

การจัดการ Overnight Order ในช่วงเปลี่ยนระบบซื้อขาย และ Bait Functionality ในระบบซื้อขายใหม่

ตามที่ บมจ. ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) (“TFEX”) มีกำหนดใช้ระบบซื้อขายใหม่ (New Trading System) ตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป TFEX จึงขอแจ้งให้ทราบเกี่ยวกับการจัดการคำสั่งที่มีอายุข้ามวัน (Overnight Order) ในช่วงเปลี่ยนระบบซื้อขาย และ Bait Functionality ในระบบซื้อขายใหม่ ดังนี้

1. การจัดการคำสั่งที่มีอายุข้ามวัน (Overnight Order) ในช่วงเปลี่ยนระบบซื้อขาย

คำสั่งซื้อขายที่มีอายุข้ามวัน (Overnight Order) ได้แก่ Good till Date (GTD) และ Good till Cancel (GTC) ไม่สามารถโอนย้ายจากระบบซื้อขายเดิมไปยังระบบซื้อขายใหม่ได้ ผู้ลงทุนจะต้องดำเนินการส่งคำสั่งดังกล่าวในระบบซื้อขายใหม่อีกครั้ง

ในวันที่ 3 พฤษภาคม 2566 ซึ่งเป็นวันสุดท้ายของการซื้อขายบนระบบซื้อขายเดิม TFEX จึงใคร่ขอความร่วมมือจากผู้ลงทุน ดังนี้

- งดส่งคำสั่งซื้อขายประเภท GTD และ GTC
- โปรดยกเลิกคำสั่งซื้อขายประเภท GTD และ GTC เก่าที่ค้างในระบบเดิม ก่อนปิดการซื้อขาย
 - สินค้าที่ซื้อขายช่วงกลางวัน เช่น S50 Index Futures, Single Stock Futures : โปรดยกเลิกคำสั่งก่อน 16.55 น.
 - สินค้าที่ซื้อขายทั้งกลางวันและกลางคืน เช่น Commodity Futures, Currency Futures : โปรดยกเลิกคำสั่งก่อนตี 3 ของคืนวันดังกล่าว (หรือ 3.00 น. ของวันที่ 4 พฤษภาคม 2566)

หลังปิดการซื้อขายบนระบบเดิม คำสั่งซื้อขายประเภท GTD และ GTC ที่ค้างค้าง จะไม่ถูกย้ายไปยังระบบซื้อขายใหม่

2. Bait Functionality ในระบบซื้อขายใหม่

Bait Order เป็นคำสั่งซื้อขายประเภทหนึ่งที่ถูกสร้างโดยระบบและใช้ภายในระบบจับคู่ซื้อขาย (Matching Engine) เพื่อช่วยให้เกิดการจับคู่ข้ามกันระหว่าง Outright Order* และ Combination Order** ง่ายขึ้น โดยเป็นฟังก์ชันที่ TFEX ใช้มาอย่างต่อเนื่องจนถึงปัจจุบัน และประสงค์จะใช้งานบนระบบซื้อขายใหม่ต่อไป อย่างไรก็ตามผู้พัฒนาระบบซื้อขายได้เสนอแนะให้ TFEX ขึ้นระบบซื้อขายใหม่โดยปิดฟังก์ชัน Bait Order เป็นการชั่วคราวไว้ก่อน เพื่อลดความเสี่ยงและความซับซ้อนของระบบงานและให้การขึ้นระบบซื้อขายใหม่เป็นไปด้วยความราบรื่น โดยตลาดอนุพันธ์ต่างประเทศชั้นนำบางแห่งที่ใช้ระบบซื้อขายเดียวกับระบบงานใหม่ของ TFEX ก็ได้ปิดฟังก์ชัน Bait Order ในระบบซื้อขายด้วยเช่นกัน

ในการนี้ TFEX จะดำเนินการปิดฟังก์ชัน Bait Order บนระบบซื้อขายใหม่ และจะทำให้ระบบซื้อขายใหม่มีการทำงานที่เปลี่ยนแปลงไป ดังนี้

- ระบบไม่มีการสร้าง (Generate) Bait Order
- Combination Order สามารถจับคู่ได้กับ Combination Order เท่านั้น
- ไม่มีการจับคู่ข้ามกันระหว่าง Outright Order และ Combination Order

อย่างไรก็ตามผู้ลงทุนที่ประสงค์จะส่งคำสั่งซื้อขายเพื่อ Rollover ยังคงสามารถส่งคำสั่งซื้อขายเป็นราย Outright ได้ตามปกติ ทั้งนี้หากมีการเปิดใช้ฟังก์ชัน Bait อีกครั้ง TFEX จะแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบต่อไป

สำหรับเกณฑ์การซื้อขายอื่น ๆ ที่มีการเปลี่ยนแปลงในระบบซื้อขายใหม่ สามารถดูได้ตาม Link ดังนี้

https://media.set.or.th/set/Documents/2023/Jan/revised_trading_criteria_TFEX.pdf

หมายเหตุ

* Outright Order คือ การเปิดสถานะเพื่อซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยเป็นการเปิดสถานะฝั่งเดียว

** Combination Order เป็นคำสั่งที่อำนวยความสะดวกให้ผู้ลงทุนที่ต้องการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตั้งแต่ 1 Series ขึ้นไป สามารถทำได้เพียงแค่ส่งคำสั่งซื้อขาย 1 คำสั่ง และระบบการซื้อขายจะทำการจับคู่การซื้อขายให้ทุก Series ที่ส่งซื้อขายพร้อมๆ กันไปเลยในเวลาเดียวกัน
