

ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด
เรื่อง การระงับการโอนและหักโอนหลักทรัพย์เพื่อการยึดหลักประกัน

ตามที่ข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนของหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 603.01 (1) และ 603.02 (2) กำหนดให้สำนักหักบัญชีอาจระงับการ โอนและหักโอนหลักทรัพย์ในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์เพื่อสมาชิกหรือลูกค้าของสมาชิกผู้ผิดนัดที่มีสิทธิรับมอบในวันแรกถือว่าผิดนัดชำระราคาและในวันถัดไปตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนดนั้น

สำนักหักบัญชีขอกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่เกี่ยวข้องกับการระงับการ โอนและหักโอนหลักทรัพย์เพื่อการยึดและการคืนหลักประกันดังนี้

1. การยึดหลักประกัน

1.1 สำนักหักบัญชีจะยึดหลักประกันจากสมาชิกผู้ผิดนัด 2 กรณี คือ

1.1.1 สมาชิกผิดนัดการชำระเงินค่าซื้อขายหลักทรัพย์หรือราคาที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายหลักทรัพย์

1.1.2 สมาชิกผิดนัดชำระเงินหลักประกันจากการผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์หรือจากการยึดหลักทรัพย์

1.2 สำนักหักบัญชีจะยึดหลักประกันจากสมาชิกผู้ผิดนัดตามลำดับบัญชี ดังนี้

บัญชีที่ผิดนัด	ลำดับบัญชีการยึดหลักทรัพย์
1. บัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของสมาชิก	1) หลักทรัพย์ที่จะได้รับในวันนั้นของบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของสมาชิก 2) หลักทรัพย์ที่ค้างค้างในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของสมาชิก
2. บัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของลูกค้าของสมาชิก	1) หลักทรัพย์ที่จะได้รับในวันนั้นของบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของลูกค้าของสมาชิก 2) หลักทรัพย์ที่จะได้รับในวันนั้นของบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของสมาชิก 3) หลักทรัพย์ที่ค้างค้างในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของสมาชิก

บัญชีที่ผิคนัด	ลำดับบัญชีการยึดหลักทรัพย์
3. บัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของลูกค้าของสมาชิก และบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของสมาชิก	1) หลักทรัพย์ที่จะได้รับในวันนั้นของบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของลูกค้าของสมาชิก 2) หลักทรัพย์ที่จะได้รับในวันนั้นของบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของสมาชิก 3) หลักทรัพย์ที่คงค้างในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของสมาชิก

1.3 ลำดับหลักทรัพย์ที่จะยึดในแต่ละบัญชีเป็นดังนี้

กลุ่มหลักทรัพย์	ลำดับการยึด
1. หลักทรัพย์ในกลุ่ม SET50	1) Turnover Value ของหลักทรัพย์ทุกประเภท เรียงลำดับจากค่ามากไปน้อย 2) Native : Foreign (F), Local (L) 3) Unit flag : NVDR (R), Thai Trust Fund (U) 4) Market Capitalization ของหลักทรัพย์ เรียงลำดับจากค่ามากไปน้อย 5) ชื่อย่อหลักทรัพย์ เรียงจาก A ไป Z
2. ตราสารหนี้ภาครัฐ	1) อายุคงเหลือ (Time to Maturity) จากน้อยไปมาก 2) ชื่อย่อตราสารหนี้ เรียงจาก A ไป Z
3. หลักทรัพย์นอกกลุ่ม SET50	1) Turnover Value ของหลักทรัพย์ทุกประเภท เรียงลำดับจากค่ามากไปน้อย 2) Native : Foreign (F), Local (L) 3) Unit flag : NVDR (R), Thai Trust Fund (U) 4) Market Capitalization ของหลักทรัพย์ เรียงลำดับจากค่ามากไปน้อย 5) ชื่อย่อหลักทรัพย์ เรียงจาก A ไป Z 6) Market เรียงจาก : SET, BEX, mai

2. การคืนหลักประกัน

2.1 สำนักหักบัญชีจะคืนหลักประกันให้กับสมาชิกผู้ผิคนัด 2 กรณี คือ

2.1.1 กรณีที่สมาชิกรนำเงินสดมาชำระ หรือมูลค่าของหลักประกันทั้งหมดที่ประเมิน ณ เวลานั้นมากกว่ามูลค่าที่ผิคนัด สำนักหักบัญชีจะทำการคืนหลักทรัพย์มูลค่าไม่เกินเงินสดที่ชำระ หรือมูลค่าหลักประกันที่เกินมา ณ เวลานั้น

2.1.2 กรณีที่หลักประกันประเภทหลักทรัพย์ที่ยึดมานั้นมีมูลค่าเท่ากับศูนย์ ณ เวลาที่ทำการประเมินมูลค่าหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีจะทำการคืนหลักทรัพย์ที่ยึดมานี้ทั้งหมด ก็ต่อเมื่อสมาชิกดำเนินการขอคืนหลักประกันดังกล่าวผ่านระบบงานเชื่อมโยงกับสำนักหักบัญชี

2.2 การคืนหลักประกัน จะเรียงลำดับหลักทรัพย์ที่ถูกยึดเป็นหลักประกันทั้งหมดตามเงื่อนไข โดยไม่คำนึงถึงบัญชีที่ยึดหลักทรัพย์นั้นมา แต่ถ้าหลักทรัพย์ 1 หลักทรัพย์ที่จะคืนมาจากบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์มากกว่า 1 บัญชี สำนักหักบัญชีจะคืนหลักทรัพย์ให้กับบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของลูกค้าของสมาชิกก่อนและจะคืนให้กับบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ของสมาชิกในลำดับถัดไป

2.3 ลำดับหลักทรัพย์ที่จะคืนเป็นดังนี้

กลุ่มหลักทรัพย์	ลำดับการคืน
1. หลักทรัพย์นอกกลุ่ม SET50	1) ชื่อหลักทรัพย์ เรียงจาก Z ไป A 2) Market Capitalization ของหลักทรัพย์ เรียงลำดับจากค่าน้อยไปมาก 3) Unit flag : Thai Trust Fund (U), NVDR (R) 4) Native : Local (L), Foreign (F) 5) Turnover Value ของหลักทรัพย์ทุกประเภท เรียงลำดับจากค่าน้อยไปมาก
2. ตราสารหนี้ภาครัฐ	1) ชื่อตราสารหนี้ เรียงจาก Z ไป A 2) อายุคงเหลือ (Time to Maturity) จากมากไปน้อย
3. หลักทรัพย์ในกลุ่ม SET50	1) Market เรียงจาก: mai, BEX, SET 2) ชื่อหลักทรัพย์ เรียงจาก Z ไป A 3) Market Capitalization ของหลักทรัพย์ เรียงลำดับจากค่าน้อยไปมาก 4) Unit flag : Thai Trust Fund (U), NVDR (R) 5) Native : Local (L), Foreign (F) 6) Turnover Value ของหลักทรัพย์ทุกประเภท เรียงลำดับจากค่าน้อยไปมาก

ความหมายของคำศัพท์

1) Turnover Value หมายถึง มูลค่าการซื้อขายของหลักทรัพย์ในทุกกระดานซื้อขาย ได้แก่ กระดาน Big-lot, Odd-lot และ Main board

2) Turnover Value ของหลักทรัพย์ประเภท NVDR (R) และ Thai Trust Fund (U) มีค่าเท่ากับหลักทรัพย์ Native-Local

3) Market Capitalization ของหลักทรัพย์ทุกประเภท (NVDR, Thai Trust Fund, Local, Foreign) มีค่าเท่ากัน เช่น BBL, BBL-F, BBL-R, BBL-U มีค่า Market Capitalization เท่ากัน เป็นต้น

ทั้งนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 24 สิงหาคม 2558 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 29 พฤษภาคม 2558

(ลงนาม) อุดมวรา เศษสังวรวิธ

(นางอุดมวรา เศษสังวรวิธ)

ผู้รับมอบอำนาจ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด