

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. กำหนดให้สมาชิกทดสอบระบบบริหารความเสี่ยงที่ Environment STAGE เท่านั้น

(Members are required to test Pre-trade Risk Management only in the testing environment STAGE)

2. Screen capture สำหรับฟังก์ชันต่างๆที่ SET / TFEX กำหนดให้มี ต้องแสดงวันที่และเวลาทดสอบ (กรณีที่ไม่ใช่ GMT+7 ให้ระบุ Time zone ด้วย)

(Screen capture of the required functions must include date and time (if not GMT+7, please specify time zone.)

1. มีระบบตรวจสอบความเพียงพอของวงเงินที่สามารถซื้อขายได้ และ/หรือสถานะที่สามารถสร้างเพิ่มได้ (Credit / Exposure Limit) โดยระบบต้องไม่อนุญาตให้ส่งคำสั่งที่มีความเสี่ยงเกินกว่า Credit / Exposure Limits ที่กำหนด (The system must check the Credit line and Exposure Limit, Orders are not allowed to submit if the Credit line is inadequate.)

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

2. มีระบบตรวจสอบมูลค่าเสนอซื้อขายสูงสุดต่อ 1 คำสั่ง เพื่อป้องกันการส่งคำสั่งซื้อขายที่มีมูลค่าเสนอซื้อขายสูงผิดปกติ หากมีการส่งคำสั่งที่มีมูลค่าเกินกว่าค่าที่กำหนด ระบบต้องไม่อนุญาตให้ส่งคำสั่งดังกล่าว (สำหรับ SET เท่านั้น)
(The system must check the maximum value per order in order to prevent the unusual outsized-value order, the system must reject the orders that contain larger value than the specified maximum value per order. (For SET only))

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

3. มีระบบตรวจสอบจำนวนหุ้น/สัญญาที่สามารถเสนอซื้อขายสูงสุดต่อ 1 คำสั่ง เพื่อป้องกันการส่งคำสั่งซื้อขายที่มีปริมาณมากผิดปกติ หากมีการส่งคำสั่งที่เกินกว่าค่าที่กำหนดไว้ ระบบต้องไม่อนุญาตให้ส่งคำสั่งดังกล่าว
(The system must check the maximum volume per order in order to prevent the unusual outsized-volume order, the system must reject the orders that contain larger volume than the specified maximum volume per order.)

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

4. มีระบบตรวจสอบราคาเสนอซื้อขาย (Order Price Check) เพื่อป้องกันการส่งคำสั่งซื้อขายที่มีราคาเกินกว่าช่วงราคาที่กำหนด โดยอาจกำหนดเป็นจำนวน Tick size หรือ Percentage (%) เทียบกับราคาอ้างอิง เช่น ราคาซื้อขายล่าสุด (Last Traded Price), ราคา Settlement ล่าสุด หรือราคาทฤษฎี เป็นต้น หากมีการส่งคำสั่งที่ราคาเกินกว่าช่วงที่กำหนด ระบบต้องไม่อนุญาตให้ส่งคำสั่งดังกล่าว

(The system must check the order price in order to prevent the unusual price deviation. Price deviations can be numbers of Tick size or percentage changes from the reference price such as Last Traded Price, Latest Settlement Price or Theoretical Price. The system must reject the orders that contain price outside the specified price ranges.)

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

5. มีการควบคุมราคาซื้อขายให้อยู่ภายในกรอบราคาซื้อขายสูงสุดและต่ำสุดประจำวัน (Ceiling and Floor)
(Daily Price Limit Control)

หมายเหตุ : ไม่บังคับใช้ กรณีขอต่อเชื่อมกับ SME Board (Remark : Not applied when connecting to the SME Board)

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

6. มีการป้องกันการส่งคำสั่งในลักษณะจับคู่กันเอง (Wash Sale)

(รายการ Wash sale หมายถึง การส่งคำสั่งซื้อและขายหลักทรัพย์และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในราคาและปริมาณที่อาจจับคู่ซื้อขายระหว่างกันเองได้ไม่ว่าจะทั้งจำนวนหรือบางส่วนอย่างมีนัยสำคัญของบุคคลเดียวกัน หรือระหว่างกลุ่มบุคคลซึ่งในที่สุดผู้ได้ประโยชน์จากการซื้อหรือขายยังคงเป็นบุคคลคนเดียวกัน โดยขอให้บริษัทอธิบายระบบงานหรือวิธีการบริหารจัดการที่บริษัทใช้เพื่อป้องกันไม่ให้เกิดรายการ 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 ให้หน้าจอแสดงวันที่ และเวลาทดสอบ Please capture screen of testing result including test date and time.

7. มีการตรวจสอบความเพียงพอของปริมาณหลักทรัพย์ก่อนส่งคำสั่งขาย เพื่อการป้องกันการส่งคำสั่งขาย โดยที่ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นในครอบครอง (Naked Short Selling)

โดยขอให้บริษัทอธิบายระบบงานหรือวิธีการบริหารจัดการที่บริษัทใช้เพื่อป้องกันไม่ให้เกิดรายการ Naked Short Selling รวมทั้งระบุวิธีการกำกับและตรวจสอบ และมาตรการดำเนินการของบริษัท หากพบการปฏิบัติที่ไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ในเรื่องดังกล่าว

(The system must check the adequacy of the amount of securities before submitting the sell orders in order to prevent the naked short selling transactions. Please describe the system function or process which companies applied in order to prevent Naked short selling transactions including the supervision process and measurement of companies if the violation occurs.)

หมายเหตุ : ไม่บังคับใช้ กรณีขอต่อเชื่อมกับ SME Board (Remark : Not applied when connecting to the SME Board)

รายละเอียด Details	โปรดระบุ / Please specify
-----------------------	---------------------------

<p>ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการป้องกัน Naked Short Selling</p> <p>Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.</p>	<p>โปรดระบุ / Please specify</p> <p>Screen capture ต้อง capture ให้นำจอแสดงวันที่ และเวลาทดสอบ</p> <p>Please capture screen of testing result including test date and time.</p>
---	---

8. มีระบบ/ฟังก์ชันที่สามารถหยุดการส่งคำสั่งซื้อขายใหม่ และยกเลิกคำสั่งซื้อขายที่ส่งเข้ามาแล้วได้ทันทีในกรณีจำเป็น (Kill switch) โดยบริษัทฯ เป็นผู้มีอำนาจในการดำเนินการดังกล่าว รายละเอียดดังนี้

(The System must contain Kill Switch function which can stop all new order and cancel all unmatched orders. And, the company must have the authority to perform such functions.)

<p>หน่วยงานที่รับผิดชอบ</p> <p>Responsible Department</p>	<p>โปรดระบุ / Please specify</p>
<p>ขั้นตอนการดำเนินการ (ขอให้อธิบาย)</p> <p>How to handle the problem (Please describe)</p>	<p>โปรดระบุ / Please specify</p>
<p>ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงว่าไม่สามารถส่ง Orders ใหม่เข้ามาในระบบได้ กรณีทำการ Kill Switch โดยการปิดระบบ ขอให้แสดงหน้าจอที่แสดงการปิดระบบ</p> <p>Reject new orders or shut down detail screen.</p>	<p>โปรดระบุ / Please specify</p> <p>Screen capture ต้อง capture ให้นำจอแสดงวันที่ และเวลาทดสอบ</p> <p>Please capture screen of testing result including test date and time.</p>
<p>ตัวอย่างหน้าจอหน้าจอแสดงผลการ Cancel ทุก Orders ที่ส่งมาจาก Program Trading / Algorithmic Trading ดังกล่าว ได้หมดในคราวเดียว</p> <p>Result of cancelling all unmatched orders sending from this program trading / algorithmic trading system.</p>	<p>โปรดระบุ / Please specify</p> <p>Screen capture ต้อง capture ให้นำจอแสดงวันที่ และเวลาทดสอบ</p> <p>Please capture screen of testing result including test date and time.</p>

9. เงื่อนไขการตรวจสอบอื่นๆ (ถ้ามี)

(Other controls, if available)

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

ตัวอย่าง (SAMPLE)

กรณีใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Algorithmic Trading / Program Trading) บริษัทฯ มีการกำกับดูแลเพิ่มเติม ดังนี้

For the deployment of Algorithmic Trading or Program Trading, the Company has the following additional supervision,

การบริหารความเสี่ยงทั่วไป (General Risk Management Control)

10. การป้องกันความผิดพลาดแบบ Fat Finger

(Fat Finger Prevention function)

รายละเอียด Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอแสดงการ ป้องกัน Fat Finger Fat Finger Prevention	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้หน้าจอแสดงวันที่ และเวลาทดสอบ Please capture screen of testing result including test date and time.

11. มีการป้องกันการส่งคำสั่งซื้อขายซ้ำ ๆ (Duplicated Order) เป็นจำนวนมากภายในช่วงเวลาหนึ่ง โดยมีได้มีเจตนาในการส่งคำสั่ง ซึ่งอาจเกิดจากความผิดพลาดของระบบ โดยอาจตรวจสอบการส่งคำสั่งซื้อขายซ้ำๆ (Repeated Order Check) หรือการตรวจสอบปริมาณการส่งคำสั่งซื้อขายในช่วงเวลาที่กำหนด (Order Rate Check)

(The system must prevent the submission of the huge amount of the duplicated orders that have no intention to trade and may occur by the system error. The function can be the repeated order check or the order rate check.)

รายละเอียด Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอแสดงการ ป้องกันไม่ให้เกิด Duplicated order (Duplicated order prevention) Example of the results (Screen display) of the	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้หน้าจอแสดงวันที่ และเวลาทดสอบ Please capture screen of testing result including test date and time.

company's risk management control.	
------------------------------------	--

12. หน้าจอที่ใช้ในการแสดงการทำงานของระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขาย (Monitoring screen) และหน้าจอแสดงการแจ้งเตือน (Notification or Alert Screen)

(Monitoring screen and Notification or Alert Screen)

รายละเอียด Details	โปรดระบุ / Please specify
ตัวอย่างหน้าจอ Monitor และ หน้าจอ 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 ให้หน้าจอแสดงวันที่ และเวลาทดสอบ Please capture screen of testing result including test date and time.

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

13. กลุ่มหลักทรัพย์และ/หรือกลุ่มสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อนุญาตให้ซื้อขาย โดยอาจกำหนดในลักษณะกลุ่มสินค้าที่สามารถซื้อขายได้ (White list) หรือกลุ่มสินค้าที่ห้ามซื้อขาย (Black list)

(Trading Universe : Securities / Futures and Options that allow to be traded. The function can be the white list or the black list.)

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

14. การควบคุมด้านราคา (Price Control)

โปรดระบุเพิ่มเติม เฉพาะในกรณีที่ต่างจากข้อ 4 (If the details are different from item 4, please specify.)

<p>มีการกำหนดค่า Maximum %Change จากราคาอ้างอิง (โปรดระบุราคาอ้างอิง เช่น ราคาล่าสุด, ราคาปิดวันก่อนหน้า, ราคา settlement ล่าสุด, ราคาทฤษฎี)</p> <p>Maximum %Change from reference price.</p> <p>(Please specify reference price e.g. Last traded price, Prior close price, Latest settlement price, Theoretical price)</p>	<p>โปรดระบุ / Please specify</p>
<p>รายละเอียด</p> <p>Details</p>	<p>โปรดระบุ / Please specify</p>

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 ให้หน้าจอแสดงวันที่ และเวลาทดสอบ Please capture screen of testing result including test date and time.
หมายเหตุ : กรณีหลักทรัพย์ และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ไม่มีสภาพคล่อง การควบคุมด้านราคาให้คำนึงถึงผลกระทบเพื่อมิให้เกิดการส่งคำสั่งที่อาจกระทบต่อสภาพการซื้อขายด้วย 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.	

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

โปรดระบุเพิ่มเติม เฉพาะในกรณีที่ต่างจากข้อ 2 และข้อ 3 (If the details are different from item 2 and 3, please specify.)

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	โปรดระบุ / Please specify Screen capture ต้อง capture ให้หน้าจอแสดงวันที่ และเวลาทดสอบ Please capture screen of testing result including test date and time.

<p>order ที่ทำให้มูลค่าเสนอซื้อขาย สูงสุดต่อ 1 คำสั่ง / ตระกร้า เกินกว่าที่กำหนด</p> <p>Maximum Value per order / basket)</p> <p>(SET) (Example of the results (Screen display) of the company's risk management control.</p>	
---	--

16. 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 ให้หน้าจอแสดงวันที่ และเวลาทดสอบ Please capture screen of testing result including test date and time.

17. เงื่อนไขการตรวจสอบอื่นๆ (ถ้ามี) การป้องกันการซื้อขายในลักษณะใส่ถอน หรือพุงราคา

(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 ให้หน้าจอแสดงวันที่ และเวลาทดสอบ Please capture screen of testing result including test date and time.

ตัวอย่าง (SAMPLE)