

สรุปประเด็นคำถามจากการประชุมร่วมกับบริษัทสมาชิกศูนย์รับฝากหลักทรัพย์และสำนักหักบัญชี

New Depository and New Cash Equity Clearing Systems

Account Opening

คำถาม/ประเด็น	คำตอบ
1. รูปแบบ Account มีกี่แบบ และมีวิธีการทำงานอย่างไร	<ul style="list-style-type: none"> แบบ Model 1 – Client Account Level: เปิดบัญชีฝากคู่กับบัญชีซื้อขายเสมอ กล่าวคือ 1 Trading Account คู่กับ 1 Depository Account (1 Trading Account : 1 Depository Account) โดยลูกค้า 1 ราย อาจมี Trading Account หลายบัญชีก็ได้ ดังนั้นจำนวนบัญชีฝากเท่ากับจำนวน Trading Accounts จะทำให้ reconcile ข้อมูลระหว่าง Back office กับ PTI ง่าย แบบ Model 2 – Client Level เปิดบัญชีฝาก 1 บัญชีสำหรับลูกค้า 1 คนซึ่งมีจำนวน Trading Accounts หลายบัญชี กล่าวคือ Many Trading Accounts : 1 Depository Account จะทำให้ reconcile ข้อมูลระหว่าง Back office กับ PTI ได้ยากกว่าแบบที่ 1
2. ช่องทางดำเนินการเปิดบัญชี	<p><u>ช่องทางที่ 1 ผ่าน API message:</u> หากระบบ Back Office ของสมาชิกมีความสามารถในการส่ง API message สมาชิกสามารถเปิดบัญชีที่ Back office และให้ระบบส่ง API message ของเปิดบัญชีฝากหลักทรัพย์ในระบบ PTI ของ TSD ได้ จะทำให้สมาชิกสามารถทำงานเพียงครั้งเดียว ไม่ได้ทำให้ขั้นตอนการปฏิบัติงานเพิ่มขึ้น</p> <p><u>ช่องทางที่ 2 เปิดบัญชีที่ระบบ TSD โดยตรง:</u> หากสมาชิกไม่ได้พัฒนาระบบงานเพิ่มเติมเพื่อให้ส่ง API message ได้ หลังจากที่สมาชิกเปิดบัญชีที่ระบบ Back Office แล้ว สมาชิกต้องเปิดบัญชีฝากหลักทรัพย์ที่ระบบ PTI ของ TSD ด้วย จะทำให้สมาชิกทำงาน 2 ครั้ง</p> <p>ทั้งนี้สมาชิกสามารถเปิดบัญชีฝากหลักทรัพย์ในระบบ PTI ได้ 2 วิธี ดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> Key-in ผ่านระบบ PTI ที่ฟังก์ชัน Account Management Upload file – Account Profile Upload
3. การเปิด account Model #2 รองรับกรณี ลูกค้า 1 รายมีมากกว่า 1 depository account ได้หรือไม่	<ul style="list-style-type: none"> สามารถทำได้
4. การเปิดบัญชีในระบบงาน ศูนย์รับฝากตามรูปแบบ Model#2 (Many Trading Accounts : 1 Depository Account) กรณีลูกค้า 1 รายมี 3 บัญชี ขายหุ้นในบัญชีที่ 1 แต่มีหุ้นอยู่ในบัญชี 2 และซื้อหุ้นที่บัญชีที่ 3 ศูนย์รับฝากทราบได้อย่างไร และจะดำเนินการอย่างไร	<ul style="list-style-type: none"> ศูนย์รับฝากจะใช้ข้อมูลที่สมาชิก Identify ความสัมพันธ์ไว้ว่า Trading Account ใด จะเป็น Depository Account ใดในระบบงานของศูนย์รับฝาก (Map Trading Account กับบัญชี Depository account ในระบบ PTI) ในวัน Settlement TCH และ TSD ดำเนินการตามขั้นตอน ดังนี้ <ol style="list-style-type: none"> TCH ประมวลผล Net ตาม Trading Account ที่ได้รับจากตลาดหลักทรัพย์ และนำส่งให้ศูนย์รับฝาก ดังนั้น จากตัวอย่าง TCH ประมวลผล Trading Account บัญชีที่ 1 เป็น Net ส่งมอบและ Trading Account บัญชีที่ 3 เป็น Net รับมอบ ศูนย์รับฝากจะทำการ map ข้อมูลบัญชี Trading Account บัญชีที่ 1 และ Trading Account บัญชีที่ 3 กับ Depository A/C เช่น บัญชีเลขที่ 123

คำถาม/ประเด็น	คำตอบ
	<p>ทั้งนี้ แม้ Depository A/C จะเป็นบัญชีเดียวกัน ศูนย์รับฝากจะไม่ Net ภาระการส่งมอบ-รับมอบของบัญชีที่ 1 และ บัญชีที่ 3 แต่จะดำเนินการตาม ข้อมูลที่ได้รับจาก TCH</p> <ol style="list-style-type: none"> 3. เวลา 12.30 น. ศูนย์รับฝากจะโอนหุ้นเพื่อเตรียมส่งมอบ (Sweep up) จาก Depository A/C เลขที่ 123 ตามจำนวน Net ส่งมอบ ของ Trading Account บัญชีที่ 1. 4. เวลา 14.30 น. ศูนย์รับฝากจะส่งมอบหุ้น (sweep down) เข้า Depository Account เลขที่ 123 ตามจำนวน Net รับมอบของ Trading Account บัญชีที่ 3
<p>5. การเปิดบัญชีต้องดำเนินการเมื่อไร</p>	<ul style="list-style-type: none"> ● เพื่อป้องกันปัญหาการส่งมอบหลักทรัพย์ สมาชิกควรเปิดบัญชีฝากหลักทรัพย์ กับ TSD พร้อมระบุเลขที่บัญชีซื้อขายให้ถูกต้องให้แล้วเสร็จ ก่อนที่ TCH จะ นำส่งรายงานสรุปการประมวลผล Net obligation จากการซื้อขายภายในเวลา 10.30 น.ของวันที่ T+3
<p>6. เมื่อเริ่มใช้ระบบใหม่ครั้งแรก ทำอย่างไร</p>	<ul style="list-style-type: none"> ● TSD จะดำเนินการ Migrate ข้อมูลที่สมาชิกจัดเตรียมทั้งหมดดังต่อไปนี้ เข้าระบบ PTI <ol style="list-style-type: none"> 1. การเปิดบัญชีพร้อมการ Map Trading และ Shareholder ของลูกค้าทั้งหมด 2. การโอนหุ้นจากบัญชี Omnibus ไปยังบัญชีลูกค้า (Segregate Depository Account) 3. การโอนหุ้นที่เข้าคิวจอง Room ในบัญชี Omnibus ไปยังบัญชีลูกค้า (Segregate Depository Account) 4. รายการจำหน่ายให้สมาชิกเตรียมเปิดบัญชี Segregate Depository Account และ Map Shareholder 5. การเครดิตหุ้น เตรียมเปิดบัญชี Segregate Depository Account และ Map Shareholder โดยระบุ Brokerage Account ID เพื่อรองรับการเครดิตหุ้นลูกค้าที่มีการจำหน่าย ● TCH จะดำเนินการ Migrate ข้อมูล ดังต่อไปนี้เข้าระบบงาน New Clearing <ol style="list-style-type: none"> 1. รายการซื้อขายที่ค้างค้าง (pending settlement trades) => TCH เตรียมข้อมูล 2. รายการ NVDR Adjustment รายการ Pre-settlement Matching Transaction ที่สมาชิกดำเนินการสร้างรายการที่ระบบ PSMS ในเวลาที่กำหนดให้ดำเนินการได้ => สมาชิกต้องดำเนินการบนระบบ PSMS 3. รายการแก้ไขรายการซื้อขาย (Trade Amendment) ที่สมาชิกดำเนินการสร้างจากระบบ Back office => สมาชิกเตรียมข้อมูล 4. NVDR/TF Late Settlement Outstanding => TCH เตรียมข้อมูล 5. SBL Outstanding ของ สมาชิกที่เป็น borrower => TCH เตรียมข้อมูล 6. Securities Default Outstanding => TCH เตรียมข้อมูล ● TSD และ TCH จะแจ้งรายละเอียดเรื่อง Data Migration อีกครั้งหนึ่ง เมื่อจะเริ่มใช้งานระบบใหม่
<p>7. กรณีระบบ Back office ของ Broker เปิดบัญชีลูกค้าไม่</p>	<ul style="list-style-type: none"> ● การเปิดบัญชีฝากแบบนี้เป็นรูปแบบที่ 2 (Model 2) คือ Many Trading Accounts map to One Depository Account (Many to one) ดังนั้นระบบ Back

คำถาม/ประเด็น	คำตอบ
<p>เหมือนกับที่เปิดในระบบ PTI จะทำอะไร เนื่องจากที่ระบบ Back Office จะเปิดบัญชีเพื่อบันทึกจำนวนหุ้นตาม Trading Account ซึ่งโดยทั่วไปมี 3 บัญชี ได้แก่</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. บัญชีสำหรับ Cash Balance 2. บัญชีสำหรับ Credit Balance และ 3. บัญชีสำหรับ Cash Account <p>แต่สมาชิกจะเปิดบัญชีฝากหลักทรัพย์สำหรับลูกค้ารายนี้ที่ TSD เพียง 1 บัญชี</p>	<p>office ของ Broker จะต้องมีโปรแกรมเพื่อ รวมบัญชีซื้อขายของลูกค้ารายนั้น และสร้างเป็นบัญชีฝาก 1 บัญชี และส่งรายการเปิดบัญชีฝากดังกล่าวเข้าสู่ระบบ PTI</p>
<p>8. เลขที่บัญชีฝากไม่จำเป็นต้องเป็นบัญชีเดียวกับบัญชี Trade ใช่หรือไม่</p>	<ul style="list-style-type: none"> ● แม้ว่าสมาชิกสามารถใช้เลขที่บัญชีต่างกันได้ แต่เพื่อความสะดวกสมาชิกควรใช้เลขที่บัญชีเดียวกัน
<p>9. หากมีการเปิดบัญชีซื้อขายของลูกค้าระหว่างวัน จะต้องเปิดบัญชีอื่นที่ใดบ้าง</p>	<ul style="list-style-type: none"> ● สมาชิกเปิดบัญชีซื้อขายของลูกค้าที่ระบบ Back office ของสมาชิกและส่ง message API มาเปิดบัญชีฝากหลักทรัพย์ที่ระบบของ TSD (PTI) ได้ทันที แต่หากสมาชิกไม่มี API สมาชิกสามารถมาเปิดบัญชีที่ระบบของ TSD ภายหลังได้ แต่ต้องดำเนินการก่อน Cut-off time ของ Settlement date (10.30 น.) ● หากสมาชิกไม่เปิดบัญชีฝากหลักทรัพย์ของลูกค้าที่ PTI <ul style="list-style-type: none"> - ถ้าลูกค้ามีหน้าที่ต้องส่งมอบหุ้น ระบบจะไม่สามารถ Sweep up ได้ ทำให้สมาชิกผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ต่อ TCH - ถ้าลูกค้ามีหน้าที่รับมอบหุ้น ระบบจะไม่สามารถ Sweep down ได้ ทำให้หุ้นที่ได้รับจากการ settlement จะเก็บอยู่ในบัญชี SINK account แทน ซึ่งสมาชิกจะต้องโอนหุ้นเอง
<p>10. ขอ Guideline ในการเปิดบัญชีเพื่อ trade กองทุน และ allot ให้ custodian เก็บรักษา underlying</p>	<ul style="list-style-type: none"> ● Model ในการเปิดบัญชีและการทำรายการ PSMS เพื่อบัญชีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน (บลจ.) ขึ้นกับ Broker และ Custodian ตกลงรูปแบบกัน โดยมีทางเลือกดังนี้ ● Model 1 Broker เปิดทั้งบัญชีแม่และบัญชีลูก และทำ Trade allotment จากบัญชีแม่ไปบัญชีลูก และทำ PSMS แบบ one-to-one เพื่อ match กับรายการ PSMS ของ Custodian ที่ระบุเลขที่บัญชีของลูกค้า ● Model 2 Broker เปิดเฉพาะบัญชีแม่ และส่งรายการ PSMS โดยระบุเลขที่บัญชีแม่ โดยส่งรายการ PSMS ด้วยจำนวนรายการเท่ากับจำนวนกองทุน เพื่อ match กับรายการ PSMS ของ Custodian ที่ระบุเลขที่บัญชีของลูกค้า
<p>11. shareholder มีที่อยู่แตกต่างกันศูนย์รับฝาก พิจารณาอย่างไร และโดยสรุป เมื่อสมาชิกเปิดบัญชี</p>	<ul style="list-style-type: none"> ● ในการเปิดบัญชีฝากในระบบงานศูนย์รับฝาก สมาชิกสามารถเปิดบัญชีได้เอง โดยสมาชิกจะต้อง map ข้อมูลเพิ่ม 2 เรื่อง <ul style="list-style-type: none"> ▪ การ map กับ Trading Account เพื่อประโยชน์ในการ sweep หุ้นสำหรับส่งมอบ – รับมอบหุ้น

คำถาม/ประเด็น	คำตอบ																									
<p>ฝากหลักทรัพย์จะต้องแจ้งข้อมูลศูนย์รับฝากในเรื่องใดบ้าง</p>	<ul style="list-style-type: none"> การ map กับ Shareholder เพื่อประโยชน์ในการส่งรายชื่อบิตสมุดทะเบียน <p>ในกรณีนี้ต้องมี <i>shareholder profile</i> เท่ากับจำนวนที่อยู่ของลูกค้า ดังนั้นจะต้องมี <i>Depository Account</i> อย่างน้อย 2 บัญชีเนื่องจาก <i>Many shareholder profiles map to one depository account</i> ไม่ได้ แต่ <i>One shareholder profile map to many depository accounts</i> หรือ <i>One shareholder profile map to one depository account</i> ได้</p> <p>การ Map Depository Account กับ Trading Account และ Shareholder Profile</p> <table border="1" data-bbox="571 566 1362 898"> <thead> <tr> <th>Depository Account (1)</th> <th>Trading Account (2)</th> <th>Map (1) กับ (2)</th> <th>Shareholder Profile (3)</th> <th>Map (1) กับ (3)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>One</td> <td>One</td> <td>✓</td> <td>One</td> <td>✓</td> </tr> <tr> <td>One</td> <td>One</td> <td>✓</td> <td>Many</td> <td>X</td> </tr> <tr> <td>Many</td> <td>One</td> <td>X</td> <td>One</td> <td>✓</td> </tr> <tr> <td>One</td> <td>Many</td> <td>✓</td> <td>One</td> <td>✓</td> </tr> </tbody> </table> <p>หลักการ: Map Shareholder กับ Depository Account และ Trading Account</p> <ol style="list-style-type: none"> One shareholder profile can be mapped to one depository account or many depository accounts. One depository account can be mapped to one trading account or many trading accounts. 	Depository Account (1)	Trading Account (2)	Map (1) กับ (2)	Shareholder Profile (3)	Map (1) กับ (3)	One	One	✓	One	✓	One	One	✓	Many	X	Many	One	X	One	✓	One	Many	✓	One	✓
Depository Account (1)	Trading Account (2)	Map (1) กับ (2)	Shareholder Profile (3)	Map (1) กับ (3)																						
One	One	✓	One	✓																						
One	One	✓	Many	X																						
Many	One	X	One	✓																						
One	Many	✓	One	✓																						
<p>12. สามารถสร้าง shareholder profile 2 profile ที่มีข้อมูลเหมือนกันได้หรือไม่</p>	<ul style="list-style-type: none"> shareholder profile 2 profile ไม่สามารถมีข้อมูลเหมือนกันทั้งหมดได้ สำหรับลูกค้า 1 รายที่ต้องการสร้างข้อมูล shareholder profile มากกว่า 1 shareholder profile จะต้องสร้างข้อมูล shareholder profile โดยกำหนด Brokerage account ให้แตกต่างกัน และจะต้องมี Depository Account มากกว่า 1 account 																									
<p>13. ถ้าผู้ถือหุ้น 1 คน มีหลาย shareholder profile หนังสือรับรองหักภาษีจะรวมส่งหรือไม่</p>	<ul style="list-style-type: none"> การส่งหนังสือรับรองหักภาษีและการคำนวณสิทธิประโยชน์ของนายทะเบียนจะยังคงหลักการเดิม ผู้ถือหุ้นที่มีชื่อ,สกุลและที่อยู่เหมือนกันจะส่งหนังสือรับรองหักภาษีไปที่อยู่เดียว 																									
<p>14. ถ้ามีการย้าย Branch เปลี่ยน Trading ID (Trading Account) และลูกค้า 1 คนมีหลาย Trading ID (Trading Accounts)</p>	<ul style="list-style-type: none"> สมาชิกสามารถ map Trading ID กับ Depository Account เพิ่มได้ แต่ถ้า 1 Depository Account มี 1 Trading ID สมาชิกต้องทำการ Rectify Trading ID (Trading Account) ในระบบ New Clearing หากอยู่ในช่วงก่อน settlement 																									
<p>15. การปิดบัญชี มี FIXML จาก Back office ไประบบ TSD</p>	<ul style="list-style-type: none"> การปิดบัญชีสำหรับ Equity market ใน Phase แรกยังไม่รองรับการส่งคำสั่งด้วย FIXML ต้องทำการปิดบัญชี/Inactive บัญชีที่ PTI 																									

คำถาม/ประเด็น	คำตอบ
หรือไม่	<ul style="list-style-type: none"> ถ้าลูกค้าคนเดิมปิดบัญชีแล้วและอาจกลับมาเปิดใหม่และต้องการใช้เลขที่บัญชีเดิม ดังนั้นสมาชิกไม่ควรปิดบัญชี ควรทำการ Inactive บัญชี
16. ในระบบใหม่ กรณีเปิดบัญชี pledge อยู่แล้วยังต้องเปิดบัญชีใหม่อีกหรือไม่	<ul style="list-style-type: none"> ถ้าเปิดบัญชี Credit Balance แล้วไม่ต้องเปิดบัญชี pledge อีก
17. กรณีลูกค้ามีการจำหน่ายหุ้น ควรเปิดบัญชีอย่างไร	<ul style="list-style-type: none"> สามารถใช้บัญชีที่เปิดกับศูนย์รับฝากในระดับ Segregate Account บัญชีเดียว โดยไม่ต้องเปิดบัญชีเพิ่ม โดยกรณีจำหน่ายจะมี status ที่ Account แจ้งให้สมาชิกทราบ
18. Interface file ที่ส่งให้กับสมาชิก ในข้อ 4.7 เรื่อง Account management เป็น interface file ของ Equity หรือ Derivatives	<ul style="list-style-type: none"> ข้อ 4.7 เรื่อง Account management เป็น interface file ของ Derivatives อย่างไรก็ตาม TCH จะปรับปรุง Interface file โดยระบุตลาดให้ชัดเจน

Trade Registration & Amendment

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> ข้อจำกัดรายการ Gross Settlement ที่จะ Settlement ในวันที่ทำการซื้อขาย (วันที่ T) กรณีฝ่ายกำกับกรซื้อขายของ SET ขอความร่วมมือจากสมาชิกไม่ให้ส่งรายการ Big lot Trade ในระหว่างวัน เนื่องจากอาจทำให้ราคาของหุ้นเบี่ยงเบน 	<ul style="list-style-type: none"> รายการซื้อขาย Big lot ที่มีจำนวน 1 ล้านหุ้น หรือ 3 ล้านบาท สามารถทำรายการซื้อขายระหว่างวันได้ แต่หากการซื้อขายดังกล่าวมีราคาที่ไม่ได้อยู่ใน ceiling-floor band หรือปริมาณการซื้อขายสูงมากจนอาจมีผลต่อสภาพปกติของตลาด สมาชิกจะต้องบันทึกรายการซื้อขายดังกล่าวเข้าสู่ระบบในช่วง off-market hour (หลังตลาดปิด) ซึ่งจะส่งผลให้สมาชิกไม่สามารถ Settle รายการดังกล่าวได้ในวันที่ T เนื่องจากมูลค่า Settlement ของ Gross Deal มักจะมีมูลค่าสูงมาก TCH ขอให้สมาชิกแจ้งให้ Settlement Bank ทราบล่วงหน้า 1 วัน โดยสมาชิกจะต้องนำส่งข้อมูลที่สมาชิกได้ประสานงานกับ Settlement Bank เกี่ยวกับจำนวนเงินที่จะรับมอบหรือส่งมอบให้เจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องของ Settlement Bank ทราบแล้วเป็นการล่วงหน้า มาที่ TCH ซึ่งในการติดต่อกับ Settlement Bank นั้นสมาชิกไม่ต้องระบุชื่อหุ้น จำนวนหุ้น แจ้งเฉพาะข้อมูลด้านเงิน เพื่อที่ TCH จะนำส่งต่อไปให้กับ หน่วยงานที่เกี่ยวข้องกับ Settlement ในระบบ BAHTNET ของ Settlement Bank และ ธนาคารแห่งประเทศไทย ต่อไป
<ul style="list-style-type: none"> การแก้ไขรายการซื้อขาย deal ที่ match แล้ว 	<ul style="list-style-type: none"> การแก้ไขรายการซื้อขายจากระบบ Front office จะผ่านทาง SET connect มาที่ clearing system ซึ่งเป็น one way เท่านั้น โดยจะไม่ได้รับ feed ตอบกลับ ถ้าแก้ไขรายการซื้อขายจากระบบ Back Office ของสมาชิกที่ส่งด้วย FIXML message มาที่ Clearing system จะได้รับ feed ตอบกลับแบบ Real time
<ul style="list-style-type: none"> Trade amendment เป็นฟังก์ชันที่ทำงานบนระบบ New clearing สำหรับ 	<ul style="list-style-type: none"> ใช้: Trade amendment เป็นฟังก์ชันงานที่ใช้แก้ไขรายการซื้อขายใน clearing system โดยสมาชิกต้องอ้างอิง Deal จากการซื้อขาย ซึ่งต้องเป็น Deal ที่ยังไม่ Settle เท่านั้น ยกเว้นรายการ NVDR Extension ซึ่งสามารถแก้ไขรายการ

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<p>รายการที่ยังไม่ Settlement ไซหรือไม</p>	<p>ได้หลังจาก Settlement ไปแล้ว โดยสามารถเลือก Deal ย้อนหลังได้ไม่เกิน 3 เดือน</p> <ul style="list-style-type: none"> ● ในการแก้ไขรายการซื้อขาย (rectify trade) สมาชิกสามารถดำเนินการได้ตั้งแต่วันที่ T โดยระบบ Clearing จะ recalculate net obligation ให้ ทั้งนี้ สมาชิกจะต้องแก้ไขก่อน Cut-off time ของการทำรายการเพื่อให้มีผลต่อการ Settlement ในวันนั้น
<ul style="list-style-type: none"> ● Broker สามารถนำข้อมูลที่ได้จาก บลจ. ในตอนเย็น มา Upload เข้าระบบ Clearing เพื่อทำ Allotment ได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ● ข้อมูลที่ได้จาก บลจ. อาจมีข้อมูลไม่ครบถ้วน และมี Format ไม่ตรงตามที่ TCH กำหนด ซึ่งสมาชิกอาจต้องใส่ข้อมูลเพิ่ม และแปลง Format ให้เหมือนกับ Format ของ TCH จึงจะสามารถ Upload เข้าระบบ Clearing ในหน้าจอ Trade Amendment หรือส่ง API message ได้
<ul style="list-style-type: none"> ● Trade Amendment ที่เป็น บัญชีกองทุน จะรวมบัญชีจากบัญชีกองแม่หลายบัญชีแล้วค่อยส่งจำนวนหลักทรัพย์แยกให้กับบัญชีกองลูก ระบบรองรับหรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ● ไม่สามารถทำได้: เนื่องจากการทำ trade allotment ของกองทุน จะต้องใช้ฟังก์ชัน trade amendment ในระบบ New Clearing ซึ่งต้องอ้างอิง deal แต่ละ deal ดังนั้นระบบจะตรวจสอบข้อมูลตาม deal คือ ใน 1 trade (ด้านซื้อหรือ ด้านขาย ของ deal) ต้องมี account เดียว (กรณีนี้เป็นบัญชีแม่) ที่ได้รับการจับคู่จะสามารถแตกออกเป็นหลาย trade ได้ตามจำนวนกองลูก ทั้งนี้สมาชิกสามารถทำพร้อมกันได้หลายๆ deal โดยระบบจะเช็คยอดรวมของหุ้นที่ split แล้วจะต้องตรงกับจำนวนหุ้นในแต่ละ trade ที่ทำการแก้ไขรายการซื้อขาย
<ul style="list-style-type: none"> ● การแก้ไขรายการซื้อขาย NVDR ผิดพลาด ทั้งก่อน Settlement และ ภายหลัง Settlement อ้างอิง Order หรือ Deal ที่ระบบการซื้อขาย ● สมาชิกสามารถเลือก Order เพื่อแก้ไขได้ครั้งเดียวซึ่งมีหลาย ๆ Deal เช่น 1 Order ที่ประกอบด้วย Deal จำนวน 2,000 Deal เป็นต้น 	<ul style="list-style-type: none"> ● การแก้ไขรายการซื้อขาย NVDR ที่ผิดพลาดในระบบ New Clearing ต้องอ้างอิง Deal ซื้อขายเช่นเดียวกับปัจจุบัน เนื่องจากเป็นเกณฑ์ที่ กลต. กำหนดว่าการแก้ไขรายการซื้อขาย NVDR ต้องเป็นความประสงค์และมาจากคำสั่งของลูกค้าเท่านั้น หากให้ระบบคัดเลือก Deal ตามลำดับ FIFO อาจได้ Deal ที่ไม่ตรงตามประสงค์ของลูกค้าได้ ดังนั้นสมาชิกจึงมีความจำเป็นที่จะต้องเลือก Deal ที่ต้องการแก้ไข NVDR แต่ละ Deal เอง ● หากสมาชิกต้องการทราบเลขที่ Order สามารถสืบค้นจาก Position Ledger ซึ่งจะมี field "Order ID" ซึ่งแสดงค่าเลขที่ Order
<ul style="list-style-type: none"> ● Sub-broker ทำรายการ trade ผ่าน broker ในระบบ new clearing ข้อมูล Net 1 จะแสดงรายการของ Sub broker หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ● ถ้า Sub-broker เป็น clearing member ข้อมูล Net Trading (Net 1) จะแสดงรายการซื้อขายของ Sub-broker
<ul style="list-style-type: none"> ● TCH ดำเนินการกรณีที่ Broker ทำการแก้ไขรายการซื้อขายจาก 2 	<ul style="list-style-type: none"> ● วันที่ทำการซื้อขาย (วันที่ T) ภายในเวลาที่ระบบ SET Connect เปิดให้บริการ TCH รับข้อมูลการแก้ไขรายการซื้อขาย ทั้งจาก Front Office Application ที่ทำการแก้ไขผ่าน SET Connect แต่ระบบ Clearing ไม่

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
ช่องทาง คือ Front Office และ Back Office อย่างไร	<p>สามารถส่งข้อมูลตอบกลับผ่าน SET Connect ทำให้ Front Office อาจมีความเข้าใจคลาดเคลื่อนเกี่ยวกับผลสำเร็จของการแก้ไขรายการซื้อขายได้จาก Back Office Application ที่ทำรายการผ่านระบบ New Clearing โดยสมาชิกจะได้รับข้อมูลตอบกลับจากระบบ New Clearing โดยตรง TCH ขอให้สมาชิกบริหารจัดการ การแก้ไขรายการซื้อขายให้มีเพียงช่องทางเดียวว่าจะให้ Front Office หรือ Back Office เป็นผู้ทำการแก้ไขรายการซื้อขาย</p> <ul style="list-style-type: none"> ● ทั้งนี้ในวันที่ซื้อขาย (วันที่ T) ภายหลังระบบ SET Connect ปิดให้บริการ สมาชิกสามารถแก้ไขรายการซื้อขายที่ระบบ New Clearing ได้จาก Back Office เท่านั้นจนถึงเวลา 19.00 น.
<ul style="list-style-type: none"> ● รายการ Give-up/Take-up ที่สมาชิกดำเนินการผ่านระบบงาน New Clearing ในวันที่ซื้อขาย (T) ระบบจะดำเนินการล้างรายการซื้อขายของสมาชิกฝั่ง Give up ที่ระบบงานซื้อขาย (Front office) ได้อย่างไร 	<ul style="list-style-type: none"> ● ระบบ Clearing ไม่สามารถล้างรายการที่ Front Office ของสมาชิกได้ หากสมาชิกที่ประสงค์ให้ update ในระบบงาน Front office สมาชิกจะต้องดำเนินการ update รายการดังกล่าวอีกครั้ง เนื่องจากปัจจุบันระบบ Front Office ของสมาชิกไม่ได้เชื่อมต่อโดยตรงกับระบบ Clearing ที่เป็นระบบจัดการ Give-up/Take-up ดังนั้นระบบ Back office ของสมาชิกต้องเป็นผู้ดำเนินการทำรายการ Give-up/ take-up และส่ง API message มาที่ Clearing System ซึ่งจะได้รับข้อมูลตอบกลับไปยังระบบ Back Office ของสมาชิกแบบ Real time เท่านั้น ดังนั้นหากสมาชิกต้องการให้ update ที่ Front office ด้วยสมาชิกต้องมีการเชื่อมต่อเองภายในบริษัทระหว่างระบบ Back Office และ Front Office แบบ real time ● อย่างไรก็ตามในระบบ New Clearing ทุกหน้าจอนั้น สมาชิกสามารถ Download ข้อมูลเป็น Excel File เพื่อนำไปใช้งานต่อไปได้
<ul style="list-style-type: none"> ● Broker ทำรายการ trade แล้ว Give up ให้ Broker อีกราย ข้อมูล Net 1 จะแสดงรายการอยู่ที่ Broker ที่ Take up หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ● ถ้ารายการ Take up ได้รับการ approve อย่างสมบูรณ์ในวันที่เกิดรายการซื้อขาย ข้อมูล Net Trading จะมาแสดงที่ Broker ที่ Take up
<ul style="list-style-type: none"> ● ใน Clearing System สามารถ Reject รายการที่ Approve ไปแล้วได้หรือไม่ หรือต้องให้ Counterparty เป็นผู้ Reject 	<ul style="list-style-type: none"> ● กรณีสมาชิกยังไม่ Approve รายการ สมาชิกสามารถ Reject รายการได้ ซึ่งเหมือนการใช้งานบนระบบ PTI ● อย่างไรก็ตาม หากเป็นรายการเกี่ยวกับการโอน Obligation เช่น Give up/Take up เป็นรายการที่คู่กรณีทั้ง 2 ด้านจะต้องรับทราบและยอมรับการทำรายการโอน หรือ รับโอน Obligation ดังนั้นหากสมาชิกด้านส่ง ทำการ approve รายการแล้วแสดงว่ายืนยันการทำรายการและ trigger ระบบว่าเป็นสถานะสุดท้ายจากสมาชิกที่สร้างรายการโอนแล้ว หากสมาชิกรายดังกล่าวต้องการยกเลิกต้องได้รับความยินยอมจากคู่กรณี โดยคู่กรณีต้องเป็นผู้ Reject รายการ
<ul style="list-style-type: none"> ● กรณี Broker ซื้อขายผิด โดยระบุประเภทหลักทรัพย์ใน deal ว่าเป็น Client แต่เปิดบัญชีฝากที่ศูนย์รับฝาก เป็น Proprietary ระบบจะ 	<ul style="list-style-type: none"> ● TCH ประมวลผล Net Obligation ตาม Trade Account และ Investor Type โดยระบบงาน TCH จะไม่ทราบข้อมูล Depository Account ของลูกค้า เช่น Trade Account 111 ส่งคำสั่งซื้อขายรายการที่ 1 เป็น Proprietary และรายการที่ 2 เป็น Client TCH ประมวลผล Net Obligation และส่งข้อมูลให้ศูนย์รับฝากแยกเป็น 2 รายการ

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
ดำเนินการอย่างไร	<ul style="list-style-type: none"> ● TSD จะตรวจสอบความถูกต้องของบัญชีที่สมาชิกเปิดที่ระบบงานศูนย์รับฝาก และแจ้ง map บัญชีไว้ หากไม่ถูกต้อง ศูนย์รับฝากจะไม่สามารถ Sweep up หรือ Sweep Down ได้ ดังนั้น Account 111 เปิดบัญชีที่ระบบงานศูนย์รับฝากเป็น Proprietary รายการที่ 1 ศูนย์รับฝากจะดำเนินการ Sweep หุ้นได้ แต่รายการที่ 2 สมาชิกเปิดบัญชีไม่ถูกต้อง ดังนั้น ศูนย์รับฝากจะไม่สามารถ Sweep หุ้นได้ ● สมาชิกสามารถ Reconcile ข้อมูล Net trading รายหลักทรัพย์ได้ในระดับ Segregate Account และ Omnibus Account ระหว่างระบบงาน Back Office ของสมาชิกกับระบบงาน New Clearing เพื่อแก้ไข Rectify Investor Type ให้ถูกต้องก่อน Cut-off time ของวัน Settlement Date ได้ หมายเหตุ: ในระบบงาน New Clearing ตรวจสอบ Net Obligation ในระดับ Segregate Account ได้จาก Net 1 และ Net 2 ตั้งแต่วันที่ T ● ในระบบงานศูนย์รับฝาก: สมาชิกสามารถตรวจสอบได้จาก Daily Report ซึ่งเป็นรายงานที่แสดง Pending Settlement ทุกสิ้นวัน ระยะเวลา 3 วัน ของแต่ละ Segregated Account
<ul style="list-style-type: none"> ● การทำรายการ SWAP หุ้น ดำเนินการอย่างไร 	<ul style="list-style-type: none"> ● การทำรายการ SWAP หุ้น จะต้องอ้างอิง Deal โดยมีเงื่อนไขการทำรายการ และเวลาทำรายการเช่นเดียวกับปัจจุบัน และ ทำได้ตั้งแต่วันที่ Trade โดย TCH อนุญาตให้ทำได้เฉพาะ Buying Trades <ul style="list-style-type: none"> ○ กรณี Swap (F - - > L) ทราบผล Real Time ○ กรณี Swap (L/R - - > F) กรณีมี Room เพียงพอ ระบบจะ Lock Room ไว้ให้เมื่อสมาชิก Approve รายการก่อนเวลา Settlement ○ กรณี Swap (L/R - - > F) กรณีไม่มี Room เพียงพอ ระบบจะเข้า Queue ให้สมาชิก และหากถึงกำหนด Cut-off time ของการทำรายการ SWAP (Foreign adjustment) ที่กำหนดเป็นเวลาเดิมคือ 15.30 น. ของวันที่ T+2 ยังไม่มี Room จะยกเลิกรายการเข้า Queue Room และยกเลิกรายการ Foreign Adjustment นั้น เพื่อให้สมาชิกมีเวลาในการจัดการด้านอื่นๆ เพื่อไม่ให้เกิดการติดขัดกับสำนักหักบัญชี
<ul style="list-style-type: none"> ● การทำรายการ SWAP ยังมี Cut-off time ที่ เวลา 15.30 น. ของวันที่ T+2 หรือไม่ สามารถขยายเวลาเป็น 10.30 น. ของ T+3 ได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ● TCH ยังคงกำหนด Cut-off time ของการทำรายการ SWAP (Foreign adjustment) ไว้ที่เวลาเดิมคือ 15.30 น. ของวันที่ T+2 เนื่องจากหากสมาชิกไม่ได้ room จากการ SWAP ก็ยังมีเวลาในการบริหารจัดการหาหลักทรัพย์ Foreign หากมีรายการขายหลักทรัพย์ Foreign ไปแล้วเพื่อไม่ให้เกิดการติดขัดกับสำนักหักบัญชี

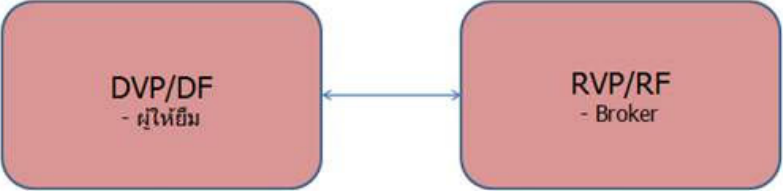
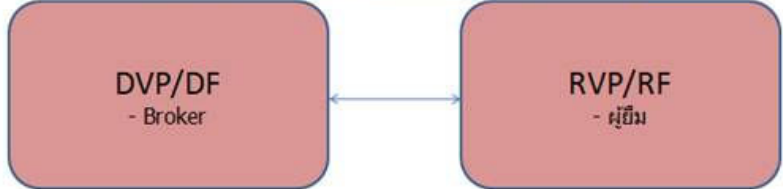
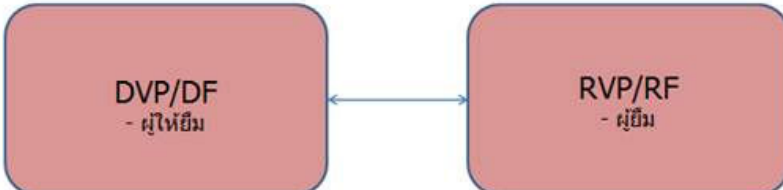
Pre-Settlement Matching System (PSMS)

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> ระบบ PSMS สามารถระบุชื่อย่อหลักทรัพย์ได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ระบบ PTI รองรับทั้งการระบุชื่อย่อหลักทรัพย์ด้วย ISIN และชื่อย่อหลักทรัพย์
<ul style="list-style-type: none"> กรณีลูกค้าซื้อ L (ดำเนินการผ่าน Broker) แต่ต้องการรับเป็น F (ดำเนินการผ่าน Custodian) ทาง Broker ต้องสร้างรายการ DVP โดยระบุเป็นหุ้น L หรือ F จะให้ระบุ ISIN code ของรายการ DVP /RVP ในระบบ PSMS อย่างไร 	<p>การระบุ ISIN code ในรายการ DVP /RVP ที่รายการ PSMS</p> <ul style="list-style-type: none"> กรณี Broker ซื้อหุ้น Local และต้องส่งมอบหุ้นให้กับ Custodian ให้ทำรายการ DVP ระบุชื่อย่อหุ้น หรือ ISIN Code เป็น Local และระบุ Conversion flag LF ส่วน Custodian ทำรายการ RVP โดยระบุชื่อย่อหุ้น หรือ ISIN Code รับมอบหุ้น Foreign กรณี Broker ขายหุ้น Local และต้องรับมอบหุ้น Foreign จาก Custodian ให้ทำรายการ RVP ระบุชื่อย่อหุ้น หรือ ISIN Code เป็น Local และระบุ Conversion flag FL ในส่วน Custodian ทำรายการ DVP โดยระบุชื่อย่อหุ้น หรือ ISIN Code ส่งมอบหุ้น Foreign มี Function ให้ Broker สามารถ Edit Conversion Flag เพื่อรองรับกรณีรายการ RVP ที่ระบุหุ้น Local และรอ match จากการระบุหรือไม่ระบุ Conversion flag FL <p>หลักการ: Broker สร้างรายการระบุหลักทรัพย์ตามที่ซื้อ/ขาย และเป็นผู้ระบุ conversion flag เสมอ</p>
<ul style="list-style-type: none"> ฟิลด์ที่ 7 ในรายการ PSMS ถ้าใส่เลขที่บัญชีไม่ถูกต้อง จะ Settle ได้หรือไม่ และจะมีวิธีการแก้ไขได้อย่างไร 	<ul style="list-style-type: none"> ฟิลด์ที่ 7 ในรายการ PSMS สำหรับ Broker ต้องระบุ Trading account และสำหรับ Custodian ต้องระบุ Client Depository account ซึ่งข้อมูลดังกล่าวจะเป็นข้อมูลสำหรับ TSD เพื่อการ sweep up หลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหลักทรัพย์สำหรับ DVP Party และ sweep down เพื่อการรับมอบหลักทรัพย์สำหรับ RVP Party หากสมาชิกใส่เลขที่บัญชีไม่ถูกต้องจะเกิดเหตุการณ์ 2 กรณี ดังนี้ <ul style="list-style-type: none"> กรณีสมาชิกที่ใส่เลขที่บัญชีผิดเป็นผู้ส่งมอบหุ้น: TSD จะไม่สามารถ Sweep up หุ้นจากบัญชีที่ต้องส่งมอบหุ้นมาไว้ที่ Settlement account ของสมาชิกเพื่อรอส่งมอบให้แก่ TCH ได้ ซึ่งจะทำให้สมาชิกผิดนัดต่อ TCH ดังนั้น สมาชิกจะต้องโอนหุ้นมาไว้ที่ Settlement account ของสมาชิกด้วยตนเองก่อนเวลา Settlement ของ TCH กรณีสมาชิกที่ใส่เลขที่บัญชีผิดเป็นผู้รับมอบหุ้น: TSD จะไม่สามารถ Sweep down หุ้นที่จะได้รับมอบไปยัง Client account ได้ โดยหุ้นจะไปค้างอยู่ที่ Sink account ซึ่งสมาชิกต้องโอนหุ้นให้แก่ลูกค้าเอง หากสมาชิกระบุเลขที่บัญชีในฟิลด์ที่ 7 ไม่ถูกต้อง สมาชิกสามารถแก้ไขเฉพาะเลขที่บัญชีได้ โดยไม่ต้องได้รับความยินยอมจากคู่กรณี เนื่องจากบัญชีในฟิลด์ที่ 7 ไม่ใช่ Matching field Account ที่ Broker และ Custodian จะรับมอบหรือส่งมอบหลักทรัพย์กับ TCH จะเป็นบัญชี Settlement Account ซึ่งเป็น Mandatory และ Matching Field ในระบบ PSMS โดยสมาชิกต้องระบุ Settlement Account Number ของตนเอง และ Settlement Account Number ของ Counterparty ซึ่งมีใช้ฟิลด์ที่ 7 และ

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
	<p>เพื่อลดความผิดพลาดในการปฏิบัติงานของสมาชิก ระบบ PTI จะอำนวยความสะดวกให้สมาชิกสามารถค้นหา Settlement Account Number ของ Counterparty ได้</p> <ul style="list-style-type: none"> นอกจากนี้ในระบบงานใหม่ของ Clearing & Depository จะยกเลิก Primary account โดยสมาชิกจะ settle กับ TCH ที่บัญชี Settlement account เท่านั้น
<ul style="list-style-type: none"> Client Settlement Account Matching Field ที่ 4 และ 5 ต่างกันอย่างไร 	<ul style="list-style-type: none"> Matching Field ที่ 4 ให้ใส่ Client Settlement Account ของสมาชิกผู้ส่งคำสั่ง (ของตัวเอง) ส่วน Matching Field ที่ 5 ให้ใส่ Client Settlement Account ของ Counterparty (คู่กรณี)
<ul style="list-style-type: none"> รายการ PSMS ที่ match โดยกำหนดให้มีส่วนต่างของมูลค่า Settlement ได้จำนวนเงิน 50 บาท (Tolerance Limit) อาจทำให้ระบบต่อเชื่อมภายในของ Broker เกี่ยวกับใบกำกับภาษี ไม่ถูกต้องได้ Tolerance Limit เป็นเปอร์เซ็นต์ของมูลค่าได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> การ match โดยกำหนดให้มีส่วนต่างของมูลค่า Settlement ได้ จำนวนเงิน 50 บาท (Tolerance Limit) เป็นไปตามที่หารือร่วมกันทั้ง Industry ในกรณีที่ มีบางรายการที่สมาชิกไม่สามารถยอมรับค่าส่วนต่างได้ สามารถตกลงร่วมกันกับ คู่กรณีและ De-match เพื่อแก้ไขมูลค่า Settlement ได้
<ul style="list-style-type: none"> Lock มูลค่า Tolerance Limit แตกต่างกันตามแต่ละ Broker ได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> Tolerance limit เป็นอัตรากลางของทั้ง Industry ดังนั้นต้องบริหารจัดการภายในระบบงานของสมาชิก ก่อนส่งคำสั่งเข้าระบบงานศูนย์รับฝาก
<ul style="list-style-type: none"> ระบบมีวิธีการแจ้งเตือนรายการที่ Match โดยมี Tolerance Limit หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ฟังก์ชันงาน PSMS รองรับให้มีหน้าจอสำหรับสมาชิก Inquiry รายการ PSMS โดยมีคอลัมน์ที่แสดงมูลค่า Settlement ที่สมาชิกระบุในรายการ PSMS (Settlement Amount) และ คอลัมน์ที่แสดงมูลค่าที่ใช้ในการ Settlement (Proceeded Settlement Amount) แยกแสดงให้สมาชิกตรวจสอบได้ หน้าจอดังกล่าว สมาชิกสามารถ download เป็น text file เพื่อใช้งานต่อไปได้
<ul style="list-style-type: none"> Custodians ยอมรับค่า Tolerance Limit จำนวนเงิน 50 บาท โดยที่ Broker จะไม่ต้องแก้ไขมูลค่า Settlement ใช่หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> Custodian ชี้แจงในที่ประชุมว่า ทั้ง Custodians และ Broker มีโอกาสที่ต้องเป็นฝั่ง DVP เช่นเดียวกัน การ match โดยมีส่วนต่างของมูลค่า Settlement ที่จำนวนเงิน 50 บาท และยึดมูลค่า Settlement ฝั่งที่เป็นรายการ DVP เป็นมูลค่า Settlement เป็นไปตามที่หารือร่วมกันทั้ง Industry
<ul style="list-style-type: none"> ถ้า Go live แล้ว ปรับ Tolerance Limit ได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ระบบรองรับไว้เป็น Parameter สามารถปรับมูลค่าได้ ซึ่งควรหารือร่วมกันทั้ง Industry
<ul style="list-style-type: none"> เมื่อ Upload รายการ PSMS แล้ว ยังต้อง Approve รายการหรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> กรณีทำรายการ PSMS โดย Upload ผ่านระบบ PTI สมาชิกยังคงต้อง Approve ที่ระบบ PTI กรณีทำรายการ PSMS โดยส่ง API message จะถือว่าสมาชิก Approve รายการเรียบร้อยแล้ว ซึ่งไม่ต้อง Approve รายการอีก กรณีรายการไม่ Match ระบบจะเปลี่ยนสถานะของรายการเป็น Reject by

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
	system ณ เวลา 10.30 น. ของ Settlement date
<ul style="list-style-type: none"> • กรณี Broker เปิดบัญชีฝากฝากเป็น segregate account แบบที่ 1 Client Account level (Model 1: One trading account with one depository account) และ TSFC เปิดบัญชีฝาก 1 บัญชีเพื่อเก็บหุ้นของทุกลูกค้าของ Broker รายนั้นไว้ในบัญชีฝากนี้บัญชีเดียว รายการ PSMS จะ match กันได้หรือไม่ อย่างไร 	<p>มีแนวทางดำเนินการได้ 2 ทางเลือกดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> • ทางเลือกที่ 1: Broker สร้างรายการ PSMS แยกย่อยตามรายลูกค้า แยกรายหุ้น และแยกด้านซื้อ (gross of buying side) แยกด้านขาย (gross of selling side) และ TSFC สร้างรายการ PSMS รายการเดียวโดยทำการ merge เพื่อให้ match กับรายการของ Broker หลายรายการ ทางเลือกนี้มีข้อเสีย คือ หากมีการผิดพลาดเกิดขึ้นรายการ PSMS ของ TSFC ไม่ได้รับการ match เลย เนื่องจากรายการ merge ต้อง <u>match แบบ all or none</u> เท่านั้น • ทางเลือกที่ 2: ทั้ง Broker และ TSFC ต้องสร้างรายการ PSMS หลายรายการ แยกย่อยตามรายลูกค้า, แยกรายหุ้น, และแยกด้านซื้อ แยกด้านขาย เพื่อให้รายการ match กัน ทีละรายการ ทางเลือกนี้มีข้อดี คือ หากมีการผิดพลาดเกิดขึ้นรายการ PSMS ของ TSFC อาจได้รับการ <u>match แบบ partial (บางรายการ) ได้</u>
<ul style="list-style-type: none"> • การทำรายการ PSMS คู่กับ TSFC ยังคงมี Purpose Collateral และ Release collateral ให้ระบุเหมือนเดิมหรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • TSD จะมีหน้าจอในระบบ PTI เพื่อให้ทำรายการ PSMS ให้ระบุ Purpose ได้ ซึ่งจะรองรับการทำธุรกรรมระหว่างสมาชิกและ TSFC โดยสมาชิกสามารถระบุ Purpose Collateral และ Release collateral ได้ รวมทั้งรองรับกรณีสมาชิกทำรายการ Transfer with purpose ที่เกิดจากธุรกรรม SBL โดยสามารถระบุ Purpose Loan และ Loan Return นอกจากนี้สมาชิกยังสามารถระบุเหตุผลของการทำ SBL ได้ใน field Remark
<ul style="list-style-type: none"> • การทำรายการ PSMS ของลูกค้าที่เกี่ยวข้องกับ TSFC ดำเนินการอย่างไร เช่น ลูกค้านาย ก. มี Buy 2,000 หุ้น และมีรายการ Sell 3,000 หุ้น 	<ul style="list-style-type: none"> • ตามที่เห็นชอบร่วมกันทั้ง Industry การส่งคำสั่ง PSMS ระหว่าง Broker และ TSFC ให้ดำเนินการในรูปแบบ Gross โดยให้แยกส่งคำสั่งของลูกค้าแต่ละรายตาม Total buy และ Total Sell อย่างไรก็ตาม เมื่อ TCH ได้รับข้อมูลรายการ PSMS ของสมาชิกแล้ว จะประมวลผล Net ตามแต่ละ Trading Account หรือ Depository Account รายลูกค้า ดังนั้น ในแต่ละวัน 1 ลูกค้าจะมีสถานะเดียวสำหรับ 1 หลักทรัพย์ คือการส่งมอบหรือรับมอบ
<ul style="list-style-type: none"> • Match ID คืออะไร เป็น Citizen ID ของลูกค้าใช่หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • Match ID เป็น ID ของรายการที่ระบบ PSMS สร้างขึ้น เมื่อเงื่อนไขในการ match สมบูรณ์แล้ว ไม่ใช่ Citizen ID ของลูกค้าที่สมาชิกแต่ละรายระบุ • ระบบ New Clearing จะนำ Match ID ที่ได้รับจาก ระบบ PSMS มาแสดงในหน้าจอ Position Ledger ปรากฏอยู่ใน Column ที่แสดง Deal Number
<ul style="list-style-type: none"> • สามารถ simulate potential match ของรายการ PSMS ได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • TSD ขอรับไว้พิจารณาดำเนินการใน phase ถัดไป และจะหารือกับสมาชิกถึงรายละเอียดเพื่อกำหนดเงื่อนไขในการพัฒนาต่อไป
<ul style="list-style-type: none"> • กรณี Broker เปิดบัญชีลูกค้าต่างประเทศในระดับ omnibus เนื่องจากไม่รู้จัก end client ขณะที่ Custodian อาจเปิดบัญชีรายลูกค้า end client และ end client แต่ละราย มีทั้งการส่งมอบและรับมอบหุ้น 	<ul style="list-style-type: none"> • หลักการทำงานของ PSMS ยังเป็นหลักการเช่นเดียวกับการ allocation ในปัจจุบัน หากรายการ PSMS ที่ให้ sweep หุ้นจากบัญชีย่อย ๆ ของ Custodian ไม่สามารถทำได้ เนื่องจากมีหุ้นไม่เพียงพอ จะเกิดการ unwind เพื่อคำนวณยอดหุ้นที่ Broker จะเป็นผู้ส่งมอบหุ้นแทน

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<p>หาก custodian ผังส่งมอบ หุ้นเกิด default อยากราบ ว่าระบบการ settlement ทำงานอย่างไร</p>	
<ul style="list-style-type: none"> • กรณี Broker เปิดบัญชี ลูกค้าต่างประเทศในระดับ omnibus แต่ลูกค้ามี Custodian หลายราย Broker สามารถส่งคำสั่ง PSMS เพียงรายการเดียว ได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • Broker ต้องส่งคำสั่ง PSMS แยกรายการสำหรับแต่ละ Custodian เนื่องจาก settlement account ของ counterparty เป็น matching field ซึ่งจะแตกต่างกัน ไปในแต่ละ Custodian
<ul style="list-style-type: none"> • ขอ Guideline ในการเปิด บัญชีเพื่อ trade กองทุน และ allot ให้ custodian เก็บรักษา underlying • กรณี Broker สร้างรายการ PSMS ของลูกค้า บลจ. เป็น omnibus ส่วน Custodian สร้างรายการ PSMS ของกองทุนย่อยได้ หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • Model ในการเปิดบัญชีและการทำรายการ PSMS เพื่อบัญชีบลจ. ขึ้นกับ Broker และ Custodian โดยมีทางเลือก ดังนี้ • Model 1 Broker เปิดทั้งบัญชีแม่และบัญชีลูก และทำ Trade allotment จากบัญชี แม่ไปบัญชีลูก และส่งรายการ PSMS แบบ one-to-one ด้วยเลขที่บัญชีของลูกค้า (Field ที่ 7 ด้าน Broker) เพื่อ match กับรายการ PSMS ของ Custodian ที่ระบุ เลขที่บัญชีของลูกค้า (Field ที่ 7 ด้าน Custodian) • Model 2 Broker เปิดเฉพาะบัญชีแม่ และส่งรายการ PSMS โดยระบุเลขที่บัญชี แม่ (Field ที่ 7 ด้าน Broker) โดยส่งรายการ PSMS ด้วยจำนวนรายการเท่ากับ จำนวนกองลูก เพื่อ match กับรายการ PSMS ของ Custodian ที่ระบุเลขที่บัญชี กองลูก (Field ที่ 7 ด้าน Custodian)
<ul style="list-style-type: none"> • สอบถามเรื่อง Cut-off time ของ PSMS 	<ul style="list-style-type: none"> • Cancel รายการ PSMS ได้ถึงวันที่ T+2 @ 19.00 น. • De-match รายการได้ถึงวันที่ T+3 @10.00 น. • รายการ PSMS with conversion flag LF ได้ถึงวันที่ T+2 @ 15.30 น.
<ul style="list-style-type: none"> • ถ้าสมาชิกสร้างรายการเข้า มาในเวลาใกล้เคียงกันมาก โดยมี Matching Field ตรงกันหมดทั้ง 2 รายการ มีโอกาสที่รายการจะ Match ผิดหรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • ถ้าสมาชิกต้องการกำหนดคู่ Match แบบเฉพาะเจาะจง สามารถใส่ Link Code ที่ ได้กำหนดตรงกันเพื่อให้รายการถูก Match ได้ตามความต้องการของสมาชิก
<ul style="list-style-type: none"> • ณ T+3 หาก Broker ต้องการแก้ไขรายการที่ยัง ไม่ Match Broker สามารถ ทำการ Cancel ทั้งหมดและ สร้างรายการเข้ามาใหม่ได้ หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • สามารถยกเลิกรายการที่ละหลายรายการโดยใช้ Function Upload Cancel และ ทำการสร้างรายการเข้ามาใหม่ได้
<ul style="list-style-type: none"> • มีปัญหาเกี่ยวกับการยืม/ ให้ยืมหุ้น SBL ของลูกค้า ภายใน Broker เอง ทาง 	<p>วิธีการสร้างรายการ PSMS แบบ SBL Principal และ SBL Agent ดังนี้ค่ะ</p> <ul style="list-style-type: none"> • SBL Principal (แบบตัวกลาง) คือ สมาชิกเป็นตัวกลาง เวลาทำรายการ PSMS

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<p>ตลาดฯ แนะนำให้ใช้ระบบ PSMS ในการรับมอบส่งมอบหุ้นลูกค้าภายใน Broker เอง จึงสอบถามวิธีการทำรายการ</p>	<p>จะต้องทำผ่านสมาชิก</p> <p>1. หากสมาชิกเซ็นสัญญา SBL แบบ Principal ต้องสร้างรายการ PSMS 2 คู่ โดยคู่แรก - Broker สร้างรายการ DVP/DF เพื่อส่งหุ้นจากบัญชีลูกค้า (ประเภทบัญชี Client) ไปเข้าบัญชี Broker (ประเภทบัญชี Port)</p> <p>คู่ที่ 2 - Broker สร้างรายการ DVP/DF เพื่อส่งหุ้นจากบัญชี Broker (ประเภทบัญชี Port) ไปเข้าบัญชีลูกค้า(ประเภทบัญชี Client)</p> <div data-bbox="571 524 1437 1167" style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin: 10px 0;"> <p>การสร้างรายการ PSMS แบบ SBL Principal - ต้องทำรายการ 2 คู่</p> <p>1. คู่ที่ 1 Broker สร้างรายการ DVP/DF เพื่อส่งหุ้นจากบัญชีลูกค้า (ประเภทบัญชี Client) ไปเข้าบัญชี Broker (ประเภทบัญชี Port)</p>  <p>2. คู่ที่ 2 Broker สร้างรายการ DVP/DF เพื่อส่งหุ้นจากบัญชี Broker (ประเภทบัญชี Port) ไปเข้าบัญชีลูกค้า(ประเภทบัญชี Client)</p>  </div> <ul style="list-style-type: none"> • SBL Agent (แบบตัวแทน) คือ สามารถทำรายการ PSMS จากบัญชีลูกค้าผู้ให้ยืมไปยังบัญชีลูกค้าผู้ยืมได้โดยตรง <p>2. หากสมาชิกเซ็นสัญญา SBL แบบ Agent สร้างรายการ PSMS 1 คู่ โดย Broker สร้างรายการ DVP/DF เพื่อส่งหุ้นจากบัญชีลูกค้า (ประเภทบัญชี Client) ไปเข้าบัญชีลูกค้า (ประเภทบัญชี Client)</p> <div data-bbox="571 1592 1437 1984" style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin: 10px 0;"> <p>การสร้างรายการ PSMS แบบ SBL Agent - ต้องทำรายการ 1 คู่</p> <p>Broker สร้างรายการ DVP/DF เพื่อส่งหุ้นจากบัญชีลูกค้า (ประเภทบัญชี Client) ไปเข้าบัญชีลูกค้า (ประเภทบัญชี Client)</p>  </div>

Settlement simulation & Settlement

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> ● การทำ settlement simulation ยังไม่ได้ Auto sweep จริงใช้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ● การทำ settlement simulation ยังไม่ได้มีการ auto sweep จริง แต่ระบบจะประมวลผลเสมือนจริง
<ul style="list-style-type: none"> ● สมาชิกสามารถ Simulate เพื่อตรวจสอบความเพียงพอของหุ้นและเงินสำหรับ Settlement ก่อนกำหนดเวลา Auto sweep ได้หรือไม่ และสามารถ Simulate เป็นรายหุ้นได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ● ระบบทำการ simulate หุ้นทุกตัว ตามรอบที่กำหนดไว้ แต่สมาชิกสามารถ inquiry เพื่อเลือกดูผลการ simulation ในแต่ละรอบโดยเลือกเฉพาะหุ้นที่สนใจได้ ● ทั้งนี้ รอบการ simulation ในระบบ New Clearing ประกอบด้วย <ul style="list-style-type: none"> ▪ 08.00 – 13.15 น. : สำหรับ simulate การ settlement ในวันทำการปัจจุบัน เป็น ทุก 15 นาที ▪ 14.30 – 20.00 น. : สำหรับ simulate การ settlement ในวันทำการถัดไป เป็น ทุก 30 นาที ● ทั้งนี้การ simulate ในระบบ PTI – Depository จะแสดง Outstanding Balance Real time และ Net Position ล่าสุด โดยรอบการ simulation ประกอบด้วย <ul style="list-style-type: none"> ▪ 08.00 – 12.30 น. : สำหรับ simulate การ settlement ในวันทำการปัจจุบัน ▪ 14.30 – 20.00 น. : สำหรับ simulate การ settlement ในวันทำการถัดไป
<ul style="list-style-type: none"> ● กรณีมี Custodian unwind จะกระทบ Broker อย่างไร 	<p>TCH ดำเนินการได้ในระดับ Omnibus เช่นเดียวกับปัจจุบัน กล่าวคือ</p> <ul style="list-style-type: none"> ● กรณีประมวลผลใหม่แล้ว เป็นรับมอบหุ้นน้อยลง จะส่งผลการ Sweep down และสมาชิกต้องพิจารณาดำเนินการเองต่อไป ● กรณีประมวลผลใหม่ เป็นส่งมอบหุ้นเพิ่มขึ้น หาก Broker มีหุ้นเพียงพอส่งมอบ จะทำให้เกิดรายการ shortage ภายใน Broker แต่หากมีหุ้นไม่เพียงพอส่งมอบ จะเข้า Process SBL หรือ Buy-in ของสำนักหักบัญชี ● กรณี shortage ภายใน Broker และมีการปิดสมุดทะเบียน สมาชิกจะต้องเป็นผู้พิจารณาสิทธิของลูกค้าย่อยเช่นเดียวกับปัจจุบัน
<ul style="list-style-type: none"> ● เวลาการ Auto sweep-up เป็นเวลาใด 	<ul style="list-style-type: none"> ● จากการหารือกับสมาชิกที่ผ่านมา สรุปว่า TSD จะ Sweep-up ในเวลา 12.30 น. เพื่อให้สมาชิกมีเวลาในการเตรียมหุ้นในบัญชี Client account ให้พร้อมก่อนการ Sweep-up และหากมีหุ้นไม่เพียงพอ สมาชิกจะด้มีเวลาเพียงพอในการบริหารจัดการหาหุ้นมาส่งมอบกับ TCH ได้ทัน settlement time
<ul style="list-style-type: none"> ● มีข้อมูลกรณีหุ้นไม่เพียงพอส่งมอบ ณ ตอน auto sweep-up หรือ มี alert แจ้งสมาชิกหรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ● สมาชิกสามารถ simulate ในระดับ Omnibus ได้ที่ระบบ New clearing หน้าจอ Settlement Simulation ● สมาชิกสามารถ simulate ในระดับ Segregate ได้ที่ระบบ PTI โดย PTI จะแสดงข้อมูลเฉพาะบัญชีที่มีหุ้นไม่เพียงพอ (Shortage Account) และจะมี report และ text file ให้สมาชิก download ได้
<ul style="list-style-type: none"> ● บัญชี Clearing ที่ใช้สำหรับ Settlement ยังเป็นบัญชีเดิมหรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ● บัญชีของสมาชิกที่ใช้ Settlement กับ TCH ยังคงเป็นเลขที่บัญชีเดิม ซึ่งไม่กระทบกับสมาชิก โดยเปลี่ยนชื่อเป็น Settlement account ทั้งนี้สมาชิกไม่ต้องเปิดเอง TSD จะทำการเปิดให้อัตโนมัติ
<ul style="list-style-type: none"> ● ยอด Balance ใน Settlement account จะเป็น 0 เสมอหรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ● หลัง Settlement time ยอดจะต้องเป็น 0 เสมอ TSD จะ sweep-down หุ้นในบัญชี Settlement ทั้งหมดเสมอ

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> • ขอ Report แสดงผลการแก้ไขหลัง Sweep down 	<ul style="list-style-type: none"> • TSD พิจารณาเพิ่ม Report on request แสดงผลการแก้ไขหลัง sweep down
<ul style="list-style-type: none"> • กรณีลูกค้ามีหุ้นไม่เพียงพอส่งมอบ (internal short) ณ T+3 จะส่งผลอย่างไร และระบบงานของ TSD มีข้อมูลแจ้งว่าลูกค้ารายไหนที่ไม่ได้รับมอบหุ้นหรือไม่ และ บันทึกจำนวนหุ้นที่ผิดนัดส่งมอบไว้ในระบบงาน (shortage shares) เพื่อให้สมาชิกเรียกดูข้อมูลย้อนหลังหรือไม่ • หากลูกค้าที่ผิดนัดนำหุ้นมาส่งมอบในวันที่ T+4 ซึ่งจะทำให้ Broker มีหุ้นมาส่งมอบให้ลูกค้าได้ครบถ้วนในวันที่ T+4 ปัจจุบัน Broker ต้องโอนเงิน และหุ้นเองนอกระบบใหม่มีฟังก์ชันที่จะช่วยโอนหุ้นเหล่านี้เพื่อลดภาระของ Broker หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • กรณีสมาชิกมี Internal short จะทำให้สมาชิกมีหุ้นไม่พอส่งมอบให้กับลูกค้าทุกรายที่จะได้รับมอบหุ้นภายในของสมาชิกเอง ดังนั้นระบบ PTI จะ Sweep down หุ้นไปที่ Sink Account และจัดสรรหุ้นให้แก่ลูกค้าแต่ละรายที่มี Net Buy Obligationจากน้อยไปมาก ซึ่งจะเป็นข้อมูลเบื้องต้นหากสมาชิกประสงค์จะแก้ไขสามารถแก้ไขเพื่อกำหนดจำนวนหุ้นที่ลูกค้ารายนั้นๆ จะได้รับมอบหุ้นให้ถูกต้องได้ • ระบบ PTI มี Text file และรายงานแจ้งผลของการ Sweep down ลงใน sink account และผลการจัดสรรหุ้นใน Sink account ให้แก่ลูกค้าทั้งหมดที่จะได้รับมอบหุ้น ซึ่งจะแสดงบัญชีลูกค้าและจำนวนหุ้นที่ได้รับมอบและยังไม่ได้รับมอบหุ้นให้เป็นรายวัน และสมาชิกสามารถนำไปทำงานต่อที่ระบบ back office ของสมาชิกได้ • ระบบ PTI จะไม่มีการบันทึกและเก็บข้อมูลจำนวนหุ้นที่ผิดนัดส่งมอบไว้ในระบบงาน • ระบบจะไม่มีการปรับข้อมูลเนื่องจาก ระบบ PTI ไม่มีการบันทึกและเก็บข้อมูลจำนวนหุ้นที่ผิดนัดส่งมอบไว้ในระบบงาน ทั้งนี้หากสมาชิกได้รับมอบหุ้นจากลูกค้ารายที่ผิดนัดในภายหลัง จะต้องโอนหุ้นที่ได้รับไปยังบัญชีลูกค้าที่ได้รับมอบหุ้นไม่ครบถ้วน ด้วยฟังก์ชันการโอนในระบบ PTI
<ul style="list-style-type: none"> • ลูกค้า short หุ้นแล้วมาคืนหุ้นที่ผิดนัดสามารถใช้ฟังก์ชัน sweep-down ได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • ฟังก์ชัน sweep-down ดำเนินการโดยระบบ PTI แบบอัตโนมัติ ณ settlement time เท่านั้น ซึ่งหากล่วงเลยเวลาดังกล่าวสมาชิกต้องมา transfer หุ้นเอง
<ul style="list-style-type: none"> • กรณี Net Omnibus ของ Broker เป็นรับมอบหลักทรัพย์ แต่มีลูกค้าบางรายของสมาชิกไม่ส่งมอบหลักทรัพย์ (ส่วนใหญ่เป็นลูกค้าสถาบันหรือลูกค้า Foreign ซึ่ง Broker จะทราบว่ามีหุ้นส่งมอบในวันที่ T+3) ซึ่งจะทำให้เกิด Internal short จะทำให้เกิด 	<ul style="list-style-type: none"> • ในระหว่างดำเนินโครงการ TCH ได้หารือกับ กลต. มาโดยตลอด ซึ่งผลการหารือคือ TCH เป็น Counter-party กับสมาชิก จึงต้องดำเนินการ SBL, Buy-in เฉพาะกรณีที่สมาชิกผิดนัดกับ TCH ในระดับ Omnibus เท่านั้น อย่างไรก็ตาม TCH จะหารือกับ กลต. เพื่อความเข้าใจ เพิ่มเติม ว่าการดำเนินการกรณีใดจะผิดหรือไม่ผิดตามเกณฑ์ของ กลต.

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<p>เกณฑ์ กลด. ในเรื่องนำ หุ่นของลูกค้ารายอื่นมาส่งมอบหรือไม่</p> <ul style="list-style-type: none"> ขอให้ TCH ทารือกับ กลด เพื่อให้สามารถยืมหุ่นหรือ Buy-in ในระดับ segregate Account 	

Fail Settlement

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> ระบบ SBL ขอให้เพิ่มฟังก์ชัน Upload รายการ Lending Request โดยระบบ Segregated Account สำหรับทำรายการให้ยืมหุ่น 	<ul style="list-style-type: none"> TSD จะรับไปพิจารณาและจะแจ้งให้สมาชิกทราบ
<ul style="list-style-type: none"> ค่านายหน้าการซื้อขายหลักทรัพย์ ในการซื้อเพื่อส่งมอบรายการที่ผิดนัด (Buy-in) หากไม่มีการกำหนดจำนวนเงินสูงสุด จะทำให้มีปัญหาเกี่ยวกับลูกค้าของสมาชิกผู้ผิดนัด ซึ่งต้องรับผิดชอบค่าใช้จ่าย 	<ul style="list-style-type: none"> TCH พิจารณาแล้วเห็นว่าจะไม่กำหนดเพดานค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ในระบบงาน เนื่องจากปัจจุบันเกณฑ์การซื้อขายหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์อนุญาตให้มีการเก็บค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์แบบเสรี อย่างไรก็ตามหากสมาชิกผู้เสนอขายหลักทรัพย์ให้แก่สำนักหักบัญชี เรียกเก็บค่านายหน้าจากการเป็นตัวแทนขายให้แก่สำนักหักบัญชีสูงเกินไป สำนักหักบัญชีอาจยกเลิกการเป็นตัวแทนขายของสมาชิกรายดังกล่าวได้

Collateral (Asset)

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> กรณี Broker มีธุรกรรมหลักทรัพย์และธุรกรรมอนุพันธ์สามารถใช้หลักประกันร่วมกันได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> TCH ไม่สามารถ Net Collateral ข้ามตลาดได้เนื่องจาก อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของกฎหมายที่แตกต่างกัน คือ พ.ร.บ. หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และ พ.ร.บ. สัญญาซื้อขายล่วงหน้า นอกจากนี้ สำนักงาน กลด. ยังมีเกณฑ์ห้าม Net Collateral ข้ามลูกค้าเช่นเดียวกัน เพื่อพิทักษ์ทรัพย์สินของลูกค้า
<ul style="list-style-type: none"> การวางหลักประกันเพื่อการบริหารความเสี่ยงในระบบ EWS จากกรณีมีค่าความเสี่ยงจากรายการ Gross Settlement ที่สมาชิกทำ 	<ul style="list-style-type: none"> ปัจจุบัน TCH รับประกันรายการ Gross settlement โดยจะนำมาประมวลผลรวมเป็น Pending Settlement Obligation เพื่อหา Total Risk Exposure ของสมาชิกรายเนื่องจากรายการดังกล่าวยังไม่ได้ Settlement จึงยังคงมีความเสี่ยงที่อาจไม่สามารถส่งมอบหุ่นหรือส่งมอบเงินจากรายการ Gross Settlement และยังคงต้องวางหลักประกันจากค่าความเสี่ยงดังกล่าว

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
รายการในวันที่ซื้อขาย แต่ ระบุนวันที่ Settlement เป็น วันที่ T+1 ขอไม่วาง หลักประกันได้หรือไม่	<ul style="list-style-type: none"> TCH ได้กำหนดเวลาในการขอทำ gross settlement ได้ตั้งแต่ 9.00 -15.00 น. ทั้งนี้แม้ว่าสมาชิกจะ settlement gross deal ไปแล้ว หากสำนักหักบัญชีจำลอง การยกเว้นรายการ gross deal ไปแล้ว และยังไม่ปรากฏค่าความเสี่ยงอยู่ สมาชิก จะต้องวางหลักประกันภายใน 11.00 น. โดยเมื่อ settlement รายการ net deal และสมาชิกได้มีการผิหนดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ สมาชิกอาจขอคืน หลักประกันได้ภายใน 15.00 น.
<ul style="list-style-type: none"> E-mail สำหรับรับ Mail alert ที่ TCH แจ้งข้อมูล เรียกหลักประกัน มีจำนวน จำกัดหรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ไม่จำกัดจำนวน E-mail และสมาชิกสามารถกำหนด email address ได้เองใน หน้าจอ Additional Email

Sub-broker (or Carpool Model), Warehousing

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> กรณี Sub-broker หรือ กรณี Carpool มีวิธีการ ดำเนินการอย่างไรและมี การแจ้งข้อมูลเกี่ยวกับ Car pool ดำเนินการอย่างไร? Sub-broker จะได้รับข้อมูล Trading Account ที่ Broker เปิดในระบบ Broker ใช้หรือไม่ Broker ได้รับ order confirmation รายการซื้อ ขายเพื่อ Clearing member หรือไม่? Broker ควรรับข้อมูลการซื้อ ขายจากระบบซื้อขาย (Trade) หรือ TCH (New Clearing) 	<ul style="list-style-type: none"> Broker หรือ Sub-broker ที่ไม่สามารถส่งคำสั่งซื้อขายเองได้ แต่เป็น Clearing member กับ TCH <u>Sub-broker</u> <ul style="list-style-type: none"> ฝ่าย Trading Operation ของ SET จะ set up ความสัมพันธ์ของ trading member และ clearing member Broker ส่งคำสั่งซื้อขาย ด้วย Omnibus Account ของ Sub-broker โดยที่ Sub-broker จะเป็นผู้ clear รายการซื้อขายเอง โดย Sub-broker จะได้รับ ข้อมูล Deal ตามที่ Broker ส่งคำสั่งซื้อขายให้จาก Clearing House <u>Car-pool</u> สามารถนำรูปแบบดังกล่าวข้างต้นมาใช้ได้ในทำนองเดียวกัน โดยสมาชิกผู้ ประสงค์จะส่งคำสั่งซื้อขายให้ และสมาชิกผู้เป็น Clearing Member ต้อง ดำเนินการแจ้งที่ฝ่ายปฏิบัติการซื้อขาย เพื่อให้ดำเนินการในระบบก่อนเริ่มส่ง คำสั่งซื้อขาย โดยมีรายละเอียดตามหนังสือที่ ปก (ว) 9.2557 ฉบับลงวันที่ 12 มิถุนายน 2557 Broker จะได้รับ Order Confirm เช่นเดียวกับ Order อื่น ๆ ในสถานะที่เป็น สมาชิกผู้ส่งคำสั่งซื้อขาย ทั้งนี้ Broker จำเป็นต้องเก็บ Order Confirm ที่ซื้อ ขายต้องออกไป Confirm ให้กับ Broker หรือ Sub-broker เพื่อใช้ทำงานต่อไป ด้วย Sub-broker ได้รับข้อมูล Deal จากระบบ New Clearing และมีภาระต้องส่งมอบ หรือรับมอบหุ้น โดย Sub-broker (Clearing Member) ต้องแก้ไข รายการซื้อ ขาย เพื่อ Split deal และแก้ไขเลขที่บัญชีซื้อขายต่อ เพื่อให้ TCH ประมวลผล Net Settlement Obligation ในระดับ Segregate Account และส่งต่อไปให้ TSD ทำการ Sweep หุ้นเพื่อส่งมอบ/รับมอบ ได้ตาม Settlement Time ทั้งนี้ กำหนดเวลา Rectify ไม่เกิน 10.30 น. ของวันที่ T+3

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> ● การเปิดบัญชี Warehousing 	<ul style="list-style-type: none"> ● Broker สามารถเปิดบัญชี Warehousing ประเภท Proprietary ได้ โดยสิทธิประโยชน์ต่างๆ จะเป็นของ Broker
<ul style="list-style-type: none"> ● วิธีการแก้ไขรายการซื้อขายผิดพลาดระหว่าง Sub-Broker และ broker 	<ul style="list-style-type: none"> ● กรณีของ Broker ส่งคำสั่งซื้อขายด้วยบัญชีของ Sub-broker ที่เป็น Clearing Member รายการซื้อขายดังกล่าวจะส่งให้ Sub-broker เป็นผู้ชำระราคากับสำนักหักบัญชี หากคำสั่งซื้อขายไม่ถูกต้องจะทำให้ Sub-broker เป็นผู้รับผิดชอบรายการดังกล่าว สำนักหักบัญชีจึงขอแจ้งวิธีการแก้ไขรายการที่ผิดพลาด ซึ่งสมาชิกสามารถเลือกทำได้ 2 ช่องทาง ดังนี้ (เลือกดำเนินการทางใดทางหนึ่ง) <ol style="list-style-type: none"> 1. ทำรายการโอน/รับโอนหลักทรัพย์พร้อมชำระราคา (Delivery Versus Payment/Receive Versus Payment; DVP/RVP) ที่ระบบ PTI ในหัวข้อ PSMS เพื่อหักลบรายการที่จะต้องส่งมอบ <ul style="list-style-type: none"> ● สามารถทำรายการได้ตั้งแต่วันที่ T ถึง T+3 (10.30 น.) ● สามารถทำแบบ Partial ได้ <ol style="list-style-type: none"> 1.1 รายการขายผิดพลาด Sub-broker ต้องทำรายการ RVP และ Broker ทำรายการ DVP คู่กัน ให้ระบุวันที่ Settlement เป็นวันเดียวกัน 1.2 รายการซื้อผิดพลาด Sub-broker ต้องทำรายการ DVP และ Broker ทำรายการ RVP คู่กัน ให้ระบุวันที่ Settlement เป็นวันเดียวกัน 2. ทำรายการโดย Back Office ของ Sub-broker มาที่ระบบ SET CLEAR (ไม่สามารถแก้ไขจากระบบ Front ของ Broker ได้ เนื่องจากรายการได้โอนไปยัง Sub-broker แล้ว) โอนรายการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ในหัวข้อ Trade Allocation /Give –up /Take-up <ul style="list-style-type: none"> ● สามารถทำรายการได้ตั้งแต่วันที่ T ถึง T+3 (10.30 น.) ● สามารถทำแบบ Partial ได้ ● Sub-broker ต้องทำรายการ Give –up ส่งรายการให้กับ Broker และ Broker ทำ Take-up รับรายการ <ol style="list-style-type: none"> 2.1 Sub-broker ทำการ Give –up โอนรายการให้ Broker ที่ <ul style="list-style-type: none"> - Screen no. 3204 (Securities Trade Give-up Request) - Screen no. 3206 (Securities Give-up/Take-up Approval) 2.2 Broker ทำการ Take-up รับโอนรายการของ Sub-broker ที่ Screen no. 3206 (Securities Give-up/Take-up Approval) 2.3 Sub-broker และ Broker สามารถดูรายการ Give –up/Take-up รายการที่เสร็จสมบูรณ์ได้ที่ <ul style="list-style-type: none"> - Screen no. 3208 (Securities Give-up/Take-up Listing) <p>ทั้งนี้สมาชิกจะต้องจัดเก็บเอกสารที่เป็นการยืนยันว่าเป็นการแก้ไขรายการซื้อขายผิดพลาดเพื่อนำส่งให้สำนักหักบัญชีทันทีที่ร้องขอ</p>

Deposit, Withdraw and Transfer

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> ● การถอนหุ้นเพื่อบุคคลอื่น หรือการโอนหุ้นเพื่อบุคคลอื่นเข้าบัญชี issuer A/C (บัญชี 600) ให้ระบุข้อมูลที่อยู่ลูกค้าด้วย หากข้อมูลที่อยู่ที่ไม่ตรงกับข้อมูลของลูกค้าหรือไม่ใช้ลูกค้าของสมาชิก จะให้สมาชิกดำเนินการอย่างไร 	<ul style="list-style-type: none"> ● ให้สมาชิกระบุรายละเอียดที่อยู่ตามที่ผู้ถือหลักทรัพย์กรอกในแบบคำขอถอนหลักทรัพย์ หรือแบบคำขอโอน/รับโอนหลักทรัพย์ ระหว่างบัญชีบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์ กับสมาชิกผู้ฝากหลักทรัพย์
<ul style="list-style-type: none"> ● การโอน – รับหุ้นโอน ระหว่างสมาชิกมี Cut-off time เท่าใด 	<ul style="list-style-type: none"> ● Cut-off time งานโอนในระบบ PTI ยังกำหนดเป็นเวลาปัจจุบันคือ 19.00 น. โดยสมาชิกสามารถกำหนดเวลาในการโอนหุ้นระหว่าง Counterparty ให้เหมาะสมกับการทำงานภายในของสมาชิก
<ul style="list-style-type: none"> ● สมาชิกขอ Text file download เลขที่บัญชี Settlement ของทุกสมาชิก รวมทั้ง BIC Code 	<ul style="list-style-type: none"> ● TSD จะ Provide Text file ข้อมูลให้สมาชิกใน Migration Phase

Corporate Actions

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> ● กรณีหุ้นค้างอยู่ sink account เพื่อลูกค้า และมี CA ลูกค้าจะได้รับสิทธิประโยชน์อย่างไร (จะถูกตัดสิทธิหรือไม่) 	<ul style="list-style-type: none"> ● หุ้นที่ค้างอยู่ในบัญชี ประเภท sink account เพื่อลูกค้า และเพื่อบริษัท จะไม่ถูกตัดสิทธิ โดยสมาชิกจะเป็นผู้รับสิทธิประโยชน์และกระจายคืนให้ลูกค้าต่อไป เพื่อให้ได้รับสิทธิประโยชน์จากการมี CA ดังกล่าว สมาชิกต้องกำหนด shareholder profile ว่าบริษัทสมาชิกเป็นผู้รับสิทธิประโยชน์ สำหรับ sink account เพื่อลูกค้า และเพื่อบริษัท อย่างไรก็ตาม สำหรับ Sink Account สมาชิกไม่สามารถกำหนด shareholder profile เองได้ จึงต้องแจ้งรายละเอียดผู้รับสิทธิประโยชน์ ใน Migration File ตั้งแต่ migrate data และส่งให้ TSD ดำเนินการ Map Shareholder profile กับ sink account เพื่อลูกค้า และเพื่อบริษัท <p>แก้ไข เพิ่มเติม จากที่ประชุมสมาชิกศูนย์รับฝากหลักทรัพย์และสำนักหักบัญชี เมื่อวันที่ 28 ตุลาคม 2557</p>
<ul style="list-style-type: none"> ● กรณีเกิด corporate action ประเภท Consolidate อาจมีกรณีที่ TCH ดำเนินการ 	<ul style="list-style-type: none"> ■ Corporate Action Adjustment ที่ TCH และ TSD ดำเนินการในระบบงาน New Clearing และ Segregated Account นั้น TCH และ TSD ยังคงยึดหลักการปัจจุบันที่ใช้อยู่ ซึ่งเป็นหลักการและสูตรเดียวกับที่นายทะเบียนหลักทรัพย์ใช้ปรับจำนวนหุ้นจดทะเบียนของบริษัทจดทะเบียน ดังนั้น สำนัก

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<p>ปรับรายการกรมคงค้างที่อาจจะทำให้ไม่มีหุ้นเพียงพอส่งมอบ และ TSD ปรับ Balance แล้วมีจำนวนหุ้นหายไป โดยเฉพาะในบัญชีของลูกค้า</p>	<p>หักบัญชี ศูนย์รับฝาก และนายทะเบียนฯ จะดำเนินการปรับ Corporate Action ด้วยแนวทางเดียวกันทั้งหมด</p> <ul style="list-style-type: none"> ▪ การปรับจะดำเนินการในเช้าวันมีผล (Start of Date on Effective Date) ▪ ประเภทของ Corporate Action ที่อาจจะส่งผลตามที่สมาชิกสอบถาม มีเพียงกรณีเดียวคือเมื่อปรับแล้วไม่ลงตัว เช่น 3:1 (3 หุ้นเดิม เป็น 1 หุ้นใหม่) <p>ข้อเสนอแนะสมาชิก</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. เช้าวัน Effective CA สมาชิกสามารถ reconcile และตรวจสอบ <ul style="list-style-type: none"> ○ Outstanding Balance ○ PSMS Transaction (Active Transaction) ○ Position Ledger & Trade Listing → แสดง movement ที่เกิดจากการปรับ CA สะท้อนถึง net settlement obligation <p>** สมาชิกสามารถนำไฟล์ CA SOD Reconcile file มาทำการตรวจสอบได้</p> 2. กรณีที่ net settlement obligation ใน SET CLEAR (TCH) ราย trading account (คำนวณจาก Net trading + PSMS transaction) มากกว่า outstanding balance ของ ใน PTI (TSD) ของลูกค้ารายนั้น สมาชิกมีทางเลือกในการดำเนินการ 2 ทางเลือก ดังนี้ <ul style="list-style-type: none"> ○ กรณี obligation สูงกว่า account balance ให้สมาชิกทำรายการ trade amendment ใน SET CLEAR ไปยัง account อื่น ก่อน 10.30 น. เพื่อป้องกันการขาดหุ้นส่งมอบ และให้ TSD automatically sweep ได้ตามเวลา 12.30 น. ○ Manually transfer หุ้นในระบบ PTI จากบัญชีใดๆ มาไว้ที่ settlement account – Client ก่อน 13.30 น. เพื่อป้องกันการขาดหุ้นส่งมอบกับ TCH ณ เวลา settlement time (13.30 น.) 3. หากเป็นกรณีที่ลูกค้าซื้อและขายหลักทรัพย์ในวันเดียวกัน ด้วยจำนวนเท่ากันแต่จากการปรับ CA ได้รับการจัดสรรไม่ตรงกันระหว่างด้านซื้อและขาย ซึ่งจะทำให้ขาดหุ้นส่งมอบแก่ TCH ขอให้สมาชิกแจ้ง TCH ทันทีในวัน Effective date เพื่อที่ TCH จะได้ดำเนินการตรวจสอบและประสานงานกับผู้ที่อาจได้รับการจัดสรรหุ้นเกิน เพื่อโอนมาให้ หรือติดต่อกับบริษัทจดทะเบียน หากมีหุ้นเหลือจากการปรับ CA ต่อไป <ul style="list-style-type: none"> ● รายละเอียด Corporate Action Adjustment นั้น สมาชิกสามารถอ้างอิงจากเอกสารประกอบการประชุมสมาชิกศูนย์รับฝากหลักทรัพย์และสำนักหักบัญชี เมื่อวันที่ 28 ต.ค. 2557

Book Closing

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> การ Simulate รายชื่อปิดสมุดทะเบียนล่วงหน้าได้ 3 วัน นานเกินไปหรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> สมาชิกสามารถตรวจสอบความถูกต้องของข้อมูลการถือครองหุ้นของลูกค้าได้ล่วงหน้า โดยสมาชิกสามารถตรวจสอบรายชื่อปิดสมุดทะเบียนล่วงหน้าได้ 3 วันก่อนวันปิดสมุดทะเบียน
<ul style="list-style-type: none"> DW เมื่อครบกำหนดอายุเป็น Cash settlement มีขั้นตอนการทำงานอย่างไร และสามารถ Auto-exercise รายลูกค้าได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> DW กรณี In the money ระบบ default การใช้สิทธิให้ผู้ถือหุ้นรายนั้นๆ เสมอ และมีช่องทางให้สามารถแจ้งปฏิเสธการใช้สิทธิได้
<ul style="list-style-type: none"> ขอให้พิจารณากรณีงานปิดสมุดทะเบียน ให้มีระบบแจ้งเตือน (Mail alert) เรื่องการถือหุ้นผิดประเภท(L/F) ณ วัน Record date 	<ul style="list-style-type: none"> จะมี Mail alert แจ้งเตือนกรณีข้อมูลปิดสมุดทะเบียนไม่สมบูรณ์ เช่น ถือครองผิดสัญชาติ, มีหุ้นค้างอยู่ใน SINK Account Mail alert จะส่งออกในวันที่ Record Date เวลา 15.00 น. และ 18.00 น.
<ul style="list-style-type: none"> จำนวนหุ้น NVDR จะอยู่ใน Field 'Quantity of Local Securities' หรือ 'Quantity of Foreign Securities' 	<ul style="list-style-type: none"> Quantity of Foreign Securities

การนำหุ้นจากการทำ IPO เข้า segregate account

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> การตรวจสอบความมีตัวตนของลูกค้า กรณีงานเครดิตดำเนินการอย่างไร ทำไมต้องมีการตรวจสอบ Brokerage account 	<ul style="list-style-type: none"> กรณี Subscription TSD จะตรวจสอบความมีตัวตนของลูกค้าจากฐานข้อมูลผู้ถือหุ้นที่สมาชิกได้สร้างไว้ในระบบ PTI โดยมีองค์ประกอบหลัก ได้แก่ Reference Type, Reference No., Nationality, Brokerage Account, Participant ID ในการตรวจสอบ หากไม่มีข้อมูลดังกล่าว ระบบจะตรวจสอบเลข Trading ID เพิ่มเติม โดยระบบจะเครดิตหุ้นเข้าบัญชี SINK Account (Port) หากไม่ปรากฏข้อมูลทั้งหมดดังกล่าวในระบบ กรณีการเครดิตหลักทรัพย์ให้กับผู้ถือหุ้นที่จะมีรายการจำหน่าย ระบบจะตรวจสอบความมีตัวตนของลูกค้า โดยองค์ประกอบหลัก ได้แก่ Reference Type, Reference No., Nationality, Brokerage Account, Participant ID ถ้าไม่ตรงจะเครดิตเข้าบัญชี SINK Account (Port) เนื่องจาก TSD จะ Credit หุ้นเข้าบัญชี Brokerage account ดังนั้นสมาชิกต้องระบุข้อมูล ให้ตรงกันกับ Brokerage account ที่ระบุไว้ใน Shareholder profile

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
	<p>เนื่องจากระบบจะตรวจสอบ ทุกตัวอักษร รวมทั้งอักขระพิเศษ</p> <ul style="list-style-type: none"> กรณีเครดิตหุ้นลงบัญชี SINK Account จะมีฟังก์ชันให้สมาชิกสามารถปรับปรุงเพื่อเครดิตลงบัญชีย่อยที่ถูกต้องตามคำสั่งของสมาชิก และสมาชิกสามารถ Download Credit Text File หลังการปรับปรุงได้ <p>แก้ไข เพิ่มเติม จากที่ประชุมสมาชิกศูนย์รับฝากหลักทรัพย์และสำนักหักบัญชี เมื่อวันที่ 28 ตุลาคม 2557</p>

Subscription

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> ระบบการบันทึกข้อมูลการจองซื้อหุ้น (Subscription) จะมีปรับปรุงหรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> ระบบการบันทึกข้อมูลการจองซื้อหุ้น (Subscription) จะเพิ่ม Field เลขที่บัญชีฝากหลักทรัพย์ของผู้จำนำ

อื่นๆ

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> ขอให้เพิ่ม API message เพื่อส่งข้อมูล Account Balance หุ้น เป็น Real time เพื่อสมาชิกจะนำไปกระทบยอดหุ้นระหว่างระบบ PTI และ ระบบ Back office 	<ul style="list-style-type: none"> TSD จะพิจารณาดำเนินการใน Phase ถัดไป
<ul style="list-style-type: none"> API message ที่ส่งให้สมาชิกมีเฉพาะบางฟังก์ชันใช้หรือไม่ เช่น มี API message ของการทำรายการ Create แต่ไม่มี API message ของการทำรายการ Delete ทำให้ user ต้องจำว่าฟังก์ชันใดต้องมาทำที่หน้าจอ PTI 	<ul style="list-style-type: none"> บางฟังก์ชันไม่มี API message เนื่องจากเห็นว่าเป็นรายการที่เกิดไม่บ่อย ทำที่หน้าจอ PTI จะสะดวกกว่า
<ul style="list-style-type: none"> ระบบ new clearing สามารถ import เป็น text file แทนการ API ได้ 	<ul style="list-style-type: none"> สามารถ download เป็น Excel ได้จากหน้าจอระบบ new clearing

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
หรือไม่ หรือต้องผ่าน API message อย่างไร	
<ul style="list-style-type: none"> • ขอดูหน้าจอของระบบใหม่ได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • TCH รับไว้พิจารณา ซึ่งอาจนำเสนอ screen ในรูปแบบของ Excel file • TCH ได้นำเสนอ screen ที่สำคัญแล้ว ในการจัดอบรมการนำเสนอ screen และ function การทำงานที่สำคัญ เมื่อเดือนกันยายน 2557 (Update เมื่อวันที่ 28 ตุลาคม 2557)

Industry-Wide Test (IWT)

คำถาม/ประเด็น	คำชี้แจง
<ul style="list-style-type: none"> • ในการทดสอบ IWT นั้น Custodian Bank ขอให้วัดผลการทดสอบ PSMS จาก SWIFT แทนการวัดผลการทดสอบผ่าน PTI Web Application ได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • Custodian Bank สามารถใช้ SWIFT ในการทดสอบงาน PSMS ได้เฉพาะการสร้างรายการเท่านั้น อย่างไรก็ตาม Custodian Bank <u>ต้องทดสอบฟังก์ชันอื่นๆ</u> ของงาน PSMS เช่น แก๊ไข ยกเลิก merge de-match รายการ ผ่าน PTI Web Application <p>แก๊ไข เพิ่มเติม จากที่ประชุมสมาชิกศูนย์รับฝากหลักทรัพย์และสำนักหักบัญชี เมื่อวันที่ 28 ตุลาคม 2557</p>
<ul style="list-style-type: none"> • การลงนามแจ้งผ่านการทดสอบ IWT หรือ Market Rehearsal ที่กำหนดให้เป็น CIO ลงนามสำหรับ IWT หรือ CEO ลงนามสำหรับ Market Rehearsal สำหรับ Custodian Bank ให้เป็นผู้บริหารท่านอื่นได้หรือไม่ 	<ul style="list-style-type: none"> • สำหรับ Custodian Bank นั้น การลงนามแจ้งผ่านการทดสอบ IWT หรือ Market Rehearsal สามารถให้ Head of Custody Services เป็นผู้ลงนามในแบบแจ้งผลการทดสอบได้ <p>แก๊ไข เพิ่มเติม จากที่ประชุมสมาชิกศูนย์รับฝากหลักทรัพย์และสำนักหักบัญชี เมื่อวันที่ 28 ตุลาคม 2557</p>