

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ๗๙/๒๕๕๕

เรื่อง หลักเกณฑ์เงื่อนไข และวิธีการในการลงทุนหรือ
แสดงหาประโยชน์เพื่อกองทุนรวมหุ้นระยะยาว

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 16/6 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 และมาตรา 117 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 อันเป็นพระราชบัญญัติที่มีบังคับใช้ตั้งแต่วันประกาศกับมาตรา 29 ประกอบกับมาตรา 33 มาตรา 34 มาตรา 41 มาตรา 43 มาตรา 44 และมาตรา 64 ของรัฐธรรมนูญแห่งราชอาณาจักรไทย บัญญัติให้กระทำได้โดยอาศัยอำนาจตามบทบัญญัติแห่งกฎหมาย คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับกับการลงทุนหรือแสดงหาประโยชน์เพื่อกองทุนรวมหุ้นระยะยาวของบริษัทจัดการกองทุนรวม

ข้อ 2 ในประกาศนี้

คำว่า “สัญญาซื้อขายล่วงหน้า” “ตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแห่ง” และ “ค่าเดคลต้า” ให้มีความหมายเช่นเดียวกับบทนิยามของคำดังกล่าวตามที่กำหนดไว้ในประกาศ สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการลงทุนและการมีไว้เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุน

“การลงทุนหรือแสดงหาประโยชน์” หมายความว่า การลงทุนหรือแสดงหาประโยชน์จากหลักทรัพย์ สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ทรัพย์สินอื่น การขายหลักทรัพย์โดยที่ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง หรือการหาดอกรผลหรือแสดงหาผลประโยชน์โดยวิธีอื่น

“กองทุนรวมหุ้นระยะยาว” หมายความว่า กองทุนรวมหุ้นระยะยาวตามประกาศ สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการจัดตั้งกองทุนรวมและ การเข้าทำสัญญารับจัดการกองทุนส่วนบุคคล

“บริษัทจัดการกองทุนรวม” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาต ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวม

“บริษัทจัดทะเบียน” หมายความว่า บริษัทที่มีหุ้นที่ได้รับการจัดทะเบียนหรือได้รับอนุญาตให้ทำการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ข้อ 3 ให้บริษัทจัดการกองทุนรวมจัดการลงทุนหรือเสวงหาประโภชณ์เพื่อกองทุนรวม หุ้นระยะยาวตามหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการจัดการลงทุนเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมที่กำหนดในประกาศ สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการลงทุนและการมีไว้เพื่อเป็น ทรัพย์สินของกองทุน

การลงทุนหรือเสวงหาประโภชณ์ตามวรรคหนึ่งต้องไม่ทำให้ฐานะการลงทุนสูญเสียของ กองทุนรวมในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนมีมูลค่าต่ำกว่าร้อยละหกสิบห้าของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ โดยเฉลี่ยรอบปีบัญชีของกองทุนรวมนั้น

ฐานะการลงทุนสูญเสียตามวรรคสองให้คำนวณจากผลรวมของมูลค่าการลงทุนในหุ้นสามัญ ของบริษัทจดทะเบียนทั้งหมด หักด้วยผลรวมของการลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือตราสาร ที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าແเพงที่ลดความเสี่ยงจากการลงทุนในหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียน

ทั้งนี้ การลงทุนหรือมีไว้ซึ่งสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือตราสารที่มีลักษณะของสัญญา ซื้อขายล่วงหน้าແเพงตามวรรคสาม ให้คำนวณตามขนาดของสัญญาหรือตราสารนั้น (notional amount) เว้นแต่ในกรณีที่เป็นสัญญาอปชัน ให้คำนวณตามขนาดของสัญญาคูณกับค่าเดลต้าของสัญญาอปชันแทน

ข้อ 4 ให้กองทุนรวมหุ้นระยะยาวที่ได้รับอนุมัติให้จัดตั้งก่อนประกาศนี้มีผลใช้บังคับ โดยโครงการจัดการกองทุนรวมนี้ไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในข้อ 3 ยังคงสามารถจัดการลงทุน หรือเสวงหาประโภชณ์ตามโครงการดังกล่าวต่อไปได้แต่จะเสนอขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมนั้น เพิ่มเติมได้ต่อเมื่อได้จัดการลงทุนหรือแก้ไขโครงการจัดการกองทุนรวมให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ ที่กำหนดในข้อ 3 แล้ว

ข้อ 5 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2555 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 12 มกราคม พ.ศ. 2555

(นายวราพล โสคติyanรักษา)

เลขานุการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน