

๒๑ สิงหาคม 2557

เรียน ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ทุกแห่ง

ผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทุกแห่ง

นายกสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

ที่ กสท.กร. (ว) 25 /2557 เรื่อง ขอความร่วมมือในการรายงานข้อมูลเพื่อประกอบ
การติดตามความเสี่ยงของบริษัทหลักทรัพย์และผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ด้วยสถานการณ์เศรษฐกิจ การเมือง และภัยพิบัติทางธรรมชาติในช่วงที่ผ่านมา มีแนวโน้มที่จะปรากฏบ่อยครั้งขึ้น ซึ่งส่งผลให้ตลาดทุนมีความผันผวนมากขึ้น และอาจส่งผลกระทบต่อการทำงานของบริษัทท่านอย่างมีนัยสำคัญได้ โดยที่ผ่านมา เมื่อมีเหตุการณ์ที่มีนัยสำคัญปรากฏขึ้น สำนักงานใช้วิธีติดต่อสอบถามข้อมูลการดำเนินงานของบริษัทท่านเป็นครั้ง ๆ ไป เพื่อให้มีข้อมูลในการประเมินผลกระทบและการติดตามความเสี่ยงได้อย่างทันเหตุการณ์ ซึ่งที่ผ่านมาสำนักงานได้รับความร่วมมือจากบริษัทท่านด้วยดีตลอดมา อย่างไรก็ตาม การดำเนินการในลักษณะดังกล่าวอาจทำให้บริษัทท่านต้องดำเนินการจัดทำข้อมูลตามที่สำนักงานร้องขอ โดยไม่ได้มีระบบหรือขั้นตอนการดำเนินการที่จัดเตรียมไว้ล่วงหน้า ซึ่งอาจทำให้เกิดความไม่สะดวกหรือจัดทำข้อมูลไม่ทันกำหนดเวลาส่งได้

ดังนั้น เพื่อให้การประสานงานระหว่างบริษัทท่านและสำนักงานเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ ในขณะเดียวกันจะช่วยเป็นการเพิ่มประสิทธิภาพของสำนักงานในการประเมินผลกระทบและการติดตามความเสี่ยงได้อย่างทันเหตุการณ์ สำนักงานจึงได้กำหนดเหตุการณ์ที่มีนัยสำคัญ พร้อมเงื่อนไขต่าง ๆ และแบบรายงาน เพื่อให้บริษัทท่านทราบข้อมูลที่สำนักงานต้องการ และจัดเตรียมระบบหรือขั้นตอนการปฏิบัติงานให้สามารถรายงานข้อมูลดังกล่าวได้ภายในเวลาที่กำหนด โดยมีรายละเอียดตามเอกสารที่แนบมาพร้อมนี้

สำนักงานจึงขอความร่วมมือจากบริษัทท่าน โปรดจัดส่งแบบรายงานการติดตามสถานะของบริษัทเมื่อเกิดเหตุการณ์ที่มีนัยสำคัญ ตามเงื่อนไขที่ได้ระบุไว้ในรูปแบบไฟล์ข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ มาที่ e-mail : insec@sec.or.th ตามกำหนดเวลาที่ระบุไว้ โดยเริ่มตั้งแต่วันที่ 1 กันยายน 2557 เป็นต้นไป

อนึ่ง สำหรับบริษัทที่มีข้อจำกัดในเรื่องระบบปฏิบัติการที่ต้องประมวลผลสิ้นวันก่อนได้ข้อมูลที่ครบถ้วน ถูกต้อง ให้บริษัททำนรายงานข้อมูลประมาณการได้ ทั้งนี้ สำนักงานขอเสนอชื่อเจ้าหน้าที่ในการติดต่อ สอบถาม คือ นายพัฒนะ สุชะธรรมโม โทรศัพท์ 0-2263-6257

จึงเรียนมาเพื่อโปรดดำเนินการ

ขอแสดงความนับถือ



(นายวรพล โสคติยานุรักษ์)

เลขาธิการ

สิ่งที่ส่งมาด้วย รูปแบบข้อมูล เงื่อนไขการจัดทำ และแบบรายงานการติดตามสถานะของบริษัทเมื่อเกิด เหตุการณ์ที่มีนัยสำคัญสำหรับบริษัทหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ฝ่ายกำกับและพัฒนาธุรกิจหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 0-2263-6257

โทรสาร 0-2263-6487

**รูปแบบ และเงื่อนไขการจัดทำข้อมูลเพื่อประกอบการติดตามความเสี่ยง
ของบริษัทหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า**

เงื่อนไข	ข้อมูลที่รายงาน	กำหนดส่ง
1. SET Index เปลี่ยนแปลง $\geq 3\%$ ในระหว่างวัน หรือ ณ สิ้นวัน	(1) บัญชีเครดิตบาลานซ์ - จำนวนลูกค้ำที่ถูก call / force และยอดเงินหลักประกันเรียกเพิ่ม - จำนวนลูกค้ำที่ถูก force ปิดสถานะและเป็นหนี้บริษัท และยอดหนี้ (2) บัญชีเงินสด - จำนวนลูกค้ำที่ไม่ชำระค่าซื้อหลักทรัพย์ภายใน t+3 และเป็นหนี้บริษัท (3) ผลขาดทุนของบัญชีเพื่อบริษัท	ภายใน 18.00 น. ของวันที่ t
2. ราคาสินค้าในตลาด TFEX ดังต่อไปนี้ เปลี่ยนแปลง \geq ระดับ margin call ¹ - SET50 Futures - Gold Futures	(1) จำนวนลูกค้ำที่ถูก call / force และยอดเงินหลักประกันเรียกเพิ่ม (2) จำนวนลูกค้ำที่ถูก force ปิดสถานะและเป็นหนี้บริษัท และยอดหนี้ (3) ผลขาดทุนของบัญชีเพื่อบริษัท	ภายใน 18.00 น. ของวันที่ t
3. ราคาหุ้นรายตัวลดลง $\geq 10\%$ โดยหุ้นดังกล่าว มีมูลค่าเป็นหลักประกัน ในบัญชีเครดิตบาลานซ์ $\geq 5\%$ ของมูลค่า หลักประกันทั้งหมด	(1) ชื่อหุ้น (2) จำนวนลูกค้ำ (ราย) (3) ปริมาณหุ้นที่เป็นหลักประกัน (4) ราคาหุ้น ณ สิ้นวัน (5) มูลค่าหลักประกันรวม (6) สัดส่วนของมูลค่าหลักประกันต่อมูลค่าหลักประกันรวม (7) จำนวนลูกค้ำที่ถูก call / force และยอดเงินหลักประกันเรียกเพิ่ม (8) จำนวนลูกค้ำที่ถูก force ปิดสถานะและเป็นหนี้บริษัท และยอดหนี้	ภายใน 18.00 น. ของวันที่ t

ข้อมูลที่ให้รายงานเป็นข้อมูล ณ เวลา 17.00 น.

¹ ระดับ margin call = (initial margin – maintenance margin) / contract size โดยเป็นไปตามที่ TFEX กำหนดสำหรับลูกค้ำทั่วไป เช่น initial margin ของ SET50 Futures เท่ากับ 85,500 บาท และ maintenance margin เท่ากับ 59,850 บาท contract size = 1,000 เท่าคือสัญญา การเปลี่ยนแปลงของราคา SET50 Futures ที่จะทำให้เกิดระดับเรียกหลักประกันรักษาสภาพ = (85,500 – 59,850) / 1,000 = 25.65 จุด

**แบบรายงานการติดตามสถานะของบริษัทเมื่อเกิดเหตุการณ์ที่มีนัยสำคัญ
สำหรับบริษัทหลักทรัพย์ และผู้ประกอบการสัญญาซื้อขายล่วงหน้า**

1. เงื่อนไขที่ต้องรายงานสถานะการประกอบธุรกิจ

(1) SET Index เปลี่ยนแปลงระหว่างวัน $\geq \pm 3\%$

(2) SET50 Index Futures หรือ Gold Futures เปลี่ยนแปลงจนแตะระดับ margin call*

* การเปลี่ยนแปลงของราคาสินค้าที่ทำให้แตะระดับ margin call เช่น สัญญา futures คือ $(\text{initial margin} - \text{maintenance margin}) / \text{contract size}$ ทั้งนี้ อัตรา initial margin และ maintenance margin ให้เป็นไปตามที่กรมผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดให้กับนักลงทุนรายย่อย

ตัวอย่าง initial margin ของ 50 baht gold futures เท่ากับ 38,000 บาท และ maintenance margin เท่ากับ 26,600 บาท

การเปลี่ยนแปลงของราคา gold fututres ที่ทำให้แตะระดับ margin call = $(38,000 - 26,600) / 50 = 228$ บาทต่อทองคำ 1 บาท

(3) ราคาก่อนรายตัวลดลงเกิน 10% และหุ้นดังกล่าวมีมูลค่าเป็นหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้น เกิน 5% ของมูลค่าหลักประกันรวม

2. การรายงาน (ข้อมูล ณ 17.00 น.)

ชื่อบริษัท	
ข้อมูล ณ วันที่	
ประเภทข้อมูล	(โปรดระบุ) ประมวลผลแล้ว หรือ ประมาณการ

(1) บัญชีมาร์จิ้นและบัญชีเงินสด

บัญชีมาร์จิ้น	จำนวนราย	จำนวนเงินที่ต้องเรียกเพิ่ม (ลบ.)	มูลค่าหนี้ที่หลักประกันไม่คุ้มหนี้ (ลบ.)
call margin			
force sell/buy			

บัญชีเงินสด	จำนวนราย	จำนวนเงินที่ลูกค้าเป็นหนี้บริษัท (ลบ.)
ลูกค้าผิดนัดชำระหนี้		

(2) บัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	จำนวนราย	จำนวนเงินที่ต้องเรียกเพิ่ม (ลบ.)	มูลค่าหนี้ที่หลักประกันไม่คุ้มหนี้ (ลบ.)
call margin			
force sell/buy			

(3) บัญชีเพื่อบริษัท

บัญชีเพื่อบริษัท ขาดทุน	มูลค่า (ลบ.)
Unrealized loss	
Realized loss	

(4) หุ้นรายตัวที่ราคาตกลงเกิน 10% และหุ้นดังกล่าวมีมูลค่าเป็นหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้น เกิน 5% ของมูลค่าหลักประกันรวม

ชื่อย่อหุ้น	จำนวนลูกค้า	ปริมาณหุ้น	มูลค่ารวม (ลบ.)	สัดส่วนของมูลค่าหลักประกันต่อมูลค่าหลักประกันรวม (ลบ.)	ราคาต่อหุ้น (บาท)

หมายเหตุ : ให้ใช้ข้อมูลของวันทำการก่อนหน้า สำหรับ จำนวนลูกค้า ปริมาณหุ้น และสัดส่วนของมูลค่าหลักประกันต่อมูลค่าหลักประกันรวม สำหรับราคา ให้ใช้ราคา ณ สิ้นวัน

contact person	ชื่อ	ตำแหน่ง	เบอร์ติดต่อ