

แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 20 ข้อ 42 ข้อ 48 ข้อ 50 ข้อ 51 ข้อ 52 และข้อ 53 ของประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 และข้อ 35 ของประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 และข้อ 47 ของประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคา และการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 5) พ.ศ. 2562 ลงวันที่ 20 ธันวาคม 2562 และข้อ 73/4 ข้อ 73/5 ข้อ 73/7 และข้อ 73/8 ของประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 7) พ.ศ. 2565 ลงวันที่ 14 มีนาคม 2565 และข้อ 78 ของประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2561 ลงวันที่ 14 กุมภาพันธ์ 2561 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

1. การจัดเก็บข้อมูล

สมาชิกต้องมีการจัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายของลูกค้าเพื่อตรวจสอบการทำธุรกรรมย้อนหลังอย่างน้อย 2 ปี หรือตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด โดยข้อมูลที่จัดเก็บให้รวมถึงแหล่งที่มาของคำสั่งซื้อขาย เช่น สำนักงาน สาขา IP Address ของเครื่องคอมพิวเตอร์ โดยสมาชิกต้องนำส่งให้ตลาดหลักทรัพย์ตรวจสอบได้เมื่อตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

2. ข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขาย

2.1 ข้อมูลที่สมาชิกต้องเปิดเผย

ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้สมาชิกเปิดเผยข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขายดังต่อไปนี้ให้แก่ลูกค้า

- (1) ชื่อหลักทรัพย์ ราคาสูงสุดและต่ำสุดของทุกหลักทรัพย์ในวันทำการซื้อขายนั้น
- (2) ราคาเสนอซื้อขายสูงสุดและต่ำสุดและราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายของทุกหลักทรัพย์

ในขณะนั้น

- (3) ราคาซื้อขายสูงสุดและต่ำสุด ราคาเปิดของทุกหลักทรัพย์ในวันทำการซื้อขายนั้น
- (4) ราคาปิดของทุกหลักทรัพย์ในวันทำการซื้อขายก่อนหน้านั้น การเปลี่ยนแปลงของราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายของทุกหลักทรัพย์ในขณะนั้นเปรียบเทียบกับราคาปิดในวันทำการซื้อขายก่อนหน้านั้นของหลักทรัพย์ดังกล่าว
- (5) ปริมาณ มูลค่าและจำนวนรายการซื้อขายของแต่ละหลักทรัพย์ในขณะนั้น
- (6) จำนวนหลักทรัพย์ที่ราคาเสนอซื้อสูงสุดและราคาที่ต่ำกว่าตามลำดับ และราคาเสนอขายต่ำสุด และราคาที่สูงกว่าตามลำดับของทุกหลักทรัพย์ในขณะนั้น
- (7) ราคาที่ระบบการซื้อขายคำนวณได้ว่าจะเป็นหรือเป็นราคาเปิด และจะเป็นหรือเป็นราคาปิด
- (8) ดัชนีราคาหลักทรัพย์ และการเปลี่ยนแปลงของดัชนีดังกล่าวเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีนั้นในวันทำการซื้อขายก่อนหน้านั้น
- (9) อักษรเครื่องหมายตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ เช่น NP NR H SP XR หรือ XD เป็นต้น

2.2 ข้อมูลที่สมาชิกอาจเปิดเผย

สมาชิกอาจเปิดเผยข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขายดังต่อไปนี้ให้แก่ลูกค้าแต่ละราย

- (1) สถานะของคำสั่งซื้อขายของลูกค้าดังกล่าว
- (2) ราคาที่ซื้อหรือขายได้ตามคำสั่งซื้อขายของลูกค้านั้น

3. การใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Algorithmic Trading)

สมาชิกต้องขออนุญาตใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติจากตลาดหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการดังนี้

3.1 การขออนุญาตใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติแบบทั่วไป โดยอาจใช้ได้หลายกลยุทธ์ (Strategy) ภายใต้ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายเดียวกัน ให้สมาชิกยื่นขออนุญาตต่อตลาดหลักทรัพย์เป็นการทั่วไปตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

เมื่อตลาดหลักทรัพย์อนุญาตการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติแบบทั่วไปตามวรรคหนึ่งแล้ว หากสมาชิกประสงค์จะเพิ่มกลยุทธ์ (Strategy) ที่จะใช้ภายใต้ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายดังกล่าว ให้สมาชิกยื่นขออนุญาตต่อตลาดหลักทรัพย์ตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 7 วันทำการ และต้องได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ก่อนเริ่มใช้งานกลยุทธ์ (Strategy) ที่มีการเพิ่มเติมขึ้น

3.2 การขออนุญาตใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติแบบรายกลยุทธ์ (Strategy) ให้สมาชิกยื่นขออนุญาตต่อตลาดหลักทรัพย์เป็นรายกลยุทธ์ (Strategy) ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

เมื่อตลาดหลักทรัพย์อนุญาตการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติตามข้อ 3.1 หรือ 3.2 แล้ว หากสมาชิกประสงค์จะเปลี่ยนแปลงในเรื่องดังต่อไปนี้ ให้สมาชิกยื่นขออนุญาตต่อ

ตลาดหลักทรัพย์ตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 7 วันทำการ โดยสมาชิกอาจต้องทดสอบตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดและต้องได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ก่อนการเปลี่ยนแปลงดังกล่าว

- (1) เปลี่ยนแปลงระบบบริหารความเสี่ยง
- (2) เปลี่ยนแปลงหลักการทำงานหรือฟังก์ชันการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับส่งคำสั่งซื้อขายโดยอัตโนมัติ หรือ
- (3) เปลี่ยนแปลงค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ที่ทำให้ความเสี่ยงเพิ่มขึ้นหรือกระทบหลักการทำงานหรือฟังก์ชันการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับส่งคำสั่งซื้อขายโดยอัตโนมัติ

4. เวลาทำการซื้อขาย

4.1 ตลาดหลักทรัพย์จะเปิดให้มีการซื้อขายประจำวันด้วยระบบการซื้อขายตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และในระหว่างช่วงเวลาดังต่อไปนี้ ทั้งนี้ ยกเว้นการซื้อขายหลักทรัพย์ตามข้อ 4.2 และ 4.3

ช่วงเวลาซื้อขาย	เวลาซื้อขาย	วิธีการซื้อขาย	ประเภทการซื้อขาย
1. ช่วงก่อนเปิดทำการ ช่วงที่ 1 เพื่อคำนวณหา ราคาเปิด (Pre-open Session I)	9.30 น. ถึง เปิดทำการ	<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) โดยจับคู่ซื้อขายครั้งเดียวเมื่อเปิดทำการ 	การซื้อขายเป็นหน่วยการซื้อขาย (Board Lot)
2. ช่วงเวลาทำการช่วงที่ 1 (Trading Session I)	เปิดทำการ ถึง 12.30 น.	<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การซื้อขายเป็นหน่วยการซื้อขาย (Board Lot) ■ การซื้อขายหน่วยย่อย (Odd Lot)
		<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) ■ การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign) ■ การบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด (Trade Report – Buy-in) ■ การบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของ

ช่วงเวลาซื้อขาย	เวลาซื้อขาย	วิธีการซื้อขาย	ประเภทการซื้อขาย
			สมาชิกผิคนัด (Trade Report - Member buy – in)
หยุดพักการซื้อขาย			
3. ช่วงก่อนเปิดทำการ ช่วงที่ 2 เพื่อคำนวณหา ราคาเปิด (Pre-open Session II)	14.00 น. ถึง เปิดทำการ	<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่ อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) โดยจับคู่ ซื้อขายครั้งเดียวเมื่อเปิดทำการ 	การซื้อขายเป็นหน่วยการ ซื้อขาย (Board Lot)
4. ช่วงเวลาทำการช่วงที่ 2 (Trading Session II)	เปิดทำการ ถึง 16.30 น.	<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่ อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การซื้อขายเป็นหน่วยการ ซื้อขาย (Board Lot) ■ การซื้อขายหน่วยย่อย (Odd Lot)
		<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการ ซื้อขาย (Trade Report) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขายราย ใหญ่ (Trade Report – Big Lot) ■ การบันทึกการซื้อขาย หลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าว เป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign)
5. ช่วงก่อนปิดทำการ เพื่อคำนวณหาราคาปิด (Pre-close)	16.30 น. ถึงปิดทำการ	<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่ อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) โดยจับคู่ ซื้อขายคราวเดียวเมื่อปิดทำการ 	การซื้อขายเป็นหน่วยการ ซื้อขาย (Board Lot)
		<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีบันทึก การซื้อขาย (Trade Report) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) ■ การบันทึกการซื้อขาย หลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าว เป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign)
6. ช่วงนอกเวลาทำการ (Off-hour)	ปิดทำการ ถึง 17.00 น.	<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีบันทึก การซื้อขาย (Trade Report) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขาย รายใหญ่ (Trade Report – Big Lot)

ช่วงเวลาซื้อขาย	เวลาซื้อขาย	วิธีการซื้อขาย	ประเภทการซื้อขาย
			<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign) ■ การบันทึกการซื้อขายนอกเวลาทำการ (Trade Report – Off-hour)

4.2 สำหรับการซื้อขายหลักทรัพย์ที่มีสินทรัพย์อ้างอิงต่างประเทศ ตลาดหลักทรัพย์จะเปิดให้มีการซื้อขายประจำวันด้วยระบบการซื้อขาย ตามหลักเกณฑ์ วิธีการและในระหว่างช่วงเวลาดังต่อไปนี้

ช่วงเวลาซื้อขาย	เวลาซื้อขาย	วิธีการซื้อขาย	ประเภทการซื้อขาย
1. ช่วงก่อนเปิดทำการ-เพื่อคำนวณหาราคาเปิด (Pre-open Session)	9.30 น. ถึงเปิดทำการ	<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) โดยจับคู่ซื้อขายครั้งเดียวเมื่อเปิดทำการ 	การซื้อขายเป็นหน่วยการซื้อขาย (Board Lot)
2. ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)	เปิดทำการ ถึง 16.30 น.	<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การซื้อขายเป็นหน่วยการซื้อขาย (Board Lot) ■ การซื้อขายหน่วยย่อย (Odd Lot)
		<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) ■ การบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด (Trade Report – Buy-in)* ■ การบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัด (Trade Report - Member buy – in)*
3. ช่วงก่อนปิดทำการเพื่อคำนวณหาราคาปิด (Pre-close)	16.30 น. ถึงปิดทำการ	<ul style="list-style-type: none"> ● การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) 	การซื้อขายเป็นหน่วยการซื้อขาย (Board Lot)

ช่วงเวลาซื้อขาย	เวลาซื้อขาย	วิธีการซื้อขาย	ประเภทการซื้อขาย
		AOM) โดยจับคู่ซื้อขายคราวเดียวเมื่อเปิดทำการ	
		● การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report)	การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot)
4. ช่วงนอกเวลาทำการ (Off-hour)	ปิดทำการ ถึง 17.00 น.	● การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report)	<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) ■ การบันทึกการซื้อขายนอกเวลาทำการ (Trade Report – Off-hour)

*การบันทึกการขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด (Trade Report – Buy-in) และการบันทึกการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิดนัด (Trade Report - Member buy – in) ให้ทำรายการภายในระยะเวลาที่สำนักกักบัญชีกำหนด

4.3 สำหรับการซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียนในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์ (LiVEx) ตลาดหลักทรัพย์จะเปิดให้มีการซื้อขายประจำวันด้วยระบบการซื้อขาย ตามหลักเกณฑ์ วิธีการและในระหว่างช่วงเวลาดังต่อไปนี้

ช่วงเวลาซื้อขาย	เวลาซื้อขาย	วิธีการซื้อขาย	ประเภทการซื้อขาย
1. ช่วงเวลาก่อนจับคู่การซื้อขายถึงเวลาจับคู่การซื้อขาย	9.30 น. ถึง เวลาจับคู่การซื้อขาย	● การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) โดยจับคู่ซื้อขายคราวเดียวเมื่อถึงเวลาจับคู่การซื้อขาย	■ การซื้อขายเป็นหน่วยการซื้อขาย (Board Lot)
		● การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report)	<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) ■ การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign)
2. ช่วงนอกเวลาทำการ (Off-hour)	ภายหลังเวลาจับคู่การซื้อขาย ถึง 11.00 น.	● การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report)	<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) ■ การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าว

ช่วงเวลาซื้อขาย	เวลาซื้อขาย	วิธีการซื้อขาย	ประเภทการซื้อขาย
			เป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign) ■ การบันทึกการซื้อขายนอกเวลาทำการ (Trade Report – Off-hour)

5. เวลาเปิดและเวลาปิดทำการซื้อขาย หรือเวลาจับคู่การซื้อขาย

5.1 ตลาดหลักทรัพย์จะจัดให้มีระบบการซื้อขาย ซึ่งจะสุ่มเลือก (Random) เวลาเปิดและเวลาปิดทำการซื้อขายประจำวัน ตามตารางด้านล่างนี้ ทั้งนี้ ยกเว้นการซื้อขายหลักทรัพย์ตามข้อ 5.2 และ 5.3

■ เวลาเปิดทำการซื้อขาย	
ช่วงเวลาทำการช่วงที่ 1	ระบบการซื้อขายจะกำหนดเวลาเปิดทำการในเวลาใดเวลาหนึ่งระหว่าง 9.55 น. ถึง 10.00 น.
ช่วงเวลาทำการช่วงที่ 2	ระบบการซื้อขายจะกำหนดเวลาเปิดทำการในเวลาใดเวลาหนึ่งระหว่าง 14.25 น. ถึง 14.30 น.
■ เวลาปิดทำการซื้อขาย	
ระบบการซื้อขายจะกำหนดเวลาปิดทำการในเวลาใดเวลาหนึ่งระหว่าง 16.35 น. ถึง 16.40 น.	

5.2 สำหรับการซื้อขายหลักทรัพย์ที่มีสินทรัพย์อ้างอิงต่างประเทศ ตลาดหลักทรัพย์จะจัดให้มีระบบการซื้อขาย ซึ่งจะสุ่มเลือก (Random) เวลาเปิดและเวลาปิดทำการซื้อขายประจำวัน ตามตารางด้านล่างนี้

■ เวลาเปิดทำการซื้อขาย	ระบบการซื้อขายจะกำหนดเวลาเปิดทำการในเวลาใดเวลาหนึ่งในช่วงเดียวกับช่วงเวลาทำการช่วงที่ 1 ตามข้อ 5.1
■ เวลาปิดทำการซื้อขาย	ระบบการซื้อขายจะกำหนดเวลาปิดทำการในเวลาใดเวลาหนึ่งในช่วงเดียวกับช่วงเวลาปิดทำการซื้อขาย ตามข้อ 5.1

5.3 สำหรับการซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียนในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์ (LiVEx) ตลาดหลักทรัพย์จะจัดให้มีระบบการซื้อขาย ซึ่งจะสุ่มเลือก (Random) เวลาจับคู่การซื้อขายประจำวันในเวลาใดเวลาหนึ่งระหว่าง 10.30 น. ถึง 10.35 น.

6. รายการขั้นต่ำในการบันทึกคำสั่งซื้อขายและการบันทึกการซื้อขาย
การบันทึกคำสั่งซื้อขายหรือการบันทึกการซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขายต้องมีรายการ
อย่างน้อยดังต่อไปนี้

- 6.1 ชื่อหลักทรัพย์
- 6.2 ราคาเสนอซื้อขายหรือราคาซื้อขาย
- 6.3 ปริมาณหลักทรัพย์
- 6.4 ประเภทผู้ซื้อขาย โดยให้จำแนกเป็นประเภทดังต่อไปนี้
 - (1) การลงทุนเพื่อบัญชีสมาชิกหรือบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก (Principal)
 - (2) ลูกค้าซึ่งเป็นคนต่างด้าว (Foreign)
 - (3) ลูกค้าซึ่งเป็นบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ธนาคาร บริษัทเงินทุน บริษัทประกัน
วินาศภัย บริษัทประกันชีวิต นิติบุคคลประเภทบริษัท กองทุนส่วนบุคคล กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ
กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ หรือนิติบุคคลอื่นที่มีลักษณะเดียวกัน (Institution)
 - (4) ลูกค้าอื่น (Customer) นอกจาก (1) – (3)
- 6.5 หมายเลขประจำตัวสมาชิก
- 6.6 หมายเลขประจำตัวเจ้าหน้าที่รับอนุญาต
- 6.7 เลขที่บัญชีลูกค้า (Client ID)
- 6.8 ประเภทการเสนอซื้อขายสำหรับการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching:
AOM) หรือประเภทการบันทึกการซื้อขาย สำหรับการซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report)
- 6.9 รายการอื่นตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

7. จำนวนและมูลค่าในการเสนอซื้อขายสำหรับการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated
Order Matching: AOM)

การเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนไม่เกิน 20 ล้านหน่วยของหลักทรัพย์นั้น
และมีมูลค่าไม่เกิน 500 ล้านบาท

8. หน่วยการซื้อขาย (Board Lot)

8.1 ให้หน่วยการซื้อขายของหลักทรัพย์แต่ละประเภทมีจำนวนตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด
เท่ากับ 100 หน่วยของหลักทรัพย์นั้น ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์อาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงหน่วยการซื้อขายของ
หลักทรัพย์ที่มีราคาปิดในแต่ละวันทำการซื้อขายตั้งแต่ 500 บาทขึ้นไป เป็นเวลา 6 เดือนติดต่อกันเป็น 50 หน่วยของ
หลักทรัพย์นั้น

8.2 ตลาดหลักทรัพย์อาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงหน่วยการซื้อขายจาก 50 หน่วยของหลักทรัพย์ตาม
ข้อ 8.1 กลับไปเป็น 100 หน่วยของหลักทรัพย์นั้น ในกรณีดังต่อไปนี้

(1) ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นในแต่ละวันทำการซื้อขายต่ำกว่า 500 บาท เป็นเวลา 6 เดือน
ติดต่อกัน หรือ

(2) มีเหตุการณ์อันอาจทำให้ราคาซื้อขายของหลักทรัพย์นั้นต่ำกว่า 500 บาท ในวันแรกที่มีเหตุการณ์ดังกล่าว

8.3 ไม่ให้นำจำนวนหน่วยการซื้อขายตามข้อ 8.1 และ 8.2 มาใช้บังคับกับหลักทรัพย์ดังต่อไปนี้ โดยให้หน่วยการซื้อขายเท่ากับ 1 หน่วยของหลักทรัพย์นั้น

(1) ตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศตามข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับ การเปิดเผยสารสนเทศ และการเพิกถอนตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ

(2) หลักทรัพย์จดทะเบียนในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์ (LiVEx)

9. ช่วงราคา (Tick Size)

ตลาดหลักทรัพย์กำหนดช่วงราคาในการเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ดังต่อไปนี้

9.1 กรณีทั่วไป

ราคาเสนอซื้อขาย		ช่วงราคา	
ต่ำกว่า			
		2 บาท	0.01 บาท
ตั้งแต่	2 บาท	แต่ต่ำกว่า 5 บาท	0.02 บาท
ตั้งแต่	5 บาท	แต่ต่ำกว่า 10 บาท	0.05 บาท
ตั้งแต่	10 บาท	แต่ต่ำกว่า 25 บาท	0.10 บาท
ตั้งแต่	25 บาท	แต่ต่ำกว่า 100 บาท	0.25 บาท
ตั้งแต่	100 บาท	แต่ต่ำกว่า 200 บาท	0.50 บาท
ตั้งแต่	200 บาท	แต่ต่ำกว่า 400 บาท	1.00 บาท
ตั้งแต่	400 บาทขึ้นไป		2.00 บาท

9.2 กรณียกเว้น

ตลาดหลักทรัพย์กำหนดช่วงราคาในการเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ดังต่อไปนี้ เท่ากับ 0.01 บาท

(1) หน่วยลงทุนของกองทุนรวม ยกเว้นหน่วยลงทุนของกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน และหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์

(2) หน่วยของอียิปต์ต่างประเทศ

10. ประเภทการเสนอซื้อขายสำหรับการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM)

สำหรับการเสนอซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียนในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์ (LiVEx) ให้สมาชิกระบุประเภทการเสนอซื้อขายที่ระบุราคาซื้อขาย (Limit Order)

11. การประกาศขึ้นเครื่องหมายแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์เป็นราคาที่ไม่รวมสิทธิประโยชน์ ตลาดหลักทรัพย์อาจประกาศขึ้นเครื่องหมายดังต่อไปนี้ไว้ที่หลักทรัพย์เพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์เป็นราคาที่ไม่รวมสิทธิประโยชน์

เครื่องหมาย	ความหมาย
1. XD (Excluding Dividend)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงเงินปันผล
2. XR (Excluding Right)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงสิทธิในการจองซื้อหลักทรัพย์ที่ออกใหม่ตามประเภทหลักทรัพย์เดิมและตามสัดส่วนการถือหลักทรัพย์ของบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์นั้น (Right Offering)
3. XB (Excluding Other Benefits)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงสิทธิในการจองซื้อหลักทรัพย์ที่ออกใหม่นอกจากที่ระบุไว้ใน 2.
4. XW (Excluding Warrant)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงสิทธิในการได้รับใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหลักทรัพย์นั้น
5. XT (Excluding Transferable Subscription Right)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงสิทธิในการได้รับใบแสดงสิทธิในการซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้
6. XN (Excluding Capital Return)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงเงินคืนทุน
7. XA (Excluding All)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงสิทธิประโยชน์ใด ๆ ตาม 1. ถึง 6. ซึ่งมากกว่าหนึ่งสิทธิประโยชน์

ผลบังคับใช้

ตลาดหลักทรัพย์จะใช้แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ฉบับนี้แทนแนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ ฉบับลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 โดยให้มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 31 มีนาคม 2565 เป็นต้นไป

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

14 มีนาคม 2565