

-ร่าง-

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทธ. /25..

เรื่อง หลักเกณฑ์ในการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขาย

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 55 และมาตรา 73 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ เป็นต้นไป
เว้นแต่ข้อ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ เป็นต้นไป

ข้อ 2 ในประกาศนี้

“ศูนย์ซื้อขายสัญญา” หมายความว่า ศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“สำนักหักบัญชีสัญญา” หมายความว่า สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“สำนักหักบัญชี” หมายความว่า สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ตลาดหลักทรัพย์” หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ผู้รับประโยชน์จากการซื้อขายสัญญาของลูกค้า” หมายความว่า

- (1) ผู้รับประโยชน์หรือร่วมรับประโยชน์จากการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า
- (2) ผู้มีอำนาจควบคุมการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า หรือ
- (3) ผู้ให้การสนับสนุนทางการเงินแก่ลูกค้าเพื่อประโยชน์ในการซื้อขายหรือการชำระหนี้ที่เกี่ยวกับหรือเนื่องจากการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า

การรับประโยชน์ การควบคุม หรือการสนับสนุนทางการเงินตามวรรคหนึ่งอาจเกิดขึ้นจากข้อตกลง ความเข้าใจ ความสัมพันธ์ในด้านใดด้านหนึ่งหรือโดยประการอื่นก็ได้

“ผู้บริหาร” หมายความว่า ผู้จัดการ รองผู้จัดการ ผู้ช่วยผู้จัดการ ผู้อำนวยการฝ่ายหรือผู้ซึ่งดำรงตำแหน่งเทียบเท่าที่เรียกชื่ออย่างอื่น และให้หมายความรวมถึงบุคคลที่ได้ทำสัญญาให้มีอำนาจทั้งหมดหรือบางส่วนในการจัดการด้วย

“สมาชิก” หมายความว่า นิติบุคคลที่เป็นสมาชิกของศูนย์ซื้อขายสัญญา

ข้อ 3 เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามประกาศนี้ สำนักงาน ก.ล.ต. อาจกำหนดหลักเกณฑ์หรือแนวทางดังต่อไปนี้

(1) กำหนดหลักเกณฑ์ในรายละเอียดของข้อกำหนดตามประกาศนี้ให้มีความชัดเจนเพียงพอที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาจะสามารถปฏิบัติตามประกาศนี้ได้ในแนวทางเดียวกัน

(2) กำหนดแนวทางการปฏิบัติ (guideline) ในรายละเอียดของข้อกำหนดตามประกาศนี้เพื่อเป็นการให้แนวทางปฏิบัติที่ถือว่าเหมาะสมและสอดคล้องตามประกาศนี้ และหากศูนย์ซื้อขายสัญญาปฏิบัติตามแนวทางดังกล่าวแล้ว ให้ถือว่าศูนย์ซื้อขายสัญญามีการปฏิบัติตามข้อกำหนดในประกาศนี้ในเรื่องที่มีการออกแนวทางนั้น

(3) เพื่อให้สำนักงาน ก.ล.ต. สามารถติดตามการปฏิบัติตามประกาศนี้ได้ ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญายื่นรายงานหรือแสดงเอกสารใดตามระยะเวลาหรือเป็นครั้งคราวต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายในระยะเวลาที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด

ข้อ 4 ประกาศนี้มีข้อกำหนดในการกำกับดูแลผู้ประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) หลักเกณฑ์ทั่วไปในการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญา โดยมีรายละเอียดตามหมวด 1

(2) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ และการทดสอบและติดตามประสิทธิภาพของการปฏิบัติงาน โดยมีรายละเอียดตามหมวด 2

(3) การเก็บรักษาข้อมูลและเอกสาร โดยมีรายละเอียดตามหมวด 3

หมวด 1

หลักเกณฑ์ทั่วไปในการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญา

ข้อ 5 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีแหล่งเงินทุนที่เพียงพอต่อการรองรับการประกอบการและความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ที่อาจเกิดจากการประกอบธุรกิจ โดยแหล่งเงินทุนส่วนที่มีไว้เพื่อรองรับความเสี่ยงต้องสามารถนำไปใช้ได้อย่างรวดเร็วและทันต่อเหตุการณ์

ข้อ 6 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีระบบการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยสำนักหักบัญชีสัญญาที่ดำเนินการโดยศูนย์ซื้อขายสัญญาเองหรือโดยบุคคลอื่น ทั้งนี้ ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องรับประกันการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยทันทีที่เกิดการซื้อขายขึ้นและจะสิ้นความผูกพันต่อเมื่อนักหักบัญชีสัญญาได้เข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญากับผู้ซื้อและผู้ขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแล้ว ในการนี้ ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาแจ้งข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่สำนักหักบัญชีสัญญาโดยเร็วภายหลังจากที่เกิดรายการซื้อขายขึ้น

ข้อ 7 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีมาตรการที่เพียงพอเพื่อส่งเสริมและรักษามาตรฐานในเรื่องความมั่นคง ความน่าเชื่อถือ ตลอดจนความ โปร่งใสและเป็นธรรมในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ดังต่อไปนี้

(1) มีระบบการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่สามารถรองรับปริมาณการซื้อขายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น รวมทั้งสามารถขยายให้รองรับการซื้อขายที่อาจเพิ่มขึ้นในอนาคตได้ โดยต้องเปิดเผยหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติในการจัดลำดับและการจับคู่คำสั่งซื้อขายด้วย

(2) มีระบบบันทึกข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าซึ่งรวมทั้งข้อมูลก่อนทำรายการซื้อขาย (pre-trade information) และข้อมูลภายหลังทำรายการซื้อขาย (post-trade information) เพื่อประโยชน์ในการติดตามและตรวจสอบการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในภายหลัง (audit trail)

(3) มีระบบติดตามและตรวจสอบสภาพการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในศูนย์ซื้อขายสัญญาที่มีประสิทธิภาพ โดยอย่างน้อยต้อง

(ก) มีการบันทึกข้อมูลที่สามารถระบุความมีตัวตนที่แท้จริง (unique identification) ของลูกค้าและผู้รับประโยชน์จากการซื้อขายสัญญาของลูกค้าให้ตรงตามความเป็นจริงและเป็นปัจจุบัน โดยอาจบันทึกเป็นหมายเลขประจำตัวประชาชน เลขทะเบียนนิติบุคคล หรือเลขหมายอื่นใดที่ศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด

(ข) มีระบบประมวลฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกและลูกค้าแต่ละราย เพื่อประโยชน์ในการติดตามฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของบุคคลดังกล่าว

(ค) มีระบบติดตามและรายงานข้อมูลเกี่ยวกับฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกและลูกค้าที่มีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าถึงระดับที่ศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด (large trader) รวมทั้งการเปลี่ยนแปลงฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของบุคคลดังกล่าว

(ง) มีระบบติดตามและตรวจสอบสภาพการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นปัจจุบัน (real time)

ข้อ 8 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีมาตรการที่เพียงพอในการป้องกันและยับยั้งการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและพฤติกรรมการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ไม่เหมาะสม โดยอย่างน้อยต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) มีกฎเกณฑ์ที่ให้อำนาจศูนย์ซื้อขายสัญญาในการดำเนินการเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทั้งที่สมาชิกกระทำเพื่อตนเองและเพื่อลูกค้า

(ก) สั่งงดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เว้นแต่เป็นการซื้อขายเพื่อล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(ข) สั่งล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(ค) สั่งจำกัดฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(ง) สั่งจำกัดปริมาณการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(2) มีข้อกำหนดให้สมาชิกต้องจัดให้มีหนังสือแสดงความยินยอมของลูกค้าที่แต่งตั้งให้สมาชิกเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยลูกค้าตกลงที่จะแจ้งและจัดหาข้อมูลที่สามารถระบุความมีตัวตนที่แท้จริงของลูกค้าและผู้รับประโยชน์จากการซื้อขายสัญญาของลูกค้าให้แก่สมาชิก รวมทั้งยินยอมให้สมาชิกจัดส่งข้อมูลดังกล่าวแก่ศูนย์ซื้อขายสัญญาและสำนักงาน ก.ล.ต. ตลอดจนยินยอมให้สมาชิกงดให้บริการในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแก่ลูกค้าเป็นการชั่วคราว บิดบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า จำกัดฐานะหรือปริมาณการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าได้ ทั้งนี้ เพื่อให้เป็นไปตามคำสั่งของศูนย์ซื้อขายสัญญา

(3) มีกฎเกณฑ์ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาสามารถเปิดเผยหรือแลกเปลี่ยนข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาชิก การกระทำความผิดและการลงโทษสมาชิก รวมตลอดถึงข้อมูลอื่นใดที่ได้รับเนื่องจากการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญากับสำนักหักบัญชีสัญญา ตลาดหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชี สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย สำนักงาน ก.ล.ต. ธนาคารแห่งประเทศไทย และองค์กรอื่นที่ติดตามตรวจสอบสินค้าหรือตัวแปร ทั้งนี้ เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สินค้า หรือตัวแปร

ข้อ 9 ในกรณีที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาให้บริการให้เช่าพื้นที่วางเซิร์ฟเวอร์ (server) แก่สมาชิกของศูนย์ซื้อขายสัญญา เพื่อให้สามารถรับส่งข้อมูลหรือคำสั่งซื้อขายได้อย่างรวดเร็ว (co-location) หรือให้บริการข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย (market data feed) ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องให้ข้อมูลเกี่ยวกับการให้บริการและโอกาสในการใช้บริการ ตลอดจนเงื่อนไขการให้บริการดังกล่าวแก่สมาชิกทุกรายอย่างทั่วถึงและเป็นธรรม

ข้อ 10 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีระบบการบันทึกและเผยแพร่ข้อมูลเกี่ยวกับการเสนอราคาและการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างมีประสิทธิภาพ โดยอย่างน้อยต้องมีระบบการบันทึกและเผยแพร่ข้อมูลดังต่อไปนี้เป็นการทั่วไปโดยแยกเป็นรายสัญญา

- (1) การเสนอราคาและปริมาณการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (2) ราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้มีการซื้อขายกัน
- (3) ปริมาณการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (4) ฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ยังคงค้างอยู่ (open interest)

ข้อ 11 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องจัดให้มีระบบการจัดการเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทที่เกิดขึ้นเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือเกิดจากการใช้บริการที่จัดโดยศูนย์ซื้อขายสัญญาที่มีประสิทธิภาพ โดยอย่างน้อยต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

- (1) จัดให้มีระเบียบปฏิบัติที่เป็นลายลักษณ์อักษรเกี่ยวกับการจัดการข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท
- (2) จัดให้มีหน่วยงานหรือบุคลากรที่มีหน้าที่รับผิดชอบเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท
- (3) จัดให้มีการติดตามตรวจสอบและแจ้งผลการพิจารณาข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทให้ผู้ร้องเรียนหรือคู่พิพาททราบ
- (4) จัดทำรายงานสรุปข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ทุก 6 เดือน ในกรณีที่น่าสงสัยว่ามีข้อเท็จจริงเพียงพอที่จะแสดงให้เห็นได้ว่าผู้ร้องเรียนหรือคู่พิพาทได้รับหรืออาจได้รับความเสียหายจากการร้องเรียนหรือการมีข้อพิพาทนั้น ทั้งนี้ ในรายงานดังกล่าวต้องมีบทสรุปสาระสำคัญ และผลการพิจารณาหรือการดำเนินการของศูนย์ซื้อขายสัญญาในแต่ละกรณี

ข้อ 12 การใดที่มีได้มีกฎหมายหรือกฎเกณฑ์กำหนดไว้เป็นการเฉพาะให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องดำเนินการด้วยตนเอง หากมีความจำเป็นเพื่อให้การประกอบธุรกิจมีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น ศูนย์ซื้อขายสัญญาอาจใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกได้ โดยต้องมั่นใจว่าผู้ให้บริการภายนอกได้ปฏิบัติตามกฎหมายและกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง และการใช้บริการนั้นไม่มีผลเสมือนเป็นการไม่ประกอบธุรกิจในการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องกำหนดอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) นโยบาย ขอบเขต และลักษณะงานที่จะใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก เป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องได้รับความเห็นชอบเป็นการทั่วไปหรือเป็นรายการฉกฉกรรณการของศูนย์ซื้อขายสัญญา หรือคณะทำงานที่คณะกรรมการดังกล่าวมอบหมาย

(2) มาตรการในการบริหารจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกที่เหมาะสมและมีประสิทธิภาพ

(3) มาตรการตรวจสอบการให้บริการของผู้ให้บริการภายนอกที่มีประสิทธิภาพ เพื่อให้การปฏิบัติงานของผู้ให้บริการภายนอกเป็นไปตามวัตถุประสงค์ของศูนย์ซื้อขายสัญญาความในวรรคสองมิให้นำมาใช้บังคับกับกรณีที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาเป็นบริษัทที่ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้นเกินกว่าร้อยละ 50 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น และได้มอบหมายให้ตลาดหลักทรัพย์หรือบริษัทที่ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้นเกินกว่าร้อยละ 50 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น เป็นผู้ให้บริการภายนอกตามวรรคหนึ่ง

ข้อ 13 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีหลักเกณฑ์ในการรับสมาชิกที่โปร่งใสและเป็นธรรม โดยการกำหนดหลักเกณฑ์ดังกล่าวต้องคำนึงถึงความเหมาะสม ฐานะทางการเงิน ผลการดำเนินงาน ความพร้อม ความสามารถและจรรยาบรรณในการประกอบธุรกิจของผู้ที่จะเป็นสมาชิกเป็นสำคัญ

ข้อ 14 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีกฎเกณฑ์ที่ใช้บังคับกับสมาชิก มีมาตรการในการกำกับดูแลให้สมาชิกและผู้ปฏิบัติงานให้กับสมาชิกปฏิบัติตามกฎเกณฑ์และจรรยาบรรณในการประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และมีมาตรการดำเนินการต่อบุคคลที่ฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ และจรรยาบรรณดังกล่าว ทั้งนี้ ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องประเมินการปฏิบัติตามกฎเกณฑ์และจรรยาบรรณของบุคคลดังกล่าวในช่วงเวลาที่เหมาะสม พร้อมทั้งจัดทำรายงานผลการประเมินและการดำเนินการต่อบุคคลที่ฝ่าฝืนกฎเกณฑ์และจรรยาบรรณเพื่อยื่นต่อสำนักงาน ก.ล.ต. เมื่อมีการร้องขอ

ข้อ 15 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องเผยแพร่กฎเกณฑ์และข่าวสารต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาให้แก่สมาชิกหรือผู้ที่เกี่ยวข้องกับศูนย์ซื้อขายสัญญาทราบ

ข้อ 16 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีมาตรการที่เพียงพอในการป้องกันมิให้กรรมการผู้บริหาร อนุกรรมการ ที่ปรึกษา พนักงาน ลูกจ้างหรือผู้ปฏิบัติงานให้แก่ศูนย์ซื้อขายสัญญา แสวงหาประโยชน์โดยมิชอบจากข้อมูลที่ได้รับจากการปฏิบัติหน้าที่ และมีมาตรการที่เพียงพอในการรักษาความลับของสมาชิกและลูกค้า

ข้อ 17 เพื่อพิทักษ์ประโยชน์ของประชาชนและเพื่อคุ้มครองผู้ลงทุน ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาชิก การกระทำความผิด และการลงโทษสมาชิก รวมตลอดถึงข้อมูลอื่นใดที่ได้รับเนื่องจากการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญา ซึ่งเป็นข้อมูลที่เป็นสาระสำคัญต่อการตัดสินใจซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของผู้ลงทุนหรือการทำธุรกรรมกับสมาชิก โดยการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวต้องกระทำในลักษณะที่ทันต่อเหตุการณ์ มีข้อมูลเพียงพอ และผู้ลงทุนทั่วไปมีโอกาสได้รับข้อมูลอย่างเท่าเทียมกัน ทั้งนี้ ประเภทของข้อมูล วิธีการ

และเงื่อนไขในการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวให้เป็นไปตามที่ศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด โดยความเห็นชอบของคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

หมวด 2

การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ และการทดสอบ และติดตามประสิทธิภาพของการปฏิบัติงาน

ข้อ 18 ในหมวดนี้

"ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา" หมายความว่า ระบบคอมพิวเตอร์หรือระบบเครือข่ายที่สำคัญที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามข้อ 7(1) และ (2) ซึ่งหากไม่สามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่องอาจส่งผลกระทบต่ออย่างมีนัยสำคัญต่อผู้ที่เกี่ยวข้องกับศูนย์ซื้อขายสัญญาได้

ข้อ 19 หมวดนี้มีข้อกำหนดในการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและการทดสอบและติดตามประสิทธิภาพของการปฏิบัติงานของศูนย์ซื้อขายสัญญาในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 1
- (2) การทบทวน ติดตามและตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 2
- (3) การรายงานความเปลี่ยนแปลงเกี่ยวกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา (material systems change report) โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 3
- (4) การบริหารจัดการเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย (incident management) โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 4
- (5) การรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 5

ส่วนที่ 1

การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ

ข้อ 20 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องดำเนินการให้มีความพร้อมในการใช้งานระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา โดยอย่างน้อยต้องกำหนดในเรื่องดังต่อไปนี้เป็นลายลักษณ์อักษร

(1) นโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ โดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการของศูนย์ซื้อขายสัญญา หรือคณะกรรมการตามที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าว เพื่อให้มั่นใจได้ว่าระบบดังกล่าวยังสามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่องหรือสามารถแก้ไขให้กลับมาดำเนินการต่อได้ภายในระยะเวลาที่เหมาะสม ในกรณีที่มีเหตุการณ์ที่ไม่ปกติเกิดขึ้น

(2) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องที่สอดคล้องกับนโยบายที่กำหนดขึ้นตาม (1) โดยได้รับความเห็นชอบจากผู้จัดการหรือผู้ดำรงตำแหน่งเทียบเท่าที่เรียกชื่ออย่างอื่น

ข้อ 21 การจัดทำแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องตามข้อ 20(2) ต้องมีรายการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) มาตรการรองรับเมื่อเกิดกรณีฉุกเฉินที่อาจมีผลกระทบต่อการใช้งานบริการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญา โดยกำหนดขอบเขตของกรณีฉุกเฉินให้ครอบคลุมถึงเหตุการณ์ต่าง ๆ ที่อาจเกิดขึ้นได้ รวมทั้งขั้นตอนการดำเนินการและผู้รับผิดชอบในการดำเนินการตามขั้นตอนดังกล่าวในแต่ละกรณีให้ชัดเจน

(2) รายชื่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญา

(3) การประเมินความเสี่ยงและโอกาสที่อาจทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาไม่สามารถดำเนินการต่อไปได้ รวมทั้งผลกระทบที่อาจมีต่อการดำเนินธุรกิจ (business impact analysis (BIA))

(4) ระยะเวลาที่คืนระบบงาน (recovery time objective)

(5) ข้อมูลล่าสุดที่จะกู้คืนได้ (recovery point objective)

(6) รายละเอียดของระบบงานสำรองและศูนย์สำรองที่สอดคล้องกับนโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง

ข้อ 22 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องจัดให้มีมาตรการที่มีประสิทธิภาพในการควบคุมติดตามการปฏิบัติตามนโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง และสื่อสารเรื่องดังกล่าวผ่านวิธีการที่เหมาะสมเพื่อให้สมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้องสามารถปฏิบัติตามได้อย่างมีประสิทธิภาพ

ข้อ 23 เพื่อให้การกำกับดูแลการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาดำเนินการในเรื่องดังต่อไปนี้อย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง

(1) ทดสอบแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องร่วมกับสมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้อง

(2) ประเมินผลการทดสอบแผนตาม (1) โดยผู้ที่มีความรู้ความสามารถและมีความเป็นอิสระจากผู้จัดทำหรือผู้บริหารแผนนั้น

(3) รายงานผลการทดสอบตาม (2) ต่อคณะกรรมการของศูนย์ซื้อขายสัญญา และสำนักงาน ก.ล.ต. ภายใน 90 วันนับแต่วันที่ดำเนินการทดสอบเสร็จสิ้น

ข้อ 24 ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาที่ส่งผลกระทบต่อการประกอบกิจการของศูนย์ซื้อขายสัญญา ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาทบทวน และปรับปรุงแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องโดยไม่ชักช้าเพื่อให้สอดคล้องกับการเปลี่ยนแปลงนั้น

ส่วนที่ 2

การทบทวน ติดตามและตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา

ข้อ 25 เพื่อให้การกำกับดูแลเกี่ยวกับขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานที่เกี่ยวข้องกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) ทบทวน ติดตามและตรวจสอบขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง โดยผู้ที่มีความรู้ความสามารถ และมีความเป็นอิสระ เช่น ผู้ตรวจสอบภายในหรือภายนอก (internal or external auditor) เป็นต้น และส่งรายงานผลการทบทวน ติดตามและตรวจสอบรายปีต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายในไตรมาสแรก ของปีถัดไป

(2) ทดสอบการเจาะระบบ (penetration test) ต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาให้ครบถ้วนทุกระบบงานทุก 3 ปี โดยเรียงลำดับความสำคัญตามผลการประเมิน ความเสี่ยง

ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาทดสอบการเจาะระบบตามวรรคหนึ่งเป็นประจำทุก 3 ปี นับแต่วันที่ทำการทดสอบครบถ้วนทุกระบบครั้งล่าสุด และรายงานผลการทดสอบดังกล่าวต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายในไตรมาสแรกของปีถัดจากปีที่มีการทดสอบนั้น

ส่วนที่ 3

การรายงานความเปลี่ยนแปลงเกี่ยวกับระบบ คอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญา (material systems change report)

ข้อ 26 เพื่อให้การกำกับดูแลการประกอบธุรกิจโดยรวมของศูนย์ซื้อขายสัญญา ดำเนินไปด้วยความเรียบร้อย มีประสิทธิภาพ และทันต่อเหตุการณ์ ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญารายงาน การเปลี่ยนแปลงใด ๆ ที่มีนัยสำคัญต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญา หรือระบบ ติดตามตรวจสอบสภาพการซื้อขาย (market surveillance) ต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายใน 30 วัน นับแต่วันสุดท้ายของปี

ส่วนที่ 4

การบริหารจัดการเหตุการณ์ที่อาจส่ง ผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย (incident management)

ข้อ 27 ในส่วนนี้

“เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย” หมายความว่า

- (1) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาไม่สามารถ ดำเนินการได้ตามปกติ (system disruption and system degrade)
- (2) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาไม่อาจดำเนินการ ให้เป็นไปตามกฎหมาย กฎเกณฑ์ ระเบียบ ข้อบังคับที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. คณะกรรมการกำกับตลาดทุน สำนักงาน ก.ล.ต. หรือศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด (system non-compliance)
- (3) เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญา อันเกิดจากการบุกรุก (system intrusion)

ข้อ 28 เมื่อปรากฏข้อเท็จจริงว่ามีเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย ตามข้อ 27 เกิดขึ้น ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาจัดทำบันทึกสาเหตุ สภาพการณ์ และแนวทางแก้ไขปัญหา เกี่ยวกับเหตุการณ์ดังกล่าว

ข้อ 29 เพื่อให้เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยได้รับการจัดการอย่างถูกต้องและมีประสิทธิภาพภายในระยะเวลาที่เหมาะสม ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) กำหนดและดำเนินการตามแผนรองรับในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยที่ได้กำหนดไว้เป็นลายลักษณ์อักษร

(2) จัดให้มีบุคคลหรือหน่วยงานเพื่อทำหน้าที่รับแจ้งเหตุการณ์ดังกล่าว (point of contact) และรายงานต่อผู้บริหารของศูนย์ซื้อขายสัญญาหรือผู้ที่เกี่ยวข้องเพื่อดำเนินการต่อไป (escalation procedure)

ข้อ 30 ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญารายงานเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยตามข้อ 27(1) และ (3) ต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ดังนี้

(1) รายงานทันทีที่เกิดเหตุการณ์โดยทางวาจาหรือทางจดหมายอิเล็กทรอนิกส์

(2) รายงานผลการตรวจสอบเหตุการณ์เป็นลายลักษณ์อักษร (investigation report) เมื่อเหตุการณ์นั้นได้รับการแก้ไขแล้วภายใน 30 วันนับแต่วันที่คณะกรรมการของศูนย์ซื้อขายสัญญาหรือคณะกรรมการที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าวได้รับรายงาน ทั้งนี้ ต้องไม่เกิน 90 วันนับแต่วันที่เกิดเหตุการณ์นั้น

รายงานผลการตรวจสอบตามวรรคหนึ่งต้องประกอบด้วยคำอธิบายรายละเอียดของเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยและการดำเนินงานของศูนย์ซื้อขายสัญญาและสมาชิก รวมทั้งสาเหตุที่แท้จริงของปัญหา (root cause) ขั้นตอนการดำเนินการแก้ไขปัญหาและมาตรการป้องกันเพื่อไม่ให้เกิดเหตุการณ์ในลักษณะเดียวกันนี้อีก

ข้อ 31 ในกรณีที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาไม่สามารถดำเนินการแก้ไขปัญหาเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยได้ตามระยะเวลาที่กึ่งระบบงาน (recovery time objective) ที่กำหนดไว้ในแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญารายงานความคืบหน้าในการแก้ไขปัญหาให้สำนักงาน ก.ล.ต. ทราบทุก 1 ชั่วโมงโดยทางจดหมายอิเล็กทรอนิกส์จนกว่าจะสามารถกลับมาดำเนินธุรกิจตามปกติได้

ส่วนที่ 5
การรักษาความมั่นคงปลอดภัยของ
ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ

ข้อ 32 เพื่อให้การรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศของศูนย์ซื้อขายสัญญาที่มีประสิทธิภาพ สามารถรักษาไว้ซึ่งความลับ ความถูกต้องน่าเชื่อถือของข้อมูล และความพร้อมใช้งาน ตลอดจนการติดตามวิเคราะห์ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาได้อย่างเหมาะสม ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) กำหนดนโยบายและมาตรการควบคุมการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศให้เป็นไปตามมาตรฐานที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับได้ ซึ่งนโยบายดังกล่าวต้องได้รับความเห็นชอบจากผู้จัดการหรือเทียบเท่า โดยต้องมีการทบทวนและปรับปรุงให้สอดคล้องและเหมาะสมกับความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศในปัจจุบัน

(2) ติดตามและวิเคราะห์ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาโดยบันทึกและจัดเก็บหลักฐานการใช้งาน (log) รวมถึงเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ

หมวด 3
การเก็บรักษาข้อมูลและเอกสาร

ข้อ 33 ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาเก็บรักษาข้อมูลและเอกสารให้เป็นไปตามกำหนดเวลาดังต่อไปนี้

(1) ข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าซึ่งรวมทั้งข้อมูลก่อนทำรายการซื้อขายและข้อมูลภายหลังทำรายการซื้อขายตามข้อ 7(2) ให้เก็บรักษาเป็นเวลาไม่น้อยกว่า 10 ปี นับแต่วันที่มีการบันทึกข้อมูล

(2) ข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินการตามข้อ 7(3)(ข) (ค) และ (ง) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการดำเนินการดังกล่าว

(3) เอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท และผลการพิจารณาตามข้อ 11(4) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่ข้อยุติเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทนั้น

(4) เอกสารที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการและหลักฐานการตรวจสอบการให้บริการของผู้ให้บริการภายนอกตามข้อ 12 วรรคสอง (3) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการดำเนินการนั้น

(5) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องตามข้อ 20(2) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการจัดทำแผนดังกล่าว

(6) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องที่ได้รับการแก้ไขตามข้อ 24 ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการแก้ไขแผนดังกล่าว

(7) หลักฐานการใช้งานรวมถึงเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศตามข้อ 32(2) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 90 วัน นับแต่วันที่มีการดำเนินการนั้น

ในการปฏิบัติตามข้อกำหนดใน (1) ถึง (7) ให้คณะกรรมการกำกับตลาดทุนมีอำนาจสั่งการเป็นประการอื่นได้ตามที่เห็นสมควร

การจัดเก็บข้อมูล เอกสารและหลักฐานตาม (1) ถึง (7) ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาจัดเก็บไว้ในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงาน ก.ล.ต. เรียกดูหรือตรวจสอบได้โดยเร็ว

ประกาศ ณ วันที่

(นายรพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน