



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

30 ธันวาคม 2551

เรียน ผู้จัดการ

ธนาคารพาณิชย์ทุกธนาคาร

ที่ ช. (ว) 5 /2551 เรื่อง การจัดทำและจัดส่งรายงานเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจค้า  
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ตามที่สำนักงานได้มีหนังสือที่ ช.(ว) 4/2551 ลงวันที่ 27 ตุลาคม 2551 เพื่อขอความร่วมมือให้ผู้ได้รับการจดทะเบียนประกอบธุรกิจผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดทำและส่งรายงานเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้าต่อสำนักงานเป็นรายไตรมาส นั้น

เนื่องจากการรายงานข้อมูลการทำธุรกรรมบางรายการในแบบรายงานข้างต้นอาจเป็นการเพิ่มภาระแก่ผู้ประกอบการ สำนักงานจึงได้ปรับปรุงแบบรายงานใหม่และขอความร่วมมือให้บริษัทท่านจัดทำและจัดส่งข้อมูลตามแบบรายงานที่แนบมาพร้อมนี้แทนแบบรายงานเดิมภายในเวลาที่กำหนดโดยให้เริ่มตั้งแต่ไตรมาส 1 ปี 2552 เป็นต้นไป ทั้งนี้ สำนักงานขอเสนอชื่อเจ้าหน้าที่สำหรับติดต่อสอบถาม คือ นางสาวสุกัญญา ทองจับ หมายเลขโทรศัพท์ 02-695-9560 หรือ e-mail address: sukanya@sec.or.th

จึงเรียนมาเพื่อโปรดดำเนินการ

ขอแสดงความนับถือ

(นางดวงมน จิ่งเสถียรทรัพย์)

ผู้อำนวยการฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

เลขที่การแทน

สิ่งที่ส่งมาด้วย แบบรายงานการทำธุรกรรมของผู้จดทะเบียนผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 0-2695-9560

โทรสาร 0-2695-9767

บริษัท ..... จำกัด

รายงานการทำธุรกรรมของผู้จดทะเบียนผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ณ วันที่ .....

(1) มูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Notional Amount) แบ่งตามตัวแปรอ้างอิงและประเภทสัญญา

	Equity			Gold	Crude Oil	รวม
	Single Stock	Basket of Stocks	Stock Index			
Forward						
Swaps						
Long options						
Written options						
อื่นๆ (ระบุ)						
รวม						

(2) มูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Notional Amount) แบ่งตามประเภทคู่สัญญา

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

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

..... (เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจลงนาม)

( )

..... ตำแหน่ง

วันที่ .....

ผู้จัดทำ .....

โทรศัพท์ .....

## คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงาน

ให้ผู้จดทะเบียนผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดทำรายงานแสดงมูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าต่อสำนักงานฯ เป็นรายไตรมาส โดยให้ส่งภายใน 14 วันหลังจากสิ้นไตรมาส นั้น ซึ่งประกอบด้วยข้อมูลดังต่อไปนี้

(1) มูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านอกตลาด (Notional Amount) แบ่งตามตัวแปรอ้างอิงและประเภทสัญญา ให้รายงานยอดรวม โดยใช้มูลค่าตามสัญญา (Notional Amount) ของแต่ละประเภทสัญญาฯ ที่ซื้อขายนอกศูนย์สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับอนุญาตจาก สนง. ประกอบด้วย Forward Swaps Long options (ซื้อสิทธิ) Written options (ขายสิทธิ) และอื่นๆ (ให้ระบุ) แยกตามสินค้าอ้างอิง ได้แก่ หลักทรัพย์ (Single Stock) กลุ่มหลักทรัพย์ (Basket of Stocks) ดัชนี (Stock Index) ทองคำ (Gold) และน้ำมันดิบ (Crude Oil)

(2) มูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านอกตลาด (Notional Amount) แบ่งตามประเภทคู่สัญญา

ให้รายงานยอดรวม โดยใช้มูลค่าตามสัญญา (Notional Amount) ทั้งหมดของแต่ละประเภทคู่สัญญาที่มีการซื้อขายนอกศูนย์สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับอนุญาตจาก สนง. ประกอบด้วย ธนาคารพาณิชย์ บริษัทหลักทรัพย์ สถาบันการเงินอื่น และอื่นๆ ตามนิยามผู้ลงทุนสถาบันตามมาตรา 3 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 และประกาศว่าด้วยการกำหนดประเภทนิติบุคคลที่เป็นผู้ลงทุนสถาบันเพิ่มเติม โดยแบ่งกลุ่มเป็นนิติบุคคลในประเทศ และนิติบุคคลต่างประเทศ

**หมายเหตุ** สำหรับผู้จดทะเบียนเป็นผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นนิติบุคคลต่างประเทศ ให้รายงานเฉพาะธุรกรรมที่มีคู่สัญญาเป็นนิติบุคคลภายใต้กฎหมายของประเทศไทย (เช่น จัดตั้ง จัดทะเบียน หรือมีสาขาในประเทศไทย)