

10 กรกฎาคม 2555

เรียน กรรมการผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ทุกบริษัท

ตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทุกแห่ง

ที่ กตต.ตธ. (ว) 10 /2555 เรื่อง การจัดส่งรายงานเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
(แบบ บ.ล.4/1) เป็นรายวัน เมื่อเป็นไปตามเงื่อนไขที่กำหนด

ตามที่ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิกำหนดว่า เมื่อเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (“NC”) หรืออัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (“NCR”) เท่ากับหรือน้อยกว่า 1.5 เท่าของเกณฑ์ขั้นต่ำ (เป็นระดับ early warning เท่ากับ 10.5% หรือ 37.5 ล้านบาท กรณีประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ หรือ 22.5 ล้านบาท กรณีประกอบธุรกิจหลักทรัพย์หรือเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างเดียว) ให้บริษัทหลักทรัพย์และตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (“บริษัท”) จัดส่งแบบ บ.ล.4/1 ต่อสำนักงานเป็นรายวันจนกว่าจะสามารถดำรง NCR และ NC ได้มากกว่าระดับ early warning เป็นเวลาไม่น้อยกว่า 2 วันทำการติดต่อกัน นั้น

สำนักงานขอเรียนว่า จากการติดตามสถานะ NC หรือ NCR ของบริษัทอย่างต่อเนื่องจากรายงานสถานะ บล. ฉบับย่อ ที่บริษัทจัดส่งให้สำนักงานเป็นรายวัน สำนักงานพบว่า ในช่วงเวลาที่ผ่านมาดัชนีราคาหุ้นตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“SET Index”) มีความผันผวนมาก เช่น กรณีวิกฤตเศรษฐกิจในยุโรปที่ผ่านมา เป็นต้น ระดับ NC และ NCR ของบริษัทจะลดลงมาอย่างรวดเร็วเพียงแค่วันหนึ่งจนข้ามระดับ early warning ที่กล่าวข้างต้นซึ่งจะทำให้เกิดความเสี่ยงที่บริษัทอาจไม่สามารถดำรง NC หรือ NCR ให้เป็นไปตามเกณฑ์ที่สำนักงานกำหนด และอาจกระทบต่อความเสี่ยงของระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์โดยรวมได้ ดังนั้น เพื่อประโยชน์ในการติดตามความเสี่ยงในเรื่องฐานะ NC หรือ NCR และการดำเนินงานของบริษัทให้ทันต่อเหตุการณ์มากยิ่งขึ้น สำนักงานจึงขอให้บริษัทที่มี NC หรือ NCR เมื่อสิ้นวันทำการ (วันที่ T) ลดลงมาอยู่ที่ระดับเท่ากับหรือน้อยกว่า 3 เท่าของเกณฑ์ขั้นต่ำที่สำนักงานกำหนด (เท่ากับ 21% หรือ 75 ล้านบาท กรณีประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ หรือ 45 ล้านบาท กรณีประกอบธุรกิจหลักทรัพย์หรือเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างเดียว)

จัดส่งแบบ บ.ล.4/1 เป็นรายวันต่อสำนักงานภายในวันทำการถัดไป (T+1) จนกว่า NC หรือ NCR จะเพิ่มขึ้นมากกว่า 3 เท่าของเกณฑ์ขั้นต่ำ เป็นเวลาติดต่อกันอย่างน้อย 2 วันทำการ โดยให้จัดส่งผ่านทาง seccom@sec.or.th ตั้งแต่วันที่ในหนังสือฉบับนี้เป็นต้นไป โดยในระหว่างที่บริษัทจัดส่งแบบ บ.ล.4/1 ตามข้อกำหนดข้างต้น นั้น บริษัทไม่ต้องจัดส่งรายงานสถานะ บล. ฉบับย่อ ต่อสำนักงาน ทั้งนี้ สำนักงานอยู่ระหว่างแก้ประกาศที่เกี่ยวข้องเพื่อให้สอดคล้องกับแนวทางดำเนินการที่กำหนด

ในการนี้ สำนักงานขอเสนอชื่อเจ้าหน้าที่สำหรับการติดต่อสอบถาม คือ นายศุภชัย สิริวิทยาปกรณ์ โทรศัพท์ 0-2695-9558 และนางสาวเพ็ญญา ปัตตนาภรณ์ โทรศัพท์ 0-2695-9551

จึงเรียนมาเพื่อ โปรดดำเนินการต่อไป

ขอแสดงความนับถือ



(นายวรพล โสคติยานุรักษ์)

เลขาธิการ

ฝ่ายวิเคราะห์และตรวจสอบธุรกิจหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 0-2695-9551

โทรสาร 0-2695-9760