

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สน. 2/2560

เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการกู้ยืมเงิน

และการทำธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืน

ในนามของกองทุนรวม

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 6 โดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการ ก.ล.ด.

และข้อ 3 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กน. 11/2552

เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการกู้ยืมเงินในนามของกองทุนรวมและการก่อภาระผูกพัน

แก่ทรัพย์สินของกองทุนรวม ลงวันที่ 20 กรกฎาคม พ.ศ. 2552 สำนักงานออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์  
ที่ สน. 43/2553 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการกู้ยืมเงินและการทำธุรกรรมการขายโดยมี  
สัญญาซื้อคืนในนามของกองทุนรวม ลงวันที่ 7 ตุลาคม พ.ศ. 2553

ข้อ 2 ในประกาศนี้

“ผู้ลงทุนสถาบัน” หมายความว่า ผู้ลงทุนสถาบันตามข้อ 4(1) ถึง (23) แห่งประกาศ  
คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กจ. 4/2560 เรื่อง การกำหนดคบทินยาม

ผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษและผู้ลงทุนรายใหญ่ ลงวันที่ 8 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2560

“กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ” หมายความว่า  
กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน  
ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือ  
ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ

ข้อ 3 ในการจัดการกองทุนรวม บริษัทจัดการกองทุนรวมสามารถกู้ยืมเงินหรือ  
ทำธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืนในนามของกองทุนรวมได้ต่อเมื่อเป็นกรณีที่มีวัตถุประสงค์  
ดังต่อไปนี้

(1) เพื่อการบริหารสภาพคล่องเป็นการชั่วคราวของกองทุนรวมเปิด โดยให้เป็นไปตามข้อ 4

(2) เพื่อการลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ

โดยให้เป็นไปตามข้อ 5

ข้อ 4 ในกรณีที่กองทุนรวมเปิดมีเหตุจำเป็นต้องบริหารสภาพคล่องเป็นการชั่วคราว บริษัทจัดการกองทุนรวมสามารถกู้ยืมเงินหรือทำธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืนในนามของกองทุนรวมได้ ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

- (1) คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งต้องเป็นผู้ลงทุนสถาบัน และต้องไม่ใช่ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมนั้น
- (2) ระยะเวลาการชำระหนี้ตามสัญญากู้ยืมเงินหรือธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืนต้องไม่เกินกว่า 90 วัน
- (3) อัตราส่วนการกู้ยืมเงินหรือการทำธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืนเพื่อการบริหารสภาพคล่องดังกล่าว ณ สิ้นวันใด เมื่อรวมกันแล้วต้องไม่เกินกว่าร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม เว้นแต่การเกินอัตราส่วนดังกล่าวมิได้เกิดจากการกู้ยืมเงินหรือการทำธุรกรรมดังกล่าวเพิ่มเติม
- (4) ในกรณีของการทำธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืน ต้องใช้สัญญามาตรฐานที่กำหนดโดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยหรือบริษัทหลักทรัพย์เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน)

ข้อ 5 ในการจัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ บริษัทจัดการกองทุนรวมสามารถกู้ยืมเงินหรือทำธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืนในนามของกองทุนรวมเพื่อประโยชน์ในการจัดการลงทุนของกองทุนรวมดังกล่าวได้ต่อเมื่อได้ระบุเรื่องดังกล่าวไว้อย่างชัดเจนในโครงการจัดการกองทุนรวมและในหนังสือชี้ชวนเสนอขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม โดยต้องเป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้ ทั้งนี้ ไม่ว่าจะมีการให้หลักประกันไว้ด้วยหรือไม่ก็ตาม

- (1) คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งต้องเป็นผู้ลงทุนสถาบัน และต้องไม่ใช่ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวมนั้น
- (2) อัตราส่วนการทำธุรกรรมดังกล่าว ณ สิ้นวันใด ต้องไม่เกินกว่าร้อยละ 50 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม เว้นแต่การเกินอัตราส่วนนั้นมิได้เกิดจากการทำธุรกรรมดังกล่าวเพิ่มเติม

ข้อ 6 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 16 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2560 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 8 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2560

(นายรพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์