

แบบแจ้งรายละเอียดการกำกับดูแลการซื้อขายหลักทรัพย์และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าผ่านระบบของสมาชิก
Details of trading supervision through member system

ข้าพเจ้า บริษัท _____ (บริษัทฯ) ซึ่งเป็นสมาชิกหมายเลข _____ ขอแจ้งรายละเอียดเกี่ยวกับการกำกับดูแลการซื้อขายหลักทรัพย์และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าผ่านระบบของสมาชิก รายละเอียดการทดสอบระบบบริหารความเสี่ยงและหน้าจอแสดงผลการทดสอบ รายละเอียดดังนี้

We, _____, (hereinafter referred to as the "Company"), Member No. _____, would like to inform the minimum controls, the test details and results (Screen display) of the company's risk management control of the company as follows:

วันที่ทำการทดสอบ (Test date) :

User ที่ใช้ในการทดสอบ (User for testing) :

ผู้ทดสอบ (Tester Name) :

ฝ่าย (Department) :

หมายเหตุ: 1. ดลท.กำหนดให้สมาชิกทดสอบระบบบริหารความเสี่ยงที่ Environment STAGE เท่านั้น
 (To test the Pre-trade Risk Management, members test in the Environment STAGE)
 2. Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา (กรณีที่ไม่ใช่ GMT+7 ให้ระบุ time zone)
 (Screen capture must include date and time (if not GMT+7 please specify time zone))

มีการตรวจสอบวงเงินซื้อขาย (Credit / Exposure Limit)

รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการตรวจสอบ (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.)	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

- มีการควบคุมมูลค่าเสนอซื้อขายสูงสุดต่อ 1 คำสั่ง (Maximum Value Per Order)

รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการตรวจสอบ (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.)	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

- มีการควบคุมปริมาณหุ้นที่เสนอซื้อขายสูงสุดต่อ 1 คำสั่ง (Maximum Volume Per Order)

รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการตรวจสอบ (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.)	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

- มีการตรวจสอบราคาเสนอซื้อขาย (Order Price Check) i.e. x% from reference price

รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการตรวจสอบ (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.)	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

- มีการควบคุมด้านราคาให้อยู่ภายในกรอบราคาซื้อขายสูงสุดและต่ำสุดประจำวัน (Ceiling and Floor)

รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการตรวจสอบ (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.)	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

มีการป้องกันการส่งคำสั่งในลักษณะจับคู่กันเอง (Wash Sale)

(รายการ wash sale หมายถึง การส่งคำสั่งซื้อและขายหลักทรัพย์และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในราคาและปริมาณที่อาจจับคู่ซื้อขายระหว่างกันเองได้ไม่ว่าจะทั้งจำนวนหรือบางส่วนอย่างมีนัยสำคัญของบุคคลเดียวกัน หรือระหว่างกลุ่มบุคคลซึ่งในที่สุดผู้ได้ประโยชน์จากการซื้อหรือขายยังคงเป็นบุคคลคนเดียวกัน อธิบายถึงระบบงานหรือวิธีการบริหารจัดการที่บริษัทใช้เพื่อป้องกันไม่ให้เกิดรายการ Wash sale รวมทั้งระบุวิธีการกำกับและตรวจสอบ และมาตรการดำเนินการของบริษัท หากพบการปฏิบัติที่ไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ในเรื่องดังกล่าว)

(Wash sale transaction refers to placing bid and offer at the price and volume, which getting matched or likely to be matched with the whole or in significant part by the same client or the same client group and also the end beneficiary of these accounts is the same person. Please clarify the company's procedure, monitoring practice for monitoring or protecting wash sale transactions and also provide any company's measurement when the wash sale transactions were detected.)

รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการป้องกันการส่งคำสั่งในลักษณะจับคู่กันเอง (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.) :	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

- มีการป้องกันการส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ โดยที่ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นในครอบครอง (Naked Short Selling)

(อธิบายถึงระบบงานหรือวิธีการบริหารจัดการที่บริษัทใช้เพื่อป้องกันไม่ให้เกิดรายการ Naked Short Selling รวมทั้งระบุวิธีการกำกับและตรวจสอบ และมาตรการดำเนินการของบริษัท หากพบการปฏิบัติที่ไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ในเรื่องดังกล่าว)

(Describe of work system or method which companies applied in order to prevent Naked short selling transactions including with explanation of supervising and inspecting method and procedure measure of companies if found that actions in violations of such rule).

รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการป้องกัน Naked Short Selling (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.):	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

- มีระบบ/ฟังก์ชันที่สามารถหยุดการส่งคำสั่งซื้อขายใหม่ และยกเลิกคำสั่งซื้อขายที่ส่งเข้ามาแล้วได้ทันทีในกรณีจำเป็น (Kill switch) โดยบริษัทฯ เป็นผู้ที่มีอำนาจในการดำเนินการดังกล่าว รายละเอียดดังนี้

(Having a kill switch function which can stop all new order processes and / or auto-cancel the unmatched orders. The company has the authority to perform such functions)

หน่วยงานที่รับผิดชอบ / Responsible Department	โปรดระบุ / Please specify
ขั้นตอนการดำเนินการ (ขอให้อธิบาย) (How to handle the problem (Please describe))	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงว่าไม่สามารถส่ง Orders ใหม่เข้ามาในระบบได้ กรณีทำการ Kill Switch โดยการปิดระบบ ขอให้แสดงหน้าจอที่แสดงการปิดระบบ (Reject new orders or shut down detail screen.)	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

ตัวอย่างหน้าจอแสดงผลการ Cancel ทุก Orders ที่ส่งมาจาก Program Trading / Algorithmic Trading ดังกล่าว ได้หมดในคราวเดียว (Result of cancelling all unmatched orders sending from this program trading / algorithmic trading system.)	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.
--	--

เงื่อนไขการตรวจสอบอื่นๆ (ถ้ามี) (Others)

รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการตรวจสอบ (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.)	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

กรณีใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading / Algorithmic Trading) บริษัทฯ มีการกำกับดูแลเพิ่มเติม ดังนี้

การบริหารความเสี่ยงทั่วไป (Basic Risk Management Control)

หน้าจอแสดงการป้องกัน Fat Finger (Fat Finger Prevention)

รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอแสดงการป้องกัน Fat Finger (Fat Finger Prevention)	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

หน้าจอแสดงการป้องกันไม่ให้เกิด Duplicated Order (Duplicated Order Prevention)

รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอแสดงการป้องกันไม่ให้เกิด Duplicated order (Duplicated order prevention) (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.)	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

หน้าจอ Monitor และหน้าจอ Alert (Monitoring and Alert Screen)

รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอ Monitor และหน้าจอ Alert (Monitoring and Alert Screen) (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.)	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

 การบริหารจัดการ หรือระบบอื่นใดในการตรวจสอบ การส่งคำสั่งซื้อหรือขายให้เป็นไปตามที่ตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า กำหนด (Risk Management Control for Preventing False Market)

 กลุ่มหลักทรัพย์และ/หรือกลุ่มสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่อนุญาตให้ซื้อขาย (Types of securities applied)

ตัวอย่างหน้าจอแสดงผลการทดสอบว่าเมื่อส่งคำสั่งหลักทรัพย์ที่ไม่ได้รับอนุญาต ระบบจะทำการ Reject Order ดังกล่าวหรือหน้าจอ Configuration (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.):	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.
--	--

การควบคุมด้านราคา (Price Control)

มีการกำหนดค่า Maximum %Change จากราคาอ้างอิง (โปรดระบุอ้างอิงจากราคาใด เช่น ราคาล่าสุด (Last Execute), ราคาปิดก่อนหน้า, ราคา settlement, ราคาทฤษฎี เป็นต้น) (Maximum %Change from last execute)	โปรดระบุ / Please specify
รายละเอียด (Details)	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่าง (Example) :	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการควบคุมด้านราคา โดยแสดงการ Reject Order หากมีการส่ง Order ด้วยราคาที่เกินกว่าราคาที่กำหนด (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.) :	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.
หมายเหตุ : กรณีหลักทรัพย์ และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ไม่มีสภาพคล่อง การควบคุมด้านราคาให้คำนึงถึงผลกระทบ เพื่อมิให้เกิดการส่งคำสั่งที่อาจกระทบต่อสภาพการซื้อขายด้วย เช่น การส่งคำสั่งที่อาจทำให้เกิดคำสั่งที่ไม่เหมาะสม (Note: According to price control set for the program trading must concern regarding securities and/or contract liquidity in order to prevent order entry that may lead to false market.)	

- การควบคุมด้านมูลค่า (Maximum value per order (SET)) / ด้านปริมาณ (Maximum volume per order (TFEX))

มีการกำหนดค่า Maximum value per order (SET) / Maximum volume per order (TFEX) ดังนี้	โปรดระบุ / Please specify
กรณีส่งแบบ Basket ค่า Maximum value per basket (SET) ดังนี้	โปรดระบุ / Please specify
รายละเอียด / Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่าง (Example)	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการควบคุมด้านมูลค่า (SET) / ด้านปริมาณ (TFEX) โดยการ Reject Order หากมีการส่ง order ที่ทำให้มูลค่าเสนอซื้อขายสูงสุดต่อ 1 คำสั่ง / ตระกร้า เกินกว่าที่กำหนด (Maximum Value per order / basket) (SET) (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.) :	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

- การป้องกันมิให้เกิดการซื้อหรือขายอย่างต่อเนื่องในหลายระดับราคา (The continuity of the orders prevention.)

รายละเอียด (Details)	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่าง (Example) :	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการป้องกันมิให้เกิดการซื้อหรือขายอย่างต่อเนื่องในหลายระดับราคา (Example of the results (Screen display) of the continuity of the orders prevention.) company's risk management control.) :	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.

- เงื่อนไขการตรวจสอบอื่นๆ (ถ้ามี) การป้องกันการซื้อขายในลักษณะใส่ถอน หรือ พยุงราคา (Others such as Orders entered and subsequently cancelled, or maintain the security price such as spread many orders with the intention to control the price of the securities.)

รายละเอียด (Details)	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่าง (Example) :	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการทดสอบ (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.) :	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้ติดวันที่ และเวลา Please capture screen of testing result including test date and time.