

ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

เรื่อง แนวทางการลงโทษสมาชิกกรณีไม่ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ของสำนักหักบัญชี

ตามที่ข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนของเกี่ยวกับหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 308 กำหนดให้สำนักหักบัญชีอาจพิจารณาลงโทษสมาชิก หากสมาชิกฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหน้าที่ตามข้อกำหนด หนังสือเวียนหรือคำสั่งของสำนักหักบัญชี และสำนักหักบัญชีได้ออกประกาศเรื่อง แนวทางการลงโทษสมาชิกกรณีไม่ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ของสำนักหักบัญชี ลงวันที่ 19 กันยายน 2556 นั้น

สำนักหักบัญชีขอยกเลิกประกาศฉบับดังกล่าว และพิจารณากำหนดบทลงโทษตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้แทน

ข้อ 1 สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกที่ไม่ดำเนินการเพื่อบริหารความเสี่ยงในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ดังต่อไปนี้

(1) กรณีที่สมาชิกไม่จัดส่งรายงานเกี่ยวกับฐานะทางการเงินตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือจัดส่งรายงานเกี่ยวกับฐานะทางการเงินที่มีข้อมูลไม่ครบถ้วนหรือไม่ถูกต้อง สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกครั้งละ 5,000 บาทต่อวันโดยคำนวณตามระยะเวลาที่ไม่จัดส่งหรือจัดส่งโดยมีข้อมูลไม่ครบถ้วน

(2) กรณีที่สมาชิกจัดส่งรายงานเกี่ยวกับฐานะทางการเงินตามที่สำนักหักบัญชีกำหนดโดยมีข้อมูลไม่ครบถ้วนหรือไม่ถูกต้อง และทำให้สมาชิกวางหลักประกันน้อยกว่าจำนวนที่สมาชิกต้องวางไว้กับสำนักหักบัญชี สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกร้อยละ 0.50 ของมูลค่าหลักประกันที่สมาชิกต้องวางเพิ่ม

(3) กรณีที่สมาชิกไม่วางหลักประกันหรือวางหลักประกันไม่ถูกต้องครบถ้วนตามหมวด 400 สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกตามระยะเวลาที่วางหลักประกันไม่ถูกต้องครบถ้วนดังต่อไปนี้

(ก) ไม่เกิน 1 วันทำการ ให้ปรับสมาชิกร้อยละ 0.50 ของมูลค่าหลักประกันที่วางไม่ถูกต้องครบถ้วน

(ข) เกินกว่า 1 วันทำการ แต่ไม่เกิน 2 วันทำการ ให้ปรับสมาชิกร้อยละ 0.75 ของมูลค่าหลักประกันที่วางไม่ถูกต้องครบถ้วน

ข้อ 2 สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกผู้ผิดนัดชำระราคาหลักทรัพย์ตามข้อมูลการชำระราคา และส่งมอบหลักทรัพย์ดังต่อไปนี้

(1) กรณีที่สมาชิกผิดนัดชำระราคาหลักทรัพย์อันเนื่องมาจากความผิดพลาดในการปฏิบัติงานของสมาชิก (Human Error) และไม่ก่อให้เกิดความเสียหายต่อระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกดังต่อไปนี้

(ก) การผิดนัดในกรณีดังกล่าวเกิดขึ้นเป็นครั้งแรกในรอบปีปฏิทิน สำนักหักบัญชีอาจพิจารณาปรับสมาชิก ครั้งละ 5,000 บาท

(ข) การผิดนัดในกรณีดังกล่าวเกิดขึ้นเป็นครั้งที่สองในรอบปีปฏิทินเดียวกัน สำนักหักบัญชีอาจพิจารณาปรับสมาชิก ครั้งละ 10,000 บาท

(ค) การผิดนัดในกรณีดังกล่าวเกิดขึ้นตั้งแต่ครั้งที่สามขึ้นไปในรอบปีปฏิทินเดียวกัน สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิก ครั้งละ 50,000 บาท

(2) กรณีที่สมาชิกผิดนัดชำระราคาหลักทรัพย์อันเนื่องมาจากเหตุอื่นนอกจาก (1) สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกอย่างสูงครั้งละไม่เกิน 2 เท่าของจำนวนเงินที่ผิดนัด

ข้อ 3 สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกผู้ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามข้อมูลการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ดังต่อไปนี้

(1) กรณีที่สมาชิกผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์อันเนื่องมาจากความผิดพลาดในการปฏิบัติงานของสมาชิก (Human Error) และสมาชิกผู้ผิดนัดสามารถแสดงได้ว่ามีหลักทรัพย์เพียงพอในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่มีการผิดนัดภายในเวลาที่เหมาะสมและสำนักหักบัญชีเห็นสมควร รวมทั้งไม่ก่อให้เกิดความเสียหายต่อระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกดังต่อไปนี้

(ก) การผิดนัดในกรณีดังกล่าวเกิดขึ้นเป็นครั้งที่สองในรอบปีปฏิทินเดียวกัน สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิก รายหลักทรัพย์ละ 2,000 บาท

(ข) การผิดนัดในกรณีดังกล่าวเกิดขึ้นตั้งแต่ครั้งที่สามขึ้นไปในรอบปีปฏิทินเดียวกัน สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิก รายหลักทรัพย์ละ 5,000 บาท

(2) กรณีที่สมาชิกผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์อันเนื่องมาจากเหตุอื่นนอกจาก (1) สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกตามระยะเวลาที่ผิดนัดดังต่อไปนี้

(ก) ผิดนัดไม่เกิน 1 วันทำการ ให้ปรับสมาชิกร้อยละ 0.50 ของมูลค่าที่เกิดจากจำนวนหลักทรัพย์ที่ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์คูณกับราคาซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์ในวันที่ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว*

(ข) คิดนับเกินกว่า 1 วันทำการแต่ไม่เกิน 2 วันทำการ ให้ปรับสมาชิกร้อยละ 0.75 ของมูลค่าที่เกิดจากจำนวนหลักทรัพย์ที่คิดนับส่งมอบหลักทรัพย์คู่กับราคาซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์ ในวันที่ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

(ค) คิดนับเกินกว่า 2 วันทำการแต่ไม่เกิน 3 วันทำการ ให้ปรับสมาชิกร้อยละ 1.00 ของมูลค่าที่เกิดจากจำนวนหลักทรัพย์ที่คิดนับส่งมอบหลักทรัพย์คู่กับราคาซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์ ในวันที่ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

(ง) คิดนับเกินกว่า 3 วันทำการแต่ไม่เกิน 5 วันทำการ ให้ปรับสมาชิกร้อยละ 1.75 ของมูลค่าที่เกิดจากจำนวนหลักทรัพย์ที่คิดนับส่งมอบหลักทรัพย์คู่กับราคาซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์ ในวันที่ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

(จ) คิดนับเกินกว่า 5 วันทำการแต่ไม่เกิน 7 วันทำการ ให้ปรับสมาชิกร้อยละ 2.50 ของมูลค่าที่เกิดจากจำนวนหลักทรัพย์ที่คิดนับส่งมอบหลักทรัพย์คู่กับราคาซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์ ในวันที่ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

(ฉ) คิดนับเกินกว่า 7 วันทำการแต่ไม่เกิน 14 วันทำการ ให้ปรับสมาชิกร้อยละ 3.75 ของมูลค่าที่เกิดจากจำนวนหลักทรัพย์ที่คิดนับส่งมอบหลักทรัพย์คู่กับราคาซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์ ในวันที่ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

ทั้งนี้ค่าปรับดังกล่าวจะต้องไม่น้อยกว่าครั้งละ 300 บาทต่อรายหลักทรัพย์

กรณีสมาชิกคิดนับส่งมอบหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าว สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกในอัตราร้อยละ 1 ของมูลค่าหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าว

ข้อ 4 ในกรณีที่สมาชิกผิดนัดชำระราคาหรือผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามรายงานใดของสำนักหักบัญชี สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกผู้ผิดนัดตามรายงานดังกล่าวไม่ว่าสมาชิกนั้นมีหน้าที่ชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ตามรายงานที่มีการแก้ไขหรือรายงานที่จัดทำขึ้นใหม่แทนรายงานนั้นก็ตาม

ข้อ 5 สำนักหักบัญชีอาจยกเว้นค่าปรับแก่สมาชิกผู้ผิดนัดชำระราคาหรือผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามข้อมูลการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ในกรณีใดๆอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้

(1) การผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์นั้นเกิดขึ้นเนื่องจากความผิดพลาดในการปฏิบัติงานของสมาชิก (Human Error) เป็นครั้งแรกในรอบปีปฏิทิน และสมาชิกผู้ผิดนัดสามารถแสดงได้ว่ามีหลักทรัพย์เพียงพอในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่มีการผิดนัดภายในเวลาที่เหมาะสม และสำนักหักบัญชีเห็นสมควร รวมทั้งไม่ก่อให้เกิดความเสียหายต่อระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

(2) การผิคนัดชำระราคาหลักทรัพย์หรือผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์นั้นเกิดขึ้นจากเหตุสุดวิสัยและสำนักหักบัญชีเห็นสมควร

ทั้งนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 24 สิงหาคม 2558 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 21 สิงหาคม 2558

(ลงนาม) อุดมวรา เศษส่งจรัส

(นางอุดมวรา เศษส่งจรัส)

ผู้รับมอบอำนาจ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

* ราคาคือขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์ในวันที่ทำการซื้อขาย มีหลักเกณฑ์ดังนี้

1. กรณีมีราคาซื้อขายเฉลี่ยจากการซื้อขายแบบจับคู่คำสั่งอัตโนมัติ (AOM) ให้ใช้ราคาเฉลี่ยจากการซื้อขายนั้น
2. กรณีไม่มีราคาตามข้อ 1 ให้ใช้ราคาจากการซื้อขายที่ผู้ซื้อและผู้ขายได้ตกลงซื้อขายกัน (Trade Report) โดยไม่พิจารณาประเภทบัญชี (P/C), แยกประเภทหุ้น Local (Local/NVDR/TTF) และ Foreign ตามลำดับ ดังนี้
 - 2.1. ใช้ราคาของ Trade report ที่ทำให้เกิดการผิคนัด โดยตรวจสอบจาก เลขที่/ชื่อสมาชิก ชื่อหุ้น และจำนวนหุ้น ที่เป็นรายการด้านขายที่ทำให้เกิดการผิคนัด
 - 2.2. หากเมื่อตรวจสอบแล้วพบว่ามีการด้านขายที่เข้าเงื่อนไขตามข้อ 2.1 มากกว่า 1 รายการ ให้นำราคาของรายการด้านขายเหล่านั้นมาหาค่าเฉลี่ย
 - 2.3. หากไม่มีรายการซื้อขายตามเงื่อนไข 2.1 และ 2.2 ให้ใช้ราคาของรายการด้านขายของสมาชิกที่ผิคนัด, หุ้นที่ผิคนัด และให้นำราคาของรายการด้านขายเหล่านั้นมาหาค่าเฉลี่ย
3. กรณีไม่มีราคาเฉลี่ยตามข้อ 1 และข้อ 2 ให้ใช้ราคาจากรายการ PSMS โดยไม่พิจารณาประเภทของบัญชี (P/C), แยกประเภทหุ้น Local (Local/NVDR/TTF) และ Foreign ตามลำดับ ดังนี้
 - 3.1. ใช้ราคาจากรายการ PSMS โดยตรวจสอบรายการที่มีเลขที่/ชื่อสมาชิก, ชื่อหุ้น และจำนวนหุ้น ที่เป็นเฉพาะด้านส่งมอบหุ้นที่ทำให้เกิดการผิคนัด (คำนวณราคาหุ้นจากมูลค่า PSMS หารจำนวนหุ้นทั้งหมด)
 - 3.2. หากตรวจสอบแล้วพบว่ามีการ PSMS ที่เข้าเงื่อนไขตามข้อ 3.1 มากกว่า 1 รายการ ให้นำราคาหุ้นของรายการเหล่านั้นมาหาค่าเฉลี่ย และใช้เป็นราคาสำหรับคำนวณมูลค่าผิคนัด/unwind
 - 3.3. หากไม่มีรายการ PSMS ที่มีจำนวนหุ้นเท่ากับจำนวนที่ผิคนัด ให้นำราคาของรายการที่มีเลขที่/ชื่อสมาชิก ชื่อหุ้น ที่เป็นเฉพาะด้านส่งมอบหุ้นที่ทำให้เกิดการผิคนัด
4. หากไม่มีราคาตามข้อ 1 ถึง 3 จะพิจารณาใช้ราคาตามที่สำนักหักบัญชีเห็นสมควร