

ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคา
และการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 8) พ.ศ. 2565

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 3 ข้อ 6 ข้อ 7 ข้อ 11 ข้อ 14 ข้อ 17 ข้อ 18 ข้อ 19 ข้อ 23 ข้อ 25 และข้อ 40 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2555 ลงวันที่ 16 กรกฎาคม 2555 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยด้วยความเห็นชอบจากคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 27 มิถุนายน 2565 เป็นต้นไป ผลบังคับใช้

ข้อ 2 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นส่วนที่ 5 การซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วย ของหมวด 5 หลักเกณฑ์เฉพาะการซื้อขายหลักทรัพย์บางประเภท ของประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560

“ส่วนที่ 5

การซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วย

ข้อ 73/11 ในส่วนนี้

“ตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ” และ “บริษัทผู้ออกตราสารแสดงสิทธิ” ให้มีความหมายเช่นเดียวกับบทนิยามของคำดังกล่าวที่กำหนดไว้ในข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับ
การเปิดเผยสารสนเทศ และการเพิกถอนตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ นิยาม

ข้อ 73/12 ความในส่วนนี้ให้ใช้บังคับกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบตราสาร
แสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วย การนำหลัก
เกณฑ์ทั่วไป

ให้นำหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่กำหนดไว้ในข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการซื้อขาย
การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ มาใช้บังคับกับการซื้อขาย การชำระราคาและ
การส่งมอบตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วยในส่วนนี้ด้วย
เท่าที่ไม่ขัดหรือแย้ง มาใช้เท่าที่ไม่
ขัดหรือแย้ง

<p>ข้อ 73/13 ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดให้บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขายตามหมวด 9 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์สามารถดำเนินการซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วยได้ตามที่เห็นสมควร</p>	<p>การซื้อขาย โดยบุคคลที่ เกี่ยวข้องใน ระบบการ ซื้อขาย</p>
<p>ข้อ 73/14 การซื้อขายด้วยระบบการซื้อขายให้กระทำได้ในเวลาทำการซื้อขายที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ทั้งนี้ ในกรณีที่มีการซื้อขายในช่วงเวลาภายหลัง 24.00 น. ของวันทำการต่อเนื่องไปถึงวันถัดไป ให้ถือว่าการซื้อขายในช่วงเวลาดังกล่าวเป็นการซื้อขายในวันทำการด้วย</p>	<p>เวลาทำการ ซื้อขาย</p>
<p>ข้อ 73/15 การซื้อขายในส่วนนี้ให้สามารถกระทำด้วยการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) โดยสมาชิกอาจบันทึกการเสนอซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขายโดยระบุประเภทการเสนอซื้อขายในช่วงเวลาซื้อขายตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ซึ่งคำสั่งซื้อขายอาจจะระบุเป็นจำนวนเงินหรือจำนวนหน่วยของตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ ที่เป็นจำนวนเต็มหรือทศนิยมก็ได้</p> <p>การเสนอซื้อขายตามวรรคหนึ่ง ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดเวลาหรือช่วงเวลาที่มผล (Validity) ในระบบการซื้อขาย</p> <p>ให้ถือว่าราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายของตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศตามวรรคหนึ่ง เป็นราคาอ้างอิงของตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศในวันทำการนั้น</p>	<p>การซื้อขาย ด้วยวิธีจับคู่ อัตโนมัติ</p> <p>อายุของการ เสนอซื้อขาย</p> <p>ราคาอ้างอิง</p>
<p>ข้อ 73/16 ก่อนบันทึกคำสั่งซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขาย ให้สมาชิกผู้ซื้อดำเนินการตรวจสอบว่าลูกค้าได้ชำระเงินไว้ในจำนวนที่เพียงพอสำหรับการชำระราคาตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ และให้สมาชิกผู้ขายดำเนินการตรวจสอบว่าลูกค้าได้ชำระตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศไว้ในจำนวนที่เพียงพอสำหรับการส่งมอบตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ</p>	<p>การตรวจสอบ ข้อมูลก่อน บันทึกคำสั่ง ซื้อขาย</p>
<p>ข้อ 73/17 เพื่อประโยชน์ในการควบคุมความผันผวนของราคาซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ ตลาดหลักทรัพย์อาจจัดให้มีระบบป้องกันการจับคู่คำสั่งซื้อขายที่เกินกว่ากรอบราคาซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศก็ได้ โดยระบบป้องกันดังกล่าวให้เป็นไปตามแนวทางที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p>	<p>การกำหนด กรอบราคา ซื้อขาย</p>
<p>ข้อ 73/18 สมาชิกอาจยกเลิกการเสนอซื้อขายของตนได้เฉพาะก่อนที่การเสนอซื้อขายดังกล่าวจะได้รับการจับคู่ซื้อขาย และให้กระทำด้วยระบบการซื้อขาย</p> <p>การแก้ไขการเสนอซื้อขายหรือการซื้อขาย สมาชิกไม่อาจกระทำได้</p>	<p>การแก้ไข/ ยกเลิกการเสนอ ซื้อขายหรือการ ซื้อขาย</p>
<p>ข้อ 73/19 การประกาศขึ้นเครื่องหมายใดในช่วงเวลาใดไว้ที่ตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ เพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายของตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศในช่วงเวลาที่ขึ้นเครื่องหมายดังกล่าวเป็นราคาที่ไม่วรรณถึงสิทธิประโยชน์ที่บริษัทผู้ออกตราสารแสดงสิทธิจะให้หรือให้แก่ผู้ถือตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศนั้นในการปิดสมุดทะเบียนพักการโอนตราสารแสดงสิทธิใน</p>	<p>การขึ้น เครื่องหมาย X</p>

หลักทรัพย์ต่างประเทศหรือในการกำหนดรายชื่อผู้ถือตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศในคราวนั้น ให้เป็นไปตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ข้อ 73/20 เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลการซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ ตลาดหลักทรัพย์อาจจัดให้มีระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายก่อนส่งเข้ามาในระบบการซื้อขาย โดยหากพบว่าคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสม ระบบดังกล่าวอาจปฏิเสธคำสั่งซื้อขายนั้น รวมทั้งตลาดหลักทรัพย์อาจพิจารณาดำเนินการอื่นใดตามที่เห็นสมควรก็ได้

ระบบตรวจสอบ
คำสั่งซื้อขาย

คำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสมตามวรรคหนึ่ง ให้รวมถึงคำสั่งซื้อขายที่มีลักษณะหนึ่งลักษณะใดดังต่อไปนี้ ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดแนวทางในการพิจารณาคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสมได้

(1) คำสั่งซื้อขายที่อาจทำให้บุคคลทั่วไปเข้าใจผิดเกี่ยวกับราคาหรือปริมาณการซื้อขายหรือขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ

(2) คำสั่งซื้อขายที่อาจมีผลทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศเปลี่ยนแปลงไปหรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด

ข้อ 73/21 มิให้นำหลักเกณฑ์ เงื่อนไข หรือวิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ในเรื่องดังต่อไปนี้มาใช้ในการซื้อขายในส่วนนี้

หลักเกณฑ์ที่
ไม่นำมาใช้กับ
การซื้อขาย
ตราสารแสดง
สิทธิฯ

(1) หน่วยการซื้อขายของหลักทรัพย์ (Board Lot)

(2) การกำหนดราคาสูงสุด (Ceiling) หรือราคาต่ำสุด (Floor)

(3) การหยุดการซื้อขายทั้งหมด (Circuit Breaker)”

ประกาศ ณ วันที่ 13 มิถุนายน 2565

(ลงนาม) ภากร ปีตธวัชชัย

(นายภากร ปีตธวัชชัย)

กรรมการและผู้จัดการ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

เหตุผลในการประกาศใช้: โดยที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยได้จัดให้มีระบบการซื้อขายเพื่อรองรับการซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วย และเห็นควรกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศดังกล่าวเป็นการเฉพาะ จึงสมควรออกประกาศฉบับนี้