-ร่าง-

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทธ. /๒๕๖๙

เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงิน
เพื่อการซื้อหลักทรัพย์
(ฉบับที่)

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

ข้อ ๑ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น (๑๖) ในข้อ ๑ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๒๕/๒๕๕๒ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์ ลงวันที่ ๒๐ กรกฎาคม พ.ศ. ๒๕๕๒ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๒๓/๒๕๖๙ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์ (ฉบับที่ ๔) ลงวันที่ ๖ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๙

“(๑๖) “อัตราทวีคูณ” หมายความว่า ค่าสัมบูรณ์ของจำนวนเท่าของผลตอบแทนของกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management)”

ข้อ ๒ ให้ยกเลิกความในข้อ ๒/๑ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๒๕/๒๕๕๒ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์ ลงวันที่ ๒๐ กรกฎาคม พ.ศ. ๒๕๕๒ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๓๓/๒๕๖๘ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้กู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์ (ฉบับที่ ๓) ลงวันที่ ๓๐ กันยายน พ.ศ. ๒๕๖๘ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ ๒/๑ ให้บริษัทหลักทรัพย์กำหนดอัตรามาร์จิ้นเริ่มต้นไม่ต่ำกว่าอัตรา ดังต่อไปนี้

(๑) ร้อยละ ๑๐๐ ในกรณีที่เป็นการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหุ้นไอพีโอที่มีมูลค่าการเสนอขายน้อยกว่า ๑๐,๐๐๐ ล้านบาท ในช่วงระยะเวลา ๑๔ วันแรกที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์

(๒) ร้อยละ ๖๐ ในกรณีที่เป็นการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหุ้นไอพีโอที่มีมูลค่าการเสนอขายน้อยกว่า ๑๐,๐๐๐ ล้านบาท ในช่วงระยะเวลาตั้งแต่วันที่ ๑๕ จนถึง ๖๐ วันแรกที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์

(๓) อัตราที่คำนวณจากผลคูณของอัตราทวีคูณกับร้อยละ ๕๐ หรืออัตราที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด แล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า สำหรับกรณีที่เป็นการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีกลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนทวีคูณหรือตรงกันข้ามกับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง (leveraged management หรือ inverse management) ตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการลงทุนของกองทุน ทั้งนี้ อัตรามาร์จิ้นเริ่มต้นที่ใช้ดังกล่าวต้องไม่เกินร้อยละ ๑๐๐

(๔) ร้อยละ ๕๐ หรืออัตราที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด แล้วแต่อัตราใดจะสูงกว่า ในกรณีอื่นนอกจาก (๑) (๒) และ (๓)”

ข้อ ๓ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่

(นางพรอนงค์ บุษราตระกูล)
เลขาธิการ
สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ประธานกรรมการ
คณะกรรมการกำกับตลาดทุน