

สรุปแนวทางการเปิดบัญชีเก็บฐานะและกำหนดวิธีการคำนวณหลักประกัน
ในระบบงานสำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ตามข้อบังคับของสำนักหักบัญชี หลักเกณฑ์ 403.02 และประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด เรื่อง การเปิดบัญชีเก็บฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และการกำหนดวิธีการคำนวณหลักประกันในระบบงานสำนักหักบัญชี สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่กำหนดให้สมาชิกเปิดบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามประเภทบัญชีของสมาชิก และ ลูกค้าของสมาชิก รวมทั้งคำนวณหลักประกันตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนดนั้น

สำนักหักบัญชีขอสรุปวิธีปฏิบัติในการเปิดบัญชีดังนี้

1. บัญชีสมาชิก (Proprietary Account)

เจ้าของบัญชี	ประเภทบัญชี	การจัดเก็บฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Position Keeping Type)	Auto Match-Out	การคำนวณหลักประกัน (Margining Type)
บริษัทหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกสำนักหักบัญชี	สมาชิก (Proprietary)	Net หรือ Gross *	Yes หรือ No*	Net หรือ Gross
บัญชีชั่วคราวของบริษัทหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกสำนักหักบัญชี (Default Account)	สมาชิก (Proprietary)	Gross	No	Net

2. บัญชีของลูกค้า (Client Account)**

เจ้าของบัญชี	ประเภทบัญชี	การจัดเก็บฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Position Keeping Type)	Auto Match-Out	การคำนวณหลักประกัน (Margining Type)
ลูกค้านิติบุคคลธรรมดา	ลูกค้า (Client)	Net หรือ Gross *	Yes หรือ No*	Net หรือ Gross
ลูกค้านิติบุคคลที่เป็นผู้รับผลประโยชน์ที่แท้จริง	ลูกค้า (Client)	Net หรือ Gross *	Yes หรือ No*	Net หรือ Gross
ลูกค้านิติบุคคลที่มีผู้รับผลประโยชน์ที่แท้จริง หรือลูกค้านิติบุคคลที่เป็นเจ้าของบัญชีแบบไม่เปิดเผยชื่อ (Omnibus A/C)	ลูกค้า (Client)	Gross	No	Gross
ลูกค้านิติบุคคลที่เป็นบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนที่จดทะเบียนภายใต้กฎหมายไทยและอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์	ลูกค้า (Client)	Net หรือ Gross *	Yes หรือ No*	Net หรือ Gross
	ลูกค้า (Client)	Gross	No	Gross
บัญชีชั่วคราวของลูกค้า (Default Account)	ลูกค้า (Client)	Gross	No	Gross

- หมายเหตุ: * สมาชิกอาจกำหนดบัญชีจัดเก็บฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบบรวม (Gross Position) และ Auto match-out = No เมื่อมีเหตุผลและความจำเป็น โดยสมาชิกต้องจัดเก็บเอกสารหลักฐานประกอบการพิจารณาพร้อมให้สำนักหักบัญชีตรวจสอบหรือเรียกดูได้ในทันที
- ** หากไม่สามารถพิสูจน์ทราบได้ว่าลูกค้าเจ้าของบัญชีเป็นผู้รับประโยชน์ที่แท้จริงหรือเป็นลูกค้าทอดเดียวหรือรายเดียว ให้สันนิษฐานว่าลูกค้าดังกล่าวเป็นเจ้าของบัญชีแบบไม่เปิดเผยชื่อ (Omnibus Account)

3. Margin Propagation

สมาชิกสามารถดำเนินการได้เฉพาะกรณีเป็นเจ้าของบัญชีไม่ใช่ลูกค้าบุคคลธรรมดา หรือไม่ใช่ลูกค้าเจ้าของบัญชีแบบไม่เปิดเผยชื่อ (Omnibus Account) และจะมีผลบังคับใช้เมื่อสำนักหักบัญชีอนุมัติแล้ว

4. ผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market Maker)

สมาชิกสามารถเปิดบัญชีของผู้ดูแลสภาพคล่องได้ ก็ต่อเมื่อผู้ดูแลสภาพคล่องรายนั้นได้รับการแต่งตั้งจากบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) และจะมีผลบังคับใช้เมื่อสำนักหักบัญชีอนุมัติแล้ว

ทั้งนี้ สรุปแนวทางการเปิดบัญชีเก็บฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และกำหนดวิธีการคำนวณหลักประกันฉบับนี้ จัดทำขึ้นโดยมีวัตถุประสงค์เพื่อให้สมาชิกใช้เป็นข้อมูลเบื้องต้นในการสร้างความเข้าใจเกี่ยวกับข้อกำหนดที่สำคัญของสำนักหักบัญชี เท่านั้น สมาชิกยังคงมีหน้าที่ต้องศึกษารายละเอียดและเนื้อหาตามหลักเกณฑ์ของสำนักหักบัญชีฯ รวมทั้งหนังสือเวียนที่เกี่ยวข้องเพื่อปฏิบัติตามด้วย