

เรื่อง การปรับปรุงคู่มือและแนวทางในการปฏิบัติงานของสมาชิก

เรียน กรรมการผู้จัดการ

บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่ใช้สมาชิกทุกบริษัท

อ้างอิง หนังสือของตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่ ปก.(ว) 3/2564 เรื่อง การปรับปรุงหลักเกณฑ์การซื้อขาย
หลักทรัพย์และการจัดส่งรายงานของบริษัทสมาชิก

- สิ่งที่ส่งมาด้วย 1. คู่มือการกำกับดูแลการปฏิบัติงานของสมาชิก (Check List) ฉบับปรับปรุง จำนวน 3 ฉบับ
ได้แก่ Check List การกำกับดูแลตามข้อกำหนดสมาชิกตลาดหลักทรัพย์ฯ Check List
ข้อกำหนดของสำนักหักบัญชี และ Check List ระบบการส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์
2. แนวทางเบื้องต้นในการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายสำหรับการขออนุญาต
Algorithmic Trading (Algo) ในตลาดหลักทรัพย์ฯ

ตามที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) ได้ปรับปรุงหลักเกณฑ์การซื้อขาย
หลักทรัพย์เรื่องการต่อเชื่อมระบบส่งคำสั่งซื้อขาย การซื้อขายผ่านระบบ Direct Market Access (DMA) การใช้
ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Algorithmic Trading) รวมถึงหลักเกณฑ์เรื่องเจ้าหน้าที่รับ
อนุญาต และการจัดส่งรายงานของบริษัทสมาชิก โดยมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 ความละเอียด
ตามที่อ้างถึง นั้น

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ปรับปรุงคู่มือการกำกับดูแลการปฏิบัติงานของสมาชิก (Check List) และ
แนวทางเบื้องต้นในการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายสำหรับการขออนุญาต Algorithmic Trading
(Algo) ให้สอดคล้องกับหลักเกณฑ์ที่ได้ปรับปรุงใหม่ดังกล่าว โดยมีรายละเอียดดังนี้

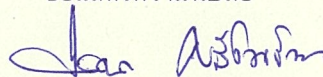
1. ปรับปรุง Check List เรื่อง การกำกับดูแลตามข้อกำหนดสมาชิกตลาดหลักทรัพย์ฯ และ
Check List ระบบการส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ เพื่อให้ครอบคลุมหลักเกณฑ์ที่ได้ปรับปรุงใหม่ อาทิเช่น การ
เพิ่มเติมหลักเกณฑ์ในการกำกับดูแลระบบส่งคำสั่งที่ต้องมีการกำกับดูแลพื้นฐานและมี PTRM ขั้นต่ำในทุก
ช่องทางการส่งคำสั่งซื้อขายเพื่อให้เป็นมาตรฐานเดียวกัน การแจ้งข้อมูลลูกค้าที่เป็นผู้พัฒนาหรือจัดหา
Algorithmic Trading การปรับปรุงคุณสมบัติและกระบวนการแต่งตั้ง/ เพิกถอน Trader การปรับระยะเวลาในการ
จัดส่งรายงานเพื่อให้ยืดหยุ่นมากขึ้น เป็นต้น พร้อมกันนี้ได้ปรับปรุง Check List ข้อกำหนดของสำนักหักบัญชีให้
เป็นปัจจุบันด้วย

2. ปรับปรุงแนวทางเบื้องต้นในการบริหารจัดการความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายสำหรับการขอ
อนุญาต Algorithmic Trading (Algo) โดยยกเลิกปริมาณหุ้นขั้นต่ำที่เคยกำหนดไว้ที่ 10 ล้านหุ้น และเพิ่มเติม
คำอธิบายประเภทของกลยุทธ์ที่ใช้ในการส่งคำสั่งให้ชัดเจนมากขึ้น

ตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงขอส่งมายังท่านเพื่อให้สมาชิกใช้เป็นแนวทางในการปฏิบัติงานและกำกับ
ดูแลบริษัทต่อไป ทั้งนี้ยังสามารถดูได้ที่เว็บไซต์ www.set.or.th ที่หัวข้อ www.set.or.th/rulebook/#/circular/tree/44
หรือที่ www.set.or.th/th/regulations/supervision/member_p1.html ด้วย

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ



(นางสาวปวีณา ศรีโพธิ์ทอง)

ผู้ช่วยผู้จัดการ

ลงนามแทน

กรรมการและผู้จัดการ

ฝ่ายกำกับบริษัทสมาชิก

โทร. 02-009-9313-20

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย The Stock Exchange of Thailand

93 ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพฯ 10400 โทร: +662 009 9000 โทรสาร: +662 009 9991 Contact Center: +662 009 9999
93 Ratchadaphisek Road, Dindaeng, Bangkok 10400 Tel: +662 009 9000 Fax: +662 009 9991 Contact Center: +662 009 9999

