

เรื่อง เพิ่มตัวอย่างพฤติกรรมลักษณะการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสม

เรียน กรรมการผู้จัดการ

บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกทุกบริษัท

- อ้างถึง 1. หนังสือที่ กข.(ว) 3/2553 เรื่อง ลักษณะการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสม ลงวันที่ 1 ตุลาคม 2553
2. หนังสือที่ กข.(ว) 3/2562 เรื่อง ตัวอย่างพฤติกรรมลักษณะการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสม ลงวันที่ 23 กันยายน 2562

สิ่งที่ส่งมาด้วย ลักษณะการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสม และตัวอย่างพฤติกรรม

ตามที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) ได้กำหนดให้บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกละเว้นการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่อาจมีหรือมีผลทำให้ราคา หรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงไป หรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market) ซึ่งอาจนำไปสู่การสร้างราคาซึ่งเป็นความผิดตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ระบุลักษณะการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสม พร้อมอธิบายตัวอย่างพฤติกรรมในแต่ละประเภทให้เห็นภาพ (Visualization) และเข้าใจมากขึ้น ความละเอียดปรากฏตามหนังสือที่อ้างถึง 1 และ 2 นั้น

เพื่อให้ครอบคลุมพฤติกรรมการซื้อขายที่มีการเปลี่ยนแปลงและมีความหลากหลายเพิ่มขึ้นในปัจจุบัน และเพื่อให้บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก รวมถึงเจ้าหน้าที่รับอนุญาต มีความเข้าใจและมีแนวทางในการกำกับดูแลการส่งคำสั่งที่เข้าข่ายเป็นการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสมครบถ้วนมากขึ้น ตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงได้ปรับปรุงเพิ่มตัวอย่างพฤติกรรมที่ไม่เหมาะสมในลักษณะใส่-ถอน ที่อาจทำให้นักลงทุนไปเข้าใจผิดเกี่ยวกับราคา หรือปริมาณการซื้อขาย หรือไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด โดยมีความละเอียดปรากฏตามสิ่งที่ส่งมาด้วย ทั้งนี้ ได้หารือและรับฟังความคิดเห็นร่วมกับผู้ปฏิบัติงานที่มีหน้าที่ในการกำกับดูแลของสมาชิกผ่านทางชมรม Compliance สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยแล้ว

ตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงขอส่งลักษณะการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสมและตัวอย่างพฤติกรรม ซึ่งรวบรวมทั้งปัจจุบันและที่เพิ่มเติมมายังสมาชิกเพื่อใช้เป็นแนวทางในการปฏิบัติงานต่อไป

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ

(ลงนาม) รศยุพา มิคะเสน

(นางรศยุพา มิคะเสน)

ผู้ช่วยผู้จัดการ

ลงนามแทน

กรรมการและผู้จัดการ

ฝ่ายกำกับกรการซื้อขาย

โทร. 0-2009-9000 ต่อ 9290, 9295 – 9298 และ 9309 - 9311