

## สารบัญ

### ข้อบังคับ

#### หมวด 700 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย

	หน้า
701 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย.....	700-1
702 คุณสมบัติของเจ้าหน้าที่รับอนุญาต.....	700-1
703 การขอแต่งตั้งเจ้าหน้าที่รับอนุญาต.....	700-2
704 การขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต.....	700-2
704.01 การพิจารณาการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต.....	700-2
704.02 การเก็บรักษาหมายเลขประจำตัวเจ้าหน้าที่รับอนุญาต ชื่อผู้ใช้และรหัสผ่าน (user name and password).....	700-2
704.03 ค่าธรรมเนียมที่เกี่ยวข้องกับเจ้าหน้าที่รับอนุญาต.....	700-2
705 หน้าที่ของเจ้าหน้าที่รับอนุญาต.....	700-2
706 การเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต.....	700-3
707 การลงโทษเจ้าหน้าที่รับอนุญาต.....	700-4
708 การสมัครเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง .....	700-4
709 คุณสมบัติของผู้ดูแลสภาพคล่อง.....	700-4
710 หน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง.....	700-5
710.01 การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง .....	700-5
710.02 ประเภทการดูแลสภาพคล่อง.....	700-6
710.03 จำนวนการเสนอซื้อและเสนอขายขั้นต่ำ (Minimum Quantity).....	700-6
710.04 ส่วนต่างระหว่างราคาเสนอซื้อและเสนอขาย (Maximum Spreads) .....	700-6

<b>711</b>	<b>หน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานอย่างต่อเนื่อง</b>	
	<b>(Making a Market on Continuous Basis) .....</b>	<b>700-6</b>
711.01	การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง .....	700-6
711.02	การปฏิบัติหน้าที่เมื่อการเสนอซื้อขายถูกจับคู่ .....	700-6
<b>712</b>	<b>หน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานเมื่อมีการร้องขอ</b>	
	<b>(Making a Market in Response to Quote Requests) .....</b>	<b>700-7</b>
712.01	การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง .....	700-6
712.02	การเสนอซื้อและเสนอขายเมื่อมีการร้องขอ .....	700-7
712.03	การปฏิบัติหน้าที่เมื่อการเสนอซื้อขายถูกจับคู่ .....	700-7
<b>713</b>	<b>การแก้ไขหรือเปลี่ยนแปลงสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีการดูแลสภาพคล่อง</b>	<b>700-7</b>
<b>714</b>	<b>การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่อง.....</b>	<b>700-7</b>
714.01	การซื้อขายด้วยระบบการซื้อขาย.....	700-7
714.02	การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องที่เป็นสมาชิก .....	700-7
714.03	การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องที่เป็นนิติบุคคลอื่นนอกจากสมาชิก.	700-8
<b>715</b>	<b>การหยุดการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องชั่วคราว.....</b>	<b>700-8</b>
715.01	การสั่งหรืออนุญาตให้หยุดการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง ชั่วคราว.....	700-8
715.02	การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องภายหลังหยุดการปฏิบัติหน้าที่ ชั่วคราว.....	700-8
<b>716</b>	<b>การสิ้นสุดการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง .....</b>	<b>700-9</b>
<b>717</b>	<b>การยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง.....</b>	<b>700-9</b>
<b>718</b>	<b>การขอยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง.....</b>	<b>700-9</b>
<b>719</b>	<b>การเปิดเผยการลงโทษบุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย.....</b>	<b>700-9</b>

## ข้อบังคับ

### หมวด 700 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย

#### 701 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย

บุคคลที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจอนุญาตให้บันทึกการเสนอซื้อขายหรือการซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขาย ได้แก่

- (1) เจ้าหน้าที่รับอนุญาต
- (2) ผู้ดูแลสภาพคล่อง
- (3) บุคคลอื่นใดตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

#### \*702 คุณสมบัติของเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

บุคคลที่สมาชิกจะขอแต่งตั้งให้เป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต ต้องมีและดำรงคุณสมบัติ ดังต่อไปนี้

- (1) เป็นผู้บรรลุนิติภาวะ
- (2) ไม่อยู่ระหว่างถูกสั่งพักการปฏิบัติงาน หรือไม่เคยถูกเพิกถอนใบอนุญาตหรือการขึ้นทะเบียนเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตภายในรอบระยะเวลา 5 ปีก่อนการขอแต่งตั้งเพราะการลงโทษของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลาดหลักทรัพย์ หรือหน่วยงานที่ทำหน้าที่กำกับดูแลอื่นที่เกี่ยวข้อง

- (3) เป็นพนักงานที่ปฏิบัติหน้าที่เต็มเวลาของสมาชิกที่ขอแต่งตั้งเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต หรือเป็นพนักงานของบริษัทหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ที่ถือหุ้นของสมาชิกไม่น้อยกว่าร้อยละเจ็ดสิบห้าของจำนวนหุ้นทั้งหมดของสมาชิก และมีสัญญายินยอมให้พนักงานนั้นมาปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าวให้แก่สมาชิก หรือเป็นพนักงานที่ปฏิบัติงานเต็มเวลาของตัวแทนสนับสนุนการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Selling Agent) ที่ทำสัญญาเป็นตัวแทนสนับสนุนการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับสมาชิกที่ขอแต่งตั้งเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

- (4) มีคุณสมบัติทางการศึกษาหรือมีประสบการณ์ดังนี้
  - (ก) จบการศึกษาระดับปริญญาตรีขึ้นไปหรือเทียบเท่าจากสถานศึกษาที่หน่วยงานราชการให้การรับรองหรือเป็นพนักงานหรือเจ้าหน้าที่ที่ปฏิบัติงานในธุรกิจหลักทรัพย์หรือธุรกิจที่เกี่ยวข้องไม่น้อยกว่า 3 ปีติดต่อกัน และ

- (ข) ผ่านการอบรมหรือการทดสอบตามหลักสูตรของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือหลักสูตรอื่นที่ได้รับความเห็นชอบจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

- (5) ไม่เป็นบุคคลที่มีลักษณะต้องห้ามของบุคลากรในธุรกิจตลาดทุนตามที่ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนกำหนด

(\*ยกเลิกความในหลักเกณฑ์ 702 โดยวิธีปฏิบัติบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 18 เมษายน 2557 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2557 เป็นต้นไป)

### 703 การขอแต่งตั้งเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

ในการขอแต่งตั้งบุคคลใดเพื่อเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตให้สมาชิกเสนอชื่อบุคคลซึ่งมีคุณสมบัติครบถ้วนตามหลักเกณฑ์ 702 และยื่นคำขอพร้อมรายละเอียดตามแบบที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

### 704 การขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

#### 704.01 การพิจารณาการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

เมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้ตรวจสอบหลักฐานเกี่ยวกับคุณสมบัติของบุคคลที่สมาชิกขอแต่งตั้งเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตและเห็นว่าบุคคลดังกล่าวมีคุณสมบัติครบถ้วนแล้ว ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะรับคำขอไว้พิจารณาและจะแจ้งผลการพิจารณาขึ้นทะเบียนบุคคลดังกล่าวเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตของสมาชิคนั้นและกำหนดหมายเลขประจำตัวเจ้าหน้าที่รับอนุญาตสำหรับบุคคลนั้น โดยจะนำส่งแก่สมาชิกผู้เสนอขอแต่งตั้งภายใน 60 วันทำการนับจากวันที่ได้รับเอกสารและหลักฐานครบถ้วน

เมื่อบุคคลใดได้ขึ้นทะเบียนเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตของสมาชิกใดและได้รับหมายเลขประจำตัวเจ้าหน้าที่รับอนุญาตตามการเสนอขอแต่งตั้งของสมาชิคนั้นแล้ว ให้ปฏิบัติงานการซื้อขายด้วยระบบการซื้อขายในนามของสมาชิกที่ขอแต่งตั้งนั้น

#### 704.02 การเก็บรักษาหมายเลขประจำตัวเจ้าหน้าที่รับอนุญาต ชื่อผู้ใช้และรหัสผ่าน (User name and Password)

ให้สมาชิกและเจ้าหน้าที่รับอนุญาตเก็บรักษาหมายเลขประจำตัวเจ้าหน้าที่รับอนุญาต ชื่อผู้ใช้และรหัสผ่าน (User name and Password) ตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

#### 704.03 ค่าธรรมเนียมที่เกี่ยวข้องกับเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

ให้ค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้องกับเจ้าหน้าที่รับอนุญาตเป็นไปตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

### 705 หน้าที่ของเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

เจ้าหน้าที่รับอนุญาต มีหน้าที่ดังต่อไปนี้

(1) ปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ข้อกำหนด หนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยมีหน้าที่เช่นเดียวกับที่สมาชิกมีหน้าที่ต้องปฏิบัติในเรื่องนั้น แต่เฉพาะที่อยู่ในวิสัยที่เจ้าหน้าที่รับอนุญาตพึงกระทำได้

ข้อบังคับของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หมวด 700 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย

(2) ให้ความร่วมมือแก่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในการป้องกันการกระทำที่ฝ่าฝืนกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และข้อกำหนด หนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(3) ไม่ให้ความร่วมมือหรือความช่วยเหลือบุคคลอื่นกระทำการฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตาม (1)

(4) ไม่ปฏิบัติกรใด ๆ ให้เป็นที่เสื่อมเสียหรืออาจเสื่อมเสียหรือเห็นได้ว่าจะเป็นทางนำไปสู่ความเสื่อมเสียแก่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(5) ไม่ส่งคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีลักษณะไม่เหมาะสมตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด หรือส่งคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อยู่หรือควรรู้หรือมีเหตุอันเชื่อได้ว่ารู้ว่าจะเข้าข่ายเป็นความผิดตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ข้อกำหนด หนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(6) ไม่ใช่ข้อมูลของลูกค้าหรือข้อมูลการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือข้อมูลใดที่ได้จากการปฏิบัติหน้าที่ของตนในการแสวงหาประโยชน์เพื่อตนเองและ/หรือบุคคลอื่น

(7) ไม่ส่งคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อตนเองและ/หรือบุคคลอื่นโดยใช้บัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า

(8) ไม่วิเคราะห์การลงทุนหรือแนะนำการลงทุนแก่ผู้ลงทุนโดยไม่ได้รับความเห็นชอบให้ปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าวจากสำนักงาน ก.ล.ต. ในกรณีที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนดหลักเกณฑ์ให้บุคลากรของสมาชิกต้องขอความเห็นชอบในการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าว

(\*เพิ่มเติมหลักเกณฑ์ 705 ข้อ (8) โดยข้อบังคับของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 18 เมษายน 2557 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2557 เป็นต้นไป)

## \*706 การเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

(1) เจ้าหน้าที่รับอนุญาตอาจถูกพักการปฏิบัติหน้าที่เจ้าหน้าที่รับอนุญาตได้ หากตลาดหลักทรัพย์สั่งพักการปฏิบัติหน้าที่เจ้าหน้าที่รับอนุญาต หรือสำนักงาน ก.ล.ต. สั่งพักการปฏิบัติหน้าที่แนะนำการลงทุน ทั้งนี้ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจสั่งพักการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าวเท่าระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์หรือสำนักงาน ก.ล.ต. สั่งพักการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าว แล้วแต่กรณี

(2) เจ้าหน้าที่รับอนุญาตอาจถูกเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาตได้ตามเหตุดังต่อไปนี้

(ก) หากในภายหลังพบว่าเจ้าหน้าที่รับอนุญาตไม่สามารถดำรงคุณสมบัติของเจ้าหน้าที่รับอนุญาตข้อใดข้อหนึ่งหรือขาดหรือบกพร่องในคุณสมบัติของเจ้าหน้าที่รับอนุญาตข้อใดข้อหนึ่งตามหลักเกณฑ์ 702 หรือตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นสมควร

เมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีการเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาตด้วยเหตุตามวรรคหนึ่ง ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะแจ้งเป็นหนังสือให้เจ้าหน้าที่รับอนุญาตและสมาชิกผู้เสนอขอแต่งตั้งทราบและประกาศให้สมาชิกทราบโดยทั่วกัน

ข้อบังคับของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หมวด 700 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย

(ข) กรณีสมาชิกประสงค์เพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

ให้สมาชิกยื่นคำขอเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาตต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามแบบที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

(ค) เจ้าหน้าที่รับอนุญาตพ้นจากการเป็นพนักงานหรือผู้ปฏิบัติงานของสมาชิก

หรือพ้นจากการเป็นพนักงานของนิติบุคคลที่ทำสัญญาเป็นตัวแทนสนับสนุนการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Selling Agent) กับสมาชิกที่ขอแต่งตั้งเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต หรือสัญญาการเป็นตัวแทนสนับสนุนการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Selling Agent) ของนิติบุคคลที่เจ้าหน้าที่รับอนุญาตเป็นพนักงานกับสมาชิกผู้ขอแต่งตั้งให้เป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตสิ้นสุดลง

เมื่อปรากฏเหตุตามวรรคหนึ่ง ให้สมาชิกแจ้งให้ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทราบทันทีและยื่นคำขอเพิกถอนเจ้าหน้าที่รับอนุญาตต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามแบบที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

(\*ยกเลิกความในหลักเกณฑ์ 706 โดยวิธีปฏิบัติบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 18 เมษายน 2557 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2557 เป็นต้นไป)

## 707 การลงโทษเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

ในกรณีที่เจ้าหน้าที่รับอนุญาตของสมาชิกกระทำหรือมีส่วนในการกระทำการอันเป็นการฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติหน้าที่ข้อกำหนดของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า บุคคลนั้นอาจได้รับการลงโทษในลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างประกอบกันดังต่อไปนี้

- (1) ตักเตือน
- (2) ภาคทัณฑ์
- (3) คำหิโดยเปิดเผยต่อสาธารณชน
- (4) ปรับเป็นเงิน
- (5) ห้ามปฏิบัติหน้าที่เป็นการชั่วคราว
- (6) ห้ามปฏิบัติงานใด ๆ ในบริษัทสมาชิกภายในระยะเวลาที่กำหนด
- (7) เพิกถอนการขึ้นทะเบียน

## \*708 การสมัครเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง

ให้บุคคลที่ประสงค์จะสมัครเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องยื่นหนังสือแจ้งความจำนงต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าภายในระยะเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดเป็นคราว ๆ ไป

## \*709 คุณสมบัติของผู้ดูแลสภาพคล่อง

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องมีและดำรงคุณสมบัติขั้นต่ำดังต่อไปนี้

## ข้อบังคับของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หมวด 700 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย

(1) เป็นสมาชิกของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือลูกค้าที่เป็นนิติบุคคลซึ่งสมาชิกแจ้งความจำนงให้เป็นผู้ดูแลสภาพคล่องต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือนิติบุคคลอื่นที่มีสัญญารับประกันการชำระราคากับสมาชิกสำนักหักบัญชี

(2) มีประสบการณ์ในการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือมีผู้ปฏิบัติงานที่มีความรู้และความสามารถเป็นที่น่าเชื่อถือว่าจะปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลสภาพคล่องได้

(3) มีความพร้อมของระบบงานที่เพียงพอหรือแสดงให้เห็นได้ว่ามีกระบวนการและมีความพร้อมในการปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง ตลอดจนมีนโยบายการจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าว

(4) มีฐานะการเงินที่มั่นคงและไม่มีความเสี่ยงที่อาจมีผลกระทบต่อความสามารถปฏิบัติหน้าที่ผู้ดูแลสภาพคล่องได้

**\*ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจกำหนดคุณสมบัติของผู้ประสงค์จะเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องดังต่อไปนี้เพิ่มเติมได้ตามที่เห็นสมควร**

(1) ผู้ดูแลสภาพคล่องที่เป็นลูกค้าที่เป็นนิติบุคคลซึ่งสมาชิกแจ้งความจำนงให้เป็นผู้ดูแลสภาพคล่องต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือนิติบุคคลอื่นที่มีสัญญารับประกันการชำระราคากับสมาชิกสำนักหักบัญชี

(2) ผู้ดูแลสภาพคล่องในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐอเมริกา (Baht/USD Futures)

*(\*ข้อความของหลักเกณฑ์ 709 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 20 มกราคม 2552 ซึ่งมีผลใช้บังคับวันที่ 2 กุมภาพันธ์ 2552 เป็นต้นไป)*

*(\*\*ข้อความของหลักเกณฑ์ 709 วรรคสองเดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 8 มกราคม 2556 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 14 มกราคม 2556 เป็นต้นไป)*

### **\*710 หน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง**

#### **710.01 การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง**

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องปฏิบัติหน้าที่ดังต่อไปนี้

(1) ทำการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับมอบหมายจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(2) ต้องปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ข้อกำหนด หนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

#### 710.02 ประเภทการดูแลสภาพคล่อง

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจมอบหมายให้ผู้ดูแลสภาพคล่องปฏิบัติหน้าที่ดูแลการซื้อขายตามประเภทการดูแลสภาพคล่องประเภทใดประเภทหนึ่งหรือสองประเภท ดังนี้

- (1) การดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานอย่างต่อเนื่อง (Continuous Basis)
- (2) การดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานเมื่อมีการร้องขอ (Response to Quote Requests)

#### 710.03 จำนวนการเสนอซื้อและเสนอขายขั้นต่ำ (Minimum Quantity)

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องทำการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในแต่ละครั้งอย่างน้อยตามจำนวนขั้นต่ำที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

#### 710.04 ส่วนต่างระหว่างราคาเสนอซื้อและเสนอขาย (Maximum Spreads)

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องทำการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อให้ราคาเสนอซื้อและเสนอขายที่ปรากฏในระบบการซื้อขายมีส่วนต่างไม่เกินกว่าที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

### \*711 หน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานอย่างต่อเนื่อง (Making a Market on Continuous Basis)

#### 711.01 การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องทำการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามแบบประเภท และเดือนที่ส่งมอบหรือชำระราคาที่ได้รับมอบหมายตลอดช่วงเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

#### 711.02 การปฏิบัติหน้าที่เมื่อการเสนอซื้อขายถูกจับคู่

ในกรณีที่การเสนอซื้อขายที่ผู้ดูแลสภาพคล่องบันทึกเข้ามาในระบบการซื้อขายถูกจับคู่ทั้งหมดหรือบางส่วนและทำให้จำนวนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ผู้ดูแลสภาพคล่องได้ทำการเสนอซื้อขายไว้ลดลงต่ำกว่าจำนวนขั้นต่ำตามหลักเกณฑ์ 710.03 ให้ผู้ดูแลสภาพคล่องทำการเสนอซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขายเพื่อให้มีจำนวนเสนอซื้อและเสนอขายขั้นต่ำและส่วนต่างระหว่างราคาเสนอซื้อและเสนอขายเป็นไปตามหลักเกณฑ์ 710.03 และ 710.04



**\*712 หน้าทีของผู้ดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานเมื่อมีการร้องขอ (Making a Market in Response to Quote Requests)**

**712.01 การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง**

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องทำการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามแบบประเภท และเดือนที่ส่งมอบหรือชำระราคาที่ได้รับมอบหมายเมื่อมีการร้องขอจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือสมาชิกตลอดช่วงเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

**712.02 การเสนอซื้อและเสนอขายเมื่อมีการร้องขอ**

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องดำเนินการดังต่อไปนี้เมื่อได้รับการร้องขอให้ทำการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Quote Requests) ตามหลักเกณฑ์ 712.01

(1) ทำการเสนอซื้อและเสนอขายเข้ามาในระบบการซื้อขายภายในระยะเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

(2) ทำให้การเสนอซื้อและเสนอขายตาม (1) ปรากฏในระบบการซื้อขายตามระยะเวลาขั้นต่ำที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

**712.03 การปฏิบัติหน้าที่เมื่อการเสนอซื้อขายถูกจับคู่**

ในกรณีที่การเสนอซื้อและเสนอขายที่ผู้ดูแลสภาพคล่องได้บันทึกเข้ามาในระบบการซื้อขายถูกจับคู่ทั้งหมดหรือบางส่วน ผู้ดูแลสภาพคล่องไม่ต้องทำการเสนอซื้อและเสนอขายเพิ่มเติมเข้ามาในระบบการซื้อขายจนกว่าจะมีการร้องขอจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือสมาชิกให้ทำการเสนอซื้อและเสนอขายอีก ยกเว้นตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและผู้ดูแลสภาพคล่องจะกำหนดเป็นอย่างอื่น

**\*713 การแก้ไขหรือเปลี่ยนแปลงสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีการดูแลสภาพคล่อง**

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและผู้ดูแลสภาพคล่องอาจแก้ไขหรือเปลี่ยนแปลงแบบ ประเภท และเดือนที่ส่งมอบหรือชำระราคาของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้มอบหมายให้ผู้ดูแลสภาพคล่องทำการเสนอซื้อและเสนอขายเข้ามาในระบบการซื้อขายได้

**\*714 การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่อง**

**714.01 การซื้อขายด้วยระบบการซื้อขาย**

ในการซื้อขายด้วยระบบการซื้อขาย โดยผู้ดูแลสภาพคล่องให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

**714.02 การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องที่เป็นสมาชิก**

ในกรณีที่ผู้ดูแลสภาพคล่องเป็นสมาชิก ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

ข้อบังคับของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หมวด 700 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย

(1) จัดให้มีระบบการดำเนินงานในการซื้อขายและการดำเนินงานในฐานะเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องแยกต่างหากจากระบบการดำเนินงานในการซื้อขายและการดำเนินงานของสมาชิกในฐานะเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่ลูกค้า

(2) ดำเนินการขอแต่งตั้งบุคคลใดเพื่อเป็นเจ้าหน้าที่ดูแลสภาพคล่องของตน

(3) ห้ามมิให้เจ้าหน้าที่ดูแลสภาพคล่องรับหรือส่งคำสั่งซื้อขายเพื่อบัญชีของลูกค้า และสมาชิกต้องมีระบบการดำเนินงานในการป้องกันมิให้เจ้าหน้าที่ดังกล่าวล่วงรู้ถึงข้อมูลหรือสามารถใช้ข้อมูลของลูกค้าเพื่อการใด ๆ ในการปฏิบัติงาน

(4) ต้องจัดให้บัญชีซื้อขายของผู้ดูแลสภาพคล่องแยกออกจากบัญชีซื้อขายอื่น ๆ

(5) ดำเนินการอื่น ๆ ตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

#### **\*714.03 การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องที่เป็นนิติบุคคลอื่นนอกจากสมาชิก**

ในกรณีที่ผู้ดูแลสภาพคล่องเป็นนิติบุคคลอื่นนอกจากสมาชิก ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจกำหนดเงื่อนไขในการปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องดังกล่าวได้ ทั้งนี้ เพื่อให้การซื้อขายเป็นไปอย่างมีระเบียบ โปร่งใสและมีความเป็นธรรม

*(ข้อความของหลักเกณฑ์ 714.03 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 20 มกราคม 2552 ซึ่งมีผลใช้บังคับวันที่ 2 กุมภาพันธ์ 2552)*

#### **\*715 การหยุดการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องชั่วคราว**

##### **715.01 การสั่งหรืออนุญาตให้หยุดการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องชั่วคราว**

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจสั่งหรืออนุญาตให้ผู้ดูแลสภาพคล่องหยุดการปฏิบัติหน้าที่ชั่วคราวได้เมื่อเกิดกรณีดังต่อไปนี้

(1) มีเหตุการณ์ที่อาจกระทบต่อการซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอันไม่สามารถทำให้การซื้อขายเป็นไปอย่างมีระเบียบ โปร่งใสและมีความเป็นธรรม

(2) มีเหตุการณ์อื่น ๆ ตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นสมควร

ในกรณีที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสั่งหรืออนุญาตให้ผู้ดูแลสภาพคล่องหยุดการปฏิบัติหน้าที่ชั่วคราว ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะประกาศให้สมาชิกทราบทั่วกัน โดยผู้ดูแลสภาพคล่องดังกล่าวจะได้รับการเว้นไม่ต้องปฏิบัติหน้าที่ในช่วงเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสั่งหรืออนุญาตให้หยุดการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าว

##### **715.02 การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องภายหลังหยุดการปฏิบัติหน้าที่ชั่วคราว**

ให้ผู้ดูแลสภาพคล่องเริ่มปฏิบัติหน้าที่ภายหลังหยุดการปฏิบัติหน้าที่ชั่วคราวตามหลักเกณฑ์ 715.01 เมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้แจ้งยกเลิกหรือสิ้นสุดระยะเวลาที่ได้รับอนุญาตให้หยุดการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าวต่อผู้ดูแลสภาพคล่อง โดยตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะประกาศการเริ่มการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องภายหลังหยุดการปฏิบัติหน้าที่ชั่วคราวให้สมาชิกทราบทั่วกัน

### **\*716 การสิ้นสุดการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง**

การเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องสิ้นสุดตามเหตุใดเหตุหนึ่งดังต่อไปนี้

(1) เมื่อสิ้นสุดระยะเวลาการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องที่ตกลงไว้กับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(2) เมื่อถูกยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ 717

(3) เมื่อมีการขอยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ 718

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะประกาศให้สมาชิกทราบทั่วกันเมื่อการปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลสภาพคล่องของผู้ดูแลสภาพคล่องรายใดสิ้นสุด

### **\*717 การยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง**

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจพิจารณายกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง เมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นว่า

(1) ผู้ดูแลสภาพคล่องไม่ปฏิบัติตามหน้าที่ที่ตกลงไว้กับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(2) ผู้ดูแลสภาพคล่องไม่ปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ข้อกำหนดหนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

### **\*718 การขอยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง**

ผู้ดูแลสภาพคล่องอาจขอยกเลิกจากการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องได้ตามที่ได้ตกลงไว้กับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยผู้ดูแลสภาพคล่องจะต้องยื่นหนังสือแจ้งล่วงหน้าอย่างน้อย 30 วัน ทั้งนี้ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจกำหนดเงื่อนไขให้แก่ผู้ดูแลสภาพคล่องปฏิบัติก่อนที่จะให้การยกเลิกมีผลได้

### **\*719 การเปิดเผยการลงโทษบุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย**

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจเปิดเผยการลงโทษบุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขายได้ ในกรณีที่บุคคลดังกล่าวได้รับการลงโทษเนื่องจากการไม่ปฏิบัติตามข้อกำหนดของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอันมีผลกระทบต่อผู้ลงทุนหรือการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยรวมตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

ในการเปิดเผยการลงโทษตามวรรคหนึ่ง ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจพิจารณาเปิดเผยแก่สมาชิกอื่นหรือบุคคลที่เกี่ยวข้องกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือเปิดเผยเป็นการทั่วไปได้

(\*เพิ่มเติมหลักเกณฑ์ 708-719 โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 24 สิงหาคม 2549 ซึ่งมีผลใช้บังคับวันที่ 28 สิงหาคม 2549)

\*\*\*\*\*