

สารบัญ

ข้อบังคับ

หมวด 700 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย

| | หน้า |
|--|-------|
| 701 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย..... | 700-1 |
| 702 คุณสมบัติของเจ้าหน้าที่รับอนุญาต..... | 700-1 |
| 703 การขอแต่งตั้งเจ้าหน้าที่รับอนุญาต..... | 700-2 |
| 704 การขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต..... | 700-2 |
| 704.01 การพิจารณาการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต..... | 700-2 |
| 704.02 การเก็บรักษาหมายเลขประจำตัวเจ้าหน้าที่รับอนุญาต ชื่อผู้ใช้และ รหัสผ่าน (user name and password)..... | 700-2 |
| 704.03 ค่าธรรมเนียมที่เกี่ยวข้องกับเจ้าหน้าที่รับอนุญาต..... | 700-2 |
| 705 หน้าที่ของเจ้าหน้าที่รับอนุญาต..... | 700-3 |
| 706 การเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต..... | 700-3 |
| 707 การลงโทษเจ้าหน้าที่รับอนุญาต..... | 700-4 |
| 708 การสมัครเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง | 700-5 |
| 709 คุณสมบัติของผู้ดูแลสภาพคล่อง..... | 700-5 |
| 710 หน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง..... | 700-6 |
| 710.01 การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง | 700-6 |
| 710.02 ประเภทการดูแลสภาพคล่อง..... | 700-6 |
| 710.03 จำนวนการเสนอซื้อและเสนอขายขั้นต่ำ (Minimum Quantity)..... | 700-6 |
| 710.04 ส่วนต่างระหว่างราคาเสนอซื้อและเสนอขาย (Maximum Spreads) | 700-6 |
| 711 หน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานอย่างต่อเนื่อง (Making a Market on Continuous Basis) | 700-6 |

| | | |
|------------|---|---------------|
| 711.01 | การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง | 700-6 |
| 711.02 | การปฏิบัติหน้าที่เมื่อการเสนอซื้อขายถูกจับคู่..... | 700-6 |
| 712 | หน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานเมื่อมีการร้องขอ | |
| | (Making a Market in Response to Quote Requests) | 700-7 |
| 712.01 | การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง..... | 700-7 |
| 712.02 | การเสนอซื้อและเสนอขายเมื่อมีการร้องขอ | 700-7 |
| 712.03 | การปฏิบัติหน้าที่เมื่อการเสนอซื้อขายถูกจับคู่..... | 700-7 |
| 713 | การแก้ไขหรือเปลี่ยนแปลงสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีการดูแลสภาพคล่อง | 700-7 |
| 714 | การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่อง..... | 700-8 |
| 714.01 | การซื้อขายด้วยระบบการซื้อขาย..... | 700-8 |
| 714.02 | การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องที่เป็นสมาชิก | 700-8 |
| 714.03 | การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องที่เป็นนิติบุคคลอื่นนอกจากสมาชิก. | 700-8 |
| 715 | การหยุดการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องชั่วคราว..... | 700-8 |
| 715.01 | การสั่งหรืออนุญาตให้หยุดการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง ชั่วคราว..... | 700-8 |
| 715.02 | การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องภายหลังหยุดการปฏิบัติหน้าที่ ชั่วคราว..... | 700-9 |
| 716 | การสิ้นสุดการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง | 700-9 |
| 717 | การยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง..... | 700-9 |
| 718 | การขอยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง..... | 700-9 |
| 719 | การสมัครเป็นผู้เสริมสร้างความสมดุล..... | 700-10 |
| 720 | คุณสมบัติของผู้เสริมสร้างความสมดุล | 700-10 |
| 721 | หน้าที่ของผู้เสริมสร้างความสมดุล | 700-10 |
| 722 | การปฏิบัติงานของผู้เสริมสร้างความสมดุล | 700-11 |
| 723 | การหยุดการปฏิบัติหน้าที่ การสิ้นสุด และการยกเลิก การเป็นผู้เสริมสร้างความสมดุล | 700-11 |
| 724 | การเปิดเผยการลงโทษบุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย..... | 700-11 |

ข้อบังคับ หมวด 700 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย

*701 บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย

บุคคลที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจอนุญาตให้บันทึกการเสนอซื้อขายหรือการซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขาย ได้แก่

- (1) เจ้าหน้าที่รับอนุญาต
- (2) ผู้ดูแลสภาพคล่อง
- (3) ผู้เสริมสร้างความสมดุล
- (4) บุคคลอื่นใดตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

(*ยกเลิกความในหลักเกณฑ์ 701 โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 23 สิงหาคม 2560 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 4 กันยายน 2560 เป็นต้นไป)

*702 คุณสมบัติของเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

บุคคลที่สมาชิกจะขอแต่งตั้งให้เป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต ต้องมีและดำรงคุณสมบัติ ดังต่อไปนี้

- (1) เป็นผู้บรรลุนิติภาวะ
- (2) ไม่อยู่ระหว่างถูกสั่งพักการปฏิบัติงาน หรือไม่เคยถูกเพิกถอนใบอนุญาตหรือการขึ้นทะเบียนเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตภายในรอบระยะเวลา 5 ปีก่อนการขอแต่งตั้งเพราะการลงโทษของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลาดหลักทรัพย์ หรือหน่วยงานที่ทำหน้าที่กำกับดูแลอื่นที่เกี่ยวข้อง

** (3) เป็นพนักงานหรือลูกจ้างที่ปฏิบัติหน้าที่เต็มเวลาของบุคคลใดบุคคลหนึ่งดังต่อไปนี้

- (3.1) สมาชิกที่ขอแต่งตั้งเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต
- (3.2) บริษัทในกลุ่มเดียวกันกับสมาชิกที่ขอแต่งตั้งเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต และมี

สัญญายินยอมให้พนักงานนั้นมาปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าวให้แก่สมาชิก

- (3.3) ตัวแทนสนับสนุนการขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Selling Agent)

ที่ทำสัญญาเป็นตัวแทนสนับสนุนการขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับสมาชิกที่ขอแต่งตั้งเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

- (4) มีคุณสมบัติทางการศึกษาหรือมีประสบการณ์ดังนี้

- (ก) จบการศึกษาระดับปริญญาตรีขึ้นไปหรือเทียบเท่าจากสถานศึกษาที่หน่วยงาน

ราชการให้การรับรองหรือเป็นพนักงานหรือเจ้าหน้าที่ที่ปฏิบัติงานในธุรกิจหลักทรัพย์หรือธุรกิจที่เกี่ยวข้องไม่น้อยกว่า 3 ปีติดต่อกัน และ

- (ข) ผ่านการอบรมหรือการทดสอบตามหลักสูตรของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

หรือหลักสูตรอื่นที่ได้รับความเห็นชอบจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(5) ไม่เป็นบุคคลที่มีลักษณะต้องห้ามของบุคลากรในธุรกิจตลาดทุนตามที่ประกาศ
คณะกรรมการกำกับตลาดทุนกำหนด

(*ยกเลิกความในหลักเกณฑ์ 702 โดยวิธีปฏิบัติบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด
(มหาชน) ลงวันที่ 18 เมษายน 2557 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2557 เป็นต้นไป)

(*ความใน (3) ของหลักเกณฑ์ 702 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับของ
ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 31 มกราคม 2566 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 8
พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป)

703 การขอแต่งตั้งเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

ในการขอแต่งตั้งบุคคลใดเพื่อเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตให้สมาชิกเสนอชื่อบุคคลซึ่งมีคุณสมบัติ
ครบถ้วนตามหลักเกณฑ์ 702 และยื่นคำขอพร้อมรายละเอียดตามแบบที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
กำหนด

704 การขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

704.01 การพิจารณาการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

เมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้ตรวจสอบหลักฐานเกี่ยวกับคุณสมบัติของบุคคลที่สมาชิก
ขอแต่งตั้งเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตและเห็นว่าบุคคลดังกล่าวมีคุณสมบัติครบถ้วนแล้ว ตลาดสัญญา
ซื้อขายล่วงหน้าจะรับคำขอไว้พิจารณาและจะแจ้งผลการพิจารณาขึ้นทะเบียนบุคคลดังกล่าวเป็น
เจ้าหน้าที่รับอนุญาตของสมาชิคนั้นและกำหนดหมายเลขประจำตัวเจ้าหน้าที่รับอนุญาตสำหรับบุคคล
นั้น โดยจะนำส่งแก่สมาชิกผู้เสนอขอแต่งตั้งภายใน 60 วันทำการนับจากวันที่ได้รับเอกสารและหลักฐาน
ครบถ้วน

เมื่อบุคคลใดได้ขึ้นทะเบียนเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตของสมาชิกใดและได้รับหมายเลขประจำตัว
เจ้าหน้าที่รับอนุญาตตามการเสนอขอแต่งตั้งของสมาชิคนั้นแล้ว ให้ปฏิบัติงานการซื้อขายด้วยระบบการ
ซื้อขายในนามของสมาชิกที่ขอแต่งตั้งนั้น

704.02 การเก็บรักษาหมายเลขประจำตัวเจ้าหน้าที่รับอนุญาต ชื่อผู้ใช้และรหัสผ่าน (User name and Password)

ให้สมาชิกและเจ้าหน้าที่รับอนุญาตเก็บรักษาหมายเลขประจำตัวเจ้าหน้าที่รับอนุญาต ชื่อผู้ใช้
และรหัสผ่าน (User name and Password) ตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

704.03 ค่าธรรมเนียมที่เกี่ยวข้องกับเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

ให้ค่าธรรมเนียมต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้องกับเจ้าหน้าที่รับอนุญาตเป็นไปตามที่ตลาดสัญญาซื้อขาย
ล่วงหน้ากำหนด

705 หน้าที่ของเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

เจ้าหน้าที่รับอนุญาต มีหน้าที่ดังต่อไปนี้

(1) ปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ข้อกำหนด หนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยมีหน้าที่เช่นเดียวกับที่สมาชิกมีหน้าที่ต้องปฏิบัติในเรื่องนั้น แต่เฉพาะที่อยู่ในวิสัยที่เจ้าหน้าที่รับอนุญาตพึงกระทำได้

(2) ให้ความร่วมมือแก่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในการป้องกันการกระทำที่ฝ่าฝืนกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และข้อกำหนด หนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(3) ไม่ให้ความร่วมมือหรือความช่วยเหลือบุคคลอื่นกระทำการฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตาม (1)

(4) ไม่ปฏิบัติกรใด ๆ ให้เป็นที่เสื่อมเสียหรืออาจเสื่อมเสียหรือเห็นได้ว่าจะเป็นทางนำไปสู่ความเสื่อมเสียแก่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(5) ไม่ส่งคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีลักษณะไม่เหมาะสมตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด หรือส่งคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อยู่หรือควรรู้หรือมีเหตุอันเชื่อได้ว่ารู้ว่าจะเข้าข่ายเป็นความผิดตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ข้อกำหนด หนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(6) ไม่ใช่ข้อมูลของลูกค้าหรือข้อมูลการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือข้อมูลใดที่ได้จากการปฏิบัติหน้าที่ของตนในการแสวงหาประโยชน์เพื่อตนเองและ/หรือบุคคลอื่น

(7) ไม่ส่งคำสั่งซื้อหรือคำสั่งขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อตนเองและ/หรือบุคคลอื่นโดยใช้บัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า

* (8) ไม่วิเคราะห์การลงทุนหรือแนะนำการลงทุนแก่ผู้ลงทุนโดยไม่ได้รับความเห็นชอบให้ปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าวจากสำนักงาน ก.ล.ต. ในกรณีที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนดหลักเกณฑ์ให้บุคลากรของสมาชิกต้องขอความเห็นชอบในการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าว

(*เพิ่มเติมหลักเกณฑ์ 705 ข้อ (8) โดยข้อบังคับของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 18 เมษายน 2557 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2557 เป็นต้นไป)

*706 การเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

(1) เจ้าหน้าที่รับอนุญาตอาจถูกพักการปฏิบัติหน้าที่เจ้าหน้าที่รับอนุญาตได้ หากตลาดหลักทรัพย์สั่งพักการปฏิบัติหน้าที่เจ้าหน้าที่รับอนุญาต หรือสำนักงาน ก.ล.ต. สั่งพักการปฏิบัติหน้าที่แนะนำการลงทุน ทั้งนี้ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจสั่งพักการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าวเท่าระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์หรือสำนักงาน ก.ล.ต. สั่งพักการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าว แล้วแต่กรณี

(2) เจ้าหน้าที่รับอนุญาตอาจถูกเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาตได้ตามเหตุดังต่อไปนี้

(ก) หากในภายหลังพบว่าเจ้าหน้าที่รับอนุญาตไม่สามารถดำรงคุณสมบัติของเจ้าหน้าที่รับอนุญาตข้อใดข้อหนึ่งหรือขาดหรือบกพร่องในคุณสมบัติของเจ้าหน้าที่รับอนุญาตข้อใดข้อหนึ่งตามหลักเกณฑ์ 702 หรือตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นสมควร

เมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีการเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาตด้วยเหตุตามวรรคหนึ่ง ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะแจ้งเป็นหนังสือให้เจ้าหน้าที่รับอนุญาตและสมาชิกผู้เสนอขอแต่งตั้งทราบและประกาศให้สมาชิกทราบโดยทั่วกัน

(ข) กรณีสมาชิกประสงค์เพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต ให้สมาชิกยื่นคำขอเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาตต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามแบบที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

(ค) เจ้าหน้าที่รับอนุญาตพ้นจากการเป็นพนักงานหรือผู้ปฏิบัติงานของสมาชิกหรือพ้นจากการเป็นพนักงานของนิติบุคคลที่ทำสัญญาเป็นตัวแทนสนับสนุนการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Selling Agent) กับสมาชิกที่ขอแต่งตั้งเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต หรือสัญญาการเป็นตัวแทนสนับสนุนการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Selling Agent) ของนิติบุคคลที่เจ้าหน้าที่รับอนุญาตเป็นพนักงานกับสมาชิกผู้ขอแต่งตั้งให้เป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตสิ้นสุดลง

เมื่อปรากฏเหตุตามวรรคหนึ่ง ให้สมาชิกแจ้งให้ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทราบทันทีและยื่นคำขอเพิกถอนเจ้าหน้าที่รับอนุญาตต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามแบบที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

*(*ยกเลิกความในหลักเกณฑ์ 706 โดยวิธีปฏิบัติบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 18 เมษายน 2557 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2557 เป็นต้นไป)*

707 การลงโทษเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

ในกรณีที่เจ้าหน้าที่รับอนุญาตของสมาชิกกระทำหรือมีส่วนในการกระทำการอันเป็นการฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหน้าที่ข้อกำหนดของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า บุคคลนั้นอาจได้รับการลงโทษในลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างประกอบกันดังต่อไปนี้

- (1) ตักเตือน
- (2) ภาคทัณฑ์
- (3) คำหนิโดยเปิดเผยต่อสาธารณชน
- (4) ปรับเป็นเงิน
- (5) ห้ามปฏิบัติหน้าที่เป็นการชั่วคราว
- (6) ห้ามปฏิบัติงานใด ๆ ในบริษัทสมาชิกภายในระยะเวลาที่กำหนด
- (7) เพิกถอนการขึ้นทะเบียน

*708 การสมัครเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง

ให้บุคคลที่ประสงค์จะสมัครเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องยื่นหนังสือแจ้งความจำนงต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าภายในระยะเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดเป็นคราว ๆ ไป

*709 คุณสมบัติของผู้ดูแลสภาพคล่อง

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องมีและดำรงคุณสมบัติขั้นต่ำดังต่อไปนี้

(1) เป็นสมาชิกของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือลูกค้าที่เป็นนิติบุคคลซึ่งสมาชิกแจ้งความจำนงให้เป็นผู้ดูแลสภาพคล่องต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือนิติบุคคลอื่นที่มีสัญญารับประกันการชำระราคากับสมาชิกสำนักหักบัญชี

(2) มีประสบการณ์ในการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือมีผู้ปฏิบัติงานที่มีความรู้และความสามารถเป็นที่น่าเชื่อถือว่าจะปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลสภาพคล่องได้

(3) มีความพร้อมของระบบงานที่เพียงพอหรือแสดงให้เห็นได้ว่ามีกระบวนการและมีความพร้อมในการปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง ตลอดจนมีนโยบายการจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าว

(4) มีฐานะการเงินที่มั่นคงและไม่มีความเสี่ยงที่อาจมีผลกระทบให้ไม่สามารถปฏิบัติหน้าที่ผู้ดูแลสภาพคล่องได้

****ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจกำหนดคุณสมบัติของผู้ประสงค์จะเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องดังต่อไปนี้เพิ่มเติมได้ตามที่เห็นสมควร**

(1) ผู้ดูแลสภาพคล่องที่เป็นลูกค้าที่เป็นนิติบุคคลซึ่งสมาชิกแจ้งความจำนงให้เป็นผู้ดูแลสภาพคล่องต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือนิติบุคคลอื่นที่มีสัญญารับประกันการชำระราคากับสมาชิกสำนักหักบัญชี

*******(2) ผู้ดูแลสภาพคล่องในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับสินค้าหรือตัวแปรที่ต้องได้รับความเห็นชอบจากหน่วยงานกำกับดูแล

*(*ข้อความของหลักเกณฑ์ 709 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 20 มกราคม 2552 ซึ่งมีผลใช้บังคับวันที่ 2 กุมภาพันธ์ 2552 เป็นต้นไป)*

*(*ข้อความของหลักเกณฑ์ 709 วรรคสองเดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 8 มกราคม 2556 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 14 มกราคม 2556 เป็นต้นไป)*

****ข้อความของหลักเกณฑ์ 709 วรรคสอง (2) เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 10 ตุลาคม 2565 ซึ่งมีผลใช้บังคับวันที่ 31 ตุลาคม 2565)*

***710 หน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง**

710.01 การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องปฏิบัติหน้าที่ดังต่อไปนี้

(1) ทำการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับมอบหมายจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(2) ต้องปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ข้อกำหนด หนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

710.02 ประเภทการดูแลสภาพคล่อง

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจมอบหมายให้ผู้ดูแลสภาพคล่องปฏิบัติหน้าที่ดูแลการซื้อขายตามประเภทการดูแลสภาพคล่องประเภทใดประเภทหนึ่งหรือสองประเภท ดังนี้

(1) การดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานอย่างต่อเนื่อง (Continuous Basis)

(2) การดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานเมื่อมีการร้องขอ (Response to Quote Requests)

710.03 จำนวนการเสนอซื้อและเสนอขายขั้นต่ำ (Minimum Quantity)

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องทำการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในแต่ละครั้งอย่างน้อยตามจำนวนขั้นต่ำที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

710.04 ส่วนต่างระหว่างราคาเสนอซื้อและเสนอขาย (Maximum Spreads)

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องทำการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อให้ราคาเสนอซื้อและเสนอขายที่ปรากฏในระบบการซื้อขายมีส่วนต่างไม่เกินกว่าที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

***711 หน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานอย่างต่อเนื่อง (Making a Market on Continuous Basis)**

711.01 การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องทำการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามแบบ ประเภท และเดือนที่ส่งมอบหรือชำระราคาที่ได้รับมอบหมายตลอดช่วงเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

711.02 การปฏิบัติหน้าที่เมื่อการเสนอซื้อขายถูกจับคู่

ในกรณีที่การเสนอซื้อขายที่ผู้ดูแลสภาพคล่องบันทึกเข้ามาในระบบการซื้อขายถูกจับคู่ทั้งหมดหรือบางส่วนและทำให้จำนวนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ผู้ดูแลสภาพคล่องได้ทำการเสนอซื้อขายไว้ลดลงต่ำกว่าจำนวนขั้นต่ำตามหลักเกณฑ์ 710.03 ให้ผู้ดูแลสภาพคล่องทำการเสนอซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขายเพื่อให้มีจำนวนเสนอซื้อและเสนอขายขั้นต่ำและส่วนต่างระหว่างราคาเสนอซื้อและเสนอขายเป็นไปตามหลักเกณฑ์ 710.03 และ 710.04

***712 หน้าของผู้ดูแลสภาพคล่องประเภทปฏิบัติงานเมื่อมีการร้องขอ (Making a Market in Response to Quote Requests)**

712.01 การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องทำการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามแบบ ประเภท และเดือนที่ส่งมอบหรือชำระราคาที่ได้รับมอบหมายเมื่อมีการร้องขอจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือสมาชิกตลอดช่วงเวลาตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

712.02 การเสนอซื้อและเสนอขายเมื่อมีการร้องขอ

ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องดำเนินการดังต่อไปนี้เมื่อได้รับการร้องขอให้ทำการเสนอซื้อและเสนอขาย สัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Quote Requests) ตามหลักเกณฑ์ 712.01

(1) ทำการเสนอซื้อและเสนอขายเข้ามาในระบบการซื้อขายภายในระยะเวลาที่ตลาด สัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

(2) ทำให้การเสนอซื้อและเสนอขายตาม (1) ปรากฏในระบบการซื้อขายตามระยะเวลา ขั้นต่ำที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

712.03 การปฏิบัติหน้าที่เมื่อการเสนอซื้อขายถูกจับคู่

ในกรณีที่การเสนอซื้อและเสนอขายที่ผู้ดูแลสภาพคล่องได้บันทึกเข้ามาในระบบการซื้อขายถูก จับคู่ทั้งหมดหรือบางส่วน ผู้ดูแลสภาพคล่องไม่ต้องทำการเสนอซื้อและเสนอขายเพิ่มเติมเข้ามาในระบบ การซื้อขายจนกว่าจะมีการร้องขอจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือสมาชิกให้ทำการเสนอซื้อและ เสนอขายอีก ยกเว้นตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและผู้ดูแลสภาพคล่องจะกำหนดเป็นอย่างอื่น

***713 การแก้ไขหรือเปลี่ยนแปลงสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีการดูแลสภาพคล่อง**

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและผู้ดูแลสภาพคล่องอาจแก้ไขหรือเปลี่ยนแปลงแบบ ประเภท และเดือนที่ส่งมอบหรือชำระราคาของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้มอบหมาย ให้ผู้ดูแลสภาพคล่องทำการเสนอซื้อและเสนอขายเข้ามาในระบบการซื้อขายได้

***714 การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่อง**

714.01 การซื้อขายด้วยระบบการซื้อขาย

ในการซื้อขายด้วยระบบการซื้อขายโดยผู้ดูแลสภาพคล่องให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

714.02 การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องที่เป็นสมาชิก

ในกรณีที่ผู้ดูแลสภาพคล่องเป็นสมาชิก ผู้ดูแลสภาพคล่องต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดให้มีระบบการดำเนินงานในการซื้อขายและการดำเนินงานในฐานะเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องแยกต่างหากจากระบบการดำเนินงานในการซื้อขายและการดำเนินงานของสมาชิกในฐานะเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่ลูกค้า

(2) ดำเนินการขอแต่งตั้งบุคคลใดเพื่อเป็นเจ้าหน้าที่ผู้ดูแลสภาพคล่องของตน

(3) ห้ามมิให้เจ้าหน้าที่ผู้ดูแลสภาพคล่องรับหรือส่งคำสั่งซื้อขายเพื่อบัญชีของลูกค้า และสมาชิกต้องมีระบบการดำเนินงานในการป้องกันมิให้เจ้าหน้าที่ดังกล่าวล่วงรู้ถึงข้อมูลหรือสามารถใช้ข้อมูลของลูกค้าเพื่อการใด ๆ ในการปฏิบัติงาน

(4) ต้องจัดให้บัญชีซื้อขายของผู้ดูแลสภาพคล่องแยกออกจากบัญชีซื้อขายอื่น ๆ

(5) ดำเนินการอื่น ๆ ตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

***714.03 การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องที่เป็นนิติบุคคลอื่นนอกจากสมาชิก**

ในกรณีที่ผู้ดูแลสภาพคล่องเป็นนิติบุคคลอื่นนอกจากสมาชิก ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจกำหนดเงื่อนไขในการปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องดังกล่าวได้ ทั้งนี้ เพื่อให้การซื้อขายเป็นไปอย่างมีระเบียบ โปร่งใสและมีความเป็นธรรม

(*ข้อความของหลักเกณฑ์ 714.03 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 20 มกราคม 2552 ซึ่งมีผลใช้บังคับวันที่ 2 กุมภาพันธ์ 2552)

***715 การหยุดการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องชั่วคราว**

715.01 การสั่งหรืออนุญาตให้หยุดการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องชั่วคราว

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจสั่งหรืออนุญาตให้ผู้ดูแลสภาพคล่องหยุดการปฏิบัติหน้าที่ชั่วคราวได้เมื่อเกิดกรณีดังต่อไปนี้

(1) มีเหตุการณ์ที่อาจกระทบต่อการซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอันไม่สามารถทำให้การซื้อขายเป็นไปอย่างมีระเบียบ โปร่งใสและมีความเป็นธรรม

(2) มีเหตุการณ์อื่น ๆ ตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นสมควร

ในกรณีที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสั่งหรืออนุญาตให้ผู้ดูแลสภาพคล่องหยุดการปฏิบัติหน้าที่ชั่วคราว ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะประกาศให้สมาชิกทราบทั่วกัน โดยผู้ดูแลสภาพคล่องดังกล่าว จะได้รับยกเว้นไม่ต้องปฏิบัติหน้าที่ในช่วงเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสั่งหรืออนุญาตให้หยุดการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าว

715.02 การปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องภายหลังหยุดการปฏิบัติหน้าที่ชั่วคราว

ให้ผู้ดูแลสภาพคล่องเริ่มปฏิบัติหน้าที่ภายหลังหยุดการปฏิบัติหน้าที่ชั่วคราวตามหลักเกณฑ์ 715.01 เมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้แจ้งยกเลิกหรือสิ้นสุดระยะเวลาที่ได้รับอนุญาตให้หยุดการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าวต่อผู้ดูแลสภาพคล่อง โดยตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะประกาศการเริ่มการปฏิบัติหน้าที่ให้ผู้ดูแลสภาพคล่องภายหลังหยุดการปฏิบัติหน้าที่ชั่วคราวให้สมาชิกทราบทั่วกัน

*716 การสิ้นสุดการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง

การเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องสิ้นสุดตามเหตุใดเหตุหนึ่งดังต่อไปนี้

- (1) เมื่อสิ้นสุดระยะเวลาการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องที่ตกลงไว้กับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (2) เมื่อถูกยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ 717
- (3) เมื่อมีการขอยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ 718

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะประกาศให้สมาชิกทราบทั่วกันเมื่อการปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลสภาพคล่องของผู้ดูแลสภาพคล่องรายใดสิ้นสุด

*717 การยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจพิจารณายกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง เมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นว่า

- (1) ผู้ดูแลสภาพคล่องไม่ปฏิบัติตามหน้าที่ที่ตกลงไว้กับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (2) ผู้ดูแลสภาพคล่องไม่ปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ข้อกำหนดหนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

*718 การขอยกเลิกการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง

ผู้ดูแลสภาพคล่องอาจขอยกเลิกจากการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องได้ตามที่ได้ตกลงไว้กับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยผู้ดูแลสภาพคล่องจะต้องยื่นหนังสือแจ้งล่วงหน้าอย่างน้อย 30 วัน ทั้งนี้ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจกำหนดเงื่อนไขให้แก่ผู้ดูแลสภาพคล่องปฏิบัติก่อนที่จะให้การยกเลิกมีผลได้

*719 การสมัครเป็นผู้เสริมสร้างความสมดุล

ให้บุคคลที่ประสงค์จะสมัครเป็นผู้เสริมสร้างความสมดุลยื่นหนังสือแจ้งความจำนงต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าภายในระยะเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดเป็นคราวๆ ไป

(*เพิ่มเติมความในหลักเกณฑ์ 719 โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 23 สิงหาคม 2560 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 4 กันยายน 2560 เป็นต้นไป)

*720 คุณสมบัติของผู้เสริมสร้างความสมดุล

ผู้เสริมสร้างความสมดุลต้องมีและดำรงคุณสมบัติขั้นต่ำดังต่อไปนี้

(1) เป็นสมาชิกของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือสมาชิกของสำนักหักบัญชีหรือลูกค้าที่เป็นนิติบุคคลซึ่งสมาชิกแจ้งความจำนงให้เป็นผู้เสริมสร้างความสมดุลต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(2) มีประสบการณ์ในการประกอบธุรกิจที่เกี่ยวกับสินค้าอ้างอิง หรือแสดงได้ว่ามีความสามารถและความพร้อมในการปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้เสริมสร้างความสมดุล

(3) มีผู้ปฏิบัติงานที่มีความรู้และความสามารถเป็นที่น่าเชื่อถือว่าจะปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้เสริมสร้างความสมดุลได้

(4) มีฐานะการเงินที่มั่นคงและไม่มีความเสี่ยงที่อาจมีผลกระทบให้ไม่สามารถปฏิบัติหน้าที่ผู้เสริมสร้างความสมดุลได้

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจกำหนดคุณสมบัติของผู้ประสงค์จะเป็นผู้เสริมสร้างความสมดุลเพิ่มเติมได้ตามที่เห็นสมควรโดยคำนึงถึงความพร้อมในการปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้เสริมสร้างความสมดุลเป็นสำคัญ

(*ยกเลิกความในหลักเกณฑ์ 720 โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 14 มีนาคม 2561 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 20 มีนาคม 2561 เป็นต้นไป)

*721 หน้าที่ของผู้เสริมสร้างความสมดุล

ผู้เสริมสร้างความสมดุลต้องปฏิบัติหน้าที่ดังต่อไปนี้

(1) ทำการซื้อและขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเข้ามาในระบบการซื้อขายเพื่อเสริมสร้างความสมดุลของการส่งมอบสินค้าตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

(2) ต้องปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ข้อกำหนดของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและสำนักหักบัญชี ตลอดจนปฏิบัติตามหนังสือเวียน และคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(*เพิ่มเติมความในหลักเกณฑ์ 721 โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 23 สิงหาคม 2560 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 4 กันยายน 2560 เป็นต้นไป)

***722 การปฏิบัติงานของผู้เสริมสร้างความสมดุล**

ในการซื้อขายด้วยระบบการซื้อขายโดยผู้เสริมสร้างความสมดุลให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด โดยให้นำความตามหลักเกณฑ์ 714 การปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องมาใช้บังคับกับการปฏิบัติงานของผู้เสริมสร้างความสมดุลตามหมวดนี้ยกเว้นหลักเกณฑ์ 714.02 (1)

(*เพิ่มเติมความในหลักเกณฑ์ 722 โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 23 สิงหาคม 2560 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 4 กันยายน 2560 เป็นต้นไป)

***723 การหยุดการปฏิบัติหน้าที่ การสิ้นสุด และการยกเลิก การเป็นผู้เสริมสร้างความสมดุล**

ให้นำหลักเกณฑ์ 715 ถึงหลักเกณฑ์ 718 มาใช้บังคับกับการหยุดการปฏิบัติหน้าที่ การสิ้นสุด การยกเลิกการ และการขอยกเลิกการเป็นผู้เสริมสร้างความสมดุลโดยอนุโลม และในการตั้งหรืออนุญาตให้หยุดการปฏิบัติหน้าที่ของผู้เสริมสร้างความสมดุลนั้นให้รวมถึงกรณีมีเหตุการณ์ที่อาจกระทบต่อการส่งมอบสินค้าหรือมีเหตุผันผวนหรือมีการเปลี่ยนแปลงที่ผิดไปจากสภาพปกติของตลาดหรือมีเหตุจำเป็นและสมควร

(*เพิ่มเติมความในหลักเกณฑ์ 723 โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 23 สิงหาคม 2560 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 4 กันยายน 2560 เป็นต้นไป)

***724 การเปิดเผยการลงโทษบุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย**

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจเปิดเผยการลงโทษบุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขายได้ในกรณีที่บุคคลดังกล่าวได้รับการลงโทษเนื่องจากการไม่ปฏิบัติตามข้อกำหนดของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอันมีผลกระทบต่อผู้ลงทุนหรือการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยรวมตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

ในการเปิดเผยการลงโทษตามวรรคหนึ่ง ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจพิจารณาเปิดเผยแก่สมาชิกอื่นหรือบุคคลที่เกี่ยวข้องกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือเปิดเผยเป็นการทั่วไปได้

(*เพิ่มเติมความในหลักเกณฑ์ 724 โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 23 สิงหาคม 2560 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 4 กันยายน 2560)
