

เอกสารรับฟังความคิดเห็น

เลขที่ อนป. 1/2567

เรื่อง ร่างประกาศเกี่ยวกับการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

เผยแพร่เมื่อวันที่ 8 มกราคม 2567

สำนักงาน ก.ล.ต. ได้จัดทำเอกสารฉบับนี้ขึ้นเพื่อสำรวจความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้อง
ท่านสามารถ download เอกสารเผยแพร่ฉบับนี้ได้จาก www.sec.or.th

ท่านสามารถส่งความเห็นหรือข้อเสนอแนะให้สำนักงาน ก.ล.ต. ได้
ตามที่ติดต่อด้านล่าง หรือ e-mail: bhumipisuth@sec.or.th
sawarin@sec.or.th หรือ arthipha@sec.or.th

วันสุดท้ายของการแสดงความคิดเห็น วันที่ 7 กุมภาพันธ์ 2567

ท่านสามารถติดต่อสอบถามข้อมูลเพิ่มเติมได้จากเจ้าหน้าที่ของสำนักงาน ก.ล.ต. ดังนี้

1. นายภูมิพิสุทธิ์ หะวานนท์ โทรศัพท์ 0-2263-6074
2. นางสาวสวริน เจือศรีกุล โทรศัพท์ 0-2033-4662
3. นายอธิภัทร พูลถนอมสุข โทรศัพท์ 0-2263-6039

สำนักงาน ก.ล.ต. ขอขอบคุณทุกท่านที่เข้าร่วมแสดงความคิดเห็น
และให้ข้อเสนอแนะมา ณ โอกาสนี้

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
เลขที่ 333/3 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900
โทรศัพท์ 1207 หรือ 0-2033-9999 โทรสาร: 0-2033-9660 email: info@sec.or.th

1. ที่มา

ตามที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“สำนักงาน ก.ล.ต.”) มีแนวคิดปรับปรุงหลักเกณฑ์การดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (“ผู้ประกอบธุรกิจ”) ในส่วนการใช้หนี้สินโดยสิทธิในการดำรงเงินกองทุน ให้มีความยืดหยุ่นมากขึ้น และปรับมูลค่าความเสี่ยง (“haircut”) ด้าน position risk¹ ที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิให้สอดคล้องกับสถานะปัจจุบัน และครอบคลุมความเสี่ยงของตราสารต่าง ๆ ที่ผู้ประกอบธุรกิจมีเงินลงทุน รวมทั้งปรับปรุงนิยามหนี้สินพิเศษ ให้ยืดหยุ่นมากขึ้นโดยครอบคลุมถึงหนี้สินรายการอื่น ๆ เพิ่มเติม และต่อมาสำนักงาน ก.ล.ต. ได้เปิดรับฟังความคิดเห็นหลักการข้างต้นตามเอกสารรับฟังความคิดเห็น เลขที่ อกต. 42/2566 เรื่อง หลักการปรับปรุงหลักเกณฑ์การดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งพบว่า มีผู้ให้ความคิดเห็น 20 ราย ส่วนใหญ่เห็นด้วยกับหลักการที่สำนักงาน ก.ล.ต. เสนอ รวมทั้งมีข้อเสนอแนะที่เป็นประโยชน์ว่า สำนักงาน ก.ล.ต. ควรลดอัตรา haircut ด้าน position risk จากการมีฐานะในเงินตราต่างประเทศบางสกุลเงินที่มีปริมาณการซื้อขายแลกเปลี่ยนสูงและมีความผันผวนต่ำ นั้น

สำนักงาน ก.ล.ต. ได้ทบทวนหลักการปรับปรุงหลักเกณฑ์การดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของผู้ประกอบธุรกิจ ในส่วน haircut ด้าน position risk จากการมีฐานะเงินตราต่างประเทศ ตามข้อเสนอแนะข้างต้น และได้ยกร่างประกาศและเอกสารแนบท้ายที่เกี่ยวข้องตามหลักการข้างต้นแล้ว ในการนี้ สำนักงาน ก.ล.ต. จึงขอเปิดรับฟังความคิดเห็นร่างประกาศจำนวน 3 ฉบับ พร้อมทั้งร่างเอกสารแนบท้ายเกี่ยวข้อง ดังนี้

1.1 ประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. /256 เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ (ฉบับที่)

1.2 ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. /256 เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ และข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ (ฉบับที่) พร้อมทั้งแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (“แบบ บ.ล. 4/1”) และคำอธิบายประกอบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิแนบท้ายประกาศดังกล่าว

¹ position risk หมายถึง ความเสี่ยงที่เกิดจากการเปลี่ยนแปลงของราคาหลักทรัพย์หรือสินทรัพย์อ้างอิงในทิศทางที่ส่งผลขาดทุน (potential loss) แก่ผู้ประกอบธุรกิจ อันเป็นผลมาจากการที่ผู้ประกอบธุรกิจมีสถานะเงินลงทุน (position taking) ในหลักทรัพย์ ตราสาร หรืออนุพันธ์ทางการเงิน โดยสถานะดังกล่าวอาจอยู่ในรูปของ long และ/หรือ short position

1.3 ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. /256 เรื่อง การกำหนดรายการเพิ่มเติมสำหรับสินทรัพย์สภาพคล่อง หนี้สินพิเศษและหนี้สินรวมในการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

2. เป้าหมายที่ต้องการบรรลุ (Intended Outcome)

เพื่อให้ผู้ประกอบการธุรกิจมีเงินกองทุนเพียงพอรองรับความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจ และสามารถประกอบธุรกิจได้อย่างต่อเนื่องอันเป็นการคุ้มครองผู้ลงทุนและป้องกันความเสี่ยงเชิงระบบ (systemic risk) โดยหลักเกณฑ์ดังกล่าวไม่สร้างภาระเกินจำเป็นแก่ผู้ประกอบการ

3. สรุปสาระสำคัญของร่างประกาศ

3.1 qualified sub-debt

3.1.1 การปรับปรุงนิยามหนี้สินด้อยสิทธิที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวมในการคำนวณเงินกองทุน (“qualified sub-debt”)

- ร่างประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. /256 เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ (ฉบับที่)
- ร่างคำอธิบายประกอบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

qualified sub-debt ที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวมในการคำนวณเงินกองทุน ต้องเป็นหนี้สินที่กำหนดสิทธิของเจ้าหนี้ไว้ต่ำกว่าเจ้าหนี้สามัญทั่วไป โดยหนี้สินดังกล่าวต้องไม่มีประกันและไม่มีเงื่อนไขให้เจ้าหนี้มีสิทธิเรียกให้มีการชำระหนี้ก่อนกำหนด ทั้งนี้ หนี้สินดังกล่าวต้องมีเงื่อนไขให้ผู้ประกอบธุรกิจยกเลิกการจ่ายดอกเบี้ยหรือผลตอบแทนอื่นใด หรือเลื่อนกำหนดเวลาในการชำระดอกเบี้ยหรือผลตอบแทนอื่นใดออกไป โดยไม่ถือว่าเป็นการผัดผ่อนชำระหนี้ หากปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้แก่ผู้ประกอบการ จนนกว่าผู้ประกอบการได้แก้ไขเหตุดังกล่าวได้

(1) ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้

(2) ผิดนัดชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชี หรือต่อลูกค้าในกรณีเป็นการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ หรือผิดนัดชำระหนี้ต่อสำนักหักบัญชี สัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือต่อลูกค้าในกรณีเป็นการประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(3) ผิดนัดชำระหนี้ตามตราสารทางการเงินที่ออกโดยผู้ประกอบการ

3.1.2 การใช้ประโยชน์จาก qualified sub-debt²

- ร่างประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. /256 เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ (ฉบับที่)
- ร่างประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. /256 เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ และข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ (ฉบับที่)
- ร่างคำอธิบายประกอบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

(1) ผู้ประกอบธุรกิจสามารถใช้ประโยชน์จาก qualified sub-debt ที่ออกใหม่ (เมื่อรวมกับ qualified sub-debt เดิมที่เคยใช้ประโยชน์) ได้ไม่เกินกว่ามูลค่าของ ส่วนของผู้ถือหุ้นของผู้ประกอบธุรกิจ (equity – “EQ”) ณ วันที่รับรู้รายการ qualified sub-debt ที่ออกใหม่

(2) หากปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้

(2.1) qualified sub-debt > 1.5 เท่าของ EQ

(2.2) qualified sub-debt > EQ ติดต่อกันตั้งแต่ 15 วันขึ้นไป

(2.3) qualified sub-debt > EQ ตั้งแต่ 3 ครั้งขึ้นไปในรอบปีปฏิทิน ให้ผู้ประกอบธุรกิจดำเนินการดังต่อไปนี้

(ก) จัดทำและยื่นแผนการแก้ไขเหตุข้างต้นต่อสำนักงาน ก.ล.ต.

ภายใน 30 วันนับแต่วันที่เกิดเหตุ เว้นแต่ก่อนครบกำหนดระยะเวลาดังกล่าว เหตุตาม (2.1) และ (2.2) หมดไป

(ข) ดำเนินการตามแผนตาม (ก) เพื่อให้ qualified sub-debt ที่ถูกใช้ประโยชน์ไม่เกินกว่า EQ ภายในระยะเวลาที่กำหนดในแผนดังกล่าวซึ่งต้องไม่เกิน 90 วันนับแต่วันที่เกิดเหตุ และแจ้งสำนักงาน ก.ล.ต. เมื่อดำเนินการแล้วเสร็จ

หากผู้ประกอบธุรกิจไม่สามารถดำเนินการได้ตาม (ก) หรือ (ข) ให้นำ qualified sub-debt ส่วนที่ถูกใช้ประโยชน์ในส่วนที่เกินกว่า EQ กลับไปรวม เป็นรายการหนี้สินรวมในการคำนวณเงินกองทุน

² การใช้ประโยชน์จาก qualified sub-debt หมายถึง การไม่นับ qualified sub-debt เป็นหนี้สินรวมในการคำนวณเงินกองทุน

(3) ในกรณีมีเหตุจำเป็นและสมควร ให้สำนักงาน ก.ล.ต. มีอำนาจผ่อนผันระยะเวลาตาม (2)(ก) และ (2)(ข) ได้ โดยให้ผู้ประกอบธุรกิจที่ประสงค์ขอผ่อนผันยื่นคำขอพร้อมทั้งเอกสารหลักฐานประกอบคำขอตามคู่มือสำหรับประชาชนต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 10 วันก่อนครบกำหนดระยะเวลาดังกล่าว ทั้งนี้ ตามขั้นตอนและวิธีการที่ระบุไว้ในคู่มือสำหรับประชาชน

(4) หากช่วงเวลาที่เกิดเหตุการณ์ตาม (2) เป็นช่วงเวลาที่ผู้ประกอบธุรกิจไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ให้ผู้ประกอบธุรกิจดำเนินการตามข้อกำหนดสำหรับผู้ประกอบธุรกิจที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ โดยไม่ต้องดำเนินการตาม (2)(ก) และ (2)(ข)

(5) ระหว่างที่ผู้ประกอบธุรกิจมี qualified sub-debt ส่วนที่ใช้ประโยชน์เกินกว่า EQ ให้ผู้ประกอบธุรกิจรายงานข้อมูลต่อไปนี้ในแบบ บ.ล. 4/1 พร้อมทั้งยื่นแบบรายงานดังกล่าวทุกวันผ่านระบบอิเล็กทรอนิกส์ของสำนักงาน ก.ล.ต. ภายในวันทำการถัดไป จนกว่าจะมี qualified sub-debt ที่ใช้ประโยชน์ไม่เกินกว่า EQ

(5.1) มูลค่าหนี้สินด้อยสิทธิที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวม

(5.2) ส่วนของผู้ถือหุ้น

(5.3) อัตราส่วนหนี้สินด้อยสิทธิที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวม

ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น

(5.4) อัตราส่วนหนี้สินด้อยสิทธิและวงเงินกู้ด้อยสิทธิ

ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น

3.1.3 บทเฉพาะกาล

- ร่างประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. /256 เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ (ฉบับที่)

ผู้ประกอบธุรกิจสามารถใช้ประโยชน์จาก qualified sub-debt ซึ่งไม่มีเงื่อนไขเกี่ยวกับการยกเลิกหรือเลื่อนการจ่ายดอกเบี้ยหรือผลตอบแทนตาม 3.1.1 ที่ออกก่อนหรือในวันที่ประกาศมีผลใช้บังคับ เฉพาะส่วนที่ไม่เกินกว่า EQ ต่อไปได้อีกไม่เกิน 6 เดือนนับแต่วันที่ประกาศมีผลใช้บังคับ

3.2 การทบทวนอัตรา haircut ด้าน position risk

3.2.1 รายชื่อประเทศและดัชนีหลักของกลุ่มประเทศ emerging market (“EM”)³

- ร่างคำอธิบายประกอบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

(1) เพิ่ม Kuwait ในรายชื่อประเทศ EM และเพิ่ม Kuwait All-Share Index เป็นดัชนีหลักของ Kuwait

(2) เพิ่ม Saudi Arabia ในรายชื่อประเทศ EM และเพิ่ม Tadawul All Share Index เป็นดัชนีหลักของ Saudi Arabia

3.2.2 ฐานะเงินตราต่างประเทศ

- ร่างคำอธิบายประกอบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
- ร่างแบบ บ.ล. 4/1

อัตรา haircut เท่ากับ 4% ของค่าที่มากกว่าระหว่างยอดรวมสุทธิของสกุลเงิน USD EUR JPY GBP CNY AUD CAD CHF HKD และ SGD ที่เป็นสินทรัพย์ และยอดรวมสุทธิสกุลเงินดังกล่าวที่เป็นหนี้สิน รวมกับ 8% ของค่าที่มากกว่าระหว่างยอดรวมสุทธิของสกุลเงินอื่น ๆ ที่เป็นสินทรัพย์ และยอดรวมสุทธิสกุลเงินอื่น ๆ ที่เป็นหนี้สิน

3.3 การกำหนดอัตรา haircut ด้าน position risk สำหรับตราสารประเภทใหม่

3.3.1 หุ้นที่ซื้อขายใน LiVE Exchange

- ร่างคำอธิบายประกอบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
- ร่างแบบ บ.ล. 4/1

กำหนดอัตรา haircut ของหุ้นที่ซื้อขายใน LiVE Exchange เท่ากับ

ร้อยละ 60

³ ในการคำนวณเงินกองทุน หุ้นต่างประเทศแต่ละกลุ่มมีอัตรา haircut ด้าน position risk ไม่เท่ากัน จำแนกโดยปัจจัยต่าง ๆ อาทิ การเป็นหุ้นที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ในประเทศกลุ่ม developed market (“DM”) หรือ EM และการเป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักในประเทศกลุ่ม DM หรือ EM

3.3.2 ตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ (“DR”)

- ร่างคำอธิบายประกอบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

กำหนดอัตรา haircut ของ DR เท่ากับค่าความเสี่ยงของสินทรัพย์อ้างอิงซึ่งเป็นหุ้นต่างประเทศหรือหน่วยลงทุนต่างประเทศ และให้คิดอัตรา haircut ของการมีฐานะเงินตราต่างประเทศที่เกิดจากการมีเงินลงทุนใน DR นั้นด้วย

3.4 การปรับปรุงนิยามหนี้สินพิเศษ

- ร่างประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. /256 เรื่อง การกำหนดรายการเพิ่มเติมสำหรับสินทรัพย์สภาพคล่อง หนี้สินพิเศษและหนี้สินรวมในการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
- ร่างคำอธิบายประกอบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

เพิ่มเติมรายการต่อไปนี้เป็นหนี้สินพิเศษ ได้แก่

- (1) หนี้สินจากการค้างจ่ายเงินค่าขายหลักทรัพย์คืนให้แก่ลูกค้า เนื่องจากมีคำสั่งจากหน่วยงานของรัฐให้อายัดเงินดังกล่าว
- (2) หนี้สินจากการรับฝากหรือเป็นตัวแทนรับฝากทรัพย์สินจากการประกอบธุรกิจอื่นที่ ผู้ประกอบธุรกิจมีการแยกทรัพย์สินที่รับฝากดังกล่าวออกจากทรัพย์สินของผู้ประกอบธุรกิจอย่างชัดเจน
- (3) หนี้สินอื่นที่ สำนักงาน ก.ล.ต. ผ่อนผันให้เป็นหนี้สินพิเศษ โดยให้ผู้ประกอบธุรกิจที่ประสงค์จะขอผ่อนผันยื่นคำขอพร้อมทั้งเอกสารหลักฐานประกอบคำขอตามที่ระบุไว้ในคู่มือสำหรับประชาชนต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ทั้งนี้ ตามขั้นตอนและวิธีการที่ระบุไว้ในคู่มือสำหรับประชาชน

4. ช่วงเวลาที่คาดว่าจะประกาศจะมีผลใช้บังคับ

ภายในไตรมาสที่ 1 ปี 2567

5. เหตุผลความจำเป็นของการมีระบบอนุญาต

การกำหนดให้สำนักงาน ก.ล.ต. มีอำนาจพิจารณาผ่อนผันระยะเวลาจัดทำและยื่นแผนการแก้ไขเหตุที่ qualified sub-debt เกินกว่า EQ รวมทั้งมีอำนาจพิจารณาผ่อนผันระยะเวลาดำเนินการตามแผนดังกล่าว ทำให้เกิดความยืดหยุ่นแก่ผู้ประกอบธุรกิจที่มีเหตุจำเป็นสมควรอันทำให้ไม่สามารถดำเนินการได้ทันกำหนดเดิม นอกจากนี้ การกำหนดให้

สำนักงาน ก.ล.ต. มีอำนาจพิจารณาอนุญาตให้หนี้สินหรือภาระผูกพันรายการใดเป็นหนี้สินพิเศษ เป็นรายกรณีนั้น ทำให้เงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจสอดคล้องความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจ อย่างแท้จริงและทันแก่สถานการณ์ โดยรองรับหนี้สินหรือภาระผูกพันที่ผู้ประกอบธุรกิจได้แยก ทรัพย์สินไว้รองรับการชำระหนี้สินหรือภาระผูกพันดังกล่าวอย่างครบถ้วนตลอดเวลา

6. ผู้เกี่ยวข้อง/บุคคลที่อาจได้รับผลกระทบ และผลกระทบที่อาจเกิดขึ้น

ผู้เกี่ยวข้อง	ผลกระทบเชิงบวก	ผลกระทบเชิงลบ
1. ผู้ประกอบธุรกิจ	<ul style="list-style-type: none"> - อัตรา haircut เหมาะสมสอดคล้องกับความผันผวนของตราสารนั้น ๆ รวมทั้งครอบคลุมการมีฐานะในตราสารประเภทใหม่ ช่วยให้มีความเสี่ยง และสร้างความน่าเชื่อถือในอุตสาหกรรม - มีความยืดหยุ่นมากขึ้นในการใช้ qualified sub-debt ในการเพิ่มระดับ NC รวมทั้งในการพิจารณาใช้รายการหนี้สินพิเศษ ประกอบการคำนวณ NC 	การปรับปรุงนิยาม qualified sub-debt อาจทำให้ต้นทุนของเงินทุนสูงขึ้น
2. ผู้ลงทุน	<ul style="list-style-type: none"> - ผู้ประกอบธุรกิจมีสินทรัพย์เพียงพอชำระภาระผูกพันที่มีต่อผู้ลงทุน - ได้รับความคุ้มครองและมีความเชื่อมั่นต่อผู้ประกอบธุรกิจ 	-

แบบสำรวจความคิดเห็น

เรื่อง ร่างประกาศเกี่ยวกับการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ข้อมูลทั่วไป

ชื่อผู้ตอบ _____ ตำแหน่ง _____

ชื่อบริษัท _____

โทรศัพท์ _____ โทรสาร _____

อีเมล _____

สถานะของผู้ให้ข้อคิดเห็น (ตอบได้มากกว่า 1 ข้อ)

- บริษัทหลักทรัพย์
- ผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- ผู้ลงทุน
- อื่น ๆ (ระบุ) _____

สำนักงาน ก.ล.ต. ขอข้อมูลส่วนบุคคลของท่าน โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อใช้พิจารณาประกอบการรับฟังความคิดเห็นและประโยชน์ในการติดต่อกลับเพื่อขอข้อมูลประกอบเอกสารรับฟังความคิดเห็นของท่านเพิ่มเติม โดยสำนักงาน ก.ล.ต. คำนึงถึงความสำคัญของข้อมูลและเคารพสิทธิความเป็นส่วนตัวของท่าน จึงขอให้ท่านอ่านและทำความเข้าใจนโยบายการคุ้มครองข้อมูลส่วนบุคคล privacy policy แล้วจึงพิจารณาให้ความยินยอมให้สำนักงาน ก.ล.ต.ประมวลผลข้อมูลส่วนบุคคลของท่าน

ยินยอม

ไม่ยินยอม

กรณีต้องการยกเลิกความยินยอมหรือขอใช้สิทธิ โปรดติดต่อไปที่ email: DPO@sec.or.th

กรุณาส่งแบบสำรวจความคิดเห็นกลับไป ที่ ฝ่ายนโยบายธุรกิจหลักทรัพย์ สำนักงาน ก.ล.ต.

เลขที่ 333/3 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900

โทรศัพท์ 1207 หรือ email : bhumpisuth@sec.or.th sawarin@sec.or.th

หรือ arthipha@sec.or.th

*** สำนักงาน ก.ล.ต. ขอขอบคุณท่านที่ได้ให้ความร่วมมือในการแสดงความคิดเห็นในครั้งนี้ ***

แบบสำรวจความคิดเห็น

ท่านเห็นด้วยหรือไม่กับร่างประกาศเกี่ยวกับการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในหัวข้อต่าง ๆ ตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนดมาข้างต้น ดังนี้

1. qualified sub-debt

1.1 การปรับปรุงนิยาม qualified sub-debt

เห็นด้วย

ไม่เห็นด้วย

ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม _____

1.2 การใช้ประโยชน์จาก qualified sub-debt

เห็นด้วย

ไม่เห็นด้วย

ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม _____

1.3 บทเฉพาะกาล

เห็นด้วย

ไม่เห็นด้วย

ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม _____

2. การทบทวนอัตรา haircut ด้าน position risk

2.1 รายชื่อประเทศและดัชนีหลักของกลุ่มประเทศ EM

เห็นด้วย

ไม่เห็นด้วย

ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม _____

2.2 ฐานะเงินตราต่างประเทศ

เห็นด้วย

ไม่เห็นด้วย

ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม _____

3. การกำหนดอัตรา haircut ด้าน position risk สำหรับตราสารประเภทใหม่

3.1 หุ้นที่ซื้อขายใน LiVE Exchange

เห็นด้วย

ไม่เห็นด้วย

ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม _____

3.2 DR

เห็นด้วย

ไม่เห็นด้วย

ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม _____

4. การปรับปรุงนิยามหนี้สินพิเศษ

เห็นด้วย

ไม่เห็นด้วย

ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม _____

5. อื่น ๆ

ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม _____