

# คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ กธ. 21/2540

เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการค้าหลักทรัพย์

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 14 และมาตรา 114 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 คณะกรรมการ ก.ล.ต. ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“บริษัทหลักทรัพย์” หมายความว่า บริษัทที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการค้าหลักทรัพย์

“บัญชีหลักทรัพย์เพื่อการค้า” หมายความว่า บัญชีที่บันทึกรายการหลักทรัพย์ที่มีไว้เพื่อการประกอบธุรกิจค้าหลักทรัพย์ หรือคงเหลือจากการประกอบธุรกิจค้าหลักทรัพย์ ไม่ว่าหลักทรัพย์ดังกล่าวจะได้มาหรือจำหน่ายไปโดยวิธีใด

“บัญชีหลักทรัพย์เพื่อการลงทุน” หมายความว่า บัญชีที่บันทึกรายการเงินลงทุนในหลักทรัพย์เพื่อบริษัทหลักทรัพย์นั้นเอง ไม่ว่าจะเป็นการลงทุนระยะสั้นหรือการลงทุนระยะยาว ตามนัยของประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการลงทุนในหลักทรัพย์เพื่อบริษัทหลักทรัพย์

“สำนักงาน” หมายความว่า สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 2 ในการประกอบการเป็นผู้ค้าหลักทรัพย์ บริษัทหลักทรัพย์ต้องปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการ ดังนี้

- (1) จัดให้มีบัญชีหลักทรัพย์เพื่อการค้าแยกจากบัญชีหลักทรัพย์เพื่อการลงทุน
- (2) แสดงตนอย่างเปิดเผยว่าพร้อมที่จะซื้อหรือขายหลักทรัพย์กับลูกค้า
- (3) จัดให้มีหลักเกณฑ์การกำหนดราคาเสนอซื้อและเสนอขายหลักทรัพย์ไว้เป็น

ลายลักษณ์อักษร

(4) แจ้งราคาหลักทรัพย์ที่เสนอซื้อและเสนอขายให้ลูกค้าทราบ และหากลูกค้าประสงค์จะซื้อหรือขายหลักทรัพย์ในราคาที่บริษัทหลักทรัพย์เสนอไว้ บริษัทหลักทรัพย์ต้องรับซื้อหรือขายหลักทรัพย์กับลูกค้า ณ ราคาดังกล่าว ทั้งนี้ บริษัทหลักทรัพย์อาจกำหนดหน่วยการซื้อขาย (lot size) หรือจำนวนหลักทรัพย์สูงสุดที่จะรับซื้อหรือขายไว้ด้วยก็ได้

(5) แจ้งให้ลูกค้าทราบทุกครั้งว่าบริษัทหลักทรัพย์เป็นคู่ค้าในการซื้อหรือขายหลักทรัพย์นั้น และในกรณีที่บริษัทหลักทรัพย์มีส่วนได้เสียกับหลักทรัพย์ที่เสนอซื้อหรือเสนอขาย ในลักษณะที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์กับการกระทำหน้าที่เป็นคู่ค้าหลักทรัพย์ บริษัทหลักทรัพย์ต้องแจ้งให้ลูกค้าทราบถึงส่วน ได้เสียดังกล่าวก่อนที่จะตกลงซื้อหรือขายหลักทรัพย์กับลูกค้า

(6) ยืนยันการซื้อหรือขายหลักทรัพย์กับลูกค้าเป็นลายลักษณ์อักษรหลังจากที่ได้ตกลงซื้อหรือขายหลักทรัพย์กับลูกค้าแล้ว

ข้อ 3 ในกรณีที่บริษัทหลักทรัพย์มีบัญชีหลักทรัพย์เพื่อการลงทุน และประสงค์จะโอนหลักทรัพย์ระหว่างบัญชีหลักทรัพย์เพื่อการค้ากับบัญชีหลักทรัพย์เพื่อการลงทุน บริษัทหลักทรัพย์ต้องโอนหลักทรัพย์ระหว่างบัญชีโดยใช้ราคาทุนหรือราคาตลาด ณ วันโอน แล้วแต่ราคาใดจะต่ำกว่า

ข้อ 4 บริษัทหลักทรัพย์ต้องจัดให้มีระบบการควบคุมภายใน ระบบการบริหารความเสี่ยง และระบบการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์ อย่างมีประสิทธิภาพ โดยกำหนดระเบียบวิธีปฏิบัติไว้เป็นลายลักษณ์อักษร และต้องได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการของบริษัทหลักทรัพย์

ข้อ 5 ระเบียบวิธีปฏิบัติตามข้อ 4 อย่างน้อยต้องมีข้อกำหนดในเรื่องดังนี้

- (1) หลักเกณฑ์การเลือกหลักทรัพย์ที่จะใช้เป็นหลักทรัพย์เพื่อการค้า
- (2) หลักเกณฑ์การ โอนหลักทรัพย์ระหว่างบัญชีหลักทรัพย์เพื่อการค้ากับบัญชีหลักทรัพย์เพื่อการลงทุน
- (3) หลักเกณฑ์การรายงานผลการค้าหลักทรัพย์ให้ผู้บริหารของบริษัทหลักทรัพย์ทราบ
- (4) มาตรการป้องกันการให้ข้อมูลอันมิพึงเปิดเผยระหว่างหน่วยงานต่าง ๆ ของบริษัทหลักทรัพย์ (Chinese wall)
- (5) ข้อกำหนดอื่นตามที่สำนักงานประกาศกำหนด

ข้อ 6 บริษัทหลักทรัพย์ต้องตรวจสอบและดูแลให้พนักงานที่ทำหน้าที่ค้าหลักทรัพย์ ปฏิบัติตามประกาศนี้ และระเบียบวิธีปฏิบัติที่บริษัทหลักทรัพย์กำหนด

ข้อ 7 ในกรณีที่สำนักงานพบว่าบริษัทหลักทรัพย์ใดไม่ปฏิบัติตามประกาศนี้ หรือไม่ปฏิบัติตามระเบียบวิธีปฏิบัติที่บริษัทหลักทรัพย์กำหนด หรือมีพฤติกรรมที่ไม่เหมาะสมในการค้าหลักทรัพย์ สำนักงานอาจสั่งให้บริษัทหลักทรัพย์นั้น แก้ไข กระทบการ หรืองดเว้นกระทบการใด ๆ เกี่ยวกับการค้าหลักทรัพย์ก็ได้

ข้อ 8 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันถัดจากวันประกาศในราชกิจจานุเบกษาเป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 17 พฤษภาคม พ.ศ. 2540



(นายอานวย วีรรณ)

รัฐมนตรีว่าการกระทรวงการคลัง

ประธานกรรมการ คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์