

ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

เรื่อง แนวทางการลงโทษสมาชิกกรณีไม่ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ของสำนักหักบัญชี

ตามที่ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนของเกี่ยวกับหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 308 กำหนดให้สำนักหักบัญชีอาจพิจารณาลงโทษสมาชิก หากสมาชิกฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหน้าที่ตามข้อกำหนด หนังสือเวียนหรือคำสั่งของสำนักหักบัญชี และสำนักหักบัญชีได้ออกประกาศเรื่อง แนวทางการลงโทษสมาชิกกรณีไม่ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ของสำนักหักบัญชี ลงวันที่ 14 กุมภาพันธ์ 2561 นั้น

สำนักหักบัญชีขอยกเลิกประกาศฉบับดังกล่าว และพิจารณากำหนดบทลงโทษตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้แทน

1. สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกที่ไม่ดำเนินการเพื่อบริหารความเสี่ยงในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ดังต่อไปนี้

1.1 กรณีที่สมาชิกไม่จัดส่งรายงานเกี่ยวกับฐานะทางการเงินตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด หรือจัดส่งรายงานเกี่ยวกับฐานะทางการเงินที่มีข้อมูล ไม่ครบถ้วนหรือไม่ถูกต้อง สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกครั้งละ 5,000 บาทต่อวัน โดยคำนวณตามระยะเวลาที่ไม่จัดส่งหรือจัดส่งโดยมีข้อมูลไม่ครบถ้วน

1.2 กรณีที่สมาชิกจัดส่งรายงานเกี่ยวกับฐานะทางการเงินตามที่สำนักหักบัญชีกำหนดโดยมีข้อมูลไม่ครบถ้วนหรือไม่ถูกต้อง และทำให้สมาชิกวางหลักประกันน้อยกว่าจำนวนที่สมาชิกต้องวางไว้กับสำนักหักบัญชี สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกในอัตราร้อยละ 0.50 ของมูลค่าหลักประกันที่สมาชิกต้องวางเพิ่ม

1.3 กรณีที่สมาชิกไม่วางหลักประกันหรือวางหลักประกันไม่ถูกต้องครบถ้วนตามมาตรการบริหารความเสี่ยง สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกตามระยะเวลาที่วางหลักประกัน ไม่ถูกต้องครบถ้วนดังต่อไปนี้

(1) ไม่เกิน 1 วันทำการ ให้ปรับสมาชิกในอัตราร้อยละ 0.50 ของมูลค่าหลักประกันที่วางไม่ถูกต้องครบถ้วน

(2) เกินกว่า 1 วันทำการ แต่ไม่เกิน 2 วันทำการ ให้ปรับสมาชิกในอัตราร้อยละ 0.75 ของมูลค่าหลักประกันที่วางไม่ถูกต้องครบถ้วน

1.4 กรณีที่สมาชิกไม่จัดส่งหนังสือเพื่อแจ้งให้สำนักหักบัญชีทราบกรณีสมาชิกมีส่วนของผู้ถือหุ้นน้อยกว่าหลักเกณฑ์ที่สำนักหักบัญชีกำหนดภายในระยะเวลาที่กำหนดไว้สำหรับการจัดส่งหนังสือดังกล่าว สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกเป็นจำนวน 5,000 บาทต่อวันตลอดระยะเวลาที่ไม่จัดส่งหนังสือ หรือจนกว่าสมาชิกจะสามารถดำรงส่วนของผู้ถือหุ้นได้ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักหักบัญชีกำหนด

1.5 กรณีที่สมาชิกไม่จัดส่งแผนการแก้ไขส่วนของผู้ถือหุ้นให้แก่สำนักหักบัญชีภายในระยะเวลาที่กำหนดไว้สำหรับการจัดส่งแผนการแก้ไขดังกล่าว สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกเป็นจำนวน 5,000 บาทต่อวันตลอดระยะเวลาที่ไม่จัดส่งแผนการแก้ไขส่วนของผู้ถือหุ้น หรือจนกว่าสมาชิกจะสามารถดำรงส่วนของผู้ถือหุ้นได้ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักหักบัญชีกำหนด

2. สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกผู้ผิดนัดชำระราคาหลักทรัพย์ตามข้อมูลการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ดังต่อไปนี้

2.1 กรณีที่สมาชิกผิดนัดชำระราคาหลักทรัพย์อันเนื่องมาจากความผิดพลาด ในการปฏิบัติงานของสมาชิก (Human Error) และไม่ก่อให้เกิดความเสียหายต่อระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกดังต่อไปนี้

(1) การผิดนัดในกรณีดังกล่าวเกิดขึ้นเป็นครั้งแรกในรอบปีปฏิทิน สำนักหักบัญชีอาจพิจารณาปรับสมาชิก ครั้งละ 5,000 บาท

(2) การผิดนัดในกรณีดังกล่าวเกิดขึ้นเป็นครั้งที่สองในรอบปีปฏิทินเดียวกัน สำนักหักบัญชีอาจพิจารณาปรับสมาชิก ครั้งละ 10,000 บาท

(3) การผิดนัดในกรณีดังกล่าวเกิดขึ้นตั้งแต่ครั้งที่สามขึ้นไปในรอบปีปฏิทินเดียวกัน สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิก ครั้งละ 50,000 บาท

2.2 กรณีที่สมาชิกผิดนัดชำระราคาหลักทรัพย์อันเนื่องมาจากเหตุอื่นนอกจากข้อ 2.1 สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกอย่างสูงครั้งละไม่เกิน 2 เท่าของจำนวนเงินที่ผิดนัด

3. สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกผู้ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามข้อมูลการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ดังต่อไปนี้

3.1 กรณีที่สมาชิกผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์อันเนื่องมาจากความผิดพลาดในการปฏิบัติงานของสมาชิก (Human Error) และสมาชิกผู้ผิดนัดสามารถแสดงได้ว่ามีหลักทรัพย์เพียงพอในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่มีการผิดนัดภายในเวลาที่เหมาะสมและสำนักหักบัญชีเห็นสมควร รวมทั้งไม่ก่อให้เกิดความเสียหายต่อระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกดังต่อไปนี้

(1) การผิดนัดในกรณีดังกล่าวเกิดขึ้นเป็นครั้งที่สองในรอบปีปฏิทินเดียวกัน สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิก รายหลักทรัพย์ละ 2,000 บาท

(2) การผิดนัดในกรณีดังกล่าวเกิดขึ้นตั้งแต่ครั้งที่สามขึ้นไปในรอบปีปฏิทินเดียวกัน สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิก รายหลักทรัพย์ละ 5,000 บาท

3.2 กรณีที่สมาชิกผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์อันเนื่องมาจากเหตุอื่นนอกจากข้อ 3.1 สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกตามระยะเวลาที่ผิดนัดจนกว่าสมาชิกจะสามารถส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนที่ผิดนัดหรือชำระเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ให้แก่สำนักหักบัญชีโดยถูกต้องครบถ้วน ดังต่อไปนี้

(1) ผิดนัดไม่เกิน 1 วันทำการนับแต่เวลาที่ผิดนัด ให้ปรับสมาชิกร้อยละ 0.50 ของมูลค่าที่เกิดจากจำนวนหลักทรัพย์ที่ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์คูณกับราคาซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์* ในวันที่ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

(2) ผิดนัดเกินกว่า 1 วันทำการแต่ไม่เกิน 2 วันทำการนับแต่เวลาที่ผิดนัด ให้ปรับสมาชิกร้อยละ 0.75 ของมูลค่าที่เกิดจากจำนวนหลักทรัพย์ที่ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์คูณกับราคาซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์* ในวันที่ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

(3) ผิดนัดเกินกว่า 2 วันทำการแต่ไม่เกิน 3 วันทำการนับแต่เวลาที่ผิดนัด ให้ปรับสมาชิก ร้อยละ 1.00 ของมูลค่าที่เกิดจากจำนวนหลักทรัพย์ที่ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์คูณกับราคาซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์* ในวันที่ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

(4) ผิดนัดเกินกว่า 3 วันทำการแต่ไม่เกิน 4 วันทำการนับแต่เวลาที่ผิดนัด ให้ปรับสมาชิก ร้อยละ 1.75 ของมูลค่าที่เกิดจากจำนวนหลักทรัพย์ที่ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์คูณกับราคาซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์* ในวันที่ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

ทั้งนี้ ค่าปรับดังกล่าวจะต้องไม่น้อยกว่าครั้งละ 300 บาทต่อรายหลักทรัพย์

กรณีสมาชิกผิดนัดส่งมอบหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าว สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกในอัตราร้อยละ 1 ของมูลค่าหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าว

4. สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกผู้ผิดนัดตามรายงานของสำนักหักบัญชี

ในกรณีที่สมาชิกผิดนัดชำระราคาหรือผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามรายงานใดของสำนักหักบัญชี สำนักหักบัญชีอาจปรับสมาชิกผู้ผิดนัดตามรายงานดังกล่าวไม่ว่าสมาชิกนั้นมีหน้าที่ชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ตามรายงานที่มีการแก้ไขหรือรายงานที่จัดทำขึ้นใหม่แทนรายงานนั้นก็ตาม

5. กรณีกองทุนทดแทนความเสียหายในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ให้ผู้จัดการกองทุนปรับสมาชิกกองทุนได้ในกรณีดังต่อไปนี้

กรณีที่สมาชิกกองทุนจ่ายเงินสมทบรายเดือนล่าช้า หรือไม่ดำเนินการจ่ายเงินสมทบรายเดือน ผู้จัดการกองทุนอาจปรับสมาชิกกองทุนในอัตราอย่างน้อย 1,000 บาทต่อครั้ง และผู้จัดการกองทุนอาจเรียกเก็บค่าปรับโดยคำนวณตามอัตราสูงสุดตามกฎหมายว่าด้วยดอกเบี้ยเงินกู้ยืมของสถาบันการเงินนับแต่วันที่สมาชิกกองทุนไม่จ่ายเงินสมทบรายเดือนหรือจ่ายไม่ถูกต้องครบถ้วนจนถึงวันที่สมาชิกกองทุนชำระครบถ้วน เว้นแต่ผู้จัดการกองทุนจะกำหนดอัตราไว้เป็นอย่างอื่น

6. สำนักหักบัญชีอาจยกเว้นค่าปรับแก่สมาชิกผู้ผิดนัดชำระราคาหรือผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตาม ข้อมูลการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ในกรณีอย่างใดอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้

6.1 การผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์นั้นเกิดขึ้นเนื่องจากความผิดพลาดในการปฏิบัติงานของสมาชิก (Human Error) เป็นครั้งแรกในรอบปีปฏิทิน และสมาชิกผู้ผิดนัดสามารถแสดงได้ว่ามีหลักทรัพย์เพียงพอในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่มีการผิดนัดภายในเวลาที่เหมาะสม และสำนักหักบัญชีเห็นสมควร รวมทั้งไม่ก่อให้เกิดความเสียหายต่อระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

6.2 การผิณัดชำระราคาหลักทรัพย์หรือผิณัดส่งมอบหลักทรัพย์นั้นเกิดขึ้นจากเหตุสุดวิสัย
และสำนักหักบัญชีเห็นสมควร

ประกาศนี้ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2562 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 1 ตุลาคม 2562

(ลงนาม) กัทรวลี สุวรรณศรี

(นางสาวกัทรวลี สุวรรณศรี)

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

*** ราคาซื้อขายเฉลี่ยของหลักทรัพย์ในวันที่ทำการซื้อขาย มีหลักเกณฑ์ดังนี้**

1. กรณีมีราคาซื้อขายเฉลี่ยจากการซื้อขายแบบจับคู่คำสั่งอัตโนมัติ (AOM) ให้ใช้ราคาเฉลี่ยจากการซื้อขายนั้น
2. กรณีไม่มีราคาตามข้อ 1 ให้ใช้ราคาจากการซื้อขายที่ผู้ซื้อและผู้ขายได้ตกลงซื้อขายกัน (Trade Report) โดยไม่พิจารณาประเภทบัญชี (P/C) แยกประเภทหุ้น Local (Local/NVDR/TTF) และ Foreign ตามลำดับดังนี้
 - 2.1 ใช้ราคาของ Trade report ที่ทำให้เกิดการผิณัด โดยตรวจสอบจาก เลขที่/ชื่อสมาชิก ชื่อหุ้น และ จำนวนหุ้น ที่เป็นรายการด้านขายที่ทำให้เกิดการผิณัด
 - 2.2 หากเมื่อตรวจสอบแล้วพบว่ามียกรการด้านขายที่เข้าเงื่อนไขตามข้อ 2.1 มากกว่า 1 รายการให้นำราคาของรายการด้านขายเหล่านั้นมาหาค่าเฉลี่ย
 - 2.3 หากไม่มีรายการซื้อขายตามเงื่อนไขข้อ 2.1 และข้อ 2.2 ให้ใช้ราคาของรายการด้านขายของสมาชิกที่ผิณัด หุ้นที่ผิณัด 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 และจำนวนหุ้นที่เป็นเฉพาะด้านส่งมอบหุ้นที่ทำให้เกิดการผิณัด (คำนวณราคาหุ้นจากมูลค่า PSMS หารจำนวนหุ้นทั้งหมด)
 - 3.2 หากตรวจสอบแล้วพบว่ามียกรการ PSMS ที่เข้าเงื่อนไขตามข้อ 3.1 มากกว่า 1 รายการให้นำราคาหุ้นของรายการเหล่านั้นมาหาค่าเฉลี่ย และใช้เป็นราคาสำหรับคำนวณมูลค่าผิณัด/unwind
 - 3.3 หากไม่มีรายการ PSMS ที่มีจำนวนหุ้นเท่ากับจำนวนที่ผิณัดให้นำราคาของรายการที่มีเลขที่/ชื่อสมาชิก ชื่อหุ้น ที่เป็นเฉพาะด้านส่งมอบหุ้นที่ทำให้เกิดการผิณัดรวมทุกรายการ และนำมาหาค่าเฉลี่ย (คำนวณจากมูลค่ารวม PSMS ทุกรายการหารจำนวนหุ้นทั้งหมด)
4. หากไม่มีราคาตามข้อ 1 ถึงข้อ 3 จะพิจารณาใช้ราคาตามที่สำนักหักบัญชีเห็นสมควร