

ที่ สช.(ว) 0011/ 2562

วันที่ 15 ตุลาคม 2562

เรื่อง ขอยกเลิกหนังสือ สช.(ว) 0003/2561 เรื่องแนวทางดำเนินการกรณีมี Cash Settlement ในช่วงที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศขึ้นเครื่องหมายเพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์นั้นเป็นราคาที่ไม่รวมถึงสิทธิประโยชน์

เรียน กรรมการผู้จัดการ
สมาชิกสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์
บุคคลที่สำนักหักบัญชีอนุญาตให้ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิก ("Settlement Agent")

อ้างถึง หนังสือเลขที่ สช.(ว) 0003/2561 เรื่อง แนวทางดำเนินการกรณีมี Cash Settlement ในช่วงที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศขึ้นเครื่องหมายเพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์นั้นเป็นราคาที่ไม่รวมถึงสิทธิประโยชน์ ลงวันที่ 15 มีนาคม 2561

ตามที่สำนักหักบัญชีได้มีหนังสือแจ้งเวียนสมาชิกเลขที่ สช.(ว) 0003/2561 ลงวันที่ 15 มีนาคม 2561 เรื่อง แนวทางดำเนินการกรณีมี Cash Settlement ในช่วงที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศขึ้นเครื่องหมายเพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์นั้นเป็นราคาที่ไม่รวมถึงสิทธิประโยชน์ เพื่อนำมาใช้ระหว่างที่สำนักหักบัญชีพัฒนาระบบงานรองรับการคำนวณค่าปรับจากผู้ผลิตส่งมอบหลักทรัพย์ด้วยเงื่อนไขดังกล่าว (รายละเอียดตามอ้างถึง) นั้น

บัดนี้ ระบบงานของสำนักหักบัญชีสามารถคำนวณค่าปรับด้วยเงื่อนไขข้างต้น และได้เพิ่มเติมเงื่อนไขการใช้ราคาสูงที่สุดนับตั้งแต่วันที่ซื้อขายหลักทรัพย์เพื่อคำนวณราคาสูงสุดจากราคาใดราคาหนึ่งดังต่อไปนี้ เรียบร้อยแล้ว

- (1) ราคา Buy – in ของวันทำการที่เกิด Cash Settlement
- (2) ร้อยละ 130 ของราคาที่ใช้คำนวณมูลค่าหลักประกันอันเนื่องมาจากการผิดนัดของวันทำการก่อนหน้าวันทำการที่เกิด Cash Settlement
- (3) ร้อยละ 130 ของราคาที่ใช้คำนวณมูลค่าหลักประกันอันเนื่องมาจากการผิดนัด ของวันทำการก่อนหน้าวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศขึ้นเครื่องหมายเพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์นั้นเป็นราคาที่ไม่รวมถึงสิทธิประโยชน์ที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์จะให้หรือให้แก่ผู้ถือหลักทรัพย์ ในกรณีที่วันทำการที่เกิด Cash Settlement ตรงกับวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศขึ้นเครื่องหมายดังกล่าว
- (4) ราคาที่คำนวณได้จากอัตราร้อยละ 130 ของราคาซื้อขายสูงสุดของหลักทรัพย์นับตั้งแต่วันที่ซื้อขายหลักทรัพย์ที่ผิดนัดจนถึงวันทำการก่อนหน้าวันทำการที่สำนักหักบัญชีเรียกเก็บค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด

สำนักหักบัญชีจึงขอยกเลิกแนวทางการดำเนินการตามหนังสือที่อ้างถึง และใช้การคำนวณจากระบบงานของสำนักหักบัญชีด้วยเงื่อนไขตามประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด เรื่อง อัตราค่าปรับเพื่อชดเชยความเสียหายแทนการส่งมอบหลักทรัพย์

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ

ประภาพรพรรณ ธาราภิวัฒนานนท์

(นางสาวประภาพรพรรณ ธาราภิวัฒนานนท์)

ผู้อำนวยการฝ่ายชำระราคาหลักทรัพย์

กลุ่มตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ฝ่ายชำระราคาหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 02-0099549 ถึง 9553