

**แนวทางการปฏิบัติงานด้านการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นการซื้อขายรายใหญ่
(Block Trading Transaction)**

เพื่อให้การซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trading Transaction) ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าด้วยระบบการซื้อขายเป็นไปอย่างราบรื่น และเพื่อป้องกันความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดให้สมาชิกปฏิบัติตามแนวทางดังนี้

การบันทึกการซื้อขาย Block Trading Transaction

1. ให้การบันทึกการซื้อขาย Block Trading Transaction ในแต่ละครั้งมีจำนวนการซื้อขายขั้นต่ำดังต่อไปนี้

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	จำนวนการซื้อขายขั้นต่ำ
SET50 Index Futures	100 สัญญา
Sector Futures	25 สัญญา
SET50 Index Options	500 สัญญา
Single Stock Futures (SSF)	25 สัญญา
- SSF ที่มีหุ้นสามัญเป็นสินค้าอ้างอิง ได้แก่ ADVANC, AOT, BANPU, BBL, BGH, BH, BLA, DTAC, INTUCH, KBANK, KK, PTT, PTTEP, PTTGC, RATCH, ROBINS, SCB, SCC, TOP และ TUF	
- SSF ทุกหุ้นสามัญที่เป็นสินค้าอ้างอิงอื่นๆ	100 สัญญา
50 Baht Gold Futures 10 Baht Gold Futures Silver Futures Brent Crude Oil Futures 5 Year Government Bond Futures 3M BIBOR Futures และ 6M THBFIX Futures	25 สัญญา
Baht/USD Futures	100 สัญญา

2. ให้การบันทึกการซื้อขาย Block Trading Transaction กระทำได้ในช่วงเวลาซื้อขาย Morning Session และ Afternoon Session ตามที่กำหนดไว้ในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแต่ละแบบ

3. การซื้อขาย Block Trading Transaction ให้สมาชิกจัดให้มีการตรวจสอบความถูกต้องของการบันทึกการซื้อขายให้มีรายการตามหลักเกณฑ์ 405.02-1 ทั้งนี้ สำหรับรายการตามหลักเกณฑ์ 405.02-1 (9) “หมายเลขเจ้าหน้าที่รับอนุญาต” ให้บันทึกตามแนวทางการปฏิบัติงานด้านการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

การรายงานข้อมูลการซื้อขาย Block Trading Transaction

1. ให้สมาชิกรายงานข้อมูลการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trading Transaction) ในกรณีที่สมาชิกหรือลูกค้ามีการซื้อขายรายใหญ่ ในลักษณะดังต่อไปนี้
 - 1.1 การซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์ส ซึ่งมีราคาซื้อขายเปลี่ยนแปลงตั้งแต่ร้อยละ ± 10 ของราคาเพื่อใช้ในการชำระหนี้ประจำวันล่าสุด (Latest Settlement Price)
 - 1.2 การซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่น ซึ่งมีราคาซื้อขายเปลี่ยนแปลงตั้งแต่ร้อยละ ± 10 ของราคาปิดของสินค้าอ้างอิงในวันทำการก่อนหน้า
 - 1.3 การซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ย และการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน ซึ่งมีราคาซื้อขายเปลี่ยนแปลงตั้งแต่ร้อยละ ± 1 ของราคาเพื่อใช้ในการชำระหนี้ประจำวันล่าสุด (Latest Settlement Price)
2. ให้สมาชิกรายงานข้อมูลการซื้อขาย Block Trading Transaction ดังกล่าว ภายในระยะเวลาและตามแบบรายงานข้อมูลการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trading Transaction) ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

ผลบังคับใช้

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะใช้แนวทางฉบับนี้แทนแนวทางการปฏิบัติงานด้านการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trading Transaction) ฉบับวันที่ 14 กันยายน 2555 โดยให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 2 กันยายน 2556 เป็นต้นไป
