



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. 18 /2541

เรื่อง การยื่นคำขออนุญาตเป็นผู้ให้บริการด้านอนุพันธ์

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 11 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 5/2541 เรื่อง การทำธุรกรรมด้านอนุพันธ์ของบริษัทหลักทรัพย์ ลงวันที่ 16 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2541 สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้บริษัทหลักทรัพย์ที่ประสงค์จะขออนุญาตเป็นผู้ให้บริการด้านอนุพันธ์ยื่นคำขออนุญาตต่อสำนักงานตามแบบ 98-1 ที่แนบท้ายประกาศนี้

ข้อ 2 ในการยื่นคำขออนุญาตตามข้อ 1 ให้บริษัทหลักทรัพย์ยื่นหลักฐานต่อไปนี้เพื่อประกอบคำขออนุญาต

(1) มติที่ประชุมคณะกรรมการบริษัทที่เห็นชอบให้บริษัทประกอบธุรกิจเป็นผู้ให้บริการด้านอนุพันธ์ รวมทั้งมติเห็นชอบในนโยบายและมาตรการการควบคุมและบริหารความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจเป็นผู้ให้บริการด้านอนุพันธ์

(2) ตัวเลขอัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่บริษัทดำรงได้ในแต่ละวันสำหรับระยะเวลาหกเดือนติดต่อกันก่อนวันที่ยื่นคำขออนุญาต

(3) หลักฐานการศึกษาของบุคลากรที่ทำหน้าที่ติดต่อให้บริการด้านอนุพันธ์กับลูกค้า หรือดูแลการบริหารความเสี่ยงจากการดำเนินกิจการของบริษัท หรือดูแลด้านเครดิตของคู่สัญญา

(4) รายงานการตรวจสอบการดำเนินกิจการของบริษัทโดยหน่วยงานตรวจสอบภายใน (internal audit) สำหรับระยะเวลาอย่างน้อยสองปีล่าสุด

ข้อ 3 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันถัดจากวันประกาศในราชกิจจานุเบกษาเป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 4 พฤษภาคม พ.ศ. 2541

(นายปรกรณ์ มาลากุล ณ อยุธยา)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

แบบคำขออนุญาตเป็นผู้ให้บริการด้านอนุพันธ์

บริษัท.....

หนังสือบริษัทที่

วันที่.....

เรียน เลขาธิการสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด.

เรื่อง ขออนุญาตเป็นผู้ให้บริการด้านอนุพันธ์

ด้วยบริษัทมีความประสงค์จะประกอบธุรกิจเป็นผู้ให้บริการด้านอนุพันธ์ ซึ่งจะต้องได้รับอนุญาตจากสำนักงานตามความในข้อ 11 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 5/2541 เรื่อง การทำธุรกรรมด้านอนุพันธ์ของบริษัทหลักทรัพย์ ลงวันที่ 16 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2541 จึงขอแสดงรายละเอียดประกอบการขออนุญาต ดังนี้

1. นโยบายและขอบเขตในการประกอบธุรกิจอนุพันธ์

ให้ระบุนโยบายหลักในการประกอบธุรกิจอนุพันธ์ เช่น ขอบเขตการประกอบธุรกิจในด้านประเภทของอนุพันธ์ที่จะให้บริการ กลุ่มลูกค้าเป้าหมาย การร่วมมือกับบริษัทต่างประเทศ การส่งเสริมและพัฒนาความรู้ความเข้าใจแก่บุคลากรที่เกี่ยวข้อง เป็นต้น

2. มาตรการในการบริหารความเสี่ยง

ให้อธิบายมาตรการในการบริหารความเสี่ยงอันเกิดจากการลงทุนและการประกอบธุรกิจอนุพันธ์อย่างน้อยในเรื่อง ดังนี้

2.1 ผังโครงสร้างการจัดองค์กร และขอบเขตอำนาจหน้าที่ความรับผิดชอบของส่วนงานที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจอนุพันธ์

2.2 การบริหารความเสี่ยงด้านเครดิต ให้อธิบายขั้นตอนการพิจารณาอนุมัติเครดิต มาตรฐานการวัด credit exposure และการกำหนด credit limits ของคู่สัญญา

2.3 การบริหารความเสี่ยงด้านราคา ให้อธิบายขั้นตอนและมาตรการในการบริหารความเสี่ยงด้านราคาของเงินลงทุน อนุพันธ์ และสินค้าหรือตัวแปรอ้างอิง ในประเด็นต่าง ๆ เช่น การจำกัดฐานะอนุพันธ์ (position limit) ในด้านต่าง ๆ pricing model ที่ใช้ วิธีการและความถี่ที่ใช้ในการ mark to market การเตรียมความพร้อมเพื่อรองรับความผันผวนของราคา เป็นต้น

2.4 การควบคุมความเสี่ยงด้านเอกสารสัญญา (legal risk) ให้อธิบายวิธีการตรวจสอบเอกสารสัญญา การใช้สัญญามาตรฐาน (ถ้ามี) หากมิได้มีนโยบายจะใช้สัญญามาตรฐานของต่างประเทศ ให้แนบตัวอย่างสัญญาที่จะใช้มาด้วย

2.5 ข้อมูลเกี่ยวกับบุคลากร ให้ระบุรายชื่อ ตำแหน่ง ประวัติการศึกษา ประสบการณ์การทำงานของบุคลากรที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการด้านอนุพันธ์และการบริหารความเสี่ยง รวมถึงอำนาจในการตัดสินใจเกี่ยวกับอนุพันธ์ของบุคลากรที่เกี่ยวข้องแต่ละราย

2.6 นโยบายเกี่ยวกับการตรวจสอบและการควบคุมภายใน การตรวจสอบดูแลการปฏิบัติงาน และการรายงานฐานะความเสี่ยงต่อผู้บริหารตามสายงาน

3. ระบบรองรับการคำนวณความเพียงพอของเงินกองทุน

ให้ระบุว่าจะใช้มาตรฐานการคำนวณความเพียงพอของเงินกองทุนที่สำนักงานกำหนด หรือจะใช้มาตรฐานอื่น ในกรณีที่ใช้มาตรฐานอื่นให้ระบุความแตกต่างของมาตรฐานดังกล่าวจากมาตรฐานที่สำนักงานกำหนดไว้อย่างชัดเจน ทั้งนี้ ให้ระบุหน่วยงานและบุคลากรที่จะเป็นผู้จัดทำรายงานการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิด้วย

4. ประวัติการกระทำผิด

ให้ระบุประวัติการถูกลงโทษหรือภาคทัณฑ์จากหน่วยงานอื่นที่กำกับดูแลของบริษัท หรือของผู้บริหารในช่วงเวลา 3 ปีก่อนยื่นคำขอ

5. อื่น ๆ (ถ้ามี)

ให้ระบุรายละเอียดอื่นที่ประสงค์จะชี้แจงเพิ่มเติม

ข้าพเจ้าขอรับรองว่าข้าพเจ้าเป็นผู้มีคุณลักษณะเป็นไปตามที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด และข้อความในคำขออนุญาตและหลักฐานประกอบคำขอที่แนบมานี้ครบถ้วนถูกต้องและเป็นความจริงทุกประการ

ลงชื่อ.....กรรมการผู้มีอำนาจลงลายมือชื่อ
()

ประทับตรา (ถ้ามี)

ลงชื่อ.....กรรมการผู้มีอำนาจลงลายมือชื่อ
()