

# ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

## The Stock Exchange of Thailand

ที่ ปก. (จ) 4 / 2552

23 มีนาคม 2552

เรื่อง การปรับปรุงข้อกำหนดเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์

เรียน กรรมการผู้จัดการ

บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่มีไซสมาชิก

- สิ่งที่ส่งมาด้วย
1. สรุปสาระสำคัญของ การเปลี่ยนแปลงเกณฑ์ซื้อขายหลักทรัพย์ที่มีผลตั้งแต่วันที่ 30 มีนาคม 2552 เป็นต้นไป
  2. สำเนาข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านอินเทอร์เน็ต (ฉบับที่ 3) พ.ศ. 2552
  3. สำเนาประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ด้วยระบบการซื้อขาย (ฉบับที่ 3) พ.ศ. 2552
  4. สำเนาประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรฐานเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านอินเทอร์เน็ต (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2552
  5. สำเนาประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรฐานเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ DMA (ฉบับที่ 3) พ.ศ. 2552
  6. ตารางสรุปหลักเกณฑ์การคัดกรองคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์

ด้วยตลาดหลักทรัพย์ได้ปรับปรุงหลักเกณฑ์การซื้อขายหลักทรัพย์ เพื่ออำนวยความสะดวกในการซื้อขายของนักลงทุนที่ซื้อขายหลักทรัพย์บนกระดานต่างประเทศ และนักลงทุนที่ซื้อขายผ่านระบบอินเทอร์เน็ต ซึ่งหลักเกณฑ์ดังกล่าวได้ผ่านการรับฟังความคิดเห็นจากที่ประชุมสมาชิกแล้ว

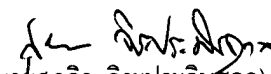
สาระสำคัญของการปรับปรุงข้อกำหนดตลาดหลักทรัพย์ สรุปได้ดังนี้

1. การยกเลิกเกณฑ์คัดกรองคำสั่งซื้อขาย (Order Screening) บนกระดานต่างประเทศสำหรับการซื้อขายทั่วไป เพื่อให้ไม่เกิดความซ้ำซ้อนของการคัดกรองคำสั่งซื้อขาย เนื่องจากได้มีการกำหนดกรอบราคา (Ceiling and Floor) ที่  $\pm 60\%$  ของราคาปิดวันก่อนหน้าของหลักทรัพย์บนกระดานหลักแล้ว ทั้งนี้ให้คงไว้เฉพาะเกณฑ์คัดกรองคำสั่งสำหรับหลักทรัพย์ที่เข้าซื้อขายในวันแรก (New Listing) หรือหลักทรัพย์ที่ไม่มี Ceiling & Floor บนกระดานหลัก
2. การปรับปรุงหลักเกณฑ์การซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต
  - (1) ให้สมาชิกสามารถเพิ่มประเภทคำสั่งแบบมีเงื่อนไขราคา (IOC และ FOK), คำสั่งประเภท Market Price (MP) และ Published Volume ทั้งนี้การอนุญาตให้ลูกค้าส่งคำสั่งประเภทต่างๆ ให้สมาชิกพิจารณาถึงความรู้ความเข้าใจของลูกค้า และความเสี่ยงในการส่งคำสั่งแต่ละประเภทด้วย
  - (2) อนุญาตให้ส่งคำสั่งซื้อขายประเภท Basket Order แบบมีเงื่อนไขราคา (IOC และ FOK) และ Published Volume (ยังคงไม่อนุญาตให้ส่งคำสั่งประเภท MP)
  - (3) เพิ่มเต็มระบบคัดกรองคำสั่งซื้อขาย (Order Screening System) เพื่อตรวจสอบการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ในราคาและปริมาณที่อาจจับคู่ซื้อขายระหว่างกันเองของลูกค้ารายเดียวกัน (Wash Sale) ของคำสั่งประเภท Market Price (MP)

การเปลี่ยนแปลงหลักเกณฑ์ที่กล่าวข้างต้น มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 30 มีนาคม 2552 รายละเอียดของหลักเกณฑ์ปรากฏตามเอกสารที่ส่งมาด้วย

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ

  
(นายสุภกิจ จิระประดิษฐ์กุล)  
ผู้ช่วยผู้จัดการ  
ลงนามแทน  
กรรมการและผู้จัดการ

ฝ่ายปฏิบัติการซื้อขาย

โทร 0-2229-2582-6

อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เลขที่ 62 ถนนรัชดาภิเษก คลองเตย กรุงเทพฯ 10110 โทรศัพท์ 0-2229-2000, 0-2654-5656 โทรสาร 0-2654-5649  
THE STOCK EXCHANGE OF THAILAND BUILDING, 62 RATCHADAPHISEK ROAD, KLONGTOEY, BANGKOK 10110 THAILAND TEL. (66) 2229-2000, 2654-5656 FAX : (66) 2654-5649

E-mail: webmaster@set.or.th http://www.set.or.th