



ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย The Stock Exchange of Thailand

ที่ กล. (ว.) 30 /2550

15 พฤศจิกายน 2550

เรื่อง การส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ที่เข้าจดทะเบียนวันแรก
เรียน กรรมการผู้จัดการ
บริษัทสมาชิกและ บริษัทหลักทรัพย์ที่มีสมาชิกทุกบริษัท
อ้างถึง หนังสือเวียน ที่ กล. (ว.) 20/2549 เรื่องขอให้ระมัดระวังในการส่งคำสั่งซื้อขายประเภท ATO/ATC
ลงวันที่ 12 กรกฎาคม 2550

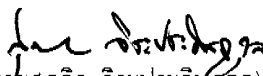
ตามที่ตลาดหลักทรัพย์ได้เคยส่งหนังสือเวียนแจ้งให้สมาชิกใช้ความระมัดระวังในการส่งคำสั่งซื้อขายประเภท At the Open / At the Close (ATO/ATC) รายละเอียดตามหนังสือที่อ้างถึงนั้น

ในช่วงที่ผ่านมา ตลาดหลักทรัพย์พบว่าการซื้อขายหลักทรัพย์ที่เข้าจดทะเบียนในวันแรก ซึ่งระบบการซื้อขายไม่ได้กำหนดกรอบราคา (Ceiling / Floor) มีการส่งคำสั่งในช่วงก่อนเปิดการซื้อขาย (Pre-open) ที่ทำให้ราคาคาดว่าจะเป็น (Projected Open Price) มีความผันผวนสูงมาก เช่น หลักทรัพย์มีราคา IPO 3 บาท แต่ราคา Projected Open Price ในบางช่วงเวลาสูงถึง 240 บาท โดยส่วนหนึ่งเกิดจากมีปริมาณหุ้นเสนอซื้อที่ราคา ATO จำนวนหลายล้านหุ้น ซึ่งหากมีการจับคู่ซื้อขายจริงที่ราคาดังกล่าว จะส่งผลเสียหายต่อบริษัท และผู้ซื้อเป็นจำนวนมาก

ตลาดหลักทรัพย์จึงขอเรียนย้ำให้บริษัทฯ ควบคุมดูแลการส่งคำสั่งของเจ้าหน้าที่บริษัทฯ รวมทั้งลูกค้าที่ส่งคำสั่งซื้อขายด้วยตนเองทางอินเทอร์เน็ตให้ส่งคำสั่งในราคาที่เหมาะสม และเป็นไปตามความประสงค์ที่แท้จริง สำหรับการส่งคำสั่งประเภท ATO และ ATC นั้น บริษัทควรดำเนินการให้เจ้าหน้าที่ผู้ส่งคำสั่งและผู้ลงทุนต้องตระหนักถึงความเสี่ยงด้านราคาที่อาจผันผวน รวมทั้งติดตามราคาที่คาดว่าจะเปิด/ปิด (Projected Open Price / Projected Close Price) อย่างใกล้ชิด โดยเฉพาะในหลักทรัพย์ที่ไม่ได้กำหนดกรอบราคา (Ceiling / Floor) เช่นหลักทรัพย์ที่เข้าซื้อขายในวันแรก, หลักทรัพย์ที่เปิดให้ซื้อขายวันแรกหลัง SP เกิน 1 ปี และ หลักทรัพย์ที่ซื้อขายบนกระดานต่างประเทศ เป็นต้น

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ


(นายสุภกิจ จิระประดิษฐ์กุล)

ผู้ช่วยผู้จัดการ

ลงนามแทน

กรรมการและผู้จัดการ

ส่วนระบบซื้อขายหลักทรัพย์
ฝ่ายกำกับกรซื้อขายหลักทรัพย์
โทร 0-2229-2582-6