

**การขออนุญาตถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าจำนวนที่กำหนด  
ในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Position Exemption)**

**การขออนุญาตเพื่อถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าจำนวนที่กำหนด**

ตลาดอนุพันธ์อาจพิจารณาอนุญาตให้มีการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าจำนวนที่กำหนดในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในกรณี ดังต่อไปนี้

1. กรณีการบริหารความเสี่ยง หมายถึงกรณีที่บุคคลประสงค์จะถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าจำนวนที่กำหนดในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อวัตถุประสงค์ในการลดความเสี่ยง (Risk Reduction)
2. กรณีบัญชีแบบไม่เปิดเผยชื่อ (Omnibus Account) หมายถึงกรณีที่เจ้าของบัญชีซื้อขายเป็นผู้ดำเนินการสั่งซื้อขายเพื่อบุคคลอื่นหลายรายหรือหลายทอดผ่านบัญชีแบบไม่เปิดเผยชื่อ (Omnibus Account) และมีความประสงค์จะให้ตลาดอนุพันธ์พิจารณาจำนวนสูงสุดในการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือ Position Limit ที่ระดับบัญชีลูกค้า (End Clients)
3. กรณีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน หมายถึงกรณีที่บัญชีซื้อขายของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนประสงค์จะถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าที่กำหนดเนื่องจากการซื้อขายเพื่อบัญชีกองทุนที่อยู่ภายใต้การจัดการของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนนั้นๆ
4. กรณีอื่นๆตามที่ตลาดอนุพันธ์กำหนด

**วิธีการขออนุญาต**

1. ผู้ประสงค์จะถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าจำนวนที่กำหนด ต้องยื่นคำขอต่อตลาดอนุพันธ์ก่อนที่จะมีฐานะการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใกล้เคียงตามจำนวนที่ตลาดอนุพันธ์กำหนดในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Position Limit)
2. ยื่นคำขอโดยใช้แบบคำขอถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าจำนวนที่กำหนดในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (เอกสารแนบ 1 - Form PE-1) และแบบรับรองตนเอง (เอกสารแนบ 2 - Form PE-2) พร้อมเอกสารหลักฐานประกอบการพิจารณาเพื่อพิสูจน์ถึงเหตุผลและความจำเป็นในการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าจำนวนที่กำหนด
3. ยื่นคำขอผ่านสมาชิกของตลาดอนุพันธ์ โดยให้สมาชิกให้คำรับรองและแสดงความเห็นเกี่ยวกับบัญชีซื้อขายตามในแบบคำขอ ตามที่ตลาดอนุพันธ์กำหนด

**เอกสารประกอบการพิจารณาอนุญาต**

ผู้ยื่นคำขอมิหน้ที่ยื่นข้อมูลและเอกสารหลักฐานเพื่อแสดงให้ตลาดอนุพันธ์พิจารณาถึงเหตุผลและความจำเป็นในการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าจำนวนที่กำหนด ทั้งนี้ ข้อมูลและเอกสารดังกล่าว ได้แก่ รายการทรัพย์สินหรือหนี้สินที่ถือครองหรือที่อยู่ในภายใต้การจัดการ จำนวนหรือรายละเอียดของลูกค้าหรือกองทุนที่อยู่ในภายใต้การจัดการ ความสัมพันธ์ระหว่างทรัพย์สินหรือหนี้สินที่ถือครองกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทีประสงค์จะถือครอง เป็นต้น

## การพิจารณาอนุญาต

1. เมื่อตลาดอนุพันธ์พิจารณาแบบคำขอแล้ว เห็นว่าต้องการข้อมูลหรือเอกสารประกอบการพิจารณาเพิ่มเติม ตลาดอนุพันธ์อาจร้องขอข้อมูลเพิ่มเติมของผู้ยื่นคำขอผ่านสมาชิกได้และในการพิจารณาอนุญาตนั้น ตลาดอนุพันธ์อาจกำหนดเงื่อนไขเพิ่มเติมให้ผู้ยื่นคำขอปฏิบัติตามที่เห็นควร
2. ตลาดอนุพันธ์จะแจ้งผลการพิจารณาให้ทราบภายใน 7 วันทำการนับจากวันที่ได้รับข้อมูลหรือเอกสารหลักฐานที่ตลาดร้องขอครบถ้วนถูกต้อง โดยจะมีหนังสือแจ้งผ่านไปยังสมาชิกที่ยื่นคำขอ
3. ในการขออนุญาต ผู้ยื่นคำขออาจจะระบุจำนวนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่จะถือครองในบัญชี อย่างไรก็ตาม ตลาดอนุพันธ์อาจพิจารณากำหนดระยะเวลาและจำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุดให้แก่ผู้ยื่นคำขอต่างไปจากที่ร้องขอ
4. ตลาดอนุพันธ์อาจพิจารณาทบทวนจำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุดที่ได้อนุญาตให้แก่ผู้ยื่นคำขอแล้วในภายหลังได้

## หน้าที่ของผู้ได้รับอนุญาตให้ถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าจำนวนที่กำหนด

1. ปฏิบัติตามข้อบังคับ วิธีปฏิบัติ หนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดอนุพันธ์รวมถึงเงื่อนไขอื่นๆ ทุกประการที่ตลาดอนุพันธ์กำหนดหรืออาจกำหนดเพิ่มเติมในอนาคต
2. ในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อสร้างหรือล้างฐานะ ต้องดำเนินการอย่างระมัดระวังเพื่อไม่ให้หรืออาจทำให้ปริมาณหรือราคาของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเปลี่ยนแปลงหรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด
3. รายงานข้อมูลตามแบบคำขออนุญาตถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าจำนวนที่กำหนดในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและภายในระยะเวลาที่กำหนดในแบบคำขอ

## หน้าที่ของสมาชิก

1. ติดตามให้ผู้ที่ได้รับอนุญาตปฏิบัติหน้าที่และส่งข้อมูลตามที่ตลาดอนุพันธ์กำหนด
2. รายงานต่อตลาดอนุพันธ์ หากพบว่ามี การเปลี่ยนแปลงอย่างมีนัยสำคัญของบัญชีซื้อขายที่ขออนุญาตดังกล่าว อันอาจกระทบต่อความสามารถในการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ยื่นขออนุญาต

## การทบทวนเปลี่ยนแปลงจำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ได้อนุญาต

ตลาดอนุพันธ์จะทำการทบทวนข้อมูลและรายงานของผู้ที่ได้รับอนุญาตให้ถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกินกว่าจำนวนที่กำหนดเป็นระยะ และอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงจำนวนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อนุญาตให้ถือครองได้ โดยตลาดอนุพันธ์จะแจ้งการเปลี่ยนแปลงดังกล่าวพร้อมเหตุผลเป็นหนังสือ ทั้งนี้ ผู้ที่ได้รับอนุญาตต้องดำเนินการล้างฐานะจำนวนที่เป็นส่วนต่างให้เสร็จสิ้นภายใน 5 วันทำการ ยกเว้นได้รับอนุญาตจากตลาดอนุพันธ์