

เรียน ลูกค้า บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด

เรื่อง ขอชักชวนความเข้าใจในการส่งคำสั่งซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทขอความร่วมมือลูกค้าทุกท่านโปรดใช้ความระมัดระวังในการส่งคำสั่งซื้อ หรือขาย หรือยกเลิกการซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในลักษณะที่บริษัทตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) กำหนดว่าเป็นการส่งคำสั่งที่มีลักษณะเข้าข่ายไม่เหมาะสม หรืออาจพิจารณาได้ว่าเป็นคำสั่งที่ไม่เหมาะสมและโดยอาจส่งผลกระทบต่อราคาสัญญาหรือสภาพการซื้อขายโดยรวมเปลี่ยนแปลงขึ้นหรือลงไม่เป็นไปตามสภาพปกติของตลาด ตามข้อบังคับที่ตลาดหลักทรัพย์ฯได้กำหนดไว้

บริษัทหวังเป็นอย่างยิ่งว่าจะได้รับความร่วมมืออย่างดีจากลูกค้าทุกท่าน อย่างไรก็ตาม หากพบการส่งคำสั่งที่อาจเข้าข่ายลักษณะไม่เหมาะสม บริษัทขอสงวนสิทธิในการดำเนินการใด ๆ กับบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือ คำสั่งซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของท่านตามคำสั่งของบริษัทตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หรือตามที่บริษัทจะเห็นสมควร

*ลักษณะของการส่งคำสั่งที่เข้าข่ายลักษณะที่ไม่เหมาะสม มีดังนี้*

1. การส่งคำสั่งซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใดในช่วงก่อนเปิดตลาด (Pre-open) ในปริมาณสูงโดยไม่มีวัตถุประสงค์ที่จะซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านั้นจริง หรือทำการส่งคำสั่งซื้อขายด้วยราคาเสนอซื้อหรือเสนอขายที่ดีที่สุด และเมื่อจะมีการจับคู่ซื้อขายเกิดขึ้นก็ทำการแก้ไข หรือยกเลิกคำสั่งนั้นทันที ซึ่งระดับราคา หรือปริมาณคำสั่งซื้อขายดังกล่าว อาจส่งผลกระทบต่อราคาคำนวนหาราคาเปิดและสภาพการซื้อขายตามปกติของตลาด (Entering Orders Without Intent to Trade)
2. ส่งคำสั่งซื้อขายหรือทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใด ซึ่งน่าจะทำให้หรือทำให้บุคคลทั่วไปเกิดความสำคัญผิดในราคาหรือปริมาณของการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านั้น (False or misleading appearance)

3. ส่งคำสั่งซื้อขายหรือทำการซื้อขายในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใดที่อาจมีหรือมีผลเป็นการสร้างราคา หรือส่งผลให้ราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเปลี่ยนแปลงหรือไม่เปลี่ยนแปลงไปจากสภาพปกติของตลาด (Price Manipulation)
4. ทำการส่งคำสั่งซื้อขายหรือทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใดที่อาจเป็นการจับคู่ซื้อขายระหว่างกันของบุคคลเดียวกันหรือระหว่างกลุ่มบุคคลที่มีความเกี่ยวข้องกัน หรือเป็นการจับคู่ซื้อขายระหว่างบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีผู้รับประโยชน์จากการซื้อขายเป็นบุคคลคนเดียวกัน (Wash trades)
5. ส่งคำสั่งซื้อขายหรือทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใด ในช่วงเวลาซื้อขายก่อนปิดตลาด ซึ่งมีผลต่อการเปลี่ยนแปลงของราคาเพื่อใช้ในการชำระหนี้ประจำวัน (Daily Settlement Price) เพื่อให้ได้ประโยชน์จากการถือครองฐานะในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า นั้น หรือเพื่อหลีกเลี่ยงการถูกเรียกวางหลักประกันเพิ่ม (Margin Call) เมื่อหลักประกันที่วางไว้ต่ำกว่าเกณฑ์ที่กำหนด เนื่องมาจากราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเปลี่ยนแปลงไป (Marking the close)
6. ทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใด ในขณะที่เดียวกันกับการซื้อขายสินค้าอ้างอิง (Underlying) หรือทำการซื้อขายใดๆ ที่อาจมีหรือมีผลต่อตัวแปร (Index) ทั้งนี้ ผลจากการเปลี่ยนแปลงหรือไม่เปลี่ยนแปลงไปของราคาสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปรจะเป็นประโยชน์ต่อการถือครองฐานะในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า นั้น (Inter-Market Manipulation)
7. ส่งคำสั่งซื้อขายหรือทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใด ไม่ว่าจะโดยตนเองหรือรวมกับบุคคลอื่นเพื่อประโยชน์ร่วมกันหรือต่างได้รับประโยชน์จากการเปลี่ยนแปลงหรือไม่เปลี่ยนแปลงของราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้า นั้นหรือราคาสินค้าอ้างอิงหรือตัวแปร (Pool)

จึงเรียนมาเพื่อทราบ