

แบบคำขออนุญาตซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading/Algorithmic Trading)

วันที่ _____

เรียน กรรมการและผู้จัดการ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“ตลาดหลักทรัพย์”) และ/หรือ

กรรมการผู้จัดการ

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

ข้าพเจ้า บริษัท _____ (“บริษัทฯ”) ซึ่งเป็นสมาชิกหมายเลข

_____ มีความประสงค์จะส่งคำสั่งซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (“ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์”) โดย

- ขออนุญาตใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์
- แบบรายกลยุทธ์ (Strategy)
 - แบบทั่วไป (ใช้ได้หลายกลยุทธ์ ภายใต้ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายเดียวกัน)
 - เพิ่มกลยุทธ์ (Strategy) ภายใต้ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายแบบทั่วไป ที่ได้รับอนุญาตแล้วตามหนังสืออนุญาตเลขที่ _____
โดยแนบเอกสาร ดังนี้
 - ระบบหรือการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (ตามเอกสารแนบ FORM B)
 - หลักการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ (ตามเอกสารแนบ FORM C)
 - คู่มือการใช้งานระบบ (User Manual)
 - รายละเอียดการใช้งานระบบหรือการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์อื่น (ถ้ามี)
- ขออนุญาตเปลี่ยนแปลงชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์
- หลักการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ ที่ได้รับอนุญาตแล้ว(ตามเอกสารแนบ FORM C) _____
 - ช่องทางการต่อเชื่อมชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ (Acting user) เดิม _____ ใหม่ _____
 - ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย ที่ได้รับอนุญาตแล้วตามหนังสืออนุญาตเลขที่ _____ สำหรับกลยุทธ์ (ตามเอกสารแนบ FORM C)
โดยแนบเอกสารในส่วนที่มีการเพิ่มเติมหรือเปลี่ยนแปลง ดังนี้
 - ระบบหรือการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (ตามเอกสารแนบ FORM B)
 - หลักการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ (ตามเอกสารแนบ FORM C)
 - คู่มือการใช้งานระบบ (User Manual)
 - รายละเอียดการใช้งานระบบหรือการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์อื่น (ถ้ามี)
- ขอยกเลิกการใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ (ตามเอกสารแนบ FORM C)
- แบบรายกลยุทธ์ (Strategy) ที่เคยได้รับอนุญาตแล้ว
 - แบบทั่วไป และ ทุกประเภทกลยุทธ์ (Strategy) ภายใต้ระบบบริหารความเสี่ยงที่เคยได้รับอนุญาตแล้ว ตามหนังสืออนุญาตเลขที่ _____
 - ยกเลิกบางกลยุทธ์ (Strategy) ภายใต้ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายแบบทั่วไป ที่ได้รับอนุญาตแล้วตามหนังสืออนุญาตเลขที่ _____
- อื่นๆ _____

โดยเป็นการส่งคำสั่งของ

- บริษัทฯ เพื่อ (บัญชีบริษัท, ลูกค้ำ หรือ ทำหน้าที่ดูแลสภาพคล่อง)
- ลูกค้ำที่ซื้อขายผ่าน DMA (โปรดระบุชื่อ และเลขที่บัญชีลูกค้ำ หรือทำหน้าที่ดูแลสภาพคล่อง)
- ลูกค้ำประเภท Internet Trading ได้แก่ (ลูกค้ำทั่วไป หรือเฉพาะราย:โปรดระบุชื่อลูกค้ำ)

บริษัท ขอรับรองว่า การส่งคำสั่งซื้อขายด้วยชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ดังกล่าว มีระบบการทำงานที่ไม่ขัดและถูกต้องครบถ้วนตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย และจะไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขายตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ทั้งนี้ หากปรากฏในภายหลังว่า คำรับรองของบริษัท ข้างต้นไม่ถูกต้องครบถ้วน หรือการส่งคำสั่งซื้อขายด้วยชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ข้างต้นก่อให้เกิดความเสียหายใดๆ ต่อตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า บริษัทฯ ตกลงและยินยอมที่จะรับผิดชอบในความเสียหายทั้งหมดที่เกิดขึ้นต่อตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในทุกกรณี

ประทับตราบริษัท

ตำแหน่ง

(_____)

ผู้มีอำนาจลงนามแทนบริษัท

ชื่อผู้ประสานงาน _____

โทรศัพท์ _____

E-mail _____

คำอธิบาย

ระบบหรือการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย

ข้าพเจ้า บริษัท _____ (บริษัทฯ) ซึ่งเป็นสมาชิกหมายเลข _____ ขอแจ้งรายละเอียดเกี่ยวกับระบบหรือการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์) รายละเอียดดังนี้

การบริหารความเสี่ยงทั่วไป

- มีการตรวจสอบคำสั่งให้เป็นไปตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เช่น ชื่อหลักทรัพย์ ชื่อสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ประเภทของคำสั่ง ราคา ปริมาณ และช่วงราคา เป็นต้น
- มีกระบวนการควบคุมดูแลการกำหนดหรือแก้ไขหลักการทำงานของระบบและตัวแปร (Parameter) ทั้งของลูกค้าและเจ้าหน้าที่ของบริษัทฯ รวมทั้งมีการบันทึกและจัดเก็บรายละเอียด เพื่อรองรับการตรวจสอบดังนี้ (ขอให้อธิบายรายละเอียดให้ชัดเจน)
- _____
- มีการทบทวนหลักการทำงานของระบบและ Parameter ของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ อย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง
- มีการจัดเก็บข้อมูลการส่งคำสั่ง (Transaction Log) เพื่อรองรับการตรวจสอบ
- มีการให้ความรู้แก่ผู้ที่ใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ การแก้ไขปัญหากรณีเกิดข้อผิดพลาดในการใช้งาน และข้อกำหนดต่าง ๆ ของตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างสม่ำเสมอ
- มีกระบวนการคัดกรองลูกค้าที่ใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ รวมทั้งตรวจสอบความเสี่ยงรายลูกค้า เช่น
- มีการกำหนดวงเงิน ปริมาณและมูลค่าการซื้อขายของลูกค้าในแต่ละวัน
 - มีการจัดการเพื่อให้ลูกค้ารับทราบ และยอมรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์
- มีระบบตรวจสอบและป้องกันความผิดพลาดในการส่งคำสั่งของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ เช่น
- มีระบบป้องกันความผิดพลาดของลูกค้าหรือหลักการทำงานของระบบ เช่นการตรวจสอบ Fat finger order (ขอให้อธิบาย)
- _____
- มีระบบป้องกันการส่งคำสั่งซ้ำเข้ามาในระบบในปริมาณมาก (Duplicated order) เพื่อลดความเสียหายที่อาจเกิดขึ้น เช่น มีระบบเตือน, มีฟังก์ชันเพื่อหยุดการส่งคำสั่งโดยอัตโนมัติเพื่อตรวจสอบ, มีการกำหนดจำนวน Order/second ให้ต่ำกว่า Throttling Limits เป็นต้น (ขอให้อธิบาย)
- _____
- มีการจัดการกรณีเกิดปัญหาการใช้งานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ โดย
- มีการ Monitor และมีระบบ Alert แจ้งเตือนเมื่อเกิดปัญหา
หน่วยงานที่รับผิดชอบ _____
โดยมีขั้นตอนการดำเนินการดังนี้ (ขอให้อธิบาย) _____
 - มีฟังก์ชันที่สามารถหยุดการส่งคำสั่ง และยกเลิกคำสั่งที่ถูกส่งโดยชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ทั้งหมดในทันที เช่น Kill Switches
หน่วยงานที่รับผิดชอบ _____
โดยมีขั้นตอนการดำเนินการดังนี้ (ขอให้อธิบาย) _____
 - มีการจัดทำคู่มือที่ระบุถึงวิธีการแก้ไขปัญหา รวมทั้งอำนาจและขั้นตอนการดำเนินงานกรณีเกิดปัญหาการใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์
- การบริหารความเสี่ยงอื่นๆ _____
- _____

การบริหารความเสี่ยงเกี่ยวกับการส่งคำสั่งที่อาจส่งผลกระทบต่อสภาพการซื้อขาย

- กลุ่มหลักทรัพย์และ/หรือกลุ่มสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อนุญาตให้ซื้อขาย (รายละเอียดตามเอกสารแนบ MO-Compliance1)
- มีระบบคัดกรองคำสั่งซื้อขาย หรือ การบริหารจัดการใดๆ เพื่อป้องกันมิให้เกิดการส่งคำสั่งที่อาจส่งผลกระทบต่อสภาพการซื้อขาย และอาจเข้าข่ายความผิดตามกฎหมายหรือข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ (รายละเอียดตามเอกสารแนบ MO-Compliance1)
 - การควบคุมด้านราคา(Maximum %Change จากราคาอ้างอิง)
 - การควบคุมด้านมูลค่า (Maximum Value per order) (SET) / ด้านปริมาณ (Maximum Volume per order) (TFEX)
 - การป้องกันมิให้เกิดการซื้อขายอย่างต่อเนื่องในหลายระดับราคา (The continuity of the orders prevention)
 - การป้องกันการส่งคำสั่งในลักษณะจับคู่กันเอง (Wash Sale)
 - การป้องกันการส่งคำสั่งขายหลักทรัพย์ โดยที่ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นในครอบครอง (Naked Short Selling) – เฉพาะ SET
 - อื่นๆ เช่น การป้องกันการซื้อขายในลักษณะใส่ถอน หรือ พุ่งราคา เช่น แดกย้อยคำสั่งเพื่อพุ่งราคา เป็นต้น

โดยระบบ ดังกล่าวข้างต้นต้องเป็นการควบคุมในระดับลูกค้าซึ่งหมายถึง ให้รวมทุกประเภทบัญชีของลูกค้ารายเดียวกัน

ทั้งนี้บริษัทฯ ขอรับรองว่าข้อมูลดังกล่าวข้างต้นถูกต้องตรงตามความเป็นจริง

ประทับตราบริษัทฯ

ตำแหน่ง

(_____)

ผู้มีอำนาจลงนามแทนบริษัทฯ

หลักการดำเนินงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ

ข้าพเจ้า บริษัท _____ (บริษัท) ซึ่งเป็นสมาชิกหมายเลข _____

ขอแจ้งหลักการดำเนินงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ รายละเอียดดังนี้

- ขออนุญาตใช้ / ขอเพิ่ม / เปลี่ยนแปลงหลักการดำเนินงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายอัตโนมัติ

ชื่อกลยุทธ์ (Strategy name) _____

โดยกลยุทธ์ที่ยื่นขออนุญาตเป็นกลยุทธ์ประเภท

- กลยุทธ์พื้นฐาน
 กลยุทธ์อื่นๆ

กลยุทธ์พัฒนาโดย ...(ระบุชื่อลูกค้า/บริษัทสมาชิก หรือบริษัทที่พัฒนากลยุทธ์)..... (เฉพาะ SET)

วัตถุประสงค์ _____

- ได้รับการอนุญาตใช้งานในตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอื่น กรุณาระบุ _____

ตัวอย่างการทำงาน (ขอให้อธิบายโดยละเอียด เช่น ภาพประกอบ กราฟ หรือตัวเลข)

โดยกลยุทธ์พื้นฐาน หมายถึง กลยุทธ์ที่มีการจัดการคำสั่งซื้อขายที่ไม่ก่อให้เกิดผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์ และ ภาวะการซื้อขาย เช่น

1. การซื้อขายที่ราคาเฉลี่ย เช่น VWAP (Volume Weighted Average Price) TWAP (Time Weighted Average Price)
2. การซื้อขายเพื่อให้ได้ปริมาณที่สอดคล้องกับปริมาณซื้อขายในตลาด/ ราคาอ้างอิง เช่น Volume inline/ Percentage of volume/ Price Inline / Implementation Shortfall
3. การซื้อหรือขายในปริมาณมาก โดยเป็นการทยอยส่งคำสั่งให้สอดคล้องกับการเคลื่อนไหวของราคาหุ้น และไม่เกิดผลกระทบต่อสภาพการซื้อขาย เช่น Iceberg, Float
4. การซื้อหรือขายเพื่อให้ได้ราคาปิด หรือ ใกล้เคียงราคาปิด ในช่วงใกล้ปิดตลาดหรือช่วง Call Market

กลยุทธ์อื่น หมายถึง กลยุทธ์อื่นที่นอกเหนือไปจากกลยุทธ์พื้นฐานข้างต้น

ขอยกเลิกหลักการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายอัตโนมัติ

ลำดับ	ชื่อกลยุทธ์ (Strategy name)	กลยุทธ์พัฒนาโดย (ระบบชื่อลูกค้า/บริษัท สมาชิก หรือบริษัทที่พัฒนากลยุทธ์) (เฉพาะ SET)	ประเภทกลยุทธ์ (Strategy type)	ตัวอย่างการทำงาน (Example of functionality)

ทั้งนี้บริษัทฯ ขอรับรองว่าข้อมูลดังกล่าวข้างต้นถูกต้องตรงตามความเป็นจริง

ประทับตราบริษัทฯ

ตำแหน่ง

(_____)

ผู้มีอำนาจลงนามแทนบริษัท