



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

26 สิงหาคม 2554

เรียน ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ทุกแห่ง¹
ตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทุกบริษัท

ที่ กลต.ธ. (ว) 15 /2554 เรื่อง แนวปฏิบัติเกี่ยวกับแผนรองรับกรณีเหตุการณ์ที่ทำให้ลูกค้าไม่สามารถส่งคำสั่งทาง internet ได้อย่างปกติ

ด้วยศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีการขยายเวลาเปิดทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีโลหะมีค่าเป็นสินค้าอ้างอิง (“Gold & Silver Futures”) เพิ่มเติมอีก 1 ชั่วโมงตั้งแต่เวลา 19.30-22.30 น. (“night session”) และมีบริษัทหลักทรัพย์และตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (“บริษัท”) หารือกันสำนักงานว่า บริษัทประสงค์จะให้บริการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในช่วงเวลาดังกล่าวโดยให้ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายด้วยตนเองโดยผ่านระบบ internet เท่านั้น และหากลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายด้วยตนเองไม่ได้เนื่องจากระบบคอมพิวเตอร์ขัดข้อง บริษัทจะมีแผนรองรับโดยจัดให้มีผู้ติดต่อ กับผู้ลงทุนดำเนินการส่งคำสั่งแทนลูกค้า นอกสถานที่ทำการของบริษัท ว่าสามารถทำได้หรือไม่

สำนักงานพิจารณาแล้วขอเรียนดังนี้

1. กรณีที่บริษัทประสงค์จะเปิดให้บริการส่งคำสั่งซื้อขาย โดยให้ลูกค้าส่งผ่านระบบ internet เท่านั้น ไม่ว่าจะเป็นช่วงการซื้อขายปกติ หรือช่วง night session นั้น ถือว่าบริษัทสามารถดำเนินการได้ เนื่องจากเป็นรูปแบบในการประกอบธุรกิจ (business model) และขึ้นอยู่กับความพร้อมของแต่ละบริษัท โดยบริษัทดังกล่าวจะต้องระมัดระวังและสื่อสารให้ลูกค้ารับทราบเกี่ยวกับขอบเขตการให้บริการดังกล่าวด้วย

2. กรณีที่บริษัทจะเปิดให้บริการโดยให้ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายผ่านระบบ internet เท่านั้น และจะมีแผนรองรับเหตุการณ์ที่ทำให้ลูกค้าไม่สามารถส่งคำสั่งผ่าน internet ด้วยตนเอง

ตามปกติ โดยให้ผู้ดูดต่อ กับผู้ลงทุน ส่งคำสั่งแทนลูกค้า สำนักงานเห็นว่า บริษัทต้องจัดให้มีผู้ดูดต่อ กับผู้ลงทุน ให้บริการในสถานที่ทำการ เพื่อให้สามารถควบคุมการปฏิบัติงาน ได้อย่างมีประสิทธิผล

อย่างไรก็ได้ ในระบบแรกของการซื้อขายในช่วง night session อาจยังมีสินค้าและ ปริมาณธุรกรรมไม่มากนัก จึงทำให้อาจมีบางบริษัทต้องการควบคุมค่าใช้จ่ายทั้งในส่วนของบุคลากร และสถานที่ทำการ โดยให้ผู้ดูดต่อ กับผู้ลงทุนบริการส่งคำสั่งนอกสถานที่ทำการของบริษัท ดังนั้น สำนักงานจึงพิจารณาผ่อนคลายให้บริษัทสามารถดำเนินการได้ โดยต้องเป็นการส่งคำสั่งแทนลูกค้า เนพาะกรณีที่มีเหตุการณ์ไม่ปกติและมีความจำเป็น รวมทั้งต้องมีได้เป็นการให้บริการในลักษณะทั่วไป โดยให้ลูกค้าแจ้งข้อขัดข้องมา ยังผู้ดูดต่อ กับผู้ลงทุนที่บริษัทมอบหมาย และบริษัทต้องมีมาตรการที่เข้มงวดในการกำกับดูแลการบริการดังกล่าวอย่างน้อยดังนี้

(1) ผู้ดูดต่อ กับผู้ลงทุน ที่จะรับคำสั่งซื้อขายจากลูกค้า จะต้องเป็นผู้ที่ได้รับการแต่งตั้ง จากผู้บัญชาติ หรือระดับสูงของบริษัทเท่านั้น

(2) ผู้ดูดต่อ กับผู้ลงทุน ต้องแจ้งและขออนุญาตผู้บังคับบัญชา ก่อนทำการ log in เข้าระบบ เพื่อส่งคำสั่งซื้อขายแทนลูกค้าทุกครั้ง และห้ามผู้ดูดต่อ กับผู้ลงทุน เข้าระบบโดยมิได้รับอนุญาต จากผู้บังคับบัญชา ในทุกรอบ

(3) บริษัทต้องกำหนดสถานที่การให้บริการของผู้ดูดต่อ กับผู้ลงทุน ในการส่งคำสั่งซื้อขายแทนลูกค้า ให้ชัดเจน เช่น สถานที่พักของผู้ดูดต่อ กับผู้ลงทุน

(4) บริษัทต้องมีการจัดเก็บที่มาของคำสั่งซื้อขายของลูกค้า ผ่านระบบการบันทึกเทป ตามข้อกำหนดของสำนักงาน และมีการจัดเก็บ log file การเข้า-ออกระบบ และการคีย์คำสั่งซื้อขาย เพื่อให้สามารถตรวจสอบได้

(5) กรณีที่มีการส่งคำสั่งให้ลูกค้าอย่างมีนัยสำคัญ เช่น ลูกค้าแต่ละรายเกิน 5 ครั้ง ต่อเดือน และลูกค้าทุกรายรวมกันเกินกว่า 10 ครั้งต่อเดือน ให้บริษัทบทวนถึงความจำเป็นในการ จัดให้มีผู้ดูดต่อ กับผู้ลงทุน เพื่อให้บริการในสถานที่ทำการของบริษัท และนำเสนอต่อกองกรรมการ ของบริษัท

(6) ฝ่ายกำกับดูแลการปฏิบัติงาน (compliance office) หรือฝ่ายตรวจสอบภายใน ต้องตรวจสอบการปฏิบัติงานของผู้ดูดต่อ กับผู้ลงทุน เป็นรายวัน ว่าได้ปฏิบัติตาม (1) ถึง (5) อย่างครบถ้วน รวมทั้งตรวจสอบเหตุผลและความจำเป็นในการให้บริการส่งคำสั่งแทนลูกค้าแต่ละครั้ง เพื่อให้มั่นใจว่า การดำเนินการดังกล่าว นั้น เป็นไปอย่างถูกต้องและสมเหตุสมผล

(7) บริษัทต้องจัดทำรายงานสรุปผลการตรวจสอบเป็นรายไตรมาส และจัดส่งให้ สำนักงานภายใน 7 วันนับจากวันสิ้นสุดในแต่ละไตรมาส

ทั้งนี้สำนักงานขอเสนอชื่อเจ้าหน้าที่สำหรับการติดต่อสอบถาม คือนางสาวรังรอง
วิจิตรไกรสր หมายเลขโทรศัพท์ 0-2263-6050

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

(นายชาลี จันทนิยং)

รองเลขานุการ

รักษาการเลขานุการ

ฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 0-2263-6050

โทรสาร 0-2263-6311