



สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

ASSOCIATION OF THAI SECURITIES COMPANIES

ประกาศคณะกรรมการชมรมผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

เลขที่ FIC 1/2557

เรื่อง หลักเกณฑ์ และวิธีการเกี่ยวกับการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อบริษัท  
(Proprietary Trading)

ตามที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (สำนักงานฯ) ได้ออกประกาศสำนักงานฯที่ สธ. 34/2556 เรื่อง การจัดระบบงานในการลงทุนในหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสำหรับผู้ประกอบธุรกิจ โดยกำหนดให้ผู้ประกอบธุรกิจที่มีการลงทุนในหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเป็นทรัพย์สินของผู้ประกอบธุรกิจ (Proprietary trading) จัดให้มีระบบบริหารจัดการและระบบบริหารความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการลงทุนดังกล่าว โดยอย่างน้อยต้องดำเนินการให้เป็นไปตามแนวทางที่สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยกำหนดโดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานฯนั้น

ต่อมา สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ได้ออกประกาศสมาคมฯ เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการเกี่ยวกับการลงทุนในหลักทรัพย์เพื่อบริษัท (Proprietary Trading) เมื่อวันที่ 30 ตุลาคม 2556 เพื่อให้บริษัทสมาชิกถือเป็นแนวปฏิบัติตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน 2556 เป็นต้นไป เพื่อให้ตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีมาตรฐานการปฏิบัติงานรวมถึงการบริหารความเสี่ยงที่ดีจากการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อบริษัท รวมถึง เพื่อให้เป็นไปตามแนวทางและวัตถุประสงค์ของสำนักงานฯ ในการส่งเสริมให้ผู้ประกอบธุรกิจมีระบบบริหารจัดการและระบบบริหารความเสี่ยง คณะกรรมการชมรมผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจึงขอให้บริษัทสมาชิกปฏิบัติตามประกาศสมาคมฯ เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการเกี่ยวกับการลงทุนในหลักทรัพย์เพื่อบริษัท (Proprietary Trading) ที่ประกาศใช้ข้างต้นโดยพร้อมเพรียงกัน ทั้งนี้ ขอให้บริษัทสมาชิกเริ่มคำนวณจากมูลค่าการซื้อขายของเดือนมกราคม 2557 เป็นต้นไป

ประกาศนี้มีผลบังคับตั้งแต่วันที่ 13 มกราคม 2557 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 10 มกราคม 2557

(ชาญชัย กงทองลักษณ์)

ประธานกรรมการ

ชมรมผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย