

ภาพรวมการเชื่อมต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายของสมาชิก กับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

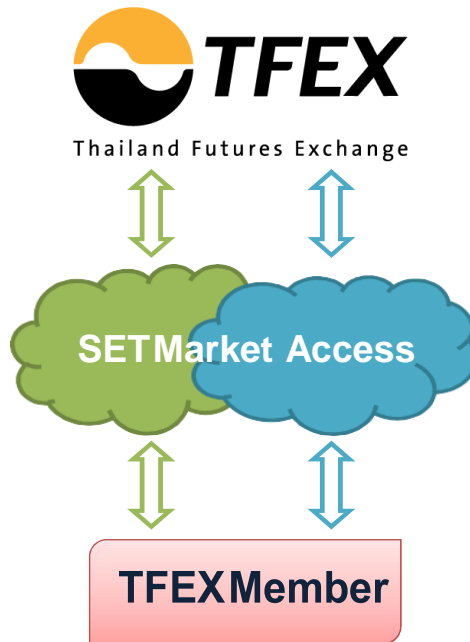
ระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

การซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นการซื้อขายแบบอิเล็กทรอนิกส์ (Electronic Trading System) โดยตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะอนุญาตให้สมาชิกตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและบุคคลที่ได้รับอนุญาตเท่านั้น สามารถเชื่อมต่อระบบคอมพิวเตอร์มายังระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ผู้เกี่ยวข้องประสงค์ที่จะได้รับความรวดเร็ว มีประสิทธิภาพ และน่าเชื่อถือ ดังนั้นระบบการซื้อขายจึงเป็นหัวใจสำคัญต่อการดำเนินงานของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยระบบการซื้อขายต้องอาศัยเทคโนโลยีที่ทันสมัย มีความรวดเร็ว และสามารถรองรับการเชื่อมต่อกับระบบงานและซอฟต์แวร์ประเภทต่างๆ ได้อย่างกว้างขวาง เพื่อให้สมาชิกสามารถดำเนินงานและสามารถใช้เทคโนโลยีในการบริหารความเสี่ยงในการดำเนินงานได้อย่างมีประสิทธิภาพ

ระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ให้บริการภายใต้สถาปัตยกรรมเทคโนโลยีสมัยใหม่ นอกเหนือจากความเร็วในการประมวลผล (High-performance) และมีความยืดหยุ่นในการให้บริการ (Flexibility) แล้ว ระบบการซื้อขายยังถูกพัฒนาโดยคำนึงถึงความมีเสถียรภาพของระบบ (Resilience and robustness) โดยในส่วนของ การเชื่อมต่อกับสมาชิกได้มีการกระจายจุดเชื่อมต่อ (Gateway) เพื่อสามารถให้บริการได้พร้อมกันหลายจุด (Concurrency) ซึ่งสมาชิกจะสามารถเปลี่ยนจุดเชื่อมต่อได้ทันทีเมื่อพบปัญหาที่จุดใดจุดหนึ่ง สำหรับเรื่องการจับคู่การซื้อขาย (Matching Engine) นั้น ระบบได้รับการออกแบบให้สามารถกระจายการทำงาน (Workload) ไปยังหลายชุดจับคู่การซื้อขาย (Matching Engine partition) โดยแต่ละชุดจับคู่การซื้อขายสามารถทำงานอย่างอิสระต่อกัน (Horizontal scalable and Independent matching engine) นอกจากนี้ระบบยังได้รับการออกแบบให้รองรับความผิดปกติสองชั้น (Double failure) โดยหากเกิดความเสียหายในชั้นแรก (Single failure) ระบบจะทำการ Failover โดยอัตโนมัติภายในศูนย์คอมพิวเตอร์หลัก และหากเกิด Double failure ระบบจะทำการ Failover ไปยังชุดจับคู่การซื้อขายที่ศูนย์สำรองต่อไป

การเชื่อมต่อกับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า



ปัจจุบันตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดให้สมาชิกเชื่อมต่อกับระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายของสมาชิก หรือที่เรียกว่าระบบส่งคำสั่งซื้อขาย เข้ากับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ผ่าน SET Managed Network (SETNET 3) และ SET Co-location

ในการส่งคำสั่งซื้อขายเข้ามายังระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาชิกจะต้องเชื่อมต่อและส่งคำสั่งซื้อขายผ่าน OUCH หรือ FIX Protocol ซึ่งเป็นเทคโนโลยี Open API ซึ่งใช้ทั่วไปตามมาตรฐานสากล โดยสมาชิกที่จะเชื่อมต่อกับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าต้องจัดหาและดูแลระบบเครือข่ายเพื่อเชื่อมต่อกับระบบการซื้อขาย (รายละเอียดตามการเชื่อมต่อกับระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายกับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) รวมทั้งต้องเตรียมการด้านการจัดการและรักษาความปลอดภัยของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่เป็นมาตรฐาน (รายละเอียดตามมาตรฐานความปลอดภัยสำหรับระบบที่ต่อเชื่อมกับระบบตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า)

ระบบการส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่เชื่อมต่อกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สมาชิกสามารถเลือกใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายได้ตามความเหมาะสม ไม่ว่าจะเป็นการใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายที่สมาชิกพัฒนาขึ้นเอง หรือระบบส่งคำสั่งซื้อขายที่พัฒนาโดยบริษัทผู้พัฒนาระบบ (Independent Software Vendor: ISV) หรือผู้ให้บริการระบบภายนอก (Service Provider: SP) อย่างไรก็ตามสมาชิกจะเชื่อมต่อกับระบบส่งคำสั่งซื้อขายนั้นกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้ก็ต่อเมื่อสมาชิกที่พัฒนาระบบขึ้นเอง หรือ ISV หรือ SP ดังกล่าวนั้น ได้ผ่านการทดสอบระบบทางเทคนิค (conformance test) กับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแล้ว รวมทั้งก่อนเริ่มใช้ชุดคำสั่งซื้อขาย สมาชิกต้องผ่านการทดสอบและได้รับอนุญาตจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (รายละเอียดตามข้อบังคับ วิธีปฏิบัติ และแนวทางปฏิบัติของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) ที่เกี่ยวกับการเชื่อมต่อกับระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายของสมาชิกกับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า)

นอกจากการเชื่อมต่อเพื่อส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ายังเปิดให้สมาชิกสามารถให้บริการผู้ลงทุนเชื่อมต่อกับระบบเพื่อส่งคำสั่งซื้อขายมายังระบบของสมาชิกได้โดยตรง หรือที่เรียกว่า Direct Market Access (DMA) โดย

สมาชิกต้องได้รับอนุญาตก่อนเริ่มให้ผู้ลงทุนส่งคำสั่งซื้อขายผ่านช่องทางดังกล่าว (รายละเอียดตามข้อบังคับ วิธีปฏิบัติ และแนวทางปฏิบัติของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกี่ยวข้องกับการเชื่อมต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายของสมาชิกกับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า)

การทดสอบระบบทางเทคนิค (Conformance Test)

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะแจ้งรายชื่อผู้พัฒนาระบบ (ISV) และผู้ให้บริการระบบภายนอก (SP) ที่ผ่านการทดสอบระบบทางเทคนิค (Conformance Test) ตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด โดยสมาชิกสามารถตรวจสอบรายชื่อได้ที่ทาง <https://www.set.or.th/th/services/information/isv>

หากสมาชิกประสงค์จะใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของผู้พัฒนาระบบงานหรือผู้ให้บริการระบบภายนอกเหล่านี้ สามารถดำเนินการขออนุญาตเชื่อมต่อได้โดยไม่ต้องให้ผู้พัฒนาระบบทำการทดสอบระบบทางเทคนิคใหม่ คงเหลือแต่การทดสอบระบบโดยสมาชิกก่อนเริ่มการใช้งาน โดยสามารถสอบถาม Software Version ที่ได้ผ่านการทดสอบ conformance กับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแล้วจาก ISV หรือ SP ที่ให้บริการ อย่างไรก็ตาม ในกรณีที่สมาชิกประสงค์จะใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของผู้พัฒนาระบบหรือผู้ให้บริการระบบภายนอกอื่นซึ่งยังไม่เคยผ่านการทดสอบระบบทางเทคนิคกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาชิกสามารถดำเนินการได้โดยให้ ISV หรือ SP ส่งหนังสือรับรองคุณสมบัติในการเป็น ISV หรือ SP ในด้านฐานะการเงิน ผลงานด้านการพัฒนาและให้บริการระบบ และข้อมูลเกี่ยวกับบุคลากร พร้อมแจ้งความประสงค์ในการพัฒนาและเข้าทดสอบระบบกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Email: ISV_Access_Support@set.or.th) เพื่อให้ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าพิจารณา และกำหนดเวลาที่จะให้เข้าทดสอบระบบเป็นครั้งคราวไป และเมื่อ ISV หรือ SP ดังกล่าวผ่านการทดสอบระบบทางเทคนิคแล้ว สมาชิกเข้าทดสอบระบบก่อนเริ่มใช้งานต่อไป

การขออนุญาตใช้ชุดคำสั่งซื้อขายและการทดสอบของสมาชิก

เมื่อระบบส่งคำสั่งซื้อขายได้ผ่านการทดสอบระบบทางเทคนิคกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแล้ว สมาชิกที่จะเชื่อมต่อระบบต้องขออนุญาตใช้ชุดคำสั่งซื้อขายสำหรับการซื้อขายผ่านช่องทางต่างๆ ได้แก่ การซื้อขายผ่านเจ้าหน้าที่รับอนุญาต ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต และ Direct Market Access (DMA) หรือการซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading) โดยยื่นแบบคำขออนุญาตต่อเชื่อมระบบของสมาชิก เข้ากับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และแบบรับรองชุดคำสั่งซื้อขายที่รับรองโดย ISV หรือ SP (กรณีที่ใช้ชุดคำสั่งซื้อขายของ ISV หรือ SP) มายังตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าผ่านระบบ Member Digital Form (รายละเอียดตามแนวทางการขออนุญาตต่อเชื่อมระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายกับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) และทำการทดสอบชุดคำสั่งซื้อขายรวมทั้งส่งผลการทดสอบให้กับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลอดจนนำเสนอข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจร้องขอจากสมาชิก เพื่อใช้ประกอบการพิจารณาต่อไป

สำหรับกำหนดการทดสอบระบบ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะแจ้งให้ผู้ที่เกี่ยวข้องได้แก่ สมาชิก ISV และ SP ทราบล่วงหน้าผ่าน CONNEX โดยผู้ที่เกี่ยวข้องสามารถรับสารดังกล่าวได้จาก E-mail หรือ Download สารดังกล่าวได้จาก ระบบ SET Community Portal โดย Test Script และรายละเอียดที่เกี่ยวข้องกับการทดสอบ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า จะแจ้งให้สมาชิกทราบผ่านระบบ Member Digital Form สำหรับ ISV หรือ SP รายใหม่ที่ประสงค์จะเข้าทดสอบระบบงานนั้น ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจพิจารณาให้ใช้กำหนดการทดสอบร่วมกับกำหนดการทดสอบเดิมหรือกำหนดเพิ่มเติมเป็นรายกรณีตามที่เห็นสมควร

การพิจารณาอนุญาตและการเริ่มใช้งานระบบส่งคำสั่งซื้อขาย

หลังจากสมาชิกที่จะเชื่อมต่อบริษัทได้ดำเนินการขออนุญาตและทำการทดสอบการใช้ชุดคำสั่งซื้อขายตามรายละเอียดข้างต้นแล้ว ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะแจ้งผลการพิจารณาให้สมาชิกทราบผ่านระบบ Member Digital Form ภายใน 10 วันทำการนับจากวันที่ได้รับข้อมูลหรือเอกสารหลักฐานที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าร้องขอครบถ้วนถูกต้อง โดยสมาชิกต้องแจ้งยืนยันวันที่เริ่มใช้งานระบบให้ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทราบต่อไป หากสมาชิกยังไม่เริ่มใช้งานระบบภายในระยะเวลา 3 เดือนนับจากวันที่ได้รับแจ้งผลการทดสอบ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจพิจารณายกเลิกผลการทดสอบดังกล่าวของบริษัทได้ตามที่เห็นสมควร

ความพร้อมของสมาชิกเกี่ยวกับระบบส่งคำสั่งซื้อขาย

เมื่อสมาชิกได้รับอนุญาตให้ทำการเชื่อมต่อบริษัทส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกกับระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแล้ว สมาชิกต้องมีความพร้อมในการใช้ระบบของสมาชิกอยู่เสมอ ไม่ว่าจะเป็นความพร้อมในด้านการจัดการและรักษาความปลอดภัยของระบบของสมาชิกที่เป็นมาตรฐานตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด โดยสมาชิกต้องจัดทำเอกสารการปฏิบัติงานตามมาตรฐานดังกล่าว และสามารถตรวจสอบได้ทันทีเมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าร้องขอ ตลอดจนดูแลและบำรุงรักษาระบบเครือข่ายให้พร้อมในการใช้งานอยู่ตลอดเวลา

นอกจากนี้ สมาชิกต้องจัดให้มีแผนสำรองและระบบสำรองของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่เชื่อมต่อกับระบบการซื้อขายที่สามารถทำงานได้ทันที และจัดให้มีการทดสอบแผนสำรองและระบบสำรองดังกล่าวอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง รวมทั้งเข้าร่วมการทดสอบระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกและระบบสำรองร่วมกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามที่กำหนด และจัดให้มีบุคลากรดูแลระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่ต่อเชื่อมกับระบบการซื้อขายอย่างเพียงพอ เพื่อประสานงานกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในช่วงเวลาทำการและนอกเวลาทำการ

การเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

หากสมาชิกประสงค์จะเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติมระบบส่งคำสั่งซื้อขาย สมาชิกสามารถติดต่อสอบถามและนำส่งข้อมูลให้กับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าพิจารณาในเบื้องต้นว่าการเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติมระบบนั้นต้องให้สมาชิกดำเนินการขออนุญาตก่อนใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายนั้นหรือไม่ โดยกรณีที่ต้องขออนุญาตสมาชิกสามารถศึกษารายละเอียดที่ต้องดำเนินการได้จากแนวทางการขออนุญาตต่อเชื่อมระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

การติดต่อสอบถามข้อมูล

- รายละเอียดการขออนุญาตเชื่อมต่อบริษัท ติดต่อสอบถามได้ที่ ส่วนซื้อขายอนุพันธ์ ฝ่ายปฏิบัติการซื้อขายอนุพันธ์ E-mail: DerivativesTradingDepartment@set.or.th
- รายละเอียดการเชื่อมต่อทางด้านเครือข่าย ติดต่อสอบถามได้ที่ SET Contact Center โทร. 0-2009-9000 E-mail: SETContactCenter@set.or.th
- รายละเอียดการเชื่อมต่อทางด้านเทคนิค ติดต่อสอบถามได้ที่ ส่วนพัฒนาระบบซื้อขายอนุพันธ์ ฝ่ายพัฒนาระบบซื้อขาย E-mail: TradingSystemsDepartment@set.or.th