



## สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. 84 /2558

เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับผู้ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขาย

สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ไม่สามารถ

ดำรงฐานะทางการเงินได้

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

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“ตัวแทนซื้อขายสัญญา” หมายความว่า ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งมีหน้าที่ดำรงฐานะทางการเงินตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน

“ประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน” หมายความว่า ประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงฐานะทางการเงินของผู้ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ข้อ 2 ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน ปฏิบัติดังต่อไปนี้

(1) ยื่นแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายในสามสิบวันนับแต่วันแรกที่ตัวแทนซื้อขายสัญญาไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ เว้นแต่ก่อนครบกำหนดระยะเวลาดังกล่าวสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงินไม่น้อยกว่าเจ็ดวันทำการติดต่อกัน

(2) ดำเนินการตามแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ได้ยื่นต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ตาม (1) เพื่อให้สามารถกลับมาดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน ภายในระยะเวลาที่กำหนดในแผนดังกล่าวซึ่งต้องไม่เกินเก้าสิบวันนับแต่วันแรกที่ตัวแทนซื้อขายสัญญาไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้

ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควร ตัวแทนซื้อขายสัญญาอาจขอผ่อนผันระยะเวลาดังกล่าวต่อสำนักงาน ก.ล.ต. โดยให้ยื่นคำขอเป็นหนังสือพร้อมแสดงเหตุผลล่วงหน้าไม่น้อยกว่าสิบวันทำการก่อนครบกำหนดระยะเวลาตามวรรคหนึ่ง

ข้อ 3 ห้ามมิให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตาม  
 ดำเนินการดังต่อไปนี้ จนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงฐานะ  
 ทางการเงินและได้รับแจ้งจากสำนักงาน ก.ล.ต. เป็นหนังสือให้ประกอบธุรกิจได้ตามปกติ

- (1) การเพิ่มวงเงินซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่ลูกค้า
- (2) การให้บริการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยไม่มีการวางหลักประกันขั้นต้น  
 (initial margin) เต็มจำนวนก่อนส่งคำสั่งซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่ลูกค้า
- (3) การให้บริการหรือการเปิดบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแก่ลูกค้ารายใหม่
- (4) การเพิ่มเงินลงทุนของบริษัท (portfolio) เว้นแต่เป็นการลงทุนดังนี้
  - (ก) การลงทุนในเงินฝาก หรือหน่วยลงทุนกองทุนรวมตลาดเงินในประเทศ
  - (ข) การลงทุนเพื่อป้องกันความเสี่ยงจากเงินลงทุนหรือภาระผูกพันของบริษัท  
 ที่มีอยู่ก่อนหรือในวันแรกที่ตัวแทนซื้อขายสัญญาไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ  
 ได้ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน

(ค) การลงทุนเนื่องจากมีภาระผูกพันในฐานะเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องในการ  
 ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งตัวแทนซื้อขายสัญญาได้ทำการป้องกันความเสี่ยงจากการลงทุน  
 ดังกล่าวไว้แล้วอย่างเต็มจำนวน

(ง) การลงทุนเนื่องจากเกิดความผิดพลาดในการส่งคำสั่งซื้อขายสัญญาซื้อขาย  
 ล่วงหน้าให้แก่ลูกค้า (error port)

(5) การสลักหลัง รับอาวัล หรือให้การรับรองตัวเงิน หรือการเป็นผู้ค้ำประกัน  
 ในนิติกรรมใดๆ ที่เกี่ยวเนื่องในการประกอบธุรกิจของตัวแทนซื้อขายสัญญาให้แก่ลูกค้า  
 เว้นแต่ลูกค้าได้วางเงินสดเป็นหลักประกันเต็มจำนวนไว้กับตัวแทนซื้อขายสัญญา

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

ข้อ 4 ในกรณีที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้ ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญา  
 ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงฐานะทางการเงิน ดำเนินการ  
 ตามที่กำหนดในข้อ 5

- (1) ไม่สามารถยื่นแผนการแก้ไขปัญหาคำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ  
 ต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ตามระยะเวลาที่กำหนดในข้อ 2(1) หรือข้อ 2 วรรคสอง แล้วแต่กรณี
- (2) ไม่สามารถแก้ไขปัญหาคำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามแผนและ  
 ระยะเวลาที่กำหนดตามข้อ 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

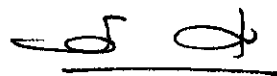
(3) โอนทรัพย์สินและฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าไปยังตัวแทนซื้อขายสัญญารายอื่นตามที่ลูกค้าแจ้งความประสงค์ไว้ ให้แล้วเสร็จภายในสิบวันทำการนับแต่วันที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งตามข้อ 4 เว้นแต่จะได้รับการผ่อนผันระยะเวลาจากสำนักงาน ก.ล.ต. เนื่องจากมีเหตุจำเป็นและสมควร ทั้งนี้ หากมีค่าใช้จ่ายเกิดขึ้นจากการดำเนินการดังกล่าว ให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาเป็นผู้รับผิดชอบค่าใช้จ่ายนั้น

(4) มีหนังสือแจ้งให้ลูกค้าทราบถึงการดำเนินการตาม (1) หรือ (3) แล้วแต่กรณี โดยไม่ชักช้า

(5) กระทำการหรืองดเว้นการกระทำอื่นใดตามที่สำนักงาน 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