

FAQ เกี่ยวกับเกณฑ์การปรับปรุงเกณฑ์ขายชอร์ตของตลาดหลักทรัพย์ (20 มีนาคม 2563)

เกณฑ์มีการปรับเปลี่ยนอย่างไร และมีผลเมื่อไร

ตลาดหลักทรัพย์มีการปรับเกณฑ์การขายชอร์ต เฉพาะในเรื่องราคาขายชอร์ต จากเดิมที่กำหนดให้ราคาขายชอร์ต ต่อกต้องเป็นราคาที่ไม่ต่ำกว่าราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (zero plus tick) มาเป็น ราคาที่สูงกว่าราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (plus tick) โดยการปรับเปลี่ยนดังกล่าวจะมีผลตั้งแต่การซื้อขายในช่วงบ่ายของวันที่ 13 มีนาคม – 30 มิถุนายน 2563

ตลาดหลักทรัพย์จะกำกับดูแลและการตรวจสอบการขายชอร์ตให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ใหม่อย่างไร

ตามหลักเกณฑ์เดิม ระบบงานตลาดหลักทรัพย์มีการตรวจสอบราคาขายชอร์ตโดยอัตโนมัติ แต่เนื่องจากในการปรับเกณฑ์ใหม่นี้ เป็นมาตรการชั่วคราว ตลาดหลักทรัพย์จึงใช้วิธีการตรวจสอบแบบ post audit เพื่อให้มั่นใจว่าผู้ซื้อขายทุกราย ดำเนินการตามเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์อย่างเคร่งครัด โดยจะมีการตรวจสอบและพิจารณาขอเอกสารหลักฐานเพิ่มเติมตามความจำเป็น

สมาชิกต้องดำเนินการอย่างไรเพื่อรองรับเกณฑ์ใหม่

ตลาดหลักทรัพย์ขอความร่วมมือให้สมาชิกชี้แจงเกณฑ์ใหม่ดังกล่าวกับลูกค้าทุกราย และดำเนินมาตรการเพื่อให้มั่นใจว่าการปฏิบัติเป็นไปตามเกณฑ์ และด้วยเกณฑ์ใหม่จะใช้เป็นการชั่วคราว สมาชิกจึงไม่มีความจำเป็นต้องปรับปรุงระบบ แต่หากสมาชิกรายได้ประสงค์จะปรับปรุงระบบงานให้รองรับราคาขายชอร์ตตามเกณฑ์ใหม่ ๆ ขอให้สมาชิกแจ้งแผนและระยะเวลาดำเนินการต่อตลาดหลักทรัพย์เพื่อทราบด้วย

เนื่องจากเกณฑ์ใหม่มีผลบังคับใช้โดยทันที สมาชิกที่ใช้โปรแกรมซื้อขายโดยอัตโนมัติอาจยังไม่สามารถดำเนินการให้เป็นไปตามเกณฑ์ใหม่ได้ทันที ขอให้สมาชิกดำเนินการแจ้งต่อตลาดหลักทรัพย์โดยทันที เพื่อขอผ่อนผันให้สมาชิกสามารถใช้โปรแกรมซื้อขายอัตโนมัติที่เคยได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ฯ ในส่วนที่ไม่เกี่ยวกับการขายชอร์ต โดยสมาชิกจะต้องควบคุมดูแลมิให้มีการใช้ฟังก์ชันขายชอร์ตที่ระบุราคาแบบ Zero plus tick (ตามเกณฑ์เดิม)

ผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market maker) สามารถปฏิบัติหน้าที่ได้หรือไม่

ผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market maker) ทุกประเภท ทั้งผู้ดูแลสภาพคล่องของ Depository Receipt (DR) Derivatives Warrant (DW) Exchange Traded Fund (ETF) และ Single Stock Futures ยังคงสามารถดำเนินธุรกรรมได้ตามปกติ โดยไม่นำเกณฑ์เรื่องราคาขายชอร์ตที่ปรับปรุงใหม่มาใช้