

**แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ
ที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วย (Fractional DR (DRx)) ในตลาดหลักทรัพย์**

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 42 ข้อ 50 และข้อ 53 ของประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 และข้อ 47 ของประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 5) พ.ศ. 2565 ลงวันที่ 20 ธันวาคม 2562 และข้อ 73/14 ข้อ 73/15 ข้อ 73/17 และข้อ 73/19 ของประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคา และการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 8) พ.ศ. 2565 ลงวันที่ 13 มิถุนายน 2565 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

1. การนำหลักเกณฑ์ทั่วไปมาใช้เท่าที่ไม่ขัดหรือแย้ง

ให้นำหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่กำหนดไว้ในแนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (“แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์”) มาใช้บังคับกับการซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วยด้วยเท่าที่ไม่ขัดหรือแย้ง

2. เวลาทำการซื้อขาย

สำหรับการซื้อขาย Fractional DR ตลาดหลักทรัพย์จะเปิดให้มีการซื้อขายประจำวันด้วยระบบการซื้อขายตามหลักเกณฑ์ วิธีการและในระหว่างช่วงเวลาดังต่อไปนี้

2.1 กรณีหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ใช้อ้างอิงมีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ในภูมิภาคเอเชีย

ช่วงเวลาซื้อขาย	เวลาซื้อขาย	วิธีการซื้อขาย
ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)	7.00 น. ถึง 17.00 น.	● การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM)

2.2 กรณีหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ใช้อ้างอิงมีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ในภูมิภาคอเมริกา

ช่วงเวลาซื้อขาย	เวลาซื้อขาย	วิธีการซื้อขาย
ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)	20.00 น. ถึง 04.00 น.	● การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM)

3. รายการขั้นต่ำในการบันทึกคำสั่งซื้อขาย

การบันทึกคำสั่งซื้อขาย Fractional DR เข้ามาในระบบการซื้อขายต้องมีรายการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- 3.1 ชื่อหลักทรัพย์
- 3.2 จำนวนเงินหรือจำนวนหน่วยที่ต้องการซื้อขาย
- 3.3 ราคาเสนอซื้อขาย (สำหรับการเสนอซื้อขายประเภท Limit Order)
- 3.4 หมายเลขประจำตัวสมาชิก
- 3.5 เลขที่บัญชีลูกค้า (Client ID)
- 3.6 รายการอื่นตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

4. ช่วงราคา (Tick Size)

ตลาดหลักทรัพย์กำหนดช่วงราคาในการเสนอซื้อขาย Fractional DR เท่ากับ 0.01 บาท

5. ประเภทการเสนอซื้อขายสำหรับการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) และช่วงเวลาที่มีผลของการเสนอซื้อขาย

- 5.1 สมาชิกอาจจะระบุประเภทการเสนอซื้อขายอย่างใดอย่างหนึ่งในช่วงเวลาทำการซื้อขายดังต่อไปนี้

ประเภทการเสนอซื้อขาย	ความหมายและลักษณะ
1. Limit Order	การเสนอซื้อขายที่ระบุราคาซื้อขาย
2. Market Order	การเสนอซื้อขายที่ระบุให้มีการเสนอซื้อ ณ ราคาเสนอขายต่ำสุดหรือเสนอขาย ณ ราคาเสนอซื้อสูงสุดตามลำดับ และหากมีจำนวนการเสนอซื้อขายที่ไม่สามารถจับคู่การซื้อขายได้ ระบบการซื้อขายจะยกเลิกจำนวนดังกล่าวทันที

- 5.2 การเสนอซื้อขายตามข้อ 5.1 ให้มีผลในระบบการซื้อขายจนกว่าการเสนอซื้อขายดังกล่าวจะถูกยกเลิก (Good till Cancel)

6. การกำหนดกรอบราคาซื้อขาย

ในการควบคุมความผันผวนของราคาซื้อขาย Fractional DR ตลาดหลักทรัพย์อาจจัดให้มีระบบป้องกันการจับคู่คำสั่งซื้อขายที่เกินกว่ากรอบราคาซื้อขาย Fractional DR โดยมีแนวทางดังนี้

- 6.1 การกำหนดกรอบราคาซื้อขาย Fractional DR ให้ใช้ราคาจับคู่การซื้อขายที่ไม่เกิน $\pm 10\%$ ของค่าเฉลี่ยของราคาซื้อขาย Fractional DR นั้นในช่วง 5 นาทีก่อนที่จะมีการจับคู่การซื้อขาย และในกรณีที่ไม่มีราคาซื้อขาย Fractional DR ในช่วงเวลาดังกล่าวให้นำกรอบราคาซื้อขายล่าสุดมาใช้แทน

ทั้งนี้ มิให้นำหลักเกณฑ์ข้างต้นมาใช้ในช่วงเวลาเปิดทำการซื้อขายซึ่งมีหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

ช่วงเวลา	หลักเกณฑ์ในการกำหนดกรอบราคาซื้อขาย Fractional DR
1. ในช่วง 10 นาทีแรกหลังจากเวลาเปิดทำการซื้อขาย	ไม่กำหนดกรอบราคาซื้อขาย
2. เมื่อมีการจับคู่การซื้อขายในช่วงเวลาตาม 1.	<p>ให้การกำหนดกรอบราคาซื้อขาย Fractional DR เมื่อครบกำหนด ณ เวลาตาม 1. เป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> • ราคาซื้อขายที่ทำให้เกิดการจับคู่การซื้อขายจะต้องไม่เกิน $\pm 10\%$ ของค่าเฉลี่ยของราคาซื้อขาย Fractional DR ในช่วง 5 นาทีสุดท้ายของช่วงเวลาตาม 1. • หากมีการจับคู่การซื้อขายเฉพาะในช่วง 5 นาทีแรกของช่วงเวลาตาม 1.ให้นำค่าเฉลี่ยของราคาซื้อขาย Fractional DR ในช่วงเวลาดังกล่าวมาพิจารณาเป็นราคาอ้างอิงในการกำหนดกรอบราคาซื้อขายแทน
3. เมื่อพ้นช่วงเวลาตาม 1. และยังไม่มีการจับคู่การซื้อขาย	ไม่กำหนดกรอบราคาซื้อขาย

6.2 ในกรณีที่มีเหตุอันอาจมีผลกระทบทำให้การซื้อขาย Fractional DR ตามกรอบราคาซื้อขายที่กำหนดไว้ตามข้อ 6.1 ไม่อาจทำได้ตามสภาพของความเป็นจริง ตลาดหลักทรัพย์อาจเปลี่ยนแปลงกรอบราคาซื้อขายของ Fractional DR หรือไม่นำกรอบราคารายนั้นมาใช้เป็นการชั่วคราวเพื่อให้เหมาะสมกับสภาพของตลาดในขณะนั้น

7. การประกาศขึ้นเครื่องหมายแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์เป็นราคาที่ไม่รวมสิทธิประโยชน์
ตลาดหลักทรัพย์อาจประกาศขึ้นเครื่องหมายตามแนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ฯ ไว้ที่ Fractional DR ภายหลังจากที่นายทะเบียนหลักทรัพย์ได้กำหนดรายชื่อผู้ถือ Fractional DR ที่จะได้รับสิทธิประโยชน์จากบริษัทผู้ออกตราสารแสดงสิทธิเป็นส่วนหนึ่งของทะเบียนผู้ถือหลักทรัพย์เพื่อแสดงว่าราคาซื้อขาย Fractional DR เป็นราคาที่ไม่รวมสิทธิประโยชน์

ผลบังคับใช้

แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการเปิดเผยสารสนเทศและการซื้อตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วยในตลาดหลักทรัพย์ฉบับนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 27 มิถุนายน 2565 เป็นต้นไป

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

13 มิถุนายน 2565