



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

๒๗ ตุลาคม ๒๕๕๑

เรียน ผู้จัดการ

ธนาคารพาณิชย์ทุกธนาคาร

ที่ ธ. (ว) ๕ / 2551 เรื่อง การจัดทำและจัดส่งรายงานเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจ
หลักทรัพย์ประเภทการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

ตามหนังสือเวียนที่ ธ.(ว) 34/2546 ลงวันที่ 31 ธันวาคม ๒๕๔๖ สำนักงานได้ขอความร่วมมือให้ธนาคารพาณิชย์ที่ได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์จัดทำรายงานประจำปีตามแบบรายงานการให้ยืมหลักทรัพย์ (แบบ บ.ล. 6) ต่อสำนักงานภายในวันที่ 31 มกราคม ของปีถัดไป นั้น เนื่องจากปัจจุบันสำนักงานได้มีการปรับปรุงรูปแบบการรายงานดังกล่าวใหม่เป็นแบบ บ.ล. 9/2 เพื่อให้สามารถติดตามการทำธุรกรรมทั้งการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์และนำไปใช้ในการพัฒนาและกำกับดูแลตลาดทุนให้มีประสิทธิภาพขึ้น สำนักงานจึงขอความร่วมมือให้ธนาคารพาณิชย์ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจดังกล่าวจัดทำรายงานตามแบบ บ.ล. 9/2 ในรูปแบบอิเล็กทรอนิกส์เป็นรายไตรมาส และยื่นผ่านระบบรับแบบรายงานของสำนักงานภายใน 14 วัน ถัดไป โดยขอให้เริ่มใช้แบบรายงานดังกล่าวตั้งแต่ไตรมาส 4 ปี 2551 เป็นต้นไป สำนักงานจึงขอให้ท่านแจ้งชื่อผู้รับผิดชอบในการส่งแบบรายงานดังกล่าว พร้อมหมายเลขโทรศัพท์และอีเมลที่ใช้ติดต่อสำหรับแจ้งความคืบหน้าและประสานงานในการใช้ระบบการรับแบบรายงานไปที่ นางสาวสุกัญญา ทองจับ โทรศัพท์ 0-2695-9560 หรือ sukanya@sec.or.th ภายในวันที่ 15 พฤศจิกายน ๒๕๕๑ ทั้งนี้ ให้ยกเลิกการจัดส่งรายงานแบบ บ.ล. 6 ตั้งแต่บัดนี้เป็นต้นไป

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

(นางดวงมน จิ่งเสถียรทรัพย์)

ผู้อำนวยการฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

เลขาธิการ^{แทน}

- สิ่งที่ส่งมาด้วย
1. สำเนาหนังสือ ธ. (ว) 34/2546 เรื่อง การจัดทำและจัดส่งรายงานเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนี้ และการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ พร้อมแบบ บ.ล. 6
 2. แบบรายงานธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (แบบ บ.ล. 9/2)

ฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 0-2695-9560

โทรสาร 0-2695-9767



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

31 ธันวาคม 2546

เรียน ผู้จัดการ

ธนาคารพาณิชย์ทุกธนาคาร

ที่ ร. (ว) 34 /2546 เรื่อง การจัดทำและจัดส่งรายงานเกี่ยวกับการประกอบ
ธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนี้
และการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

ด้วยสำนักงานได้ออกประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สธ. 54 /2546
เรื่อง การยกเลิกประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วย
การยื่นรายงานการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนี้
ลงวันที่ 26 ธันวาคม 2546 และประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สธ. 55 /2546 เรื่อง
แบบรายงานของบริษัทหลักทรัพย์ ลงวันที่ 26 ธันวาคม 2546 โดยมีผลใช้บังคับวันที่ 1 มกราคม 2547
เพื่อยกเลิกการยื่นรายงานการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนี้ (แบบ 116-1) และ
รายงานการให้ยืมหลักทรัพย์ (แบบ บ.ล. 6) อย่างไรก็ตาม เพื่อให้สำนักงานสามารถติดตามปริมาณ
การประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนี้ และประเภท
กิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ได้ สำนักงานจึงขอความร่วมมือให้ธนาคารพาณิชย์ที่ได้รับ
ใบอนุญาตประกอบธุรกิจดังกล่าวจัดทำรายงานประจำปีตามแบบรายงานการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์
อันเป็นตราสารแห่งหนี้ และแบบรายงานการให้ยืมหลักทรัพย์ที่แนบมาพร้อมนี้ โดยขอให้จัดส่ง
รายงานดังกล่าวต่อสำนักงานภายในวันที่ 31 มกราคม ของปีถัดไป ทั้งนี้ ขอให้เริ่มจัดทำและจัดส่ง
รายงานดังกล่าวสำหรับรายงานประจำปี 2546 เป็นต้นไป

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

(นายประคิด นุณษ์จรูดี)

ผู้อำนวยการฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

แทน
เลขาธิการ

- สิ่งที่ส่งมาด้วย
1. สำเนาประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สช. 54 /2546 เรื่อง การยกเลิกประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการยื่นรายงานการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่ง ลงวันที่ 26 ธันวาคม 2546
 2. สำเนาประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สช. 55/2546 เรื่อง แบบรายงานของบริษัทหลักทรัพย์ ลงวันที่ 26 ธันวาคม 2546
 3. แบบรายงานการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่ง
 4. แบบรายงานการให้ยืมหลักทรัพย์

ฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

โทร. 0-2252-3223 ต่อ 1229

แบบ บ.ล. 6 (เดิม)

บริษัท

รายงานการให้ยืมหลักทรัพย์

ณ วันที่

หน่วย : พันบาท

สถานภาพ	มูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม (ราคาตลาด)	มูลค่าหลักประกัน (ราคาตลาด)
1. มูลค่าหลักประกันเป็นไปตามข้อตกลง		
Principal ราย		
Agent ราย		
2. มูลค่าหลักประกันต่ำกว่าข้อตกลง		
Principal ราย		
Agent ราย		

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

..... (เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจลงนาม)

()

ตำแหน่ง

วันที่

ผู้จัดทำ

โทร.....

บริษัท จำกัด

รายงานการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL)

ณ วันที่

	มูลค่าการยืม			มูลค่าการให้ยืม		
	ธุรกรรม ระหว่าง ไตรมาส	มูลค่าคงค้าง สิ้นไตรมาส	หลักประกัน	ธุรกรรม ระหว่าง ไตรมาส	มูลค่าคงค้าง สิ้นไตรมาส	หลักประกัน
(1) ฐานะ Agent ลูกค้าย่อย ลูกค้าสถาบัน						
(2) ฐานะ Principal ลูกค้าย่อย ลูกค้าสถาบัน						
รวม						

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

..... (เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจลงนาม)

()

..... ตำแหน่ง

วันที่

ผู้จัดทำ

โทรศัพท์

คำอธิบายประกอบรายงานการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

ให้ผู้ได้รับอนุญาตประกอบธุรกิจยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ที่มีใช้บริษัทหลักทรัพย์ เช่น ธนาคารพาณิชย์ เป็นต้น รายงานการให้ยืมหลักทรัพย์ทั้งในฐานะตัวการที่ยืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์ (principal) และในฐานะตัวแทนของผู้ยืมหรือผู้ให้ยืมหลักทรัพย์ (agent) แยกตามประเภทลูกค้ำที่เป็นรายย่อย หรือสถาบัน โดยให้รายงานยอดมูลค่าหลักทรัพย์ที่ยืม ยอดมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืมทุกประเภทรวมถึง ETF และยอดมูลค่าหลักประกันตามราคาตลาด ในกรณีที่ไม่มีราคาตลาด ให้คำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ยืมหรือให้ยืมตามเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ว่าด้วยข้อกำหนดเกี่ยวกับหลักประกันในธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ โดยให้ส่งรายงานดังกล่าวภายใน 14 วันนับจากวันสุดท้ายของแต่ละไตรมาส มีรายละเอียดดังนี้

รายการ	ความหมาย
ธุรกรรมระหว่างไตรมาส	แสดงยอดมูลค่าการยืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์ที่เกิดขึ้นจริงในไตรมาสที่ทุกรายการตามมูลค่าตลาด (ราคาปิด ในวันที่เกิดธุรกรรมนั้น)
มูลค่าคงค้างสิ้นไตรมาส	แสดงยอดมูลค่าการยืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์คงค้างที่เกิดขึ้นจริง ณ สิ้นไตรมาสที่ตามมูลค่าตลาด (ราคาปิด ณ สิ้นไตรมาส)
มูลค่าหลักประกัน	แสดงยอดมูลค่าหลักประกันตามราคาตลาด ในกรณีที่ไม่มีราคาตลาด ให้คำนวณมูลค่าหลักประกันตามเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ว่าด้วยข้อกำหนดเกี่ยวกับหลักประกันในธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

ทั้งนี้ ในการจัดทำรายงานไม่รวมถึงลูกหนี้ที่ยืมหลักทรัพย์ผ่านระบบ credit balance