

ประกาศคณะกรรมการกองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ

เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการจัดการเงินกองทุนกรณีลงทุนในต่างประเทศ

พ.ศ. ๒๕๕๑

อาศัยอำนาจตามความในข้อ ๖ (๒) ของกฎกระทรวงกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีการจัดการเงินของกองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ พ.ศ. ๒๕๔๖ แก้ไขเพิ่มเติมโดยกฎกระทรวงกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีการจัดการเงินของกองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ (ฉบับที่ ๔) พ.ศ. ๒๕๕๑ คณะกรรมการกองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการออกประกาศไว้ ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ให้ยกเลิก

(๑) ประกาศคณะกรรมการกองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการจัดการเงินกองทุนกรณีลงทุนในต่างประเทศ ลงวันที่ ๑๒ พฤษภาคม ๒๕๔๘

(๒) ประกาศคณะกรรมการกองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการจัดการเงินกองทุนกรณีลงทุนในต่างประเทศ (ฉบับที่ ๒) พ.ศ. ๒๕๔๘ ลงวันที่ ๒๖ ตุลาคม ๒๕๔๘

ข้อ ๒ ในประกาศนี้

“การลงทุนในต่างประเทศ” หมายความว่า การลงทุนในหลักทรัพย์ที่ผู้ออกมิได้มีภูมิลำเนาอยู่ในประเทศไทย แต่ไม่หมายความรวมถึงการลงทุนในหลักทรัพย์ที่ผู้ออกดังกล่าวได้รับอนุญาตให้เสนอขายในประเทศไทย หรือการลงทุนในหลักทรัพย์ที่ผู้ออกดังกล่าวเป็นผู้กระทำการแทนธนาคารพาณิชย์หรือสถาบันการเงินไทย หรือเป็นนิติบุคคลต่างประเทศที่อยู่ภายใต้อำนาจการควบคุมหรือการบริหารของนิติบุคคลไทย

ข้อ ๓ การลงทุนในต่างประเทศ ให้ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

๓.๑ ประเทศที่ลงทุนต้องมีหน่วยงานกำกับดูแลด้านหลักทรัพย์และการซื้อขายหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกสามัญของ International Organization of Securities Commissions (IOSCO) หรือมีตลาดซื้อขายหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกของ World Federation of Exchanges (WFE)

๓.๒ การลงทุนนอกเหนือจากข้อ ๓.๑ สามารถลงทุนได้หากได้รับอนุมัติจากคณะกรรมการ

ข้อ ๔ หลักทรัพย์ที่ลงทุนได้ มีดังต่อไปนี้

๔.๑ หลักทรัพย์ที่มีความมั่นคงสูง ได้แก่

(ก) เงินฝากธนาคารหรือสถาบันการเงิน

(ข) ตราสารแสดงสิทธิในหนี้

(ค) หน่วยลงทุนและใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในหลักทรัพย์ตาม (ก) หรือ (ข)

หลักทรัพย์ตาม (ก) และ (ข) ต้องเป็นหลักทรัพย์ที่ผู้รับฝากเงิน ผู้ออกตราสาร หรือหลักทรัพย์ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในลำดับแรก (Investment Grade) จากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับในระดับสากล ในกรณีที่ผู้รับฝากเงิน ผู้ออกตราสาร หรือหลักทรัพย์ใดถูกปรับลดอันดับความน่าเชื่อถือจนต่ำกว่าระดับดังกล่าว ให้ถือว่าหลักทรัพย์นั้นเป็นหลักทรัพย์อื่น และให้ดำเนินการตามวิธีการที่คณะกรรมการจัดการลงทุนกำหนดและรายงานคณะกรรมการเพื่อทราบ

๔.๒ หลักทรัพย์อื่น ได้แก่

(ก) หุ้น

(ข) หุ้นกู้แปลงสภาพเป็นหุ้น

(ค) ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น

(ง) ตราสารอนุพันธ์ที่มีวัตถุประสงค์เกี่ยวกับการลงทุนในหลักทรัพย์ตาม (ก)

(ข) หรือ (ค) โดยหลักทรัพย์ดังกล่าวจะต้องมีการจดทะเบียนซื้อขายหรือมีแผนที่จะจดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ทั้งนี้ ประเภทตราสารอนุพันธ์ให้เป็นไปตามที่คณะกรรมการจัดการลงทุนพิจารณาอนุมัติ

(จ) ส่วนของผู้เป็นหุ้นส่วนหรือการเข้าลงทุนเพื่อแบ่งสรรผลประโยชน์ (Contribution/Participation/Interest) แบบจำกัดความรับผิดชอบในหุ้นส่วน หรือนิติบุคคลที่มีลักษณะทำนองเดียวกัน

(ฉ) หน่วยลงทุนหรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในหลักทรัพย์ตาม (ก) (ข) (ค) (ง) หรือ (จ) หรือมีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนใน Real Estate Investment Trusts (REITs) หรือหลักทรัพย์ที่มีลักษณะทำนองเดียวกัน หรือลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ ทั้งนี้ ให้รวมถึงหน่วยลงทุนที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในกองทุนอื่นด้วย (Fund of Funds)

๔.๓ หลักทรัพย์ที่นอกเหนือจากหลักทรัพย์ตามข้อ ๔.๑ และ ๔.๒ คณะกรรมการโดยข้อเสนอแนะของคณะกรรมการจัดการลงทุนอาจอนุมัติให้ลงทุนได้ โดยให้กำหนดด้วยว่าหลักทรัพย์นั้นเป็นหลักทรัพย์ที่มีความมั่นคงสูงหรือเป็นหลักทรัพย์อื่น

ข้อ ๕ ในการลงทุนในต่างประเทศ อาจทำธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนเพื่อบริหารและ
ป้องกันความเสี่ยง บริหารสภาพคล่อง และเพิ่มประสิทธิภาพในการลงทุน ดังต่อไปนี้ได้

๕.๑ ธุรกรรมป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

๕.๒ ธุรกรรมอนุพันธ์ (Derivatives) ที่โยงกับตราสารที่อนุญาตให้ลงทุน ทั้งนี้
ประเภทธุรกรรมอนุพันธ์ให้เป็นไปตามที่คณะกรรมการจัดการลงทุนพิจารณาอนุมัติ

๕.๓ ธุรกรรมให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Lending)

ทั้งนี้ ตั้งแต่บัดนี้เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ ๑๔ กรกฎาคม พ.ศ. ๒๕๕๑

สตีฟ ลิมพงศ์พันธุ์

รองปลัดกระทรวงการคลัง รักษาราชการแทน

ปลัดกระทรวงการคลัง

ประธานกรรมการกองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ