

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทธ. 41/2553

เรื่อง การดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้ำของผู้ได้รับใบอนุญาต

เป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(ฉบับที่ 2)

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 18 มาตรา 33 และมาตรา 34(2) แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 อันเป็นพระราชบัญญัติที่มีบทบัญญัติบางประการเกี่ยวกับการจำกัดสิทธิและเสรีภาพของบุคคล ซึ่งมาตรา 29 ประกอบกับมาตรา 33 มาตรา 34 มาตรา 36 มาตรา 41 มาตรา 43 และมาตรา 45 ของรัฐธรรมนูญแห่งราชอาณาจักรไทย บัญญัติให้กระทำได้โดยอาศัยอำนาจตามบทบัญญัติแห่งกฎหมาย คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกความในข้อ 7 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. 84/2552 เรื่อง การดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้ำของผู้ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2552 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 7 ตัวแทนซื้อขายสัญญาอาจนำเงินของลูกค้ำไปฝากหรือลงทุนได้ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) ฝากไว้กับธนาคารพาณิชย์หรือธนาคารอื่นที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น โดยในกรณีที่เป็นเงินฝากประเภทชำระคืนเมื่อครบกำหนดระยะเวลา เงินฝากดังกล่าวต้องไม่มีข้อห้ามการไถ่ถอนคืนก่อนครบกำหนด

(2) ลงทุนในตัวเงินคลัง พันธบัตรรัฐบาลไทย พันธบัตรรัฐวิสาหกิจที่กระทรวงการคลังเป็นผู้ค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข หรือพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย โดยตราสารดังกล่าวต้องไม่มีเงื่อนไขการห้ามขายหรือโอนก่อนครบกำหนดอายุของตราสาร

(3) ลงทุนในตราสารแห่งหนึ่งที่กระทรวงการคลังเป็นผู้รับอวัลทั้งจำนวนหรือเป็นผู้ค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข โดยตราสารดังกล่าวต้องไม่มีเงื่อนไขการห้ามขายหรือโอนก่อนครบกำหนดอายุของตราสาร

(4) ลงทุนในตัวสัญญาใช้เงินหรือบัตรเงินฝากที่ออกโดยธนาคารพาณิชย์หรือบริษัทเงินทุน หรือลงทุนในตัวแลกเงินที่ออกโดยธนาคารพาณิชย์ โดยในกรณีที่ตัวสัญญาใช้เงินบัตรเงินฝาก หรือตัวแลกเงิน เป็นประเภทชำระคืนเมื่อครบกำหนดระยะเวลา ตัวสัญญาใช้เงินบัตรเงินฝาก หรือตัวแลกเงินดังกล่าวต้องไม่มีข้อห้ามการไถ่ถอนคืนก่อนครบกำหนด

(5) ลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตลาดเงินในประเทศ (money market fund) ที่กำหนดวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนทุกวันทำการ (daily redemption fund)

(6) ลงทุนในธุรกรรมการซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืนซึ่งหลักทรัพย์ตาม (2) หรือ (3) ภายใต้หลักเกณฑ์และเงื่อนไขดังต่อไปนี้

(ก) มีคู่สัญญาเป็นผู้ลงทุนสถาบันตามมาตรา 3 และประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการกำหนดประเภทนิติบุคคลที่ผู้ลงทุนสถาบันเพิ่มเติม

(ข) ใช้สัญญามาตรฐานตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ

(ค) ระยะเวลาการรับชำระหนี้ของธุรกรรมการซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืนไม่เกินเก้าสิบวัน

(ง) มูลค่าของหลักทรัพย์ที่ได้รับจากธุรกรรมซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืน ณ วันเริ่มต้นสัญญาสูงกว่าราคาซื้อหลักทรัพย์ในจำนวนที่สมเหตุสมผล โดยส่วนต่างดังกล่าวต้องคำนวณจากอัตราส่วนลดของหลักทรัพย์ที่ซื้อ (initial margin) ซึ่งกำหนดขึ้นโดยคำนึงถึงปัจจัยความเสี่ยงของคู่สัญญาและหลักทรัพย์ที่ซื้อนั้น

(จ) มีการเรียกเงินหรือหลักทรัพย์เพิ่มเติมจากคู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง เมื่อมูลค่าของหลักทรัพย์ที่ได้รับจากธุรกรรมซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืนลดลงต่ำกว่าราคาซื้อ $\times (1 + \text{อัตราส่วนลดของหลักทรัพย์ที่ซื้อ})$

(ฉ) ไม่มีการนำหลักทรัพย์ที่ได้รับจากธุรกรรมซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืนไปขายหรือโอนต่อ เว้นแต่เป็นการขายหรือโอนตามข้อกำหนดในธุรกรรมซื้อขายโดยมีสัญญาขายคืนนั้น

ในการดำเนินการตามวรรคหนึ่ง ตัวแทนซื้อขายสัญญาต้องระบอบอย่างชัดเจนในบัญชีเงินฝากหรือการลงทุนนั้นว่าเป็นการดำเนินการ โดยตัวแทนซื้อขายสัญญาเพื่อประโยชน์ของลูกค้า

ในกรณีที่ตัวแทนซื้อขายสัญญานำเงินจำนวนที่แยกไว้เป็นทรัพย์สินของลูกค้าไปฝากหรือลงทุนกับสถาบันการเงินที่มีความสัมพันธ์ในลักษณะบริษัทใหญ่ บริษัทย่อย หรือบริษัทร่วมของตัวแทนซื้อขายสัญญา ตัวแทนซื้อขายสัญญาต้องได้รับความยินยอมเป็นลายลักษณ์อักษรจากลูกค้าก่อนดำเนินการ

คำว่า “บริษัทใหญ่” “บริษัทย่อย” และ “บริษัทร่วม” ตามวรรคสาม ให้อธิบายตามบทนิยามของคำดังกล่าวที่กำหนดไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการกำหนดบทนิยามในประกาศเกี่ยวกับการออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ซึ่งออกตามความในพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535”

ข้อ 2 ในกรณีที่ว่าตัวแทนซื้อขายสัญญาที่มีการนำเงินของลูกค้าไปลงทุนในตัวสัญญาใช้เงินที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ ตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. 84/2552 เรื่อง การดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้าของผู้ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2552 อยู่ก่อนวันที่ประกาศนี้มีผลใช้บังคับ ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาการเงินลงทุนในตัวสัญญาใช้เงินดังกล่าวได้เพียงเท่าระยะเวลาที่เหลืออยู่ของตัวสัญญาใช้เงินนั้น

ข้อ 3 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม พ.ศ. 2553 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 15 กันยายน พ.ศ. 2553

(นายธีระชัย ภูวนาถนรานุบาล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน

หมายเหตุ : เหตุผลในการออกประกาศฉบับนี้ คือ เพื่อเป็นการผ่อนคลายและเพิ่มทางเลือกให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสามารถนำเงินของลูกค้าที่อยู่ภายใต้การดูแลรักษาไปฝากหรือลงทุนในหลักทรัพย์หรือตราสารตามที่กำหนดเพิ่มเติมได้ จึงจำเป็นต้องออกประกาศนี้