

แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 20 ข้อ 35 ข้อ 42 ข้อ 47 ข้อ 48 ข้อ 50 ข้อ 51 ข้อ 52 ข้อ 53 และข้อ 78 ของประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง วิธีปฏิบัติที่เกี่ยวกับการซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2560 ลงวันที่ 28 สิงหาคม 2560 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

1. การจัดเก็บข้อมูล

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

2. ข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขาย

2.1 ข้อมูลที่สมาชิกต้องเปิดเผย

ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้สมาชิกเปิดเผยข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขายดังต่อไปนี้ให้แก่ลูกค้า

- (1) ชื่อหลักทรัพย์ ราคาสูงสุดและต่ำสุดของทุกหลักทรัพย์ในวันทำการซื้อขายนั้น
- (2) ราคาเสนอซื้อขายสูงสุดและต่ำสุดและราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายของทุกหลักทรัพย์ในขณะนั้น
- (3) ราคาซื้อขายสูงสุดและต่ำสุด ราคาเปิดของทุกหลักทรัพย์ในวันทำการซื้อขายนั้น
- (4) ราคาปิดของทุกหลักทรัพย์ในวันทำการซื้อขายก่อนหน้านั้น การเปลี่ยนแปลงของราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายของทุกหลักทรัพย์ในขณะนั้นเปรียบเทียบกับราคาปิดในวันทำการซื้อขายก่อนหน้านั้นของหลักทรัพย์ดังกล่าว
- (5) ปริมาณ มูลค่าและจำนวนรายการซื้อขายของแต่ละหลักทรัพย์ในขณะนั้น
- (6) จำนวนหลักทรัพย์ที่ราคาเสนอซื้อสูงสุดและราคาต่ำสุดต่ำกว่าตามลำดับ และราคาเสนอขายต่ำสุดและราคาที่สูงกว่าตามลำดับของทุกหลักทรัพย์ในขณะนั้น
- (7) ราคาที่ระบบการซื้อขายคำนวณได้ว่าจะเป็นหรือเป็นราคาเปิด และจะเป็นหรือเป็นราคาปิด
- (8) ดัชนีราคาหลักทรัพย์ และการเปลี่ยนแปลงของดัชนีดังกล่าวเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีนั้นในวันทำการซื้อขายก่อนหน้านั้น
- (9) อักษรเครื่องหมายตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ เช่น NP NR H SP XR หรือ XD เป็นต้น
- (10) ข่าวสารที่ตลาดหลักทรัพย์แจ้งให้แก่สมาชิก โดยระบบการซื้อขาย

2.2 ข้อมูลที่สมาชิกอาจเปิดเผย

สมาชิกอาจเปิดเผยข้อมูลที่ได้จากระบบการซื้อขายดังต่อไปนี้ให้แก่ลูกค้าแต่ละราย

- (1) สถานะของคำสั่งซื้อขายของลูกค้าดังกล่าว

(2) ราคาที่ซื้อหรือขายได้ตามคำสั่งซื้อขายของลูกค้านั้น

3. การใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Program Trading)

สมาชิกต้องขออนุญาตใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติจากตลาดหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการดังนี้

(1) การขออนุญาตใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติแบบทั่วไป โดยอาจใช้ได้หลายกลยุทธ์ (Strategy) ภายใต้ระบบบริหารความเสี่ยงในการส่งคำสั่งซื้อขายเดียวกัน ให้สมาชิกยื่นขออนุญาตต่อตลาดหลักทรัพย์เป็นการทั่วไปตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

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

(2) การขออนุญาตใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติแบบรายกลยุทธ์ (Strategy) ให้สมาชิกยื่นขออนุญาตต่อตลาดหลักทรัพย์เป็นรายกลยุทธ์ (Strategy) ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

เมื่อตลาดหลักทรัพย์อนุญาตการใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับการซื้อขายโดยอัตโนมัติตาม (1) หรือ (2) แล้ว หากสมาชิกประสงค์จะเปลี่ยนแปลงในเรื่องดังต่อไปนี้ ให้สมาชิกยื่นขออนุญาตต่อตลาดหลักทรัพย์ตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 7 วันทำการ โดยสมาชิกอาจต้องทดสอบตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดและต้องได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ก่อนการเปลี่ยนแปลงดังกล่าว

(1) เปลี่ยนแปลงระบบบริหารความเสี่ยง

(2) เปลี่ยนแปลงหลักการทำงานหรือฟังก์ชันการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับส่งคำสั่งซื้อขายโดยอัตโนมัติ หรือ

(3) เปลี่ยนแปลงค่าพารามิเตอร์ (Parameters) ที่ทำให้ความเสี่ยงเพิ่มขึ้นหรือกระทบหลักการทำงานหรือฟังก์ชันการทำงานของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์สำหรับส่งคำสั่งซื้อขายโดยอัตโนมัติ

4. เวลาทำการซื้อขาย

ตลาดหลักทรัพย์เปิดให้มีการซื้อขายประจำวันด้วยระบบการซื้อขายตามหลักเกณฑ์ วิธีการและในระหว่างช่วงเวลาดังต่อไปนี้

ช่วงเวลาซื้อขาย	เวลาซื้อขาย	วิธีการซื้อขาย	ประเภทการซื้อขาย
1. ช่วงก่อนเปิดทำการช่วงที่ 1 เพื่อคำนวณหาราคาเปิด (Pre-open Session I)	9.30 น. ถึงเปิดทำการ	<ul style="list-style-type: none">• การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) โดยจับคู่ซื้อขายครั้งเดียวเมื่อเปิดทำการ	การซื้อขายเป็นหน่วยการซื้อขาย (Board Lot)

ช่วงเวลาซื้อขาย	เวลาซื้อขาย	วิธีการซื้อขาย	ประเภทการซื้อขาย
2. ช่วงเวลาทำการช่วงที่ 1 (Trading Session I)	เปิดทำการ ถึง 12.30 น.	<ul style="list-style-type: none"> • การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การซื้อขายเป็นหน่วยการซื้อขาย (Board Lot) ■ การซื้อขายหน่วยย่อย (Odd Lot)
		<ul style="list-style-type: none"> • การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) ■ การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign) ■ การบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบ หลักทรัพย์ที่ผิดนัด (Trade Report – Buy-in) ■ การบันทึกการซื้อขายเพื่อส่งมอบ หลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิดนัด (Trade Report - Member buy – in)
หยุดพักการซื้อขาย			
3. ช่วงก่อนเปิดทำการช่วง ที่ 2 เพื่อคำนวณหาราคา เปิด (Pre-open Session II)	14.00 น. ถึง เปิดทำการ	<ul style="list-style-type: none"> • การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) โดยจับคู่ซื้อขายครั้งเดียวเมื่อเปิดทำการ 	การซื้อขายเป็นหน่วยการซื้อขาย (Board Lot)
4. ช่วงเวลาทำการช่วงที่ 2 (Trading Session II)	เปิดทำการ ถึง 16.30 น.	<ul style="list-style-type: none"> • การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การซื้อขายเป็นหน่วยการซื้อขาย (Board Lot) ■ การซื้อขายหน่วยย่อย (Odd Lot)
		<ul style="list-style-type: none"> • การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) ■ การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign)
5. ช่วงก่อนปิดทำการเพื่อ คำนวณหาราคาปิด (Pre-close)	16.30 น. ถึง ปิดทำการ	<ul style="list-style-type: none"> • การซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) โดยจับคู่ซื้อขายคราวเดียวเมื่อปิดทำการ 	การซื้อขายเป็นหน่วยการซื้อขาย (Board Lot)
		<ul style="list-style-type: none"> • การซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report) 	<ul style="list-style-type: none"> ■ การบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report – Big Lot) ■ การบันทึกการซื้อขายหลักทรัพย์ ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Trade Report – Foreign)

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

5. เวลาเปิดและเวลาปิดทำการซื้อขาย

ระบบการซื้อขายจะสุ่มเลือก (Random) เวลาเปิดและเวลาปิดทำการซื้อขายประจำวัน ดังนี้

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

6. รายการขั้นต่ำในการบันทึกคำสั่งซื้อขายและการบันทึกการซื้อขาย

การบันทึกคำสั่งซื้อขายหรือการบันทึกการซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขายต้องมีรายการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- 6.1 ชื่อหลักทรัพย์
- 6.2 ราคาเสนอซื้อขายหรือราคาซื้อขาย
- 6.3 ปริมาณหลักทรัพย์
- 6.4 ประเภทผู้ซื้อขาย โดยให้จำแนกเป็นประเภทดังต่อไปนี้
 - (1) การลงทุนเพื่อบัญชีสมาชิกหรือบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก (Principal)
 - (2) ลูกค้านั่งเป็นคนต่างด้าว (Foreign)
 - (3) ลูกค้าซึ่งเป็นบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ธนาคาร บริษัทเงินทุน บริษัทประกันวินาศภัย บริษัทประกันชีวิต นิติบุคคลประเภทบรรษัท กองทุนส่วนบุคคล กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ หรือนิติบุคคลอื่นที่มีลักษณะเดียวกัน (Institution)
 - (4) ลูกค้าอื่น (Customer) นอกจาก (1) – (3)
- 6.5 หมายเลขประจำตัวสมาชิก
- 6.6 หมายเลขประจำตัวเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

6.7 เลขที่บัญชีลูกค้า (Client ID)

6.8 ประเภทการเสนอซื้อขาย สำหรับการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM) หรือประเภทการบันทึกการซื้อขาย สำหรับการซื้อขายด้วยวิธีบันทึกการซื้อขาย (Trade Report)

6.9 รายการอื่นตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

7. จำนวนและมูลค่าในการเสนอซื้อขายสำหรับการซื้อขายด้วยวิธีจับคู่อัตโนมัติ (Automated Order Matching: AOM)

การเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ในแต่ละครั้งต้องมีจำนวนไม่เกิน 10 ล้านหน่วยของหลักทรัพย์นั้นและมีมูลค่าไม่เกิน 500 ล้านบาท

8. หน่วยการซื้อขาย (Board Lot)

8.1 ให้หน่วยการซื้อขายของหลักทรัพย์แต่ละประเภทมีจำนวนตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดเท่ากับ 100 หน่วยของหลักทรัพย์นั้น ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์อาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงหน่วยการซื้อขายของหลักทรัพย์ที่มีราคาปิดในแต่ละวันทำการซื้อขายตั้งแต่ 500 บาทขึ้นไป เป็นเวลา 6 เดือนติดต่อกันเป็น 50 หน่วยของหลักทรัพย์นั้น

8.2 ตลาดหลักทรัพย์อาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงหน่วยการซื้อขายจาก 50 หน่วยของหลักทรัพย์ตาม 8.1 กลับไปเป็น 100 หน่วยของหลักทรัพย์นั้น ในกรณีดังต่อไปนี้

(1) ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นในแต่ละวันทำการซื้อขายต่ำกว่า 500 บาท เป็นเวลา 6 เดือนติดต่อกัน หรือ

(2) มีเหตุการณ์อันอาจทำให้ราคาซื้อขายของหลักทรัพย์นั้นต่ำกว่า 500 บาท ในวันแรกที่มีเหตุการณ์ดังกล่าว

8.3 ไม่ให้นำจำนวนหน่วยการซื้อขายตาม 8.1 และ 8.2 มาใช้บังคับกับตราสารแสดงสิทธิการฝากหลักทรัพย์ต่างประเทศตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับ การเปิดเผยสารสนเทศ และการเพิกถอนตราสารแสดงสิทธิการฝากหลักทรัพย์ต่างประเทศ โดยให้หน่วยการซื้อขายของตราสารแสดงสิทธิการฝากหลักทรัพย์ต่างประเทศมีจำนวนเท่ากับ 1 หน่วยของตราสารแสดงสิทธิการฝากหลักทรัพย์ต่างประเทศ

9. ช่วงราคา (Tick Size)

ตลาดหลักทรัพย์กำหนดช่วงราคาในการเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ดังต่อไปนี้

9.1 กรณีทั่วไป

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

9.2 กรณียกเว้น

ตลาดหลักทรัพย์กำหนดช่วงราคาในการเสนอซื้อขายหลักทรัพย์ดังต่อไปนี้ เท่ากับ 0.01 บาท

- (1) หน่วยลงทุนของกองทุนรวม ยกเว้นหน่วยลงทุนของกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน และหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์
- (2) หน่วยของอีทีเอฟต่างประเทศ

10. การประกาศขึ้นเครื่องหมายแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์เป็นราคาที่ไม่รวมสิทธิประโยชน์

ตลาดหลักทรัพย์อาจประกาศขึ้นเครื่องหมายดังต่อไปนี้ไว้ที่หลักทรัพย์เพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์เป็นราคาที่ไม่รวมสิทธิประโยชน์

เครื่องหมาย	ความหมาย
1. XD (Excluding Dividend)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงเงินปันผล
2. XR (Excluding Right)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงสิทธิในการจองซื้อหลักทรัพย์ที่ออกใหม่ตามประเภทหลักทรัพย์เดิมและตามสัดส่วนการถือหลักทรัพย์ของบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์นั้น (Right Offering)
3. XB (Excluding Other Benefits)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงสิทธิในการจองซื้อหลักทรัพย์ที่ออกใหม่นอกจากที่ระบุไว้ใน 2.
4. XW (Excluding Warrant)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงสิทธิในการได้รับใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหลักทรัพย์นั้น
5. XT (Excluding Transferable Subscription Right)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงสิทธิในการได้รับใบแสดงสิทธิในการซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้

เครื่องหมาย	ความหมาย
6. XN (Excluding Capital Return)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงเงินคืนทุน
7. XI (Excluding Interest)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงดอกเบี้ย
8. XP (Excluding Principal)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงเงินต้น
9. XA (Excluding All)	ราคาซื้อขายไม่รวมถึงสิทธิประโยชน์ใด ๆ ตาม 1 ถึง 8 ซึ่งมากกว่าหนึ่งสิทธิประโยชน์

ผลบังคับใช้

ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้แนวทางฉบับนี้มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 11 กันยายน 2560 เป็นต้นไป