

แบบคำขออนุญาตซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading)

วันที่ _____

เรียน กรรมการผู้จัดการ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“ตลาดหลักทรัพย์”) และ/หรือ บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)
 (“ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า”)

ข้าพเจ้า บริษัท _____ (บริษัท) ซึ่งเป็นสมาชิกหมายเลข

_____ มีความประสงค์จะส่งคำสั่งซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์) โดยเป็น
การส่งคำสั่งของ

- บริษัท โดยส่งคำสั่งซื้อขายสำหรับ (บัญชีบริษัท, ลูกค้ำ หรือ ทำหน้าที่ดูแลสภาพคล่อง)
- ลูกค้ำที่ซื้อขายผ่าน DMA (โปรดระบุชื่อ และเลขที่บัญชีลูกค้ำ หรือทำหน้าที่ดูแลสภาพคล่อง)
- ลูกค้ำประเภท Online Trading ได้แก่ (ลูกค้ำทั่วไป หรือเฉพาะราย:โปรดระบุชื่อลูกค้ำ)

ทั้งนี้ บริษัท มีความประสงค์

- ขออนุญาตใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์
- แบบรายการกลยุทธ์ (Strategy)
- แบบทั่วไป (ใช้ได้หลายกลยุทธ์ ภายใต้ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายเดียวกัน)
- เพิ่มกลยุทธ์ (Strategy) ภายใต้ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายแบบทั่วไป ที่ได้รับอนุญาตแล้วตามหนังสืออนุญาต
เลขที่ _____

โดยแนบเอกสาร ดังนี้

- ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (ตามเอกสารแนบ FORM B)
- หลักการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ (ตามเอกสารแนบ FORM C)
- หน้าจอที่แสดงผลการทดสอบระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (ทุกหัวข้อ)
- คู่มือการใช้งานระบบ (User Manual)
- รายละเอียดการใช้งานระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์อื่น (ถ้ามี)
- ขออนุญาตเปลี่ยนแปลงชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์
- หลักการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์
- ช่องทางการต่อเชื่อมชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ (Acting user) เดิม _____ ใหม่ _____
- ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย ที่ได้รับอนุญาตแล้วตามหนังสืออนุญาตเลขที่ _____
สำหรับกลยุทธ์

โดยแนบเอกสารในส่วนที่มีการเพิ่มเติมหรือเปลี่ยนแปลง ดังนี้

- ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (ตามเอกสารแนบ FORM B)
- หลักการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ (ตามเอกสารแนบ FORM C)
- หน้าจอที่แสดงผลการทดสอบระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย
- คู่มือการใช้งานระบบ (User Manual)
- รายละเอียดการใช้งานระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์อื่น (ถ้ามี)
- ขอยกเลิกการใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ โดยแนบเอกสารแบบแจ้งยกเลิกชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ
(ตามเอกสารแนบ FORM D)
- อื่นๆ _____

บริษัท ขอรับรองว่า การส่งคำสั่งซื้อขายด้วยชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ดังกล่าว มีระบบการทำงานที่ไม่ขัดและถูกต้องครบถ้วนตาม
ข้อกำหนดตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในส่วนที่เกี่ยวกับการซื้อขาย และไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบ
การซื้อขายตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ทั้งนี้หากคำรับรองดังกล่าวไม่ถูกต้อง หรือการส่งคำสั่งซื้อขายด้วย
ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ดังกล่าวก่อให้เกิดความเสียหายใดๆ ต่อตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า บริษัท ตกลงและ
ยินยอมที่จะรับผิดชอบในความเสียหายใดๆ ที่อาจเกิดขึ้นต่อตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในทุกกรณี

ประทับตราบริษัท

ตำแหน่ง

(_____)

ผู้มีอำนาจลงนามแทนบริษัท

ชื่อผู้ประสานงาน _____

โทรศัพท์ _____

E-mail _____

ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย

ข้าพเจ้า บริษัท _____ (บริษัท) ซึ่งเป็นสมาชิกหมายเลข _____ ขอแจ้งรายละเอียดเกี่ยวกับระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์) รายละเอียดดังนี้

การบริหารความเสี่ยงทั่วไป

- มีการตรวจสอบคำสั่งให้เป็นไปตามกฎเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เช่น ชื่อหลักทรัพย์ ชื่อสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ประเภทของคำสั่ง ราคา ปริมาณ และช่วงราคา เป็นต้น
- มีกระบวนการควบคุมดูแลการกำหนดหรือแก้ไขหลักการทำงานของระบบและตัวแปร (Parameter) ทั้งของลูกค้าและเจ้าหน้าที่ของบริษัท รวมทั้งมีการบันทึกและจัดเก็บรายละเอียด เพื่อรองรับการตรวจสอบดังนี้ (ขอให้อธิบายรายละเอียดให้ชัดเจน)
- _____
- มีการทบทวนหลักการทำงานของระบบและ Parameter ของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ อย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง
- มีการจัดเก็บข้อมูลการส่งคำสั่ง (Transaction Log) เพื่อรองรับการตรวจสอบ
- มีการให้ความรู้แก่ผู้ที่ใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ การแก้ไขปัญหากรณีเกิดข้อผิดพลาดในการใช้งาน และกฎเกณฑ์ต่างๆของตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างสม่ำเสมอ
- มีกระบวนการคัดกรองลูกค้าที่ใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ รวมทั้งตรวจสอบความเสี่ยงรายลูกค้า เช่น
- มีการกำหนดวงเงิน ปริมาณและมูลค่าการซื้อขายของลูกค้าในแต่ละวัน
 - มีการจัดการเพื่อให้ลูกค้ารับทราบ และยอมรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์
- มีระบบตรวจสอบและป้องกันความผิดพลาดในการส่งคำสั่งของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ เช่น
- มีระบบป้องกันความผิดพลาดของลูกค้าหรือหลักการทำงานของระบบ เช่นการตรวจสอบ Fat finger order (ขอให้อธิบาย)
- _____
- มีระบบป้องกันการส่งคำสั่งซ้ำเข้ามาในระบบในปริมาณมาก (Duplicated order) เพื่อลดความเสียหายที่อาจเกิดขึ้น เช่น มีระบบเตือน, มีฟังก์ชันเพื่อหยุดการส่งคำสั่งโดยอัตโนมัติเพื่อตรวจสอบ, มีการกำหนดจำนวน Order/second ให้ต่ำกว่า Throttling Limits เป็นต้น (ขอให้อธิบาย)
- _____
- มีการจัดการกรณีเกิดปัญหาการใช้งานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ โดย
- มีการ Monitor และมีระบบ Alert แจ้งเตือนเมื่อเกิดปัญหา
หน่วยงานที่รับผิดชอบ _____
โดยมีขั้นตอนการดำเนินการดังนี้ (ขอให้อธิบาย) _____
 - มีฟังก์ชันที่สามารถหยุดการส่งคำสั่ง และยกเลิกคำสั่งที่ถูกส่งโดยชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ทั้งหมดในทันที เช่น Kill Switches
หน่วยงานที่รับผิดชอบ _____
โดยมีขั้นตอนการดำเนินการดังนี้ (ขอให้อธิบาย) _____
 - มีการจัดทำคู่มือที่ระบุถึงวิธีการแก้ไขปัญหา รวมทั้งอำนาจและขั้นตอนการดำเนินงานกรณีเกิดปัญหาการใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์
- การบริหารความเสี่ยงอื่นๆ _____
- _____

การบริหารความเสี่ยงเกี่ยวกับคำสั่งที่ไม่เหมาะสมที่อาจส่งผลกระทบต่อสภาพการซื้อขาย

- กลุ่มหลักทรัพย์และ/หรือกลุ่มสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ถูกอนุญาตให้ซื้อขาย (โปรดระบุ) _____
- มีระบบคัดกรองคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสมหรือระบบอื่นใด ที่สามารถช่วยป้องกันมิให้เกิดคำสั่งซื้อขายที่อาจส่งผลกระทบต่อสภาพการซื้อขาย และเป็นไปตามแนวทางเบื้องต้นการพิจารณาคัดกรองคำสั่งที่ไม่เหมาะสมสำหรับการใช้ Program Trading (PG) เพื่อป้องกันมิให้เกิดการส่งคำสั่งที่อาจเข้าข่ายความผิดตามข้อบังคับฯ เกี่ยวกับ False Market และ/หรือ กฎหมายที่เกี่ยวข้อง ซึ่งเป็นการป้องกันในระดับรายบุคคล (ไม่ใช่ตามประเภทบัญชีของบุคคล) เช่น บัญชี Cash, Cash Balance หรือ Credit Balance เป็นต้น
 - การควบคุมด้านราคา
 - มีการกำหนดค่า Maximum %Change จากราคาอ้างอิงคือ _____ (โปรดระบุว่าเป็นราคาใด เช่น ราคาล่าสุด (Last Execute), ราคาปิดก่อนหน้า, ราคา settlement, ราคาทฤษฎี เป็นต้น) ดังนี้
 - รายละเอียด : _____
 - ตัวอย่าง : _____
 - หมายเหตุ กรณีหลักทรัพย์ และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ไม่ีสภาพคล่อง การควบคุมด้านราคาให้คำนึงถึงผลกระทบเพื่อมิให้เกิดการส่งคำสั่งที่ไม่เหมาะสม
 - การควบคุมด้านมูลค่า
 - มีการกำหนดค่า Maximum value per order ดังนี้ _____
 - กรณีส่งแบบ Basket ค่า Maximum value per basket ดังนี้ _____
 - รายละเอียด : _____
 - ตัวอย่าง : _____
 - การป้องกันมิให้เกิดการซื้อขายอย่างต่อเนื่องในหลายระดับราคา
 - รายละเอียด : _____
 - ตัวอย่าง : _____
 - การป้องกันการส่งคำสั่งในลักษณะจับคู่กันเอง (Wash Sale) ของลูกค้ารายเดียวกัน
 - รายละเอียด : _____
 - ตัวอย่าง : _____
 - การป้องกันการส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ โดยที่ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นในครอบครอง (Short Sale) – เฉพาะ SET
 - รายละเอียด : _____
 - ตัวอย่าง : _____
 - อื่นๆ เช่น การป้องกันการซื้อขายในลักษณะใส่-ถอน แตกย่อย %Average Daily Volume (ADV) ลักษณะกลยุทธ์แบบ Aggressive หรือ Passive เป็นต้น
 - รายละเอียด : _____
 - ตัวอย่าง : _____
 - _____

ทั้งนี้บริษัทฯ ขอรับรองว่าข้อมูลดังกล่าวข้างต้นถูกต้องตรงตามความเป็นจริง

ประทับตราบริษัทฯ

ตำแหน่ง

(_____)
ผู้มีอำนาจลงนามแทนบริษัท

หลักการดำเนินงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ

ข้าพเจ้า บริษัท _____ (บริษัทฯ) ซึ่งเป็นสมาชิกหมายเลข _____ ขอแจ้งหลักการดำเนินงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ รายละเอียดดังนี้

ชื่อกลยุทธ์ (Strategy name) _____

โดยกลยุทธ์ที่ยื่นขออนุญาตเป็นกลยุทธ์ประเภท

- กลยุทธ์พื้นฐาน¹
- กลยุทธ์อื่นๆ

วัตถุประสงค์ _____

ได้รับการอนุญาตใช้งานในตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอื่น กรุณาระบุ _____

ตัวอย่างการทำงาน (ขอให้อธิบายโดยละเอียด เช่น ภาพประกอบ กราฟ หรือตัวเลข)

ทั้งนี้บริษัทฯ ขอรับรองว่าข้อมูลดังกล่าวข้างต้นถูกต้องตรงตามความเป็นจริง

ประทับตราบริษัทฯ

ตำแหน่ง

(_____)
ผู้มีอำนาจลงนามแทนบริษัทฯ

หมายเหตุ

¹ กลยุทธ์พื้นฐาน หมายถึง โปรแกรมคำสั่งซื้อขายที่มีวัตถุประสงค์เฉพาะและชัดเจน ซึ่งได้แก่กลยุทธ์สำหรับ

1. การซื้อขายหลักทรัพย์ที่ราคาเฉลี่ย เช่น VWAP, TWAP
2. การซื้อขายเพื่อให้สอดคล้องกับปริมาณซื้อขายในตลาด / ราคาอ้างอิง เช่น Volume Inline, Percentage of Volume, Price Inline, Implementation Shortfall
3. การซื้อขายหลักทรัพย์ในปริมาณมากเพื่อป้องกัน Market Impact เช่น Reserve, Iceberg, Float, Pegging
4. การซื้อขายหลักทรัพย์ในช่วงใกล้ปิดตลาดหรือช่วง Call Market เช่น Market on Close
(เป็นไปตามประกาศ / แนวทางปฏิบัติ / มาตรฐาน และหนังสือเวียนที่เกี่ยวข้อง)

