

**แนวทางการปฏิบัติงานด้านการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นการซื้อขายรายใหญ่
(Block Trading Transaction)**

ตามหลักเกณฑ์ 405.02 ของข้อบังคับของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า จะกำหนดแนวทางการปฏิบัติงานด้านการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trading Transaction) และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออกแนวทางการปฏิบัติงานด้านการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trading Transaction) ฉบับลงวันที่ 17 พฤษภาคม 2562 นั้น ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าขอยกเลิกแนวทางการปฏิบัติงานของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าว

เพื่อให้การซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trading Transaction) ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าด้วยระบบการซื้อขายเป็นไปอย่างราบรื่น และเพื่อป้องกันความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดให้สมาชิกปฏิบัติตามแนวทางดังนี้

การบันทึกการซื้อขาย Block Trading Transaction

1. ให้การบันทึกการซื้อขาย Block Trading Transaction ในแต่ละครั้งมีจำนวนซื้อขายขั้นต่ำดังต่อไปนี้

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	จำนวนซื้อขายขั้นต่ำ
1. Single Stock Futures (SSF) ที่มีหุ้นสามัญเป็นสินค้าอ้างอิง ดังนี้	
(1) ADVANC, AEONTS, AOT, BBL, BH, BJC, CBG, CPALL, CPN, DELTA, EGCO, GLOW, GPSC, GULF, INTUCH, IVL, KBANK, KKP, PTTEP, PTTGC, RATCH, ROBINS, SAWAD, SCB, SCC, TCAP, TISCO, TOP	20 สัญญา
(2) AMATA, BA, BANPU, BAY, BCH, BCP, BCPG, BDMS, BGRIM, BLA, BTS, CENTEL, CK, COM7, CPF, DTAC, EA, ESSO, GFPT, GLOBAL, HANA, HMPRO, KCE, KTB, KTC, LH, MAJOR, MEGA, MINT, MTC, PSH, PTG, PTT, RS, SPALI, SPCG, STA, STEC, TASCO, THAI, TTW, TU, TVO, UNIQ	100 สัญญา
(3) AAV, AP, BEAUTY, BEC, BEM, BLAND, CHG, CKP, EPG, ERW, GUNKUL, ICHI, IRPC, ITD, JAS, LPN, ORI, PLANB, PRM, PSL, QH, S, SAMART, SGP, SIRI, SPRC, STPI, THANI, THCOM, TKN, TMB, TPIPL, TRUE, TTA, TTCL, VGI, VNG, WHA	500 สัญญา

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	จำนวนซื้อขายขั้นต่ำ
(4) SUPER	1,000 สัญญา
2. สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอื่น ๆ	
(1) กลุ่มที่ 1 ได้แก่ SET50 Index Futures SET50 Index Options Baht/USD Futures	100 สัญญา
(2) กลุ่มที่ 2 ได้แก่ Sector Futures 50 Baht Gold Futures 10 Baht Gold Futures Gold-D Futures Gold Online Futures RSS3 Futures RSS3D Futures 5 Year Government Bond Futures 3M BIBOR Futures	20 สัญญา

2. ให้การบันทึกการซื้อขาย Block Trading Transaction กระทำได้ในช่วงเวลาซื้อขาย Morning Session Afternoon Session และ Open Session ตามที่กำหนดไว้ในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแต่ละแบบ

3. การซื้อขาย Block Trading Transaction ให้สมาชิกจัดให้มีการตรวจสอบความถูกต้องของการบันทึกการซื้อขายให้มีรายการตามหลักเกณฑ์ 405.02-1 ทั้งนี้ สำหรับรายการตามหลักเกณฑ์ 405.02-1 (9) “หมายเลขเจ้าหน้าที่รับอนุญาต” ให้บันทึกตามแนวทางการปฏิบัติงานด้านการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด

4. ราคาในการบันทึกการซื้อขาย Block Trading Transaction ต้องเป็นราคาที่ไม่เกินกว่าค่าสูงสุดของการเปลี่ยนแปลงราคาซื้อขายสูงสุดในแต่ละวัน (Daily Price Limit) ตามที่กำหนดในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแต่ละแบบ และเป็นราคาที่ตรงตามช่วงราคาซื้อขายขั้นต่ำ (Minimum Tick Size) ดังต่อไปนี้

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า	ช่วงราคาซื้อขายขั้นต่ำ
SET50 Index Futures SET50 Index Options Sector Futures	0.00001 จุด
Single Stock Futures Baht/USD Futures RSS3 Futures และ RSS3D Futures	0.00001 บาท
5 Year Government Bond Futures 3M BIBOR Futures	0.00001
50 Baht Gold Futures 10 Baht Gold Futures	0.01 บาท
Gold-D Futures Gold Online Futures	0.00001 ดอลลาร์ สหรัฐอเมริกา

ทั้งนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 2 มกราคม 2563 เป็นต้นไป