

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. 34/2556

เรื่อง การจัดระบบงานในการลงทุนในหลักทรัพย์หรือ

สัญญาซื้อขายล่วงหน้าสำหรับผู้ประกอบธุรกิจ

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 6 และข้อ 30 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน
ที่ ทธ. 63/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และการค้า
หลักทรัพย์ที่มีใช้ตราสารแห่งหนึ่งหรือหน่วยลงทุน ลงวันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2552 และข้อ 6 ข้อ 8 วรรคหนึ่ง
และข้อ 33 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. 80/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์การประกอบธุรกิจ
สัญญาซื้อขายล่วงหน้าสำหรับผู้ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ 3
สิงหาคม พ.ศ. 2552 สำนักงานออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“ผู้ประกอบธุรกิจ” หมายความว่า

(1) บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการเป็น
นายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์หรือการค้าหลักทรัพย์ ซึ่งมีได้จำกัดเฉพาะหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่ง
หรือหน่วยลงทุน

(2) ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทตัวแทนซื้อขาย
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“สมาคมบริษัทหลักทรัพย์” หมายความว่า สมาคมที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจหลักทรัพย์
ที่ได้รับใบอนุญาตและจดทะเบียนกับสำนักงาน ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 2 ให้ผู้ประกอบธุรกิจที่มีการลงทุนในหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
เพื่อเป็นทรัพย์สินของผู้ประกอบธุรกิจ (proprietary trading) จัดให้มีระบบบริหารจัดการและระบบ
บริหารความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการลงทุนดังกล่าว โดยอย่างน้อยต้องดำเนินการให้เป็นไปตาม
แนวทางที่สมาคมบริษัทหลักทรัพย์กำหนด โดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน

ข้อ 3 ให้ผู้ประกอบการจัดทำและจัดเก็บเอกสารหรือหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนในหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อเป็นทรัพย์สินของผู้ประกอบธุรกิจ ซึ่งรวมถึงรายงานการปฏิบัติงานภายในของผู้ประกอบธุรกิจเกี่ยวกับการลงทุนดังกล่าว ไว้ไม่น้อยกว่าห้าปี นับแต่วันที่ได้ทำการลงทุน โดยการจัดเก็บเอกสารหรือหลักฐานดังกล่าวต้องกระทำในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงานเรียกดูหรือตรวจสอบได้โดยไม่ชักช้า

ข้อ 4 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน พ.ศ. 2556 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 ตุลาคม พ.ศ. 2556

(นายวรพล โสคติยานุรักษ์)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์