

-ร่าง-

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทธ. /25..

เรื่อง หลักเกณฑ์ในการประกอบกิจการเป็นสำนักหักบัญชี

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 76 มาตรา 82 วรรคสาม และมาตรา 89 วรรคหนึ่ง ประกอบกับมาตรา 73 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 คณะกรรมการกำกับตลาดทุน ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ พ.ศ. 2559 เป็นต้นไป
เว้นแต่ข้อ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ พ.ศ. 2560 เป็นต้นไป

หมวด 1

ข้อกำหนดทั่วไป

ส่วนที่ 1

วัตถุประสงค์ในการกำกับดูแลสำนักหักบัญชีสัญญา

ข้อ 2 โดยที่ระบบการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นระบบพื้นฐานที่สำคัญ และมีความเชื่อมโยงกับระบบการซื้อขายในศูนย์ซื้อขายสัญญา ดังนั้น การกำหนดหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการกำกับดูแลการปฏิบัติงานของสำนักหักบัญชีสัญญาให้เป็นไปตามที่มาตรฐานที่องค์การระหว่างประเทศที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลด้านตลาดทุนกำหนดขึ้นอันนำไปสู่การปฏิบัติอย่างเป็นรูปธรรมนั้น จึงมีความสำคัญและจำเป็นอย่างยิ่ง หลักเกณฑ์ตามประกาศนี้จึงกำหนดขึ้นโดยมีวัตถุประสงค์ให้เป็น มาตรฐานที่สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการเพื่อให้เกิดการให้บริการที่มีประสิทธิภาพ มีกระบวนการ ในการจำกัดและจัดการความเสี่ยงของระบบอย่างเหมาะสม มีความโปร่งใส และสามารถตรวจสอบได้ ทั้งนี้ เพื่อสร้างความเชื่อมั่น ความมีเสถียรภาพ และความมั่นคงของระบบการเงินโดยรวม ตลอดจน ส่งเสริมความสามารถในการแข่งขันและภาพลักษณ์ที่ดีของตลาดทุนไทย

ส่วนที่ 2

หลักการสำคัญในการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญา

ข้อ 3 เพื่อเป็นการส่งเสริมให้สำนักหักบัญชีสัญญาซึ่งเป็นโครงสร้างพื้นฐานทางการเงิน (financial market infrastructures) ที่สำคัญ มีระบบงานรวมถึงระบบบริหารความเสี่ยงที่มีประสิทธิภาพและมีความมั่นคงปลอดภัยรวมทั้งให้บริการแก่ผู้ที่เกี่ยวข้องอย่างโปร่งใสและเป็นธรรม โดยมีการดำเนินงานที่เหมาะสมและสอดคล้องกับมาตรฐานที่องค์การระหว่างประเทศที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลด้านตลาดทุนกำหนดขึ้น สำนักหักบัญชีสัญญาต้องประกอบการภายใต้หลักการที่สำคัญดังต่อไปนี้

- (1) การบริหารกิจการที่ดีและการจัดโครงสร้างองค์กรที่มีความชัดเจนและโปร่งใส
- (2) การบริหารจัดการความเสี่ยง (risk management) ที่ดีเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านกฎหมาย (legal) ด้านเครดิต (credit) ด้านสภาพคล่อง (liquidity) ด้านการดำเนินการ (operation) และความเสถียรด้านอื่น ๆ โดยมีมาตรการในการติดตาม ควบคุม และจัดการความเสี่ยงในแต่ละด้านอย่างเหมาะสมเพื่อให้มั่นใจได้ว่าการบริหารจัดการดังกล่าวสามารถรองรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นได้
- (3) การมีแหล่งเงินทุนที่เพียงพอ มีระบบและกฎเกณฑ์ในการรับและกำกับดูแลสมาชิกที่เหมาะสม และรองรับวิธีปฏิบัติที่ทำให้มั่นใจได้ว่าจะสามารถชำระหนี้ได้อย่างมีประสิทธิภาพ รวมถึงต้องมีกระบวนการในการจัดการกรณีที่มีการผิดนัดชำระหนี้ด้วย
- (4) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ (business continuity management) โดยมีมาตรการที่เหมาะสมและสอดคล้องกับมาตรฐานสากล อันเป็นการส่งเสริมและรักษาไว้ซึ่งความพร้อมในการใช้งานของระบบงานที่สำคัญของสำนักหักบัญชีสัญญาให้สามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่อง
- (5) การเปิดเผยข้อมูลอย่างชัดเจน โปร่งใส (transparency) และเพียงพอเพื่อให้สมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจ สามารถเข้าใจผลกระทบและความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้น

ส่วนที่ 3
สาระสำคัญของข้อกำหนด

ข้อ 4 ประกาศนี้มีข้อกำหนดในการกำกับดูแลบุคคลผู้ประกอบการเป็นสำนักหักบัญชี สัญญาในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) การบริหารกิจการที่ดีและการจัด โครงสร้างองค์กร โดยมีรายละเอียดตามหมวด 2
- (2) ข้อกำหนดเฉพาะเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจ โดยมีรายละเอียดตามหมวด 3
- (3) การบริหารจัดการความเสี่ยง โดยมีรายละเอียดตามหมวด 4
- (4) การบริหารจัดการกรณีที่มีการเชื่อมโยงการให้บริการกับผู้ที่เกี่ยวข้องของ สำนักหักบัญชีสัญญา โดยมีรายละเอียดตามหมวด 5
- (5) การจัดการและการเปิดเผยข้อมูล โดยมีรายละเอียดตามหมวด 6
- (6) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ และการทดสอบและติดตาม ประสิทธิภาพของการปฏิบัติงาน โดยมีรายละเอียดตามหมวด 7
- (7) การใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก โดยมีรายละเอียดตามหมวด 8
- (8) การจัดการเรื่องร้องเรียน โดยมีรายละเอียดตามหมวด 9
- (9) การเก็บรักษาข้อมูลและเอกสาร โดยมีรายละเอียดตามหมวด 10
- (10) ข้อกำหนดอื่น ๆ เกี่ยวกับการประกอบธุรกิจ โดยมีรายละเอียดตามหมวด 11

ส่วนที่ 4
อำนาจสำนักงาน ก.ล.ต.

ข้อ 5 เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามประกาศนี้ สำนักงาน ก.ล.ต. อาจกำหนด ในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) กำหนดหลักเกณฑ์ในรายละเอียดของข้อกำหนดตามประกาศนี้ให้มีความชัดเจน เพียงพอที่สำนักหักบัญชีสัญญาจะสามารถปฏิบัติตามประกาศนี้ได้ ในแนวทางเดียวกัน
- (2) กำหนดแนวทางการปฏิบัติ (guideline) ในรายละเอียดของข้อกำหนดตามประกาศนี้ เพื่อเป็นการให้แนวทางปฏิบัติที่ถือว่าเหมาะสมและสอดคล้องตามประกาศนี้ และหากสำนักหักบัญชี สัญญาปฏิบัติตามแนวทางดังกล่าวแล้ว ให้ถือว่าสำนักหักบัญชีสัญญา มีการปฏิบัติตามข้อกำหนดใน ประกาศนี้ ในเรื่องที่มีการออกแนวทางนั้น

(3) เพื่อให้สำนักงาน ก.ล.ต. สามารถติดตามการปฏิบัติตามประกาศนี้ได้ ให้สำนักหักบัญชีสัญญายื่นรายงานหรือแสดงเอกสารใดตามระยะเวลาหรือเป็นครั้งคราว ต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายในระยะเวลาที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด

ส่วนที่ 5

บทนิยาม

ข้อ 6 ในประกาศนี้

“ผู้บริหาร” หมายความว่า ผู้จัดการ รองผู้จัดการ ผู้ช่วยผู้จัดการ ผู้อำนวยการฝ่าย หรือผู้ซึ่งดำรงตำแหน่งเทียบเท่าที่เรียกชื่ออย่างอื่น และให้หมายความรวมถึงบุคคลที่ได้ทำสัญญาให้มีอำนาจทั้งหมดหรือบางส่วนในการจัดการด้วย

“ตลาดหลักทรัพย์” หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์” หมายความว่า ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์” หมายความว่า ศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ศูนย์ซื้อขายสัญญา” หมายความว่า ศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“สำนักหักบัญชี” หมายความว่า สำนักหักบัญชีตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“สำนักหักบัญชีสัญญา” หมายความว่า สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“อำนาจควบคุมกิจการ” หมายความว่า อำนาจควบคุมกิจการตามที่กำหนดไว้ในมาตรา 89/1 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“สมาชิก” หมายความว่า นิติบุคคลที่เป็นสมาชิกของสำนักหักบัญชีสัญญา

“ทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก” หมายความว่า

(1) ทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีสัญญาได้รับมาจากสมาชิกทั้งที่เป็นของสมาชิกและของลูกค้าเพื่อเป็นประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(2) ทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีสัญญาได้รับมาเนื่องจากการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทั้งของสมาชิกและของลูกค้า

(3) ทรัพย์สินที่สมาชิกนำมาวางไว้กับสำนักหักบัญชีสัญญาเพื่อความมั่นคงของระบบการซื้อขายและการชำระหนี้ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า”

หมายความว่า ระบบคอมพิวเตอร์หรือระบบเครือข่ายที่สำคัญที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าซึ่งหากไม่สามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่อง อาจส่งผลกระทบต่ออย่างมีนัยสำคัญต่อผู้ที่เกี่ยวข้องกับสำนักหักบัญชีสัญญาได้

หมวด 2

การบริหารกิจการที่ดีและการจัดโครงสร้างองค์กร

ข้อ 7 สำนักหักบัญชีสัญญาโดยการอนุมัติจากคณะกรรมการต้องจัดให้มีข้อกำหนดเกี่ยวกับการบริหารกิจการที่ดีซึ่งมีความชัดเจนและเป็นลายลักษณ์อักษร โดยข้อกำหนดดังกล่าวจะต้องเป็นการส่งเสริมความมั่นคงและประสิทธิภาพของสำนักหักบัญชีสัญญา และคำนึงถึงผลประโยชน์สาธารณะและผู้ให้บริการ ทั้งนี้ ข้อกำหนดนั้นต้องระบุอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) นโยบายป้องกันและจัดการความขัดแย้งทางผลประโยชน์

(2) มาตรการที่เพียงพอในการป้องกันมิให้กรรมการ ผู้บริหาร อนุกรรมการ ที่ปรึกษา พนักงาน ลูกจ้างหรือผู้ปฏิบัติงานให้แก่สำนักหักบัญชีสัญญาแสวงหาประโยชน์โดยมิชอบจากข้อมูลที่ได้รับจากการปฏิบัติหน้าที่ และมีมาตรการที่เพียงพอในการรักษาความลับของสมาชิกและลูกค้า

ให้สำนักหักบัญชีสัญญาเปิดเผยข้อกำหนดเกี่ยวกับการบริหารกิจการที่ดีต่อประชาชนและผู้ที่เกี่ยวข้องเป็นการทั่วไปภายหลังจากข้อกำหนดดังกล่าวได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการของสำนักหักบัญชีสัญญาแล้ว

ข้อ 8 เพื่อให้การดำเนินการของสำนักหักบัญชีสัญญาเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ โปร่งใส และส่งเสริมความมีเสถียรภาพของตลาดทุน รวมทั้งสอดคล้องกับข้อกำหนดเกี่ยวกับการบริหารกิจการที่ดีซึ่งได้กำหนดขึ้นตามข้อ 7 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีคณะกรรมการขึ้นคณะหนึ่ง ประกอบด้วยประธานกรรมการ กรรมการ และกรรมการอิสระ ที่แต่งตั้งจากผู้ที่มีความรู้และมีประสบการณ์ที่เกี่ยวกับตลาดทุนหรือที่จะเป็นประโยชน์ต่อการประกอบกิจการของสำนักหักบัญชีสัญญา

เพื่อให้เป็นไปตามที่กำหนดไว้ในวรรคหนึ่ง สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการดังต่อไปนี้เป็นอย่างน้อย

(1) กำหนดบทบาทหน้าที่และความรับผิดชอบที่ชัดเจนของคณะกรรมการและผู้บริหาร

(2) ประเมินผลการปฏิบัติหน้าที่ของคณะกรรมการและผู้บริหาร

ข้อ 9 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการจัด โครงสร้างองค์กรอย่างน้อยในเรื่อง ดังต่อไปนี้

- (1) กรรมการอิสระตามข้อ 8 วรรคหนึ่งในจำนวนอย่างน้อย 1 ใน 3 ของจำนวน กรรมการทั้งหมดและต้องมีจำนวน ไม่น้อยกว่า 2 คน
- (2) ระบบการควบคุมกิจการภายในที่มีประสิทธิภาพ และมีระบบการตรวจสอบที่มี ประสิทธิภาพและเป็นอิสระ

นอกจากที่กำหนดไว้ตามวรรคหนึ่ง สำนักหักบัญชีสัญญาต้องบริหารจัดการ ความเสี่ยงในลักษณะดังต่อไปนี้ด้วย

- (1) จัดให้มีคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงที่ทำหน้าที่กำหนดนโยบายในการบริหาร จัดการความเสี่ยงและติดตามให้มีการปฏิบัติตามนโยบายดังกล่าว โดยกรรมการใน คณะกรรมการ นี้ต้องแต่งตั้งจากผู้ที่มีความรู้และมีประสบการณ์ในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า การบริหารความเสี่ยง หรือการบริหารงานสำนักหักบัญชีสัญญา ทั้งนี้ ประธานกรรมการต้องเป็นผู้ที่สามารถให้ความเห็นของตน ได้โดยอิสระ และกรรมการจำนวนไม่น้อยกว่ากึ่งหนึ่งของจำนวนกรรมการทั้งหมดต้องเป็นกรรมการอิสระ
- (2) จัดให้มีหน่วยงานที่ทำหน้าที่บริหารจัดการความเสี่ยงตามกรอบนโยบาย ความเสี่ยง ทั้งนี้ การจ่ายผลตอบแทนให้กับหน่วยงานดังกล่าวต้องไม่ก่อให้เกิดความขัดแย้ง ทางผลประโยชน์

ข้อ 10 กรรมการอิสระตามข้อ 9(1) ต้องเป็นผู้ที่สามารถปฏิบัติหน้าที่ของตนได้ อย่างอิสระ เป็นกลาง และมีความเป็นธรรม ตลอดจนคำนึงถึงประโยชน์ส่วนรวมของสำนักหักบัญชีสัญญา และความมั่นคงปลอดภัยและเสถียรภาพของระบบตลาดทุนเป็นสำคัญ

กรรมการอิสระของสำนักหักบัญชีสัญญาต้องไม่มีลักษณะดังต่อไปนี้

- (1) เป็นกรรมการ ผู้จัดการ บุคคลผู้มีอำนาจในการบริหารงานประจำ พนักงาน ลูกจ้าง ที่ปรึกษา หรือตำแหน่งอื่นใดในสำนักหักบัญชีสัญญา สมาชิกหรือองค์กรที่มีความสัมพันธ์ทาง ธุรกิจอย่างมีนัยสำคัญกับสำนักหักบัญชีสัญญา
- (2) เป็นผู้ถือหุ้นที่มีอำนาจควบคุมกิจการของสำนักหักบัญชีสัญญา
- (3) เป็นกรรมการหรือผู้บริหารของสำนักหักบัญชีอื่น

หมวด 3

ลักษณะเฉพาะของการประกอบธุรกิจ

ข้อ 11 ในการให้บริการระบบการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชีสัญญาต้องมีระบบที่สามารถให้ความมั่นใจว่าจะมีการปฏิบัติการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยสำนักหักบัญชีสัญญาต้องเข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญากับผู้ซื้อและผู้ขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในทันทีที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาแจ้งข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายให้แก่สำนักหักบัญชีสัญญาภายหลังจากที่ เกิดรายการซื้อขายในศูนย์ซื้อขายสัญญา และสำนักหักบัญชีสัญญาหรือผู้ที่เกี่ยวข้องจะยกเลิก แก้ไข หรือเปลี่ยนแปลงรายการมิได้ เว้นแต่ระเบียบหรือข้อบังคับจะกำหนดเป็นอย่างอื่น รวมทั้งต้องกำหนด ขั้นตอนและวิธีการดำเนินการเมื่อมีการผิดนัดชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าด้วย

ข้อ 12 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องมีระบบกำกับตรวจสอบฐานะทางการเงิน และความเสียงโดยรวมของสมาชิก โดยอย่างน้อยต้องมีการประเมินและติดตามฐานะทางการเงิน ความมั่นคงทางการเงิน และระบบการบริหารความเสียงของสมาชิกอย่างสม่ำเสมอ และมีมาตรการ ดำเนินการเพื่อให้มั่นใจว่าฐานะทางการเงินและระบบการบริหารความเสียงของสมาชิกเป็นไปตาม ระเบียบหรือข้อบังคับของสำนักหักบัญชีสัญญา

ข้อ 13 ในกรณีที่มีการส่งมอบสินค้าอ้างอิงตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชี สัญญาต้องจัดให้มีข้อบังคับหรือข้อตกลงที่มีความชัดเจนและเป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องกำหนด อย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) หน้าที่และความรับผิดชอบของสำนักหักบัญชีสัญญากับสมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้อง เกี่ยวกับการส่งมอบสินค้าอ้างอิงตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (2) กระบวนการรองรับการผิดนัดชำระหนี้ หรือส่งมอบสินค้าอ้างอิงตามสัญญา ซื้อขายล่วงหน้า

ข้อ 14 ในกรณีที่สำนักหักบัญชีสัญญาลงทุนหรือฝากทรัพย์สินไว้กับธนาคารพาณิชย์ ทั้งในและต่างประเทศ สำนักหักบัญชีสัญญาต้องมีการประเมินความเสียงที่อาจเกิดขึ้นจากการใช้ บริการจากธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศ เพื่อให้มั่นใจว่าธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศ มีกระบวนการเก็บรักษาทรัพย์สินที่มีประสิทธิภาพ มีความสามารถชำระหนี้เมื่อทวงถาม และอยู่ภายใต้ การกำกับดูแลขององค์กรที่น่าเชื่อถือ ทั้งนี้ การลงทุนและฝากทรัพย์สินดังกล่าวต้องไม่กระจุกตัว ในธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศแห่งใดแห่งหนึ่งมากเกินไป

ข้อ 15 การดูแลรักษาทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก สำนักหักบัญชีสัญญา จะมอบหมายให้ผู้อื่นดำเนินการแทนมิได้ ทั้งนี้ สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดทำและเก็บรักษาบัญชีทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิกแยกจากของ สำนักหักบัญชีสัญญา โดยให้ดำเนินการแยกเป็นบัญชีของสมาชิกแต่ละราย รวมทั้งจัดทำและเก็บรักษา บัญชีทรัพย์สินของลูกค้ายกจากบัญชีทรัพย์สินของสมาชิกให้ถูกต้องครบถ้วนและเป็นปัจจุบัน

(2) จัดเก็บทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิกให้มีความปลอดภัย มั่นคง และมีรายการและจำนวนตรงตามที่ปรากฏในบัญชีทรัพย์สินตาม (1)

(3) จัดเก็บทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิกแยกจากทรัพย์สินของสำนักหักบัญชี สัญญาในลักษณะที่สามารถชี้เฉพาะได้ว่าเป็นทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก โดยปราศจาก เหตุสงสัย

(4) รายงานการดูแลรักษาทรัพย์สินดังกล่าวให้สมาชิกทราบภายในระยะเวลาที่เหมาะสม หลักเกณฑ์ในการดำเนินการตามวรรคหนึ่งให้เป็นไปตามที่สำนักหักบัญชีสัญญากำหนด

ข้อ 16 ในกรณีที่สำนักหักบัญชีสัญญาจัดเก็บทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก ตามวิธีการดังต่อไปนี้ ให้ถือว่าเป็นการแยกทรัพย์สินตามข้อ 15(3) แล้ว และมีให้ถือว่าเป็นการมอบหมายให้ ผู้อื่นดูแลรักษาทรัพย์สินดังกล่าวแทนตน

(1) ในกรณีที่เป็นทรัพย์สินประเภทเงิน ให้จัดเก็บโดยฝากไว้กับธนาคารพาณิชย์ หรือธนาคารอื่นที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น หรือลงทุนตามกรอบการลงทุนที่สำนักหักบัญชีสัญญา กำหนด ทั้งนี้ การกำหนดกรอบหรือนโยบายการลงทุนต้องคำนึงถึงสภาพคล่อง ความเสี่ยงในการลงทุน และ ผลกระทบที่อาจเกิดขึ้นต่อเสถียรภาพของระบบ และรายงานกรอบหรือนโยบายการลงทุนที่กำหนด และรายงานกรณีที่มีการแก้ไขกรอบหรือนโยบายการลงทุนดังกล่าวต่อสำนักงาน ก.ล.ต. โดยไม่ชักช้า รวมทั้งมีการเปิดเผยให้สมาชิกทราบด้วย ในกรณี ให้ระบุด้วยว่าการฝากหรือการลงทุนดังกล่าวเป็น การดำเนินการโดยสำนักหักบัญชีสัญญาเพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามที่กำหนดในมาตรา 82 และ มาตรา 83 และให้ระบุวัตถุประสงค์ประสงค์ของการจัดเก็บดังกล่าวไว้อย่างชัดเจนด้วย

(2) ในกรณีที่เป็นทรัพย์สินประเภทหลักทรัพย์ ให้จัดเก็บโดยฝากไว้ที่ศูนย์รับฝาก หลักทรัพย์หรือธนาคารแห่งประเทศไทย ในกรณี ให้ระบุด้วยว่าการฝากหรือการลงทุนดังกล่าวเป็น การดำเนินการโดยสำนักหักบัญชีสัญญาเพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามที่กำหนดในมาตรา 82 และ มาตรา 83 และให้ระบุวัตถุประสงค์ประสงค์ของการจัดเก็บดังกล่าวไว้อย่างชัดเจนด้วย

(3) ในกรณีที่เป็นทรัพย์สินอื่น ให้แยกไว้ในลักษณะที่สามารถชี้เฉพาะได้ว่าทรัพย์สิน นั้นเป็นทรัพย์สินของสมาชิก หรือลูกค้ายกของสมาชิกโดยปราศจากเหตุสงสัย

หมวด 4
การบริหารจัดการความเสี่ยง

ข้อ 17 เพื่อประโยชน์ในการบริหารจัดการความเสี่ยง ให้สำนักหักบัญชีสัญญาดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดให้มีกรอบนโยบายบริหารความเสี่ยงที่เป็นลายลักษณ์อักษรและครอบคลุมความเสี่ยงทุกด้านโดยกรอบนโยบายดังกล่าวต้องได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการของสำนักหักบัญชีสัญญา

(2) กำหนดมาตรการบริหารจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นซึ่งเพียงพอที่จะป้องกันและจัดการความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ได้อย่างมีประสิทธิภาพ

(3) ทบทวนความเหมาะสมของกรอบนโยบายและมาตรการบริหารจัดการความเสี่ยงเป็นประจำ

ข้อ 18 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีแหล่งเงินทุนที่เพียงพอต่อการรองรับการประกอบการและความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ที่อาจเกิดขึ้นจากการประกอบธุรกิจ ทั้งนี้ ส่วนของผู้ถือหุ้นต้องมีมูลค่าไม่น้อยกว่าค่าใช้จ่ายในการประกอบธุรกิจรวม 6 เดือน และคำนวณจากงบการเงินปีล่าสุด โดยต้องอยู่ในรูปของทรัพย์สินที่มีคุณภาพและมีสภาพคล่องเพียงพอ

สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีแผนดำเนินการเพิ่มเติมแหล่งเงินทุนที่ชัดเจนเพื่อใช้ในกรณีที่เงินทุนไม่เพียงพอรองรับการประกอบการและความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ตามวรรคหนึ่ง

ข้อ 19 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีแผนรองรับเหตุการณ์ที่ทำให้สำนักหักบัญชีสัญญาไม่สามารถดำเนินงานต่อไปได้ โดยอย่างน้อยต้องกำหนดให้มีแผนเพื่อการกอบกู้หรือการเลิกประกอบกิจการ (plan for recovery or orderly wind-down) ซึ่งแผนดังกล่าวต้องผ่านการอนุมัติจากคณะกรรมการของสำนักหักบัญชีสัญญาและต้องมีรายละเอียดในเรื่องดังต่อไปนี้เป็นอย่างน้อย

(1) การให้บริการหรือระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ต้องแก้ไขเพื่อให้สำนักหักบัญชีสัญญากลับมาดำเนินการได้ตามปกติ

(2) เหตุการณ์และช่วงเวลาที่ทำให้นสำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการตามแผนเพื่อการกอบกู้หรือการเลิกประกอบกิจการ

(3) แนวทางหรือวิธีการที่ใช้เพื่อกอบกู้กิจการ

(4) แนวทางหรือวิธีการในการจัดการสินทรัพย์และหนี้สินของสำนักหักบัญชีสัญญาสมาชิก และลูกค้าในกรณีที่การกอบกู้กิจการไม่บรรลุผล

หมวด 5
การบริหารจัดการกรณีที่มีการเชื่อมโยงการให้บริการกับ
ผู้ที่เกี่ยวข้องของสำนักหักบัญชีสัญญา

ข้อ 20 ในกรณีที่สมาชิกของสำนักหักบัญชีสัญญาให้บริการเกี่ยวกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแก่ผู้ให้บริการซึ่งให้บริการแก่บุคคลที่เป็นลูกค้านอกหนึ่ง สำนักหักบัญชีสัญญาต้องควบคุมดูแลและติดตามความเสี่ยงของสมาชิกดังกล่าวที่อาจเกิดขึ้นตามความเสี่ยงในแต่ละกรณี

ในกรณีที่สำนักหักบัญชีสัญญาจะทำการเชื่อมโยงการให้บริการกับสำนักหักบัญชีสัญญาอื่น สำนักหักบัญชีสัญญาต้องกำหนดมาตรการเพื่อบริหารจัดการความเสี่ยงก่อนดำเนินการดังกล่าวอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) กฎหมายหรือกฎเกณฑ์รองรับการเชื่อมโยงการให้บริการและคุ้มครองการทำธุรกรรมของสำนักหักบัญชีสัญญาที่แตกต่างกัน
- (2) ขั้นตอนและวิธีการจัดการในกรณีที่มีการผิดนัดชำระหนี้ (default management) ที่สามารถบังคับใช้กับสำนักหักบัญชีสัญญาอื่นที่เชื่อมโยงการให้บริการระหว่างกันได้
- (3) ประสิทธิภาพในการเรียกหรือบังคับหลักประกันได้ทันต่อเหตุการณ์
- (4) ความเพียงพอของแหล่งเงินทุนรองรับความเสี่ยงที่เกิดจากการเชื่อมโยงการให้บริการ

หมวด 6
การจัดการและการเปิดเผยข้อมูล

ข้อ 21 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องเปิดเผยหรือเผยแพร่ระเบียบ ข้อบังคับ ข่าวดูสาร หรือข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญาอย่างเพียงพอเพื่อให้สมาชิก ลูกค้านอกของสมาชิก หรือบุคคลที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการของสำนักหักบัญชีสัญญาเข้าใจถึงความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการใช้บริการ และต้องทบทวนปรับปรุงข้อมูลที่เปิดเผยหรือเผยแพร่ให้เป็นปัจจุบันเป็นประจำหรือทุกครั้งที่มีการเปลี่ยนแปลง

ข้อ 22 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีระบบการจัดการและจัดเก็บข้อมูลเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจที่มีประสิทธิภาพ รัศกุม และครบถ้วน โดยต้องสามารถรวบรวม ประมวลผลและเรียกดูข้อมูลดังกล่าวได้ภายในระยะเวลาอันสมควร

ในกรณีที่ระบบตามวรรคหนึ่งไม่สามารถใช้งานได้ สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการให้มีระบบสำรองเพื่อให้การจัดการและจัดเก็บข้อมูลเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจสามารถดำเนินการต่อไปได้ตามปกติ

ข้อ 23 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องมีระเบียบหรือข้อบังคับที่กำหนดให้สามารถแลกเปลี่ยนข้อมูลเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจกับตลาดหลักทรัพย์ ศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ ศูนย์ซื้อขายสัญญา สำนักหักบัญชี สำนักหักบัญชีสัญญา ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ สำนักงาน ก.ล.ต. และธนาคารแห่งประเทศไทยได้

ข้อ 24 เพื่อพิทักษ์ประโยชน์ของประชาชนหรือคุ้มครองผู้ลงทุน ให้สำนักหักบัญชีสัญญาเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า การชำระหนี้ สมาชิก การกระทำความผิด และการลงโทษสมาชิก รวมตลอดถึงข้อมูลอื่นใดที่ได้รับเนื่องจากการประกอบกิจการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญา ซึ่งเป็นข้อมูลที่เป็นสาระสำคัญต่อการทำธุรกรรมกับสมาชิก โดยการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวต้องกระทำในลักษณะที่ทันต่อเหตุการณ์ มีข้อมูลเพียงพอ และผู้ลงทุนทั่วไปมีโอกาสได้รับข้อมูลอย่างเท่าเทียมกัน ทั้งนี้ ประเภทของข้อมูล วิธีการและเงื่อนไขในการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวให้เป็นไปตามที่สำนักหักบัญชีสัญญากำหนดโดยความเห็นชอบของคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

หมวด 7

การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ และการทดสอบ และติดตามประสิทธิภาพของการปฏิบัติงาน

ข้อ 25 หมวดนี้มีข้อกำหนดในการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ และการทดสอบและติดตามประสิทธิภาพของการปฏิบัติงานของสำนักหักบัญชีสัญญา ในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 1
- (2) การทบทวน ติดตามและตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 2
- (3) การรายงานความเปลี่ยนแปลงเกี่ยวกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (material systems change report) โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 3

(4) การบริหารจัดการเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย (incident management) โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 4

(5) การรักษาความปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 5

ส่วนที่ 1

การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ

ข้อ 26 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการให้มีความพร้อมในการใช้งานระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยอย่างน้อยต้องกำหนดในเรื่องดังต่อไปนี้เป็นลายลักษณ์อักษร

(1) นโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจโดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการของสำนักหักบัญชีสัญญาหรือคณะทำงานตามที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าวเพื่อให้มั่นใจได้ว่าระบบดังกล่าวสามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่องหรือสามารถแก้ไขให้กลับมาดำเนินการต่อได้ภายในระยะเวลาที่เหมาะสม ในกรณีที่มีเหตุการณ์ไม่ปกติเกิดขึ้น

(2) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องที่สอดคล้องกับนโยบายที่กำหนดขึ้นตาม (1) โดยได้รับความเห็นชอบจากผู้จัดการหรือผู้ดำรงตำแหน่งเทียบเท่าที่เรียกชื่ออย่างอื่น

ข้อ 27 การจัดทำแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องตามข้อ 26(2) ต้องมีรายการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) มาตรการรองรับเมื่อเกิดกรณีฉุกเฉินที่อาจมีผลกระทบต่อการทำงานของบริการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญา โดยกำหนดขอบเขตของกรณีฉุกเฉินให้ครอบคลุมถึงเหตุการณ์ต่าง ๆ ที่อาจเกิดขึ้นได้ รวมทั้งขั้นตอนการดำเนินการและผู้รับผิดชอบในการดำเนินการตามขั้นตอนดังกล่าวในแต่ละกรณีให้ชัดเจน

(2) รายชื่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

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

(4) ระยะเวลากู้คืนระบบงาน (recovery time objective)

(5) ข้อมูลล่าสุดที่จะกู้คืนได้ (recovery point objective)

(6) รายละเอียดของระบบงานสำรองและศูนย์สำรองที่สอดคล้องกับนโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง

ข้อ 28 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีมาตรการที่มีประสิทธิภาพในการควบคุม ติดตามการปฏิบัติตามนโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง และสื่อสารเรื่องดังกล่าวผ่านวิธีการที่เหมาะสม เพื่อให้สมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้องสามารถ ปฏิบัติตามได้อย่างมีประสิทธิภาพ

ข้อ 29 เพื่อให้การกำกับดูแลการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจเป็นไป อย่างมีประสิทธิภาพ ให้สำนักหักบัญชีสัญญาดำเนินการในเรื่องดังต่อไปนี้อย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง

- (1) ทดสอบแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องร่วมกับสมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้อง
- (2) ประเมินผลการทดสอบแผนตาม (1) โดยผู้ที่มีความรู้ความสามารถและ มีความเป็นอิสระจากผู้จัดทำหรือผู้บริหารแผนนั้น
- (3) รายงานผลการทดสอบตาม (2) ให้คณะกรรมการสำนักหักบัญชีสัญญาและ สำนักงาน ก.ล.ต. ภายใน 90 วันนับแต่วันที่ดำเนินการทดสอบเสร็จสิ้น

ข้อ 30 ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระหนี้ ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าซึ่งส่งผลกระทบต่อการประกอบกิจการของสำนักหักบัญชีสัญญา ให้สำนัก หักบัญชีสัญญาทบทวนและปรับปรุงแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องโดยไม่ชักช้า เพื่อให้สอดคล้อง กับการเปลี่ยนแปลงนั้น

ส่วนที่ 2

การทบทวน ติดตามและตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับ
การชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ข้อ 31 เพื่อให้การกำกับดูแลเกี่ยวกับขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานที่เกี่ยวข้อง กับการระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ ให้สำนักหักบัญชีสัญญาดำเนินการดังต่อไปนี้

- (1) ทบทวน ติดตามและตรวจสอบขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานที่เกี่ยวข้อง กับการระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง โดยผู้ที่มี ความรู้ความสามารถและมีความเป็นอิสระ เช่น ผู้ตรวจสอบภายในหรือภายนอก (internal or external auditor) เป็นต้น และส่งรายงานผลการทบทวน ติดตาม และตรวจสอบรายปีต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายในไตรมาสแรกของปีถัดไป

(2) ทดสอบการเจาะระบบ (penetration test) ต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ให้ครบถ้วนทุกระบบงานภายใน 3 ปี โดยเรียงลำดับความสำคัญตามผลการประเมินความเสี่ยง

ให้สำนักหักบัญชีสัญญาทดสอบการเจาะระบบตามวรรคหนึ่งเป็นประจำทุก 3 ปี นับแต่วันที่ทำการทดสอบครบถ้วนทุกระบบครั้งสุดท้าย และรายงานผลการทดสอบดังกล่าวต่อ สำนักงาน ก.ล.ต. ภายในไตรมาสแรกของปีถัดจากปีที่มีการทดสอบนั้น

ส่วนที่ 3

การรายงานความเปลี่ยนแปลงเกี่ยวกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้อง
การชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
(material systems change report)

ข้อ 32 เพื่อให้การกำกับดูแลการประกอบกิจการโดยรวมของสำนักหักบัญชีสัญญา ดำเนินไปด้วยความเรียบร้อย มีประสิทธิภาพ และทันต่อเหตุการณ์ ให้สำนักหักบัญชีสัญญา รายงานการเปลี่ยนแปลงใด ๆ ที่มีนัยสำคัญต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายใน 30 วันนับแต่วันสุดท้ายของปี

ส่วนที่ 4

การบริหารจัดการเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย
(incident management)

ข้อ 33 ในส่วนนี้

“เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย” หมายความว่า

- (1) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าไม่สามารถดำเนินการได้ตามปกติ (system disruption and system degrade)
- (2) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าไม่อาจดำเนินการให้เป็นไปตามกฎหมาย กฎเกณฑ์ ระเบียบ ข้อบังคับที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. คณะกรรมการกำกับตลาดทุน สำนักงาน ก.ล.ต. หรือสำนักหักบัญชีสัญญากำหนด (system non-compliance)

(3) เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอันเกิดจากการบุกรุก (system intrusion)

ข้อ 34 เมื่อปรากฏข้อเท็จจริงว่ามีเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยตามข้อ 33 เกิดขึ้น ให้สำนักหักบัญชีสัญญาจัดทำบันทึกสาเหตุ สภาพการณ์ และแนวทางแก้ไขปัญหากับเหตุการณ์ดังกล่าว

ข้อ 35 เพื่อให้เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยได้รับการจัดการอย่างถูกต้องและมีประสิทธิภาพภายในระยะเวลาที่เหมาะสม สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) กำหนดและดำเนินการตามแผนรองรับในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยที่ได้กำหนดไว้เป็นลายลักษณ์อักษร

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

ข้อ 36 ให้สำนักหักบัญชีสัญญารายงานเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยตามข้อ 33(1) และ (3) ต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ดังนี้

(1) รายงานทันทีที่เกิดเหตุการณ์โดยทางวาจาหรือทางจดหมายอิเล็กทรอนิกส์

(2) รายงานผลการตรวจสอบเหตุการณ์เป็นลายลักษณ์อักษร (investigation report)

เมื่อเหตุการณ์นั้นได้รับการแก้ไขแล้วภายใน 30 วันนับแต่วันที่คณะกรรมการของสำนักหักบัญชีสัญญาหรือคณะกรรมการที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าวได้รับรายงาน ทั้งนี้ ต้องไม่เกิน 90 วันนับแต่วันที่เกิดเหตุการณ์นั้น

รายงานผลการตรวจสอบตามวรรคหนึ่งต้องประกอบด้วยคำอธิบายรายละเอียดของเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย และการดำเนินงานของสำนักหักบัญชีสัญญาและสมาชิก รวมทั้งสาเหตุที่แท้จริงของปัญหา (root cause) ขั้นตอนการดำเนินการแก้ไขปัญหา และมาตรการป้องกันเพื่อไม่ให้เกิดเหตุการณ์ในลักษณะเดียวกันนี้อีก

ข้อ 37 ในกรณีที่สำนักหักบัญชีสัญญาไม่สามารถดำเนินการแก้ไขปัญหาเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยได้ภายในระยะเวลาที่ระบบงาน (recovery time objective) ที่กำหนดไว้ในแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง ให้สำนักหักบัญชีสัญญารายงานความคืบหน้า

ในการแก้ไขปัญหาให้สำนักงาน ก.ล.ต. ทราบทุก 1 ชั่วโมงโดยทางจดหมายอิเล็กทรอนิกส์จนกว่าจะสามารถกลับมาดำเนินธุรกิจตามปกติได้

ส่วนที่ 5

การรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ

ข้อ 38 เพื่อให้การรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศของสำนักหักบัญชีสัญญามีประสิทธิภาพ สามารถรักษาไว้ซึ่งความลับ ความถูกต้องน่าเชื่อถือของข้อมูล และความพร้อมใช้งาน ตลอดจนการติดตามวิเคราะห์ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้อย่างเหมาะสม ให้สำนักหักบัญชีสัญญาดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) กำหนดนโยบายและมาตรการควบคุมการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศให้เป็นไปตามมาตรฐานที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับได้ ซึ่งนโยบายดังกล่าวต้องได้รับความเห็นชอบจากผู้จัดการหรือเทียบเท่าโดยต้องมีการทบทวนและปรับปรุงให้สอดคล้องและเหมาะสมกับความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศในปัจจุบัน

(2) ติดตามและวิเคราะห์ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยบันทึกและจัดเก็บหลักฐานการใช้งาน (log) รวมถึงเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ

หมวด 8

การใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก

ข้อ 39 การใดที่มีได้มีกฎหมายหรือกฎเกณฑ์กำหนดไว้เป็นการเฉพาะ ให้สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการด้วยตนเอง หากมีความจำเป็นเพื่อให้การประกอบธุรกิจมีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น สำนักหักบัญชีสัญญาอาจใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกได้โดยต้องมั่นใจว่าผู้ให้บริการภายนอกได้ปฏิบัติตามกฎหมายและกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง และการใช้บริการนั้นไม่มีผลเสมือนเป็นการไม่ประกอบธุรกิจ

ในการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก สำนักหักบัญชีสัญญาต้องกำหนดรายละเอียดอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) นโยบาย ขอบเขต และลักษณะงานที่จะใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกเป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องได้รับความเห็นชอบเป็นการทั่วไปหรือเป็นรายการณิจากคณะกรรมการของสำนักหักบัญชีสัญญาหรือคณะทำงานที่คณะกรรมการดังกล่าวมอบหมาย

(2) มาตรการในการบริหารจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกที่เหมาะสมและมีประสิทธิภาพ

(3) มาตรการตรวจสอบบริการของผู้ให้บริการภายนอกที่มีประสิทธิภาพ เพื่อให้การปฏิบัติงานของผู้ให้บริการภายนอกเป็นไปตามวัตถุประสงค์ของสำนักหักบัญชีสัญญา
ความในวรรคสองมิให้นำมาใช้บังคับกับกรณีที่สำนักหักบัญชีสัญญาเป็นบริษัทที่ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้นเกินกว่าร้อยละ 50 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น และได้มอบหมายให้ตลาดหลักทรัพย์หรือบริษัทที่ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้นเกินกว่าร้อยละ 50 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้นเป็นผู้ให้บริการภายนอกตามวรรคหนึ่ง

หมวด 9

การจัดการเรื่องร้องเรียน

ข้อ 40 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีระบบที่มีประสิทธิภาพเกี่ยวกับการจัดการข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทที่เกิดขึ้นเกี่ยวกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือเกิดขึ้นจากการใช้บริการที่จัดโดยสำนักหักบัญชีสัญญา โดยอย่างน้อยต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดให้มีระเบียบปฏิบัติที่เป็นลายลักษณ์อักษรเกี่ยวกับการจัดการข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท

(2) จัดให้มีหน่วยงานหรือบุคลากรที่มีหน้าที่รับผิดชอบเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท

(3) จัดให้มีการติดตามตรวจสอบและแจ้งผลการพิจารณาข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทให้ผู้ร้องเรียนหรือคู่พิพาททราบ

(4) จัดทำรายงานสรุปข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ทุก 6 เดือน ในกรณีปรากฏว่ามีข้อเท็จจริงเพียงพอที่จะแสดงให้เห็นได้ว่าผู้ร้องเรียนหรือคู่พิพาทได้รับหรืออาจได้รับความเสียหายจากการร้องเรียนหรือการมีข้อพิพาทนั้น ทั้งนี้ ในรายงานดังกล่าวต้องมีบทสรุปสาระสำคัญและผลการพิจารณาหรือการดำเนินการของสำนักหักบัญชีสัญญา

หมวด 10
การเก็บรักษาข้อมูลและเอกสาร

ข้อ 41 ให้สำนักหักบัญชีสัญญาเก็บรักษาข้อมูลและเอกสารให้เป็นไปตามกำหนดเวลาดังต่อไปนี้

- (1) ข้อมูลเกี่ยวกับการจัดการและจัดเก็บข้อมูลเกี่ยวกับการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญาตามที่ระบุไว้ในข้อ 22 ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 10 ปีนับแต่วันที่ได้มาหรือวันที่มีการดำเนินการเกี่ยวกับข้อมูลนั้น
 - (2) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องตามข้อ 26(2) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการจัดทำแผนดังกล่าว
 - (3) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องที่ได้รับการแก้ไขตามข้อ 30 ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการแก้ไขแผนดังกล่าว
 - (4) หลักฐานการใช้งานรวมถึงเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศตามข้อ 38(2) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 90 วันนับแต่วันที่มีการดำเนินการนั้น
 - (5) เอกสารที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการและหลักฐานการตรวจสอบผู้ให้บริการภายนอกตามข้อ 39(3) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการดำเนินการนั้น
 - (6) เอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทและผลการพิจารณาตามข้อ 40(4) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มิใช่ข้อยุติเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทนั้น
- ในการปฏิบัติตามข้อกำหนดใน (1) ถึง (6) ให้คณะกรรมการกำกับตลาดทุนมีอำนาจสั่งการเป็นประการอื่นได้ตามที่เห็นสมควร
- การจัดเก็บข้อมูล เอกสารและหลักฐานตาม (1) ถึง (6) ให้สำนักหักบัญชีสัญญาจัดเก็บไว้ในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงาน ก.ล.ต. เรียกดู หรือตรวจสอบได้โดยเร็ว

หมวด 11
ข้อกำหนดอื่น ๆ เกี่ยวกับการประกอบธุรกิจ

ข้อ 42 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องมีหลักเกณฑ์ในการรับสมาชิกที่โปร่งใสและเป็นธรรม โดยการกำหนดหลักเกณฑ์ดังกล่าวต้องคำนึงถึงความเหมาะสม ฐานะทางการเงิน และระบบการบริหารความเสี่ยงของผู้สมัครเป็นสมาชิกเป็นสำคัญ

ข้อ 43 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องมีระเบียบหรือข้อบังคับที่ใช้บังคับกับสมาชิก มีมาตรการในการกำกับดูแลให้สมาชิกปฏิบัติตามระเบียบหรือข้อบังคับดังกล่าว และมีมาตรการ ดำเนินการกับสมาชิกที่ฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามระเบียบหรือข้อบังคับ ทั้งนี้ สำนักหักบัญชีสัญญา ต้องประเมินการปฏิบัติตามระเบียบหรือข้อบังคับของสมาชิกในช่วงเวลาที่เหมาะสม พร้อมทั้งจัดทำ รายงานผลการประเมินและการดำเนินการต่อสมาชิกที่ฝ่าฝืนระเบียบหรือข้อบังคับให้สำนักงาน ก.ล.ต.ทราบ

ข้อ 44 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องตรวจสอบและดูแลให้พนักงานปฏิบัติตาม ประกาศและกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องซึ่งสำนักหักบัญชีสัญญากำหนดขึ้นโดยเคร่งครัด ทั้งนี้ หากปรากฏต่อ สำนักงาน ก.ล.ต. ว่าสำนักหักบัญชีสัญญาแห่งใดฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามประกาศหรือกฎเกณฑ์ที่ สำนักหักบัญชีสัญญากำหนดขึ้น หรือดำเนินการที่ไม่เหมาะสมในการประกอบกำกับการเป็นสำนักหักบัญชี สัญญา สำนักงาน ก.ล.ต. อาจสั่งให้สำนักหักบัญชีสัญญาแห่งนั้นดำเนินการให้เป็นไปตามประกาศและ กฎเกณฑ์ดังกล่าว หรือดำเนินการใด ๆ ตามที่เห็นสมควรได้

ประกาศ ณ วันที่ ... พ.ศ. 25..

(นายรพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน