

**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  $\pm 10$  ของราคาเพื่อใช้ในการชำระหนี้ประจำวันล่าสุด (Latest Settlement Price)
  - 1.2 การซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่น ซึ่งมีราคาซื้อขายเปลี่ยนแปลงตั้งแต่ร้อยละ  $\pm 10$  ของราคาปิดของสินค้าอ้างอิงในวันทำการก่อนหน้า
  - 1.3 การซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ย และการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน ซึ่งมีราคาซื้อขายเปลี่ยนแปลงตั้งแต่ร้อยละ  $\pm 1$  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

-----