

๒๕ กรกฎาคม 2559

เรียน ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ทุกแห่ง¹
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนทุกแห่ง²

ที่ นพ.(ว) ๓ /2559 เรื่อง การฝ่ายหลักเกณฑ์การลงทุนในผลิตภัณฑ์
สกุลเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทย

ด้วยธนาคารแห่งประเทศไทย (“บปท.”) ได้ออกประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงินเรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 27 มิถุนายน 2559 และได้มีหนังสือเวียนของ บปท. ที่ ฝกง.(21)ว. 32/2559 เรื่อง การปรับปรุงหลักเกณฑ์ การลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ ลงวันที่ 27 มิถุนายน 2559

สำนักงานจึงขอนำส่วนของการลงทุนของประเทศไทยและหนังสือเวียนดังกล่าวให้แก่ผู้ประกอบธุรกิจทั้งนี้ ขอเรียนสรุปสาระสำคัญของประกาศและหนังสือเวียนข้างต้น ซึ่งมีอยู่ 3 เรื่อง ดังนี้

1. เพิ่มเติมให้ผู้ลงทุนประเภท Qualified Investor (“QI”) ที่มีคุณสมบัติเป็นนิติบุคคลไทย หรือนิติบุคคลไทย ที่มีเงินฝาก หรือเงินลงทุนในตราสารและอนุพันธ์ รวมตั้งแต่ 100 ล้านบาทขึ้นไป ให้สามารถลงทุนในตราสารในต่างประเทศหรือทำธุกรรมอนุพันธ์ได้โดยตรง โดยไม่ผ่านตัวแทนการลงทุน ได้ โดยกรณีที่ลงทุนโดยตรงไม่ผ่านตัวแทนการลงทุนมีหลักเกณฑ์ ดังนี้

1.1 วงเงินลงทุน สามารถส่งเงินออกไปลงทุน (flow) ไม่เกิน 5 ล้านหรือญิดอลาร์ สรอ. ต่อรายต่อปี ซึ่งรวมการส่งเงินเพื่อการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ และเพื่อฝากในบัญชีเพื่อการลงทุนด้วย

1.2 ประเภทตราสาร ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ที่อ้างอิงด้วยแบร์เติร์น ได้ทุกประเภท

1.3 ประเทศที่ลงทุนได้ ตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ที่ออกหรือจำหน่ายในประเทศสมาชิกอื่นๆ หรือประเทศที่มีหน่วยงานกำกับดูแลเป็นสมาชิกของ International Organization of Securities Commissions (IOSCO) ประเภท Signatory A ใน Multilateral Memorandum of Understanding Concerning Consultation and Cooperation and the Exchange of Information (MMOU) หรือเปิดบัญชีเพื่อการลงทุนในประเทศดังกล่าว

1.4 การรายงานข้อมูล ให้ QI จัดทำรายงานการลงทุนให้กับ บปท. ตามแบบและระยะเวลาที่ บปท. กำหนด ทั้งนี้ กรณี QI ที่ต้องการลงทุนโดยตรงไม่ผ่านตัวแทนการลงทุนนั้น ก่อนการลงทุนจะต้องแจ้งความประสงค์ต่อ บปท. ผ่านทางเว็บไซต์ของ บปท. และพิมพ์ “แบบรับทราบ” จากระบบของ บปท. และใช้แบบรับทราบดังกล่าวเป็นเอกสารประกอบการทำธุกรรมซื้อขายเงินตราต่างประเทศกับธนาคารพาณิชย์

2. ปรับหลักเกณฑ์การทำธุกรรมอนุพันธ์อ้างอิงด้วยแบร์เติร์น โดยให้ผู้ลงทุนทำธุกรรมอนุพันธ์ที่มีจำนวนเงินตามสัญญา (notional amount) เป็นสกุลเงินตราต่างประเทศกับคู่สัญญาที่เป็นบุคคลที่มีลิขสิทธิ์ออกประเทศ หรือนิติบุคคลรับอนุญาตเท่านั้น

3. ปรับปรุงแบบรายงานการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ของผู้ลงทุนรายย่อย เพื่อให้ QI รวมถึงบริษัทหลักทรัพย์ ธนาคารพาณิชย์ และผู้จัดการกองทุนส่วนบุคคล ที่เป็นตัวแทนการลงทุนของ QI และรายย่อย จัดทำรายงานได้สะดวกยิ่งขึ้น ทั้งนี้ สามารถเรียกดูคู่มือรายงานดังกล่าวที่ www.bot.or.th ภายใต้หัวข้อ สถาบัน / การรับส่งข้อมูลกับ บปภ. / แบบรายงานและเอกสารซึ่งแจงข้อมูลตลาดการเงิน / ข้อมูลการลงทุนในตราสาร ในต่างประเทศและอนุพันธ์

4. นอกจากนี้ จากการหารือกับ บปภ. สำนักงานขอเรียนเพิ่มเติมว่า QI สามารถลงทุนในตราสาร ในต่างประเทศ หรือทำธุรกรรมอนุพันธ์ โดยจะทำผ่านตัวแทนการลงทุนก็ได้ โดยอยู่ภายใต้หลักเกณฑ์ของสำนักงาน ดังนี้

4.1 วงเงินลงทุน ต้องขอจัดสรรงเงินผ่านระบบจัดสรรงเงินของสำนักงาน โดยจะได้รับจัดสร งเงินตามจำนวนเงินที่ผู้ลงทุนแจ้งว่าต้องการนำออกไปลงทุน

4.2 ประเภทตราสาร เป็นไปตามที่หลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการ ก.ต.ท. กำหนด

4.3 ประเภทที่ลงทุนได้ ปัจจุบันไม่มีการจำกัดประเทศที่จะไปลงทุน อย่างไรก็ได้ สำนักงาน อุปerrห่วงการปรับปรุงแก้ไขหลักเกณฑ์โดยจะกำหนดประเทศที่ลงทุนได้ ซึ่งได้แก่ ประเทศที่เป็นสมาชิกของ International Organization of Securities Commissions (IOSCO) โดยหน่วยงานกำกับดูแลต้องเป็นพหุภาคีประเทศ Signatory A ใน Multilateral Memorandum of Understanding Concerning Consultation and Cooperation and the Exchange of Information (MMOU) (IOSCO MMOU) หรือประเทศในกลุ่ม Organization for Economic Co-operation and Development (OECD) หรือประเทศที่อยู่ในประชาคมเศรษฐกิจอาเซียน (AEC) ทั้งนี้ หลักเกณฑ์ที่แก้ไขดังกล่าว ได้ผ่านการเปิดรับฟังความคิดเห็น (public hearing) แล้ว หากดำเนินการแล้วเสร็จ จะแจ้งให้ผู้ประกอบธุรกิจทราบต่อไป

4.4 การรายงานข้อมูล ตัวแทนการลงทุนต้องจัดทำรายงานการลงทุนของ QI ให้กับ บปภ. ตามแบบและระยะเวลาที่ บปภ. กำหนดในข้อ 3. โดยสามารถเลือกรายงานตามแบบที่กำหนดใช้อยู่ในปัจจุบัน หรือตามแบบที่กำหนดให้กับ QI กรณีที่ไปลงทุนโดยไม่ผ่านตัวแทนการลงทุนก็ได้

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

(นางสาวพรพรรณ อินทรรุ่ง)

ผู้อำนวยการฝ่ายนโยบายและพัฒนาธุรกิจตัวกลาง

เลขานุการ

ฝ่ายนโยบายและพัฒนาธุรกิจตัวกลาง

โทรศัพท์ 0-2263-6574

โทรสาร 0-2263-6575

- สิ่งที่ส่งมาด้วย
- ภาพถ่ายประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติ เกี่ยวกับการลงทุนในตราสาร ในต่างประเทศ และอนุพันธ์ (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 27 มิถุนายน 2559
 - ภาพถ่ายหนังสือธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ ฝก.(21)ว. 32/2559 เรื่อง การปรับปรุงหลักเกณฑ์ การลงทุนในตราสาร ในต่างประเทศและอนุพันธ์ ลงวันที่ 27 มิถุนายน 2559



ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน

เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ (ฉบับที่ ๓)

อาศัยอำนาจตามความในข้อ ๗ แล้วข้อ ๒๐ แห่งกฎกระทรวง ฉบับที่ ๑๓ (พ.ศ. ๒๕๔๗) ออกตามความในพระราชบัญญัติความคุ้มการแลกเปลี่ยนเงิน พุทธศักราช ๒๕๔๕ และที่แก้ไขเพิ่มเติม แล้วข้อ ๑๓ (๓) ข้อ ๑๓ ทวี ข้อ ๑๓ ตรี ข้อ ๑๔ และข้อ ๑๕ แห่งประกาศกระทรวงการคลัง เรื่อง คำสั่งรัฐมนตรีให้ไว้แก่ตัวแทนรับอนุญาต ลงวันที่ ๓๑ มีนาคม ๒๕๔๗ และที่แก้ไขเพิ่มเติม เจ้าพนักงานออกประกาศไว้ ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ให้ยกเลิกคำนิยามคำว่า “ผู้ลงทุน” ในข้อ ๒ ของประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ ลงวันที่ ๒๕ มิถุนายน ๒๕๔๘ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ “ผึ้งทุน” หมายความว่า

- (๑) กองทุนบำเหน็จบำรุงข้าราชการ
 - (๒) กองทุนประกันสังคม
 - (๓) กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
 - (๔) กองทุนรวม (ไม่รวมกองทุนส่วนบุคคล)
 - (๕) บริษัทหลักทรัพย์ (เฉพาะการลงทุนเพื่อต้นเงินหรือเพื่อผู้ถือทุนรายอื่นตามประกาศนี้)
 - (๖) บริษัทประกันชีวิตและบริษัทประกันวินาศภัย
 - (๗) สถาบันการเงินที่มีกิจกรรมทางการเงินที่สำคัญ
 - (๘) นิติบุคคลที่จดทะเบียนตามกฎหมายไทยที่มีsinทรัพย์ตามงบดุลตั้งแต่ ๕,๐๐๐ ล้านบาท
 - (๙) บริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
 - (๑๐) ผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตามพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และที่แก้ไขเพิ่มเติม
 - (๑๑) นิติบุคคลที่จดทะเบียนตามกฎหมายไทยหรือบุคคลธรรมชาติที่มีถิ่นที่อยู่ในประเทศไทยหรืออนุพันธ์ หรือเงินฝาก ตั้งแต่ ๑๐๐ ล้านบาทขึ้นไป”

ข้อ ๒ ให้ยกเลิกความในข้อ ๓ ของประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ ลงวันที่ ๒๕ มิถุนายน ๒๕๕๘ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ ๓ เจ้าพนักงานอนุญาตให้ผู้ลงทะเบียนตามนิยามผู้ลงทะเบียน (๑) ถึง (๑๐) ในข้อ ๒ ซึ่งหรือ
แลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับนิติบุคคลรับอนุญาต หรือถอนเงินตราต่างประเทศจากบัญชีเหล่านั้น
ต่างประเทศหรือบัญชีเหล่านั้นในประเทศไทยไม่มีภาระผูกพันตามข้อ ๒๓ ของประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการ
แลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการแลกเปลี่ยนเงิน ลงวันที่ ๓๑ มีนาคม
๒๕๔๗ และที่แก้ไขเพิ่มเติม หรือบัญชีเพื่อการลงทะเบียน เพื่อวัตถุประสงค์ดังต่อไปนี้ได้โดยไม่จำกัดจำนวน

(๑) ชำระเงินลงทุนในตราสารในต่างประเทศให้แก่บุคคลที่มีถื่นที่อยู่นอกประเทศ
นิติบุคคลรับอนุญาต ผู้ลงทุนรายอื่น หรือผู้ออกตราสารในต่างประเทศ
ทั้งนี้ การชำระเงินลงทุนข้างต้นให้รวมถึงการชำระเงินตามอนุพันธ์ตาม (๒) ที่อ้างอิง
ตราสารในต่างประเทศในกรณีที่มีการรับมอบตราสารในต่างประเทศ ในวันที่รับมอบด้วย

(๒) ชำระเงินลงทุนในอนุพันธ์ให้แก่บุคคลที่มีถื่นที่อยู่นอกประเทศ หรือนิติบุคคลรับอนุญาต
ที่เป็นคู่สัญญา ตามลักษณะอนุพันธ์ดังนี้

(ก) เป็นอนุพันธ์ที่ซื้อขายในตลาดในต่างประเทศหรือทำกับบุคคลที่มีถื่นที่อยู่
นอกประเทศ และมีลักษณะดังนี้

๑. อ้างอิงตัวแปรต่างประเทศที่ไม่ใช้อัตราแลกเปลี่ยนที่เกี่ยวกับเงินบาท
หรือไม่ใช่ดัชนีทางการเงินที่คำนวณโดยใช้อัตราแลกเปลี่ยนที่เกี่ยวกับเงินบาท และ

๒. มีการตกลงจำนวนเงินตามสัญญาเป็นเงินตราต่างประเทศ

(ข) เป็นอนุพันธ์ที่ทำกับนิติบุคคลรับอนุญาตที่อ้างอิงตัวแปรต่างประเทศ

ทั้งนี้ กรณีเป็นอนุพันธ์ที่อ้างอิงตัวแปรต่างประเทศที่ไม่ใช้อัตราแลกเปลี่ยนที่เกี่ยวกับ
เงินบาท หรือไม่ใช่ดัชนีทางการเงินที่คำนวณโดยใช้อัตราแลกเปลี่ยนที่เกี่ยวกับเงินบาทจะต้องมีการตกลง
จำนวนเงินตามสัญญาเป็นเงินตราต่างประเทศ

การทำอนุพันธ์ตาม (ข) ไม่รวมถึงอนุพันธ์ที่อ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยนที่เป็นการทำเพื่อ
ป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยนอื่นจาก การลงทุนในตราสารในต่างประเทศหรือจากการฝากเงิน
ในบัญชีเพื่อการลงทุน

กรณีที่เป็นอนุพันธ์ที่อ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยนที่เกี่ยวกับเงินบาทหรือดัชนีทางการเงิน
ที่เกิดจากการคำนวณโดยใช้อัตราแลกเปลี่ยน ให้ปฏิบัติตามข้อ ๔ ด้วย

ทั้งนี้ ให้ถือปฏิบัติตามประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่เกี่ยวกับการอนุญาตให้
ธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมอนุพันธ์ที่อ้างอิงตัวแปรด้านตลาด และธุรกรรม Credit Derivatives รวมทั้ง
หนังสือเวียนของเจ้าพนักงานที่เกี่ยวกับการทำธุรกรรมข้างต้นในส่วนที่เกี่ยวข้องกับผู้ลงทุนด้วย

ในกรณีที่ผู้ลงทุนประสงค์จะชำระเงินลงทุนในอนุพันธ์กรณีอื่นนอกจากที่กำหนดไว้ใน (๒)
ให้ผู้ลงทุนยื่นขออนุญาตต่อเจ้าพนักงานก่อน

(๓) ชำระเงินตามธุรกรรมยืมหรือให้ยืมตราสารในต่างประเทศ (Securities Borrowing
and Lending) ให้แก่บุคคลที่มีถื่นที่อยู่นอกประเทศ นิติบุคคลรับอนุญาต หรือผู้ลงทุนรายอื่นที่ได้รับ^๑
ใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทกิจกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วย
หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ โดยตกลงจำนวนเงินตามสัญญาเป็นเงินตราต่างประเทศ

(๔) ชำระเงินตามธุรกรรมขายหรือซื้อตราสารในต่างประเทศโดยมีสัญญาซื้อคืนหรือขายคืน
ตามลำดับ (Repo หรือ Reverse Repo) ให้แก่บุคคลที่มีถื่นที่อยู่นอกประเทศ นิติบุคคลรับอนุญาต หรือ
ผู้ลงทุนรายอื่น โดยตกลงจำนวนเงินตามสัญญาเป็นเงินตราต่างประเทศ

(๕) ชำระรายจ่ายหรือผลขาดทุนที่เกิดจากการลงทุนหรือทำธุรกรรมตาม (๑) ถึง (๔)

ในกรณีที่ตัวแทนการลงทุนซื้อหรือแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศตามวรรคหนึ่งแทน
ผู้ลงทุน ให้สามารถหักกลบรายการชำระเงินที่เกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและ
อนุพันธ์ของผู้ลงทุนกับลูกค้ารายอื่น และให้ซื้อหรือแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศเพื่อชำระเงินหรือ^๒
รับชำระเงินกับคู่ค้าในต่างประเทศตามยอดสุทธิจากการหักกลบท่านนั้น โดยให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์และ
วิธีการที่เจ้าพนักงานกำหนด”

ข้อ ๓ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ ๓/๑ ของประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ ลงวันที่ ๒๕ มิถุนายน ๒๕๕๘

“ข้อ ๓/๑ เจ้าพนักงานอนุญาตให้ผู้ลงทุนตามนิยามผู้ลงทุน (๑๑) ในข้อ ๒ ซึ่งหรือ แลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศกับนิติบุคคลรับอนุญาต หรือถอนเงินตราต่างประเทศจากบัญชีแหล่งต่างประเทศหรือบัญชีแหล่งในประเทศแบบไม่มีภาระผูกพันตามข้อ ๒๓ ของประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการแลกเปลี่ยนเงิน ลงวันที่ ๓๐ มีนาคม ๒๕๕๗ และที่แก้ไขเพิ่มเติม หรือบัญชีเพื่อการลงทุน เพื่อวัตถุประสงค์ดังต่อไปนี้ได้

(๑) กรณีลงทุนโดยไม่ผ่านตัวแทนการลงทุน ให้ข้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศเพื่อชำระเงินลงทุนตามที่กำหนดในข้อ ๓ (๑) และ (๒) และเพื่อชำระรายจ่ายหรือผลขาดทุนที่เกิดจากการลงทุนดังกล่าวได้เป็นจำนวนรวมกันไม่เกินปีละ ๕ ล้านдолลาร์สหรัฐอเมริกาหรือเทียบเท่าตามอัตราราคาต่อราย โดยจะต้องเป็นการชำระเงินลงทุนในตราสารในต่างประเทศ ตามข้อ ๓ (๑) ที่ออกหรือจำหน่ายในประเทศสมาชิกอาเซียน หรือในประเทศที่มีหน่วยงานกำกับดูแลเป็นสมาชิกของ International Organization of Securities Commissions (IOSCO) โดยหน่วยงานดังกล่าวต้องเป็นพหุภาคีประเภท Signatory A ใน Multilateral Memorandum of Understanding Concerning Consultation and Cooperation and the Exchange of Information (MMOU) หรือชำระเงินลงทุนในอนุพันธ์ตาม ข้อ ๓ (๒) ที่ซื้อขายในตลาดในประเทศดังกล่าวหรือทำกับบุคคลในประเทศดังกล่าว และจะต้องชำระเงินไปยังประเทศดังกล่าวด้วย

ทั้งนี้ ในการนี้ที่ผู้ลงทุนถอนเงินตราต่างประเทศจากบัญชีเพื่อการลงทุนไปชำระเงินลงทุน หรือชำระรายจ่ายหรือผลขาดทุนที่เกิดจากการลงทุนตามวรรคก่อน ให้ทำได้โดยไม่นับรวมเป็นวงเงินตามวรรคก่อน

(๒) กรณีลงทุนผ่านตัวแทนการลงทุน ให้ข้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศเพื่อชำระเงินตามวัตถุประสงค์ที่กำหนดในข้อ ๓ ได้โดยมียอดคงค้างการลงทุนตามราคานุณ ขณะใดขณะหนึ่งไม่เกินวงเงินที่ผู้ลงทุนได้รับจัดสรรจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ทั้งนี้ กรณีชำระเงินลงทุนตามข้อ ๓ (๒) (ก) ที่ทำกับบุคคลที่มิถันที่อยู่นอกประเทศไทย หรือกรณีชำระเงินลงทุนตามข้อ ๓ (๒) (ข) ที่อ้างอิงตัวแปรต่างประเทศอื่นที่ไม่ใช่อัตราแลกเปลี่ยน หรืออ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยนที่ไม่ใช่เป็นการทำเพื่อป้องกันความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยน หรือกรณีชำระเงินตามธุรกรรมตามข้อ ๓ (๓) และข้อ ๓ (๔) ให้ทำได้เฉพาะกรณีที่ลงทุนผ่านตัวแทนการลงทุนซึ่งเป็นบริษัทจัดการที่เป็นผู้จัดการกองทุนส่วนบุคคลเท่านั้น

ในการซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศตามวรรคหนึ่ง ให้ฝ่ายเข้าบัญชีเพื่อถูกค้าของตัวแทนการลงทุนที่เปิดโดยตัวแทนการลงทุนของตน

ทั้งนี้ ในการนี้ที่ตัวแทนการลงทุนซื้อหรือแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศตามวรรคหนึ่งแทนผู้ลงทุน ให้สามารถหักกลบรายการชำระเงินหรือรับชำระเงินที่เกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ของผู้ลงทุนกับถูกค้ารายอื่น และให้ข้อ หรือแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศเพื่อชำระเงินหรือรับชำระเงินกับถูกค้าในต่างประเทศตามยอดสุทธิจากการหักกลบท่านนี้ โดยให้เป็นปีตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่เจ้าพนักงานกำหนด”

ข้อ ๔ ให้ยกเลิกความในข้อ ๔ ของประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ ลงวันที่ ๒๕ มิถุนายน ๒๕๕๘ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ ๔ เมื่อผู้ลงทุนหรือตัวแทนการลงทุนขอซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศ ตามข้อ ๓ และ ข้อ ๓/๑ นิติบุคคลรับอนุญาตด้องเรียกให้ผู้ลงทุนหรือตัวแทนการลงทุนยื่นเอกสารหลักฐานดังนี้

(๑) ในกรณีที่เป็นผู้ลงทุนตามนิยามผู้ลงทุน (๑) ถึง (๑๐) ในข้อ ๒ ให้เรียกเอกสารหลักฐานดังนี้

(ก) ในกรณีที่เป็นผู้ลงทุนตามนิยามผู้ลงทุน (๗) ถึง (๗) และ (๑๐) ในข้อ ๒ ให้เรียกหลักฐานที่ออกโดยหน่วยงานที่กำกับดูแลผู้ลงทุน หรือในกรณีที่เป็นผู้ลงทุน (๑) (๔) และ (๙) ในข้อ ๒ ให้เรียกหลักฐานที่ออกโดยคณะกรรมการหรือผู้มีอำนาจบริหารของผู้ลงทุน ซึ่งหลักฐานดังกล่าวต้องแสดงการอนุญาตให้ผู้ลงทุนลงทุนในตราสารในต่างประเทศ หรืออนุพันธ์ โดยระบุวงเงินลงทุน

(ข) ในกรณีที่เป็นผู้ลงทุนตามนิยามผู้ลงทุน (๘) ในข้อ ๒ ให้เรียกงบการเงินที่ผ่านการตรวจสอบและรับรองจากผู้สอบบัญชีรับอนุญาตปีล่าสุด

(ค) ในกรณีที่เป็นผู้ลงทุนตามนิยามผู้ลงทุน (๑) (๒) (๖) และ (๗) ในข้อ ๒ ที่มีการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์จำนวนตั้งแต่ ๑๐ ล้านบาทถ้วนหรือเทียบเท่าตามอัตราตลาดต่อปี และในกรณีที่เป็นผู้ลงทุนตามนิยามผู้ลงทุน (๔) และ (๙) ในข้อ ๒ ให้เรียกแบบรับทราบการแจ้งความประสงค์การลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ที่ออกให้โดยเจ้าพนักงาน

(ง) กรณีผู้ลงทุนเป็นผู้ขอซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศ ให้เรียกหนังสือรับรองของผู้ลงทุน ซึ่งรับรองว่าการซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศดังกล่าวจะทำให้ผู้ลงทุนมียอดคงค้างการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ไม่เกินวงเงินที่กำหนดโดยหน่วยงานที่กำกับดูแลผู้ลงทุนหรือคณะกรรมการหรือผู้มีอำนาจบริหารของผู้ลงทุน

(จ) กรณีตัวแทนการลงทุนเป็นผู้ขอซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศ ให้เรียกหนังสือรับรองของตัวแทนการลงทุน ซึ่งรับรองว่าการซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศดังกล่าวเป็นไปเพื่อการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์แทนผู้ลงทุน ภายใต้วงเงินลงทุนที่กำหนดโดยหน่วยงานที่กำกับดูแลผู้ลงทุนหรือคณะกรรมการหรือผู้มีอำนาจบริหารของผู้ลงทุน

(๒) ในกรณีที่เป็นผู้ลงทุนตามนิยามผู้ลงทุน (๑) ในข้อ ๒ ให้เรียกเอกสารหลักฐานดังนี้

(ก) กรณีผู้ลงทุนเป็นผู้ขอซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศ ในกรณีลงทุนโดยไม่ผ่านตัวแทนการลงทุน ให้เรียกหลักฐานที่แสดงว่าผู้ลงทุนมีเงินลงทุนในตราสารหรืออนุพันธ์ หรือเงินฝากตามที่กำหนด ซึ่งออกไว้ไม่เกิน ๑ เดือน แบบรับทราบการแจ้งความประสงค์การลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ที่ออกให้โดยเจ้าพนักงาน และแบบแสดงการรับทราบหลักเกณฑ์และความเสี่ยงในการส่งเงินตราต่างประเทศออกไปลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ ตามที่เจ้าพนักงานกำหนด

(ข) กรณีผู้ลงทุนเป็นผู้ขอซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศ ในกรณีลงทุนผ่านตัวแทนการลงทุน ให้เรียกหลักฐานที่แสดงว่าผู้ลงทุนได้รับจัดสรรวงเงินลงทุนจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และหนังสือรับรองของผู้ลงทุน ซึ่งรับรองว่าการซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศดังกล่าวจะทำให้ผู้ลงทุนมียอดคงค้างการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ ทุกประเภทรวมทั้งสิ้นไม่เกินวงเงินลงทุนที่ผู้ลงทุนได้รับจัดสรรจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

(ค) กรณีตัวแทนการลงทุนเป็นผู้ขอซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศ ให้เรียกหลักฐานที่แสดงว่าผู้ลงทุนได้รับจัดสรรเงินลงทุนจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และหนังสือรับรองของตัวแทนการลงทุน ซึ่งรับรองว่าการซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศดังกล่าวเป็นไปเพื่อการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์แทนผู้ลงทุน ภายใต้เงื่อนไขที่ผู้ลงทุนได้รับจัดสรรจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

อนึ่ง เจ้าพนักงานอาจพิจารณาไม่อนุญาตให้ออกแบบรับทราบการแจ้งความประ拯救การลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ ในกรณีที่มีการตรวจสอบว่าผู้ลงทุนมีปฏิบัติตามหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติ เกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ตามประกาศฉบับนี้ และที่แก้ไขเพิ่มเติม

นิติบุคคลรับอนุญาตอาจเรียกหนังสือรับรองตาม (๑) (๑) หรือ (๑) และ (๒) (๗) หรือ (๑) เป็นรายครั้งหรือรายปีได้ โดยนิติบุคคลรับอนุญาตต้องถูกลงให้หนังสือรับรองดังกล่าวครอบคลุมการรับรอง สำหรับการซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศสำหรับปีดังกล่าวด้วย

เมื่อนิติบุคคลรับอนุญาตตรวจสอบและพอยาว่าเป็นเอกสารที่แท้จริงและถูกต้อง ให้ขาย แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศได้ตามเอกสารหลักฐาน และให้เก็บรักษาเอกสารหลักฐานไว้ ไม่น้อยกว่า ๕ ปีเพื่อให้เจ้าพนักงานตรวจสอบ”

ข้อ ๕ ให้ยกเลิกความใน (๑) ของข้อ ๕ ของประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ ลงวันที่ ๒๕ มิถุนายน ๒๕๔๘ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“(๑) เจ้าพนักงานอนุญาตให้ผู้ลงทุนเปิดบัญชีเพื่อการลงทุนได้ ทั้งนี้ กรณีที่เป็นผู้ลงทุนตาม นิยามผู้ลงทุน (๑) ในข้อ ๒ ให้เปิดบัญชีเพื่อการลงทุนได้เฉพาะในประเทศไทยเช่นเดียว หรือในประเทศที่ มีหน่วยงานกำกับดูแลเป็นสมาชิกของ International Organization of Securities Commissions (IOSCO) โดยหน่วยงานดังกล่าวต้องเป็นพหุภาคีประเภท Signatory A ใน Multilateral Memorandum of Understanding Concerning Consultation and Cooperation and the Exchange of Information (MMOU)”

ข้อ ๖ ให้ยกเลิกความใน (๓) ของข้อ ๕ ของประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ ลงวันที่ ๒๕ มิถุนายน ๒๕๔๘ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“(๓) เจ้าพนักงานอนุญาตให้ผู้ลงทุนซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศจากบัญชี แหล่งต่างประเทศ บัญชีแหล่งในประเทศไทยแบบไม่มีการผูกพันตามข้อ ๒๓ ของประกาศเจ้าพนักงานควบคุม การแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการแลกเปลี่ยนเงิน ลงวันที่ ๓๑ มีนาคม ๒๕๔๗ และที่แก้ไขเพิ่มเติม เพื่อฝากเข้าบัญชีเพื่อการลงทุนของตนเองหรือบัญชีเพื่อลูกค้าของ ตัวแทนการลงทุนที่เปิดโดยตัวแทนการลงทุนของตนได้ โดยให้นิติบุคคลรับอนุญาตปฏิบัติตามข้อ ๕

ทั้งนี้ ในกรณีผู้ลงทุนตามนิยามผู้ลงทุน (๑) ในข้อ ๒ ซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอน เงินตราต่างประเทศ เพื่อฝากเข้าบัญชีเพื่อการลงทุนของตนเองตามวรคก่อน ให้นับจำนวนเงินดังกล่าวรวม เป็นจำนวนเงินที่ผู้ลงทุนซื้อ แลกเปลี่ยน หรือถอนเงินตราต่างประเทศ เพื่อการลงทุนตามข้อ ๓/๑ (๑) ด้วย”

ข้อ ๗ ให้ยกเลิกความในวรคหนึ่งของข้อ ๗ ของประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ ลงวันที่ ๒๔ มิถุนายน ๒๕๕๘ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ ๗ ให้ผู้ลงทุนชำระเงินหรือรับชำระเงินในการลงทุนหรือการทำธุกรรมทุกประเภท ตามที่กำหนดไว้ในประกาศฉบับนี้เป็นเงินตราต่างประเทศเท่านั้น ยกเว้นกรณีการชำระเงินหรือรับชำระเงินลงทุนในอนุพันธ์ที่ทำกับนิติบุคคลรับอนุญาต โดยเป็นอนุพันธ์ที่มีลักษณะดังต่อไปนี้ ให้ชำระเป็นเงินบาทหรือเงินตราต่างประเทศก็ได้

- (๑) อนุพันธ์ที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ย
- (๒) สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีทองคำเป็นสินค้า

(๓) อนุพันธ์ในรูปของสัญญา Plain Vanilla Swap ที่อ้างอิงราคตราสารหนี้ ราคาตราสารทุน ราคสินค้าโภคภัณฑ์ หรือดัชนีทางการเงินที่ไม่ได้เกิดจากการคำนวณโดยใช้อัตราแลกเปลี่ยน”

ข้อ ๘ ประกาศฉบับนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ ๒๐ กรกฎาคม ๒๕๕๙

ประกาศ ณ วันที่ ๒๗ มิถุนายน ๒๕๕๘

จ.หาดใหญ่ สุจิตกุล
(นางจันทรรณ สุจิตกุล)
เจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน

รายงานการลงทุนตราสารในต่างประเทศและธุรกิจที่ออกผลิตภัณฑ์ทางการเงิน (Retail Investors' Portfolio and Derivative Investment Abroad)

ລະຫວ່າງສະບັບການ (Provider Unique ID)	
ບະນາດການກໍ່ເຄີຍຕົກການ (Provider Unique Name)	
ຊື່ຜູ້ອານຸມານາ (Provider Name)	
ວັນທີອະນຸມານາ (Data Set Date)	(2009-mm-dd ແລ້ວ 1 ຕຸລາ 2016-01-31)

(תלמוד בבלי)

รายชื่อประเทศที่ไปลงทุนของผู้ล็อกทุนรายย่อย (รายงานข้อมูลสอดคล้องตาม Data Set Date)

รหัสผู้รายงาน (Provider Unique ID)	
ประเภทรหัสผู้รายงาน (Provider Unique ID Type)	
ชื่อผู้รายงาน (Provider Name)	
วันที่ของชุดข้อมูล (Data Set Date) [YYYY-MM-DD (ค.ศ.) เช่น 2016-01-31]	

ลำดับ (No.)	รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (End Investor Id)	ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (End Investor Name)	ประเทศไทย/มาเลเซีย/อุดหนุนเปรียบตราสาร (Country of Investment/Country of Counter Party/ Country of Registration)
1			
2			
3			
4			
5			
6			
7			
8			
9			
10			
11			
12			
13			
14			
15			
16			
17			
18			
19			
20			
21			
22			
23			



ธนาคารแห่งประเทศไทย

๒๗ มิถุนายน ๒๕๕๙

เรียน ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน

ที่ ฝกง.(21)ว. ๓๒ /๒๕๕๙ เรื่อง การปรับปรุงหลักเกณฑ์การลงทุนในตราสาร
ในต่างประเทศ และอนุพันธ์

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้ออกประกาศเจ้าหน้าที่งานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ (ฉบับที่ ๓) เพื่อผ่อนคลายคุณสมบัติของผู้ลงทุนให้รวมถึง Qualified Investor (QI) และปรับปรุงหลักเกณฑ์การลงทุน อีนๆ โดยสรุป ดังนี้

๑. ปรับปรุงแบบรายงานการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ของผู้ลงทุน รายย่อย ซึ่งได้แนบมาพร้อมนี้ เพื่อให้ QI รวมถึงบริษัทหลักทรัพย์ ธนาคารพาณิชย์ และผู้จัดการกองทุน ส่วนบุคคล ที่เป็นตัวแทนการลงทุนของ QI และบุคคลรายย่อย จัดทำรายงานได้สะดวกมากยิ่งขึ้น โดยสามารถเรียกดูคู่มือการยื่นรายงานดังกล่าว ที่ www.bot.or.th ภายใต้หัวข้อ สถิติ / การรับส่งข้อมูล กับ ธปท. / แบบรายงานและเอกสารซึ่งแจงข้อมูลตลาดการเงิน / ข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์

อย่างไรก็ได้ ตัวแทนการลงทุนของ QI หรือบุคคลรายย่อย สามารถเลือกรายงานในแบบ รายงานการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ ตามแบบหรือตามแบบเดิมได้

๒. ปรับหลักเกณฑ์การทำธุรกรรมอนุพันธ์อ้างอิงตัวแปรต่างประเทศของผู้ลงทุน โดยให้ ผู้ลงทุนทำธุรกรรมอนุพันธ์ที่มีจำนวนเงินตามสัญญา (notional amount) เป็นสกุลเงินตราต่างประเทศ กับคู่สัญญาที่กำหนด ได้แก่ บุคคลที่มีถื่นที่อยู่ออกประเทศ หรือนิติบุคคลรับอนุญาต เท่านั้น

๓. เพิ่มประเภทผู้ลงทุน ได้แก่ QI ซึ่งหมายถึง นิติบุคคลไทย และบุคคลไทย ที่มีเงินฝาก หรือเงินลงทุนในตราสาร และอนุพันธ์ รวมตั้งแต่ 100 ล้านบาทขึ้นไป ให้สามารถลงทุนในตราสารใน ต่างประเทศ หรือทำธุรกรรมอนุพันธ์ โดยไม่ผ่านตัวแทนการลงทุน สรุปได้ดังนี้

๓.๑ วงเงินการลงทุน : ให้ส่งเงินออกไปลงทุน (flow) ไม่เกิน 5 ล้านคอตราร์ สรอ. ต่อรายต่อปี

๓.๒ ประเภทหลักทรัพย์ : ให้ลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ที่อ้างอิง ตัวแปรต่างประเทศ ที่ออกหรือจำหน่ายในประเทศตามที่กำหนด

ในการนี้ที่ QI ประสงค์ที่จะลงทุนโดยผ่านตัวแทนการลงทุนในประเทศ เช่น บริษัท หลักทรัพย์ ธนาคารพาณิชย์ หรือลงทุนผ่านผู้จัดการกองทุนส่วนบุคคล สามารถลงทุนได้ภายในวงเงินที่ได้รับ จัดสรรจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ตามหลักเกณฑ์เดิม

จึงเรียนมาเพื่อทราบและถือปฏิบัติตามประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงินตามที่แนบมาพร้อมนี้ และโปรดแจ้งให้ลูกค้าทราบโดยทั่วถัน

ขอแสดงความนับถือ

นางสาว ลักษณ์

(นางจันทรรณ สุจิตรกุล)
เจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน

- สิ่งที่ส่งมาด้วย 1. ประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ (ฉบับที่ 3)
2. แบบรายงานการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ของผู้ลงทุนรายย่อย

ฝ่ายนโยบายและกำกับการแลกเปลี่ยนเงิน

สายตลาดการเงิน

โทรศัพท์ 0 2356 7345, 0 2356 7858-9