



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

๒๗ ตุลาคม 2551

เรียน ผู้จัดการ

ธนาคารพาณิชย์ทุกธนาคาร

ที่ ธ. (ว) 4 /2551 เรื่อง การจัดทำและจัดส่งรายงานเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจค้า  
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ด้วยสำนักงานมีความประสงค์จะติดตามปริมาณการทำธุรกรรมด้านสัญญาซื้อขาย  
ล่วงหน้า เพื่อใช้เป็นข้อมูลในการพัฒนาและกำกับดูแลตลาดทุนต่อไป สำนักงานจึงขอความร่วมมือ  
ให้ผู้ได้รับการจดทะเบียนประกอบธุรกิจผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดทำรายงานการทำธุรกรรมของ  
ผู้จดทะเบียนผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นรายไตรมาสในรูปแบบอิเล็กทรอนิกส์ และยื่นรายงาน  
ดังกล่าวผ่านระบบรับแบบรายงานของสำนักงานภายใน 14 วันนับจากวันสุดท้ายของไตรมาส นั้น  
โดยขอให้เริ่มใช้แบบรายงานดังกล่าวตั้งแต่ไตรมาส 4 ปี 2551 เป็นต้นไป สำนักงานจึงขอให้ท่าน  
แจ้งชื่อผู้รับผิดชอบในการส่งแบบรายงานดังกล่าว พร้อมหมายเลขโทรศัพท์และอีเมลที่ใช้ติดต่อ  
สำหรับแจ้งความคืบหน้าและประสานงานในการใช้ระบบการรับแบบรายงานไปที่ นางสาวสุกัญญา  
ทองจับ โทรศัพท์ 0-2695-9560 หรือ sukanya@sec.or.th ภายในวันที่ 15 พฤศจิกายน 2551 นี้

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

(นางดวงมน จิ่งเสถียรทรัพย์)

ผู้อำนวยการฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

เลขานุการ<sup>๓๓๓</sup>

สิ่งที่ส่งมาด้วย แบบรายงานการทำธุรกรรมของผู้จดทะเบียนผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 0-2695-9560

โทรสาร 0-2695-9767

บริษัท ..... จำกัด

รายงานการทำธุรกรรมของผู้จดทะเบียนผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ณ วันที่ .....

(1) มูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Notional Amount) แบ่งตามตัวแปรอ้างอิงและประเภทสัญญา

	Equity	Interest rate	Currency	อื่นๆ <sup>1</sup>	รวม
Forward					
Swaps					
Long options					
Written options					
อื่นๆ (ระบุ)					
รวม					

หมายเหตุ

1 สินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรอ้างอิงอื่นๆ หมายถึง ที่นอกเหนือจาก Equity Interest Currency เช่น ทองคำ น้ำมัน เป็นต้น

(2) มูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Notional Amount) แบ่งตามประเภทคู่สัญญา (ผู้ลงทุนสถาบัน ตามประกาศ กษ 6/2547)

	นิติบุคคลในประเทศ	นิติบุคคลต่างประเทศ	รวม
1. ธนาคารพาณิชย์			
2. บริษัทหลักทรัพย์			
3. สถาบันการเงินอื่น			
4. บริษัทจำกัด			
5. อื่นๆ			
รวม			

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

..... (เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจลงนาม)

( )

..... ตำแหน่ง

วันที่ .....

ผู้จัดทำ .....

โทรศัพท์ .....

## คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงาน

ให้ผู้จดทะเบียนผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดทำรายงานแสดงมูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าต่อสำนักงานฯ เป็นรายไตรมาส โดยให้ส่งภายใน 14 วันหลังจากสิ้นไตรมาส นั้น ซึ่งประกอบด้วยข้อมูลดังต่อไปนี้

(1) มูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านอกตลาด (Notional Amount) แบ่งตามตัวแปรอ้างอิงและประเภทสัญญา ให้รายงานยอดรวมโดยใช้มูลค่าตามสัญญา (Notional Amount) ของแต่ละประเภทสัญญาฯ ที่ซื้อขายนอกศูนย์สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับอนุญาตจาก สนง. ประกอบด้วย Forward Swaps Long options Written options และอื่นๆ (ให้ระบุ) แยกตามสินค้าอ้างอิง ได้แก่ ตราสารทุน(equity) อัตราดอกเบี้ย(interest rate) อัตราแลกเปลี่ยน(currency) สำหรับสินค้าอ้างอิงอื่นๆ หมายถึง สินค้าอ้างอิงที่นอกเหนือจากที่กล่าวมา เช่น ทองคำ น้ำมัน commodity เป็นต้น

(2) มูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านอกตลาด (Notional Amount) แบ่งตามประเภทสัญญา

ให้รายงานยอดรวมโดยใช้มูลค่าตามสัญญา (Notional Amount) ทั้งหมดของแต่ละประเภทสัญญาที่มีการซื้อขายนอกศูนย์สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับอนุญาตจาก สนง. ประกอบด้วย ธนาคารพาณิชย์ บริษัทหลักทรัพย์ สถาบันการเงินอื่น บริษัทจำกัด และอื่นๆ ตามนิยามผู้ลงทุนสถาบันตามมาตรา 3 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 และประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 6/2547 เรื่อง การกำหนดประเภทนิติบุคคลที่เป็นผู้ลงทุนสถาบันเพิ่มเติม โดยแบ่งกลุ่มเป็นนิติบุคคลในประเทศ และนิติบุคคลต่างประเทศ

**หมายเหตุ** สำหรับผู้จดทะเบียนผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นนิติบุคคลต่างประเทศ ให้รายงานเฉพาะธุรกรรมที่มีคู่สัญญาเป็นนิติบุคคลภายใต้กฎหมายของประเทศไทย (เช่น จัดตั้ง จดทะเบียน หรือมีสาขาในประเทศไทย)