

- ร่าง -

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. /๒๕๖๗

เรื่อง หลักเกณฑ์ในรายละเอียดเกี่ยวกับการให้บริการสำหรับ

ผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจ

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(ฉบับที่)

อาศัยอำนาจตามความในข้อ ๕ (๑) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๓๕/๒๕๕๖ เรื่อง มาตรฐานการประกอบธุรกิจ โครงสร้างการบริหารงาน ระบบงาน และการให้บริการของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ ๖ กันยายน พ.ศ. ๒๕๕๖ ประกอบกับข้อ ๑๑ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๓๕/๒๕๕๖ เรื่อง มาตรฐานการประกอบธุรกิจ โครงสร้างการบริหารงาน ระบบงาน และการให้บริการของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ ๖ กันยายน พ.ศ. ๒๕๕๖ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๗๑/๒๕๖๓ เรื่อง มาตรฐานการประกอบธุรกิจ โครงสร้างการบริหารงาน ระบบงาน และการให้บริการของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ฉบับที่ ๑๔) ลงวันที่ ๔ ธันวาคม พ.ศ. ๒๕๖๓ และข้อ ๑๒ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๓๕/๒๕๕๖ เรื่อง มาตรฐานการประกอบธุรกิจ โครงสร้างการบริหารงาน ระบบงาน และการให้บริการของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ ๖ กันยายน พ.ศ. ๒๕๕๖ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๖/๒๕๖๐ เรื่อง มาตรฐานการประกอบธุรกิจ โครงสร้างการบริหารงาน ระบบงาน และการให้บริการของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ฉบับที่ ๗) ลงวันที่ ๙ กุมภาพันธ์ พ.ศ. ๒๕๖๐ สำนักงานออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ให้ยกเลิกความในข้อ ๖ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๑๔/๒๕๖๒ เรื่อง หลักเกณฑ์ในรายละเอียดเกี่ยวกับการให้บริการสำหรับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ ๑๒ กุมภาพันธ์ พ.ศ. ๒๕๖๒ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ ๖ ในการบริหารและจัดการความเสี่ยง ผู้ประกอบธุรกิจต้องกำหนดนโยบายหรือระเบียบวิธีปฏิบัติในการบริหารและจัดการความเสี่ยงด้านต่าง ๆ ที่เกิดจากการประกอบธุรกิจให้สอดคล้องกับลักษณะและระดับความเสี่ยง ลักษณะการดำเนินธุรกิจ หรือแผนกลยุทธ์ของผู้ประกอบธุรกิจ โดยอย่างน้อยต้องครอบคลุมถึงเรื่องดังต่อไปนี้

(๑) การประเมินความเสี่ยง ได้แก่ การระบุความเสี่ยง การวิเคราะห์ความเสี่ยง และการประเมินค่าความเสี่ยง

(๒) การจัดการกับความเสี่ยง

(๓) การติดตามและทบทวนความเสี่ยง

(๔) การรายงานผลการบริหารความเสี่ยง โดยต้องรายงานต่อคณะกรรมการของผู้ประกอบธุรกิจหรือคณะกรรมการที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการของผู้ประกอบธุรกิจ

ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจมีการประกอบกิจการอื่นตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการประกอบกิจการอื่นที่มีใช้ธุรกิจหลักทรัพย์ในประเภทที่ได้รับอนุญาตของบริษัทหลักทรัพย์หรือประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการประกอบกิจการอื่นของผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า แล้วแต่กรณี ผู้ประกอบธุรกิจต้องจัดให้นโยบายหรือระเบียบวิธีปฏิบัติตามวรรคหนึ่งครอบคลุมถึงการบริหารและจัดการความเสี่ยงเพื่อป้องกันไม่ให้เกิดการประกอบกิจการอื่นส่งผลกระทบต่อลูกค้าของธุรกิจ หรือก่อให้เกิดความเสี่ยงต่อการประกอบธุรกิจ (business risk) หรือความเสี่ยงต่อความน่าเชื่อถือหรือชื่อเสียงของธุรกิจ (reputation risk) ด้วย

ในการกำหนดนโยบายหรือระเบียบวิธีปฏิบัติตามวรรคหนึ่งและวรรคสอง ผู้ประกอบธุรกิจต้องจัดทำเป็นลายลักษณ์อักษรและได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการของผู้ประกอบธุรกิจ และต้องจัดให้มีการให้ความรู้และคำแนะนำแก่บุคคลที่เกี่ยวข้องเพื่อให้บุคคลดังกล่าวเข้าใจและสามารถปฏิบัติ

ตามหลักเกณฑ์ได้อย่างถูกต้อง รวมทั้งพิจารณาทบทวนความมีประสิทธิภาพและความเหมาะสม
ของนโยบายหรือระเบียบวิธีปฏิบัติอย่างน้อยปีละ ๑ ครั้ง หรือเมื่อมีเหตุการณ์ใด ๆ ที่อาจส่งผลกระทบต่อ
ต่อการประกอบธุรกิจอย่างมีนัยสำคัญ”

ข้อ ๒ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่
ประกาศ ณ วันที่

เป็นต้นไป

(นางพรอนงค์ บุชราตระกูล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์