

ที่ ปก.(ว) 5 / 2565

วันที่ 27 กันยายน 2565

เรื่อง การปรับปรุงแนวทางปฏิบัติในการคัดกรองลูกค้าที่ซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ Direct Market Access (DMA)

เรียน กรรมการผู้จัดการ
บริษัทสมาชิก และบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกทุกบริษัท

อ้างถึง หนังสือที่ ปก.(ว) 4/2564 เรื่องแนวทางปฏิบัติในการคัดกรองลูกค้าที่ซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ Direct Market Access (DMA) ลงวันที่ 15 มีนาคม 2564

สิ่งที่ส่งมาด้วย แนวทางปฏิบัติในการคัดกรองลูกค้าที่ซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ Direct Market Access (DMA)

ตามที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“ตลาดหลักทรัพย์ฯ”) ได้กำหนดแนวทางปฏิบัติในการคัดกรองลูกค้าที่ซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ Direct Market Access (DMA) เพื่อให้บริษัทสมาชิกมีมาตรฐานการปฏิบัติงานเป็นไปในแนวทางเดียวกัน รายละเอียดตามหนังสือที่อ้างถึงนั้น

เพื่อให้แนวทางปฏิบัติดังกล่าวมีความเหมาะสมและสอดคล้องกับการปรับปรุงนิยามผู้ลงทุน ตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กจ. 39/2564 เรื่อง การกำหนดบทนิยามผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และผู้ลงทุนรายใหญ่ ตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงได้ร่วมกับสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ปรับปรุงแนวทางปฏิบัติในการคัดกรองลูกค้าที่ซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ Direct Market Access (DMA) ดังมีรายละเอียดปรากฏตามสิ่งที่ส่งมาด้วย

ตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงขอยกเลิกแนวทางปฏิบัติและหนังสือเวียนฉบับที่อ้างถึง และกำหนดให้ใช้แนวทางปฏิบัติและหนังสือเวียนนี้แทน โดยให้มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2565 เป็นต้นไป

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ

(ลงนาม) ภัทรวลี สุวรรณศร

(นางสาวภัทรวลี สุวรรณศร)

รองผู้จัดการ

ลงนามแทน

กรรมการและผู้จัดการ

ฝ่ายปฏิบัติการซื้อขายหลักทรัพย์

โทร. 0-2009-9323-8

แนวทางปฏิบัติในการคัดกรองลูกค้าที่ซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ Direct Market Access (DMA)

คุณสมบัติของลูกค้าที่จะซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA

ลูกค้าที่บริษัทสมาชิกจะอนุญาตให้ซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA ได้ อย่างน้อยต้องมีคุณสมบัติ ดังนี้

1. เป็นผู้ลงทุนสถาบันตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กจ. 39/2564 เรื่อง การกำหนดบทนิยามผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และผู้ลงทุนรายใหญ่ (“ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ต.”) โดยต้องเป็นผู้ลงทุนสถาบันที่เป็นนิติบุคคล หรือ
2. เป็นผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษหรือผู้ลงทุนสถาบันที่เป็นบุคคลธรรมดา ตามประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ต. โดยผู้ลงทุน ทั้ง 2 กลุ่มข้างต้นจะต้องมีความรู้หรือประสบการณ์ และมีเงินลงทุนในหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามที่ กำหนดไว้ในตารางคุณสมบัติผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษแนบท้ายประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ต. (รวมทั้งที่จะมีการ แก่ไข) และยังคงต้องมีคุณสมบัติและไม่มีลักษณะต้องห้ามดังต่อไปนี้ด้วย
 - 2.1. มีความรู้เกี่ยวกับกฎหมายและข้อกำหนดเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ เช่น การกระทำอันไม่เป็นธรรม เกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ การส่งคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสม และการขายหลักทรัพย์โดยไม่มี หลักทรัพย์ในครอบครอง เป็นต้น
 - 2.2. ไม่ถูกกล่าวโทษหรือไม่อยู่ระหว่างถูกลงโทษโดยสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาด หลักทรัพย์ หรือตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“ตลาดหลักทรัพย์ฯ”) หรือหน่วยงานในต่างประเทศที่ทำ หน้าที่กำกับดูแลด้านตลาดทุน และต้องไม่มีพฤติกรรมกรรมการส่งคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสมตามข้อกำหนดของ ตลาดหลักทรัพย์ฯ หรือตลาดหลักทรัพย์ในต่างประเทศ (หากผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษเป็นนิติบุคคล ผู้บริหาร ของนิติบุคคลนั้นจะต้องไม่มีลักษณะต้องห้ามตามข้อนี้ด้วย)

กระบวนการในการพิจารณาคุณสมบัติของลูกค้า

เพื่อให้แน่ใจว่า ได้มีการประเมินคุณสมบัติของลูกค้าที่บริษัทสมาชิกจะอนุญาตให้ซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA ตามที่แนวทางปฏิบัติที่กำหนด และเพื่อประโยชน์ในการนำส่งเอกสาร / ข้อมูล กรณีที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ หรือหน่วยงานที่มี อำนาจกำกับดูแลอาจร้องขอเกี่ยวกับการดำเนินการดังกล่าวของบริษัทสมาชิก ให้บริษัทสมาชิกดำเนินการอย่างน้อย ดังนี้

1. กำหนดหลักเกณฑ์หรือแนวทางที่ใช้ในการพิจารณาคุณสมบัติลูกค้า DMA ให้เป็นไปตามเกณฑ์ที่กำหนดอย่าง เหมาะสม และเป็นลายลักษณ์อักษร
2. กำกับดูแลให้มีการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์หรือแนวทางที่กำหนดตาม ข้อ 1 รวมทั้งพิจารณาทบทวนข้อมูล คุณสมบัติของลูกค้าให้เป็นปัจจุบันตามรอบการทำหรือทบทวนข้อมูล Know Your Client: KYC
3. จัดเก็บเอกสารหลักฐานการคัดกรองคุณสมบัติของลูกค้าที่บริษัทสมาชิกอนุญาตให้ซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA เช่น เอกสารหลักฐานการประเมินคุณสมบัติของลูกค้า รวมถึงเอกสารหลักฐานประกอบต่างๆ ที่แสดงถึง คุณสมบัติของลูกค้า และนำส่งให้ได้ทันทีเมื่อตลาดหลักทรัพย์ฯ ร้องขอ
4. ให้ผู้ที่มีหน้าที่รับผิดชอบงานคัดกรองลูกค้าซึ่งได้รับมอบหมายจากบริษัทสมาชิก ลงนามรับทราบการประเมิน ดังกล่าวด้วย
