

ที่ สช.(ว) 00084-2561

4 ธันวาคม 2561

เรื่อง นำส่งคู่มือดำเนินการกรณีสมาชิกผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์
เรียน กรรมการผู้จัดการ
บริษัทสมาชิกสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์
สิ่งที่ส่งมาด้วย คู่มือการดำเนินการกรณีผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์

ตามที่กลุ่มตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ได้สำรวจความคิดเห็นของบริษัทสมาชิกเกี่ยวกับการดำเนินงานของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ซึ่งบริษัทสมาชิกได้มีข้อเสนอแนะให้บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด (สำนักหักบัญชี) จัดทำคู่มือการดำเนินการกรณีผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ เพื่อให้บริษัทสมาชิกใช้เป็นแนวทางในการปฏิบัติงานเมื่อผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์กับสำนักหักบัญชี นั้น

ในการนี้ สำนักหักบัญชีได้จัดทำและขอให้นำส่งคู่มือการดำเนินการกรณีผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ โดยมีแนวทางดำเนินการกรณีผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ดังนี้

1. กรณีผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ Foreign หรือ Local

หากในเวลาที่ยกกำหนดส่งมอบหลักทรัพย์ สมาชิกมีหลักทรัพย์ Foreign หรือ Local ในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ (Settlement Account) ไม่เพียงพอส่งมอบกับสำนักหักบัญชี เป็นเหตุให้สมาชิกผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ Foreign หรือ Local และมีหน้าที่ยืมหลักทรัพย์ Foreign หรือ Local เพื่อการส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชี (SBL) และ/หรือ มีฐานะผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ Foreign หรือ Local คงค้างต่อสำนักหักบัญชี (Pending Delivery)

ภายหลังเมื่อสมาชิกมีหลักทรัพย์ Foreign หรือ Local สมาชิกสามารถนำหลักทรัพย์ดังกล่าวมาคืนรายการยืมหลักทรัพย์ เพื่อระงับการคิดค่าธรรมเนียมการยืมหลักทรัพย์ ด้วยวิธีการ Return SBL หรือนำมาคืนรายการผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์คงค้าง เพื่อระงับรายการ Buy-in และการคำนวณค่าปรับผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ ด้วยวิธีการ Return Securities Defaulted รายละเอียดของวิธีการดำเนินการ ปรากฏตามสิ่งที่ส่งมาด้วยที่แนบมาพร้อมนี้

2. กรณีผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ NVDR

เนื่องจากการส่งมอบ NVDR เกิดจากรายการขาย NVDR โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อการขายหลักทรัพย์อ้างอิงที่เป็น Local ดังนั้นในวันที่ยกกำหนดส่งมอบหลักทรัพย์ เมื่อมีรายการผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ NVDR หากบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์เพื่อลูกค้าของสมาชิก (Settlement Account-Client) และ/หรือ บัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์เพื่อสมาชิก (Settlement Account-Proprietary) มีหลักทรัพย์ NVDR ไม่เพียงพอส่งมอบ ทำให้ต้องดำเนินการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงที่เป็น Local ของสมาชิกแทน ระบบงานของสำนักหักบัญชีจะหักหลักทรัพย์อ้างอิงในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์เพื่อสมาชิก (Settlement Account-Proprietary) ในจำนวนเดียวกับหลักทรัพย์ NVDR ที่ผิดนัดส่งมอบ และหากไม่เพียงพอ สมาชิกจะมีสถานะผิดนัดหรือยืมหลักทรัพย์ (SBL) Local หรือ ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ Local คงค้างต่อสำนักหักบัญชี (Pending Delivery)

ภายหลังเมื่อสมาชิกมีหลักทรัพย์ NVDR สามารถระงับรายการผิติดส่งมอบ Local ในบัญชี
ฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์เพื่อสมาชิก (Settlement Account-Proprietary)
ได้ด้วยวิธีการ ดังนี้

- 2.1 นำ NVDR ที่สมาชิกได้รับมอบจากลูกค้าในภายหลังมาส่งมอบ โดยทำรายการผ่าน
ระบบงานสำนักหักบัญชี (Late Settlement) อ้างอิงข้อมูลวันที่และจำนวน NVDR ที่ขาดส่ง
มอบ ย้อนหลังได้ไม่เกิน 5 วันทำการ
- 2.2 นำรายการซื้อขาย NVDR ที่ชำระราคาและส่งมอบแล้ว มาแก้ไขผ่านระบบงานของสำนัก
หักบัญชี (NVDR Adjustment Extension) โดยอ้างอิงหมายเลขรายการซื้อขาย (Deal
Number) ย้อนหลังได้ไม่เกิน 3 เดือน แต่หากหลักทรัพย์นั้นมีการปิดสมุดทะเบียนภายใน
3 เดือนที่ผ่านมา สมาชิกจะทำรายการที่อ้างอิงกับรายการซื้อขายได้หลังวันปิดสมุด
ทะเบียนแล้วเท่านั้น
- 2.3 นำ NVDR ที่ถือครองอยู่มาเปลี่ยนเป็นหุ้น Local ที่ระบบการซื้อขายของตลาดหลักทรัพย์
(รายการขาย NVDR ซื้อหลักทรัพย์ Local)

ทั้งนี้ เมื่อสมาชิกมีหลักทรัพย์ Local พร้อมส่งมอบแล้ว จะต้องดำเนินการส่งมอบหลักทรัพย์
ที่ผิติดหรือคืนรายการยืมหลักทรัพย์ผ่านระบบงานสำนักหักบัญชีด้วย (Return Securities Defaulted
/Return SBL) รายละเอียดของวิธีการดำเนินการปรากฏตามสิ่งที่ส่งมาด้วยที่แนบมาพร้อมนี้

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ

(ลงนาม) (นางสาวกัลยรัตน์ ศรีอรุณ)

(นางสาวกัลยรัตน์ ศรีอรุณ)

ผู้อำนวยการ ฝ่ายชำระราคาหลักทรัพย์
กลุ่มตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ฝ่ายชำระราคาหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 0-2009-9549 ถึง 9553



คู่มือดำเนินการเกี่ยวกับการผัดสน้ส่งมอบหลักทรัพย์

4 ธันวาคม 2561

- ❑ การดำเนินการหากสมาชิกผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์กับ TCH
- ❑ การระงับรายการ SBL/Pending Deliver
 - หุ้ที่จะนำมาระงับประเภท เดียวกับ หุ้ที่ผิดนัด
 - หุ้ที่จะนำมาระงับประเภท ต่างจาก หุ้ที่ผิดนัด
 - วิธีการสร้างรายการ Return บนระบบ SET CLEAR
- ❑ ตัวอย่างการดำเนินการของสมาชิก

การดำเนินการหากสมาชิกผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์

การดำเนินการ: กรณีผิดนัดส่งมอบหุ้น Foreign / Local



การดำเนินการ : กรณีมี NVDR ไม่เพียงพอส่งมอบ

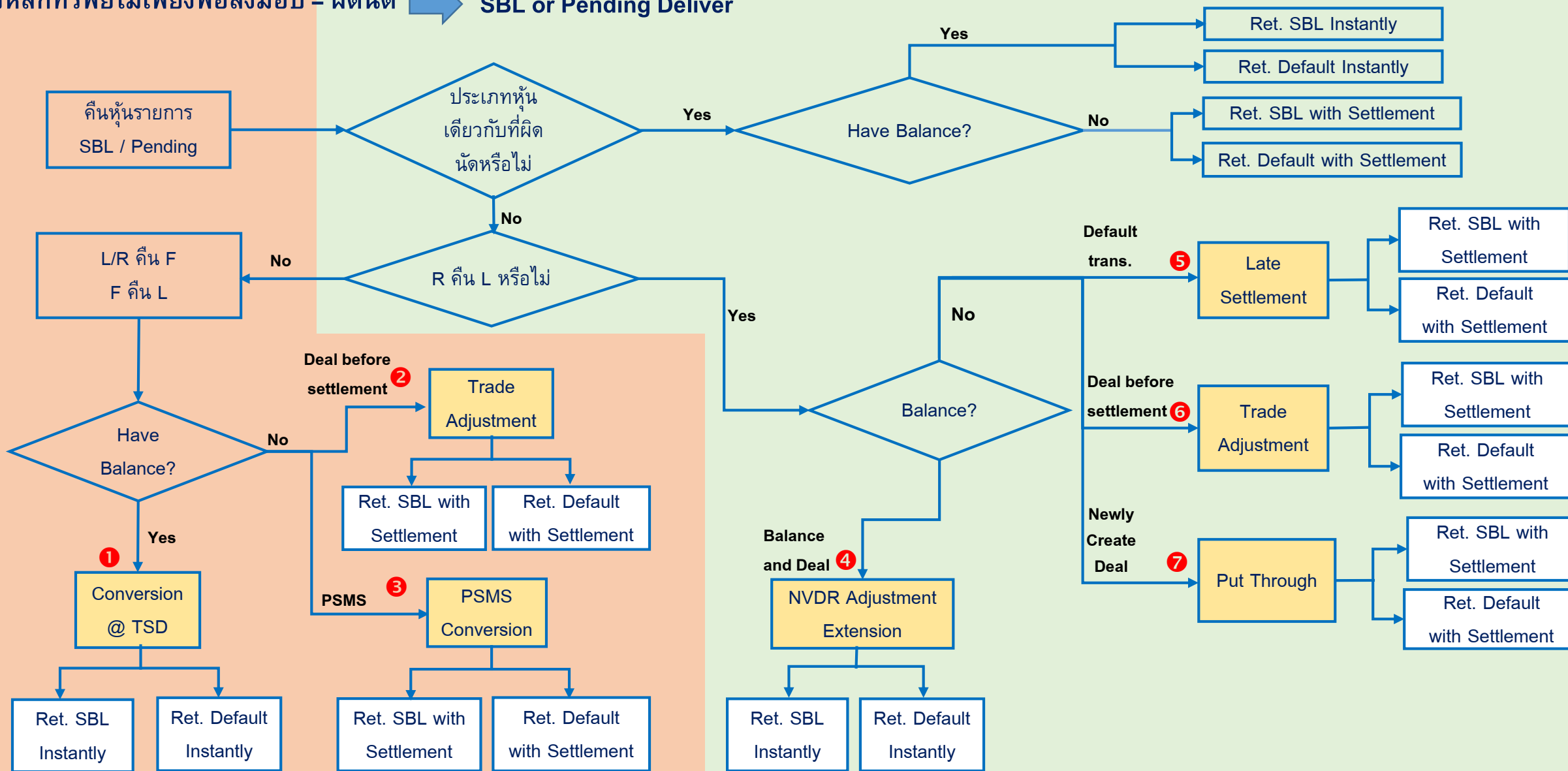


การระงับรายการ SBL/Pending Deliver

การระงับรายการ SBL / Pending Settlement



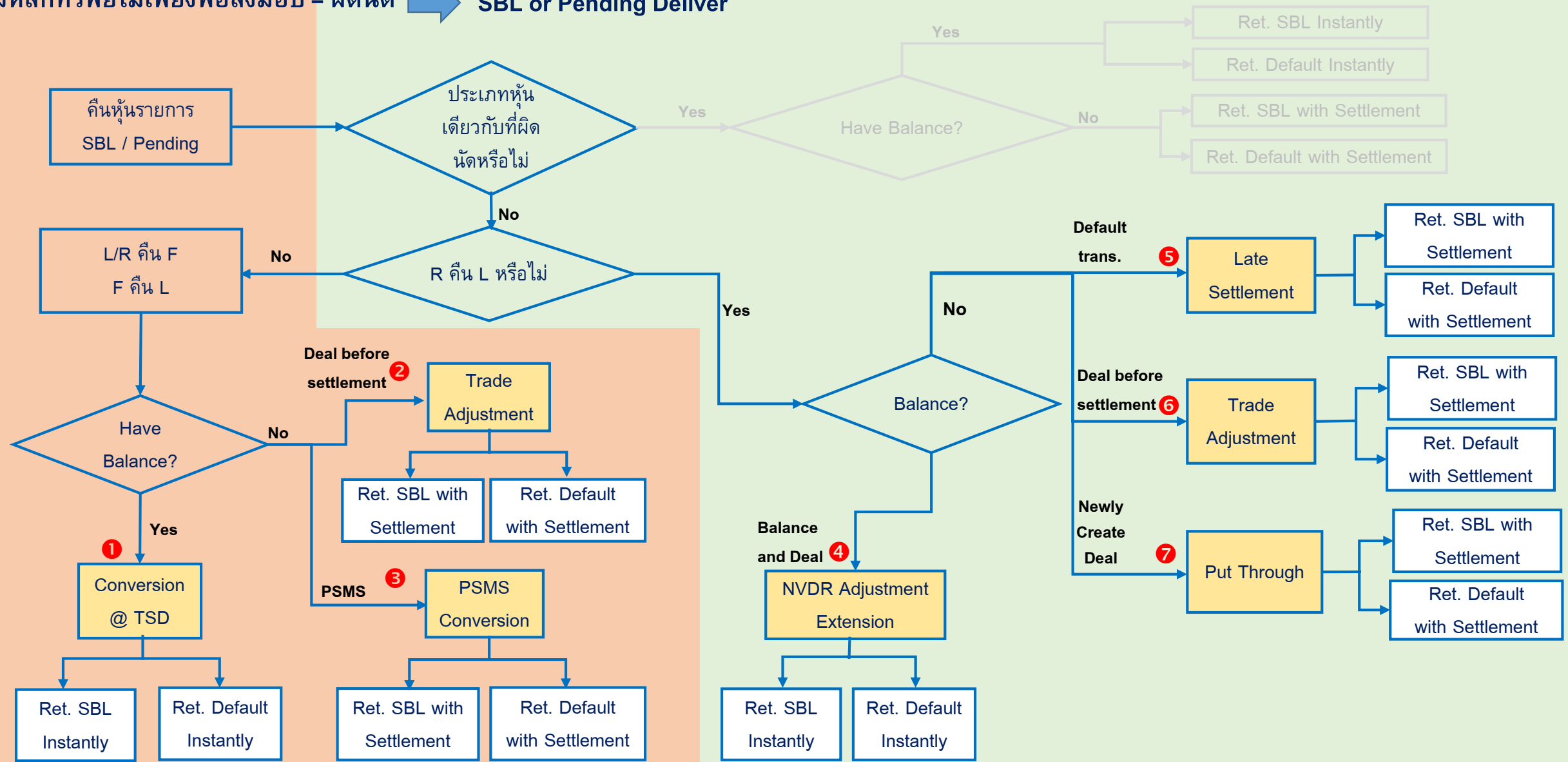
มีหลักทรัพย์ไม่เพียงพอส่งมอบ = ผิดนัด → SBL or Pending Deliver



การระงับรายการ SBL / Pending Settlement : หุ้นที่จะนำมาระงับประเภท ต่างจาก หุ้นที่ผิดนัด



มีหลักทรัพย์ไม่เพียงพอส่งมอบ = ผิดนัด → SBL or Pending Deliver



การระงับรายการ SBL/Pending Deliver:

- หุ้่นที่จะนำมาระงับประเภทเดียวกับหุ้่นที่ผิดนัด

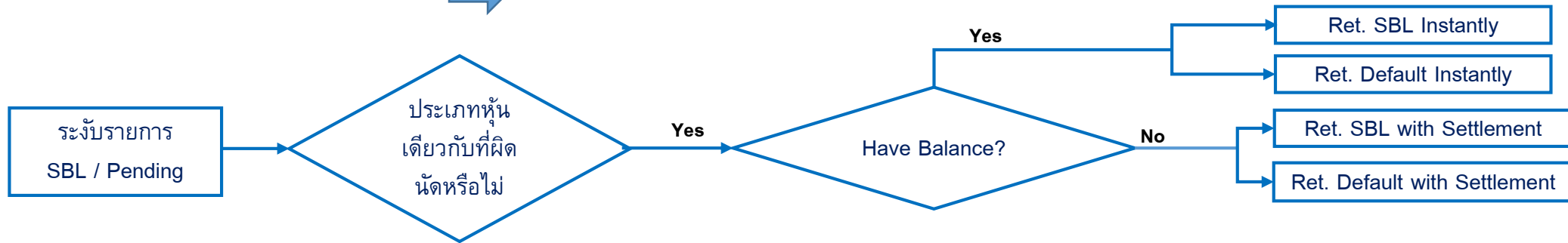
การระงับรายการ SBL/Pending Deliver: หุ่นที่จะนำมาระงับประเภทเดียวกับ หุ่นที่ผิดนัด



มีหลักทรัพย์ไม่เพียงพอส่งมอบ = ผิดนัด



SBL or Pending Deliver



การสร้างรายการ Return	วัตถุประสงค์
Return Default	<ul style="list-style-type: none"> • ระงับรายการ TCH Buy-in • ระงับการคำนวณค่าปรับ
Return SBL	<ul style="list-style-type: none"> • ส่งมอบหุ่นคืน TCH เพื่อให้ TCH นำไปส่งมอบคืนให้กับ Lender • ระงับการคำนวณค่าธรรมเนียมการยืม
Screen no. in SET CLEAR	<p><u>Return Default</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Screen no. 4855 : Return Securities Defaulted-Request • Screen no. 4856 : Return Securities Defaulted-Approve <p><u>Return SBL</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Screen no. 4659 : Return SBL Request • Screen no. 4660 : Return SBL Approve

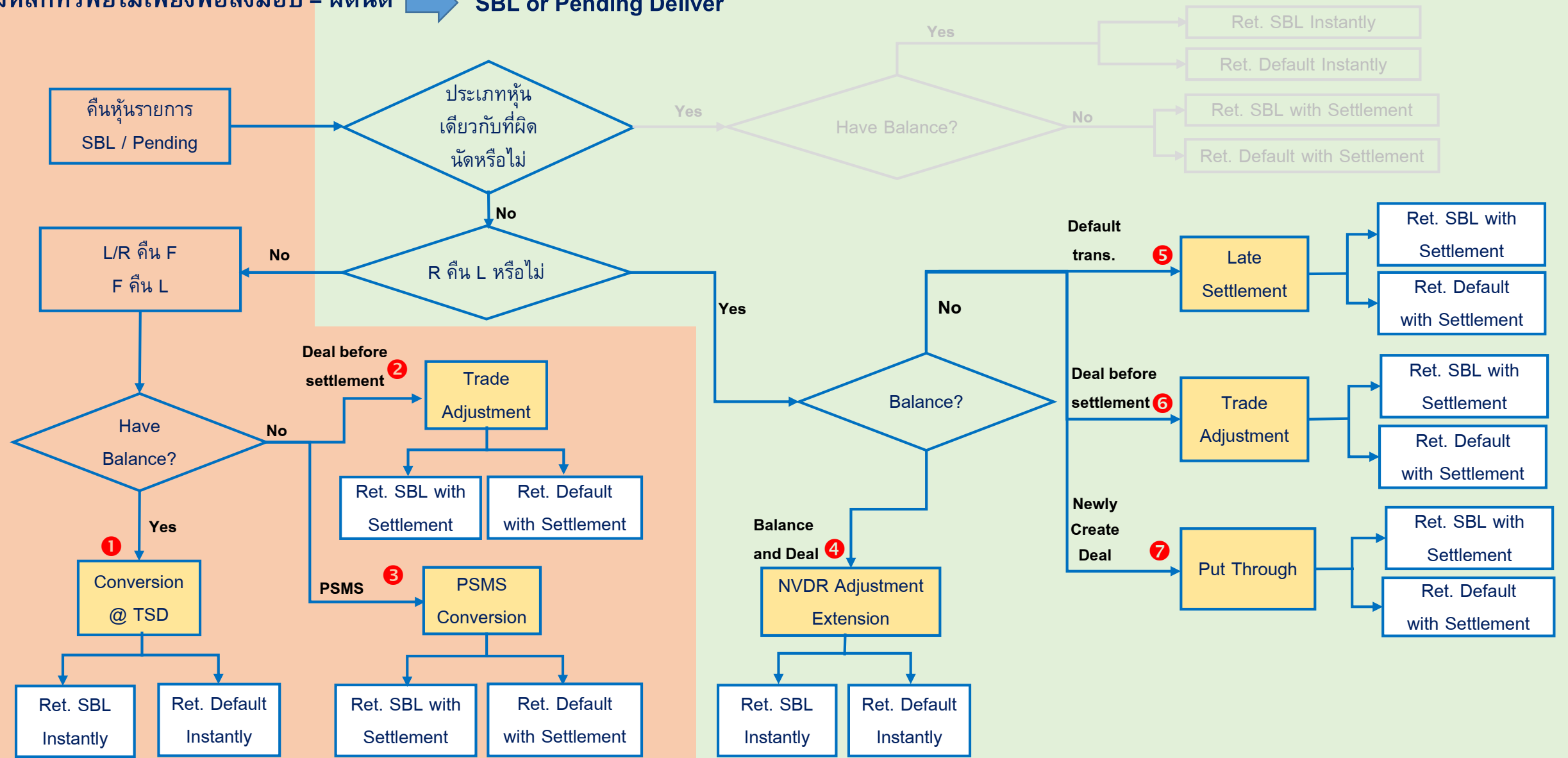
การระงับรายการ SBL/Pending Deliver:

- หุ้่นที่จะนำมาระงับประเภทต่างจากหุ้่นที่ผิดนัด

การระงับรายการ SBL / Pending Settlement : หุ้นที่จะนำมาระงับประเภท ต่างจาก หุ้นที่ผิดนัด

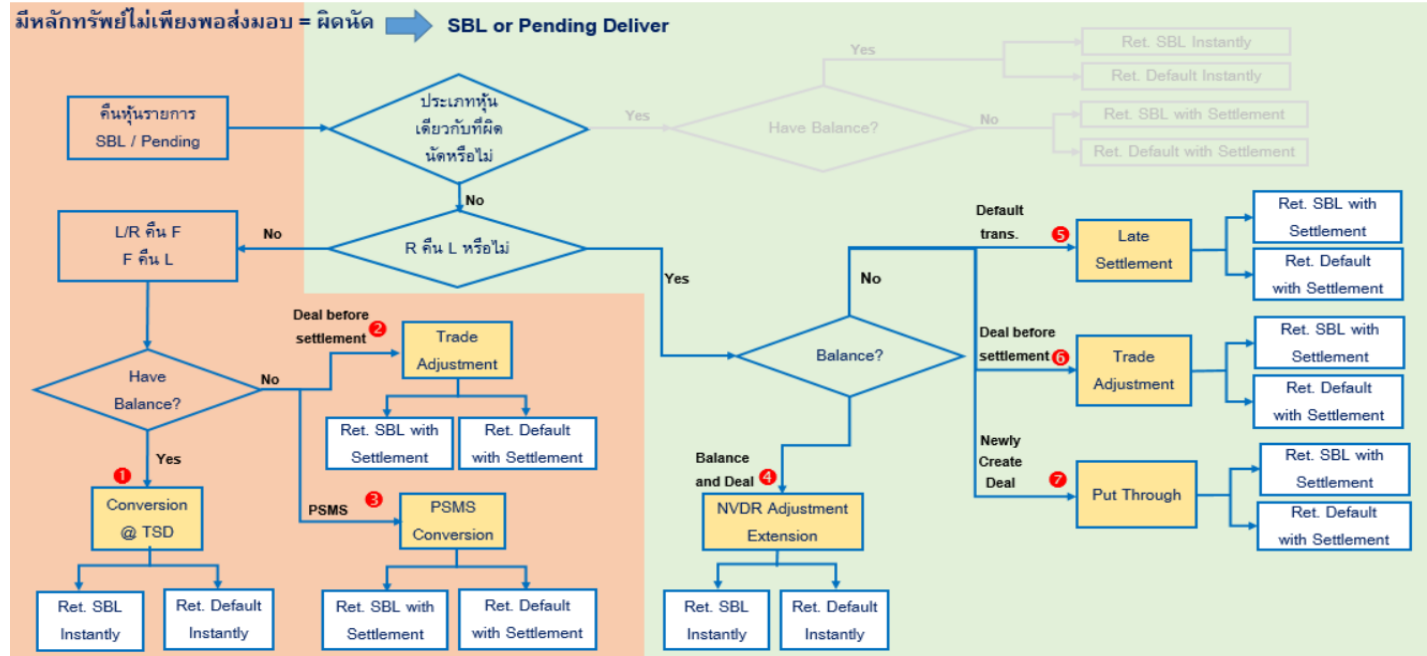
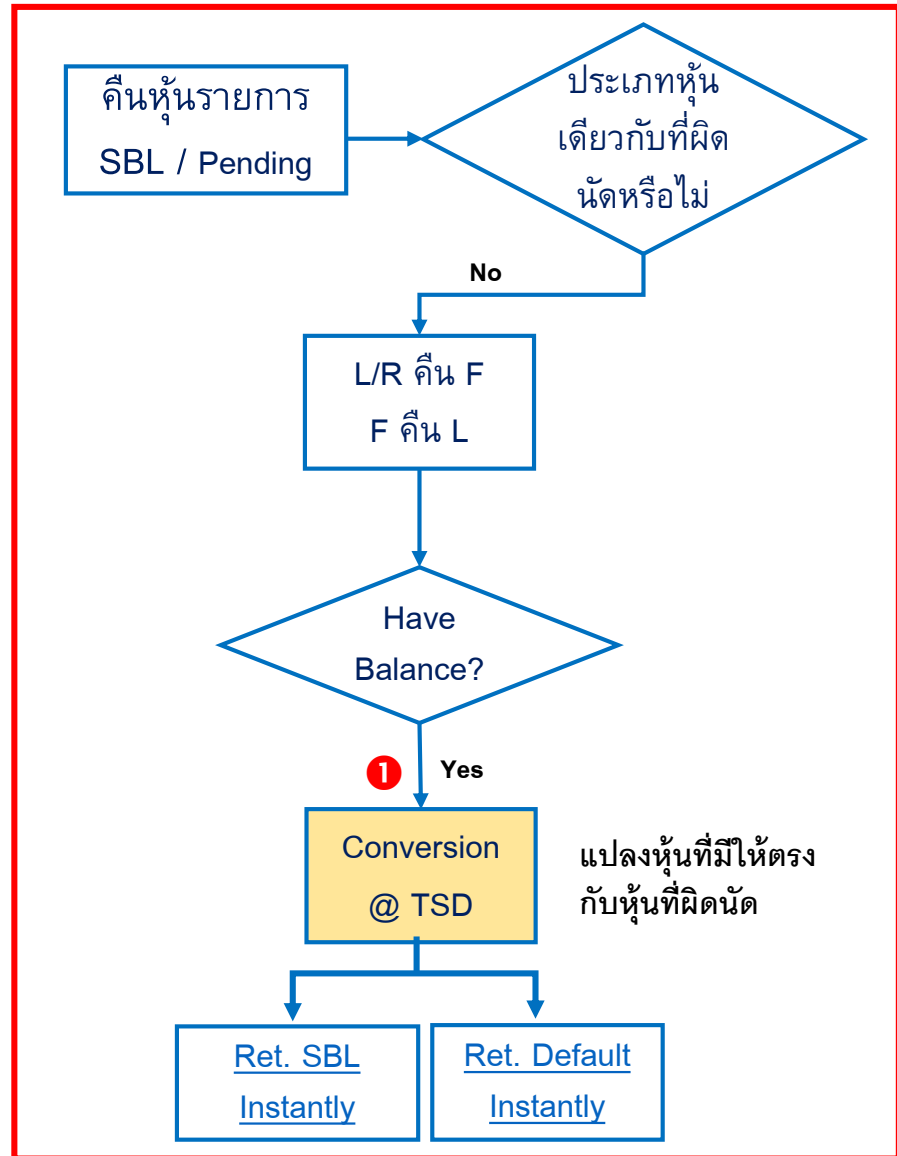


มีหลักทรัพย์ไม่เพียงพอส่งมอบ = ผิดนัด → SBL or Pending Deliver



แปลงหุ้นก่อน Return : Transfer => Balance

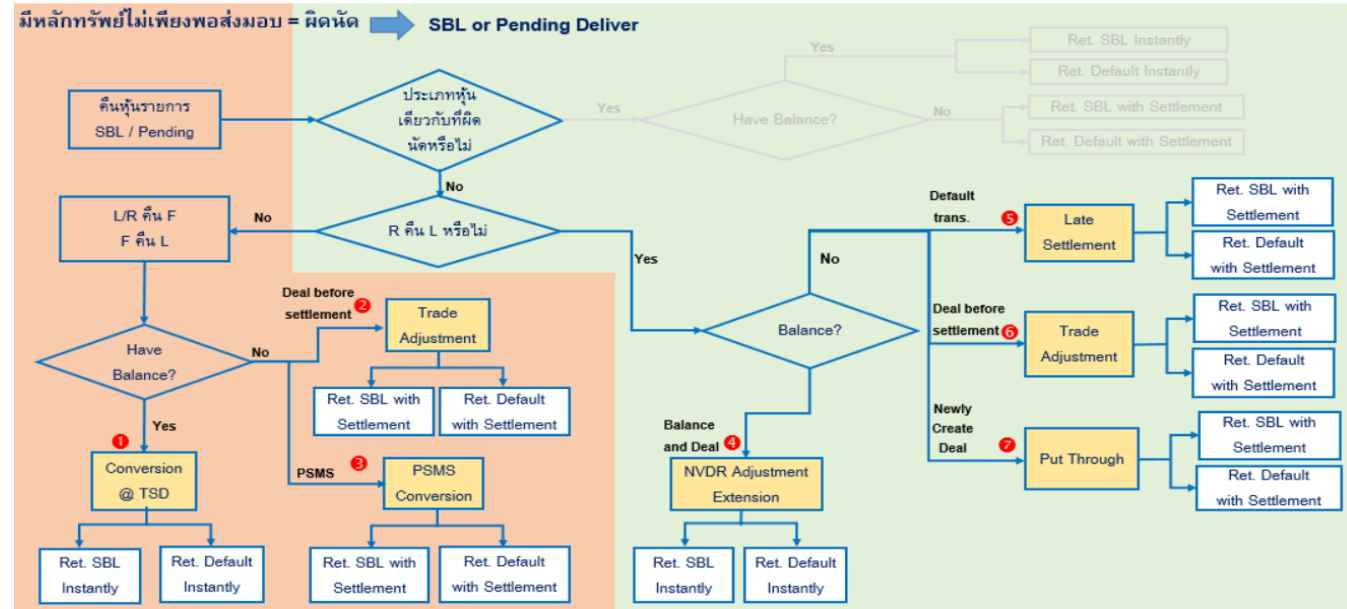
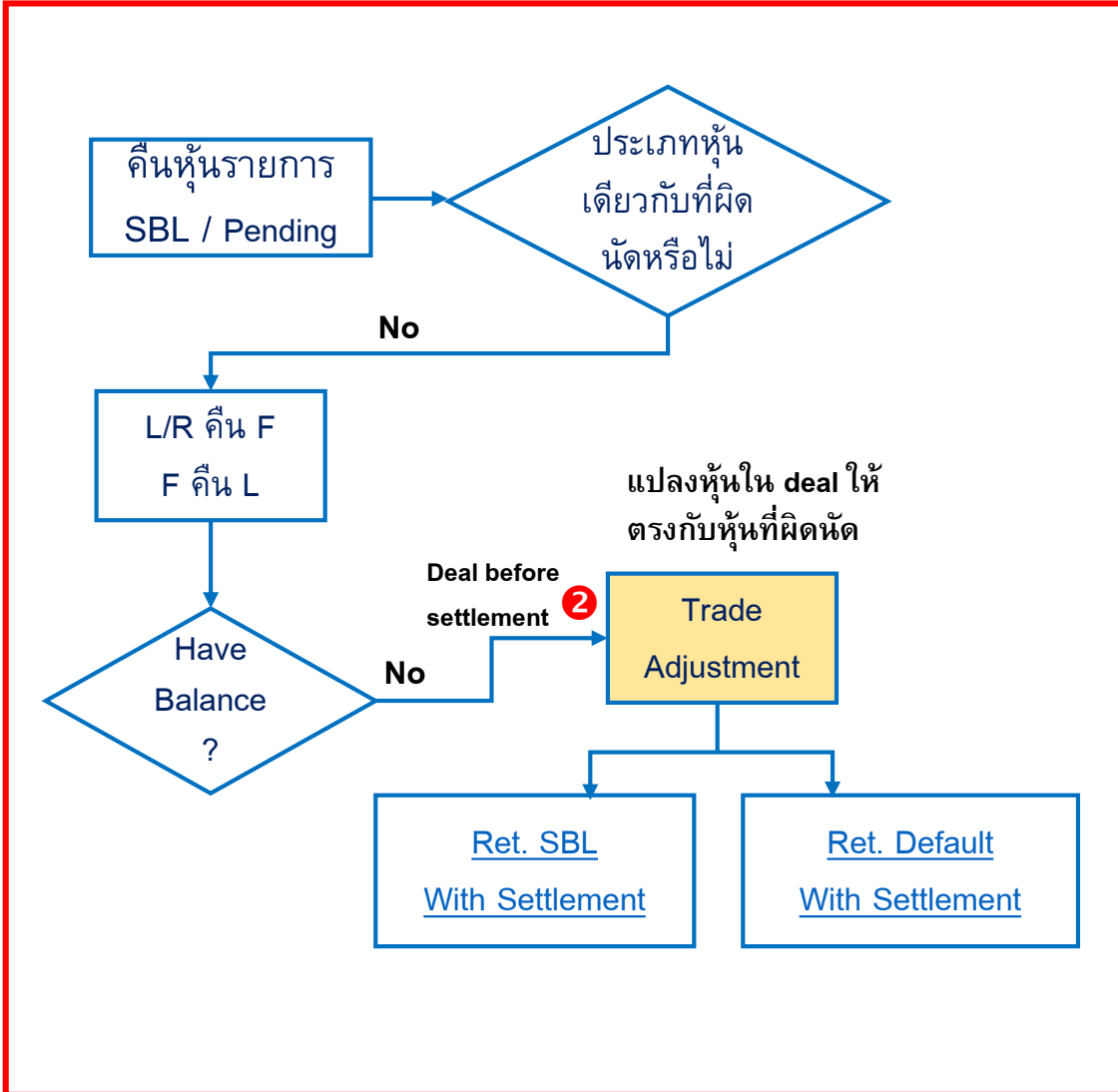
นำ L/R มาคืนหุ้น F ที่ผิดนัด ,
นำ F มาคืนหุ้น L ที่ผิดนัด



Transfer @ TSD	รายละเอียด
เงื่อนไขการ Validate ของระบบ PTI	<ul style="list-style-type: none"> ต้องมีหุ้น (Balance) พร้อมทั้งจะแปลง ตรวจสอบว่ามี Room กรณีขอแปลงเป็น F => หากไม่มี Room F แปลงไม่สำเร็จ => คืนไม่สำเร็จ
กำหนดเวลาดำเนินการ	07.00 - 19.00
ผลของการแปลง	L/R -> F F -> L

แปลงหุ้นก่อน Return : Deal with Trade Adjustment

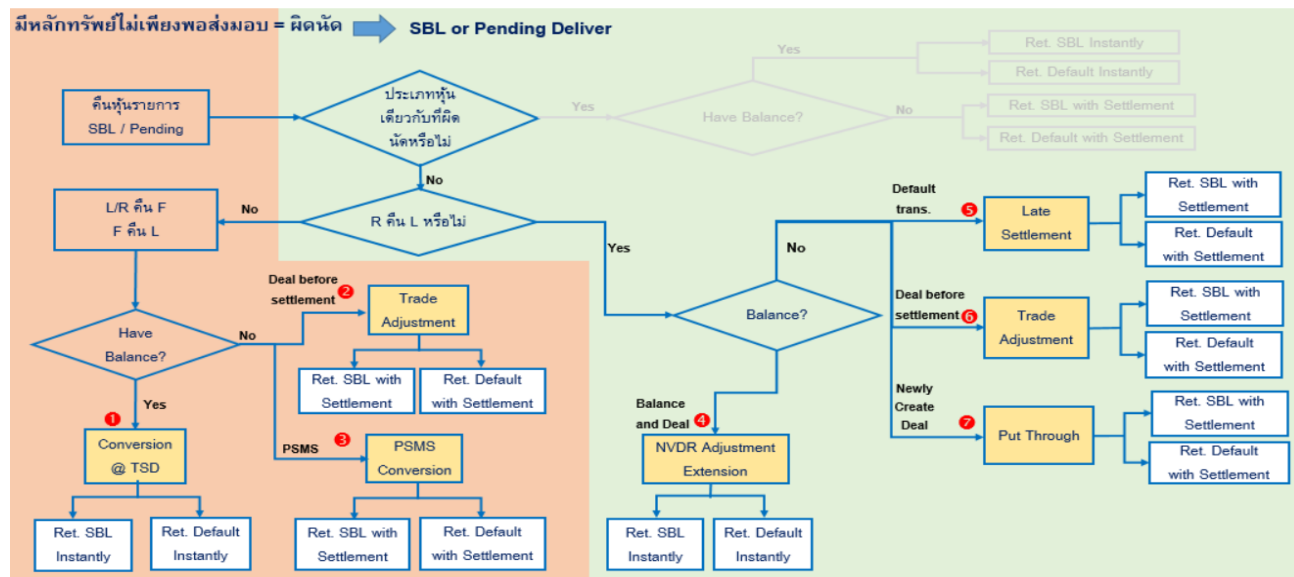
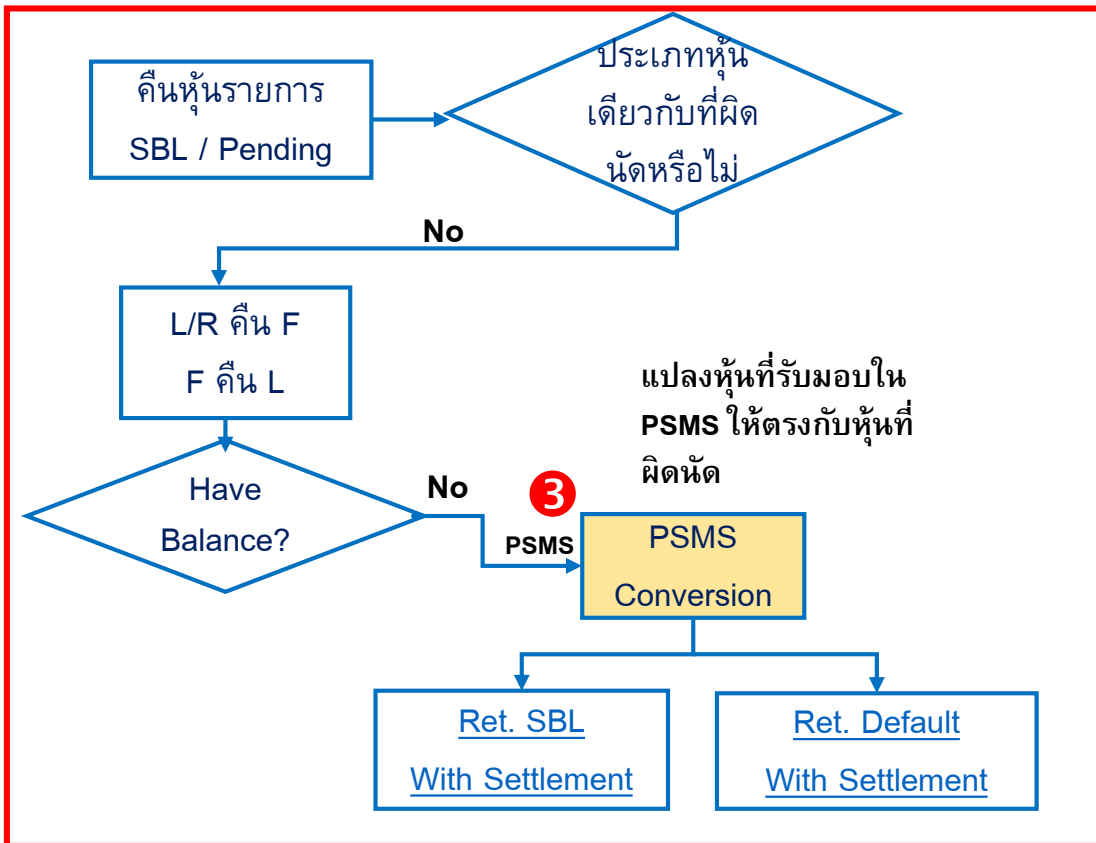
นำ L/R มาคืนหุ้น F ที่ผิดนัด ,
นำ F มาคืนหุ้น L ที่ผิดนัด



Trade Adjustment	รายละเอียด
เงื่อนไขการ Validate ของระบบ SET CLEAR	<ul style="list-style-type: none"> อ้างอิง Deal (Buy Side) ที่ยังไม่ได้ Settlement ตรวจสอบว่ามี Room กรณีขอแปลงเป็น F => หากไม่มี Room F แปลงไม่สำเร็จ => คืนไม่สำเร็จ
กำหนดเวลา	ตั้งแต่ Trade จนถึงวัน S.D. (11.30 น.)
ผลของการแปลง	L (Buy side) -> F หรือ R (Buy side) -> F หรือ F (Buy side) -> L

แปลงหุ้นก่อน Return : PSMS with conversion

นำ L/R มาคืนหุ้น F ที่ผิดนัด ,
นำ F มาคืนหุ้น L ที่ผิดนัด



เงื่อนไขการแปลงหุ้น

เงื่อนไขการ Validate ของระบบ PSMS

- การ Conversion ต้องเป็นระหว่าง Broker/ Sub-broker กับ Settlement Agent เท่านั้น
 - SA ทำรายการ DVP/DF with conversion L/R to F only
 - Broker ทำรายการ RVP/RF with conversion F to L only
- ตรวจสอบว่ามี Room กรณีขอแปลงเป็น F => หากไม่มี Room F แปลงไม่สำเร็จ => คืนไม่สำเร็จ

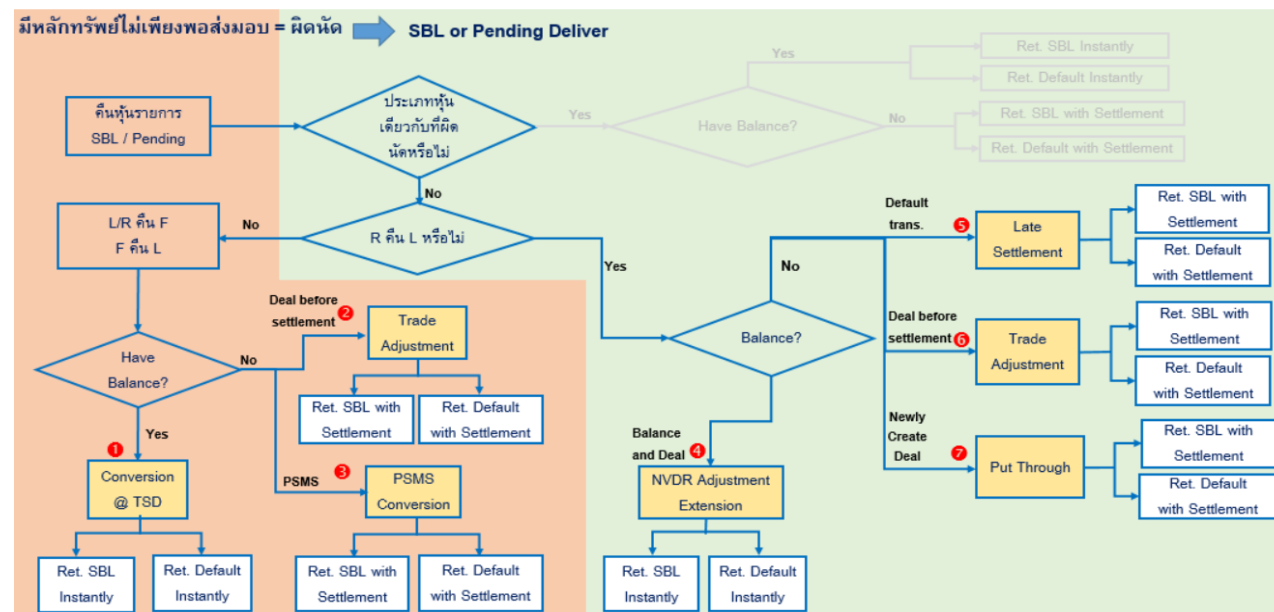
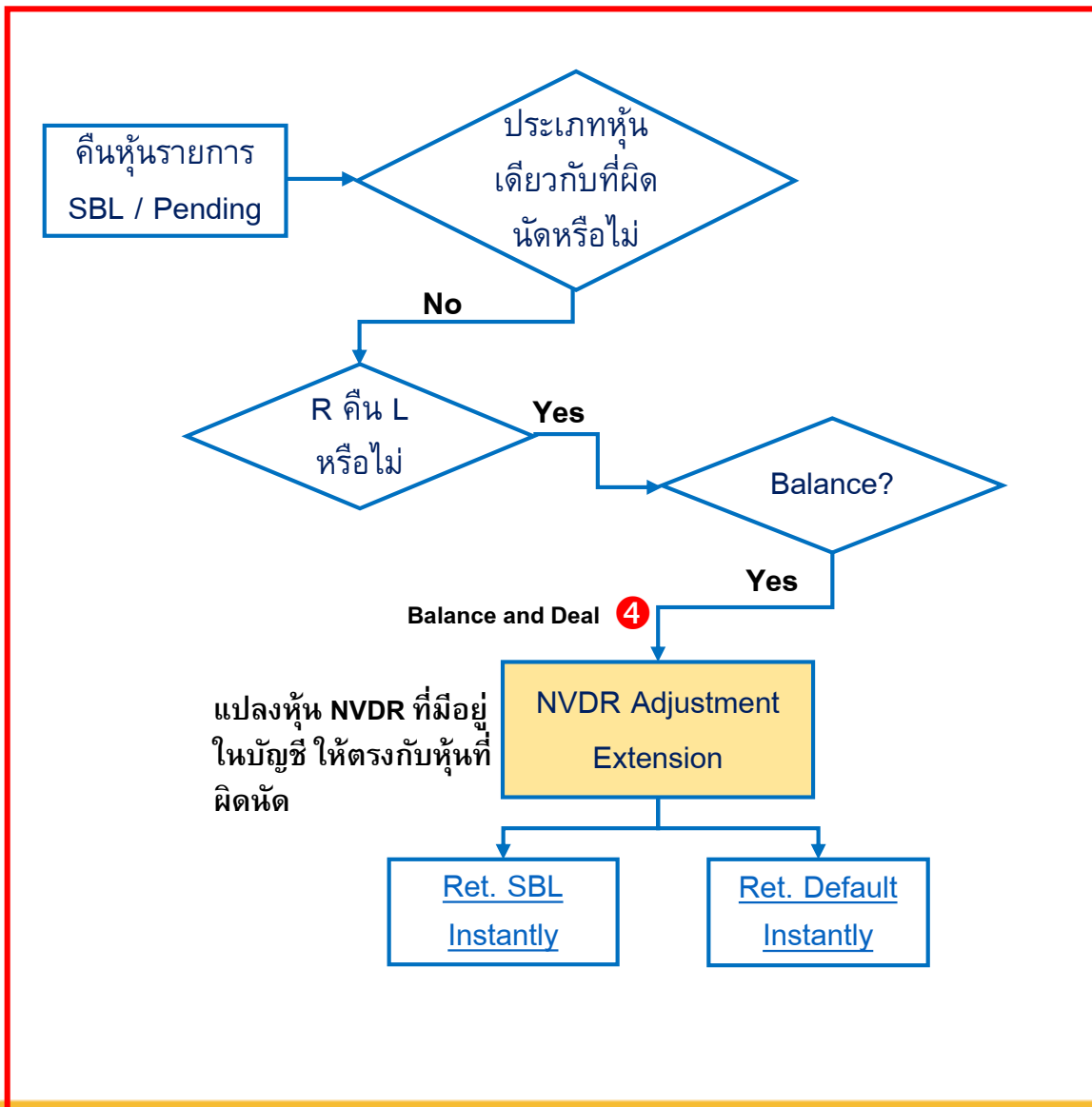
Convert PSMS	Broker	Custodian
ผิดนัด L	RVP or RF : Flag F > L	DVP or DF : F
ผิดนัด F	RVP or RF : F	DVP or DF : Flag L/R > F

กำหนดเวลา
รายการที่ไม่ขอ Room F ภายใน 11.30 น. ของวันที่ SD
รายการที่ขอ Room F ภายใน 16.30 น. ของวันที่ SD-1

ผลของการแปลง
Settlement Agent -> Broker/ Sub-broker
F -> L , L/R -> F

แปลงหุ้นก่อน Return : NVDR Adjustment Extension

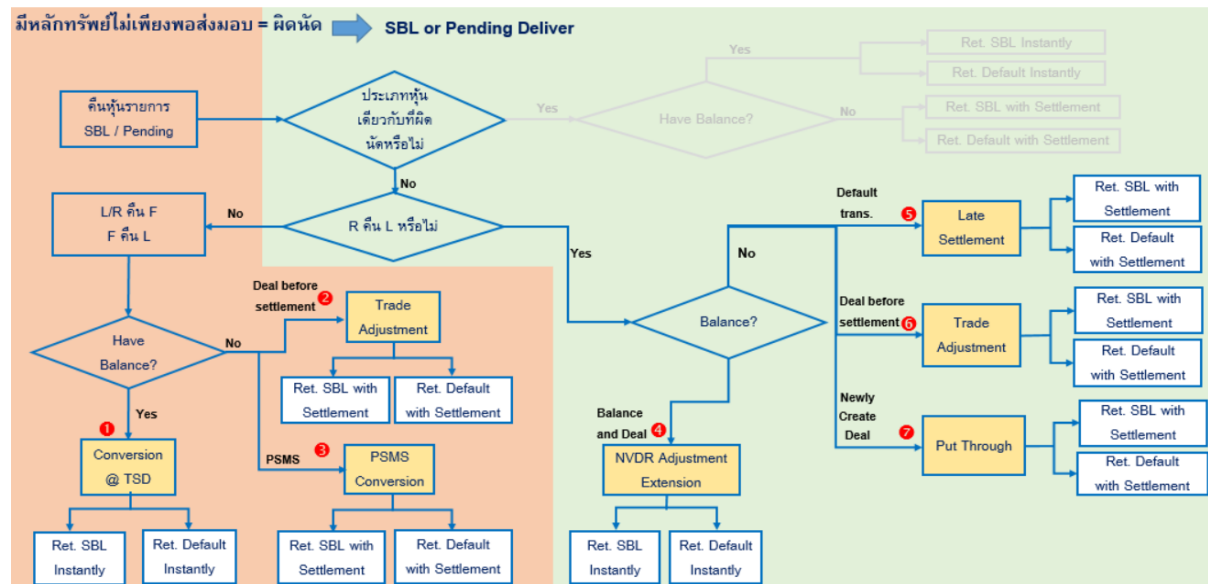
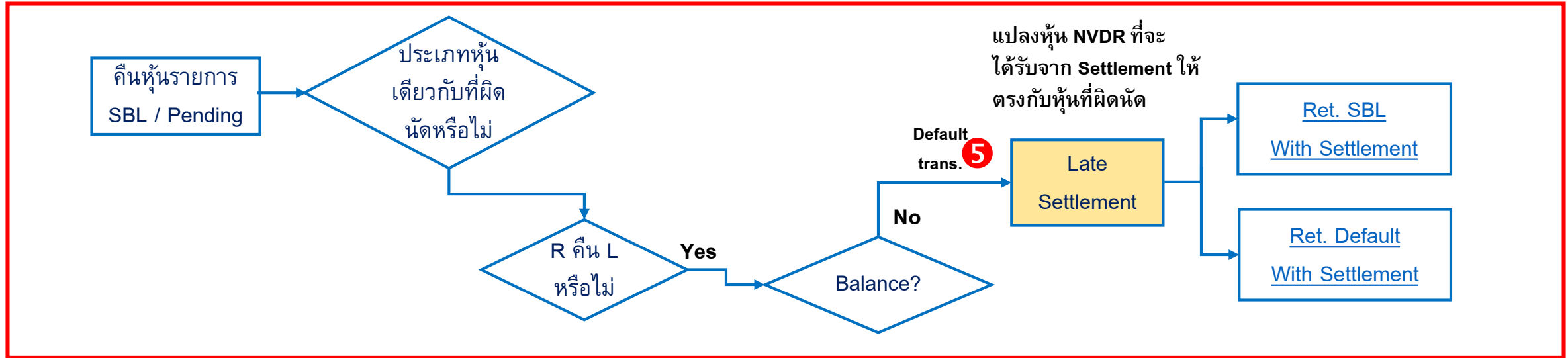
นำ R มาคืนหุ้น L ที่ผิดนัด



NVDR Adjustment Extension	รายละเอียด
เงื่อนไขการ Validate ของระบบ SET CLEAR	<ul style="list-style-type: none"> ต้องมีหุ้น (Balance) พร้อมทั้งจะแปลง อ้างอิง Deal ในอดีต Settlement แล้ว <ul style="list-style-type: none"> Deal ขาย L Deal ชื้อ NVDR ภายใน 3 เดือน และไม่มีการปิดสมุดทะเบียน
กำหนดเวลา	7.00 - 19.00
ผลของการแปลง	R -> L

แปลงหุ้นก่อน Return : Late Settlement

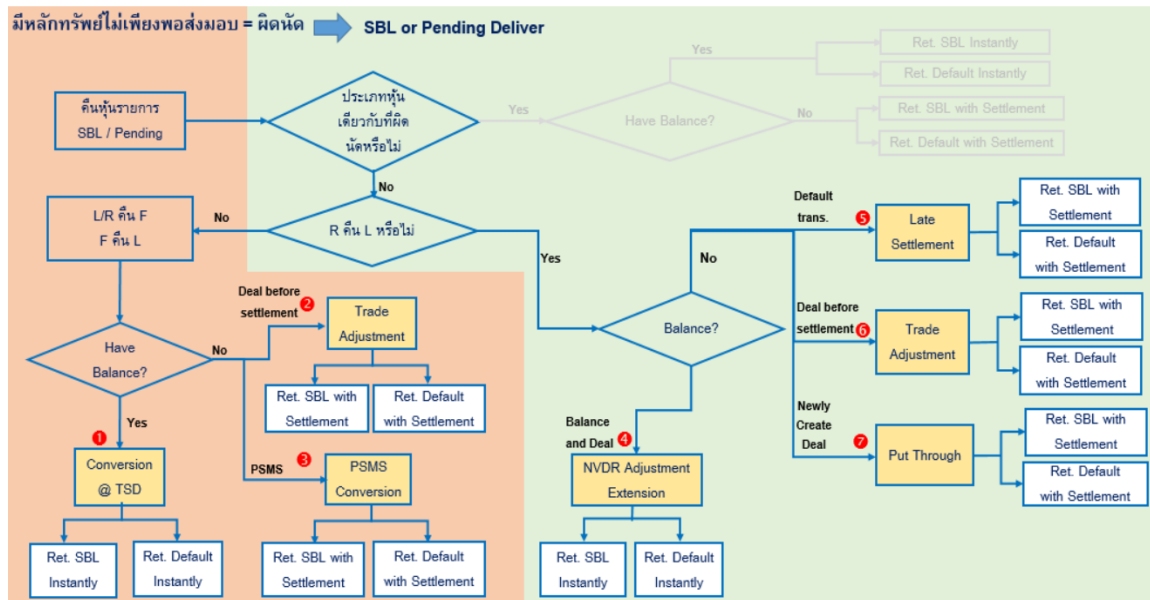
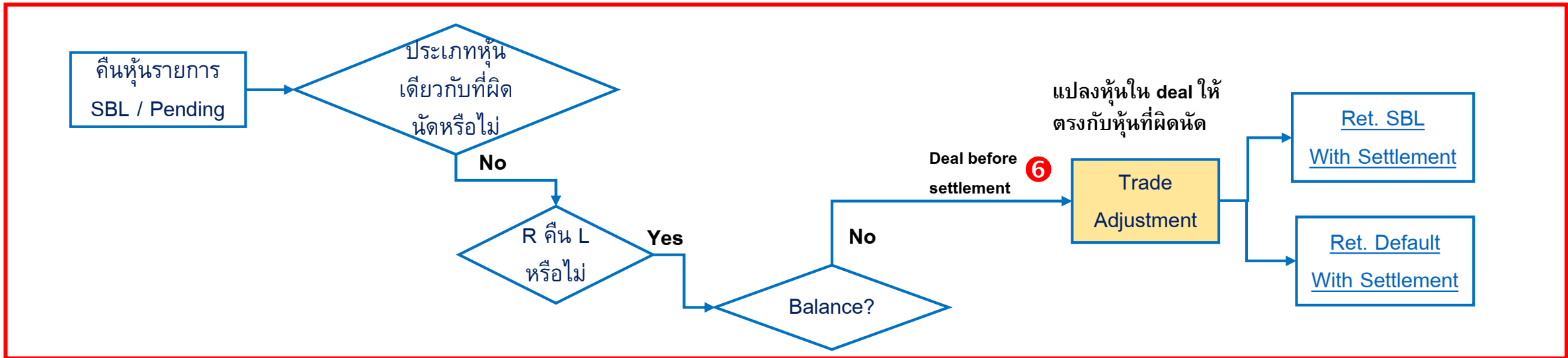
นำ R มาคืนหุ้น L ที่ผิดนัดในบัญชี Settlement - Proprietary



Late Settlement	เงื่อนไขการแปลงหุ้น
เงื่อนไขการ Validate ของระบบ SET CLEAR	<ul style="list-style-type: none"> อ้างอิงรายการผิดนัด และแปลงได้ภายใน 5 วันทำการ นับตั้งแต่วันที่ขาด R ส่งมอบ ตรวจสอบจำนวนหุ้นที่ต้องไม่เกินจำนวน R ที่ขาด
กำหนดเวลา	Settlement รอบ 1 : ภายในเวลา 11.30 น. ของวัน SD Settlement รอบ 2 : เวลา 14.15 – 14.45 น. ของวัน SD
ผลของการแปลง	R (sett a/c ที่ผิดนัด) -> L (Port)

แปลงหุ้นก่อน Return : : Deal with Trade Adjustment

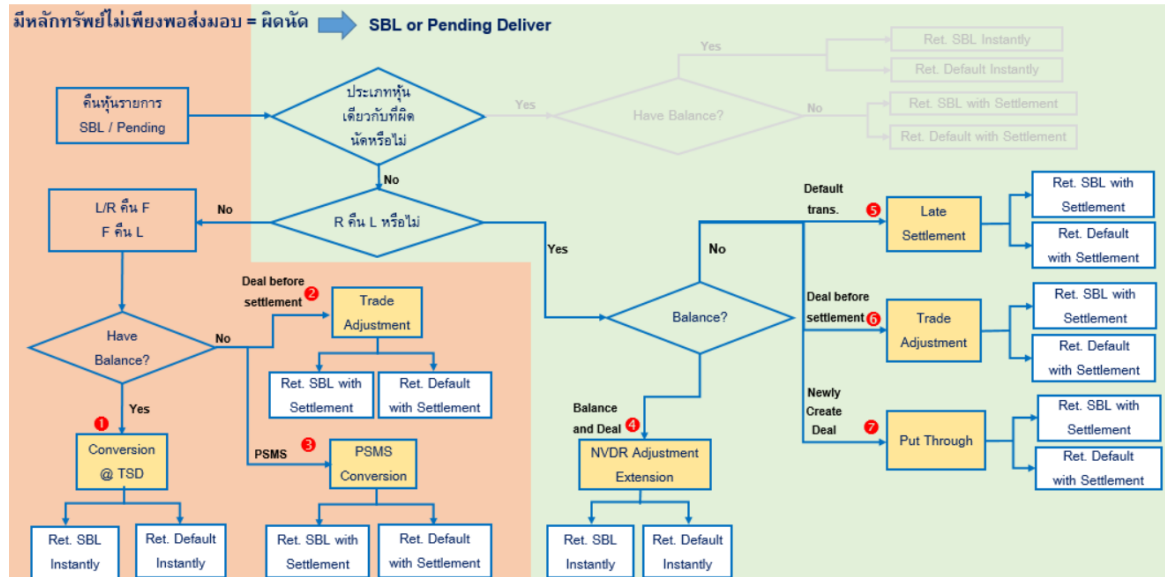
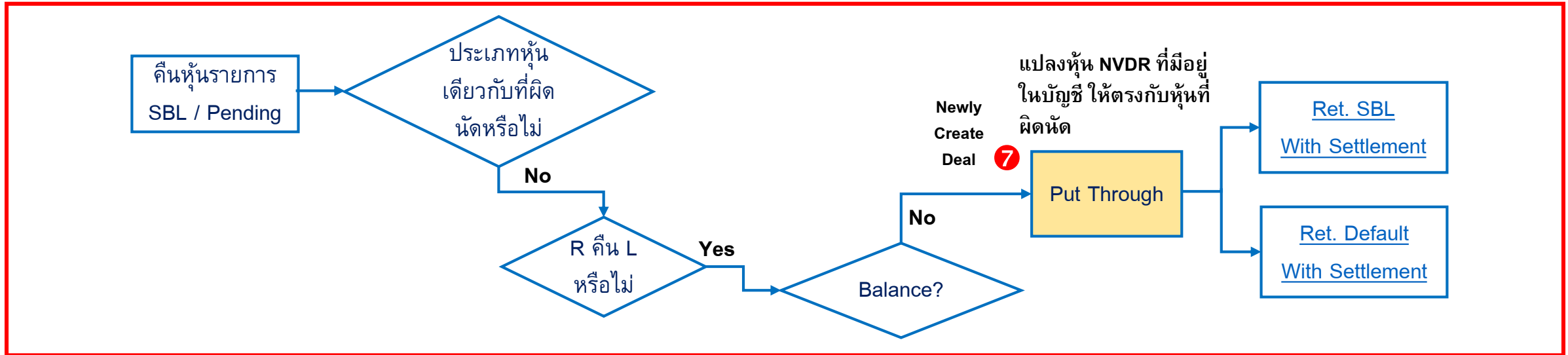
นำ R มาคืนหุ้น L ที่ผิดนัดในบัญชี
Settlement - Proprietary



Trade Adjustment	รายละเอียด
เงื่อนไขการ Validate ของระบบ SET CLEAR	<ul style="list-style-type: none"> อ้างอิง Deal (Buy Side) ที่ยังไม่ได้ Settlement ตรวจสอบว่ามี Room กรณีขอแปลงเป็น F => หากไม่มี Room F แปลงไม่สำเร็จ => คืนไม่สำเร็จ
กำหนดเวลา	ตั้งแต่ Trade จนถึงวัน SD (11.30 น.)
ผลของการแปลง	R -> L

แปลงหุ้นก่อน Return : Trade with Put through

นำ R มาคืนหุ้น L ที่ผิดนัดในบัญชี Settlement - Proprietary



Put Through	รายละเอียด
เงื่อนไข (ไม่มีการ Validate ในระบบงาน หลังการซื้อขาย) ทั้งหมด	<ul style="list-style-type: none"> เป็นการส่งคำสั่งซื้อขายใน SET <ul style="list-style-type: none"> One firm put through ต้องมี Balance ของ NVDR เพื่อส่งมอบ
ผลของการแปลง	R -> L

By Broker

หุ้นที่นำมาระงับเป็น ประเภทเดียวกับ หุ้นที่ผิดนัด

ผู้ยืมแจ้ง
ระงับ
รายการ
SBL

Return SBL	จุดประสงค์	เงื่อนไขทำรายการ	ผลการทำรายการ
Instantly	ระงับการคำนวณ ค่าธรรมเนียมการยืม	- อ้างอิงรายการ SBL - มีหุ้นในบัญชี (Balance)	ระงับได้ตามจำนวนที่ทำรายการและมีผลทันที
With Settlement	ระงับการคำนวณ ค่าธรรมเนียมการยืม	- อ้างอิงรายการ SBL - จะได้หุ้นในรอบ Settlement - ระบบตรวจสอบจำนวนหุ้นที่ระงับรายการจาก Total buy + RVP + RF + Late Settlement (Proprietary) + Pending Receive	- ระงับรายการ SBL ณ เวลา Settlement สำเร็จ ตามจำนวนหุ้นคงเหลือจากการ Settlement ภายหลังจากที่ระบบคำนวณ Pending Receive แล้ว ไม่สำเร็จ หากไม่ได้รับหุ้น ณ เวลา Settlement (Pending Receiver)

By Auto

Auto return (On Due Date ณ Settlement)

- TCH ระงับรายการ SBL อัตโนมัติ โดยหักโอนหุ้นจากยอด Net รับมอบสุทธิของสมาชิก ภายหลังจากที่ระบบคำนวณ Pending Receive แล้ว หรือจาก Settlement Account ของสมาชิก

หุ้นที่นำมาระงับเป็น ประเภทเดียวกับ หุ้นที่ผิดนัด

By Broker

ผู้ผิดนัดแจ้ง
ระงับ
รายการ
Pending
Delivered

Return Default	จุดประสงค์	เงื่อนไขทำรายการ	ผลการทำรายการ
Instantly	Break Buy-in	- อ้างอิงรายการผิดนัด - มีหุ้นในบัญชี (Balance)	- Brake Buy-in และ ระงับรายการผิดนัดตามจำนวนที่ทำรายการทันที
With Settlement	Break Buy-in	- อ้างอิงรายการผิดนัด - จะได้รับหุ้น ณ เวลา Settlement - ระบบตรวจสอบจำนวนหุ้นที่ระงับรายการ จาก Total buy + RVP + RF+ Late Settlement (Proprietary)	- Brake Buy-in ตามจำนวนที่ทำรายการทันที - ระงับรายการผิดนัด ณ เวลา Settlement

By Auto

Auto return (คืนหุ้น ณ Settlement)

- หากไม่ทำรายการ Return อาจได้รับรายการ Buy-in ได้
- TCH ระงับรายการผิดนัดอัตโนมัติ โดยหักโอนหุ้นรายการผิดนัดคงค้าง กับ ภาระรับมอบหุ้นสุทธิของสมาชิกหรือจากหุ้นในบัญชี Settlement ของสมาชิก

Auto re-netting เพื่อให้ผู้รับหุ้นจะขายหุ้นได้ปกติ
➤ เพื่อให้ผู้ผิดนัดรับผิดชอบต่อรายการผิดนัด โดย Pend D จะถูก Re-net กับภาระรับหุ้น

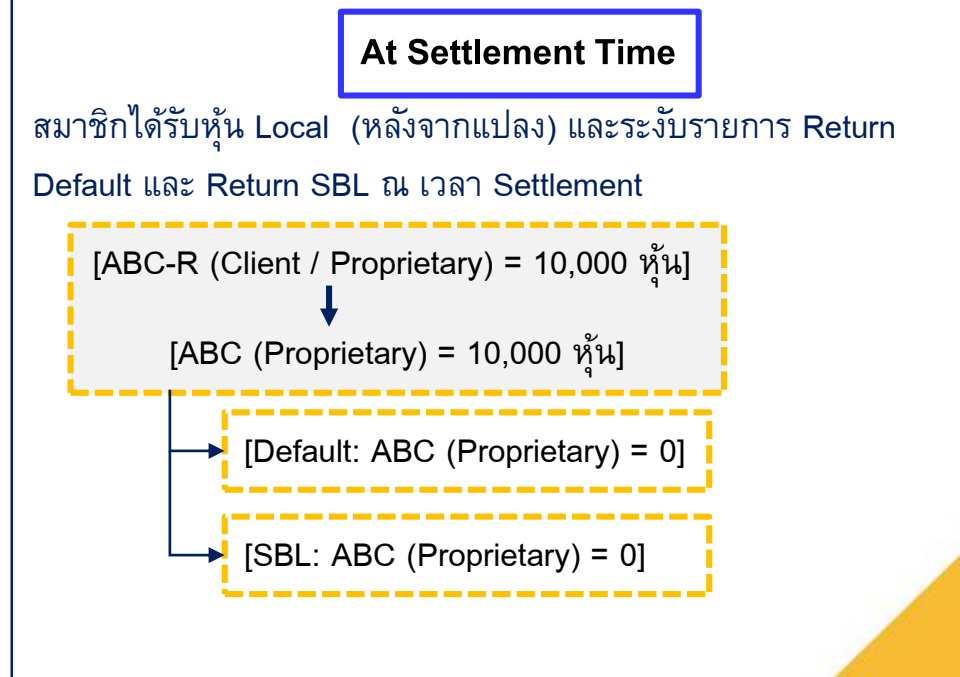
1. กรณีผิดนัดส่งมอบ NVDR

กรณีผิดนัดส่งมอบ NVDR



แนวทางที่ 1 : Late Settlement

จะได้รับมอบ NVDR จาก Custodians หรือจากการซื้อ NVDR



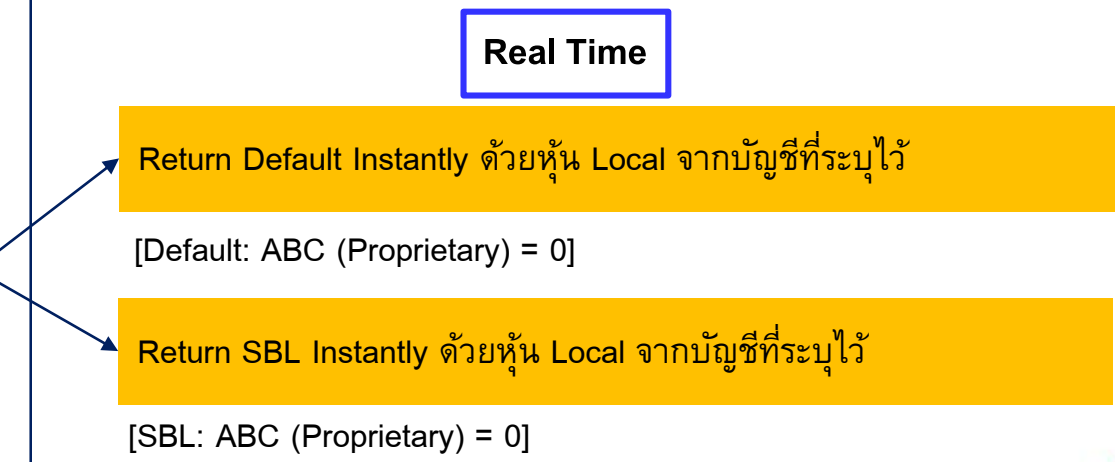
- เงื่อนไข**
- สามารถแปลง NVDR เป็น Local ได้ ภายใน 5 วันทำการนับจาก Failed Settlement Date
 - Return Default มี Priority สูงกว่า Return SBL เนื่องจากอาจมีผลกระทบกับสมาชิกที่เป็นผู้รอรับมอบหุ้นหลายราย
 - Return SBL จะสำเร็จ เมื่อได้รับมอบหุ้น ณ เวลา Settlement และมีหุ้นคงเหลือสำหรับการคืน เนื่องจากต้องนำหุ้นไปส่งมอบต่อให้กับ Lender

กรณีผิดนัดส่งมอบ NVDR



แนวทางที่ 2 : NVDR Adjustment Extension

มี NVDR อยู่ใน Account Balance ของสมาชิก พร้อมสำหรับการแก้ไขรายการซื้อขายที่ผิดพลาด



เงื่อนไข

1. เป็นรายการซื้อขาย NVDR/Local ที่ชำระราคาและส่งมอบแล้ว
2. สามารถแก้ไขรายการซื้อขายผ่านระบบงานของ TCH โดยอ้างอิงรายการซื้อขาย (Deal Number) ย้อนหลังได้ ไม่เกิน 3 เดือน แต่หากมีการปิดสมุดทะเบียนภายใน 3 เดือนที่ผ่านมา จะสามารถทำรายการได้หลังวันปิดสมุดทะเบียนแล้วเท่านั้น
3. ต้องมีหุ้นอยู่ใน Account Balance ของสมาชิก พร้อมสำหรับการแก้ไขรายการซื้อขายที่ผิดพลาด

กรณีผิดนัดส่งมอบ NVDR



สมาชิกมีภาระส่งมอบ NVDR ที่บัญชี Settlement – Client / Proprietary

ไม่มี NVDR ส่งมอบ

ระบบหักโอนหุ้น Local ที่บัญชี Settlement -Proprietary

บัญชี Settlement -Proprietary ไม่มี Local

สมมติให้

- SBL บางส่วน
- Default บางส่วน

เช่น [ABC-R (Client / Proprietary) = 10,000 หุ้น]

[ABC (Proprietary) = 10,000 หุ้น]

[SBL: ABC (Proprietary) = 3,000 หุ้น]
[Pend D: ABC (Proprietary) = 7,000 หุ้น]

แนวทางที่ 3: ทำรายการซื้อขายในตลาด (Trade Report)

T

ส่งคำสั่งซื้อขายประเภท One-firm Trade Report เข้าระบบซื้อขาย เพื่อขาย NVDR ที่บัญชี Client / Proprietary และซื้อหุ้น Local ที่บัญชี Proprietary

T+2

ทำรายการ Return Default with Settlement ด้วยหุ้น Local จากบัญชี Settlement-Proprietary

ทำรายการ Return SBL with Settlement ด้วยหุ้น Local จากบัญชี Settlement-Proprietary

At Settlement Time (T+2)

ของรายการซื้อขายประเภท One-firm Trade Report

สมาชิกได้รับหุ้น Local จากการซื้อ และระงับรายการ Return Default และ Return SBL

[ABC (Proprietary) = 10,000 หุ้น]

[Default: ABC (Proprietary) = 0]

[SBL: ABC (Proprietary) = 0]

เงื่อนไข

1. ต้องมี NVDR พร้อมส่งมอบ เพื่อป้องกันการผิดนัดซ้ำซ้อน
2. ทำรายการ Return ได้ในวัน Settlement Date T+2 ของรายการซื้อขายประเภท One-firm Trade Report
3. Return Default มี Priority สูงกว่า Return SBL เนื่องจากอาจมีผลกระทบกับสมาชิกที่เป็นผู้รองรับมอบหุ้นหลายราย
4. Return SBL จะสำเร็จ เมื่อได้รับมอบหุ้น ณ เวลา Settlement และมีหุ้นคงเหลือสำหรับการคืน เนื่องจากต้องนำหุ้นไปส่งมอบต่อให้กับ Lender

2. กรณีผลิตจัดส่งมอบ Local

กรณีผิดนัดส่งมอบ Local - Client



สมาชิกมีภาระส่งมอบ Local ที่บัญชี
Client / Proprietary

บัญชี Settlement ไม่มี Local
ส่งมอบ

สมมติให้

- SBL บางส่วน
- Default บางส่วน

เช่น [XYZ (Client) = 10,000 หุ้น]

[SBL: XYZ (Client) = 3,000 หุ้น]
[Pend D: XYZ (Client) = 7,000 หุ้น]

แนวทางที่ 1 : NVDR Adjustment Extension

มี NVDR อยู่ใน Account Balance ของสมาชิก พร้อมสำหรับการแก้ไขรายการซื้อขาย
ที่ผิดพลาด

มี NVDR อยู่ใน
บัญชีใดๆ บน
ระบบงาน CSD

ทำรายการ NVDR Adjustment Extension จากรายการซื้อ/ขาย (Deal)

- Deal ชื่อ NVDR หรือ
- Deal ขาย Local

สามารถระบุบัญชีใด ๆ ที่ต้องการรับ Local ได้ ไม่เฉพาะ Settlement Account

[XYZ-R (Client)
= 10,000 หุ้น]

[XYZ-R (Client) = 10,000 หุ้น]

[XYZ(Client) = 10,000 หุ้น]

Real Time

Return Default Instantly ด้วยหุ้น Local จากบัญชีที่ระบุไว้

[Default: XYZ (Client) = 0]

Return SBL Instantly ด้วยหุ้น Local จากบัญชีที่ระบุไว้

[SBL: XYZ (Client) = 0]

เงื่อนไข

1. เป็นรายการซื้อขาย NVDR/Local ที่ชำระราคาและส่งมอบแล้ว
2. สามารถแก้ไขรายการซื้อขายผ่านระบบงานของ TCH โดยอ้างอิงรายการซื้อขาย (Deal Number) ย้อนหลังได้ ไม่เกิน 3 เดือน แต่หากมีการปิดสมุดทะเบียนภายใน 3 เดือนที่ผ่านมา จะสามารถทำรายการได้หลังวันปิดสมุดทะเบียนแล้วเท่านั้น
3. ต้องมีหุ้นอยู่ใน Account Balance ของสมาชิก พร้อมสำหรับการแก้ไขรายการซื้อขายที่ผิดพลาด

กรณีผิดนัดส่งมอบ Local - Client



สมาชิกมีภาระส่งมอบ Local บัญชี
Client / Proprietary

บัญชี Settlement ไม่มี Local
ส่งมอบ

สมมติให้

- SBL บางส่วน
- Default บางส่วน

เช่น [XYZ (Client) = 10,000 หุ้น]

[SBL: XYZ (Client) = 3,000 หุ้น]

[Pend D : XYZ (Client) = 7,000 หุ้น]

แนวทางที่ 2: ทำรายการซื้อขายในตลาด (Trade Report)

T

ส่งคำสั่งซื้อขายประเภท
One-firm Trade Report
ที่ระบบงานซื้อขาย เพื่อ
ขาย NVDR ที่บัญชี
Client / Proprietary
และซื้อ Local ที่บัญชี
Client

T+2

ทำรายการ Return Default with
Settlement ด้วยหุ้น Local จากบัญชี
Settlement-Client

ทำรายการ Return SBL with
Settlement ด้วยหุ้น Local จากบัญชี
Settlement-Client

At Settlement Time (T+2)

ของรายการซื้อขายประเภท One-firm Trade Report

สมาชิกได้รับหุ้น Local จากการซื้อ และระงับรายการ Return Default และ Return SBL

[XYZ (Client) = 10,000 หุ้น]

[Default: XYZ (Client) = 0]

[SBL: XYZ (Client) = 0]

เงื่อนไข

1. ต้องมีหุ้น NVDR พร้อมส่งมอบ เพื่อป้องกันการผิดนัดซ้ำซ้อน
2. ทำรายการ Return ได้ในวัน Settlement Date T+2 ของรายการซื้อขายประเภท One-firm Trade Report
3. Return Default มี Priority สูงกว่า Return SBL เนื่องจากอาจมีผลกระทบกับสมาชิกที่เป็นผู้รับมอบหุ้นหลายราย
4. Return SBL จะสำเร็จ เมื่อได้รับมอบหุ้น ณ เวลา Settlement และมีหุ้นคงเหลือสำหรับการคืน เนื่องจากต้องนำหุ้นไปส่งมอบต่อให้กับ Lender



www.set.or.th/tch