

แบบคำขออนุญาตซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading/Algorithmic Trading)

วันที่ _____

เรียน กรรมการและผู้จัดการ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“ตลาดหลักทรัพย์”) และ/หรือ

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (“ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า”)

ข้าพเจ้า บริษัท _____ (“บริษัทฯ”) ซึ่งเป็นสมาชิกหมายเลข

_____ มีความประสงค์จะส่งคำสั่งซื้อขายโดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (“ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์”) โดย

 ขออนุญาตใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ แบบที่มีระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (Pre-trade risk management : PTRM) ที่สามารถรองรับกลยุทธ์ ได้เป็นรายกลยุทธ์ (Strategy) แบบที่มีระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (Pre-trade risk management : PTRM) ที่สามารถรองรับกลยุทธ์ (Strategy) ได้หลายกลยุทธ์

โดยแนบเอกสาร ดังนี้

 ระบบหรือการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (ตามข้อมูล MO-COMPLIANCE1) หลักการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ (ตามเอกสารแนบ FORM C) หน้าจอที่แสดงผลการทดสอบระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (ตามข้อมูล MO-COMPLIANCE1) คู่มือการใช้งานระบบ (User Manual) รายละเอียดการใช้งานระบบหรือการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์อื่น (ถ้ามี) ขออนุญาตเปลี่ยนแปลงชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ หลักการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ ที่ได้รับอนุญาตแล้ว (ตามเอกสารแนบ FORM C) _____ ช่องทางการต่อเชื่อมชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ (Acting user) เดิม _____ ใหม่ _____ ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย ที่ได้รับอนุญาตแล้วตามหนังสืออนุญาตเลขที่ _____ สำหรับกลยุทธ์ (ตามเอกสารแนบ FORM C)

โดยแนบเอกสารในส่วนที่มีการเพิ่มเติมหรือเปลี่ยนแปลง ดังนี้

 ระบบหรือการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (ตามข้อมูล MO-COMPLIANCE1) หลักการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ (ตามเอกสารแนบ FORM C) หน้าจอที่แสดงผลการทดสอบระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (ตามข้อมูล MO-COMPLIANCE1) คู่มือการใช้งานระบบ (User Manual) รายละเอียดการใช้งานระบบหรือการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์อื่น (ถ้ามี) ขอยกเลิกการใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ (ตามเอกสารแนบ FORM C) แบบที่มีระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (Pre-trade risk management : PTRM) ที่สามารถรองรับกลยุทธ์ ได้เป็นรายกลยุทธ์ (Strategy) ที่เคยได้รับอนุญาตแล้ว ตามหนังสืออนุญาตเลขที่ _____ แบบที่มีระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย (Pre-trade risk management : PTRM) ที่สามารถรองรับกลยุทธ์ (Strategy) ได้หลายกลยุทธ์ ตามหนังสืออนุญาตเลขที่ _____ อื่นๆ _____

โดยเป็นการส่งคำสั่งของ

 บริษัทฯ เพื่อ (บัญชีบริษัท, ลูกค้า หรือ ทำหน้าที่ดูแลสภาพคล่อง) ลูกค้าที่ซื้อขายผ่าน DMA (ไปตรงบัญชี และเลขที่บัญชีลูกค้า หรือทำหน้าที่ดูแลสภาพคล่อง) ลูกค้าประเภท Internet Trading ได้แก่ (ลูกค้าทั่วไป หรือเฉพาะราย:ไปตรงบัญชีลูกค้า)

บริษัท ขอรับรองว่า การส่งคำสั่งซื้อขายด้วยชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ดังกล่าว มีระบบการทำงานที่ไม่ขัดและถูกต้องครบถ้วนตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย และจะไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขายตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ทั้งนี้ หากปรากฏในภายหลังว่า คำรับรองของบริษัท ข้างต้นไม่ถูกต้องครบถ้วน หรือการส่งคำสั่งซื้อขายด้วยชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ข้างต้นก่อให้เกิดความเสียหายใดๆ ต่อตลาดหลักทรัพย์และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า บริษัทฯ ตกลงและยินยอมที่จะรับผิดชอบในความเสียหายทั้งหมดที่เกิดขึ้นต่อตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในทุกกรณี

ประทับตราบริษัท

(_____)
ตำแหน่ง _____
ผู้มีอำนาจลงนามแทนบริษัท

ชื่อผู้ประสานงาน _____
โทรศัพท์ _____
E-mail _____

คำอธิบาย

หลักการดำเนินงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ

ข้าพเจ้า บริษัท _____ (บริษัทฯ) ซึ่งเป็นสมาชิกหมายเลข _____ ขอแจ้งหลักการดำเนินงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ รายละเอียดดังนี้

- ขออนุญาตใช้ / ขอเพิ่ม / เปลี่ยนแปลงหลักการดำเนินงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายอัตโนมัติ

ชื่อกลยุทธ์ (Strategy name) _____

โดยกลยุทธ์ที่ยื่นขออนุญาตเป็นกลยุทธ์ประเภท

- กลยุทธ์พื้นฐาน
 กลยุทธ์อื่นๆ

กลยุทธ์พัฒนาโดย ...(ระบุชื่อลูกค้า/บริษัทสมาชิก หรือบริษัทที่พัฒนากลยุทธ์)..... (เฉพาะ SET)

วัตถุประสงค์ _____

- ได้รับการอนุญาตใช้งานในตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอื่น กรุณาระบุ _____

ตัวอย่างการทำงาน (ขอให้อธิบายโดยละเอียด เช่น ภาพประกอบ กราฟ หรือตัวเลข)

โดยกลยุทธ์พื้นฐาน หมายถึง กลยุทธ์ที่มีการจัดการคำสั่งซื้อขายที่ไม่ก่อให้เกิดผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์ และ ภาวะการซื้อขาย เช่น

1. การซื้อขายที่ราคาเฉลี่ย เช่น VWAP (Volume Weighted Average Price) TWAP (Time Weighted Average Price)
2. การซื้อขายเพื่อให้ได้ปริมาณที่สอดคล้องกับปริมาณซื้อขายในตลาด/ ราคาอ้างอิง เช่น Volume inline/ Percentage of volume/ Price Inline / Implementation Shortfall
3. การซื้อหรือขายในปริมาณมาก โดยเป็นการทยอยส่งคำสั่งให้สอดคล้องกับการเคลื่อนไหวของราคาหุ้น และไม่เกิดผลกระทบต่อสภาพการซื้อขาย เช่น Iceberg, Float

กลยุทธ์อื่น หมายถึง กลยุทธ์อื่นที่นอกเหนือไปจากกลยุทธ์พื้นฐานข้างต้น

ขอยกเลิกหลักการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายอัตโนมัติ

ลำดับ	ชื่อกลยุทธ์ (Strategy name)	กลยุทธ์พัฒนาโดย (ระบบชื่อลูกค้า/บริษัท สมาชิก หรือบริษัทที่พัฒนากลยุทธ์) (เฉพาะ SET)	ประเภทกลยุทธ์ (Strategy type)	ตัวอย่างการทำงาน (Example of functionality)

ทั้งนี้บริษัทฯ ขอรับรองว่าข้อมูลดังกล่าวข้างต้นถูกต้องตรงตามความเป็นจริง

ประทับตราบริษัทฯ

ตำแหน่ง

(_____)

ผู้มีอำนาจลงนามแทนบริษัท