

16 มกราคม 2547

เรียน ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ทุกแห่ง

ที่ กตต.ช. (ว) 1/2547 เรื่อง การจัดส่งรายงานการซื้อขายหลักทรัพย์

ด้วยสำนักงานมีความประสงค์จะจัดทำฐานข้อมูลที่แสดงถึงการซื้อขายหลักทรัพย์ทั้งระบบ สำหรับหลักทรัพย์บางหลักทรัพย์ที่มีปริมาณการซื้อขายอยู่ในระดับสูงเมื่อเทียบกับจำนวนหุ้นที่หมุนเวียน สำนักงานจึงได้จัดทำตารางแสดงรายชื่อหุ้นที่มีสัดส่วนจำนวนหุ้นที่ซื้อขายเปรียบเทียบกับจำนวนหุ้นที่หมุนเวียน (Adjusted Free Float) สำหรับ 50 อันดับแรก (Turnover List) พร้อมทั้ง P/E ratio และสถานะความเป็นหุ้นที่อยู่ในหมวดแก้ไขการดำเนินงาน (REHABCO) ในสัปดาห์ก่อนหน้า ดังตัวอย่างที่แนบมาพร้อมนี้ และต่อไปสำนักงานจะประกาศข้อมูลดังกล่าวใน website ของสำนักงานภายใต้ What 's New หัวข้อ Turnover List เป็นรายสัปดาห์

ในการนี้ สำนักงานขอความร่วมมือให้บริษัทหลักทรัพย์จัดทำรายงานชั่วคราวที่แสดงการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้านักลงทุนโดยไม่ต้องระบุชื่อลูกค้าแต่ละราย ทั้งนี้ เฉพาะหุ้นที่อยู่ใน Turnover List ที่มีลักษณะดังต่อไปนี้

1. หุ้นที่มี P/E Ratio เกิน 100 หรือหุ้นที่บริษัทมีผลการดำเนินงานขาดทุน
2. หุ้นที่อยู่ในหมวดแก้ไขการดำเนินงาน (REHABCO)

ทั้งนี้ ให้จัดทำและจัดส่งรายงานดังกล่าวให้สำนักงานเป็นรายสัปดาห์ภายใน 7 วัน นับแต่สิ้นสุดสัปดาห์ โดยเริ่มตั้งแต่ข้อมูลของสัปดาห์แรกของเดือนกุมภาพันธ์ 2547 เป็นต้นไป

สำหรับบริษัทหลักทรัพย์ใดที่ไม่สามารถจัดส่งข้อมูลดังกล่าวได้ภายในเวลาที่กำหนด ขอให้ดำเนินการขอ
ผ่อนผันพร้อมทั้งแสดงเหตุผลประกอบเป็นรายกรณี

จึงเรียนมาเพื่อ โปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

(นายธีระชัย ภูวนาถนรานุบาล)

เลขาธิการ

- สิ่งที่ส่งมาด้วย
1. [ตัวอย่าง Turnover List ของสัปดาห์สิ้นสุดวันที่ 9 มกราคม 2547](#)
 2. [ตัวอย่างแบบรายงาน](#)

ฝ่ายกำกับธุรกิจนายหน้าและค้าหลักทรัพย์

โทร. 0-2252-3223 ต่อ 1214, 1219