

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สช. 84/2558

เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับผู้ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขาย

สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ไม่สามารถ

ดำรงฐานะทางการเงินได้

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 50 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
พ.ศ. 2546 สำนักงาน ก.ล.ต. ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“ตัวแทนซื้อขายสัญญา” หมายความว่า ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจสัญญา
ซื้อขายล่วงหน้าประเภทการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งมีหน้าที่ดำรงฐานะทางการเงิน
ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน

“ประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน” หมายความว่า ประกาศคณะกรรมการ
กำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงฐานะทางการเงินของผู้ได้รับใบอนุญาต
เป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ข้อ 2 ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ได้ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน ปฏิบัติดังต่อไปนี้

(1) ยื่นแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อสำนักงาน ก.ล.ต.
ภายในสามสิบวันนับแต่วันแรกที่ตัวแทนซื้อขายสัญญาไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้
เว้นแต่ก่อนครบกำหนดระยะเวลาดังกล่าวสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศ
การดำรงฐานะทางการเงินไม่น้อยกว่าเจ็ดวันทำการติดต่อกัน

(2) ดำเนินการตามแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ที่ยื่นต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ตาม (1) เพื่อให้สามารถกลับมาดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้
ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน ภายในระยะเวลาที่กำหนดในแผนดังกล่าวซึ่งต้องไม่เกิน
เก้าสิบวันนับแต่วันแรกที่ตัวแทนซื้อขายสัญญาไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้

ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควร ตัวแทนซื้อขายสัญญาอาจขอผ่อนผันระยะเวลา
ดังกล่าวต่อสำนักงาน ก.ล.ต. โดยให้ยื่นคำขอเป็นหนังสือพร้อมแสดงเหตุผลล่วงหน้าไม่น้อยกว่า
สิบวันทำการก่อนครบกำหนดระยะเวลาตามวรรคหนึ่ง

ข้อ 3 ห้ามมิให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ดำเนินการดังต่อไปนี้ จนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงินและได้รับแจ้งจากสำนักงาน ก.ล.ต. เป็นหนังสือให้ประกอบธุรกิจได้ตามปกติ

- (1) การเพิ่มวงเงินซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่ลูกค้า
 - (2) การให้บริการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยไม่มีการวางหลักประกันขั้นต้น (initial margin) เต็มจำนวนก่อนส่งคำสั่งซื้อสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่ลูกค้า
 - (3) การให้บริการหรือการเปิดบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแก่ลูกค้ารายใหม่
 - (4) การเพิ่มเงินลงทุนของบริษัท (portfolio) เว้นแต่เป็นการลงทุนดังนี้
 - (ก) การลงทุนในเงินฝาก หรือหน่วยลงทุนกองทุนรวมตลาดเงินในประเทศ
 - (ข) การลงทุนเพื่อป้องกันความเสี่ยงจากเงินลงทุนหรือภาระผูกพันของบริษัท
- ที่มีอยู่ก่อนหรือในวันแรกที่ตัวแทนซื้อขายสัญญาไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน

(ค) การลงทุนเนื่องจากมีภาระผูกพันในฐานะเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งตัวแทนซื้อขายสัญญาได้ทำการป้องกันความเสี่ยงจากการลงทุนดังกล่าวไว้แล้วอย่างเต็มจำนวน

(ง) การลงทุนเนื่องจากเกิดความผิดพลาดในการส่งคำสั่งซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่ลูกค้า (error port)

(5) การสลักหลัง รับอาวัล หรือให้การรับรองตัวเงิน หรือการเป็นผู้ค้ำประกัน ในนิติกรรมใด ๆ ที่เกี่ยวเนื่องในการประกอบธุรกิจของตัวแทนซื้อขายสัญญาให้แก่ลูกค้า เว้นแต่ลูกค้าได้วางเงินสดเป็นหลักประกันเต็มจำนวนไว้กับตัวแทนซื้อขายสัญญา

(6) การกระทำอื่นใดที่มีลักษณะเป็นการเพิ่มความเสี่ยงต่อฐานะการเงิน การดำเนินงาน หรือการปฏิบัติตามข้อตกลงกับลูกค้า ทั้งนี้ ตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด

ข้อ 4 ในกรณีที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้ ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน ดำเนินการตามที่กำหนดในข้อ 5

- (1) ไม่สามารถยื่นแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ตามระยะเวลาที่กำหนดในข้อ 2(1) หรือข้อ 2 วรรคสอง แล้วแต่กรณี
- (2) ไม่สามารถแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามแผนและระยะเวลาที่กำหนดตามข้อ 2(2) หรือข้อ 2 วรรคสอง แล้วแต่กรณี
- (3) มีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่ำกว่าศูนย์ติดต่อกันเกินห้าวันทำการ
- (4) มีการผิคนัดชำระหนี้ต่อสำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือต่อลูกค้า

ข้อ 5 ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งตามข้อ 4 ดำเนินการดังต่อไปนี้

- (1) ระวังการดำเนินธุรกิจจนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงินและได้รับแจ้งจากสำนักงาน ก.ล.ต. เป็นหนังสือให้ดำเนินธุรกิจได้ตามปกติ ทั้งนี้ ไม่รวมถึงการป้องกันความเสี่ยงโดยรวมในเงินลงทุนของบริษัทหรือการดำเนินการตามภาระผูกพันที่ค้างอยู่
- (2) ล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีไว้เพื่อตนเอง เว้นแต่เป็นกรณีใดกรณีหนึ่งดังนี้
 - (ก) สัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าวมีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ป้องกันความเสี่ยงจากเงินลงทุนหรือภาระผูกพันของตัวแทนซื้อขายสัญญา
 - (ข) การมีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้านั้นไม่ทำให้ตัวแทนซื้อขายสัญญา มีภาระผูกพันหรือก่อหนี้เพิ่มเติมในภายหลัง
- (3) โอนทรัพย์สินและฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าไปยังตัวแทนซื้อขายสัญญารายอื่นตามที่ลูกค้าแจ้งความประสงค์ไว้ ให้แล้วเสร็จภายในสิบวันทำการนับแต่วันที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งตามข้อ 4 เว้นแต่จะได้รับการผ่อนผันระยะเวลาจากสำนักงาน ก.ล.ต. เนื่องจากมีเหตุจำเป็นและสมควร ทั้งนี้ หากมีค่าใช้จ่ายเกิดขึ้นจากการดำเนินการดังกล่าว ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาเป็นผู้รับผิดชอบค่าใช้จ่ายนั้น
- (4) มีหนังสือแจ้งให้ลูกค้าทราบถึงการดำเนินการตาม (1) หรือ (3) แล้วแต่กรณี โดยไม่ชักช้า
- (5) กระทบการหรือลดวันการกระทำอื่นใดตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด เพื่อให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาสามารถกลับมาดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน

ข้อ 6 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 16 ธันวาคม พ.ศ. 2558 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 2 ธันวาคม พ.ศ. 2558

(นายรพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์