

**ประกาศชมรมผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
ที่ FIC. 1/2569**

เรื่อง มาตรการอันเกิดจากการเปิดเผยข้อมูลลูกค้าที่มีพฤติกรรมส่งคำสั่งไม่เหมาะสม

เพื่อเป็นการยกระดับการกำกับดูแลและเพิ่มความเชื่อมั่นให้กับผู้ลงทุน และเพื่อให้บริษัทสมาชิกมีมาตรฐานการปฏิบัติงานกรณีที่ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเทศไทยเปิดเผยข้อมูลของลูกค้าที่มีพฤติกรรมส่งคำสั่งไม่เหมาะสมให้เป็นไปในทิศทางเดียวกัน

โดยอาศัยอำนาจตามข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หมวด 400 การซื้อขาย หลักเกณฑ์ 410.02 การกำกับดูแลการซื้อขาย โดยความเห็นชอบจากบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ชมรมผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจึงกำหนดมาตรการอันเกิดจากการเปิดเผยข้อมูลลูกค้าที่มีพฤติกรรมส่งคำสั่งไม่เหมาะสม เพื่อให้สมาชิกชมรมถือปฏิบัติ ดังนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“สำนักงาน ก.ล.ต.” หมายความว่า สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

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

“ชมรม” หมายความว่า ชมรมผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“สมาชิก” หมายความว่า บริษัทสมาชิกชมรมผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ โดยปฏิบัติงานในฐานะตัวแทนในการซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives Broker)

“ลูกค้า” หมายความว่า ลูกค้าที่ใช้บริการของสมาชิก

“สัญญาซื้อขายล่วงหน้า” หมายความว่า สัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546

“วงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเดิม” หมายความว่า วงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าล่าสุดก่อนที่ลูกค้าจะถูกเปิดเผยรายชื่อให้ดำเนินการตามมาตรการปรับลดวงเงินครั้งแรก

“Algorithmic Trading” หมายความว่า การซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

ข้อ 2 กรณีเป็นการซื้อขายทั่วไปที่ไม่ใช่เป็นการซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Algorithmic Trading) หากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเปิดเผยรายชื่อบุคคลที่มีพฤติกรรมการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีลักษณะไม่เหมาะสมผ่านช่องทางหรือระบบงานที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด ให้สมาชิกดำเนินการตรวจสอบรายชื่อดังกล่าวหากพบว่ามีกรณีเปิดบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับสมาชิก ให้สมาชิกดำเนินการตามมาตรการที่กำหนดไว้ดังนี้

2.1 กรณีเป็นการเปิดเผยรายชื่อบุคคลดังกล่าวเป็นครั้งแรกในรอบ 6 เดือนที่ผ่านมา ให้สมาชิกปรับลดวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าในทุกบัญชีของลูกค้ารายนั้นอย่างน้อยร้อยละ 20 ของวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเดิมเป็นระยะเวลา 1 เดือน และให้สมาชิกมีการทำความเข้าใจกับลูกค้ารายนั้นเกี่ยวกับพฤติกรรมการซื้อขายที่เป็นคำสั่งที่ไม่เหมาะสมตามเกณฑ์ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด เพื่อไม่ให้มีการส่งคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสมอีก

2.2 กรณีการเปิดเผยชื่อลูกค้ารายดังกล่าวเป็นครั้งที่สองในรอบ 6 เดือนนับจากครั้งล่าสุด ให้สมาชิกปรับลดวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าในทุกบัญชีของลูกค้ารายนั้นอย่างน้อยร้อยละ 60 ของวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเดิมและระงับการให้บริการส่งคำสั่งซื้อขายผ่านระบบออนไลน์ของลูกค้ารายดังกล่าวในทุกบัญชีเป็นระยะเวลา 1 เดือน

2.3 กรณีการเปิดเผยชื่อลูกค้ารายดังกล่าวเป็นครั้งที่สามในรอบ 6 เดือนนับจากครั้งล่าสุด ให้สมาชิกปรับลดวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าในทุกบัญชีของลูกค้ารายนั้นอย่างน้อยร้อยละ 80 ของวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเดิมและระงับการให้บริการส่งคำสั่งซื้อขายผ่านระบบออนไลน์ของลูกค้ารายดังกล่าวในทุกบัญชีเป็นระยะเวลา 1 เดือน

2.4 กรณีการเปิดเผยชื่อลูกค้ารายดังกล่าวตั้งแต่ครั้งที่สี่เป็นต้นไปในรอบ 6 เดือนนับจากครั้งล่าสุด ห้ามมิให้สมาชิกเปิดสถานะเพิ่ม ให้กับลูกค้าในทุกบัญชีของลูกค้ารายนั้น และระงับการให้บริการส่งคำสั่งซื้อขายผ่านระบบออนไลน์ของลูกค้ารายดังกล่าวในทุกบัญชีเป็นระยะเวลา 1 เดือน

ข้อ 3 กรณีเป็นการซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Algorithmic Trading) ที่มีพฤติกรรมการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีลักษณะไม่เหมาะสมและตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเปิดเผยรายชื่อผ่านทางหรือระบบงานที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด ให้สมาชิกดำเนินการตรวจสอบรายชื่อลูกค้าดังกล่าว หากพบว่ามีกรณีเปิดบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับสมาชิก ให้สมาชิกดำเนินการตามมาตรการที่กำหนดไว้ดังนี้

3.1 กรณีเป็นการเปิดเผยรายชื่อลูกค้าดังกล่าวเป็นครั้งแรกในรอบ 6 เดือนที่ผ่านมา ให้สมาชิกปรับลดวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าในทุกบัญชีของลูกค้ารายนั้นอย่างน้อยร้อยละ 20 ของวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเดิมเป็นระยะเวลา 1 เดือน และให้ลูกค้ารายดังกล่าวทบทวน Algorithmic Trading ดังกล่าว เพื่อไม่ให้มีการส่งคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสม

3.2 กรณีการเปิดเผยชื่อลูกค้ารายดังกล่าวเป็นครั้งที่สองในรอบ 6 เดือนนับจากครั้งล่าสุด ให้สมาชิกปรับลดวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าในทุกบัญชีของลูกค้ารายนั้นอย่างน้อยร้อยละ 60 ของวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเดิมเป็นระยะเวลา 1 เดือน และให้ลูกค้ารายดังกล่าวปรับปรุงแก้ไขชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ดังกล่าว เพื่อไม่ให้มีการส่งคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสม รวมถึงแยกบัญชีซื้อขาย Algorithmic Trading ที่ส่งคำสั่งซื้อขายไม่เหมาะสมออกมาต่างหากเฉพาะในกรณีที่ Algorithmic Trading ดังกล่ารวมอยู่กับ Algorithmic Trading อื่นในบัญชีเดียวกัน หากไม่สามารถแยกบัญชีได้ ห้ามมิให้สมาชิกเปิดสถานะเพิ่มเป็นระยะเวลา 1 เดือนด้วย ให้กับลูกค้าในทุกบัญชีของลูกค้ารายนั้น

3.3 กรณีการเปิดเผยชื่อลูกค้ารายดังกล่าวเป็นครั้งที่สามในรอบ 6 เดือนนับจากครั้งล่าสุด ให้สมาชิกปรับลดวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าในทุกบัญชีของลูกค้ารายนั้นอย่างน้อยร้อยละ 80 ของวงเงินที่ได้รับอนุมัติเพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเดิมเป็นระยะเวลา 1 เดือน และห้ามมิให้สมาชิกเปิดสถานะเพิ่มเป็นระยะเวลา 1 เดือนด้วย ให้กับลูกค้าในทุกบัญชีของลูกค้ารายนั้น

3.4 กรณีการเปิดเผยชื่อลูกค้ารายดังกล่าวตั้งแต่ครั้งที่สี่เป็นต้นไปในรอบ 6 เดือนนับจากครั้งล่าสุด ให้สมาชิกยกเลิกการใช้ Algorithmic Trading นั้นในทันที

ข้อ 4 การดำเนินการให้เป็นไปตามข้อ 2 และข้อ 3 ให้ดำเนินการและมีผลก่อนตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเปิดทำการซื้อขายในวันทำการถัดจากวันที่ชื่อของลูกค้าถูกเปิดเผยในระบบหรือช่องทางที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดเป็นต้นไป

ข้อ 5 ห้ามมิให้สมาชิกเพิ่มวงเงินในทุกบัญชีให้กับลูกค้าของตนที่ถูกเปิดเผยรายชื่อภายในระยะเวลา 6 เดือนนับจากวันเริ่มต้นที่สมาชิกต้องดำเนินการตามมาตรการครั้งล่าสุด

ข้อ 6 ก่อนการอนุมัติให้มีการเปิดบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า สมาชิกต้องดำเนินการตรวจสอบรายชื่อที่ถูกเปิดเผย หากพบว่าลูกค้ารายดังกล่าวถูกเปิดเผยชื่อและต้องดำเนินการตามมาตรการที่กำหนดตามประกาศนี้ ให้สมาชิกดำเนินการตามมาตรการตามข้อ 2 หรือข้อ 3 ตามระยะเวลาเท่าที่เหลือ

ข้อ 7 การนับจำนวนครั้งของการเปิดเผยรายชื่อลูกค้าในระยะเวลา 6 เดือน ตามข้อ 2 และข้อ 3 ไม่ว่าลูกค้าซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยใช้หรือไม่ใช้ Algorithmic Trading ก็ตาม จะนับการเปิดเผยรายชื่อลูกค้าต่อเนื่องกัน

ข้อ 8 ให้บรรดาประกาศ แนวทางการปฏิบัติงาน คำสั่ง และหนังสือเวียน ที่ชมรมออกหรือวางแนวปฏิบัติ ซึ่งใช้บังคับอยู่ก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ ยังคงใช้บังคับได้ต่อไปเท่าที่ไม่ขัดหรือแย้งกับข้อกำหนดแห่งประกาศนี้

ประกาศนี้มีผลบังคับตั้งแต่วันที่ 20 เมษายน 2569 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 2 เมษายน 2569



(นายเนคตล นิมมานพิภักดิ์)

ประธานกรรมการ

ชมรมผู้ประกอบการสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย