

แบบคำขออนุญาตทำธุรกรรมด้านอนุพันธ์นอกตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

บริษัท

วันที่

หนังสือบริษัทที่

เรียน เลขาธิการสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

เรื่อง การขออนุญาตทำธุรกรรมด้านอนุพันธ์นอกตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ด้วยบริษัทมีความประสงค์จะซื้อขายอนุพันธ์หรือมีฐานะอนุพันธ์เพื่อตนเองตามข้อ 7 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กข. 30/2543 เรื่อง การทำธุรกรรม และการให้บริการด้านอนุพันธ์ของบริษัทหลักทรัพย์นอกตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ลงวันที่ 24 สิงหาคม พ.ศ. 2543 จึงขอแสดงรายละเอียดประกอบคำขออนุญาตดังนี้

1. ข้อมูลเกี่ยวกับบุคลากร

ให้ระบุรายชื่อ ตำแหน่ง ประวัติการศึกษา ประสบการณ์การทำงานของบุคลากร แต่ละรายที่รับผิดชอบในการตัดสินใจในการทำธุรกรรมด้านอนุพันธ์เพื่อบริษัท หรือการบริหาร ความเสี่ยงของการดำเนินกิจการของบริษัท

2. มาตรการในการบริหารความเสี่ยง

ให้อธิบายมาตรการในการบริหารความเสี่ยงอันเกิดจากการทำธุรกรรมด้านอนุพันธ์ นอกตลาดหลักทรัพย์อย่างน้อยในเรื่องต่อไปนี้

2.1 พังโครงสร้างการจัดองค์กรและขอบเขตอำนาจหน้าที่ความรับผิดชอบของ ส่วนงานที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมอนุพันธ์

2.2 การบริหารความเสี่ยงด้านราคา ให้อธิบายขั้นตอนและมาตรการในการบริหาร ความเสี่ยงด้านราคาของเงินลงทุน อนุพันธ์ และสินค้าหรือตัวแปรอ้างอิงในด้านต่าง ๆ เช่น การจำกัด ฐานะอนุพันธ์ (position limit) การเตรียมความพร้อมเพื่อรองรับความผันผวนของราคา เป็นต้น

2.3 นโยบายเกี่ยวกับการตรวจสอบและการควบคุมภายใน การตรวจสอบดูแล การปฏิบัติงาน และการรายงานฐานะความเสี่ยงต่อผู้บริหารตามสายงาน

3. อื่นๆ (ถ้ามี)

ให้ระบุรายละเอียดอื่นที่ประสงค์จะชี้แจงเพิ่มเติม

ทั้งนี้ ขอรับรองว่าบริษัทมีคุณลักษณะเป็นไปตามที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด และข้อความในคำขออนุญาตและหลักฐานประกอบคำขอที่แนบมานี้ครบถ้วนและเป็นความจริงทุกประการ

ลงชื่อ กรรมการผู้มีอำนาจลงลายมือชื่อ
()

ประทับตรา (ถ้ามี)

ลงชื่อ กรรมการผู้มีอำนาจลงลายมือชื่อ
()