

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทธ. 31 /2559

เรื่อง หลักเกณฑ์ในการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชี

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 76 มาตรา 82 วรรคสาม และมาตรา 83 วรรคสอง ประกอบกับมาตรา 34(2) และมาตรา 89 วรรคหนึ่ง ประกอบกับมาตรา 73 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม พ.ศ. 2560 เป็นต้นไป

หมวด 1

ข้อกำหนดทั่วไป

ส่วนที่ 1

วัตถุประสงค์ในการกำกับดูแลสำนักหักบัญชีสัญญา

ข้อ 2 โดยที่ระบบการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นระบบพื้นฐานที่สำคัญ และมีความเชื่อมโยงกับระบบการซื้อขายในศูนย์ซื้อขายสัญญาและระบบอื่นๆที่เกี่ยวข้อง ประกอบกับ ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศเป็นระบบที่มีความจำเป็นต่อองค์กรในการดำเนินการเพื่อบรรลุเป้าหมายที่กำหนดไว้ ดังนั้น การกำหนดหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการกำกับดูแลสำนักหักบัญชีสัญญาและการทำงานของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศดังกล่าว (IT Governance) ให้เป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ รวมทั้งมีการบริหารจัดการความเสี่ยงและจัดสรรทรัพยากรอย่างเหมาะสม โดยคณะกรรมการและผู้บริหาร ให้สอดคล้องกับมาตรฐานที่องค์การระหว่างประเทศที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลด้านตลาดทุน กำหนดขึ้นและนำไปสู่การปฏิบัติอย่างเป็นรูปธรรมนั้น จึงมีความสำคัญและจำเป็นอย่างยิ่ง หลักเกณฑ์ตามประกาศนี้จึงกำหนดขึ้นเพื่อให้เป็นมาตรฐานที่สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการเพื่อการให้บริการที่มีประสิทธิภาพ มีความโปร่งใสและสามารถตรวจสอบได้ ทั้งนี้ เพื่อสร้างความเชื่อมั่น ความมีเสถียรภาพ และความมั่นคงของระบบการเงินโดยรวม ตลอดจนส่งเสริมความสามารถในการแข่งขันและภาพลักษณ์ที่ดีของตลาดทุนไทย

ส่วนที่ 2

หลักการสำคัญในการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญา

ข้อ 3 เพื่อเป็นการส่งเสริมให้สำนักหักบัญชีสัญญาซึ่งเป็นโครงสร้างพื้นฐานทางการเงิน (financial market infrastructures) ที่สำคัญ มีระบบงานรวมถึงระบบบริหารความเสี่ยงที่มีประสิทธิภาพและมีความมั่นคงปลอดภัย รวมทั้งให้บริการแก่ผู้ที่เกี่ยวข้องอย่างโปร่งใสและเป็นธรรม โดยมีการดำเนินงานที่เหมาะสมและสอดคล้องกับมาตรฐานที่องค์การระหว่างประเทศที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลด้านตลาดทุนกำหนดขึ้น สำนักหักบัญชีสัญญาต้องประกอบการภายใต้หลักการที่สำคัญดังต่อไปนี้

- (1) การบริหารกิจการที่ดีและการจัด โครงสร้างองค์กรที่มีความชัดเจนและโปร่งใส
- (2) การบริหารจัดการความเสี่ยง (risk management) ที่ดีเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านกฎหมาย (legal) ด้านเครดิต (credit) ด้านสภาพคล่อง (liquidity) ด้านการดำเนินการ (operation) และความเสี่ยงด้านอื่น ๆ โดยมีมาตรการในการติดตาม ควบคุม และจัดการความเสี่ยงในแต่ละด้านอย่างเหมาะสม เพื่อให้มั่นใจได้ว่าการบริหารจัดการดังกล่าวสามารถรองรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้น
- (3) การมีแหล่งเงินทุนที่เพียงพอ มีระบบและกลไกเกณฑ์ในการรับและกำกับดูแลสมาชิกที่เหมาะสม และรองรับวิถีปฏิบัติที่ทำให้มั่นใจได้ว่าจะสามารถชำระหนี้ได้อย่างมีประสิทธิภาพ รวมถึงต้องมีกระบวนการในการจัดการกรณีที่มีการผิดนัดชำระหนี้ด้วย
- (4) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ (business continuity management) โดยมีมาตรการที่เหมาะสมและสอดคล้องกับมาตรฐานสากล อันเป็นการส่งเสริมและรักษาไว้ซึ่งความพร้อมในการใช้งานของระบบงานที่สำคัญของสำนักหักบัญชีสัญญาให้สามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่อง
- (5) การเปิดเผยข้อมูลอย่างชัดเจน โปร่งใสและเพียงพอเพื่อให้สมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจนั้น ๆ สามารถเข้าใจผลกระทบและความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้น

ส่วนที่ 3

สาระสำคัญของข้อกำหนด

ข้อ 4 ประกาศนี้มีข้อกำหนดในการกำกับดูแลสำนักหักบัญชีสัญญาในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) การบริหารกิจการที่ดีและการจัด โครงสร้างองค์กร โดยมีรายละเอียดตามหมวด 2
- (2) ข้อกำหนดเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจ โดยมีรายละเอียดตามหมวด 3
- (3) การบริหารจัดการความเสี่ยง โดยมีรายละเอียดตามหมวด 4

- (4) การบริหารจัดการกรณีที่มีการเชื่อมโยงการให้บริการกับผู้ที่เกี่ยวข้องของ
สำนักหักบัญชีสัญญา โดยมีรายละเอียดตามหมวด 5
- (5) การจัดการและการเปิดเผยข้อมูล โดยมีรายละเอียดตามหมวด 6
- (6) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและความมั่นคงปลอดภัยของระบบ
เทคโนโลยีสารสนเทศ โดยมีรายละเอียดตามหมวด 7
- (7) การให้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก โดยมีรายละเอียดตามหมวด 8
- (8) การจัดการเรื่องร้องเรียน โดยมีรายละเอียดตามหมวด 9
- (9) การเก็บรักษาข้อมูลและเอกสาร โดยมีรายละเอียดตามหมวด 10

ส่วนที่ 4

อำนาจสำนักงาน ก.ล.ต.

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

- (1) กำหนดหลักเกณฑ์ในรายละเอียดของข้อกำหนดให้มีความชัดเจนเพียงพอ
ที่สำนักหักบัญชีสัญญาจะสามารถปฏิบัติได้ในแนวทางเดียวกัน
- (2) กำหนดแนวทางการปฏิบัติ (guideline) ในรายละเอียดของข้อกำหนดเพื่อเป็นการให้
แนวทางปฏิบัติที่ถือว่าเหมาะสมและสอดคล้องตามประกาศนี้ โดยหากสำนักหักบัญชีสัญญาปฏิบัติ
ตามแนวทางดังกล่าวแล้ว ให้ถือว่าสำนักหักบัญชีสัญญาปฏิบัติตามข้อกำหนดในเรื่องที่มีการออก
แนวทางนั้น
- (3) เพื่อให้สำนักงาน ก.ล.ต. สามารถติดตามการปฏิบัติตามประกาศนี้ได้
ให้สำนักหักบัญชีสัญญายื่นรายงานหรือแสดงเอกสารใดตามระยะเวลาหรือเป็นครั้งคราวต่อ
สำนักงาน ก.ล.ต.ภายในระยะเวลาที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด โดยต้องไม่เป็นภาระต่อสำนักหักบัญชี
สัญญาจนเกินสมควร

ส่วนที่ 5

บทนิยาม

ข้อ 6 ในประกาศนี้

“สำนักหักบัญชีสัญญา” หมายความว่า สำนักหักบัญชีสัญญาซึ่งขายล่วงหน้า
ได้รับใบอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์” หมายความว่า สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ศูนย์ซื้อขายสัญญา” หมายความว่า ศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับใบอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“ศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์” หมายความว่า ศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์” หมายความว่า ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ตลาดหลักทรัพย์” หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“คณะกรรมการ” หมายความว่า คณะกรรมการของสำนักหักบัญชีสัญญา

“กรรมกรที่มีส่วนร่วมบริหารงาน” หมายความว่า กรรมกรที่มีส่วนร่วมบริหารงานตามที่กำหนดไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายหุ้นที่ออกใหม่

“ผู้บริหาร” หมายความว่า ผู้จัดการ รองผู้จัดการ ผู้ช่วยผู้จัดการ ผู้อำนวยการฝ่าย หรือผู้ซึ่งดำรงตำแหน่งเทียบเท่าตำแหน่งข้างต้นที่เรียกชื่ออย่างอื่น และให้หมายความรวมถึงบุคคลที่ได้ทำสัญญาให้มีอำนาจทั้งหมดหรือบางส่วนในการจัดการด้วย

“บริษัทในเครือ” หมายความว่า บริษัทในเครือตามที่กำหนดไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการให้บุคคลอื่นเป็นผู้รับดำเนินการในงานที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจ

“สมาชิก” หมายความว่า สมาชิกของสำนักหักบัญชีสัญญา

“อำนาจควบคุมกิจการ” หมายความว่า อำนาจควบคุมกิจการตามที่กำหนดไว้ในมาตรา 89/1 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก” หมายความว่า

(1) ทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีสัญญาได้รับมาจากสมาชิกทั้งที่เป็นของสมาชิกและของลูกค้ำเพื่อเป็นประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(2) ทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีสัญญาได้รับมาเนื่องจากการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทั้งของสมาชิกและของลูกค้ำ

(3) ทรัพย์สินที่สมาชิกรับมาวางไว้กับสำนักหักบัญชีสัญญาเพื่อความมั่นคงของระบบการซื้อขายและการชำระหนี้ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

หมวด 2

การบริหารกิจการที่ดีและการจัดโครงสร้างองค์กร

ข้อ 7 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีข้อกำหนดเกี่ยวกับการบริหารกิจการที่ดีที่มีความชัดเจนและเป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการ

ข้อกำหนดตามวรรคหนึ่งจะต้องเป็นการส่งเสริมความมั่นคงและประสิทธิภาพของสำนักหักบัญชีสัญญา รวมทั้งคำนึงถึงผลประโยชน์สาธารณะและผู้ให้บริการ โดยต้องระบุอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) นโยบายป้องกันและจัดการความขัดแย้งทางผลประโยชน์

(2) มาตรการที่เพียงพอในการป้องกันมิให้กรรมการ ผู้บริหาร อนุกรรมการ ที่ปรึกษา พนักงาน ลูกจ้างหรือผู้ปฏิบัติงานให้แก่สำนักหักบัญชีสัญญาแสวงหาประโยชน์โดยมิชอบจากข้อมูลที่ได้รับจากการปฏิบัติหน้าที่ และมีมาตรการที่เพียงพอในการรักษาความลับของสมาชิกและลูกค้า

ให้สำนักหักบัญชีสัญญาเปิดเผยข้อกำหนดเกี่ยวกับการบริหารกิจการที่ดีต่อประชาชนและผู้ที่เกี่ยวข้องเป็นการทั่วไปภายหลังจากข้อกำหนดดังกล่าวได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการแล้ว

ข้อ 8 เพื่อให้การดำเนินการของสำนักหักบัญชีสัญญาเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ โปร่งใส และส่งเสริมความมีเสถียรภาพของตลาดทุน รวมทั้งสอดคล้องกับข้อกำหนดเกี่ยวกับการบริหารกิจการที่ดีซึ่งได้กำหนดขึ้นตามข้อ 7 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีคณะกรรมการขึ้นคณะหนึ่ง ประกอบด้วยประธานกรรมการ กรรมการที่มีส่วนร่วมบริหารงาน และกรรมการอิสระที่แต่งตั้งจากผู้ที่มีความรู้และมีประสบการณ์ที่เกี่ยวกับตลาดทุนหรือที่จะเป็นประโยชน์ต่อการประกอบการของสำนักหักบัญชีสัญญา

เพื่อให้เป็นไปตามที่กำหนดไว้ในวรรคหนึ่ง สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) กำหนดบทบาทหน้าที่และความรับผิดชอบที่ชัดเจนของคณะกรรมการและผู้บริหาร

(2) ประเมินผลการปฏิบัติหน้าที่ของคณะกรรมการและผู้บริหาร

ข้อ 9 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการจัดโครงสร้างองค์กรอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) กรรมการอิสระตามข้อ 8 วรรคหนึ่งในจำนวนอย่างน้อย 1 ใน 3 ของจำนวนกรรมการทั้งหมดและต้องมีจำนวนไม่น้อยกว่า 2 คน

(2) ระบบการควบคุมกิจการภายในที่มีประสิทธิภาพ และระบบการตรวจสอบที่มีประสิทธิภาพและเป็นอิสระ

(3) จัดให้มีคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง เพื่อทำหน้าที่กำหนดนโยบายในการบริหารจัดการความเสี่ยงและติดตามให้มีการปฏิบัติตามนโยบายดังกล่าว โดยแต่งตั้งจากผู้ที่มีความรู้และมีประสบการณ์ในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า การบริหารความเสี่ยง หรือการบริหารงานสำนักหักบัญชีสัญญา ทั้งนี้ ประธาน และกรรมการจำนวนไม่น้อยกว่ากึ่งหนึ่งของจำนวนกรรมการทั้งหมด ต้องไม่เป็นผู้บริหาร พนักงานหรือลูกจ้างของสำนักหักบัญชีสัญญาและบริษัทในเครือของสำนักหักบัญชีสัญญา

(4) จัดให้มีหน่วยงานที่ทำหน้าที่บริหารจัดการความเสี่ยงตามกรอบนโยบายความเสี่ยง ทั้งนี้ การจ่ายผลตอบแทนให้กับหน่วยงานดังกล่าวต้องไม่ก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์

ข้อ 10 กรรมการอิสระตามข้อ 8 วรรคหนึ่ง ต้องเป็นผู้ที่มีความอิสระในการปฏิบัติหน้าที่ เป็นกลาง และมีความเป็นธรรม ตลอดจนคำนึงถึงประโยชน์ส่วนรวม ความมั่นคงปลอดภัยและเสถียรภาพของระบบตลาดทุนเป็นสำคัญ

กรรมการอิสระของสำนักหักบัญชีสัญญาต้องไม่มีลักษณะดังต่อไปนี้

(1) เป็นหรือเคยเป็นกรรมการที่มีส่วนร่วมบริหารงาน ผู้บริหาร พนักงาน ลูกจ้าง ที่ปรึกษา หรือบุคคลที่มีตำแหน่งอื่นใดที่เทียบเท่าตำแหน่งข้างต้นของสำนักหักบัญชีสัญญาและบริษัทในเครือของสำนักหักบัญชีสัญญา เว้นแต่จะได้พ้นจากตำแหน่งดังกล่าวมาแล้ว ไม่น้อยกว่า 2 ปีก่อนวันที่รับตำแหน่ง

(2) เป็นกรรมการ ผู้บริหาร พนักงาน ลูกจ้าง หรือบุคคลที่มีตำแหน่งอื่นใดที่เทียบเท่าตำแหน่งข้างต้น รวมทั้งบุคคลที่มีส่วนร่วมบริหารงานของสมาชิก

(3) เป็นผู้ถือหุ้นที่มีอำนาจควบคุมกิจการของสำนักหักบัญชีสัญญา

(4) เป็นบุคคลอื่นใดที่ไม่สามารถให้ความเห็นได้โดยอิสระเกี่ยวกับการดำเนินงานของสำนักหักบัญชีสัญญา

หมวด 3

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจ

ข้อ 11 ในการให้บริการระบบการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชีสัญญาต้องมีระบบที่สามารถให้ความมั่นใจว่าจะมีการปฏิบัติการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยสำนักหักบัญชีสัญญาต้องเข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญากับผู้ซื้อและผู้ขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ในทันทีที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาแจ้งข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายให้แก่สำนักหักบัญชีสัญญาภายหลังจากที่
เกิดรายการซื้อขายในศูนย์ซื้อขายสัญญา และสำนักหักบัญชีสัญญาหรือผู้ที่เกี่ยวข้องจะยกเลิก แก้ไข
หรือเปลี่ยนแปลงรายการมิได้ เว้นแต่ระเบียบหรือข้อบังคับซึ่งได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการ
กำกับตลาดทุนจะกำหนดเป็นอย่างอื่น

ข้อ 12 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องกำหนดระเบียบและขั้นตอนที่เกี่ยวข้องกับ
การชำระหนี้ที่ชัดเจน เพื่อให้การชำระหนี้เป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ โดยอย่างน้อยต้องมีการดำเนินการ
ดังต่อไปนี้

- (1) ประมวลผลการซื้อขายสัญญาเพื่อแจ้งยอดสุทธิของการชำระหนี้ให้แก่สมาชิก
- (2) กำหนดขั้นตอนและระยะเวลาในการชำระหนี้รวมทั้งกำหนดจุดเวลาเพื่อการ
ชำระหนี้ที่ให้อธิบายว่าเป็นที่สุด (finality of settlement) ในข้อบังคับอย่างชัดเจน
- (3) กำหนดขั้นตอนและวิธีดำเนินการเมื่อสมาชิกมีการผิดนัดชำระหนี้ตาม
สัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้ชัดเจนเพื่อให้สามารถจัดการเมื่อเกิดเหตุผิดนัดได้อย่างมีประสิทธิภาพและทันเวลา
โดยมีการเปิดเผยขั้นตอนและวิธีการดำเนินการดังกล่าวเป็นการทั่วไป รวมทั้งทดสอบร่วมกับสมาชิก
และผู้ที่เกี่ยวข้อง และทบทวนขั้นตอนและวิธีดำเนินการกรณีสมาชิกผิดนัด (default procedure)
อย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง
- (4) ในกรณีที่มีการชำระราคาผ่านธนาคารพาณิชย์ สำนักหักบัญชีสัญญาต้องกำหนด
หลักเกณฑ์ในการเลือกใช้ธนาคารพาณิชย์ที่เหมาะสม และมีประสิทธิภาพ โดยต้องมีมาตรการบริหาร
จัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้น

ข้อ 13 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องมีระบบกำกับตรวจสอบฐานะทางการเงิน
และความเสี่ยงโดยรวมของสมาชิก โดยอย่างน้อยต้องมีการประเมินและติดตามฐานะทางการเงิน
ความมั่นคงทางการเงิน และระบบการบริหารความเสี่ยงของสมาชิกอย่างสม่ำเสมอ และมีมาตรการ
ดำเนินการเพื่อให้มั่นใจว่าฐานะทางการเงินและระบบการบริหารความเสี่ยงของสมาชิกเป็นไปตามระเบียบ
หรือข้อบังคับของสำนักหักบัญชีสัญญา

ข้อ 14 ในกรณีที่มีการส่งมอบสินค้าอ้างอิงตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชี
สัญญาต้องจัดให้มีข้อบังคับหรือข้อตกลงที่มีความชัดเจนและเป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องกำหนด
อย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) หน้าที่และความรับผิดชอบของสำนักหักบัญชีสัญญากับสมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้อง
เกี่ยวกับการส่งมอบสินค้าอ้างอิงตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(2) กระบวนการรองรับการฟื้นัดชำระหนี้ หรือส่งมอบสินค้าอ้างอิงตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ข้อ 15 ในกรณีที่สำนักหักบัญชีสัญญาลงทุนหรือฝากทรัพย์สินไว้กับธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศ สำนักหักบัญชีสัญญาต้องมีการประเมินความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการใช้บริการจากธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศ เพื่อให้มั่นใจว่าธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศมีกระบวนการเก็บรักษาทรัพย์สินที่มีประสิทธิภาพ มีความสามารถชำระหนี้เมื่อทวงถาม และอยู่ภายใต้การกำกับดูแลขององค์กรที่น่าเชื่อถือ ทั้งนี้ การลงทุนและฝากทรัพย์สินดังกล่าวต้องไม่กระจุกตัวในธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศแห่งใดแห่งหนึ่งมากเกินไป

ข้อ 16 ในการดูแลรักษาทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดทำและเก็บรักษาบัญชีทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิกแยกจากของสำนักหักบัญชีสัญญา โดยให้ดำเนินการแยกเป็นบัญชีของสมาชิกแต่ละราย รวมทั้งจัดทำและเก็บรักษาบัญชีทรัพย์สินของลูกค้าแยกจากบัญชีทรัพย์สินของสมาชิกให้ถูกต้องครบถ้วนและเป็นปัจจุบัน

(2) จัดเก็บทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิกให้มีความปลอดภัย มั่นคง และมีรายการและจำนวนตรงตามที่ปรากฏในบัญชีทรัพย์สินตาม (1)

(3) จัดเก็บทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิกแยกจากทรัพย์สินของสำนักหักบัญชีสัญญาในลักษณะที่สามารถชี้เฉพาะได้ว่าเป็นทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิกโดยปราศจากเหตุสงสัย

(4) รายงานการดูแลรักษาทรัพย์สินดังกล่าวให้สมาชิกทราบภายในระยะเวลาที่เหมาะสม ให้สำนักหักบัญชีสัญญากำหนดกฎเกณฑ์สำหรับการดำเนินการตามวรรคหนึ่ง

ข้อ 17 ในการดูแลรักษาทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก สำนักหักบัญชีสัญญาจะใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกมิได้

ในกรณีที่สำนักหักบัญชีสัญญาได้ปฏิบัติตามวิธีการที่กำหนดดังต่อไปนี้ มิให้ถือว่าเป็นการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกและให้ถือว่าเป็นการแยกทรัพย์สินตามข้อ 16(3)

(1) ในกรณีที่เป็ทรัพย์สินประเภทเงิน ให้ดำเนินการตามหลักเกณฑ์ดังนี้

(ก) จัดเก็บโดยการฝากไว้กับธนาคารพาณิชย์หรือธนาคารอื่นที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น หรือลงทุนตามกรอบหรือนโยบายการลงทุนที่สำนักหักบัญชีสัญญากำหนดขึ้น โดยในการกำหนดกรอบหรือนโยบายการลงทุนดังกล่าวต้องคำนึงถึงสภาพคล่อง ความเสี่ยงในการลงทุน และผลกระทบที่อาจเกิดขึ้นต่อเสถียรภาพของระบบการซื้อขายและชำระหนี้ในศูนย์ซื้อขายสัญญา

(ง) ในกรณีที่เป็นการลงทุน ให้รายงานกรอบหรือนโยบายการลงทุนที่กำหนดตาม (ก) รวมทั้งในกรณีที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมต่อสำนักงาน ก.ล.ต. โดยไม่ชักช้า พร้อมทั้งเปิดเผยให้สมาชิกทราบด้วย

(ค) ระบุวัตถุประสงค์การจัดเก็บอย่างชัดเจน พร้อมทั้งแสดงว่าการฝากหรือลงทุนดังกล่าวเป็นการดำเนินการโดยสำนักหักบัญชีสัญญาเพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามมาตรา 82 และมาตรา 83

(2) ในกรณีที่เป็นทรัพย์สินประเภทหลักทรัพย์ ให้จัดเก็บโดยฝากไว้ที่ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์หรือธนาคารแห่งประเทศไทย โดยระบุวัตถุประสงค์การจัดเก็บอย่างชัดเจน พร้อมทั้งแสดงว่าการฝากหลักทรัพย์ดังกล่าวเป็นการดำเนินการโดยสำนักหักบัญชีสัญญาเพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามมาตรา 82 และมาตรา 83

(3) ในกรณีที่เป็นทรัพย์สินอื่น ให้เก็บโดยมีเอกสารหลักฐานที่สามารถชี้เฉพาะได้ว่าทรัพย์สินนั้นเป็นทรัพย์สินของสมาชิก หรือลูกค้าของสมาชิกโดยปราศจากเหตุสงสัย

ข้อ 18 ในการดำเนินการตามข้อ 16 และข้อ 17 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องตรวจสอบและดูแลให้พนักงานปฏิบัติตามประกาศและกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องซึ่งสำนักหักบัญชีสัญญากำหนดขึ้นโดยเคร่งครัด ทั้งนี้ หากปรากฏต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ว่าสำนักหักบัญชีสัญญาแห่งใดฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามประกาศหรือกฎเกณฑ์ที่สำนักหักบัญชีสัญญากำหนดขึ้น หรือดำเนินการที่ไม่เหมาะสมในการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญา สำนักงาน ก.ล.ต. อาจสั่งให้สำนักหักบัญชีสัญญาแห่งนั้นดำเนินการให้เป็นไปตามประกาศและกฎเกณฑ์ดังกล่าว หรือดำเนินการใด ๆ ตามที่เห็นสมควรได้

ข้อ 19 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องมีหลักเกณฑ์ในการรับสมาชิกที่โปร่งใสและเป็นธรรม โดยการกำหนดหลักเกณฑ์ดังกล่าวต้องคำนึงถึงความเหมาะสม ฐานะทางการเงิน และระบบการบริหารความเสี่ยงของผู้สมัครเป็นสมาชิกเป็นสำคัญ

ข้อ 20 เพื่อให้การดำเนินงานของสมาชิกเป็นไปตามระเบียบหรือข้อบังคับ สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

- (1) จัดให้มีระเบียบหรือข้อบังคับที่ใช้บังคับกับสมาชิก
- (2) จัดให้มีมาตรการในการกำกับดูแลให้สมาชิกปฏิบัติตามระเบียบหรือข้อบังคับ
- (3) จัดให้มีมาตรการดำเนินการกับสมาชิกที่ฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามระเบียบหรือข้อบังคับ

ข้อบังคับ

- (4) ประเมินผลการปฏิบัติตามระเบียบหรือข้อบังคับของสมาชิกในช่วงเวลาที่เหมาะสม

(5) จัดทำรายงานการประเมินผลและการดำเนินการต่อสมาชิกที่ฝ่าฝืนระเบียบหรือข้อบังคับ แล้วจัดส่งให้สำนักงาน ก.ล.ต. เพื่อทราบ

หมวด 4

การบริหารจัดการความเสี่ยง

ข้อ 21 ให้สำนักหักบัญชีสัญญาบริหารจัดการความเสี่ยงโดยดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) จัดให้มีกรอบนโยบายบริหารความเสี่ยงที่เป็นลายลักษณ์อักษรและครอบคลุมความเสี่ยงทุกด้าน โดยกรอบนโยบายดังกล่าวต้องได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการหรือคณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าว

(2) กำหนดมาตรการบริหารจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นซึ่งเพียงพอที่จะป้องกันและจัดการความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ได้อย่างมีประสิทธิภาพ

(3) ทบทวนความเหมาะสมของกรอบนโยบายและมาตรการบริหารจัดการความเสี่ยงเป็นประจำ

ข้อ 22 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีแหล่งเงินทุนที่เพียงพอต่อการรองรับการประกอบการและความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ที่อาจเกิดขึ้นจากการประกอบธุรกิจ ทั้งนี้ ส่วนของผู้ถือหุ้นต้องมีมูลค่าไม่น้อยกว่าค่าใช้จ่ายในการประกอบธุรกิจรวม 6 เดือน และคำนวณจากงบบัญชีล่าสุด โดยต้องอยู่ในรูปของทรัพย์สินที่มีคุณภาพและมีสภาพคล่องเพียงพอ

สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีแผนดำเนินการเพิ่มเติมแหล่งเงินทุนที่ชัดเจนสำหรับกรณีที่เงินทุนไม่เพียงพอรองรับการประกอบการและความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ตามวรรคหนึ่ง

ข้อ 23 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีแผนเพื่อการกอบกู้หรือการเลิกประกอบกิจการ (plan for recovery or orderly wind-down) ซึ่งแผนดังกล่าวต้องได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการ และต้องระบุรายละเอียดอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) เหตุการณ์และช่วงเวลาที่จะทำให้สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการตามแผนเพื่อการกอบกู้หรือการเลิกประกอบกิจการ

(2) งานสำคัญที่เกี่ยวกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ทำให้สำนักหักบัญชีสัญญาสามารถดำเนินธุรกิจต่อไปได้

(3) แนวทางหรือวิธีการที่ใช้เพื่อการกอบกู้กิจการ

(4) แนวทางหรือวิธีการในการจัดการสินทรัพย์และหนี้สินของสำนักหักบัญชีสัญญาสมาชิก และลูกค้าในกรณีที่การกอบกู้กิจการไม่บรรลุผล

หมวด 5

การบริหารจัดการกรณีที่มีการเชื่อมโยงการให้บริการกับผู้ที่เกี่ยวข้อง
ของสำนักหักบัญชีสัญญา

ข้อ 24 ในกรณีที่สำนักหักบัญชีสัญญาให้บริการเกี่ยวกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแก่สมาชิกที่มีลูกค้าเป็นนิติบุคคลซึ่งให้บริการกับลูกค้าอีกทอดหนึ่ง (tiered participant) สำนักหักบัญชีสัญญาต้องควบคุมดูแลและติดตามความเสี่ยงของสมาชิกรายดังกล่าวที่อาจเกิดขึ้นด้วย

ข้อ 25 ในกรณีที่สำนักหักบัญชีสัญญาจะทำการเชื่อมโยงการให้บริการกับสำนักหักบัญชีสัญญาอื่น สำนักหักบัญชีสัญญาต้องกำหนดมาตรการเพื่อบริหารจัดการความเสี่ยงก่อนดำเนินการดังกล่าวอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

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

หมวด 6

การจัดการและการเปิดเผยข้อมูล

ข้อ 26 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องเปิดเผยหรือเผยแพร่ระเบียบ ข้อบังคับ ข่าวดารหรือข้อมูลเกี่ยวกับการให้บริการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญาอย่างเพียงพอ เพื่อให้สมาชิก ลูกค้าของสมาชิก หรือผู้ที่เกี่ยวข้องเข้าใจความเสี่ยงจากการใช้บริการ และต้องทบทวนข้อมูลที่เปิดเผยหรือเผยแพร่เป็นประจำหรือทุกครั้งที่มีการเปลี่ยนแปลง เพื่อปรับปรุงให้ข้อมูลดังกล่าวเป็นปัจจุบัน

ข้อ 27 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีระบบการจัดการและจัดเก็บข้อมูลเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจที่มีประสิทธิภาพ รัศकुम และครบถ้วน โดยต้องสามารถรวบรวม ประมวลผลและเรียกดูข้อมูลดังกล่าวได้ภายในระยะเวลาอันสมควร

ในกรณีที่ระบบงานตามวรรคหนึ่งไม่สามารถใช้งานได้ สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการให้มีระบบสำรองเพื่อให้การจัดการและจัดเก็บข้อมูลเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจสามารถดำเนินการต่อไปได้ตามปกติ

ข้อ 28 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องมีระเบียบหรือข้อบังคับที่กำหนดให้สามารถแลกเปลี่ยนข้อมูลเกี่ยวกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิก รวมถึงข้อมูลอื่นใดที่ได้รับเนื่องจากการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญากับตลาดหลักทรัพย์ ศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ ศูนย์ซื้อขายสัญญา สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ สำนักงาน ก.ล.ด. ธนาคารแห่งประเทศไทย ทั้งนี้ เพื่อประโยชน์ในการกำกับตรวจสอบฐานะทางการเงินและความเสี่ยงของสมาชิก

ข้อ 29 เพื่อพิทักษ์ประโยชน์ของประชาชนหรือคุ้มครองผู้ลงทุน ให้สำนักหักบัญชีสัญญาเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาชิก การกระทำความผิดและการลงโทษสมาชิก รวมถึงข้อมูลอื่นใดที่ได้รับเนื่องจากการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญาซึ่งเป็นสาระสำคัญต่อการทำธุรกรรมกับสมาชิก

การเปิดเผยข้อมูลตามวรรคหนึ่ง ต้องกระทำในลักษณะที่ทันต่อเหตุการณ์ มีข้อมูลเพียงพอ และประชาชนมีโอกาสได้รับข้อมูลอย่างเท่าเทียมกัน ทั้งนี้ ประเภทของข้อมูล วิธีการและเงื่อนไขในการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าว ให้เป็นไปตามที่สำนักหักบัญชีสัญญากำหนด โดยความเห็นชอบของคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

หมวด 7

การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและความมั่นคง ปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ

ข้อ 30 ในหมวดนี้

“ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระหนี้” หมายความว่า ระบบคอมพิวเตอร์หรือระบบเครือข่ายที่สำคัญที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าซึ่งหากไม่สามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่องอาจส่งผลกระทบต่ออย่างมีนัยสำคัญต่อสำนักหักบัญชีสัญญาและผู้ที่เกี่ยวข้องกับสำนักหักบัญชีสัญญา

ข้อ 31 หมวดนี้มีข้อกำหนดในการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ และความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศในเรื่องดังต่อไปนี้

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

ส่วนที่ 1

การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ

ข้อ 32 สำนักกำกับบัญชีสัญญาต้องดำเนินการให้มีความพร้อมในการให้บริการ โดยอย่างน้อยต้องกำหนดในเรื่องดังต่อไปนี้เป็นลายลักษณ์อักษร

- (1) นโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ โดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการหรือคณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าว เพื่อให้มั่นใจว่า หากมีเหตุการณ์ที่ไม่ปกติเกิดขึ้น การชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้ายังสามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่องหรือสามารถแก้ไขให้กลับมาดำเนินการต่อได้ภายในระยะเวลาที่เหมาะสม
- (2) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องที่สอดคล้องกับนโยบายที่กำหนดขึ้นตาม (1) โดยได้รับความเห็นชอบจากผู้จัดการหรือผู้ดำรงตำแหน่งเทียบเท่าที่เรียกชื่ออย่างอื่น

ข้อ 33 แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องตามข้อ 32(2) ต้องระบุรายละเอียดอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) มาตรการรองรับเมื่อเกิดกรณีฉุกเฉินที่อาจมีผลกระทบต่อการให้บริการเป็นสำนักกำกับบัญชีสัญญา โดยต้องกำหนดขอบเขตของกรณีฉุกเฉินให้ครอบคลุมถึงเหตุการณ์ต่าง ๆ ที่อาจเกิดขึ้น รวมทั้งขั้นตอนการดำเนินการ และผู้รับผิดชอบในการดำเนินการตามขั้นตอนดังกล่าวในแต่ละกรณีให้ชัดเจน
- (2) รายชื่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระหนี้

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

(4) ระยะเวลาที่คืนระบบงาน (recovery time objective)

(5) ข้อมูลล่าสุดที่จะกู้คืนได้ (recovery point objective)

(6) รายละเอียดของระบบงานสำรองและศูนย์สำรองที่สอดคล้องกับนโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง

ข้อ 34 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีมาตรการควบคุมติดตามและสื่อสารกับสมาชิก เพื่อให้ปฏิบัติตามนโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ และแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องได้อย่างมีประสิทธิภาพ

ข้อ 35 เพื่อให้การกำกับดูแลการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ ให้สำนักหักบัญชีสัญญาดำเนินการในเรื่องดังต่อไปนี้อย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง

(1) ทดสอบแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องร่วมกับสมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้อง

(2) ประเมินผลการทดสอบแผนตาม (1) โดยผู้ที่มีความรู้ความสามารถ และมีความเป็นอิสระจากผู้จัดทำหรือผู้บริหารแผนนั้น

(3) รายงานผลการทดสอบตาม (2) ต่อคณะกรรมการและสำนักงาน ก.ล.ต. ภายใน 90 วันนับแต่วันที่ดำเนินการทดสอบเสร็จสิ้น

ข้อ 36 ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ที่ส่งผลกระทบต่อการประกอบธุรกิจของสำนักหักบัญชีสัญญา ให้สำนักหักบัญชีสัญญาทบทวนและปรับปรุงแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องโดยไม่ชักช้า

ส่วนที่ 2

การทบทวน ติดตามและตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้

ข้อ 37 เพื่อให้การกำกับดูแลเกี่ยวกับขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานที่เกี่ยวข้องกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้เป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ ให้สำนักหักบัญชีสัญญาดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) ทบทวน ติดตามและตรวจสอบขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ ตามแผนการตรวจสอบซึ่งจัดทำตามระดับความเสี่ยงขององค์กร โดยผู้ที่มีความรู้ ความสามารถและมีความเป็นอิสระ เช่น ผู้ตรวจสอบภายในหรือภายนอก (internal or external auditor) เป็นต้น ทั้งนี้ ให้สำนักหักบัญชีสัญญาจัดส่งรายงานผลการทบทวน ติดตามและตรวจสอบปีละ 1 ครั้ง พร้อมทั้งแผนการตรวจสอบซึ่งจัดทำตามระดับความเสี่ยงของ องค์กรต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายใน 60 วันนับแต่วันที่ได้เสนอรายงานดังกล่าวต่อคณะกรรมการหรือ คณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าว

(2) ทดสอบการเจาะระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ (penetration test) ให้ ครบถ้วนทุกระบบงานทุก 3 ปี โดยเรียงลำดับความสำคัญตามผลการประเมินความเสี่ยง และ รายงานผลการทดสอบดังกล่าวต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายในไตรมาสแรกของปีถัดจากปีที่มีการทดสอบ แต่ละระบบ

ส่วนที่ 3

การรายงานการเปลี่ยนแปลงเกี่ยวกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้อง
กับการชำระหนี้ (material systems change report)

ข้อ 38 เพื่อให้การกำกับดูแลการประกอบธุรกิจโดยรวมของสำนักหักบัญชีสัญญา ดำเนินการไปด้วยความเรียบร้อย มีประสิทธิภาพ และทันต่อเหตุการณ์ ให้สำนักหักบัญชีสัญญา รายงานการเปลี่ยนแปลงใด ๆ ที่มีนัยสำคัญต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ต่อ สำนักงาน ก.ล.ต. ภายในเดือนมกราคมของปีถัดไป

ส่วนที่ 4

การบริหารจัดการเหตุการณ์ที่อาจส่ง
ผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย
(incident management)

ข้อ 39 ในส่วนนี้

“เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย” หมายความว่า

(1) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ไม่สามารถดำเนินการได้ตามปกติ (system disruption and system degrade)

(2) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ไม่สามารถดำเนินการให้เดินไปตามกฎหมาย กฎเกณฑ์ ระเบียบ ข้อบังคับที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. คณะกรรมการกำกับตลาดทุน สำนักงาน ก.ล.ต. สำนักหักบัญชีสัญญากำหนด (system non-compliance)

(3) เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้อันเกิดจากการบุกรุก (system intrusion)

ข้อ 40 เมื่อปรากฏข้อเท็จจริงว่ามีเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยเกิดขึ้น ให้สำนักหักบัญชีสัญญารวบรวมข้อมูลเพื่อวิเคราะห์สาเหตุของปัญหา พร้อมทั้งกำหนดแนวทางการแก้ไข และรายงานเหตุการณ์ดังกล่าวต่อผู้บริหาร รวมทั้งจัดเก็บเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องไว้ในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงาน ก.ล.ต. เรียกดูหรือตรวจสอบได้

ข้อ 41 เพื่อให้เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยได้รับการจัดการอย่างถูกต้องและมีประสิทธิภาพภายในระยะเวลาที่เหมาะสม สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) กำหนดและดำเนินการตามแผนรองรับในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยที่กำหนดไว้เป็นลายลักษณ์อักษร

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

ข้อ 42 ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยซึ่งมีความร้ายแรง นอกจากต้องปฏิบัติตามข้อ 40 และข้อ 41 แล้ว ให้สำนักหักบัญชีสัญญารายงานเหตุการณ์ดังกล่าวต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้เพิ่มเติมด้วย

(1) รายงาน โดยทางวาจาหรือทางจดหมายอิเล็กทรอนิกส์ทันทีเมื่อทราบเหตุการณ์

(2) รายงานผลการตรวจสอบเหตุการณ์เป็นลายลักษณ์อักษร (investigation report) เมื่อเหตุการณ์นั้นได้รับการแก้ไขแล้วภายใน 30 วันนับแต่วันที่คณะกรรมการหรือคณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าวได้รับรายงาน แต่ทั้งนี้ ต้องไม่เกิน 90 วันนับแต่วันที่เกิดเหตุการณ์นั้น

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

เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามความในวรรคหนึ่ง คำว่า “เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยซึ่งมีความร้ายแรง” หมายความว่า

- (1) เหตุการณ์ที่ส่งผลให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ไม่สามารถดำเนินการได้ตามปกติในลักษณะที่ทำให้การให้บริการต้องหยุดชะงักลง
- (2) เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้อันเกิดจากการบุกรุก ซึ่งอาจกระทบต่อความน่าเชื่อถือของสำนักหักบัญชีสัญญาอย่างร้ายแรง

ส่วนที่ 5

การกำหนดนโยบาย การติดตามและการวิเคราะห์ ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ

ข้อ 43 เพื่อให้การรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศของสำนักหักบัญชีสัญญามีประสิทธิภาพ สามารถรักษาไว้ซึ่งความลับ ความถูกต้อง ความน่าเชื่อถือของข้อมูล และความพร้อมใช้งาน ตลอดจนการติดตามวิเคราะห์ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ได้อย่างเหมาะสม ให้สำนักหักบัญชีสัญญาดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) กำหนดนโยบายและมาตรการควบคุมการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศให้เป็นไปตามมาตรฐานที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับได้ หรือมาตรฐานอื่นที่สามารถบรรลุวัตถุประสงค์ดังกล่าวและเป็นที่ยอมรับได้ในอุตสาหกรรม ซึ่งนโยบายดังกล่าวต้องได้รับความเห็นชอบจากผู้จัดการหรือผู้ดำรงตำแหน่งเทียบเท่าที่เรียกชื่ออย่างอื่น โดยต้องมีการทบทวนและปรับปรุงให้สอดคล้องและเหมาะสมกับความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศในปัจจุบัน
- (2) ติดตามและวิเคราะห์ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้โดยบันทึกและจัดเก็บหลักฐานการใช้งาน รวมถึงเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ (log)

หมวด 8

การใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก

ข้อ 44 การใดที่มีได้มีกฎหมายหรือกฎเกณฑ์กำหนดไว้เป็นการเฉพาะ ให้สำนักหักบัญชีสัญญาต้องดำเนินการด้วยตนเอง หากการนั้นเป็นการกระทำด้วยความจำเป็นเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการประกอบธุรกิจ ให้สำนักหักบัญชีสัญญาสามารถใช้บริการจากผู้ให้บริการ

ภายนอกได้ โดยต้องมั่นใจว่าผู้ให้บริการภายนอกสามารถปฏิบัติตามกฎหมายและกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง และการให้บริการนั้นไม่มีผลเสมือนเป็นการไม่ประกอบธุรกิจ

ในการให้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก สำนักหักบัญชีสัญญาต้องกำหนดอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) นโยบาย ขอบเขต หรือลักษณะงานที่จะใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก เป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องได้รับความเห็นชอบเป็นการทั่วไปหรือเป็นรายกรณีจากคณะกรรมการ หรือคณะทำงานที่คณะกรรมการดังกล่าวมอบหมาย

(2) มาตรการบริหารจัดการความเสี่ยงในการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก ที่เหมาะสมและมีประสิทธิภาพ

(3) มาตรการตรวจสอบบริการของผู้ให้บริการภายนอกที่มีประสิทธิภาพ เพื่อให้ การปฏิบัติงานของผู้ให้บริการภายนอกเป็นไปตามวัตถุประสงค์ของสำนักหักบัญชีสัญญา

ความในวรรคสองมิให้นำมาใช้บังคับกับกรณีที่สำนักหักบัญชีสัญญาเป็นบริษัทที่ ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้นเกินกว่าร้อยละ 50 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น และใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกที่เป็นตลาดหลักทรัพย์หรือบริษัทที่ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้น เกินกว่าร้อยละ 50 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น

หมวด 9

การจัดการเรื่องร้องเรียน

ข้อ 45 สำนักหักบัญชีสัญญาต้องจัดให้มีระบบการจัดการเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือ ข้อพิพาทที่เกิดขึ้นเกี่ยวกับการชำระหนี้ หรือเกิดขึ้นจากการใช้บริการของสำนักหักบัญชีสัญญา ที่มีประสิทธิภาพ ซึ่งอย่างน้อยต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดให้มีระเบียบปฏิบัติที่เป็นลายลักษณ์อักษรเกี่ยวกับการจัดการข้อร้องเรียน หรือข้อพิพาท โดยการกำหนดระเบียบปฏิบัติดังกล่าวต้องคำนึงถึงการคุ้มครองผู้ร้องเรียนด้วย

(2) จัดให้มีหน่วยงานหรือบุคลากรที่มีหน้าที่รับผิดชอบเกี่ยวกับข้อร้องเรียน หรือข้อพิพาท

(3) จัดให้มีการติดตามตรวจสอบและแจ้งผลการพิจารณาข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท ให้ผู้ร้องเรียนหรือคู่พิพาททราบ

(4) จัดทำรายงานสรุปข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ทุก 6 เดือน ทั้งนี้ ในรายงานดังกล่าวต้องมีบทสรุปสาระสำคัญและผลการพิจารณาหรือการดำเนินการของ สำนักหักบัญชีสัญญาด้วย

หมวด 10
การเก็บรักษาข้อมูลและเอกสาร

ข้อ 46 ให้สำนักหักบัญชีสัญญาเก็บรักษาข้อมูลและเอกสารให้เป็นไปตามกำหนดเวลาดังต่อไปนี้

(1) ข้อมูลเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจตามที่ระบุไว้ในข้อ 27 ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 10 ปี นับแต่วันที่ได้มาหรือวันที่มีการดำเนินการเกี่ยวกับข้อมูลนั้น

(2) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องตามข้อ 32 (2) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการจัดทำแผนดังกล่าว

(3) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องที่ได้รับการแก้ไขตามข้อ 36 ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการแก้ไขแผนดังกล่าว

(4) หลักฐานการใช้งานรวมถึงเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศตามข้อ 43(2) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่าระยะเวลาที่กฎหมายว่าด้วยการกระทำความผิดเกี่ยวกับคอมพิวเตอร์กำหนด

(5) หลักฐานการตรวจสอบผู้ให้บริการภายนอกตามข้อ 44 วรรคสอง(3) และเอกสารที่เกี่ยวข้องกับการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการดำเนินการนั้น

(6) เอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท และผลการพิจารณาตามข้อ 45(4) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่ข้อยุติเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทนั้น

ในการปฏิบัติตามข้อกำหนดในวรรคหนึ่ง ให้คณะกรรมการกำกับตลาดทุนมีอำนาจสั่งการเป็นประการอื่นได้ตามที่เห็นสมควร

การจัดเก็บข้อมูล เอกสารและหลักฐานตามข้อกำหนดในวรรคหนึ่ง ให้สำนักหักบัญชีสัญญาจัดเก็บไว้ในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงาน ก.ล.ต. เรียกดู หรือตรวจสอบได้


หมวด 11
บทเฉพาะกาล

ข้อ 47 ให้บรรดาประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ คำสั่ง และหนังสือเวียน ที่ออกหรือวางแนวปฏิบัติตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทค. 96/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ในการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและ

สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ 28 ตุลาคม พ.ศ. 2552 ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการประกอบกิจการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญาและประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทค. 98/2552 เรื่อง การดูแลรักษาทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก ลงวันที่ 28 ตุลาคม พ.ศ. 2552 ซึ่งใช้บังคับอยู่ในวันก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ ยังคงใช้บังคับได้ต่อไปเท่าที่ไม่ขัดหรือแย้งกับข้อกำหนดแห่งประกาศนี้ จนกว่าจะได้มีประกาศ คำสั่ง และหนังสือเวียน ที่ออกหรือวางแนวปฏิบัติตามประกาศนี้ใช้บังคับ

ข้อ 48 ในกรณีที่มีประกาศฉบับอื่นอ้างอิงประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทค. 96/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ในการประกอบกิจการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและสำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ 28 ตุลาคม พ.ศ. 2552 ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการประกอบกิจการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญาและประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทค. 98/2552 เรื่อง การดูแลรักษาทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก ลงวันที่ 28 ตุลาคม พ.ศ. 2552 ให้การอ้างอิงดังกล่าวหมายถึงการอ้างอิงประกาศฉบับนี้

ประกาศ ณ วันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2559



(นายรพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน