

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สน. 11/2545

เรื่อง การกำหนดประเภททรัพย์สินที่ลูกค้ายอมมอบหมายให้
บริษัทจัดการจัดการ ได้เพิ่มเติม

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 4(8) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์
และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กน. 14/2543 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดการกองทุนส่วนบุคคล
ลงวันที่ 4 เมษายน พ.ศ. 2543 สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“ลูกค้าย” หมายความว่า บุคคลหรือคณะบุคคลที่มอบหมายหรือจะมอบหมายให้
บริษัทจัดการจัดการกองทุนส่วนบุคคล ทั้งนี้ ในกรณีที่บริษัทจัดการจัดการกองทุนส่วนบุคคลที่เป็น
กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ คำว่า “ลูกค้าย” หมายความว่า กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

“บริษัทจัดการ” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบ
ธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนส่วนบุคคล

“สัญญาฟิวเจอร์” หมายความว่า สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกิดขึ้นในตลาดหรือ
ศูนย์กลางในการซื้อขายหลักทรัพย์หรือหลักทรัพย์ล่วงหน้า ซึ่งบริษัทจัดการเข้าผูกพันตนในสัญญา
ดังกล่าว โดยมีข้อกำหนดให้บริษัทจัดการต้องส่งมอบสินค้าอ้างอิงหรือชำระราคาของสินค้าอ้างอิง
ให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง ณ เวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคต หรือมีข้อกำหนดให้บริษัทจัดการได้รับ
ชำระเงินหรือต้องชำระเงินให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งเท่ากับจำนวนเงินที่คำนวณได้จากส่วนต่าง
ระหว่างราคาหรือมูลค่าของสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรอ้างอิงที่กำหนดไว้ในสัญญากับราคาหรือมูลค่า
ของสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรอ้างอิงที่เป็นอยู่ ณ เวลาใดเวลาหนึ่งหรือช่วงเวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคต
ตามที่กำหนดไว้ในสัญญา

“สินค้าอ้างอิง” หมายความว่า หลักทรัพย์หรือเงินตราสกุลใด ๆ

“ตัวแปรอ้างอิง” หมายความว่า ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์หรืออัตราดอกเบี้ย

“สัญญาฟอว์เวิร์ด” หมายความว่า สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกิดขึ้นนอกตลาดหรือ
ศูนย์กลางในการซื้อขายหลักทรัพย์หรือหลักทรัพย์ล่วงหน้า ซึ่งบริษัทจัดการเข้าผูกพันตนในสัญญา
ดังกล่าว โดยมีข้อกำหนดให้บริษัทจัดการต้องส่งมอบสินค้าอ้างอิงหรือชำระราคาของสินค้าอ้างอิง

ให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง ณ เวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคต หรือมีข้อกำหนดให้บริษัทจัดการได้รับชำระเงินหรือต้องชำระเงินให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งเท่ากับจำนวนเงินที่คำนวณได้จากส่วนต่างระหว่างราคาหรือมูลค่าของสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรอ้างอิงที่กำหนดไว้ในสัญญากับราคาหรือมูลค่าของสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรอ้างอิงที่เป็นอยู่ ณ เวลาใดเวลาหนึ่งหรือช่วงเวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคตตามที่กำหนดไว้ในสัญญา

“สัญญาสวอป” หมายความว่า สัญญาที่บริษัทจัดการเข้าผูกพันแลกเปลี่ยนผลตอบแทนซึ่งมีมูลค่าผลตอบแทนอย่างน้อยข้างใดข้างหนึ่งของสัญญาผูกกับสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรอ้างอิง ทั้งนี้ ตามระยะเวลาและวิธีการที่กำหนดไว้ล่วงหน้าในสัญญา

ข้อ 2 ในการมอบหมายให้จัดการกองทุนส่วนบุคคล ลูกค้ายาจมอบสัญญาฟิวเจอร์ สัญญาฟอร์เวิร์ด หรือสัญญาสวอป ให้บริษัทจัดการจัดการได้

ข้อ 3 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 16 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2545 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 15 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2545

(นายประสาร ไตรรัตน์วรกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์