

## ผลการรับฟังความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้อง (hearing)

เรื่องการแก้ไขร่างประกาศหลักเกณฑ์การประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า  
สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ เพื่อให้รองรับ  
มาตรฐานสากลและการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบสารสนเทศ

การรับฟังความคิดเห็นของสำนักงาน มี 2 รูปแบบ ดังนี้

- (1) เมื่อวันที่ 17 ธันวาคม 2558 สำนักงานส่งหนังสือถึงศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชีและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์เพื่อขอฟังความคิดเห็นเกี่ยวกับประกาศโดยตรง
- (2) เมื่อวันที่ 8 มกราคม – 8 มีนาคม 2559 จัดให้มีการรับฟังความคิดเห็นผ่านทางเว็บไซต์ของสำนักงาน โดยภายหลังระยะเวลาดังกล่าว พบว่ามีผู้เข้าชมจำนวน 173 ราย แต่ไม่มีผู้ตอบกลับความคิดเห็น

ผลการรับฟังความคิดเห็น

1. ร่างประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. /25.. เรื่อง การออกใบอนุญาตประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาและสำนักหักบัญชีสัญญา
  - ประเด็นที่ปรับปรุง: ปรับเพิ่มทุนจดทะเบียนของผู้ขอใบอนุญาตเป็นสำนักหักบัญชีสัญญาเป็น 300 ล้านบาท (จากเดิมที่กำหนดไว้ที่ 100 ล้านบาท) เพื่อให้มั่นใจว่าสำนักหักบัญชีสัญญา มีฐานะการเงินที่มั่นคง น่าเชื่อถือ และสอดคล้องกับมาตรฐานสากลยิ่งขึ้น
  - ผลการรับฟังความคิดเห็น: ไม่มีผู้แสดงความเห็น
2. ร่างประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนและร่างประกาศสำนักงานรวม 5 ฉบับ ดังนี้
  - ร่างประกาศ ที่ ทธ. /25.. เรื่อง หลักเกณฑ์ในการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญา
  - ร่างประกาศ ที่ ทธ. /25.. เรื่อง หลักเกณฑ์ในการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีสัญญา
  - ร่างประกาศ ที่ ทธ. /25.. เรื่อง หลักเกณฑ์ในการประกอบการเป็นสำนักหักบัญชีและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์
  - ร่างประกาศ ที่ สธ. /25.. เรื่อง ข้อกำหนดในรายละเอียดเกี่ยวกับแหล่งเงินทุนและการบริหารจัดการความเสี่ยงของสำนักหักบัญชีสัญญา
  - ร่างประกาศ ที่ สธ. /25.. เรื่อง ข้อกำหนดในรายละเอียดเกี่ยวกับแหล่งเงินทุนและการบริหารจัดการความเสี่ยงของสำนักหักบัญชี
  - ประเด็นที่ปรับปรุง: ปรับปรุงหลักเกณฑ์ในการประกอบการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญา สำนักหักบัญชีสัญญา สำนักหักบัญชีและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ เพื่อให้สอดคล้องกับมาตรฐานสากลและ พัฒนาการทางด้านเทคโนโลยีในส่วนการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบสารสนเทศมากยิ่งขึ้น
  - ผลการรับฟังความคิดเห็น: สรุปประเด็นความคิดเห็นที่สำคัญ ดังนี้

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p>1.การมีผลบังคับใช้ของประกาศหลักเกณฑ์เป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาสำนักหักบัญชีสัญญา สำนักหักบัญชีและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</p>	<p>ขอให้ประกาศมีผลบังคับใช้กลางปี 2560 เพื่อให้ศูนย์ซื้อขายสัญญา สำนักหักบัญชีสัญญา สำนักหักบัญชีและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ซึ่งต่อไปจะใช้คำย่อว่า “บริษัท”) มีเวลาเตรียมการเพื่อดำเนินการให้เป็นไปตามที่ประกาศกำหนดได้</p>	<p>สำนักงานเห็นควรขยายเวลาตามที่เสนอเหตุผล จากการประสานงานและประเมินการดำเนินงานของบริษัท สำนักงานเห็นว่า บริษัทได้มีการดำเนินการปรับปรุงระบบงานตามสมควรแล้ว และไม่มีเรื่องเร่งด่วนที่ต้องดำเนินการ</p>
<p>2. คุณสมบัติกรรมการอิสระของสำนักหักบัญชีสัญญา สำนักหักบัญชีและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</p> <p>ประกาศกำหนดให้</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- สำนักหักบัญชี: มีกรรมการอิสระอย่างน้อย 1/3 และมีจำนวนไม่น้อยกว่า 2 คน</li> <li>- ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์: มีกรรมการอิสระอย่างน้อย 1 คน</li> <li>- กรรมการอิสระต้องเป็นผู้ที่สามารถปฏิบัติหน้าที่ของตนได้อย่างอิสระ เป็นกลาง และมีความเป็นธรรม คำนึงถึงประโยชน์ส่วนรวม(ของสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์) และความมั่นคงปลอดภัยและเสถียรภาพของระบบตลาดทุนเป็นสำคัญ</li> </ul>	<p>กรรมการอิสระควรต้องเป็นผู้ที่มีความรู้เกี่ยวกับงานสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ เพื่อให้สามารถแสดงความคิดเห็นที่เป็นประโยชน์ได้ ดังนั้น เห็นควรให้ตัวแทนจากสมาชิกหรือบริษัทที่มีความสัมพันธ์ทางธุรกิจอย่างมีนัยสำคัญกับสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์เป็นกรรมการอิสระได้</p>	<p>สำนักงานเห็นด้วยว่า สมาชิกเป็นผู้ที่มีความรู้และสามารถให้ความคิดเห็นอันเป็นประโยชน์ต่องานสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ได้ แต่เนื่องจากบทบาทและภาระหน้าที่ของสมาชิกซึ่งมี commercial interest อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ต่องานของสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ที่เน้นการจัดการความเสี่ยงในภาพรวมของระบบการชำระราคาและส่งมอบได้ ดังนั้น สำนักงานจึงเห็นควรปรับปรุงประกาศโดยนำแนวทางกรรมการอิสระซึ่งใช้กับบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์มาใช้ (ทจ.28/2551) ดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- กรรมการอิสระต้องไม่มีลักษณะดังนี้ <ul style="list-style-type: none"> <li>(1) เป็นหรือเคยเป็นกรรมการที่มีส่วนร่วมบริหารงาน ผู้จัดการ บุคคลผู้มีอำนาจในการ</li> </ul> </li> </ul>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p>- กรรมการอิสระต้องไม่มีลักษณะดังนี้</p> <p>(1) เป็นผู้จัดการ บุคคลผู้มีอำนาจในการบริหารงานประจำ พนักงาน ลูกจ้าง ที่ปรึกษา หรือตำแหน่งอื่นใดในสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</p> <p>(2) เป็นกรรมการ ผู้จัดการ บุคคล ผู้มีอำนาจในการบริหารงานประจำ พนักงาน ลูกจ้าง ที่ปรึกษาของ <u>สมาชิกหรือองค์กร ที่มี</u> <u>ความสัมพันธ์ทางธุรกิจอย่างมีนัยสำคัญกับ</u> <u>สำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</u></p> <p>(3) เป็นผู้ถือหุ้นที่มีอำนาจควบคุมกิจการของสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</p> <p>(4) เป็นกรรมการหรือผู้บริหารของสำนักหักบัญชีอื่นหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์อื่น</p>		<p>บริหารงานประจำ พนักงาน ลูกจ้าง ที่ปรึกษา หรือตำแหน่งอื่นใดของสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ และบริษัทในเครือของ <u>สำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</u> <u>แล้วแต่กรณี เว้นแต่จะได้พ้นจากการมีลักษณะดังกล่าวมาแล้วไม่น้อยกว่า 2 ปีก่อนวันที่รับตำแหน่ง”</u></p> <p>(2) เป็นกรรมการ ผู้จัดการ บุคคล ผู้มีอำนาจในการบริหารงานประจำ พนักงาน ลูกจ้าง รวมทั้ง <u>บุคคลที่มีส่วนร่วมบริหารงานของสมาชิก</u></p> <p>(3) เป็นผู้ถือหุ้นที่มีอำนาจควบคุมกิจการของสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</p> <p>(4) <u>เป็นบุคคลอื่นใดที่ไม่สามารถให้ความเห็นได้</u> <u>อย่างเป็นอิสระเกี่ยวกับการดำเนินงานของ</u> <u>สำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</u></p>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p>- สำนักหักบัญชีต้องจัดให้มี<b>คณะกรรมการบริหารความเสี่ยง</b>ที่ทำหน้าที่กำหนดนโยบายในการบริหารจัดการความเสี่ยงและติดตามให้มีการปฏิบัติตามนโยบายดังกล่าว โดยกรรมการในคณะกรรมการนี้ต้องแต่งตั้งจากผู้ที่มีความรู้และมีประสบการณ์ในการซื้อขายหลักทรัพย์ การบริหารความเสี่ยง หรือ การบริหารงานสำนักหักบัญชี ทั้งนี้ <u>ประธานกรรมการต้องเป็นผู้ที่สามารถให้ความเห็นของตนได้โดยอิสระ และกรรมการจำนวนไม่น้อยกว่ากึ่งหนึ่งของจำนวนกรรมการทั้งหมด ต้องเป็นกรรมการอิสระ</u></p>		<p>- สำหรับคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงของสำนักหักบัญชี สำนักงานเห็นว่าเป็นเรื่องการบริหารงานภายในของสำนักหักบัญชีในการพิจารณาความเสี่ยง อีกทั้งมาตรฐานสากลยังกำหนดให้ประธานและกรรมการส่วนใหญ่ของคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงต้องเป็นอิสระจากฝ่ายจัดการ (executive management) จึงเห็นควรปรับถ้อยคำเป็นดังนี้“<u>ประธานกรรมการและกรรมการจำนวนไม่น้อยกว่ากึ่งหนึ่งของจำนวนกรรมการทั้งหมด ต้องมิใช่บุคคลที่มาจากฝ่ายจัดการของสำนักหักบัญชีหรือบริษัทในเครือของสำนักหักบัญชี</u>”</p>
<p><b>3. การบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจ</b></p> <p>ศูนย์ซื้อขายสัญญา สำนักหักบัญชี และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีมาตรการที่มีประสิทธิภาพในการควบคุมติดตามการปฏิบัติตามนโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง <b>และสื่อสารเรื่องดังกล่าวผ่านวิธีการที่</b></p>	<p>ประกาศกำหนดให้บริษัทต้องจัดให้มีมาตรการที่มีประสิทธิภาพในการควบคุม ติดตามการปฏิบัติตามนโยบายการบริหารความต่อเนื่องในการดำเนินธุรกิจและแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง และสื่อสารเรื่องดังกล่าวผ่านวิธีการที่เหมาะสมเพื่อให้สมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้องสามารถปฏิบัติตามได้อย่างมีประสิทธิภาพ</p>	<p>สำนักงานไม่ได้มีแนวทางให้บริษัทนำแผน BCP เผยแพร่ให้กับสมาชิกทราบ แต่สำนักงานคาดหวังว่าบริษัทต้องมีวิธีการหรือช่องทางในการสื่อสาร (communication protocol) และทำความเข้าใจกับสมาชิกเพื่อให้สมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้องสามารถดำเนินการหรือปฏิบัติตามนโยบายและแผน BCP ที่บริษัทได้กำหนดไว้ อย่างมีประสิทธิภาพ</p>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p>เหมาะสมเพื่อให้สมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้องสามารถปฏิบัติตามได้อย่างมีประสิทธิภาพ</p>	<p>โดยขอตัดการสื่อสารต่อสมาชิก เพราะมองว่าแผน BCP เป็นข้อมูลที่เป็นความลับ ไม่สามารถเผยแพร่แก่บุคคลอื่นได้ โดยทางปฏิบัติจะแจ้งสมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้องให้ทดสอบแผน BCP ร่วมกัน</p>	<p>ดังนั้น เพื่อให้มีความชัดเจนยิ่งขึ้น สำนักงานเห็นควรปรับถ้อยคำใหม่ ดังนี้ “บริษัทต้องจัดให้มีมาตรการควบคุมติดตามและสื่อสารกับสมาชิก เพื่อให้ปฏิบัติตามนโยบายและแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่องได้อย่างมีประสิทธิภาพ”</p>
<p><b>4. การทบทวน ติดตามและตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับงาน</b></p> <p>ทบทวน ติดตามและตรวจสอบขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญา การชำระหนี้ หรือการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ตามแผนการตรวจสอบซึ่งจัดทำตามระดับความเสี่ยงขององค์กรอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง โดยผู้ที่มีความรู้ความสามารถและมีความเป็นอิสระ เช่น ผู้ตรวจสอบภายในหรือภายนอก (internal or external auditor) เป็นต้น และส่งรายงานผลการทบทวน ติดตามและตรวจสอบรายปีต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ภายในไตรมาสแรกของปีถัดไป 60 วันนับจากวันที่ได้เสนอรายงานดังกล่าวต่อ</p>	<p>ขอปรับระยะเวลาที่กำหนดให้ทบทวน ติดตามและตรวจสอบขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับงาน จาก อย่างน้อยปีละครั้ง เป็น ตามแผนการตรวจสอบซึ่งจัดทำตามระดับความเสี่ยงขององค์กร แทน</p> <p>ขอปรับระยะเวลาในการส่งรายงานผลการทบทวน ติดตามและตรวจสอบต่อสำนักงาน จากรายปี โดยให้ส่งภายในไตรมาสแรกของปีถัดไป เป็น นับจาก 60 วันจากวันที่ได้เสนอรายงานต่อคณะกรรมการบริษัท หรือคณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการบริษัท</p>	<p>สำนักงานเห็นด้วยตามข้อเสนอที่ว่า การทบทวน ติดตามและตรวจสอบขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานของระบบคอมพิวเตอร์ควรเป็นไปตามแผนการตรวจสอบซึ่งจัดทำตามระดับความเสี่ยงขององค์กร (risk base) อย่างไรก็ตาม เพื่อให้สำนักงานทราบถึงแผนและผลการตรวจสอบตามผลการประเมินความเสี่ยงดังกล่าว สำนักงานเห็นควรปรับถ้อยคำ ดังนี้</p> <p>“ทบทวน ติดตามและตรวจสอบขั้นตอนหรือกระบวนการปฏิบัติงานของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญา การติดตามและตรวจสอบการซื้อขาย (surveillance) การชำระหนี้ และการชำระราคาและส่งมอบ ตามแผนการตรวจสอบซึ่งจัดทำตามระดับความเสี่ยงขององค์กร โดยผู้ที่มีความรู้ความสามารถและมีความเป็นอิสระ เช่น ผู้ตรวจสอบภายในหรือ</p>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p>คณะกรรมการของบริษัทหรือคณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าว</p>		<p>ภายนอก (internal or external auditor) เป็นต้น ทั้งนี้ให้บริษัทนำส่ง</p> <p>(1) แผนการตรวจสอบซึ่งจัดทำตามระดับความเสี่ยงขององค์กรตามรอบที่จัดทำแผน</p> <p>(2) รายงานผลการทบทวน ติดตามและตรวจสอบเฉพาะที่เกี่ยวข้องกับระบบซื้อขายสัญญา การติดตามและตรวจสอบการซื้อขาย (surveillance) และการชำระราคาและส่งมอบภายใน 60 วันนับจากวันที่ได้เสนอรายงานดังกล่าวต่อคณะกรรมการหรือคณะทำงานที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการดังกล่าว”</p>
<p><b>5. การบริหารจัดการเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย (incident management)</b></p> <p>“เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย” หมายความว่า</p> <p>(1) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาไม่สามารถดำเนินการได้ตามปกติ อันเป็นผลทำให้การให้บริการหยุดชะงักซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อความเชื่อมั่นของบริษัท</p>	<p>ขอปรับให้เหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย ให้ความหมายรวมถึง เฉพาะเหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบในวงกว้างและกระทบชื่อเสียงของบริษัทอย่างมีนัยสำคัญเท่านั้น</p> <p>(1) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องไม่สามารถดำเนินการได้ตามปกติอันเป็นผลทำให้การให้บริการหยุดชะงักซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อความเชื่อมั่นของบริษัทอย่างร้ายแรง</p>	<p>ด้วยเหตุการณ์ทั้ง 3 เป็นเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยต่อระบบสารสนเทศและความเชื่อมั่นต่อการดำเนินงานของบริษัท ดังนั้น การรวบรวมข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับเหตุการณ์อย่างเพียงพอต่อการนำไปติดตาม วิเคราะห์สาเหตุของปัญหา ช่องโหว่หรือความเสี่ยงที่เกี่ยวข้อง เพื่อนำไปปรับปรุงระบบงานและหาแนวทางป้องกันเหตุการณ์ดังกล่าว จึงถือเป็นวิธีการบริหารจัดการกับเหตุการณ์ที่ได้รับการยอมรับว่า มีประสิทธิภาพและเป็นมาตรฐานสากล (NIST)</p>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p><b>อย่างร้ายแรง (system disruption and system degrade)</b></p> <p>(2) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาไม้อาจดำเนินการให้เป็นไปตามกฎหมาย กฎเกณฑ์ <b>ระเบียบ</b> ข้อบังคับที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. คณะกรรมการกำกับตลาดทุน สำนักงาน ก.ล.ต. หรือศูนย์ซื้อขายสัญญากำหนด (system non-compliance) <b>ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อความเชื่อมั่นของบริษัทอย่างร้ายแรง</b></p> <p>(3) เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาอันเกิดจากการบุกรุก (system intrusion) <b>ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อความเชื่อมั่นของบริษัทอย่างร้ายแรง (เฉพาะ successful attempt)</b></p>	<p>(2) เหตุการณ์ที่ทำให้ระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องไม้อาจดำเนินการให้เป็นไปตามกฎหมาย กฎเกณฑ์ที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. คณะกรรมการกำกับตลาดทุน สำนักงาน ก.ล.ต. หรือที่บริษัทกำหนด <b>ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อความเชื่อมั่นของบริษัทอย่างร้ายแรง</b></p> <p>(3) เหตุการณ์ที่ส่งผลกระทบต่อระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องอันเกิดจากการบุกรุก <b>ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อความเชื่อมั่นของบริษัทอย่างร้ายแรง (เฉพาะ successful attempt)</b></p>	<p>อย่างไรก็ตาม สำนักงานเห็นด้วยกับข้อเสนอที่จะให้บริษัทรายงานเหตุการณ์เฉพาะกรณีที่มีกระทบต่อความเชื่อมั่นอย่างร้ายแรงเพื่อมิให้เป็นภาระต่อบริษัทมากเกินไป แต่เห็นควรให้บริษัทจัดเก็บข้อมูลเหตุการณ์ที่มีผลกระทบต่อระบบทุกกรณีเพื่อนำไปวิเคราะห์และอ้างอิงได้</p>
<p>เมื่อปรากฏข้อเท็จจริงว่ามีเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยเกิดขึ้น ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาจัดเก็บข้อมูล ทำบันทึกสาเหตุ สภาพการณ์ และแนวทางแก้ไขปัญหาเกี่ยวกับเหตุการณ์ดังกล่าว</p>	<p>เมื่อมีเหตุการณ์ตาม (1) – (3) ข้างต้น บริษัทจะขอเก็บข้อมูลเกี่ยวกับเหตุการณ์ดังกล่าว โดยไม่ทำบันทึกสาเหตุ สภาพการณ์และแนวทางแก้ไข ปัญหาของเหตุการณ์ตามที่ร่างประกาศกำหนด</p>	

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p style="color: red;">ในกรณีที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาไม่สามารถดำเนินการแก้ไขเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยได้ตามระยะเวลาที่กำหนดไว้ ระบบงาน (recovery time objective) ที่กำหนดไว้ในแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง ให้ศูนย์ซื้อขายสัญญารายงานความคืบหน้าในการแก้ไขปัญหาให้สำนักงาน ก.ล.ต. ทราบทุก 1 ชั่วโมงโดยทางจดหมายอิเล็กทรอนิกส์จนกว่าจะสามารถกลับมาดำเนินธุรกิจตามปกติได้</p>	<p>ขอตัดการกำหนดให้บริษัทรายงานความคืบหน้าในการแก้ไขปัญหาในกรณีที่บริษัทไม่สามารถดำเนินการแก้ไขเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัยได้ตามระยะเวลาที่กำหนดในแผนการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง ( recovery time objective) เพราะเห็นว่าควรให้ความสำคัญกับการเร่งแก้ไขปัญหาเพื่อให้เปิดให้บริการได้โดยเร็วก่อน โดยสำนักงานอาจประสานงานกับบริษัททางโทรศัพท์ เพื่อสอบถามความคืบหน้ารวมทั้งบริษัทจะแจ้งให้สำนักงานและผู้ที่เกี่ยวข้องทราบก่อนเปิดให้บริการเป็นการล่วงหน้า</p>	<p>สำนักงานเห็นด้วยตามข้อเสนอของบริษัท ทั้งนี้ สำนักงานจะพิจารณาช่องทางที่เหมาะสมในการประสานงานกับบริษัทในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่อาจส่งผลกระทบต่อความมั่นคงปลอดภัย</p>
<p><b>6.การรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ</b></p> <p>กำหนดนโยบายและมาตรการควบคุมการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศให้เป็นไปตามมาตรฐานที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับได้หรือแนวทางปฏิบัติอื่นที่บรรลุดูประสงค์และมีประสิทธิภาพเพียงพอและอยู่ในมาตรฐานที่ยอมรับได้ในอุตสาหกรรม ซึ่ง</p>	<p>ปรับถ้อยคำ โดยเพิ่มเติมให้บริษัทกำหนดนโยบายและมาตรการควบคุมการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศให้เป็นไปตามมาตรฐานที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับได้ หรือ <u>แนวทางปฏิบัติอื่นที่บรรลุดูประสงค์และมีประสิทธิภาพเพียงพอและอยู่ในมาตรฐานที่ยอมรับได้ในอุตสาหกรรม</u></p>	<p>สำนักงานเห็นด้วยตามข้อเสนอของบริษัท สำนักงานคาดหวังให้บริษัทต้องมีการกำกับดูแลในเรื่องการรักษาความมั่นคงปลอดภัยทางด้านเทคโนโลยีสารสนเทศที่มีประสิทธิภาพเพียงพอเพื่อรักษาไว้ซึ่งความลับของข้อมูล (confidentiality) ความถูกต้องน่าเชื่อถือ (integrity) และความพร้อมใช้งาน (availability) สำนักงานจึงได้ออกแนวทางปฏิบัติในการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบสารสนเทศของ</p>



เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p>นโยบายดังกล่าวต้องได้รับความเห็นชอบจากผู้จัดการหรือเทียบเท่าโดยต้องมีการทบทวนและปรับปรุงให้สอดคล้องและเหมาะสมกับความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศในปัจจุบัน</p>		<p>ผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งอ้างอิงจากมาตรฐาน ISO27001 เพื่อเป็นแนวทางในการปฏิบัติให้ได้ตามความคาดหวังของสำนักงาน อย่างไรก็ตาม หากบริษัทแสดงให้สำนักงานเห็นได้ว่าการกำกับดูแลการรักษาความมั่นคงปลอดภัยทางด้านเทคโนโลยีสารสนเทศตามแนวทางอื่นที่บริษัทเลือกใช้ สามารถบรรลุวัตถุประสงค์ได้ตามความคาดหวังดังกล่าว บริษัทก็สามารถดำเนินการได้</p> <p>ทั้งนี้ สำนักงานเห็นควรชี้แจงความคาดหวังในการจัดเก็บหลักฐานการใช้งาน (log) ให้ชัดเจนยิ่งขึ้น ดังนี้</p> <p>การบันทึก จัดเก็บหลักฐานและติดตามการควบคุมการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศตามแนวปฏิบัติในการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ มีวัตถุประสงค์เพื่อบันทึกและจัดเก็บหลักฐานการใช้งานเกี่ยวกับระบบสารสนเทศอย่างครบถ้วนและเพียงพอสำหรับการตรวจสอบการลวงรู้ข้อมูลภายในระหว่างหน่วยงานและบุคลากร การสอบถามการใช้งานข้อมูลและระบบ</p>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
		<p>สารสนเทศตามหน้าที่ที่ผู้ปฏิบัติงานได้รับมอบหมาย การตรวจสอบการเข้าใช้งานระบบสารสนเทศโดย บุคลากรที่ไม่มีอำนาจหน้าที่เกี่ยวข้อง การตรวจสอบและ ป้องกันการใช้งานระบบสารสนเทศที่มีความผิดปกติ หรือไม่เป็นไปตามกฎหมายหรือหลักเกณฑ์ของทางการ รวมทั้งเพื่อให้มีการติดตามและวิเคราะห์หลักฐานที่ จัดเก็บได้อย่างมีประสิทธิภาพ</p> <p>สำนักงานเห็นว่าการจัดเก็บข้อมูลจราจรทาง คอมพิวเตอร์ตามที่กำหนดไว้ใน พรบ. ว่าด้วยการกระทำ ความผิดเกี่ยวกับคอมพิวเตอร์อาจไม่เพียงพอเพื่อให้ บรรลุวัตถุประสงค์ดังกล่าว</p> <p>สำนักงานเห็นว่าบริษัทควรบันทึกและจัดเก็บหลักฐาน (log) เพิ่มเติมอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● หลักฐานการเข้าถึงพื้นที่หวงห้าม (physical access log)</li> <li>● หลักฐานการเข้าถึงระบบปฏิบัติการ ฐานข้อมูลและ ระบบเครือข่ายคอมพิวเตอร์ (authentication log)</li> <li>● หลักฐานการเข้าถึงและใช้งานระบบสารสนเทศ (application log)</li> </ul>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
		<ul style="list-style-type: none"> <li>หลักฐานการใช้งานอินเทอร์เน็ตผ่านระบบเครือข่ายคอมพิวเตอร์ภายในของผู้ประกอบธุรกิจ (internet access log)</li> </ul>
<p>หลักฐานการใช้งานรวมถึงเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศตามข้อ 32(2) ให้เก็บรักษาไม่น้อยกว่าที่กฎหมายกำหนด 90 วัน นับแต่วันที่มีการดำเนินการนั้น</p> <p>การจัดเก็บข้อมูล เอกสารและหลักฐานตาม (1) ถึง (7) ให้บริษัทเก็บไว้ในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงาน ก.ล.ต. ศึกษาคูหรือตรวจสอบได้โดยเร็ว</p>	<p>ปรับระยะเวลาในการจัดเก็บหลักฐานการใช้งาน (log) และเหตุการณ์ที่เกิดจากการใช้ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ จาก 90 วันนับแต่วันที่มีการดำเนินการ เป็น เก็บไว้ไม่น้อยกว่าที่กฎหมายกำหนด เนื่องจาก พรบ.คอมพิวเตอร์กำหนดระยะเวลาในการจัดเก็บ log ไว้อยู่แล้ว จึงควรอ้างอิงจาก พรบ. ดังกล่าวเพื่อลดภาระในการปฏิบัติตามเกณฑ์ที่อาจแตกต่างกัน</p>	<p>โดยหลักการแล้วสำนักงานมีความเห็นตรงกันกับข้อเสนอของบริษัทในเรื่องระยะเวลาของการบันทึกและจัดเก็บหลักฐานการใช้งาน (log) ของระบบคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญา การชำระราคาและส่งมอบไว้ที่ 90 วัน ซึ่งสอดคล้องกับ พรบ. ว่าด้วยการกระทำความผิดเกี่ยวกับคอมพิวเตอร์ อย่างไรก็ดี เพื่อให้มีความชัดเจนในเรื่องระยะเวลาในการจัดเก็บหลักฐานดังกล่าว สำนักงานเห็นควรปรับปรับถ้อยคำ โดยเพิ่มเติม “ระยะเวลาที่กฎหมายกำหนด” เข้าไป และสำนักงานไม่ขัดข้องที่จะตัดคำว่า “โดยเร็ว” ออกตามที่เสนอมา</p>
<p>7. กรณีที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาให้บริการเช่าพื้นที่วางเซิร์ฟเวอร์แก่สมาชิก เพื่อให้สามารถรับส่งข้อมูลหรือคำสั่งซื้อขายได้อย่างรวดเร็ว (co-location) หรือให้บริการข้อมูล</p>	<p>จากเดิมที่กำหนดให้ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องให้ข้อมูลเกี่ยวกับการให้บริการและโอกาสในการใช้บริการ ตลอดจนเงื่อนไขการใช้บริการแก่สมาชิกทุกรายอย่างทั่วถึงและเป็นธรรม นั้น</p>	<p>บริการ co-location และบริการ market data feed เป็นบริการที่ช่วยเพิ่มประสิทธิภาพในซื้อขายหลักทรัพย์ ซึ่งบริษัทหลักทรัพย์ที่สามารถเข้าถึงบริการดังกล่าวสามารถสร้างความได้เปรียบจากการรับ-ส่งคำสั่งซื้อขายหรือทราบข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์ที่รวดเร็วกว่า</p>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p><b>ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย (market data feed)</b></p> <p>ในกรณีที่ศูนย์ซื้อขายสัญญาให้บริการให้เช่าพื้นที่วางเซิร์ฟเวอร์ (server) แก่สมาชิกของศูนย์ซื้อขายสัญญา เพื่อให้สามารถรับส่งข้อมูลหรือคำสั่งซื้อขายได้อย่างรวดเร็ว (co-location) หรือให้บริการข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย (market data feed) ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องให้ข้อมูลเกี่ยวกับการให้บริการและโอกาสในการใช้บริการ ตลอดจนเงื่อนไขการใช้บริการดังกล่าวแก่สมาชิกทุกรายอย่างทั่วถึงและเป็นธรรม</p>	<p>บริษัทขอตัดถ้อยคำ “โอกาสในการใช้บริการ ตลอดจนเงื่อนไขการใช้บริการดังกล่าว” และ “เป็นธรรม” ออก เนื่องจากบริษัทจะให้ข้อมูลเกี่ยวกับบริการบน website เพื่อให้ผู้ที่สนใจได้รับข้อมูลอย่างเพียงพอและทั่วถึงเพราะเห็นว่าน่าจะมีคามยืดหยุ่นในการดำเนินการมากกว่า</p>	<p>ดังนั้น การให้บริการดังกล่าวจึงควรถูกดำเนินการด้วยความเป็นธรรมและโปร่งใสตามวิธีการดำเนินการธุรกิจแบบปกติ ไม่มีลักษณะของการกีดกันการเข้าถึงบริการ ซึ่งสอดคล้องกับวัตถุประสงค์ของ IOSCO (principles of securities regulation) อย่างไรก็ดี เพื่อให้มีความยืดหยุ่นต่อการดำเนินธุรกิจ สำนักงานจึงขอปรับปรุงถ้อยคำเป็น “ศูนย์ซื้อขายสัญญาต้องให้ข้อมูลเกี่ยวกับการให้บริการและโอกาสในการใช้บริการแก่สมาชิกทุกรายอย่างโปร่งใสและเป็นธรรม” รวมทั้งจะกำหนดแนวทางการตีความในหนังสือช้กข้อคมความเข้าใจ เพื่อให้การบังคับใช้มีความชัดเจนยิ่งขึ้นด้วย</p>
<p><b>8.ระบบการจัดการเกี่ยวกับข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาท</b></p> <p>จัดทำรายงานสรุปข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ทุก 6 เดือน ในกรณีที่น่าปรากฏว่ามีข้อเท็จจริงเพียงพอที่จะแสดงให้เห็นได้ว่าผู้ร้องเรียนหรือคู่พิพาทได้รับหรืออาจได้รับความเสียหายจากการร้องเรียนหรือการมี</p>	<p>ขอเก็บรายงานสรุปข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทไว้ให้สำนักงานตรวจสอบแทนการส่งต่อสำนักงานทุก 6 เดือน ทั้งนี้ หากเป็นข้อร้องเรียนที่เกี่ยวข้องกับสำนักงาน บริษัทจะประสานงานเพื่อส่งเรื่องให้สำนักงานพิจารณาต่อไป</p>	<p>สำนักงานไม่มีวัตถุประสงค์ที่จะเพิ่มภาระในการกำกับดูแลแก่บริษัท ทั้งนี้ เพื่อให้การรายงานสรุปข้อร้องเรียนดังกล่าวสอดคล้องกับแนวทางที่บริษัทดำเนินการอยู่ สำนักงานเห็นควรปรับปรุงถ้อยคำใหม่เป็น “จัดทำรายงานสรุปข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ทุก 6 เดือน ทั้งนี้ ในรายงานดังกล่าว</p>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p>ข้อพิพาทนั้น ทั้งนี้ ในรายงานดังกล่าวต้องมีบทสรุปสาระสำคัญ และผลการพิจารณาหรือการดำเนินการของบริษัทในแต่ละกรณี</p>		<p>ต้องมีบทสรุปสาระสำคัญ และผลการพิจารณาหรือการดำเนินการของบริษัท”</p> <p>นอกจากนี้ สำนักงานเห็นว่า บริษัทควรต้องคำนึงถึงการคุ้มครองผู้ร้องเรียน เพื่อป้องกันมิให้ผู้ร้องเรียนได้รับผลกระทบหรือการปฏิบัติที่ไม่เหมาะสม จึงปรับปรุงเพิ่มให้บริษัทต้อง “จัดให้มีระเบียบปฏิบัติที่เป็นลายลักษณ์อักษรเกี่ยวกับการจัดการข้อร้องเรียนหรือข้อพิพาทที่คำนึงถึงการคุ้มครองผู้ร้องเรียนด้วย”</p>
<p><b>9. การใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก</b></p> <p>ในการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก บริษัทต้องกำหนดพิจารณาประเด็นอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้</p> <p>(1) นโยบาย ขอบเขตและหรือลักษณะงานที่จะใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกเป็นลายลักษณ์อักษรโดยต้องได้รับความเห็นชอบเป็นการทั่วไปหรือเป็นรายการนี้จากคณะกรรมการของบริษัท หรือคณะทำงานที่คณะกรรมการดังกล่าวมอบหมาย</p>	<p>ปรับถ้อยคำจากเดิมที่กำหนดให้บริษัทต้องกำหนดหลักเกณฑ์ในการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก เป็นต้องพิจารณาเรื่องดังต่อไปนี้หากมีการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) นโยบาย ขอบเขตหรือลักษณะงานที่จะใช้ บริการ</li> <li>(2) มาตรการในการบริหารความเสี่ยง</li> <li>(3) มาตรการตรวจสอบการให้บริการของผู้ให้บริการภายนอกเฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับการใช้บริการของบริษัทเป็นไปตามสัญญาใช้บริการหรือข้อตกลงระหว่างกัน</li> </ol>	<p>สำนักงานเห็นด้วยในบางเรื่องตามที่บริษัทเสนอมาร้อยละตามที่สมควรเพื่อให้หลักการของประกาศสอดคล้องกับมาตรฐานของ IOSCO (principles on outsourcing) สำนักงานเห็นควรยื่นตามร่างประกาศเดิม โดยปรับถ้อยคำใหม่ให้สอดคล้องกับข้อเสนอ ดังนี้</p> <p>“ในการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอก บริษัทต้องกำหนดอย่างน้อยในเรื่องดังต่อไปนี้</p> <p>(1) นโยบาย ขอบเขตหรือลักษณะงานที่จะใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกเป็นลายลักษณ์อักษรโดยต้องได้รับความเห็นชอบเป็นการทั่วไปหรือเป็นรายการนี้จาก</p>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p>(2) มาตรการในการบริหารจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกที่เหมาะสมและมีประสิทธิภาพ</p> <p>(3) มาตรการตรวจสอบการให้บริการของผู้ให้บริการภายนอกที่มีประสิทธิภาพเพื่อให้การปฏิบัติงานของผู้ให้บริการภายนอกเฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับการใช้บริการของบริษัทเป็นไปตามสัญญาใช้บริการหรือเป็นไปตามวัตถุประสงค์ของบริษัทข้อตกลงระหว่างกัน</p>		<p>คณะกรรมการของบริษัท หรือคณะทำงานที่คณะกรรมการดังกล่าวมอบหมาย</p> <p>(2) มาตรการในการบริหารจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการใช้บริการจากผู้ให้บริการภายนอกที่เหมาะสมและมีประสิทธิภาพ</p> <p>(3) มาตรการติดตามการให้บริการของผู้ให้บริการภายนอกที่มีประสิทธิภาพเพื่อให้การปฏิบัติงานของผู้ให้บริการภายนอกเฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับการใช้บริการของบริษัทเป็นไปตามสัญญาใช้บริการหรือข้อตกลงระหว่างกัน”</p>
<p><b>10.การจัดทำและเปิดเผยงบการเงิน</b></p> <p>ประกาศกำหนดให้</p> <p>สำนักหักบัญชีและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดทำและส่งงบการเงินประจำงวดการบัญชีสำหรับรอบปีที่ผู้สอบบัญชีตรวจสอบและแสดงความเห็นแล้วต่อสำนักงานจำนวน 1 ฉบับพร้อมทั้งดำเนินการดังนี้</p> <p>(1) เปิดเผยงบดุล งบกำไรขาดทุนและรายงานของผู้สอบบัญชีเพื่อให้ประชาชน</p>	<p>(1) ขอตัดข้อกำหนดให้เปิดเผยงบดุล งบกำไรขาดทุนและรายงานของผู้สอบบัญชี</p>	<p>เจตนารมณ์ของข้อนี้ กำหนดเพื่อให้สำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีงบดุล งบกำไรขาดทุน</p>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p>ตรวจดูได้ <u>ณ ที่ทำการของสำนักหักบัญชี หรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</u></p> <p>(2) ลงประกาศงบดุล งบกำไรขาดทุนและรายงานของผู้สอบบัญชีในหนังสือรายวัน <u>แห่งท้องถิ่นอย่างน้อย 1 ฉบับ</u> ตลอดจนส่งสำเนาหนังสือพิมพ์ฉบับที่ได้มีการลงประกาศดังกล่าวต่อสำนักงานจำนวน 1 ฉบับ</p>	<p><u>ณ ที่ทำการของสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</u> เนื่องจากที่ทำการตามที่จดทะเบียนกับกระทรวงพาณิชย์เป็นอาคารสำนักงานซึ่งบุคคลภายนอกไม่สามารถเข้าไปดูได้</p>	<p>และรายงานผู้สอบบัญชีหากมีผู้ต้องการถามถึง ณ สถานที่ให้บริการสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ โดยอาจจะใช้วิธีการใดเป็นเรื่องที่สำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์เห็นสมควรและเหมาะสมตามสถานการณ์ของผู้ร้องขอ (เช่น ติดประกาศในบริเวณที่คนภายนอกเข้าถึงได้ แสดงเอกสารให้ผู้ร้องขอเห็นเป็นกระดาษหรือบนหน้าจอคอมพิวเตอร์ เป็นต้น)</p> <p>ดังนั้น เพื่อให้ถ้อยคำสอดคล้องกับเจตนารมณ์ข้างต้น สำนักงานเห็นควรปรับปรุงถ้อยคำเป็น “(1) จัดให้มีงบดุล งบกำไรขาดทุน และรายงานของผู้สอบบัญชีเพื่อให้ประชาชนตรวจดูได้ <u>ณ ที่ทำการของสำนักหักบัญชีหรือศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</u>”</p>
	<p>(2) ขอปรับปรุงวิธีการเปิดเผยงบดุล งบกำไรขาดทุน และรายงานของผู้สอบบัญชีผ่านสื่อ online แทนการลงประกาศในหนังสือพิมพ์รายวันแห่งท้องถิ่น เนื่องจากเห็นว่าในปัจจุบันแทบจะไม่มีใครอ่านหนังสือพิมพ์รายวันท้องถิ่นแล้ว</p>	<p>สำนักงานเห็นด้วยกับข้อเสนอ และจะปรับปรุงถ้อยคำเป็น “(2) เผยแพร่งบดุล งบกำไรขาดทุนและรายงานของผู้สอบบัญชีโดยลงประกาศในหนังสือพิมพ์รายวันอย่างน้อย 1 ฉบับหรือในเว็บไซต์ของบริษัท ในการนี้ให้ส่งเอกสารหลักฐานที่แสดงได้ว่าการลงประกาศดังกล่าวแล้วต่อสำนักงาน”</p>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p><b>11.การดูแลรักษาทรัพย์สินที่ได้รับมา หรือมีไว้เพื่อสมาชิก</b></p> <p>ประกาศกำหนดให้</p> <p>ในกรณีที่สำนักหักบัญชีจัดเก็บทรัพย์สินที่ได้รับมา หรือมีไว้เพื่อสมาชิกตามวิธีการดังต่อไปนี้ ให้ถือว่าเป็นการแยกทรัพย์สินและมีให้ถือว่าเป็นการมอบหมายให้ผู้อื่นดูแลรักษาทรัพย์สินดังกล่าว แทนตน</p> <p>(1) ในกรณีเป็นทรัพย์สินประเภทเงิน...</p> <p>(2) ในกรณีเป็นทรัพย์สินประเภทหลักทรัพย์ ..</p> <p>(3) ในกรณีเป็นทรัพย์สินอื่น ให้แยกไว้ในลักษณะที่สามารถชี้เฉพาะได้ว่าทรัพย์สินนั้นเป็นทรัพย์สินของสมาชิก <b>หรือลูกค้ำของสมาชิก</b> โดยปราศจากเหตุสงสัย</p>	<p>ตัดถ้อยคำ “หรือลูกค้ำของสมาชิก” เนื่องจาก TCH และ TSD รับผิดชอบในระดับสมาชิก</p>	<p>สำนักงานเห็นด้วยว่า สำนักหักบัญชีไม่ต้องจัดเก็บทรัพย์สินแยกสำหรับลูกค้ำแต่ละราย ซึ่งข้อความใน (3) เจตนาจะหมายถึง การจัดเก็บทรัพย์สินอื่นในส่วนที่เป็นของลูกค้ำทั้งหมดแยกจากส่วนที่เป็นของสมาชิกให้ชัดเจน ทำนองเดียวกันกับหุ้นหรือตราสารหนี้ จึงควรคงคำว่า “หรือลูกค้ำของสมาชิก” ไว้เช่นเดิม</p>
<p><b>12.ข้อกำหนดในรายละเอียดเกี่ยวกับแหล่งเงินทุนและการบริหารจัดการความเสี่ยงของสำนักหักบัญชี</b></p>	<p>(1) ปรับการรายงานผลการประเมินค่าความเสี่ยงสูงสุด (stress test) ต่อสำนักงาน จาก ทุกเดือน เป็น ทุกไตรมาส เพื่อให้เป็นไปตามที่กำหนดในประกาศปัจจุบัน</p>	<p>สำนักงานเห็นด้วยและจะปรับปรุงตามที่เสนอ</p>



เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p>ประกาศกำหนดให้</p> <p>(1) สำนักหักบัญชีประเมินค่าความเสี่ยงสูงสุด (stress test) เป็นประจำทุกวัน โดย สถานการณ์สมมุติ/ค่าตัวแปรและสมมติฐาน ที่ใช้เป็นไปตามแนวทางที่ได้รับอนุมัติจาก คณะกรรมการบริหารความเสี่ยง ซึ่งต้อง ครอบคลุมภาวะตลาดผันผวนสูงสุดที่มีโอกาส เกิดขึ้นและจัดส่งรายงานผลการประเมิน ดังกล่าวต่อสำนักงานเป็นประจำทุก <b>เดือน ไตรมาส</b> ภายในวันที่ 15 ของเดือนถัดไป</p> <p>(2) (ด้านหลักทรัพย์) สำนักหักบัญชีต้องคำนวณ มูลค่าความเสี่ยงของสมาชิกแต่ละรายจาก มูลค่าคงค้างชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ สุทธิเป็นประจำทุกวันตามความผันผวนของ ราคาหลักทรัพย์ โดยต้อง <b>ไม่นำมูลค่าคงค้าง สุทธิของสมาชิกไปหักกลับกับของลูกค้า</b> <b>คำนวณค่าความเสี่ยงของสมาชิกและของ ลูกค้าแยกออกจากกัน และไม่นำผลกำไรของ ลูกค้ามาหักล้างผลขาดทุนของสมาชิก</b></p> <p>(3) (ด้านอนุพันธ์) สำนักหักบัญชีต้องคำนวณ มูลค่าความเสี่ยงทุกวันตามความผันผวนของ ราคาและฐานะของสมาชิกและลูกค้า โดย</p>	<p>(2) ปรับถ้อยคำในประกาศให้ชัดเจนยิ่งขึ้นสำหรับการคำนวณมูลค่าความเสี่ยงของสมาชิกแต่ละ ราย (ด้านหลักทรัพย์) จาก ต้องไม่นำมูลค่าคงค้างชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์สุทธิของสมาชิกไปหักกลับกับของลูกค้า เป็น ต้องคำนวณค่าความเสี่ยงของสมาชิกและของลูกค้าแยกออกจากกัน และไม่นำผลกำไรของลูกค้ามาหักล้างผลขาดทุนของสมาชิก (ด้านอนุพันธ์) <u>เพิ่มข้อความ</u> โดยกรณีที่ราคามีความผันผวนมาก "และหลักประกันที่สมาชิกวางไว้มีไม่เพียงพอ" สำนักหักบัญชีอาจมีการเรียกหลักประกันระหว่างวัน</p>	<p>สำนักงานเห็นด้วยและจะปรับปรุงตามที่เสนอ</p>

เรื่อง	ความเห็นของผู้ประกอบธุรกิจ/ผู้ที่เกี่ยวข้อง	ความเห็นของสำนักงาน
<p>กรณีที่เราค่ามีความผันผวนมากและ  <u>หลักประกันที่สมาชิกวางไว้ไม่เพียงพอต้องมี</u>  การเรียกหลักประกันระหว่างวันและปรับ  มูลค่าหลักประกันที่วางไว้ให้เป็นปัจจุบันทุก  วัน นอกจากนี้ ต้องมีการคำนวณและเรียกให้  สมาชิกชำระผลขาดทุนจากฐานะสัญญาซื้อ  ขายล่วงหน้าที่เกิดขึ้นทุกวันเพื่อมิให้เกิดผล  ขาดทุนสะสม</p>		