

มติการพิจารณาความผิดและลงโทษของคณะกรรมการวินัย พ.ศ. 2545

มติอนุกรรมการวินัย	ลักษณะการกระทำผิด	ข้อกำหนด / ประกาศ ตทท.	ผลการพิจารณา
ครั้งที่ 1 / 2545 วันที่ 8 มกราคม 2545	- เจ้าหน้าที่การตลาดและเจ้าหน้าที่รับอนุญาตบริษัทหลักทรัพย์ เกียรตินาคนิ จำกัด (มหาชน) ส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ TPI ให้ลูกค้า ในปริมาณมากและยกเลิกรายการเป็นส่วนใหญ่โดยมีหลายรายการที่ ยกเลิกคำสั่งซื้อหลักทรัพย์เดิมและส่งเข้ามาใหม่ในจำนวนและราคา เดียวกันกับรายการที่เพิ่งส่งยกเลิกไปในเวลาใกล้เคียงกัน (EF-M 19/44)	- ประกาศ เรื่อง เจ้าหน้าที่รับอนุญาต ลงวันที่ 4 ก.พ. 2543 ข้อ 12 (1) (2) และ (3) - ข้อบังคับ เรื่อง เรื่องการซื้อขาย (ฉบับที่ 2) พ.ศ.2542 ลงวันที่ 31 ส.ค.2542 ข้อ 37 (6) - หนังสือที่ ฝค.(ว) 11/2543 ลงวันที่ 10 ก.ค. 2543	ห้าม Trader ปฏิบัติหน้าที่เป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต 4 เดือน
	- เจ้าหน้าที่การตลาดและเจ้าหน้าที่รับอนุญาตบริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด และ บริษัทหลักทรัพย์ทรีนิตี้ จำกัด ส่ง คำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ SITHAI และ CPH ให้กับลูกค้าในลักษณะ ต่อเนื่อง เพื่อผลักดันราคา กล่าวคือส่งคำสั่งซื้อในปริมาณมากที่สุด Best Offer เพื่อให้มีปริมาณหุ้นเหลือเป็น Best Bid และส่งคำสั่งซื้อเพิ่ม ปริมาณ Bid เพื่อลวงบุคคลทั่วไปว่ามีความต้องการซื้อสูงและเมื่อ บุคคลทั่วไปเสนอซื้อตามจรรยาบรรณราคาเพิ่มขึ้น ลูกค้าก็จะส่งยกเลิก คำสั่งซื้อและทยอยขายหลักทรัพย์ที่ซื้อไว้ ณ ราคาเสนอซื้อที่สูงที่สุด (EF-M 13 - 15 / 2545)	- ประกาศ เรื่อง เจ้าหน้าที่รับอนุญาต ลงวันที่ 4 ก.พ. 2543 ข้อ 12 (1) (2) และ (3) - ข้อบังคับ เรื่อง เรื่องการซื้อขาย (ฉบับที่ 2) พ.ศ.2542 ลงวันที่ 31 ส.ค.2542 ข้อ 37 (6)	ห้าม Trader ปฏิบัติหน้าที่เป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต 3-6 เดือน
ครั้งที่ 2 / 2545 วันที่ 6 มีนาคม 2545	- เจ้าหน้าที่รับอนุญาตบริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ส่งคำสั่ง เสนอขายและเคาะซื้อหลักทรัพย์ให้ลูกค้าในลักษณะจับคู่กันเอง (wash sales) 1 รายการ จำนวน 100 หุ้น ในเวลาใกล้เคียงกัน (EF-M 3 / 2545)	- ประกาศ เรื่อง เจ้าหน้าที่รับอนุญาต ลงวันที่ 4 ก.พ. 2543 ข้อ 12 (1) (2) และ (3) - ข้อบังคับ เรื่อง เรื่องการซื้อขาย (ฉบับที่ 2) พ.ศ.2542 ลงวันที่ 31 ส.ค.2542 ข้อ 37 (6) วรรคสอง (ก) และ (ข)	ห้าม Trader ปฏิบัติหน้าที่เป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต 1 เดือน

มติการพิจารณาความผิดและลงโทษของคณะกรรมการวินัย พ.ศ. 2545

มติอนุกรรมการวินัย	ลักษณะการกระทำผิด	ข้อกำหนด / ประกาศ ตทท.	ผลการพิจารณา
ครั้งที่ 3 / 2545 วันที่ 20 มิถุนายน 2545	- เจ้าหน้าที่การตลาดและเจ้าหน้าที่รับอนุญาตบริษัทหลักทรัพย์ ทรีนิตี้ จำกัด ส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ STA ให้กับลูกค้า 2 ราย โดยมีลักษณะของการผลักดันราคาและพุงราคาไม่ให้ลดต่ำลงเป็นระยะๆ และกระทำต่อเนื่องทุกวันในช่วงผิดปกติ โดยส่งคำสั่งเคาะซื้อในระดับราคา offer ลำดับที่ 2 เพื่อกวาด Best Offer ในลำดับที่ 1 และคงเหลือให้เกิดรายการในลำดับ 2 เพียง 100 - 500 หุ้น ส่งคำสั่งเคาะซื้อที่ Best Offer ณ ขณะนั้น และส่งคำสั่ง Matched Order และ Wash Sales (EF-M 6 / 2545)	ประกาศ เรื่อง เจ้าหน้าที่รับอนุญาต ลงวันที่ 4 ก.พ. 2543 ข้อ 12 (1) (2) และ (3) - ข้อบังคับ เรื่อง เรื่องการซื้อขาย (ฉบับที่ 2) พ.ศ.2542 ลงวันที่ 31 ส.ค.2542 ข้อ 37 (6) วรรคหนึ่ง และ วรรคสอง (ข)	ห้าม Trader ปฏิบัติหน้าที่เป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต 3 เดือน
	- เจ้าหน้าที่การตลาดและเจ้าหน้าที่รับอนุญาตบริษัทหลักทรัพย์ ซิกโก้ จำกัด (มหาชน) ส่งคำสั่งซื้อหลักทรัพย์ LH ในลักษณะผลักดันราคา โดยการเคาะซื้อทุกระดับราคาอย่างต่อเนื่องจำนวน 6 คำสั่งๆ ละ 100-200 หุ้นที่ทำให้ราคาปรับตัวเพิ่มขึ้น 29.23% ใน 1 นาที (EF-M 4 / 45)	- ประกาศ เรื่อง เจ้าหน้าที่รับอนุญาต ลงวันที่ 4 ก.พ. 2543 ข้อ 12 (1) (2) และ (3) - ข้อบังคับ เรื่อง เรื่องการซื้อขาย (ฉบับที่ 2) พ.ศ.2542 ลงวันที่ 31 ส.ค.2542 ข้อ 37 (6)	ปรับเจ้าหน้าที่รับอนุญาต 25,000 บาท

มติการพิจารณาความผิดและลงโทษของคณะกรรมการวินัย พ.ศ. 2545

มติอนุกรรมการวินัย	ลักษณะการกระทำผิด	ข้อกำหนด / ประกาศ ตลท.	ผลการพิจารณา
ครั้งที่ 4 /2545 วันที่ 20 มิถุนายน 2545	- เจ้าหน้าที่การตลาดและเจ้าหน้าที่รับอนุญาตบริษัทหลักทรัพย์ ทรีนิตี้ จำกัด ส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ BAFS ให้กับลูกค้า 3 รายที่เป็นญาติสนิทกันในลักษณะที่ไม่มีเจตนาซื้อขายหลักทรัพย์นั้นจริง โดยลูกค้าแต่ละรายนั้นผลัดกันส่งคำสั่งอย่างต่อเนื่องคราวละ 5 แส่น - 1 ล้านหุ้น เมื่อรายการใกล้จะจับคู่ซื้อขายกับบุคคลอื่นลูกค้าก็จะส่งยกเลิกรายการ และส่งคำสั่งซื้อเข้าไปใหม่ในราคาเดิมในลำดับต่อท้ายคำสั่งซื้อขายของบุคคลอื่น โดยส่งคำสั่ง 1 วัน จำนวน 150 คำสั่ง และ ยกเลิกคำสั่งซื้อคิดเป็นร้อยละ 90.77 ของคำสั่งซื้อ และ ยกเลิกคำสั่งขายคิดเป็นร้อยละ 73 คำสั่งขาย (EF-M 16 / 45)	- ประกาศ เรื่อง เจ้าหน้าที่รับอนุญาต (ฉบับที่ 3) พ.ศ.2545 ลงวันที่ 26 มีนาคม 2545 ข้อ 12 (1) (2) (3) และ (5) - ข้อบังคับ เรื่องการซื้อขาย (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2542 ลงวันที่ 31 ส.ค.2542 ข้อ 37 (6)	ปรับเจ้าหน้าที่รับอนุญาต 50,000 บาท

มติการพิจารณาความผิดและลงโทษของคณะกรรมการวินัย พ.ศ. 2545

มติอนุกรรมการวินัย	ลักษณะการกระทำผิด	ข้อกำหนด / ประกาศ ตลท.	ผลการพิจารณา
ครั้งที่ 5/2545 วันที่ 21 พฤศจิกายน 2545	<p>- เจ้าหน้าที่รับอนุญาตของ บล.กิมเอ็ง(ประเทศไทย)จก. ส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ SUSCO และ TPI ให้กับลูกค้าในลักษณะผลักดันราคาและอำพรางบุคคลทั่วไปให้หลงผิดว่ามีปริมาณความต้องการซื้อขายมากในหลักทรัพย์นั้น ส่งผลให้ราคาของหลักทรัพย์นั้นเปลี่ยนแปลงไปไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด โดย ส่งคำสั่งเสนอซื้อในปริมาณที่มากและราคาที่สูงกว่าราคาที่เสนอขาย ณ ขณะนั้น (Best Bid) เพื่อลวงให้บุคคลอื่นเห็นว่าในขณะนั้นมีปริมาณความต้องการซื้อมาก ประกอบกับเคาะซื้อตามราคาที่มีผู้เสนอขายในราคาที่ดีที่สุด ณ ขณะนั้น (Best Offer) แต่ในปริมาณที่มากกว่าเพื่อให้ราคาเสนอขายปรับตัวสูงขึ้นและให้มีหุ้นคงเหลือค้างเป็น Best Bid เมื่อราคาของหลักทรัพย์ปรับตัวลดลงก็จะเข้าซื้อในลักษณะของการผลักดันราคา โดยจะเคาะซื้อในปริมาณที่มากและราคาดีกว่า Best Offer อีกทั้งยังได้มีการเสนอขายรอไว้ในราคาที่สูงกว่า Best Offer ถึง 12 ช่วงราคาและเข้าซื้อเป็นระยะเพื่อผลักดันหรือไล่ราคาให้สูงขึ้นจนได้ โดยในช่วงที่ผิดปกตินี้ เจ้าหน้าที่รับอนุญาตส่งคำสั่งให้กับลูกค้าในหลักทรัพย์ดังกล่าวถึงร้อยละ 92 ของจำนวนคำสั่งที่ส่งให้กับลูกค้าทั้งหมด โดยมีปริมาณหุ้นที่ซื้อขายถึง 12 ล้านหุ้น ราคาหลักทรัพย์ปรับตัวเพิ่มขึ้น 13-20% (EF-M 37/45)</p>	<p>- ประกาศ เรื่อง เจ้าหน้าที่รับอนุญาต (ฉบับที่ 3) พ.ศ.2545 ลงวันที่ 26 มีนาคม 2545 ข้อ 12 (1) (2) (3) และ (5)</p> <p>- ข้อบังคับ เรื่องการซื้อขาย (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2542 ลงวันที่ 31 ส.ค.2542 ข้อ 37 (6)</p>	ห้าม Trader ปฏิบัติหน้าที่ใดๆ ในบริษัทหลักทรัพย์เป็นเวลา 3 เดือน