



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

23 เมษายน 2553

เรียน กรรมการผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ทุกบริษัท

ตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทุกแห่ง

ที่ กส.ช.(ว) 10 /2553 เรื่อง การจัดส่งรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
(แบบ บล. 4/1) รายวันเป็นการชั่วคราว

ตามที่ปัจจุบันได้เกิดเหตุการณ์ความไม่สงบทางการเมืองอันเป็นผลให้เกิดความผันผวนในตลาดทุนอย่างต่อเนื่อง ซึ่งเหตุการณ์ดังกล่าวอาจส่งผลกระทบต่อฐานะการเงินของบริษัทหลักทรัพย์และตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและอาจนำมาซึ่งความเสี่ยงต่อระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์โดยรวมได้ ประกอบกับประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิกำหนดให้บริษัทหลักทรัพย์และตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (แบบ บล. 4/1) เป็นรายวันให้เสร็จสิ้นภายในวันทำการถัดไป (T+1) นั้น

ดังนั้น เพื่อประโยชน์ในการติดตามฐานะและการดำเนินงานของบริษัทหลักทรัพย์และตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้อย่างใกล้ชิดและทันต่อเหตุการณ์มากยิ่งขึ้น และเพื่อให้มีการปฏิบัติเป็นไปตามประกาศข้างต้น สำนักงานจึงขอให้บริษัทท่านจัดส่งแบบ บล. 4/1 เป็นรายวันต่อสำนักงานเป็นการชั่วคราว โดยให้จัดส่งภายในวันทำการถัดจากวันจัดทำแบบรายงานดังกล่าวแล้วเสร็จ (T+2) ทั้งนี้ การจัดส่งแบบรายงานดังกล่าวให้จัดส่งในรูปแบบข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ในระบบการจัดส่งข้อมูลของสำนักงาน และสำนักงานขอเสนอชื่อเจ้าหน้าที่สำหรับการติดต่อสอบถามคือ นางสาวกมลวรรณ ทิชาคุณเจริญสุข โทรศัพท์ 0-2263-6053 นางสาวบุตรี เลิศวัฒนสิวลี โทรศัพท์ 0-2263-6047 และนายอิสรา ชำรงธัญวงศ์ โทรศัพท์ 0-2263-6064 ทั้งนี้ หากมีการเปลี่ยนแปลงการจัดส่งรายงานดังกล่าวสำนักงานจะได้แจ้งให้บริษัทท่านทราบต่อไป

จึงเรียนมาเพื่อโปรดดำเนินการต่อไป

ขอแสดงความนับถือ

(นายธีระชัย ภูวนาถนรานุบาล)

เลขาธิการ

ฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 0-2263-6053

โทรสาร 0-2263-6314