

11 มิถุนายน 2555

เรียน ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ทุกแห่ง

ตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทุกแห่ง

ที่ กสท.กร. (ว) 9 /2555 เรื่อง นำส่งภาพถ่ายประกาศและชักซ้อมความเข้าใจ  
เกี่ยวกับการลงทุนในตราสารต่างประเทศของลูกค้ายบริษัทหลักทรัพย์

ตามที่สำนักงานได้มีประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. 25/2555 เรื่อง หลักเกณฑ์  
ในการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในต่างประเทศ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 12 พฤษภาคม พ.ศ. 2555  
เพื่ออำนวยความสะดวกให้ผู้ลงทุนสามารถลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (“ตราสารอนุพันธ์”) ในศูนย์ซื้อขาย  
สัญญาต่างประเทศ นั้น

สำนักงานขอเรียนว่า ประกาศดังกล่าวข้างต้นกำหนดให้บริษัทหลักทรัพย์ (“บล.”) ที่เป็น  
ตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (“ตัวแทนซื้อขายสัญญา”) ต้องจัดทำเอกสารเปิดเผยข้อมูลความเสี่ยง  
และปฏิบัติตามขั้นตอน ระเบียบ และวิธีปฏิบัติอื่น (“work flow”) ที่สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยกำหนด  
ซึ่งได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ปัจจุบันสำนักงานได้พิจารณาให้ความเห็นชอบเอกสารเปิดเผยข้อมูล  
ความเสี่ยง และ work flow ดังกล่าวแล้ว (สิ่งที่ส่งมาด้วย 1) และสำนักงานขอชักซ้อมความเข้าใจเกี่ยวกับ  
หลักเกณฑ์และขั้นตอนดังกล่าว ดังนี้

### 1. การลงทุนในตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ

#### 1.1 ผู้ให้บริการ

ตัวแทนซื้อขายสัญญาที่สามารถให้บริการพาลูกค้าไปลงทุนในตราสารอนุพันธ์  
ต่างประเทศได้ ต้องเป็น บล. ที่ได้รับใบอนุญาตประเภทการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์หรือการค้าหลักทรัพย์  
ซึ่งมิได้จำกัดเฉพาะหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่งหรือหน่วยลงทุน

#### 1.2 ประเภทตราสารอนุพันธ์

ตราสารอนุพันธ์ที่ลงทุนได้ ต้องเป็นตราสารที่มีการซื้อขายในศูนย์ซื้อขายสัญญา  
ซื้อขายล่วงหน้า (exchange traded derivatives) ในต่างประเทศ และเป็นตราสารอนุพันธ์ตามคำนิยาม ซึ่งรวมถึง  
ประเภทของสินค้าและตัวแปรอ้างอิงที่กำหนดไว้ใน พ.ร.บ. สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ทั้งนี้ ต้องไม่เป็นสินค้า  
และตัวแปรอ้างอิงที่เกี่ยวข้องกับเงินบาท

#### 1.3 ข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ

เจ้าหน้าที่ของตัวแทนซื้อขายสัญญาต้องอธิบายถึงรายละเอียดเกี่ยวกับกฎเกณฑ์  
และขั้นตอนการดำเนินงานเกี่ยวกับการเรียกและวางหลักประกัน ตลอดจนการบังคับขายกรณีลงทุนใน  
ตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ พร้อมทั้งกำหนดให้ลูกค้าลงนามรับทราบการอธิบายดังกล่าวด้วย

2. การปรับปรุง work flow อื่น ๆ ในครั้งนี้ จะช่วยให้เกิดความสะดวกและคล่องตัว  
เพื่อรองรับการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศสรุปดังนี้

2.1 การย้ายพอร์ตลงทุนของลูกค้ำที่เปิดบัญชีไว้โดยตรงกับ บล. ต่างประเทศมายัง  
บัญชีของลูกค้ำที่ บล. ไทย

2.2 การย้ายพอร์ตลงทุนของลูกค้ำที่ลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศระหว่าง บล. ไทย  
ด้วยกัน

2.3 การยกเลิกข้อกำหนดเรื่องนำเงินตราต่างประเทศกลับภายในระยะเวลาที่กำหนด  
หากลงทุนไม่ถึงร้อยละ 80 ของเงินที่นำออกไป

3. การปรับปรุงเอกสารเปิดเผยข้อมูลความเสี่ยงในส่วน “ข้อจำกัดบางประการในการลงทุน  
ในหลักทรัพย์ต่างประเทศ” ให้ชัดเจนขึ้นเพื่อรองรับการผ่อนคลายข้อจำกัดการย้ายพอร์ตตามข้อ 2 แต่ยังคง  
ถ้อยคำเกี่ยวกับข้อจำกัดการย้ายพอร์ตลงทุนของลูกค้ำ ไปยังบัญชีของลูกค้ำที่เปิดบัญชีไว้โดยตรงกับ  
บล. ต่างประเทศ

4. เพื่อรองรับการจัดสรรวงเงินเพิ่มเติม และการแก้ไข work flow อื่น ๆ สำนักงาน  
ได้ปรับปรุงระบบควบคุมวงเงินลงทุนในต่างประเทศ (“Financial Investment Allotment: FIA”) ดังนี้

#### 4.1 การเพิ่มวงเงินจัดสรร


สำหรับบุคคลธรรมดาและผู้ลงทุนอื่น ๆ ที่ปัจจุบันมีวงเงินสูงสุดรายละ  
5 ล้านดอลลาร์สหรัฐ ได้ปรับวงเงินเพิ่มเป็นรายละไม่เกิน 20 ล้านดอลลาร์สหรัฐ โดยวิธีการจัดสรรยังคงเดิม  
คือ จัดสรรให้ครั้งละ 5 แสนดอลลาร์สหรัฐ และเมื่อใช้ถึง 4 แสนดอลลาร์สหรัฐ จึงสามารถขอจัดสรรเพิ่มได้

#### 4.2 การย้ายพอร์ตลงทุนระหว่าง บล.

เมื่อลูกค้ำมีคำสั่งให้โอนพอร์ตลงทุนไปยัง บล. อื่นแล้ว ให้ บล. ผู้โอน และ  
บล. ผู้รับโอน ดำเนินการตามคู่มือการใช้งาน เรื่องการโอนวงเงินผ่านระบบ FIA ทั้งนี้ ระบบดังกล่าวจะเริ่ม  
ใช้งานได้ตั้งแต่วันที่ 15 มิถุนายน 2555 เป็นต้นไป

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ



(นายวันต์ เทียนหอม)

รองเลขาธิการ

เลขาธิการแทน

สิ่งที่ส่งมาด้วย 1. ภาพถ่ายแนวทางการปฏิบัติงานของบริษัทหลักทรัพย์ ฉบับแก้ไขเพิ่มเติม มิถุนายน 2555  
2. ภาพถ่ายเอกสารเปิดเผยข้อมูลความเสี่ยง ฉบับแก้ไขเพิ่มเติม มิถุนายน 2555

ฝ่ายกำกับและพัฒนารูทกิจหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 0-2263-6255

โทรสาร 0-2263-6446