

27 กุมภาพันธ์ 2547

เรียน ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ทุกแห่ง

ที่ กต.ธ.(ว) 12 /2547 เรื่อง Turnover list

ตามที่สำนักงานได้เผยแพร่ Turnover list ของหุ้นที่มีอัตราการซื้อขายหมุนเวียนต่อสัปดาห์สูงสุด (1 W-Turnover) 50 อันดับแรกเป็นรายสัปดาห์ผ่านเว็บไซต์ของสำนักงาน และขอความร่วมมือให้บริษัทหลักทรัพย์จัดทำรายงานมูลค่าซื้อหุ้นที่เข้าข่ายต้องรายงาน นั้น

เพื่อให้ข้อมูลใน Turnover list สะท้อนภาวะการลงทุนได้ดีขึ้น รวมทั้งเพื่อมิให้เกิดผลกระทบต่อหุ้นที่เพิ่งเข้าจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์เป็นครั้งแรก (IPO) สำนักงานจึงได้ปรับปรุงวิธีการจัดทำ Turnover list ใหม่ ดังนี้

1. กรณีหุ้น IPO สำนักงานจะไม่นำมาคำนวณ 1 W-Turnover จนกว่าจะซื้อขายไปแล้วเป็นเวลา 4 สัปดาห์ เพื่อทอดระยะเวลาให้มีรูปแบบการซื้อขาย (trading pattern) ที่ชัดเจนเสียก่อน
2. ยกเลิกการประกาศรายซื้อหุ้นที่มี 1 W-Turnover ต่ำกว่า 20% เนื่องจากเห็นว่าไม่มีนัยสำคัญในการใช้เป็นข้อมูลบริหารความเสี่ยง
3. กรณีที่บริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ได้ยื่นรายงานผลการดำเนินงานล่าสุดต่อตลาดหลักทรัพย์แล้ว สำนักงานจะใช้ผลการดำเนินงานดังกล่าวมาคำนวณ P/E ratio
4. รายซื้อหุ้นที่เข้าข่ายต้องจัดทำรายงานมูลค่าซื้อต่อสำนักงานยังคงตามเกณฑ์เดิม กล่าวคือ เป็นหุ้นที่มีอยู่ใน Turnover list และเข้าเงื่อนไขใดเงื่อนไขหนึ่งดังต่อไปนี้
  - (1) มีค่า P/E สูงกว่า 100 เท่าขึ้นไป หรือ
  - (2) มีผลการดำเนินงานขาดทุน หรือ
  - (3) อยู่ในหมวด Rehabco

5. สำนักงานและสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ได้หารือและมีความเห็นร่วมกันว่า สมาชิกของสมาคมควรระงับการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหุ้น (margin loan) และการซื้อขายแบบชำระราคาสุทธิ (net settlement) ของหุ้นที่มี 1 W-Turnover ตั้งแต่ 100% ขึ้นไป และมี P/E สูงกว่า 100 เท่า หรือมีผลการดำเนินงานขาดทุน ซึ่งสำนักงานก็เห็นด้วย หุ้นดังกล่าวจึงจะแสดงเป็นแถบสีเทา และการดำเนินการดังกล่าวให้มีผลเป็นการชั่วคราวในสัปดาห์ถัดไป และให้รวมถึงใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นดังกล่าว ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย ที่มีหุ้นดังกล่าวเป็นหลักทรัพย์อ้างอิงด้วย

6. การปฏิบัติตามข้อเสนอของสมาคมนี้ ให้เริ่มในสัปดาห์วันจันทร์ที่ 8 มีนาคม 2547 โดยใช้ข้อมูลจาก Turnover list สัปดาห์ก่อนหน้า

นอกจากนี้ เพื่อให้ผู้ลงทุนทั่วไปเข้าใจรายงาน Turnover list ที่ถูกต้อง สำนักงานขอให้บริษัทหลักทรัพย์ชี้แจงต่อผู้ลงทุนตามรายละเอียดที่แนบมาพร้อมนี้ด้วย

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติต่อไป

ขอแสดงความนับถือ

(นายธีระชัย ภูวนาถนรานุบาล)

เลขาธิการ

สิ่งที่ส่งมาด้วย รายละเอียดเกี่ยวกับ Turnover list

ฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

โทร. 0-2252-3223 ต่อ 1228-9