายชอร์ต โดยบริษัทหลักทรัพย์ต้องมั่นใจว่าตนเองสามารถส่งมอบหน่วยลงทุนตามรายการที่ขายชอร์ตภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือภายในระยะเวลาที่คู่สัญญาซื้อขายหลักทรัพย์ตกลงกันแล้วแต่กรณี ทั้งนี้ ด้วยการนำหุ้นนั้นไปชำระเป็นค่าซื้อหน่วยลงทุนที่ต้องส่งมอบ

(2) ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตตามคำสั่งของลูกค้า บริษัทหลักทรัพย์ต้องให้ลูกค้า แสดงว่าลูกค้ามีหุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีที่กองทุนรวมอีทีเอฟดังกล่าวอ้างอิงอยู่ในความครอบครอง ในขณะที่มีคำสั่งขายชอร์ต โดยบริษัทหลักทรัพย์ต้องมั่นใจว่าลูกค้าสามารถส่งมอบหน่วยลงทุนอีทีเอฟ ตามรายการที่ขายชอร์ตภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือภายในระยะเวลาที่คู่สัญญาตกลงกัน แล้วแต่กรณี ทั้งนี้ ด้วยการนำหุ้นนั้นไปชำระเป็นค่าซื้อหน่วยลงทุนที่ต้องส่งมอบ

ข้อ 3 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน พ.ศ.2550 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 26 ตุลาคม พ.ศ.2550

๑-๗-๖

(นายธีระชัย ภูวนาถนรานุบาล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

หมายเหตุ : เหตุผลในการออกประกาศฉบับนี้ คือ เนื่องจากประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์ และตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้การขายชอร์ตหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟตามคำสั่งลูกค้า โดยการยืมหน่วยลงทุนดังกล่าวมาส่งมอบ และการขายชอร์ตหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ ไม่ว่าเพื่อบัญชีตัวเองหรือตามคำสั่งของลูกค้า โดยการซื้อหน่วยลงทุนจากบริษัทจัดการกองทุนรวม มาส่งมอบ ต้องเป็นไปตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขที่สำนักงานประกาศกำหนด ดังนั้น จึงมีความ จำเป็นต้องออกประกาศฉบับนี้เพื่อรองรับให้บริษัทหลักทรัพย์สามารถดำเนินธุรกรรมดังกล่าวได้