

แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอันเนื่องมาจากราคาซื้อขายมีการเปลี่ยนแปลงถึงระดับการเปลี่ยนแปลงราคาซื้อขายสูงสุดในแต่ละวัน (Daily Price Limit)

ตามหลักเกณฑ์ 604 และ 607 ของวิธีปฏิบัติของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า กำหนดแนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอันเนื่องมาจากราคาซื้อขายมีการเปลี่ยนแปลงถึงระดับการเปลี่ยนแปลงราคาซื้อขายสูงสุดในแต่ละวัน (Daily Price Limit) ดังนี้

1. ราคาซื้อขายที่ใช้ในการพิจารณาหยุดการซื้อขาย

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเมื่อราคาซื้อขายมีการเปลี่ยนแปลงถึงระดับ Daily Price Limit ตามที่กำหนดในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยราคาซื้อขายดังกล่าว จะพิจารณาจากราคาซื้อขายของสัญญาเดือนใกล้เคียงที่สุด (Nearest Month) หรือสัญญาที่มีสภาพคล่องการซื้อขายหรือ ตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นสมควร

2. การหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นช่วงระยะเวลาหนึ่ง ในกรณีที่ราคาซื้อขายของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเปลี่ยนแปลงถึงระดับ Daily Price Limit ตามที่กำหนดในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ดังนี้

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	Daily Price Limit ที่ทำให้เกิดการหยุด การซื้อขาย	Daily Price Limit ที่ยายหลังจากหยุด การซื้อขายแล้ว	การหยุดการซื้อขาย
50 Baht Gold Futures* 10 Baht Gold Futures* Gold-D Futures Gold Online Futures Silver Online Futures Japanese Rubber Futures	± 10%	± 20%	<ul style="list-style-type: none"> ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะหยุดการซื้อขาย 2 นาที** โดยในช่วงเวลาดังกล่าวจะกำหนดให้เป็นช่วง Pre-open และสามารถส่งคำสั่งซื้อขายในช่วง Pre-open นั้นได้ หากในช่วงเวลาซื้อขายนั้นมีเวลาทำการซื้อขายคงเหลือน้อยกว่า 2 นาที** ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจพิจารณาจับคู่ซื้อขายเมื่อสิ้นสุดช่วงเวลาซื้อขายนั้น
RSS3 Futures RSS3D Futures	± 5%	± 10%	
5 Year Government Bond Futures EUR/USD Futures USD/JPY Futures	± 2.5%	± 5%	
Baht/USD Futures	± 2%	± 4%	
3M BIBOR Futures	± 1.25%	± 2.5%	

* ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะพิจารณาหยุดการซื้อขาย 50 Baht Gold Futures และ 10 Baht Gold Futures พร้อมกันเมื่อราคาซื้อขายของ 50 Baht Gold Futures หรือ 10 Baht Gold Futures เปลี่ยนแปลงถึงระดับ Daily Price Limit

** ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจปรับเปลี่ยนช่วงเวลาดังกล่าวให้ไม่เกินกว่า 5 นาที โดยจะแจ้งให้ทราบล่วงหน้า

ผลบังคับใช้

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะใช้แนวทางฉบับนี้ โดยให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 5 พฤศจิกายน 2561 เป็นต้นไป และยกเลิกแนวทางปฏิบัติของการหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอันเนื่องมาจากราคาซื้อขายมีการเปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นหรือลดลงถึงระดับการเปลี่ยนแปลงราคาซื้อขายสูงสุดในแต่ละวัน (Daily Price Limit) ตามที่กำหนดในหนังสือที่ TFEX-PS (ว) 001/2555 ลงวันที่ 20 มกราคม 2555

(ตารางของข้อ 2. ถูกแก้ไขเพิ่มเติมโดยแนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับการหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอันเนื่องมาจากราคาซื้อขายมีการเปลี่ยนแปลงถึงระดับการเปลี่ยนแปลงราคาซื้อขายสูงสุดในแต่ละวัน (Daily Price Limit) (ฉบับที่ 4) ลงวันที่ 31 มกราคม 2566 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป)