

ที่ กส.(ว) 010/2566

21 พฤศจิกายน 2566

เรื่อง กำหนดระยะเวลาให้นำส่งเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับการขายชอร์ต

เรียน กรรมการผู้จัดการ

บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่ใช่สมาชิกทุกบริษัท

อ้างถึง 1. ข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การขายชอร์ตในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2544
2. หนังสือที่ กส.(ว) 009/2566 เรื่อง ขอให้กำกับดูแลการซื้อขายของลูกค้ายุโรปให้เป็นไปตามข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การขายชอร์ต ลงวันที่ 20 พฤศจิกายน 2566

ตามที่ข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“ตลาดหลักทรัพย์ฯ”) ว่าด้วยการขายชอร์ตในตลาดหลักทรัพย์ ได้กำหนดให้บริษัทหลักทรัพย์สามารถขายชอร์ตหลักทรัพย์ได้ในกรณีที่ได้มีการยืมหลักทรัพย์มาเพื่อการส่งมอบ และต่อมาตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มีหนังสือขอให้บริษัทหลักทรัพย์กำกับดูแลและตรวจสอบเพื่อให้มั่นใจได้ว่า ลูกค้ายของบริษัทท่านทุกรายปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ อย่างเคร่งครัด ดังความละเอียดตามหนังสือที่อ้างถึง นั้น

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ขอแจ้งให้ทราบว่า เพื่อให้การกำกับและตรวจสอบธุรกรรมการขายชอร์ตของตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ และเพื่อไม่ให้เกิดการขายชอร์ตถูกนำไปใช้ในทางที่ไม่เหมาะสม หากบริษัทหลักทรัพย์รายใดได้รับแจ้งให้นำส่งเอกสารหลักฐานที่แสดงได้ว่า ลูกค้ายของบริษัทซึ่งรวมถึงลูกค้าประเภท Omnibus Account มีหรือได้ยืมหลักทรัพย์ไว้แล้วก่อนการส่งคำสั่งขาย บริษัทรายนั้นมีหน้าที่ที่จะต้องนำส่งเอกสารมายังตลาดหลักทรัพย์ฯ ภายใน 15 วันนับแต่วันที่ได้รับแจ้งจากตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อพิสูจน์ว่าธุรกรรมการขายหลักทรัพย์ดังกล่าวไม่ใช่การขายหลักทรัพย์โดยไม่มีหลักทรัพย์ในครอบครอง (Naked Short Selling) หากไม่สามารถจัดส่งเอกสารภายในระยะเวลาดังกล่าวได้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะสันนิษฐานว่า บริษัทสมาชิกรายนั้นมีการกระทำที่เข้าข่ายเป็นการฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่อ้างถึงข้างต้น และจะดำเนินการทางวินัยกับบริษัทสมาชิกรายนั้นต่อไป

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ



(นายภากร ปีตธวัชชัย)
กรรมการและผู้จัดการ

ฝ่ายกำกับบริษัทสมาชิก

โทร 02-009-9315-21