

ประกาศคณะกรรมการประกันสังคม

เรื่อง การลงทุนในตราสารอนุพันธ์

เพื่อปฏิบัติให้เป็นไปตามระเบียบคณะกรรมการประกันสังคม ว่าด้วยการจัดหาผลประโยชน์ของกองทุนประกันสังคม พ.ศ. ๒๕๕๙ ข้อ ๕ ที่กำหนดให้สำนักงานประกันสังคมมีอำนาจหน้าที่ในการนำเงินกองทุนไปจัดหาผลประโยชน์ หรืออาจดำเนินการให้บริษัทจัดการกองทุนนำเงินกองทุนย่อยไปจัดหาผลประโยชน์

อาศัยอำนาจตามความในข้อ ๖ (ก) (๑๕) ข้อ ๖ (ข) (๙) และข้อ ๖ (ง) แห่งระเบียบคณะกรรมการประกันสังคม ว่าด้วยการจัดหาผลประโยชน์ของกองทุนประกันสังคม พ.ศ. ๒๕๕๙ คณะกรรมการประกันสังคมจึงออกประกาศไว้ ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่บัดนี้เป็นต้นไป

ข้อ ๒ ประเภทตราสารอนุพันธ์ที่ลงทุนได้ ประกอบด้วย สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์ส (Futures) สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟอร์เวิร์ด (Forward) สัญญาซื้อขายล่วงหน้าสวอป (Swap) และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่น (Options)

หลักทรัพย์อ้างอิงของตราสารอนุพันธ์ตามวรรคหนึ่ง เป็นสินค้าหรือตัวแปรอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่าง ดังต่อไปนี้

- (๑) ตราสารทุน
- (๒) ตราสารแห่งหนึ่ง
- (๓) ตราสารกึ่งหนึ่งกึ่งทุน
- (๔) ตราสารแห่งหนึ่งที่เกิดจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์
- (๕) ตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝงและหุ้นกู้อนุพันธ์
- (๖) อัตราดอกเบี้ย
- (๗) อัตราแลกเปลี่ยนเงิน
- (๘) ดัชนีเงินเฟ้อ หรือดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นสินค้าหรือตัวแปรตาม (๑) - (๗)
- (๙) ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นดัชนีตามข้อ (๘)

ข้อ ๓ การลงทุนในตราสารอนุพันธ์ตามข้อ ๒ ให้ลงทุนเฉพาะกรณีที่มีวัตถุประสงค์เพื่อลดความเสี่ยง (hedging) โดยให้ลงทุนรวมกันไม่เกินมูลค่าความเสี่ยงที่กองทุนมีการลงทุนอยู่ในต่างประเทศ

ประกาศ ณ วันที่ ๒๖ พฤษภาคม พ.ศ. ๒๕๖๐

หม่อมหลวงปทุมทริก สมิติ

ปลัดกระทรวงแรงงาน

ประธานกรรมการประกันสังคม