

สารบัญ

ข้อบังคับ

หมวด 200 คำนิยาม

หน้า

201	คำนิยาม.....	200-1
-----	--------------	-------

*** ข้อบังคับ**

หมวด 200 คำนิยาม

201 คำนิยาม

“สำนักหักบัญชี” หมายความว่า บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

“ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า” หมายความว่า บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

“ตลาดหลักทรัพย์” หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

“บริษัทในเครือ” หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์และบริษัทที่ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้นเกินกว่าร้อยละห้าสิบของทุนชำระแล้ว

“คณะกรรมการ ก.ล.ต.” หมายความว่า คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“คณะกรรมการกำกับตลาดทุน” หมายความว่า คณะกรรมการกำกับตลาดทุนตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“สำนักงาน ก.ล.ต.” หมายความว่า สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“คณะกรรมการ” หมายความว่า คณะกรรมการสำนักหักบัญชี

“ผู้สมัคร” หมายความว่า ผู้สมัครที่ยื่นคำขอเป็นสมาชิกของสำนักหักบัญชี

“สมาชิก” หมายความว่า บุคคลที่สำนักหักบัญชีอนุญาตให้ใช้บริการในการชำระหนี้และการส่งมอบสินค้าตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“สมาชิกสามัญ” หมายความว่า สมาชิกที่ใช้บริการการหักบัญชีของสำนักหักบัญชีเพื่อตนเอง เพื่อลูกค้าของตนเอง เพื่อสมาชิกสำนักหักบัญชีรายอื่น และเพื่อบัญชีของสมาชิกรายอื่นที่สมาชิกทำหน้าที่ชำระหนี้แทน

“ผู้บริหาร” หมายความว่า ผู้บริหารตามประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ต. หรือประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

“กรรมการบริหาร” หมายความว่า บุคคลซึ่งคณะกรรมการบริษัทแต่งตั้งให้เป็นกรรมการบริหารหรือมอบหมายให้อำนาจตัดสินใจในการดำเนินงานของบริษัทแทนคณะกรรมการบริษัท

“ผู้อำนวยการฝ่าย” หมายความว่า บุคคลซึ่งรับผิดชอบงานในระดับส่วนงานภายในบริษัท

“หัวหน้างาน” หมายความว่า เจ้าหน้าที่ของสมาชิกที่สมาชิกได้มอบหมายให้เป็นผู้ควบคุมและรับผิดชอบการปฏิบัติงานของสมาชิก

“ตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า” หมายความว่า ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“ลูกค้า” หมายความว่า ผู้ซื้อหรือผู้ขายซึ่งทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยผ่านตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“เจ้าหน้าที่ปฏิบัติการ” หมายความว่า เจ้าหน้าที่ปฏิบัติการหลังการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิก

“เจ้าหน้าที่รับอนุญาต” หมายความว่า บุคคลที่ทำหน้าที่ในการส่งคำสั่งซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าเข้ามาในระบบซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“เจ้าหน้าที่กำกับดูแลการปฏิบัติงาน” หมายความว่า บุคคลที่ทำหน้าที่ในการกำกับดูแลการปฏิบัติงานตามข้อกำหนด หนังสือเวียน และคำสั่งของสำนักหักบัญชี

“เจ้าหน้าที่ตรวจสอบภายใน” หมายความว่า บุคคลที่ทำหน้าที่ในการตรวจสอบระบบและการดำเนินการภายในเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิก

“เจ้าหน้าที่บริหารความเสี่ยง” หมายความว่า บุคคลที่ทำหน้าที่ในการกำหนดวงเงินและเพดานการซื้อขายของลูกค้า และบริหารจัดการความเสี่ยงของการประกอบธุรกรรมสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิก

“การชำระหนี้” หมายความว่า การชำระราคา การวางหลักประกัน การชำระค่าธรรมเนียมและหนี้อื่น ๆ ต่อสำนักหักบัญชี ซึ่งไม่รวมถึงการส่งมอบสินค้าตลอดจนการชำระค่าสินค้าและค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้อง

“ระบบการชำระหนี้” หมายความว่า ระบบคอมพิวเตอร์ที่สำนักหักบัญชีจัดให้มีขึ้นเพื่อให้บริการระหว่างสมาชิกกับสำนักหักบัญชี

“สัญญาซื้อขายล่วงหน้า” หมายความว่า สัญญาที่มีลักษณะใดลักษณะหนึ่งหรือหลายลักษณะตามพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 ตลอดจนที่มีการแก้ไขเป็นคราวๆ ไป และเป็นสัญญาในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดขึ้นและจัดให้มีการซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์ส” หรือ “ฟิวเจอร์ส” (Futures) หมายความว่า สัญญาที่กำหนดให้คู่สัญญาฝ่ายหนึ่งส่งมอบสินค้าให้คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง ซึ่งเป็นผู้ชำระราคา ณ เวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคตเป็นจำนวนและราคาตามที่กำหนดไว้ในสัญญา หรือสัญญาที่กำหนดให้คู่สัญญาฝ่ายหนึ่งได้รับชำระเงินหรือต้องชำระเงินให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง เท่ากับจำนวนเงินที่คำนวณได้จากส่วนต่างระหว่างราคาหรือมูลค่าของสินค้าหรือตัวแปรที่กำหนดไว้ในสัญญากับราคาหรือมูลค่าของสินค้าหรือตัวแปรที่เป็นอยู่ ณ เวลาใดเวลาหนึ่งหรือช่วงเวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคตตามที่กำหนดไว้ในสัญญา

“สัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่น” หรือ “ออปชั่น” (Options) หมายความว่า สัญญาที่กำหนดให้สิทธิแก่คู่สัญญาฝ่ายหนึ่งที่จะเรียกให้คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งส่งมอบสินค้าหรือชำระราคาของสินค้า หรือชำระเงินที่คำนวณได้จากส่วนต่างระหว่างราคาหรือมูลค่าของสินค้าหรือตัวแปรที่กำหนดไว้ในสัญญากับราคาหรือ

มูลค่าของสินค้าหรือตัวแปรที่เป็นอยู่ ณ เวลาใดเวลาหนึ่งหรือช่วงเวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคตตามที่กำหนดไว้ในสัญญา ซึ่งประกอบด้วยคอลออปชั่นและพุทออปชั่น

“คอลออปชั่น” (Call Options) หมายความว่า สัญญาที่กำหนดให้สิทธิและหน้าที่ดังนี้

(1.1) ผู้มีฐานะซื้อมีสิทธิซื้อสินค้าอ้างอิงหรือได้รับชำระราคาเท่ากับจำนวนเงินที่คำนวณได้จากส่วนต่างระหว่างราคาสำหรับการชำระราคา (Settlement Price) หักด้วยราคาใช้สิทธิ ตามลักษณะและเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(1.2) ผู้มีฐานะขายมีหน้าที่ส่งมอบสินค้าอ้างอิงหรือชำระราคาเท่ากับจำนวนเงินที่คำนวณได้จากส่วนต่างระหว่างราคาสำหรับการชำระราคา (Settlement Price) หักด้วยราคาใช้สิทธิ ตามลักษณะและเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“พุทออปชั่น” (Put Options) หมายความว่า สัญญาที่กำหนดให้สิทธิและหน้าที่ดังนี้

(2.1) ผู้มีฐานะซื้อมีสิทธิขายสินค้าอ้างอิงหรือได้รับชำระราคาเท่ากับจำนวนเงินที่คำนวณได้จากส่วนต่างระหว่างราคาใช้สิทธิหักด้วยราคาสำหรับการชำระราคา (Settlement Price) ตามลักษณะและเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(2.2) ผู้มีฐานะขายมีหน้าที่รับมอบสินค้าอ้างอิงหรือชำระราคาเท่ากับจำนวนเงินที่คำนวณได้จากส่วนต่างระหว่างราคาใช้สิทธิหักด้วยราคาสำหรับการชำระราคา (Settlement Price) ตามลักษณะและเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“ออปชั่นที่ชำระด้วยเงิน” (Cash Settlement) หมายความว่า สัญญาที่กำหนดให้สิทธิที่จะได้รับชำระเงินจากส่วนต่างระหว่างราคาใช้สิทธิ (Strike Price) และราคาสำหรับการชำระราคา (Settlement price)

“ออปชั่นที่ส่งมอบสินค้า” (Physical Settlement) หมายความว่า สัญญาที่กำหนดให้สิทธิซื้อหรือขายสินค้าอ้างอิง (Physical Delivery)

“ฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า” หมายความว่า ภาระหรือสิทธิของบุคคลหนึ่งบุคคลใดอันเนื่องมาจากการซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“บัญชีทรัพย์สิน” หมายความว่า บัญชีที่สำนักหักบัญชีจัดทำขึ้นเพื่อเก็บรักษาทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีได้รับมาทั้งที่เป็นของสมาชิกและของลูกค้าของสมาชิก เพื่อเป็นประกันและเพื่อความมั่นคงในการซื้อขาย การชำระหนี้ และการส่งมอบสินค้าตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“บัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า” (Position Account) หมายความว่า บัญชีทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีจัดให้มีขึ้นเพื่อบันทึกฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและข้อมูลการส่งมอบสินค้า

“บัญชีหลักประกัน” (Margin Account) หมายความว่า บัญชีทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีจัดให้มีขึ้นเพื่อบันทึกอัตราหรือมูลค่าหลักประกัน

“บัญชีสมาชิก” (House Account) หมายความว่า บัญชีเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิก

“บัญชีของลูกค้า” (Client Account) หมายความว่า บัญชีเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าของสมาชิก

“ฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า” หมายความว่า การฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 ที่มีผลเป็นคราวๆ ไป

“โอนฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า” หมายความว่า การโอนฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกรายหนึ่งไปยังสมาชิกรายหนึ่งเพื่อการชำระหนี้แทน

“ผู้ที่เกี่ยวข้อง” หมายความว่า ผู้ที่เกี่ยวข้องตามข้อกำหนดของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“สินค้า” หมายความว่า หลักทรัพย์ ทองคำ น้ำมันดิบ หรือทรัพย์สินอื่นใดที่ใช้อ้างอิงในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

“สินค้าอ้างอิง” หมายความว่า สินค้าหรือตัวแปรที่ใช้อ้างอิงในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“ตัวแปร” หมายความว่า อัตราแลกเปลี่ยนเงิน อัตราดอกเบี้ย ดัชนีทางการเงิน ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ หรือตัวแปรอื่นใดตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

“รายงานการชำระหนี้” หมายความว่า รายงานการชำระหนี้ที่สำนักหักบัญชีทำขึ้นเพื่อแจ้งให้สมาชิกทราบเพื่อทำการชำระราคาและวางหลักประกันเพิ่มเติม

“การซื้อขาย” หมายความว่า การซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“รายการซื้อขาย” หมายความว่า การซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกิดขึ้นแล้ว

***“เงินชดเชยการเลื่อนการส่งมอบสินค้า” หมายความว่า เงินชดเชยการเลื่อนการส่งมอบสินค้าในกรณีที่เกิดความไม่สมดุลของการแจ้งความประสงค์ในการส่งมอบสินค้า

(*เพิ่มเติมบทนิยามคำว่า “เงินชดเชยการเลื่อนการส่งมอบสินค้า” โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 200 คำนิยาม ลงวันที่ 26 กันยายน 2559 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 3 ตุลาคม 2559 เป็นต้นไป)

“ราคาใช้สิทธิ” (Strike Price) หมายความว่า ราคาซึ่งผู้ซื้อสามารถใช้อ้างอิงซื้อหรือขายสินค้าอ้างอิงตามลักษณะและเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

***“หน่วยส่งมอบ” หมายความว่า ขนาดของการส่งมอบสินค้าตามที่กำหนดในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

***“แบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า” หมายความว่า แบบและข้อความของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าซึ่งกำหนดรายละเอียดต่างๆ ของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดให้มีการซื้อขาย

(*เพิ่มเติมบทนิยามคำว่า “หน่วยส่งมอบ” และ “แบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า” โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 200 คำนิยาม ลงวันที่ 26 กันยายน 2559 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 3 ตุลาคม 2559 เป็นต้นไป)

“การวางหลักประกัน” หมายความว่า การนำทรัพย์สินใดๆ มาวางเป็นประกันในการซื้อขายและการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามประเภท อัตรา หรือมูลค่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด

“หลักประกัน” หมายความว่า ทรัพย์สินที่สมาชิกวางเป็นประกันในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามอัตราหรือมูลค่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด เพื่อเป็นประกันในการซื้อขายและการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“หลักประกันรักษาสภาพ” (Maintenance Margin) หมายความว่า จำนวนทรัพย์สินขั้นต่ำที่สมาชิกต้องวางเป็นประกันและดำรงไว้ตลอดเวลาที่มีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำหรับฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในแต่ละเดือน และฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีความเสี่ยงตรงข้ามกัน ภายหลังจากส่วนลดค่าความเสี่ยงระหว่างสินค้าอ้างอิง

“หลักประกันรักษาสภาพก่อนระยะเวลาส่งมอบสินค้า” (Spot Month Margin) หมายความว่า จำนวนทรัพย์สินที่สมาชิกต้องวางเป็นประกันสำหรับสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่กำหนดให้มีการส่งมอบสินค้า

“หลักประกันรักษาสภาพของค่าความเสี่ยงระหว่างเดือน” (Inter-month Spread Maintenance Margin) หมายความว่า จำนวนทรัพย์สินที่สมาชิกต้องวางเป็นประกันเมื่อมีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีความเสี่ยงตรงข้ามกัน

“หลักประกันรักษาสภาพของค่าความเสี่ยงระหว่างสินค้าอ้างอิง” (Inter-commodity Spread Credit) หมายความว่า จำนวนทรัพย์สินที่สมาชิกต้องวางเป็นประกันสำหรับสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสินค้าอ้างอิงที่มีความสัมพันธ์กัน

“หลักประกันผันแปร” (Variation Margin) หมายความว่า จำนวนเงินที่สมาชิกต้องวางเป็นประกันเพื่อรองรับความเปลี่ยนแปลงราคาของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์ส

“หลักประกันระหว่างวัน” (Intra-day Margin) หมายความว่า จำนวนเงินที่สมาชิกต้องวางเป็นประกันเมื่อสำนักหักบัญชีตรวจพบว่าราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีความผันผวนอย่างรุนแรง

“ทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า” (Delivery Deposit) หมายความว่า ทรัพย์สินที่สมาชิกวางเพื่อรับรองการส่งมอบสินค้า ณ เวลาใดเวลาหนึ่งในอนาคตเป็นจำนวนและราคาตามที่สำนักหักบัญชีกำหนดสำหรับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“ส่งมอบสินค้า” หมายความว่า การดำเนินการเพื่อส่งมอบและรับมอบสินค้าตามภาระผูกพันที่เกิดขึ้นจากการจับคู่โดยสำนักหักบัญชีตามที่กำหนดไว้ในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“หลักประกันส่วนเพิ่ม” (Additional Margin) หมายความว่า จำนวนทรัพย์สินที่สมาชิกต้องวางเป็นประกันเพิ่มเติมตามประเภท อัตรา หรือมูลค่าตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด

“กองทุนทดแทนความเสียหาย” (Clearing Fund) หมายความว่า ทรัพย์สินที่สมาชิกต้องวางเป็นประกันเพื่อความมั่นคงของระบบการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่สมาชิกทำการซื้อขายหรือมีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามหลักเกณฑ์ อัตรา หรือมูลค่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด

* “หลักทรัพย์เพื่อความมั่นคง” (Security Deposit) หมายความว่า ทรัพย์สินที่สมาชิกต้องวางเป็นประกัน เพื่อความมั่นคงของการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามอัตราหรือมูลค่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(*ยกเลิกบทนิยามคำว่า “หลักทรัพย์เพื่อความมั่นคง” และให้ใช้บทนิยามใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 200 คำนิยาม ลงวันที่ 13 ธันวาคม 2559 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2560 เป็นต้นไป)

“หลักทรัพย์” หมายความว่า หลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“เหตุสุดวิสัย” หมายความว่า เหตุใดๆ อันอาจเกิดขึ้นและเป็นเหตุที่ไม่อาจป้องกันได้ แม้ว่าจะได้มีการใช้ความระมัดระวังตามสมควรอันพึงคาดหมายได้ในฐานะและภาวะเช่นนั้นแล้ว

“คณะกรรมการบริหารความเสี่ยง” หมายความว่า คณะกรรมการที่คณะกรรมการแต่งตั้งให้ทำหน้าที่พิจารณาบริหารความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นในการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและการส่งมอบสินค้า

“คณะกรรมการวินัย” หมายความว่า คณะกรรมการที่คณะกรรมการแต่งตั้งให้ทำหน้าที่พิจารณาความผิดของบุคคลที่ฝ่าฝืนหรือมีส่วนเกี่ยวข้องในการฝ่าฝืนข้อกำหนดของสำนักหักบัญชีและลงโทษบุคคลดังกล่าว

“คณะกรรมการอุทธรณ์” หมายความว่า คณะกรรมการที่คณะกรรมการแต่งตั้งให้ทำหน้าที่พิจารณาและวินิจฉัยอุทธรณ์คำสั่งลงโทษ

(*ความในหมวด 200 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 200 คำนิยาม ลงวันที่ 18 ธันวาคม 2558 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 4 มกราคม 2559 เป็นต้นไป)