

ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์
ในตลาดหลักทรัพย์ 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 นิยาม
การซื้อขายหลักทรัพย์ที่ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายด้วยระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่จัดให้แก่ลูกค้า

“การซื้อขายหลักทรัพย์ทางอิเล็กทรอนิกส์” (Direct Electronic Access) หมายความว่า
การซื้อขายหลักทรัพย์ที่สมาชิกอนุญาตให้ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายทางอิเล็กทรอนิกส์ด้วยตนเอง

“การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA” (Direct Market Access) หมายความว่า การซื้อขายที่สมาชิกอนุญาตให้ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายผ่านระบบส่งคำสั่งซื้อขายของลูกค้ายที่ต่อเชื่อมกับระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก โดยคำสั่งซื้อขายดังกล่าวผ่านระบบควบคุมความเสี่ยงที่สมาชิกสามารถบริหารจัดการได้

“ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ” (Program Trading) หมายความว่า ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับส่งคำสั่งซื้อขายที่สามารถสร้างและบันทึกการเสนอซื้อขายได้โดยอัตโนมัติ

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

“หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารแห่งนี้” หมายความว่า หน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่มีนโยบายการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งเงินฝาก ตราสารแห่งนี้ หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นหรือการหาผลประโยชน์โดยวิธีการอื่นตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดตั้งและจัดการกองทุน

“บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการทำสัญญาเป็นนายหน้าหรือตัวแทนซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ให้แก่บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก

“การซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน” หมายความว่า การซื้อหุ้นเพื่อส่งมอบหุ้นในส่วนที่จัดสรรเกินกว่าจำนวนหุ้นที่จัดจำหน่ายตามเงื่อนไขที่คณะกรรมการกำกับตลาดทุนกำหนด โดยทำการซื้อในตลาดหลักทรัพย์ตามคำสั่งที่ได้รับจากผู้จัดจำหน่ายหลักทรัพย์ที่มีความผูกพันตามหนังสือชี้ชวนที่ออกในการจัดจำหน่ายหุ้นนั้น

“ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน” หมายความว่า สมาชิกที่ได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ให้ดำเนินการซื้อหุ้นใดหุ้นหนึ่งเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินของหุ้นนั้นในช่วงเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด โดยให้อยู่ภายใต้หลักเกณฑ์ที่ระบุไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการจัดสรรหุ้นเกินกว่าจำนวนที่จัดจำหน่าย

หมวด 1
การซื้อขาย

ส่วนที่ 1
บททั่วไป

- ข้อ 4 ในกรณีที่มีข้อสงสัยหรือมีปัญหาเกี่ยวกับการซื้อขาย ให้ผู้จัดการเป็นผู้มีอำนาจวินิจฉัยและสั่งการ อำนาจวินิจฉัย
สั่งการของผู้จัดการ
- ข้อ 5 สมาชิกอาจยื่นคำขอให้ตลาดหลักทรัพย์ออกหนังสือรับรองการซื้อขายของตนได้ การขอออกหนังสือ
รับรองการซื้อขาย

ส่วนที่ 2
ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

- ข้อ 6 สมาชิกต้องจัดให้มีระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่มีการทำงานและที่มีระบบการบริหารและควบคุมความปลอดภัยในการปฏิบัติงาน (Security Management) ที่ได้มาตรฐานตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด การจัดให้มีระบบส่ง
คำสั่งซื้อขายตาม
มาตรฐาน
- ข้อ 7 สมาชิกจะใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกได้ เมื่อได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์โดยแสดงรายละเอียดว่าระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกดังกล่าวเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด และทดสอบระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด การใช้ระบบส่งคำสั่ง
ซื้อขายของสมาชิก
- ข้อ 8 สมาชิกต้องติดตั้งระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกเฉพาะในที่ทำการแต่ละแห่งของสมาชิกเท่านั้น ยกเว้นสมาชิกจะได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ การติดตั้งระบบส่ง
คำสั่งซื้อขายของ
สมาชิก
สมาชิกต้องแจ้งสถานที่ติดตั้งระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด
- ข้อ 9 สมาชิกต้องติดตั้งเครื่องคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการส่งคำสั่งซื้อขายไว้ในสถานที่ซึ่งได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ การติดตั้งเครื่อง
คอมพิวเตอร์
สมาชิกต้องควบคุมมิให้บุคคลซึ่งมิได้มีหน้าที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายเข้าไปในสถานที่ดังกล่าว

<p>ข้อ 10 สมาชิกอาจใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายที่พัฒนาด้วยตนเองหรือที่พัฒนาโดยผู้พัฒนาระบบ โดยผู้พัฒนาระบบต้องมีและดำรงคุณสมบัติดังต่อไปนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> (1) มีฐานะการเงินที่มั่นคงหรือมีทุนชำระแล้วไม่น้อยกว่า 20 ล้านบาท (2) มีผลงานและประสบการณ์ด้านการพัฒนาและการให้บริการที่เกี่ยวกับระบบส่งคำสั่งซื้อขายไม่น้อยกว่า 2 ปีก่อนยื่นคำขอหรือตามระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์เห็นสมควร (3) มีผู้บริหารซึ่งมีความสามารถ มีความซื่อสัตย์ มีจรรยาบรรณในการประกอบธุรกิจ และมีประสบการณ์ในธุรกิจด้านพัฒนาระบบคอมพิวเตอร์ (4) มีระบบการจัดการด้านการพัฒนาและให้บริการเกี่ยวกับระบบส่งคำสั่งซื้อขายที่เป็นที่ยอมรับตามมาตรฐานสากลหรือมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์ยอมรับ (5) มีบุคลากรที่เพียงพอ ซึ่งมีความรู้ความสามารถและประสบการณ์ในงานด้านพัฒนาและให้บริการที่เกี่ยวกับระบบส่งคำสั่งซื้อขาย 	<p>ระบบส่งคำสั่งซื้อขาย ของสมาชิกและ คุณสมบัติของ ผู้พัฒนาระบบ</p>
<p>ข้อ 11 ในกรณีที่ผู้พัฒนาระบบไม่สามารถดำรงคุณสมบัติตามข้อ 10 ตลาดหลักทรัพย์อาจห้ามสมาชิกใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกซึ่งพัฒนาโดยผู้พัฒนาระบบดังกล่าว หรือกำหนดให้สมาชิกเปลี่ยนแปลงผู้พัฒนาระบบ หรือดำเนินการอื่นใดตามที่ตลาดหลักทรัพย์เห็นสมควร</p>	<p>การกำกับดูแล ผู้พัฒนาระบบ</p>

ส่วนที่ 3

การรับรองระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกและความพร้อมในการใช้งาน

<p>ข้อ 12 สมาชิกต้องรับรองว่าระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกทำงานได้ถูกต้องตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย และไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขาย ตลอดจนเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p> <p>ในกรณีที่สมาชิกมีการเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกที่ต้องได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ สมาชิกต้องรับรองว่าการเปลี่ยนแปลงดังกล่าวยังคงทำให้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกทำงานได้ถูกต้องตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย และไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขาย ตลอดจนเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p>	<p>การรับรองระบบ ส่งคำสั่งซื้อขาย ของสมาชิก</p>
<p>ข้อ 13 ในกรณีที่สมาชิกใช้หรือเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกซึ่งพัฒนาโดยผู้พัฒนาระบบ นอกจากการดำเนินการรับรองตามข้อ 12 แล้ว สมาชิกต้องจัดให้มีผู้พัฒนาระบบหรือผู้ให้บริการตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ตรวจสอบและรับรองการทำงานของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามข้อ 12 ด้วย</p> <p>ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดให้สมาชิกจัดให้มีหรือเปลี่ยนแปลงผู้ตรวจสอบและรับรองระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกได้ตามที่เห็นสมควร</p>	<p>การรับรองระบบ ส่งคำสั่งซื้อขายของ สมาชิกที่พัฒนาโดย ผู้พัฒนาระบบ</p>

<p>ข้อ 14 ในกรณีที่สมาชิก ผู้พัฒนาระบบ หรือผู้ให้บริการตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ รับผิดชอบต่อการทำงานของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกไม่ถูกต้องซึ่งอาจทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบ การซื้อขาย ตลาดหลักทรัพย์อาจห้ามสมาชิกใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก หรือกำหนดให้สมาชิก เปลี่ยนแปลงผู้พัฒนาระบบ หรือดำเนินการอื่นใดตามที่ตลาดหลักทรัพย์เห็นสมควร</p>	<p>กรณีที่มีการรับรอง ระบบส่งคำสั่ง ซื้อขายไม่ถูกต้อง</p>
<p>ข้อ 15 ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์มีการเปลี่ยนแปลงใด ๆ ในระบบการซื้อขาย หรือ มีการออกหรือเปลี่ยนแปลงข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ มติคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ หรือ หนังสือเวียนที่เกี่ยวกับการซื้อขาย ให้สมาชิกเข้าทดสอบระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกตามที่ตลาด หลักทรัพย์กำหนด พร้อมทั้งรายงานผลการทดสอบดังกล่าวมายังตลาดหลักทรัพย์ทุกครั้ง</p> <p>ให้สมาชิกรายงานผลการทดสอบครั้งสุดท้ายก่อนเริ่มใช้งานระบบส่งคำสั่งซื้อขายของ สมาชิกตามวรรคหนึ่ง พร้อมทั้งรับรองว่าสมาชิกได้ทดสอบแล้วว่าระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก ทำงานได้ถูกต้องตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย และไม่ทำให้เกิดความเสียหาย ต่อระบบการซื้อขาย ตลอดจนเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด โดยต้องมีผู้มีอำนาจ ลงนามของสมาชิกรับรองรายงานดังกล่าว</p>	<p>การร่วมทดสอบ ระบบเมื่อตลาด หลักทรัพย์ เปลี่ยนแปลงระบบ หรือข้อกำหนด</p>
<p>ข้อ 16 สมาชิกต้องจัดให้มีแผนสำรองและระบบสำรองของระบบส่งคำสั่งซื้อขาย ของสมาชิกที่สามารถทำงานได้ทันที เพื่อรองรับในกรณีที่ระบบส่งคำสั่งซื้อขายหลักของสมาชิก ไม่สามารถทำงานได้ตามปกติ</p> <p>สมาชิกต้องรายงานรายละเอียดแผนสำรองและระบบสำรองของระบบส่งคำสั่งซื้อขาย ของสมาชิกตามวรรคหนึ่งให้ตลาดหลักทรัพย์ทราบตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดและจัดให้มีการ ทดสอบระบบสำรองดังกล่าวอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง</p>	<p>แผนสำรองและ ระบบสำรอง ของสมาชิก</p>
<p>ข้อ 17 สมาชิกต้องมีความพร้อมและเข้าร่วมการทดสอบระบบการซื้อขายสำรอง และการใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายสำรองที่ตลาดหลักทรัพย์จัดเตรียมไว้ให้สมาชิกในกรณีที่ระบบสำรอง ของสมาชิกไม่สามารถทำงานได้ตามปกติ โดยเข้าร่วมการทดสอบดังกล่าวตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p>	<p>ความพร้อมในการ เข้าร่วมทดสอบ ระบบสำรอง</p>
<p>ข้อ 18 สมาชิกต้องจัดให้มีระบบทดสอบ (Test Environment) เพื่อใช้ทดสอบการ ทำงานของระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก</p>	<p>การจัดให้มีระบบ ทดสอบ (Test Environment)</p>
<p>ข้อ 19 สมาชิกต้องจัดให้มีบุคลากรในการดูแลระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก อย่างเพียงพอทั้งในช่วงเวลาทำการและนอกเวลาทำการ</p>	<p>บุคลากรผู้ดูแลระบบ ส่งคำสั่งซื้อขายของ สมาชิก</p>

ข้อ 20 สมาชิกต้องมีระบบจัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายของลูกค้า ตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด และจัดส่งข้อมูลดังกล่าวให้แก่ตลาดหลักทรัพย์ทันทีเมื่อ ตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

การจัดเก็บข้อมูล

ส่วนที่ 4

การเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

ข้อ 21 สมาชิกจะเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกในกรณีดังต่อไปนี้ ได้เมื่อได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ โดยแสดงรายละเอียดและทดสอบระบบตามที่ตลาดหลักทรัพย์ กำหนด

การเปลี่ยนแปลง
ที่ต้องได้รับ
อนุญาตจาก
ตลาดหลักทรัพย์

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

ข้อ 22 ในกรณีที่บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกตามข้อ 24 มีการเปลี่ยนแปลง ระบบส่งคำสั่งซื้อขายตามข้อ 21 สมาชิกต้องดำเนินการให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกจัดส่งรายงาน การเปลี่ยนแปลงดังกล่าวให้ตลาดหลักทรัพย์ทราบตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การเปลี่ยนแปลง
ระบบส่งคำสั่งซื้อ
ขายของ บล. ที่มีใช้
สมาชิก

ข้อ 23 ในกรณีที่สมาชิกให้ผู้พัฒนาระบบเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของ สมาชิก สมาชิกต้องมีมาตรการควบคุมดูแลการดำเนินการดังกล่าวของผู้พัฒนาระบบอย่างเคร่งครัดเพื่อ ป้องกันความเสียหายที่อาจเกิดแก่ระบบการซื้อขายได้

มาตรการควบคุม
ผู้พัฒนาระบบ

ส่วนที่ 5

การให้บุคคลอื่นต่อเชื่อมระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

ข้อ 24 สมาชิกอาจให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกหรือบุคคลอื่นใดต่อเชื่อมระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกเพื่อให้บุคคลดังกล่าวสามารถบันทึกคำสั่งซื้อขายได้ โดยการต่อเชื่อมดังกล่าวต้องเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ในกรณีสมาชิกให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกบันทึกคำสั่งซื้อขายตามวรรคหนึ่ง สมาชิกต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

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

การให้บุคคลอื่นต่อเชื่อมระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิก

ส่วนที่ 6

การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต

ข้อ 25 สมาชิกอาจจัดให้มีการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตได้เมื่อได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์โดยแสดงรายละเอียดว่าระบบดังกล่าวเป็นไปตามมาตรฐานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด และทดสอบระบบตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตต้องมีการทำงานและมีระบบการบริหารและควบคุมระบบรักษาความปลอดภัยในการปฏิบัติงาน (Security Management) ที่ได้มาตรฐานตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

สมาชิกต้องรับรองการทำงานของระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตและจัดให้มีผู้พัฒนาระบบหรือผู้ให้บริการตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ตรวจสอบและรับรองการทำงานของระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตตามหลักเกณฑ์ว่าด้วยการรับรองระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกและความพร้อมในการใช้งานในส่วนที่ 3 ของหมวด 1

ข้อ 26 ในกรณีที่สมาชิกจะเปลี่ยนแปลงระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตที่ได้รับอนุญาตตามข้อ 25 สมาชิกต้องดำเนินการตามหลักเกณฑ์ว่าด้วยการเปลี่ยนแปลงระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกในส่วนที่ 4 ของหมวด 1 และต้องดำเนินการรับรองการทำงานของระบบ

การขออนุญาต และการใช้ระบบซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต

การเปลี่ยนแปลงระบบซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต

ที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตตามหลักเกณฑ์ว่าด้วยการรับรองระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกและความพร้อมในการใช้งานในส่วนที่ 3 ของหมวด 1

ข้อ 27 ในกรณีที่สมาชิกอนุญาตให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกมีระบบที่ใช้ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตสำหรับลูกค้าของบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก สมาชิกต้องดำเนินการให้บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกยอมรับและปฏิบัติตามความในส่วนนี้

กรณีสมาชิกให้ บล. ที่มีใช้สมาชิกจัดให้มีการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต

ข้อ 28 การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตให้กระทำได้ด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM)

วิธีการเสนอซื้อขาย

ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต สมาชิกต้องระบุรหัสแสดงช่องทางในการบันทึกคำสั่งซื้อขาย (Designated Trader ID) ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ข้อ 29 ตลาดหลักทรัพย์อาจเรียกให้สมาชิกนำเสนอรายชื่อลูกค้าที่ส่งคำสั่งซื้อขายในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การนำเสนอรายชื่อลูกค้า

ข้อ 30 เพื่อกำกับดูแลการบันทึกคำสั่งซื้อขายในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต สมาชิกต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

การกำกับดูแลการบันทึกคำสั่งซื้อขายผ่านระบบอินเทอร์เน็ต

(1) จัดให้มีมาตรการป้องกันความลับของลูกค้า

(2) จัดให้มีระบบหรือกระบวนการในการตรวจสอบและติดตามดูแลคำสั่งซื้อขายของลูกค้าก่อนเข้ามาเป็นการเสนอซื้อขายในระบบการซื้อขาย

(3) จัดให้มีมาตรการป้องกันและควบคุมไม่ให้นุคคลอื่นบันทึกการซื้อขายให้แก่ลูกค้า ยกเว้นในกรณีที่มีเหตุขัดข้องทำให้ลูกค้าไม่สามารถบันทึกคำสั่งซื้อขายเข้ามาในระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกได้ ลูกค้าอาจมอบหมายให้เจ้าหน้าที่รับอนุญาตบันทึกคำสั่งซื้อขายแทนได้

(4) จัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายของลูกค้าตามมาตรฐานของตลาดหลักทรัพย์ โดยสมาชิกต้องสามารถจำแนกช่องทางหรือวิธีการที่ลูกค้าใช้ในการเสนอซื้อขายได้ และจัดส่งข้อมูลดังกล่าวต่อตลาดหลักทรัพย์ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

(5) ควบคุมดูแลให้ลูกค้ารับทราบและปฏิบัติตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ มติของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ และหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต รวมทั้งข้อห้ามปฏิบัติเกี่ยวกับการบันทึกคำสั่งซื้อขายที่มีลักษณะไม่เหมาะสม

ส่วนที่ 7

การซื้อขายหลักทรัพย์ทางอิเล็กทรอนิกส์ (Direct Electronic Access)

<p>ข้อ 31 สมาชิกอาจจัดให้มีการซื้อขายหลักทรัพย์ทางอิเล็กทรอนิกส์ (Direct Electronic Access) ได้ โดยต้องเป็นการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA ที่ได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์</p>	<p>การซื้อขาย หลักทรัพย์ทาง อิเล็กทรอนิกส์</p>
<p>ข้อ 32 สมาชิกอาจให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA ได้เฉพาะลูกค้าดังต่อไปนี้</p> <p>(1) ผู้ลงทุนสถาบันตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการกำหนดบทนิยามผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และผู้ลงทุนรายใหญ่ หรือ</p> <p>(2) นิติบุคคลที่มีคุณสมบัติดังต่อไปนี้</p> <p>(2.1) มีฐานะการเงินมั่นคง</p> <p>(2.2) มีประสบการณ์ด้านการลงทุนในตลาดทุนในประเทศไทยหรือต่างประเทศ</p>	<p>ลูกค้าที่สามารถ ทำการซื้อขาย หลักทรัพย์ผ่าน ระบบ DMA</p>
<p>(2.3) มีผู้บริหารที่ไม่ถูกกล่าวโทษหรือไม่อยู่ระหว่างถูกลงโทษโดยสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์หรือตลาดหลักทรัพย์ และต้องไม่มีพฤติกรรมการส่งคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสมตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้อง</p>	
<p>ข้อ 33 ในการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA สมาชิกต้องดำเนินการดังต่อไปนี้</p> <p>(1) จัดให้มีกระบวนการในการคัดกรองลูกค้า เพื่อให้มั่นใจว่าลูกค้ามีคุณสมบัติตามข้อ 32 รวมทั้งมีความรู้ความเข้าใจเกี่ยวกับระบบและกระบวนการส่งคำสั่งซื้อขาย และข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย</p>	<p>การดำเนินการของ สมาชิกกรณีมีการซื้อ ขายหลักทรัพย์ผ่าน ระบบ DMA</p>
<p>(2) จัดให้มีมาตรการควบคุมความเสี่ยง รวมทั้งระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายของลูกค้าก่อนส่งเข้ามาในระบบการซื้อขาย โดยระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายดังกล่าวต้องมีการตรวจสอบในเรื่องตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p>	
<p>(3) จัดให้มีการบริหารจัดการ โดยสมาชิกต้องมีอำนาจควบคุมและบริหารจัดการ รวมทั้งกำหนดและเปลี่ยนแปลงค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ในระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายได้ และในกรณีที่จำเป็นสมาชิกต้องสามารถหยุดการส่งคำสั่งซื้อขายใหม่และยกเลิกคำสั่งซื้อขายของลูกค้าที่ถูกส่งเข้ามาในระบบการซื้อขายแล้วได้ทันที (Kill Switch)</p>	
<p>(4) จัดให้มีการทบทวนความเหมาะสมของมาตรการควบคุมความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย ตลอดจนค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ในระบบตรวจสอบคำสั่งซื้อขายอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง</p>	
<p>(5) ในกรณีที่สมาชิกพบหรือสงสัยว่าลูกค้าอาจฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย หรือกรณีในตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ ให้สมาชิกตรวจสอบและนำเสนอข้อมูลเกี่ยวกับลูกค้าและข้อมูลการซื้อขายของลูกค้าให้แก่ตลาดหลักทรัพย์</p>	

ข้อ 34 ให้นำความในส่วนที่ 6 การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตมาใช้กับการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA ตามส่วนนี้เท่าที่ไม่ขัดหรือแย้ง โดยอนุโลม

การนำความในส่วน
การซื้อขายหลักทรัพย์
ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต
มาใช้บังคับ

ส่วนที่ 8

การใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading)

ข้อ 35 สมาชิกอาจใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติได้ โดยก่อนเริ่มใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ สมาชิกต้องได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การขออนุญาตใช้
Program Trading

ข้อ 36 สมาชิกต้องรับรองว่าชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติตามข้อ 35 มีการทำงานและมีระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายที่เป็นไปตามข้อกำหนดหรือมาตรฐานของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขาย และจะไม่ทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขายหรือสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวมหรือไม่ทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงไปหรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market)

การรับรองของ
สมาชิกกรณีการใช้
Program Trading

ข้อ 37 ในกรณีที่สมาชิกประสงค์จะเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติมเกี่ยวกับชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติที่ได้รับอนุญาตตามข้อ 35 ในเรื่องดังต่อไปนี้ สมาชิกจะต้องได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ก่อนเริ่มใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติที่มีการเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติม

การเปลี่ยนแปลง
การใช้ Program
Trading

(1) เพิ่มกลยุทธ์ (Strategy)

(2) เปลี่ยนแปลงระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย

(3) เปลี่ยนแปลงหลักการทำงานหรือฟังก์ชันการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์

สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ รวมถึงการเปลี่ยนแปลงค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ที่ทำให้ความเสี่ยงเพิ่มขึ้นหรือกระทบหลักการทำงานหรือฟังก์ชันการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ

ให้สมาชิกที่ประสงค์จะเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติมเกี่ยวกับชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติตามวรรคหนึ่งยื่นขออนุญาตต่อตลาดหลักทรัพย์ล่วงหน้าก่อนการเปลี่ยนแปลงดังกล่าวตามระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

ข้อ 38 ในการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติที่สมาชิกใช้บันทึกการเสนอซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขาย สมาชิกต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

การดำเนินการของ
สมาชิกสำหรับการ
ใช้ Program
Trading

(1) มีระบบการจัดการ และระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย และ กำกับดูแลการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติหรือจัดการการเสนอซื้อขายเมื่อมี เหตุจำเป็นและสมควร

(2) ควบคุมดูแลมิให้มีการบันทึกการเสนอซื้อขายที่มีลักษณะเป็นการทำให้หรือ อาจทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์หรือสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวม เปลี่ยนแปลงไป หรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market)

ข้อ 39 สมาชิกที่ได้รับอนุญาตให้ใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดย อัตโนมัติต้องทบทวนระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายให้มีประสิทธิภาพอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง และให้สมาชิกปรับปรุงหรือเปลี่ยนแปลงระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายให้เหมาะสม ในกรณีดังต่อไปนี้

การทบทวนระบบ
บริหารความเสี่ยง
สำหรับการใช้
Program Trading

(1) กรณีที่มีการแก้ไขข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายใน เรื่องที่ส่งผลกระทบต่อระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขาย

(2) กรณีที่ตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

ข้อ 40 สมาชิกต้องจัดเก็บข้อมูลเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงฟังก์ชันการทำงานของ ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติในส่วนที่เกี่ยวข้องกับค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ตามระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดและจัดส่งข้อมูลดังกล่าวให้แก่ตลาดหลักทรัพย์ทันทีเมื่อ ตลาดหลักทรัพย์ร้องขอ

การจัดเก็บข้อมูล

ส่วนที่ 9

ข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขาย

ข้อ 41 ห้ามสมาชิกให้หรือจำหน่ายข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขายแก่ลูกค้าหรือ บุคคลอื่นไม่ว่าจะโดยวิธีการใด ยกเว้นการเปิดเผยข้อมูลตามข้อ 42 หรือการเปิดเผยข้อมูลให้บุคคล อื่นใดที่ได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์

ห้ามให้หรือจำหน่าย
ข้อมูลที่ได้จากระบบ
การซื้อขาย

ข้อ 42 ให้สมาชิกเปิดเผยข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขายให้แก่ลูกค้าตามที่ ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การเปิดเผยข้อมูล
ให้ลูกค้า

ข้อ 43 ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกระงับการให้หรือจำหน่ายข้อมูลที่ได้จากระบบ การซื้อขายแก่ลูกค้าของสมาชิกหรือบุคคลอื่นได้ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

การระงับการให้
หรือจำหน่ายข้อมูล

หมวด 2

การกำกับดูแลการซื้อขายของสมาชิก

ข้อ 44 เพื่อกำกับดูแลการใช้ระบบส่งคำสั่งซื้อขายของสมาชิกหรือในกรณีที่มีเหตุจำเป็นอันอาจมีผลกระทบต่อการทำงานของระบบการซื้อขายหรือต่อสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวม ตลาดหลักทรัพย์อาจดำเนินการดังต่อไปนี้

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

การกำกับดูแล
การใช้ระบบส่ง
คำสั่งซื้อขายของ
สมาชิก

ข้อ 45 ในกรณีที่คำสั่งซื้อขายของลูกค้าที่ส่งผ่านระบบอินเทอร์เน็ตหรือส่งทางอิเล็กทรอนิกส์มีลักษณะฝ่าฝืนหรือไม่เป็นไปตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ มติของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ หรือหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกดำเนินการอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังต่อไปนี้

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

การดำเนินการของ
สมาชิกกรณีลูกค้า
ฝ่าฝืนข้อกำหนดของ
ตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 46 ในกรณีที่ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติของสมาชิกมีการทำงานไม่เป็นไปตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย และทำให้หรืออาจทำให้เกิดความเสียหายต่อระบบการซื้อขายหรือสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวม ตลาดหลักทรัพย์อาจระงับหรือยกเลิกการอนุญาตการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติได้

กรณีที่คำสั่งที่ส่งโดยชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติมีหรืออาจมีผลทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงไปหรือไม่มีการเปลี่ยนแปลงอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด (False Market) ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกปรับปรุงแก้ไขค่าพารามิเตอร์ (Parameters) และ/หรือโปรแกรมฟังก์ชันการทำงานและ/หรือระบบบริหารความเสี่ยงของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติหรือระงับการใช้งานชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ

การระงับหรือยกเลิก
การอนุญาตใช้
Program Trading
เมื่อไม่เป็นไปตาม
ข้อกำหนดและทำให้
หรืออาจทำให้เกิด
ความเสียหายโดยรวม

ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นอันอาจมีผลกระทบต่อการทำงานของระบบการซื้อขายหรือต่อสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์โดยรวม ตลาดหลักทรัพย์อาจให้สมาชิกกระจัดการซื้อขายหลักทรัพย์โดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติทุกกลยุทธ์ (Strategy) หรือเฉพาะบางกลยุทธ์ (Strategy) เป็นการชั่วคราวได้

การระงับการใช้
Program Trading
เมื่อมีเหตุจำเป็น หรือ
Circuit Breaker

เมื่อตลาดหลักทรัพย์หยุดทำการซื้อขายหลักทรัพย์ทั้งหมดอันเป็นผลมาจากการทำงานของระบบ Circuit Breaker ของตลาดหลักทรัพย์ ตลาดหลักทรัพย์จะให้สมาชิกกระจัดการซื้อขายหลักทรัพย์โดยใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติเป็นการชั่วคราว

หมวด 3

เวลาทำการซื้อขาย

ข้อ 47 ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดวิธีการซื้อขายแตกต่างกันสำหรับแต่ละช่วงเวลาทำการซื้อขาย

เวลาทำการซื้อขาย

ข้อ 48 ตลาดหลักทรัพย์จะกำหนดเวลาเปิดและปิดทำการซื้อขายประจำวันตามเวลาที่ได้มีการสุ่มเลือก (Random) ด้วยระบบการซื้อขาย

เวลาเปิด/ปิด
ทำการซื้อขาย

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

การเปลี่ยนแปลง
เวลา Pre-open
หรือ Pre-close

หมวด 4

วิธีการซื้อขาย

ส่วนที่ 1

รายการซื้อขาย

ข้อ 50 การบันทึกคำสั่งซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขายต้องมีรายการอย่างน้อยตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

รายการขั้นต่ำในการ
บันทึกคำสั่งซื้อขาย

ส่วนที่ 2

การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM)

- ข้อ 51 การเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนและมูลค่าของหลักทรัพย์ ไม่เกินจำนวนและมูลค่าตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด จำนวนและมูลค่าหลักทรัพย์สูงสุดที่เสนอซื้อขายได้
- ข้อ 52 ให้หน่วยการซื้อขายของหลักทรัพย์แต่ละประเภทมีจำนวนตามที่ตลาดหลักทรัพย์ กำหนด หน่วยการซื้อขายหลักทรัพย์ (Board Lot)
- ข้อ 53 ราคาเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาที่ตรงตามช่วงราคาในตลาดหลักทรัพย์ กำหนด ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์อาจกำหนดช่วงราคาของหลักทรัพย์แต่ละประเภทแตกต่างกันไป ช่วงราคา (Tick Size)
- ข้อ 54 สมาชิกอาจระบุประเภทการเสนอซื้อขายอย่างใดอย่างหนึ่งในช่วงเวลาซื้อขาย ดังต่อไปนี้ ประเภทการเสนอซื้อขาย

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

ประเภทการเสนอซื้อขาย	ความหมายและลักษณะ	ช่วงเวลาซื้อขาย
	เวลาทำการซื้อขายที่ระบบการซื้อขายจะแบ่งการซื้อขายออกเป็นจำนวนย่อย ๆ แล้วทยอยนำเข้าสู่ระบบการซื้อขายโดยอัตโนมัติและให้การเสนอซื้อขายในครั้งหลังกระทำได้อีกเมื่อการเสนอซื้อขายในครั้งก่อนได้ถูกจับคู่การซื้อขายแล้ว	Session)
5. At the Open (ATO)	การเสนอซื้อขายที่ประสงค์ให้มีการซื้อขายครั้งเดียวที่ราคาเปิด และหากมีจำนวนการเสนอซื้อขายที่ไม่สามารถจับคู่การซื้อขายได้ เมื่อเปิดทำการซื้อขาย ระบบการซื้อขายจะยกเลิกการเสนอซื้อขายที่ยังจับคู่ไม่ได้	• ช่วงก่อนเปิดทำการ (Pre-open)
6. At the Close (ATC)	การเสนอซื้อขายที่ประสงค์ให้มีการซื้อขายครั้งเดียวที่ราคาปิด และหากมีจำนวนการเสนอซื้อขายที่ไม่สามารถจับคู่การซื้อขายได้ เมื่อปิดทำการซื้อขาย ระบบการซื้อขายจะยกเลิกการเสนอซื้อขายที่ยังจับคู่ไม่ได้	• ช่วงก่อนปิดทำการ (Pre-close)
7. Market Order	การเสนอซื้อขายที่ระบุให้มีการเสนอซื้อ ณ ราคาเสนอขายต่ำสุดหรือเสนอขาย ณ ราคาเสนอซื้อสูงสุดตามลำดับ และหากมีจำนวนการเสนอซื้อขายที่ไม่สามารถจับคู่การซื้อขายได้ ระบบการซื้อขายจะยกเลิกจำนวนดังกล่าวทันที	• ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)
8. Special Market Order	การเสนอซื้อขายที่ระบุให้มีการเสนอซื้อ ณ ราคาเสนอขายต่ำสุดหรือเสนอขาย ณ ราคาเสนอซื้อสูงสุดตามลำดับ และหากมีจำนวนการเสนอซื้อขายที่ไม่สามารถจับคู่การซื้อขายได้ ระบบการซื้อขายจะจัดให้จำนวนดังกล่าวเป็นการเสนอซื้อที่ราคาสูงกว่าหรือเป็นการเสนอขายที่ราคาต่ำกว่าราคาซื้อขายสุดท้าย 1 ช่วงราคา	• ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)
9. Market to Limit Order	การเสนอซื้อขายที่ระบุให้มีการเสนอซื้อ ณ ราคาเสนอขายต่ำสุดหรือเสนอขาย ณ ราคาเสนอซื้อสูงสุดเพียงลำดับราคาเดียวและหากมีจำนวนการเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถ	• ช่วงเวลาทำการ (Trading Session)

ประเภทการเสนอซื้อขาย	ความหมายและลักษณะ	ช่วงเวลาซื้อขาย
	จับคู่การเสนอซื้อขายได้ ระบบการเสนอซื้อขายจะจัดให้จำนวนดังกล่าวเป็นการเสนอซื้อหรือเสนอขายที่ราคาซื้อขายสุดท้าย	

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

(1) กรณีการเสนอซื้อ ระบบการเสนอซื้อขายจะจัดให้เป็นราคาที่สูงกว่าราคาเสนอซื้อสูงสุด 1 ช่วงราคา หรือราคาเสนอขายสูงสุด แล้วแต่ราคาใดจะสูงกว่า

(2) กรณีการเสนอขาย ระบบการเสนอซื้อขายจะจัดให้เป็นราคาที่ต่ำกว่าราคาเสนอขายต่ำสุด 1 ช่วงราคา หรือราคาเสนอซื้อต่ำสุด แล้วแต่ราคาใดจะต่ำกว่า

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

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

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

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

เมื่อเกิดกรณีใดกรณีหนึ่งดังต่อไปนี้ ระบบการเสนอซื้อขายจะยกเลิกการเสนอซื้อขายที่ระบุประเภท Iceberg Order

(1) ระบบการเสนอซื้อขายไม่อาจจัดให้มีการซื้อขายภายในช่วงเวลาทำการช่วงที่ 1 หรือช่วงที่ 2 แล้วแต่กรณี

(2) หลักทรัพย์ที่ทำการเสนอซื้อขายนั้นถูกห้ามการซื้อขายตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการห้ามซื้อขายหลักทรัพย์เป็นการชั่วคราว

ข้อ 58 การซื้อขายหลักทรัพย์หน่วยย่อย ให้สมาชิกบันทึกคำสั่งซื้อขายได้เฉพาะประเภท Limit Order เท่านั้น

ส่วนที่ 3

การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report)

ข้อ 59 สมาชิกอาจซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) ตามประเภทการซื้อขายดังต่อไปนี้ ประเภทการบันทึก
การซื้อขาย

- (1) การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot)
- (2) การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างค้ำเป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign)
- (3) การบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด (Trade Report - Buy-in)
- (4) การบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ถูกค้ำของสมาชิกผิคนัด (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

ตลาดหลักทรัพย์อาจอนุญาตให้สมาชิกบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ซึ่งมีจำนวนหลักทรัพย์หรือมูลค่าการซื้อขายต่ำกว่าที่กำหนดในวรรคหนึ่งได้ในกรณีที่สมาชิกซื้อขายหลักทรัพย์เพื่อปฏิบัติให้เป็นไปตามกฎหมาย

ให้สมาชิกรายงานข้อมูลการบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ต่อตลาดหลักทรัพย์ตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด เมื่อสมาชิกบันทึกการซื้อขายที่มีปริมาณการซื้อขายหรือขายหลักทรัพย์เพิ่มขึ้นจนถึงหรือข้ามจุดซึ่งต้องทำคำเสนอซื้อหลักทรัพย์ทั้งหมดของกิจการตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ หรือการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สมาชิกรู้หรือมีเหตุอันควรรู้ว่าเป็นผลให้ผู้ซื้อได้มาหรือเป็นผู้ถือหลักทรัพย์เพิ่มขึ้นจนถึงหรือข้ามจุดซึ่งต้องทำคำเสนอซื้อหลักทรัพย์ดังกล่าว ให้สมาชิกรายงานทันทีภายหลังบันทึกการซื้อขาย

ข้อ 61 การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างค้ำเป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign) ให้ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้ Trade Report –
Foreign

(1) เป็นการซื้อขายหลักทรัพย์ซึ่งมีจำนวนหลักทรัพย์และมีมูลค่าการซื้อขายต่ำกว่าที่กำหนดในข้อ 60 วรรคหนึ่ง

(2) มิให้นำหลักเกณฑ์เรื่องหน่วยการซื้อขายตามข้อ 52 และช่วงราคา ตามข้อ 53 มาใช้บังคับ

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

Trade Report –
Buy - in

- (1) บันทึกการซื้อขายโดยสมาชิกผู้ซื้อและผู้ขายเป็นรายเดียวกัน (One-firm Trade Report)
- (2) บันทึกการซื้อขายภายในช่วงเวลาตลาดหลักทรัพย์กำหนด
- (3) ราคาซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาที่ตรงตามช่วงราคาตามตลาดหลักทรัพย์กำหนด
- (4) การซื้อขายในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนหลักทรัพย์เป็นหน่วยการซื้อขาย ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

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

Trade Report –
Member buy - in

- (1) บันทึกการซื้อขายในวันที่สมาชิกมีหน้าที่ส่งมอบหลักทรัพย์ตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด
- (2) ราคาซื้อขายต้องเป็นราคาที่เพิ่มขึ้นอีกไม่น้อยกว่า 5 ช่วงราคาจากราคาปิดของวันทำการก่อนหน้า หรือราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด ณ เวลา 10.00 น. แล้วแต่ราคาใดจะสูงกว่า และให้ถือว่าเป็นราคาซื้อขายสำหรับการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัด (Final Member buy-in) ในวันนั้น และหากไม่สามารถซื้อได้ สมาชิกจะทำการซื้อขายในวันทำการถัดไปในราคาที่เพิ่มขึ้นอีกไม่น้อยกว่า 5 ช่วงราคาจากราคาปิดของวันทำการก่อนหน้า หรือราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด ณ เวลา 10.00 น. หรือราคาซื้อขายสำหรับการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัด (Final Member buy-in) ในวันทำการก่อนหน้า แล้วแต่ราคาใดจะสูงกว่า
- (3) ราคาซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาที่ตรงตามช่วงราคาตามตลาดหลักทรัพย์กำหนด
- (4) การซื้อขายในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนหลักทรัพย์เป็นหน่วยการซื้อขาย ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด
- (5) สำหรับหลักทรัพย์ใด ๆ ที่สมาชิกไม่สามารถดำเนินการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัด ได้ครบทั้งจำนวนในวันนั้น และปรากฏว่ามีรายการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัดสำหรับหลักทรัพย์เดียวกันนั้นในวันทำการถัดไป สมาชิกจะรวมจำนวนหลักทรัพย์ที่ต้องดำเนินการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิคนัดเข้ากับจำนวนหลักทรัพย์ที่ยังไม่สามารถดำเนินการซื้อได้ โดยใช้ราคาเดียวกับราคาเสนอซื้อของหลักทรัพย์ส่วนที่ยังไม่สามารถดำเนินการซื้อได้

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

Trade Report –
Off-hour

- (1) มีจำนวนหลักทรัพย์และมีมูลค่าการซื้อขายต่ำกว่าที่กำหนดในข้อ 60 วรรคหนึ่ง
- (2) บันทึกการซื้อขายภายในช่วงเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด
- (3) ราคาซื้อขายหลักทรัพย์ต้องเป็นราคาปิดหรือราคาเฉลี่ยของหลักทรัพย์ในเวลาทำการประจำวันของวันที่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว ในกรณีที่ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าวในเวลาทำการประจำวัน ให้ใช้ราคาปิดของวันทำการก่อนหน้านั้นเป็นราคาซื้อขาย
- (4) การซื้อขายในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนหลักทรัพย์เป็นหน่วยการซื้อขายตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

หมวด 5

หลักเกณฑ์เฉพาะการซื้อขายหลักทรัพย์บางประเภท

ส่วนที่ 1

การซื้อขายใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย

(Non-voting Depository Receipt: NVDR)

ข้อ 65 การซื้อขายใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย ให้กระทำด้วยวิธีการซื้อขายตามหมวด 4 โดยให้สมาชิกบันทึกเครื่องหมายแสดงว่าเป็นคำสั่งซื้อขายใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทยตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

วิธีการซื้อขาย
NVDR

ส่วนที่ 2

การซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าว

ข้อ 66 การซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าว ให้กระทำด้วยวิธีการซื้อขายตามหมวด 4 โดยให้สมาชิกบันทึกเครื่องหมายแสดงว่าเป็นคำสั่งซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าวตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

วิธีการซื้อขาย
หน่วยลงทุน
Thai Trust Fund

ข้อ 67 ตลาดหลักทรัพย์อาจห้ามไม่ให้สมาชิกบันทึกคำสั่งซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าวในกรณีที่อาจทำให้อัตราส่วนการลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าวเกินกว่าอัตราส่วนที่กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าวได้ตกลงไว้กับบริษัทจดทะเบียน

การห้ามสมาชิกซื้อขาย
หน่วยลงทุน Thai
Trust Fund กับ
อัตราส่วนการลงทุน

ข้อ 68 ให้สมาชิกมีมาตรการในการตรวจสอบว่าการบันทึกคำสั่งซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าวเป็นการเสนอซื้อขายหรือซื้อขายตามคำสั่งของลูกค้าซึ่งเป็นคนต่างด้าวเท่านั้น

การตรวจสอบว่า
ลูกค้าต่างด้าวเป็น
ผู้ส่งคำสั่ง

ส่วนที่ 3 การซื้อขายตราสารหนี้

ข้อ 69 การซื้อขายตราสารหนี้ให้กระทำด้วยวิธีการซื้อขายตามหมวด 4

วิธีการซื้อขาย
ตราสารหนี้

ข้อ 70 ตราสารหนี้ที่ซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) ต้องมีคุณสมบัติดังต่อไปนี้

คุณสมบัติของตราสาร
หนี้ที่ซื้อขายด้วยวิธี
จับคู่อัตโนมัติ

(1) ไม่มีข้อจำกัดในการโอน

(2) กรณีเป็นตราสารหนี้ที่ต้องมีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ต้องได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในแต่ละครั้งที่ออกอย่างน้อยในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment Grade) หรือเทียบเท่า จนกว่าสิทธิเรียกร้องตามตราสารหนี้จะระงับลง หรือในกรณีที่ตราสารหนี้เป็นหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารแห่งหนึ่งต้องมีนโยบายการลงทุนในตราสารหนี้ที่มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือโดยรวมในลักษณะเดียวกับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหนี้ตามหลักเกณฑ์ดังกล่าว

ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควร ตลาดหลักทรัพย์อาจผ่อนผันการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหนี้โดยกำหนดเงื่อนไขหรือเงื่อนไขไว้ด้วยก็ได้ ทั้งนี้ โดยคำนึงถึงความจำเป็นของผู้ลงทุนในการมีข้อมูลการจัดอันดับความน่าเชื่อถือนั้น

การซื้อขายตราสารหนี้ที่ขาดคุณสมบัติตามวรรคหนึ่ง ให้ซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) โดยตลาดหลักทรัพย์จะกำหนดวันที่ให้เริ่มซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) ดังกล่าว

ข้อ 71 การซื้อขายตราสารหนี้ต้องบันทึกราคาที่ซึ่งรวมดอกเบี้ยค้างรับตามข้อตกลงในตราสารหนี้ด้วย (ถ้ามี) และการซื้อขายตราสารหนี้ด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) ต้องบันทึกราคาที่เสนอซื้อขายเป็นจุดทศนิยมไม่เกินสองตำแหน่ง

ราคาซื้อขาย
ตราสารหนี้

การซื้อขาย
ตราสารหนี้ด้วยวิธี
จับคู่อัตโนมัติ

ข้อ 72 ให้นำหลักเกณฑ์ว่าด้วยการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) ในส่วนที่ 2 ของหมวด 4 มาใช้บังคับกับการซื้อขายตราสารหนี้ด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ ยกเว้นเรื่องดังต่อไปนี้

(1) ช่วงราคา

(2) จำนวนหลักทรัพย์ในการเสนอซื้อขายแต่ละครั้ง โดยให้จำนวนตราสารหนี้ในการเสนอซื้อขายแต่ละครั้งไม่เกิน 10,000 หน่วยของตราสารหนี้

สมาชิกอาจซื้อขายตราสารหนี้เป็นหน่วยการซื้อขายหรือหน่วยย่อยก็ได้ โดยให้หน่วยการซื้อขายของตราสารหนี้เท่ากับ 100 หน่วยของตราสารหนี้

ข้อ 73 ให้นำหลักเกณฑ์ว่าด้วยการซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) ในส่วนที่ 3 ของหมวด 4 มาใช้บังคับกับการซื้อขายตราสารหนี้ด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) ยกเว้นเรื่องจำนวนหลักทรัพย์หรือมูลค่าการซื้อขาย โดยให้การซื้อขายตราสารหนี้ที่มีจำนวนตราสารหนี้หรือมูลค่าการซื้อขายดังต่อไปนี้

การซื้อขาย
ตราสารหนี้ด้วยวิธี
บันทึกการซื้อขาย

(1) จำนวนตราสารหนี้ตั้งแต่ 10,000 หน่วยของตราสารหนี้หรือมีมูลค่าการซื้อขายตั้งแต่ 10 ล้านบาทขึ้นไป สำหรับการบันทึกการซื้อขายตราสารหนี้รายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) โดยให้คิดมูลค่าตามราคาของผู้ซื้อและผู้ขายตกลงซื้อขายตราสารหนี้

(2) จำนวนตราสารหนี้น้อยกว่า 10,000 หน่วยของตราสารหนี้หรือมีมูลค่าการซื้อขายน้อยกว่า 10 ล้านบาท สำหรับการบันทึกการซื้อขายนอกเวลาทำการ (Trade Report – Off-hour) โดยให้คิดมูลค่าตามราคาของผู้ซื้อและผู้ขายตกลงซื้อขายตราสารหนี้

การบันทึกการซื้อขายตราสารหนี้ต้องระบุรายการเพิ่มเติมดังต่อไปนี้ด้วย

(1) อักษรเครื่องหมาย “N” กรณีสมาชิกประสงค์จะชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ตามข้อมูล Net Clearing ที่สำนักหักบัญชีจัดทำขึ้นตามข้อบังคับของสำนักหักบัญชีว่าด้วยการชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์

(2) อักษรเครื่องหมาย “G” พร้อมระบุวันชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ตามระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด กรณีสมาชิกประสงค์จะชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ตามข้อมูล Gross Clearing ที่สำนักหักบัญชีจัดทำขึ้นตามข้อบังคับของสำนักหักบัญชีว่าด้วยการชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์

*หมวด 5/1

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

หมวด 6

การแก้ไขหรือยกเลิกการซื้อขาย

ข้อ 74 การขออนุญาตแก้ไขการซื้อขาย ให้สมาชิกกระทำด้วยระบบการซื้อขายก่อนเวลา 17.00 น.

การแก้ไขหรือ
ยกเลิกการซื้อขาย

การขออนุญาตยกเลิกการบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) ให้สมาชิกกระทำด้วยระบบการซื้อขายก่อนเวลา 17.00 น. ยกเว้นการขออนุญาตยกเลิกการบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด (Trade Report - Buy-in) หรือการบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิดนัด (Trade Report - Member buy – in) ให้สมาชิกกระทำภายในช่วงเวลาตลาดหลักทรัพย์กำหนด

หมวด 7

เครื่องหมายประกอบการซื้อขาย

ส่วนที่ 1

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

ข้อ 75 ในส่วนนี้

“บริษัทจดทะเบียน” หมายความว่า บริษัทที่มีหุ้นสามัญจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ รวมถึงผู้มีหน้าที่เปิดเผยสารสนเทศตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการเปิดเผยสารสนเทศ

นิยาม

ข้อ 76 ตลาดหลักทรัพย์อาจขึ้นเครื่องหมาย NP (Notice Pending) ไว้ที่หลักทรัพย์ เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบว่าบริษัทจดทะเบียนมีสารสนเทศต้องชี้แจงหรือรายงานต่อตลาดหลักทรัพย์

เครื่องหมาย NP

ข้อ 77 เมื่อตลาดหลักทรัพย์ได้รับสารสนเทศตามข้อ 76 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) หลักทรัพย์อยู่ระหว่างที่ตลาดหลักทรัพย์สั่งห้ามซื้อหรือขายหลักทรัพย์จดทะเบียนเป็นการชั่วคราว โดยการขึ้นเครื่องหมาย SP ไว้ที่หลักทรัพย์นั้นเนื่องจากบริษัทจดทะเบียนฝ่า

ฝืนหรือละเลยไม่ปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ข้อบังคับ ระเบียบ ประกาศ คำสั่ง มติคณะกรรมการ ข้อตกลงการจดทะเบียนหลักทรัพย์กับตลาดหลักทรัพย์ ตลอดจนหนังสือเวียนใด ๆ ที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้ถือปฏิบัติอย่างร้ายแรง และตลาดหลักทรัพย์ให้ซื้อหลักทรัพย์นั้นด้วยบัญชี แคมบาลานซ์ (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 ตลาดหลักทรัพย์อาจประกาศขึ้นเครื่องหมายตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ไว้ที่หลักทรัพย์ล่วงหน้า 2 วันทำการก่อนวันที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์กำหนดปิดสมุดทะเบียนพักการ โอนหลักทรัพย์ หรือ 2 วันทำการถึงวันที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์กำหนดรายชื่อผู้ถือหลักทรัพย์เพื่อให้ สิทธิประโยชน์ แล้วแต่กรณี เพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์นั้นเป็นราคาที่ไม่รวมถึงสิทธิ ประโยชน์ที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์นั้นจะให้หรือให้แก่ผู้ถือหลักทรัพย์นั้นในการปิดสมุดทะเบียนพัก การโอนหลักทรัพย์หรือในการกำหนดรายชื่อผู้ถือหลักทรัพย์คราวนั้น

เครื่องหมาย X

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

ข้อ 79 ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่สามารถขึ้นเครื่องหมายภายในระยะเวลาที่กำหนดตามข้อ 78 ตลาดหลักทรัพย์อาจพิจารณาประกาศขึ้นเครื่องหมายไว้เป็นการล่วงหน้าก่อนวันที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์กำหนดปิดสมุดทะเบียนพักการโอนหลักทรัพย์หรือกำหนดรายชื่อผู้ถือหลักทรัพย์เพื่อการนั้นตามสมควรแก่กรณี

การประกาศขึ้น
เครื่องหมาย X
ล่วงหน้า

*ส่วนที่ 3

เครื่องหมาย C (Caution)

ข้อ 79/1 ในส่วนนี้

“มาตรการดำเนินการ” หมายความว่า มาตรการดำเนินการตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยมาตรการดำเนินการกรณีบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจ

นิยาม

“หลักทรัพย์” หมายความว่า หลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนที่อยู่ภายใต้มาตรการดำเนินการ รวมถึงใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีหุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนดังกล่าวเป็นสินทรัพย์อ้างอิง

หลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียนตามวรรคหนึ่ง ไม่รวมหุ้นกู้ หุ้นกู้ที่อาจแปลงสภาพแห่งสิทธิเป็นหุ้นได้ และใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้

ข้อ 79/2 ตลาดหลักทรัพย์อาจขึ้นเครื่องหมาย C (Caution) ไว้ที่หลักทรัพย์ในวันทำการถัดจากวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศรายชื่อบริษัทจดทะเบียนที่อยู่ภายใต้มาตรการดำเนินการ เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบว่าบริษัทจดทะเบียนอยู่ภายใต้มาตรการดำเนินการดังกล่าว

การขึ้น
เครื่องหมาย C

ข้อ 79/3 ตลาดหลักทรัพย์อาจปลดเครื่องหมาย C (Caution) ออกจากหลักทรัพย์ในวันทำการถัดจากวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศรายชื่อบริษัทจดทะเบียนที่พ้นจากมาตรการดำเนินการ เพื่อให้ผู้ลงทุนทราบว่าบริษัทจดทะเบียนได้พ้นจากมาตรการดำเนินการดังกล่าวแล้ว

การปลด
เครื่องหมาย C

(*เพิ่มเติมความในส่วนที่ 3 ของหมวด 7 โดยประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง ระเบียบปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 3) พ.ศ. 2561 ลงวันที่ 5 มีนาคม 2561 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 2 กรกฎาคม 2561 เป็นต้นไป))

หมวด 8

หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินโดยสมาชิก

- ข้อ 80 สมาชิกผู้ประสงค์จะเป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นใดต้องได้รับ อนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ การขออนุญาตเป็น ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้น ที่จัดสรรเกิน
- ให้สมาชิกยื่นคำขออนุญาตเป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินตามแบบที่ตลาด หลักทรัพย์กำหนดเป็นการล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 1 วันทำการก่อนวันที่สมาชิกเริ่มทำการซื้อเพื่อส่งมอบ หุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นดังกล่าว
- ข้อ 81 ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นใดมีหน้าที่ต้องทำการซื้อเพื่อส่งมอบ หุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นนั้นโดยการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) ตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขดังต่อไปนี้ วิธีการซื้อเพื่อส่งมอบ หุ้นที่จัดสรรเกิน
- (1) ระบุว่าเป็นการเสนอซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน
 - (2) บันทึกราคาสั่งซื้อประเภท Limit Order โดยกำหนดราคาเสนอซื้อที่ไม่สูงกว่า ราคาเสนอซื้อสูงสุดในขณะนั้น หรือราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายในขณะนั้น หรือราคาเสนอขายครั้งแรก (IPO Price) ทั้งนี้ แล้วแต่ราคาใดจะต่ำกว่า
 - (3) ให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินทำการแยกบัญชีสำหรับการซื้อเพื่อส่ง มอบหุ้นที่จัดสรรเกินออกจากบัญชีเพื่อการลงทุนของตนเอง
- ข้อ 82 ในการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในแต่ละวันทำการ ให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบ หุ้นที่จัดสรรเกินแจ้งชื่อของเจ้าหน้าที่รับอนุญาตที่ทำหน้าที่ดังกล่าว การแจ้งชื่อเจ้าหน้าที่ รับอนุญาต
- ข้อ 83 ห้ามมิให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน กระทำการดังต่อไปนี้ ข้อห้ามของผู้ซื้อ เพื่อส่งมอบหุ้นที่ จัดสรรเกิน
- (1) อนุญาตให้เจ้าหน้าที่รับอนุญาตที่ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินมอบหมาย ทำการอื่นใดนอกจากการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน
 - (2) ซื้อขายหุ้นที่ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินมีหน้าที่ต้องทำการซื้อเพื่อส่ง มอบหุ้นที่จัดสรรเกินเพื่อบัญชีของตนเอง ในระหว่างเวลาที่เป็นผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินในหุ้นนั้น
 - (3) เสนอซื้อหุ้นในราคาหรือปริมาณที่ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินรู้หรือมี เหตุอันควรรู้ว่าราคาดังกล่าวอาจเกิดจากการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์
- ข้อ 84 ให้ผู้ซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินจัดทำรายงานประจำวันและรายงานสรุป การซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินเมื่อครบระยะเวลาของการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกินตามแบบที่ ตลาดหลักทรัพย์กำหนด และส่งต่อตลาดหลักทรัพย์ภายใน 12.00 น. ของวันทำการถัดไป การจัดทำและ ส่งรายงาน

ข้อ 85 ตลาดหลักทรัพย์จะระบุเครื่องหมายเพื่อแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบว่าหุ้นใดมีการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน 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 ปีนับแต่วันที่ฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหมวดนี้ การฝ่าฝืนหลักเกณฑ์การซื้อหุ้นคืน

หมวด 9

การซื้อขายหลักทรัพย์ของสมาชิกหรือบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก ในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนของลูกค้า

ข้อ 88 ในกรณีที่สมาชิกทำการซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทตนเองในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนของลูกค้า ให้สมาชิกปฏิบัติดังต่อไปนี้ ข้อปฏิบัติของสมาชิกกรณีซื้อขาย

(1) ซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าวเฉพาะด้วยเงินสด หลักทรัพย์ของ

(2) จัดให้มีมาตรการแก้ไขความผิดพลาดในการซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทตนเองที่เหมาะสมและชัดเจน โดยต้องไม่ทำให้สมาชิกเป็นผู้ถือหลักทรัพย์ของบริษัทตนเองที่เกี่ยวข้อง

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

ในกรณีที่สมาชิกทำการซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิกในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนของลูกค้า ให้สมาชิกปฏิบัติตามวรรคหนึ่ง (3)

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

หลักเกณฑ์เกี่ยวกับการใช้ข้อมูลภายใน Conflict of Interest

ข้อ 90 ให้สมาชิกรายงานรายชื่อบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก และรายงานการเปลี่ยนแปลงรายชื่อบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิกที่เพิ่มขึ้นหรือลดลงต่อตลาดหลักทรัพย์ภายในเวลาและตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ทั้งนี้ ให้ระบุชื่อของบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก และความสัมพันธ์ที่แสดงถึงการมีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก และประกาศรายชื่อบริษัทนั้นไว้ในที่เปิดเผย ณ สำนักงานของสมาชิก

การรายงานและเปิดเผยชื่อของบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้อง

ข้อ 91 ให้สมาชิกจัดให้มีระบบกำกับดูแลและตรวจสอบการปฏิบัติงานของสมาชิก และรายงานให้ตลาดหลักทรัพย์ทราบทันทีเมื่อตรวจสอบพบว่าสมาชิกฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหมวดนี้

ระบบดูแลการปฏิบัติงาน

หมวด 10

บทเฉพาะกาล

ข้อ 92 ให้บรรดาคำสั่งหรือหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ที่ออกตามความในประกาศตลาดหลักทรัพย์ตามข้อ 2 ซึ่งใช้บังคับอยู่ก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ ยังคงใช้ต่อไปได้จนกว่าจะมีการกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข หรือวิธีการใด ๆ ในเรื่องดังกล่าวขึ้นใหม่ออกใช้บังคับ

บทเฉพาะกาล

ข้อ 93 ในกรณีที่ยกข้อกำหนด คำสั่ง หนังสือเวียน แนวทางปฏิบัติ หรือนโยบายของ ตลาดหลักทรัพย์ฉบับใดมีการอนุโลมใช้หรืออ้างถึงประกาศหรือความในประกาศตลาดหลักทรัพย์ตาม ข้อ 2 ให้การอนุโลมใช้หรืออ้างถึงประกาศหรือความในประกาศดังกล่าว หมายความว่าถึงการอนุโลมใช้ หรืออ้างถึงหลักเกณฑ์ในเรื่องดังกล่าวตามประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่ เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 แทน

บทเฉพาะกาล

ข้อ 94 ในกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้สมาชิกมีหน้าที่ปฏิบัติตามประกาศ ตลาดหลักทรัพย์ตามข้อ 2 และสมาชิกยังปฏิบัติไม่ครบตามประกาศดังกล่าว ให้นำหน้าที่ในการดำเนินการ ดังกล่าวยังคงมีต่อไปจนกว่าจะครบระยะเวลาที่กำหนด

บทเฉพาะกาล

ประกาศ ณ วันที่ 28 สิงหาคม 2560

(ลงนาม) นางเกศรา มัญชุศรี

(นางเกศรา มัญชุศรี)

กรรมการและผู้จัดการ

เหตุผลในการประกาศใช้: โดยที่ตลาดหลักทรัพย์ได้มีการปรับปรุงหลักเกณฑ์การซื้อขายหลักทรัพย์ เพื่อให้มีความเหมาะสม กับสภาพแวดล้อมทางธุรกิจ เนื่องกับการขยายฐานผู้ลงทุนและเพิ่ม โอกาสทางธุรกิจของสมาชิก ตลอดจนสอดคล้องกับ มาตรฐานสากล ตลาดหลักทรัพย์จึงเห็นควรให้ปรับปรุงหลักเกณฑ์ที่ เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบ หลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ โดยได้จัดทำให้มีความเหมาะสมและง่ายต่อการทำความเข้าใจยิ่งขึ้น จึงสมควรออกประกาศนี้