

เอกสารหลักฐานประกอบคำขอจดทะเบียนประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า  
ประเภทการเป็นผู้จัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ชื่อผู้จดทะเบียน.....

ข้อมูล ณ วันที่.....

การพิจารณาคุณสมบัติของผู้จดทะเบียน	ข้อมูลประกอบการพิจารณาของสำนักงาน
<p><b>I. คุณสมบัติด้านฐานะทางการเงิน</b></p> <p>1. สามารถประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทที่ขอจดทะเบียนได้ตามกฎหมายที่ควบคุมการประกอบธุรกิจของนิติบุคคลนั้น</p>	<p>กรณีที่ผู้จดทะเบียนเป็นธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน และบริษัทประกันชีวิต ให้แนบหลักฐาน (☐) และกรอกข้อมูล (●) ดังนี้</p> <p>☐ หลักฐานที่แสดงว่าผู้จดทะเบียนได้รับอนุญาตจากองค์กรหรือหน่วยงานกำกับดูแล ให้ประกอบธุรกิจการเป็นผู้จัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้</p> <p style="padding-left: 40px;">ผลการอนุญาต</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● ไม่มีเงื่อนไข</li> <li>● มีเงื่อนไข (ระบุ).....</li> </ul> <p>.....</p> <p>.....</p>
<p>2. สามารถดำรงเงินกองทุนและกันเงินสำรองได้ตามหลักเกณฑ์ของกฎหมายที่ควบคุมการประกอบธุรกิจของนิติบุคคลนั้น</p>	<p>กรณีที่ผู้จดทะเบียนเป็นธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทหลักทรัพย์ และบริษัทประกันชีวิต หรือกรณีที่ผู้จดทะเบียนเป็นบริษัทจำกัดหรือบริษัทมหาชนจำกัดที่จัดตั้งขึ้นใหม่เพื่อขอรับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวมหรือการจัดการกองทุนส่วนบุคคล โดยมีธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทหลักทรัพย์ และบริษัทประกันชีวิตเป็นผู้ถือหุ้นเกินกว่าร้อยละ 10 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น ให้แนบหลักฐาน (☐) ของธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัท</p>

การพิจารณาคุณสมบัติของผู้จดทะเบียน	ข้อมูลประกอบการพิจารณาของสำนักงาน										
	<p><b>หลักทรัพย์ และบริษัทประกันชีวิต และกรอกข้อมูล (●) ดังนี้</b></p> <p><input type="checkbox"/> หนังสือรับรองจากหน่วยงานที่ควบคุมการประกอบธุรกิจว่าสามารถดำรงเงินกองทุนและกันเงินสำรองได้ตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด (ต้องยื่นคำขอรับใบอนุญาตภายใน 30 วัน นับตั้งแต่วันที่ถัดจากวันที่ในหนังสือรับรอง) ทั้งนี้ ภายหลังจากหน่วยงานควบคุมการประกอบธุรกิจได้ออกหนังสือรับรองแล้วและอยู่ในระหว่างพิจารณาคำขอ หากปรากฏว่าไม่สามารถดำรงเงินกองทุนและกันเงินสำรองได้ตามที่หน่วยงานควบคุมการประกอบธุรกิจกำหนด ให้มีหนังสือแจ้งสำนักงานโดยพลัน (กรณีเป็นบริษัทหลักทรัพย์ไม่ต้องแนบหลักฐานดังกล่าว)</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● ข้อมูล ณ วันที่.....</li> <li>● หลักเกณฑ์ขั้นต่ำในการดำรงเงินกองทุนและกันสำรอง .....</li> <li>● การดำรงเงินกองทุนและกันสำรองของบริษัท .....</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> งบการเงินที่มีผู้สอบบัญชีรับอนุญาตตรวจสอบและแสดงความเห็นแล้วในรอบปีบัญชีล่าสุดเปรียบเทียบกับปีก่อน</p> <table style="width: 100%; border: none;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left; border: none;">ปีล่าสุด (ปี.....)</th> <th style="text-align: left; border: none;">ปีก่อน (ปี.....)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="border: none;">● สินทรัพย์ .....</td> <td style="border: none;">● สินทรัพย์ .....</td> </tr> <tr> <td style="border: none;">● หนี้สิน .....</td> <td style="border: none;">● หนี้สิน .....</td> </tr> <tr> <td style="border: none;">● ส่วนของผู้ถือหุ้น .....</td> <td style="border: none;">● ส่วนของผู้ถือหุ้น .....</td> </tr> <tr> <td style="border: none;">● กำไร/ขาดทุนสุทธิ .....</td> <td style="border: none;">● กำไร/ขาดทุนสุทธิ .....</td> </tr> </tbody> </table>	ปีล่าสุด (ปี.....)	ปีก่อน (ปี.....)	● สินทรัพย์ .....	● สินทรัพย์ .....	● หนี้สิน .....	● หนี้สิน .....	● ส่วนของผู้ถือหุ้น .....	● ส่วนของผู้ถือหุ้น .....	● กำไร/ขาดทุนสุทธิ .....	● กำไร/ขาดทุนสุทธิ .....
ปีล่าสุด (ปี.....)	ปีก่อน (ปี.....)										
● สินทรัพย์ .....	● สินทรัพย์ .....										
● หนี้สิน .....	● หนี้สิน .....										
● ส่วนของผู้ถือหุ้น .....	● ส่วนของผู้ถือหุ้น .....										
● กำไร/ขาดทุนสุทธิ .....	● กำไร/ขาดทุนสุทธิ .....										
<p><b>II. คุณสมบัติด้านความพร้อมของระบบงาน</b></p> <p>หมายเหตุ ให้แสดงรายละเอียดประกอบการพิจารณาของสำนักงานเฉพาะกรณีที่ผู้จดทะเบียนประสงค์จะประกอบธุรกิจเป็นผู้จัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับลูกค้าที่เป็นกองทุนส่วนบุคคลของผู้ลงทุนทั่วไป</p>											

การพิจารณาคุณสมบัติของผู้จดทะเบียน	ข้อมูลประกอบการพิจารณาของสำนักงาน
<p>แสดงได้ว่าจะมีระบบงานที่ดีที่แสดงถึงความพร้อมในการประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทการเป็นผู้จัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์การจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า</p> <p><b>1. ระบบการกำกับดูแลการบริหารความเสี่ยง</b></p> <p>จัดให้มีระบบการกำกับดูแลการบริหารความเสี่ยงที่สะท้อนให้เห็นถึงบทบาทหน้าที่และความรับผิดชอบของคณะกรรมการหรือผู้บริหารบริษัท ในการสร้างวัฒนธรรมการบริหารความเสี่ยงในบริษัท และทำให้มั่นใจได้ว่าบริษัทได้มีการนำนโยบายในเรื่องดังกล่าวไปสู่การปฏิบัติอย่างมีประสิทธิภาพดังต่อไปนี้</p> <p>1) การจัดให้มีนโยบายและหลักปฏิบัติในการบริหารความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างเป็นลายลักษณ์อักษร (รายละเอียดที่จะกำหนดมีอะไรบ้าง และมีวิธีการอย่างไรที่จะทำให้บุคลากรที่เกี่ยวข้องรับทราบถึงนโยบายและหลักปฏิบัติดังกล่าว และนำไปปฏิบัติ)</p> <p>2) การจัดให้มีการประเมินนโยบายและหลักปฏิบัติในการบริหารความเสี่ยงอย่างสม่ำเสมอเพื่อให้มั่นใจว่าหลักปฏิบัติดังกล่าวเหมาะสมและมีประสิทธิภาพ (มีวิธีการในการกำกับดูแลอย่างไรที่จะทำให้มั่นใจได้ว่า บริษัทมีการประเมินนโยบายและหลักปฏิบัติในการบริหารความเสี่ยงอย่างสม่ำเสมอ และเมื่อพบข้อบกพร่องจากการประเมิน ได้มีการดำเนินการแก้ไข)</p> <p>3) การให้ความเห็นชอบนโยบายสำคัญ ๆ ที่เกี่ยวข้องกับการบริหารความเสี่ยง ซึ่งรวมถึงความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ใครเป็นผู้ให้ความเห็นชอบ และปัจจัยที่ใช้ในการพิจารณาให้ความเห็นชอบคืออะไร)</p>	

การพิจารณาคุณสมบัติของผู้จดทะเบียน	ข้อมูลประกอบการพิจารณาของสำนักงาน
<p>4) ความรับผิดชอบต่อการจัดให้มีนโยบายและหลักปฏิบัติในการจัดการสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างเพียงพอ ทั้งในระยะยาวและในระยะสั้นแบบวันต่อวัน โดยมีสายงานที่รับผิดชอบด้านการบริหารความเสี่ยง การวัดความเสี่ยง การควบคุมความเสี่ยง มิให้เกิดสัดส่วนที่กำหนด การควบคุมภายในที่มีประสิทธิภาพ และการกำหนดขั้นตอนและวิธีการในการรายงานความเสี่ยงที่ชัดเจน (ใครเป็นผู้รับผิดชอบ และจะมีวิธีการแสดงให้เห็นถึงความรับผิดชอบต่อเรื่องดังกล่าวอย่างไร)</p> <p>5) การให้ความเห็นชอบการเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และการดูแลให้บุคลากรมีการดำเนินการต่าง ๆ ตามขั้นตอนและวิธีการที่กำหนดไว้สำหรับการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างถูกต้องและครบถ้วน ตลอดจนดูแลให้มีระบบในการควบคุมความเสี่ยงอย่างเพียงพอที่สามารถรองรับการทำธุรกรรมดังกล่าวได้ (ใครเป็นผู้ให้ความเห็นชอบและดูแล และในการพิจารณาเพื่อให้ความเห็นชอบในการเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใด ๆ จะมีการพิจารณาในเรื่องใดบ้าง)</p> <p>6) การจัดสรรทรัพยากร (เช่น เครื่องคอมพิวเตอร์ software อุปกรณ์ต่าง ๆ) และบุคลากรที่มีความรู้ความสามารถอย่างเพียงพอในการบริหารและควบคุมความเสี่ยง (ใครเป็นผู้รับผิดชอบ และจะมีวิธีการในการจัดสรรให้เกิดความเพียงพออย่างไร)</p> <p>7) การติดตามและการรายงานสถานะความเสี่ยง (risk exposure) ของกองทุน/ลูกค้า (ใครเป็นผู้ทำหน้าที่วัด ติดตาม และควบคุมความเสี่ยง บุคลากรดังกล่าวเป็นผู้จัดการลงทุนหรือไม่ หากใช่ มีผู้ทำหน้าที่ติดตามตรวจสอบการดำเนินการดังกล่าวของผู้จัดการลงทุนหรือไม่ รายงานใครทราบ มีวิธีการในการรายงานให้ทราบอย่างไร รายงานเมื่อไร ข้อมูลที่ต้องรายงานมีอะไรบ้าง และเมื่อได้รายงานให้ผู้บริหารนั้น ๆ ทราบแล้ว มีการดำเนินการอย่างไรต่อไป)</p>	

การพิจารณาคุณสมบัติของผู้จดทะเบียน	ข้อมูลประกอบการพิจารณาของสำนักงาน
<p><b>2. ระบบการบริหารความเสี่ยง</b></p> <p>จัดให้มีระบบการบริหารความเสี่ยงแต่ละประเภทดังต่อไปนี้ เพื่อจัดการกับความเสี่ยงซึ่งอาจเกิดขึ้นจากการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า</p> <p>1) credit risk (ความเสี่ยงที่คู่สัญญาจะไม่สามารถชำระหนี้ได้ตามสัญญา)</p> <p>1.1) การกำหนดระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (มีวิธีการในการกำหนดระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้หรือสัดส่วนการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับคู่สัญญาแต่ละรายอย่างไร ปัจจัยที่ใช้ในการพิจารณากำหนดระดับความเสี่ยงคืออะไร และมีวิธีการสื่อสารให้ผู้ที่เกี่ยวข้องทราบอย่างไร)</p> <p>1.2) การวัดความเสี่ยงโดยคำนวณมูลค่าตามราคาตลาดของการจัดการสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสำหรับคู่สัญญาแต่ละรายอย่างถูกต้องเหมาะสมและทันต่อเหตุการณ์ (ระบบ/โปรแกรมที่ใช้คืออะไร และมีประสิทธิภาพที่จะรองรับเรื่องดังกล่าวอย่างไร)</p> <p>1.3) มาตรการ/เครื่องมือที่จะช่วยในการลดความเสี่ยง (ในกรณีที่เป็นจะมีมาตรการ/เครื่องมือที่ช่วยลดความเสี่ยงได้อย่างไรบ้าง)</p> <p>1.4) การเรียกหลักประกัน (call margin) ระหว่างบริษัทและคู่สัญญา (มีระบบรองรับการปฏิบัติงานในเรื่องดังกล่าวอย่างไร ใครเป็นผู้รับผิดชอบ)</p> <p>1.5) การควบคุมความเสี่ยงไม่ให้เกินสัดส่วนที่กำหนด (มีวิธีการในการควบคุมความเสี่ยงไม่ให้เกินสัดส่วนที่กำหนดอย่างไร)</p> <p>1.6) การอนุญาตให้จัดการเกินกว่าสัดส่วนที่กำหนด (ใครเป็นผู้อนุญาต ในการพิจารณาอนุญาตจะพิจารณาจากปัจจัยใดบ้าง ขั้นตอนในการดำเนินการขออนุญาตเป็นอย่างไร)</p> <p>1.7) การให้ความสำคัญกับสถานะการจัดการที่เกินสัดส่วนการลงทุน (ผู้บริหารให้ความสำคัญกับสถานะการจัดการที่เกินสัดส่วนการลงทุนอย่างไร)</p>	

การพิจารณาคุณสมบัติของผู้จดทะเบียน	ข้อมูลประกอบการพิจารณาของสำนักงาน
<p>2) market risk (ความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากความผันผวนของราคาสินทรัพย์อ้างอิงหรืออัตราดอกเบี้ย)</p> <p>2.1) เครื่องมือในการวัดความเสี่ยง ซึ่งสามารถวัด ติดตาม และควบคุมความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ระบบ/โปรแกรมที่ใช้คืออะไร และมีประสิทธิภาพอย่างไร)</p> <p>2.2) การประเมินและทบทวนสมมติฐานที่ใช้ในการคาดการณ์หรือปรับปรุง models ที่ใช้ในการวัดความเสี่ยง (มีวิธีการในการประเมินและทบทวนอย่างไร)</p> <p>2.3) การพิจารณาผลกระทบที่อาจเกิดขึ้นต่อสถานะตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หากเกิดเหตุการณ์ต่าง ๆ เช่น ราคาของสินทรัพย์อ้างอิง/อัตราดอกเบี้ยผันผวน และประเมินความสามารถของกองทุน/ลูกค้าที่จะรับเหตุการณ์ดังกล่าว (เครื่องมือที่ใช้ในการวัดผลกระทบคืออะไร มีการนำข้อมูลที่ได้จากการพิจารณาผลกระทบไปดำเนินการต่ออย่างไรบ้าง)</p> <p>2.4) การคำนวณมูลค่า/สัดส่วนของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างถูกต้องเหมาะสม และทันต่อเหตุการณ์ โดยเฉพาะอย่างยิ่งกรณีที่ข้อกำหนดหรือเงื่อนไขตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า นั้น ๆ อาจทำให้เกิด unlimited loss แก่กองทุน/ลูกค้า (ระบบ/โปรแกรมที่ใช้คืออะไร และจะคำนวณเมื่อไร)</p> <p>2.5) การจำกัดความเสี่ยง (มีการดำเนินการในการจำกัดความเสี่ยงอย่างไร)</p>	

การพิจารณาคุณสมบัติของผู้จดทะเบียน	ข้อมูลประกอบการพิจารณาของสำนักงาน
<p>3) liquidity risk (มี 2 ประเภท คือ (1) ความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากการที่กองทุน/ลูกค้าไม่สามารถเลิกสัญญา (unwind/offset position) ณ ราคาตลาด เนื่องจากการขาดสภาพคล่องตลาดยังมีความลึกไม่เพียงพอ หรือเกิดวิกฤตการณ์ใด ๆ และ (2) ความเสี่ยงที่กองทุน/ลูกค้าจะไม่สามารถชำระหนี้ ณ วัน settlement หรือเมื่อมีการเรียก margin เพิ่มเติม (ถ้ามี))</p> <p>3.1) การบริหาร liquidity risk (มีแนวทางในการบริหาร liquidity risk ทั้ง 2 ประเภทอย่างไรบ้าง และจัดให้มีแผนฉุกเฉินรองรับอย่างไร)</p> <p>4) operational risk (ความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากความบกพร่องหรือความไม่เพียงพอของบุคลากร ระบบฐานข้อมูล และระบบควบคุมภายใน)</p> <p>4.1) การจัดสรรทรัพยากร (ทั้งด้านการเงินและบุคลากร) ที่เพียงพอต่อการจัดการ และการพัฒนาระบบฐานข้อมูลเพื่อรองรับการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (มีการจัดสรรทรัพยากรและพัฒนาระบบฐานข้อมูลเพื่อรองรับอย่างไร)</p> <p>4.2) ระบบฐานข้อมูลที่ใช้ในการบันทึกรายการและการคำนวณมูลค่า/สัดส่วนการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างครบถ้วนถูกต้องและเป็นปัจจุบัน ทั้งนี้ ระบบดังกล่าวจะต้องสอดคล้องกับปริมาณการจัดการและความซับซ้อนของสัญญา โดยมีการคาดการณ์ปริมาณการเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในอนาคตร่วมด้วย และระบบดังกล่าวต้องสามารถให้ข้อมูลที่ถูกต้องและเพียงพอที่จะทำให้สามารถติดตามและควบคุมสถานะความเสี่ยงได้อย่างทันต่อเหตุการณ์ (ระบบ/โปรแกรมที่ใช้คืออะไร และมีประสิทธิภาพอย่างไร)</p> <p>4.3) การแบ่งแยกหน้าที่และความรับผิดชอบระหว่างสายงานการปฏิบัติการและสายงานการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างชัดเจน (หน่วยงานใดบ้างที่มีหน้าที่และความรับผิดชอบตามสายงานดังกล่าวข้างต้น)</p>	

การพิจารณาคุณสมบัติของผู้จดทะเบียน	ข้อมูลประกอบการพิจารณาของสำนักงาน
<p>4.4) การสอบยื่นการเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าระหว่างสายงานการจัดการ เงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและสายงานการปฏิบัติการ (มีขั้นตอนและวิธีการปฏิบัติงานในเรื่องดังกล่าวอย่างไร)</p> <p>4.5) การประเมิน operational risk และการจัดให้มีแผนฉุกเฉินรองรับ และ การทบทวนขั้นตอนการปฏิบัติงาน ระบบฐานข้อมูล แผนฉุกเฉิน เพื่อลดโอกาส ที่จะเกิดความผิดพลาดและปรับปรุงการควบคุมความเสี่ยง (มีการประเมิน operational risk และจัดให้มีแผนฉุกเฉินรองรับอย่างไร และจะทบทวนและ ปรับปรุงขั้นตอนการปฏิบัติงาน ระบบฐานข้อมูล และแผนฉุกเฉิน เมื่อไร)</p> <p>5) legal risk (ความเสี่ยงที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะไม่สามารถบังคับใช้ได้ตามกฎหมาย)</p> <p>5.1) วิธีการบริหาร legal risk (มีวิธีการในการบริหาร legal risk อย่างไร)</p>	
<p><b>3. ระบบควบคุมภายในและการตรวจสอบการปฏิบัติงาน</b></p> <p>จัดให้มีระบบควบคุมภายในและการตรวจสอบการปฏิบัติงานอย่างสม่ำเสมอ ดังนี้</p> <p>1) ระบบควบคุมภายในที่ช่วยสนับสนุนให้มีการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าอย่างมีประสิทธิภาพ มีการรายงานที่เชื่อถือได้ และสามารถควบคุมให้มีการ จัดการที่เป็นไปตามกฎหมายและนโยบายของบริษัท (มีการวางระบบควบคุมภายใน/ขั้นตอนการปฏิบัติงานอย่างไรบ้าง)</p>	

การพิจารณาคุณสมบัติของผู้จดทะเบียน	ข้อมูลประกอบการพิจารณาของสำนักงาน
<p>2) การตรวจสอบการปฏิบัติงานตามระบบการบริหารความเสี่ยงและระบบควบคุมภายในเป็นระยะ ๆ (มีการตรวจสอบการปฏิบัติงานเมื่อไร ใครเป็นผู้รับผิดชอบ)</p> <p>3) การประเมินประสิทธิภาพของนโยบายและหลักปฏิบัติในการบริหารความเสี่ยงประเภทต่าง ๆ (ใครทำหน้าที่ประเมิน ประเมินเมื่อไร และเมื่อพบว่ามีข้อผิดพลาด จะดำเนินการอย่างไร)</p> <p>4) การประเมินความน่าเชื่อถือและความทันต่อเหตุการณ์ในการรายงานข้อมูลต่อผู้บริหารและคณะกรรมการบริษัท (มีวิธีการใดในการประเมิน และใครเป็นผู้รับผิดชอบ)</p> <p>5) การควบคุมมิให้มีการเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทใหม่ ๆ จนกว่าผู้ที่เกี่ยวข้อง (ผู้บริหาร ผู้จัดการลงทุน รวมทั้งบุคลากรที่รับผิดชอบในการบริหารความเสี่ยง การควบคุมภายใน และการตรวจสอบ) จะมีความรู้ความเข้าใจใน product และได้มีการวางมาตรการในการวัดและควบคุมความเสี่ยงจาก product นั้นแล้ว (วิธีการในการควบคุมเป็นอย่างไร)</p> <p>6) การประเมินความเป็นอิสระและประสิทธิภาพของสายงานที่รับผิดชอบด้านการบริหารความเสี่ยง (มีวิธีการใดในการประเมิน และใครเป็นผู้รับผิดชอบการประเมิน)</p>	
<p><b>4. ระบบการเก็บรักษาทรัพย์สิน</b></p> <p>ในกรณีที่ประสงค์จะเก็บรักษาทรัพย์สินของลูกค้า ต้องจัดให้มีระบบการเก็บรักษาทรัพย์สินดังต่อไปนี้</p>	

การพิจารณาคุณสมบัติของผู้จดทะเบียน	ข้อมูลประกอบการพิจารณาของสำนักงาน
<p>1) การจัดให้มีสัญญาหรือข้อตกลงเกี่ยวกับการดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้า (รายละเอียดที่จะกำหนดในสัญญามีอะไรบ้าง และมีวิธีการอย่างไรที่จะทำให้บุคลากรที่เกี่ยวข้องรับทราบข้อกำหนดในสัญญาดังกล่าว)</p> <p>2) บุคลากรที่รับผิดชอบงานด้านการดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้ามีความเป็นอิสระ และมีการจัดเก็บรักษาทรัพย์สินของลูกค้าแยกต่างหากจากของบริษัทและบ่งชี้ได้ว่าทรัพย์สินแต่ละรายการเป็นของลูกค้ารายใด (บุคลากรที่รับผิดชอบงานด้านการดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้ามีใครบ้าง มีความเป็นอิสระจากหน่วยงานอื่นอย่างไร และมีระบบในการจัดเก็บทรัพย์สินของลูกค้าอย่างไร)</p> <p>3) สถานที่เก็บรักษาทรัพย์สินมีความมั่นคงปลอดภัย (เก็บรักษาทรัพย์สินไว้ที่ไหน สถานที่ดังกล่าวมีความมั่นคงปลอดภัยอย่างไร)</p> <p>4) บุคลากรที่ทำหน้าที่เก็บรักษาทรัพย์สินและจัดทำทะเบียนทรัพย์สินแยกต่างหากจากบุคลากรที่ทำหน้าที่จัดทำบัญชีทรัพย์สินของลูกค้า (บุคลากรที่ทำหน้าที่ดังกล่าวคือใคร เป็นคนละคนกันหรือไม่)</p> <p>5) รายละเอียดในทะเบียนทรัพย์สิน (ทะเบียนทรัพย์สินมีรายละเอียดอะไรบ้าง ผู้อนุมัติการทำรายการคือใคร)</p> <p>6) ระบบในการฝากถอนทรัพย์สินของลูกค้า (มีระบบในการฝากถอนทรัพย์สินของลูกค้าอย่างไร)</p> <p>7) ระบบเตือนและรายงานกรณีมีรายการผิดปกติ (มีระบบเตือนและรายงานผู้บริหารกรณีบัญชีทรัพย์สินของลูกค้ามีรายการผิดปกติอย่างไร)</p> <p>8) การสอบทานและจัดทำงบกระทบยอดรายการเคลื่อนไหวของทรัพย์สินของลูกค้า (มีวิธีการในการดำเนินการอย่างไร และดำเนินการเมื่อไร)</p> <p>9) การตรวจนับ ตรวจสอบ และจัดทำงบกระทบยอดทรัพย์สินของลูกค้าที่เก็บรักษา (มีวิธีการในการดำเนินการอย่างไร และดำเนินการเมื่อไร)</p>	

การพิจารณาคุณสมบัติของผู้จดทะเบียน	ข้อมูลประกอบการพิจารณาของสำนักงาน
<p><b>III. คุณสมบัติด้านความพร้อมของบุคลากร</b></p> <p>หมายเหตุ ให้แสดงรายละเอียดประกอบการพิจารณาของสำนักงานเฉพาะกรณีของผู้จดทะเบียนประสงค์จะประกอบธุรกิจเป็นผู้จัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับลูกค้าที่เป็นกองทุนส่วนบุคคลของผู้ลงทุนทั่วไป</p> <p><b>1. ความเพียงพอของบุคลากร</b></p> <p>1) จำนวนบุคลากรที่เพียงพอต่อการปฏิบัติงาน (บุคลากรที่รับผิดชอบงานด้านบริหารความเสี่ยง บุคลากรที่รับผิดชอบงานด้านปฏิบัติการ และผู้จัดการลงทุนมีจำนวนเท่าไร สอดคล้องกับนโยบายในการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของบริษัทอย่างไร)</p>	
<p><b>2. ความรู้ความสามารถของบุคลากร</b></p> <p>1) ผู้จัดการลงทุนผ่านการอบรมและทดสอบความรู้ตามที่สำนักงานประกาศกำหนด (บุคลากรดังกล่าวมีคุณสมบัติเป็นไปตามที่ประกาศกำหนดหรือไม่ อย่างไร)</p> <p>2) บุคลากรที่ทำหน้าที่บริหารความเสี่ยงมีความเข้าใจอย่างถ่องแท้เกี่ยวกับความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและวิธีการวัดความเสี่ยง โดยจะต้องสามารถควบคุมและติดตามความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากการจัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้ (แสดงได้ว่าบุคลากรมีความรู้ความสามารถที่เพียงพอต่อการปฏิบัติงาน โดยระบุประวัติการศึกษา ประวัติการทำงาน และประวัติการฝึกอบรม เป็นต้น)</p> <p>3) บุคลากรที่รับผิดชอบด้านการปฏิบัติการจะต้องมีความรู้และประสบการณ์อย่างเพียงพอที่จะบันทึก ทำรายการ และคำนวณมูลค่าการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (แสดงได้ว่าบุคลากรมีความรู้ความสามารถที่เพียงพอต่อการปฏิบัติงาน โดยระบุประวัติการศึกษา ประวัติการทำงาน และประวัติการฝึกอบรม เป็นต้น)</p>	

