

14 กุมภาพันธ์ 2561

เรื่อง วิธีการดำเนินการของสำนักหักบัญชีและราคาเฉลี่ยที่ใช้ในการคำนวณค่าปรับการผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ในวันที่ 6 มีนาคม 2561
เรียน กรรมการผู้จัดการ
สมาชิกสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์

ตามที่บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด (สำนักหักบัญชี) กำหนดให้ระยะเวลาการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์เป็น 2 วันทำการถัดจากวันซื้อขายหลักทรัพย์ (T+2) เพื่อให้สอดคล้องกับต่างประเทศและเสริมสร้างศักยภาพการแข่งขันให้แก่ตลาดหุ้นไทย โดยผู้ร่วมอุตสาหกรรมที่เกี่ยวข้องได้ร่วมกันกำหนดวันแรกที่เริ่มซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยรอบระยะเวลาการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แบบ T+2 คือ วันศุกร์ที่ 2 มีนาคม 2561 นั้น

สำนักหักบัญชีขอเรียนแจ้งข้อมูลสำคัญที่เกี่ยวข้องกับการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ เพื่อชักชวนความเข้าใจ ดังนี้

ในวันอังคารที่ 6 มีนาคม 2561 จะเป็นวันครบกำหนดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ของรายการซื้อขายของวันที่ทำการซื้อขาย 2 วันรายละเอียดปรากฏดังนี้

วันที่ทำการซื้อขาย	รอบการชำระราคาและส่งมอบ	วันครบกำหนดชำระราคาและส่งมอบ หลักทรัพย์
28 กุมภาพันธ์ 2561	T+3 (วันสุดท้าย)	6 มีนาคม 2561
2 มีนาคม 2561	T+2 (วันแรก)	6 มีนาคม 2561

ดังนั้น ณ วันครบกำหนดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีจะดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) สำนักหักบัญชีจะประมวลผลรายการซื้อขายของวันที่ทำการซื้อขาย 2 วันรวมกัน และดำเนินการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์เป็นยอดสุทธิ (Net Settlement) ในวันที่ 6 มีนาคม 2561 ตามที่ได้เคยหารือและตกลงร่วมกันกับผู้ร่วมอุตสาหกรรมที่เกี่ยวข้อง

(2) การคำนวณค่าปรับผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ที่เกิดขึ้นในวันที่ 6 มีนาคม 2561 สำนักหักบัญชีจะใช้ราคาถัวเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักด้วยปริมาณซื้อขายของวันที่ทำการซื้อขาย 2 วัน เช่น การคำนวณราคาเฉลี่ยจากการซื้อขายแบบจับคู่คำสั่งอัตโนมัติ (AOM) สำนักหักบัญชีจะนำมูลค่าซื้อขายรวมของวันที่ทำการซื้อขายทั้ง 2 วัน หาดด้วยจำนวนหุ้นที่มีการซื้อขายรวมทั้ง 2 วัน (วันที่ซื้อขาย 28 กุมภาพันธ์ 2561 รวมกับวันที่ซื้อขาย 2 มีนาคม 2561)

ทั้งนี้ ในกรณีที่ต้องใช้ราคาจากการซื้อขายที่ผู้ซื้อและผู้ขายได้ตกลงซื้อขายกัน (Trade Report) สำนักหักบัญชีจะคำนวณค่าปรับจากราคาจาก Trade report ที่ทำให้เกิดการผิดนัดหรือกรณีต้องใช้ราคาที่คำนวณจากการบันทึกรายการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ (Pre-Settlement Matching) ที่เป็นเฉพาะด้านส่งมอบหุ้นที่ทำให้เกิดการผิดนัด เป็นต้น สำนักหักบัญชีจะใช้แนวทางเดียวกันในการคำนวณ

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ

(ลงนาม) กัลยรัตน์ ศรีอรุณ

(นางสาวกัลยรัตน์ ศรีอรุณ)

ผู้อำนวยการฝ่ายชำระราคาหลักทรัพย์

ฝ่ายชำระราคาหลักทรัพย์ โทรศัพท์ 02-009-9999 ต่อ 9549 - 9553