



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สน. 50 /2546

เรื่อง การกำหนดอัตราส่วนการลงทุนของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

ที่มีนโยบายการลงทุนในตลาดเงิน

(ฉบับที่ 3)

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 6 วรรคหนึ่ง แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กน. 14/2543 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดการกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 4 เมษายน พ.ศ. 2543 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กน. 4/2544 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดการกองทุนส่วนบุคคล (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 2 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2544 สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้เพิ่มบทนิยามคำว่า “ใบแสดงสิทธิ” “หลักทรัพย์อ้างอิง” และ “บริษัทจดทะเบียน” ระหว่างบทนิยามคำว่า “กองทุนที่มีนโยบายการลงทุนในตลาดเงิน” และคำว่า “ธุรกรรมการซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืน” ในข้อ 1 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 34 /2545 เรื่อง การกำหนดอัตราส่วนการลงทุนของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่มีนโยบายการลงทุนในตลาดเงิน ลงวันที่ 30 กรกฎาคม พ.ศ. 2545

“ใบแสดงสิทธิ” หมายความว่า ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย (depository receipt)

“หลักทรัพย์อ้างอิง” หมายความว่า หลักทรัพย์ประเภทใดประเภทหนึ่งทีออกโดยบริษัทจดทะเบียนและใช้เพื่อรองรับใบแสดงสิทธิ

“บริษัทจดทะเบียน” หมายความว่า บริษัทที่มีหุ้นจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ข้อ 2 ให้ยกเลิกความในข้อ 3 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 34/2545 เรื่อง การกำหนดอัตราส่วนการลงทุนของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่มีนโยบายการลงทุนในตลาดเงิน ลงวันที่ 30 กรกฎาคม พ.ศ. 2545 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 20/2546 เรื่อง การกำหนดอัตราส่วนการลงทุนของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่มีนโยบายการลงทุนในตลาดเงิน (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 8 สิงหาคม พ.ศ. 2546 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 3 ให้บริษัทจัดการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งตราสารแห่งหนึ่ง เงินฝาก และหลักทรัพย์ ที่บุคคลใดดังต่อไปนี้เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน เพื่อเป็นทรัพย์สินของ กองทุนที่มีนโยบายการลงทุนในตลาดเงินได้ โดยมีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นไม่เกินร้อยละสิบห้าของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิของกองทุนที่มีนโยบายการลงทุนในตลาดเงิน ทั้งนี้ ให้นำตราสารแห่งหนึ่งและหลักทรัพย์ ที่บุคคลดังกล่าวเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน ตามธุรกรรมการซื้อขาย โดยมี สัญญาขายคืนรวมในอัตราส่วนการลงทุนดังกล่าวด้วย

(1) ตราสารแห่งหนึ่งและหลักทรัพย์ที่บุคคลดังต่อไปนี้เป็นผู้ออก หรือเงินฝากที่บุคคล ดังกล่าวรับฝากไว้

(ก) ธนาคารหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น

(ข) ธนาคารพาณิชย์ตามกฎหมายว่าด้วยการธนาคารพาณิชย์

(ค) บริษัทเงินทุน

(ง) บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

(จ) บริษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย

(2) พันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งที่รัฐวิสาหกิจเป็นผู้ออก

(3) ตัวแลกเงิน ตัวสัญญาใช้เงิน หรือหุ้นกู้ ที่บริษัทจำกัดหรือบริษัทมหาชนจำกัด เป็นผู้ออก โดยมีบุคคลตาม (1) (ก) (ข) หรือ (ค) เป็นผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน

(4) ตัวแลกเงิน ตัวสัญญาใช้เงิน หรือหุ้นกู้ ที่บริษัทได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ในสี่อันดับแรก (category) จากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการเห็นชอบหรือ ได้รับการยอมรับจากสำนักงาน เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน

(5) ตราสารแห่งหนึ่งที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในสี่อันดับแรก (category) จากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการเห็นชอบจากสำนักงาน

(6) พันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งที่รัฐวิสาหกิจตามกฎหมายต่างประเทศ รัฐบาลต่างประเทศ หรือองค์การระหว่างประเทศ เป็นผู้ออกหรือผู้ค้ำประกัน โดยพันธบัตรหรือ ตราสารแห่งหนึ่ง หรือองค์การระหว่างประเทศที่เป็นผู้ออก ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือใน สี่อันดับแรก (category) จากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงาน

(7) ใบแสดงสิทธิที่ผู้ออก หรือผู้ค้ำประกันหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นบุคคลตาม (1) (2) (3) (4) หรือ (6)

ในกรณีที่บุคคลตามวรรคหนึ่งเป็นธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน หรือบริษัทเงินทุนอุตสาหกรรมแห่งประเทศไทย ให้บริษัทจัดการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่ง ตราสารแห่งหนึ่งและหลักทรัพย์ตามวรรคหนึ่ง มีมูลค่ารวมกันทั้งสิ้นไม่เกินร้อยละสิบห้าของมูลค่า ทรัพย์สินสุทธิของกองทุนที่มีนโยบายการลงทุนในตลาดเงิน และให้นำเงินฝากที่บุคคลดังกล่าวรับฝากไว้รวมใน อัตราส่วนดังกล่าวด้วย ทั้งนี้ ในกรณีที่ธนาคารพาณิชย์นั้นเป็นสาขาของธนาคารต่างประเทศ ให้นำ อัตราส่วนการลงทุนในตราสารแห่งหนึ่งและหลักทรัพย์ที่ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นสาขาของธนาคารต่างประเทศ

หรือธนาคารต่างประเทศดังกล่าวเป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน และเงินฝาก  
ในธนาคารพาณิชย์ที่เป็นสาขาของธนาคารต่างประเทศดังกล่าวรวมกัน

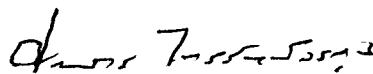
การคำนวณอัตราส่วนการลงทุนตามวรรคสอง มิให้นำเงินฝากในบัญชีเงินฝากเพื่อการ  
ดำเนินงานของกองทุนที่มีนโยบายการลงทุนในตลาดเงิน คำสัญญาใช้เงินที่ออกโดยบริษัทเงินทุนหลักทรัพย์  
กรุงเทพธนกิจ จำกัด (มหาชน) ตามโครงการรับแลกเปลี่ยนคำสัญญาใช้เงินของ 16 สถาบันการเงินเป็น  
คำสัญญาใช้เงินของบริษัทเงินทุนหลักทรัพย์กรุงเทพธนกิจ จำกัด (มหาชน) และบัตรเงินฝากที่ออกโดย  
ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ตามโครงการธนาคารกรุงเทพรับแลกเปลี่ยนคำสัญญาใช้เงิน 42 บริษัท  
(คปต. 42) รวมในอัตราส่วนดังกล่าว”

ข้อ 3 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ 3/1 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการ  
กำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 34/2545 เรื่อง การกำหนดอัตราส่วนการลงทุนของ  
กองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่มีนโยบายการลงทุนในตลาดเงิน ลงวันที่ 30 กรกฎาคม พ.ศ. 2545

“ข้อ 3/1 ในกรณีที่บริษัทจัดการลงทุนในใบแสดงสิทธิ ให้บริษัทจัดการนับมูลค่าของ  
หลักทรัพย์อ้างอิงที่ใบแสดงสิทธิดังกล่าวได้อย่างรวมในอัตราส่วนการลงทุนที่กำหนดในข้อ 3 หรือข้อ 6  
แล้วแต่กรณี โดยถือเสมือนหนึ่งว่าบริษัทจัดการได้ลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นโดยตรง ทั้งนี้ มูลค่าของ  
หลักทรัพย์อ้างอิงที่นำมาคำนวณรวมในอัตราส่วนการลงทุนดังกล่าวให้มีมูลค่าเท่ากับมูลค่าใบแสดงสิทธิ  
ที่บริษัทจัดการได้ลงทุนไว้”

ข้อ 4 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2547 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 26 ธันวาคม พ.ศ. 2546



(นายประสาร ไตรรัตน์วรกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์