

ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
เรื่อง การซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) พ.ศ. 2562

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 3/1 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด พ.ศ. 2544 ลงวันที่ 29 สิงหาคม พ.ศ. 2544 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด (ฉบับที่ 5) พ.ศ. 2558 ลงวันที่ 10 กรกฎาคม 2558 ข้อ 11 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การเพิกถอนหลักทรัพย์จดทะเบียน พ.ศ. 2542 ลงวันที่ 9 ธันวาคม พ.ศ. 2542 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การเพิกถอนหลักทรัพย์จดทะเบียน (ฉบับที่ 12) พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 25 ธันวาคม 2560 ข้อ 17/1 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การเพิกถอนหลักทรัพย์จดทะเบียน พ.ศ. 2542 ลงวันที่ 9 ธันวาคม พ.ศ. 2542 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การเพิกถอนหลักทรัพย์จดทะเบียน (ฉบับที่ 13) พ.ศ. 2562 ลงวันที่ 21 มีนาคม 2562 ข้อ 4 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจ พ.ศ. 2561 ลงวันที่ 5 มีนาคม พ.ศ. 2561 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจ (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2562 ลงวันที่ 21 มีนาคม 2562 และข้อ 9 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการเกี่ยวกับการห้ามซื้อหรือขายหลักทรัพย์จดทะเบียนเป็นการชั่วคราว พ.ศ. 2562 ลงวันที่ 21 มีนาคม 2562 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2562 เป็นต้นไป

ผลบังคับใช้

ข้อ 2 ในประกาศนี้

“ตลาดหลักทรัพย์” หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

นิยาม

“คณะกรรมการ” หมายความว่า คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์

“สมาชิก” หมายความว่า สมาชิกของตลาดหลักทรัพย์

“หลักทรัพย์” หมายความว่า หลักทรัพย์จดทะเบียน

“การซื้อขาย” หมายความว่า การซื้อหรือขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์

“บัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance)” หมายความว่า บัญชีที่ลูกค้าวางเงินไว้ล่วงหน้ากับสมาชิกเต็มจำนวนที่จะซื้อหลักทรัพย์ก่อนการซื้อหลักทรัพย์หรือมีข้อตกลงให้สมาชิกหักเงินตามคำสั่งของสมาชิกในบัญชีเงินฝากของลูกค้าที่ฝากเงินไว้เต็มจำนวนที่จะซื้อหลักทรัพย์ก่อนการซื้อหลักทรัพย์ หรือโอนเงินค่าขายหลักทรัพย์เข้าบัญชีดังกล่าว

“การขายชอร์ต” หมายความว่า การขายหลักทรัพย์ที่ต้องยืมหลักทรัพย์มาเพื่อการส่งมอบ

หมวด 1

การซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance)

ส่วนที่ 1

กรณีทั่วไป

ข้อ 3 ในกรณีที่เมื่อเหตุดังต่อไปนี้เกิดขึ้นกับหลักทรัพย์ใดและตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้มีการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าวด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าซื้อขายหลักทรัพย์นั้นด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ตามข้อ 4

(1) หลักทรัพย์อยู่ภายใต้มาตรการดำเนินการตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยมาตรการดำเนินการกรณีบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจ

(2) หลักทรัพย์ที่ไม่มีการซื้อขายหรือขายหลักทรัพย์ กรณีบริษัทจดทะเบียนอยู่ระหว่างดำเนินการตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดเรื่องแนวทางดำเนินการต่อบริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินงานหรือฐานะทางการเงินที่เข้าข่ายอาจถูกเพิกถอน

(3) หลักทรัพย์ที่ไม่มีการซื้อขายหรือขายหลักทรัพย์ก่อนวันที่มีผลเป็นการเพิกถอนตามที่คณะกรรมการกำหนดตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการเพิกถอนหลักทรัพย์

(4) หลักทรัพย์ที่ไม่มีการซื้อขายหรือขายหลักทรัพย์ กรณีมีการสั่งห้ามซื้อขายหลักทรัพย์ใดหลักทรัพย์หนึ่งในตลาดหลักทรัพย์เป็นการชั่วคราว โดยการขึ้นเครื่องหมาย SP ไว้ที่หลักทรัพย์นั้นครบตามระยะเวลาที่กำหนดตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการเกี่ยวกับการห้ามซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียนเป็นการชั่วคราว

ข้อ 4 ให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ในวันทำการที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้มีการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) และให้ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีดังกล่าวตลอดระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์ให้มีการซื้อขายหลักทรัพย์นั้น

ในระหว่างระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์ให้มีการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ตามวรรคหนึ่ง หากเหตุที่ทำให้หลักทรัพย์นั้นต้องซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) สิ้นสุดลง ให้มีการซื้อขายหลักทรัพย์นั้นด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ตามส่วนนี้ต่อไปอีก 1 วันทำการถัดจากวันที่เหตุดังกล่าวหมดไป

การซื้อขายหลักทรัพย์
ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์
(Cash Balance)
กรณีทั่วไป

ระยะเวลาการซื้อขาย
หลักทรัพย์ด้วย
บัญชีแคชบาลานซ์
(Cash Balance)

*ข้อ 5 ในกรณีที่สมาชิกต้องดำเนินการให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์ด้วยบัญชีเงินสด (Cash Balance) เนื่องจากหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนอยู่ภายใต้มาตรการดำเนินการตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยมาตรการดำเนินการกรณีบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะการเงิน และการดำเนินธุรกิจ ให้หลักทรัพย์ตามข้อนี้ นอกจากหมายถึงหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนที่อยู่ภายใต้ มาตรการดำเนินการแล้วยังหมายรวมถึงใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียน ดังกล่าวเป็นสินทรัพย์อ้างอิง

หลักทรัพย์ที่ต้องซื้อ ด้วยบัญชีเงินสด (Cash Balance) กรณีบริษัทอยู่ภายใต้ มาตรการดำเนินการ

(*ความในข้อ 5 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ยกเลิกและปรับปรุงความในประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่เกี่ยวกับตราสารหนี้ที่ได้รับการจดทะเบียนหรือ ได้รับอนุญาตให้ทำการซื้อขายได้ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2563 ลงวันที่ 29 ธันวาคม 2563 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

ส่วนที่ 2

กรณีหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนมีการซื้อขายผิดไปจากสภาพปกติของตลาด

ข้อ 6 ในส่วนนี้

“หลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายผิดไปจากสภาพปกติของตลาด” หมายความว่า หลักทรัพย์ที่มี อัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูงจนอาจส่งผลกระทบต่อสภาพการซื้อขาย และตลาดหลักทรัพย์เห็นว่าการซื้อขายหลักทรัพย์นั้นมีพฤติกรรมหรือลักษณะการซื้อขายที่ทำให้หรืออาจทำให้ราคาหรือปริมาณการ ซื้อขายเปลี่ยนแปลงไปอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด ทั้งนี้ ตามแนวทางที่ได้รับความเห็นชอบจาก คณะกรรมการ

นิยาม

*ข้อ 7 ให้สมาชิกเริ่มดำเนินการให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายผิดไปจากสภาพ ปกติของตลาดด้วยบัญชีเงินสด (Cash Balance) ในวันทำการถัดจากวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศให้ หลักทรัพย์ดังกล่าวเป็นหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายผิดไปจากสภาพปกติของตลาด โดยให้ทำการซื้อขายด้วย บัญชีดังกล่าวเป็นระยะเวลาตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การซื้อหลักทรัพย์ด้วย บัญชีเงินสด (Cash Balance) กรณีมีการซื้อขายผิด ไปจากสภาพปกติ

ในกรณีที่ระยะเวลาตามวรรคหนึ่งสิ้นสุดลงและหลักทรัพย์นั้นยังคงเป็นหลักทรัพย์ที่มีการ ซื้อขายที่ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด ให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์ด้วยบัญชีเงินสด (Cash Balance) ต่อไปจนกว่าหลักทรัพย์นั้นจะไม่เข้าเงื่อนไขเป็นหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายที่ผิดไปจากสภาพ ปกติของตลาด

(*ความในวรรคหนึ่งของข้อ 7 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่ง ประเทศไทย เรื่อง การซื้อหลักทรัพย์ด้วยบัญชีเงินสด (Cash Balance) (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 19 พฤศจิกายน 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 13 ธันวาคม 2564 เป็นต้นไป)

หมวด 2

การซื้อขายหลักทรัพย์เพื่อส่งมอบคืนหลักทรัพย์ (Short Covering)

ข้อ 8 ในกรณีที่ลูกค้าของสมาชิกทำการขายชอร์ตหลักทรัพย์ใด ๆ ก่อนวันที่ตลาดหลักทรัพย์จะประกาศให้หลักทรัพย์นั้นเป็นหลักทรัพย์ที่สมาชิกต้องดำเนินการให้ลูกค้าซื้อด้วยบัญชีแชนบาลานซ์ (Cash Balance) ในระยะเวลาตามหมวด 1 แล้วแต่กรณี ให้สมาชิกสามารถให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์เพื่อส่งมอบคืนหลักทรัพย์ดังกล่าว (Short Covering) ในบัญชีเดียวกับบัญชีที่ลูกค้าได้ทำการขายชอร์ตไว้ได้

การ short covering ในรอบระยะเวลาที่ทำการซื้อขายด้วยบัญชีแชนบาลานซ์ (Cash Balance)

บทเฉพาะกาล

ข้อ 9 ในกรณีที่มีความในข้อใดข้อหนึ่งของคำสั่งหรือหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ที่ออกตามความในข้อกำหนดในประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแชนบาลานซ์ (Cash Balance) พ.ศ. 2558 ลงวันที่ 10 กรกฎาคม 2558 มีการกำหนดเกี่ยวกับหลักทรัพย์ที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูง (Turnover List) ที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ประกาศกำหนด ให้หมายถึงหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายผิดไปจากสภาพปกติของตลาดตามประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแชนบาลานซ์ (Cash Balance) พ.ศ. 2562 ลงวันที่ 21 มีนาคม 2562 แทน

บทเฉพาะกาลรองรับให้ประกาศ Turnover List ที่สำนักงาน ก.ล.ต. ประกาศกำหนด หมายถึงหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายผิดไปจากสภาพปกติของตลาด

ข้อ 10 ให้บรรดาข้อกำหนด คำสั่ง หนังสือเวียน แนวทางปฏิบัติ หรือนโยบายของตลาดหลักทรัพย์ที่ออกตามความในประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแชนบาลานซ์ (Cash Balance) พ.ศ. 2558 ลงวันที่ 10 กรกฎาคม 2558 ซึ่งใช้บังคับอยู่ก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ หรือที่ยังมีผลใช้บังคับเนื่องจากบทเฉพาะกาลของบรรดาข้อกำหนดดังกล่าว ยังคงใช้ได้เท่าที่ไม่ขัดหรือแย้งกับประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแชนบาลานซ์ (Cash Balance) พ.ศ. 2562 ลงวันที่ 21 มีนาคม 2562 จนกว่าจะมีการออกข้อกำหนด คำสั่ง หนังสือเวียน แนวทางปฏิบัติ หรือนโยบายในเรื่องดังกล่าวขึ้นใหม่ออกใช้บังคับ

บทเฉพาะกาล

ข้อ 11 ในกรณีที่ข้อกำหนด คำสั่ง หนังสือเวียน แนวทางปฏิบัติ หรือนโยบายของตลาดหลักทรัพย์ฉบับใดมีการอนุโลมใช้หรืออ้างอิงถึงข้อกำหนดหรือความในประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแชนบาลานซ์ (Cash Balance) พ.ศ. 2558 ลงวันที่ 10 กรกฎาคม 2558 ให้การอนุโลมใช้หรืออ้างอิงถึงข้อกำหนดหรือความในข้อกำหนดดังกล่าว หมายความว่า การอนุโลมใช้หรืออ้างอิงหลักเกณฑ์ในเรื่องดังกล่าวตามประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแชนบาลานซ์ (Cash Balance) พ.ศ. 2562 ลงวันที่ 21 มีนาคม 2562 แทน

บทเฉพาะกาล

ข้อ 12 ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้สมาชิกเริ่มดำเนินการให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายคิดไปจากสภาพปกติของตลาดด้วยบัญชีแควชบาลานซ์ (Cash Balance) ตามประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแควชบาลานซ์ (Cash Balance) พ.ศ. 2558 ลงวันที่ 10 กรกฎาคม 2558 และยังไม่ครบกำหนดระยะเวลา ให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายคิดไปจากสภาพปกติของตลาดด้วยบัญชีแควชบาลานซ์ (Cash Balance) ดังกล่าวยังคงมีผลใช้บังคับจนกว่าจะครบระยะเวลาที่กำหนด

ประกาศ ณ วันที่ 21 มีนาคม 2562

(ลงนาม) ภากร ปีตธวัชชัย

(นายภากร ปีตธวัชชัย)

กรรมการและผู้จัดการ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

เหตุผลในการประกาศใช้ : โดยที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเห็นควรให้มีการเพิ่มเติมหลักเกณฑ์การซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแควชบาลานซ์ (Cash Balance) ให้รองรับการซื้อขายหลักทรัพย์เมื่อมีการสั่งห้ามซื้อหรือขายหลักทรัพย์เป็นการชั่วคราวและการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนก่อนวันที่มีผลเป็นการเพิกถอน จึงสมควรออกประกาศนี้