

9 สิงหาคม 2567

เรื่อง การปรับปรุงเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเพื่อยกระดับการกำกับดูแล (เพิ่มเติม)

เรียน กรรมการผู้จัดการ

บริษัทสมาชิก และบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกทุกบริษัท

สิ่งที่ส่งมาด้วย 1. สรุปสาระสำคัญของการปรับปรุงเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

2. สำเนาเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยฉบับปรับปรุง (รวม 6 ฉบับ)

อ้างถึง หนังสือที่ กส.(ว) 005/2565 เรื่อง การปรับปรุงหลักเกณฑ์เกี่ยวกับสมาชิก ลงวันที่ 27 กันยายน 2565

ด้วยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“ตลาดหลักทรัพย์ฯ”) ได้ปรับปรุงเกณฑ์เพิ่มเติมเกี่ยวกับมาตรการยกระดับการกำกับดูแลและเพิ่มความเชื่อมั่นของผู้ลงทุน ซึ่งจะมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 2 กันยายน 2567 เป็นต้นไป โดยสรุปหลักการของเกณฑ์ที่ปรับปรุงได้ดังนี้

1. การกำหนดให้ผู้ลงทุนทุกประเภท หากจะซื้อขายหลักทรัพย์ที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนดให้ใช้มาตรการกำกับการซื้อขายหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายผิดไปจากสภาพปกติของตลาด ตั้งแต่มาตรการระดับ 2 ขึ้นไป ต้องซื้อขายด้วยวิธีจับคู่ซื้อขายในคราวเดียว (Auction) ซึ่งเป็นมาตรการเพิ่มเติมจากมาตรการที่มีอยู่แล้วในปัจจุบัน เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพของการกำกับดูแลการซื้อขายหลักทรัพย์ที่มีสภาพการซื้อขายที่ผิดไปจากปกติ

2. การกำหนดกรอบราคาซื้อขายแบบ Dynamic Price Band (DPB) เป็นรายหลักทรัพย์ ที่ไม่เกิน $\pm 10\%$ จากราคาซื้อขายล่าสุดของหลักทรัพย์นั้น เพิ่มเติมจากการกำหนดราคาเสนอซื้อสูงสุดและต่ำสุดประจำวัน (Ceiling and Floor) เพื่อลดความผันผวนระหว่างวันของราคาซื้อขายหลักทรัพย์

3. การกำหนดให้คำสั่งซื้อขายต้องคงอยู่ในระบบซื้อขาย (Minimum Resting Time) เป็นเวลาอย่างน้อย 250 มิลลิวินาที จึงจะสามารถแก้ไขหรือยกเลิกคำสั่งดังกล่าวได้ เพื่อเป็นการป้องกันไม่ให้เกิดคำสั่งซื้อขายในลักษณะใส่-ถอนที่มีความถี่จนอาจทำให้หรือทำให้ผู้ลงทุนทั่วไปเข้าใจผิดว่ามีความต้องการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ปริมาณมาก ยกเว้นกรณีการส่งคำสั่งซื้อขายของผู้ดูแลสภาพคล่อง (“Market Maker”) ที่ขึ้นทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์ฯ และบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX) ซึ่งทำหน้าที่ดูแลสภาพคล่องของสินค้าที่ตนขึ้นทะเบียนเป็น Market Maker

นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ขอแจ้งว่ามีผลบังคับใช้ของข้อยกเว้นการใช้เกณฑ์ราคาสำหรับการขายชอร์ตให้กับ Market Maker ที่ขึ้นทะเบียนการทำหน้าที่ดูแลสภาพคล่องของตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ (DR) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ (ETF) และหน่วยของอีทีเอฟต่างประเทศ (Foreign ETF) ตามเอกสารที่อ้างถึง ซึ่งจะให้มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 2 กันยายน 2567 เป็นต้นไป ด้วยเช่นกัน

ทั้งนี้ สรุปสาระสำคัญของการปรับปรุงเกณฑ์ พร้อมทั้งเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่ปรับปรุงในครั้งนี้ มีรายละเอียดปรากฏตามสิ่งที่ส่งมาด้วย

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ

(ลงนาม) ภากร ปิตรวัชชัย

(นายภากร ปิตรวัชชัย)

กรรมการและผู้จัดการ

ฝ่ายปฏิบัติการซื้อขายหลักทรัพย์
โทร 0-2009-9322-8

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย The Stock Exchange of Thailand

93 ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพฯ 10400 โทร: +662 009 9000 โทรสาร: +662 009 9991 Contact Center: +662 009 9999
93 Ratchadaphisek Road, Dindaeng, Bangkok 10400 Tel: +662 009 9000 Fax: +662 009 9991 Contact Center: +662 009 9999

