

**แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการหยุดทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและมาตรการสำรอง  
กรณีเกิดเหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Trading Disruption)**

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ได้กำหนดแนวทางการปฏิบัติกรณีเกิดเหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Trading Disruption) เพื่อให้การซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสามารถดำเนินไปได้อย่างต่อเนื่อง และเพื่อรองรับกรณีเกิดเหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย สัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

**การหยุดทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า**

**I. การหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทั้งหมดเป็นการชั่วคราว**

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทั้งหมดเป็นการชั่วคราวในกรณีต่อไปนี้

1. ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทั้งหมดเป็นการชั่วคราวเมื่อเกิดเหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย โดยเหตุขัดข้องนั้นต้องเข้าเกณฑ์ที่กำหนดไว้ทั้ง 3 ข้อ ดังนี้

- 1) เหตุขัดข้องเกิดจากระบบการซื้อขายที่อยู่ในความรับผิดชอบของ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือระบบคอมพิวเตอร์ หลักของสมาชิกที่ใช้ในการซื้อขาย (Main Platform) ที่เชื่อมต่อกับระบบการซื้อขายของ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า รวมถึงเหตุขัดข้องที่เกิดจากระบบสาธารณูปโภคของทางการหรือเหตุสุดวิสัยที่มีผลกระทบต่อระบบการซื้อขาย
- 2) เหตุขัดข้องที่เกิดมีผลกระทบกับสมาชิกที่ไม่สามารถบันทึกการเสนอซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขายจำนวนเกินกว่า 1 ใน 3 ของสมาชิกทั้งหมด ที่ดำเนินธุรกรรมในการให้บริการซื้อขาย
- 3) เหตุขัดข้องเกิดติดต่อกันนานเกินกว่า 15 นาที

ทั้งนี้ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจไม่นับสมาชิกที่สามารถส่งคำสั่งซื้อขายผ่านระบบการส่งคำสั่งซื้อขายสำรองที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดเตรียมไว้ และสมาชิกที่ได้ทำสัญญาส่งคำสั่งซื้อขายผ่านสมาชิกรายอื่นอยู่ในหลักเกณฑ์การหยุดการซื้อขายดังกล่าว ทั้งนี้ เพื่อให้การซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าดำเนินไปอย่างต่อเนื่อง

2. ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทั้งหมดเป็นการชั่วคราวกรณีมีเหตุวิกฤติร้ายแรงที่มีผลกระทบในวงกว้าง (Crisis) หากมีเงื่อนไขครบตามหลักเกณฑ์ทั้ง 2 ข้อ ดังนี้

- 1) เกิดเหตุวิกฤติร้ายแรงที่มีผลกระทบในวงกว้าง เช่น เหตุจลาจล การก่อการร้าย ภัยพิบัติทางธรรมชาติ เป็นต้น

- 2) เหตุวิฤตร้ายแรงส่งผลกระทบต่อระบบ คอมพิวเตอร์หลักของสมาชิกที่ใช้ในการซื้อขาย (Main Platform) ของสมาชิกดังนี้
  - 2.1) สมาชิกไม่สามารถบันทึกการเสนอซื้อขายด้วยระบบคอมพิวเตอร์หลักของสมาชิกที่ใช้ในการซื้อขาย (Main Platform) เข้ามาในระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และไม่สามารถใช้ระบบสำรองที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดเตรียมไว้ มีจำนวนเกินกว่า 1 ใน 3 ของสมาชิกทั้งหมดที่ดำเนินธุรกรรมในการให้บริการซื้อขาย หรือ
  - 2.2) สมาชิกไม่สามารถบันทึกการเสนอซื้อขายด้วยระบบคอมพิวเตอร์หลักของสมาชิกที่ใช้ในการซื้อขาย (Main Platform) เข้ามาในระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า มีจำนวนเกินกว่า 1 ใน 2 ของสมาชิกทั้งหมดที่ดำเนินธุรกรรมในการให้บริการซื้อขาย

การพิจารณาระบบคอมพิวเตอร์หลักของสมาชิกที่ใช้ในการซื้อขาย (Main Platform) ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะพิจารณาจาก API User ตามที่สมาชิกแจ้งต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

3. ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทั้งหมดเป็นการชั่วคราวเมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นว่ามีความจำเป็นและสมควรเพื่อเป็นการป้องกันความเสียหายที่อาจเกิดขึ้นกับการดำเนินงานของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เช่น ในกรณีที่สำนักหักบัญชีประกาศระงับการชำระราคาเป็นการชั่วคราวอันเนื่องมาจากเหตุขัดข้องของสำนักหักบัญชี เป็นต้น

## II. การหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเฉพาะบางประเภทเป็นการชั่วคราว

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าบางประเภทเป็นการชั่วคราวในกรณีที่ตลาดสินค้าอ้างอิงของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทดังกล่าวหยุดการซื้อขาย

ทั้งนี้ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า อาจหยุดทำการซื้อขาย สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกี่ยวข้องกับดัชนีหรือหุ้นสามัญที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ เมื่อตลาดหลักทรัพย์หยุดการซื้อขายทั้งหมดเป็นการชั่วคราว โดย ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจหยุดการซื้อขายภายใน 15 นาที ถัดจากเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์หยุดการซื้อขาย

หากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีการจัดให้มีการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทอื่นๆ ที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ หรือดัชนีราคาหลักทรัพย์ประเภทอื่นๆ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า อาจหยุดทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าด้วยเมื่อตลาดหลักทรัพย์หยุดการซื้อขายทั้งหมดเป็นการชั่วคราว

ในกรณีมีเหตุการณ์อื่นใดที่อาจส่งผลกระทบต่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงหรือกำหนดแนวปฏิบัติเกี่ยวกับการหยุดทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นอย่างอื่นได้

### เหตุขัดข้องที่เกี่ยวกับระบบการเผยแพร่ข้อมูลของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ในกรณีที่ระบบเผยแพร่ข้อมูลของ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ขัดข้องทำให้ไม่สามารถเผยแพร่ข้อมูล การซื้อขายได้ตามปกติ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า จะยังคงเปิดทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าต่อไป เนื่องจากสมาชิกยังสามารถได้รับขั้ ้อมูลการซื้อขายผ่านระบบการส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก และระบบการส่ง คำสั่งซื้อขายสำรองที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดหาไว้ให้

### ผลกระทบที่เกิดจากเหตุขัดข้องของระบบการซื้อขายที่ใช้ในการซื้อขาย

ในกรณีที่ระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าขัดข้องและจำเป็นต้องโอนย้ายการทำงาน ไปที่ระบบการซื้อขายสำรอง (Secondary Site) ของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะ โอนย้ายข้อมูลรายการซื้อขาย (Deal) ทั้งที่ได้รับการจับคู่แล้ว และยังไม่ได้รับ การจับคู่ (Order) ไปที่ระบบการซื้อขายสำรอง

### การเปิดทำการซื้อขายภายหลังที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประกาศหยุดทำการซื้อขาย

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะเริ่มเปิดทำการซื้อขายหลังจากมีการแก้ไขเหตุขัดข้องที่มีผล กระทบต่อการซื้อขายเสร็จสิ้นแล้ว โดยตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะประกาศเวลาเปิดทำการซื้อขายที่แน่นอน (Definite Point of Time) ให้สมาชิกทราบเป็นการล่วงหน้าก่อนเปิดการซื้อขาย โดยในการเปิดทำการซื้อขายนั้น ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะกำหนดให้มีช่วง Pre-open เป็นเวลาอย่างน้อย 10 นาที และกำหนดให้มีช่วงเวลา เปิดทำการซื้อขายเป็นเวลาอย่างน้อย 15 นาที ยกเว้นกรณีดังต่อไปนี้

1. กรณีที่มีการแก้ไขเหตุขัดข้องเสร็จสิ้นแล้ว มีระยะเวลาทำการซื้อขายของช่วงเวลาซื้อขายนั้น คงเหลือน้อยกว่า 30 นาที หรือตามระยะเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจ กำหนดให้เปิดทำการซื้อขายตามปกติในช่วงเวลาซื้อขายถัดไป
2. กรณีมีการแก้ไขเหตุขัดข้องเสร็จสิ้นภายในช่วงเวลาซื้อขายล่าสุดก่อนที่สำนักหักบัญชีจะประมวล ผลเพื่อจัดทำรายงานการชำระหนี้ประจำวันตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจพิจารณาขยายเวลาทำการซื้อขายออกไป ได้ตามที่เห็นสมควร
3. กรณีอื่นๆ ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นสมควร

### การประกาศหยุดทำการซื้อขาย

เมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสั่งหยุดทำการซื้อขาย ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะดำเนินการดังนี้

1. แจ้งให้สมาชิกทราบสาเหตุเบื้องต้นที่ต้องหยุดทำการซื้อขาย และเวลาที่คาดว่าจะเปิดทำการ ซื้อขายใหม่ (ในกรณีที่สามารถระบุได้) โดยผ่านระบบการส่งคำสั่งซื้อขายหรือระบบเผยแพร่ข้อมูลของ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือทาง โทรศัพท์หรือช่องทางสื่อสารอื่นที่สามารถใช้งานได้

2. เมื่อทราบกำหนดเวลาแน่นอนที่จะเปิดทำการซื้อขาย ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า จะแจ้งยืนยันเวลาเปิดทำการซื้อขายใหม่ให้สมาชิกทราบล่วงหน้าผ่านระบบการส่งคำสั่งซื้อขายหรือระบบเผยแพร่ข้อมูล ของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือทางโทรศัพท์หรือช่องทางการสื่อสารอื่นที่สามารถใช้งานได้ก่อนเปิดทำการซื้อขาย เพื่อให้สมาชิกได้มีเวลาเตรียมความพร้อมในการทำการเสนอซื้อขายเมื่อจะเปิดทำการซื้อขาย อีกครั้ง

3. หากมีเหตุจำเป็นต้องเปลี่ยนแปลงเวลาเปิดทำการซื้อขายใหม่หรือขยายเวลาทำการซื้อขาย ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะแจ้งสมาชิกทราบล่วงหน้าโดยผ่านระบบการส่งคำสั่งซื้อขายหรือระบบเผยแพร่ข้อมูลของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือทางโทรศัพท์หรือช่องทางการสื่อสารอื่นที่สามารถใช้งานได้

**มาตรการหรือแผนสำรองกรณีมีเหตุขัดข้องทำให้สมาชิกไม่สามารถบันทึกการเสนอซื้อขายเข้ามายังระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า**

ในการดำเนินงานของสมาชิกในฐานะเป็นตัวแทนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาชิกต้องทำการบำรุงรักษาอุปกรณ์คอมพิวเตอร์ที่ใช้กับระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายของตนเองให้อยู่ในสภาพที่พร้อมใช้งานอยู่เสมอ และควรจัดให้มีระบบไฟฟ้าสำรองและระบบสื่อสารสำรองไว้ โดยการดำเนินการดังกล่าวจะต้องเป็นไปตามมาตรฐานการเตรียมความพร้อมตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

อย่างไรก็ดี เพื่อเป็นการอำนวยความสะดวกให้สมาชิกมีทางเลือกเพิ่มขึ้นในการส่งคำสั่งซื้อขายในกรณีที่มีระบบคอมพิวเตอร์หรือโปรแกรมคอมพิวเตอร์ของสมาชิกที่ใช้ในการซื้อขายไม่สามารถส่งคำสั่งซื้อขายมายังระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจึงได้จัดให้มีระบบการส่งคำสั่งซื้อขาย เพื่อให้สมาชิกใช้เป็นระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายสำรองและ/หรือให้สมาชิกดังกล่าวสามารถบันทึกการเสนอซื้อขายผ่านสมาชิกรายอื่นได้ โดยสมาชิกจะเลือกใช้วิธีใดวิธีหนึ่งหรือทั้งสองวิธีก็ได้ อย่างไรก็ตาม ในกรณีที่สมาชิกได้รับอนุญาตจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในการใช้ระบบการส่งคำสั่งซื้อขายสำรองที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดเตรียมไว้ เป็นระบบการส่งคำสั่งซื้อขายนั้น สมาชิกจะต้องใช้การบันทึกเสนอซื้อขายผ่านสมาชิกรายอื่นเป็นแผนสำรองกรณีมีเหตุขัดข้อง โดยรายละเอียดของมาตรการสามารถสรุปได้ดังนี้

**1. การใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายสำรองที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดเตรียมไว้**

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดให้มีระบบการส่งคำสั่งซื้อขาย สำรองไว้เป็นระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายสำรองให้สมาชิกสามารถใช้ได้ ซึ่ง ที่ทำการของสมาชิกหรือ ณ อาคารวิทยากรตลาดทุน (โครงการนอร์ธปาร์ค) เพื่อให้สมาชิกสามารถใช้ในการทำการเสนอซื้อขายในกรณีที่ระบบการส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกขัดข้อง

**ขั้นตอนการดำเนินการ**

ในกรณีที่สมาชิกที่จะใช้ระบบการส่งคำสั่งซื้อขายสำรอง ณ ที่ทำการของสมาชิก หรือ ณ อาคารวิทยากรตลาดทุน (โครงการนอร์ธปาร์ค) ให้สมาชิกดำเนินการตามแนวทางปฏิบัติที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

## 2. การส่งคำสั่งซื้อขายผ่านสมาชิกรายอื่น

สมาชิกอาจทำการเสนอซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยผ่านสมาชิกรายอื่นเป็นแผนสำรองเพื่อรองรับกรณีมีเหตุขัดข้อง เช่น อุปกรณ์คอมพิวเตอร์หรือโปรแกรมคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายขัดข้อง โดยสมาชิกต้องเตรียมการล่วงหน้าในการเปิดบัญชีเพื่อใช้ในการทำการเสนอซื้อขายผ่านสมาชิกรายอื่น โดยในการเปิดบัญชีต้องแยกบัญชีสำหรับบัญชีซื้อขายเพื่อสมาชิก และบัญชีซื้อขายเพื่อลูกค้าออกจากกัน

### ขั้นตอนการดำเนินการ

- 1) สมาชิกต้องส่งหนังสือแจ้งรายละเอียดของบัญชีซื้อขายที่เปิดกับสมาชิกรายอื่นเพื่อใช้ในกรณีระบบการส่งคำสั่งซื้อขายขัดข้องให้แก่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และสำนักหักบัญชี เพื่อทราบถึงการเตรียมการเป็นการล่วงหน้า
- 2) เมื่อเกิดเหตุขัดข้อง ให้สมาชิกรายที่ระบบการส่งคำสั่งซื้อขายขัดข้องทำการเสนอซื้อขายผ่านสมาชิกรายอื่น และให้สมาชิกรายที่ระบบการส่งคำสั่งซื้อขายขัดข้องแจ้งให้ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทราบทันที
- 3) ให้สมาชิกรายที่ทำการเสนอซื้อขายโอนย้ายรายการซื้อขายหรือฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่สมาชิกรายที่ระบบการส่งคำสั่งซื้อขายขัดข้อง ตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด
- 4) เมื่อสมาชิกดำเนินการแก้ไขเครื่องหรืออุปกรณ์ที่ใช้กับระบบการส่งคำสั่งซื้อขายของตนเอง และสามารถใช้งานได้ตามปกติแล้ว ให้สมาชิกแจ้งให้ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และสำนักหักบัญชีทราบทันที

### ผลบังคับใช้

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะให้แนวทางฉบับนี้แทนแนวทางการปฏิบัติเกี่ยวกับการหยุดทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและมาตรการสำรองกรณีเกิดเหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฉบับที่มีผลบังคับใช้วันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2557 โดยให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2557 เป็นต้นไป