

# คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ กน. 1 /2552

เรื่อง การกำหนดลักษณะบุคคลที่เข้าการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ที่ไม่ถือเป็นผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภท

การเป็นผู้จัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 3 และมาตรา 9 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 อันเป็นพระราชบัญญัติที่มีบทบัญญัติบางประการเกี่ยวกับการจำกัดสิทธิและเสรีภาพของบุคคลซึ่งมาตรา 29 ประกอบมาตรา 33 มาตรา 34 มาตรา 41 มาตรา 43 มาตรา 44 และมาตรา 45 ของรัฐธรรมนูญแห่งราชอาณาจักรไทย บัญญัติให้กระทำได้โดยอาศัยอำนาจตามบทบัญญัติแห่งกฎหมาย คณะกรรมการ ก.ล.ต. ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

## ข้อ 1 ในประกาศนี้

“การจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า” หมายความว่า การเข้าจัดการเงินทุนหรือแสดงต่อบุคคลทั่วไปว่าพร้อมจะรับจัดการเงินทุนให้แก่บุคคลอื่น เพื่อแสวงหาประโยชน์จากสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยกระทำเป็นทางค้าปกติ

“การลดความเสี่ยง (hedging)” หมายความว่า การลดหรือป้องกันความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการที่กองทุนรวมหรือกองทุนส่วนบุคคล แล้วแต่กรณี ลงทุนหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินอื่นด้วยการเข้าเป็นคู่สัญญาในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ข้อ 2 บุคคลที่มีการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีลักษณะดังต่อไปนี้ ไม่ถือเป็นผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทการเป็นผู้จัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(1) เป็นการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยบริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวมหรือกองทุนส่วนบุคคล เพื่อกองทุนรวมหรือกองทุนส่วนบุคคล แล้วแต่กรณี และ

(2) เป็นการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการลดความเสี่ยง (hedging) เท่านั้น

ข้อ 3 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 16 มกราคม พ.ศ. 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 มกราคม พ.ศ. 2552



(นายวิจิตร สุพินิจ)

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

---

หมายเหตุ : เหตุผลในการออกประกาศฉบับนี้ คือ ด้วยปรากฏว่าสถานการณ์ในตลาดหลักทรัพย์ ปัจจุบันมีความผันผวนอย่างต่อเนื่อง ดังนั้น สมควรสนับสนุนให้บริษัทจัดการกองทุนสามารถใช้สัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นเครื่องมือในการบริหารความเสี่ยงในการจัดการกองทุนรวมและกองทุนส่วนบุคคลได้โดยไม่ถือว่าบริษัทดังกล่าวเป็นผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทการเป็นผู้จัดการเงินทุน สัญญาซื้อขายล่วงหน้า จึงจำเป็นต้องออกประกาศนี้