

-ร่าง-

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทธ. /๒๕๖๘

เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์
ของบริษัทหลักทรัพย์ประเภทการให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์
(ฉบับที่)

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา ๑๖/๖ วรรคสอง (๑) และมาตรา ๑๐๒ แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. ๒๕๓๕ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ ๔) พ.ศ. ๒๕๕๑ คณะกรรมการกำกับตลาดทุน ออกประกาศไว้ ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น (๖) และ (๗) ในข้อ ๑ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๒๖/๒๕๕๒ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์ของบริษัทหลักทรัพย์ประเภทการให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ ลงวันที่ ๒๐ กรกฎาคม พ.ศ. ๒๕๕๒

“(๖) “หุ้นไอพีโอ” หมายความว่า หุ้นที่ได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้เสนอขายต่อประชาชนเป็นการทั่วไปเป็นครั้งแรก (initial public offering)

(๗) “มูลค่าการลงทุนสุทธิ” หมายความว่า มูลค่าการลงทุนสุทธิในทรัพย์สินไม่ว่าเป็นการลงทุนโดยตรงหรือโดยอ้อมผ่านการลงทุนในตราสารหรือสัญญาที่ให้ผลตอบแทนโดยอ้างอิงอยู่กับทรัพย์สิน ซึ่งเป็นผลให้กองทุนมีความเสี่ยงในทรัพย์สินนั้น (net exposure)”

ข้อ ๒ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น ข้อ ๑/๑ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๒๖/๒๕๕๒ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์ของบริษัทหลักทรัพย์ประเภทการให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ ลงวันที่ ๒๐ กรกฎาคม พ.ศ. ๒๕๕๒

“ข้อ ๑/๑ การให้กู้ยืมเงินของบริษัทหลักทรัพย์จะกระทำได้อต่อเมื่อมีวัตถุประสงค์เพื่อการนำไปซื้อขายหลักทรัพย์เท่านั้น ทั้งนี้ บริษัทหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีมาตรการในการดูแลไม่ให้ลูกค้าทำธุรกรรมที่ขัดกับวัตถุประสงค์ดังกล่าว

ในการพิจารณาวัตถุประสงค์ตามวรรคหนึ่ง ให้พิจารณาจากข้อเท็จจริงที่แสดงถึงความมุ่งหมายหรือเนื้อหาสาระที่แท้จริง (substance) ของการให้กู้ยืมเงินนั้นเป็นสำคัญ ไม่ว่าการกู้ยืมเงินดังกล่าวจะมีลักษณะหรือรูปแบบเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในประกาศนี้หรือไม่ก็ตาม”

ข้อ ๓ ให้ยกเลิกความใน (๖) ของข้อ ๒ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทธ. ๒๖/๒๕๕๒ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์ของบริษัทหลักทรัพย์ประเภทการให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ ลงวันที่ ๒๐ กรกฎาคม พ.ศ. ๒๕๕๒ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๕๒/๒๕๖๑ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์ของบริษัทหลักทรัพย์ประเภทการให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ (ฉบับที่ ๒) ลงวันที่ ๑๔ กันยายน พ.ศ. ๒๕๖๑ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“(๖) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมเปิดตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการลงทุนของกองทุน ที่กำหนดวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนทุกวันทำการ (daily redemption fund) ดังนี้ แต่ไม่รวมถึงหน่วยลงทุนที่มีข้อจำกัดการโอน

(ก) กองทุนรวมดัชนี

(ข) กองทุนรวมหน่วยลงทุน

(ค) กองทุนรวมฟีดเดอร์

หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตามวรรคหนึ่ง ต้องมีนโยบายการลงทุนซึ่งจะส่งผลให้มีมูลค่าการลงทุนสุทธิที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ ๘๐ ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม และมีการกำหนดให้ชำระค่าขายคืนหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ขายคืนหน่วยลงทุนในระยะเวลาไม่เกิน ๕ วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน”

ข้อ ๔ ในกรณีที่บริษัทหลักทรัพย์ให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์ตาม ข้อ ๒ (๖) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๒๖/๒๕๕๒ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์ของบริษัทหลักทรัพย์ประเภทการให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ ลงวันที่ ๒๐ กรกฎาคม พ.ศ. ๒๕๕๒ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทธ. ๕๒/๒๕๖๑ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์ของบริษัทหลักทรัพย์ประเภทการให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ (ฉบับที่ ๒) ลงวันที่ ๑๔ กันยายน พ.ศ. ๒๕๖๑ โดยมีข้อตกลงหรือสัญญาให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์กับบุคคลใดก่อนวันที่ประกาศนี้มีผลใช้บังคับ

บริษัทหลักทรัพย์จะปฏิบัติตามข้อตกลงหรือสัญญาที่ผูกพันไว้ต่อไปก็ได้จนกว่าข้อตกลงหรือสัญญาดังกล่าวจะสิ้นสุดลง

ข้อ ๕ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่
ประกาศ ณ วันที่ เป็นต้นไป

(นางพรอนงค์ บุษราตระกูล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน