

สารบัญ

ข้อบังคับ

หมวด 500 เหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย

	หน้า
501 เหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย (Trading Disruption).....	500-1
502 การดำเนินการของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเมื่อเกิดเหตุขัดข้อง ที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย.....	500-1
503 การกำหนดเวลาเปิดทำการซื้อขายภายหลังจากหยุดการซื้อขาย.....	500-3

ข้อบังคับ

หมวด 500 เหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย

*501 เหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย (Trading Disruption)

เหตุการณ์ใด ๆ ที่มีผลหรืออาจมีผลกระทบต่อการซื้อขายหรือการชำระหนี้ ซึ่งทำให้หรืออาจทำให้ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าไม่สามารถดำเนินงานได้ตามปกติ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะถือเป็นเหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขายตามหมวดนี้ โดยเหตุขัดข้องดังกล่าวให้หมายความรวมถึงเหตุการณ์ดังต่อไปนี้

(1) เหตุจำเป็นเร่งด่วนที่เกิดขึ้นกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือตลาดสินค้าอ้างอิง รวมถึงเหตุที่อยู่นอกเหนือความควบคุมของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือตลาดสินค้าอ้างอิง ที่ส่งผลให้การซื้อขายหรือการชำระหนี้ไม่สามารถดำเนินการได้ตามปกติ

(2) การดำเนินการใด ๆ ของภาครัฐหรือองค์กรต่าง ๆ ซึ่งมีกฎหมายกำหนดให้ใช้อำนาจทางปกครอง ซึ่งส่งผลกระทบต่อสภาพการซื้อขายโดยรวม หรือการดำเนินงานตามปกติของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(3) เหตุขัดข้องตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

(*ความในหลักเกณฑ์ 501 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทนโดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า(ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หมวด 500 เหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย ลงวันที่ 20 สิงหาคม 2563 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 31 สิงหาคม 2563 เป็นต้นไป*)

502 การดำเนินการของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเมื่อเกิดเหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย

เมื่อเกิดเหตุขัดข้องตามหลักเกณฑ์ 501 ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะดำเนินการ อย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังต่อไปนี้เพื่อแก้ไขบรรเทาเหตุขัดข้องหรือผลที่เกิดขึ้นจากเหตุดังกล่าว

(1) หยุดการซื้อขายทั้งหมดเป็นการชั่วคราวตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

(2) หยุดการซื้อขายเฉพาะกลุ่มของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสินค้าอ้างอิงเดียวกัน (Class of Contracts) หรือหยุดการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใดในช่วงระยะเวลาตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

(3) เปลี่ยนแปลงหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เช่น วันหรือเวลาทำการซื้อขาย วิธีการซื้อขายซึ่งรวมถึงการเปลี่ยนแปลงจากวิธีจับคู่อัตโนมัติเป็นวิธีการอื่น ช่วงเวลาซื้อขายประเภทหรือเงื่อนไขของการเสนอซื้อขายเป็นการชั่วคราว

- (4) ให้สมาชิกฐานะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยทันทีหรือสั่งการใด ๆ ที่มีผลกับจำนวนฐานะของสัญญา (Open Position) หรือกำหนดข้อจำกัดหรือเงื่อนไขในการซื้อขายของสมาชิกตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นสมควร
- (5) แก้ไขเปลี่ยนแปลงหรือยกเลิกแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (6) อนุญาตให้สมาชิกส่งมอบสินค้าอ้างอิงประเภทเดียวกันและที่มีคุณภาพเท่าเทียมหรือสูงกว่าที่กำหนดไว้ในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยอาจกำหนดเงื่อนไขให้สมาชิกจ่ายเงินชดเชยตามความเหมาะสม
- *(7) กำหนดให้สัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีการชำระหนี้ ณ ราคาใดราคาดหนึ่งที่แตกต่างจากราคาสำหรับการส่งมอบหรือใช้อ้างอิงเพื่อคำนวณส่วนต่างของราคาเพื่อใช้ในการชำระหนี้ (Settlement Price) ที่คำนวณได้ตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดขึ้นเนื่องจากการเปลี่ยนแปลงหลักเกณฑ์เกี่ยวกับราคาสำหรับการส่งมอบหรือใช้อ้างอิงเพื่อคำนวณส่วนต่างของราคาเพื่อใช้ในการชำระหนี้ (Settlement Price) เช่น การเปลี่ยนแปลงเวลาของข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณราคา แหล่งที่มาเพื่อใช้ในการคำนวณราคา
- (8) ให้สมาชิกกระทำหรือไม่กระทำใด ๆ เพื่อแก้ไขเหตุขัดข้องหรือยับยั้งผลที่อาจเกิดขึ้นจากเหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย
- (9) ร้องขอให้สำนักหักบัญชีดำเนินการใด ๆ ตามข้อกำหนดของสำนักหักบัญชีเพื่อแก้ไขเหตุขัดข้องหรือยับยั้งผลที่อาจเกิดขึ้นจากเหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย
- (10) เปลี่ยนแปลงอัตราหรือมูลค่าขั้นต่ำของหลักประกันเริ่มต้น (Initial Margin) ที่สมาชิกต้องเรียกจากลูกค้า
- *** (11) ยกเลิกการเสนอซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิก ในกรณีมีเหตุขัดข้องจากระบบการซื้อขายหรือระบบคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการซื้อขายของสมาชิกที่เชื่อมต่อกับระบบการซื้อขายที่มีผลหรืออาจมีผลกระทบต่อสภาพการซื้อขายซึ่งทำให้หรืออาจทำให้การซื้อขายไม่สามารถกระทำได้ตามปกติ
- *** (12) ดำเนินการอื่นใดตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นสมควร โดยในการใช้มาตรการใด ๆ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะคำนึงถึงความจำเป็น และสถานการณ์ที่เกิดขึ้น ณ ขณะนั้น รวมทั้งดำเนินการเป็นการชั่วคราวเท่านั้น
- **ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจพิจารณาดำเนินการตามวรรคหนึ่งกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทั้งหมดหรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใด ๆ หรือกับเฉพาะกลุ่มของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสินค้าอ้างอิงเดียวกัน (Class of Contracts) หรือกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบบใด ๆ เป็นการชั่วคราว ทั้งนี้ เพื่อให้เหมาะสมกับภาวะเหตุขัดข้องตามหลักเกณฑ์ 501 ที่เกิดขึ้นหรือสอดคล้องกับการดำเนินการของตลาดสินค้าอ้างอิง
- **ในกรณีที่การดำเนินการตามวรรคหนึ่งและวรรคสองส่งผลให้ต้องมีการยกเลิกหรือแก้ไขเปลี่ยนแปลงแบบและข้อความของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ให้ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าดำเนินการเป็นการชั่วคราวภายในกรอบที่สำนักงานกำหนด

ข้อบังคับของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

หมวด 500 เหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย

(*ความใน (3) (7) (11) ของหลักเกณฑ์ 502 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทนโดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า(ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หมวด 500 เหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย ลงวันที่ 20 สิงหาคม 2563 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 31 สิงหาคม 2563 เป็นต้นไป)

(**เพิ่มเติมความในวรรคสองและวรรคสามของหลักเกณฑ์ 502 โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ลงวันที่ 20 สิงหาคม 2563 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 31 สิงหาคม 2563 เป็นต้นไป)

(***ความใน (11) ของหลักเกณฑ์ 502 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทนโดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หมวด 500 เหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย ลงวันที่ 31 มกราคม 2566 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป)

(***เพิ่ม (12) ของหลักเกณฑ์ 502 โดยข้อบังคับบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า(ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หมวด 500 เหตุขัดข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขาย ลงวันที่ 31 มกราคม 2566 ซึ่งมีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป)

503 การกำหนดเวลาเปิดทำการซื้อขายภายหลังจากหยุดการซื้อขาย

การกำหนดเวลาเปิดทำการซื้อขายภายหลังจากหยุดการซื้อขายให้เป็นตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด
