

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สน. 5/2553

เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมและการเข้าทำสัญญาบริหารจัดการ

กองทุนส่วนบุคคล

(ฉบับที่ 2)

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 7 โดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการกำกับตลาดทุน และข้อ 19(1) และ (6) และข้อ 20 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 27/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการกองทุน ลงวันที่ 20 กรกฎาคม พ.ศ. 2552 และข้อ 5 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 27/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการกองทุน ลงวันที่ 20 กรกฎาคม พ.ศ. 2552 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 91/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการกองทุน (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 1 ตุลาคม พ.ศ. 2552 สำนักงานออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกบทนิยามคำว่า “ผู้ดูแลสภาพคล่อง” ในวรรคสองของ (ท) ใน (2) ของข้อ 5 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 22/2552 เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมและการเข้าทำสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 28 กรกฎาคม พ.ศ. 2552 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ผู้ดูแลสภาพคล่อง” หมายความว่า ผู้ลงทุนรายใหญ่ที่ได้รับการแต่งตั้งจากบริษัทจัดการกองทุนรวมให้ทำหน้าที่เพื่อให้ราคาซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟในตลาดรองสะท้อนมูลค่าหน่วยลงทุนที่คำนวณจากมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวมดังกล่าวได้อย่างใกล้เคียงกัน”

ข้อ 2 ให้ยกเลิกความในข้อ 58 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 22/2552 เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมและการเข้าทำสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 28 กรกฎาคม พ.ศ. 2552 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 58 กองทุนรวมอิตีเอฟที่สามารถยื่นคำขอจัดตั้งตามส่วนที่ 2 ของหมวด 1 ของภาค 1 ต้องมีลักษณะดังต่อไปนี้

(1) ต้องเป็นกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไปเท่านั้น
 (2) โครงการจัดการกองทุนรวมระบุไว้อย่างชัดเจนว่า กองทุนรวมดังกล่าวมีนโยบายสร้างผลตอบแทนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนตามความเคลื่อนไหวของปัจจัยอ้างอิงอย่างใดอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้

(ก) ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงาน
 (ข) ราคากลุ่มหลักทรัพย์หรือกลุ่มตราสารทางการเงินอื่นที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน
 (ค) ราคาหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟต่างประเทศที่มีลักษณะตามข้อ 58/1(2)”

ข้อ 3 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ 58/1 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 22/2552 เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมและการเข้าทำสัญญารับจัดการกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 28 กรกฎาคม พ.ศ. 2552

“ข้อ 58/1 ในกรณีที่กองทุนรวมอิตีเอฟที่ขอจัดตั้งตามข้อ 58 เป็นทั้งกองทุนรวมอิตีเอฟและกองทุนรวมหน่วยลงทุน ซึ่งมีนโยบายสร้างผลตอบแทนตามความเคลื่อนไหวของราคาหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟต่างประเทศ กองทุนรวมอิตีเอฟที่ขอจัดตั้งดังกล่าวต้องมีลักษณะดังต่อไปนี้ด้วย

(1) มีการบริหารจัดการกองทุนรวมในเชิงรับ (passive management)
 (2) กองทุนรวมอิตีเอฟต่างประเทศที่กองทุนรวมอิตีเอฟอ้างอิงต้องมีลักษณะดังนี้
 (ก) มีนโยบายสร้างผลตอบแทนให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนตามความเคลื่อนไหวของราคาทองคำ ดัชนีที่มีองค์ประกอบทั้งหมดเป็นหรือเกี่ยวข้องกับน้ำมันดิบ ดัชนีกลุ่มสินค้าโภคภัณฑ์หรือดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ที่ได้รับการยอมรับจากตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศที่เป็นสมาชิกของ World Federations of Exchange (WFE) และดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ดังกล่าวมีองค์ประกอบทั้งหมดเป็นหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศที่เป็นสมาชิกของ World Federations of Exchange (WFE) ด้วย

(ข) มีการบริหารจัดการกองทุนรวมในเชิงรับ (passive management)
 (ค) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟต่างประเทศดังกล่าวมีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศที่เป็นสมาชิกของ World Federations of Exchange (WFE) และมีลักษณะตามที่กำหนดไว้ในหลักเกณฑ์การลงทุนหรือมีไว้ซึ่งหน่วยลงทุนของกองทุนรวมต่างประเทศเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการลงทุนหรือการมีไว้เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุน โดยอนุโลม

ในกรณีที่กองทุนรวมอีทีเอฟต่างประเทศที่กองทุนรวมอีทีเอฟอ้างอิง มีนโยบายสร้างผลตอบแทนตามความเคลื่อนไหวของราคาทองคำ สำนักงานจะพิจารณาอนุมัติคำขอจัดตั้งกองทุนรวมอีทีเอฟ เมื่อมีข้อบังคับของตลาดหลักทรัพย์เกี่ยวกับการรับสมาชิกที่สามารถส่งคำสั่งซื้อหรือขายเฉพาะหลักทรัพย์ที่อ้างอิงกับราคาทองคำแล้ว”

ข้อ 4 ให้ยกเลิกความใน (1) ของข้อ 60 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 22/2552 เรื่อง การจัดตั้งกองทุนรวมและการเข้าทำสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 28 กรกฎาคม พ.ศ. 2552 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“(1) ข้อ 22 วรรคหนึ่ง (1) และ (3) และข้อ 27 วรรคหนึ่ง (1)”

ข้อ 5 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน พ.ศ. 2553 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 มีนาคม พ.ศ. 2553

(นายธีระชัย ภูวนาถนรานุบาล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

หมายเหตุ : เหตุผลในการออกประกาศฉบับนี้ คือ เพื่อกำหนดปัจจัยอ้างอิงของกองทุนรวมอีทีเอฟเพิ่มเติม โดยให้รวมถึงราคาหลักทรัพย์หรือตราสารทางการเงินอื่นตัวใดตัวหนึ่ง และเพื่อกำหนดลักษณะของกองทุนรวมอีทีเอฟต่างประเทศที่กองทุนรวมอีทีเอฟสามารถใช้เป็นปัจจัยอ้างอิงได้ อันจะช่วยเพิ่มสินค้าประเภทใหม่ในตลาดทุนเพื่อให้ผู้ลงทุนมีทางเลือกในการลงทุนหลากหลายมากขึ้น จึงจำเป็นต้องออกประกาศฉบับนี้