

แนวทางการปฏิบัติงานของบริษัทหลักทรัพย์
เกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศ ตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ
และหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศที่เสนอขายในไทย (FX bond)

1. การพิจารณารับลูกค้าและเปิดบัญชี รวมถึงการจัดทำ KYC/CDD
2. การจัดทำ Risk Disclosure Statement เพื่อเปิดเผยข้อมูลความเสี่ยง และข้อจำกัดจากการลงทุนให้ลูกค้ารับทราบ
3. การอนุมัติการเปิดบัญชีและพิจารณาวงเงินจัดสรรของลูกค้า
4. การขออนุมัติวงเงินจากสำนักงาน กลต.
5. การนำเงินไปลงทุน
 - 5.1 กรณีหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ
 - 5.1.1 การเตรียมการของบริษัทหลักทรัพย์ก่อนการซื้อขายหลักทรัพย์
 - 5.1.2 การโอนเงินของลูกค้าเพื่อเตรียมไว้ก่อนการส่งคำสั่งซื้อขาย
 - 5.1.3 การส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ในต่างประเทศ
 - 5.1.4 การส่งคำสั่งซื้อขายตราสารอนุพันธ์ในต่างประเทศ
 - 5.1.4.1 การส่งคำสั่งซื้อขาย
 - 5.1.4.2 การวางหลักประกัน
 - 5.1.5 การนำเงินไปชำระและการโอนเงินค่าขายกลับ กรณีเงินบาท
 - 5.1.6 การนำเงินไปชำระและการโอนเงินค่าขายกลับ กรณีเงินตราต่างประเทศ
 - 5.2 กรณีหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศที่เสนอขายในประเทศไทย (FX bond)
 - 5.2.1 การทำหน้าที่รับจัดจำหน่ายหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศ (ตลาดแรก)
 - 5.2.1.1 การจองซื้อ
 - 5.2.1.2 การนำเงินไปชำระค่าจองซื้อ
 - 5.2.1.3 การคืนค่าจองซื้อ
 - 5.2.2 การรับเงินจากหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศ
 - 5.2.2.1 การรับดอกเบี้ยและผลประโยชน์จากหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศ
 - 5.2.2.2 การรับเงินต้น ดอกเบี้ย และผลประโยชน์จากหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศ
6. การทำ Currency Hedge ของลูกค้าที่ลงทุน
7. การดูแลทรัพย์สิน และการรายงานสถานะการลงทุนของลูกค้า
 - 7.1 กรณีหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ
 - 7.2 กรณีหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศที่เสนอขายในประเทศไทย
8. การลงทุนหลักทรัพย์เพื่อค้าของบริษัทหลักทรัพย์
 - 8.1 กรณีหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ
 - 8.2 กรณีหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศที่เสนอขายในประเทศไทย
9. การย้ายพอร์ตลงทุน
 - 9.1 การย้ายพอร์ตลงทุนระหว่างบัญชีกองทุนส่วนบุคคล (Private Fund: PF) กับบัญชีซื้อขายผ่าน บล.
 - 9.2 การย้ายพอร์ตลงทุนจากบัญชีของลูกค้าที่ต่างประเทศมายังบัญชีซื้อขายผ่าน บล.
 - 9.3 การย้ายพอร์ตลงทุนระหว่าง บล. เฉพาะกรณีหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศ (FX bond)
 - 9.4 การย้ายพอร์ตลงทุนระหว่าง บล. กรณีลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ
10. การจัดทำรายงานข้อมูลต่อหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง

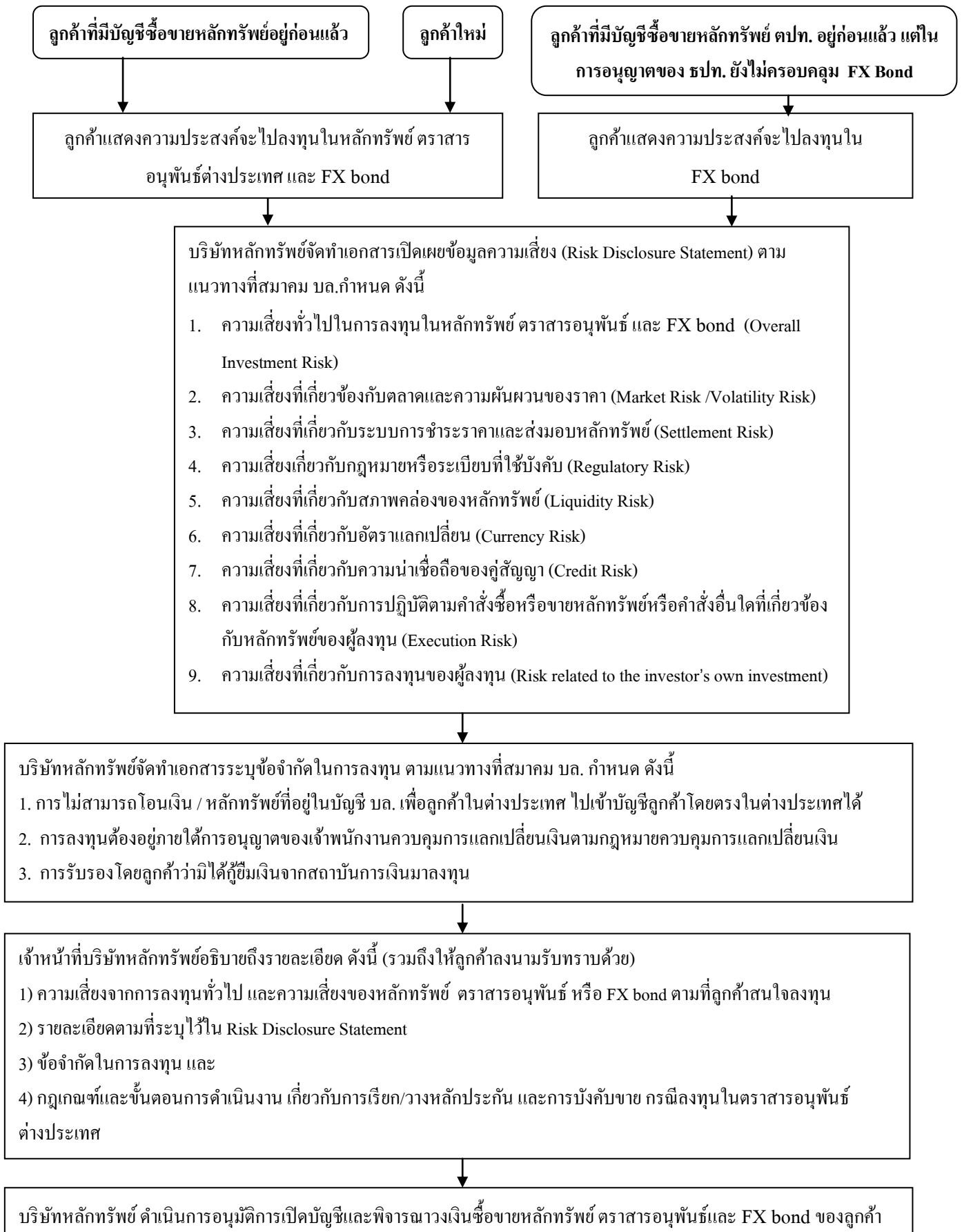
1. การพิจารณารับลูกค้าและเปิดบัญชีรวมถึงการจัดทำ KYC/CDD



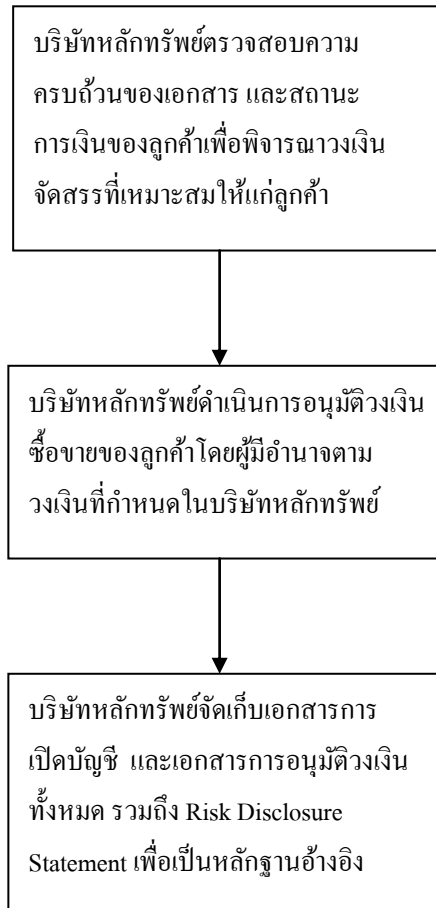
* ในการทำ KYC/CDD บล. ต้องให้ลูกค้าลงนามยืนยันว่าเงินที่จะนำมาลงทุนนั้นไม่ได้มาจากการฉ้อโกง และขอความร่วมมือให้ลูกค้ารายงานการทำธุรกรรมป้องกันความเสี่ยง (currency hedge) ที่เกี่ยวข้องแก่ บล. ด้วย นอกจากนี้ บล. จะมีการทบทวนเอกสารหลักฐานการเปิดบัญชีและทำ KYC/CDD ในช่วงเวลาตามเกณฑ์ที่กำหนดหลังจากที่มีการดำเนินการเปิดบัญชีเรียบร้อยแล้ว

** กรณีลูกค้าของ บล. เป็นกองทุนส่วนบุคคล (PF) บล. ไม่ต้องดำเนินการจัดส่งรายชื่ออีกครั้ง เนื่องจาก บล./ บล. ในฐานะบริษัทจัดการได้ดำเนินการแล้ว

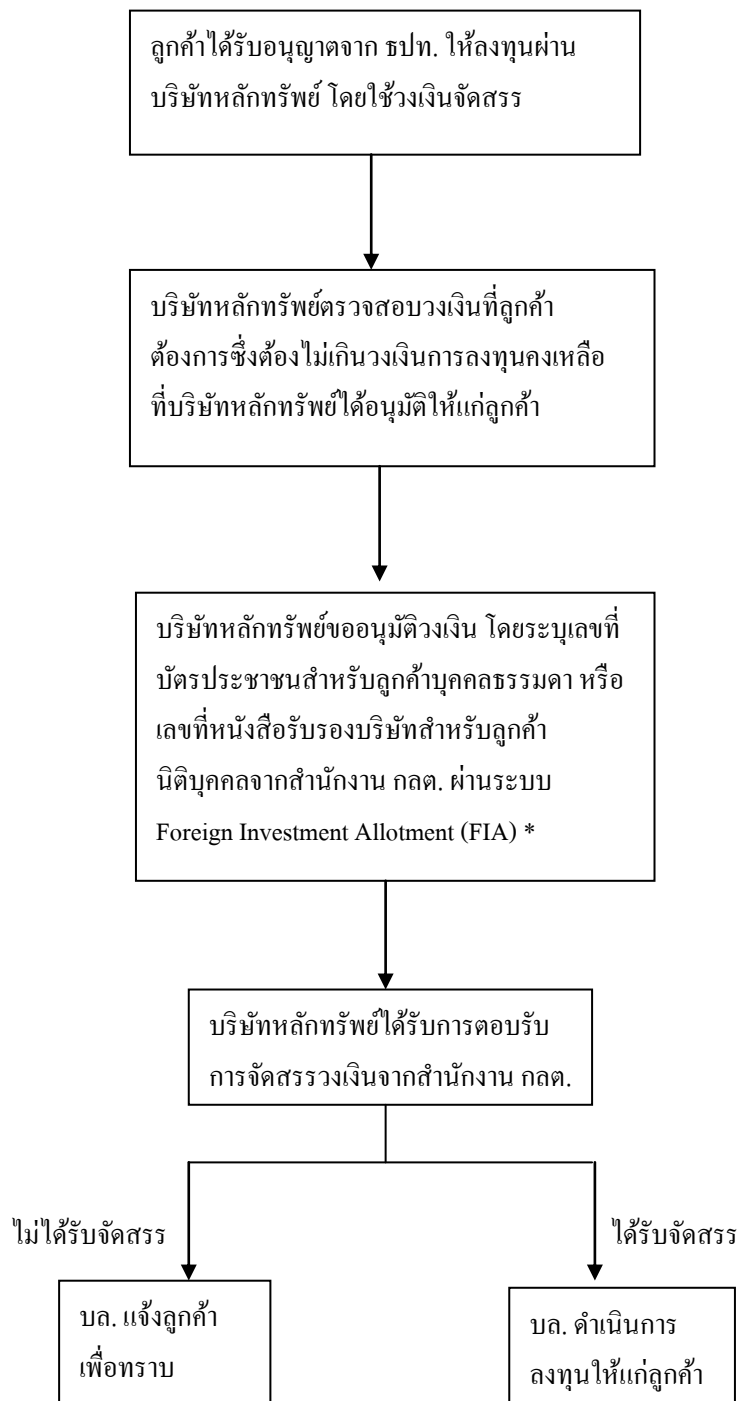
2. การจัดทำ Risk Disclosure Statement เพื่อเปิดเผยข้อมูลความเสี่ยง และข้อจำกัดจากการลงทุนให้ลูกค้ารับทราบ



3. การอนุมัติการเปิดบัญชีและพิจารณาวงเงินจัดสรรของลูกค้า



4. การขออนุมัติวงเงินจากสำนักงาน กสท.

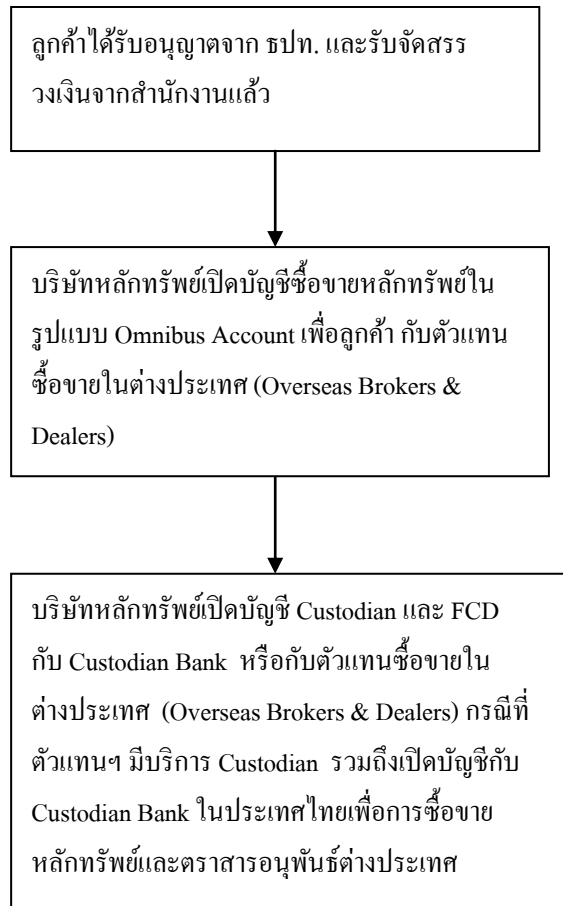


* กรณีลูกค้าของ บล. เป็นกองทุนส่วนบุคคล (PF) บล. ไม่ต้องดำเนินการขออนุมัติวงเงินจัดสรรอีกครั้ง ทั้งนี้ เนื่องจาก บล./ บล. ในฐานะบริษัทจัดการได้ดำเนินการแล้ว

5. การนำเงินไปลงทุน

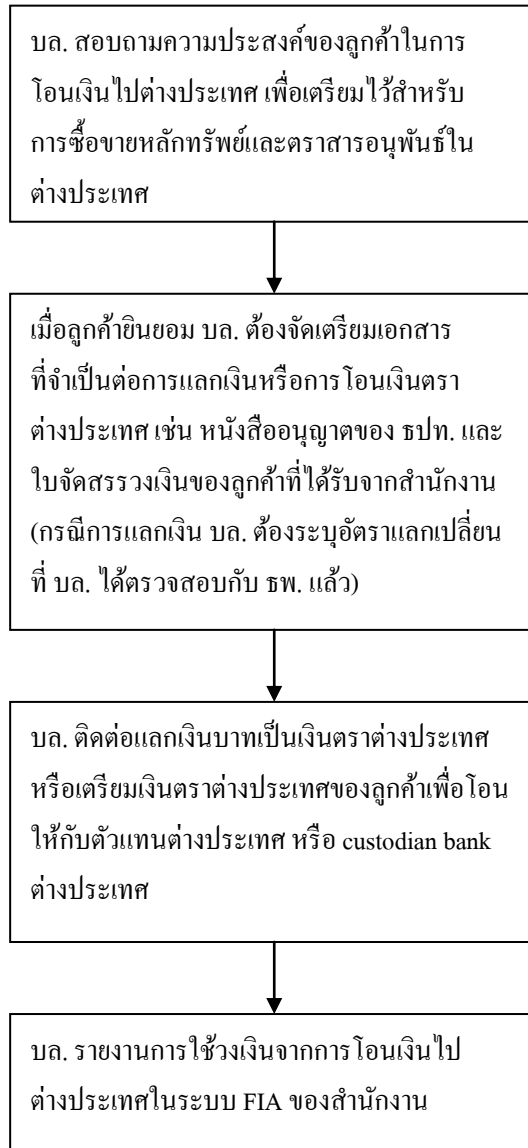
5.1 กรณีหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ

5.1.1 การเตรียมการของบริษัทหลักทรัพย์ก่อนการซื้อขายหลักทรัพย์

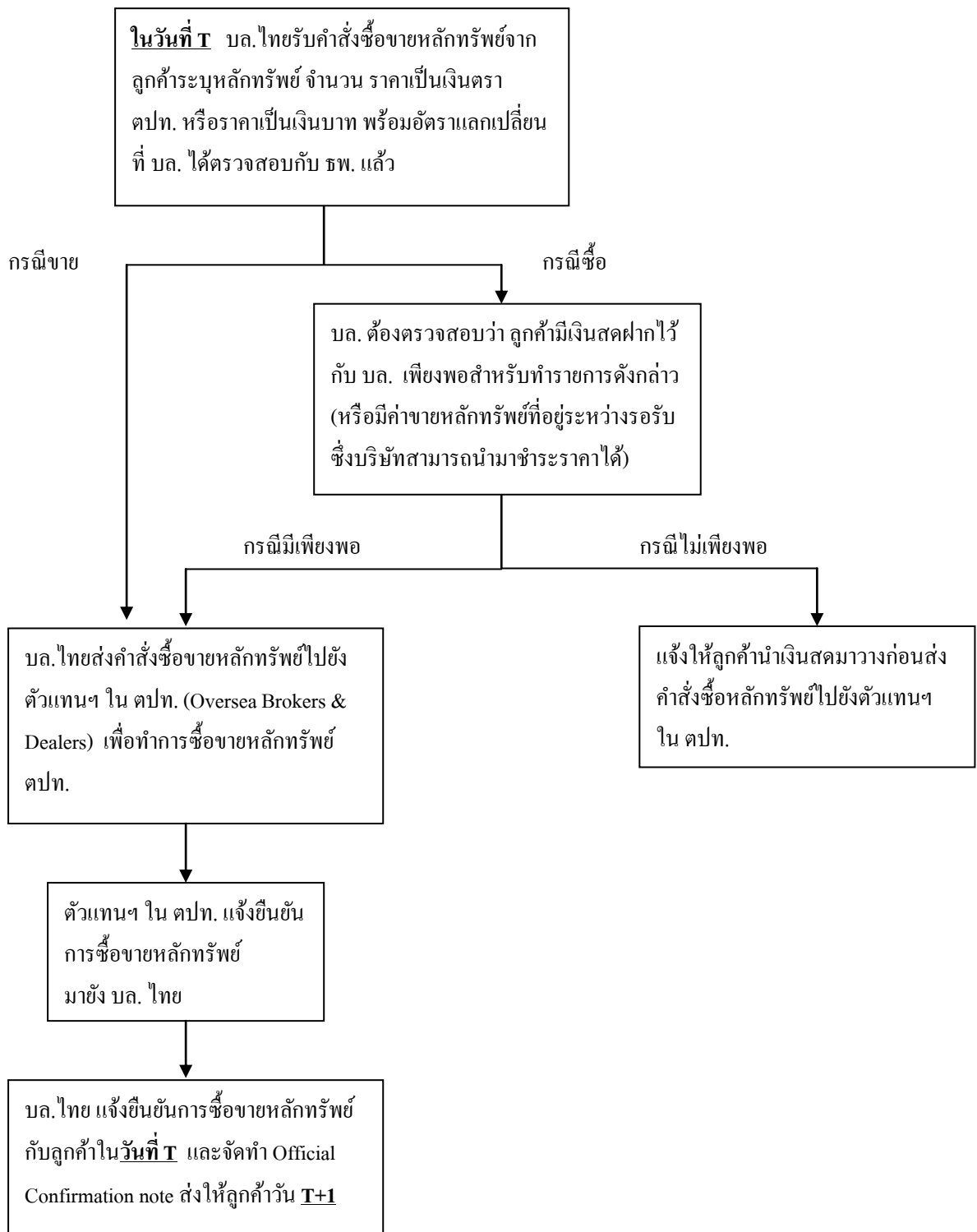


- กรณีลูกค้าที่เป็น Non-Resident (NR) สามารถลงทุนได้โดยไม่ต้องขออนุญาตจาก ธปท.

5.1.2 การโอนเงินของลูกค้าเพื่อเตรียมไว้ก่อนการส่งคำสั่งซื้อขาย

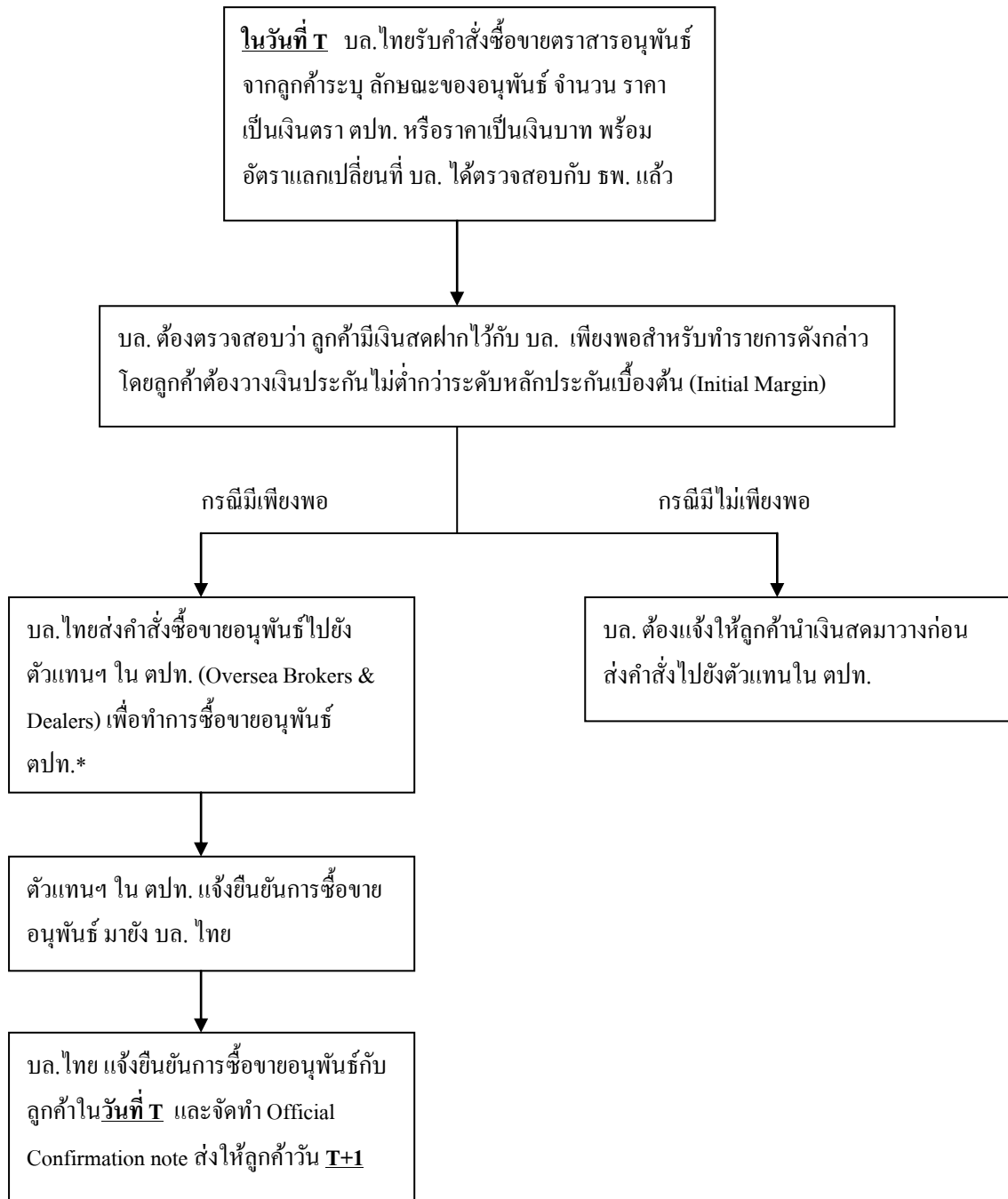


5.1.3 การส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ในต่างประเทศ



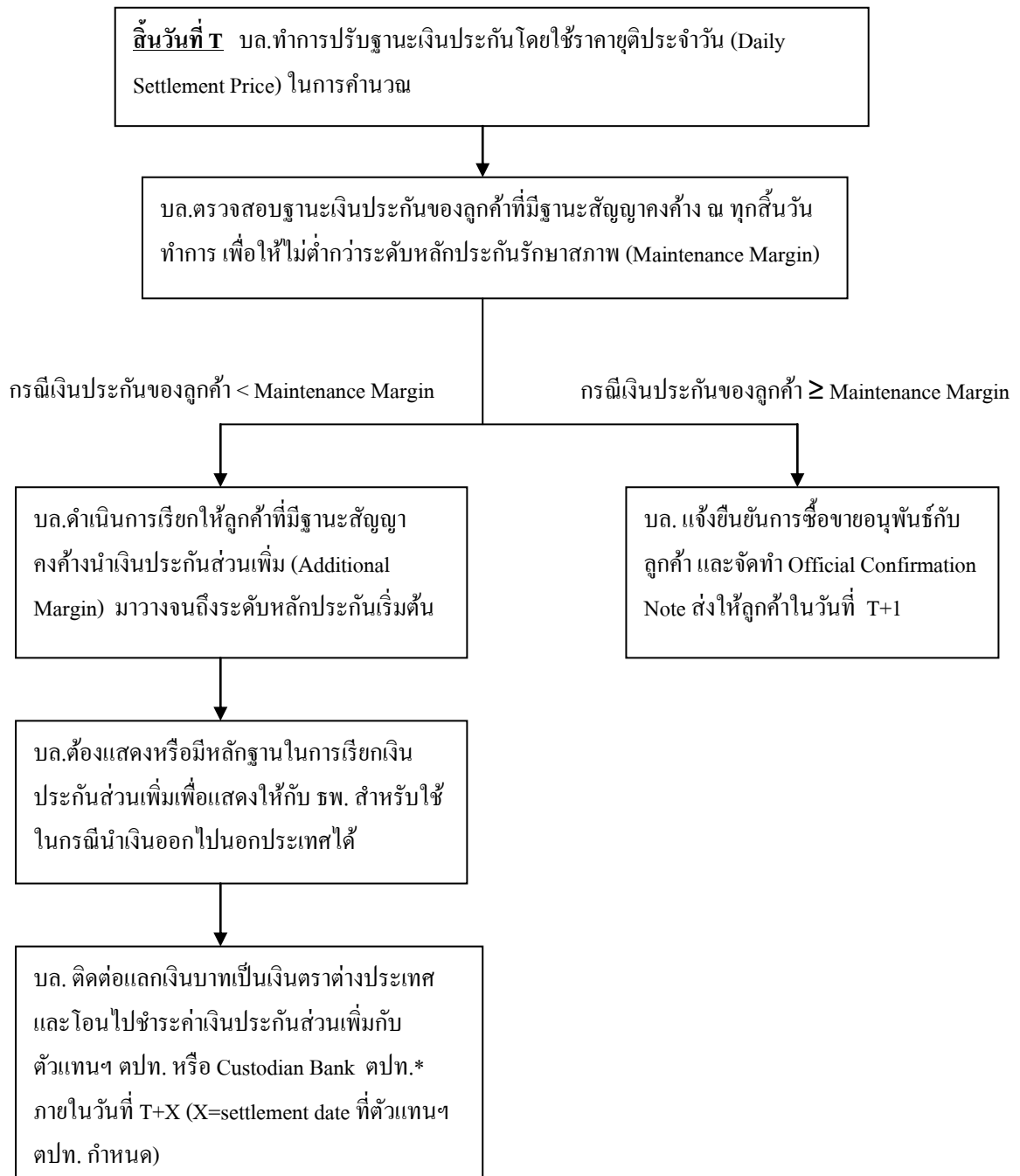
5.1.4 การส่งคำสั่งซื้อขายตราสารอนุพันธ์ในต่างประเทศ

5.1.4.1 การส่งคำสั่งซื้อขาย



* ในการเปิดฐานะอนุพันธ์ให้ลูกค้า บล. จะต้องระมัดระวังความเพียงพอของเงินที่อาจจะต้องนำไปวางเพิ่ม กรณีที่
อาจจะต้องนำหลักประกันไปวางเพิ่ม (margin) ด้วย

5.1.4.2 การวางหลักประกัน



* ภายใต้บัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศของ บล. เพื่อลูกค้ำ

5.1.5 การนำเงินไปชำระและการโอนเงินค่าขายกลับ กรณีเงินบาท

ก. การชำระค่าซื้อหลักทรัพย์ / เปิดฐานะอนุพันธ์



* ภายใต้บัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศของ บล. เพื่อลูกค้า

- กรณีลูกค้าเป็น Non-Resident (NR) ที่ชำระค่าซื้อเป็นเงินบาท ให้ บล. คืนเงินค่าขายให้แก่ NR เป็นเงินบาท

5.1.5 การนำเงินไปชำระและการโอนเงินค่าขายกลับ กรณีเงินบาท (ต่อ)

ข. การขายหลักทรัพย์ / ปิดฐานอนุพันธ์ และนำเงินกลับ



* ภายใต้บัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศของ บล. เพื่อลูกค้า (Omnibus Account)

** หากลูกค้าต้องการให้เก็บไว้สำหรับรายการซื้อครั้งต่อไปจะเก็บไว้ในบัญชี Omnibus Account โดย บล. จะจัดทำบัญชี Sub-Account ตามรายลูกค้า ซึ่งลูกค้าไม่สามารถโอนเงินไปยังสถาบันการเงินอื่นในต่างประเทศได้

5.1.6 การนำเงินไปชำระและการโอนเงินค่าขายกลับ กรณีเงินตราต่างประเทศ

ก. การชำระค่าซื้อ / เปิดฐานอนุพันธ์



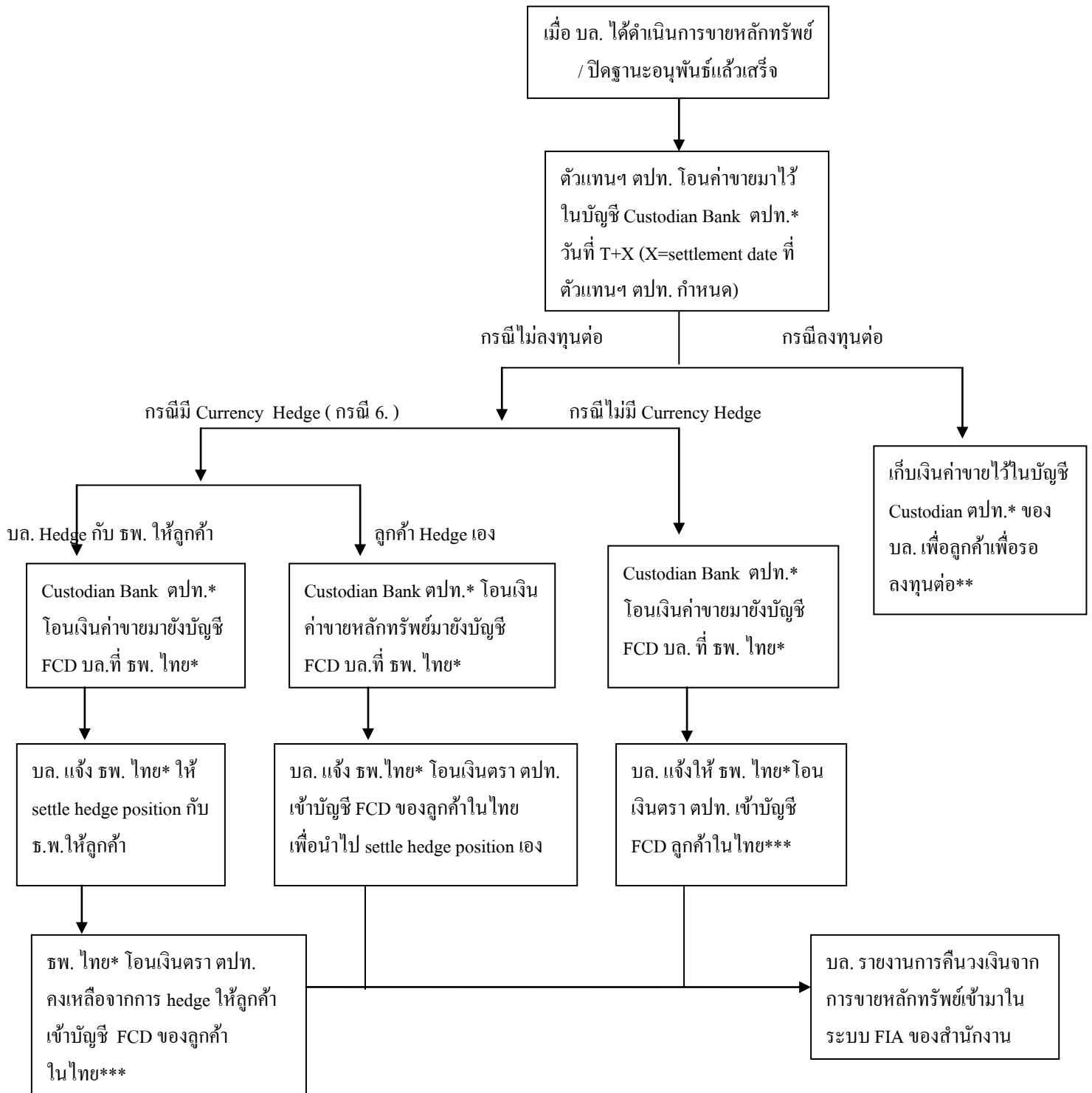
* ภายใต้บัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศของ บล. เพื่อลูกค้า

- กรณีลูกค้าเป็น Non-Resident (NR) ที่ชำระค่าซื้อเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้ บล. คืนเงินค่าขายให้แก่ NR เป็นเงินตราต่างประเทศ

หมายเหตุ บริษัทหลักทรัพย์สามารถรับชำระค่านายหน้าการซื้อขายหลักทรัพย์จากลูกค้าไทยเป็นเงินตราต่างประเทศได้ แต่ยังมีข้อจำกัดเรื่องวงเงิน

5.1.6 การนำเงินไปชำระและการโอนเงินกลับ กรณีเงินตราต่างประเทศ (ต่อ)

ข. การขายหลักทรัพย์ / ปิดฐานะอนุพันธ์ และนำเงินกลับ



* ภายใต้บัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศของ บล. เพื่อลูกค้า (Omnibus Account)

** หากลูกค้าต้องการให้เก็บไว้สำหรับรายการซื้อครั้งต่อไปจะเก็บไว้ในบัญชี Omnibus Account ที่ Custodian Bank ตปท. โดย บล. จะจัดทำบัญชี Sub-Account ตามรายลูกค้า ซึ่งลูกค้าไม่สามารถโอนเงินไปยังสถาบันการเงินอื่นในต่างประเทศได้

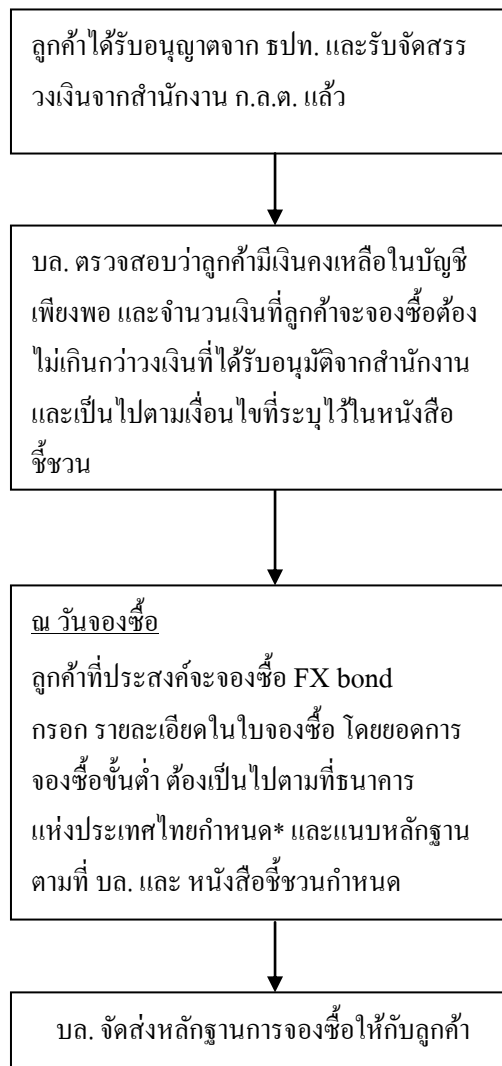
*** โอนเข้าได้เฉพาะบัญชี FCD ในประเทศประเภทไม่มีภาวะผูกพัน สำหรับบุคคลธรรมดา/นิติบุคคลสามารถมียอดคงเหลือในบัญชีได้ไม่เกิน 500,000 เหรียญสหรัฐ

5. การนำเงินไปลงทุน

5.2 กรณีหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศ (FX bond) ที่เสนอขายใน ไทย

5.2.1 การทำหน้าที่รับจัดจำหน่ายหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศ (ตลาดแรก)

5.2.1.1 การจองซื้อ



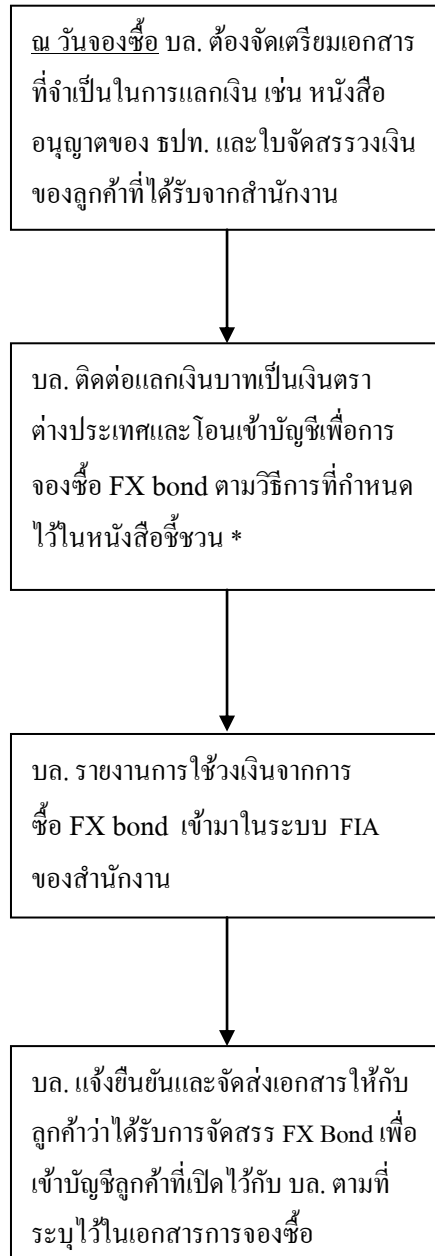
* กรณีลูกค้าจองซื้อ บล. ต้องตรวจสอบว่า เป็นไปตามเงื่อนไขของการซื้อ FX bond ตามที่กำหนดในหนังสือชี้ชวน ตอนเสนอขาย เช่น ประเภทผู้ลงทุนที่ซื้อได้ มูลค่าขั้นต่ำ (เช่น หนังสือชี้ชวนอาจมีการกำหนดให้ลูกค้าทั่วไปซื้อแต่ละครั้ง ไม่ต่ำกว่า 100,000 เหรียญสหรัฐ)

- กรณีลูกค้าที่เป็น Non-Resident (NR) สามารถลงทุนใน FX Bond เป็นเงินตราต่างประเทศได้โดยไม่ต้องขออนุญาตจาก ธปท.

หมายเหตุ : กรณีกองทุนส่วนบุคคลหากประสงค์จะจองซื้อหุ้นกู้สกุลเงินต่างประเทศจะต้องจองซื้อผ่าน บล. เช่นเดียวกับลูกค้าทั่วไป โดย บล. ต้องตรวจสอบให้เป็นไปตามเงื่อนไขของการซื้อขาย FX bond (เช่น ให้ลูกค้าจองซื้อแต่ละครั้งต้องไม่ต่ำกว่า 100,000 เหรียญสหรัฐ หรือเทียบเท่า) ทั้งนี้ บลจ./ บล. ในฐานะบริษัทจัดการ ต้องมีการขออนุมัติวงเงินและรายงานการใช้วงเงินตามแนวทางที่สำนักงานฯ กำหนดไว้

5.2.1.2 การนำเงินไปชำระค่าของซื้อ

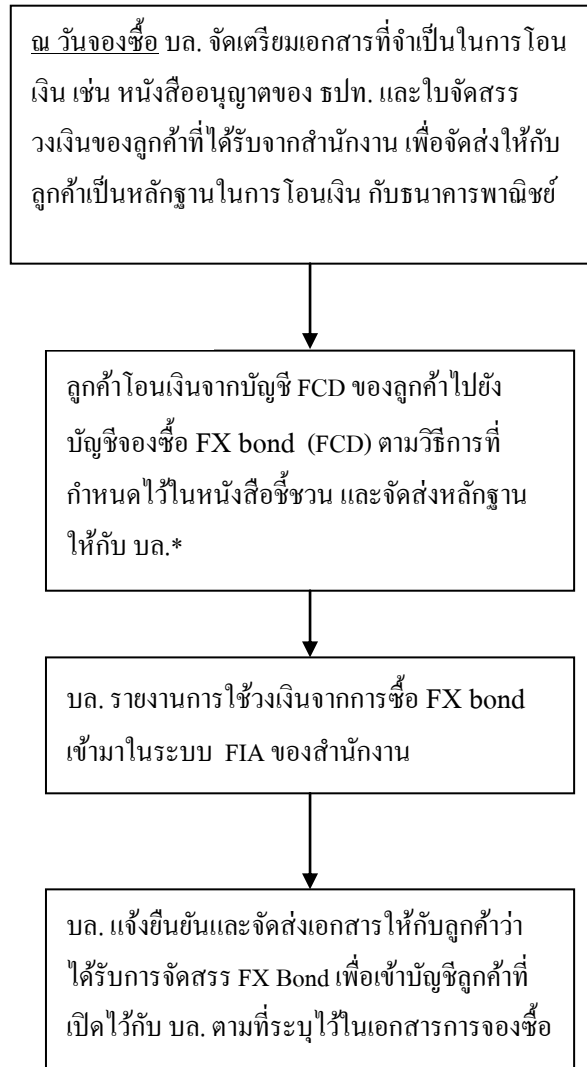
ก. กรณีเงินบาท



* กรณีลูกค้าประสงค์จะฝากเงินที่เหลือจากการแลกเปลี่ยนเงินบาทเป็นเงินตราต่างประเทศไว้กับ บล. ให้ บล. ปฏิบัติตามขั้นตอนกรณีลูกค้าขอฝากเงินกับ บล. ตามขั้นตอนปกติ

5.2.1.2 การนำเงินไปชำระค่าของซื้อ

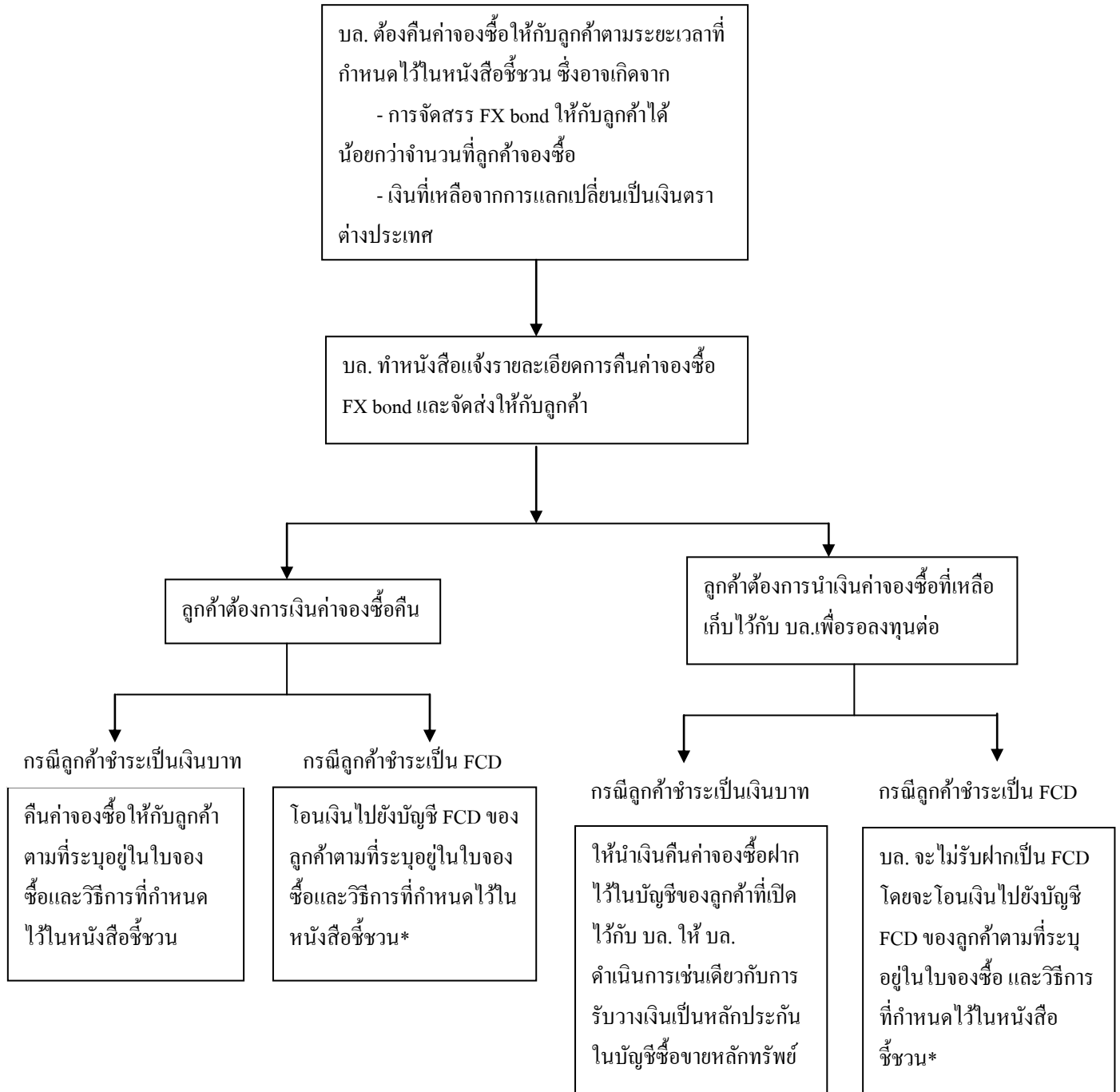
ข. กรณีเงินตราต่างประเทศ



* หนังสือชี้ชวนอาจกำหนดเงื่อนไขให้ผู้ซื้อต้องแนบสำเนาหน้าสมุดบัญชีเงินฝาก (เงินบาท) เพื่อประโยชน์ในการแลกเปลี่ยนเป็นเงินบาทและนำเงินเข้าบัญชีเงินฝาก (เงินบาท) หากได้รับดอกเบี้ยหรือเงินต้นคืนจนทำให้เงินในบัญชี FCD ในประเทศประเภทไม่มีภาวะผูกพัน มีจำนวนเกินกว่า 500,000 เหรียญสหรัฐ สำหรับลูกค้าบุคคลธรรมดาและนิติบุคคล

- บล.สามารถเปิดบัญชี FCD เพื่อการของซื้อได้ภายหลังจากที่ได้รับอนุญาตจาก ธปท. และให้ บล. รายงานเลขที่บัญชีดังกล่าวไปยัง ธปท.

5.2.1.3 การคืนค่าจองซื้อ

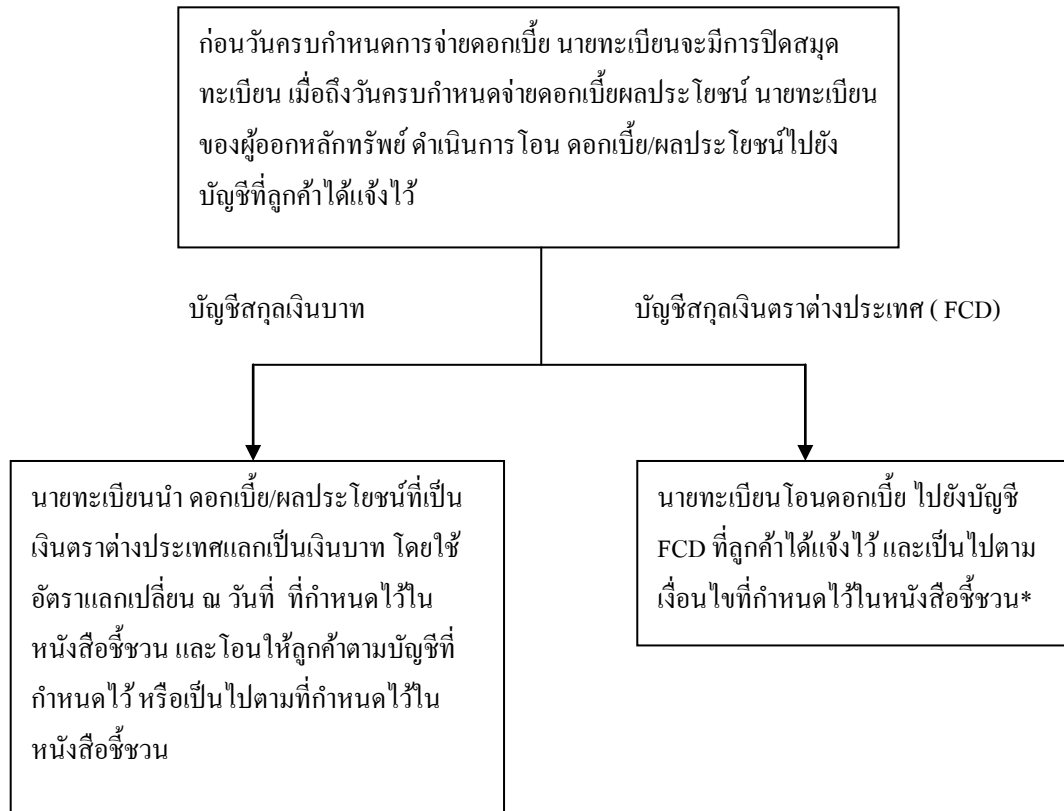


* บล. จะคืนค่าจองเข้าบัญชี FCD แหล่งในประเทศและไม่มีภาระผูกพันเท่านั้น ซึ่งจะมียอดคงค้างได้ไม่เกิน 500,000 เหรียญสหรัฐ สำหรับลูกค้าบุคคลธรรมดา และนิติบุคคล

- กรณี NR ที่จองซื้อเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้บล. คืนเงินค่าจองซื้อเข้าบัญชี FCD ของลูกค้าในและต่างประเทศได้
กรณี NR จองซื้อเป็นเงินบาท ให้ บล. คืนเงินค่าจองซื้อให้แก่ NR เป็นเงินบาท

5.2.2 การรับเงินจากหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศ

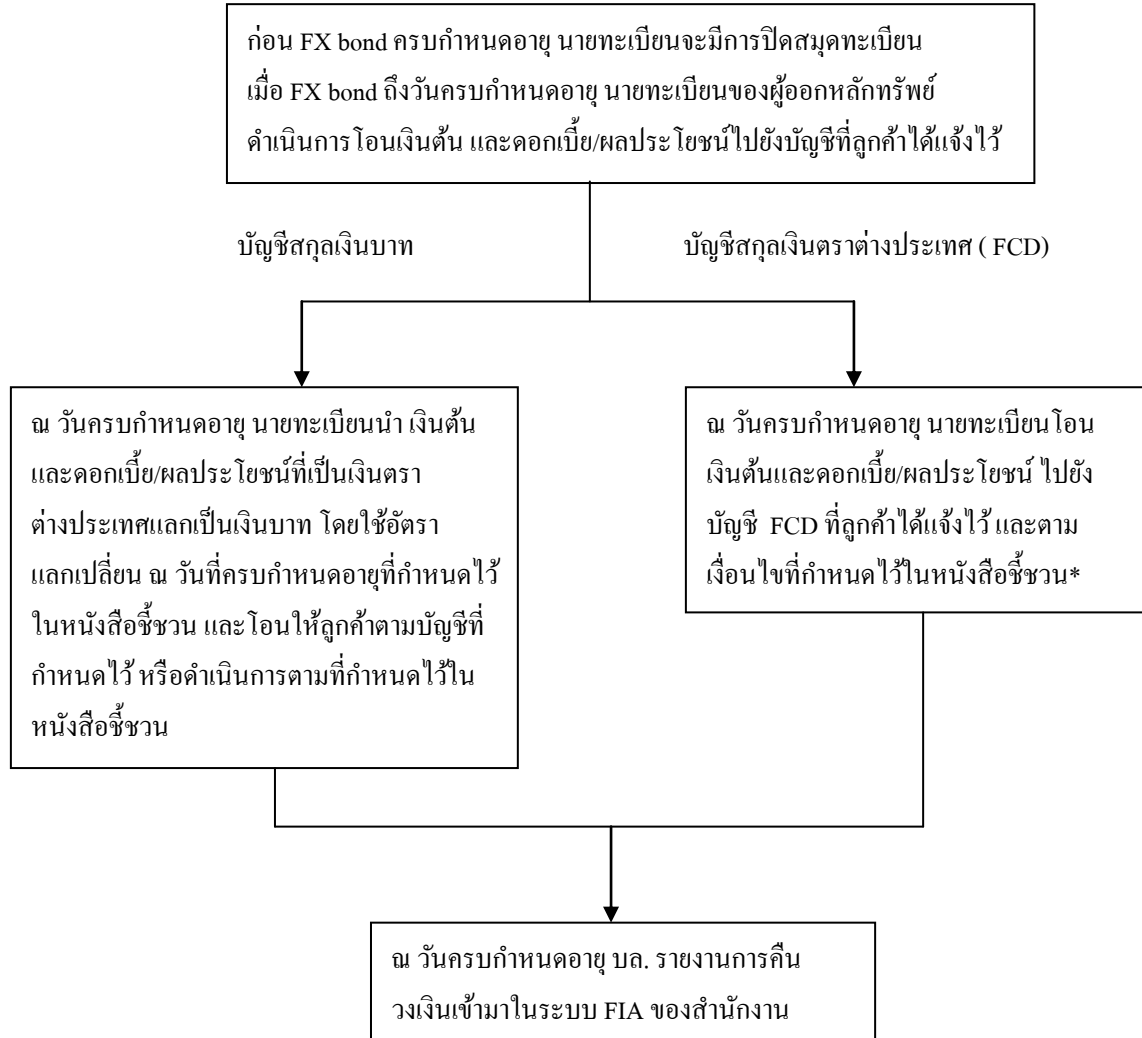
5.2.2.1 การรับดอกเบี้ย และผลประโยชน์จากหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศ



* หนังสือชี้ชวนอาจกำหนดเงื่อนไขให้ผู้จองซื้อต้องแนบสำเนาหน้าสมุดบัญชีเงินฝาก (เงินบาท) เพื่อประโยชน์ในการแลกเปลี่ยนเป็นเงินบาทและนำเงินเข้าบัญชีเงินฝาก (เงินบาท) หากได้รับดอกเบี้ยหรือเงินต้นคืนจนทำให้เงินในบัญชี FCD ในประเทศประเภทไม่มีภาวะผูกพัน มีจำนวนเกินกว่า 500,000 เหรียญสหรัฐ สำหรับลูกค้าบุคคลธรรมดาและนิติบุคคล

- กรณี NR ที่จองซื้อเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้ บล. คำนวณค่าจองซื้อเข้าบัญชี FCD ของลูกค้าในและต่างประเทศได้ กรณี NR จองซื้อเป็นเงินบาท ให้ บล. คำนวณค่าจองซื้อให้แก่ NR เป็นเงินบาท

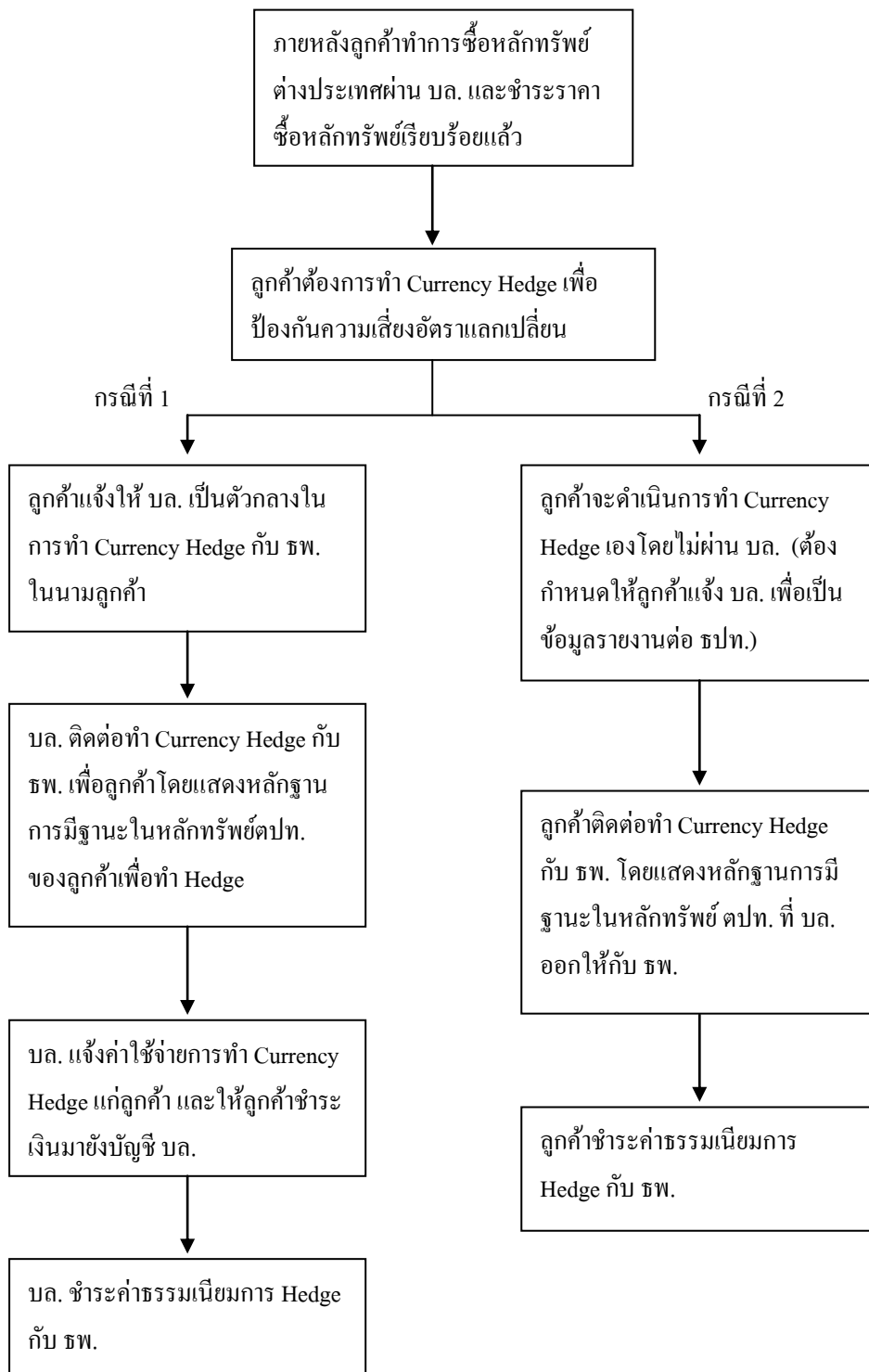
5.2.2.2 การรับเงินต้น ดอกเบี้ย และผลประโยชน์จากหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศ



* กรณีบัญชี FCD ในประเทศประเภทแบบไม่มีภาระผูกพัน จะสามารถมียอดคงเหลือในบัญชีได้ไม่เกิน 500,000 เหรียญสหรัฐ สำหรับบุคคลธรรมดาและนิติบุคคล

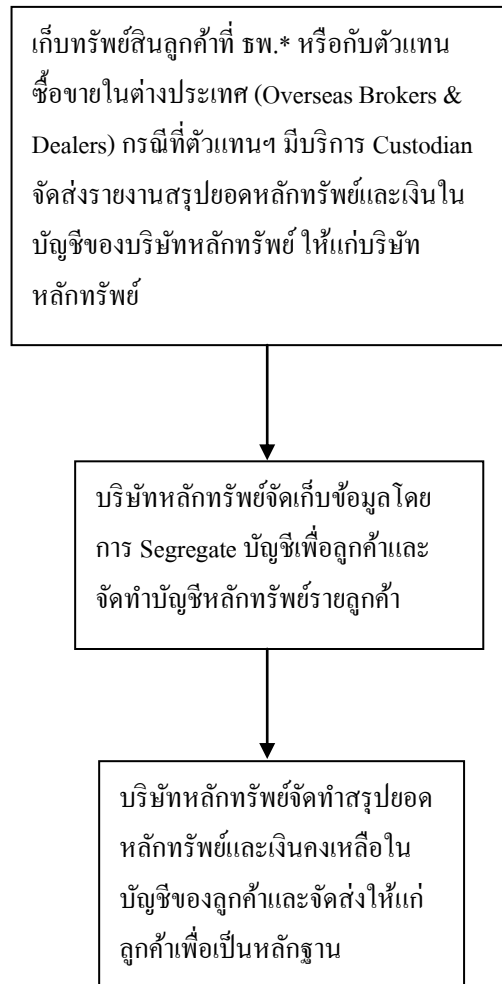
- กรณี NR ที่จองซื้อเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้ บล. คืนเงินค่าจองซื้อเข้าบัญชี FCD ของลูกค้าในและต่างประเทศได้ กรณี NR จองซื้อเป็นเงินบาท ให้ บล. คืนเงินค่าจองซื้อให้แก่ NR เป็นเงินบาท

6. การทำ Currency Hedge ของลูกค้าที่ลงทุน



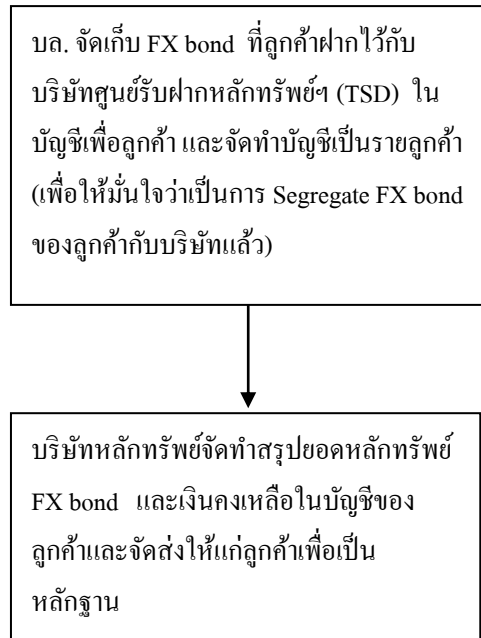
7. การดูแลทรัพย์สิน และการรายงานสถานะการลงทุนของลูกค้า

7.1 กรณีหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ



* ภายใต้บัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศของ บล. เพื่อลูกค้า

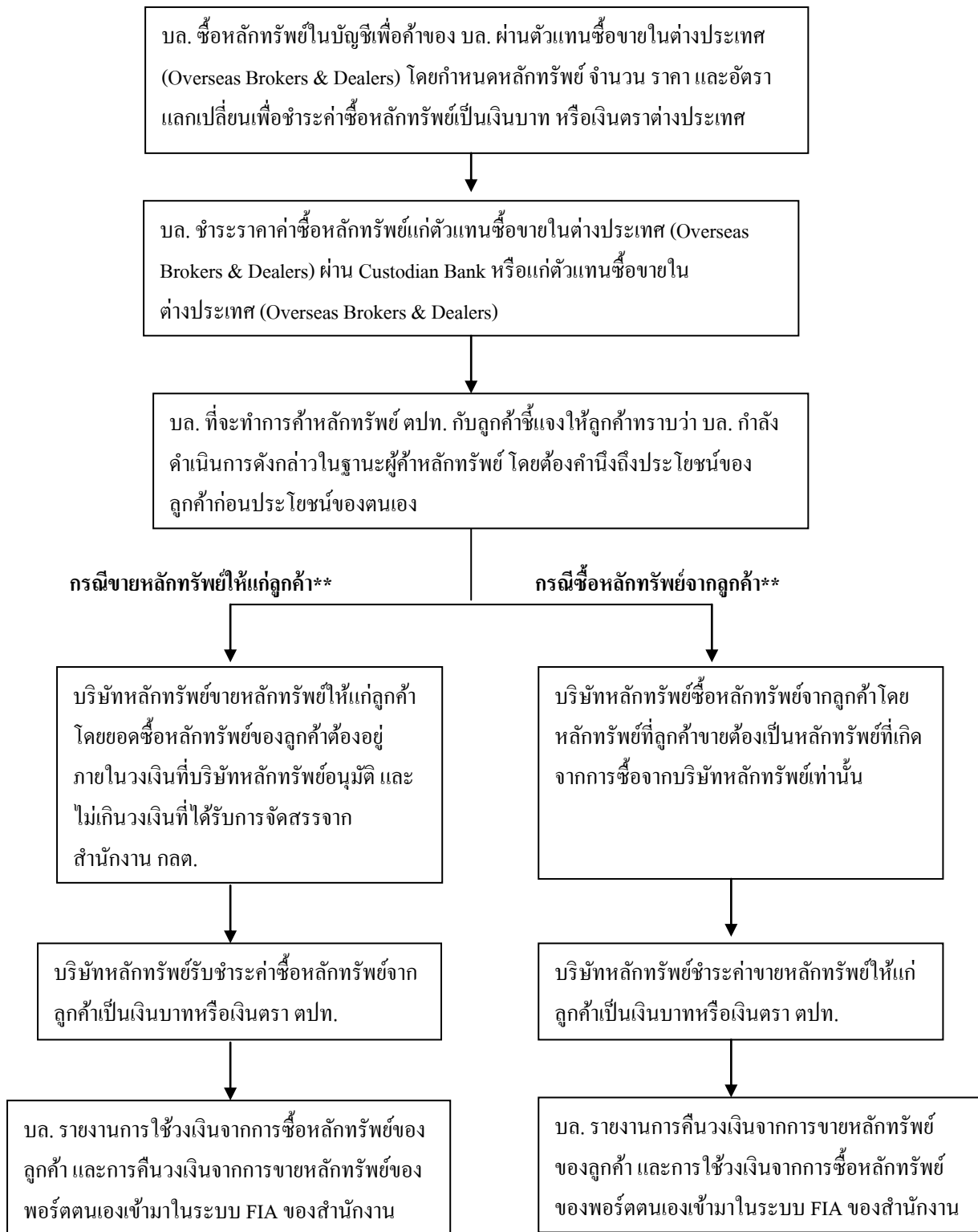
7.2 กรณีหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศที่เสนอขายในประเทศไทย



* กรณีลูกค้าของ บล. เป็นกองทุนส่วนบุคคล (PF) ให้ บลจ./ บล. ในฐานะบริษัทจัดการต้องจัดให้มีผู้รับฝาก
หลักทรัพย์สันทตามแนวทางที่สำนักงานกำหนด

8. การลงทุนหลักทรัพย์เพื่อค่าของบริษัทหลักทรัพย์

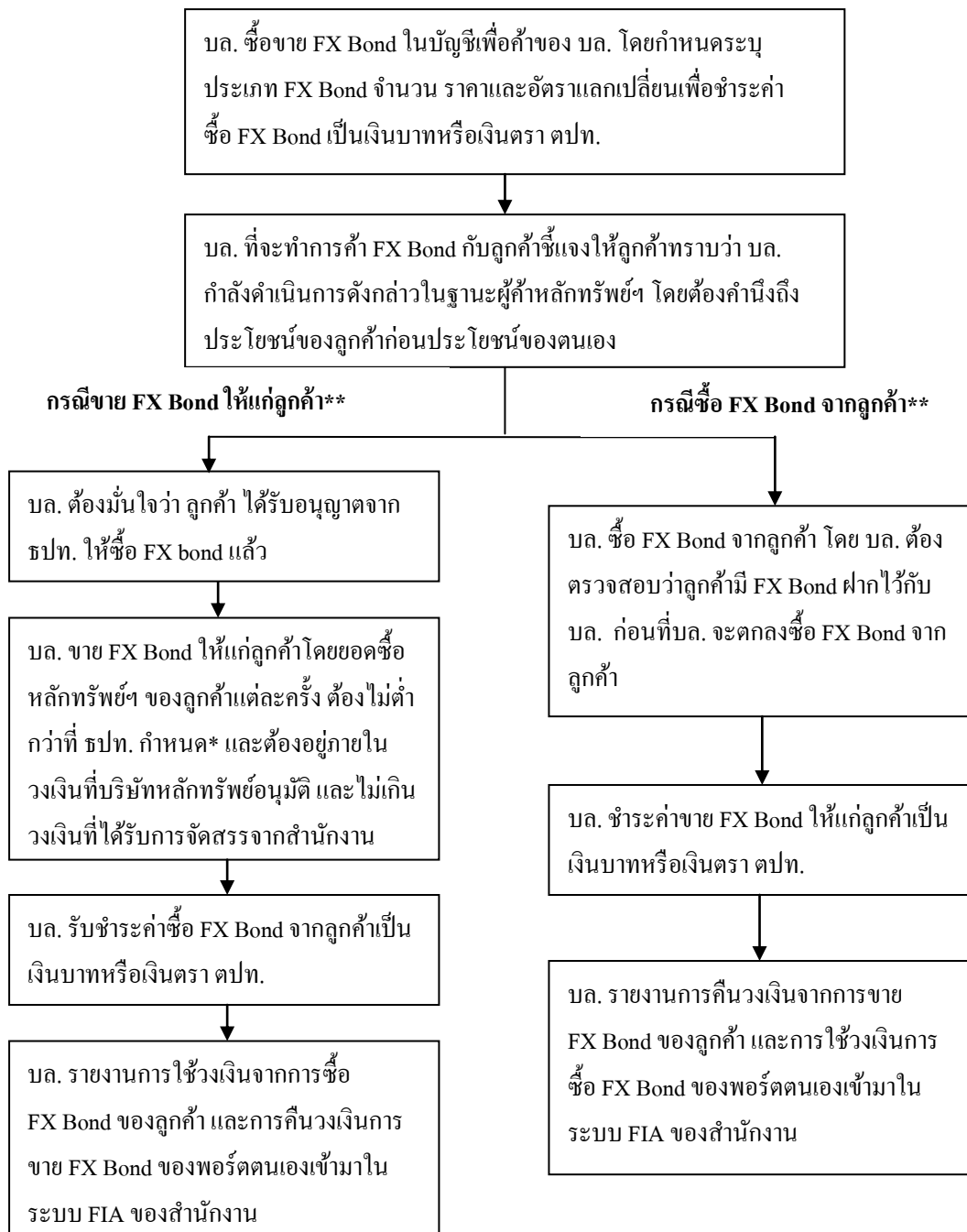
8.1 กรณีหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ



** ตามกรณีดังกล่าวลูกค้าจะสามารถซื้อและขายหลักทรัพย์กับ บล. ที่ตนมีบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ ตปท. อยู่ด้วยเท่านั้น ห้ามทำการซื้อขายกับผู้ลงทุนสถาบันตามที่ตปท. กำหนด เช่น กบข. บริษัทประกันภัย ฯลฯ

หมายเหตุ บริษัทต้องนำวิธีปฏิบัติตามแนวทางของการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์มาใช้โดยอนุโลม เช่น การเปิดบัญชี การเปิดเผยความเสี่ยง การขออนุมัติวงเงินผ่านระบบ FIA เป็นต้น

8.2 กรณีหุ้นกู้สกุลเงินต่างประเทศ (FX bond) ที่เสนอขายในไทย



* กรณีลูกค้าต้องการซื้อ บล. ต้องตรวจสอบว่าเป็นไปตามเงื่อนไขของการซื้อ FX bond ตามที่กำหนดในหนังสือชี้ชวนตอนเสนอขาย เช่น ประเภทผู้ลงทุนที่ซื้อได้ มูลค่าขั้นต่ำ (เช่น หนังสือชี้ชวนอาจมีการกำหนดให้ลูกค้าทั่วไปซื้อแต่ละครั้งไม่ต่ำกว่า 100,000 เหรียญสหรัฐ)

** ตามกรณีดังกล่าวลูกค้าจะสามารถซื้อและขายหลักทรัพย์กับ บล. ที่ตนมีบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ ตปท. ที่ครอบคลุมถึง FX Bond อยู่ด้วยเท่านั้น ห้ามทำการซื้อขายกับผู้ลงทุนสถาบันตามที่รปท. กำหนด เช่น กบข. บริษัทประกันฯ ฯลฯ

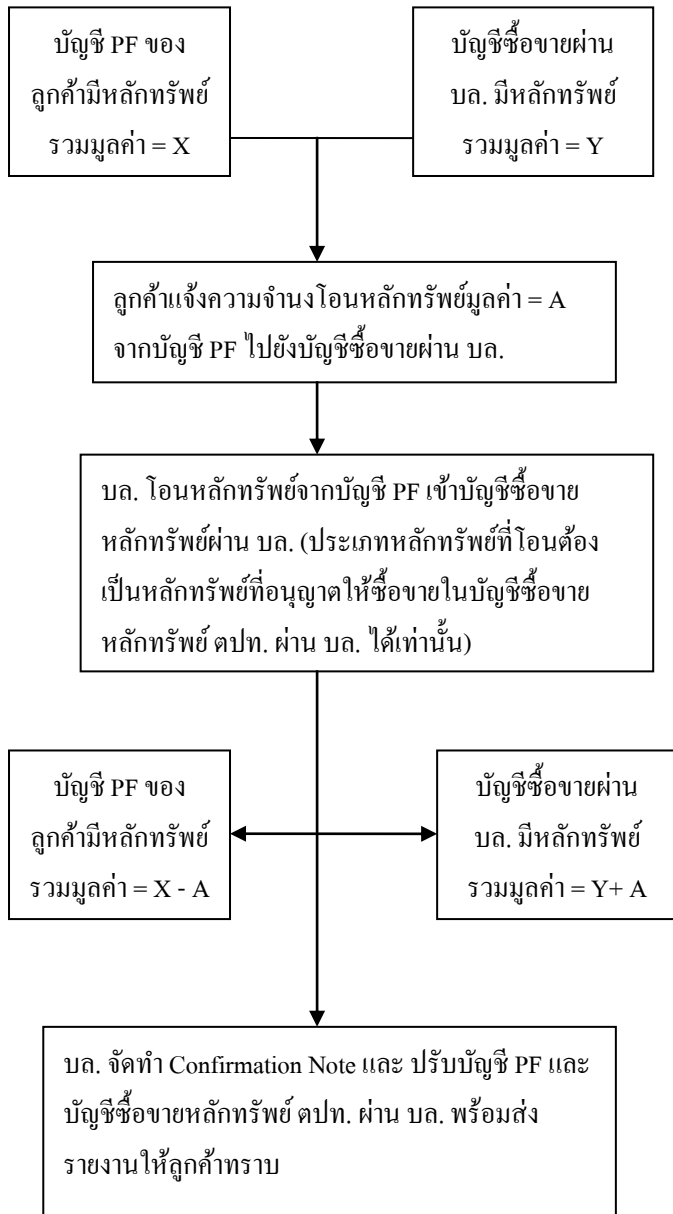
หมายเหตุ บริษัทต้องนำวิธีปฏิบัติตามแนวทางของการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์มาใช้โดยอนุโลม เช่น การเปิดเผยความเสี่ยง การขออนุมัติวงเงินผ่านระบบ FIA เป็นต้น

9. การย้ายพอร์ตลงทุน

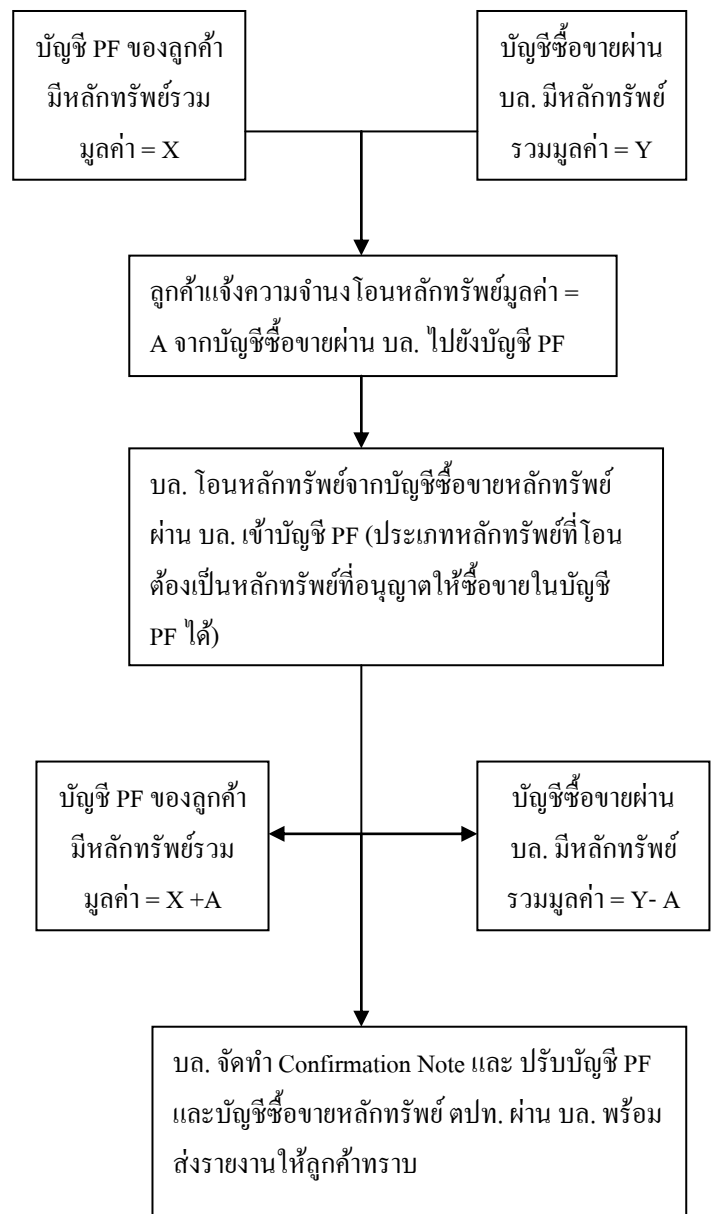
9.1 การย้ายพอร์ตลงทุนระหว่างบัญชีกองทุนส่วนบุคคล (Private Fund: PF) กับบัญชีซื้อขายผ่าน บล.

9.1.1 กรณีภายในบริษัทเดียวกัน

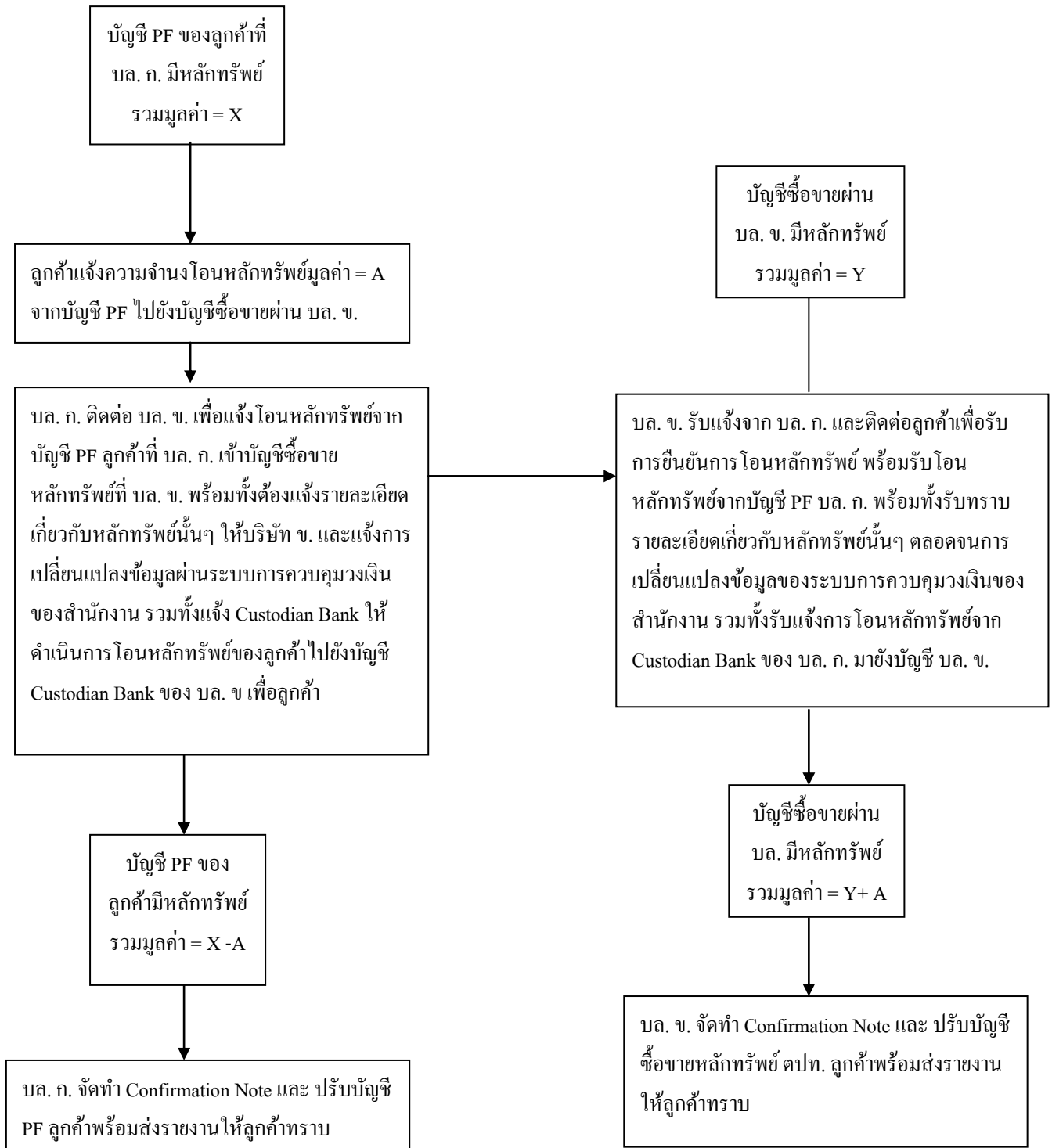
ก) ย้ายหลักทรัพย์จาก PF ไป บัญชีซื้อขายผ่าน บล.



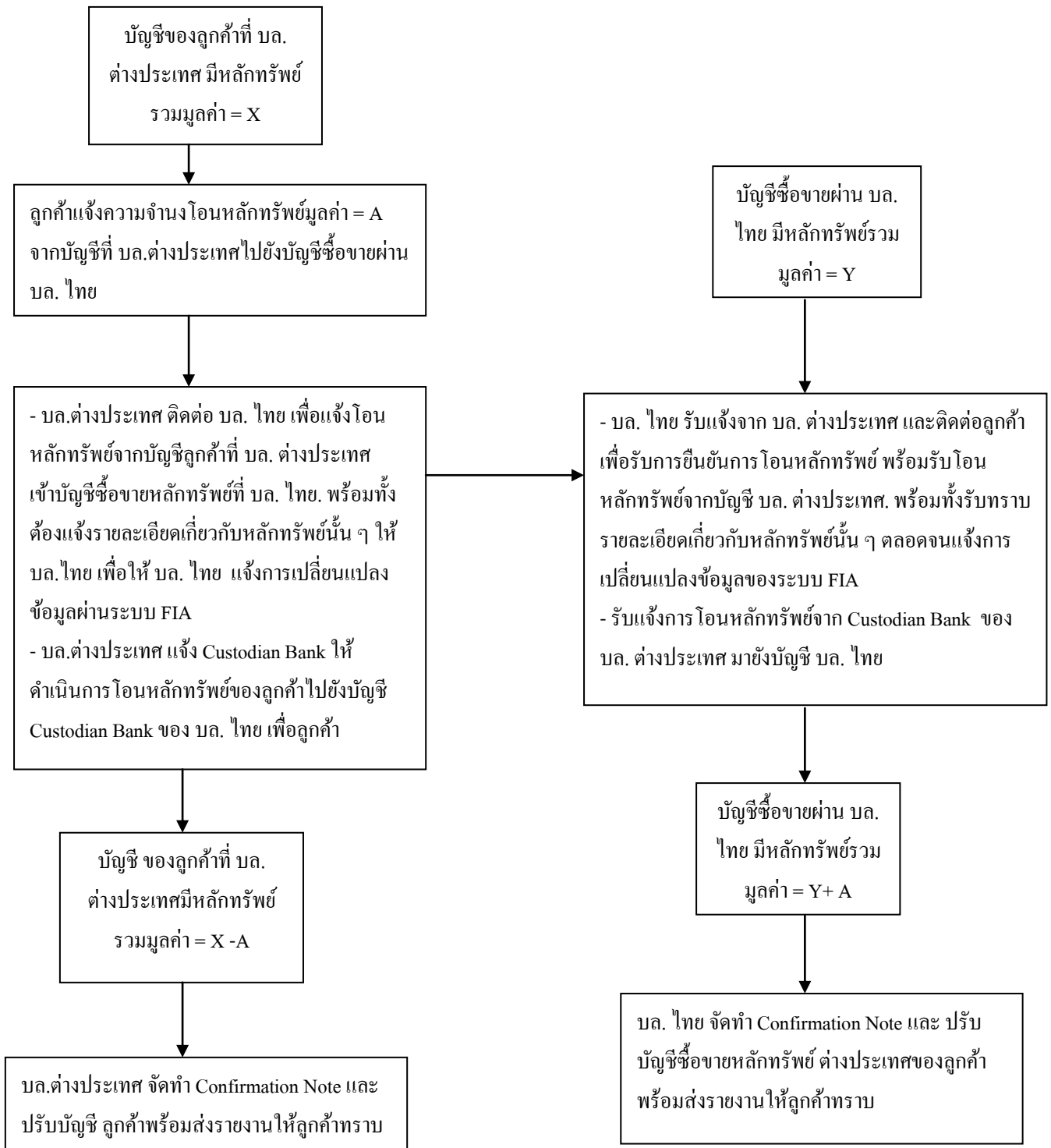
ข) ย้ายหลักทรัพย์จาก บัญชีซื้อขายผ่าน บล. ไป PF



9.1.2 กรณีต่างบริษัทกัน



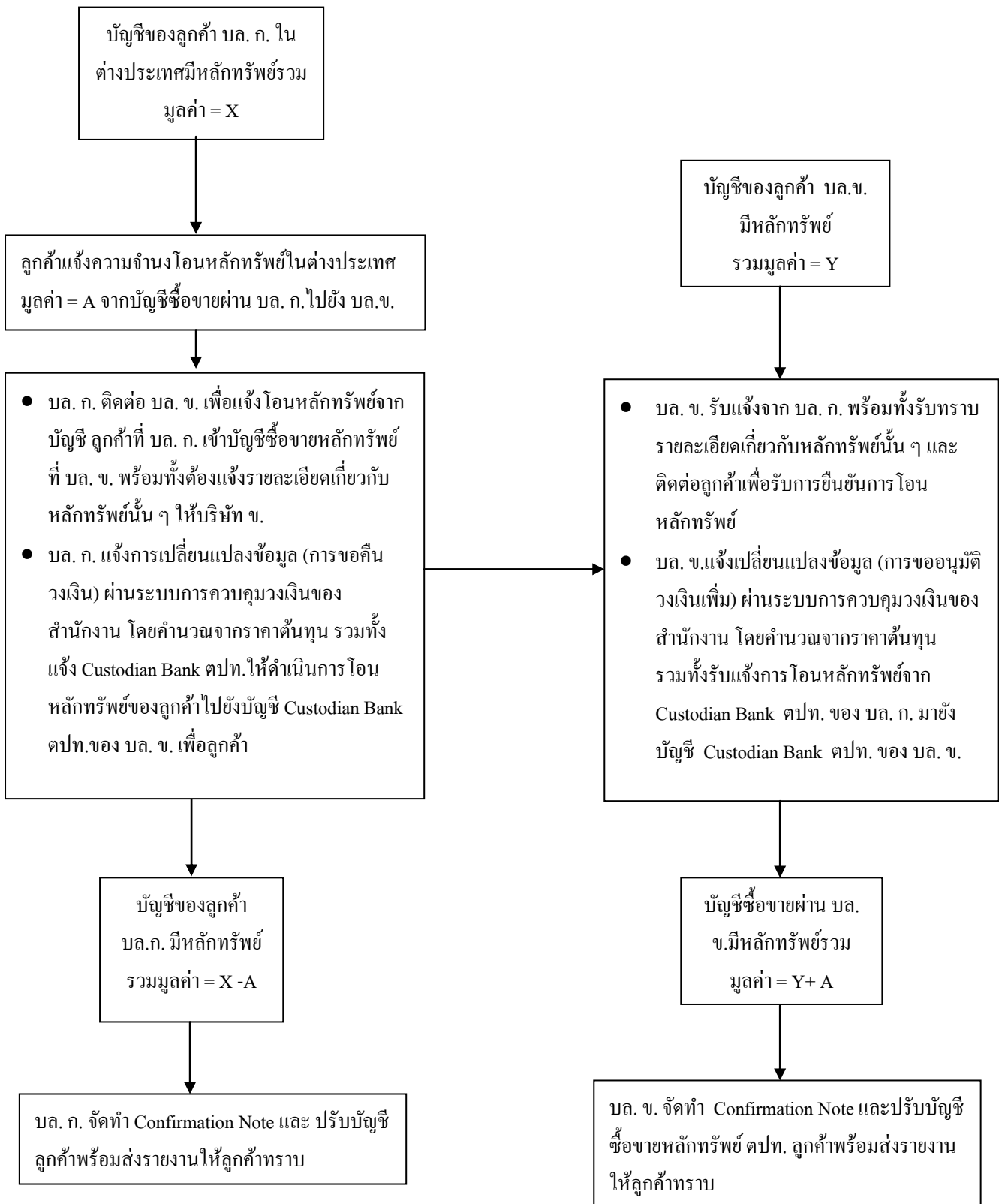
9.2 การย้ายพอร์ตลงทุนจากบัญชีของลูกค้าที่ต่างประเทศมายังบัญชีซื้อขายผ่านบริษัทหลักทรัพย์



9.3 การย้ายพอร์ตลงทุนระหว่าง บล. เฉพาะกรณีหุ้นกู้สกุลเงินตราต่างประเทศ (FX bond) ที่เสนอขายในไทย



9.4 การย้ายพอร์ตลงทุนระหว่าง บล. กรณีลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ



10. การจัดทำรายงานข้อมูลต่อหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง

บริษัทหลักทรัพย์ต้องดำเนินการรายงานข้อมูลให้เป็นไปตามข้อกำหนดของสำนักงาน ก.ล.ต. หน่วยงานที่เกี่ยวข้อง เช่น

1. รายงานการใช้จ่ายเงินการซื้อหลักทรัพย์ การคืนวงเงินจากการขายหลักทรัพย์ และการยกเลิกวงเงินกรณีที่ถูกค้าไม่สามารถชำระเงินค่าซื้อหลักทรัพย์ภายในเวลาที่กำหนด หรือไม่ต้องการใช้จ่ายเงินดังกล่าว เข้ามาในระบบ Foreign Investment Allotment ของสำนักงาน
2. จัดส่งรายงานยอดคงค้างการลงทุนในต่างประเทศของพอร์ต บล. และลูกค้าของ บล. แยกตามประเภทหลักทรัพย์ ณ สิ้นวันทำการสุดท้ายของเดือนให้แก่ธนาคารแห่งประเทศไทย และสำนักงาน