

ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคา
และการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560

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 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

- | | | |
|-------|--|-------------|
| ข้อ 1 | ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 11 กันยายน 2560 เป็นต้นไป | ผลบังคับใช้ |
| ข้อ 2 | ให้ยกเลิก | บทยกเลิก |
| (1) | ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2555 ลงวันที่ 16 กรกฎาคม 2555 | |
| (2) | ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2555 ลงวันที่ 22 ตุลาคม 2555 | |
| (3) | ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 3) พ.ศ. 2556 ลงวันที่ 15 มีนาคม 2556 | |
| (4) | ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2556 ลงวันที่ 2 เมษายน 2556 | |
| (5) | ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 5) พ.ศ. 2556 ลงวันที่ 16 กรกฎาคม 2556 | |
| (6) | ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2558 ลงวันที่ 7 พฤษภาคม 2558 | |
| (7) | ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 7) พ.ศ. 2558 ลงวันที่ 21 สิงหาคม 2558 | |
| ข้อ 3 | ในประกาศนี้
“การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต” (Internet Trading) หมายความว่า การซื้อขายหลักทรัพย์ที่ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายด้วยระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่จัดให้แก่ลูกค้า
“การซื้อขายหลักทรัพย์ทางอิเล็กทรอนิกส์” (Direct Electronic Access) หมายความว่า การซื้อขายหลักทรัพย์ที่สมาชิกอนุญาตให้ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายทางอิเล็กทรอนิกส์ด้วยตนเอง | นิยาม |

*“การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA” (Direct Market Access) หมายความว่า การซื้อขายที่สมาชิกอนุญาตให้ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายผ่านระบบส่งคำสั่งซื้อขายของลูกค้านั้นที่ต่อเชื่อมกับระบบของสมาชิก โดยคำสั่งซื้อขายดังกล่าวต้องผ่านระบบควบคุมความเสี่ยงที่สมาชิกสามารถบริหารจัดการได้

(ยกเลิกบทนิยามคำว่า “การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA” (Direct Market Access) และให้ใช้ความหมายใหม่แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

*“ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ” (Algorithmic Trading) หมายความว่า ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับส่งคำสั่งซื้อขายที่สามารถสร้างและบันทึกการเสนอซื้อขายได้โดยอัตโนมัติ

(ยกเลิกบทนิยามคำว่า “ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขาย โดยอัตโนมัติ” (Program Trading) และให้ใช้ความหมายใหม่แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

*“ผู้พัฒนาระบบ” หมายความว่า ผู้พัฒนาระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก (Independent Software Vendor: ISV) หรือผู้ให้บริการระบบส่งคำสั่งซื้อขาย (Application Service Provider: ASP)

(*เพิ่มเติมบทนิยามคำว่า “ผู้พัฒนาระบบ” โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

*“ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย” (Non-voting Depository Receipt: NVDR) หมายความว่า ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทยตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับและเพิกถอนใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย

*“หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารแห่งหนึ่ง” หมายความว่า หน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่มีนโยบายการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งเงินฝาก ตราสารแห่งหนึ่ง หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นหรือการหาผลประโยชน์โดยวิธีการอื่นตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการกองทุน

*“บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการทำสัญญาเป็นนายหน้าหรือตัวแทนซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ให้แก่บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก

*“การซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน” หมายความว่า การซื้อหุ้นเพื่อส่งมอบหุ้นในส่วนที่จัดสรรเกินกว่าจำนวนหุ้นที่จัดจำหน่ายตามเงื่อนไขที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนกำหนด โดยทำการซื้อในตลาดหลักทรัพย์ตามคำสั่งที่ได้รับจากผู้จัดจำหน่ายหลักทรัพย์ที่มีความผูกพันตามหนังสือชี้ชวนที่ออกในการจัดจำหน่ายหุ้นนั้น

“ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน” หมายความว่า สมาชิกที่ได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ให้ดำเนินการซื้อหุ้นใดหุ้นหนึ่งเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินของหุ้นนั้นในช่วงเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด โดยให้อยู่ภายใต้หลักเกณฑ์ที่ระบุไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการจัดสรรหุ้นเกินกว่าจำนวนที่จัดจำหน่าย

หมวด 1

การซื้อขาย

ส่วนที่ 1

บททั่วไป

- | | | |
|-------|--|--|
| ข้อ 4 | ในกรณีที่มีข้อสงสัยหรือมีปัญหาเกี่ยวกับการซื้อขาย ให้ผู้จัดการเป็นผู้มีอำนาจวินิจฉัยและสั่งการ | อำนาจวินิจฉัย
สั่งการของ
ผู้จัดการ |
| ข้อ 5 | สมาชิกอาจยื่นคำขอให้ตลาดหลักทรัพย์ออกหนังสือรับรองการซื้อขายของตนได้ | การขอออกหนังสือ
รับรองการซื้อขาย |

ส่วนที่ 2

ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

- | | | |
|----------|---|---|
| ข้อ 6 | สมาชิกต้องจัดให้มีระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่มีการทำงานและที่มีระบบการบริหารและควบคุมความปลอดภัยในการปฏิบัติงาน (Security Management) ที่ได้มาตรฐานตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด | การจัดให้มีระบบ
ส่งคำสั่งซื้อขาย
ตามมาตรฐาน |
| *ข้อ 6/1 | สมาชิกอาจใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่พัฒนาด้วยตนเอง หรือที่ได้รับสิทธิในการใช้งาน หรือที่พัฒนาโดยผู้พัฒนาระบบก็ได้ โดยสมาชิกต้องมีอำนาจควบคุมเหนือระบบส่งคำสั่งซื้อขายดังกล่าว | ระบบส่งคำสั่งซื้อ
ขายของสมาชิก |

(*เพิ่มเติมความในข้อ 6/1 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

- | | | |
|-------|--|---|
| ข้อ 7 | สมาชิกจะใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกได้ เมื่อได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์โดยแสดงรายละเอียดว่าระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกดังกล่าวเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด และทดสอบระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด | การใช้ระบบส่งคำสั่ง
ซื้อขายของสมาชิก |
|-------|--|---|

<p>ข้อ 8 สมาชิกต้องติดตั้งระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกเฉพาะในที่ทำการแต่ละแห่งของสมาชิกเท่านั้น ยกเว้นสมาชิกจะได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ สมาชิกต้องแจ้งสถานที่ติดตั้งระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p>	<p>การติดตั้งระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก</p>
<p>ข้อ 9 สมาชิกต้องติดตั้งเครื่องคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการส่งคำสั่งซื้อขายไว้ในสถานที่ซึ่งได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ สมาชิกต้องควบคุมมิให้บุคคลซึ่งมิได้มีหน้าที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายเข้าไปในสถานที่ดังกล่าว</p>	<p>การติดตั้งเครื่องคอมพิวเตอร์</p>
<p>*ข้อ 10 กรณีสมาชิกใช้บริการของผู้พัฒนาระบบ ผู้พัฒนาระบบต้องมีและดำรงคุณสมบัติดังต่อไปนี้</p> <p>(1) มีฐานะการเงินที่มั่นคงและไม่มีความเสี่ยงที่อาจทำให้ไม่สามารถดำเนินธุรกิจได้</p> <p>(2) มีผลงานและประสบการณ์ด้านการพัฒนาและการให้บริการที่เกี่ยวข้องกับระบบส่งคำสั่งซื้อขายไม่น้อยกว่า 2 ปีก่อนยื่นคำขอหรือตามระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์เห็นสมควร</p> <p>(3) มีผู้บริหารซึ่งมีความสามารถ มีความซื่อสัตย์และมีประสบการณ์ในธุรกิจด้านพัฒนาระบบคอมพิวเตอร์ โดยต้องไม่เคยเป็นผู้บริหารของผู้พัฒนาระบบที่ตลาดหลักทรัพย์พิจารณาว่าขาดจรรยาบรรณในการประกอบธุรกิจในขณะที่ดำรงตำแหน่งนั้น ทั้งนี้ ตามแนวทางและภายในช่วงระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p> <p>(4) มีระบบการจัดการด้านการพัฒนาและให้บริการเกี่ยวกับระบบส่งคำสั่งซื้อขายที่เป็นที่ยอมรับตามมาตรฐานสากลหรือมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์ยอมรับ</p> <p>(5) มีบุคลากรที่เพียงพอ ซึ่งมีความรู้ความสามารถและประสบการณ์ในงานด้านพัฒนาและให้บริการเกี่ยวกับระบบส่งคำสั่งซื้อขาย</p>	<p>ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกและคุณสมบัติของผู้พัฒนาระบบ</p>
<p>(*ความในข้อ 10 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)</p>	
<p>ข้อ 11 ในกรณีที่ผู้พัฒนาระบบไม่สามารถดำรงคุณสมบัติตามข้อ 10 ตลาดหลักทรัพย์อาจห้ามสมาชิกใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกซึ่งพัฒนาโดยผู้พัฒนาระบบดังกล่าว หรือกำหนดให้สมาชิกเปลี่ยนแปลงผู้พัฒนาระบบ หรือดำเนินการอื่นใดตามที่ตลาดหลักทรัพย์เห็นสมควร</p>	<p>การกำกับดูแลผู้พัฒนาระบบ</p>

ส่วนที่ 3

การรับรองระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกและความพร้อมในการใช้งาน

ข้อ 12 สมาชิกต้องรับรองว่าระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกทำงานได้ถูกต้องตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย และไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขาย ตลอดจนเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การรับรองระบบ
ส่งคำสั่งซื้อขาย
ของสมาชิก

ในกรณีที่สมาชิกมีการเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่ต้องได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ สมาชิกต้องรับรองว่าการเปลี่ยนแปลงดังกล่าวยังคงทำให้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกทำงานได้ถูกต้องตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย และไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขาย ตลอดจนเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ข้อ 13 ในกรณีที่สมาชิกใช้หรือเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกซึ่งพัฒนาโดยผู้พัฒนาระบบ นอกจากการดำเนินการรับรองตามข้อ 12 แล้ว สมาชิกต้องจัดให้มีผู้พัฒนาระบบหรือผู้ให้บริการตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ตรวจสอบและรับรองการทำงานของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามข้อ 12 ด้วย

การรับรองระบบ
ส่งคำสั่งซื้อขายของ
สมาชิกที่พัฒนาโดย
ผู้พัฒนาระบบ

ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดให้สมาชิกจัดให้มีหรือเปลี่ยนแปลงผู้ตรวจสอบและรับรองระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกได้ตามที่เห็นสมควร

ข้อ 14 ในกรณีที่สมาชิก ผู้พัฒนาระบบ หรือผู้ให้บริการตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์รับรองการทำงานของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกไม่ถูกต้องซึ่งอาจทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขาย ตลาดหลักทรัพย์อาจห้ามสมาชิกใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก หรือกำหนดให้สมาชิกเปลี่ยนแปลงผู้พัฒนาระบบ หรือดำเนินการอื่นใดตามที่ตลาดหลักทรัพย์เห็นสมควร

กรณีที่มีการรับรอง
ระบบส่งคำสั่งซื้อ
ขายไม่ถูกต้อง

ข้อ 15 ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์มีการเปลี่ยนแปลงใด ๆ ในระบบการซื้อขาย หรือมีการออกหรือเปลี่ยนแปลงข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ มติคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ หรือหนังสือเวียนที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย ให้สมาชิกเข้าทดสอบระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด พร้อมทั้งรายงานผลการทดสอบดังกล่าวมายังตลาดหลักทรัพย์ทุกครั้ง

การร่วมทดสอบ
ระบบเมื่อตลาด
หลักทรัพย์
เปลี่ยนแปลง
ระบบหรือ
ข้อกำหนด

ให้สมาชิกรายงานผลการทดสอบครั้งสุดท้ายก่อนเริ่มใช้งานระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามวรรคหนึ่ง พร้อมทั้งรับรองว่าสมาชิกได้ทดสอบแล้วว่าระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกทำงานได้ถูกต้องตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย และไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขาย ตลอดจนเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด โดยต้องมีผู้มีอำนาจลงนามของสมาชิกรับรองรายงานดังกล่าว

<p>ข้อ 16 สมาชิกต้องจัดให้มีแผนสำรองและระบบสำรองของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่สามารถทำงานได้ทันที เพื่อรองรับในกรณีที่ระบบส่งคำสั่งซื้อขายหลักของสมาชิกไม่สามารถทำงานได้ตามปกติ</p>	<p>แผนสำรองและระบบสำรองของสมาชิก</p>
<p>สมาชิกต้องรายงานรายละเอียดแผนสำรองและระบบสำรองของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามวรรคหนึ่งให้ตลาดหลักทรัพย์ทราบตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดและจัดให้มีการทดสอบระบบสำรองดังกล่าวอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง</p>	
<p>ข้อ 17 สมาชิกต้องมีความพร้อมและเข้าร่วมการทดสอบระบบการซื้อขายสำรองและการใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายสำรองที่ตลาดหลักทรัพย์จัดเตรียมไว้ให้สมาชิกในกรณีที่ระบบสำรองของสมาชิกไม่สามารถทำงานได้ตามปกติ โดยเข้าร่วมการทดสอบดังกล่าวตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p>	<p>ความพร้อมในการเข้าร่วมทดสอบระบบสำรอง</p>
<p>*ข้อ 18 สมาชิกต้องจัดให้มีระบบทดสอบ (Test Environment) เพื่อใช้ทดสอบการทำงานของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก และกำกับดูแลให้การส่งคำสั่งซื้อขายเพื่อการทดสอบใด ๆ จะต้องกระทำในระบบทดสอบ (Test Environment) เท่านั้น</p>	<p>การจัดให้มีระบบทดสอบ (Test Environment)</p>
<p><i>(*ความในข้อ 18 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)</i></p>	
<p>ข้อ 19 สมาชิกต้องจัดให้มีบุคลากรในการดูแลระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกอย่างเพียงพอทั้งในช่วงเวลาทำการและนอกเวลาทำการ</p>	<p>บุคลากรผู้ดูแลระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก</p>
<p>ข้อ 20 สมาชิกต้องมีระบบจัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายของลูกค้าตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด และจัดส่งข้อมูลดังกล่าวให้แก่ตลาดหลักทรัพย์ทันทีเมื่อตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ</p>	<p>การจัดเก็บข้อมูล</p>

ส่วนที่ 4

การเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

<p>ข้อ 21 สมาชิกจะเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกในกรณีดังต่อไปนี้ได้เมื่อได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ โดยแสดงรายละเอียดและทดสอบระบบตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p>	<p>การเปลี่ยนแปลงที่ ต้อง ใ้ ด้ รั บ อนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์</p>
<p>(1) เปลี่ยนแปลงผู้พัฒนาระบบ</p>	
<p>(2) เปลี่ยนแปลงเทคโนโลยีของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก</p>	

- (3) เปลี่ยนแปลงโครงสร้างระบบเครือข่ายของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก (Network Architecture)
- (4) เปลี่ยนแปลงฟังก์ชันการทำงานของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก (Functional Specification)
- (5) เปลี่ยนแปลงสถานที่ตั้งของเครื่องคอมพิวเตอร์ (Server) ของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก
- (6) เรื่องอื่น ๆ ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ข้อ 22 ในกรณีที่บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกตามข้อ 24 มีการเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายตามข้อ 21 สมาชิกต้องดำเนินการให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกจัดส่งรายงานการเปลี่ยนแปลงดังกล่าวให้ตลาดหลักทรัพย์ทราบตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของ บล. ที่มีใช้สมาชิก

ข้อ 23 ในกรณีที่สมาชิกให้ผู้พัฒนาระบบเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก สมาชิกต้องมีมาตรการควบคุมดูแลการดำเนินการดังกล่าวของผู้พัฒนาระบบอย่างเคร่งครัดเพื่อป้องกันความเสียหายที่อาจเกิดแก่ระบบการซื้อขายได้

มาตรการควบคุมผู้พัฒนาระบบ

ส่วนที่ 5

การให้บุคคลอื่นต่อเชื่อมระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

ข้อ 24 สมาชิกอาจให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกหรือบุคคลอื่นใดต่อเชื่อมระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกเพื่อให้บุคคลดังกล่าวสามารถบันทึกคำสั่งซื้อขายได้ โดยการต่อเชื่อมดังกล่าวต้องเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การให้บุคคลอื่นต่อเชื่อมระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

ในกรณีสมาชิกให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกบันทึกคำสั่งซื้อขายตามวรรคหนึ่ง สมาชิกต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

- (1) จัดให้มีระบบการจัดการและกำกับดูแลการบันทึกคำสั่งซื้อขายของบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก
- (2) ให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกบันทึกคำสั่งซื้อขายโดยบุคคลที่ได้รับอนุญาตให้เป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต
- (3) ให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกยอมรับและปฏิบัติตามข้อกำหนดที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายโดยอนุโลม

ส่วนที่ 6

การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต

ข้อ 25 สมาชิกอาจจัดให้มีการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตได้เมื่อได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์โดยแสดงรายละเอียดว่าระบบดังกล่าวเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด และทดสอบระบบตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตต้องมีการทำงานและมีระบบการบริหารและควบคุมระบบรักษาความปลอดภัยในการปฏิบัติงาน (Security Management) ที่ได้มาตรฐานตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

สมาชิกต้องรับรองการทำงานของระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตและจัดให้มีผู้พัฒนาระบบหรือผู้ให้บริการตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ตรวจสอบและรับรองการทำงานของระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตตามหลักเกณฑ์ว่าด้วยการรับรองระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกและความพร้อมในการใช้งานในส่วนที่ 3 ของหมวด 1

ข้อ 26 ในกรณีที่สมาชิกจะเปลี่ยนแปลงระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตที่ได้รับอนุญาตตามข้อ 25 สมาชิกต้องดำเนินการตามหลักเกณฑ์ว่าด้วยการเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกในส่วนที่ 4 ของหมวด 1 และต้องดำเนินการรับรองการทำงานของระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตตามหลักเกณฑ์ว่าด้วยการรับรองระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกและความพร้อมในการใช้งานในส่วนที่ 3 ของหมวด 1

ข้อ 27 ในกรณีที่สมาชิกอนุญาตให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกมีระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตสำหรับลูกค้าของบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก สมาชิกต้องดำเนินการให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกยอมรับและปฏิบัติตามความในส่วนนี้

ข้อ 28 การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตให้กระทำได้ด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM)

ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต สมาชิกต้องระบุรหัสแสดงช่องทางในการบันทึกคำสั่งซื้อขาย (Designated Trader ID) ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ข้อ 29 ตลาดหลักทรัพย์อาจเรียกให้สมาชิกนำส่งรายชื่อลูกค้าที่ส่งคำสั่งซื้อขายในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การขออนุญาต และ
การใช้ระบบซื้อขาย
หลักทรัพย์ผ่าน
ระบบอินเทอร์เน็ต

การเปลี่ยนแปลง
ระบบซื้อขาย
หลักทรัพย์ผ่าน
ระบบอินเทอร์เน็ต

กรณีสมาชิกให้ บล. ที่มีใช้สมาชิกจัดให้มีการ
ซื้อขายหลักทรัพย์ผ่าน
ระบบอินเทอร์เน็ต

วิธีการเสนอซื้อขาย

การนำส่งรายชื่อลูกค้า

*ข้อ 30 -

(ยกเลิกความในข้อ 30 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

ส่วนที่ 7

การซื้อขายหลักทรัพย์ทางอิเล็กทรอนิกส์ (Direct Electronic Access)

ข้อ 31 สมาชิกอาจจัดให้มีการซื้อขายหลักทรัพย์ทางอิเล็กทรอนิกส์ (Direct Electronic Access) ได้ โดยต้องเป็นการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA ที่ได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์

การซื้อขาย
หลักทรัพย์ทาง
อิเล็กทรอนิกส์

*ข้อ 32 -

(ยกเลิกความในข้อ 32 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

*ข้อ 33 ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA สมาชิกต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

การดำเนินการของ
สมาชิกกรณีมีการ
ซื้อขายผ่านระบบ
DMA

(1) จัดให้มีกระบวนการในการคัดกรองลูกค้า เพื่อให้มั่นใจว่าลูกค้ามีความรู้ความเข้าใจเกี่ยวกับระบบและกระบวนการส่งคำสั่งซื้อขาย และข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย พร้อมทั้งแจ้งข้อมูลของลูกค้าที่จะทำการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA ต่อตลาดหลักทรัพย์ภายในเวลาและตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(2) ในกรณีที่สมาชิกพบหรือสงสัยว่าลูกค้าอาจฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย หรือกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์ร้องขอให้สมาชิกตรวจสอบและนำส่งข้อมูลเกี่ยวกับลูกค้าและข้อมูลการซื้อขายของลูกค้าให้แก่ตลาดหลักทรัพย์

(*ความในข้อ 33 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

ข้อ 34 ให้นำความในส่วนที่ 6 การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตมาใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA ตามส่วนนี้เท่าที่ไม่ขัดหรือแย้ง โดยอนุโลม

การนำความใน
ส่วนการซื้อขาย
หลักทรัพย์ผ่าน
ระบบอินเทอร์เน็ต
มาใช้บังคับ

*ส่วนที่ 8

การใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Algorithmic Trading)

(*ยกเลิกชื่อของส่วนที่ 8 การใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading) และให้ใช้ชื่อใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

ข้อ 35 สมาชิกอาจใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติได้ โดยก่อนเริ่มใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ สมาชิกต้องได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การขออนุญาตใช้
Algorithmic
Trading

*เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแล ให้สมาชิกแจ้งข้อมูลของลูกค้ำที่ใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติซึ่งลูกค้ำเป็นผู้พัฒนาหรือจัดหาด้วยตนเองต่อตลาดหลักทรัพย์ภายในเวลา และตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(*เพิ่มความในวรรคสองของข้อ 35 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

ข้อ 36 สมาชิกต้องรับรองว่าชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติตามข้อ 35 มีการทำงานและมีระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายที่เป็นไปตามข้อกำหนดหรือมาตรฐานของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย และจะไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขายหรือสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวมหรือไม่ทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงไปหรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market)

การรับรองของ
สมาชิกกรณีการ
ใช้ Algorithmic
Trading

ข้อ 37 ในกรณีที่สมาชิกประสงค์จะเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติมเกี่ยวกับชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติที่ได้รับอนุญาตตามข้อ 35 ในเรื่องดังต่อไปนี้ สมาชิกจะต้องได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ก่อนเริ่มใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติที่มีการเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติม

การเปลี่ยนแปลง
การใช้ Algorithmic
Trading

- (1) เพิ่มกลยุทธ์ (Strategy)
- (2) เปลี่ยนแปลงระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย
- (3) เปลี่ยนแปลงหลักการทำงานหรือฟังก์ชันการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์

สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ รวมถึงการเปลี่ยนแปลงค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ที่ทำให้ความเสี่ยงเพิ่มขึ้นหรือกระทบหลักการทำงานหรือฟังก์ชันการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ

ให้สมาชิกที่ประสงค์จะเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติมเกี่ยวกับชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติตามวรรคหนึ่งยื่นขออนุญาตต่อตลาดหลักทรัพย์ล่วงหน้าก่อนการเปลี่ยนแปลง ดังกล่าวตามระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ข้อ 38 ในการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติที่สมาชิก ใช้บันทึกการเสนอซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขาย สมาชิกต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) มีระบบการจัดการ และระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย และ กำกับดูแลการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติหรือจัดการการเสนอซื้อขายเมื่อมี เหตุจำเป็นและสมควร

(2) ควบคุมดูแลมิให้มีการบันทึกการเสนอซื้อขายที่มีลักษณะเป็นการทำให้หรือ อาจทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์หรือสภาพการเสนอซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวมเปลี่ยนแปลงไป หรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market)

การดำเนินการ
ของสมาชิก
สำหรับการใช้
Algorithmic
Trading

ข้อ 39 สมาชิกที่ได้รับอนุญาตให้ใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดย อัตโนมัติต้องทบทวนระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายให้มีประสิทธิภาพอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง และให้สมาชิกปรับปรุงหรือเปลี่ยนแปลงระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายให้เหมาะสม ในกรณีดังต่อไปนี้

(1) กรณีที่มีการแก้ไขข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายใน เรื่องที่ส่งผลกระทบต่อระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย

(2) กรณีที่ตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

การทบทวนระบบ
บริหารความเสี่ยง
สำหรับการใช้
Algorithmic
Trading

ข้อ 40 สมาชิกต้องจัดเก็บข้อมูลเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงฟังก์ชันการทำงานของ ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติในส่วนที่เกี่ยวกับค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ตามระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดและจัดส่งข้อมูลดังกล่าวให้แก่ตลาดหลักทรัพย์ทันที เมื่อตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

การจัดเก็บข้อมูล

ส่วนที่ 9

ข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขาย

ข้อ 41 ห้ามสมาชิกให้หรือจำหน่ายข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขายแก่ลูกค้าหรือ บุคคลอื่นไม่ว่าจะโดยวิธีการใด ยกเว้นการเปิดเผยข้อมูลตามข้อ 42 หรือการเปิดเผยข้อมูลให้บุคคล อื่นใดที่ได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์

ห้ามให้หรือจำหน่าย
ข้อมูลที่ได้จากระบบ
การซื้อขาย

ข้อ 42 ให้สมาชิกเปิดเผยข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขายให้แก่ลูกค้าตามที่ ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การเปิดเผยข้อมูล
ให้ลูกค้า

ข้อ 43 ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกระงับการให้หรือจำหน่ายข้อมูลที่ได้จากระบบ การซื้อขายแก่ลูกค้าของสมาชิกหรือบุคคลอื่นได้ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การระงับการให้
หรือจำหน่ายข้อมูล

หมวด 2

การกำกับดูแลการซื้อขายของสมาชิก

ข้อ 44 เพื่อกำกับดูแลการใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกหรือในกรณีที่มีเหตุ จำเป็นอันอาจมีผลกระทบต่อการทำงานของระบบการซื้อขายหรือต่อสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์ โดยรวม ตลาดหลักทรัพย์อาจดำเนินการดังต่อไปนี้

การกำกับดูแล
การใช้ระบบส่ง
คำสั่งซื้อขายของ
สมาชิก

- (1) ตรวจสอบระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก
- (2) กำหนดให้สมาชิกเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก
- (3) ห้ามสมาชิกใช้งานทั้งหมดหรือบางส่วนของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก
- (4) ระงับการให้บริการซื้อขายผ่านระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกหรือช่องทาง

การซื้อขายใด ๆ ของสมาชิก

*ข้อ 44 /1 เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบของ สมาชิก สมาชิกต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

การกำกับดูแล
การ ซื้อ ขาย
ผ่านระบบของ
สมาชิก

- (1) จัดให้มีมาตรการป้องกันความลับของลูกค้า
- (2) จัดให้มีมาตรการควบคุมความเสี่ยง รวมทั้งระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขาย

ก่อนส่งเข้ามาในระบบการซื้อขาย โดยระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายดังกล่าวต้องมีการตรวจสอบในเรื่อง ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด และทบทวนความเหมาะสมของมาตรการดังกล่าวอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง

- (3) จัดให้มีการบริหารจัดการ โดยสมาชิกต้องมีอำนาจควบคุมและบริหาร จัดการ รวมทั้งกำหนดและเปลี่ยนแปลงค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ในระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายได้ และทบทวนความเหมาะสมของค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ดังกล่าวอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง

(4) กรณีที่มีความจำเป็น สมาชิกต้องสามารถหยุดการส่งคำสั่งซื้อขายใหม่ และยกเลิกคำสั่งซื้อขายที่ถูกลงเข้ามาในระบบการซื้อขายแล้วได้ทันที (Kill Switch)

(5) จัดให้มีมาตรการป้องกันและควบคุมไม่ให้บุคคลอื่นบันทึกการซื้อขาย ให้แก่ลูกค้า ยกเว้นในกรณีที่มีเหตุขัดข้องทำให้ลูกค้าไม่สามารถบันทึกคำสั่งซื้อขายเข้ามาในระบบ ส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกได้ ลูกค้าอาจมอบหมายให้เจ้าหน้าที่รับอนุญาตบันทึกคำสั่งซื้อขายแทนได้

(6) จัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายตามมาตรฐานของตลาดหลักทรัพย์ โดยสามารถจำแนกช่องทางหรือวิธีการที่ใช้ในการเสนอซื้อขายได้ และจัดส่งข้อมูลดังกล่าวต่อตลาดหลักทรัพย์ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

(7) ควบคุมดูแลให้ลูกค้ารับทราบและปฏิบัติตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ มติของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ และหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ ที่เกี่ยวกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายในการซื้อขายหลักทรัพย์ รวมทั้งข้อห้ามปฏิบัติเกี่ยวกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายที่มีลักษณะไม่เหมาะสม

(8) จัดส่งข้อมูลเกี่ยวกับลูกค้าและข้อมูลการซื้อขายของลูกค้าให้แก่ตลาดหลักทรัพย์เมื่อตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

(*เพิ่มเติมความในข้อ 44/1 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

ข้อ 45 ในกรณีที่คำสั่งซื้อขายของลูกค้าที่ส่งผ่านระบบอินเทอร์เน็ตหรือส่งทางอิเล็กทรอนิกส์มีลักษณะฝ่าฝืนหรือไม่เป็นไปตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ มติของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ หรือหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกดำเนินการอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังต่อไปนี้

- (1) แจ้งให้ลูกค้าหยุดการบันทึกคำสั่งเข้ามาในระบบการซื้อขาย
- (2) ยกเลิกคำสั่งซื้อขายของลูกค้าที่มีลักษณะดังกล่าว
- (3) ระงับการให้บริการการซื้อขายหลักทรัพย์แก่ลูกค้า

ข้อ 46 ในกรณีที่ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติของสมาชิกมีการทำงานไม่เป็นไปตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย และทำให้หรืออาจทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขายหรือสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวม ตลาดหลักทรัพย์อาจระงับหรือยกเลิกการอนุญาตการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติได้

กรณีที่คำสั่งที่ส่งโดยชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติมีหรืออาจมีผลทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงไปหรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market) ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกปรับปรุงแก้ไขค่าพารามิเตอร์ (Parameters) และ/หรือ โปรแกรมฟังก์ชันการทำงานและ/หรือระบบบริหารความเสี่ยงของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติหรือระงับการใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ

การดำเนินการของสมาชิกกรณีลูกค้าฝ่าฝืนข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์

การระงับหรือยกเลิกการอนุญาตใช้ Algorithmic Trading เมื่อไม่เป็นไปตามข้อกำหนดและทำให้หรืออาจทำให้เกิดความเสียหายโดยรวม

ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นอันอาจมีผลกระทบต่อการทำงานของระบบการซื้อขายหรือต่อสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวม ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกกระงับการซื้อขายหลักทรัพย์โดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติทุกกลยุทธ์ (Strategy) หรือเฉพาะบางกลยุทธ์ (Strategy) เป็นการชั่วคราวได้

การกระงับการใช้
Algorithmic Trading
เมื่อมีเหตุจำเป็น หรือ
Circuit Breaker

เมื่อตลาดหลักทรัพย์หยุดทำการซื้อขายหลักทรัพย์ทั้งหมดอันเป็นผลมาจากการทำงานของระบบ Circuit Breaker ของตลาดหลักทรัพย์ ตลาดหลักทรัพย์จะให้สมาชิกกระงับการซื้อขายหลักทรัพย์โดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติเป็นการชั่วคราว

หมวด 3 เวลาทำการซื้อขาย

* ข้อ 47 ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดวิธีการซื้อขายแตกต่างกันสำหรับแต่ละช่วงเวลาทำการซื้อขาย รวมถึงอาจกำหนดเวลาทำการซื้อขายแตกต่างกันสำหรับหลักทรัพย์บางประเภทก็ได้
(*ความในข้อ 47 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 5) พ.ศ. 2562 ลงวันที่ 20 ธันวาคม 2562 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 13 มกราคม 2563 เป็นต้นไป)

เวลาทำการซื้อขาย

ข้อ 48 ตลาดหลักทรัพย์จะกำหนดเวลาเปิดและปิดทำการซื้อขายประจำวันตามเวลาที่ได้มีการสุ่มเลือก (Random) ด้วยระบบการซื้อขาย

เวลาเปิด/ปิด
ทำการซื้อขาย

ข้อ 49 ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดเปลี่ยนแปลงระยะเวลาก่อนการเปิดทำการซื้อขายเพื่อคำนวณหาราคาเปิด (Pre-open) หรือก่อนการปิดทำการซื้อขายเพื่อคำนวณหาราคาปิด (Pre-close) ตามข้อ 47 หรือข้อ 48 หรือระงับเป็นการชั่วคราว

การเปลี่ยนแปลง
เวลา Pre-open
หรือ Pre-close

หมวด 4 วิธีการซื้อขาย

ส่วนที่ 1 รายการซื้อขาย

ข้อ 50 การบันทึกคำสั่งซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขายต้องมีรายการอย่างน้อยตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

รายการขั้นต่ำในการ
บันทึกคำสั่งซื้อขาย

ส่วนที่ 2

การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM)

ข้อ 51	การเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนและมูลค่าของหลักทรัพย์ไม่เกินจำนวนและมูลค่าตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด	จำนวนและมูลค่าหลักทรัพย์สูงสุดที่เสนอซื้อขายได้
ข้อ 52	ให้หน่วยการซื้อขายของหลักทรัพย์แต่ละประเภทมีจำนวนตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด	หน่วยการซื้อขายหลักทรัพย์ (Board Lot)
ข้อ 53	ราคาเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาที่ตรงตามช่วงราคาในตลาดหลักทรัพย์กำหนด ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดช่วงราคาของหลักทรัพย์แต่ละประเภทแตกต่างกันไป	ช่วงราคา (Tick Size)
ข้อ 54	สมาชิกอาจระบุประเภทการเสนอซื้อขายอย่างใดอย่างหนึ่งในช่วงเวลาซื้อขายดังต่อไปนี้	ประเภทการเสนอซื้อขาย

ประเภทการเสนอซื้อขาย	ความหมายและลักษณะ	ช่วงเวลาซื้อขาย
1. Limit Order	การเสนอซื้อขายที่ระบุราคาซื้อขาย	<ul style="list-style-type: none"> ช่วงก่อนเปิดทำการ (Pre-open) ช่วงเวลาทำการ (Trading Session) ช่วงก่อนปิดทำการ (Pre-close)
2. Immediate or Cancel (IOC)	การเสนอซื้อขายประเภท Limit Order ซึ่งกำหนดให้มีการจับคู่การซื้อขายทันที และหากไม่สามารถจับคู่การซื้อขายได้เลย หรือจับคู่ได้บางส่วน และมีจำนวนการเสนอซื้อขายเหลืออยู่บางส่วน ให้ยกเลิกการเสนอซื้อขายที่ยังจับคู่ไม่ได้ในทันที	<ul style="list-style-type: none"> ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)
3. Fill or Kill (FOK)	การเสนอซื้อขายประเภท Limit Order ซึ่งกำหนดให้การเสนอซื้อขายมีการจับคู่การซื้อขายทันที และหากไม่สามารถจับคู่การซื้อขายดังกล่าวได้ทั้งหมดตามจำนวนที่มีการเสนอซื้อขาย ให้ยกเลิกการเสนอขายนั้นทันที	<ul style="list-style-type: none"> ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)
4. Iceberg Order	การเสนอซื้อขายประเภท Limit Order ในช่วงเวลาทำการซื้อขายที่ระบบการซื้อขายจะแบ่งการซื้อขายออกเป็นจำนวนย่อย ๆ แล้วทยอย	<ul style="list-style-type: none"> ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)

ประเภทการเสนอซื้อขาย	ความหมายและลักษณะ	ช่วงเวลาซื้อขาย
	นำเข้าสู่ระบบการซื้อขายโดยอัตโนมัติและให้การเสนอซื้อขายในครั้งหลังกระทำได้อีกเมื่อการเสนอซื้อขายในครั้งก่อนได้ถูกจับคู่การซื้อขายแล้ว	
5. At the Open (ATO)	การเสนอซื้อขายที่ประสงค์ให้มีการซื้อขายครั้งเดียวที่ราคาเปิด และหากมีจำนวนการเสนอซื้อขายที่ไม่สามารถจับคู่การซื้อขายได้ เมื่อเปิดทำการซื้อขาย ระบบการซื้อขายจะยกเลิกการเสนอซื้อขายที่ยังจับคู่ไม่ได้	<ul style="list-style-type: none"> • ช่วงก่อนเปิดทำการ (Pre-open)
6. At the Close (ATC)	การเสนอซื้อขายที่ประสงค์ให้มีการซื้อขายครั้งเดียวที่ราคาปิด และหากมีจำนวนการเสนอซื้อขายที่ไม่สามารถจับคู่การซื้อขายได้ เมื่อปิดทำการซื้อขาย ระบบการซื้อขายจะยกเลิกการเสนอซื้อขายที่ยังจับคู่ไม่ได้	<ul style="list-style-type: none"> • ช่วงก่อนปิดทำการ (Pre-close)
7. Market Order	การเสนอซื้อขายที่ระบุให้มีการเสนอซื้อ ณ ราคาเสนอขายต่ำสุดหรือเสนอขาย ณ ราคาเสนอซื้อสูงสุดตามลำดับ และหากมีจำนวนการเสนอซื้อขายที่ไม่สามารถจับคู่การซื้อขายได้ ระบบการซื้อขายจะยกเลิกจำนวนดังกล่าวทันที	<ul style="list-style-type: none"> • ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)
8. Special Market Order	การเสนอซื้อขายที่ระบุให้มีการเสนอซื้อ ณ ราคาเสนอขายต่ำสุดหรือเสนอขาย ณ ราคาเสนอซื้อสูงสุดตามลำดับ และหากมีจำนวนการเสนอซื้อขายที่ไม่สามารถจับคู่การซื้อขายได้ ระบบการซื้อขายจะจัดให้จำนวนดังกล่าวเป็นการเสนอซื้อที่ราคาสูงกว่าหรือเป็นการเสนอขายที่ราคาต่ำกว่าราคาซื้อขายสุดท้าย 1 ช่วงราคา	<ul style="list-style-type: none"> • ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)
9. Market to Limit Order	การเสนอซื้อขายที่ระบุให้มีการเสนอซื้อ ณ ราคาเสนอขายต่ำสุดหรือเสนอขาย ณ ราคาเสนอซื้อสูงสุดเพียงลำดับราคาเดียวและหากมีจำนวนการเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถจับคู่การซื้อขายได้ ระบบการซื้อขายจะจัดให้	<ul style="list-style-type: none"> • ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)

ประเภทการเสนอซื้อขาย	ความหมายและลักษณะ	ช่วงเวลาซื้อขาย
	จำนวนดังกล่าวเป็นการเสนอซื้อหรือเสนอขายที่ราคาซื้อขายสุดท้าย	

ข้อ 55 ระบบการซื้อขายจะจัดให้มีการเสนอซื้อขายประเภท At the Open (ATO) ราคา ATO และ ATC และ At the Close (ATC) เป็นการเสนอซื้อขายที่ราคาดังต่อไปนี้

(1) กรณีการเสนอซื้อ ระบบการซื้อขายจะจัดให้เป็นราคาที่สูงกว่าราคาเสนอซื้อสูงสุด 1 ช่วงราคา หรือราคาเสนอขายสูงสุด แล้วแต่ราคาใดจะสูงกว่า

(2) กรณีการเสนอขาย ระบบการซื้อขายจะจัดให้เป็นราคาที่ต่ำกว่าราคาเสนอขายต่ำสุด 1 ช่วงราคา หรือราคาเสนอซื้อต่ำสุด แล้วแต่ราคาใดจะต่ำกว่า

ในกรณีที่ราคาเสนอซื้อตาม (1) หรือราคาเสนอขายตาม (2) สูงกว่าราคาสูงสุด (Ceiling) หรือต่ำกว่าราคาต่ำสุด (Floor) ระบบการซื้อขายจะจัดให้มีการเสนอซื้อขายที่ราคาสูงสุด (Ceiling) หรือราคาต่ำสุด (Floor) แล้วแต่กรณี

เมื่อเปิดหรือปิดทำการซื้อขาย ระบบการซื้อขายจะจับคู่การซื้อขายโดยจัดให้มีการเสนอซื้อขายประเภท At the Open (ATO) และ At the Close (ATC) เป็นการเสนอซื้อขายที่อยู่ในลำดับแรกก่อนการเสนอซื้อขายประเภท Limit Order

ข้อ 56 การระบุประเภทการเสนอซื้อขายแบบ Market Order หรือ Special Market Order หรือ Market to Limit Order สมาชิกสามารถระบุได้ต่อเมื่อปรากฏว่ามีคำสั่งซื้อขายฝั่งตรงข้ามที่ระบุประเภทการเสนอซื้อขายแบบ Limit Order อยู่ในระบบการซื้อขายในขณะนั้น

คำสั่งซื้อขายที่
ราคาตลาด

ข้อ 57 การระบุประเภทการเสนอซื้อขายแบบ Iceberg Order แต่ละครั้ง ให้สมาชิกบันทึกคำสั่งซื้อขายได้เฉพาะประเภท Limit Order และให้แบ่งการเสนอซื้อขายออกเป็นจำนวนย่อย ๆ ได้ไม่เกิน 100 การเสนอซื้อขาย

Iceberg Order

เมื่อเกิดกรณีใดกรณีหนึ่งดังต่อไปนี้ ระบบการซื้อขายจะยกเลิกการเสนอซื้อขายที่ระบุประเภท Iceberg Order

(1) ระบบการซื้อขายไม่อาจจัดให้มีการซื้อขายภายในช่วงเวลาทำการช่วงที่ 1 หรือช่วงที่ 2 แล้วแต่กรณี

(2) หลักทรัพย์ที่ทำการเสนอซื้อขายนั้นถูกห้ามการซื้อขายตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการห้ามซื้อขายหลักทรัพย์เป็นการชั่วคราว

ข้อ 58 การซื้อขายหลักทรัพย์หน่วยย่อย ให้สมาชิกบันทึกคำสั่งซื้อขายได้เฉพาะประเภท Limit Order เท่านั้น

การซื้อขายหลักทรัพย์
หน่วยย่อย

ส่วนที่ 3

การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report)

ข้อ 59	สมาชิกอาจซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) ตามประเภทการซื้อขายดังต่อไปนี้	ประเภทการบันทึกการซื้อขาย
(1)	การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot)	
(2)	การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างค้ำวเป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign)	
(3)	การบันทึกการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด (Trade Report - Buy-in)	
(4)	การบันทึกการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัด (Trade Report - Member buy – in)	
(5)	การบันทึกการซื้อขายนอกเวลาทำการประจำวัน (Trade Report - Off-hour) สมาชิกอาจประกาศโฆษณาการเสนอซื้อหรือขายหลักทรัพย์ในระบบการซื้อขายก็ได้ ทั้งนี้ การประกาศโฆษณาดังกล่าว ไม่มีผลผูกพันสมาชิกให้ต้องตกลงซื้อหรือขายตามประกาศโฆษณานั้น	
*ข้อ 60	การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) หมายถึง การซื้อขายซึ่งมีจำนวนหลักทรัพย์ตั้งแต่ 1 ล้านหน่วยของหลักทรัพย์หรือมีมูลค่าการซื้อขายตั้งแต่ 3 ล้านบาทขึ้นไป ตลาดหลักทรัพย์อาจอนุญาตให้สมาชิกบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ซึ่งมีจำนวนหลักทรัพย์หรือมูลค่าการซื้อขายต่ำกว่าที่กำหนดในวรรคหนึ่งได้ในกรณีที่สมาชิกซื้อขายหลักทรัพย์เพื่อปฏิบัติให้เป็นไปตามกฎหมาย มิให้นำหลักเกณฑ์เรื่องหน่วยการซื้อขายตามข้อ 52 และช่วงราคาตามข้อ 53 มาใช้บังคับกับการบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ตามวรรคหนึ่งและวรรคสอง ให้สมาชิกรายงานข้อมูลการบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ต่อตลาดหลักทรัพย์ตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด เมื่อสมาชิกบันทึกการซื้อขายที่มีปริมาณการซื้อหรือขายหลักทรัพย์เพิ่มขึ้นจนถึงหรือข้ามจุดซึ่งต้องทำคำเสนอซื้อหลักทรัพย์ทั้งหมดของกิจการตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ หรือการซื้อหลักทรัพย์ที่สมาชิกรู้หรือมีเหตุอันควรรู้ว่า เป็นผลให้ผู้ซื้อได้มาหรือเป็นผู้ถือหลักทรัพย์เพิ่มขึ้นจนถึงหรือข้ามจุดซึ่งต้องทำคำเสนอซื้อหลักทรัพย์ดังกล่าว ให้สมาชิกรายงานทันทีภายหลังบันทึกการซื้อขาย (*ความในข้อ 60 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)	Trade Report – Big Lot
ข้อ 61	การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างค้ำวเป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign) ให้ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้	Trade Report – Foreign

(1) เป็นการซื้อขายหลักทรัพย์ซึ่งมีจำนวนหลักทรัพย์และมีมูลค่าการซื้อขายต่ำกว่าที่กำหนดในข้อ 60 วรรคหนึ่ง

(2) มิให้นำหลักเกณฑ์เรื่องหน่วยการซื้อขายตามข้อ 52 และช่วงราคาตามข้อ 53 มาใช้บังคับ

ข้อ 62 การบันทึกการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด (Trade Report - Buy-in) ให้ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

**Trade Report –
Buy - in**

(1) บันทึกการซื้อขายโดยสมาชิกผู้ซื้อและผู้ขายเป็นรายเดียวกัน (One-firm Trade Report)

(2) บันทึกการซื้อขายภายในช่วงเวลาตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(3) ราคาซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาที่ตรงตามช่วงราคาตามตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(4) การซื้อขายในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนหลักทรัพย์เป็นหน่วยการซื้อขายตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ข้อ 63 การบันทึกการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัด (Trade Report - Member buy-in) ให้ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

**Trade Report –
Member buy - in**

(1) บันทึกการซื้อขายในวันที่สมาชิกมีหน้าที่ส่งมอบหลักทรัพย์ตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(2) ราคาซื้อขายต้องเป็นราคาที่เพิ่มขึ้นอีกไม่น้อยกว่า 5 ช่วงราคาจากราคาปิดของวันทำการก่อนหน้า หรือราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด ณ เวลา 10.00 น. แล้วแต่ราคาใดจะสูงกว่า และให้ถือว่าเป็นราคาซื้อขายสำหรับการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัด (Final Member buy -in) ในวันนั้น และหากไม่สามารถซื้อได้ สมาชิกจะทำการซื้อขายในวันทำการถัดไปในราคาที่เพิ่มขึ้นอีกไม่น้อยกว่า 5 ช่วงราคาจากราคาปิดของวันทำการก่อนหน้า หรือราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด ณ เวลา 10.00 น. หรือราคาซื้อขายสำหรับการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัด (Final Member buy-in) ในวันทำการก่อนหน้า แล้วแต่ราคาใดจะสูงกว่า

(3) ราคาซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาที่ตรงตามช่วงราคาตามตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(4) การซื้อขายในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนหลักทรัพย์เป็นหน่วยการซื้อขาย ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(5) สำหรับหลักทรัพย์ใด ๆ ที่สมาชิกไม่สามารถดำเนินการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัดได้ครบทั้งจำนวนในวันนั้น และปรากฏว่ามีรายการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัดสำหรับหลักทรัพย์เดียวกันนั้นในวันทำการถัดไป สมาชิกจะรวมจำนวนหลักทรัพย์ที่ต้องดำเนินการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัดเข้ากับจำนวน

หลักทรัพย์ที่ยังไม่สามารถดำเนินการซื้อได้ โดยใช้ราคาเดียวกับราคาเสนอซื้อของหลักทรัพย์ส่วนที่ยังไม่สามารถดำเนินการซื้อได้

ข้อ 64	การบันทึกการซื้อขายนอกเวลาทำการ (Trade Report - Off-hour) ให้ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้	Trade Report – Off-hour
(1)	มีจำนวนหลักทรัพย์และมีมูลค่าการซื้อขายต่ำกว่าที่กำหนดในข้อ 60 วรรคหนึ่ง	
(2)	บันทึกการซื้อขายภายในช่วงเวลาตลาดหลักทรัพย์กำหนด	
(3)	ราคาซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาปิดหรือราคาเฉลี่ยของหลักทรัพย์ในเวลาทำการประจำวันของวันที่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว ในกรณีที่ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าวในเวลาทำการประจำวัน ให้ใช้ราคาปิดของวันทำการก่อนหน้านั้นเป็นราคาซื้อขาย	
(4)	การซื้อขายในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนหลักทรัพย์เป็นหน่วยการซื้อขายตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด	

หมวด 5

หลักเกณฑ์เฉพาะการซื้อขายหลักทรัพย์บางประเภท

ส่วนที่ 1

การซื้อขายใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย

(Non-voting Depository Receipt: NVDR)

ข้อ 65	การซื้อขายใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทยให้กระทำด้วยวิธีการซื้อขายตามหมวด 4 โดยให้สมาชิกบันทึกเครื่องหมายแสดงว่าเป็นคำสั่งซื้อขายใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทยตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด	วิธีการซื้อขาย NVDR
--------	--	---------------------

ส่วนที่ 2

การซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าว

ข้อ 66	การซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าว ให้กระทำด้วยวิธีการซื้อขายตามหมวด 4 โดยให้สมาชิกบันทึกเครื่องหมายแสดงว่าเป็นคำสั่งซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าวตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด	วิธีการซื้อขาย หน่วยลงทุน Thai Trust Fund
--------	---	---

ข้อ 67 ตลาดหลักทรัพย์อาจห้ามไม่ให้สมาชิกบันทึกคำสั่งซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าวในกรณีที่ต้องทำให้อัตราส่วนการลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าวเกินกว่าอัตราส่วนที่กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าวได้ตกลงไว้กับบริษัทจดทะเบียน

การห้ามสมาชิกซื้อขายหน่วยลงทุน Thai Trust Fund ถิ่นอัตราส่วนการลงทุน

ข้อ 68 ให้สมาชิกมีมาตรการในการตรวจสอบว่าการบันทึกคำสั่งซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าวเป็นการเสนอซื้อขายหรือซื้อขายตามคำสั่งของลูกค้าซึ่งเป็นคนต่างด้าวเท่านั้น

การตรวจสอบว่าลูกค้าต่างด้าวเป็นผู้ส่งคำสั่ง

*ส่วนที่ 3 การซื้อขายตราสารหนี้

(*ยกเลิกความในส่วนที่ 3 การซื้อขายตราสารหนี้ โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ยกเลิกและปรับปรุงความในประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่เกี่ยวกับตราสารหนี้ที่ได้รับการจดทะเบียนหรือได้รับอนุญาตให้ทำการซื้อขายได้ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2563 ลงวันที่ 29 ธันวาคม 2563 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

วิธีการซื้อขายตราสารหนี้

*ส่วนที่ 4 การซื้อขายหุ้นสามัญที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์ (LiVEx)

ข้อ 73/1 ในส่วนนี้

นิยาม

“ไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์” (LiVEx) หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์ไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์

“หลักทรัพย์จดทะเบียน” หมายความว่า หลักทรัพย์ที่ได้รับการจดทะเบียนให้ทำการซื้อขายได้ในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์ (LiVEx)

“หลักทรัพย์” หมายความว่า หุ้นสามัญที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนตามข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับหุ้นสามัญเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์

“ศูนย์รับฝาก” หมายความว่า บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด

ข้อ 73/2 ความในส่วนนี้ให้ใช้บังคับกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหุ้นสามัญที่ได้รับการจดทะเบียนให้ทำการซื้อขายได้ในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์ (LiVEx) ตามข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับหุ้นสามัญเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์

การนำหลักเกณฑ์ทั่วไปมาใช้เท่าที่ไม่ขัดหรือแย้ง

ให้นำหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่กำหนดไว้ในข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ มาใช้บังคับกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ตามส่วนนี้ด้วยเท่าที่ไม่ขัดหรือแย้ง

ข้อ 73/3 การซื้อขายในส่วนนี้ให้สามารถกระทำด้วยการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) หรือวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) วิธีการซื้อขาย

ข้อ 73/4 ในการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) ให้สมาชิกประเภทการเสนอซื้อขายตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด โดยสมาชิกอาจบันทึกการเสนอซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขายในช่วงเวลาก่อนจับคู่การซื้อขาย เพื่อให้ระบบการซื้อขายคำนวณราคาเพื่อจับคู่การซื้อขายในคราวเดียวโดยอัตโนมัติตามหลักราคาและเวลาที่ดีที่สุด (Price then Time Priority) ทั้งนี้ ให้นำหลักเกณฑ์ในการกำหนดราคาเปิดหรือราคาปิดสำหรับช่วงก่อนเปิดทำการซื้อขาย (Pre-open) หรือก่อนปิดทำการซื้อขาย (Pre-close) มาใช้กับการคำนวณราคาเพื่อจับคู่การซื้อขายโดยอนุโลม

ให้ถือว่าราคาจับคู่ของหลักทรัพย์ที่คำนวณได้ตามวรรคหนึ่งในวันใดเป็นราคาปิดของหลักทรัพย์ในวันดังกล่าว ราคาอ้างอิง

ข้อ 73/5 ตลาดหลักทรัพย์จะกำหนดเวลาจับคู่การซื้อขายประจำวันตามเวลาที่ได้มีการสุ่มเลือก (Random) ด้วยระบบการซื้อขาย การกำหนดเวลาจับคู่การซื้อขาย

ข้อ 73/6 ก่อนบันทึกคำสั่งซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขาย ให้สมาชิกผู้ซื้อดำเนินการตรวจสอบว่าลูกค้าได้ดำรงเงินไว้ในจำนวนที่เพียงพอสำหรับการชำระราคาหลักทรัพย์ และให้สมาชิกผู้ขายดำเนินการตรวจสอบว่าลูกค้าได้ดำรงหลักทรัพย์ไว้ในจำนวนที่เพียงพอสำหรับการส่งมอบหลักทรัพย์ การตรวจสอบข้อมูลก่อนบันทึกคำสั่งซื้อขาย

ข้อ 73/7 สมาชิกอาจแก้ไขหรือยกเลิกการเสนอซื้อขายของตนได้เฉพาะก่อนที่การเสนอซื้อขายดังกล่าวจะได้รับการจับคู่ซื้อขาย และให้กระทำด้วยระบบการซื้อขาย การแก้ไขหรือยกเลิกการซื้อขาย

การแก้ไขการเสนอซื้อขายตามวรรคหนึ่ง ให้กระทำได้เฉพาะรายการดังต่อไปนี้

- (1) การลดจำนวนหลักทรัพย์
- (2) รายการอื่นตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การขออนุญาตแก้ไขหรือยกเลิกการซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขาย สมาชิกไม่อาจกระทำได้

ข้อ 73/8 ตลาดหลักทรัพย์อาจประกาศขึ้นเครื่องหมายตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดไว้ที่หลักทรัพย์ในช่วงเวลาทำการซื้อขายภายหลังจากที่นายทะเบียนหลักทรัพย์ได้กำหนดรายชื่อผู้ถือหลักทรัพย์ที่จะได้รับสิทธิประโยชน์จากบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์เป็นส่วนหนึ่งของทะเบียนผู้ถือหลักทรัพย์ เพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์ในช่วงที่ขึ้นเครื่องหมายดังกล่าวเป็นราคาที่ไม่รวมถึงสิทธิประโยชน์ที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์จะให้หรือให้แก่ผู้ถือหลักทรัพย์ในการปิดสมุดทะเบียนพักการโอนหลักทรัพย์ หรือในการกำหนดรายชื่อผู้ถือหลักทรัพย์ในคราวนั้น เครื่องหมาย X

ข้อ 73/9 ในการชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ระหว่างสมาชิก ให้สมาชิก ดำเนินการ โดยใช้บริการที่ศูนย์รับฝากจัดให้มีขึ้น และสมาชิกต้องปฏิบัติตามข้อบังคับของศูนย์รับฝาก เกี่ยวกับการส่งมอบและรับมอบหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายในไลฟ์อิเล็กทรอนิกส์ (LiVEx)

การชำระ
ราคาและ
การส่งมอบ
หลักทรัพย์

ข้อ 73/10 มิให้นำหลักเกณฑ์ เงื่อนไข หรือวิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ ในเรื่องดังต่อไปนี้มาใช้กับการซื้อขายในส่วนนี้

หลักเกณฑ์ที่
ไม่นำมาใช้กับ
การซื้อขาย
หลักทรัพย์
จดทะเบียนใน
ไลฟ์ อิเล็ก
ทรอนิกส์

- (1) การกำหนดราคาสูงสุด (Ceiling) หรือราคาต่ำสุด (Floor)
- (2) การหยุดการซื้อขายทั้งหมด (Circuit Breaker)
- (3) การซื้อขายหลักทรัพย์ทางอิเล็กทรอนิกส์ (Direct Electronic Access)
- (4) การใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Algorithmic Trading)
- (5) การขึ้นเครื่องหมาย NR (Notice Received)
- (6) การขึ้นเครื่องหมาย C (Caution)

Trading)

(*เพิ่มเติมความในตอนที่ 4 ของหมวด 5 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติ เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 7) พ.ศ. 2565 ลงวันที่ 14 มีนาคม 2565 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 31 มีนาคม 2565 เป็นต้นไป)

*ส่วนที่ 5

การซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วย

ข้อ 73/11 ในส่วนนี้

“ตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ” และ “บริษัทผู้ออกตราสารแสดงสิทธิ” ให้มีความหมายเช่นเดียวกับบทนิยามของคำดังกล่าวที่กำหนดไว้ในข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับ การเปิดเผยสารสนเทศ และการเพิกถอนตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ

นิยาม

ข้อ 73/12 ความในส่วนนี้ให้ใช้บังคับกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบ ตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วย

การนำหลัก
เกณฑ์ทั่วไป
มาใช้เท่าที่ไม่
ขัดหรือแย้ง

ให้นำหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่กำหนดไว้ในข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วย การซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ มาใช้บังคับกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวน เต็มของหน่วยในส่วนนี้ด้วยเท่าที่ไม่ขัดหรือแย้ง

ข้อ 73/13 ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดให้บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขายตาม หมวด 9 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ใน

การซื้อขายโดย
บุคคลที่เกี่ยวข้องใน
ระบบการซื้อขาย

ตลาดหลักทรัพย์ สามารถดำเนินการซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วยได้ตามที่เห็นสมควร

ข้อ 73/14 การซื้อขายด้วยระบบการซื้อขายให้กระทำได้ในเวลาทำการซื้อขายที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ทั้งนี้ ในกรณีที่มีการซื้อขายในช่วงเวลาภายหลัง 24.00 น. ของวันทำการต่อเนื่องไปถึงวันถัดไป ให้ถือว่าการซื้อขายในช่วงเวลาดังกล่าวเป็นการซื้อขายในวันทำการด้วย เวลาทำการซื้อขาย

ข้อ 73/15 การซื้อขายในส่วนนี้ให้สามารถกระทำด้วยการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) โดยสมาชิกอาจบันทึกการเสนอซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขายโดยระบุประเภทการเสนอซื้อขายในช่วงเวลาซื้อขายตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ซึ่งคำสั่งซื้อขายอาจจะระบุเป็นจำนวนเงินหรือจำนวนหน่วยของตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ ที่เป็นจำนวนเต็มหรือทศนิยมก็ได้ การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ

การเสนอซื้อขายตามวรรคหนึ่ง ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดเวลาหรือช่วงเวลาที่มผล (Validity) ในระบบการซื้อขาย อายุของการเสนอซื้อขายให้ถือว่าราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายของตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศตามวรรคหนึ่งเป็นราคาอ้างอิงของตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศในวันทำการนั้น ราคาอ้างอิง

ข้อ 73/16 ก่อนบันทึกคำสั่งซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขาย ให้สมาชิกผู้ซื้อดำเนินการตรวจสอบว่าลูกค้าได้ชำระเงินไว้ในจำนวนที่เพียงพอสำหรับการชำระราคาตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ และให้สมาชิกผู้ขายดำเนินการตรวจสอบว่าลูกค้าได้ชำระตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศไว้ในจำนวนที่เพียงพอสำหรับการส่งมอบตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ การตรวจสอบข้อมูลก่อนบันทึกคำสั่งซื้อขาย

ข้อ 73/17 เพื่อประโยชน์ในการควบคุมความผันผวนของราคาซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ ตลาดหลักทรัพย์อาจจัดให้มีระบบป้องกันการจับคู่คำสั่งซื้อขายที่เกินกว่ากรอบราคาซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศก็ได้ โดยระบบป้องกันดังกล่าวให้เป็นไปตามแนวทางที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด การกำหนดกรอบราคาซื้อขาย

ข้อ 73/18 สมาชิกอาจยกเลิกการเสนอซื้อขายของตนได้เฉพาะก่อนที่การเสนอซื้อขายดังกล่าวจะได้รับการจับคู่ซื้อขาย และให้กระทำด้วยระบบการซื้อขาย การแก้ไขการเสนอซื้อขายหรือการซื้อขาย สมาชิกไม่อาจกระทำได้ การแก้ไขยกเลิกการเสนอซื้อขายหรือการซื้อขาย

ข้อ 73/19 การประกาศขึ้นเครื่องหมายไคในช่วงเวลาใดไว้ที่ตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ เพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายของตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศในช่วงเวลาที่ขึ้นเครื่องหมายดังกล่าวเป็นราคาที่ ไม่รวมถึงสิทธิประโยชน์ที่บริษัทผู้ออกตราสารแสดงสิทธิจะให้หรือให้แก่ผู้ถือตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศนั้น ในการปิดสมุดทะเบียนพักการโอน การขึ้นเครื่องหมาย X

ตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศหรือในการกำหนดรายชื่อผู้ถือตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศในคราวนั้น ให้เป็นไปตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ข้อ 73/20 เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลการซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ ตลาดหลักทรัพย์อาจจัดให้มีระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายก่อนส่งเข้ามาในระบบการซื้อขาย โดยหากพบว่ามีคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสม ระบบดังกล่าวอาจปฏิเสธคำสั่งซื้อขายนั้น รวมทั้งตลาดหลักทรัพย์อาจพิจารณาดำเนินการอื่นใดตามที่เห็นสมควรก็ได้

ระบบตรวจสอบ
คำสั่งซื้อขาย

คำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสมตามวรรคหนึ่ง ให้รวมถึงคำสั่งซื้อขายที่มีลักษณะหนึ่งลักษณะใดดังต่อไปนี้ ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดแนวทางในการพิจารณาคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสมได้

(1) คำสั่งซื้อขายที่อาจทำให้บุคคลทั่วไปเข้าใจผิดเกี่ยวกับราคาหรือปริมาณการซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ

(2) คำสั่งซื้อขายที่อาจมีผลทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศเปลี่ยนแปลงไปหรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด

ข้อ 73/21 มิให้นำหลักเกณฑ์ เงื่อนไข หรือวิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ในเรื่องดังต่อไปนี้มาใช้ในการซื้อขายในส่วนนี้

หลักเกณฑ์ที่ไม่
นำมาใช้กับการ
ซื้อขายตราสาร
แสดงสิทธิฯ

(1) หน่วยการซื้อขายของหลักทรัพย์ (Board Lot)

(2) การกำหนดราคาสูงสุด (Ceiling) หรือราคาต่ำสุด (Floor)

การหยุดการซื้อขายทั้งหมด (Circuit Breaker)

(*เพิ่มเติมความใน ส่วนที่ 5 ของหมวด 5 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 8) พ.ศ. 2565 ลงวันที่ 13 มิถุนายน 2565 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 27 มิถุนายน 2565 เป็นต้นไป)

*หมวด 5/1

(*ยกเลิกความในหมวด 5/1 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2562 ลงวันที่ 21 มีนาคม 2562 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2562 เป็นต้นไป)

หมวด 6

การแก้ไขหรือยกเลิกการซื้อขาย

ข้อ 74 การขออนุญาตแก้ไขการซื้อขาย ให้สมาชิกกระทำด้วยระบบการซื้อขายก่อนเวลา 17.00 น.

การแก้ไขหรือ
ยกเลิกการซื้อขาย

การขออนุญาตยกเลิกการบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) ให้สมาชิกกระทำด้วยระบบการซื้อขายก่อนเวลา 17.00 น. ยกเว้นการขออนุญาตยกเลิกการบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด (Trade Report - Buy-in) หรือการบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ถูกค้ำของสมาชิกผิคนัด (Trade Report - Member buy - in) ให้สมาชิกกระทำภายในช่วงเวลาตลาดหลักทรัพย์กำหนด

หมวด 7

เครื่องหมายประกอบการซื้อขาย

ส่วนที่ 1

เครื่องหมาย NP (Notice Pending) และเครื่องหมาย NR (Notice Received)

ข้อ 75 ในส่วนนี้

“บริษัทจดทะเบียน” หมายความว่า บริษัทที่มีหุ้นสามัญจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์
รวมถึงผู้มีหน้าที่เปิดเผยสารสนเทศตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการเปิดเผยสารสนเทศ

นิยาม

ข้อ 76 ตลาดหลักทรัพย์อาจขึ้นเครื่องหมาย NP (Notice Pending) ไว้ที่หลักทรัพย์

เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบว่าบริษัทจดทะเบียนมีสารสนเทศต้องชี้แจงหรือรายงานต่อตลาดหลักทรัพย์

เครื่องหมาย NP

ข้อ 77 เมื่อตลาดหลักทรัพย์ได้รับสารสนเทศตามข้อ 76 ครบถ้วนและชัดเจนและ

ได้เผยแพร่แก่ผู้ลงทุนแล้ว ตลาดหลักทรัพย์อาจปลดเครื่องหมาย NP (Notice Pending) และขึ้นเครื่องหมาย NR (Notice Received) ไว้ที่หลักทรัพย์นั้น เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบว่าบริษัทจดทะเบียนได้ชี้แจงหรือรายงานสารสนเทศต่อตลาดหลักทรัพย์แล้ว

เครื่องหมาย NR

*ส่วนที่ 1/1

เครื่องหมาย NC (Non Compliance)

ข้อ 77/1 ตลาดหลักทรัพย์อาจขึ้นเครื่องหมาย NC (Non-Compliance) ไว้ที่หลักทรัพย์
เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบว่าหลักทรัพย์นั้นเป็นหลักทรัพย์ที่มีเหตุใดเหตุหนึ่งดังต่อไปนี้เกิดขึ้น

เครื่องหมาย NC

(1) หลักทรัพย์เข้าข่ายอาจถูกเพิกถอน

(2) หลักทรัพย์อยู่ระหว่างที่ตลาดหลักทรัพย์สั่งห้ามซื้อหรือขายหลักทรัพย์

จดทะเบียนเป็นการชั่วคราว โดยการขึ้นเครื่องหมาย SP ไว้ที่หลักทรัพย์นั้นเนื่องจากบริษัทจดทะเบียนฝ่าฝืนหรือละเลยไม่ปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ข้อบังคับ ระเบียบ ประกาศ คำสั่ง มติคณะกรรมการ ข้อตกลงการจดทะเบียนหลักทรัพย์กับตลาดหลักทรัพย์ ตลอดจนหนังสือเวียนใด ๆ

ที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้ถือปฏิบัติอย่างร้ายแรง และตลาดหลักทรัพย์ให้ซื้อหลักทรัพย์นั้นด้วยบัญชี
เงินสด (Cash Balance)

เมื่อบริษัทจดทะเบียนสามารถดำเนินการให้เหตุตาม (1) และ (2) ของวรรคหนึ่งหมดไป
ตลาดหลักทรัพย์อาจปลดเครื่องหมาย NC (Non-Compliance)

(*เพิ่มเติมความในตอนที่ 1/1 ของหมวด 7 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธี
ปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2562 ลงวันที่
21 มีนาคม 2562 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2562 เป็นต้นไป)

ส่วนที่ 2

เครื่องหมายแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์เป็นราคาที่ไม่รวมสิทธิประโยชน์

*ข้อ 78 ตลาดหลักทรัพย์อาจประกาศขึ้นเครื่องหมายตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด
ไว้ที่หลักทรัพย์ล่วงหน้า 2 วันทำการก่อนวันที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์กำหนดปิดสมุดทะเบียนพักการ
โอนหลักทรัพย์ หรือ 2 วันทำการถึงวันที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์กำหนดรายชื่อผู้ถือหลักทรัพย์เพื่อให้
สิทธิประโยชน์ แล้วแต่กรณี เพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์นั้นเป็นราคาที่ไม่รวมถึงสิทธิ
ประโยชน์ที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์นั้นจะให้หรือให้แก่ผู้ถือหลักทรัพย์นั้นในการปิดสมุดทะเบียนพัก
การโอนหลักทรัพย์หรือในการกำหนดรายชื่อผู้ถือหลักทรัพย์คราวนั้น

เครื่องหมาย X

(*ความในข้อ 78 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2561
ลงวันที่ 14 กุมภาพันธ์ 2561 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 6 มีนาคม 2561 เป็นต้นไป)

ข้อ 79 ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่สามารถขึ้นเครื่องหมายภายในระยะเวลาที่
กำหนดตามข้อ 78 ตลาดหลักทรัพย์อาจพิจารณาประกาศขึ้นเครื่องหมายไว้เป็นการล่วงหน้าก่อนวันที่
บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์กำหนดปิดสมุดทะเบียนพักการโอนหลักทรัพย์หรือกำหนดรายชื่อผู้ถือ
หลักทรัพย์เพื่อการนั้นตามสมควรแก่กรณี

การประกาศขึ้น
เครื่องหมาย X
ล่วงหน้า

*ส่วนที่ 3

เครื่องหมาย C (Caution)

ข้อ 79/1 ในส่วนนี้

“มาตรการดำเนินการ” หมายความว่า มาตรการดำเนินการตามข้อกำหนดของตลาด
หลักทรัพย์ว่าด้วยมาตรการดำเนินการกรณีบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะ
การเงินและการดำเนินธุรกิจ

นิยาม

“หลักทรัพย์” หมายความว่า หลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนที่อยู่ภายใต้มาตรการ
ดำเนินการ รวมถึงใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนดังกล่าวเป็นสินทรัพย์
อ้างอิง

หลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนตามวรรคหนึ่ง ไม่รวมหุ้นกู้ หุ้นกู้ที่อาจแปลงสภาพ
แห่งสิทธิเป็นหุ้นได้ และใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้

ข้อ 79/2 ตลาดหลักทรัพย์อาจขึ้นเครื่องหมาย C (Caution) ไว้ที่หลักทรัพย์ในวันทำการ
ถัดจากวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศรายชื่อบริษัทจดทะเบียนที่อยู่ภายใต้มาตรการดำเนินการ เพื่อให้
ผู้ลงทุนทราบว่าบริษัทจดทะเบียนอยู่ภายใต้มาตรการดำเนินการดังกล่าว

การขึ้น
เครื่องหมาย C

ข้อ 79/3 ตลาดหลักทรัพย์อาจปลดเครื่องหมาย C (Caution) ออกจากหลักทรัพย์ใน
วันทำการถัดจากวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศรายชื่อบริษัทจดทะเบียนที่พ้นจากมาตรการดำเนินการ
เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบว่าบริษัทจดทะเบียนได้พ้นจากมาตรการดำเนินการดังกล่าวแล้ว

การปลด
เครื่องหมาย C

(*เพิ่มเติมความใน ส่วนที่ 3 ของหมวด 7 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติ
เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 3) พ.ศ. 2561 ลงวันที่ 5 มีนาคม
2561 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 2 กรกฎาคม 2561 เป็นต้นไป)

หมวด 8

หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินโดยสมาชิก

ข้อ 80 สมาชิกผู้ประสงค์จะเป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นใดต้อง
ได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์

การขออนุญาตเป็น
ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้น
ที่จัดสรรเกิน

ให้สมาชิกยื่นคำขออนุญาตเป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินตามแบบที่ตลาด
หลักทรัพย์กำหนดเป็นการล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 1 วันทำการก่อนวันที่สมาชิกเริ่มทำการซื้อเพื่อส่งมอบ
หุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นดังกล่าว

ข้อ 81 ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นใดมีหน้าที่ต้องทำการซื้อเพื่อส่งมอบ
หุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นนั้น โดยการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM)
ตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขดังต่อไปนี้

วิธีการซื้อเพื่อส่งมอบ
หุ้นที่จัดสรรเกิน

- (1) ระบุว่าเป็นการเสนอซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน
- (2) บันทึกราคาสั่งซื้อประเภท Limit Order โดยกำหนดราคาเสนอซื้อที่ไม่สูงกว่า
ราคาเสนอซื้อสูงสุดขณะนั้น หรือราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายขณะนั้น หรือราคาเสนอขายครั้งแรก (IPO
Price) ทั้งนี้ แล้วแต่ราคาใดจะต่ำกว่า

(3) ให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินทำการแยกบัญชีสำหรับการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินออกต่างหากจากบัญชีเพื่อการลงทุนของตนเอง

ข้อ 82 ในการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในแต่ละวันทำการ ให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินแจ้งชื่อของเจ้าหน้าที่รับอนุญาตที่ทำหน้าที่ดังกล่าว

การแจ้งชื่อเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

ข้อ 83 ห้ามมิให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน กระทำการดังต่อไปนี้

ข้อห้ามของผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน

* (1) -

(2) ซื้อขายหุ้นที่ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินมีหน้าที่ต้องทำการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินเพื่อบัญชีของตนเองในระหว่างเวลาที่เป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นนั้น

(3) เสนอซื้อหุ้น ในราคาหรือปริมาณที่ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินรู้หรือมีเหตุอันควรรู้ว่าราคาดังกล่าวอาจเกิดจากการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์

(ยกเลิกความใน (1) ของข้อ 83 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

* ข้อ 84 ให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินจัดส่งรายงานประจำวันและรายงานสรุปการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินเมื่อครบระยะเวลาของการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน ให้แก่ตลาดหลักทรัพย์ตามแบบและวิธีการที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การจัดส่งรายงานเกี่ยวกับการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน

(ความในข้อ 84 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

ข้อ 85 ตลาดหลักทรัพย์จะระบุเครื่องหมายเพื่อแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบว่าหุ้นใดมีการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน

เครื่องหมาย

ข้อ 86 ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินจะหยุดทำหน้าที่ในการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินได้เฉพาะในกรณีใดกรณีหนึ่งดังต่อไปนี้

การหยุดทำหน้าที่ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน

(1) เมื่อสิ้นสุดระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์อนุญาตให้ทำการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน

(2) ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินใช้สิทธิซื้อหุ้นจากบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์หรือจากผู้ถือหุ้นเพื่อส่งมอบหุ้นในส่วนของจัดสรรเกินจำนวนให้แก่ผู้ลงทุน ตามที่ระบุไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการจัดสรรหุ้นเกินกว่าจำนวนที่จัดจำหน่าย

(3) เมื่อผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินซื้อหุ้นได้ครบตามจำนวนที่ได้ขออนุญาตไว้กับตลาดหลักทรัพย์

ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินที่ประสงค์จะหยุดทำหน้าที่เป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นใดในกรณีตามวรรคหนึ่ง (2) และ (3) ให้แจ้งต่อตลาดหลักทรัพย์ล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 1 วันทำการก่อนวันที่ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินจะหยุดทำหน้าที่เป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นนั้น

ข้อ 87 ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินผู้ใดฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหมวดนี้ นอกจากตลาดหลักทรัพย์จะพิจารณาลงโทษผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินดังกล่าวตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการพิจารณาลงโทษสมาชิกแล้ว ตลาดหลักทรัพย์จะไม่อนุญาตให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินนั้นทำหน้าที่เป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินเป็นเวลา 1 ปีนับแต่วันที่ ฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหมวดนี้

การฝ่าฝืนหลักเกณฑ์
การซื้อขายหุ้นคืน

หมวด 9

การซื้อขายหลักทรัพย์ของสมาชิกหรือบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก ในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนของลูกค้า

ข้อ 88 ในกรณีที่สมาชิกทำการซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทตนเองในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนของลูกค้า ให้สมาชิกปฏิบัติตามดังต่อไปนี้

(1) ซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าวเฉพาะด้วยเงินสด
(2) จัดให้มีมาตรการแก้ไขความผิดพลาดในการซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทตนเองที่เหมาะสมและชัดเจน โดยต้องไม่ทำให้สมาชิกเป็นผู้ถือหลักทรัพย์ของบริษัทตนเอง

(3) เปิดเผยให้ลูกค้าทราบถึงลักษณะที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ (Conflict of Interest) ตามที่กำหนดในหลักเกณฑ์ วิธีการ หรือแนวทางปฏิบัติของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยที่เกี่ยวกับการเป็นนายหน้าหรือตัวแทนการซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียน ตามที่ตลาดหลักทรัพย์ให้ความเห็นชอบ

ในกรณีที่สมาชิกทำการซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิกในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนของลูกค้า ให้สมาชิกปฏิบัติตามวรรคหนึ่ง (3)

ข้อ 89 ให้สมาชิกจัดทำหลักเกณฑ์การห้ามใช้ข้อมูลภายในเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทตนเองหรือบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิกในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนของลูกค้า และหลักเกณฑ์การห้ามซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าวที่ทำให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ (Conflict of Interest) ระหว่างสมาชิกกับลูกค้า เพื่อใช้ปฏิบัติภายในหน่วยงานของสมาชิก รวมทั้งบทลงโทษพนักงานของสมาชิกในกรณีที่มีการฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังกล่าว

ข้อปฏิบัติของ
สมาชิกกรณีซื้อ
ขายหลักทรัพย์
ของบริษัทตนเอง
หรือบริษัทที่มี
ส่วนเกี่ยวข้อง

หลักเกณฑ์เกี่ยวกับ
การใช้ข้อมูลภายใน
Conflict of Interest

ข้อ 90 ให้สมาชิกรายงานรายชื่อบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก และรายงานการเปลี่ยนแปลงรายชื่อบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิกที่เพิ่มขึ้นหรือลดลงต่อตลาดหลักทรัพย์ภายในเวลาและตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ทั้งนี้ ให้ระบุชื่อของบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก และความสัมพันธ์ที่แสดงถึงการมีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก และประกาศรายชื่อบริษัทนั้นไว้ในที่เปิดเผย ณ สำนักงานของสมาชิก

การรายงานและเปิดเผยชื่อของบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้อง

ข้อ 91 ให้สมาชิกจัดให้มีระบบกำกับดูแลและตรวจสอบการปฏิบัติงานของสมาชิก และรายงานให้ตลาดหลักทรัพย์ทราบทันทีเมื่อตรวจสอบพบว่าสมาชิกฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหมวดนี้

ระบบดูแลการปฏิบัติงาน

หมวด 10

บทเฉพาะกาล

ข้อ 92 ให้บรรดาคำสั่งหรือหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ที่ออกตามความในประกาศตลาดหลักทรัพย์ตามข้อ 2 ซึ่งใช้บังคับอยู่ก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ ยังคงใช้ต่อไปได้จนกว่าจะมีการกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข หรือวิธีการใด ๆ ในเรื่องดังกล่าวขึ้นใหม่ออกใช้บังคับ

บทเฉพาะกาล

ข้อ 93 ในกรณีที่ข้อกำหนด คำสั่ง หนังสือเวียน แนวทางปฏิบัติ หรือนโยบายของตลาดหลักทรัพย์ฉบับใดมีการอนุโลมใช้หรืออ้างอิงถึงประกาศหรือความในประกาศตลาดหลักทรัพย์ตามข้อ 2 ให้การอนุโลมใช้หรืออ้างอิงถึงประกาศหรือความในประกาศดังกล่าว หมายความว่า การอนุโลมใช้หรืออ้างอิงหลักเกณฑ์ในเรื่องดังกล่าวตามประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 แทน

บทเฉพาะกาล

ข้อ 94 ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้สมาชิกมีหน้าที่ปฏิบัติตามประกาศ
ตลาดหลักทรัพย์ตามข้อ 2 และสมาชิกยังปฏิบัติไม่ครบตามประกาศดังกล่าว ให้หน้าที่ในการดำเนินการ
ดังกล่าวยังคงมีต่อไปจนกว่าจะครบระยะเวลาที่กำหนด

บทเฉพาะกาล

ประกาศ ณ วันที่ 28 สิงหาคม 2560

(ลงนาม) นางเกศรา มัญชุศรี

(นางเกศรา มัญชุศรี)

กรรมการและผู้จัดการ

เหตุผลในการประกาศใช้: โดยที่ตลาดหลักทรัพย์ได้มีการปรับปรุงหลักเกณฑ์การซื้อขายหลักทรัพย์ เพื่อให้มีความเหมาะสม
กับสภาพแวดล้อมทางธุรกิจ เนื่องจากการขยายฐานผู้ลงทุนและเพิ่ม โอกาสทางธุรกิจของสมาชิก ตลอดจนสอดคล้องกับ
มาตรฐานสากล ตลาดหลักทรัพย์จึงเห็นควรให้ปรับปรุงหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบ
หลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ โดยได้จัดทำให้มีความเหมาะสมและง่ายต่อการทำความเข้าใจยิ่งขึ้น จึงสมควรออกประกาศนี้