

สรุปสาระสำคัญของการปรับปรุงหลักเกณฑ์ของ บมจ. ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย)

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้ปรับปรุงหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการซื้อขาย Block Trading Transaction ซึ่งจะมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 2 กันยายน 2556 เป็นต้นไป สรุปได้ดังนี้

1. การปรับปรุงจำนวนการซื้อขายขั้นต่ำและอนุญาตให้ทำ Block Trading Transaction เพิ่มเติม

ปรับปรุงจำนวนการซื้อขายขั้นต่ำและอนุญาตให้ทำ Block Trading Transaction เพิ่มเติมในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ดังนี้

	จำนวนการซื้อขายขั้นต่ำของ Block Trade Transaction		
	ปัจจุบัน	ปรับปรุงเป็น	
Single Stock Futures (SSF)	100 สัญญา	SSF ที่มีหุ้นอ้างอิง ได้แก่ ADVANC, AOT, BANPU, BBL, BGH, BH, BLA, DTAC, INTUCH, KBANK, KK, PTT, PTTEP, PTTGC, RATCH, ROBINS, SCB, SCC, TOP และ TUF	25 สัญญา
		SSF ทุกหุ้นอ้างอิงอื่นๆ	100 สัญญา
50 Baht Gold Futures & 10 Baht Gold Futures	100 สัญญา	25 สัญญา	
Sector Futures Silver Futures Brent Crude Oil Futures	ไม่อนุญาตให้ทำ Block Trade	25 สัญญา	

2. การรายงานข้อมูล Block Trading Transaction

เพื่ออำนวยความสะดวกในการรายงานข้อมูล Block Trading Transaction ที่มีราคาซื้อขายเปลี่ยนแปลงถึงระดับที่กำหนด ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้มีการปรับปรุงการรายงานข้อมูลดังกล่าว ดังนี้

การรายงานข้อมูล Block Trading Transaction	ปัจจุบัน	ปรับปรุงเป็น
แบบรายงานข้อมูล	1 แบบรายงาน ต่อ 1 รายการ	1 แบบรายงาน ต่อ หลายรายการ
เวลาการนำส่งแบบรายงานข้อมูล	ไม่เกิน 17.30 น. ของวันทำการซื้อขาย	ไม่เกิน 12.00 น. ของวันทำการถัดไป

สรุปแนวทางปฏิบัติด้านการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

	Equity			
	SET50 Index Futures	Sector Futures	SET50 Index Options	Single Stock Futures
Electronic Trading Transaction				
จำนวนเสนอซื้อขายสูงสุด	100 สัญญา		500 สัญญา	
จำนวนเสนอซื้อขายขั้นต่ำสำหรับรายการ Hidden Order	10 สัญญา			
ประเภทและเงื่อนไขคำสั่งที่ไม่อนุญาตให้เสนอซื้อขาย*	<ul style="list-style-type: none"> • ช่วง Pre-open: Combination Order และ คำสั่งที่มีเงื่อนไข Fill or Kill • ช่วง Morning / Afternoon / Night Session: <ol style="list-style-type: none"> 1. Combination Order ที่มีเงื่อนไข Good till Date/Good till Expiration 2. Market Order ที่มีเงื่อนไข Day/Good till Date/Good till Expiration 			
Daily Price Limit สำหรับ Combination Order (เทียบจากส่วนต่างของราคาที่ใช้ชำระราคาล่าสุดของ Series ที่ประกอบเป็น Combination)	± 10 จุด	ENERG } ± 400 จุด COMM } FOOD } ± 200 จุด BANK } ± 10 จุด ICT }		± 10 บาท
ระดับราคาเสนอซื้อขายที่จะมีการแจ้งเตือนการบันทึกรายการเข้าระบบซื้อขาย (เทียบจากราคาซื้อขายล่าสุด ยกเว้น SET50 Options)	± 5%	± 5%	± 5% ของราคาปิดดัชนี SET50 วันก่อนหน้า	± 5%
Block Trading Transaction (อนุญาตเฉพาะ Morning & Afternoon Session)				
จำนวนซื้อขายขั้นต่ำ	100 สัญญา	25 สัญญา	500 สัญญา	25 หรือ 100 สัญญา ตามที่ TFEX ประกาศกำหนด

หมายเหตุ : * ไม่อนุญาตให้ส่ง Combination Order สำหรับ SET50 Index Options ทุกช่วงเวลาการซื้อขาย

สรุปแนวทางปฏิบัติด้านการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

	Commodity			Interest Rate Futures	Currency
	Gold Futures	Silver Futures	Brent Crude Oil Futures		Baht/USD Futures
Electronic Trading Transaction					
จำนวนเสนอซื้อขายสูงสุด	100 สัญญา				
จำนวนเสนอซื้อขายขั้นต่ำสำหรับ รายการ Hidden Order	10 สัญญา				
ประเภทและเงื่อนไขคำสั่งที่ไม่อนุญาตให้ เสนอซื้อเสนอขาย*	<ul style="list-style-type: none"> • ช่วง Pre-open: Combination Order และ คำสั่งที่มีเงื่อนไข Fill or Kill • ช่วง Morning / Afternoon / Night Session: <ol style="list-style-type: none"> 1. Combination Order ที่มีเงื่อนไข Good till Date/Good till Expiration 2. Market Order ที่มีเงื่อนไข Day/Good till Date/Good till Expiration 				
Daily Price Limit สำหรับ Combination Order (เทียบจากส่วนต่างของราคาที่ใช้ ชำระราคาล่าสุดของ Series ที่ประกอบ เป็น Combination)	± 200 บาท	± 100 บาท	± 200 บาท	± 1.5	± 3 บาท
ระดับราคาเสนอซื้อขายที่จะมีการแจ้ง เตือนการบันทึกรายการเข้าระบบซื้อขาย (เทียบจากราคาซื้อขายล่าสุด ยกเว้น SET50 Options)	± 5%			6MTHBFIX } ± 0.5% 3MBIBOR } Bond Futures ±1%	± 0.5%
Block Trading Transaction (อนุญาตเฉพาะ Morning & Afternoon Session)					
จำนวนซื้อขายขั้นต่ำ	25 สัญญา				100 สัญญา

หมายเหตุ : * ไม่อนุญาตให้ส่ง Combination Order สำหรับ SET50 Index Options ทุกช่วงเวลาการซื้อขาย