

ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
เรื่อง กำหนดหลักทรัพย์ที่สามารถขายชอร์ตได้ พ.ศ. 2553

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 4 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การขายชอร์ตในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2544 ลงวันที่ 3 มกราคม 2544 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 4 มกราคม 2554 เป็นต้นไป

ผลใช้บังคับ

*ข้อ 2 สมาชิกจะขายชอร์ตได้ในหลักทรัพย์ดังต่อไปนี้

หลักทรัพย์ที่สมาชิก
สามารถขายชอร์ตได้

(1) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 Index

(2) หุ้นสามัญที่มีมูลค่าตามราคาตลาด (Market Capitalization) เฉลี่ยในระยะเวลา 3 เดือน ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดไม่น้อยกว่า 5,000 ล้านบาท และมีการกระจายการถือหุ้นของผู้ถือหุ้นสามัญรายย่อย ไม่น้อยกว่าร้อยละ 20 ของทุนชำระแล้ว ตามรายชื่อที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศกำหนด

“ผู้ถือหุ้นสามัญรายย่อย” ให้มีความหมายเช่นเดียวกับบทนิยามของคำดังกล่าวที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วย การรับหุ้นสามัญหรือหุ้นบุริมสิทธิเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน

(3) หลักทรัพย์ซึ่งคนขึ้นทะเบียนเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง

(4) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟ หรือหลักทรัพย์ที่ใช้คำนวณดัชนีอ้างอิงหรือ หลักทรัพย์อ้างอิงของกองทุนรวมอิตีเอฟ

(5) หน่วยของอิตีเอฟตามข้อกำหนดตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วย การรับและเพิกถอนหน่วย ของอิตีเอฟ และการเปิดเผยสารสนเทศของอิตีเอฟต่างประเทศ

(6) หุ้นสามัญที่เป็นสินทรัพย์อ้างอิงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ตามข้อกำหนด ตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วย การรับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน

(7) หุ้นสามัญที่เป็นสินค้าอ้างอิงของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า Single Stock Futures ตาม ข้อกำหนดของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า”

** (8) ตราสารแสดงสิทธิการฝากหลักทรัพย์ต่างประเทศ ตามข้อกำหนดตลาดหลักทรัพย์ ว่าด้วยการรับ การเปิดเผยสารสนเทศ และการเพิกถอนตราสารแสดงสิทธิการฝากหลักทรัพย์ต่างประเทศ

** (9) ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทยตามข้อกำหนดตลาด หลักทรัพย์ว่าด้วยการรับและเพิกถอนใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย ทั้งนี้ เฉพาะใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทยที่มีหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นหุ้นสามัญ ที่สามารถขายชอร์ตได้ตามประกาศนี้

(* ความในข้อ 2 ถูกยกเลิกและใช้ความใหม่^{นี้}แทน โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง กำหนดหลักทรัพย์ที่สามารถขายชอร์ตได้ (ฉบับที่ 3) พ.ศ.2560 ลงวันที่ 29 พฤษภาคม 2560 และมีผลใช้บังคับวันที่ 1 กรกฎาคม 2560)

(** เพิ่มเติมความใน (8) และ (9) ของข้อ 2 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง กำหนดหลักทรัพย์ที่สามารถขายชอร์ตได้ (ฉบับที่ 4) พ.ศ.2562 ลงวันที่ 19 มีนาคม 2562 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 3 เมษายน 2562 เป็นต้นไป)

ข้อ 3 สมาชิกซึ่งทำหน้าที่เป็นนายหน้าหรือตัวแทนซื้อหรือขายหลักทรัพย์จดทะเบียนของผู้ดูแลสภาพคล่องซึ่งเป็นนิติบุคคลที่มีใช้สมาชิกจะขายชอร์ตได้ตามคำสั่งของผู้ดูแลสภาพคล่องดังกล่าวในหลักทรัพย์ ซึ่งผู้ดูแลสภาพคล่องนั้นขึ้นทะเบียนเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องได้ด้วย

หลักทรัพย์ที่สมาชิก
สามารถขายชอร์ตได้
แทนผู้ดูแลสภาพ
คล่องมีใช้สมาชิก

ประกาศ ณ วันที่ 16 ธันวาคม 2553

(ลงนาม) จรัมพร โชติกเสถียร
(นายจรัมพร โชติกเสถียร)
กรรมการและผู้จัดการ

เหตุผลในการประกาศใช้: โดยที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ เห็นสมควรเพิ่มเติมหลักทรัพย์ที่สามารถขายชอร์ตได้ เพื่อเป็นการสนับสนุนธุรกรรมกริ้มและให้ยืมหลักทรัพย์ ตลอดจนช่วยในการบริหารความเสี่ยงและสร้างสมดุลในการขึ้นลงของราคาหลักทรัพย์ โดยคำนึงถึงความเสี่ยงต่อผู้ลงทุนและการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์โดยรวม จึงสมควรออกประกาศนี้