

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทธ. 49/2552

เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่
บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 16/6 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 และมาตรา 98(5) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 อันเป็นพระราชบัญญัติที่มีบทบัญญัติบางประการเกี่ยวกับการจำกัดสิทธิและเสรีภาพของบุคคล ซึ่งมาตรา 29 ประกอบกับมาตรา 33 มาตรา 34 มาตรา 41 มาตรา 43 มาตรา 44 และมาตรา 64 ของรัฐธรรมนูญแห่งราชอาณาจักรไทย บัญญัติให้กระทำได้โดยอาศัยอำนาจตามบทบัญญัติแห่งกฎหมาย คณะกรรมการ ก.ล.ต. ทำหน้าที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนตามมาตรา 60 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

- (1) “กองทุนรวมอีทีเอฟ” หมายความว่า กองทุนรวมอีทีเอฟตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการจัดตั้งกองทุนรวมและการเข้าทำสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคล
- (2) “การขายชอร์ต” หมายความว่า การขายหลักทรัพย์โดยที่ยังไม่มีหลักทรัพย์อยู่ในครอบครอง
- (3) “ตลาดหลักทรัพย์” หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- (4) “บริษัทจัดการกองทุนรวม” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวม
- (5) “สำนักหักบัญชี” หมายความว่า สำนักหักบัญชีตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 2 ให้บริษัทหลักทรัพย์ขายชอร์ตได้ในกรณีดังต่อไปนี้

- (1) การขายชอร์ตหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ในนามบริษัทหลักทรัพย์เองหรือตามคำสั่งของลูกค้า โดยการยืมหน่วยลงทุนดังกล่าวมาเพื่อส่งมอบ หรือซื้อหน่วยลงทุนดังกล่าวจากบริษัทจัดการกองทุนรวมมาเพื่อส่งมอบ
- (2) การขายชอร์ตหุ้นที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์และเป็นองค์ประกอบของดัชนีที่กองทุนรวมอีทีเอฟนั้นอ้างอิงในนามของบริษัทหลักทรัพย์เองหรือตามคำสั่ง

ของลูกค้า โดยการยืมหุ้นนั้นมาส่งมอบ หรือโดยการขายคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟกับบริษัทจัดการกองทุนรวมเพื่อนำหุ้นที่ได้รับชำระเป็นค่าขายคืนหน่วยลงทุนนั้นมาส่งมอบ

ข้อ 3 การขายชอร์ตหน่วยลงทุนตามข้อ 2(1) หรือหุ้นตามข้อ 2(2) ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยประกาศกำหนดด้วยความเห็นชอบของสำนักงาน

ข้อ 4 ในการขายชอร์ตหน่วยลงทุนตามข้อ 2(1) ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) การขายชอร์ตหน่วยลงทุนโดยการยืมหน่วยลงทุนนั้นมาส่งมอบ ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตในนามของบริษัทหลักทรัพย์เอง ให้บริษัทหลักทรัพย์ดำเนินการจัดหาแหล่งยืมหน่วยลงทุนไว้ให้พร้อมเพื่อให้สามารถส่งมอบหน่วยลงทุนตามรายการดังกล่าวได้ภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนดหรือภายในเวลาที่คู่สัญญาซื้อขายหลักทรัพย์ตกลงกัน แล้วแต่กรณี ทั้งนี้บริษัทหลักทรัพย์ต้องดำเนินการข้างต้นก่อนการขายชอร์ตหน่วยลงทุนนั้น และในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตตามคำสั่งของลูกค้า ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขที่สำนักงานประกาศกำหนด

(2) การขายชอร์ตหน่วยลงทุนโดยการซื้อหน่วยลงทุนนั้นจากบริษัทจัดการกองทุนรวม ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขที่สำนักงานประกาศกำหนด

ข้อ 5 ในการขายชอร์ตหุ้นตามข้อ 2(2) ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) การขายชอร์ตหุ้นโดยการยืมหุ้นนั้นมาส่งมอบ ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขายหลักทรัพย์โดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์อยู่ในครอบครอง

(2) การขายคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟกับบริษัทจัดการกองทุนรวมเพื่อนำหุ้นที่ได้รับชำระเป็นค่าขายคืนหน่วยลงทุนนั้นมาส่งมอบ ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติดังนี้

(ก) ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตหุ้นเพื่อบัญชีตัวเอง บริษัทหลักทรัพย์ต้องมีหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับดัชนีที่มีหุ้นนั้นเป็นองค์ประกอบอยู่ในความครอบครองในขณะที่มีคำสั่งขายชอร์ต และบริษัทหลักทรัพย์มั่นใจว่าตนเองสามารถส่งมอบหุ้นตามรายการที่ขายชอร์ตด้วยการขายคืนหน่วยลงทุนดังกล่าวและรับชำระค่าขายคืนเป็นหุ้นที่ต้องส่งมอบได้ภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือภายในระยะเวลาที่คู่สัญญาซื้อขายหลักทรัพย์ตกลงกันแล้วแต่กรณี

(ข) ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตหุ้นตามคำสั่งลูกค้า บริษัทหลักทรัพย์ต้องให้ลูกค้าแสดงว่าลูกค้ามีหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับดัชนีที่มีหุ้นนั้นเป็นองค์ประกอบ อยู่ในความครอบครองในขณะที่มีคำสั่งขายชอร์ต และแสดงว่าลูกค้าสามารถส่งมอบหุ้นตามรายการที่ขายชอร์ตด้วยการขายคืนหน่วยลงทุนดังกล่าวและรับชำระค่าขายคืนเป็นหุ้นที่ต้องส่งมอบได้ ภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือภายในระยะเวลาที่คู่สัญญาซื้อขายหลักทรัพย์ตกลงกันแล้วแต่กรณี

ข้อ 6 ให้บริษัทหลักทรัพย์เก็บรักษาข้อมูลและจัดทำรายงานเกี่ยวกับการขายชอร์ตตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานประกาศกำหนด

ข้อ 7 ให้บรรดาประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ คำสั่ง และหนังสือเวียน ที่ออกหรือวางแนวปฏิบัติตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 10/2550 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง ลงวันที่ 24 สิงหาคม พ.ศ. 2550 ซึ่งใช้บังคับอยู่ในวันก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ ยังคงใช้บังคับได้ต่อไปเท่าที่ไม่ขัดหรือแย้งกับข้อกำหนดแห่งประกาศนี้ จนกว่าจะได้มีประกาศ คำสั่ง และหนังสือเวียน ที่ออกหรือวางแนวปฏิบัติตามประกาศนี้ใช้บังคับ

ข้อ 8 ในกรณีที่มีประกาศฉบับอื่นใดอ้างอิงประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 10/2550 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง ลงวันที่ 24 สิงหาคม พ.ศ. 2550 ให้การอ้างอิงดังกล่าวหมายถึงการอ้างอิงประกาศฉบับนี้

ข้อ 9 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กันยายน พ.ศ. 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2552

(นายวิจิตร สุพินิจ)

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

หมายเหตุ : เหตุผลในการออกประกาศฉบับนี้ คือ เนื่องจากพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 กำหนดให้การออกหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการขายหลักทรัพย์โดยที่บริษัทหลักทรัพย์ ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง เป็นอำนาจของคณะกรรมการกำกับตลาดทุน จึงเห็นควรออก ประกาศเพื่อทดแทนประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 10/2550 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้น อยู่ในครอบครอง ลงวันที่ 24 สิงหาคม พ.ศ. 2550 จึงจำเป็นต้องออกประกาศนี้