

## แนวทางการปฏิบัติงานด้านการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ตามหลักเกณฑ์ 405 และหลักเกณฑ์ 411 ของข้อบังคับของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และหลักเกณฑ์ 401.01 และหลักเกณฑ์ 407.01 ของวิธีปฏิบัติของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะกำหนดแนวทางการปฏิบัติงานด้านการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในเรื่องการบันทึกการเสนอซื้อขายและการซื้อขาย การกำหนดจำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด และการรายงานจำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้า การปฏิบัติงานของสมาชิกที่เกี่ยวกับระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขาย และการแก้ไขรายการซื้อขาย นั้น

เพื่อให้การซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าซึ่งรวมถึงการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ผ่านเจ้าหน้าที่รับอนุญาต ระบบอินเทอร์เน็ต และระบบ Direct Market Access (DMA) เป็นไปอย่างราบรื่น และเพื่อป้องกันความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า กำหนดให้สมาชิกปฏิบัติตามแนวทางดังนี้

### 1. การบันทึกการเสนอซื้อขายและการซื้อขาย

1.1 ให้การบันทึกการเสนอซื้อขายหรือการบันทึกการซื้อขายเข้าระบบการซื้อขายต้องมีรายการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) ชื่อของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (2) การเสนอซื้อหรือการเสนอขาย หรือการซื้อหรือการขาย
- (3) ราคาเสนอซื้อขายหรือราคาซื้อขาย
- (4) จำนวนเสนอซื้อขายหรือจำนวนซื้อขาย
- (5) ประเภทและเงื่อนไขของการเสนอซื้อขาย (กรณีการบันทึกการเสนอซื้อขายแบบจับคู่

อัตโนมัติ (Electronic Trading Transaction))

- (6) เลขที่บัญชีซื้อขาย
- (7) ประเภทผู้ซื้อขาย โดยให้จำแนกเป็นประเภทดังต่อไปนี้

(7.1) การลงทุนเพื่อบัญชีสมาชิก (Principal)

(7.2) ลูกค้านักค้าซึ่งเป็นคนต่างด้าว (Foreign)

(7.3) ลูกค้านักค้าซึ่งเป็นบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ธนาคาร บริษัทเงินทุน บริษัทประกันวินาศภัย บริษัทประกันชีวิต นิติบุคคลประเภทบรรษัท กองทุนส่วนบุคคล กองทุนบำเหน็จบำนาญ

ข้าราชการ ตลอดจนกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ หรือนิติบุคคลอื่นที่มีลักษณะเดียวกัน (Institution)

(7.4) ลูกค้าอื่น (Customer) นอกเหนือจาก (7.1) – (7.3)

(8) การสร้างฐานะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Open Position) หรือการล้างฐานะเดิมของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Close Position)

(9) หมายเลขประจำตัวสมาชิก

(10) หมายเลขเจ้าหน้าที่รับอนุญาต

(11) หมายเลขหรืออักษรย่อของสมาชิกสำนักหักบัญชี (Clearing Member ID)

(12) วิธีการเสนอซื้อขายสำหรับการซื้อขายแบบจับคู่โดยอัตโนมัติ (Electronic Trading Transaction) หรือวิธีการบันทึกการซื้อขายด้วยวิธี Block Trading Transaction

(13) รายการอื่น ๆ ตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

ในการบันทึกการซื้อขายเข้ามาในระบบการซื้อขาย สมาชิกอาจประกาศโฆษณาการเสนอซื้อหรือขายในระบบการซื้อขายได้ ทั้งนี้ การประกาศโฆษณาดังกล่าวไม่มีผลผูกพันสมาชิกให้ต้องตกลงซื้อหรือขายตามประกาศโฆษณานั้น

1.2 ให้การบันทึกการเสนอซื้อขายในแต่ละครั้งมีจำนวนเสนอซื้อขายอย่างน้อย 1 สัญญา และในกรณีที่เป็นการบันทึกการเสนอซื้อขายแบบจับคู่โดยอัตโนมัติ (Electronic Trading Transaction) ต้องมีจำนวนเสนอซื้อขายสูงสุดไม่เกินจำนวนดังต่อไปนี้

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	จำนวนเสนอซื้อหรือเสนอขายสูงสุด
Sector Futures 50 Baht Gold Futures 10 Baht Gold Futures Gold-D Futures Gold Online Futures RSS3 Futures RSS3D Futures 5 Year Government Bond Futures 3M BIBOR Futures	ไม่เกินกว่า 100 สัญญา
Silver Online Futures Japanese Rubber Futures	ไม่เกินกว่า 200 สัญญา
SET50 Index Futures SET50 Index Options Single Stock Futures	ไม่เกินกว่า 500 สัญญา
Baht/USD Futures EUR/USD Futures USD/JPY Futures	ไม่เกินกว่า 1,000 สัญญา

1.3 ให้การบันทึกการเสนอซื้อขายของคำสั่งซื้อขายประเภท Iceberg Order มีจำนวนเสนอซื้อขายที่แบ่งการเสนอซื้อหรือการเสนอขายออกเป็นจำนวนย่อย ๆ ในแต่ละครั้ง (Shown Quantity) อย่างน้อย 10 สัญญา

1.4 ให้การบันทึกการเสนอซื้อขายของคำสั่งซื้อขายประเภท Combination Order มีราคาเสนอซื้อขายเปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นสูงสุดหรือลดลงต่ำสุดจากส่วนต่างของราคาเพื่อใช้ในการชำระหนี้ประจำวันล่าสุดของ Series ที่ประกอบเป็น Combination Order ไม่เกินค่าที่ต่ำกว่า ระหว่าง

1.4.1 ค่าส่วนต่างของ Daily Price Limit ที่คำนวณได้จาก Series ที่ประกอบเป็น Combination Order นั้น กับ

1.4.2 ค่าการเปลี่ยนแปลงของราคาเสนอซื้อขายสูงสุดที่กำหนด ดังตารางต่อไปนี้

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	การเปลี่ยนแปลงของ ราคาเสนอซื้อหรือเสนอขายสูงสุด ของ Combination Order*
SET50 Index Futures	ไม่เกิน $\pm 10$ จุด
Sector Futures <ul style="list-style-type: none"> <li>ENERG Index Futures และ COMM Index Futures</li> <li>FOOD Index Futures</li> <li>BANK Index Futures และ ICT Index Futures</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>ไม่เกิน <math>\pm 400</math> จุด</li> <li>ไม่เกิน <math>\pm 200</math> จุด</li> <li>ไม่เกิน <math>\pm 10</math> จุด</li> </ul>
Single Stock Futures	ไม่เกิน $\pm 10$ บาท
50 Baht Gold Futures	ไม่เกิน $\pm 200$ บาท
10 Baht Gold Futures	
Gold-D Futures	ไม่เกิน $\pm 30$ ดอลลาร์สหรัฐอเมริกา
Gold Online Futures	ไม่เกิน $\pm 30$ บาท
Silver Online Futures	ไม่เกิน $\pm 1$ ดอลลาร์สหรัฐอเมริกา
5 Year Government Bond Futures	ไม่เกิน $\pm 1.5$
3M BIBOR Futures	
Baht/USD Futures	ไม่เกิน $\pm 3$ บาท
EUR/USD Futures	ไม่เกิน $\pm 0.15$ ดอลลาร์สหรัฐอเมริกา
USD/JPY Futures	ไม่เกิน $\pm 15$ เยน

\* รายการซื้อขายที่เกิดจากการจับคู่การซื้อขาย Combination Order อาจมีราคาซื้อขายอยู่นอกช่วง Daily Price Limit ของ Combination Order หรือ Daily Price Limit ของแต่ละ Series ที่ประกอบเป็น Combination Order

1.5 ประเภทและเงื่อนไขของการบันทึกการเสนอซื้อขายที่ไม่อนุญาตในแต่ละช่วงเวลาซื้อขายมีดังต่อไปนี้

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	ช่วง Pre-open	ช่วง Morning / Afternoon / Night / Open Session
SET50 Index Futures Sector Futures Single Stock Futures 50 Baht Gold Futures 10 Baht Gold Futures Gold-D Futures* Gold Online Futures RSS3 Futures* RSS3D Futures* 5 Year Government Bond Futures 3M BIBOR Futures Baht/USD Futures SET50 Index Options* Silver Online Futures Japanese Rubber Futures* EUR/USD Futures และ USD/JPY Futures	<ul style="list-style-type: none"> <li>● ประเภท Market Order ที่มีเงื่อนไขเป็น Day, Fill or Kill, Good till Date หรือ Good till Cancel</li> <li>● ประเภท Limit Order ที่มีเงื่อนไขเป็น Fill or Kill</li> <li>● ประเภท Market to Limit Order</li> <li>● การเสนอซื้อขายที่มีเงื่อนไข Stop Order ควบคู่กับเงื่อนไข Day, Good till Date หรือ Good till Cancel</li> <li>● ประเภท Combination Order ที่ส่งควบคู่กับ Limit Order หรือ Market Order</li> <li>● ประเภท Combination Order ที่ส่งควบคู่กับ Stop Order ที่มีเงื่อนไข Day, Good till Date หรือ Good till Cancel</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>● ประเภท Market Order ที่มีเงื่อนไขเป็น Day, Good till Date หรือ Good till Cancel</li> <li>● การเสนอซื้อขายที่มีเงื่อนไข Stop Order ควบคู่กับเงื่อนไข Day, Good till Date หรือ Good till Cancel</li> <li>● ประเภท Combination Order ที่ส่งควบคู่กับ Market Order หรือ Stop Order ที่มีเงื่อนไข Day, Good till Date หรือ Good till Cancel</li> </ul>

\* Gold-D Futures, RSS3 Futures, RSS3D Futures, SET50 Index Options และ Japanese Rubber Futures ไม่อนุญาตให้บันทึกการเสนอซื้อขายประเภท Combination Order ในทุกช่วงเวลาซื้อขาย

ทั้งนี้ ในกรณีที่มีการปรับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า Single Stock Futures เมื่อมี Corporate Action การเสนอซื้อขายที่ยังค้างอยู่ในระบบการซื้อขาย ณ สิ้นวันทำการก่อนวันที่มีการปรับ Single Stock Futures นั้นจะถูกยกเลิกโดยอัตโนมัติ

การเสนอซื้อหรือเสนอขายประเภท Good till Cancel หรือ Good till Date จะอยู่ในระบบการซื้อขายไม่เกิน 255 วัน

1.6 ให้สมาชิกจัดให้มีการตรวจสอบความถูกต้องของการบันทึกการเสนอซื้อขายและการซื้อขายของเจ้าหน้าที่รับอนุญาตของสมาชิกหรือลูกค้า ก่อนที่จะส่งเข้ามาในระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ดังนี้

1.6.1 ให้สมาชิกจัดให้มีระบบตรวจสอบความถูกต้องของการบันทึกการเสนอซื้อขายและการซื้อขายของเจ้าหน้าที่รับอนุญาตของสมาชิกหรือลูกค้า ให้มีรายการตามข้อ 1.1 ทั้งนี้ สำหรับรายการ “หมายเลขเจ้าหน้าที่รับอนุญาต” ให้บันทึก ดังนี้

□ กรณีการซื้อขายโดยเจ้าหน้าที่รับอนุญาตหรือเจ้าหน้าที่ปฏิบัติงานเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง ให้บันทึกตามที่ได้รับหมายเลขเจ้าหน้าที่รับอนุญาตหรือเจ้าหน้าที่ปฏิบัติงานเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เช่น DXXXX (D ตามด้วยตัวอักษร/ตัวเลขจำนวน 4 หลัก) เป็นต้น

□ กรณีการซื้อขายผ่านระบบอินเทอร์เน็ต

- บันทึกเป็น I1111 (I ตามด้วยตัวเลข 1111) สำหรับการบันทึกการเสนอซื้อขายของลูกค้าที่เป็นผู้ลงทุนทั่วไป หรือ

- บันทึกเป็น I9999 (I ตามด้วยตัวเลข 9999) สำหรับการบันทึกการเสนอซื้อขายของลูกค้าที่เป็นผู้ลงทุนสถาบัน

□ กรณีการซื้อขายผ่านระบบ Direct Market Access (DMA)

- บันทึกเป็น D1111 (D ตามด้วยตัวเลข 1111) สำหรับการบันทึกการเสนอซื้อขายของลูกค้าที่เป็นผู้ลงทุนทั่วไป หรือ

- บันทึกเป็น D9999 (D ตามด้วยตัวเลข 9999) สำหรับการบันทึกการเสนอซื้อขายของลูกค้าที่เป็นผู้ลงทุนสถาบัน

1.6.2 ให้สมาชิกจัดให้มีการตรวจสอบการบันทึกการเสนอซื้อขายผ่านเจ้าหน้าที่รับอนุญาตและระบบอินเทอร์เน็ตเพื่อไม่ให้เกิดความผิดพลาดในการปฏิบัติงานของสมาชิก โดยเฉพาะอย่างยิ่งในกรณีที่มีราคาเสนอซื้อหรือเสนอขายเปลี่ยนแปลงจากราคาซื้อขายล่าสุด (Last Execution Price) เกินกว่าอัตราที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดดังต่อไปนี้ ให้สมาชิกทำการตรวจสอบความถูกต้องและสอบถามความประสงค์เพื่อให้ลูกค้ายืนยันการซื้อขขายอีกครั้งหนึ่งก่อนทำการเสนอซื้อขาย

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	อัตราที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด
SET50 Index Futures Sector Futures Single Stock Futures 50 Baht Gold Futures 10 Baht Gold Futures Gold-D Futures และ Gold Online Futures	ร้อยละ $\pm 5$ ของราคาซื้อขายล่าสุด (Last Execution Price)
Silver Online Futures Japanese Rubber Futures	ร้อยละ $\pm 5$ ของราคาซื้อขายล่าสุด (Last Execution Price)

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	อัตราที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด
SET50 Index Options	ร้อยละ $\pm 5$ ของราคาปิดของดัชนี SET50 ในวันทำการก่อนหน้า
RSS3 Futures RSS3D Futures	ร้อยละ $\pm 1.5$ ของราคาซื้อขายล่าสุด (Last Execution Price)
5 Year Government Bond Futures	ร้อยละ $\pm 1$ ของราคาซื้อขายล่าสุด (Last Execution Price)
3M BIBOR Futures Baht/USD Futures EUR/USD Futures USD/JPY Futures	ร้อยละ $\pm 0.5$ ของราคาซื้อขายล่าสุด (Last Execution Price)

## 2. การแก้ไขหรือยกเลิกการเสนอซื้อขายหรือการบันทึกการซื้อขาย

2.1 สมาชิกจะแก้ไขหรือยกเลิกการเสนอซื้อขายได้เฉพาะก่อนที่การเสนอขายนั้นจะได้รับการจับคู่ การซื้อขาย และให้กระทำได้เฉพาะในกรณีที่ลูกค้าขอแก้ไขหรือยกเลิกคำสั่งซื้อขายของตน หรือสมาชิกทำการเสนอซื้อขายไม่ถูกต้องตามคำสั่งซื้อขายที่ได้รับ

การแก้ไขการเสนอซื้อขายของสมาชิกให้ทำได้เฉพาะรายการดังต่อไปนี้

- (1) ราคาเสนอซื้อขาย
- (2) จำนวนเสนอซื้อขาย
- (3) เงื่อนไขของการเสนอซื้อขาย
- (4) เลขที่บัญชีซื้อขาย
- (5) ประเภทผู้ซื้อขาย
- (6) การสร้างฐานะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Open Position) หรือการล้างฐานะเดิมของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Close Position)

(7) รายการอื่น ๆ ตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

การแก้ไขราคาเสนอซื้อขายหรือการเพิ่มจำนวนเสนอซื้อขาย มีผลให้ลำดับการเสนอซื้อขายเปลี่ยนแปลงตามเวลาที่มีการแก้ไขการเสนอซื้อขาย

2.2 สมาชิกจะแก้ไขหรือยกเลิกการบันทึกการซื้อขายได้เฉพาะก่อนที่การบันทึกการซื้อขายนั้นจะได้รับการยืนยันการซื้อขายจากระบบการซื้อขาย และให้กระทำได้เฉพาะในกรณีที่ลูกค้าขอแก้ไขหรือยกเลิกการบันทึกการซื้อขายของตน หรือสมาชิกทำการบันทึกการซื้อขายไม่ถูกต้องตามรายการซื้อขายที่ได้รับ

### 3. การแก้ไขรายการซื้อขาย

ในกรณีที่สมาชิกมีการแก้ไขรายการซื้อขาย ให้สมาชิกรายงานและชี้แจงเหตุผลในการแก้ไขรายการซื้อขายดังกล่าวต่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยให้รายงานตามแบบและระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

### 4. การถือครองและการรายงานจำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ในกรณีที่สมาชิกหรือลูกค้าเปิดบัญชีการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับสมาชิกเกินกว่า 1 บัญชี ไม่ว่าจะเป็นการเปิดบัญชีเพื่อซื้อขายผ่านระบบส่งคำสั่งซื้อขายใดที่สมาชิกให้บริการ ให้สมาชิกมีหน้าที่ควบคุม ตรวจสอบและรายงานจำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกและของลูกค้า โดยให้สมาชิกดำเนินการตามหลักเกณฑ์ 411 รวมทั้งหนังสือเวียน แนวทางปฏิบัติและคำสั่งของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกี่ยวข้องกับการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ดังกล่าว

### 5. การปฏิบัติงานของสมาชิกในกรณีการซื้อขายผ่านระบบอินเทอร์เน็ต

ให้สมาชิกจัดให้มีหนังสือหรือเอกสารอื่นใดที่แสดงได้ว่าลูกค้ารับทราบและยอมรับเงื่อนไขในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าผ่านระบบอินเทอร์เน็ต รวมถึงหน้าที่ในการเก็บรักษาและมีให้บุคคลอื่นล่วงรู้ข้อมูลเกี่ยวกับชื่อผู้ใช้ (User Name) รหัสผ่าน (Password) และรหัสการยืนยันความเป็นลูกค้า เช่น PIN ID เป็นต้น ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการใช้ข้อมูลดังกล่าวโดยขาดความระมัดระวัง

### 6. การปฏิบัติงานของสมาชิกในกรณีการซื้อขายผ่านระบบ DMA

ให้สมาชิกดำเนินการก่อนอนุญาตให้ลูกค้าซื้อขายผ่านระบบ DMA ดังนี้

6.1 กำหนดนโยบายและขั้นตอนในการพิจารณาอนุญาตให้ลูกค้าซื้อขายผ่านระบบ DMA ที่ชัดเจนเป็นลายลักษณ์อักษร

6.2 จัดให้มีบุคลากรเพื่อติดต่อประสานงานกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับการซื้อขายผ่านระบบ DMA

6.3 ขออนุญาตจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามรูปแบบและวิธีการที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

### ผลบังคับใช้

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดให้ใช้แนวทางฉบับนี้ตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป