

## แนวทางการวางเงินตราต่างประเทศเป็นหลักประกันในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

### ประเภทผู้ลงทุนที่สามารถวางเงินตราต่างประเทศเป็นหลักประกัน

- ผู้ลงทุนทั้งที่มีถิ่นที่อยู่ในประเทศไทย (Resident) และผู้ลงทุนที่ไม่ได้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศไทย (Non-Resident)

### ประเภทหลักประกันที่สามารถวางเงินตราต่างประเทศเป็นหลักประกันได้

- หลักประกันรักษาสภาพ (Maintenance Margin)
- หลักประกันส่วนเพิ่ม (Additional Margin)

โดยสำนักหักบัญชีจะคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกันเป็นเงินบาท (Translation Value) ทุกสิ้นวันทำการ ด้วยอัตราแลกเปลี่ยนที่สำนักหักบัญชีกำหนด ปัจจุบันใช้อัตราแลกเปลี่ยนที่ธนาคารแห่งประเทศไทยประกาศ ณ เวลา 18.00 น. หักด้วยค่าความเสี่ยง (Haircut) ที่สำนักหักบัญชีกำหนด

ทั้งนี้ สำหรับหลักประกันที่สำนักหักบัญชีรับมาจากสมาชิกรายหนึ่ง และจ่ายให้สมาชิกอีกรายหนึ่ง จะไม่สามารถวางเงินตราต่างประเทศเป็นหลักประกันได้ ได้แก่ หลักประกันผันแปร (Variation Margin) รวมถึงมูลค่าการซื้อขายและมูลค่าการใช้สิทธิ options

### ขั้นตอนการเปิดบัญชีฝากเงินตราต่างประเทศเป็นหลักประกัน

1. สมาชิกแจ้งความประสงค์ขอวางเงินตราต่างประเทศเป็นหลักประกันในตลาดสัญญาซื้อขายต่างประเทศต่อสำนักหักบัญชี
2. สมาชิกติดต่อธนาคารที่สมาชิกใช้บริการ (Settlement Bank) เพื่อเปิดบัญชีเงินตราต่างประเทศ รวมทั้งจัดทำหนังสือยินยอมให้สำนักหักบัญชีหักบัญชีเงินฝากตามแบบฟอร์มที่ Settlement Bank กำหนด
  - สมาชิกสามารถกำหนดชื่อบัญชีได้เอง โดยต้องระบุชี้ชัดเจนได้ว่าเป็นไปตามหลักการเก็บรักษาทรัพย์สินของลูกค้าแยกออกจากทรัพย์สินของสมาชิก
  - การยื่นเอกสารประกอบการเปิดบัญชีเงินตราต่างประเทศเพื่อสมาชิกหรือเพื่อลูกค้าของสมาชิก ให้เป็นไปตามแนวทางของธนาคารที่สมาชิกใช้บริการ (Settlement Bank)
  - สมาชิกสามารถใช้บัญชีดังกล่าว สำหรับฝากเงินตราต่างประเทศของลูกค้าที่เป็นผู้ลงทุนที่มีถิ่นที่อยู่ในประเทศไทย (Resident) และผู้ลงทุนที่ไม่ได้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศไทย (Non-Resident) ไปด้วยกันได้
3. เมื่อสมาชิกเปิดบัญชีเงินตราต่างประเทศเรียบร้อยแล้ว ขอให้นำส่งหนังสือแจ้งรายละเอียดการใช้บริการ Settlement Bank รวมทั้งเอกสารแนบให้แก่สำนักหักบัญชี ([Link หนังสือแจ้ง](#))
4. สำนักหักบัญชีจะตรวจสอบความพร้อมของบัญชีสำหรับการหักโอนเงินตราต่างประเทศกับ Settlement Bank ดังนั้น จึงขอให้สมาชิกนำส่งเอกสารให้ครบถ้วนก่อนวันที่ต้องการเริ่มใช้งานอย่างน้อย 14 วันทำการ

### เงื่อนไขอื่น ๆ

#### 1. การแลกเปลี่ยนเป็นเงินบาท

ห้ามแลกเปลี่ยนเป็นเงินบาท ยกเว้น เพื่อชำระค่าธรรมเนียมการบริหารหลักประกัน ค่าใช้จ่ายอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องกับการวางหลักประกัน เช่น ภาษีมูลค่าเพิ่ม หรือภาษีหัก ณ ที่จ่าย รวมทั้งการบังคับหลักประกันกรณีสมาชิกหรือลูกค้าผิดนัดชำระหนี้ ซึ่งครอบคลุมค่าใช้จ่าย ค่าปรับ หรือค่าเสียหายที่เกี่ยวข้องเนื่องมาจากการบังคับหลักประกัน (แล้วแต่กรณี)

#### 2. การฝาก/ถอนเงินตราต่างประเทศ

- Resident ต้องโอนผ่านบัญชีฝากเงินตราต่างประเทศที่เปิดกับธนาคารพาณิชย์ไทยเท่านั้น (ห้ามรับเงินสด)
- Non-Resident อาจเป็นการโอน-รับโอนมาจากต่างประเทศ หรือระหว่างบัญชีของลูกค้าที่เปิดกับนิติบุคคลรับอนุญาตในประเทศ (ห้ามรับเงินสด)

เริ่มใช้ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 เป็นต้นไป

สอบถามข้อมูลเพิ่มเติม

กรุณาติดต่อฝ่ายชำระราคาอนุพันธ์

E-mail: [DerivativesClearingDepartment@set.or.th](mailto:DerivativesClearingDepartment@set.or.th)

โทรศัพท์ 02-009-9543-9547