

10 กรกฎาคม 2558

เรื่อง การปรับปรุงข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

เรียน กรรมการผู้จัดการ

บริษัทสมาชิกและบริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่ใช่สมาชิกทุกบริษัท

อ้างถึง ข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด

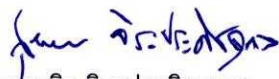
- สิ่งที่ส่งมาด้วย
1. สรุปสาระสำคัญในการปรับปรุงข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์
 2. สำเนาข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด (ฉบับที่ 5) พ.ศ.2558
 3. สำเนาประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่องการให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) พ.ศ. 2558

ด้วยคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยโดยความเห็นชอบของคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์เห็นควรปรับปรุงข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด โดยแก้ไขในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์ที่มีอัตราหมุนเวียนสูง (Turnover list) ทั้งนี้เพื่อให้สอดคล้องกับการที่สำนักงาน ก.ล.ด ได้ประกาศยกเลิกการเปิดเผยรายชื่อหลักทรัพย์ดังกล่าว และเพื่อให้ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) ยังคงมาตรการกำกับการซื้อขายสำหรับหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติด้วยหลักการและแนวทางเดิมที่ได้กำหนดไว้รายละเอียดตามสำเนาข้อบังคับของตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่แนบ ทั้งนี้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 10 กรกฎาคม 2558 เป็นต้นไป

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ขอเรียนว่าแนวทางและวิธีการดำเนินการในเรื่องนี้ยังคงเป็นไปตามแนวทางที่ดำเนินการในปัจจุบัน กล่าวคือตลาดหลักทรัพย์ฯจะพิจารณาและเปิดเผยรายชื่อหลักทรัพย์ที่กำหนดให้สมาชิกต้องให้ลูกค้าซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าวด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (cash balance) ผ่าน SET website ในวันทำการสุดท้ายของสัปดาห์หลังปิดทำการซื้อขาย โดยการคำนวณรายชื่อหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายหมุนเวียนสูงด้วยหลักการและวิธีการเช่นเดียวกับที่สำนักงาน ก.ล.ด. ดำเนินการ คือเริ่มคำนวณจากวันทำการสุดท้ายของสัปดาห์ก่อนจนถึงวันทำการก่อนสุดท้ายของสัปดาห์ที่คำนวณ และพิจารณาเงื่อนไขตามตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ


(นายสุภกิจ จิระประดิษฐกุล)

รองผู้จัดการ

ลงนามแทน

กรรมการและผู้จัดการ

ฝ่ายกำกับการซื้อขาย

โทร.0-2229-2000 ต่อ 2361 -2367

สำเนาเรียน Compliance Unit

สรุปสาระสำคัญในการปรับปรุงข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์

เนื่องจากสำนักงาน ก.ล.ต.จะยกเลิกการประกาศและคำนวณรายชื่อหลักทรัพย์ที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูง (Turnover list) ซึ่งตลาดหลักทรัพย์ฯ ใช้เป็นข้อมูลหนึ่งในการพิจารณาว่าหลักทรัพย์ใดมีการซื้อขายผิดไปจากสภาพปกติของตลาด ดังนั้นเพื่อให้มาตรการกำกับดูแลกรณีการซื้อขายหลักทรัพย์ที่มีสภาพผิดปกติยังคงดำเนินต่อเนื่องไปด้วยแนวทางและวิธีการเดิม ตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงจะใช้วิธีการในการคำนวณหลักทรัพย์ที่มีอัตราการหมุนเวียนสูงตามแนวทางของสำนักงาน ก.ล.ต. โดยหลักเกณฑ์และแนวทางดำเนินการในด้านอื่นยังคงเดิม

แนวทางการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เข้าข่ายมาตรการ Cash balance :

ยังคงพิจารณาในแนวทางและหลักการเดิม คือ ใช้เกณฑ์พิจารณาและการคำนวณเป็นรายสัปดาห์ เช่นเดียวกับเกณฑ์เดิมร่วมกับปัจจัยที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด ทั้งนี้หลักทรัพย์ที่เข้าข่ายตามมาตรการ จะพิจารณาจากหลักทรัพย์ที่มีอัตราการหมุนเวียนการซื้อขายต่อสัปดาห์ มีมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในรอบสัปดาห์สูง และเข้าเงื่อนไขตามที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด

ในกรณีที่บริษัทสมาชิกต้องการให้ข้อมูลลูกค้าเกี่ยวกับหลักทรัพย์ที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูงซึ่งอาจเข้าข่ายต้องซื้อด้วยบัญชี Cash balance เพื่อให้นักลงทุนได้ใช้ความระมัดระวังในการลงทุน บริษัทสมาชิกสามารถใช้หลักการคำนวณตามเกณฑ์ Turnover list เดิมของสำนักงาน ก.ล.ต. ได้ (รายละเอียดตามแนบ)

ระยะเวลาในการพิจารณา และ เปิดเผยรายชื่อหลักทรัพย์ :

พิจารณาเป็นรายสัปดาห์และเปิดเผยผ่าน SET website เช่นเดิม คือเริ่มจากวันทำการสุดท้ายของสัปดาห์ก่อนจนถึงวันทำการก่อนสุดท้ายของสัปดาห์ที่คำนวณ และเปิดเผยรายชื่อในวันทำการสุดท้ายของสัปดาห์ที่คำนวณ หลังปิดทำการซื้อขาย โดยกำหนดให้สมาชิกต้องให้ชื่อหลักทรัพย์ดังกล่าวด้วยบัญชี Cash balance เป็นระยะเวลา 6 สัปดาห์ และหากในระหว่างที่ต้องซื้อด้วยบัญชี Cash balance หากหลักทรัพย์ยังคงมีสภาพผิดปกติกำหนดให้ขยายมาตรการเดิมที่ใช้อยู่ออกไปอีก 3 สัปดาห์นับจากวันสิ้นสุดมาตรการ

หลักเกณฑ์และสูตรการคำนวณหลักทรัพย์ที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูง (Turnover list) สำหรับหุ้นสามัญ และ warrant (ตามหลักการเดิมของสำนักงาน ก.ล.ต.)

หลักเกณฑ์	หุ้นสามัญใน		หมายเหตุ
	SET	mai	
1. อัตราการหมุนเวียนการซื้อขายต่อสัปดาห์ (%1W-Turnover)	≥ 30%	≥ 30%	กรณีที่หุ้นสามัญของบริษัทจดทะเบียนใน SET และ mai ที่ติด Turnover list ให้ warrant ของบริษัทนั้นติด Turnover list ควบคู่ไปด้วย
2. มูลค่าซื้อขายเฉลี่ยต่อวันในรอบสัปดาห์	≥ 100 ลบ.	≥ 20 ลบ.	
3. จำนวนหลักทรัพย์ที่ติด	ไม่จำกัด	ไม่จำกัด	
หลักเกณฑ์		Warrant : SET/mai	
1. อัตราการหมุนเวียนการซื้อขายต่อสัปดาห์	≥ 100%		
2. ส่วนเกินมูลค่า (% premium)	≥ 20%		

Note: ไม่นับรวมหุ้น IPO หรือ warrant ที่เข้าซื้อขายระหว่างสัปดาห์ โดยจะไม่คำนวณในสัปดาห์แรกที่ซื้อขาย

สูตรคำนวณ

1. หุ้นสามัญ

$\%1W\text{-Turnover} = \left[\frac{\text{มูลค่าซื้อหุ้นเฉลี่ยต่อวันในรอบสัปดาห์} \times 5}{\% \text{ Free Float} \times \text{Market Capitalization ของหุ้นเฉลี่ยต่อวันในรอบสัปดาห์}} \right] \times 100$
$\% \text{ Free float} = \frac{\text{จำนวนหุ้นทั้งหมด} - \text{จำนวนหุ้นของ Strategic Shareholder}}{\text{จำนวนหุ้นทั้งหมด}} \times 100$
โดยที่ มูลค่าซื้อหุ้นเฉลี่ยต่อวัน หมายถึง ผลรวมของมูลค่าซื้อหุ้นทำการในรอบสัปดาห์หารด้วยจำนวนวันทำการในรอบสัปดาห์ โดยไม่รวมวันที่ขึ้นเครื่องหมาย SP เติมน มูลค่าซื้อหุ้น นับเฉพาะที่ซื้อขายแบบจับคู่ซื้อขายอัตโนมัติผ่านระบบการซื้อขายของตลาดหลักทรัพย์ (Automatic Order Matching : AOM) Market Capitalization ของหุ้นเฉลี่ยต่อวัน หมายถึง ผลรวมของ Market Capitalization ทุกวันทำการในรอบสัปดาห์หารด้วยจำนวนวันทำการในรอบสัปดาห์

2. ใบสำคัญแสดงสิทธิ

$\%1W\text{-Turnover} = \left[\frac{\text{มูลค่าซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิเฉลี่ยต่อวันในรอบสัปดาห์} \times 5}{\text{Market Capitalization ของใบสำคัญแสดงสิทธิเฉลี่ยต่อวันในรอบสัปดาห์}} \right] \times 100$
โดยที่ มูลค่าซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิเฉลี่ยต่อวัน หมายถึง ผลรวมของมูลค่าซื้อหุ้นทำการในรอบสัปดาห์หารด้วยจำนวนวันทำการในรอบสัปดาห์ โดยไม่รวมวันที่ขึ้นเครื่องหมาย SP เติมน Market Capitalization ของใบสำคัญแสดงสิทธิเฉลี่ยต่อวัน หมายถึง ผลรวมของ Market Capitalization ทุกวันทำการในรอบสัปดาห์หารด้วยจำนวนวันทำการในรอบสัปดาห์

%Premium กรณีให้สิทธิผู้ถือในการซื้อ (call) $\% \text{ Premium} = \frac{[(\text{ราคา Warrants} \times \text{อัตราการใช้สิทธิ}) + \text{ราคาใช้สิทธิ}] - \text{ราคาหุ้นสามัญอ้างอิง}}{\text{ราคาหุ้นสามัญอ้างอิง}} \times 100$ %Premium หมายถึง ต้นทุนส่วนที่ต้องจ่ายแบ่งไปหากมีการใช้สิทธิ Warrants แทนการซื้อหรือขายหุ้นโดยตรงในตลาด ณ วันสิ้นสุดสัปดาห์

ข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

**เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์
 ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด (ฉบับที่ 5) พ.ศ. 2558**

อาศัยอำนาจตามมาตรา 170 วรรคสอง (17) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย พ.ศ. 2535 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ด้วยความเห็นชอบจากคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ข้อบังคับนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 10 กรกฎาคม 2558 เป็นต้นไป

ผลบังคับใช้

ข้อ 2 ให้ยกเลิกความในข้อ 3/1 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด พ.ศ. 2544 ลงวันที่ 29 สิงหาคม 2544 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2551 ลงวันที่ 21 พฤษภาคม 2551 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 3/1 ในกรณีที่หลักทรัพย์ใดมีสภาพการซื้อขายที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูง จนอาจส่งผลกระทบต่อสภาพการซื้อขาย และมีลักษณะตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์นั้นด้วยบัญชีเงินสด (Cash Balance) เป็นการชั่วคราวตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด”

การกำหนดให้สมาชิก
ดำเนินการให้ลูกค้าซื้อ
หลักทรัพย์ด้วยบัญชี
(Cash Balance)

ข้อ 3 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ 7 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด พ.ศ. 2544 ลงวันที่ 29 สิงหาคม 2544

“ข้อ 7 ในกรณีที่ความในข้อใดข้อหนึ่งของคำสั่งหรือหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ที่ออกตามความในข้อ 3/1 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด พ.ศ. 2544 ลงวันที่ 29 สิงหาคม 2544 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2551 ลงวันที่ 21 พฤษภาคม 2551 มีการกำหนดเกี่ยวกับหลักทรัพย์ที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูง (Turnover List) ที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ประกาศกำหนด ให้หมายถึงหลักทรัพย์ที่มีสภาพการซื้อขาย

บทเฉพาะกาลรองรับให้
ประกาศ Turnover List
ที่สำนักงาน ก.ล.ด.
ประกาศกำหนด
หมายถึงหลักทรัพย์ที่มี
สภาพการซื้อขายที่มี
อัตราการซื้อขาย
หมุนเวียนสูงจนอาจ
ส่งผลกระทบต่อ
สภาพการซื้อขาย

ที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูงจนอาจส่งผลกระทบต่อสภาพการซื้อขายตามข้อบังคับ
ตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยมาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไป
จากสภาพปกติของตลาดตามฉบับนี้แทน”

ประกาศ ณ วันที่ 10 กรกฎาคม 2558

(นายสittichai ลิ้มพงศ์พันธุ์)

ประธานกรรมการ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

เหตุผลในการประกาศใช้: โดยที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์จะยกเลิก
การประกาศกำหนดหลักทรัพย์ที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูง (Turnover List) ซึ่งเป็นปัจจัยหนึ่ง
ของมาตรการ Cash Balance ของตลาดหลักทรัพย์นั้น โดยตลาดหลักทรัพย์จะยังคงหลักการเรื่องอัตราการซื้อขาย
หมุนเวียนสูงเป็นปัจจัยหนึ่งของมาตรการดังกล่าว เพื่อให้มาตรการ Cash Balance มีประสิทธิภาพเช่นเดิม
จึงสมควรออกข้อบังคับนี้

ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชี
แคะบาลานซ์ (Cash Balance) พ.ศ. 2558

อาศัยอำนาจตามข้อ 3/1 ของข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด พ.ศ. 2544 ลงวันที่ 29 สิงหาคม พ.ศ. 2544 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรการดำเนินการกรณีมีการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด (ฉบับที่ 5) พ.ศ. 2558 ลงวันที่ 10 กรกฎาคม 2558 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 10 กรกฎาคม 2558 เป็นต้นไป **ผลบังคับใช้**

ข้อ 2 ให้ยกเลิก

(1) ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคะบาลานซ์ (Cash Balance) พ.ศ. 2551 ลงวันที่ 21 พฤษภาคม 2551 **บทยกเลิก**

(2) ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคะบาลานซ์ (Cash Balance) (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2552 ลงวันที่ 15 กรกฎาคม 2552

(3) ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคะบาลานซ์ (Cash Balance) (ฉบับที่ 3) พ.ศ. 2553 ลงวันที่ 19 พฤศจิกายน 2553

(4) ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคะบาลานซ์ (Cash Balance) (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2554 ลงวันที่ 15 มิถุนายน 2554

ข้อ 3 ในประกาศนี้

“หลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายผิดไปจากสภาพปกติของตลาด” หมายความว่า หลักทรัพย์ที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูงจนอาจส่งผลกระทบต่อสภาพการซื้อขาย และตลาดหลักทรัพย์เห็นว่าการซื้อขายหลักทรัพย์นั้นมีพฤติกรรมหรือลักษณะการซื้อขายที่ทำให้หรืออาจทำให้ราคาหรือปริมาณการซื้อขายเปลี่ยนแปลงไปอันไม่ตรงต่อสภาพปกติของตลาด ทั้งนี้ ตามแนวทางที่ได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการ **บทนิยาม**

“การขายชอร์ต” หมายความว่า การขายหลักทรัพย์ที่ต้องยืมหลักทรัพย์มาเพื่อการส่งมอบ

ข้อ 4 ให้สมาชิกเริ่มดำเนินการให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายผิดไปจากสภาพปกติของตลาดด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ในวันทำการถัดจากวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศให้หลักทรัพย์ดังกล่าวเป็นหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายผิดไปจากสภาพปกติของตลาด โดยให้ทำการซื้อขายด้วยบัญชีดังกล่าวอย่างน้อย 3 สัปดาห์

การซื้อขายหลักทรัพย์
ด้วยบัญชี
Cash Balance

ในกรณีที่ระยะเวลาตามวรรคหนึ่งสิ้นสุดลงและหลักทรัพย์นั้นยังคงมีการซื้อขายที่ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด ให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ต่อไปจนกว่าหลักทรัพย์นั้นจะไม่เข้าเงื่อนไขการซื้อขายที่ผิดไปจากสภาพปกติของตลาด

ข้อ 5 ในกรณีที่ลูกค้าของสมาชิกขายชอร์ตหลักทรัพย์ใดๆ ก่อนวันที่ตลาดหลักทรัพย์จะประกาศให้หลักทรัพย์นั้นเป็นหลักทรัพย์ที่สมาชิกต้องดำเนินการให้ลูกค้าซื้อด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ในระยะเวลาตามข้อ 4 ให้สมาชิกสามารถให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์เพื่อส่งมอบคืนหลักทรัพย์ดังกล่าว (Short Covering) ในบัญชีเดียวกับบัญชีที่ลูกค้าได้ขายชอร์ตไว้ได้

การ short covering
ในรอบระยะเวลาที่
ทำการซื้อขายด้วย
บัญชีแคชบาลานซ์

ข้อ 6 ให้บรรดาคำสั่งหรือหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ที่ออกตามความในข้อกำหนดในข้อ 2 ซึ่งใช้บังคับอยู่ก่อนวันที่ประกาศนี้ใช้บังคับ ยังคงใช้ต่อไปได้จนกว่าจะมีการกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข หรือวิธีการใดๆ ในเรื่องดังกล่าวขึ้นใหม่ออกมาใช้บังคับ

บทเฉพาะกาล

ข้อ 7 ในกรณีที่ความในข้อใดข้อหนึ่งของคำสั่งหรือหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ที่ออกตามความในข้อกำหนดในข้อ 2 มีการกำหนดเกี่ยวกับหลักทรัพย์ที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูง (Turnover List) ที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ประกาศกำหนดให้หมายถึงหลักทรัพย์ที่มีการซื้อขายผิดไปจากสภาพปกติของตลาดตามประกาศตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ตามฉบับนี้แทน

บทเฉพาะกาลรองรับ
ให้ประกาศ
Turnover List
ที่สำนักงาน ก.ล.ต.
ประกาศกำหนด
หมายถึงหลักทรัพย์ที่
มีการซื้อขายผิดไป
จากสภาพปกติ
ของตลาด

ประกาศ ณ วันที่ 10 กรกฎาคม 2558

17 กรกฎาคม 2558

(นางเกศรา มัญชุศรี)

กรรมการและผู้จัดการ

เหตุผลในการประกาศใช้: โดยที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์จะยกเลิกการประกาศกำหนดหลักทรัพย์ที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูง (Turnover List) ซึ่งเป็นปัจจัยหนึ่งของมาตรการ Cash Balance ของตลาดหลักทรัพย์นั้น โดยตลาดหลักทรัพย์จะยังคงหลักการเรื่องอัตราการซื้อขายหมุนเวียนสูงเป็นปัจจัยหนึ่งของมาตรการดังกล่าว เพื่อให้มาตรการ Cash Balance มีประสิทธิภาพเช่นเดิม จึงสมควรออกประกาศนี้