

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน  
ที่ ทธ. 32/2559  
เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการประกอบ  
เป็นสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และ  
ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์  
(ฉบับประมวล)

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 16/6 มาตรา 223/3 และมาตรา 228 วรรคสอง แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 และมาตรา 223 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม พ.ศ. 2560 เป็นต้นไป

หมวด 1  
ข้อกำหนดทั่วไป

ส่วนที่ 1  
วัตถุประสงค์ในการกำกับดูแลสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และ  
ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์

ข้อ 2 โดยที่ระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์เป็นระบบพื้นฐานที่สำคัญ และมีความเชื่อมโยงกับระบบการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์และระบบอื่น ๆ ที่เกี่ยวข้อง ประกอบกับระบบเทคโนโลยีสารสนเทศเป็นระบบที่มีความจำเป็นต่อองค์กรในการดำเนินการเพื่อบรรลุ เป้าหมายที่กำหนดไว้ ดังนั้น การกำหนดหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการกำกับดูแลสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ และการใช้งานระบบเทคโนโลยีสารสนเทศดังกล่าว (IT Governance) ให้เป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ รวมทั้งมีการบริหารจัดการความเสี่ยงและจัดสรรทรัพยากรอย่างเหมาะสม โดยคณะกรรมการและผู้บริหารให้สอดคล้องกับมาตรฐานที่องค์การระหว่างประเทศที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลด้านตลาดทุนกำหนดขึ้น และนำไปสู่การปฏิบัติอย่างเป็นรูปธรรมนั้น จึงมีความสำคัญ และจำเป็นอย่างยิ่ง หลักเกณฑ์ตามประกาศนี้จึงกำหนดขึ้น เพื่อให้เป็นมาตรฐานที่สำนักหักบัญชี

หลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องดำเนินการเพื่อการให้บริการที่มีประสิทธิภาพ มีความโปร่งใส และสามารถตรวจสอบได้ ทั้งนี้ เพื่อสร้างความเชื่อมั่น ความมีเสถียรภาพและความมั่นคงของระบบการเงินโดยรวม ตลอดจนส่งเสริมความสามารถในการแข่งขันและภาพลักษณ์ที่ดีของตลาดทุนไทย

## ส่วนที่ 2

### หลักการสำคัญในการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์

ข้อ 3 เพื่อเป็นการส่งเสริมให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ซึ่งเป็นโครงสร้างพื้นฐานทางการเงิน (financial market infrastructures) ที่สำคัญ มีระบบงาน รวมถึงระบบบริหารความเสี่ยงที่มีประสิทธิภาพและความมั่นคงปลอดภัย รวมทั้งให้บริการแก่ ผู้ที่เกี่ยวข้องอย่าง โปร่งใสและเป็นธรรม โดยมีการดำเนินงานที่เหมาะสมและสอดคล้องกับ มาตรฐานที่องค์การระหว่างประเทศที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลด้านตลาดทุนกำหนดขึ้น สำนักหักบัญชี หลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องประกอบการภายใต้หลักการที่สำคัญดังต่อไปนี้

- (1) การบริหารกิจการที่ดีและการจัดโครงสร้างองค์กรที่มีความชัดเจนและโปร่งใส
- (2) การบริหารจัดการความเสี่ยง (risk management) ที่ดีเพื่อรองรับความเสี่ยง ด้านกฎหมาย (legal) ด้านเครดิต (credit) ด้านสภาพคล่อง (liquidity) ด้านการดำเนินการ (operation) และความเสี่ยงด้านอื่น ๆ โดยมีมาตรการในการติดตาม ควบคุม และจัดการความเสี่ยงในแต่ละด้าน อย่างเหมาะสม เพื่อให้มั่นใจว่าการบริหารจัดการดังกล่าวสามารถรองรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้น
- (3) การมีแหล่งเงินทุนที่เพียงพอ มีระบบและกฎเกณฑ์ในการรับและกำกับดูแล สมาชิกที่เหมาะสม และรองรับวิธีปฏิบัติที่ทำให้มั่นใจได้ว่าจะสามารถชำระราคาและส่งมอบ หลักทรัพย์ได้อย่างมีประสิทธิภาพ รวมถึงต้องมีกระบวนการในการจัดการกรณีที่มีการผิดนัดชำระ ราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ด้วย
- (4) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ (business continuity management) โดยมีมาตรการที่เหมาะสมและสอดคล้องกับมาตรฐานสากล อันเป็นการส่งเสริมและรักษาไว้ซึ่งความพร้อม ในการใช้งานของระบบงานที่สำคัญของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ให้สามารถ ดำเนินการได้อย่างต่อเนื่อง
- (5) การเปิดเผยข้อมูลอย่างชัดเจน โปร่งใสและเพียงพอเพื่อให้สมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้อง กับการประกอบธุรกิจนั้น ๆ สามารถเข้าใจผลกระทบและความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้น
- (6) ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องมีระบบและกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวกับการให้บริการที่ทำให้ มั่นใจได้ว่าจะมีการเก็บรักษาหลักทรัพย์ไว้อย่างปลอดภัย และสามารถนำไปใช้ได้อย่างมีประสิทธิภาพ

ส่วนที่ 3  
สาระสำคัญของข้อกำหนด

---

ข้อ 4 ประกาศนี้มีข้อกำหนดในการกำกับดูแลสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) การบริหารกิจการที่ดีและการจัด โครงสร้างองค์กร โดยมีรายละเอียดตามหมวด 2
- (2) การบริหารจัดการความเสี่ยง โดยมีรายละเอียดตามหมวด 3
- (3) การบริหารจัดการกรณีที่มีการเชื่อมโยงการให้บริการกับผู้ที่เกี่ยวข้องของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ โดยมีรายละเอียดตามหมวด 4
- (4) การจัดการและการเปิดเผยข้อมูล โดยมีรายละเอียดตามหมวด 5
- (5) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ โดยมีรายละเอียดตามหมวด 6
- (6) การใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก โดยมีรายละเอียดตามหมวด 7
- (7) การจัดการเรื่องร้องเรียน โดยมีรายละเอียดตามหมวด 8
- (8) การให้ความเห็นชอบระเบียบหรือข้อบังคับ โดยมีรายละเอียดตามหมวด 9
- (9) การจัดทำและเปิดเผยงบการเงิน โดยมีรายละเอียดตามหมวด 10
- (10) การเก็บรักษาข้อมูลและเอกสาร โดยมีรายละเอียดตามหมวด 11
- (11) ข้อกำหนดเพิ่มเติมตามลักษณะเฉพาะของการประกอบธุรกิจ โดยมีรายละเอียดตามหมวด 12

ส่วนที่ 4  
อำนาจสำนักงาน

---

ข้อ 5 เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามประกาศนี้ สำนักงานอาจกำหนดในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) กำหนดหลักเกณฑ์ในรายละเอียดของข้อกำหนดให้มีความชัดเจนเพียงพอที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์จะสามารถปฏิบัติได้ในแนวทางเดียวกัน

(2) กำหนดแนวทางการปฏิบัติ (guideline) ในรายละเอียดของข้อกำหนดเพื่อเป็นการให้แนวทางปฏิบัติที่ถือว่าเหมาะสมและสอดคล้องตามประกาศนี้ โดยหากสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ปฏิบัติตามแนวทางดังกล่าวแล้ว ให้ถือว่าสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์มีการปฏิบัติตามข้อกำหนดในเรื่องที่มีการออกแนวทางนั้น

(3) เพื่อให้สำนักงาน สามารถติดตามการปฏิบัติตามประกาศนี้ได้ ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ยื่นรายงานหรือแสดงเอกสารใดตามระยะเวลาหรือเป็นครั้งคราวต่อสำนักงาน ภายในระยะเวลาที่สำนักงานกำหนด โดยต้องไม่เป็นภาระต่อสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์จนเกินสมควร

## ส่วนที่ 5

### บทนิยาม

ข้อ 6 ในประกาศนี้

“สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์” หมายความว่า สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“สำนักหักบัญชีสัญญา” หมายความว่า สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับใบอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์” หมายความว่า ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ศูนย์ซื้อขายสัญญา” หมายความว่า ศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับใบอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“ศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์” หมายความว่า ศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“ตลาดหลักทรัพย์” หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“คณะกรรมการ” หมายความว่า คณะกรรมการของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ แล้วแต่กรณี

“กรรมการที่มีส่วนร่วมบริหารงาน” หมายความว่า กรรมการที่มีส่วนร่วมบริหารงานตามที่กำหนดไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายหุ้นที่ออกใหม่

“ผู้บริหาร” หมายความว่า ผู้จัดการ รองผู้จัดการ ผู้ช่วยผู้จัดการ ผู้อำนวยการฝ่าย หรือผู้ซึ่งดำรงตำแหน่งเทียบเท่าตำแหน่งข้างต้นที่เรียกชื่ออย่างอื่น และให้หมายความรวมถึงบุคคลที่ได้ทำสัญญาให้มีอำนาจทั้งหมดหรือบางส่วนในการจัดการด้วย

“บริษัทในเครือ” หมายความว่า บริษัทในเครือตามที่กำหนดไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการให้บุคคลอื่นเป็นผู้รับดำเนินการในงานที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจ

“สมาชิก” หมายความว่า สมาชิกของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ แล้วแต่กรณี

“อำนาจควบคุมกิจการ” หมายความว่า อำนาจควบคุมกิจการตามที่กำหนดไว้ในมาตรา 89/1

“ผู้รับประโยชน์จากหุ้น” หมายความว่า ผู้ซึ่งมีอำนาจโดยทางตรงหรือทางอ้อมในลักษณะดังต่อไปนี้

(1) อำนาจกำหนดหรือควบคุมการใช้สิทธิออกเสียงลงคะแนนในกิจการของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ แล้วแต่กรณี

(2) อำนาจกำหนดหรือควบคุมการได้มา จำหน่าย หรือก่อภาระผูกพันในหุ้น

“ทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก” หมายความว่า

(1) ทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ได้รับมาจากสมาชิกทั้งที่เป็นของสมาชิกและของลูกค้าเพื่อเป็นประกันการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่เกิดจากการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สมาชิกเป็นผู้รับผิดชอบต่อสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์

(2) ทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ได้รับมาเนื่องจากการซื้อขายหลักทรัพย์ทั้งของสมาชิกและของลูกค้า

(3) ทรัพย์สินที่สมาชิคนำมาวางไว้กับสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของระบบการซื้อขายและการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

## หมวด 2

### การบริหารกิจการที่ดีและการจัดโครงสร้างองค์กร

ข้อ 7 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีข้อกำหนดเกี่ยวกับการบริหารกิจการที่ดีที่มีความชัดเจนและเป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการ

ข้อกำหนดตามวรรคหนึ่งจะต้องเป็นการส่งเสริมความมั่นคงและประสิทธิภาพของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ รวมทั้งคำนึงถึงผลประโยชน์สาธารณะและผู้ให้บริการ โดยต้องระบุอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) นโยบายป้องกันและจัดการความขัดแย้งทางผลประโยชน์

(2) มาตรการที่เพียงพอในการป้องกันมิให้กรรมการ ผู้บริหาร อนุกรรมการ ที่ปรึกษา พนักงาน ลูกจ้างหรือผู้ปฏิบัติงานให้แก่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์แสวงหาประโยชน์โดยมิชอบจากข้อมูลที่ได้รับจากการปฏิบัติหน้าที่ และมีมาตรการที่เพียงพอในการรักษาความลับของสมาชิกและลูกค้า

ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์เปิดเผยข้อกำหนดเกี่ยวกับการบริหารกิจการที่ดีต่อประชาชนและผู้ที่เกี่ยวข้องเป็นการทั่วไปภายหลังจากข้อกำหนดดังกล่าวได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการแล้ว

ข้อ 8 เพื่อให้การดำเนินการของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์เป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ โปร่งใส และส่งเสริมความมีเสถียรภาพของตลาดทุน รวมทั้งสอดคล้องกับข้อกำหนดเกี่ยวกับการบริหารกิจการที่ดีซึ่งได้กำหนดขึ้นตามข้อ 7 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีคณะกรรมการของแต่ละองค์กรขึ้นคณะหนึ่ง ประกอบด้วย ประธานกรรมการ กรรมการที่มีส่วนร่วมบริหารงานและกรรมการอิสระที่แต่งตั้งจากผู้ที่มีความรู้และมีประสบการณ์ที่เกี่ยวกับตลาดทุนหรือที่จะเป็นประโยชน์ต่อการประกอบกิจการของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์แล้วแต่กรณี

เพื่อให้เป็นไปตามที่กำหนดไว้ในวรรคหนึ่ง สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) กำหนดบทบาทหน้าที่และความรับผิดชอบที่ชัดเจนของคณะกรรมการและผู้บริหาร
- (2) ประเมินผลการปฏิบัติหน้าที่ของคณะกรรมการและผู้บริหาร

ข้อ 9 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องดำเนินการจัดโครงสร้างองค์กรอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) กรรมการอิสระตามข้อ 8 วรรคหนึ่งในจำนวนดังนี้

(ก) กรรมการอิสระอย่างน้อย 1 ใน 3 ของจำนวนกรรมการทั้งหมดและต้องมีจำนวนไม่น้อยกว่า 2 คน ในกรณีที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์

(ข) กรรมการอิสระจำนวน 1 คน ในกรณีที่ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์

(2) ระบบการควบคุมกิจการภายในที่มีประสิทธิภาพ และระบบการตรวจสอบที่มีประสิทธิภาพและเป็นอิสระ

นอกจากที่กำหนดไว้ตามวรรคหนึ่ง สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ต้องบริหารจัดการความเสี่ยงในลักษณะดังต่อไปนี้ด้วย

(1) จัดให้มีคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง เพื่อทำหน้าที่กำหนดนโยบายในการบริหารจัดการความเสี่ยงและติดตามให้มีการปฏิบัติตามนโยบายดังกล่าว โดยแต่งตั้งจากผู้ที่มีความรู้และมีประสบการณ์ในการซื้อขายหลักทรัพย์ การบริหารความเสี่ยง หรือการบริหารงานสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ ทั้งนี้ ประธานและกรรมการจำนวนไม่น้อยกว่ากึ่งหนึ่งของจำนวนกรรมการทั้งหมด ต้องไม่เป็นผู้บริหาร พนักงานหรือลูกจ้างของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และบริษัทในเครือของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์

(2) จัดให้มีหน่วยงานที่ทำหน้าที่บริหารจัดการความเสี่ยงตามกรอบนโยบายความเสี่ยง ทั้งนี้ การจ่ายผลตอบแทนให้กับหน่วยงานดังกล่าวต้องไม่ก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์

ข้อ 10 กรรมการอิสระตามข้อ 8 วรรคหนึ่ง ต้องเป็นผู้ที่มีความอิสระในการปฏิบัติหน้าที่ เป็นกลาง และมีความเป็นธรรม ตลอดจนคำนึงถึงประโยชน์ส่วนรวม ความมั่นคงปลอดภัย และเสถียรภาพของระบบตลาดทุนเป็นสำคัญ

กรรมการอิสระของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องไม่มีลักษณะต้องห้าม ดังต่อไปนี้

(1) เป็นหรือเคยเป็นกรรมการที่มีส่วนร่วมบริหารงาน ผู้บริหาร พนักงาน ลูกจ้าง ที่ปรึกษา หรือบุคคลที่มีตำแหน่งอื่นใดที่เทียบเท่าตำแหน่งข้างต้นของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ และบริษัทในเครือของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ แล้วแต่กรณี เว้นแต่จะได้พ้นจากตำแหน่งดังกล่าวมาแล้วไม่น้อยกว่า 2 ปีก่อนวันที่รับตำแหน่ง

(2) เป็นกรรมการ ผู้บริหาร พนักงาน ลูกจ้าง หรือบุคคลที่มีตำแหน่งอื่นใดที่เทียบเท่าตำแหน่งข้างต้น รวมทั้งบุคคลที่มีส่วนร่วมบริหารงานของสมาชิก

(3) เป็นผู้ถือหุ้นที่มีอำนาจควบคุมกิจการของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ แล้วแต่กรณี

(4) เป็นบุคคลอื่นใดที่ไม่สามารถให้ความเห็นได้โดยอิสระเกี่ยวกับการดำเนินงานของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ แล้วแต่กรณี

หมวด 3  
การบริหารจัดการความเสี่ยง

---

ข้อ 11 ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์บริหารจัดการความเสี่ยงโดยดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) จัดให้มีกรอบนโยบายบริหารความเสี่ยงที่เป็นลายลักษณ์อักษรและครอบคลุมความเสี่ยงทุกด้าน โดยกรอบนโยบายดังกล่าวต้องได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการหรือคณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าว

(2) กำหนดมาตรการบริหารจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นซึ่งเพียงพอที่จะป้องกันและจัดการความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ได้อย่างมีประสิทธิภาพ

(3) ทบทวนความเหมาะสมของกรอบนโยบายและมาตรการบริหารจัดการความเสี่ยงเป็นประจำ

ข้อ 12 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีแหล่งเงินทุนที่เพียงพอต่อการรองรับการประกอบการและความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ที่อาจเกิดขึ้นจากการประกอบธุรกิจ ทั้งนี้ ส่วนของผู้ถือหุ้นต้องมีมูลค่าไม่น้อยกว่าค่าใช้จ่ายในการประกอบธุรกิจรวม 6 เดือน และคำนวณจากงบบัญชีล่าสุดโดยต้องอยู่ในรูปของทรัพย์สินที่มีคุณภาพและมีสภาพคล่องเพียงพอ

สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีแผนดำเนินการเพิ่มเติมแหล่งเงินทุนที่ชัดเจนสำหรับกรณีที่เงินทุนไม่เพียงพอรองรับการประกอบการและความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ตามวรรคหนึ่ง

ข้อ 13 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีแผนเพื่อการกอบกู้หรือการเลิกประกอบกิจการ (plan for recovery or orderly wind-down) ซึ่งแผนดังกล่าวต้องได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการ และต้องระบุรายละเอียดอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) เหตุการณ์และช่วงเวลาที่สามารถทำให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องดำเนินการตามแผนเพื่อการกอบกู้หรือการเลิกประกอบกิจการ

(2) งานสำคัญที่เกี่ยวกับการชำระราคา ส่งมอบและรับฝากหลักทรัพย์ที่ทำให้แต่ละองค์กรดำเนินธุรกิจต่อไปได้

(3) แนวทางหรือวิธีการที่ใช้เพื่อการกอบกู้กิจการ

(4) แนวทางหรือวิธีการในการจัดการสินทรัพย์และหนี้สินของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ สมาชิก และลูกค้าในกรณีที่การกอบกู้กิจการไม่บรรลุผล



## หมวด 4

การบริหารจัดการกรณีที่มีการเชื่อมโยงการให้บริการกับผู้ที่เกี่ยวข้อง  
ของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์

ข้อ 14 ในกรณีที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ให้บริการเกี่ยวกับการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ หรือให้บริการรับฝากหลักทรัพย์แก่สมาชิกที่มีลูกค้ำเป็นนิติบุคคลซึ่งให้บริการกับลูกค้ำอีกทอดหนึ่ง (tiered participant) สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ต้องควบคุมดูแลและติดตามความเสี่ยงของสมาชิกรายดังกล่าวที่อาจเกิดขึ้นด้วย

ข้อ 15 ในกรณีที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์จะทำการเชื่อมโยงการให้บริการกับสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์อื่นหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ต้องกำหนดมาตรการเพื่อบริหารจัดการความเสี่ยงก่อนดำเนินการดังกล่าวอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) กฎหมายหรือกฎเกณฑ์รองรับการเชื่อมโยงการให้บริการและคุ้มครองการทำธุรกรรมของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ที่แตกต่างกัน
- (2) ขั้นตอนและวิธีการจัดการในกรณีที่มีการผัดขันธ์ชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (default management) ที่สามารถบังคับใช้กับสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์อื่นหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ที่เชื่อมโยงการให้บริการระหว่างกันได้
- (3) ประสิทธิภาพในการเรียกหรือบังคับหลักประกันได้ทันต่อเหตุการณ์
- (4) ความเพียงพอของแหล่งเงินทุนรองรับความเสี่ยงที่เกิดจากการเชื่อมโยงการให้บริการ

ในกรณีที่ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์จะทำการเชื่อมโยงการให้บริการกับศูนย์รับฝากหลักทรัพย์อื่นหรือสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องกำหนดมาตรการเพื่อบริหารจัดการความเสี่ยงอย่างน้อยตามที่กำหนดในวรรคหนึ่ง (1) โดยอนุโลม

## หมวด 5

การจัดการและการเปิดเผยข้อมูล

ข้อ 16 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องเปิดเผยหรือเผยแพร่ระเบียบ ข้อบังคับ ข่าวดสารหรือข้อมูลเกี่ยวกับการให้บริการเป็นสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์อย่างเพียงพอ เพื่อให้สมาชิก ลูกค้ำของสมาชิก หรือผู้ที่เกี่ยวข้องเข้าใจความเสี่ยง

จากการใช้บริการ และต้องทบทวนข้อมูลที่เปิดเผยหรือเผยแพร่เป็นประจำหรือทุกครั้งที่มีการเปลี่ยนแปลง เพื่อปรับปรุงให้ข้อมูลดังกล่าวเป็นปัจจุบัน

ข้อ 17 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีระบบการจัดการและจัดเก็บข้อมูลเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจที่มีประสิทธิภาพ รัดกุม และครบถ้วน โดยต้องสามารถรวบรวม ประมวลผลและเรียกดูข้อมูลดังกล่าวได้ภายในระยะเวลาอันสมควร

ในกรณีที่ระบบงานตามวรรคหนึ่งไม่สามารถใช้งานได้ สำนักหักบัญชีและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องดำเนินการให้มีระบบสำรองเพื่อให้การจัดการและจัดเก็บข้อมูลเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจสามารถดำเนินการต่อไปได้ตามปกติ

ข้อ 18 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องมีระเบียบหรือข้อบังคับที่กำหนดให้สามารถแลกเปลี่ยนข้อมูลเกี่ยวกับการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ รวมถึงข้อมูลอื่นใดที่ได้รับเนื่องจากการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์กับ ตลาดหลักทรัพย์ ศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ ศูนย์ซื้อขายสัญญา สำนักหักบัญชีสัญญา ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ สำนักงานและธนาคารแห่งประเทศไทย ทั้งนี้ เพื่อประโยชน์ในการกำกับตรวจสอบฐานะทางการเงิน และความเสียงของสมาชิก

ข้อ 19 เพื่อพิทักษ์ประโยชน์ของประชาชนและเพื่อคุ้มครองผู้ลงทุน ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ สมาชิก การกระทำคามผิด และการลงโทษสมาชิก รวมตลอดถึงข้อมูลอื่นใดที่ได้รับเนื่องจากการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ ซึ่งเป็นสาระสำคัญต่อการทำธุรกรรมกับสมาชิก

การเปิดเผยข้อมูลตามวรรคหนึ่ง ต้องกระทำในลักษณะที่ทันต่อเหตุการณ์ มีข้อมูลเพียงพอ และประชาชนมีโอกาสได้รับข้อมูลอย่างเท่าเทียมกัน ทั้งนี้ ประเภทของข้อมูล วิธีการและเงื่อนไขในการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าว ให้เป็นไปตามที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์กำหนด โดยความเห็นชอบของคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

#### หมวด 6

การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและความมั่นคงปลอดภัย  
ของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ

ข้อ 20 ในหมวดนี้

“ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์” หมายความว่า

ระบบคอมพิวเตอร์หรือระบบเครือข่ายที่สำคัญที่เกี่ยวข้องกับการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (clearing and settlement) รวมถึงการรับฝากหลักทรัพย์ (depository) ซึ่งหากไม่สามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่องอาจส่งผลกระทบต่ออย่างมีนัยสำคัญต่อสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ หรือผู้ที่เกี่ยวข้องกับสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ แล้วแต่กรณี

ข้อ 21 หมวดนี้มีข้อกำหนดในการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ ในเรื่องดังต่อไปนี้

- (1) การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 1
- (2) การทบทวน ติดตามและตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 2
- (3) การรายงานการเปลี่ยนแปลงเกี่ยวกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ (material systems change report) โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 3
- (4) การบริหารจัดการเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย (incident management) โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 4
- (5) การกำหนดนโยบาย การติดตามและการวิเคราะห์ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ โดยมีรายละเอียดตามส่วนที่ 5

## ส่วนที่ 1

### การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ

ข้อ 22 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องดำเนินการให้ความพร้อมในการให้บริการ โดยอย่างน้อยต้องกำหนดในเรื่องดังต่อไปนี้เป็นลายลักษณ์อักษร

- (1) นโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ โดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการหรือคณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าว เพื่อให้มั่นใจว่าหากมีเหตุการณ์ที่ไม่ปกติเกิดขึ้น การชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ยังสามารถดำเนินการได้อย่างต่อเนื่อง หรือสามารถแก้ไขให้กลับมาดำเนินการต่อได้ภายในระยะเวลาที่เหมาะสม
- (2) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องที่สอดคล้องกับนโยบายที่กำหนดขึ้นตาม (1) โดยได้รับความเห็นชอบจากผู้จัดการหรือผู้ดำรงตำแหน่งเทียบเท่าที่เรียกชื่ออย่างอื่น

ข้อ 23 แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องตามข้อ 22(2) ต้องระบุรายละเอียดอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) มาตรการรองรับเมื่อเกิดกรณีฉุกเฉินที่อาจมีผลกระทบต่อการใช้บริการเป็น  
สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ โดยต้องกำหนดขอบเขตของกรณีฉุกเฉิน  
ให้ครอบคลุมถึงเหตุการณ์ต่าง ๆ ที่อาจเกิดขึ้น รวมทั้งขั้นตอนการดำเนินการ และผู้รับผิดชอบในการ  
ดำเนินการตามขั้นตอนดังกล่าวในแต่ละกรณีให้ชัดเจน

(2) รายชื่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์

(3) การประเมินความเสี่ยงและโอกาสที่อาจทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้อง  
กับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ไม่สามารถดำเนินการต่อไปได้ รวมทั้งผลกระทบ  
ที่อาจมีต่อการดำเนินธุรกิจ (business impact analysis: BIA)

(4) ระยะเวลาที่กู้คืนระบบงาน (recovery time objective)

(5) ข้อมูลล่าสุดที่จะกู้คืนได้ (recovery point objective)

(6) รายละเอียดของระบบงานสำรองและศูนย์สำรองที่สอดคล้องกับนโยบาย  
การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง

ข้อ 24 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีมาตรการ  
ควบคุมติดตามและสื่อสารกับสมาชิก เพื่อให้ปฏิบัติตามนโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนิน  
ธุรกิจ และแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องได้อย่างมีประสิทธิภาพ

ข้อ 25 เพื่อให้การกำกับดูแลการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจเป็นไปอย่างมี  
ประสิทธิภาพ ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ดำเนินการในเรื่องดังต่อไปนี้  
อย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง

(1) ทดสอบแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องร่วมกับสมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้อง

(2) ประเมินผลการทดสอบแผนตาม (1) โดยผู้ที่มีความรู้ความสามารถและมีความเป็น  
อิสระจากผู้จัดทำหรือผู้บริหารแผนนั้น

(3) รายงานผลการทดสอบตาม (2) ต่อคณะกรรมการและสำนักงาน ภายใน 90 วัน  
นับแต่วันที่ดำเนินการทดสอบเสร็จสิ้น

ข้อ 26 ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระราคา  
ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ที่ส่งผลกระทบต่อประกอบธุรกิจของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือ  
ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ทบทวนและปรับปรุง  
แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องโดยไม่ชักช้า

## ส่วนที่ 2

### การทบทวน ติดตามและตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ ที่เกี่ยวกับการชำระราคา ส่งมอบ และ รับฝากหลักทรัพย์

---

ข้อ 27 เพื่อให้การกำกับดูแลเกี่ยวกับขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานที่เกี่ยวข้องกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์เป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) ทบทวน ติดตามและตรวจสอบขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ ตามแผนการตรวจสอบซึ่งจัดทำตามระดับความเสี่ยงของแต่ละองค์กร โดยผู้ที่มีความรู้ ความสามารถและมีความเป็นอิสระ เช่น ผู้ตรวจสอบภายในหรือภายนอก (internal or external auditor) เป็นต้น ทั้งนี้ ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์จัดส่งรายงานผลการทบทวน ติดตามและตรวจสอบปีละ 1 ครั้ง พร้อมทั้งแผนการตรวจสอบซึ่งจัดทำตามระดับความเสี่ยงของแต่ละองค์กรต่อสำนักงาน ภายใน 60 วันนับแต่วันที่ได้เสนอรายงานดังกล่าวต่อคณะกรรมการหรือคณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าว

(2) ทดสอบการเจาะระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ (penetration test) ให้ครบถ้วนทุกระบบงานทุก 3 ปี โดยเรียงลำดับความสำคัญตามผลการประเมินความเสี่ยง และรายงานผลการทดสอบดังกล่าวต่อสำนักงาน ภายในไตรมาสแรกของปีถัดจากปีที่มีการทดสอบแต่ละระบบ

## ส่วนที่ 3

### การรายงานการเปลี่ยนแปลงเกี่ยวกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการ ชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ (material systems change report)

---

ข้อ 28 เพื่อให้การกำกับดูแลการประกอบธุรกิจโดยรวมของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ดำเนินการไปด้วยความเรียบร้อย มีประสิทธิภาพ และทันต่อเหตุการณ์ ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์รายงานการเปลี่ยนแปลงใด ๆ

ที่มีนัยสำคัญต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ต่อสำนักงานภายในเดือนมกราคมของปีถัดไป

#### ส่วนที่ 4

### การบริหารจัดการเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย (incident management)

---

ข้อ 29 ในส่วนนี้

“เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย” หมายความว่า

- (1) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ไม่สามารถดำเนินการได้ตามปกติ (system disruption and system degrade)
- (2) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ไม่สามารถดำเนินการให้เป็นไปตามกฎหมาย กฎเกณฑ์ ระเบียบ ข้อบังคับที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. คณะกรรมการกำกับตลาดทุน สำนักงาน สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์กำหนด (system non-compliance)
- (3) เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์อันเกิดจากการบุกรุก (system intrusion)

ข้อ 30 เมื่อมีเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยเกิดขึ้น ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์รวบรวมข้อมูลเพื่อวิเคราะห์สาเหตุของปัญหา พร้อมทั้งกำหนดแนวทางการแก้ไข และรายงานเหตุการณ์ดังกล่าวต่อผู้บริหาร รวมทั้งจัดเก็บเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องไว้ในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงานเรียกดูหรือตรวจสอบได้

ข้อ 31 เพื่อให้เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยได้รับการจัดการอย่างถูกต้องและมีประสิทธิภาพภายในระยะเวลาที่เหมาะสม สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) กำหนดและดำเนินการตามแผนรองรับในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยที่กำหนดไว้เป็นลายลักษณ์อักษร
- (2) จัดให้มีบุคคลหรือหน่วยงานเพื่อทำหน้าที่รับแจ้งเหตุการณ์ดังกล่าว (point of contact) และรายงานต่อผู้บริหารหรือผู้ที่เกี่ยวข้องกับสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ แล้วแต่กรณี เพื่อดำเนินการต่อไป (escalation procedure)

ข้อ 32 ในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยซึ่งมีความร้ายแรง นอกจากต้องปฏิบัติตามข้อ 30 และข้อ 31 แล้ว ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์รายงานเหตุการณ์ดังกล่าวต่อสำนักงาน ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้เพิ่มเติมด้วย

- (1) รายงาน โดยทางวาจาหรือทางจดหมายอิเล็กทรอนิกส์ทันทีเมื่อทราบเหตุการณ์
- (2) รายงานผลการตรวจสอบเหตุการณ์เป็นลายลักษณ์อักษร (investigation report)

เมื่อเหตุการณ์นั้นได้รับการแก้ไขแล้วภายใน 30 วันนับแต่วันที่คณะกรรมการหรือคณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าวได้รับรายงาน แต่ทั้งนี้ ต้องไม่เกิน 90 วันนับแต่วันที่เกิดเหตุการณ์นั้น

รายงานผลการตรวจสอบตามวรรคหนึ่ง (2) ต้องประกอบด้วยคำอธิบายรายละเอียดของเหตุการณ์ ผลกระทบต่อการดำเนินงานของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์และสมาชิก รวมทั้งสาเหตุที่แท้จริงของปัญหา (root cause) ขั้นตอนการดำเนินการแก้ไขปัญหาและมาตรการป้องกันเพื่อไม่ให้เกิดเหตุการณ์ในลักษณะเดียวกันนี้อีก

เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามความในวรรคหนึ่ง คำว่า “เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยซึ่งมีความร้ายแรง” หมายความว่า

- (1) เหตุการณ์ที่ส่งผลให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ไม่สามารถดำเนินการได้ตามปกติในลักษณะที่ทำให้การให้บริการต้องหยุดชะงักลง
- (2) เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์อันเกิดจากการบุกรุก ซึ่งอาจกระทบต่อความน่าเชื่อถือของแต่ละองค์กรอย่างร้ายแรง

## ส่วนที่ 5

การกำหนดนโยบาย การติดตามและการวิเคราะห์

ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ

ข้อ 33 เพื่อให้การรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์มีประสิทธิภาพ สามารถรักษาไว้ซึ่งความลับ ความถูกต้องความน่าเชื่อถือของข้อมูล และความพร้อมใช้งาน ตลอดจนการติดตามวิเคราะห์ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) กำหนดนโยบายและมาตรการควบคุมการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศให้เป็นไปตามมาตรฐานที่สำนักงานยอมรับได้ หรือมาตรฐานอื่นที่สามารถบรรลุวัตถุประสงค์ดังกล่าวและเป็นที่ยอมรับได้ในอุตสาหกรรม ซึ่งนโยบายดังกล่าวต้องได้รับความเห็นชอบจากผู้จัดการหรือผู้ดำรงตำแหน่งเทียบเท่าที่เรียกชื่ออย่างอื่น โดยต้องมีการทบทวนและปรับปรุงให้สอดคล้องและเหมาะสมกับความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศในปัจจุบัน

(2) ติดตามและวิเคราะห์ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นกับระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระราคา ส่งมอบ และรับฝากหลักทรัพย์โดยบันทึกและจัดเก็บหลักฐานการใช้งาน รวมถึงเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ (log)

#### หมวด 7

#### การใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก

ข้อ 34 การใดที่มีได้มีกฎหมายหรือกฎเกณฑ์กำหนดไว้เป็นการเฉพาะ ให้สำนักหักบัญชีและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องดำเนินการด้วยตนเอง หากการนั้นเป็นการกระทำด้วยความจำเป็นเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการประกอบธุรกิจ ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์สามารถใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกได้โดยต้องมั่นใจว่าผู้ให้บริการภายนอกสามารถปฏิบัติตามกฎหมายและกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง และการใช้บริการนั้น ไม่มีผลเสมือนเป็นการไม่ประกอบธุรกิจ

ในการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องกำหนดอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้

(1) นโยบาย ขอบเขต หรือลักษณะงานที่จะใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกเป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องได้รับความเห็นชอบเป็นการทั่วไปหรือเป็นรายกรณีจากคณะกรรมการหรือคณะทำงานที่คณะกรรมการดังกล่าวมอบหมาย

(2) มาตรการบริหารจัดการความเสี่ยงในการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกที่เหมาะสมและมีประสิทธิภาพ

(3) มาตรการตรวจสอบบริการของผู้ให้บริการภายนอกที่มีประสิทธิภาพเพื่อการปฏิบัติงานของผู้ให้บริการภายนอกเป็นไปตามวัตถุประสงค์ของแต่ละองค์กร

ความในวรรคสองมิให้นำมาใช้บังคับกับกรณีที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์เป็นบริษัทที่ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้นเกินกว่าร้อยละ 50 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น และใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกที่เป็นตลาดหลักทรัพย์ หรือบริษัทที่ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้นเกินกว่าร้อยละ 50 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น



หมวด 8  
การจัดการเรื่องร้องเรียน

---

ข้อ 35 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีระบบการจัดการเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทที่เกิดขึ้นเกี่ยวกับการชำระราคา ส่งมอบและรับฝากหลักทรัพย์ หรือเกิดขึ้นจากการใช้บริการของแต่ละองค์กรที่มีประสิทธิภาพ ซึ่งอย่างน้อยต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

- (1) จัดให้มีระเบียบปฏิบัติที่เป็นลายลักษณ์อักษรเกี่ยวกับการจัดการข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท โดยการกำหนดระเบียบปฏิบัติดังกล่าวต้องคำนึงถึงการคุ้มครองผู้ร้องเรียนด้วย
- (2) จัดให้มีหน่วยงานหรือบุคลากรที่มีหน้าที่รับผิดชอบเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท
- (3) จัดให้มีการติดตามตรวจสอบและแจ้งผลการพิจารณาข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทให้ผู้ร้องเรียนหรือคู่พิพาททราบ
- (4) จัดทำรายงานสรุปข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทต่อสำนักงาน ทุก 6 เดือน ทั้งนี้ ในรายงานดังกล่าวต้องมีบทสรุปสาระสำคัญและผลการพิจารณาหรือการดำเนินการของแต่ละองค์กรด้วย

หมวด 9  
การให้ความเห็นชอบระเบียบหรือข้อบังคับ

---

ข้อ 36<sup>1</sup> ระเบียบหรือข้อบังคับของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ให้มีผลใช้บังคับเมื่อได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการกำกับตลาดทุน และในกรณีที่ระเบียบหรือข้อบังคับดังกล่าวอาจมีผลกระทบต่อการดำเนินธุรกิจหรือประโยชน์ได้เสียของสมาชิก ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์จัดให้มีการรับฟังความคิดเห็นจากบุคคลดังกล่าว และเสนอรายงานการรับฟังความคิดเห็นนั้นต่อคณะกรรมการกำกับตลาดทุนเพื่อประกอบการพิจารณาให้ความเห็นชอบ

การขอความเห็นชอบระเบียบหรือข้อบังคับตามวรรคหนึ่ง มิให้ใช้บังคับกับระเบียบหรือข้อบังคับดังต่อไปนี้

---

<sup>1</sup> แก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทค. 75/2563 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 24 ธันวาคม พ.ศ. 2563 (มีผลใช้บังคับเมื่อวันที่ 1 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2564)

(1) ระเบียบหรือข้อบังคับที่เกี่ยวข้องกับการบริหารงานภายในองค์กรของสำนักหักบัญชี หลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์

(2) ระเบียบหรือข้อบังคับของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ซึ่งเป็นบริษัทที่ตลาดหลักทรัพย์ถือหุ้นไม่น้อยกว่าร้อยละ 75 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ของบริษัทนั้น และเป็นไปตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่กำหนดไว้ในข้อ 36/1

การรับฟังความคิดเห็นระเบียบหรือข้อบังคับตามวรรคหนึ่ง มิให้ใช้บังคับกับ ระเบียบหรือข้อบังคับตามวรรคสอง (1)

ข้อ 36/1<sup>1</sup> ให้ระเบียบหรือข้อบังคับของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝาก หลักทรัพย์ตามข้อ 36 วรรคสอง (2) มีผลใช้บังคับได้โดยไม่ต้องได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการ กำกับตลาดทุน หากเป็นไปตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่กำหนดไว้โดยครบถ้วนดังต่อไปนี้

(1) เป็นการกำหนดหรือแก้ไขเปลี่ยนแปลงระเบียบหรือข้อบังคับของสำนักหักบัญชี หลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ที่มีลักษณะอย่างหนึ่งอย่างใดดังนี้

(ก) การกำหนดหรือแก้ไขเปลี่ยนแปลงระเบียบหรือข้อบังคับเพื่อให้สอดคล้อง กับพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 หรือประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ประกาศคณะกรรมการ กำกับตลาดทุน และประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ออกตาม ความในพระราชบัญญัติดังกล่าว

(ข) การกำหนดหรือแก้ไขเปลี่ยนแปลงระเบียบหรือข้อบังคับ โดยยังคงสาระสำคัญของ ระเบียบหรือข้อบังคับที่มีผลใช้บังคับอยู่ก่อนแล้ว ในลักษณะที่เป็นการจัดหมวดหมู่หรือเนื้อหา หรือแก้ไขความขาดตกบกพร่องของระเบียบหรือข้อบังคับนั้น

(2) ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์จัดส่งร่างระเบียบหรือ ข้อบังคับตาม (1) ต่อสำนักงาน พร้อมรายงานผลการรับฟังความคิดเห็นของร่างระเบียบหรือข้อบังคับ (ถ้ามี) เป็นการล่วงหน้าอย่างน้อย 10 วันทำการ ก่อนวันที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝาก หลักทรัพย์ประสงค์จะประกาศใช้ระเบียบหรือข้อบังคับดังกล่าว

ข้อ 37 เมื่อสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์เสนอระเบียบหรือ ข้อบังคับ เพื่อขอความเห็นชอบจากคณะกรรมการกำกับตลาดทุนแล้ว คณะกรรมการกำกับตลาดทุน จะแจ้งผลการพิจารณาให้ทราบภายใน 45 วันนับแต่วันที่ได้รับระเบียบหรือข้อบังคับและเอกสาร หลักฐานประกอบคำขอที่ถูกต้องครบถ้วนตามข้อ 38

<sup>1</sup> แก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทช. 75/2563 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการประกอบการเป็น สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 24 ธันวาคม พ.ศ. 2563 (มีผลใช้บังคับเมื่อวันที่ 1 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2564)

เมื่อพ้นกำหนดระยะเวลาตามวรรคหนึ่งแล้ว หากคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ไม่แจ้งผลการพิจารณาหรือไม่แจ้งให้มีการแก้ไขระเบียบหรือข้อบังคับดังกล่าวไปยังสำนักหักบัญชี หลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ให้ถือว่าระเบียบหรือข้อบังคับนั้นได้รับความเห็นชอบจาก คณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ข้อ 38 ในการเสนอระเบียบหรือข้อบังคับเพื่อขอความเห็นชอบ ให้สำนักหักบัญชี หลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ยื่นเอกสารหลักฐานประกอบการขอความเห็นชอบดังต่อไปนี้

(1) หนังสือแสดงรายละเอียดเกี่ยวกับหลักการ เหตุผล และความจำเป็นในการออก ระเบียบหรือข้อบังคับดังกล่าว รวมทั้งประโยชน์และผลกระทบที่อาจเกิดขึ้นตลอดจนแนวทาง ในการบังคับใช้ระเบียบหรือข้อบังคับดังกล่าว

(2) รายงานการประชุมคณะกรรมการในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการพิจารณาระเบียบ หรือข้อบังคับดังกล่าว พร้อมทั้งเอกสารที่ใช้ประกอบการพิจารณา เช่น ระเบียบหรือข้อบังคับของ ต่างประเทศในเรื่องทำนองเดียวกัน เป็นต้น และในกรณีที่คณะกรรมการมีมติให้ความเห็นชอบระเบียบ หรือข้อบังคับดังกล่าวไม่เป็นเอกฉันท์ ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ระบุ จำนวนกรรมการที่ไม่เห็นด้วยพร้อมทั้งสรุปความเห็นของกรรมการที่ไม่เห็นด้วยดังกล่าว

(3) บันทึกความเห็นของคณะอนุกรรมการของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือ ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ที่ได้รับมอบหมายให้ทำหน้าที่พิจารณากลับกรองและเสนอข้อคิดเห็นเกี่ยวกับ ระเบียบหรือข้อบังคับ ในกรณีที่มีการเสนอระเบียบหรือข้อบังคับต่อคณะอนุกรรมการ

(4) รายงานการรับฟังความคิดเห็นของสมาชิกและเอกสารประกอบ พร้อมทั้ง ความเห็นของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ในเรื่องดังกล่าว

ข้อ 39 ในกรณีที่ข้อเท็จจริงและพฤติการณ์เปลี่ยนแปลงไป คณะกรรมการกำกับ ตลาดทุนอาจสั่งให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ กำหนดระเบียบหรือข้อบังคับ เพิ่มเติม ยกเลิก หรือแก้ไขเปลี่ยนแปลงระเบียบหรือข้อบังคับที่มีอยู่แล้ว ตลอดจนอาจสั่งให้สำนักหักบัญชี หลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ดำเนินการใด ๆ ตามที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนเห็นสมควร

ข้อ 40 ในกรณีที่มีความจำเป็น สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝาก หลักทรัพย์จะออกระเบียบหรือข้อบังคับเพื่อใช้บังคับเป็นการชั่วคราวได้โดยไม่ต้องดำเนินการตาม ข้อ 36 ก็ได้

ในกรณีที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนเห็นว่า สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับ ฝากหลักทรัพย์ดำเนินการตามวรรคหนึ่งโดยไม่สุจริตหรือไม่มีเหตุอันสมควร คณะกรรมการกำกับตลาด

ทุนอาจสั่งให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ยกเลิกหรือแก้ไขเปลี่ยนแปลงระเบียบหรือข้อบังคับดังกล่าว ตลอดจนดำเนินการใด ๆ ตามที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนเห็นสมควร

## หมวด 10

### การจัดทำและเปิดเผยงบการเงิน

ข้อ 41 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดทำและส่งงบการเงินประจำงวดการบัญชีสำหรับรอบปีที่ผู้สอบบัญชีตรวจสอบและแสดงความเห็นแล้วต่อสำนักงานจำนวน 1 ฉบับ พร้อมทั้งดำเนินการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) จัดให้มีงบดุล งบกำไรขาดทุน และรายงานของผู้สอบบัญชีเพื่อให้ประชาชนตรวจสอบได้ ณ ที่ทำการของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ แล้วแต่กรณี

(2) เผยแพร่งบดุล งบกำไรขาดทุน และรายงานของผู้สอบบัญชีโดยลงประกาศในหนังสือพิมพ์รายวันแห่งท้องถิ่นอย่างน้อย 1 ฉบับหรือในเว็บไซต์ของแต่ละองค์กร ในการนี้ให้ส่งเอกสารหลักฐานที่แสดงได้ว่าการลงประกาศดังกล่าวแล้วต่อสำนักงานด้วย

การดำเนินการตามวรรคหนึ่งต้องกระทำแล้วเสร็จภายใน 21 วันนับแต่วันที่งบการเงินได้รับอนุมัติจากที่ประชุมใหญ่ผู้ถือหุ้นแต่ไม่เกิน 4 เดือนนับแต่วันสิ้นสุดรอบปีบัญชี

ข้อ 42 ในการจัดทำงบการเงิน สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีผู้สอบบัญชีเพื่อตรวจสอบบัญชีและแสดงความเห็นต่องบการเงิน โดยผู้สอบบัญชีดังกล่าวต้องมีคุณสมบัติและไม่มีลักษณะต้องห้ามดังนี้

(1) ไม่เป็นผู้ถือหุ้นหรือผู้รับประโยชน์จากหุ้นที่ออกโดยสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ กรรมการ พนักงาน หรือลูกจ้างของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์นั้น

(2) ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานให้สอบบัญชีและลงลายมือชื่อเพื่อแสดงความเห็นต่องบการเงินของบริษัทหลักทรัพย์ตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการให้ความเห็นชอบผู้สอบบัญชี และไม่อยู่ระหว่างถูกสำนักงานสั่งพักการทำงานที่เป็นผู้สอบบัญชี

สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องดำเนินการให้มีข้อกำหนดในสัญญาที่ทำกับผู้สอบบัญชีเกี่ยวกับการให้ความร่วมมือกับสำนักงาน ในการชี้แจงหรือนำส่งข้อมูลอื่นใดที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติงานสอบบัญชี รวมทั้งในเรื่องอื่นใดตามที่สำนักงานร้องขอ

ข้อ 43 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดทำและเปิดเผยข้อมูลในงบการเงินให้เป็นไปตามมาตรฐานการบัญชีที่กำหนดตามกฎหมายว่าด้วยการบัญชี

ในกรณีที่มีการจัดทำหรือการเปิดเผยข้อมูลในเรื่องใดที่ไม่มีมาตรฐานการบัญชีไทย กำหนดไว้ ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ปฏิบัติตามมาตรฐานการบัญชีต่อไปนี

(1) มาตรฐานการบัญชีของ International Accounting Standards Board

(2) ในกรณีที่ไม่มีมาตรฐานการบัญชีตาม (1) ให้ใช้มาตรฐานการบัญชีของ American Institution of Certified Public Accountants หรือ Financial Accounting Standards Board

ในกรณีที่ปฏิบัติตามมาตรฐานการบัญชีในวรรคสอง (1) หรือ (2) ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ระบุแหล่งที่มาของมาตรฐานการบัญชีดังกล่าวด้วย

#### หมวด 11

#### การเก็บรักษาข้อมูลและเอกสาร

ข้อ 44 ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์เก็บรักษาข้อมูลและเอกสารให้เป็นไปตามกำหนดเวลาดังต่อไปนี้

(1) ข้อมูลเกี่ยวกับการประกอบธุรกิจตามที่ระบุไว้ในข้อ 17 ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 10 ปีนับแต่วันที่ได้มาหรือวันที่มีการดำเนินการเกี่ยวกับข้อมูลนั้น

(2) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องตามข้อ 22(2) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการจัดทำแผนดังกล่าว

(3) แผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องที่แก้ไขตามข้อ 26 ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการแก้ไขแผนดังกล่าว

(4) หลักฐานการใช้งานรวมถึงเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศตามข้อ 33(2) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่าระยะเวลาที่กฎหมายว่าด้วยการกระทำความผิดเกี่ยวกับคอมพิวเตอร์กำหนด

(5) หลักฐานการตรวจสอบผู้ให้บริการภายนอกตามข้อ 34 วรรคสอง(3) และเอกสารที่เกี่ยวข้องกับการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มีการดำเนินการนั้น

(6) เอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท และผลการพิจารณาตามข้อ 35(4) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่า 3 ปี นับแต่วันที่มิชข้อยุติเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทนั้น

ในการปฏิบัติตามข้อกำหนดในวรรคหนึ่ง ให้คณะกรรมการกำกับตลาดทุนมีอำนาจสั่งการเป็นประการอื่นได้ตามที่เห็นสมควร

การจัดเก็บข้อมูล เอกสารและหลักฐานตามข้อกำหนดในวรรคหนึ่ง ให้สำนักหักบัญชี  
 หลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์จัดเก็บไว้ในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงานเรียกดู หรือตรวจสอบได้

## หมวด 12

### ข้อกำหนดเพิ่มเติมตามลักษณะเฉพาะของการประกอบธุรกิจ

#### ส่วนที่ 1

#### ข้อกำหนดเพิ่มเติมสำหรับการประกอบกิจการเป็น สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์

ข้อ 45 ในการให้บริการระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชี  
 หลักทรัพย์ต้องมีระบบที่สามารถให้ความมั่นใจว่าจะมีการปฏิบัติการชำระราคาและส่งมอบ  
 หลักทรัพย์ตามสัญญาซื้อขายหลักทรัพย์ โดยสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ต้องเข้าผูกพันหรือแทนที่เป็น  
 คู่สัญญากับผู้ซื้อและผู้ขายหลักทรัพย์ในทันทีที่ตลาดหลักทรัพย์แจ้งข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายให้แก่  
 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ภายหลังจากที่เกิดรายการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ และสำนักหักบัญชี  
 หลักทรัพย์หรือผู้ที่เกี่ยวข้องจะยกเลิก แก้ไข หรือเปลี่ยนแปลงรายการมิได้

ข้อ 46 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ต้องกำหนดระเบียบและขั้นตอนที่เกี่ยวข้องกับ  
 การชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่ชัดเจน เพื่อให้การชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์เป็นไปอย่าง  
 มีประสิทธิภาพ โดยอย่างน้อยต้องมีการดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) ประมวลผลการซื้อขายหลักทรัพย์เพื่อแจ้งยอดสุทธิของการชำระราคาและ  
 ส่งมอบหลักทรัพย์ให้แก่สมาชิก

(2) กำหนดขั้นตอนและระยะเวลาในการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์  
 รวมทั้งกำหนดจุดเวลาเพื่อการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่ให้อธิบายว่าเป็นที่สุด (finality of  
 settlement) ในข้อบังคับอย่างชัดเจน

(3) กำหนดขั้นตอนและวิธีดำเนินการเมื่อสมาชิกมีการผิดนัดชำระราคาและส่งมอบ  
 หลักทรัพย์ให้ชัดเจน เพื่อให้สามารถจัดการเมื่อเกิดเหตุผิดนัดได้อย่างมีประสิทธิภาพและทันเวลา โดยมีการ  
 เปิดเผยขั้นตอนและวิธีการดำเนินการดังกล่าวเป็นการทั่วไป รวมทั้งทดสอบร่วมกับสมาชิกและผู้  
 ที่เกี่ยวข้อง และทบทวนขั้นตอนและวิธีดำเนินการกรณีสมาชิกผิดนัด (default procedure) อย่างน้อย  
 ปีละ 1 ครั้ง

(4) ในกรณีที่มีการชำระราคาผ่านธนาคารพาณิชย์ สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ต้องกำหนดหลักเกณฑ์ในการเลือกใช้ธนาคารพาณิชย์ที่เหมาะสม และมีประสิทธิภาพ โดยต้องมีมาตรการบริหารจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้น

(5) มีระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แบบ delivery versus payment (DVP)

ข้อ 47 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ต้องมีหลักเกณฑ์ในการรับสมาชิกที่โปร่งใสและเป็นธรรม โดยการกำหนดหลักเกณฑ์ดังกล่าวต้องคำนึงถึงความเหมาะสม ฐานะทางการเงิน และระบบการบริหารความเสี่ยงของผู้สมัครเป็นสมาชิกเป็นสำคัญ

ข้อ 48 เพื่อให้การดำเนินงานของสมาชิกเป็นไปตามระเบียบหรือข้อบังคับ สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

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

ข้อ 49

- (4) ประเมินผลการปฏิบัติตามระเบียบหรือข้อบังคับของสมาชิกในช่วงเวลาที่เหมาะสม
- (5) จัดทำรายงานการประเมินผลและการดำเนินการต่อสมาชิกที่ฝ่าฝืนระเบียบหรือข้อบังคับ แล้วจัดส่งให้สำนักงานเพื่อทราบ

ข้อ 49 สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ต้องมีระบบกำกับตรวจสอบฐานะทางการเงินและความเสี่ยงโดยรวมของสมาชิก โดยอย่างน้อยต้องมีการประเมินและติดตามฐานะทางการเงิน ความมั่นคงทางการเงิน และระบบการบริหารความเสี่ยงของสมาชิกอย่างสม่ำเสมอ และมีมาตรการดำเนินการเพื่อให้มั่นใจว่าฐานะทางการเงินและระบบการบริหารความเสี่ยงของสมาชิกเป็นไปตามระเบียบหรือข้อบังคับของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์

ข้อ 50 ในกรณีที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ลงทุนหรือฝากทรัพย์สินไว้กับธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศ สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ต้องมีการประเมินความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการใช้บริการจากธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศดังกล่าว เพื่อให้มั่นใจว่าธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศ มีกระบวนการเก็บรักษาทรัพย์สินที่มีประสิทธิภาพ มีความสามารถชำระหนี้เมื่อทวงถาม และอยู่ภายใต้การกำกับดูแลขององค์กรที่น่าเชื่อถือ ทั้งนี้ การลงทุนและฝากทรัพย์สินดังกล่าวต้องไม่กระจุกตัวในธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศแห่งใดแห่งหนึ่งมากเกินไป

ข้อ 51 ในการดูแลรักษาทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก สำนักหักบัญชี  
 หลักทรัพย์ต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดทำและเก็บรักษาบัญชีทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิกแยกจากของสำนัก  
 หักบัญชีหลักทรัพย์ โดยให้ดำเนินการแยกเป็นบัญชีของสมาชิกแต่ละราย รวมทั้งจัดทำและเก็บ  
 รักษาบัญชีทรัพย์สินของลูกค้ายกจากบัญชีทรัพย์สินของสมาชิกให้ถูกต้องครบถ้วนและเป็นปัจจุบัน

(2) จัดเก็บทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิกให้มีความปลอดภัย มั่นคง และ  
 มีรายการและจำนวนตรงตามที่ปรากฏในบัญชีทรัพย์สินตาม (1)

(3) จัดเก็บทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิกแยกจากทรัพย์สินของสำนักหักบัญชี  
 หลักทรัพย์ในลักษณะที่สามารถชี้เฉพาะได้ว่าเป็นทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิกโดยปราศจาก  
 เหตุสงสัย

(4) รายงานการดูแลรักษาทรัพย์สินดังกล่าวให้สมาชิกทราบภายในระยะเวลาที่  
 เหมาะสม

ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์กำหนดกฎเกณฑ์สำหรับการดำเนินการตามวรรคหนึ่ง

ข้อ 52 ในการดูแลรักษาทรัพย์สินที่ได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก สำนักหักบัญชี  
 หลักทรัพย์จะใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกมิได้

ในกรณีที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ได้ปฏิบัติตามวิธีการที่กำหนดดังต่อไปนี้ มิให้ถือว่าเป็น  
 เป็นการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกและให้ถือว่าเป็นการแยกทรัพย์สินตามข้อ 51(3)

(1) ในกรณีที่เป็ทรัพย์สินประเภทเงิน ให้ดำเนินการตามหลักเกณฑ์ดังนี้

(ก) จัดเก็บโดยการฝากไว้กับธนาคารพาณิชย์หรือธนาคารอื่นที่มีกฎหมายเฉพาะ  
 จัดตั้งขึ้น หรือลงทุนตามกรอบหรือนโยบายการลงทุนที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์กำหนดขึ้น  
 โดยในการกำหนดกรอบหรือนโยบายการลงทุนดังกล่าวต้องคำนึงถึงสภาพคล่อง ความเสี่ยงในการลงทุน  
 และผลกระทบที่อาจเกิดขึ้นต่อเสถียรภาพของระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

(ข) ในกรณีที่เป็นการลงทุน ให้รายงานกรอบหรือนโยบายการลงทุนที่กำหนด  
 ตาม (ก) รวมทั้งในกรณีที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมต่อสำนักงานโดยไม่ชักช้า พร้อมทั้งต้องเปิดเผยให้  
 สมาชิกทราบด้วย

(ค) ระบุวัตถุประสงค์การจัดเก็บอย่างชัดเจน พร้อมทั้งแสดงว่าการฝากหรือ  
 ลงทุนดังกล่าวเป็นการดำเนินการ โดยสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตาม  
 มาตรา 223/3

(2) ในกรณีที่เป็ทรัพย์สินประเภทหลักทรัพย์ ให้จัดเก็บโดยฝากไว้ที่ศูนย์รับฝาก  
 หลักทรัพย์หรือธนาคารแห่งประเทศไทย โดยระบุวัตถุประสงค์การจัดเก็บอย่างชัดเจน พร้อมทั้ง



แสดงว่าการฝากหลักทรัพย์ดังกล่าวเป็นการดำเนินการโดยสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามมาตรา 223/3

(3) ในกรณีที่เป็นทรัพย์สินอื่น ให้เก็บโดยมีเอกสารหลักฐานที่สามารถชี้เฉพาะได้ว่าทรัพย์สินนั้นเป็นทรัพย์สินของสมาชิก หรือลูกค้าของสมาชิกโดยปราศจากเหตุสงสัย

ข้อ 53 ในการดำเนินการตามข้อ 51 และข้อ 52 ให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ตรวจสอบและดูแลให้พนักงานปฏิบัติตามประกาศและกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องซึ่งสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์กำหนดขึ้นโดยเคร่งครัด ทั้งนี้ หากปรากฏต่อสำนักงานว่าสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์แห่งใดฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามประกาศหรือกฎเกณฑ์ที่สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์กำหนดขึ้นหรือดำเนินการที่ไม่เหมาะสมในการประกอบกิจการเป็นสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ สำนักงานอาจสั่งให้สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์แห่งนั้นดำเนินการให้เป็นไปตามประกาศและกฎเกณฑ์ดังกล่าว หรือดำเนินการใด ๆ ตามที่เห็นสมควรได้

## ส่วนที่ 2

### ข้อกำหนดเพิ่มเติมสำหรับการประกอบกิจการเป็น ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์

ข้อ 54 เพื่อเป็นการส่งเสริมและรักษาความน่าเชื่อถือ ความโปร่งใสและความเสมอภาคในการให้บริการเป็นศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ระเบียบหรือข้อบังคับของศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ในเรื่องดังต่อไปนี้ต้องไม่มีข้อกำหนดที่เป็นการจำกัด ขัดขวางหรือลดทอนสิทธิของสมาชิกหรือจำกัดการให้บริการของศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ โดยไม่มีเหตุผลอันสมควร

- (1) หลักทรัพย์ที่ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์รับฝาก หรือบุคคลที่ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์อนุญาตให้เป็นสมาชิก
- (2) การให้บริการฝาก ถอน และ โอนหลักทรัพย์ หรือบริการอื่นใดที่เกี่ยวกับการให้บริการของศูนย์รับฝากหลักทรัพย์
- (3) อัตราค่าธรรมเนียม ค่าใช้จ่าย และค่าปรับที่เกี่ยวกับการให้บริการของศูนย์รับฝากหลักทรัพย์
- (4) การดำเนินการกับสมาชิก ที่ฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามระเบียบหรือข้อบังคับของศูนย์รับฝากหลักทรัพย์

ข้อ 55 ในการให้บริการเป็นศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีระบบงานดังต่อไปนี้ให้มีประสิทธิภาพ

(1) ระบบงานด้านการรับฝาก ถอน และโอนหลักทรัพย์ และระบบงานที่เกี่ยวข้อง เพื่อให้การดำเนินการดังกล่าวมีความถูกต้องครบถ้วน ตรงต่อความเป็นจริงและเป็นปัจจุบัน รวมทั้งสามารถนำไปใช้งาน ได้อย่างมีประสิทธิภาพภายในระยะเวลาที่เหมาะสม

(2) ระบบการจัดการ รวบรวม ประมวลผล เก็บรักษา และเรียกดูข้อมูลเกี่ยวกับการรับฝาก ถอน และโอนหลักทรัพย์ และข้อมูลอื่นใดที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการในงานศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ระบบสำรองข้อมูลไว้ใช้ทดแทนในกรณีที่ไม่สามารถนำข้อมูลนั้นมาใช้ได้

(3) ระบบการรายงานข้อมูลหลักทรัพย์ เพื่อให้สมาชิกสามารถใช้ตรวจสอบข้อมูลหลักทรัพย์คงเหลือประจำวันในบัญชีฝากหลักทรัพย์และความถูกต้องในการทำรายการของสมาชิก

(4) ระบบตรวจสอบเพื่อให้มั่นใจว่าบุคคลที่สั่งให้ดำเนินการเกี่ยวกับหลักทรัพย์ ในบัญชีของสมาชิกเป็นสมาชิกหรือบุคคลที่ได้รับมอบอำนาจจากสมาชิก

ข้อ 56 ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีสัญญาเกี่ยวกับสมาชิกไว้เป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องกำหนดขอบเขตและเงื่อนไขในการให้บริการรับฝากหลักทรัพย์อย่างชัดเจน

ข้อ 57 การ โอนหลักทรัพย์จากบัญชีสมาชิกรายหนึ่ง ไปยังบัญชีของสมาชิกอีกรายหนึ่ง หรือภายในบัญชีสมาชิกรายเดียวกัน โดยศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ที่ประกอบการ โดยตลาดหลักทรัพย์ ตามมาตรา 224 จะกระทำได้อีกต่อเมื่อศูนย์รับฝากหลักทรัพย์นั้นได้รับคำร้องขอจากสมาชิก หรือเมื่อสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ได้แจ้งรายการการส่งมอบหลักทรัพย์ระหว่างสมาชิกที่ได้ซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ในแต่ละสิ้นวัน ทั้งนี้ ให้ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ดำเนินการ โอนหลักทรัพย์ให้เป็นไปตามระเบียบหรือข้อบังคับที่ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์กำหนด และเมื่อมีการบันทึกบัญชีการ โอนหลักทรัพย์ตามระเบียบหรือข้อบังคับดังกล่าวแล้ว ให้การ โอนหลักทรัพย์ดังกล่าวมีผลสมบูรณ์ตามกฎหมาย

ในกรณีที่เป็นการ โอนหลักทรัพย์ระหว่างสมาชิกที่ได้ซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ ตามวรรคหนึ่ง ให้ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ดำเนินการ โอนหลักทรัพย์เมื่อได้รับแจ้งยืนยันการชำระราคาหลักทรัพย์จากสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ และเมื่อศูนย์รับฝากหลักทรัพย์บันทึกบัญชีการ โอนหลักทรัพย์แล้ว ให้ถือว่าการ โอนหลักทรัพย์ดังกล่าวเป็นที่สุด (finality of settlement) โดยศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ หรือผู้ที่เกี่ยวข้องจะยกเลิก แก้ไข หรือเปลี่ยนแปลงรายการมิได้

ข้อ 58 ในกรณีที่ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ลงทุนหรือฝากทรัพย์สินไว้กับธนาคารพาณิชย์ ทั้งในและต่างประเทศ ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องมีการประเมินความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการใช้บริการจากธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศดังกล่าว เพื่อให้มั่นใจว่าธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศมีกระบวนการเก็บรักษาทรัพย์สินที่มีประสิทธิภาพ มีความสามารถชำระหนี้เมื่อทางถาม

และอยู่ภายใต้การกำกับดูแลขององค์กรที่น่าเชื่อถือ และ ทั้งนี้ การลงทุนและฝากทรัพย์สินดังกล่าวต้องไม่กระจุกตัวในธนาคารพาณิชย์ทั้งในและต่างประเทศแห่งใดแห่งหนึ่งมากเกินไป

### หมวด 13

#### บทเฉพาะกาล

---

ข้อ 59 ให้บรรดาประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ คำสั่ง และหนังสือเวียน ที่ออก หรือวางแผนปฏิบัติตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทด. 94/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการ ในการประกอบกิจการเป็นสำนักหักบัญชีและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ลงวันที่ 28 ตุลาคม พ.ศ. 2552 และประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทด. 97/2552 เรื่อง การดูแลรักษาทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก ลงวันที่ 28 ตุลาคม พ.ศ. 2552 ซึ่งใช้บังคับอยู่ในวันก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ ยังคงใช้บังคับได้ต่อไปเท่าที่ไม่ขัดหรือแย้งกับข้อกำหนดแห่งประกาศนี้ จนกว่าจะได้มีประกาศ คำสั่ง และหนังสือเวียน ที่ออกหรือวางแผนปฏิบัติตามประกาศนี้ใช้บังคับ

ข้อ 60 ในกรณีที่มีประกาศฉบับอื่นอ้างอิงประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทด. 94/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการ ในการประกอบกิจการเป็นสำนักหักบัญชีและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ลงวันที่ 28 ตุลาคม พ.ศ. 2552 และประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทด. 97/2552 เรื่อง การดูแลรักษาทรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีได้รับมาหรือมีไว้เพื่อสมาชิก ลงวันที่ 28 ตุลาคม พ.ศ. 2552 ให้การอ้างอิงดังกล่าวหมายถึงการอ้างอิงประกาศนี้

ประกาศ ณ วันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2559

(นายรพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน