

21 มิถุนายน 2567

เรื่อง การปรับปรุงเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเพื่อยกระดับการกำกับดูแล

เรียน กรรมการผู้จัดการ

บริษัทสมาชิก และบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกทุกบริษัท

- สิ่งที่ส่งมาด้วย
1. สรุปสาระสำคัญของการปรับปรุงเกณฑ์
  2. ข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่ปรับปรุง (รวม 4 ฉบับ)
  3. แบบแจ้งข้อมูลของผู้ดูแลสภาพคล่องที่ประสงค์จะขายชอร์ตโดยได้รับยกเว้นเกณฑ์ราคาขายชอร์ต
  4. แบบคำขอขึ้นทะเบียนลูกค้า HFT (High Frequency Trading)
  5. แบบแจ้งรายชื่อผู้มีสิทธิเข้าใช้งานในระบบเปิดเผยข้อมูลผู้ลงทุนที่มีการส่งคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสม

ด้วยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“ตลาดหลักทรัพย์”) ได้ปรับปรุงเกณฑ์เกี่ยวกับมาตรการเพื่อยกระดับการกำกับดูแลและเพิ่มความเชื่อมั่นของผู้ลงทุน โดยสรุปหลักการที่มีการปรับปรุงได้ดังนี้

1. ปรับปรุงคุณสมบัติของหุ้นที่สามารถขายชอร์ตได้: กำหนดคุณสมบัติเกี่ยวกับมูลค่าตามราคาตลาด (Market Capitalization) เพิ่มขึ้น และกำหนดปริมาณการซื้อขายหมุนเวียนเฉลี่ยต่อเดือน (Monthly Turnover) เพื่อให้สอดคล้องกับขนาดและสภาพการซื้อขายในปัจจุบัน
2. ปรับปรุงเกณฑ์ราคาในการขายชอร์ต: กำหนดให้ใช้ราคาที่สูงกว่าราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (Uptick) กับทุกหลักทรัพย์ ยกเว้นผู้ดูแลสภาพคล่อง (“Market Maker”) ที่ขึ้นทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์ฯ และบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX) เพื่อประโยชน์ในการดูแลสภาพคล่องของสินค้าที่ตนขึ้นทะเบียนเป็น Market Maker
3. กำหนดให้มีการขึ้นทะเบียนผู้ลงทุนกลุ่ม High-Frequency Trading (“HFT”): บริษัทสมาชิกจะต้องขึ้นทะเบียนลูกค้าซึ่งเป็นผู้ลงทุนกลุ่ม HFT ก่อนเริ่มใช้งาน สำหรับบริษัทสมาชิกที่ได้ให้บริการแก่ผู้ลงทุนกลุ่ม HFT อยู่แล้วในปัจจุบันจะต้องดำเนินการขึ้นทะเบียนลูกค้าซึ่งเป็นผู้ลงทุนกลุ่ม HFT ให้แล้วเสร็จภายในวันที่ 31 กรกฎาคม 2567 เพื่อยกระดับการกำกับดูแลผู้ลงทุนกลุ่มดังกล่าวให้เข้มงวดขึ้น
4. เปิดเผยข้อมูลผู้ลงทุนที่มีพฤติกรรมส่งคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสม: ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวให้แก่บริษัทสมาชิกทุกรายทราบ เพื่อยกระดับให้สมาชิกทุกรายสามารถกำกับดูแลกลุ่มผู้ลงทุนดังกล่าวได้อย่างมีประสิทธิภาพมากขึ้น

ทั้งนี้ ให้มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 ยกเว้นคุณสมบัติของหุ้นที่สามารถขายชอร์ตได้ให้มีผลตั้งแต่วันที่ 21 มิถุนายน 2567 โดยขอส่งสรุปสาระสำคัญของการปรับปรุงเกณฑ์และข้อกำหนดที่เกี่ยวข้อง โดยมีรายละเอียดการปรับปรุงปรากฏตามสิ่งที่ส่งมาด้วย 1. – 5.

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ

(ลงนาม) ภากร ปีตธวัชชัย

(นายภากร ปีตธวัชชัย)

กรรมการและผู้จัดการ

ฝ่ายกำกับบริษัทสมาชิก

โทร 0-2009-9312-21