

ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

เรื่อง การบันทึกรายการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย ในตลาดหลักทรัพย์ (Pre-Settlement Matching)

ตามที่ข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 504.01(1) กำหนดให้สมาชิกหรือบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกต้องบันทึกรายการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และภายในวันและระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนดนั้น

สำนักหักบัญชีขอกำหนดหลักเกณฑ์ และเงื่อนไข การบันทึกรายการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ดังนี้

1. ประเภทของรายการ

- 1) รายการโอน/รับโอนหลักทรัพย์พร้อมชำระราคา (Delivery Versus Payment/Receive Versus Payment; DVP/RVP)
- 2) รายการโอน/รับโอนหลักทรัพย์ที่ไม่มีการชำระราคา (Delivery Free of Payment/Receive Free of Payment; DF/RF)

2. ข้อมูลที่ต้องบันทึกในระบบและข้อมูลที่ใช้ในการจับคู่รายการ

สมาชิกหรือบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกต้องบันทึกรายการผ่านระบบงานเชื่อมโยงกับสำนักหักบัญชี โดยระบบจะใช้วิธีการจับคู่รายการเมื่อมีข้อมูลที่ใช้ในการจับคู่รายการ (Matching Fields) ตรงกัน

สำหรับรายการ DVP/RVP ที่ต้องมีการระบุมูลค่าการชำระราคา สำนักหักบัญชีกำหนดให้มีส่วนต่างของมูลค่าการชำระราคาไม่เกิน 50 บาท (\pm 50 บาท) โดยสำนักหักบัญชีจะใช้มูลค่าของรายการรับเงิน (DVP) เป็นมูลค่าชำระราคา

ข้อมูลที่ต้องบันทึกในระบบ	ข้อมูลที่ใช้ในการจับคู่รายการ	
	DVP/RVP	DF/RF
1. เลขที่อ้างอิงของรายการ (Sender's Reference)	-	-
2. วันที่ซื้อขาย (Trade Date)	-	-
3. วันที่ชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (Settlement Date)	✓	✓
4. รหัสหลักทรัพย์สากล (ISIN Code)	✓	✓

ข้อมูลที่ต้องบันทึกในระบบ	ข้อมูลที่ใช้ในการจับคู่รายการ	
	DVP/RVP	DF/RF
5. จำนวนหลักทรัพย์	✓	✓
6. เลขที่บัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบและรับมอบหลักทรัพย์ (Settlement Account) ของผู้ส่งคำสั่ง	✓	✓
7. เลขที่บัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบและรับมอบหลักทรัพย์ (Settlement Account) ของคู่กรณี	✓	✓
8. มูลค่าการชำระราคา	✓	-
9. เลขที่บัญชีในระบบงานศูนย์รับฝาก 9.1 สำหรับสมาชิกทั่วไป : ระบุเลขที่บัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (Trading Account Number) 9.2 สำหรับบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิก : ระบุเลขที่บัญชีฝากหลักทรัพย์ (Depository Account Number)	-	-
10. ประเภทการแปลงหลักทรัพย์ (Conversion Type)	-	-
11. เลขที่คู่กรณี	-	-
12. BIC Code ของการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (Place of Settlement)	-	-

3 การระบุในรายการเพื่อเปลี่ยนแปลงประเภทหลักทรัพย์

3.1 สมาชิกหรือบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกอาจทำการเปลี่ยนแปลงประเภทของหลักทรัพย์ได้เฉพาะรายการดังต่อไปนี้

3.1.1 รายการระหว่างสมาชิกกับบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิก

3.1.2 รายการระหว่างบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกกับบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิก

3.2 รายการเพื่อการเปลี่ยนแปลงประเภทของหลักทรัพย์

3.2.1 รายการ DVP/DF สามารถเลือกการเปลี่ยนแปลงประเภทของหลักทรัพย์ได้เฉพาะจาก Local/NVDR เป็น Foreign

3.2.2 รายการ RVP/RF สามารถเลือกการเปลี่ยนแปลงประเภทของหลักทรัพย์ได้เฉพาะจาก Foreign เป็น Local

4 การระบุวัตถุประสงค์ของการทำรายการ

4.1 รายการเพื่อการส่งมอบและรับมอบหลักทรัพย์ของสมาชิกหรือของบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกที่เกิดจากการซื้อขายหลักทรัพย์ของสมาชิก ไม่ต้องระบุวัตถุประสงค์ (No)

4.2 รายการที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย : ต้องระบุวัตถุประสงค์ใดวัตถุประสงค์หนึ่ง ดังนี้ Loan, Loan Return, Collateral และ Release Collateral

5 การปรับปรุงรายการเพื่อการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

รายการ	วัตถุประสงค์	เงื่อนไข
1) การรวมรายการ (Merge)	<ul style="list-style-type: none"> - เพื่อรวมจำนวนหลักทรัพย์และรวมมูลค่าชำระราคาให้มีข้อมูลที่ใช้ในการจับคู่รายการตรงกันกับข้อมูลของคู่กรณี - เพื่อแก้ไขการรวมรายการ (Edit Merge) - เพื่อยกเลิกการรวมรายการ (Cancel Merge) 	<ul style="list-style-type: none"> - ดำเนินการได้ทั้งสมาชิกหรือบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิก
2) การยกเลิกการจับคู่รายการ (De-match)	<p>เพื่อย้อนสถานะของรายการให้สามารถแก้ไขข้อมูลของรายการที่จับคู่ได้แล้ว</p>	<ul style="list-style-type: none"> - ดำเนินการได้ทั้งสมาชิกหรือบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิก - ต้องได้รับความยินยอมจากคู่กรณี ทั้งนี้หากคู่กรณีไม่ยืนยันการยกเลิกการจับคู่รายการ (De-match) ภายในเวลาที่กำหนดจะถือว่าการยกเลิกการจับคู่รายการนั้นไม่สมบูรณ์ ระบบจะนำรายการนั้นไปประมวลผลต่อไป - รายการที่ยกเลิกการจับคู่แล้วสามารถจับคู่ได้อีก
3) การแก้ไขรายการที่จับคู่แล้วและยังไม่ได้รับการจับคู่ (Edit)	<ul style="list-style-type: none"> - เพื่อแก้ไขข้อมูลรายการที่ยังไม่ได้รับการจับคู่ - เพื่อแก้ไขข้อมูลรายการที่จับคู่แล้ว 	<ul style="list-style-type: none"> - สามารถแก้ไขข้อมูลได้ทุกประเภทข้อมูล (Field) ยกเว้น Message type และ sender's reference - สามารถแก้ไขข้อมูลได้ทุกประเภทข้อมูล (Field) ยกเว้น Message type sender's reference และ Matching field - ต้องได้รับความยินยอมจากคู่กรณี
4) การยกเลิกรายการ (Cancel)	<ul style="list-style-type: none"> - เพื่อยกเลิกรายการที่ยังไม่ได้รับการจับคู่ - เพื่อยกเลิกรายการที่จับคู่แล้ว 	<ul style="list-style-type: none"> - ไม่ต้องได้รับความยินยอมจากคู่กรณี - ต้องได้รับความยินยอมจากคู่กรณี <ul style="list-style-type: none"> ● หากคู่กรณียืนยันการยกเลิกรายการภายในเวลาที่กำหนดจะถือว่ารายการที่ยกเลิกนั้นสมบูรณ์และไม่สามารถจับคู่รายการได้อีก

รายการ	วัตถุประสงค์	เงื่อนไข
		<ul style="list-style-type: none"> ● หากคู่กรณีไม่ยืนยันการยกเลิกรายการภายในเวลาที่กำหนดจะถือว่ารายการที่ยกเลิกนั้นไม่สมบูรณ์ และระบบจะนำรายการนั้นไปประมวลผลต่อไป

ทั้งนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 24 สิงหาคม 2558 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 29 พฤษภาคม 2558

(ลงนาม) อุดมวรา เศษสังจรัส

(นางอุดมวรา เศษสังจรัส)

ผู้รับมอบอำนาจ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด