



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

๑๗ กุมภาพันธ์ ๒๕๔๙

เรียน ผู้จัดการ

บริษัทที่ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ที่ ร. (ว) _____ / 2549 เรื่อง การนำส่งประกาศและซักซ้อมความเข้าใจ

ด้วยสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ได้ออกประกาศที่เกี่ยวกับผู้ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า จำนวน ๒ ฉบับ ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 16 กุมภาพันธ์ ๒๕๔๙ ดังนี้

1. ประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สร. ๒/๒๕๔๙ เรื่อง การจัดทำและการจัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยมีสาระสำคัญตามเอกสารแนบ 1
2. ประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สร. ๓/๒๕๔๙ เรื่อง หลักเกณฑ์ในการดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้าและสาระสำคัญของสัญญาดูแลทรัพย์สินของลูกค้าโดยมีสาระสำคัญตามเอกสารแนบ 2

อนึ่ง ประกาศทั้ง ๒ ฉบับข้างต้น สำนักงานได้เผยแพร่ไว้ในเว็บไซต์ของสำนักงานที่ www.sec.or.th/ตัวแทนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า/กฎหมายและประกาศ/การกำกับดูแลการประกอบธุรกิจ (มาตรา 18)

จึงขอ นำส่งสำเนาประกาศดังกล่าวข้างต้นมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

(นางประภาลี สุคนธมาน)

ผู้อำนวยการฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

เลขานุการ^{แทน}

- สิ่งที่ส่งมาด้วย
1. สำเนาประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สร. ๒/๒๕๔๙ เรื่อง การจัดทำและการจัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ ๘ กุมภาพันธ์ ๒๕๔๙
 2. สำเนาประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สร. ๓/๒๕๔๙ เรื่อง หลักเกณฑ์ในการดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้าและสาระสำคัญของสัญญาดูแลทรัพย์สินของลูกค้า ลงวันที่ ๘ กุมภาพันธ์ ๒๕๔๙
 3. สรุปสาระสำคัญของประกาศสำนักงาน ก.ล.ต. ที่ สร. ๒/๒๕๔๙
 4. สรุปสาระสำคัญของประกาศสำนักงาน ก.ล.ต. ที่ สร. ๓/๒๕๔๙

ฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าค้าหลักทรัพย์

โทร. ๐-๒๒๖๓-๖๐๔๗

สรุปสาระสำคัญของประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สธ. 2/2549 เรื่อง การจัดทำและการจัดเก็บ ข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

1. ตัวแทนซื้อขายสัญญาฯ จะต้องจัดให้มีหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับการรับส่งคำสั่งซื้อขายตั้งแต่เวลาที่ได้รับคำสั่งจนถึงเวลาที่ทำการเสร็จสิ้น การยืนยันการซื้อขายแก่ลูกค้า (confirmation statement) การเรียกหลักประกันเพิ่มเติมจากลูกค้า (margin call statement) การจัดทำบัญชีแสดงรายการซื้อขายสัญญาฯ ของลูกค้าแต่ละราย ทั้งนี้ในการจัดทำหลักฐานอาจจัดทำในรูปข้อมูลเอกสารหรือข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ก็ได้

2. confirmation statement margin call statement และ บัญชีแสดงรายการซื้อขายฯ ต้องแสดงรายละเอียดอย่างน้อยในเรื่องรายละเอียดเกี่ยวกับตัวสัญญาฯ จำนวนและราคา ประเภทของการทำการรายการ อัตราค่าธรรมเนียม มูลค่าหลักประกันเริ่มต้นและหลักประกันรักษาสภาพ ราคาตลาด ผลขาดทุนจากฐานสัญญาฯ และมูลค่าหลักประกันคงเหลือ จำนวนและประเภทของทรัพย์สินที่เรียกให้ลูกค้านำมาวางเพิ่ม เป็นต้น

3. ตัวแทนซื้อขายสัญญาฯ ต้องจัดส่ง confirmation statement margin call statement ให้แก่ลูกค้า ตามวิธีการที่ตกลงกันภายในวันทำการถัดจากวันที่มีการซื้อขายหรือวันที่มีการเรียกหลักประกันเพิ่มเติม

4. ตัวแทนซื้อขายสัญญาฯ จะต้องเก็บเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาฯ ดังนี้

4.1 บันทึกการให้คำแนะนำและการรับคำสั่งซื้อขายสัญญาฯ ให้เก็บไว้อย่างน้อย 1 เดือน แต่หากมีข้อร้องเรียนให้จัดเก็บไว้จนกว่าข้อร้องเรียนจะแล้วเสร็จ

4.2 รายงานหรือบทความเกี่ยวกับการวิเคราะห์และหลักฐานเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาฯ ของลูกค้าให้เก็บไว้อย่างน้อย 5 ปี นับแต่วันที่มีการส่งคำสั่ง วันที่เกิดรายการซื้อขาย วันที่มีการเรียกหลักประกันเพิ่มเติม หรือวันที่เผยแพร่รายงานหรือบทวิเคราะห์ แล้วแต่กรณี โดยสำหรับเอกสารในช่วง 2 ปีแรกต้องจัดเก็บในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงานเรียกดูหรือตรวจสอบได้ทันที ทั้งนี้ หลักฐานเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาฯ ที่กล่าวหาความรวมถึงหลักฐานเกี่ยวกับการส่งคำสั่งซื้อขายเข้าไปในระบบของบริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX) ทั้งที่สามารถจับคู่และไม่สามารถจับคู่ได้ รายการแก้ไข รายการยกเลิก รวมทั้ง เนื่องจากระบบซื้อขายสามารถรองรับคำสั่งที่มีระยะเวลาเกินกว่า 1 วันทำการ (good til date/ good til expiration/ good til cancel) ตัวแทนซื้อขายสัญญาฯ จึงควรจัดให้มีการจัดเก็บหลักฐานเกี่ยวกับคำสั่งที่ค้างอยู่ ณ สิ้นวันทำการใดๆ เพื่อให้สามารถตรวจสอบย้อนหลังได้ด้วย

4.3 ในกรณีที่มีการให้คำแนะนำหรือรับคำสั่งซื้อขายทางโทรศัพท์หรือสื่ออิเล็กทรอนิกส์ ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาฯ ทำการบันทึกเทปหรือจัดเก็บสิ่งบันทึกข้อมูลทางอิเล็กทรอนิกส์ไว้ด้วย

สรุปสาระสำคัญของประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สธ. 3/2549 เรื่อง หลักเกณฑ์ในการดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้าและสาระสำคัญของสัญญาดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้า

1. ตัวแทนซื้อขายสัญญาฯ จะต้องจัดให้มีหน่วยงานดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้าที่เป็นอิสระจากหน่วยงานที่ทำหน้าที่รับผิดชอบด้านการซื้อขายหรือการคำแนะนำ มีระบบการควบคุมภายในที่ดีโดยการแบ่งแยกคนที่ทำในการทำบัญชีทรัพย์สินจากคนที่เก็บรักษาตัวทรัพย์สิน เป็นต้น

นอกจากนี้ จะต้องเก็บรักษาข้อมูลเอกสารเกี่ยวกับการดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้าไว้ไม่น้อยกว่า 5 ปี โดยใน 2 ปีแรกต้องกระทำในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงานเรียกดูหรือตรวจสอบได้ทันที

2. ตัวแทนสัญญาฯ ต้องจัดทำบัญชีแสดงรายการทรัพย์สินของลูกค้าแต่ละรายแยกออกจากบัญชีทรัพย์สินของตนเอง และต้องมีการบันทึกรายการให้ถูกต้องและเป็นปัจจุบัน โดยกำหนดวิธีการในการแยกทรัพย์สินของลูกค้าในทำนองเดียวกับของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ (กธ. 4/2543)

3. ตัวแทนสัญญาฯ ต้องจัดทำรายงานแสดงทรัพย์สินและฐานะสัญญาฯ ของลูกค้าเป็นรายเดือน และจัดส่งให้ลูกค้าภายในวันที่ 7 ของเดือนถัดไป และหากทรัพย์สินของลูกค้าไม่มีการเปลี่ยนแปลงเป็นเวลา 3 เดือนให้ตัวแทนสัญญาฯ จัดส่งรายงานทรัพย์สินของลูกค้าอย่างน้อยทุก 3 เดือน