

**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  | นิยาม       |
|       | “การซื้อขายหลักทรัพย์ทางอิเล็กทรอนิกส์” (Direct Electronic Access) หมายความว่า การซื้อขายหลักทรัพย์ที่สมาชิกอนุญาตให้ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายทางอิเล็กทรอนิกส์ด้วยตนเอง       |             |

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

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

\*“ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ” (Algorithmic Trading) หมายความว่า ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับส่งคำสั่งซื้อขายที่สามารถสร้างและบันทึกการเสนอซื้อขายได้โดยอัตโนมัติ

(\*ยกเลิกบทนิยามคำว่า “ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ” (Program Trading) และให้ใช้ความใหม่แทน 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)

\*“หลักเกณฑ์สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย” หมายความว่า หลักเกณฑ์ของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินการกับลูกค้ำที่มีพฤติกรรมหรือลักษณะการส่งคำสั่งซื้อขายที่พิจารณาได้ว่าเป็นการส่งคำสั่งที่ไม่เหมาะสม ซึ่งอาจมีหรือมีผลทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงไปหรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market) โดยหลักเกณฑ์ของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยดังกล่าวต้องเป็นไปตามที่ได้รับความเห็นชอบจากตลาดหลักทรัพย์

(\*เพิ่มเติมบทนิยามคำว่า “หลักเกณฑ์สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย” โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 12) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 21 มิถุนายน 2567 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 เป็นต้นไป)

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

\*“หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารแห่งนี้” หมายความว่า หน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่มีนโยบายการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งเงินฝาก ตราสารแห่งนี้ หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นหรือการหาผลตอบแทนโดยวิธีการอื่นตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์ 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	อำนาจวินิจฉัยสั่งการของผู้จัดการ
ข้อ 5	สมาชิกอาจยื่นคำขอให้ตลาดหลักทรัพย์ออกหนังสือรับรองการซื้อขายของตนได้	การขอออกหนังสือรับรองการซื้อขาย

#### ส่วนที่ 2

#### ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

ข้อ 6	สมาชิกต้องจัดให้มีระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่มีการทำงานและที่มีระบบการบริหารและควบคุมความปลอดภัยในการปฏิบัติงาน (Security Management) ที่ได้มาตรฐานตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด	การจัดให้มีระบบส่งคำสั่งซื้อขายตามมาตรฐาน
-------	---	---

\*ข้อ 6/1 สมาชิกอาจใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่พัฒนาด้วยตนเอง หรือที่ได้รับสิทธิในการใช้งาน หรือที่พัฒนาโดยผู้พัฒนาระบบก็ได้ โดยสมาชิกต้องมีอำนาจควบคุมเหนือระบบส่งคำสั่งซื้อขายดังกล่าว

ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

(\*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

การใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

ข้อ 8 สมาชิกต้องติดตั้งระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกเฉพาะในที่ทำการแต่ละแห่งของสมาชิกเท่านั้น ยกเว้นสมาชิกจะได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์  
สมาชิกต้องแจ้งสถานที่ติดตั้งระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การติดตั้งระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

ข้อ 9 สมาชิกต้องติดตั้งเครื่องคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการส่งคำสั่งซื้อขายไว้ในสถานที่ซึ่งได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์  
สมาชิกต้องควบคุมมิให้บุคคลซึ่งมิได้มีหน้าที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายเข้าไปในสถานที่ดังกล่าว

การติดตั้งเครื่องคอมพิวเตอร์

\*ข้อ 10 กรณีสมาชิกใช้บริการของผู้พัฒนาระบบ ผู้พัฒนาระบบต้องมีและดำรงคุณสมบัติดังต่อไปนี้

ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกและคุณสมบัติของผู้พัฒนาระบบ

(1) มีฐานะการเงินที่มั่นคงและไม่มีความเสี่ยงที่อาจทำให้ไม่สามารถดำเนินธุรกิจได้

(2) มีผลงานและประสบการณ์ด้านการพัฒนาและการให้บริการที่เกี่ยวข้องกับระบบส่งคำสั่งซื้อขายไม่น้อยกว่า 2 ปีก่อนยื่นคำขอหรือตามระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์เห็นสมควร

(3) มีผู้บริหารซึ่งมีความสามารถ มีความซื่อสัตย์และมีประสบการณ์ในธุรกิจด้านพัฒนาระบบคอมพิวเตอร์ โดยต้องไม่เคยเป็นผู้บริหารของผู้พัฒนาระบบที่ตลาดหลักทรัพย์พิจารณาว่าขาดจรรยาบรรณในการประกอบธุรกิจในขณะที่ดำรงตำแหน่งนั้น ทั้งนี้ ตามแนวทางและภายในช่วงระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(4) มีระบบการจัดการด้านการพัฒนาและให้บริการเกี่ยวกับระบบส่งคำสั่งซื้อขายที่เป็นที่ยอมรับตามมาตรฐานสากลหรือมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์ยอมรับ

(5) มีบุคลากรที่เพียงพอ ซึ่งมีความรู้ความสามารถและประสบการณ์ในงานด้านพัฒนาและให้บริการที่เกี่ยวข้องกับระบบส่งคำสั่งซื้อขาย

(\*ความในข้อ 10 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

ข้อ 11 ในกรณีที่ผู้พัฒนาระบบไม่สามารถดำรงคุณสมบัติตามข้อ 10 ตลาดหลักทรัพย์อาจห้ามสมาชิกใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกซึ่งพัฒนาโดยผู้พัฒนาระบบดังกล่าว หรือกำหนดให้สมาชิกเปลี่ยนแปลงผู้พัฒนาระบบ หรือดำเนินการอื่นใดตามที่ตลาดหลักทรัพย์เห็นสมควร

การกำกับดูแล  
ผู้พัฒนาระบบ

### 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 หรือ มีการออกหรือเปลี่ยนแปลงข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ มติคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ หรือ หนังสือเวียนที่เกี่ยวกับการซื้อขาย ให้สมาชิกเข้าทดสอบระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด พร้อมทั้งรายงานผลการทดสอบดังกล่าวมายังตลาดหลักทรัพย์ทุกครั้ง

การร่วมทดสอบระบบเมื่อตลาดหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงระบบหรือข้อกำหนด

ให้สมาชิกรายงานผลการทดสอบครั้งสุดท้ายก่อนเริ่มใช้งานระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามวรรคหนึ่ง พร้อมทั้งรับรองว่าสมาชิกได้ทดสอบแล้วว่าระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกทำงานได้ถูกต้องตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย และไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขาย ตลอดจนเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด โดยต้องมีผู้มีอำนาจลงนามของสมาชิกรับรองรายงานดังกล่าว

ข้อ 16 สมาชิกต้องจัดให้มีแผนสำรองและระบบสำรองของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่สามารถทำงานได้ทันที เพื่อรองรับในกรณีที่ระบบส่งคำสั่งซื้อขายหลักของสมาชิกไม่สามารถทำงานได้ตามปกติ

แผนสำรองและระบบสำรองของสมาชิก

สมาชิกต้องรายงานรายละเอียดแผนสำรองและระบบสำรองของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามวรรคหนึ่งให้ตลาดหลักทรัพย์ทราบตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดและจัดให้มีการทดสอบระบบสำรองดังกล่าวอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง

ข้อ 17 สมาชิกต้องมีความพร้อมและเข้าร่วมการทดสอบระบบการซื้อขายสำรอง และการใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายสำรองที่ตลาดหลักทรัพย์จัดเตรียมไว้ให้สมาชิกในกรณีที่ระบบสำรองของสมาชิกไม่สามารถทำงานได้ตามปกติ โดยเข้าร่วมการทดสอบดังกล่าวตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ความพร้อมในการเข้าร่วมทดสอบระบบสำรอง

\*ข้อ 18 สมาชิกต้องจัดให้มีระบบทดสอบ (Test Environment) เพื่อใช้ทดสอบการทำงานของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก และกำกับดูแลให้การส่งคำสั่งซื้อขายเพื่อการทดสอบใด ๆ จะต้องกระทำในระบบทดสอบ (Test Environment) เท่านั้น

การจัดให้มีระบบทดสอบ (Test Environment)

(\*ความในข้อ 18 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

ข้อ 19 สมาชิกต้องจัดให้มีบุคลากรในการดูแลระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกอย่างเพียงพอทั้งในช่วงเวลาทำการและนอกเวลาทำการ

บุคลากรผู้ดูแลระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

ข้อ 20 สมาชิกต้องมีระบบจัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายของลูกค้าตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด และจัดส่งข้อมูลดังกล่าวให้แก่ตลาดหลักทรัพย์ทันทีเมื่อตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

การจัดเก็บข้อมูล

#### ส่วนที่ 4

#### การเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

ข้อ 21 สมาชิกจะเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกในกรณีดังต่อไปนี้ได้เมื่อได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ โดยแสดงรายละเอียดและทดสอบระบบตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การเปลี่ยนแปลงที่ ต้อง ได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์

- (1) เปลี่ยนแปลงผู้พัฒนาระบบ
- (2) เปลี่ยนแปลงเทคโนโลยีของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก
- (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

การขออนุญาต และ การใช้ระบบซื้อขาย หลักทรัพย์ผ่าน ระบบอินเทอร์เน็ต

ระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตต้องมีการทำงานและมีระบบการบริหารและความคุ้มครองระบบรักษาความปลอดภัยในการปฏิบัติงาน (Security Management) ที่ได้มาตรฐานตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

สมาชิกต้องรับรองการทำงานของระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตและจัดให้มีผู้พัฒนาระบบหรือผู้ให้บริการตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ตรวจสอบและรับรองการทำงานของระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตตามหลักเกณฑ์ว่าด้วยการรับรองระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกและความพร้อมในการใช้งานในส่วนที่ 3 ของหมวด 1

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

การเปลี่ยนแปลง ระบบซื้อขาย หลักทรัพย์ผ่าน ระบบอินเทอร์เน็ต

ข้อ 27 ในกรณีที่สมาชิกอนุญาตให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกมีระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตสำหรับลูกค้าของบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก สมาชิกต้องดำเนินการให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกยอมรับและปฏิบัติตามความในส่วนนี้

กรณีสมาชิกให้ บล. ที่มีใช้สมาชิกจัดให้มีการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่าน ระบบอินเทอร์เน็ต

ข้อ 28 การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตให้กระทำได้ด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM)

วิธีการเสนอซื้อขาย

ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต สมาชิกต้องระบุรหัสแสดงช่องทางในการบันทึกคำสั่งซื้อขาย (Designated Trader ID) ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด



ข้อ 29 ตลาดหลักทรัพย์อาจเรียกให้สมาชิกนำส่งรายชื่อลูกค้าที่ส่งคำสั่งซื้อขาย ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การนำส่งรายชื่อลูกค้า

\*ข้อ 30 -

(\*ยกเลิกความในข้อ 30 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย 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 วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย 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 หรือกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ ให้สมาชิกตรวจสอบและนำส่งข้อมูลเกี่ยวกับลูกค้าและข้อมูลการซื้อขายของลูกค้าให้แก่ตลาดหลักทรัพย์

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

ข้อ 34 ให้นำความในส่วนที่ 6 การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตมาใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA ตามส่วนนี้เท่าที่ไม่ขัดหรือแย้งโดยอนุโลม

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

การดำเนินการ  
ของสมาชิกกรณี  
มีการซื้อขายผ่าน  
Algorithmic  
Trading

ในกรณีที่สมาชิกตามวรรคหนึ่งมีลูกค้าที่มีลักษณะการซื้อขายเป็น High Frequency Trading (HFT) ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ให้สมาชิกจัดให้ลูกค้าดังกล่าวขึ้นทะเบียนต่อตลาดหลักทรัพย์และปฏิบัติตามเงื่อนไขเพิ่มเติมที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดเป็นการเฉพาะสำหรับลูกค้านั้นด้วย

เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแล ให้สมาชิกแจ้งข้อมูลของลูกค้าที่ใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติซึ่งลูกค้าเป็นผู้พัฒนาหรือจัดหาด้วยตนเองต่อตลาดหลักทรัพย์ภายในเวลาและตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(\*ความในข้อ 35 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 12) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 21 มิถุนายน 2567 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 เป็นต้นไป)

ข้อ 36 สมาชิกต้องรับรองว่าชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติตามข้อ 35 มีการทำงานและมีระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายที่เป็นไปตามข้อกำหนดหรือมาตรฐานของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย และจะไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขายหรือสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวมหรือไม่ทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงไปหรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market)

การรับรองของ  
สมาชิกกรณีการ  
ใช้ Algorithmic  
Trading

\*ข้อ 37 ในกรณีที่สมาชิกประสงค์จะเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติมเกี่ยวกับชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติที่ได้รับอนุญาตตามข้อ 35 สมาชิกจะต้องได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ก่อนเริ่มใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติที่มีการเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติม

การเปลี่ยนแปลง  
การใช้ Algorithmic  
Trading

(\*ความในข้อ 37 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 9) พ.ศ. 2566 ลงวันที่ 31 มกราคม 2566 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป)

ข้อ 38 ในการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติที่สมาชิกใช้บันทึกการเสนอซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขาย สมาชิกต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

การดำเนินการ  
ของสมาชิก  
สำหรับการใช้  
Algorithmic  
Trading

(1) มีระบบการจัดการ และระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย และกำกับดูแลการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติหรือจัดการการเสนอซื้อขายเมื่อมีเหตุจำเป็นและสมควร

(2) ควบคุมดูแลมิให้มีการบันทึกการเสนอซื้อขายที่มีลักษณะเป็นการทำให้หรืออาจทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์หรือสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวมเปลี่ยนแปลงไปหรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market)

ข้อ 39 สมาชิกที่ได้รับอนุญาตให้ใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติต้องทบทวนระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายให้มีประสิทธิภาพอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง และให้สมาชิกปรับปรุงหรือเปลี่ยนแปลงระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายให้เหมาะสมในกรณีดังต่อไปนี้

การทบทวนระบบ  
บริหารความเสี่ยง  
สำหรับการใช้  
Algorithmic  
Trading

(1) กรณีที่มีการแก้ไขข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายในเรื่องที่ส่งผลกระทบต่อระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย

(2) กรณีที่ตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

ข้อ 40 สมาชิกต้องจัดเก็บข้อมูลเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงฟังก์ชันการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติในส่วนที่เกี่ยวกับค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ตามระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดและจัดส่งข้อมูลดังกล่าวให้แก่ตลาดหลักทรัพย์ทันทีเมื่อตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

การจัดเก็บข้อมูล

## ส่วนที่ 9

### ข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขาย

ข้อ 41 ห้ามสมาชิกให้หรือจำหน่ายข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขายแก่ลูกค้าหรือบุคคลอื่นไม่ว่าจะโดยวิธีการใด ยกเว้นการเปิดเผยข้อมูลตามข้อ 42 หรือการเปิดเผยข้อมูลให้บุคคลอื่นใดที่ได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์

ห้ามให้หรือจำหน่าย  
ข้อมูลที่ได้จากระบบ  
การซื้อขาย

ข้อ 42 ให้สมาชิกเปิดเผยข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขายให้แก่ลูกค้าตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การเปิดเผยข้อมูล  
ให้ลูกค้า

ข้อ 43 ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกระงับการให้หรือจำหน่ายข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขายแก่ลูกค้าของสมาชิกหรือบุคคลอื่นได้ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การระงับการให้หรือจำหน่ายข้อมูล

## หมวด 2

### การกำกับดูแลการซื้อขายของสมาชิก

ข้อ 44 เพื่อกำกับดูแลการใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกหรือในกรณีที่มีเหตุจำเป็นอันอาจมีผลกระทบต่อการทำงานของระบบการซื้อขายหรือต่อสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวม ตลาดหลักทรัพย์อาจดำเนินการดังต่อไปนี้

การกำกับดูแลการใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

- (1) ตรวจสอบระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก
- (2) กำหนดให้สมาชิกเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก
- (3) ห้ามสมาชิกใช้งานทั้งหมดหรือบางส่วนของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก
- (4) ระงับการให้บริการซื้อขายผ่านระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกหรือช่องทางการซื้อขายใด ๆ ของสมาชิก

\*ข้อ 44 /1 เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบของสมาชิก สมาชิกต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

การกำกับดูแลการซื้อขายผ่านระบบของสมาชิก

- (1) จัดให้มีมาตรการป้องกันความลับของลูกค้า
- (2) จัดให้มีมาตรการควบคุมความเสี่ยง รวมทั้งระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายก่อนส่งเข้ามาในระบบการซื้อขาย โดยระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายดังกล่าวต้องมีการตรวจสอบในเรื่องตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด และทบทวนความเหมาะสมของมาตรการดังกล่าวอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง
- (3) จัดให้มีการบริหารจัดการ โดยสมาชิกต้องมีอำนาจควบคุมและบริหารจัดการ รวมทั้งกำหนดและเปลี่ยนแปลงค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ในระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายได้ และทบทวนความเหมาะสมของค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ดังกล่าวอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง
- (4) กรณีที่มีความจำเป็น สมาชิกต้องสามารถหยุดการส่งคำสั่งซื้อขายใหม่และยกเลิกคำสั่งซื้อขายที่ถูกส่งเข้ามาในระบบการซื้อขายแล้วได้ทันที (Kill Switch)
- (5) จัดให้มีมาตรการป้องกันและควบคุมไม่ให้บุคคลอื่นบันทึกการซื้อขายให้แก่ลูกค้า ยกเว้นในกรณีที่มีเหตุขัดข้องทำให้ลูกค้าไม่สามารถบันทึกคำสั่งซื้อขายเข้ามาในระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกได้ ลูกค้าอาจมอบหมายให้เจ้าหน้าที่รับอนุญาตบันทึกคำสั่งซื้อขายแทนได้
- (6) จัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายตามมาตรฐานของตลาดหลักทรัพย์ โดยสามารถจำแนกช่องทางหรือวิธีการที่ใช้ในการเสนอซื้อขายได้ และจัดส่งข้อมูลดังกล่าวต่อตลาดหลักทรัพย์ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ
- (7) ควบคุมดูแลให้ลูกค้ารับทราบและปฏิบัติตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ มติของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ และหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ ที่เกี่ยวกับการ

บันทึกคำสั่งซื้อขายในการซื้อขายหลักทรัพย์ รวมทั้งข้อห้ามปฏิบัติเกี่ยวกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายที่มีลักษณะไม่เหมาะสม

(8) จัดส่งข้อมูลเกี่ยวกับลูกค้ำและข้อมูลการซื้อขายของลูกค้ำให้แก่ตลาดหลักทรัพย์เมื่อตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

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

\*ข้อ 44/2 เพื่อป้องกันและยับยั้งการเสนอซื้อขาย หรือการซื้อขายที่อาจมีหรือมีผลทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงไปหรือ ไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market) หากตลาดหลักทรัพย์พบว่า การเสนอซื้อขาย หรือการซื้อขายของลูกค้ำรายใดมีลักษณะดังกล่าว ตลาดหลักทรัพย์อาจเปิดเผยรายชื่อและข้อมูลของลูกค้ำดังกล่าวให้แก่สมาชิกทุกรายทราบ

เมื่อสมาชิกได้รับทราบรายชื่อและข้อมูลของลูกค้ำที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดเผยตามวรรคหนึ่ง สมาชิกต้องจัดให้มีการดำเนินการกับลูกค้ำดังกล่าวให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

(\*เพิ่มเติมความในข้อ 44/2 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 12) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 21 มิถุนายน 2567 ทั้งนี้ เฉพาะความในวรรคสองให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยประกาศใช้บังคับหลักเกณฑ์สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย เป็นต้นไป)

ข้อ 45 ในกรณีที่คำสั่งซื้อขายของลูกค้ำที่ส่งผ่านระบบอินเทอร์เน็ตหรือส่งทางอิเล็กทรอนิกส์มีลักษณะฝ่าฝืนหรือไม่เป็นไปตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ มติของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ หรือหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกดำเนินการอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังต่อไปนี้

- (1) แจ้งให้ลูกค้ำหยุดการบันทึกคำสั่งเข้ามาในระบบการซื้อขาย
- (2) ยกเลิกคำสั่งซื้อขายของลูกค้ำที่มีลักษณะดังกล่าว
- (3) ระงับการให้บริการการซื้อขายหลักทรัพย์แก่ลูกค้ำ

การดำเนินการของสมาชิกกรณีลูกค้ำฝ่าฝืนข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 46 ในกรณีที่ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติของสมาชิกมีการทำงานไม่เป็นไปตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย และทำให้หรืออาจทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขายหรือสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวม ตลาดหลักทรัพย์อาจระงับหรือยกเลิกการอนุญาตการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติได้

กรณีคำสั่งที่ส่งโดยชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติมีหรืออาจมีผลทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงไปหรือ ไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรง

การระงับหรือยกเลิกการอนุญาตใช้ Algorithmic Trading เมื่อไม่เป็นไปตามข้อกำหนดและทำให้หรืออาจทำให้เกิดความเสียหายโดยรวม

ต่อสภาพปกติของตลาด (False Market) ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกปรับปรุงแก้ไขค่าพารามิเตอร์ (Parameters) และ/หรือโปรแกรมฟังก์ชันการทำงานและ/หรือระบบบริหารความเสี่ยงของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติหรือระบบการใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ

ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นอันอาจมีผลกระทบต่อการทำงานของระบบการซื้อขายหรือต่อสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวม ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกกระทำการซื้อขายหลักทรัพย์โดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติทุกกลยุทธ์ (Strategy) หรือเฉพาะบางกลยุทธ์ (Strategy) เป็นการชั่วคราวได้

เมื่อตลาดหลักทรัพย์หยุดทำการซื้อขายหลักทรัพย์ทั้งหมดอันเป็นผลมาจากการทำงานของระบบ Circuit Breaker ของตลาดหลักทรัพย์ ตลาดหลักทรัพย์จะให้สมาชิกกระทำการซื้อขายหลักทรัพย์โดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติเป็นการชั่วคราว

การกระทำการใช้ Algorithmic Trading เมื่อมีเหตุจำเป็น หรือ Circuit Breaker

### หมวด 3 เวลาทำการซื้อขาย

\*ข้อ 47 ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดเวลาทำการซื้อขายของหลักทรัพย์แต่ละประเภทแตกต่างกัน ทั้งนี้ หากเป็นหลักทรัพย์ที่มีสินทรัพย์อ้างอิงต่างประเทศ ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดเวลาทำการซื้อขายของหลักทรัพย์ดังกล่าวให้แตกต่างกัน โดยคำนึงถึงเวลาทำการซื้อขายของตลาดต่างประเทศที่มีการซื้อขายสินทรัพย์อ้างอิงนั้นด้วย

เวลาทำการซื้อขาย

ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดวิธีการซื้อขายที่แตกต่างกันสำหรับแต่ละช่วงเวลาทำการซื้อขายก็ได้

(\*ความในข้อ 47 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 15) พ.ศ. 2568 ลงวันที่ 3 เมษายน 2568 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2568 เป็นต้นไป)

\*ข้อ 48 ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดเวลาเปิดและปิดทำการซื้อขายตามเวลาที่ได้มีการสุ่มเลือก (Random) ด้วยระบบการซื้อขาย

เวลาเปิด/ปิดทำการซื้อขาย

(\*ความในข้อ 48 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 15) พ.ศ. 2568 ลงวันที่ 3 เมษายน 2568 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2568 เป็นต้นไป)

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

การเปลี่ยนแปลงเวลา Pre-open หรือ Pre-close

หมวด 4  
วิธีการซื้อขาย

ส่วนที่ 1  
รายการซื้อขาย

ข้อ 50 การบันทึกคำสั่งซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขายต้องมีรายการอย่างน้อยตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

รายการขั้นต่ำในการบันทึกคำสั่งซื้อขาย

ส่วนที่ 2

การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM)

ข้อ 51 การเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนและมูลค่าของหลักทรัพย์ไม่เกินจำนวนและมูลค่าตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

จำนวนและมูลค่าหลักทรัพย์สูงสุดที่เสนอซื้อขายได้

ข้อ 52 ให้นำหน่วยการซื้อขายของหลักทรัพย์แต่ละประเภทมีจำนวนตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

หน่วยการซื้อขายหลักทรัพย์ (Board Lot)

ข้อ 53 ราคาเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาที่ตรงตามช่วงราคาในตลาดหลักทรัพย์กำหนด ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดช่วงราคาของหลักทรัพย์แต่ละประเภทแตกต่างกันไป

ช่วงราคา (Tick Size)

\*ข้อ 54 สมาชิกอาจะระบุประเภทและเงื่อนไขการเสนอซื้อขายที่เกี่ยวกับราคา จำนวน และเวลา หรือช่วงเวลาที่มิผล (Validity) ของการเสนอซื้อขายในระบบการซื้อขาย ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ประเภท และเงื่อนไขการเสนอซื้อขาย

(\*ความในข้อ 54 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 9) พ.ศ. 2566 ลงวันที่ 31 มกราคม 2566 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป)

\*ข้อ 55 -

(\*ยกเลิกความในข้อ 55 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 9) พ.ศ. 2566 ลงวันที่ 31 มกราคม 2566 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป)

\*ข้อ 56 -

(ยกเลิกความในข้อ 56 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 9) พ.ศ. 2566 ลงวันที่ 31 มกราคม 2566 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป)

\*ข้อ 57 -

(ยกเลิกความในข้อ 57 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 9) พ.ศ. 2566 ลงวันที่ 31 มกราคม 2566 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป)

\*ข้อ 58 การซื้อขายหลักทรัพย์หน่วยย่อย ให้สามารถทำได้เฉพาะประเภทหลักทรัพย์ที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด โดยสมาชิกที่จะทำการซื้อขายหลักทรัพย์หน่วยย่อยต้องบันทึกคำสั่งซื้อขายตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การซื้อขายหลักทรัพย์  
หน่วยย่อย

(\*ความในข้อ 58 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 9) พ.ศ. 2566 ลงวันที่ 31 มกราคม 2566 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป)

\*ข้อ 58/1 ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้หลักทรัพย์ใดซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) ที่เป็นการจับคู่การซื้อขายในคราวเดียวตามช่วงเวลาซื้อขายที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้นำหลักเกณฑ์ในการคำนวณราคาเปิดหรือราคาปิดสำหรับช่วงก่อนเปิดทำการซื้อขาย (Pre-open) หรือก่อนปิดทำการซื้อขาย (Pre-close) มาใช้กับการคำนวณราคาเพื่อจับคู่การซื้อขายหลักทรัพย์นั้น โดยอนุโลม ทั้งนี้ ตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การซื้อขายด้วยวิธี  
จับคู่ในคราวเดียว

(\*เพิ่มเติมความในข้อ 58/1 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 13) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 9 สิงหาคม 2567 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 2 กันยายน 2567 เป็นต้นไป)

### ส่วนที่ 3

#### การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report)

ข้อ 59 สมาชิกอาจซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) ตามประเภทการซื้อขายดังต่อไปนี้

ประเภทการบันทึก  
การซื้อขาย

- (1) การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot)
- (2) การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign)
- (3) การบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผลิต (Trade Report - Buy-in)



(4) การบันทึกการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัด (Trade Report - Member buy - in)

(5) การบันทึกการซื้อขายนอกเวลาทำการประจำวัน (Trade Report - Off-hour)  
สมาชิกอาจประกาศโฆษณาการเสนอซื้อหรือขายหลักทรัพย์ในระบบการซื้อขายก็ได้  
ทั้งนี้ การประกาศโฆษณาดังกล่าวไม่มีผลผูกพันสมาชิกให้ต้องตกลงซื้อหรือขายตามประกาศโฆษณานั้น

\*ข้อ 60 การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) หมายถึง การซื้อขาย  
ซึ่งมีจำนวนหลักทรัพย์ตั้งแต่ 1 ล้านหน่วยของหลักทรัพย์หรือมีมูลค่าการซื้อขายตั้งแต่ 3 ล้านบาทขึ้นไป

**Trade Report –  
Big Lot**

ตลาดหลักทรัพย์อาจอนุญาตให้สมาชิกบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ซึ่งมีจำนวนหลักทรัพย์  
หรือมูลค่าการซื้อขายต่ำกว่าที่กำหนดในวรรคหนึ่งได้ในกรณีที่สมาชิกซื้อขายหลักทรัพย์เพื่อปฏิบัติให้  
เป็นไปตามกฎหมาย

มิให้นำหลักเกณฑ์เรื่องหน่วยการซื้อขายตามข้อ 52 และช่วงราคาตามข้อ 53 มาใช้  
บังคับกับการบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ตามวรรคหนึ่งและวรรคสอง

ให้สมาชิกรายงานข้อมูลการบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ต่อตลาดหลักทรัพย์ตามแบบที่  
ตลาดหลักทรัพย์กำหนด เมื่อสมาชิกบันทึกการซื้อขายที่มีปริมาณการซื้อหรือขายหลักทรัพย์เพิ่มขึ้นจนถึง  
หรือข้ามจุดซึ่งต้องทำคำเสนอซื้อหลักทรัพย์ทั้งหมดของกิจการตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาด  
หลักทรัพย์ หรือการซื้อหลักทรัพย์ที่สมาชิกรู้หรือมีเหตุอันควรรู้ว่าเป็นผลให้ผู้ซื้อได้มาหรือเป็นผู้ถือ  
หลักทรัพย์เพิ่มขึ้นจนถึงหรือข้ามจุดซึ่งต้องทำคำเสนอซื้อหลักทรัพย์ดังกล่าว ให้สมาชิกรายงานทันที  
ภายหลังบันทึกการซื้อขาย

(\*ความในข้อ 60 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

ข้อ 61 การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Trade Report –  
Foreign) ให้ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

**Trade Report –  
Foreign**

(1) เป็นการซื้อขายหลักทรัพย์ซึ่งมีจำนวนหลักทรัพย์และมีมูลค่าการซื้อขายต่ำกว่า  
ที่กำหนดในข้อ 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) บันทึกการซื้อขายภายในช่วงเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด
- (3) ราคาซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาโดยตรงตามช่วงราคาตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด
- (4) การซื้อขายในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนหลักทรัพย์เป็นหน่วยการซื้อขาย ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

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

**Trade Report –  
Member buy - in**

(1) บันทึกการซื้อขายในวันที่สมาชิกมีหน้าที่ส่งมอบหลักทรัพย์ตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด

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

(3) ราคาซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาโดยตรงตามช่วงราคาตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(4) การซื้อขายในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนหลักทรัพย์เป็นหน่วยการซื้อขาย ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(5) สำหรับหลักทรัพย์ใด ๆ ที่สมาชิกไม่สามารถดำเนินการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัดได้ครบทั้งจำนวนในวันนั้น และปรากฏว่ามีรายการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัดสำหรับหลักทรัพย์เดียวกันนั้นในวันทำการถัดไป สมาชิกจะรวมจำนวนหลักทรัพย์ที่ต้องดำเนินการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัดเข้ากับจำนวนหลักทรัพย์ที่ยังไม่สามารถดำเนินการซื้อได้ โดยใช้ราคาเดียวกับราคาเสนอซื้อของหลักทรัพย์ส่วนที่ยังไม่สามารถดำเนินการซื้อได้

ข้อ 64 การบันทึกการซื้อขายนอกเวลาทำการ (Trade Report - Off-hour) ให้ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

**Trade Report –  
Off-hour**

(1) มีจำนวนหลักทรัพย์และมีมูลค่าการซื้อขายต่ำกว่าที่กำหนดในข้อ 60 วรรคหนึ่ง

(2) บันทึกการซื้อขายภายในช่วงเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

\* (3) ราคาซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาปิดหรือราคาเฉลี่ยของหลักทรัพย์ ตามที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศ ในกรณีที่ไม่มีราคาซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว ให้ใช้ราคาปิดของวันทำการก่อนหน้าเป็นราคาซื้อขาย

(4) การซื้อขายในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนหลักทรัพย์เป็นหน่วยการซื้อขายตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(\*ความในข้อ 64(3) เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 15) พ.ศ. 2568 ลงวันที่ 3 เมษายน 2568 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2568 เป็นต้นไป)

## หมวด 5

### หลักเกณฑ์เฉพาะการซื้อขายหลักทรัพย์บางประเภท

#### ส่วนที่ 1

#### การซื้อขายใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย

#### (Non-voting Depository Receipt: NVDR)

ข้อ 65 การซื้อขายใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย ให้กระทำด้วยวิธีการซื้อขายตามหมวด 4 โดยให้สมาชิกบันทึกเครื่องหมายแสดงว่าเป็นคำสั่งซื้อขายใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทยตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

วิธีการซื้อขาย  
NVDR

\* ข้อ 65/1 ในการบันทึกการเสนอซื้อขายหรือบันทึกการซื้อขายใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย ห้ามไม่ให้สมาชิกบันทึกคำสั่งซื้อให้ลูกค้าซึ่งไม่เป็นคนต่างด้าว

ห้ามสมาชิก  
บันทึกคำสั่งซื้อ  
ให้ลูกค้าคนไทย

(\*เพิ่มเติมความใน 65/1 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. (ฉบับที่ 11) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 21 พฤษภาคม 2567 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 4 มิถุนายน 2567 เป็นต้นไป)

\* ข้อ 65/2 ให้สมาชิกมีมาตรการในการตรวจสอบว่าการบันทึกการเสนอซื้อขายหรือบันทึกการซื้อขายใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย เป็นคำสั่งซื้อของลูกค้าซึ่งเป็นคนต่างด้าวเท่านั้น

การจัดให้มี  
มาตรการ  
ตรวจสอบว่า  
คำสั่งซื้อเป็น  
ของลูกค้าต่าง  
ด้าวเท่านั้น

(\*เพิ่มเติมความใน 65/2 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. (ฉบับที่ 11) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 21 พฤษภาคม 2567 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 4 มิถุนายน 2567 เป็นต้นไป)

## \*ส่วนที่ 2

### การซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าว

(\*ยกเลิกความในส่วนที่ 2 การซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าวของหมวด 5 หลักเกณฑ์เฉพาะการซื้อขายหลักทรัพย์บางประเภท โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. (ฉบับที่ 10) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 19 กุมภาพันธ์ 2567 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 25 มีนาคม 2567 เป็นต้นไป)

วิธีการซื้อขาย  
หน่วยลงทุน  
Thai Trust Fund

## \*ส่วนที่ 3

### การซื้อขายตราสารหนี้

(\*ยกเลิกความในส่วนที่ 3 การซื้อขายตราสารหนี้ ของหมวด 5 หลักเกณฑ์เฉพาะการซื้อขายหลักทรัพย์บางประเภท โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ยกเลิกและปรับปรุงความในประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยที่เกี่ยวกับตราสารหนี้ที่ได้รับการจดทะเบียนหรือได้รับอนุญาตให้ทำการซื้อขายได้ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2563 ลงวันที่ 29 ธันวาคม 2563 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

วิธีการซื้อขาย  
ตราสารหนี้

## \*ส่วนที่ 4

### การซื้อขายหุ้นสามัญที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์ (LiVEx)

ข้อ 73/1 ในส่วนนี้

“ไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์” (LiVEx) หมายความว่า ตลาดหลักทรัพย์ไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์

“หลักทรัพย์จดทะเบียน” หมายความว่า หลักทรัพย์ที่ได้รับการจดทะเบียนให้ทำการซื้อขายได้ในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์ (LiVEx)

“หลักทรัพย์” หมายความว่า หุ้นสามัญที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนตามข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับหุ้นสามัญเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์

“ศูนย์รับฝาก” หมายความว่า บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด

นิยาม

ข้อ 73/2 ความในส่วนนี้ให้ใช้บังคับกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหุ้นสามัญที่ได้รับการจดทะเบียนให้ทำการซื้อขายได้ในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์ (LiVEx) ตามข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับหุ้นสามัญเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์

ให้นำหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่กำหนดไว้ในข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ มาใช้บังคับกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ตามส่วนนี้ด้วยเท่าที่ไม่ขัดหรือแย้ง

การนำหลัก  
เกณฑ์ทั่วไป  
มาใช้เท่าที่ไม่  
ขัดหรือแย้ง

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

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

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 เพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์ในช่วงที่ขึ้นเครื่องหมายดังกล่าวเป็นราคาที่ ไม่รวมถึงสิทธิประโยชน์ที่ เครื่องหมาย X

บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์จะให้หรือให้แก่ผู้ถือหลักทรัพย์ในการปิดสมุดทะเบียนพักการโอนหลักทรัพย์ หรือในการกำหนดรายชื่อผู้ถือหลักทรัพย์ในคราวนั้น

ข้อ 73/9 ในการชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ระหว่างสมาชิก ให้สมาชิกดำเนินการ โดยใช้บริการที่ศูนย์รับฝากจัดให้มีขึ้น และสมาชิกต้องปฏิบัติตามข้อบังคับของศูนย์รับฝากเกี่ยวกับการส่งมอบและรับมอบหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายในไลฟ์อิเล็กทรอนิกส์ (LiVEx)

การชำระ  
ราคาและ  
การส่งมอบ  
หลักทรัพย์

ข้อ 73/10 มิให้นำหลักเกณฑ์ เงื่อนไข หรือวิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ ในเรื่องดังต่อไปนี้มาใช้กับการซื้อขายในส่วนนี้

หลักเกณฑ์ที่ไม่  
นำมาใช้กับการซื้อ  
ขายหลักทรัพย์จด  
ทะเบียนใน ไลฟ์  
อิเล็กทรอนิกส์

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

ต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจ

- \*\*\* (7) การกำหนดกรอบราคาซื้อขาย (Dynamic Price Band)
- \*\*\* (8) การห้ามซื้อหรือขายหลักทรัพย์จดทะเบียนเป็นการชั่วคราวโดยอัตโนมัติตาม

ข้อยกเว้นในไลฟ์  
อิเล็กทรอนิกส์

หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่กำหนด ในข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการห้ามซื้อหรือขายหลักทรัพย์จดทะเบียนเป็นการชั่วคราว

(\*เพิ่มเติมความในส่วนที่ 4 การซื้อขายหุ้นสามัญที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนใน ไลฟ์อิเล็กทรอนิกส์ (LiVEx) ของหมวด 5 หลักเกณฑ์เฉพาะการซื้อขายหลักทรัพย์บางประเภท โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 7) พ.ศ. 2565 ลงวันที่ 14 มีนาคม 2565 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 31 มีนาคม 2565 เป็นต้นไป)

(\*\*ความใน (6) ของข้อ 73/10 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. (ฉบับที่ 10) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 19 กุมภาพันธ์ 2567 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 25 มีนาคม 2567 เป็นต้นไป)

(\*\*\*เพิ่มเติมความใน (7) และ (8) ของข้อ 73/10 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 13) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 9 สิงหาคม 2567 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 2 กันยายน 2567 เป็นต้นไป)

## \*ส่วนที่ 5

(\*ยกเลิกความในส่วนที่ 5 การซื้อขายตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วยของหมวด 5 หลักเกณฑ์เฉพาะการซื้อขายหลักทรัพย์บางประเภท โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 15) พ.ศ. 2568 ลงวันที่ 3 เมษายน 2568 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2568 เป็นต้นไป)

## \*หมวด 6

(\*ยกเลิกความในหมวด 6 การแก้ไขการซื้อขาย โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 15) พ.ศ. 2568 ลงวันที่ 3 เมษายน 2568 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2568 เป็นต้นไป)

## หมวด 7

### เครื่องหมายประกอบการซื้อขาย

## ส่วนที่ 1

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

#### ข้อ 75 ในส่วนนี้

“บริษัทจดทะเบียน” หมายความว่า บริษัทที่มีหุ้นสามัญจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ **นิยาม**  
รวมถึงผู้มีหน้าที่เปิดเผยสารสนเทศตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการเปิดเผยสารสนเทศ

ข้อ 76 ตลาดหลักทรัพย์อาจขึ้นเครื่องหมาย NP (Notice Pending) ไว้ที่หลักทรัพย์ **เครื่องหมาย NP**  
เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบว่าบริษัทจดทะเบียนมีสารสนเทศต้องชี้แจงหรือรายงานต่อตลาดหลักทรัพย์

\*ในกรณีที่บริษัทจดทะเบียนไม่ได้จัดให้มีการประชุมเพื่อนำเสนอและชี้แจงข้อมูลเกี่ยวกับธุรกิจและผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียนตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด หรือเมื่อคณะกรรมการของบริษัทจดทะเบียนมีมติให้บริษัทจดทะเบียนหรือบริษัทย่อยเข้าทำรายการได้มาซึ่งสินทรัพย์ของบริษัทที่มีบริษัทจดทะเบียนที่มีลักษณะเป็นการเข้าจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์โดยอ้อมตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการเข้าจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์โดยอ้อม ตลาดหลักทรัพย์จะถือว่าเป็นกรณีที่บริษัทจดทะเบียนมีสารสนเทศต้องชี้แจงหรือรายงานต่อตลาดหลักทรัพย์ตามวรรคหนึ่งด้วย

(\*เพิ่มเติมความในวรรคสองของข้อ 76 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. (ฉบับที่ 10) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 19 กุมภาพันธ์ 2567 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 25 มีนาคม 2567 เป็นต้นไป)

ข้อ 77 เมื่อตลาดหลักทรัพย์ได้รับสารสนเทศตามข้อ 76 ครบถ้วนและชัดเจนและได้เผยแพร่แก่ผู้ลงทุนแล้ว 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 แคลชบาลานซ์ (Cash Balance)

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

(\*เพิ่มเติมความในส่วนที่ 1/1 ของหมวด 7 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2562 ลงวันที่ 21 มีนาคม 2562 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2562 เป็นต้นไป)

### ส่วนที่ 2

#### เครื่องหมายแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์เป็นราคาที่ไม่รวมสิทธิประโยชน์

\*ข้อ 78 ในการขึ้นเครื่องหมายเพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์ในช่วงเวลาที่ขึ้นเครื่องหมายดังกล่าวเป็นราคาที่ไม่รวมถึงสิทธิประโยชน์ที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์จะให้หรือให้แก่ผู้ถือหลักทรัพย์ในการปิดสมุดทะเบียนพักการโอนหลักทรัพย์หรือในการกำหนดครายชื่อผู้ถือหลักทรัพย์ในคราวนั้น ตลาดหลักทรัพย์อาจดำเนินการ โดยประกาศขึ้นเครื่องหมายตามแนวทางที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

เครื่องหมาย X



(\*ความในข้อ 78 เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่นี้แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 15) พ.ศ. 2568 ลงวันที่ 3 เมษายน 2568 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2568 เป็นต้นไป)

\*ข้อ 79 -

(\*ยกเลิกความในข้อ 79 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 15) พ.ศ. 2568 ลงวันที่ 3 เมษายน 2568 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 6 พฤษภาคม 2568 เป็นต้นไป)

### \*ส่วนที่ 3

#### เครื่องหมายที่แสดงว่าบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อ ฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจ

ข้อ 79/1 ในส่วนนี้

นิยาม

“มาตรการดำเนินการ” หมายความว่า มาตรการดำเนินการตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยมาตรการดำเนินการกรณีบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจ

“หลักทรัพย์” หมายความว่า หลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนที่อยู่ภายใต้มาตรการดำเนินการ รวมถึงใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนดังกล่าวเป็นสินทรัพย์อ้างอิง

ข้อ 79/2 ตลาดหลักทรัพย์อาจขึ้นเครื่องหมายที่แสดงว่าบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจไว้ที่หลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนในวันทำการถัดจากวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศรายชื่อบริษัทจดทะเบียนที่อยู่ภายใต้มาตรการดำเนินการ เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบว่าบริษัทจดทะเบียนอยู่ภายใต้มาตรการดำเนินการดังกล่าว ทั้งนี้ ประเภทของเครื่องหมายดังกล่าวให้เป็นไปตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การขึ้นเครื่องหมายที่แสดงว่าบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจ

ข้อ 79/3 ตลาดหลักทรัพย์อาจปลดเครื่องหมายตามข้อ 79/2 ออกจากหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนในวันทำการถัดจากวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศรายชื่อบริษัทจดทะเบียนที่พ้นจากมาตรการดำเนินการ เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบว่าบริษัทจดทะเบียนได้พ้นจากมาตรการดำเนินการดังกล่าวแล้ว

การปลดเครื่องหมายที่แสดงว่าบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจ

\*ข้อ 79/4 ให้นำความในส่วนนี้มาใช้กับหน่วยลงทุนตามข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยมาตรการดำเนินการกรณีกองทุนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจเท่าที่ไม่ขัดหรือแย้งโดยอนุโลม

(\*เพิ่มเติมความข้อ 79/4 ของส่วนที่ 3 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 14) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 25 พฤศจิกายน 2567 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2568 เป็นต้นไป)

(\*ความในส่วนที่ 3 เครื่องหมาย C (Caution) ของหมวด 7 เครื่องหมายประกอบการซื้อขาย เดิมถูกยกเลิกและใช้ความใหม่แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. (ฉบับที่ 10) พ.ศ. 2567 ลงวันที่ 19 กุมภาพันธ์ 2567 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 25 มีนาคม 2567 เป็นต้นไป)

## หมวด 8

### หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินโดยสมาชิก

ข้อ 80 สมาชิกผู้ประสงค์จะเป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินในหุ้นใดต้องได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์

การขออนุญาตเป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงิน

ให้สมาชิกยื่นคำขออนุญาตเป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดเป็นการล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 1 วันทำการก่อนวันที่สมาชิกเริ่มทำการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินในหุ้นดังกล่าว

ข้อ 81 ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินในหุ้นใดมีหน้าที่ต้องทำการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินในหุ้นนั้น โดยการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) ตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขดังต่อไปนี้

วิธีการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงิน

(1) ระบุว่าเป็นการเสนอซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงิน

(2) บันทึกลำสั่งซื้อประเภท Limit Order โดยกำหนดราคาเสนอซื้อที่ไม่สูงกว่าราคาเสนอซื้อสูงสุดในขณะนั้น หรือราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายในขณะนั้น หรือราคาเสนอขายครั้งแรก (IPO Price) ทั้งนี้ แล้วแต่ราคาใดจะต่ำกว่า

(3) ให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินทำการแยกบัญชีสำหรับการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินออกจากบัญชีเพื่อการลงทุนของตนเอง

ข้อ 82 ในการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินในแต่ละวันทำการ ให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินแจ้งชื่อของเจ้าหน้าที่รับอนุญาตที่ทำหน้าที่ดังกล่าว

การแจ้งชื่อเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

ข้อ 83 ห้ามมิให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงิน กระทำการดังต่อไปนี้

ข้อห้ามของผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงิน

\*(1) -

(2) ซื้อขายหุ้นที่ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินมีหน้าที่ต้องทำการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินเพื่อบัญชีของตนเองในระหว่างเวลาที่เป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเงินในหุ้นนั้น

(3) เสนอซื้อหุ้นในราคาหรือปริมาณที่ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินรู้หรือมีเหตุอันควรรู้ว่าราคาดังกล่าวอาจเกิดจากการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์

(\*ยกเลิกความในข้อ 83 (1) โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

\*ข้อ 84 ให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินจัดส่งรายงานประจำวันและรายงานสรุปการซื้อขายเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินเมื่อครบระยะเวลาของการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน ให้แก่ตลาดหลักทรัพย์ตามแบบและวิธีการที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

(\*ความในข้อ 84 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2564 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป)

ข้อ 85 ตลาดหลักทรัพย์จะระบุเครื่องหมายเพื่อแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบว่าหุ้นใดมีการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน

การจัดส่งรายงานเกี่ยวกับการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน

เครื่องหมาย

ข้อ 86 ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินจะหยุดทำหน้าที่ในการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินได้เฉพาะในกรณีใดกรณีหนึ่งดังต่อไปนี้

การหยุดทำหน้าที่ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน

(1) เมื่อสิ้นสุดระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์อนุญาตให้ทำการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน

(2) ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินใช้สิทธิซื้อหุ้นจากบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์หรือจากผู้ถือหุ้นเพื่อส่งมอบหุ้นในส่วนที่จัดสรรเกินจำนวนให้แก่ผู้ลงทุน ตามที่ระบุไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการจัดสรรหุ้นเกินกว่าจำนวนที่จัดจำหน่าย

(3) เมื่อผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินซื้อหุ้นได้ครบตามจำนวนที่ได้ขออนุญาตไว้กับตลาดหลักทรัพย์

ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินที่ประสงค์จะหยุดทำหน้าที่เป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นใดในกรณีตามวรรคหนึ่ง (2) และ (3) ให้แจ้งต่อตลาดหลักทรัพย์ล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 1 วันทำการก่อนวันที่ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินจะหยุดทำหน้าที่เป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นนั้น

ข้อ 87 ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินผู้ใดฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหมวดนี้ นอกจากตลาดหลักทรัพย์จะพิจารณาลงโทษผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินดังกล่าวตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการพิจารณาลงโทษสมาชิกแล้ว ตลาดหลักทรัพย์จะไม่อนุญาตให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินนั้นทำหน้าที่เป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินเป็นเวลา 1 ปีนับแต่วันที่ ฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหมวดนี้

การฝ่าฝืนหลักเกณฑ์การซื้อหุ้นคืน

## หมวด 9

### การซื้อขายหลักทรัพย์ของสมาชิกหรือบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก ในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนของลูกค้า

ข้อ 88 ในกรณีที่สมาชิกทำการซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทตนเองในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนของลูกค้า ให้สมาชิกปฏิบัติตามดังต่อไปนี้

- (1) ซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าวเฉพาะด้วยเงินสด
- (2) จัดให้มีมาตรการแก้ไขความผิดพลาดในการซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทตนเองที่เหมาะสมและชัดเจน โดยต้องไม่ทำให้สมาชิกเป็นผู้ถือหลักทรัพย์ของบริษัทตนเอง
- (3) เปิดเผยให้ลูกค้าทราบถึงลักษณะที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ (Conflict of Interest) ตามที่กำหนดในหลักเกณฑ์ วิธีการ หรือแนวทางปฏิบัติของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยที่เกี่ยวข้องกับการเป็นนายหน้าหรือตัวแทนการซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียน ตามที่ตลาดหลักทรัพย์ให้ความเห็นชอบ

ในกรณีที่สมาชิกทำการซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิกในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนของลูกค้า ให้สมาชิกปฏิบัติตามวรรคหนึ่ง (3)

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

ข้อ 90 ให้สมาชิกรายงานรายชื่อบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก และรายงานการเปลี่ยนแปลงรายชื่อบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิกที่เพิ่มขึ้นหรือลดลงต่อตลาดหลักทรัพย์ภายในเวลาและตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ทั้งนี้ ให้ระบุชื่อของบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก และความสัมพันธ์ที่แสดงถึงการมีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก และประกาศรายชื่อบริษัทนั้นไว้ในที่เปิดเผย สำนักงานของสมาชิก

ข้อ 91 ให้สมาชิกจัดให้มีระบบกำกับดูแลและตรวจสอบการปฏิบัติงานของสมาชิก และรายงานให้ตลาดหลักทรัพย์ทราบทันทีเมื่อตรวจสอบพบว่าสมาชิกฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหมวดนี้

ข้อปฏิบัติของสมาชิกกรณีซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทตนเองหรือบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้อง

หลักเกณฑ์เกี่ยวกับการใช้ข้อมูลภายใน Conflict of Interest

การรายงานและเปิดเผยชื่อของบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้อง

ระบบดูแลการปฏิบัติงาน

## หมวด 10

### บทเฉพาะกาล

ข้อ 92 ให้บรรดาคำสั่งหรือหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ที่ออกตามความในประกาศตลาดหลักทรัพย์ตามข้อ 2 ซึ่งใช้บังคับอยู่ก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ ยังคงใช้ต่อไปได้จนกว่าจะมีการกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข หรือวิธีการใด ๆ ในเรื่องดังกล่าวขึ้นใหม่ออกใช้บังคับ

บทเฉพาะกาล

ข้อ 93 ในกรณีที่ข้อกำหนด คำสั่ง หนังสือเวียน แนวทางปฏิบัติ หรือนโยบายของตลาดหลักทรัพย์ฉบับใดมีการอนุโลมใช้หรืออ้างถึงประกาศหรือความในประกาศตลาดหลักทรัพย์ตามข้อ 2 ให้การอนุโลมใช้หรืออ้างถึงประกาศหรือความในประกาศดังกล่าว หมายความว่าถึงการใช้หรืออ้างถึงหลักเกณฑ์ในเรื่องดังกล่าวตามประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 แทน

บทเฉพาะกาล

ข้อ 94 ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้สมาชิกมีหน้าที่ปฏิบัติตามประกาศตลาดหลักทรัพย์ตามข้อ 2 และสมาชิกยังปฏิบัติไม่ครบตามประกาศดังกล่าว ให้หน้าที่ในการดำเนินการดังกล่าวยังคงมีต่อไปจนกว่าจะครบระยะเวลาที่กำหนด

บทเฉพาะกาล

ประกาศ ณ วันที่ 28 สิงหาคม 2560

(ลงนาม) นางเกศรา มัญชุศรี

(นางเกศรา มัญชุศรี)

กรรมการและผู้จัดการ

---

เหตุผลในการประกาศใช้: โดยที่ตลาดหลักทรัพย์ได้มีการปรับปรุงหลักเกณฑ์การซื้อขายหลักทรัพย์ เพื่อให้มีความเหมาะสมกับสภาพแวดล้อมทางธุรกิจ เนื่องจากการขยายฐานผู้ลงทุนและเพิ่มโอกาสทางธุรกิจของสมาชิก ตลอดจนสอดคล้องกับมาตรฐานสากล ตลาดหลักทรัพย์จึงเห็นควรให้ปรับปรุงหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ โดยได้จัดทำให้มีความเหมาะสมและง่ายต่อการทำความเข้าใจยิ่งขึ้น จึงสมควรออกประกาศนี้

### **บทเฉพาะกาล**

ในกรณีที่สมาชิกรายใดมีลูกค้ำที่ใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติเป็นลูกค้ำที่มีลักษณะการซื้อขายเป็น High Frequency Trading (HFT) ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดอยู่ก่อนวันที่ 1 กรกฎาคม 2567 ให้สมาชิกจัดให้ลูกค้ำดังกล่าวขึ้นทะเบียนต่อตลาดหลักทรัพย์และปฏิบัติตามเงื่อนไขเพิ่มเติมที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดเป็นการเฉพาะสำหรับลูกค้ำนั้นเช่นเดียวกับที่กำหนดไว้ตามข้อ 35 ภายในระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด