

## ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด เรื่อง อัตราค่าปรับเพื่อชดเชยความเสียหายแทนการส่งมอบหลักทรัพย์

ตามที่ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนของที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 511.03 (2) หลักเกณฑ์ 604.01 หลักเกณฑ์ 604.02 หลักเกณฑ์ 904.02 และหลักเกณฑ์ 908.02 (1)-1 กำหนดให้สำนักหักบัญชีอาจเรียกค่าปรับจากสมาชิกผู้ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์เพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์ในกรณีที่มีการจ่ายสิทธิประโยชน์ใด ๆ ที่อาจคำนวณมูลค่าเป็นเงินได้ตามประเภทที่สำนักหักบัญชีกำหนดในระหว่างการผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ หรือเพื่อชดเชยความเสียหายแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด และกำหนดให้สำนักหักบัญชีอาจเรียกเงินค่าปรับกรณีผู้ผิดนัดคืนหลักทรัพย์เพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่ผู้ให้ยืมแทนการคืนหลักทรัพย์ที่ให้ยืมนั้น

สำนักหักบัญชีขอกำหนดอัตราค่าปรับ ดังนี้

### 1. อัตราค่าปรับเพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์

#### 1.1 ค่าปรับระหว่างรอรับหลักทรัพย์

กรณีที่มีการจ่ายสิทธิประโยชน์ใด ๆ ที่อาจคำนวณมูลค่าเป็นเงินได้ตามประเภทที่สำนักหักบัญชีกำหนด ในระหว่างการผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีอาจเรียกค่าปรับจากสมาชิกผู้ผิดนัดเพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์ในอัตราร้อยละ 115 ของมูลค่าสิทธิประโยชน์ที่คำนวณได้ \*

#### 1.2 ค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด

กรณีที่สมาชิกผู้ผิดนัดไม่สามารถจัดหาหลักทรัพย์ตามประเภท ชนิด และจำนวนเดียวกันมาส่งมอบให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์ภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนดตามประกาศของสำนักหักบัญชีว่าด้วยการกำหนดวันชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีอาจเรียกค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัดจากสมาชิกผู้ผิดนัดตามจำนวนหลักทรัพย์ที่ผิดนัดเพื่อนำมาชดเชยความเสียหายให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์แทนการส่งมอบหลักทรัพย์ ทั้งนี้ สำนักหักบัญชีจะนำหลักเกณฑ์การจัดสรรกรณีที่มีการผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ของสำนักหักบัญชีมาใช้บังคับกับการชำระเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์โดยอนุโลม

---

\* สูตรการคำนวณมูลค่าสิทธิประโยชน์ใด ๆ สำหรับสิทธิประโยชน์ที่อาจคำนวณมูลค่าเป็นเงินได้ตามประเภทที่สำนักหักบัญชีกำหนด และอัตราค่าปรับเพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์เป็นไปตามที่สมาชิกและบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกร่วมกันกำหนด

สำนักหักบัญชีจะคำนวณค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัดตามวรรคหนึ่ง โดยใช้ราคาสูงสุดที่คำนวณได้จากราคาใดราคาหนึ่งดังต่อไปนี้

(1) ราคาสำหรับการเสนอซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด (Buy - in) ในวันทำการที่สำนักหักบัญชีเรียกเก็บค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด

(2) ราคาที่คำนวณได้จากอัตราร้อยละ 130 ของราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารตามประกาศของสำนักหักบัญชีว่าด้วยการคำนวณมูลค่าหลักประกันอันเนื่องมาจากการผิดนัด ในวันทำการก่อนหน้าวันทำการที่สำนักหักบัญชีเรียกเก็บค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด

(3) กรณีวันที่สำนักหักบัญชีเรียกเก็บค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัดตรงกับวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศขึ้นเครื่องหมายเพื่อแสดงว่าราคาซื้อขายหลักทรัพย์นั้นเป็นราคาที่ไม่วรมถึงสิทธิประโยชน์ที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์จะให้หรือให้แก่ผู้ถือหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีอาจนำราคาที่คำนวณได้จากอัตราร้อยละ 130 ของราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารตามประกาศของสำนักหักบัญชีว่าด้วยการคำนวณมูลค่าหลักประกันอันเนื่องมาจากการผิดนัดของวันทำการก่อนหน้าวันที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศขึ้นเครื่องหมายดังกล่าวมาใช้อ้างอิงในการคำนวณเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัดด้วย

(4) ราคาที่คำนวณได้จากอัตราร้อยละ 130 ของราคาซื้อขายสูงสุดของหลักทรัพย์นับแต่วันที่ซื้อขายหลักทรัพย์ที่ผิดนัดจนถึงวันทำการก่อนหน้าวันทำการที่สำนักหักบัญชีเรียกเก็บค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด

## 2. อัตราค่าปรับแทนการคืนหลักทรัพย์ที่ให้ยืม

ในกรณีที่ผู้ยืมไม่สามารถคืนหลักทรัพย์ได้ตามวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด ภายในวันทำการที่ 6 ถัดจากวันที่มีการยืมหลักทรัพย์ (“วันครบกำหนดคืนหลักทรัพย์”) หรือวันที่สำนักหักบัญชีเรียกคืนหลักทรัพย์ที่ให้ยืม ก่อนถึงวันครบกำหนดคืนหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีขอกำหนดอัตราค่าปรับกรณีผู้ยืมผิดนัดคืนหลักทรัพย์ โดยใช้ราคาสูงสุดที่คำนวณได้จากราคาใดราคาหนึ่ง ดังต่อไปนี้

2.1 ราคาที่คำนวณได้จากอัตราร้อยละ 130 ของราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารตามประกาศของสำนักหักบัญชีว่าด้วยการคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์และหลักประกันการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชี ในวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดคืนหลักทรัพย์ที่ยืมตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือ วันทำการก่อนหน้าวันที่สำนักหักบัญชีเรียกคืนหลักทรัพย์ที่ให้ยืมก่อนวันครบกำหนดคืนหลักทรัพย์ แล้วแต่กรณี

2.2 ราคาที่คำนวณได้จากอัตราร้อยละ 130 ของราคาซื้อขายสูงสุดของหลักทรัพย์นับแต่วันที่มีการซื้อหลักทรัพย์จนถึงวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดคืนหลักทรัพย์ที่ยึดตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือวันทำการก่อนหน้าวันที่สำนักหักบัญชีเรียกคืนหลักทรัพย์ที่ยึดก่อนวันครบกำหนดคืนหลักทรัพย์ แล้วแต่กรณี

ประกาศนี้ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2562 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 1 ตุลาคม 2562

(ลงนาม) กัทรวดี สุวรรณสร

(นางสาวกัทรวดี สุวรรณสร)

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด