

**แนวทางการขออนุญาตต่อเชื่อมระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขาย
กับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า**

ขั้นตอนการดำเนินการ

1. ให้สมาชิกยื่นคำขออนุญาตผ่านระบบ Member Digital Form ใน SET Community portal (www.setportal.set.or.th) มายังตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและนำส่งเอกสารประกอบการพิจารณาตามที่กำหนด ทั้งนี้ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจร้องขอข้อมูลหรือเอกสารประกอบการพิจารณาเพิ่มเติมจากสมาชิกได้ รวมทั้งอาจกำหนดเงื่อนไขเพิ่มเติมในการอนุญาตได้ตามที่เห็นสมควร
2. สมาชิกสามารถเข้าร่วมการทดสอบตามรอบที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด โดยให้ยื่นคำขอล่วงหน้าอย่างน้อย 7 วันทำการก่อนวันเริ่มการทดสอบในรอบนั้นๆ
3. ในกรณีที่ต้องมีการทดสอบระบบงาน ให้สมาชิกทดสอบตามรายละเอียดและกำหนดการที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด และสมาชิกต้องผ่านการทดสอบหรือส่งผลการทดสอบ (แล้วแต่กรณี) ตามที่กำหนด
4. ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะแจ้งผลการพิจารณาให้สมาชิกทราบภายใน 10 วันทำการนับจากวันที่ได้รับข้อมูลหรือเอกสารที่ร้องขอครบถ้วนและถูกต้อง
5. ให้สมาชิกแจ้งยืนยันวันที่จะเริ่มใช้งานระบบที่ขออนุญาตนั้นให้แก่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทราบภายใน 7 วันทำการนับจากวันที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหลังจากได้รับแจ้งผลการพิจารณาข้างต้น
6. ในกรณีที่สมาชิกไม่สามารถเริ่มใช้ระบบดังกล่าวภายในระยะเวลา 3 เดือนหลังจากที่ได้รับแจ้งผลการทดสอบตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าขอสงวนสิทธิ์ในการพิจารณายกเลิกผลการทดสอบดังกล่าว

อนึ่ง ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจมอบหมายให้หน่วยงานอื่น เช่น ตลาดหลักทรัพย์ ดำเนินการในเรื่องการทดสอบและรายละเอียดของการดำเนินการข้างต้น

ระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายที่ต้องขออนุญาต

สมาชิกต้องขออนุญาตทั้งในกรณีที่เป็นระบบงานที่พัฒนาโดยบริษัทสมาชิก (In-house Application) และ/หรือดำเนินงานโดยผู้พัฒนาระบบหรือผู้ให้บริการระบบภายนอก (Service Provider) โดยมีรายละเอียด ดังนี้

1. การขออนุญาตครั้งแรก
ในกรณีดังต่อไปนี้ ต้องผ่านการทดสอบทางเทคนิค (Conformance Test) ก่อนการเริ่มการใช้งาน
 - 1.1 การขอต่อเชื่อมชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขาย เพื่อใช้เป็น
 - Front Office Application
 - Internet Trading Application
 - 1.2 การขอต่อเชื่อมชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายผ่านช่องทาง Direct Market Access (DMA)
 - 1.3 การขอต่อเชื่อมชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading)

2. การเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติมระบบคอมพิวเตอร์ของสมาชิก

ในกรณีดังต่อไปนี้ ต้องผ่านการทดสอบทางเทคนิค (Conformance Test) ก่อนการเริ่มการใช้งาน

- 2.1 การเปลี่ยนแปลงผู้พัฒนาระบบ หรือผู้ให้บริการระบบภายนอก (Service Provider)
- 2.2 การเปลี่ยนแปลงเทคโนโลยีของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขาย
- 2.3 การเปลี่ยนแปลงฟังก์ชันการทำงานของระบบคอมพิวเตอร์ (Functional Specification) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับระบบการซื้อขาย

ในกรณีต่อไปนี้ สมาชิกสามารถนำส่งผลการทดสอบให้ตรวจสอบ

- 2.4 การเปลี่ยนแปลงโครงสร้างของระบบเครือข่าย (Network Architecture) ของระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขาย
- 2.5 การเปลี่ยนแปลงสถานที่ตั้งเครื่องคอมพิวเตอร์ (Server) ของระบบคอมพิวเตอร์ของสมาชิกที่ใช้ในการซื้อขาย

3. การขออนุญาตเพิ่ม เปลี่ยนแปลงข้อมูล หรือยกเลิก ลูกค้าย่อยผ่านช่องทาง DMA

- 3.1 การเพิ่มลูกค้าย่อยที่ซื้อขายผ่านช่องทาง DMA โดยที่ลูกค้าย่อยใหม่มีการต่อเชื่อมกับสมาชิกในรูปแบบเดิมที่ได้ขออนุญาตไปแล้ว
- 3.2 การเปลี่ยนแปลง (Update) ข้อมูลของลูกค้าย่อยหรือยกเลิกการให้บริการซื้อขายผ่านช่องทาง DMA แก่ลูกค้าย่อยที่ได้รับอนุญาตไปแล้ว
- 3.3 การเพิ่มลูกค้าย่อยที่ซื้อขายผ่านช่องทาง DMA โดยที่ลูกค้าย่อยใหม่มีการต่อเชื่อมกับสมาชิกแตกต่างจากเดิมที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้อนุญาตไปแล้ว

4. ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจกำหนดให้มีการขออนุญาตในกรณีอื่นๆ ตามความจำเป็นและเหมาะสมได้

การยื่นเอกสาร

เอกสารประกอบการยื่นคำขอ มีดังนี้

1. แบบ MO-API1 ใช้ทุกครั้งเมื่อยื่นขออนุญาตครั้งแรกและเมื่อขอเปลี่ยนแปลงที่กระทบ API User
2. แบบ MO-Member1 ใช้ทุกครั้งเมื่อยื่นขออนุญาตครั้งแรกและเมื่อขอเปลี่ยนแปลง
3. แบบ MO-ISV1 ใช้ในกรณีที่สมาชิกใช้บริการผู้พัฒนาระบบหรือผู้ให้บริการระบบภายนอก (Service Provider)
4. แบบ MO-Security1 เอกสารเพิ่มเติมสำหรับการยื่นขออนุญาตครั้งแรกและเมื่อมีการเปลี่ยนแปลงด้านการรักษาความปลอดภัยของระบบ (System Security)
5. แบบ MO-DMA1 เอกสารเพิ่มเติมกรณีขออนุญาตในส่วนที่เกี่ยวข้องกับลูกค้าย่อยที่ต่อเชื่อมผ่านช่องทาง Direct Market Access (DMA)
6. แบบ MO-PROG1 เอกสารเพิ่มเติมกรณีขออนุญาตในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการต่อเชื่อมชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading)
7. แบบ MO-COMPLIANCE1 เอกสารเพิ่มเติมกรณีขออนุญาตในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการต่อเชื่อมชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading)

ติดต่อสอบถาม

- รายละเอียดการขออนุญาตเชื่อมต่อระบบ ติดต่อสอบถามได้ที่
ส่วนซื้อขายอนุพันธ์ ฝ่ายปฏิบัติการซื้อขายอนุพันธ์ E-mail: DerivativesTradingOperationUnit@set.or.th
- รายละเอียดการเชื่อมต่อทางด้านเทคนิค ติดต่อสอบถามได้ที่
ส่วนพัฒนาระบบซื้อขายอนุพันธ์ ฝ่ายพัฒนาระบบซื้อขาย E-mail: DerivativesTradingSystemUnit@set.or.th

ผลบังคับใช้

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะใช้แนวทางฉบับนี้แทนแนวทางการขออนุญาตต่อเชื่อมระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายกับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ฉบับวันที่ 30 มิถุนายน 2553 โดยให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2557 เป็นต้นไป

สรุปแนวทางการขออนุญาตต่อเชื่อมระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายกับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ประเภทที่ขออนุญาต	แบบคำขอ	การทดสอบระบบ
1. การขออนุญาตครั้งแรก		
1.1 ขอต้อเชื่อมชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายเพื่อใช้เป็น □ <i>Front Office Application</i> □ <i>Internet Trading Application</i>	แบบ MO-API1 แบบ MO-Member1 แบบ MO-ISV1* แบบ MO-Security1	<ul style="list-style-type: none"> ▪ ยื่นคำขอล่วงหน้าอย่างน้อย 7 วันทำการก่อนวันที่เริ่มทดสอบ ▪ ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ต้องผ่านการทดสอบทางเทคนิค (Conformance Test) ก่อนเริ่มใช้งาน ▪ ให้สมาชิกทดสอบระบบตามรายละเอียดและกำหนดการที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด
1.2 ขอต้อเชื่อมชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายผ่านช่องทาง DMA	แบบ MO-API1 แบบ MO-Member1 แบบ MO-ISV1* แบบ MO-DMA1 แบบ MO-Security1	
1.3 ขอต้อเชื่อมชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading)	แบบ MO-API1 แบบ MO-Member1 แบบ MO-ISV1* แบบ MO-Security1 แบบ MO-DMA1 (ถ้ามี) แบบ MO-PROG1 แบบ MO-COMPLIANCE1	

ประเภทที่ขออนุญาต	แบบคำขอ	การทดสอบระบบ
2. การเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติมระบบคอมพิวเตอร์ของสมาชิก		
2.1 ขอเปลี่ยนแปลงผู้พัฒนาระบบ หรือผู้ให้บริการระบบ ภายนอก (Service Provider)	แบบ MO-API1 (กรณีกระทบต่อ API User) แบบ MO-Member1 แบบ MO-ISV1*	<ul style="list-style-type: none"> ▪ ยื่นคำขอล่วงหน้าอย่างน้อย 7 วันทำการ ก่อนวันที่เริ่มทดสอบ ▪ ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ต้องผ่านการทดสอบทางเทคนิค (Conformance Test) ก่อนเริ่มใช้งาน ▪ ให้สมาชิกทดสอบระบบตามรายละเอียดที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด
2.2 ขอเปลี่ยนแปลงเทคโนโลยีของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์	แบบ MO-Security1 (กรณีกระทบความปลอดภัยของ System Security)	
2.3 ขอเปลี่ยนแปลงฟังก์ชันการทำงานของระบบคอมพิวเตอร์ของสมาชิกในส่วนที่เกี่ยวกับการซื้อขายของสมาชิกที่เชื่อมต่อกับระบบการซื้อขาย		
2.4 ขอเปลี่ยนแปลงโครงสร้างของระบบเครือข่ายของสมาชิกที่เชื่อมต่อกับระบบการซื้อขาย (Network Architecture)	แบบ MO-API1 (กรณีกระทบต่อ API User) แบบ MO-Member1 แบบ MO-ISV1 (กรณีเกี่ยวข้องกับระบบของผู้พัฒนาระบบ หรือ	<ul style="list-style-type: none"> ▪ ยื่นคำขอล่วงหน้าอย่างน้อย 7 วันทำการ ก่อนวันที่เริ่มทดสอบ ▪ ให้สมาชิกทดสอบภายในบริษัทและนำส่งผลการทดสอบระบบ โดยแนบมาพร้อมแบบ MO-Member 1
2.5 ขอเปลี่ยนแปลงสถานที่ตั้งเครื่องคอมพิวเตอร์ (Server) ของระบบคอมพิวเตอร์ของสมาชิกที่เชื่อมต่อกับระบบการซื้อขาย	ผู้ให้บริการระบบภายนอก (Service Provider) แบบ MO-Security1 (กรณีกระทบความปลอดภัยของ System Security)	

ประเภทที่ขออนุญาต	แบบคำขอ	การทดสอบระบบ
3 การขออนุญาตเพิ่ม เปลี่ยนแปลงข้อมูล หรือยกเลิก ลูกค้ำที่ซื้อขายผ่านช่องทาง DMA		
3.1 กรณีสมาชิกจะขออนุญาตเพิ่มลูกค้ำที่ซื้อขายผ่านช่องทาง DMA โดยที่ลูกค้ำรายใหม่มีการต่อเชื่อมกับสมาชิกในรูปแบบเดิมที่ได้ขออนุญาตไปแล้ว 3.2 กรณีที่มีการเปลี่ยนแปลง (Update) ข้อมูลของลูกค้ำหรือยกเลิกการให้บริการซื้อขายผ่านช่องทาง DMA แก่ลูกค้ำที่ได้รับอนุญาตไปแล้ว	ให้รายงานข้อมูลการเปลี่ยนแปลงตามแบบ MO-DMA1 ให้ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทราบล่วงหน้าอย่างน้อย 7 วันทำการ	<ul style="list-style-type: none"> ■ ไม่ต้องทดสอบระบบกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
3.3 กรณีที่สมาชิกจะขออนุญาตเพิ่มลูกค้ำที่ซื้อขายผ่านช่องทาง DMA โดยที่ลูกค้ำรายใหม่มีการต่อเชื่อมกับสมาชิกแตกต่างจากเดิมที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้อนุญาตไปแล้ว	แบบ MO-Member1 แบบ MO-ISV1* แบบ MO-Security1 (กรณีกระทบความปลอดภัยของ Security) แบบ MO-DMA1	<ul style="list-style-type: none"> ■ ยื่นคำขอล่วงหน้าอย่างน้อย 7 วันทำการก่อนวันที่เริ่มทดสอบ ■ ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ต้องผ่านการทดสอบทางเทคนิค (Conformance Test) ก่อนเริ่มใช้งาน ■ ให้สมาชิกทดสอบระบบตามรายละเอียดที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

หมายเหตุ : * ยื่นเอกสารกรณีสมาชิกใช้บริการผู้พัฒนาระบบหรือผู้ให้บริการระบบภายนอก (Service Provider)

ตัวอย่างแบบฟอร์มต่างๆ สามารถดาวน์โหลดได้ที่ <https://www.tfex.co.th/th/rules/form.html>