

กค�

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

25 มกราคม 2554

เรียน ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ทุกบริษัท

บริษัทที่ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ที่ กดต.ธ.(ว) 2 /2554 เรื่อง การควบคุมดูแลการอนบันดาลการซื้อขายของลูกค้า

ด้วยสำนักงานตรวจสอบว่าบริษัทหลักทรัพย์หลายแห่งยินยอมให้ลูกค้า 1 ราย มอนอัมนาจการซื้อขายให้ผู้รับมอบอำนาจหารายราย หรือผู้รับมอบอำนาจ 1 ราย รับมอบอำนาจซื้อขายแทนลูกค้า รายราย โดยบริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีมาตรการควบคุมดูแลและตรวจสอบบัญชีลักษณะดังกล่าวที่รัดกุม เพียงพอเพื่อให้มั่นใจว่าจะไม่มีการใช้การมอบอำนาจเป็นช่องทางในการหลอกเลี้ยงการปฎิบัติตามกฎหมายที่ของทางการ เนื่องจากสำนักงานตรวจสอบพฤติกรรมการส่งคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสมอันรวมไปถึงการส่งคำสั่งซื้อขายในลักษณะจับคู่ซื้อขายกันเอง (wash sale) รวมทั้งยังพบว่ามีการทำ KYC/CDD ไม่ครบถ้วน สมบูรณ์ พฤติกรรมในลักษณะเช่นนี้อาจทำให้เกิดความเสียหายต่อลูกค้าและบริษัทหลักทรัพย์ ซึ่งจะส่งผลกระทบต่อความน่าเชื่อถือของตลาดทุนโดยรวม

สำนักงานจึงขอคำชี้แจงให้บริษัทหลักทรัพย์และตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ทุกแห่งควบคุมดูแลให้มีการมอบอำนาจหรือรับมอบอำนาจในการซื้อขายตามความจำเป็นเหมาะสม และเพื่อให้มั่นใจว่าจะไม่มีการใช้การมอบอำนาจเป็นช่องทางในการหลอกเลี้ยงการปฎิบัติตามกฎหมายที่ของทางการหรือเป็นช่องทางในการส่งคำสั่งซื้อขายไม่เหมาะสม บริษัทหลักทรัพย์และตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ต้องทำ KYC/CDD บัญชีลักษณะดังกล่าวอย่างเคร่งครัดและต้องดำเนินมาตรการในการควบคุมดูแลและตรวจสอบพฤติกรรมการส่งคำสั่งซื้อขายให้รัดกุมยิ่งขึ้น

ทั้งนี้ หากปรากฏข้อเท็จจริงว่า บริษัทหลักทรัพย์และตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ไม่ได้เข้มงวดในการกำกับดูแลและตรวจสอบบัญชีลักษณะดังกล่าว สำนักงานจะพิจารณาในเบื้องต้นว่า บริษัทหลักทรัพย์และตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีระบบการบริหารความเสี่ยงและระบบการควบคุมภายในที่ไม่มีประสิทธิภาพ และสำนักงานจะดำเนินการกับกรณีดังกล่าวอย่างเคร่งครัด

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

นายธีระชัย ภูวนานนท์
เลขานุการ

ฝ่ายกำกับธุรกิจนาขหน้าและค้าหลักทรัพย์
โทรศัพท์ 0-2263-6057
โทรสาร 0-2263-6318