

แบบแจ้งข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายผ่านระบบ Direct Market Access (DMA)

วันที่ _____

เรียน กรรมการผู้จัดการ

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

ข้าพเจ้า บริษัท _____ (บริษัทฯ) ซึ่งเป็นสมาชิก

หมายเลข _____ ขอรายงานข้อมูลลูกค้าของบริษัทฯ ที่ซื้อขายผ่านระบบ DMA เพื่อวัตถุประสงค์

- ขอต่อเชื่อมระบบที่ให้บริการซื้อขายผ่านระบบ DMA
- ขอเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติมระบบที่ให้บริการซื้อขายผ่านระบบ DMA ที่ได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าไปแล้ว
- ขอแจ้งเปลี่ยนแปลง (Update) ข้อมูลของลูกค้าที่ได้รับอนุญาตไปแล้ว
- ขอแจ้งยกเลิกการต่อเชื่อมระบบที่ให้บริการซื้อขายผ่านระบบ DMA ที่ได้รับอนุญาตไปแล้ว
- อื่นๆ _____

ส่วนที่ 1 : ข้อมูลเกี่ยวกับลูกค้าบริษัท

No.	Customer Name	Customer Type*	Account No.	Customer detail	Customers' Application Software		
					Application Name	ISV/ Developer	Server location
1							
2							
3							
4							

* เช่น Customer, Foreign, Principal, Institution

ทั้งนี้ บริษัทฯ ขอรับรองว่าลูกค้าดังกล่าวข้างต้นมีคุณสมบัติครบถ้วนตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือข้อกำหนดของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย (แล้วแต่กรณี)

ส่วนที่ 2 : มาตรการกำกับดูแลการส่งคำสั่งซื้อขายผ่านระบบ DMA ของบริษัทฯ (โปรดทำเครื่องหมาย ✓ ในช่อง)

- มีระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Auto-checking System) ที่บริษัทฯ มีอำนาจควบคุมและบริหารจัดการ รวมทั้งกำหนดและเปลี่ยนแปลงค่าพารามิเตอร์ ตามเกณฑ์ดังนี้ (เฉพาะ Equity Market นำส่งรายละเอียดตามแบบฟอร์ม MO-DMA RM)
 1. วงเงินการซื้อขาย (Credit/Exposure limit)
 2. มูลค่าเสนอซื้อขายสูงสุดต่อ 1 คำสั่ง (Maximum value per order)
 3. ปริมาณหุ้นที่เสนอซื้อขายสูงสุดต่อ 1 คำสั่ง (Maximum volume per order)
 4. การตรวจสอบราคาเสนอซื้อขาย (Order price check) (เช่น % of last traded price)
 5. เงื่อนไขการตรวจสอบอื่น ๆ (ถ้ามี)
- มีระบบ/ฟังก์ชันที่สามารถหยุดการส่งคำสั่งซื้อขายใหม่และยกเลิกคำสั่งซื้อขายของลูกค้าที่ถูกส่งเข้ามาในระบบการซื้อขายแล้วได้ทันที (Kill Switch) โดยบริษัทฯ มีอำนาจดำเนินการ (เฉพาะ Equity Market นำส่งรายละเอียดตามแบบฟอร์ม MO-DMA RM)
- มีระบบติดตามดูแลการส่งคำสั่ง ณ สิ้นวัน (End-of-Day Surveillance System)
- มีเจ้าหน้าที่ของบริษัทฯ ติดตามดูแลการซื้อขายผ่านระบบ DMA
- มีกระบวนการในการคัดกรองลูกค้า เพื่อให้มั่นใจว่าลูกค้ามีคุณสมบัติตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด
- มีการจัดทำสัญญา ข้อตกลง หรือเอกสารสำคัญระหว่างบริษัทฯ และลูกค้าที่ขอต่อเชื่อมระบบที่บริษัทฯ ให้บริการซื้อขายผ่านระบบ DMA

- มีการแจ้งให้ลูกค้าทราบข้อกำหนดเกี่ยวกับการส่งคำสั่งซื้อขายผ่านระบบ DMA และข้อกำหนดที่เกี่ยวข้อง รวมถึงข้อห้ามการส่งคำสั่งซื้อขายไม่เหมาะสม ซึ่งลูกค้าได้รับทราบและยินยอมปฏิบัติตามแล้ว
- มีการบันทึกการทำงานของระบบ และสามารถนำมาตรวจสอบได้เมื่อตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าร้องขอ (แล้วแต่กรณี)
- มีการทบทวนความเหมาะสมของมาตรการควบคุมความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย ตลอดจนค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ในระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง
- อื่นๆ _____

บริษัทฯ ขอรับรองว่าข้อมูลดังกล่าวข้างต้นถูกต้องครบถ้วนตรงตามความเป็นจริง ทั้งนี้ หากคำรับรองดังกล่าวไม่ถูกต้องหรือการต่อเชื่อมระบบที่ให้บริการซื้อขายผ่านระบบ DMA ของบริษัทฯ ก่อให้เกิดความเสียหายใดๆ ต่อตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า บริษัทฯ ตกลงและยินยอมที่จะรับผิดชอบในความเสียหายใดๆ ที่อาจเกิดขึ้นต่อตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในทุกกรณี รวมทั้งบริษัทฯ ตกลงว่า ตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า อาจยกเลิกหรือระงับการต่อเชื่อมระบบที่ให้บริการซื้อขายผ่านระบบ DMA หรือให้บริษัทฯ ระงับการให้บริการซื้อขายผ่านระบบ DMA แก่ลูกค้าได้ ตามที่ตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นสมควร

_____)
 ตำแหน่ง _____
 ผู้มีอำนาจลงนามแทนบริษัท

ประทับตราบริษัท

_____)
 ตำแหน่ง _____
 ผู้มีอำนาจลงนามแทนบริษัท

ชื่อผู้ประสานงาน _____
 ฝ่าย / หน่วยงาน _____
 โทรศัพท์ _____
 E-mail _____

รายละเอียดการกำกับดูแลการส่งคำสั่งซื้อขายผ่านช่องทาง Direct Market Access (DMA)

1. มีระบบตรวจสอบก่อนการคำสั่งโดยอัตโนมัติ (Automated Pre-trade Risk Management) ที่บริษัทเป็นผู้มีอำนาจในการบริหารจัดการ รวมทั้งกำหนดและแก้ไขค่าตัวแปร (Parameters) ได้ในเรื่องดังนี้

1.1 การตรวจสอบวงเงินซื้อขาย (Credit/Exposure limit)

รายละเอียด : _____

ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการตรวจสอบ

1.2 การตรวจสอบมูลค่าเสนอซื้อขายสูงสุดต่อ 1 คำสั่ง (Maximum value per order)

รายละเอียด: _____

ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการตรวจสอบ

1.3 การตรวจสอบปริมาณหุ้นที่เสนอซื้อขายสูงสุดต่อ 1 คำสั่ง (Maximum volume per order)

รายละเอียด: _____

ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการตรวจสอบ

1.4 การตรวจสอบราคาเสนอซื้อขาย (Order price check)

รายละเอียด: _____

ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการตรวจสอบ

1.5 เงื่อนไขการตรวจสอบอื่นๆ (ถ้ามี)

รายละเอียด: _____

ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการตรวจสอบ

2. บริษัท มีระบบที่สามารถหยุดการส่งคำสั่งซื้อขายใหม่และ/หรือยกเลิกคำสั่งซื้อขายของลูกค้าที่ถูกส่งเข้ามาในระบบการซื้อขายแล้วได้ทันที (Kill Switch) โดยบริษัท เป็นผู้มีอำนาจในการดำเนินการดังกล่าว

รายละเอียด: _____

ตัวอย่างหน้าจอที่แสดงผลการยกเลิกคำสั่งโดยใช้ Kill switch

รายละเอียดของลูกค้า DMA ประเภทนิติบุคคล

ชื่อลูกค้า: _____

มีคุณสมบัติเป็นนิติบุคคลที่มีคุณสมบัติตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ดังนี้

- มีฐานะการเงินมั่นคง
- มีประสบการณ์ในการลงทุนในตลาดทุน
- ผู้บริหารไม่ถูกกล่าวโทษหรือถูกลงโทษจาก ก.ล.ต. / ตลท. และไม่มีพฤติกรรมการซื้อขายที่ไม่เหมาะสม โดยมีรายชื่อผู้บริหาร ดังนี้

รายชื่อผู้บริหาร	ตำแหน่ง