ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ สธ. 22/2549
เรื่อง การกำหนดอัตราหรือมูลค่าของทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 1(9) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 66/2547 เรื่อง การดำรงฐานะทางการเงินของผู้ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ 22 ธันวาคม พ.ศ. 2547 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 19/2549 เรื่อง การดำรงฐานะทางการเงินของผู้ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 2 พฤษภาคม พ.ศ. 2549 และข้อ 3(2) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 67/2547 เรื่อง การเรียกและการวางหลักประกันในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ 22 ธันวาคม พ.ศ. 2547 สำนักงาน ก.ล.ต. ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

"ตัวแทนซื้อขายสัญญา" หมายความว่า ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

"ศูนย์ซื้อขายสัญญา" หมายความว่า ศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับใบอนุญาตจากคณะกรรมการ ก.ล.ต.

ข้อ 2 เพื่อประโยชน์ในการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของตัวแทนซื้อขายสัญญา ให้จำนวนทรัพย์สินที่ลูกค้าต้องนำมาวางเป็นประกันสำหรับฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าที่คงค้างอยู่ เป็นไปตามอัตราหรือมูลค่าขั้นต่ำที่ศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด

ข้อ 3 ในการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในศูนย์ซื้อขายสัญญา ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาเรียกให้ลูกค้านำทรัพย์สินมาวางเป็นหลักประกันเริ่มต้น (initial margin) ในอัตราหรือมูลค่าไม่ต่ำกว่าที่ศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด

ข้อ 4 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 16 พฤษภาคม พ.ศ. 2549 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 8 พฤษภาคม พ.ศ. 2549

(นายธีระชะัย ภูวนาถนรานุบาล)
เลขาธิการ
สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์