

ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด
เรื่อง การบันทึกรายการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์
ที่เกี่ยวกับการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ (Pre-Settlement Matching)

ตามที่ข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 504.01 (1) กำหนดให้สมาชิกหรือบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกต้องบันทึกรายการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และภายในวันและระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด และสำนักหักบัญชีได้ออกประกาศ เรื่อง การบันทึกรายการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ (Pre-Settlement Matching) ลงวันที่ 1 ตุลาคม 2562 นั้น

สำนักหักบัญชีขอยกเลิกประกาศฉบับลงวันที่ 1 ตุลาคม 2562 ดังกล่าว และขอกำหนดหลักเกณฑ์ และเงื่อนไข การบันทึกรายการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่เกี่ยวกับการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ดังต่อไปนี้แทน

1. ประเภทของรายการ

- 1.1 รายการ โอน/รับ โอนหลักทรัพย์พร้อมชำระราคา (Delivery Versus Payment/Receive Versus Payment; DVP/RVP)
- 1.2 รายการ โอน/รับ โอนหลักทรัพย์ที่ไม่มีการชำระราคา (Delivery Free of Payment/Receive Free of Payment; DF/RF)

2. ข้อมูลที่ต้องบันทึกในระบบและข้อมูลที่ใช้ในการจับคู่รายการ

สมาชิกหรือบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกต้องบันทึกรายการผ่านระบบงานเชื่อมโยงกับสำนักหักบัญชี โดยระบบจะใช้วิธีการจับคู่รายการเมื่อมีข้อมูลที่ใช้ในการจับคู่รายการ (Matching Fields) ตรงกัน เว้นแต่รายการที่มีลักษณะหรือเป็นรายการดังต่อไปนี้ ระบบจะจับคู่รายการเมื่อมีข้อมูลรายการทั้งหมดเป็นไปตามเงื่อนไขตามที่กำหนด

2.1 รายการที่มีการกำหนดเงื่อนไขการจับคู่รายการที่มีรหัส TURN และ Pool Code หรือรหัส และรายการอื่นใดที่มีเงื่อนไขลักษณะเดียวกัน

2.2 รายการที่รอการจับคู่กับรายการตาม 2.1

2.3 รายการ DVP/RVP ที่มีส่วนต่างของมูลค่าการชำระราคาไม่เกิน 50 บาท (\pm 50 บาท)

ทั้งนี้ สำนักหักบัญชีจะใช้มูลค่าของรายการรับเงิน (DVP) เป็นมูลค่าการชำระราคาตามวรรคหนึ่ง ยกเว้นรายการระหว่างสมาชิกกับบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิก สำนักหักบัญชีจะใช้มูลค่าของรายการที่ดำเนินการโดยสมาชิกเป็นมูลค่าการชำระราคา

ข้อมูลที่ต้องบันทึกในระบบ	ข้อมูลที่ใช้ในการจับคู่รายการ	
	DVP/RVP	DF/RF
1. เลขที่อ้างอิงของรายการ (Sender's Reference)	-	-
2. วันที่ซื้อขาย (Trade Date)	-	-
3. วันที่ชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (Settlement Date)	✓	✓
4. รหัสหลักทรัพย์สากล (ISIN Code)	✓	✓
5. จำนวนหลักทรัพย์	✓	✓
6. เลขที่บัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบและรับมอบหลักทรัพย์ (Settlement Account) ของผู้ส่งคำสั่ง	✓	✓
7. เลขที่บัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบและรับมอบหลักทรัพย์ (Settlement Account) ของคู่กรณี	✓	✓
8. มูลค่าการชำระราคา	✓	-
9. เลขที่บัญชีในระบบงานศูนย์รับฝาก 9.1 สำหรับสมาชิก : 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

- (1) รายการระหว่างสมาชิกกับบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิก
- (2) รายการระหว่างบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกกับบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิก

3.2 รายการเพื่อการเปลี่ยนแปลงประเภทของหลักทรัพย์

- (1) รายการ DVP/DF สามารถเลือกการเปลี่ยนแปลงประเภทของหลักทรัพย์ได้เฉพาะจาก Local/NVDR เป็น Foreign

(2) รายการ RVP/RF สามารถเลือกการเปลี่ยนแปลงประเภทของหลักทรัพย์ได้เฉพาะจาก Foreign เป็น Local

4. การระบุนวัตกรรมประสงค์ของการทำรายการ

4.1 รายการเพื่อการส่งมอบและรับมอบหลักทรัพย์ของสมาชิกหรือของบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคา และส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกที่เกิดจากการซื้อขายหลักทรัพย์ของสมาชิก ไม่ต้องระบุนวัตกรรมประสงค์ (No)

4.2 รายการที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย ต้องระบุนวัตกรรมประสงค์ใดนวัตกรรมประสงค์หนึ่ง ดังนี้ Loan, Loan Return, Collateral และ Release Collateral

5. การปรับปรุงรายการเพื่อการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

รายการ	นวัตกรรมประสงค์	เงื่อนไข
5.1 การรวมรายการ (Merge)	<ul style="list-style-type: none"> - เพื่อรวมจำนวนหลักทรัพย์ และรวมมูลค่าชำระราคาให้มีข้อมูลที่ใช้ในการจับคู่รายการ ตรงกันกับข้อมูลของคู่กรณี - เพื่อแก้ไขการรวมรายการ (Edit Merge) - เพื่อยกเลิกการรวมรายการ (Cancel Merge) 	<ul style="list-style-type: none"> - ดำเนินการได้ทั้งสมาชิกหรือบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิก
5.2 การยกเลิกการจับคู่รายการ (De-match)	<p>เพื่อย้อนสถานะของรายการให้สามารถแก้ไขข้อมูลของรายการที่จับคู่ได้แล้ว</p>	<ul style="list-style-type: none"> - ดำเนินการได้ทั้งสมาชิกหรือบุคคลอื่นที่ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิก - ต้องได้รับความยินยอมจากคู่กรณี ทั้งนี้หากคู่กรณีไม่ยืนยันการยกเลิกการจับคู่รายการ (De-match) ภายในเวลาที่กำหนดจะถือว่าการยกเลิกการจับคู่รายการนั้นไม่สมบูรณ์ ระบบจะนำรายการนั้นไปประมวลผลต่อไป - รายการที่ยกเลิกการจับคู่แล้ว สามารถจับคู่ได้อีก
5.3 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

รายการ	วัตถุประสงค์	เงื่อนไข
5.4 การยกเลิกรายการ (Cancel)	<ul style="list-style-type: none"> - เพื่อยกเลิกรายการที่ยังไม่ได้รับการจับคู่ - เพื่อยกเลิกรายการที่จับคู่แล้ว 	<ul style="list-style-type: none"> - ไม่ต้องได้รับความยินยอมจากคู่กรณี - ต้องได้รับความยินยอมจากคู่กรณี <ol style="list-style-type: none"> (1) หากคู่กรณียื่นขออนุญาตยกเลิกรายการภายในเวลาที่กำหนด จะถือว่ารายการที่ยกเลิกนั้น สมบูรณ์ และไม่สามารถจับคู่รายการได้อีก (2) หากคู่กรณีไม่ยื่นขออนุญาตยกเลิกรายการภายในเวลาที่กำหนด จะถือว่ารายการที่ยกเลิกนั้น ไม่สมบูรณ์ และระบบจะนำรายการนั้นไปประมวลผลต่อไป

ประกาศนี้ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 28 กันยายน 2563 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 22 กันยายน 2563

(ลงนาม) ภัทรวลี สุวรรณสร

(นางสาวภัทรวลี สุวรรณสร)

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด