

ที่ กข. (ว) 002/2565

22 กรกฎาคม 2565

- เรื่อง หลักเกณฑ์และแนวทางการกำกับดูแลการซื้อขายในตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วย (Fractional DR – DRx)
- เรียน กรรมการผู้จัดการ
บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกทุกบริษัท
- อ้างถึง 1. ข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การซื้อขาย การชำระราคา และการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2555 ข้อ 39 ลงวันที่ 16 กรกฎาคม 2555
2. ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคา และการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 8) พ.ศ. 2565 ข้อ 73/20 ลงวันที่ 13 มิถุนายน 2565
3. หนังสือที่ กข.(ว) 3/2562 ตัวอย่างพฤติกรรมการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสม

ตามที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) ได้ปรับปรุงหลักเกณฑ์เพื่อรองรับให้มีการซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วย (Fractional DR) โดยให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 27 มิถุนายน 2565 เป็นต้นไป โดยห้ามมิให้บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกเสนอซื้อหรือเสนอขายหลักทรัพย์ หรือซื้อหรือขายหลักทรัพย์ในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนหรือในนามสมาชิกเองที่อาจมีหรือมีผลทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงไป หรือไม่เปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market) และเพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลการซื้อขาย Fractional DR ตลาดหลักทรัพย์ฯ อาจจัดให้มีระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายก่อนส่งเข้ามาในระบบซื้อขาย และหากพบว่าคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสม ระบบจะปฏิเสธคำสั่งซื้อขายหรือตลาดหลักทรัพย์ฯ อาจพิจารณาดำเนินการอื่นใดตามที่เห็นสมควรได้ รายละเอียดตามเอกสารที่อ้างถึง 1 และ 2 นั้น

เพื่อให้บริษัทสมาชิกและบริษัทที่มีใช้สมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ฯ ทราบและเข้าใจในหลักการและแนวทางของการกำกับดูแลการซื้อขาย Fractional DR ที่จะกำหนดให้มีระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายของนักลงทุนทุกประเภทและทุกรายก่อนส่งเข้ามาในระบบการซื้อขาย โดยหากพบว่าคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสม ระบบดังกล่าวจะปฏิเสธคำสั่งซื้อขายนั้น ดังนี้

1. ระบบตรวจสอบการส่งคำสั่งซื้อขาย และการปฏิเสธคำสั่งซื้อขาย (Reject order) ที่ไม่เหมาะสม
 - 1.1 การจับคู่ซื้อขายกันเอง (wash sales) : ระบบจะ Reject คำสั่งใหม่ที่จะทำให้เกิดรายการจับคู่กับคำสั่งของตนเองที่เสนอไว้ในด้านตรงกันข้าม
 - 1.2 การไล่-ถอน : ระบบจะ Reject คำสั่งซื้อหรือขายที่ส่งเข้ามาใหม่ภายใน 5 วินาทีนับจากคำสั่งที่ยกเลิกไปก่อนหน้านี้ หากคำสั่งใหม่ดังกล่าวเป็นการส่งคำสั่งที่ราคาเดิม และปริมาณที่อยู่ในช่วง $\pm 20\%$ ของปริมาณคำสั่งที่ยกเลิกไปก่อนหน้านี้
2. หลักเกณฑ์ และ แนวทางในการกำกับดูแลการซื้อขายที่ไม่เหมาะสม ยังคงหลักการเดิมเช่นเดียวกับหลักทรัพย์ประเภทอื่นๆ รายละเอียดตามที่ยังอ้างถึง

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ขอเรียนว่าบริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก ยังคงต้องมีหน้าที่กำกับดูแล หรือมีมาตรการป้องกันหรือควบคุมการส่งคำสั่ง เพื่อให้เป็นไปตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่เกี่ยวข้อง และป้องกันคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสมซึ่งอาจนำไปสู่การสร้างราคาซึ่งผิดไปตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ

(ลงนาม) รศยุพา มิคะเสน

(นางรศยุพา มิคะเสน)

ผู้ช่วยผู้จัดการ

ลงนามแทน

กรรมการและผู้จัดการ

ฝ่ายกำกับการซื้อขาย-Equity

โทร.0-2009-9000 ต่อ 9295-9299

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย The Stock Exchange of Thailand

93 ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพฯ 10400 Ins : +662 009 9000 Insสาร : +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

