

การทำสัญญาป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน (FX/THB Hedging)

ผู้ที่มีความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน (เช่น ผู้ส่งออก ผู้นำเข้า) สามารถทำสัญญาป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน โดยใช้ตราสารอนุพันธ์เป็นเครื่องมือป้องกันความเสี่ยง เช่น Forward, Swap และ Option

หลักเกณฑ์การทำสัญญาป้องกันความเสี่ยง (สัญญา)

- ต้องทำกับ ธพ. ในประเทศ
- ลูกค้าน่าต้องมีรายจ่ายหรือรายรับ FX ในอนาคต (underlying) เช่น เงินที่จะได้รับจากค่าของส่งออก และเงินที่จะชำระภาระในต่างประเทศ

Trade Date

- ในวันที่ทำสัญญา (trade date) ให้ลูกค้าแสดงเอกสาร underlying^{1/} ต่อ ธพ. หรือสามารถใช้ประมาณการค่าสินค้า/บริการ ที่มีระยะเวลาไม่เกิน 1 ปี ในการเข้าทำสัญญา

Settlement Date

- ให้ลูกค้ารับมอบ/ส่งมอบ FX ตามสัญญา
- ให้สามารถ ต่ออายุสัญญา (rollover) หรือยกเลิก (unwind) ธุรกรรมดังกล่าวได้ ตามเกณฑ์ที่กำหนด โดยชำระหรือรับชำระส่วนต่างเป็นสกุลเงินบาท
- กรณีรับมอบ FX ดังกล่าวเพื่อฝากเข้าบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ (FCD) สามารถทำได้โดยแสดงเอกสารหลักฐาน underlying ที่เกี่ยวข้อง

กรณีการทำสัญญาป้องกันความเสี่ยงที่ไม่เกี่ยวกับสกุลเงินบาท (FX/FX)

ลูกค้าสามารถทำได้เสรี โดยไม่ต้องแสดงเอกสารหลักฐาน

1/ เอกสารแสดงภาระ FX ที่ต้องชำระ เช่น ใบเรียกเก็บเงินค่าสินค้า/บริการ สัญญาซื้อขายหรือลงทุน หรือเอกสารที่แสดงว่ามีเงินได้ FX ในอนาคต