



ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

The Stock Exchange of Thailand

ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

เรื่อง การซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ด้วยระบบการซื้อขาย (ฉบับที่ 3) พ.ศ. 2552

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 4 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2542 ลงวันที่ 31 สิงหาคม 2542 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

- | | | |
|-------|---|---|
| ข้อ 1 | ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 30 มีนาคม 2552 เป็นต้นไป | ผลบังคับใช้ |
| ข้อ 2 | ให้ยกเลิกประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ด้วยระบบการซื้อขาย (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2550 ลงวันที่ 26 มิถุนายน 2550 | บทยกเลิก |
| ข้อ 3 | ให้สมาชิกปฏิบัติงานในส่วนที่เกี่ยวข้องกับระบบคัดกรองคำสั่งซื้อขาย (Order Screening System) ของมาตรฐานคอมพิวเตอร์สำหรับระบบคอมพิวเตอร์ของสมาชิก (Broker Front Office) ที่ต่อเชื่อมกับระบบการซื้อขาย ตามเอกสารที่แนบท้ายประกาศนี้ | ระบบคัดกรองคำสั่งซื้อขาย (Order Screening System) |

ประกาศ ณ วันที่ 23 มีนาคม 2552

(นางภัทริยา เบญจพลชัย)

กรรมการและผู้จัดการ

เหตุผลในการประกาศใช้: โดยที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ เห็นควรปรับปรุงระบบคัดกรองคำสั่งซื้อขายเพื่ออำนวยความสะดวกในการซื้อขายของผู้ลงทุน จึงสมควรออกประกาศนี้

มาตรฐานคอมพิวเตอร์สำหรับระบบคอมพิวเตอร์ของสมาชิก (Broker Front Office) ที่ต่อเชื่อมกับระบบการซื้อขาย¹

II. ระบบคัดกรองคำสั่งซื้อขาย (Order Screening System)

ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้ระบบคอมพิวเตอร์ของสมาชิกที่ต่อเชื่อมกับระบบการซื้อขายต้องมีระบบคัดกรองคำสั่งซื้อขาย โดยระบบดังกล่าวทำหน้าที่คัดกรองคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสมบางประเภทที่สามารถกำหนดรูปแบบในเบื้องต้น อย่างไรก็ตามสำหรับการส่งคำสั่งในลักษณะหลบเลี่ยงการตรวจสอบของระบบคัดกรองคำสั่งซื้อขาย และลักษณะคำสั่งไม่เหมาะสมบางประเภทที่ไม่สามารถจัดทำระบบคัดกรองนั้น ตลาดหลักทรัพย์จะติดตามการซื้อขายของลูกค้า โดยพิจารณาจากพฤติกรรมการซื้อขาย เจตนา และสภาพตลาดในขณะนั้นตามขั้นตอนการดำเนินงานปกติ

สำหรับลักษณะคำสั่งซื้อขายไม่เหมาะสมที่จะจัดทำระบบคัดกรองมีดังนี้

1. คำสั่งในลักษณะลัดคิวและปิดบังคำสั่งของผู้อื่น
2. คำสั่งในลักษณะฉ้อราคา

① คำสั่งในลักษณะปิดบังและลัดคิวคำสั่งของผู้อื่น

หมายถึง การส่งคำสั่งซื้อหรือขายในราคาที่สูงหรือต่ำกว่าราคาที่ควรจะเป็นมาก ซึ่งโดยปกติไม่น่าจะเกิดการจับคู่ซื้อขาย หรือผู้ส่งคำสั่งไม่ได้ประสงค์จะทำให้เกิดการซื้อขายตามราคาดังกล่าว ไม่ว่าจะมีการยกเลิกคำสั่งดังกล่าวในภายหลังหรือไม่ก็ตาม เพื่อให้คำสั่งตนเองลัดคิว และปิดบังคำสั่งของผู้อื่น ดังนี้

	ประเภทของหลักทรัพย์	ช่วงเวลาตรวจสอบ	เกณฑ์การตรวจสอบ
1	หลักทรัพย์ที่ซื้อขายบนกระดานหลัก กรณีซื้อขายวันแรก (IPO) หรือกรณีอื่นที่ไม่มี Ceiling และ Floor ²	ช่วงก่อนเปิดตลาด (Pre-open) และก่อนปิดตลาด (Pre-close)	ระบบการซื้อขายจะไม่รับคำสั่งซื้อขาย ที่ส่งมาในราคาที่สูงกว่า + 50% หรือต่ำกว่า -50% ของราคาต่อไปนี้ 1. ราคาที่คาดว่าจะเปิด (Projected Open Price) หรือราคาที่คาดว่าจะปิด (Projected Close Price) 2. หากในช่วงเวลานั้น ราคาที่คาดว่าจะเปิด (Projected Open Price) หรือราคาที่คาดว่าจะปิด (Projected Close Price) ให้ใช้ราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (Last Sale) 3. หากไม่มีราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (Last Sale) : ■ ให้ใช้ราคาเสนอขายครั้งแรกต่อประชาชน (IPO Price) สำหรับกรณีหลักทรัพย์ที่เปิดให้ซื้อขายวันแรก ■ ระบบจะไม่ตรวจสอบสำหรับกรณีอื่นๆ ที่ไม่มี Ceiling และ Floor ²
2	หลักทรัพย์ที่ซื้อขายบนกระดานต่างประเทศ และมีลักษณะดังต่อไปนี้ - เป็นการซื้อขายวันแรก (IPO) ของหลักทรัพย์ดังกล่าวบนกระดานหลัก	ช่วงก่อนเปิดตลาด (Pre-open) และก่อนปิดตลาด (Pre-close)	ระบบการซื้อขายจะไม่รับคำสั่งซื้อขาย ที่ส่งมาในราคาที่สูงกว่า + 50% หรือต่ำกว่า -50% ของราคาต่อไปนี้ 1. ราคาที่คาดว่าจะเปิด (Projected Open Price) หรือราคาที่คาดว่าจะปิด (Projected Close Price) 2. หากในช่วงเวลานั้น ราคาที่คาดว่าจะเปิด (Projected Open Price) หรือราคาที่คาดว่าจะปิด (Projected Close Price) ให้ใช้ราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (Last Sale)

¹ กำหนดตามข้อ 6 ของ ประกาศฯ เรื่องการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ด้วยระบบการซื้อขาย พ.ศ. 2548

² เช่น หลักทรัพย์ที่เปิดซื้อขายวันแรกหลัง SP เกิน 1 ปี หรือ หลักทรัพย์ที่มีการลดทุนโดยลดจำนวนหุ้น เป็นต้น

ประเภทของหลักทรัพย์	ช่วงเวลาตรวจสอบ	เกณฑ์การตรวจสอบ
- กรณีอื่นที่ทำให้ หลักทรัพย์ดังกล่าวบน กระดานหลักไม่มี Ceiling และ Floor ²		3. หากในช่วงเวลานั้น ไม่มีราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (Last Sale) ให้ใช้ราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายของหลักทรัพย์ บนกระดานหลัก 4. หากไม่มีราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายของหลักทรัพย์บน กระดานหลัก: <ul style="list-style-type: none"> ▪ ให้ใช้ราคาเสนอขายครั้งแรกต่อประชาชน (IPO Price) สำหรับกรณีหลักทรัพย์ที่เปิดให้ซื้อขายวันแรก ▪ ระบบจะไม่ตรวจสอบสำหรับกรณีอื่นๆ ที่ไม่มี Ceiling และ Floor²

หมายเหตุ : ราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (Last Sale) หมายถึง ราคาจับคู่ครั้งสุดท้ายของวันที่มีการส่งคำสั่ง ไม่รวมถึงราคาปิดในวันทำการก่อนหน้า (Previous Close)

② คำสั่งในลักษณะขึ้นราคา

หมายถึง การส่งคำสั่งซื้อหรือขายในราคาที่สูงกว่าหรือต่ำกว่าราคาที่จะเป็นมาก เพื่อควบคุมราคาหลักทรัพย์ โดยให้สมาชิกจัดทำระบบตรวจสอบ ดังนี้

ประเภทของหลักทรัพย์	ช่วงเวลาตรวจสอบ	เกณฑ์การตรวจสอบ
1 หลักทรัพย์ที่ซื้อขายบน กระดานหลัก เฉพาะกรณีซื้อ ขายวันแรก (IPO) หรือกรณี อื่นที่ไม่มี Ceiling และ Floor ²	ช่วงเปิดตลาด (Open)	ให้สมาชิกจัดทำข้อความเตือน (Warning Message) สำหรับ คำสั่งซื้อของนักลงทุนที่ส่งในราคาสูงกว่า +30% หรือ ต่ำกว่า -30% ของราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (Last Sale)
2 หลักทรัพย์ที่ซื้อขายบน กระดานต่างประเทศและมี ลักษณะดังต่อไปนี้ - เป็นการซื้อขายวันแรก (IPO) ของหลักทรัพย์ ดังกล่าวบนกระดานหลัก - กรณีอื่นที่ทำให้ หลักทรัพย์ดังกล่าวบน กระดานหลัก ไม่มี Ceiling และ Floor ²	ช่วงเปิดตลาด (Open)	ให้สมาชิกจัดทำข้อความเตือน (Warning Message) สำหรับ คำสั่งซื้อของนักลงทุนที่ส่งในราคาสูงกว่า +30% หรือ ต่ำกว่า -30% ของราคาต่อไปนี้ <ol style="list-style-type: none"> 1. ราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (Last Sale) 2. หากในช่วงเวลานั้น ไม่มีราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (Last Sale) ให้ใช้ราคาซื้อขายครั้งสุดท้ายของหลักทรัพย์ บนกระดานหลัก

ฝ่ายปฏิบัติการซื้อขาย

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย