

ที่ กข.(ว) 3 / 2562

23 กันยายน 2562

เรื่อง ตัวอย่างพฤติกรรมลักษณะการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสม

เรียน กรรมการผู้จัดการ
บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกทุกบริษัทอ้างถึง หนังสือที่ กข.(ว) 3/2553 เรื่อง ลักษณะการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสม
ลงวันที่ 1 ตุลาคม 2553

สิ่งที่ส่งมาด้วย ลักษณะการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสม และตัวอย่างพฤติกรรม

ตามที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) ได้กำหนดให้บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกละเว้นการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสมเข้ามาในระบบซื้อขายที่อาจมีผลทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายของหลักทรัพย์ไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด โดยได้นำส่งตัวอย่างการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสมมายังสมาชิก ความละเอียดปรากฏตามหนังสือที่อ้างถึง นั้น

เพื่อให้บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิกมีความเข้าใจที่ดีขึ้นในลักษณะของการส่งคำสั่งที่เข้าข่ายเป็นการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสม ซึ่งอาจนำไปสู่การสร้างราคาซึ่งผิดไปตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 และเพื่อช่วยเพิ่มประสิทธิภาพในการกำกับดูแล ตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงได้เพิ่มเติมการอธิบายตัวอย่างพฤติกรรมในแต่ละประเภทให้เห็นภาพมากขึ้น (Visualization) และปรับปรุงการจัดกลุ่มประเภทตัวอย่างลักษณะของคำสั่งไม่เหมาะสมด้วยเพื่อให้เข้าใจง่ายขึ้น ทั้งนี้ได้หารือและรับฟังความคิดเห็นร่วมกับผู้ปฏิบัติงานที่มีหน้าที่ในการกำกับดูแลของสมาชิกผ่านทางชมรม Compliance สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย แล้ว

ตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงขอส่งลักษณะการส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสมและตัวอย่างพฤติกรรม มายังสมาชิกเพื่อใช้เป็นแนวทางในการปฏิบัติงานต่อไป

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ



(นางสาวปวีณา ศรีโพธิ์ทอง)

ผู้ช่วยผู้จัดการ

ลงนามแทน

กรรมการและผู้จัดการ

ฝ่ายกำกับกำกับการซื้อขาย

โทร. 0-2009-9000 ต่อ 9293 – 9299