

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน
ที่ ทธ. 30/2559
เรื่อง หลักเกณฑ์ในการประกอบกิจการเป็นศูนย์ซื้อขาย
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 55 และมาตรา 73 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขาย
ล่วงหน้า พ.ศ. 2546 คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม พ.ศ. 2560 เป็นต้นไป

หมวด 1
ข้อกำหนดทั่วไป

ส่วนที่ 1
วัตถุประสงค์ในการกำกับดูแลศูนย์ซื้อขายสัญญา

ข้อ 2 โดยที่ระบบการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในศูนย์ซื้อขายสัญญาเป็น
ระบบพื้นฐานที่สำคัญและมีความเชื่อมโยงกับระบบชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีสัญญาและระบบอื่น ๆ
ที่เกี่ยวข้อง ประกอบกับระบบเทคโนโลยีสารสนเทศเป็นระบบที่มีความจำเป็นต่อการดำเนินการเพื่อบรรลุ
เป้าหมายที่กำหนดไว้ ดังนั้น การกำหนดหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการกำกับดูแลศูนย์ซื้อขายสัญญาและการใช้งาน
ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศดังกล่าว (IT Governance) ให้เป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ รวมทั้งมีการบริหาร
จัดการความเสี่ยงและจัดสรรทรัพยากรอย่างเหมาะสม โดยคณะกรรมการและผู้บริหาร ให้สอดคล้อง
กับมาตรฐานที่องค์การระหว่างประเทศที่เกี่ยวข้องกับการกำกับการดูแลด้านตลาดทุนกำหนดขึ้นและนำไปสู่
การปฏิบัติอย่างเป็นรูปธรรมนั้น จึงมีความสำคัญและจำเป็นอย่างยิ่ง หลักเกณฑ์ตามประกาศนี้จึงกำหนดขึ้น
เพื่อให้เป็นมาตรฐานที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องดำเนินการ เพื่อให้การให้บริการที่มีประสิทธิภาพ โปร่งใส และ
สามารถตรวจสอบได้ ทั้งนี้ เพื่อสร้างความเชื่อมั่น ความมีเสถียรภาพ และความมั่นคงของระบบการเงิน
โดยรวม ตลอดจนส่งเสริมความสามารถในการแข่งขันและภาพลักษณ์ที่ดีของตลาดทุนไทย

ส่วนที่ 2

สาระสำคัญของข้อกำหนด

ข้อ 3 ประกาศนี้มีข้อกำหนดในการกำกับดูแลศูนย์ซื้อขายสัญญาในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) หลักเกณฑ์ทั่วไปในการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญา โดยมีรายละเอียด

ตามหมวด 2

(2) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและความมั่นคงปลอดภัยของระบบ

เทคโนโลยีสารสนเทศ โดยมีรายละเอียดตามหมวด 3

(3) การเก็บรักษาข้อมูลและเอกสาร โดยมีรายละเอียดตามหมวด 4

ส่วนที่ 3

อำนาจสำนักงาน ก.ล.ต.

ข้อ 4 เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามประกาศนี้ สำนักงาน ก.ล.ต. อาจกำหนดหลักเกณฑ์หรือแนวทางดังต่อไปนี้

(1) กำหนดหลักเกณฑ์ในรายละเอียดของข้อกำหนดให้มีความชัดเจนเพียงพอที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาจะสามารถปฏิบัติได้ในแนวทางเดียวกัน

(2) กำหนดแนวทางการปฏิบัติ (guideline) ในรายละเอียดของข้อกำหนด เพื่อเป็นการให้แนวทางปฏิบัติที่ถือว่าเหมาะสมและสอดคล้องตามประกาศนี้ โดยหากศูนย์ซื้อขายสัญญาปฏิบัติตามแนวทางดังกล่าวแล้ว ให้ถือว่าศูนย์ซื้อขายสัญญามีการปฏิบัติตามข้อกำหนดในเรื่องที่มีการออกแนวทางนั้น

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

ส่วนที่ 4
บทนิยาม

ข้อ 5 ในประกาศนี้

“ศูนย์ซื้อขายสัญญา” หมายความว่า ศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับใบอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“สำนักหักบัญชีสัญญา” หมายความว่า สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับใบอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์” หมายความว่า สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ตลาดหลักทรัพย์” หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ผู้รับประโยชน์จากการซื้อขายสัญญาของลูกค้า” หมายความว่า

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

การรับประโยชน์ การควบคุม หรือการสนับสนุนทางการเงินตามวรรคหนึ่งอาจเกิดขึ้นจากข้อตกลง ความเข้าใจ ความสัมพันธ์ในด้านใดด้านหนึ่งหรือโดยประการอื่นก็ได้

“ผู้บริหาร” หมายความว่า ผู้จัดการ รองผู้จัดการ ผู้ช่วยผู้จัดการ ผู้อำนวยการฝ่าย หรือผู้ซึ่งดำรงตำแหน่งเทียบเท่ากับตำแหน่งข้างต้นที่เรียกชื่ออย่างอื่น และให้หมายความรวมถึงบุคคลที่ได้ทำสัญญาให้มีอำนาจทั้งหมดหรือบางส่วนในการจัดการด้วย

“สมาชิก” หมายความว่า สมาชิกของศูนย์ซื้อขายสัญญา

หมวด 2

หลักเกณฑ์ทั่วไปในการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญา

ข้อ 6 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีแหล่งเงินทุนที่เพียงพอต่อการรองรับการประกอบการและความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ที่อาจเกิดจากการประกอบธุรกิจ โดยแหล่งเงินทุนส่วนที่มีไว้เพื่อรองรับความเสี่ยงต้องสามารถนำไปใช้ได้อย่างรวดเร็วและทันต่อเหตุการณ์

ข้อ 7 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีระบบการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยสำนักหักบัญชีสัญญาที่ดำเนินการโดยศูนย์ซื้อขายสัญญาเองหรือโดยบุคคลอื่น ทั้งนี้ ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องรับประกันการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยทันทีที่เกิดการซื้อขายขึ้นและจะสิ้นความผูกพันต่อเมื่อสำนักหักบัญชีสัญญาได้เข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญากับผู้ซื้อและผู้ขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแล้ว ในกรณีนี้ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาแจ้งข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่สำนักหักบัญชีสัญญาโดยเร็วภายหลังจากที่เกิดรายการซื้อขายขึ้น

ข้อ 8 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีมาตรการที่เพียงพอเพื่อส่งเสริมและรักษามาตรฐานในเรื่องความมั่นคง ความน่าเชื่อถือ ตลอดจนความโปร่งใสและเป็นธรรมในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ดังต่อไปนี้

(1) มีระบบการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่สามารถรองรับปริมาณการซื้อขายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น รวมทั้งสามารถขยายให้รองรับการซื้อขายที่อาจเพิ่มขึ้นในอนาคตได้ โดยต้องเปิดเผยหลักเกณฑ์และวิปฏิบัติในการจัดลำดับและการจับคู่คำสั่งซื้อขายด้วย

(2) มีระบบบันทึกข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยเฉพาะข้อมูลก่อนทำรายการซื้อขาย (pre-trade information) และข้อมูลภายหลังทำรายการซื้อขาย (post-trade information) ทั้งนี้ เพื่อติดตามและตรวจสอบการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในภายหลัง (audit trail)

(3) มีระบบติดตามและตรวจสอบสภาพการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในศูนย์ซื้อขายสัญญาที่มีประสิทธิภาพ โดยอย่างน้อยต้องกำหนดในเรื่องดังนี้

(ก) การบันทึกข้อมูลที่สามารถระบุความมีตัวตนที่แท้จริง (unique identification) ของลูกค้าและผู้รับประโยชน์จากการซื้อขายสัญญาของลูกค้าให้ตรงตามความเป็นจริงและเป็นปัจจุบันตามที่ได้รับข้อมูลจากสมาชิก โดยอาจบันทึกเป็นหมายเลขประจำตัวประชาชน เลขทะเบียนนิติบุคคล หรือเลขหมายอื่นใดที่ศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด

(ข) ระบบประมวลฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกและลูกค้าแต่ละราย เพื่อติดตามฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของบุคคลดังกล่าว

(ค) ระบบติดตามและรายงานข้อมูลเกี่ยวกับฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกและลูกค้าที่มีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าถึงระดับที่ศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด (large trader) รวมทั้งการเปลี่ยนแปลงฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของบุคคลดังกล่าว

(ง) ระบบติดตามและตรวจสอบการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นปัจจุบัน (real time)

ข้อ 9 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีมาตรการที่เพียงพอในการป้องกันและยับยั้งการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และพฤติกรรมการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ไม่เหมาะสม โดยอย่างน้อยต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) มีกฎเกณฑ์ที่ให้อำนาจศูนย์ซื้อขายสัญญาในการดำเนินการเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทั้งที่สมาชิกกระทำเพื่อตนเองและเพื่อลูกค้า

(ก) สั่งงดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เว้นแต่เป็นการซื้อขายเพื่อล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(ข) สั่งล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(ค) สั่งจำกัดฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(ง) สั่งจำกัดปริมาณการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(2) มีข้อกำหนดให้สมาชิกต้องจัดให้มีหนังสือแสดงความยินยอมของลูกค้าที่แต่งตั้งให้สมาชิกเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยลูกค้าตกลงที่จะแจ้งและจัดหาข้อมูลที่สามารถระบุความมีตัวตนที่แท้จริงของลูกค้าและผู้รับประโยชน์จากการซื้อขายสัญญาของลูกค้าให้แก่สมาชิก รวมทั้งยินยอมให้สมาชิกจัดตั้งข้อมูลดังกล่าวแก่ศูนย์ซื้อขายสัญญาและสำนักงาน ก.ล.ต. ตลอดจนยินยอมให้สมาชิกดำเนินการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแก่ลูกค้าเป็นการชั่วคราว ปิดบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า จำกัดฐานะหรือปริมาณการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าได้ ทั้งนี้ เพื่อให้เป็นไปตามคำสั่งของศูนย์ซื้อขายสัญญา

(3) มีกฎเกณฑ์ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาสามารถเปิดเผยหรือแลกเปลี่ยนข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาชิก การกระทำความผิดและการลงโทษสมาชิก รวมถึงข้อมูลอื่นใดที่ได้รับเนื่องจากการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญากับสำนักหักบัญชีสัญญา สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ ตลาดหลักทรัพย์ ศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ สำนักงาน ก.ล.ต. ธนาคารแห่งประเทศไทย สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย และองค์กรอื่นที่ติดตามตรวจสอบสินค้าหรือตัวแปร ทั้งนี้ เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สินค้า หรือตัวแปร

ข้อ 10 ในกรณีที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาให้เช่าพื้นที่วางเซิร์ฟเวอร์ (server) แก่สมาชิกเพื่อการรับส่งข้อมูลหรือคำสั่งซื้อขายที่รวดเร็ว (co-location) หรือให้บริการข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย (market data feed) ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องให้ข้อมูลเกี่ยวกับการให้บริการและ โอกาสในการใช้บริการแก่สมาชิกทุกรายอย่างโปร่งใสและเป็นธรรม

ข้อ 11 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีระบบบันทึกและเผยแพร่ข้อมูลเกี่ยวกับการเสนอราคาและการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีประสิทธิภาพ โดยอย่างน้อยต้องมีระบบการบันทึกและเผยแพร่ข้อมูลดังต่อไปนี้เป็นการทั่วไปโดยแยกตามประเภทของสินค้าและตัวแปร

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

ข้อ 12 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องจัดให้มีระบบการจัดการเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทที่เกิดขึ้นเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือเกิดจากการใช้บริการที่จัดโดยศูนย์ซื้อขายสัญญาที่มีประสิทธิภาพ โดยอย่างน้อยต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

- (1) จัดให้มีระเบียบปฏิบัติที่เป็นลายลักษณ์อักษรเกี่ยวกับการจัดการข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท โดยการกำหนดระเบียบปฏิบัติดังกล่าวต้องคำนึงถึงการคุ้มครองผู้ร้องเรียนด้วย
- (2) จัดให้มีหน่วยงานหรือบุคลากรที่มีหน้าที่รับผิดชอบเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท
- (3) จัดให้มีการติดตามตรวจสอบและแจ้งผลการพิจารณาข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทให้ผู้ร้องเรียนหรือคู่พิพาททราบ
- (4) จัดส่งรายงานสรุปข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ทุก 6 เดือน ทั้งนี้ ในรายงานดังกล่าวต้องมีบทสรุปสาระสำคัญ และผลการพิจารณาหรือการดำเนินการของศูนย์ซื้อขายสัญญา

ข้อ 13 การใดที่มีได้มีกฎหมายหรือกฎเกณฑ์กำหนดไว้เป็นการเฉพาะให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องดำเนินการด้วยตนเอง หากการนั้นเป็นการกระทำด้วยความจำเป็นเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการประกอบธุรกิจ ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาสามารถใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกได้ โดยต้องมั่นใจว่าผู้ให้บริการภายนอกสามารถปฏิบัติตามกฎหมายและกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง และการใช้บริการนั้นไม่มีผลเสมือนเป็นการไม่ประกอบธุรกิจ

ในการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องกำหนดอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) นโยบาย ขอบเขต หรือลักษณะงานที่จะใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก เป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องได้รับความเห็นชอบเป็นการทั่วไปหรือเป็นรายการฉีกคณะกรรมการของศูนย์ซื้อขายสัญญา หรือคณะทำงานที่คณะกรรมการดังกล่าวมอบหมาย

(2) มาตรการบริหารจัดการความเสี่ยงในการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกที่เหมาะสมและมีประสิทธิภาพ

(3) มาตรการตรวจสอบการให้บริการของผู้ให้บริการภายนอกที่มีประสิทธิภาพ เพื่อให้การปฏิบัติงานของผู้ให้บริการภายนอกเป็นไปตามวัตถุประสงค์ของศูนย์ซื้อขายสัญญาความในวรรคสองมิให้นำมาใช้บังคับกับกรณีที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาเป็นบริษัทที่ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้นเกินกว่าร้อยละ 50 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น และใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกที่เป็นตลาดหลักทรัพย์ หรือบริษัทที่ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้นเกินกว่าร้อยละ 50 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น

ข้อ 14 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีหลักเกณฑ์ในการรับสมาชิกที่โปร่งใสและเป็นธรรม โดยการกำหนดหลักเกณฑ์ดังกล่าวต้องคำนึงถึงความเหมาะสม ฐานะทางการเงิน ผลการดำเนินงาน ความพร้อม ความสามารถและจรรยาบรรณในการประกอบธุรกิจของผู้ที่จะเป็นสมาชิกเป็นสำคัญ

ข้อ 15 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีกฎเกณฑ์ที่ใช้บังคับกับสมาชิก มีมาตรการกำกับดูแลสมาชิกและผู้ปฏิบัติงานที่ขึ้นทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายสัญญาซึ่งได้ปฏิบัติงานให้กับสมาชิกปฏิบัติตามกฎเกณฑ์และจรรยาบรรณในการประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และมีมาตรการดำเนินการต่อบุคคลที่ฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามกฎเกณฑ์และจรรยาบรรณ ทั้งนี้ ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องประเมินการปฏิบัติตามกฎเกณฑ์และจรรยาบรรณของบุคคลดังกล่าวในช่วงเวลาที่เหมาะสมแล้วจัดทำรายงานผลการประเมินและการดำเนินการต่อบุคคลที่ฝ่าฝืนกฎเกณฑ์และจรรยาบรรณให้สำนักงาน ก.ล.ต. ทราบ

ข้อ 16 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องเผยแพร่กฎเกณฑ์และข่าวสารต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้องกับ การให้บริการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาให้แก่สมาชิกหรือผู้ที่เกี่ยวข้องกับศูนย์ซื้อขายสัญญาทราบ

ข้อ 17 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องมีมาตรการที่เพียงพอในการป้องกันมิให้กรรมการ ผู้บริหาร อนุกรรมการ ที่ปรึกษา พนักงาน ลูกจ้างหรือผู้ปฏิบัติงานให้แก่ศูนย์ซื้อขายสัญญา แสวงหาประโยชน์โดยมิชอบจากข้อมูลที่ได้รับจากการปฏิบัติหน้าที่ และมีมาตรการที่เพียงพอในการรักษา ความลับของสมาชิกและลูกค้า

ข้อ 18 เพื่อพิทักษ์ประโยชน์ของประชาชนและเพื่อคุ้มครองผู้ลงทุน ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาชิก การกระทำความผิดและการลงโทษสมาชิก รวมตลอดถึงข้อมูลอื่นใดที่ได้รับเนื่องจากการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญา ซึ่งเป็นสาระสำคัญต่อการตัดสินใจซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของผู้ลงทุนหรือการทำธุรกรรมกับสมาชิก

การเปิดเผยข้อมูลตามวรรคหนึ่ง ต้องกระทำในลักษณะที่ทันต่อเหตุการณ์ มีข้อมูลเพียงพอ และประชาชนมีโอกาสได้รับข้อมูลอย่างเท่าเทียมกัน ทั้งนี้ ประเภทของข้อมูล วิธีการและเงื่อนไขในการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวให้เป็นไปตามที่ศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด โดยความเห็นชอบของคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

หมวด 3

การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ

ข้อ 19 ในหมวดนี้

"ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา" หมายความว่า ระบบคอมพิวเตอร์หรือระบบเครือข่ายที่สำคัญที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามข้อ 8(1) และ (2) ซึ่งหากไม่สามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่อง อาจส่งผลกระทบต่ออย่างมีนัยสำคัญต่อศูนย์ซื้อขายสัญญาหรือผู้ที่เกี่ยวข้องกับศูนย์ซื้อขายสัญญา

ข้อ 20 หมวดนี้มีข้อกำหนดเกี่ยวกับการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 1
- (2) การทบทวน ติดตามและตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 2
- (3) การรายงานการเปลี่ยนแปลงเกี่ยวกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา (material systems change report) โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 3
- (4) การบริหารจัดการเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย (incident management) โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 4
- (5) การกำหนดนโยบาย การติดตามและการวิเคราะห์ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 5

ส่วนที่ 1

การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ

ข้อ 21 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องดำเนินการให้มีความพร้อมในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยอย่างน้อยต้องกำหนดในเรื่องดังต่อไปนี้เป็นลายลักษณ์อักษร

(1) นโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ โดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการของศูนย์ซื้อขายสัญญาหรือคณะกรรมการที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าว เพื่อให้มั่นใจว่าหากมีเหตุการณ์ที่ไม่ปกติเกิดขึ้น การซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ายังสามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่อง หรือสามารถแก้ไขให้กลับมาดำเนินการต่อได้ภายในระยะเวลาที่เหมาะสม

(2) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องที่สอดคล้องกับนโยบายที่กำหนดขึ้นตาม (1) โดยได้รับความเห็นชอบจากผู้จัดการหรือผู้ดำรงตำแหน่งเทียบเท่าที่เรียกชื่ออย่างอื่น

ข้อ 22 แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องตามข้อ 21(2) ต้องระบุรายละเอียดอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) มาตรการรองรับเมื่อเกิดกรณีฉุกเฉินที่อาจมีผลกระทบต่อการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญา โดยต้องกำหนดขอบเขตของกรณีฉุกเฉินให้ครอบคลุมถึงเหตุการณ์ต่าง ๆ ที่อาจเกิดขึ้น รวมทั้งขั้นตอนการดำเนินการ และผู้รับผิดชอบในการดำเนินการตามขั้นตอนดังกล่าวในแต่ละกรณีให้ชัดเจน

(2) รายชื่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญา

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

(4) ระยะเวลากู้คืนระบบงาน (recovery time objective)

(5) ข้อมูลล่าสุดที่จะกู้คืนได้ (recovery point objective)

(6) รายละเอียดของระบบงานสำรองและศูนย์สำรองที่สอดคล้องกับนโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง

ข้อ 23 ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องจัดให้มีมาตรการควบคุมติดตามและสื่อสารกับสมาชิก เพื่อให้ปฏิบัติตามนโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ และแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องได้อย่างมีประสิทธิภาพ

ข้อ 24 เพื่อให้การกำกับดูแลการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาดำเนินการในเรื่องดังต่อไปนี้อย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง

- (1) ทดสอบแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องร่วมกับสมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้อง
- (2) ประเมินผลการทดสอบแผนตาม (1) โดยผู้ที่มีความรู้ความสามารถและมีความเป็นอิสระจากผู้จัดทำหรือผู้บริหารแผนนั้น
- (3) รายงานผลการทดสอบตาม (2) ต่อคณะกรรมการของศูนย์ซื้อขายสัญญาและสำนักงาน ก.ล.ต. ภายใน 90 วันนับแต่วันที่ดำเนินการทดสอบเสร็จสิ้น

ข้อ 25 ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาที่ส่งผลกระทบต่อการประกอบธุรกิจของศูนย์ซื้อขายสัญญา ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาทบทวนและปรับปรุงแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องโดยไม่ชักช้า

ส่วนที่ 2

การทบทวน ติดตามและตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา

ข้อ 26 เพื่อให้การกำกับดูแลเกี่ยวกับขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานที่เกี่ยวข้องกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) ทบทวน ติดตามและตรวจสอบขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา และระบบการติดตามและตรวจสอบการซื้อขาย (surveillance) ตามแผนการตรวจสอบซึ่งจัดทำตามระดับความเสี่ยงของศูนย์ซื้อขายสัญญา โดยผู้ที่มีความรู้ความสามารถและมีความเป็นอิสระ เช่น ผู้ตรวจสอบภายในหรือภายนอก (internal or external auditor) เป็นต้น ทั้งนี้ ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาจัดส่งรายงานผลการทบทวน ติดตามและตรวจสอบปีละ 1 ครั้ง พร้อมทั้งแผนการตรวจสอบซึ่งจัดทำตามระดับความเสี่ยงของศูนย์ซื้อขายสัญญาต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายใน 60 วัน นับแต่วันที่ได้เสนอรายงานดังกล่าวต่อคณะกรรมการของศูนย์ซื้อขายสัญญาหรือคณะกรรมการที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าว

(2) ทดสอบการเจาะระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา (penetration test) ให้ครบถ้วนทุกระบบงานทุก 3 ปี โดยเรียงลำดับความสำคัญตามผลการประเมินความเสี่ยง และรายงานผลการทดสอบดังกล่าวต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายในไตรมาสแรกของปีถัดจากปีที่มีการทดสอบแต่ละระบบ

ส่วนที่ 3

การรายงานการเปลี่ยนแปลงเกี่ยวกับระบบ คอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา (material systems change report)

ข้อ 27 เพื่อให้การกำกับดูแลการประกอบธุรกิจโดยรวมของศูนย์ซื้อขายสัญญา
ดำเนินการไปด้วยความเรียบร้อย มีประสิทธิภาพ และทันต่อเหตุการณ์ ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญารายงาน
การเปลี่ยนแปลงใด ๆ ที่มีนัยสำคัญต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา หรือระบบติดตาม
ตรวจสอบสภาพการซื้อขาย (market surveillance) ต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายในเดือนมกราคม
ของปีถัดไป

ส่วนที่ 4

การบริหารจัดการเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อ ต่อความมั่นคงปลอดภัย (incident management)

ข้อ 28 ในส่วนนี้

“เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย” หมายความว่า

(1) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาไม่สามารถ
ดำเนินการได้ตามปกติ (system disruption and system degrade)

(2) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาไม่สามารถ
ดำเนินการให้เป็นไปตามกฎหมาย กฎเกณฑ์ ระเบียบ ข้อบังคับที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. คณะกรรมการ
กำกับตลาดทุน สำนักงาน ก.ล.ต. หรือศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด (system non-compliance)

(3) เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญา
อันเกิดจากการบุกรุก (system intrusion)

ข้อ 29 เมื่อมีเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยเกิดขึ้น
ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญารวบรวมข้อมูลเพื่อวิเคราะห์สาเหตุของปัญหา พร้อมทั้งกำหนดแนวทางการแก้ไข
และรายงานเหตุการณ์ดังกล่าวต่อผู้บริหาร รวมทั้งจัดเก็บเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องไว้ในลักษณะ
ที่พร้อมให้สำนักงาน ก.ล.ต. เรียกดูหรือตรวจสอบได้

ข้อ 30 เพื่อให้เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยได้รับการจัดการอย่างถูกต้องและมีประสิทธิภาพภายในระยะเวลาที่เหมาะสม ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) กำหนดและดำเนินการตามแผนรองรับในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยที่ได้กำหนดไว้เป็นลายลักษณ์อักษร

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

ข้อ 31 ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยซึ่งมีความร้ายแรง นอกจากต้องปฏิบัติตามข้อ 29 และข้อ 30 แล้ว ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญารายงานเหตุการณ์ดังกล่าวต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้เพิ่มเติมด้วย

(1) รายงานโดยทางวาจาหรือทางจดหมายอิเล็กทรอนิกส์ทันทีเมื่อทราบเหตุการณ์

(2) รายงานผลการตรวจสอบเหตุการณ์เป็นลายลักษณ์อักษร (investigation report) เมื่อเหตุการณ์นั้นได้รับการแก้ไขแล้วภายใน 30 วันนับแต่วันที่คณะกรรมการของศูนย์ซื้อขายสัญญาหรือคณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าวได้รับรายงาน แต่ทั้งนี้ ต้องไม่เกิน 90 วัน นับแต่วันที่เกิดเหตุการณ์นั้น

รายงานผลการตรวจสอบตามวรรคหนึ่ง (2) ต้องประกอบด้วยคำอธิบายรายละเอียดของเหตุการณ์ ผลกระทบต่อการดำเนินงานของศูนย์ซื้อขายสัญญาและสมาชิก รวมทั้งสาเหตุที่แท้จริงของปัญหา (root cause) ขั้นตอนการดำเนินการแก้ไขปัญหาและมาตรการป้องกันเพื่อไม่ให้เกิดเหตุการณ์ในลักษณะเดียวกันนี้อีก

เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามความในวรรคหนึ่ง คำว่า “เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยซึ่งมีความร้ายแรง” หมายความว่า

(1) เหตุการณ์ที่ส่งผลให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาไม่สามารถดำเนินการได้ตามปกติในลักษณะที่ทำให้การให้บริการต้องหยุดชะงักลง

(2) เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญา อันเกิดจากการบุกรุก ซึ่งอาจกระทบต่อความน่าเชื่อถือของศูนย์ซื้อขายสัญญาอย่างร้ายแรง

ส่วนที่ 5

การกำหนดนโยบาย การติดตามและการวิเคราะห์
ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ

ข้อ 32 เพื่อให้การรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศของศูนย์ซื้อขายสัญญาที่มีประสิทธิภาพ สามารถรักษาไว้ซึ่งความลับ ความถูกต้อง ความน่าเชื่อถือของข้อมูล และความพร้อมใช้งาน ตลอดจนการติดตามวิเคราะห์ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาได้อย่างเหมาะสม ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

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

(2) ติดตามและวิเคราะห์ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาโดยบันทึกและจัดเก็บหลักฐานการใช้งาน รวมถึงเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ (log)

หมวด 4

การเก็บรักษาข้อมูลและเอกสาร

ข้อ 33 ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาเก็บรักษาข้อมูลและเอกสารให้เป็นไปตามกำหนดเวลาดังต่อไปนี้

(1) ข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าซึ่งรวมทั้งข้อมูลก่อนทำรายการซื้อขายและข้อมูลภายหลังทำรายการซื้อขายตามข้อ 8(2) ให้เก็บรักษาเป็นเวลาไม่น้อยกว่า 10 ปี นับแต่วันที่มีการบันทึกข้อมูล

(2) ข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินการตามข้อ 8(3)(ข) (ค) และ (ง) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปีนับแต่วันที่มีการดำเนินการดังกล่าว

(3) เอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท และผลการพิจารณาตามข้อ 12(4) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปีนับแต่วันที่มีข้อยุติเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทนั้น

(4) หลักฐานการตรวจสอบการให้บริการของผู้ให้บริการภายนอกตามข้อ 13 วรรคสอง (3) และเอกสารที่เกี่ยวข้องกับการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการดำเนินการนั้น

(5) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องตามข้อ 21(2) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการจัดทำแผนดังกล่าว

(6) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องที่มีการแก้ไขตามข้อ 25 ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการแก้ไขแผนดังกล่าว

(7) หลักฐานการใช้งานรวมถึงเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศตามข้อ 32(2) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่าระยะเวลาตามที่กฎหมายว่าด้วยการกระทำความผิดเกี่ยวกับคอมพิวเตอร์กำหนด

ในการปฏิบัติตามข้อกำหนดในวรรคหนึ่ง ให้คณะกรรมการกำกับตลาดทุนมีอำนาจสั่งการเป็นประการอื่นได้ตามที่เห็นสมควร

การจัดเก็บข้อมูล เอกสารและหลักฐานตามข้อกำหนดในวรรคหนึ่ง ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาจัดเก็บไว้ในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงาน ก.ล.ต. เรียกดูหรือตรวจสอบได้

หมวด 5

บทเฉพาะกาล

ข้อ 34 ให้บรรดาประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ คำสั่ง และหนังสือเวียน ที่ออกหรือวางแนวปฏิบัติตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทด. 96/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ในการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและสำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ 28 ตุลาคม พ.ศ. 2552 ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญา ซึ่งใช้บังคับอยู่ในวันก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ ยังคงใช้บังคับได้ต่อไปเท่าที่ไม่ขัดหรือแย้งกับข้อกำหนดแห่งประกาศนี้ จนกว่าจะได้มีประกาศ คำสั่ง และหนังสือเวียน ที่ออกหรือวางแนวปฏิบัติตามประกาศนี้ใช้บังคับ

ข้อ 35 ในกรณีที่มีประกาศอื่นอ้างอิงประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน
ที่ ทด. 96/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ในการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและสำนักหักบัญชี
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ 28 ตุลาคม พ.ศ. 2552 ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการประกอบการเป็น
ศูนย์ซื้อขายสัญญาให้การอ้างอิงดังกล่าวหมายถึงการอ้างอิงประกาศฉบับนี้

ประกาศ ณ วันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2559

(นายรพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน