

ກລົດ

ສໍານັກງານຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່ແລຕລາດຫລັກທີ່

ປະກາສສໍານັກງານຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່ແລຕລາດຫລັກທີ່

ທີ່ສ. 2 /2549

ເຮືອງ ກາຮ່າກທີ່ແລຕລາດຫລັກທີ່
ກາຮ່າຍສ້າງສ້າງກຳນົດ

ອາຫັນຈາດຕາມຄວາມໃນຂໍ້ 11 ຫຼື 14 ແລະ ຂໍ້ 24 ແຫ່ງປະກາສຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່
ຫລັກທີ່ແລຕລາດຫລັກທີ່ ທີ່ ກ.ຮ. 65/2547 ເຮືອງ ພັດທະນາກົດປະກາດຫລັກທີ່
ສໍາຫັນຜູ້ໄດ້ຮັບໃບອຸນຸມາຕເປັນຕົວແທນໜີ້ຂໍ້ອາຍສ້າງສ້າງກຳນົດ
ລົງວັນທີ 22 ພຸດພະຈິກ ພ.ສ. 2547
ສໍານັກງານ ກ.ລ.ຕ. ອອກຂໍ້ກຳນົດໄວ້ດັ່ງຕ່ອໄປນີ້

ຂໍ້ 1 ໃນປະກາສນີ້

“ຕົວແທນໜີ້ຂໍ້ອາຍສ້າງສ້າງ” ມາຍຄວາມວ່າ ຜູ້ໄດ້ຮັບໃບອຸນຸມາຕປະກາດຫລັກທີ່
ສ້າງສ້າງກຳນົດ
“ສູນຍີ້ຂໍ້ອາຍສ້າງສ້າງ” ມາຍຄວາມວ່າ ສູນຍີ້ຂໍ້ອາຍສ້າງສ້າງກຳນົດທີ່ໄດ້ຮັບ¹
ໃບອຸນຸມາຕຈາກຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່ ກ.ລ.ຕ.

“ຫລັກປະກັນເປັນຕົ້ນ” (initial margin) ມາຍຄວາມວ່າ ຈຳນວນທັງໝົດສິນ
ທີ່ລູກຄ້າຕ້ອງວາງເປັນປະກັນໃນການສ້າງສ້າງກຳນົດ
ກຳນົດທີ່ໄດ້ຮັບໃບອຸນຸມາຕຈາກຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່ ກ.ລ.ຕ.

“ຫລັກປະກັນຮັກຢາສກາພ” (maintenance margin) ມາຍຄວາມວ່າ ຈຳນວນທັງໝົດສິນ
ທີ່ລູກຄ້າຕ້ອງດຳເນີນຢາສກາພໃນການສ້າງສ້າງກຳນົດ
ກຳນົດທີ່ໄດ້ຮັບໃບອຸນຸມາຕຈາກຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່ ກ.ລ.ຕ.

ຂໍ້ 2 ຕົວແທນໜີ້ຂໍ້ອາຍສ້າງສ້າງທີ່ຈັດໃຫ້ມີຫລັກຫຼາຍທີ່ໄດ້ຍື່ອງກຳນົດ ກຳນົດທີ່ໄດ້ຮັບໃບອຸນຸມາຕຈາກຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່ ກ.ລ.ຕ.

(1) ຫລັກຫຼາຍເກີຍກຳນົດກາຮ່າກທີ່ໄດ້ຍື່ອງກຳນົດທີ່ໄດ້ຮັບໃບອຸນຸມາຕຈາກຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່ ໂດຍ
ອ່ານັ້ນວ່າ ບໍ່ໄດ້ຮັບໃບອຸນຸມາຕຈາກຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່ໄດ້ຮັບໃບອຸນຸມາຕຈາກຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່
ກຳນົດທີ່ໄດ້ຮັບໃບອຸນຸມາຕຈາກຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່ ໂດຍ

(2) ຫລັກຫຼາຍເປັນຍັນການສ້າງສ້າງກຳນົດທີ່ໄດ້ຮັບໃບອຸນຸມາຕຈາກຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່ (confirmation statement)

(3) ຫລັກຫຼາຍເປັນຍັນການຮັບຮັກປະກັນເພີ່ມເຕີມ ໃນການສ້າງສ້າງກຳນົດທີ່ໄດ້ຮັບໃບອຸນຸມາຕຈາກຄະນະກຽມກາຮ່າກທີ່
ເຮັດວຽກໃຫ້ລູກຄ້ານຳທັງໝົດສິນມາວັງເປັນຫລັກປະກັນເພີ່ມເຕີມ

(4) บัญชีแสดงรายการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าแต่ละราย ตัวแทนซื้อขายสัญญาต้องส่งหลักฐานยืนยันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าและหลักฐานยืนยันการเรียกหลักประกันเพิ่มเติมตามวรรคหนึ่ง ให้แก่ลูกค้าตามวิธีการที่ได้ตกลงไว้กับลูกค้าภายในวันทำการถัดจากวันที่มีการซื้อขายหรือวันที่มีการเรียกหลักประกันเพิ่มเติมแล้วแต่กรณี

ข้อ 3 ตัวแทนซื้อขายสัญญาต้องแสดงรายละเอียดอย่างน้อยตามรายการดังต่อไปนี้ ในหลักฐานยืนยันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า

- (1) ชื่อลูกค้าหรือหมายเลขบัญชีเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า
- (2) วันที่เกิดรายการซื้อขาย
- (3) รายละเอียดเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เช่น ประเภทของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (contract type) ชนิดของสินค้าหรือตัวแปร (underlying assets/variables) เดือนที่ส่งมอบหรือชำระราคา (settlement month) เป็นต้น หรือชื่อย่อของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (symbol) ที่ศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด
- (4) จำนวนและราคารองสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (5) ประเภทของการทำรายการซื้อขาย เช่น เป็นการสร้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ขึ้นใหม่ เป็นการถ่างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีอยู่ เป็นต้น
- (6) อัตราค่าธรรมเนียมในการทำรายการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ข้อ 4 ตัวแทนซื้อขายสัญญาต้องแสดงรายละเอียดอย่างน้อยตามรายการที่กำหนดไว้ ในข้อ 3(1) และ(3) ตลอดจนรายการดังต่อไปนี้ในหลักฐานยืนยันการเรียกหลักประกันเพิ่มเติม

- (1) บัญชีหลักประกันเริ่มต้นและบัญชีหลักประกันรักษาสภาพ ทั้งนี้ ในการณ์ที่ตัวแทนซื้อขายสัญญารายกเก็บบัญชีหลักประกันเริ่มต้นหรือบัญชีหลักประกันรักษาสภาพสำหรับการมีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใด ๆ แตกต่างกัน ให้ระบุบัญชีหลักประกันเริ่มต้นหรือบัญชีหลักประกันรักษาสภาพสำหรับการมีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้านั้น ๆ เป็นรายสัญญาด้วย
- (2) ราคาตลาด (market price) ของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ณ ถึงวันทำการ
- (3) ผลขาดทุนจากฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าและบัญชีหลักประกันคงเหลือภายหลังจากการปรับบัญชีตามราคาตลาด (mark to market) ของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (4) จำนวนและประเภทของทรัพย์สินที่ตัวแทนซื้อขายสัญญารายกให้ลูกค้านำมาวางเป็นหลักประกันเพิ่มเติม

ข้อ 5 ตัวแทนซื้อขายสัญญาต้องแสดงรายละเอียดอย่างน้อยตามรายการที่กำหนดไว้ในข้อ 3 และข้อ 4 ตลอดจนรายการดังต่อไปนี้ในบัญชีแสดงรายการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าแต่ละราย

- (1) ประเภทของลูกค้า โดยให้ระบุว่าเป็นผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายย่อย และในกรณีที่ลูกค้าเป็นผู้ดำเนินการสั่งซื้อขายเพื่อบุคคลอื่นหลายรายหรือหลายหอดผ่านบัญชีแบบไม่เปิดเผยชื่อ (omnibus account) ให้ระบุกรณีดังกล่าวไว้ด้วย
- (2) ฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุดที่ลูกค้าอาจมีได้ ณ ขณะใดขณะหนึ่ง
- (3) ฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าที่คงค้างอยู่ (open interest)
- (4) จำนวนและประเภทของทรัพย์สินที่ลูกค้านำมาวางเป็นหลักประกัน หรือเพื่อชำระราคาและส่งมอบตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเมื่อสัญญารอบกำหนด
- (5) ผลกำไรจากฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าและมูลค่าหลักประกันคงเหลือภายหลังจากการปรับมูลค่าตามราคาตลาด (mark to market) ของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (6) จำนวนและประเภทของทรัพย์สินที่เกินกว่ามูลค่าหลักประกันรักษาสภาพ

ข้อ 6 ตัวแทนซื้อขายสัญญาต้องจัดทำหลักฐานยืนยันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า หลักฐานยืนยันการเรียกหลักประกันเพิ่มเติม และบัญชีแสดงรายการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าแต่ละราย ไว้เป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องจัดทำเป็นภาษาไทยหรือภาษาอังกฤษ ทั้งนี้ ตัวแทนซื้อขายสัญญาอาจจัดทำข้อมูลดังกล่าวในรูปข้อมูลเอกสารหรือข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ได้

ข้อ 7 ตัวแทนซื้อขายสัญญาต้องจัดเก็บหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

- (1) บันทึกการให้คำแนะนำแก่ลูกค้าและการรับคำสั่งซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจากลูกค้า ให้เก็บไว้อย่างน้อยเป็นระยะเวลาหนึ่งเดือนนับแต่วันที่ให้คำแนะนำหรือวันที่ได้รับคำสั่งซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า แล้วแต่กรณี ทั้งนี้ หากมีข้อร้องเรียนเกี่ยวกับการให้คำแนะนำหรือการรับคำสั่งซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจากลูกค้าและการดำเนินการเกี่ยวกับข้อร้องเรียนยัง ไม่แล้วเสร็จภายในระยะเวลาดังกล่าว ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาจัดเก็บบันทึกการให้คำแนะนำและการรับคำสั่งซื้อขายไว้ต่อไปจนกว่าการดำเนินการเกี่ยวกับข้อร้องเรียนจะแล้วเสร็จ

ในกรณีที่การให้คำแนะนำหรือการรับคำสั่งซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามวรรคหนึ่ง ได้กระทำการโจรศพที่หรือทางอิเล็กทรอนิกส์ ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาจัดเก็บเทปบันทึกเสียงหรือสิ่งบันทึกข้อมูลทางอิเล็กทรอนิกส์ดังกล่าวด้วย

- (2) บันทึกรายละเอียดเกี่ยวกับการทำรายการให้แก่ลูกค้า หลักฐานยืนยันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า หลักฐานยืนยันการเรียกหลักประกันเพิ่มเติม บัญชีแสดงรายการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าแต่ละราย และรายงานหรือบันทึกความการวิเคราะห์คุณค่าหรือ

ความเหนชอบในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สินค้า หรือตัวเปรียกกำหนดในสัญญาซื้อขาย
ล่วงหน้า ตลอดจนหลักฐานอื่นที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า ให้เก็บไว้
อย่างน้อยเป็นระยะเวลาห้าปีนับแต่วันที่เกิดรายการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า ให้เก็บไว้
หลักประกันเพิ่มเติม หรือวันที่เผยแพร่รายงานหรือบันทึกการวิเคราะห์ดังกล่าวให้แก่ลูกค้า แล้วแต่กรณี
โดยการจัดเก็บข้อมูลดังกล่าวในระยะเวลาสองปีแรกต้องกระทำในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงาน ก.ด.ต.
เรียกดูหรือตรวจสอบได้ในทันที

ข้อ 8 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 16 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2549 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 8 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2549

(นายประسنศ์ วินัยแพทย์)

รองเลขาธิการ

รักษาการแทนเลขานุการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์