

-ร่าง-

## ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. /๒๕๖๗

เรื่อง หลักเกณฑ์ในรายละเอียดเกี่ยวกับการติดต่อและ

ให้บริการลูกค้าสำหรับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์

และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(ฉบับที่ )

อาศัยอำนาจตามความในข้อ ๕ (๑) ประกอบกับข้อ ๑๒ วรรคหนึ่ง (๓) และ (๑๒) ข้อ ๑๔ ข้อ ๔๓ (๓) และข้อ ๔๔ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๓๕/๒๕๕๖ เรื่อง มาตรฐานการประกอบธุรกิจ โครงสร้างการบริหารงาน ระบบงาน และการให้บริการของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ ๖ กันยายน พ.ศ. ๒๕๕๖ และข้อ ๑๒ วรรคหนึ่ง (๘/๑) ข้อ ๓๑ (๒/๑) ข้อ ๖๗/๕ และข้อ ๖๗/๖ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. /๒๕๖๗ เรื่อง มาตรฐานการประกอบธุรกิจ โครงสร้างการบริหารงาน ระบบงาน และการให้บริการของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ฉบับที่ ) ลงวันที่ พ.ศ. ๒๕๖๗ สำนักงานออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น (๔/๑) ของข้อ ๓ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๓๕/๒๕๕๗ เรื่อง หลักเกณฑ์ในรายละเอียดเกี่ยวกับการติดต่อและให้บริการลูกค้าสำหรับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ ๑๐ พฤศจิกายน พ.ศ. ๒๕๕๗ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๓/๒๕๖๐ เรื่อง หลักเกณฑ์ในรายละเอียดเกี่ยวกับการติดต่อและให้บริการลูกค้าสำหรับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ฉบับที่ ๔) ลงวันที่ ๙ กุมภาพันธ์ พ.ศ. ๒๕๖๐

“(๔/๑) กระบวนการซื้อขายหลักทรัพย์ ให้เป็นไปตามหมวด ๔/๑”

ข้อ ๒ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น (ค/๑) ของ (๑) ในข้อ ๑๗ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๓๕/๒๕๕๗ เรื่อง หลักเกณฑ์ในรายละเอียดเกี่ยวกับการติดต่อและให้บริการลูกค้าสำหรับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ ๑๐ พฤศจิกายน พ.ศ. ๒๕๕๗

“(ค/๑) ในกรณีที่ลูกค้าเป็นผู้ประกอบธุรกิจนายหน้าต่างประเทศ ลูกค้ายินยอมที่จะแจ้งข้อมูลเกี่ยวกับระบบงานการควบคุมและติดตามให้การปฏิบัติการเป็นไปตามกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ของผู้ประกอบธุรกิจ โดยข้อมูลดังกล่าวต้องทำให้ผู้ประกอบธุรกิจมั่นใจว่าลูกค้ามีความเข้าใจและสื่อสารกฎเกณฑ์ดังกล่าวให้แก่บุคคลที่ลูกค้าซื้อขายหลักทรัพย์เพื่อบุคคลนั้น”

ข้อ ๓ ให้ยกเลิกความใน (ง) ของ (๑) ในข้อ ๑๗ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๓๕/๒๕๕๗ เรื่อง หลักเกณฑ์ในรายละเอียดเกี่ยวกับการติดต่อและให้บริการลูกค้าสำหรับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ ๑๐ พฤศจิกายน พ.ศ. ๒๕๕๗ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“(ง) ในกรณีที่ลูกค้าเป็นผู้ดำเนินการสั่งซื้อขายเพื่อบุคคลอื่นหลายรายหรือหลายทอดผ่านบัญชีแบบไม่เปิดเผยชื่อ (omnibus account) ลูกค้ายินยอมที่จะแจ้ง จัดหา และจัดทำคำชี้แจงเกี่ยวกับข้อมูลตาม (ก) (ข) (ค) และ (ค/๑) ของบุคคลอื่นนั้นทุกรายและทุกทอด ทั้งนี้ เฉพาะที่ลูกค้ารู้หรือควรรู้เนื่องจากการเป็นผู้ดำเนินการเช่นนั้น”

ข้อ ๔ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ ๒๔/๓ และข้อ ๒๔/๔ ในหมวด ๔/๑ กระบวนการซื้อขายหลักทรัพย์ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๓๕/๒๕๕๗ เรื่อง หลักเกณฑ์ในรายละเอียดเกี่ยวกับการติดต่อและให้บริการลูกค้าสำหรับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ ๑๐ พฤศจิกายน พ.ศ. ๒๕๕๗ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๑๓/๒๕๖๒ เรื่อง หลักเกณฑ์ในรายละเอียดเกี่ยวกับการติดต่อและให้บริการลูกค้าสำหรับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ฉบับที่ ๕) ลงวันที่ ๑๒ กุมภาพันธ์ พ.ศ. ๒๕๖๒

“ข้อ ๒๔/๓ ในการให้บริการรับคำสั่งขายหลักทรัพย์จากลูกค้า โดยหลักทรัพย์ที่ขายไม่ได้อยู่ในความครอบครองของผู้ประกอบธุรกิจ ให้ผู้ประกอบธุรกิจปฏิบัติตามหลักเกณฑ์เพิ่มเติมดังต่อไปนี้

(๑) ดำเนินการเพื่อประโยชน์ในการจำแนกประเภทของธุรกรรมการขายหลักทรัพย์ในแต่ละครั้ง ดังนี้

(ก) จัดให้มีระบบงานในการจำแนกประเภทของคำสั่งขายหลักทรัพย์ของลูกค้าในแต่ละครั้งว่าเป็นการขายชอร์ต หรือเป็นการขายหลักทรัพย์ตามคำสั่งของลูกค้าโดยลูกค้ายังไม่ได้ส่งมอบการครอบครองหลักทรัพย์นั้นให้แก่ผู้ประกอบธุรกิจในขณะที่ลูกค้ามีคำสั่งขาย

(ข) ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจมีการส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ตาม (ก) ให้แก่ผู้ประกอบธุรกิจรายอื่น ต้องจัดให้มีกระบวนการส่งคำสั่งที่ทำให้มั่นใจได้ว่าผู้ประกอบธุรกิจรายอื่นดังกล่าวทราบว่าเป็นการขายชอร์ต หรือเป็นการขายหลักทรัพย์ตามคำสั่งของลูกค้าโดยลูกค้ายังไม่ได้ส่งมอบการครอบครองหลักทรัพย์นั้นให้แก่ผู้ประกอบธุรกิจในขณะที่ลูกค้ามีคำสั่งขาย

(ค) ในการส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ตาม (ก) เข้าสู่ระบบของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ต้องจัดให้มีระบบงานในการส่งและแปลงคำสั่งเพื่อให้ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยสามารถจำแนกประเภทของคำสั่งได้ ทั้งนี้ ตามข้อบังคับหรือหลักเกณฑ์ที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนด

(๒) จัดให้มีหลักฐานหรือเอกสารเพื่อยืนยันว่า

(ก) กรณีที่ลูกค้ามีคำสั่งขายชอร์ต

๑. หากลูกค้าไม่ได้ยึดหลักทรัพย์ไว้เพื่อการส่งมอบก่อนส่งคำสั่งขาย ผู้ประกอบธุรกิจได้ดำเนินการให้ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการยืมและให้ยึดหลักทรัพย์เป็นผู้จัดหาหลักทรัพย์เพื่อให้ลูกค้าดังกล่าวยืม หรือจัดหาแหล่งยืมหลักทรัพย์ไว้ให้พร้อมสำหรับลูกค้าดังกล่าวในฐานะเป็นตัวแทนของลูกค้าแล้ว

๒. หากลูกค้าได้ยึดหลักทรัพย์ไว้เพื่อการส่งมอบแล้ว ต้องยืนยันได้ว่าเป็นการยืมหลักทรัพย์จากแหล่งยืมที่แน่นอนและน่าเชื่อถือ และในกรณีที่ลูกค้าฝากหลักทรัพย์ที่ยึดไว้กับผู้รับฝากหลักทรัพย์ ต้องแสดงได้ว่าลูกค้ามีหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบอย่างครบถ้วนก่อนส่งคำสั่งขาย

(ข) กรณีที่ลูกค้ามีคำสั่งขายหลักทรัพย์โดยลูกค้ายังไม่ได้ส่งมอบการครอบครองหลักทรัพย์นั้นให้แก่ผู้ประกอบธุรกิจ ต้องยืนยันได้ว่าลูกค้ามีหลักทรัพย์ของตนเองอย่างครบถ้วนก่อนส่งคำสั่ง ไม่ว่าจะหลักทรัพย์นั้นจะอยู่ในความครอบครองของลูกค้า หรือฝากไว้กับผู้ประกอบธุรกิจรายอื่น หรือผู้รับฝากหลักทรัพย์รายใด

(๓) ในกรณีที่ลูกค้ามีคำสั่งขายชอร์ต ให้ผู้ประกอบธุรกิจแจ้งให้ลูกค้าทราบทันทีเมื่อคำสั่งขายหลักทรัพย์ของลูกค้าได้รับการยืนยันจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยแล้ว และดำเนินการให้ลูกค้ายืนยันไปยังผู้ให้ยืมหลักทรัพย์ดังกล่าวเพื่อให้ผู้ประกอบธุรกิจสามารถส่งมอบหลักทรัพย์ตามรายการที่ขายชอร์ตภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือภายในระยะเวลาที่คู่สัญญาซื้อขายหลักทรัพย์ตกลงกัน แล้วแต่กรณี

(๔) ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจรับคำสั่งขายหลักทรัพย์ตาม (๒) (ก) หรือ (ข) จากผู้ประกอบธุรกิจนายหน้าต่างประเทศ ให้ผู้ประกอบธุรกิจดำเนินการเพิ่มเติมดังนี้

(ก) จัดให้มีหลักฐานหรือเอกสารจากผู้ประกอบธุรกิจนายหน้าต่างประเทศเพื่อยืนยันว่าบุคคลที่มอบหมายให้ส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ได้ปฏิบัติเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องรวมถึงมีหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบแล้วก่อนบุคคลนั้นจะส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์

(ข) จัดให้มีการติดตามและสุ่มตรวจสอบธุรกรรมการส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ตาม (๒) (ก) และ (ข) ภายหลังที่ผู้ประกอบธุรกิจได้ส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ดังกล่าวไปยังตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เพื่อให้ผู้ประกอบธุรกิจมั่นใจได้ว่าการส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ของผู้ประกอบธุรกิจนายหน้าต่างประเทศได้ปฏิบัติเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องแล้ว

ข้อ ๒๔/๔ เพื่อให้มั่นใจว่าการทำธุรกรรมของลูกค้ายอดคล้องกับปริมาณการทำธุรกรรมโดยทั่วไปของลูกค้าและความเสี่ยงต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายหลักทรัพย์ รวมถึงลักษณะการปฏิบัติงานของผู้ประกอบธุรกิจ ในกรณีที่ลูกค้ายังมีคำสั่งขายหลักทรัพย์โดยหลักทรัพย์ที่ขายไม่ได้อยู่ในความครอบครองของผู้ประกอบธุรกิจ และลูกค้าได้มีการปฏิบัติเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องแล้ว ให้ผู้ประกอบธุรกิจปฏิบัติตามหลักเกณฑ์เพิ่มเติมดังต่อไปนี้ด้วย

(๑) จัดให้มีการติดตามและสุ่มตรวจสอบธุรกรรมรวมถึงพฤติกรรมของลูกค้าในการส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ภายหลังที่ผู้ประกอบธุรกิจได้ส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ดังกล่าวไปยังตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเป็นประจำ ไม่ว่าในกรณีที่เป็นการขายชอร์ตหรือการขายหลักทรัพย์ตามคำสั่งของลูกค้า โดยลูกค้ายังไม่ได้ส่งมอบการครอบครองหลักทรัพย์นั้นให้แก่ผู้ประกอบธุรกิจ

(๒) ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจพบเหตุการณ์อันควรสงสัยว่าการปฏิบัติของลูกค้าไม่เป็นไปตามกฎหมายหรือกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องกับการขายหลักทรัพย์ ให้ผู้ประกอบธุรกิจขอหลักฐานหรือเอกสารจากลูกค้าเพื่อตรวจสอบว่าลูกค้าได้มีการปฏิบัติเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องแล้วหรือไม่

(๓) ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจพบว่าลูกค้าปฏิบัติไม่เป็นไปตามกฎหมายหรือกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องกับการขายหลักทรัพย์ ให้ผู้ประกอบธุรกิจจัดให้มีมาตรการป้องกันที่ทำให้มั่นใจได้ว่าจะไม่ปรากฏเหตุการณ์ในลักษณะดังกล่าวอีก

(๔) ให้ผู้ประกอบการธุรกิจรายงานการดำเนินการตาม (๑) (๒) และ (๓) ต่อคณะกรรมการบริษัทของผู้ประกอบธุรกิจ และจัดเก็บเอกสารหลักฐานดังกล่าวเป็นระยะเวลาอย่างน้อย ๕ ปีนับแต่วันที่มีการดำเนินการ ทั้งนี้ในระยะเวลา ๒ ปีแรกต้องจัดเก็บในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงานเรียกดูหรือตรวจสอบได้ทันที”

ข้อ ๕ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ เป็นต้นไป  
ประกาศ ณ วันที่

(นางพรอนงค์ บุชราตระกูล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์