

สมาคมบริษัท
หลักทรัพย์ไทย
ASCO

ASSOCIATION OF THAI SECURITIES COMPANIES

ISSUE 02 | APRIL - JUNE 2024

<https://www.asco.or.th>

Newsletter



0-2264-0909



asco@asco.or.th



การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญ

- สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย
- กิจกรรมของชมรมต่างๆ
- สถาบันฟิออรัม ATI
- Capital Markets Note
- Market & Securities Industry Statistics

สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

• ร่วมกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้องและสมาชิกที่เข้าร่วมโครงการให้ความเห็นแนวทางการดำเนินโครงการ Digital Infrastructure for Capital Market (DIF)

• ร่วมกับตลาดหลักทรัพย์ฯ และสำนักงาน ก.ล.ต. ทหารเรือเกี่ยวกับการทบทวนและปรับปรุงหลักเกณฑ์เพื่อป้องกันเหตุการณ์ทำนองเดียวกับการซื้อขายหุ้น MORE และแนวทางการพัฒนาศูนย์ข้อมูล Securities Bureau อย่างต่อเนื่อง โดยเมื่อเดือนมิถุนายน 2567 ได้นำเสนอโครงการแลกเปลี่ยนข้อมูลลูกค้าเพื่อการเปิดการซื้อขายหลักทรัพย์และให้เงินซื้อขายแก่ลูกค้าของ บล. (Data Exchange Platform) เพื่อขอเงินทุนสนับสนุนจากกองทุนส่งเสริมการพัฒนาตลาดทุน (CMDP) ในการพัฒนาระบบในลักษณะที่เป็นศูนย์กลางในการแลกเปลี่ยนข้อมูล ซึ่งดำเนินการโดย บริษัท เนชั่นแนล ดิจิทัลไอดี จำกัด (NDID) ในระยะ 2 ปี (2567 - 2569)

• ร่วมกับสมาชิกให้ข้อมูลเพิ่มเติมเพื่อประกอบการศึกษาประเด็นอุปสรรคที่เสนอภายใต้โครงการกียอดิน กฎระเบียบตลาดทุน โดยมีสถาบันวิจัยเพื่อการพัฒนาประเทศไทย (TDRI) เป็นผู้วิจัย

• ดำเนินการเรื่องต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับสำนักงาน ก.ล.ต. ดังนี้

- ร่วมกับสำนักงาน ก.ล.ต. จัดการประชุมรายครึ่งปี ครั้งที่ 1/2567 เพื่อรับทราบนโยบายและแนวทางการทำงานของสำนักงาน ก.ล.ต. รวมถึงแลกเปลี่ยนความคิดเห็นเกี่ยวกับปัญหาและอุปสรรคในการประกอบธุรกิจ โดยสมาคมฯ ได้นำเสนอภาวะการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ รวมถึงจัดทำข้อเสนอในประเด็นต่างๆ เพื่อหารือร่วมกัน

- คณะทำงานร่วมหารือและให้ความเห็นในประเด็นต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการพัฒนาชุดข้อมูลทรัพย์สินลูกค้า โดยสมาคมฯ ได้ประชาสัมพันธ์ให้สมาชิกเข้าร่วมการประชุม Focus Group การเปิดรับฟังความเห็นในเรื่องดังกล่าว

- ผลักดันให้สำนักงาน ก.ล.ต. จัดการประชุมชี้แจงแนวทางการสนับสนุน Investment Token ในตลาดแรกและตลาดรอง

- จัดทำข้อมูลและประชาสัมพันธ์ให้คณะทำงานพิจารณา

ให้ความเห็นต่อการรับฟังความคิดเห็นของสำนักงาน ก.ล.ต. ในเรื่องการปรับเกณฑ์ NC

• จัดตั้งคณะทำงานกำหนดแนวปฏิบัติ Short/Long Sell โดยจัดให้มีการหารือเพื่อแลกเปลี่ยนความเห็นอย่างต่อเนื่อง รวมถึงประสานงานไปยังตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อขอความอนุเคราะห์ด้านข้อมูลสถิติที่เกี่ยวข้องเพื่อเป็นข้อมูลสนับสนุนการกำหนดแนวทางปฏิบัติข้างต้น

• หารือกับตัวแทนบริษัทสมาชิกเพื่อหาแนวทางในการลดอุปสรรคเกี่ยวกับการให้บริการผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนที่ปั่นสกุลเงินตราต่างประเทศ ตามข้อ 12 (1) ของประกาศ ที่ ทธ.1/2560 ที่กำหนดให้ตัวผลิตภัณฑ์ต้องมีลักษณะและเงื่อนไขทำนองเดียวกับผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนที่สามารถออกหรือเสนอขายในประเทศไทย

• ประชาสัมพันธ์ให้สมาชิกเข้าร่วมการประชุมเตรียมความพร้อมการรายงานข้อมูลบัญชีทางการเงิน ตาม FATCA และ CRS โดยกรมสรรพากร รวมถึงแจ้งร่างแนวคำตอบสำหรับประเด็นคำถาม FATCA และ CRS ที่จัดทำโดยกรมสรรพากรไปยังสมาชิก

• ร่วมประชุมรายไตรมาส FETCO และสำนักงาน ก.ล.ต. ครั้งที่ 1/2567 มีวาระการประชุมที่สำคัญในการหารือรายละเอียดการจัดตั้งกองทุนรวมภาษีเพื่อพัฒนาตลาดทุนไทย

• เข้าร่วมการประชุม The 37th ICSA Annual General Meeting 2024 ณ กรุงแฟรงก์เฟิร์ต ประเทศประเทศเยอรมนี



เอกสารฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (สมาคม) เพื่อเผยแพร่ข้อมูลที่เป็นประโยชน์ภายในหน่วยงานสมาชิกของสมาคม และบุคคลภายนอกที่สนใจศึกษาเท่านั้น การนำข้อมูล ข่าวสารที่ปรากฏในเอกสารนี้ไปใช้ ควรใช้ความระมัดระวังและพิจารณาถึงความเสี่ยงที่ต้องครบถ้วน และความเป็นปัจจุบันของข้อมูลด้วยเป็นเพียงข้อมูล ณ วันที่ปรากฏในเอกสารจึงอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังวันดังกล่าว ทั้งนี้ สมาคมไม่รับผิดชอบ และไม่อาจรับประกันได้ว่า ในกรณีใดๆ ในผลจากการนำข้อมูลข่าวสารไปใช้ รวมถึงไม่สามารถรับผิดชอบต่อผู้หรือบุคคลใดๆ จากการเรียกหรือใดๆ ไม่ว่าในทางสัญญา ในการทำละเมิด รวมถึงความประมาท หรือเหตุอื่นใด ที่เกิดจากเนื้อหา หรือจากการใช้ การตัดสินใจ หรือการกระทำใดๆ ที่เกิดจากความเชื่อในเนื้อหาดังกล่าวของผู้ใช้ หรือในความเสียหาย ความสูญเสีย ค่าสินไหมทดแทน หรือความรับผิดชอบใดๆ ถึงแม้ว่าสมาคมจะได้รับแจ้งว่าจะเกิดความเสียหายดังกล่าวขึ้นได้ก็ตาม หากท่านได้รับเอกสารฉบับนี้โดยไม่ใช้สมาชิกหรือในฐานะตัวแทนของสมาชิกสมาคม โปรดทราบว่ากรมเผยแพร่แจกจ่ายหรือคัดลอกเอกสารนี้ ไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วนเป็นสิ่งต้องห้ามโดยเด็ดขาด



• เข้าเฝ้าทูลละอองพระบาทถวายเงินรายได้จากการจัดแข่งขัน Broker Badminton Championship 2024 ซึ่งถวายพระราชทาน สมเด็จพระกนิษฐาธิราชเจ้า กรมสมเด็จพระเทพรัตนราชสุดาฯ สยามบรมราชกุมารี จำนวน 200,000 บาท โดยเสด็จพระราชกุศล ตามพระราชอัธยาศัย

• เข้าร่วมพิธีเปิดและส่งมอบสนามกีฬาเทเบิลเทนนิส ศูนย์กีฬา เบญจกิติให้แก่กรุงเทพมหานคร ซึ่งเป็นการพัฒนาร่วมกันระหว่าง ตลาดหลักทรัพย์ฯ และสมาคมเทเบิลเทนนิสฯ เพื่อเป็นสถานที่ ออกกำลังกายและพัฒนาทักษะกีฬาเทเบิลเทนนิสให้แก่เยาวชน และประชาชนทั่วไป



ชมรมวาณิชธนกิจ

การเสนอความคิดเห็น/หารือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง

สำนักงาน ก.ล.ต.

• การหารือเรื่องการจัดเสวนาเกี่ยวกับประเด็นที่พบจากการ ยื่นคำขออนุญาตออกและเสนอขายหลักทรัพย์ (IPO)

• การเสนอความคิดเห็นเรื่อง “ร่างพระราชบัญญัติหลักทรัพย์ และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ ...) พ.ศ. ...”

• การประชุมเพื่อรับฟังและแสดงความคิดเห็นเรื่อง “แนวทางการสนับสนุน Investment Token ในตลาดแรกและตลาดรอง” ร่วมกับบริษัทสมาชิกสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

ตลาดหลักทรัพย์ฯ

• การเสนอความคิดเห็นเรื่อง “การยกระดับมาตรการกำกับดูแล”

• การเสนอความคิดเห็นเรื่อง “การยกระดับมาตรการกำกับดูแล การซื้อขายที่ไม่เหมาะสมและลดความผันผวนที่ผิดปกติของราคา”

สำนักงาน ป.ป.ง.

• การส่งผู้แทนเข้าร่วมประชุมเพื่อแสดงความคิดเห็นโครงการสำรวจความเชื่อมั่นต่อการปฏิบัติงานของสำนักงาน ป.ป.ง. ประจำปีงบประมาณ 2567

การจัดอบรม/สัมมนา

• การจัดสัมมนาเรื่อง “การควบรวมกิจการและการทำประกันภัย (Warranty & Indemnity) เพื่อการซื้อขายกิจการให้ประสบผลสำเร็จ”

• การจัดอบรมและทดสอบหลักสูตรที่ปรึกษาทางการเงิน ครั้งที่ 1/2567 รวมทั้งจัดให้มีการรับชมเทปบันทึกภาพการอบรม หลักสูตรที่ปรึกษาทางการเงินผ่านระบบ e-Learning

กิจกรรมอื่นๆ

• การจัดโครงการการแข่งขันกรณีศึกษาด้านวาณิชธนกิจ

• เข้าร่วมการประชุม ICSA VIRTUAL ISSUES BRIEFING เพื่อรับทราบความคืบหน้าสถานการณ์ต่างๆ ของธุรกิจหลักทรัพย์ในระดับนานาชาติ ในรูปแบบออนไลน์

• เข้าร่วมงาน Capital Market Experience Sharing Forum โดย CMDF และ AIMC หัวข้อเสวนา “Platform for Sustainable Recovery & Springboard for Accelerating Growth” Lessons learned from Japan & India Capital Market Experiences

• ให้สัมภาษณ์และให้ข้อมูลต่อมูลนิธิสถาบันวิจัยนโยบาย เศรษฐกิจการคลัง “โครงการวิเคราะห์ช่องว่างการบริหารจัดการ Conduct Risks ในตลาดทุนไทยเมื่อเทียบกับต่างประเทศ”

• ให้สัมภาษณ์และให้ข้อมูลแก่ TDRI เพื่อศึกษาวิจัยในโครงการ “การยกระดับการออมผ่านช่องทางตลาดทุน”

• ร่วมเป็นกรรมการตัดสินการแข่งขันกรณีศึกษาด้านการวิเคราะห์ทางการเงินและการจัดการลงทุน ในกิจกรรม Exclusive Financial Career Camp ภายใตโครงการ New Breed Capital Market Financial Professionals 2024 จัดโดยตลาดหลักทรัพย์ฯ



เพื่อตลาดทุน (CMCC) ปี 2567 (เป็นปีที่สองจากระยะเวลาดำเนินโครงการ 3 ปี) ร่วมกับ บริษัท ฟินคอร์ป แอดไวซอรี จำกัด โดยได้มีการประชุมคณะกรรมการโครงการ CMCC ครั้งที่ 2/2567 เมื่อวันที่ 29 เมษายน 2567 และครั้งที่ 3/2567 เมื่อวันที่ 17 มิถุนายน 2567



ชมรมผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

การเสนอความคิดเห็น/หารือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง สำนักงาน ก.ล.ต.

- การเสนอความคิดเห็นในเรื่องต่างๆ ดังนี้
 - การปรับปรุงหลักเกณฑ์การดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในส่วนนิยามหนี้สินโดยสิทธิที่ใช้ในการดำรงเงินกองทุน (อนป. 23/2567)
 - การเข้าร่วมประชุมรายครึ่งปีครั้งที่ 1/2567 กับเลขาธิการและผู้บริหารของสำนักงาน ก.ล.ต. เพื่อรับทราบนโยบายและแนวทางการทำงาน รวมถึงแลกเปลี่ยนความคิดเห็นเกี่ยวกับปัญหาและอุปสรรคในการประกอบธุรกิจ เมื่อวันที่ 9 พฤษภาคม 2567
 - การเข้าร่วมประชุม Focus Group เพื่อแสดงความคิดเห็นและข้อเสนอแนะในการปรับปรุงหลักเกณฑ์การจัดทำและยื่นรายงานของ บล. และผู้ประกอบการสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เมื่อวันที่ 30 พฤษภาคม 2567
 - การประชุมเพื่อรับฟังและแสดงความคิดเห็นเรื่อง “แนวทางการสนับสนุน Investment Token ในตลาดแรกและตลาดรอง” ร่วมกับบริษัทสมาชิกชมรมวานิชธนกิจ
 - การร่วมหารือและปรับปรุงแนวปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trade) สำหรับ Single Stock Futures

ตลาดหลักทรัพย์ฯ

- การหารือเกี่ยวกับแนวทางการอนุญาตให้นักลงทุนทั่วไปสามารถเปิดสถานะทั้ง Long และ Short ในสัญญาเดียวกันได้
- การร่วมประชุมชี้แจงและตอบข้อซักถามเกี่ยวกับรายละเอียดการเปิดเผยข้อมูลการโอนหลักทรัพย์ เพื่อเป็นข้อมูลให้ บล. ใช้ประกอบการบริการความเสี่ยง เมื่อวันที่ 29 เมษายน 2567

กรมสรรพากร

- การเข้าร่วมการประชุมเตรียมความพร้อมการรายงานข้อมูลบัญชีทางการเงินตาม FATCA และ CRS เมื่อวันที่ 14 มิถุนายน 2567

การจัดอบรม/สัมมนา

- การสำรวจความคิดเห็นเกี่ยวกับหัวข้อการจัดอบรมให้ความรู้แก่ผู้แนะนำการลงทุนและนักวิเคราะห์การลงทุนด้านสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ประจำปี 2567

กิจกรรมอื่นๆ

- การรับฟังความคิดเห็นเกี่ยวกับการปรับปรุงแนวปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trade) สำหรับ Single Stock Futures จากบริษัทสมาชิก เมื่อวันที่ 29 พฤษภาคม 2567 - 11 มิถุนายน 2567



ชมรมผู้ดูแลการปฏิบัติงานด้านหลักทรัพย์

การเสนอความคิดเห็น/หารือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง สำนักงาน ก.ล.ต.

- การหารือเรื่องประเด็นปัญหา อุปสรรค ข้อเสนอในการให้บริการธุรกรรมเกี่ยวกับ NVDR ของบริษัทหลักทรัพย์ เมื่อวันที่ 3 เมษายน 2567
- การร่วมให้ความคิดเห็นต่อการปรับปรุงแนวทางการปฏิบัติงานเรื่องการพิจารณากำหนดวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าสืบเนื่องจากกรณีการซื้อขายหลักทรัพย์บริษัท มอร์ รีเทิร์น จำกัด (มหาชน) (“MORE”) โดยมีกำหนดสิ้นสุดการรับฟังความคิดเห็น เมื่อวันที่ 31 พฤษภาคม 2567
- การเข้าร่วมประชุม Focus Group เพื่อแสดงความคิดเห็นและข้อเสนอแนะในการปรับปรุงหลักเกณฑ์การจัดทำและยื่นรายงานของ บล. และผู้ประกอบการสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เมื่อวันที่ 30 พฤษภาคม 2567

ตลาดหลักทรัพย์ฯ

- การร่วมประชุมชี้แจงและตอบข้อซักถามเกี่ยวกับรายละเอียดการเปิดเผยข้อมูลการโอนหลักทรัพย์ เพื่อเป็นข้อมูลให้ บล. ใช้ประกอบการบริการความเสี่ยง เมื่อวันที่ 29 เมษายน 2567

- การร่วมให้ความคิดเห็นกับตลาดหลักทรัพย์ฯ ในเรื่องดังนี้
 - การยกระดับมาตรการกำกับดูแลของตลาดหลักทรัพย์ฯ
 - การปรับปรุงหลักเกณฑ์การคัดเลือกหลักทรัพย์ของดัชนี

SET50/SET100

- การกำหนดมาตรการจากการเปิดเผยข้อมูลลูกค้าที่ส่งคำสั่งไม่เหมาะสม

- สำนักรวบรวมความคิดเห็นการจัดกิจกรรม Compliance สัมพันธ์ประจำปี 2567

สำนักงาน ปปง.

- เสนอความคิดเห็นต่อรายงานผลการดำเนินงานตามแผนปฏิบัติการด้าน AML/CFT ประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2567 รอบไตรมาสที่ 2

- การส่งผู้แทนเข้าร่วมประชุมเพื่อแสดงความคิดเห็นโครงการสำรวจความเชื่อมั่นต่อการปฏิบัติงานของสำนักงาน ปปง. ประจำปีงบประมาณ 2567

หน่วยงานอื่น

- การร่วมประชุมเตรียมความพร้อมการรายงานข้อมูลบัญชีทางการเงินตาม FATCA และ CRS จัดโดย กรมสรรพากร

- การร่วมให้ความเห็นต่อการจัดทำร่างข้อเสนอแนะมาตรฐานว่าด้วยการพิสูจน์และยืนยันตัวตนทางดิจิทัล - คนต่างด้าวที่ทำธุรกรรมในประเทศไทย เพื่อเป็นข้อกำหนดสำหรับผู้พิสูจน์และยืนยันตัวตน (identity provider: IdP) ในการพิสูจน์ตัวตนของคนต่างด้าวที่ประสงค์จะใช้บริการหรือทำธุรกรรมทางอิเล็กทรอนิกส์ในประเทศไทย



ชมรมปฏิบัติการหลักทรัพย์

การเสนอความคิดเห็น/หารือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง สำนักงาน ก.ล.ต.

- การหารือเรื่อง ประเด็นปัญหา อุปสรรค ข้อสงสัยในการให้บริการธุรกรรมเกี่ยวกับ NVDR ของบริษัทหลักทรัพย์ เมื่อวันที่ 3 เมษายน 2567

- การร่วมให้ความเห็นต่อการปรับปรุงแนวทางการปฏิบัติงานเรื่องการพิจารณากำหนดวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าสืบเนื่องจากกรณีการซื้อขายหลักทรัพย์บริษัท มอร์ริเทิร์น จำกัด (มหาชน) (“MORE”) โดยมีกำหนดสิ้นสุดการรับฟังความคิดเห็นเมื่อวันที่ 31 พฤษภาคม 2567

- การเข้าร่วมประชุม Focus Group เพื่อแสดงความคิดเห็นและ

ข้อเสนอแนะในการปรับปรุงหลักเกณฑ์การจัดทำและยื่นรายงานของ บล. และผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เมื่อวันที่ 30 พฤษภาคม 2567

ตลาดหลักทรัพย์ฯ

- การร่วมประชุมชี้แจงและตอบข้อซักถามเกี่ยวกับรายละเอียดการเปิดเผยข้อมูลการโอนหลักทรัพย์ เพื่อเป็นข้อมูลให้ บล. ใช้ประกอบการบริการความเสี่ยง เมื่อวันที่ 29 เมษายน 2567

- การร่วมหารือกับกรรมการ Custodian และผู้แทนจากศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ในเรื่องแนวทางการนำเสนอรายงาน NVDR เมื่อวันที่ 28 พฤษภาคม 2567

- การร่วมหารือกับตลาดหลักทรัพย์ฯ ในเรื่องดังนี้

- แนวทางการพัฒนา DR & DRX
- การคำนวณหลักประกันระหว่างวันใน Securities Market
- การเลื่อนเวลาคำนวณหลักประกัน/ค่าความเสี่ยงระหว่างวันของทั้ง 2 ตลาด

- การแจ้งอัตราหลักประกันกรณีมี Corporate Action

- แนวทางการพัฒนาระบบ Pre-settlement Matching System (PSMS) และแนวทางการระบุ code SBL ในคำสั่ง PSMS

- แนวทางการจัดส่งเอกสารทางอิเล็กทรอนิกส์ให้กับผู้ถือหลักทรัพย์

- แนวทางสนับสนุนการพัฒนาแหล่งระดมทุน EEC

- การปรับปรุงหลักเกณฑ์การซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด (ฉบับปรับปรุง)

หน่วยงานอื่น

- การร่วมหารือกับสมาคมฯ เรื่อง แนวปฏิบัติ short/long sell สำหรับกลุ่ม บล. ที่ลูกค้าใช้และไม่ได้ใช้บริการ settle ของ บล. เมื่อวันที่ 5 มิถุนายน 2567

- การร่วมให้ความเห็นต่อการจัดทำร่างข้อเสนอแนะมาตรฐานว่าด้วยการพิสูจน์และยืนยันตัวตนทางดิจิทัล - คนต่างด้าวที่ทำธุรกรรมในประเทศไทย เพื่อเป็นข้อกำหนดสำหรับผู้พิสูจน์และยืนยันตัวตน (identity provider: IdP) ในการพิสูจน์ตัวตนของคนต่างด้าวที่ประสงค์จะใช้บริการหรือทำธุรกรรมทางอิเล็กทรอนิกส์ในประเทศไทย

การจัดอบรม/สัมมนา

- การให้ความเห็นต่อศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาคความรู้ตลาดทุนตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (TSI) กับสถาบันฝึกอบรมสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (ATI) เกี่ยวกับหลักสูตรการจัดอบรมสำหรับบุคลากร BOO ประจำปี 2567



ชมรมเทคโนโลยีสารสนเทศ

การเสนอความคิดเห็น/หารือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง สำนักงาน ก.ล.ต.

- การร่วมให้ความคิดเห็นต่อการปรับปรุงแนวทางการปฏิบัติงาน เรื่อง การพิจารณากำหนดวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าสืบเนื่องจากกรณีการซื้อขายหลักทรัพย์บริษัท มอร์ รีเทิร์น จำกัด (มหาชน) (“MORE”) โดยมีกำหนดสิ้นสุดการรับฟังความคิดเห็นเมื่อวันที่ 31 พฤษภาคม 2567
- การเข้าร่วมประชุม Focus Group เพื่อแสดงความคิดเห็นและข้อเสนอแนะในการปรับปรุงหลักเกณฑ์การจัดทำและยื่นรายงานของ บล. และผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เมื่อวันที่ 30 พฤษภาคม 2567
- การเข้าร่วมการประชุม Cyber Club Q - Meeting ครั้งที่ 2/2567 เพื่อรับทราบความคืบหน้าของกฎหมาย กฎเกณฑ์ ข้อกำหนด และสถานการณ์ต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ เมื่อวันที่ 27 มิถุนายน 2567
- หารือความคืบหน้าและบทบาท หน้าที่การดำเนินงานภารกิจของ TCM-CERT ร่วมกับคณะทำงาน Sectorial CERT เมื่อวันที่ 25 เมษายน 2567

ตลาดหลักทรัพย์ฯ

- การปรับปรุงหลักเกณฑ์รองรับเหตุการณ์ทำนองเดียวกับหุ้น MORE
 - การร่วมประชุมชี้แจงและตอบข้อซักถามเกี่ยวกับรายละเอียดการเปิดเผยข้อมูลการโอนหลักทรัพย์ เพื่อเป็นข้อมูลให้ บล. ใช้ประกอบการบริการความเสี่ยง เมื่อวันที่ 29 เมษายน 2567
 - การประชุมหารือกับ SET เมื่อวันที่ 7 มิถุนายน 2567 เกี่ยวกับ
 - Securities Bureau
 - การเปิดเผยข้อมูล Net Settlement
 - การเปิดเผยข้อมูลบุคคลที่มีพฤติกรรมกำกวมส่งคำสั่งไม่เหมาะสม
 - การ Auto Halt
 - การเปิดเผยข้อมูลการโอนหลักทรัพย์
- การร่วมกิจกรรม “Data and AI Is Transforming the Fight Against Financial Crime” รับฟังการนำเสนอ global trend และการนำ AI มาใช้ช่วยเพิ่มประสิทธิภาพในการดำเนินงาน เมื่อวันที่ 5 มิถุนายน 2567

หน่วยงานอื่นๆ

- การร่วมทดสอบการรับ - ส่งข้อมูลจำลองให้ IRS ที่กรมสรรพากร ได้เปิดให้ทดสอบระบบการแลกเปลี่ยนข้อมูลตามความตกลง FATCA ผ่านระบบ IDES โดยสรรพากรสหรัฐฯ (IRS) เปิดระบบ IDES เพื่อให้สถาบันการเงินไทยทดลองรับ - ส่งข้อมูลจำลองแบบครบวงจร ตั้งแต่วันที่ 1 - 26 กรกฎาคม 2567
- โครงการการฝึกซ้อมแผนรับมือภัยคุกคามทางไซเบอร์ของภาคตลาดทุน (โครงการ CMX)
 - จัดทำโครงการ CMX ปี 2567 - 2569 เพื่อขอรับทุนสนับสนุนจากกองทุนส่งเสริมการพัฒนาตลาดทุน (CMDF)
 - เข้ารับการสัมภาษณ์รายละเอียดโครงการเพิ่มเติม พร้อมทั้งได้จัดทำข้อมูลเพิ่มเติมจากการสัมภาษณ์ให้ CMDF พิจารณา
 - ร่วมประชุมหารือร่วมกับที่ปรึกษาโครงการจำนวน 4 บริษัท เพื่อคัดเลือกให้ดำเนินโครงการ CMX



ชมรมบริหารทรัพยากรบุคคลบริษัทหลักทรัพย์

การเสนอความคิดเห็น/หารือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง สำนักงานส่งเสริมเศรษฐกิจดิจิทัล

- ร่วมประชุมเชิงปฏิบัติการเพื่อหารือแนวทางการยกระดับการจ้างงานกลุ่มเปราะบาง ด้วยเทคโนโลยีดิจิทัล เมื่อวันที่ 31 พฤษภาคม 2567

การจัดอบรม/สัมมนา

- การให้ความเห็นต่อศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (TSI) กับสถาบันฝึกอบรม สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (ATI) เกี่ยวกับหลักสูตรการจัดอบรมสำหรับบุคลากร HR ประจำปี 2567
- การบรรยายเรื่อง “Generative AI for HR” โดยคุณพชรนันท์ สุวรรณราช กรรมการชมรมฯ และทีมงานจากบริษัทหลักทรัพย์ อินโนเวสต์ เอกซ์ จำกัด เมื่อวันที่ 27 มิถุนายน 2567

กิจกรรมอื่นๆ

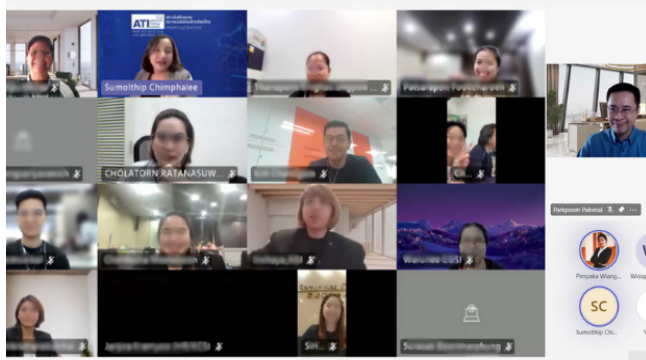
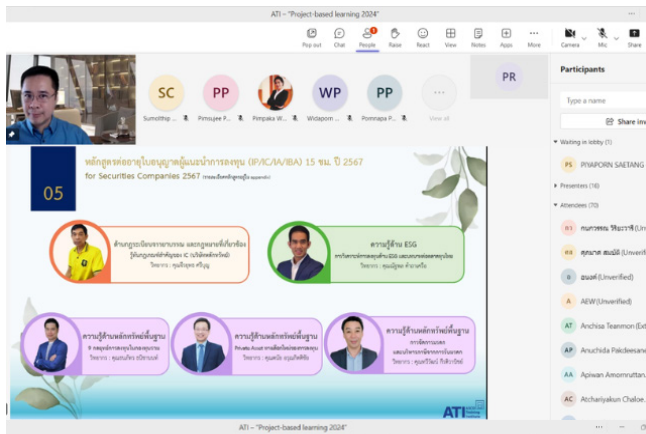
- ร่วมมือกับหน่วยงานต่างๆ ในการประชาสัมพันธ์ ดังนี้
 - ตลาดหลักทรัพย์ฯ ในการประชาสัมพันธ์เรื่อง “การจัดอบรมหลักสูตร Global Wealth Creation ภายใต้โครงการ Strengthening Financial Professionals @ Intermediaries 2024”
 - บริษัทวิลลิส ทาวเวอร์ส วัตสัน (ประเทศไทย) จำกัด ในการประชาสัมพันธ์งาน “WTW Compensation Survey Kick-off Meeting” จัดขึ้นเมื่อวันที่ 8 และ 10 พฤษภาคม 2567

การดำเนินงาน

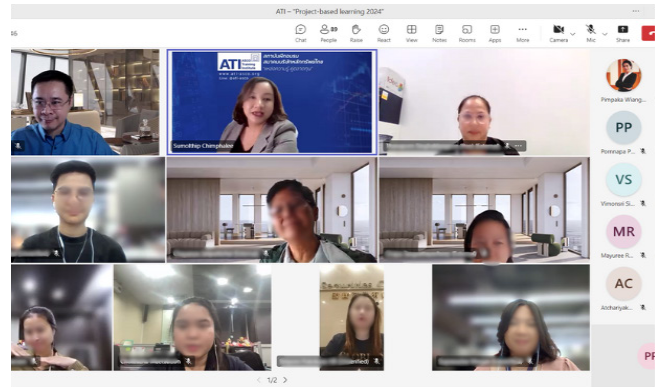
สถาบันฝึกอบรม สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (ATI) ดำเนินงานด้านพัฒนาและเผยแพร่ความรู้เกี่ยวกับการลงทุนในหลักทรัพย์ การวางแผนการลงทุนและการเงิน การดำเนินงานของธุรกิจหลักทรัพย์ และความรู้ที่เกี่ยวข้องกับตลาดทุนไทย

- จัดกิจกรรมงาน ATI – “Project-based learning 2024”

โดยเชิญบุคลากรฝ่ายทรัพยากรบุคคลบริษัทหลักทรัพย์เข้าร่วม
รับฟังแนวทางในการสร้างศักยภาพและพัฒนาทักษะความรู้
ให้แก่บุคลากรในธุรกิจหลักทรัพย์ เมื่อวันที่ 28 มิถุนายน 2024
เวลา 10.00 – 12.00 น. ระบบ Online (Microsoft Teams) ซึ่ง
ได้รับการตอบรับและสนใจจากผู้เข้าร่วมงานเป็นอย่างดี



ATI - “Project-based learning 2024” วันที่ 28 มิถุนายน 2567



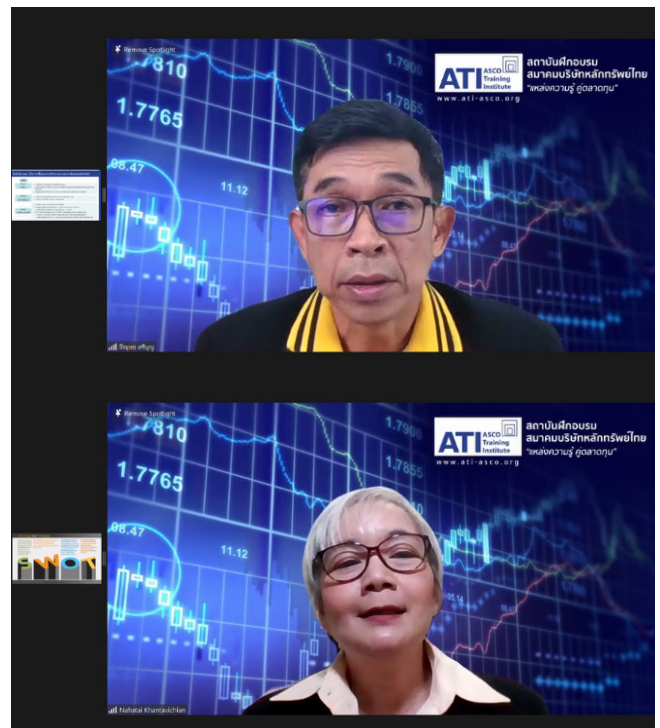
ATI - “Project-based learning 2024” วันที่ 28 มิถุนายน 2567

- จัดอบรม“หลักสูตรต่ออายุใบอนุญาตฯ (Refresher Course)”

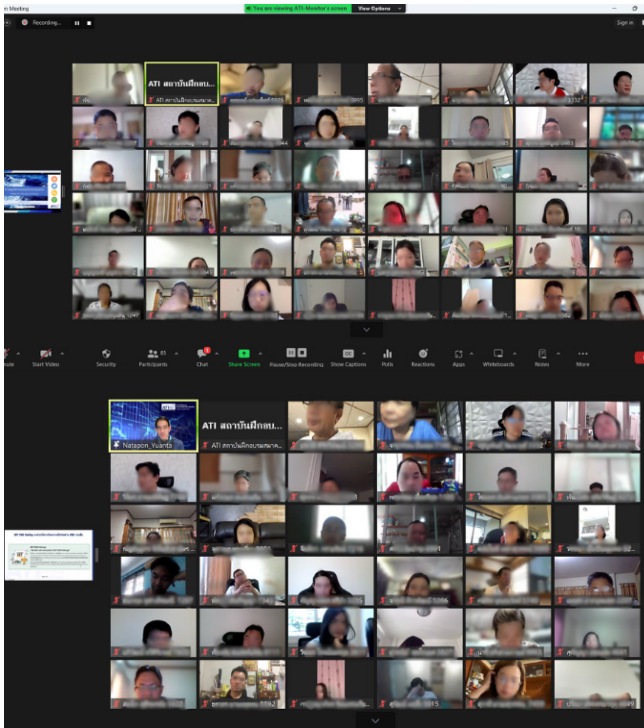
สำหรับผู้ที่ต้องการต่ออายุใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุน (IC Plain, IC Complex 1, 2, 3) ผู้วางแผนการลงทุน (IP) นักวิเคราะห์การลงทุน (IA) และผู้แนะนำลูกค้า (IBA) หรือผู้ที่ต้องการเพิ่มพูนความรู้ความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุนในตลาดทุน ในรูปแบบ ดังนี้

- ระบบ E-Learning ของ ATI มีระยะเวลาในการเรียน 60 วัน
- ระบบ Online (โปรแกรม ZOOM) (เหมาะสำหรับผู้ที่ไม่สามารถมาเรียนได้)

ต้องการอบรมให้แล้วเสร็จภายใน 2 วัน)



รอบอบรมวันที่ 15-16 มิถุนายน 2567 โปรแกรม ZOOM Meeting



รอบอบรมวันที่ 15-16 มิถุนายน 2567 โปรแกรม ZOOM Meeting

• จัดอบรม **หลักสูตรการวางแผนการเงิน CFP (CFP Module 1-6)** อบรมOnline (โปรแกรม ZOOM) สำหรับผู้ที่ต้องการ Upgradeใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุน (IC License) เป็นผู้วางแผนการลงทุน (IP License) หรือเพื่อให้ได้คุณวุฒิ CFP และสำหรับบุคคลทั่วไปที่ต้องการเพิ่มเติมความรู้เกี่ยวกับการลงทุน

- Module 1 จำนวน 1 รุ่น วันที่ 11-12, 18-19 พ.ค. 67
- Module 2 จำนวน 1 รุ่น วันที่ 20-21, 27-28 เม.ย. 67
- New Module 2 จำนวน 1 รุ่น วันที่ 22-23, 29-30 มิ.ย.

และ 6-7, 13-14 ก.ค. 67

- Module 3 จำนวน 1 รุ่น วันที่ 20-21, 27-28 เม.ย. 67
- Module 4 จำนวน 1 รุ่น วันที่ 11-12, 18-19 พ.ค. 67
- Module 5 จำนวน 1 รุ่น วันที่ 15-16, 22-23 มิ.ย. 67
- Module 6 จำนวน 1 รุ่น วันที่ 15-16, 22-23 มิ.ย. 67

• ดำเนินงานตามโครงการที่ได้รับทุนสนับสนุนจากกองทุนส่งเสริมการพัฒนาลาดทุน (CMDP) จำนวน 3 โครงการ ดังนี้

- **โครงการอบรมเพื่อยกระดับผู้แนะนำการลงทุน (IC)** เป็นการ จัดอบรมและทดสอบในหลักสูตร IC Complex P2 และ P3 และหลักสูตรนักวางแผนการเงิน (CFP) ตั้งแต่ Module ที่ 1 ถึง 6 ระยะเวลาโครงการตั้งแต่ปี 2564 - 2567 สำหรับผู้แนะนำการลงทุน (IC) ที่สังกัดบริษัทหลักทรัพย์ (บล.) และ ที่สังกัดบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน (บลจ.) รวมถึงนักศึกษาและอาจารย์จากมหาวิทยาลัยต่างๆ โดยตั้งแต่ปี 2564 จนถึงเดือนมิถุนายน ปี 2567 มี IC เข้าร่วมโครงการทั้งหมด 5,167 คน นักศึกษาจาก

มหาวิทยาลัยต่างๆ จำนวน 1,130 คน และมีอาจารย์มหาวิทยาลัยเข้าร่วมโครงการจำนวน 14 คน

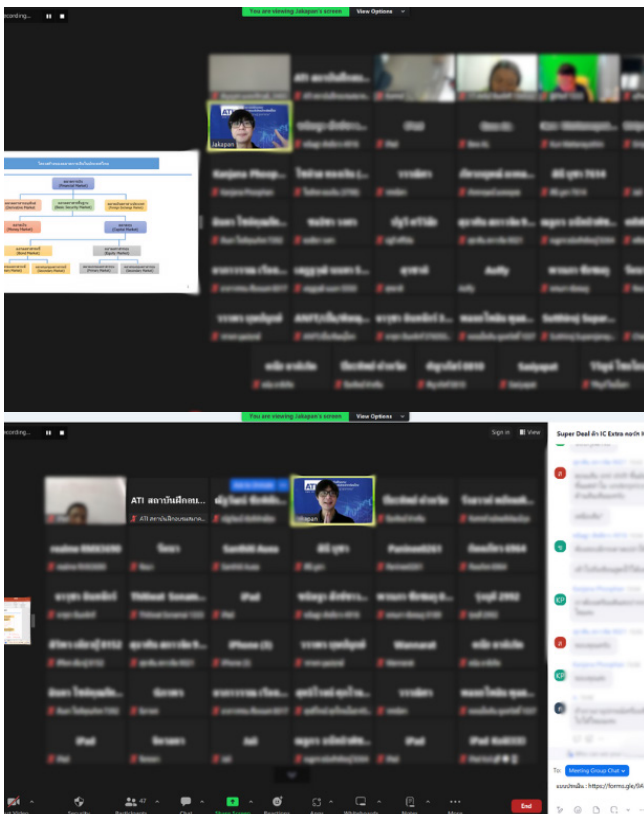
- โครงการสนับสนุนทุนการสอบใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุนสำหรับนักศึกษาในมหาวิทยาลัย ทางสมาคมฯ ได้ตระหนักเห็นความสำคัญและความจำเป็นในการสรรหาและสร้างบุคลากรด้านผู้แนะนำการลงทุนรุ่นใหม่ที่จะเพิ่มเติม เพื่อทดแทนบุคลากรที่มีโอกาสจะเกษียณอายุและออกจากธุรกิจ โดยให้ทุนสนับสนุนค่าใช้จ่ายการทดสอบใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุนตราสารทั่วไป (IC Plain : P1) สำหรับนักศึกษาในมหาวิทยาลัยทั่วประเทศที่เรียนวิชาที่มีการนำเอาผลการสอบใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุนตราสารทั่วไป (IC Plain : P1) มาเป็นส่วนหนึ่งในการวัดผลการศึกษา ระยะเวลาโครงการตั้งแต่กันยายน 2565 - มิถุนายน 2568 โดยปัจจุบัน มีนักศึกษาเข้าร่วมโครงการ 1,709 คน สอบ IC Plain ผ่านแล้ว 792 คน



โครงการสนับสนุนทุนการสอบใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุนสำหรับนักศึกษาในมหาวิทยาลัย ทุนสนับสนุนจากกองทุนส่งเสริมการพัฒนาลาดทุน (CMDP)

- โครงการอบรมเพื่อพัฒนาบุคลากรต่อเนื่องเพื่อสร้างศักยภาพให้บริษัทหลักทรัพย์ ได้รับพิจารณาอนุมัติทุนสนับสนุนจาก CMDP แล้วเมื่อวันที่ 31 พฤษภาคม 2567 โดยมีระยะเวลาการดำเนินโครงการ ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 ถึง 28 กุมภาพันธ์ 2569 ปัจจุบันอยู่ระหว่างการดำเนินงานจัดอบรม 20 หลักสูตร ซึ่งครอบคลุมใน 3 ด้าน ได้แก่

- หลักสูตรเพื่อเตรียมความพร้อมสำหรับการทำธุรกิจด้าน Digital Asset ของบริษัทหลักทรัพย์ จำนวน 12 หลักสูตร
- หลักสูตรเพื่อพัฒนาความรู้ความสามารถในหน้าที่หลักของแต่ละ Function งาน (ที่นอกเหนือจากองค์ความรู้ด้าน Digital) จำนวน 7 หลักสูตร
- หลักสูตรเพื่อพัฒนาความรู้ให้กับ Introducing Broker Agent (IBA) จำนวน 1 หลักสูตร
- จัด Campaign พิเศษ สำหรับผู้ที่ต้องการถือ License IC ในโครงการ “Super Deal ติว IC - Extra” คอร์สตีว IC Plain (P1) รวมสอบ 1 ครั้ง อบรมผ่านระบบ E-Learning (มีระยะเวลาเรียนถึง 1 ปี) และมีสิทธิ์อบรมบรรยายสดผ่าน ZOOM ทุกรอบที่จัดอบรม (เดือนละ 2 รอบ) อีกทั้งยังสามารถเลือกเพิ่ม“โจทย์พิเศษ”ได้ตามต้องการ ซึ่งมีผู้สนใจและกระแสดาวน์โหลดอย่างต่อเนื่อง



“Super Deal ติว IC - Extra” คอร์สตีว IC Plain (P1) รวมสอบ 1 ครั้ง
บรรยายสดผ่าน ZOOM (จัดอบรมเดือนละ 2 รอบ)

ข่าวประชาสัมพันธ์

หลักสูตรที่เปิดรับสมัครอบรม มีดังนี้

- เปิดอบรม หลักสูตรต่ออายุใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุน (IC) ผู้วางแผนการลงทุน (IP) นักวิเคราะห์การลงทุน (IA) และผู้แนะนำลูกค้า (IBA) 15 ชั่วโมง (บรรยายสดผ่านโปรแกรม Zoom Meeting / ผ่านระบบ E-Learning)

- วันเสาร์ที่ 14 – วันอาทิตย์ที่ 15 กันยายน 2567 (ผ่านโปรแกรม ZOOM Meeting)

- เปิดรับสมัครอบรม **New campaign “Super Deal ติว IC - EXTRA”** คอร์สตีว IC Plain (P1) รวมสอบ 1 ครั้ง (บรรยายสดผ่านโปรแกรม Zoom Meeting (จัดบรรยายสดเดือนละ 2 รอบ) / ผ่านระบบ E-Learning (มีระยะเวลาเรียนถึง 1ปี))

รอบบรรยายสดผ่านโปรแกรม Zoom Meeting ใน Q3-2567 มีดังนี้ :

- วันเสาร์ที่ 13 – วันอาทิตย์ที่ 14 และ วันพุธที่ 24 – วันพฤหัสบดีที่ 25 กรกฎาคม 2567
- วันพุธที่ 14 – วันพฤหัสบดีที่ 15 และ วันเสาร์ที่ 24 – วันอาทิตย์ที่ 25 สิงหาคม 2567
- วันพุธที่ 18 – วันพฤหัสบดีที่ 19 และ วันเสาร์ที่ 28 – วันอาทิตย์ที่ 29 กันยายน 2567

- เปิดอบรม หลักสูตรการวางแผนทางการเงิน CFP (ชุดวิชาที่ 1-6) บรรยายสดผ่านโปรแกรม Zoom Meeting

- หลักสูตรอบรมผ่านระบบ E-Learning
- หลักสูตรเตรียมสอบ IC
- *หลักสูตร P1, P3 Update เนื้อหาใหม่ (เริ่มใช้กับการทดสอบตั้งแต่วันที่ 1 ก.ย. 2566 เป็นต้นไป)

- หลักสูตรผู้แนะนำการลงทุนตราสารทั่วไป IC Plain (P1)
- หลักสูตรผู้แนะนำการลงทุนด้านตราสารซับซ้อน:ตราสารหนี้และกองทุนรวม (P2)

- หลักสูตรผู้แนะนำการลงทุนด้านตราสารซับซ้อน:สัญญาซื้อขายล่วงหน้า (P3)

- หลักสูตรต่ออายุใบอนุญาตฯ (IC, IP, IA) (อบรม 15 ชั่วโมง)
- หลักสูตรต่ออายุใบอนุญาตฯ ด้าน ESG (อบรม 3 ชั่วโมง)
- หลักสูตรผู้แนะนำลูกค้า (IBA) : หลักสูตรผู้แนะนำลูกค้า (IBA), หลักสูตรต่ออายุผู้แนะนำลูกค้า (IBA)
- หลักสูตรสอบซ่อมผู้แนะนำลูกค้า (IBA)
- หลักสูตรอื่นๆ

- หลักสูตรแนวทางปฏิบัติที่เกี่ยวข้องกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)

- หลักสูตรเรียนรู้เรื่องกฎหมายการป้องกันการฟอกเงิน (AML/CFT) สำหรับผู้มีหน้าที่รายงานเพื่อปฏิบัติหน้าที่อย่างมืออาชีพ

- หลักสูตร การลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ (FPI)
- ศูนย์ทดสอบATI เปิดรอบทดสอบใบอนุญาตในเขตกรุงเทพฯ และเขตภูมิภาค

เขตกรุงเทพฯ

- วันจันทร์ – วันพฤหัสบดี

เปิดสอบ 2 รอบ คือ 09.30-12.00, 13.30-16.00 น.

- วันศุกร์ - วันเสาร์ - วันอาทิตย์

เปิดสอบ 3 รอบ คือ 09.30-12.00, 13.30-16.00 และ 18.00-20.30 น.

- พิเศษ สัปดาห์สุดท้ายของทุกเดือน

เปิดสอบ 3 รอบ คือ 09.30-12.00, 13.30-16.00 และ 18.00-20.30 น.

เขตภูมิภาค **ตรวจสอบวันและที่นั่งว่างได้ที่ปฏิทินการสอบ*

สำหรับผู้สนใจ ท่านสามารถสมัครอบรมและทดสอบได้ตามช่องทางด้านล่างนี้ หรือติดตามข่าว ประชาสัมพันธ์ Update ใหม่ๆ ได้ที่ Line OA / Facebook



สอบตามข้อมูลเพิ่มเติม

02-096-2955

(กด 1 ศูนย์ฝึกอบรม | กด 2 ศูนย์ทดสอบ)



www.ati-asco.org

สมัครอบรม/สอบ



LINE Official Account



facebook



- **ทบทวนมาตรการและกฎเกณฑ์เพื่อป้องกันเหตุการณ์ทำนองเดียวกับการซื้อขายหุ้น MORE** โดยสมาคมได้จัดทำข้อเสนอปรับปรุงหลักเกณฑ์และกำหนดแนวทางที่เหมาะสมในทางปฏิบัติ และเป็นไปตามกฎหมายในประเด็นต่างๆ ซึ่งมีความซับซ้อน ดังนี้
 - **การจัดให้มีข้อมูลเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการป้องกันความเสี่ยงและการกำกับดูแล**
 - **การจัดตั้ง Securities Bureau** เพื่อตรวจสอบข้อมูลวงเงินการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าย่อยในตลาดหลักทรัพย์ โดยใช้ Data Exchange Platform ของ NDID ในการแลกเปลี่ยนข้อมูลแบบ Decentralization โดยสมาคมยื่นขอรับการสนับสนุนงบประมาณในการพัฒนา Platform การพัฒนาระบบเชื่อมต่อข้อมูลของ บล. และค่าใช้จ่ายบริการของ บล. เป็นระยะเวลา 3 ปี จาก CMDP แล้ว ปัจจุบันอยู่ระหว่างหารือกับสำนักงาน ก.ล.ต. เพื่อกำหนดหลักเกณฑ์ให้ บล. มีหน้าที่ตรวจสอบและแลกเปลี่ยนข้อมูลลูกค้าย่อยกัน รวมถึงกำหนดแนวปฏิบัติ อาทิ วงเงินขั้นต่ำที่ต้องตรวจสอบข้อมูลลูกค้าย่อย ระยะเวลาในการส่งข้อมูล เป็นต้น
 - **การเปิดเผยข้อมูลรายชื่อบริษัทที่มีพฤติกรรมกำกวมในการซื้อขายไม่เหมาะสม** โดยเปิดเผยให้ บล. ทุกแห่งรับทราบเพื่อให้มีมาตรการดำเนินการที่สอดคล้องกันทุก บล. ซึ่งตลาดหลักทรัพย์ได้ปรับปรุงหลักเกณฑ์และเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวแล้ว ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 และสมาคมได้จัดทำร่างมาตรการในการดำเนินการกับลูกค้าย่อยที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ เปิดเผยข้อมูลเพื่อให้ทุก บล. มีการดำเนินการกับลูกค้าย่อยดังกล่าวในแนวทางเดียวกันอย่างเท่าเทียม ซึ่งเปิดรับฟังความคิดเห็นจากสมาชิกแล้วเมื่อ 26 มิถุนายน 2567 เพื่อรวบรวมข้อเสนอแนะและขอความเห็นชอบจากตลาดหลักทรัพย์ฯ ต่อไป
 - **การเปิดเผยข้อมูลการโอนหลักทรัพย์ที่มีลักษณะผิดปกติ** โดยเปิดเผยเป็นรายหลักทรัพย์และแยกเป็นข้อมูลการโอนข้าม บล. การโอนใบหุ้น และการโอนผ่านบัญชี 600 เพื่อเป็นข้อมูลให้ บล. ใช้ประกอบการบริหารความเสี่ยง ซึ่งสมาคมได้จัดประชุมชี้แจงและตอบข้อซักถามการเปิดเผยข้อมูลโดยวิทยากรจาก TSD เมื่อวันที่ 29 เมษายน 2567 และตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เปิดเผยข้อมูลแบบรายวันผ่านระบบ SET Portal ตั้งแต่วันที่ 2 พฤษภาคม 2567 โดยสมาคมอยู่ระหว่างรวบรวมความเห็นสมาชิกเพิ่มเติมเพื่อหารือกับตลาดหลักทรัพย์ฯ สำหรับพัฒนาระบบ Query ใน Phase ถัดไป
 - **การเปิดเผยข้อมูล Net Settlement** สำหรับการซื้อขายหลักทรัพย์เดียวกันในวันเดียวกันในจำนวนหน่วยที่เท่ากัน เพื่อเป็นข้อมูลให้ บล. พิจารณาความเสี่ยงของหลักทรัพย์ โดยสมาคมและตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ข้อสรุปร่วมกันในรูปแบบการรายงานการคำนวณมูลค่าการซื้อขาย บัญชีลูกค้าย่อยที่จะเปิดเผยข้อมูล เป็นต้น และตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างพัฒนาระบบซึ่งคาดว่าจะแล้วเสร็จภายในไตรมาสที่ 3 โดยเบื้องต้นจะเปิดเผยในรูปแบบ

File Download ก่อนและจะพัฒนาระบบ Query ใน Phase ถัดไป

- **การจัดทำและส่งข้อมูลของ บล. ในรูปแบบ Standard Form** เพื่อให้หน่วยงานกำกับดูแลมีข้อมูลเพื่อคัดกรองการกระทำผิดได้ทันที โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ และ บล. ได้ข้อสรุปรายละเอียดของชุดข้อมูลแล้ว และอยู่ระหว่างหารือเพื่อปรับปรุงระบบงานการนำส่งข้อมูล โดยจะออกหนังสือเวียนแจ้งให้ บล. นำส่งข้อมูลตามรูปแบบใหม่เมื่อระบบแล้วเสร็จซึ่งคาดว่าจะภายในไตรมาสที่ 3
- **การป้องกันการซื้อขายที่อาจเข้าข่ายการซื้อขายผิดปกติหรือทุจริตฉ้อโกง**
 - **การกำหนดให้มีระบบ Auto Halt การซื้อขายเมื่อมีคำสั่งซื้อขายที่ผิดปกติ** เพื่อให้ทุกฝ่ายพิจารณาทบทวนในส่วนที่เกี่ยวข้อง ปัจจุบันตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เสนอให้มี Auto Halt เมื่อ Bid/Offer > 15% ของจำนวนหลักทรัพย์จดทะเบียน เป็นเวลา 60 นาที เพื่อให้ บล. ตรวจสอบและจัดการกับคำสั่งค้าง ซึ่งเปิดรับฟังความคิดเห็นถึงวันที่ 9 มิถุนายน 2567 โดยคณะกรรมการสมาคมเห็นควรให้กำหนดเวลา Halt 30 นาที และ Pre-open 30 นาที ซึ่งตลาดหลักทรัพย์ฯ รับพิจารณาดำเนินการต่อไป
 - **การทบทวนเงื่อนไขหลักทรัพย์ที่เข้าข่ายมาตรการกำกับดูแล** โดยปรับเงื่อนไขการขึ้นเครื่องหมาย C และยกระดับการแจ้งเตือน ซึ่งตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เพิ่มและปรับปรุงเงื่อนไขการขึ้นเครื่องหมายตามเหตุต่างกัน ดังนี้ CB: Business CS: Financial Statement CC: Non-compliance CF: Free Float มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 25 มีนาคม 2567
 - **การปรับปรุงระบบส่งคำสั่งซื้อขายให้ บล. คัดกรองคำสั่งก่อน Match ได้** โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ แจ้งว่ามีระบบ Pre-trade Risk Management (PTRM) ซึ่งสมาชิกสามารถใช้ได้พร้อมระบบการซื้อขายใหม่ (Nasdaq) โดยสมาคมนำเสนอแนะเพื่อปรับปรุงระบบต่อตลาดหลักทรัพย์ฯ พิจารณาแล้ว
 - **การจำกัดหรือบรรเทาความเสียหายจากการซื้อขายผิดปกติหรือทุจริตฉ้อโกง**
 - **การปรับปรุงหลักเกณฑ์การพิจารณาวงเงินและกำหนดอำนาจซื้อของลูกค้า**
 - 1) **ปรับปรุงข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์ฯ เกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด** โดยกำหนดให้พิจารณาคุณภาพลูกค้าและหลักประกันตามแนวทางที่สมาคมกำหนดในการพิจารณาวงเงินและอำนาจซื้อลูกค้าซึ่งรับฟังความเห็นแล้ว อยู่ระหว่างรอการประกาศใช้เมื่อสมาคมกำหนดแนวทางแล้วเสร็จ
 - 2) **ปรับปรุงแนวปฏิบัติของสมาคม เรื่อง การพิจารณากำหนดวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้า** โดยกำหนดให้นำปัจจัยด้านคุณภาพหลักทรัพย์และพฤติกรรมลูกค้ามา Haircut ในการคำนวณวงเงินและอำนาจซื้อ ซึ่งสำนักงาน ก.ล.ต. มีความเห็น

ให้ปรับปรุงหลักการในส่วนที่มีสาระสำคัญ อาทิ กำหนดอัตรา Haircut ตามเกณฑ์การคำนวณ NC สมาคมจึงเปิดรับฟังความเห็นจากสมาชิกเป็นครั้งที่ 2 และได้ปรับปรุงแนวทางในประเด็นอัตรา Haircut ตามเกณฑ์ NC ที่อาจไม่เหมาะสม การกำหนดแนวทางการเพิ่มอัตรา Haircut ตามคุณภาพหลักทรัพย์ให้ชัดเจนเพื่อลดการตีความในทางปฏิบัติ และไม่ควรให้ปรับอำนาจซื้อตามพฤติกรรมลูกค้า เป็นต้น โดยอยู่ระหว่างขอความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ต.

▪ **การชะลอการชำระค่าขายกรณีที่มีการซื้อขายเข้าข่ายการกระทำ อันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์หรือฉ้อโกง เป็นต้น** โดยสมาคมเสนอให้หน่วยงานกำกับดูแลมีอำนาจสั่งให้ บล. ชะลอค่าขายได้ และ บล. สามารถชะลอค่าขายได้ตามกรอบที่กำหนด อย่างไรก็ตาม สำนักงาน ก.ล.ต. พิจารณาข้อกฎหมายแล้วแจ้งว่าสำนักงาน ก.ล.ต. และตลาดหลักทรัพย์ฯ ไม่มีอำนาจในการสั่งการดังกล่าวได้ โดยรับพิจารณาเพื่อแก้ไขกฎหมายต่อไป

▪ **การกำหนดให้ NVDR ซื้อขายได้เฉพาะต่างชาติ** เพื่อป้องกันการไม่ปฏิบัติตามเกณฑ์ของนักลงทุน โดยสำนักงาน ก.ล.ต. ได้ประกาศกำหนดห้าม บล. รับคำสั่งซื้อ รับโอน หรือแลกเปลี่ยนหลักทรัพย์ ที่มีผลทำให้ผู้ลงทุนไทยมีหลักทรัพย์ NVDR เพิ่มขึ้น มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2567 และตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ปรับปรุงหลักเกณฑ์ให้สอดคล้องกัน โดยทั้งสำนักงาน ก.ล.ต. และตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ออกประกาศยกเว้นค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจาก บล. สำหรับธุรกรรมการแปลง NVDR เป็นหุ้นสามัญภายใต้เงื่อนไขว่า บล. ไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมดังกล่าวจากลูกค้า มีผลตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน – 31 ธันวาคม 2567

▪ **การทบทวนหลักเกณฑ์ NC/NCR** โดยปรับให้หนี้สินพิเศษรวมถึงกรณีมีคำสั่งจากหน่วยงานทางการให้ระงับการชำระค่าขาย รวมถึงปรับนิยามและการใช้ประโยชน์ Sub-debt เพื่อให้สามารถนำไปเพิ่มระดับ NC ได้ โดยต้องมีเงื่อนไขหักเล็หรือเลื่อนการจ่ายดอกเบี้ย/ผลตอบแทนได้ ทั้งนี้ สำนักงาน ก.ล.ต. ได้ปรับนิยาม Sub-debt โดยให้เลื่อนการจ่ายเงินต้นได้เพิ่มเติมซึ่งเปิดรับฟังความเห็นถึงวันที่ 7 มิถุนายน 2567 ปัจจุบันอยู่ระหว่างรอประกาศในราชกิจจานุเบกษา

• **เตรียมความพร้อมสมาชิกเพื่อรองรับการปฏิบัติให้เป็นไปตามกฎหมาย FATCA และ CRS** โดยกรมสรรพากรประกาศผ่อนผันค่าปรับสำหรับการรายงานข้อมูล FATCA โดยผู้มีหน้าที่รายงานสามารถยื่นรายงานข้อมูลผ่านระบบ IDES ได้จนถึง 30 กันยายน 2567 จากเดิมกำหนดไว้วันที่ 30 มิถุนายน 2567

• **การปรับปรุง พ.ร.บ. หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์** เข้าร่วมการประชุมคณะกรรมการกฤษฎีกา ในประเด็นการปรับปรุงให้สมาคมที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจหลักทรัพย์มีช่องทางเพิ่มเติมในการบริหารจัดการเงินลงทุน โดยเปิดโอกาสให้ทำการลงทุนในผลิตภัณฑ์อื่นเพิ่มเติมนอกเหนือจากเงินฝาก และบทบัญญัติ

เกี่ยวกับศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ อาทิ มีคุณสมบัติเป็นนิติบุคคล และเป็นสถาบันการเงินตามกฎหมายฟอกเงิน โดยสำนักงาน ก.ล.ต. มีอำนาจกำหนดประเภทของหลักทรัพย์ที่ซื้อขายได้ เป็นต้น

• **ทบทวนปรับปรุงหลักเกณฑ์ในโครงการ Regulatory Guillotine ของสภาธุรกิจตลาดทุน (“FETCO”)**

- เสนอประเด็น Pain Point เกี่ยวกับธุรกิจนายหน้ารวม 11 ประเด็น โดย TDRi วิเคราะห์และให้ข้อเสนอแนะแล้ว 7 ประเด็น ได้แก่ การจัดทำ Guideline และกำหนดระยะเวลาพิจารณาในกระบวนการขอใบอนุญาต การปรับปรุงนิยามผู้ลงทุนสถาบันที่มีความแตกต่างกันระหว่างผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาการจดจำหน่วยลงทุน เป็นต้น

- พิจารณา Pain Point เพิ่มเติมและหารือกับสำนักงาน ก.ล.ต. โดยตรงรวม 5 ประเด็น ได้แก่ การพิสูจน์และยืนยันตัวตนโดย NFC เพื่อให้เป็นไปตามสรุปข้อหารือระหว่างสมาคมและสำนักงาน ปปง. การปรับปรุงลักษณะต้องห้ามผู้ถือหุ้นรายใหญ่ให้สอดคล้องกันระหว่างผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาการปรับปรุงหลักเกณฑ์การประกอบธุรกิจอื่นเพื่อลดประกาศที่ซ้ำซ้อน ซึ่งสำนักงาน ก.ล.ต. รับพิจารณาดำเนินการแล้ว

• **จัดทำแนวทางการมอบอำนาจการส่งคำสั่งซื้อขายผ่านช่องทางออนไลน์** สมาคมได้จัดทำสรุปข้อหารือระหว่างตลาดหลักทรัพย์ฯ และสำนักงาน ก.ล.ต. โดยมีหลักการ อาทิ จำกัดจำนวนผู้รับมอบอำนาจไม่เกิน 1 คน ต่อลูกค้า 1 ราย การมีระบบงานที่จำกัดให้ลูกค้าและผู้รับมอบอำนาจสามารถส่งคำสั่งได้จาก 1 device หรือ 1 platform เท่านั้น รวมถึงต้องมีขั้นตอนการส่ง Username และ Password ที่เป็นไปตามมาตรฐานความปลอดภัยและมีการควบคุมดูแลการทำ KYC และตรวจสอบบัญชีที่มีการมอบอำนาจอย่างเหมาะสม ซึ่งคณะกรรมการสมาคมได้เห็นควรให้จำกัดการมอบอำนาจให้เฉพาะกรณีในครอบครัว หรือมีเหตุจำเป็นอันเนื่องมาจากความบกพร่องทางร่างกาย เป็นต้น ปัจจุบันอยู่ระหว่างหารือเพิ่มเติมกับตลาดหลักทรัพย์ฯ และสำนักงาน ก.ล.ต.

• **การกำหนดแนวปฏิบัติ Short/Long Sell** ให้ความเห็นต่อการจัดทำแนวปฏิบัติของสมาคม ตั้งแต่กระบวนการก่อนเริ่มให้บริการลูกค้า รวมถึง Pre-Trade และ Post-Trade อาทิ ระบบงานและวิธีปฏิบัติการรับส่งคำสั่ง Short/Long Sell แนวทางการตรวจสอบคำสั่ง และ Post-Audit โดยหารือและพิจารณาความเห็นจากสมาชิกและหน่วยงานกำกับดูแลในการกำหนดรายละเอียดต่อไป

• **การให้ความเห็นอย่างเป็นลายลักษณ์อักษรต่อหน่วยงานกำกับดูแล ดังนี้**

- **การเปิดรับฟังความคิดเห็นการปรับปรุงหลักเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ** โดยสมาคมเสนอให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ จัดให้มีการแจ้งเตือนสมาชิกหรือส่งเอกสารการรับฟังความเห็นให้สมาชิกทุกราย เพื่อให้บริษัทสมาชิกรับทราบและมีระยะเวลาเพียงพอ

ในการให้ความเห็นรวมถึงเตรียมความพร้อมเพื่อดำเนินการในส่วนที่เกี่ยวข้อง เช่น การแจ้งลูกค้าให้รับทราบ และปรับปรุงระบบงาน เป็นต้น

- **การยกระดับมาตรการกำกับดูแลการซื้อขายที่ไม่เหมาะสมและลดความผันผวนที่ผิดปกติของราคา** โดยให้ข้อสังเกตเกี่ยวกับหลักทรัพย์ที่อยู่ในมาตรการ Dynamic Price Band ซึ่งควรครอบคลุม Derivatives Warrant (“DW”) ที่หลักทรัพย์อ้างอิงต้องหยุดการซื้อขายด้วย และควรพิจารณาถึงการรักษาสภาพคล่องของ DW ที่อ้างอิงหลักทรัพย์ต้องเข้ามาตรการ Auction เพื่อให้ให้นักลงทุนและผู้ออก DW มีวิธีบริหารความเสี่ยงที่เหมาะสม

• **การเข้าร่วมประชุม/สัมมนา เพื่อให้ความเห็น**

- การประชุมรับฟังความคิดเห็นต่อร่างข้อเสนอแนะมาตรฐานว่าด้วยการพิสูจน์และยืนยันตัวตนทางดิจิทัลคนต่างด้าวที่ทำธุรกรรมในประเทศไทยเพื่อเป็นข้อกำหนดในการพิสูจน์ตัวตนที่เป็นมาตรฐานเดียวกันตามระดับความน่าเชื่อถือ ซึ่งประกอบด้วย การคัดเลือกเอกสารสำคัญ ข้อกำหนดการรวบรวมข้อมูลเกี่ยวกับอัตลักษณ์ และการตรวจสอบอัตลักษณ์ เป็นต้น ซึ่งกำหนดให้รวบรวมข้อมูลและตรวจสอบจากหลักฐานแสดงตนอื่นเพิ่มเติมแทนได้ กรณีไม่มีข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ วันที่ 14 มิถุนายน 2567

- สัมมนาเผยแพร่ความรู้และผลการศึกษา ลายมือชื่อดิจิทัล: การยกระดับการลงลายมือชื่อดิจิทัลให้มีความน่าเชื่อถือในระยะยาว (Long-term Digital Signature) ของสำนักงานพัฒนาธุรกรรมทางอิเล็กทรอนิกส์ (ETDA) เพื่อให้ข้อเสนอแนะหรือมาตรฐานสำหรับการสร้างและตรวจสอบลายมือชื่อดิจิทัลให้มีความน่าเชื่อถือและมั่นคงปลอดภัย อาทิ การแนะนำให้มีการลง Time Stamp ใหม่ทุก 3 ปี ซึ่งปัจจุบัน ETDA เผยแพร่รายชื่อผู้ให้บริการที่ผ่านการรับรอง โดยยังไม่มีออกหลักเกณฑ์เกี่ยวกับระดับความน่าเชื่อถือและการกำกับดูแลผู้ให้บริการ วันที่ 21 มิถุนายน 2567

- การประชุมเพื่อเตรียมความพร้อมสำหรับการรายงานข้อมูล FATCA/CRS ในส่วนของภาพรวมสาระสำคัญและความคืบหน้ากฎหมาย กรอบเวลาการรายงานข้อมูลในปี 2567 รวมถึงระบบและวิธีการรายงานข้อมูล FATCA ผ่านระบบ IDES และการรายงานข้อมูล CRS ผ่านระบบของสรรพากร วันที่ 4, 10 เมษายน และวันที่ 14 มิถุนายน 2567

- การประชุมรายครึ่งปีกับสำนักงาน ก.ล.ต. เพื่อรับทราบนโยบายและแนวทางดำเนินการ รวมถึงแลกเปลี่ยนความเห็นปัญหาและอุปสรรคการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ โดยร่วมหารือและชี้แจงความคืบหน้าและแนวทางการดำเนินงานโครงการ Securities Bureau วันที่ 9 พฤษภาคม 2567

DRx...ประเด็นปัญหาอุปสรรคและทิศทางในอนาคต

Highlight

- ปี 2565 สำนักงาน ก.ล.ต. ได้ปรับปรุงเกณฑ์สำหรับตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วย (DRx) โดย DRx สามารถออกและเสนอขายได้ 2 วิธี แก่ 1. IPO และ 2. Direct Listing
- DRx เป็นทางเลือกสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการเข้าถึงการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ โดยไม่ต้องซื้อขายโดยตรงในตลาดต่างประเทศ และมีความแตกต่างจาก DR หลายประการ เช่น ขนาดการซื้อขายขั้นต่ำ ช่วงเวลาในการซื้อขาย เป็นต้น
- เนื่องจาก DRx เป็นผลิตภัณฑ์ที่ทางตลาดหลักทรัพย์ฯ พัฒนามาจากผลิตภัณฑ์ DR ทั้งนี้รายงานของ Deutsche Bank ระบุว่า ในปี 2566 มูลค่าการซื้อขาย DR ทั่วโลกอยู่ที่ 4.1 ล้านล้านดอลลาร์สหรัฐฯ ลดลง 24% จากปีก่อน ขณะที่มูลค่าการซื้อขาย DRx ที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ ในช่วงครึ่งแรกปี 2567 อยู่ที่ 4,476 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 213% จากช่วงเดียวกันของปี 2566
- ปัจจุบัน DRx ยังมีข้อจำกัดที่อาจส่งผลให้ผู้ที่ต้องการลงทุน หรือผู้ที่ให้บริการยังเข้าถึงหรือให้บริการได้ไม่เต็มที่ เช่น ต้องแจ้งความประสงค์เปิดบัญชี DRx เพิ่มเติม และทำการซื้อขายผ่าน Streaming เท่านั้น เป็นต้น ทำให้จำนวนและมูลค่าการซื้อขายในช่วงที่ผ่านมาเติบโตได้ไม่มากนัก ซึ่งปัจจุบันตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างการพิจารณาแก้ไขข้อจำกัด

ปัจจุบันผลิตภัณฑ์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) ได้มีการพัฒนาเพื่อเพิ่มทางเลือกให้กับผู้สนใจลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่หลากหลายมากขึ้น โดยที่ผ่านมาผู้ลงทุนสามารถเลือกการลงทุนได้หลายช่องทาง เช่น ลงทุนผ่านตลาดหุ้นในต่างประเทศโดยตรง ลงทุนผ่านกองทุนรวม กองทุนส่วนบุคคล รวมทั้งการลงทุนผ่านตลาดหุ้นไทย อาทิ ตราสารแสดงสิทธิการฝากหลักทรัพย์ต่างประเทศ (Depository Receipt หรือ DR) ทั้งนี้ในช่วงปี 2565 สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (สำนักงาน ก.ล.ต.) มีมติเห็นชอบร่างข้อบังคับและประกาศของตลาดหลักทรัพย์ฯ เกี่ยวกับการปรับปรุงเกณฑ์สำหรับตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่ต้องซื้อขายเป็นจำนวนเต็มของหน่วย (Fractional Depository Receipt หรือ DRx) เพื่อให้รองรับการซื้อขาย DR ที่มีหลักทรัพย์อ้างอิงอยู่ใน time zone ทั้งในภูมิภาคเอเชียและอเมริกา รวมทั้งพัฒนาให้สอดคล้องกับพฤติกรรมของนักลงทุนใหม่ ที่เป็น small ticket size และรองรับการส่งคำสั่งซื้อขายที่ไม่ต้องเป็นจำนวนเต็มของหน่วย DR หรือเป็นจำนวนเงินได้

Fractional Depository Receipt (DRx) เป็นตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ไม่วันหมดอายุ โดยสามารถมีสินทรัพย์อ้างอิงทั้งหุ้น, ETF, REITs, Infrastructure Fund และ Infrastructure Trust ที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด DRx ถูกออกแบบมาเพื่ออำนวยความสะดวกให้ผู้ลงทุนไทยสามารถซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศได้ ผ่านการซื้อขาย DRx ที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ ซึ่งมีตัวกลางคือผู้ออก DRx คอยช่วยบริหารจัดการให้ ทั้งนี้ ผู้ออก DRx สามารถออกและเสนอขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ 2 วิธี ได้แก่ 1. เสนอขายให้กับประชาชนทั่วไปครั้งแรก (IPO) ผ่าน Underwriter โดยจะนำเงินที่ได้ทั้งหมดไปซื้อหลักทรัพย์ในต่างประเทศแล้วนำมาจดทะเบียนให้ซื้อขายผ่าน DRx ในตลาดหลักทรัพย์ฯ เหมือนหุ้นทั่วไป 2. เสนอขายผ่านระบบการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ (Direct Listing) ซึ่งวิธีนี้บริษัทจะเสนอขาย DRx ต่อนักลงทุนโดยตรงผ่านตลาดหลักทรัพย์ฯ ทั้งนี้ผู้ออก DRx ในประเทศไทยจะต้องได้รับอนุญาตจากสำนักงาน ก.ล.ต. และตลาดหลักทรัพย์ฯ รับ DRx เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนแล้ว ผู้ออก DRx จึงจะสามารถออกและเสนอขาย DRx ต่อผู้ลงทุนได้

DRx เป็นทางเลือกสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการเข้าถึงการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ โดยไม่ต้องซื้อขายโดยตรงในตลาดต่างประเทศ และมีความแตกต่างจาก DR หลายประการ เช่น ขนาดการซื้อขายขั้นต่ำ ช่วงเวลาในการซื้อขาย เป็นต้น

ทั้งนี้ DRx เป็นผลิตภัณฑ์การลงทุนที่พัฒนาต่อยอดมาจาก DR เพื่ออำนวยความสะดวกให้แก่ผู้ลงทุนไทยในการลงทุนหลักทรัพย์ต่างประเทศ อย่างไรก็ตามผลิตภัณฑ์ DRx และ DR มีความแตกต่างหลายประการ (ภาพที่ 1) เช่น ผู้ลงทุนสามารถซื้อขาย DRx ได้ในสกุลเงินบาทเช่นเดียวกับ DR ในปัจจุบัน แต่ผู้ลงทุนใน DRx สามารถเลือกส่งคำสั่งได้ทั้งแบบจำนวนบาทหรือจำนวนหน่วยก็ได้ และมี

เวลาเปิดทำการซื้อขายที่สอดคล้องกับตลาดต่างประเทศ ซึ่งผู้ออก (Issuer) ไปซื้อหลักทรัพย์ต่างประเทศแล้วนำมาเก็บรักษาไว้กับ ผู้รับฝากทรัพย์สิน จากนั้นก็ออก DRx เสนอขายให้ผู้ลงทุนไทย เป็นต้น

ภาพที่ 1 ความแตกต่างระหว่าง DR และ DRx

	DR	DRx
ประเภทบัญชี	บัญชีหุ้นทุกประเภท	บัญชีหุ้นทุกประเภทที่แจ้งความประสงค์ว่าการซื้อขาย DRx เพิ่มเติม
การฝากเงินเพื่อซื้อ	ตามช่องทางที่โบรกเกอร์กำหนด เช่น โอนเงิน / ATS / Online direct debit	QR Payment
ระยะเวลาการชำระราคา	T+2	Real Time Settlement
วิธีการซื้อขาย	เหมือนการซื้อขายหุ้นในตลาดหลักทรัพย์ฯ	ส่งคำสั่งซื้อขายได้ถึง จำนวนหน่วย หรือ จำนวนเงิน
ประเภทคำสั่งซื้อขาย	เหมือนการซื้อขายหุ้นในตลาดหลักทรัพย์ฯ	Market order และ Limit order
เวลาซื้อขาย	ตามเวลา SET (9:30 – 17:00 น.) (ไม่มีพักกลางวัน)	ตามเวลาตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศที่หลักทรัพย์อ้างอิงจดทะเบียนอยู่ โดยแบ่งเป็น 2 ช่วงเวลา Asia Time Zones 07:00 – 17:00 น. US Time Zones 20:00 – 04:00 น. (T+1) Pre-open 15 นาทีก่อนตลาดเปิดซื้อขาย (ผู้ลงทุนสามารถยกเลิกคำสั่งที่ค้างอยู่ก่อนตลาดเปิดซื้อขายได้)
Ceiling & Floor – Price Band	Ceiling & Floor	Dynamic Price Band
ขนาดการซื้อขายขั้นต่ำ	1 DR	0.0001 DRx
หน่วยการส่งคำสั่งซื้อขาย	ส่งเป็นจำนวนหน่วย DR	ส่งเป็นจำนวนหน่วย DRx หรือจำนวนเงิน
Trading Symbol (สัญลักษณ์)	U U U U U U U U 0 0	U U U U U U U U 0 0 X

ที่มา : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

นอกจากนี้ในช่วงที่ผ่านมา DRx ถือเป็นอีกทางเลือกสำหรับผู้ลงทุนที่ต้องการเข้าถึงการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ แต่ไม่ต้องการซื้อขายโดยตรงในตลาดต่างประเทศ ประกอบกับมีข้อดีหรือความหลากหลายของการลงทุนที่แตกต่างกับ DR อย่างเช่น

- ผู้ลงทุนสามารถซื้อขายได้ทั้งจำนวนบาทและจำนวนหน่วย โดยไม่จำเป็นต้องซื้อเต็มจำนวนหน่วยเหมือนในกรณีของ DR
- สามารถซื้อขายใน 2 ช่วงเวลาตามเวลาตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศที่หลักทรัพย์อ้างอิงจดทะเบียนอยู่ คือ Asia Time Zone และ US Time Zone ในขณะที่ DR สามารถซื้อขายตามเวลาตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

- การชำระราคาเป็น Real Time Settlement ทำให้ผู้ลงทุนสามารถชำระราคาได้ทันทีหลังจากส่งคำสั่งซื้อขาย ในขณะที่ DR ใช้ระบบ T+2 ต้องชำระราคากายใน 2 วันทำการ

อย่างไรก็ตามผู้ลงทุนใน DRx ควรตระหนักถึงความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้น เนื่องจาก DRx อ้างอิงกับหลักทรัพย์ต่างประเทศ โดยอาจมีความเสี่ยงจากหลายด้านที่อาจเกิดขึ้นได้เช่นเดียวกับ DR อย่างเช่น

- ความเสี่ยงจากความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อราคาซื้อขาย DRx
- ความเสี่ยงเรื่องของความผันผวนของภาวะตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศ รวมถึงความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงในผลการดำเนินงานของหลักทรัพย์ต่างประเทศที่อ้างอิง
- DRx เป็นตราสารที่ซื้อขายในตลาดเฉพาะ ผู้ลงทุนอาจเผชิญกับความเสี่ยงด้านสภาพคล่องในการซื้อขายเมื่อต้องการเปลี่ยนแปลงการลงทุน

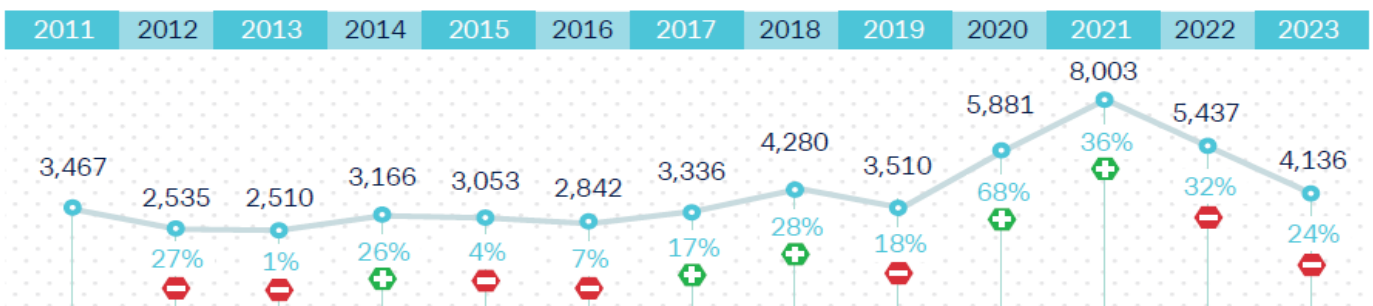
เนื่องจากผลิตภัณฑ์ DRx เป็นผลิตภัณฑ์ที่ทางตลาดหลักทรัพย์ฯ พัฒนามาจากผลิตภัณฑ์ DR ทั้งนี้รายงานของ Deutsche Bank ระบุว่าในปี 2566 มูลค่าการซื้อขาย DR ทั่วโลกอยู่ที่ 4.1 ล้านล้าน ดอลลาร์สหรัฐฯ ลดลง 24% จากปีก่อน

เนื่องจาก DRx เป็นผลิตภัณฑ์ที่ทางตลาดหลักทรัพย์ฯ พัฒนามาจากผลิตภัณฑ์ DR ทั้งนี้ภาพรวมของ DR ทั่วโลกจากรายงานของ Deutsche Bank ระบุว่าในปี 2566 มูลค่าการซื้อขายรวมทั่วโลก ในปี 2566 อยู่ที่ประมาณ 4.1 ล้านล้านดอลลาร์สหรัฐฯ ลดลง 24%

จากปี 2565 (ภาพที่ 2) โดย DR ที่อ้างอิงหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ของประเทศจีน/ฮ่องกงมีมูลค่าสูงสุดในปีที่ผ่านมา หรือคิดเป็น 37% ของมูลค่าการซื้อขาย DR ทั่วโลก

ภาพที่ 2 มูลค่าการซื้อขาย DR ทั่วโลก

DR value traded (USD bn)



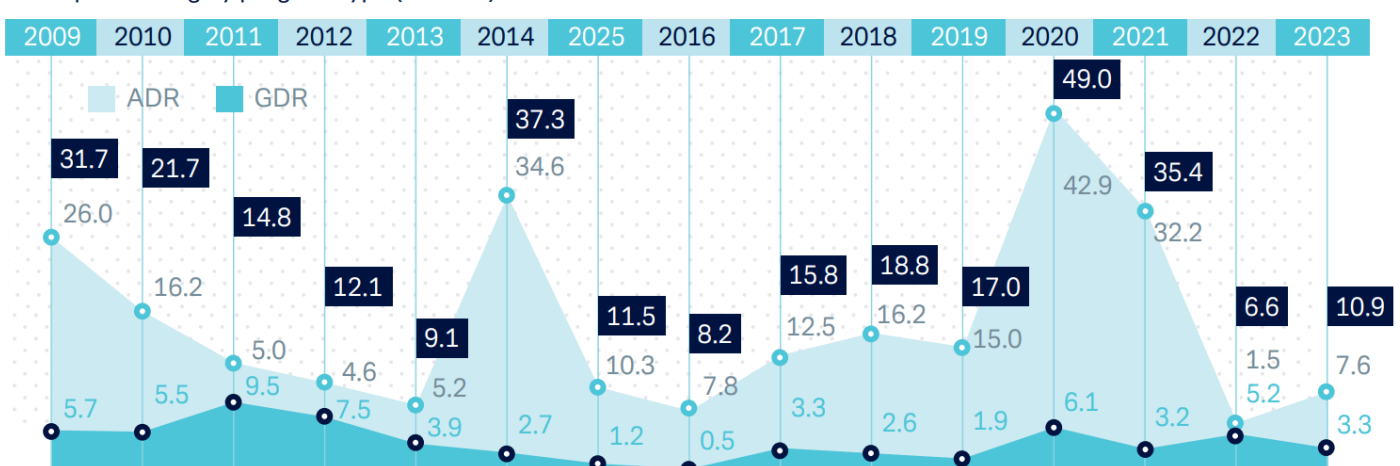
ที่มา : Deutsche Bank

แม้ว่ามูลค่าการซื้อขายรวมของ DR ทั่วโลกจะลดลง แต่การระดมทุน DR ในปี 2566 ก็เพิ่มขึ้นถึง 65% จากปี 2565 หรือมีมูลค่ารวมอยู่ที่ 10.9 พันล้านดอลลาร์สหรัฐฯ (ภาพที่ 3) จากการ

เพิ่มขึ้นของการระดมทุนจากการเสนอขายหุ้น ARM Holdings PLC ซึ่งมีสัดส่วนประมาณ 48% ของการระดมทุนผ่าน DR ในปี 2566 ที่ผ่านมา

ภาพที่ 3 การระดมทุน DR ทั่วโลก

DR capital raising by program type (USD bn)

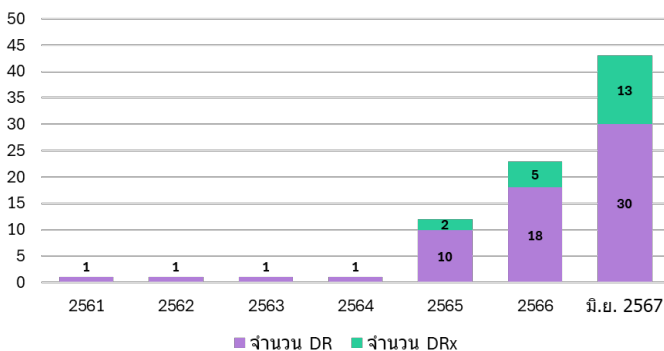


ที่มา : Deutsche Bank

ในประเทศไทยปัจจุบันมีผู้ออก DRx 1 ราย โดยมีจำนวน 13 DRx ที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ เพิ่มขึ้นจากปี 2566 ที่มีจำนวน 5 DRx ขณะที่มูลค่าการซื้อขายในช่วงครึ่งแรกปี 2567 อยู่ที่ 4,476 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 213% จากช่วงเดียวกันของปี 2566

ความต้องการลงทุนใน DR และ DRx ในตลาดหุ้นไทยมีแนวโน้มเพิ่มขึ้นจากความต้องการกระจายความเสี่ยงในการลงทุน รวมถึงเมื่อต้นปี 2567 ทางกรมสรรพากรได้มีการปรับปรุงหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการเก็บภาษีการลงทุนจากต่างประเทศ ส่งผลให้ DR และ DRx มีแนวโน้มได้รับความสนใจมากขึ้นในช่วงที่ผ่านมา มีการออกเสนอขาย DR อย่างต่อเนื่อง โดยข้อมูลจากตลาดหลักทรัพย์ฯ ณ วันที่ 28 มิถุนายน 2567 มีจำนวน 30 DR ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ (ภาพที่ 4) และมีมูลค่าการซื้อขายในช่วงครึ่งแรกของปี 2567 อยู่ที่ 24,155 ล้านบาท (ภาพที่ 5) ทั้งนี้ผลิตภัณฑ์ DRx เป็นผลิตภัณฑ์ที่ทางตลาดหลักทรัพย์ฯ พัฒนามาจากผลิตภัณฑ์ DR แม้ในปัจจุบัน DRx อาจยังไม่เป็นที่รู้จักอย่างแพร่หลายมากนัก แต่อย่างไรก็ตาม มี DRx ที่จดทะเบียนซื้อขายอยู่ในตลาดหลักทรัพย์ฯ จำนวน 13 DRx มีจำนวนเพิ่มขึ้นจากปี 2566 ที่มีจำนวน 5 DRx และมีผู้ออก DRx ทั้งสิ้น 1 ราย ได้แก่ ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (ภาพที่ 4) โดย AAPL80X และ TSLA80X เป็น DRx 2 หลักทรัพย์ที่เข้าจดทะเบียนหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยเริ่มต้นซื้อขายเมื่อวันที่ 29 ก.ย. 2565 และเสนอขายในรูปแบบ Direct Listing

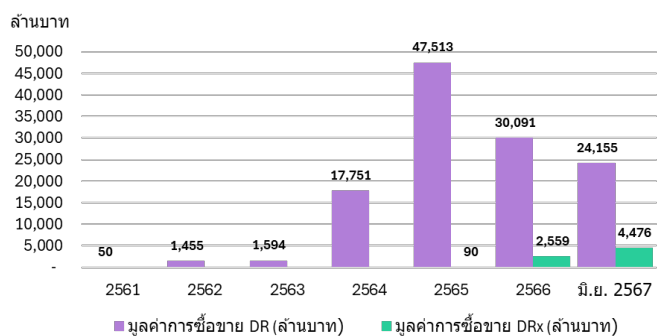
ภาพที่ 4 จำนวนของ DR และ DRx ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ



ที่มา : SETSMART วันที่ 28 มิถุนายน 2567

ขณะที่มูลค่าการซื้อขายของ DRx ในช่วงครึ่งแรกของปี 2567 มีมูลค่าอยู่ที่ 4,476 ล้านบาท (ภาพที่ 5) ปรับเพิ่มขึ้น 213% จากครึ่งแรกปี 2566 หรือจากมูลค่า 1,430 ล้านบาท โดยในช่วงครึ่งแรกปี 2567 มีมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ย 37 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากปี 2566 ที่มีมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยอยู่ที่ 10 ล้านบาทต่อวัน ในด้านมูลค่าตามราคาตลาด ณ สิ้นเดือนมิถุนายน 2567 อยู่ที่ 2,003 ล้านบาท ปรับเพิ่มขึ้นร้อยละ 255 จากปี 2566 ซึ่งอยู่ที่ 564 ล้านบาท ทั้งนี้ในช่วงครึ่งแรกปี 2567 สัดส่วนมูลค่าการซื้อขาย DRx เมื่อเทียบกับมูลค่าการซื้อขายของ DR เพิ่มขึ้นเป็น 18% จาก 8% ในครึ่งแรกปี 2566

ภาพที่ 5 มูลค่าการซื้อขาย DR และ DRx ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ



ที่มา : SETSMART วันที่ 28 มิถุนายน 2567

ปัจจุบัน DRx ยังมีข้อจำกัดที่อาจส่งผลให้ผู้ที่ต้องการลงทุน หรือผู้ที่ให้บริการยังเข้าถึงหรือให้บริการได้ไม่เต็มที่ เช่น ต้องแจ้งความประสงค์เปิดบัญชี DRx เพิ่มเติม และทำการซื้อขายผ่าน Streaming เท่านั้น เป็นต้น ทำให้จำนวนและมูลค่าการซื้อขายในช่วงที่ผ่านมาเติบโตได้ไม่มากนัก ซึ่งปัจจุบันตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างการพิจารณาแก้ไขข้อจำกัด

แม้ว่าในช่วงที่ผ่านมาปริมาณการซื้อขาย DRx มีการปรับตัวเพิ่มขึ้น อย่างไรก็ตามยังมีข้อจำกัดที่อาจส่งผลให้ผู้ที่ต้องการลงทุน หรือผู้ที่ให้บริการยังเข้าถึงหรือให้บริการได้ไม่เต็มที่ ทั้งนี้ สมาคมฯ

ได้สอบถามความคิดเห็นจากตัวแทนผู้ประกอบการถึงข้อจำกัดในการเข้าถึง DRx โดยมีตัวอย่างประเด็นข้อจำกัด ดังนี้

- ด้านผู้ลงทุน ในกรณีที่ผู้ลงทุนมีบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์อยู่แล้ว

หากต้องการลงทุนใน DRx จะต้องแจ้งความประสงค์ว่าต้องการเปิดบัญชี DRx เพิ่มเติมกับบริษัทหลักทรัพย์ผู้ให้บริการซื้อขาย DRx รวมทั้งต้องแยกวงเงินเพื่อซื้อขาย ซึ่งเพิ่มขึ้นตอนการเปิดบัญชีที่ซื้อช้อนแก่ผู้ลงทุน ขณะที่การฝากเงินทำได้เพียงช่องทาง QR Payment เท่านั้น โดยกำหนดไม่เกิน 2 ล้านบาท ต่อ รายการ/วัน ส่งผลให้ผู้ลงทุนรายใหญ่เข้าถึงยาก

• **ด้านการให้บริการผู้ลงทุนผ่านการส่งคำสั่งการซื้อขายผ่านเจ้าหน้าทีการตลาด** ปัจจุบัน DRx ยังไม่มีระบบที่รองรับให้เจ้าหน้าทีการตลาดช่วยในการให้บริการการซื้อขายผ่านเจ้าหน้าทีการตลาด ดังนั้นผู้ลงทุนจะต้องดำเนินการซื้อขายด้วยตนเองเท่านั้น ซึ่งไม่เอื้ออำนวยแก่ผู้ลงทุนมากนัก เช่น กรณีมีปัญหา

ในการส่งคำสั่งการซื้อขายอาจทำให้นักลงทุนต้องใช้เวลาในการแก้ปัญหาที่นานขึ้น เป็นต้น

• **ด้านของบริษัทหลักทรัพย์ที่มีระบบการให้บริการซื้อขาย** หลักทรัพย์เป็นของตนเองต้องแยกระบบการใช้งานเนื่องจากการซื้อขาย DRx สามารถซื้อขายได้ผ่านเฉพาะระบบ Streaming เท่านั้น จากข้อจำกัดในตัวอย่างดังกล่าว ประกอบกับในช่วงเดือนมีนาคม ปี 2567 ที่ผ่านมาทางตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้หารือกับผู้เกี่ยวข้อง 3 ส่วน ได้แก่ ผู้ลงทุน บริษัทหลักทรัพย์ และผู้ออก DRx/ผู้ดูแลสภาพคล่อง (MM) โดยพบว่ายังมีปัญหาหรือจุดอ่อนที่ยังเป็นข้อจำกัดในการลงทุนและการขยายฐานผู้ลงทุน DRx ดังตารางข้างล่างนี้

นักลงทุน	• วิธีการซื้อขายยังมีความไม่สะดวก เนื่องจากระบบงานที่แยกจากหุ้น ทำให้ 1. ต้องเปิดบัญชีย่อยใหม่และแยกวงเงินเพื่อซื้อขาย 2. ข้อจำกัดการฝากเงิน ได้เพียงครั้งละ 2 ล้านบาท และผ่าน QR Payment ไม่มีช่องทาง IC ทำให้ HNW เข้าถึงยาก 3. รูปแบบการเทรดต่างจาก Product DR ปกติ เช่น การเข้าใช้งานเมนูแยก และ Function การใช้งานไม่ครบถ้วน เช่น Order Type, Research หรือ Technical Analysis Chart
บริษัทหลักทรัพย์ (บล.)	• Function การใช้งานไม่ครบถ้วน และต้องเข้าใช้งานแยกระบบ • ใช้ได้เฉพาะ Streaming ทำให้บล. ที่มี Front หลักเป็นของตนเอง onboard ลูกค้าลำบาก
Issuer / Market Maker (MM)	• ต้นทุนในการทำหน้าที่ MM สูงกว่า DR เพราะเป็น cash balance ต้นทุนด้านการเตรียมเงินสดและ manage inventory จึงสูง • MM ไม่สามารถใช้ระบบเดิมใน SET เพื่อการทำหน้าที่ MM ต้องพัฒนาระบบ MM เพิ่มเติม

ที่มา : เอกสารประกอบการรับฟังความเห็นสมาชิกตลาดหลักทรัพย์ฯ (SET Member Hearing, 24 Apr 2024)

จากปัญหาหรือจุดอ่อนที่ยังเป็นข้อจำกัดข้างต้นนั้น ทางตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้นำเสนอแนวทางการพัฒนา DRx เพื่อปรับให้เหมาะสม ชัดเจน และตอบสนองความต้องการของผู้ลงทุน และผู้มีส่วนเกี่ยวข้องอย่างเหมาะสมยิ่งขึ้น โดยในเบื้องต้นทางตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้หารือมายังสมาคมฯ และได้รับฟังความเห็นจากการประชุมสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่ผ่านมา **ในหลักการการ Migrate DRx เป็น DR โดยมีแนวทางการพัฒนาเบื้องต้น¹ ดังนี้ Migrate DRx ที่ซื้อขายปัจจุบันทั้งหมด มาเป็น DR โดยใช้เกณฑ์ซื้อขายเหมือน DR ในปัจจุบัน เพื่อช่วยแก้ไขข้อจำกัดในการซื้อขายและส่วนที่เกี่ยวข้อง** เช่น เรื่องกระบวนการเปิดบัญชี

เพิ่มเติม ช่องทางการส่งคำสั่งซื้อขายและฝากเงิน ต้นทุนในการปฏิบัติหน้าที่ของ Market Maker ทั้งนี้ **ทางตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้รับฟังความเห็นในหลักการดังกล่าวข้างต้นต่อสมาชิก และมองว่าจะส่งผลให้ผู้มีส่วนเกี่ยวข้องได้รับประโยชน์ดังตารางข้างล่างนี้**

¹ แนวทางการพัฒนา DRx เป็นข้อมูลเบื้องต้นเท่านั้น ทางตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างการพัฒนา และปรับปรุงระบบดังกล่าว

นักลงทุน

- **สะดวกในการลงทุน:** สามารถใช้บัญชีซื้อขายและวงเงินเดียวกันกับการลงทุนหุ้นและ DR, สามารถใช้ช่องทางการฝากถอนเงินเหมือนกับการลงทุนในหุ้น
- **มีช่องทางและเครื่องมือลงทุนที่ครบถ้วน:** สามารถใช้ช่องทางลงทุน (Online, Marketing, Trade Report) และ Function ปัจจุบันที่มีในตลาดหุ้นได้อย่างครบถ้วน
- **ยังสามารถลงทุนด้วยเงินจำนวนไม่สูง:** การซื้อขาย DR ปัจจุบันกำหนด Board Lot อยู่ที่ 1 หน่วย (DRx ที่ราคาต่อหน่วยสูงสุดในปัจจุบันอยู่ที่ 14-16 บาท)

บริษัท
หลักทรัพย์ (บล.)

- **ลดต้นทุนในการ Acquisition ผู้ลงทุน:** ผู้ที่มีบัญชีหุ้นอยู่แล้วสามารถซื้อขายได้ทันที และการ Acquire ผู้ลงทุนใหม่ สามารถแนะนำสินค้าอื่นได้ทันที
- **เพิ่มจำนวนสมาชิกที่สามารถให้บริการ:** เดิม DRx ซื้อขายผ่าน Streaming ทำให้เป็นข้อจำกัดของสมาชิกที่ไม่ได้ใช้ Streaming เป็น Front หลัก
- **เพิ่มช่องทางการให้บริการผู้ลงทุน:** ส่งคำสั่งผ่าน Marketing และ Trade Report

Issuer /
Market Maker
(MM)

- **ลดต้นทุนในการปฏิบัติหน้าที่ MM:** สามารถใช้ระบบงานที่ใช้ทำ Market Making เดียวกับผลิตภัณฑ์อื่นๆ และลด Market Risk และ Funding Cost ในส่วนของ Inventory

ที่มา : เอกสารประกอบการรับฟังความเห็นสมาชิกตลาดหลักทรัพย์ฯ (SET Member Hearing, 24 Apr 2024)

นอกจากนี้สมาคมฯ ได้สอบถามความคิดเห็นจากตัวแทนผู้ประกอบการถึงแนวทางดังกล่าวซึ่งเห็นว่าเป็นแนวทางการพัฒนาที่เป็นประโยชน์ต่ออุตสาหกรรมทั้งด้านผู้ลงทุนและผู้ประกอบการเอง โดยด้านผู้ลงทุนเองจะสามารถเข้าถึงหรือมีขั้นตอนการเปิดบัญชีที่สะดวกมากขึ้น การเพิ่มช่องทางการฝากเงินเพื่อซื้อ และผู้ลงทุนสามารถใช้เครื่องมือลงทุนที่ครบถ้วนสำหรับทางด้านผู้ประกอบการก็มองว่าการพัฒนาดังกล่าวจะส่งผลดีในหลายด้าน เช่น ในแง่ของการให้บริการจะสามารถเพิ่มช่องทางให้ผู้ลงทุนส่งคำสั่งการซื้อขายผ่านเจ้าหน้าที่การตลาดได้อีกช่องทาง โดยผู้ลงทุนสามารถส่งคำสั่งการซื้อขายผ่านเจ้าหน้าที่การตลาดได้ช่วยลดข้อจำกัดทางด้านระบบการซื้อขายของบริษัทหลักทรัพย์

ที่ไม่ได้จำกัดเฉพาะบนระบบ Streaming เท่านั้น นอกจากนี้มองว่าเป็นการสนับสนุนให้ตลาดมีสภาพคล่องที่มากขึ้น เนื่องจากปัจจุบัน DRx มีผู้ดูแลสภาพคล่องเพียงแห่งเดียว ซึ่งต่างจาก DR ที่มีผู้ดูแลสภาพคล่องหลายแห่ง ดังนั้นการพัฒนาดังกล่าวจะช่วยสนับสนุนให้ตลาดมีสภาพคล่องที่มากขึ้นในอนาคต

อย่างไรก็ตามแนวทางดังกล่าวปัจจุบันทางตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังอยู่ในระหว่างการพัฒนา ทั้งนี้ทางตลาดหลักทรัพย์ฯ คาดว่า จะพัฒนาระบบแล้วเสร็จในช่วงกลางปี 2568 ซึ่งปัจจุบัน DRx ยังสามารถซื้อขายได้ในรูปแบบเดิม โดยทางสมาคมฯ จะแจ้งความคืบหน้าให้สมาชิกทราบเป็นระยะต่อไป

Disclaimer:

เอกสารนี้จัดทำขึ้นโดยสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยเพื่อเผยแพร่ข้อมูลและเพื่อการศึกษาเท่านั้น ซึ่งจัดทำขึ้นจากแหล่งข้อมูลต่างๆ ที่น่าเชื่อถือ โดยข้อมูลดังกล่าวเป็นเพียงข้อมูล ณ วันที่ปรากฏในเอกสารนี้เท่านั้น จึงอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังวันดังกล่าว หรือเมื่อข้อมูลที่เกี่ยวข้องมีการเปลี่ยนแปลง ทั้งนี้ สมาคมฯ ได้ยืนยัน ตรวจสอบ หรือรับรองความสมบูรณ์ ความถูกต้องครบถ้วน ทันกาลทันเวลาของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด สมาคมฯ ไม่รับผิดชอบต่อบุคคลใดๆ จากการเรียกร้องใดๆ ไม่ว่าในทางสัญญา ในการทำละเมิด รวมถึงความประมาท หรือเหตุอื่นใด ที่เกิดจากการตัดสินใจหรือการกระทำใดๆ ที่เกิดจากความเชื่อถือในเอกสารดังกล่าว หรือในความเสียหาย ความสูญหาย ค่าสินไหมทดแทน หรือความรับผิดชอบใดๆ รวมถึงการสูญหายของข้อมูลหรือผลประโยชน์ ถึงแม้ว่าสมาคมฯ จะได้รับแจ้งว่าอาจเกิดความเสียหายดังกล่าวขึ้นได้ก็ตาม



Market & Securities Industry Statistics

Market & Securities Industry Statistics in Q2-2024

- ณ สิ้นไตรมาส 2/2567 ดัชนี SET ปิดที่ 1,300.96 จุด ลดลง 8.11% จากปี 2566 ส่วนดัชนี mai ปิดที่ 355.45 จุด ลดลง 13.64% จากปี 2566 โดยปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันของ SET และ mai รวมกัน ไตรมาส 2/2567 อยู่ที่ 44,708 ล้านบาท ลดลง 16.17% จากปี 2566
- มูลค่าการค้าตลาดตราสารหนี้ ณ สิ้นไตรมาส 2/2567 อยู่ที่ 16.91 ล้านล้านบาท เติบโต 2.85% จากสิ้นปี 2566 จากการเพิ่มขึ้นของตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐบาลเป็นหลัก
- ณ สิ้นไตรมาส 2/2567 บล.มีจำนวนสาขาทั้งสิ้น 382 แห่ง ลดลง 7 แห่ง จากปี 2566 และมีจำนวนการขึ้นทะเบียนและปฏิบัติหน้าที่ Investment Planner (IP) และ Investment Consultant (IC) มีจำนวนรวมกัน 7,807 ใบอนุญาต ลดลง 269 ใบอนุญาตจากปี 2566 โดยในส่วน IC ตามโครงสร้างเดิม มีจำนวน 171 ใบอนุญาต ลดลง 13 ใบอนุญาต และ IC ตามโครงสร้างใหม่ มีจำนวน 6,638 ใบอนุญาต รวมทุกประเภทลดลง 253 ใบอนุญาตจากปี 2566 ในส่วน IP ลดลง 3 ใบอนุญาต และ Analyst (ไม่รวม Technical) มี 404 ใบอนุญาต ลดลง 17 ใบอนุญาตจากปี 2566

%Change							
Equity Market -SET & mai	2023	Q4-2023	Q1-2024	Q2-2024	QoQ	YTD	
SET Index *	1,415.85	1,415.85	1,377.94	1,300.96	-5.59%	-8.11%	
mai Index*	411.61	411.61	411.72	355.45	-13.67%	-13.64%	
Market Capitalization (mil.Bt)*	17,859,733	17,859,733	17,434,494	16,468,996	-5.54%	-7.79%	
Total Turnover (mil. Bt)	12,959,506	2,671,588	2,880,166	2,548,382	-11.52%		
Avg. Daily Turnover (mil. Bt)	53,331	44,526	45,717	44,708	-2.21%	-16.17%	
Derivatives Market	2023	Q4-2023	Q1-2024	Q2-2024	QoQ	YTD	
Total Trading Volume (contracts)	129,491,241	29,067,099	27,272,406	26,493,052	-2.86%		
Avg. Daily Turnover (contracts)	532,886	484,452	432,895	464,790	+7.37%	-12.78%	
Open Interest (contracts)*	2,683,105	2,683,105	2,643,822	2,841,262	+7.47%	+5.89%	
Bond Market – ThaiBMA	2023	Q4-2023	Q1-2024	Q2-2024	QoQ	YTD	
Outright Trading Value (mil.Bt)	15,817,778	3,787,922	4,456,311	4,369,475	-1.95%		
Outright Daily Average (mil.Bt)	65,094	63,132	70,735	76,657	+8.37%	+17.76%	
Outstanding Value of domestic bond (mil.Bt)*	16,446,155	16,446,155	16,940,040	16,914,807	-0.15%	+2.85%	
Change							
License Holder (unit: company)*	2023	Q4-2023	Q1-2024	Q2-2024	QoQ	YTD	
Brokerage License	44	44	43	44	+1	0	
Dealer License	35	35	35	35	0	0	
Derivatives Agent	44	44	43	43	0	-1	
Financial Advisory License	70	70	72	70	-2	0	
Underwriting License	40	40	39	39	0	-1	
SBL License	28	28	27	27	0	-1	
Number of Branch (unit: branch)*	2023	Q4-2023	Q1-2024	Q2-2024	QoQ	YTD	
Bangkok and Surrounding Area**	180	180	181	175	-6	-5	
Other Provincial Area	209	209	212	207	-5	-2	
Number of IP/Analyst/IC (unit: license)*	2023	Q4-2023	Q1-2024	Q2-2024	QoQ	YTD	
Analysts	Capital Market	85	85	91	84	-7	-1
	Securities Market	305	305	299	292	-7	-13
	Derivatives Market	31	31	31	28	-3	-3
	Technical	83	83	84	82	-2	-1
	Investment Planners	1,001	1,001	1,002	998	-4	-3
Investment Consultants	Capital Market	0	0	0	0	0	0
	Securities Market	125	125	118	115	-3	-10
	Derivatives Market	59	59	57	56	-1	-3
	(New) Complex 1	4,844	4,844	4,779	4,703	-76	-141
	(New) Complex 2	1,494	1,494	1,423	1,414	-9	-80
	(New) Complex 3	199	199	188	186	-2	-13
(New) IC Plain	354	354	338	335	-3	-19	
Number of Investors – Equity*	2023	Q4-2023	Q1-2024	Q2-2024	QoQ	YTD	
No. of Investors Accounts (unit: accounts)*	5,662,406	5,662,406	5,861,622	6,017,232	+155,610	+354,826	
No. of Investors (unit: clients)* (not counting duplicates)	2,548,604	2,548,604	2,661,246	2,798,205	+136,959	+249,601	
Active Investors*** (unit: accounts)	476,979	424,893	449,938	443,278	-6,660	-33,701	
Number of Accounts – Derivatives*	2023	Q4-2023	Q1-2024	Q2-2024	QoQ	YTD	
Total Accounts*	318,860	318,860	326,868	338,452	+11,584	+19,592	

*Data at end of each period **Nonthaburi, Pathum Thani and Samut Prakan provinces *** Average data calculated from monthly data of number of active investors
Disclaimer: เอกสารนี้จัดทำขึ้นเพื่อเผยแพร่ข้อมูลและเพื่อการศึกษาเท่านั้น ซึ่งจัดทำขึ้นจากแหล่งข้อมูลต่างๆ ที่น่าเชื่อถือ โดยข้อมูลดังกล่าวเป็นเพียงข้อมูล ณ วันที่ปรากฏในเอกสารเท่านั้น จึงอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังวันดังกล่าว หรือเมื่อข้อมูลที่เกี่ยวข้องมีการเปลี่ยนแปลง ทั้งนี้ สมาคมมิได้ยืนยัน ตรวจสอบ หรือรับรองความสมบูรณ์ ความถูกต้องครบถ้วน ทันกาลทันเวลา ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด สมาคมไม่รับผิดชอบใดๆ จากการเรียกชื่อใด ไม่ว่าในทางสัญญา ในการทำละเมิด รวมถึงความประมาท หรือเหตุอื่นใด ที่เกิดจากการตัดสินใจ หรือการกระทำใดๆ ที่เกิดจากความเชื่อถือในเอกสารดังกล่าว หรือในความเสียหาย ความสูญหาย ค่าสินไหมทดแทน หรือความรับผิดชอบ รวมถึงการสูญหายของข้อมูลหรือผลประโยชน์ ถึงแม้ว่าสมาคมจะได้รับแจ้งว่าจะเกิดความเสียหายดังกล่าวขึ้นก็ตาม

Source: SET, TFEX, ThaiBMA, SEC