

แบบคำขออนุญาตต่อเชื่อมระบบคอมพิวเตอร์ของบริษัทเข้ากับระบบการซื้อขาย SET / TFEX

วันที่ _____

เรียน กรรมการและผู้จัดการ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“ตลาดหลักทรัพย์”) และ / หรือ

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (“ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า”)

ข้าพเจ้า บริษัท _____ (“บริษัทฯ”)

ซึ่งเป็นสมาชิกหมายเลข _____ มีความประสงค์จะขออนุญาตต่อเชื่อมระบบคอมพิวเตอร์ของบริษัทฯ เข้ากับระบบการซื้อขายของตลาดหลักทรัพย์ และ / หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตามรายละเอียดดังนี้

ตลาด	<input type="checkbox"/> ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) หรือ <input type="checkbox"/> ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (TFEX)
การเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขระบบคอมพิวเตอร์ของบริษัท	<input type="checkbox"/> ขอใช้งานระบบดังกล่าวเป็นครั้งแรก (New Platform) <input type="checkbox"/> เปลี่ยนแปลงผู้พัฒนาระบบหรือผู้ให้บริการระบบภายนอก (Service Provider) <input type="checkbox"/> เปลี่ยนแปลงเทคโนโลยีของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขาย <input type="checkbox"/> เปลี่ยนแปลงฟังก์ชันการทำงานของระบบคอมพิวเตอร์ของบริษัท (Functional Specification) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย <input type="checkbox"/> เปลี่ยนแปลงโครงสร้างของระบบเครือข่าย (Network Architecture) ของระบบคอมพิวเตอร์ของบริษัทที่ใช้ในการซื้อขาย <input type="checkbox"/> เปลี่ยนแปลงสถานที่ตั้งของเครื่องคอมพิวเตอร์ (Server) ของระบบคอมพิวเตอร์ของบริษัทที่ใช้ในการซื้อขาย <input type="checkbox"/> อื่นๆ: _____
วันที่ยื่นแบบคำขอ	_____
วันที่คาดว่าจะมีผล:	_____
วัตถุประสงค์การใช้งาน	<input type="checkbox"/> การส่งคำสั่งซื้อขายโดยเจ้าหน้าที่รับอนุญาต (Front Office) <input type="checkbox"/> Internet Trading <input type="checkbox"/> Direct Market Access (DMA) <input type="checkbox"/> Program Trading / Algorithmic Trading <input type="checkbox"/> Market Maker <input type="checkbox"/> อื่นๆ: _____
Protocol	<input type="checkbox"/> EMAPI <input type="checkbox"/> FIX
ข้อมูลเกี่ยวกับระบบที่ขออนุญาต	ชื่อระบบ: _____ Version: _____ ชื่อบริษัทผู้พัฒนาระบบ: _____ สถานที่ตั้งระบบ: _____ หากการขออนุญาตดังกล่าวดำเนินการบนระบบเดิม (CU เดิม) ที่ได้รับอนุญาตแล้ว โปรดระบุข้อมูลดังนี้ Acting user ของสมาชิก (เช่น 0099_CU1 สำหรับ SET หรือ D0099_CU1 สำหรับ TFEX): _____ ซึ่งพัฒนาโดยผู้พัฒนาระบบ: _____

<p>การกำกับดูแลการซื้อขายหลักทรัพย์ [เฉพาะ SET]</p>	<p><input type="checkbox"/> บริษัท มีการกำกับดูแลการซื้อขายหลักทรัพย์ ดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. มีการตรวจสอบคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ก่อนที่จะส่งเข้ามายังระบบการซื้อขาย อย่างน้อยในเรื่องต่อไปนี้ <ol style="list-style-type: none"> 1.1. การตรวจสอบวงเงินซื้อขาย (Credit / Exposure Limit) 1.2. การควบคุมมูลค่าเสนอซื้อขายสูงสุดต่อ 1 คำสั่ง (Maximum Value Per Order) 1.3. การควบคุมปริมาณหุ้นที่เสนอซื้อขายสูงสุดต่อ 1 คำสั่ง (Maximum Volume Per Order) 1.4. การตรวจสอบราคาเสนอซื้อขาย (Order Price Check) 1.5. การควบคุมด้านราคาให้อยู่ภายในกรอบราคาซื้อขายสูงสุดและต่ำสุดประจำวัน (Ceiling and Floor) (กรณีมีระบบตรวจสอบ บริษัทมีอำนาจควบคุมและบริหารจัดการระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายดังกล่าว) 2. มีระบบ/ฟังก์ชันที่สามารถหยุดการส่งคำสั่งซื้อขายใหม่ และยกเลิกคำสั่งซื้อขายที่ส่งเข้ามาแล้วได้ทันทีในกรณีจำเป็น (Kill switch) 3. มีการบริหารจัดการ หรือระบบอื่นใดในการตรวจสอบการส่งคำสั่งซื้อขายก่อนเข้ามายังระบบการซื้อขาย ให้เป็นไปตามที่ตลาดหลักทรัพย์หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด เช่น <ol style="list-style-type: none"> 3.1 การป้องกันการส่งคำสั่งในลักษณะจับคู่กันเอง (Wash Sale) 3.2 การป้องกันการส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ โดยที่ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นในครอบครอง (Naked Short Selling) * ข้อ 1-3 รายละเอียดตามแบบฟอร์ม MO-Compliance1 4. มีการแจ้งให้ลูกค้าของบริษัททราบว่า มิให้ใช้ Program Trading / Algorithmic Trading ก่อนได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ 	
<p>Security</p>	<p><input type="checkbox"/> การขออนุญาตดังกล่าว<u>กระทบ</u>ต่อความปลอดภัยของระบบ (Security) ** สมาชิกต้องนำส่งแบบฟอร์ม MO-SECURITY1</p>	<p><input type="checkbox"/> การขออนุญาตดังกล่าว<u>ไม่กระทบ</u>ต่อความปลอดภัยของระบบ (Security)</p>

พร้อมกันนี้บริษัทได้แนบข้อมูลประกอบการพิจารณา ดังนี้

	รายละเอียด	แนบมาด้วยพร้อมแบบคำขอ	หมายเหตุ
เอกสารประกอบการขออนุญาตต่อเชื่อมทุกกรณี			
1	รายละเอียดของ Hardware และ Software Description	<input type="checkbox"/>	_____
2	รายละเอียดของ System และ Network Diagram	<input type="checkbox"/>	_____
3	รายละเอียดของ Software Specification (System Process Flow, Functional Specification ของระบบ และ Program Description)	<input type="checkbox"/>	_____
4	แบบประเมินการทำงานและการรักษาความปลอดภัยของระบบ (แบบฟอร์ม MO-SECURITY1)	<input type="checkbox"/>	_____
5	คู่มือการใช้งานของระบบ	<input type="checkbox"/>	_____
6	รายละเอียดการทดสอบ และผลการทดสอบ (Test Cases, Test Scripts and Test Results) พร้อมทั้งรายชื่อผู้รับผิดชอบการทดสอบ	<input type="checkbox"/>	_____
7	แบบรับรองชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์จากผู้พัฒนาระบบ/ผู้ให้บริการระบบภายนอก (แบบฟอร์ม MO-ISV1)	<input type="checkbox"/>	_____
8	แบบแจ้งข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายผ่านระบบ Direct Market Access (แบบฟอร์ม MO-DMA1) *เอกสารเพิ่มเติม สำหรับการขออนุญาตใช้งาน DMA	<input type="checkbox"/>	_____
9	แบบคำขออนุญาตซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์โดยอัตโนมัติ (Program Trading / Algorithmic Trading)	<input type="checkbox"/>	_____

	รายละเอียด	แนบมาด้วยพร้อมแบบคำขอ	หมายเหตุ
	*เอกสารเพิ่มเติม สำหรับการขออนุญาตใช้งาน Program Trading / Algorithmic Trading		
10	หนังสือรับรองคุณสมบัติจากผู้พัฒนาระบบหรือผู้ให้บริการระบบภายนอกของบริษัท (กรณียื่นขอใช้งานระบบเป็นครั้งแรก)	<input type="checkbox"/>	_____
11	แบบแจ้งรายละเอียดการกำกับดูแลการซื้อขายหลักทรัพย์และ/หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าผ่านระบบของสมาชิก (แบบฟอร์ม MO-Compliance1) *ไม่ต้องนำเสนอแบบฟอร์มกรณีขอเปลี่ยน Network Architecture, เปลี่ยนสถานที่ตั้งของเครื่องคอมพิวเตอร์ (Server) และเปลี่ยน hardware /อุปกรณ์ network	<input type="checkbox"/>	_____

บริษัทฯ ขอรับรองว่าระบบคอมพิวเตอร์ของบริษัทฯ ที่ต่อเชื่อมกับระบบการซื้อขายของตลาดหลักทรัพย์ และ / หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ข้างต้น มีระบบการทำงานที่ไม่ขัดและถูกต้องตามข้อกำหนดตลาดหลักทรัพย์ และ / หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และจะไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขายของตลาดหลักทรัพย์ และ / หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยบริษัทฯ ยินดีนำเสนอข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย หรือการทำธุรกรรมการซื้อขายของบริษัทฯ และลูกค้า หรือเอกสารอื่นใดที่ตลาดหลักทรัพย์ และ / หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าร้องขอให้แก่ตลาดหลักทรัพย์และ / หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ทั้งนี้ หากปรากฏในภายหลังว่า คำรับรองของบริษัทฯ ข้างต้น ไม่ถูกต้องครบถ้วน และ/หรือ มีความเสียหายใดๆ เกิดขึ้นต่อตลาดหลักทรัพย์และ / หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอันเนื่องมาจากการเชื่อมต่อระบบคอมพิวเตอร์ของบริษัทฯ บริษัทฯ ตกลงและยินยอมที่จะรับผิดชอบในความเสียหายทั้งหมดที่เกิดขึ้นต่อตลาดหลักทรัพย์ และ / หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในทุกกรณี

ประทับตราบริษัท

(_____)
ตำแหน่ง _____

ผู้มีอำนาจลงนามผูกพันแทนบริษัท

(_____)
ตำแหน่ง _____

ผู้มีอำนาจลงนามผูกพันแทนบริษัท

ชื่อผู้ประสานงาน _____

ฝ่าย / หน่วยงาน _____

โทรศัพท์ _____

E-mail _____