

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ/น. 13/2553

เรื่อง หลักเกณฑ์และเงื่อนไขในการขายชอร์ตหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ
โดยการยืมหรือซื้อหน่วยลงทุนนั้นมาเพื่อส่งมอบ

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 4(1) และ (2) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน
ที่ ทธ. 49/2552 เรื่อง การขายหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมอีทีเอฟโดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มี
หลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง ลงวันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2552 สำนักงานออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟตามคำสั่งของลูกค้า
โดยการยืมหน่วยลงทุนนั้นมาส่งมอบ ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ในประกาศคณะกรรมการ
กำกับตลาดทุนว่าด้วยการขายหลักทรัพย์โดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง
ที่กำหนดไว้สำหรับการขายชอร์ตตามคำสั่งของลูกค้า โดยอนุโลม

ข้อ 2 ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟโดยการซื้อ
หน่วยลงทุนนั้นจากบริษัทจัดการกองทุนรวมมาเพื่อส่งมอบ ให้บริษัทหลักทรัพย์ปฏิบัติตามข้อกำหนดต่อไปนี้

(1) ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตในนามของบริษัทหลักทรัพย์เอง บริษัทหลักทรัพย์ต้องมี
หลักทรัพย์ ตราสารทางการเงิน หรือทรัพย์สินอื่น ตามประเภทที่กองทุนรวมอีทีเอฟใช้เป็นปัจจัยอ้างอิง
ตามที่กำหนดไว้ในโครงการจัดการกองทุนรวมดังกล่าวอยู่ในความครอบครองในขณะที่มีคำสั่งขายชอร์ต
โดยบริษัทหลักทรัพย์ต้องมั่นใจว่าตนเองสามารถส่งมอบหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟตามรายการ
ที่ขายชอร์ตภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือภายในระยะเวลาที่คู่สัญญาซื้อขายหลักทรัพย์
ตกลงกัน แล้วแต่กรณี ทั้งนี้ ด้วยการนำหลักทรัพย์ ตราสารทางการเงิน หรือทรัพย์สินอื่นนั้น ไปชำระเป็น
ค่าซื้อหน่วยลงทุนที่ต้องส่งมอบ

(2) ในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตตามคำสั่งของลูกค้าที่เป็นผู้ลงทุนรายใหญ่ของกองทุนรวม
อีทีเอฟ บริษัทหลักทรัพย์ต้องให้ลูกค้าดังกล่าวแสดงว่ามีหลักทรัพย์ ตราสารทางการเงิน หรือทรัพย์สินอื่น
ตามประเภทที่กองทุนรวมอีทีเอฟใช้เป็นปัจจัยอ้างอิงตามที่กำหนดไว้ในโครงการจัดการกองทุนรวมดังกล่าว
อยู่ในความครอบครองในขณะที่มีคำสั่งขายชอร์ต โดยบริษัทหลักทรัพย์ต้องมั่นใจว่าลูกค้าสามารถส่งมอบ
หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟตามรายการที่ขายชอร์ตภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด
หรือภายในระยะเวลาที่คู่สัญญาซื้อขายหลักทรัพย์ตกลงกัน แล้วแต่กรณี ทั้งนี้ ด้วยการนำหลักทรัพย์
ตราสารทางการเงิน หรือทรัพย์สินอื่นนั้น ไปชำระเป็นค่าซื้อหน่วยลงทุนที่ต้องส่งมอบ

ผู้ลงทุนรายใหญ่ตามวรรคหนึ่ง ให้หมายความถึง ผู้ลงทุนที่ซื้อหรือขาย หน่วยลงทุนของกองทุนรวมกับบริษัทจัดการกองทุนรวมในปริมาณหรือมูลค่าตามที่กำหนดไว้ใน โครงการจัดการกองทุนรวม ซึ่งต้องไม่น้อยกว่าสิบล้านบาท หรือตามที่ได้รับผ่อนผันจากสำนักงาน เป็นรายกรณี

ข้อ 3 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 16 พฤษภาคม พ.ศ. 2553 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 26 เมษายน พ.ศ. 2553

(นายธีระชัย ภูวนาถนรานุบาล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

หมายเหตุ : เหตุผลในการออกประกาศฉบับนี้ คือ เนื่องจากได้มีการปรับปรุงประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์เพื่อให้เป็นไปตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 และเพื่อปรับปรุงหลักเกณฑ์ในการขายชอร์ตหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ ให้สอดคล้องกับการเพิ่มเติมปัจจัยอ้างอิงของกองทุนรวมอีทีเอฟที่กำหนดครอบคลุมถึงหลักทรัพย์ ตราสารทางการเงินและทรัพย์สินอื่น จึงเห็นควรออกประกาศเพื่อทดแทนประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 31/2550 เรื่อง หลักเกณฑ์ และเงื่อนไขในการขายชอร์ต หน่วยลงทุนอีทีเอฟโดยการยืมหรือซื้อหน่วยลงทุนนั้นมาเพื่อส่งมอบ ลงวันที่ 26 ตุลาคม พ.ศ. 2550 จึงจำเป็นต้องออกประกาศนี้