

ประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ กธ. 29/2543

เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับบริษัทหลักทรัพย์ที่ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ไม่ได้ตามเกณฑ์ที่กำหนด

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 14 และมาตรา 143 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์
และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 คณะกรรมการ ก.ล.ต. ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ กธ. 35/2541 เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับบริษัทหลักทรัพย์ที่ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิไม่ได้
ตามเกณฑ์ที่กำหนด ลงวันที่ 10 กันยายน พ.ศ. 2541

ข้อ 2 ในประกาศนี้

“บริษัทหลักทรัพย์” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์หรือบริษัทเงินทุนหลักทรัพย์
ตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงเงินกองทุน
สภาพคล่องสุทธิ

“ออปชัน” หมายความว่า ออปชันตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์
และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กจ. 6/2542 เรื่อง การกำหนดประเภทหลักทรัพย์เพิ่มเติม (ฉบับที่ 3)
ลงวันที่ 22 กุมภาพันธ์ 2542

“ฐานะออปชัน” หมายความว่า ภาระหรือสิทธิอันเนื่องมาจากการซื้อขายออปชัน

“ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ” หมายความว่า ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
หรือฐานะการเงินตามเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ว่าด้วยการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

“สำนักงาน” หมายความว่า สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 3 โดยไม่เป็นการจำกัดอำนาจของคณะกรรมการ ก.ล.ต. ตามมาตรา 143
แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ที่จะสั่งเป็นประการอื่น
บริษัทหลักทรัพย์ใดไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ให้บริษัทหลักทรัพย์นั้นปฏิบัติ
ดังต่อไปนี้

(1) จัดทำแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ และยื่นต่อสำนักงานภายในสามสิบวันนับแต่วันแรกที่บริษัทหลักทรัพย์ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิไม่ได้ตามเกณฑ์ที่กำหนด เว้นแต่ก่อนพ้นกำหนดเวลาสามสิบวันดังกล่าว บริษัทหลักทรัพย์นั้นสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิให้เป็นไปตามเกณฑ์ที่กำหนดได้เป็นระยะเวลาไม่น้อยกว่าเจ็ดวันทำการติดต่อกัน

(2) ดำเนินการให้เป็นไปตามแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ได้ยื่นต่อสำนักงานตาม (1) ให้แล้วเสร็จภายในระยะเวลาที่กำหนดในแผนดังกล่าว ซึ่งต้องไม่เกินหนึ่งร้อยยี่สิบวันนับแต่วันแรกที่บริษัทหลักทรัพย์ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิไม่ได้ตามเกณฑ์ที่กำหนด

ข้อ 4 ในระหว่างที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิหรืออยู่ระหว่างการดำเนินการตามข้อ 2(1) หรือ (2) ห้ามมิให้บริษัทหลักทรัพย์นั้นขยายการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์เกินกว่าบริษัทหลักทรัพย์นั้นจะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามเกณฑ์ที่กำหนด และได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ได้ตามปกติ

เพื่อประโยชน์ตามวรรคหนึ่ง “การขยายการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์” ให้นำหมายถึง

(1) การเพิ่มวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ให้แก่ลูกค้าบัญชีเงินสด เว้นแต่เป็นการซื้อหลักทรัพย์ที่ลูกค้าได้วางเงินไว้กับบริษัทหลักทรัพย์ หรือเป็นการขายหลักทรัพย์ของลูกค้าที่อยู่ในความครอบครองของบริษัทหลักทรัพย์แล้ว

(2) การเพิ่มยอดหนี้คงค้างของลูกค้าบัญชีมาร์จินหรือลูกค้าสถาบันที่ยืมหลักทรัพย์จากยอดหนี้คงค้างที่ปรากฏในวันแรกที่บริษัทหลักทรัพย์ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิไม่ได้ตามเกณฑ์ที่กำหนด เว้นแต่เป็นการเพิ่มขึ้นเนื่องจากดอกเบี้ยค้างรับ

(3) การเปิดบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ให้แก่ลูกค้ารายใหม่

(4) การเพิ่มความเสี่ยงโดยรวมในเงินลงทุนของบริษัท (portfolio)

(5) การทำสัญญารับประกันการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์เพิ่ม เว้นแต่เป็นการปฏิบัติตามสัญญาที่มีผลผูกพันอยู่ก่อนวันที่บริษัทหลักทรัพย์จะดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิไม่ได้ตามเกณฑ์ที่กำหนด

(6) การเพิ่มมูลค่าเงินทุนที่รับบริหารให้แก่ลูกค้าบัญชีกองทุนส่วนบุคคล หรือการเปิดบัญชีกองทุนส่วนบุคคลให้แก่ลูกค้ารายใหม่

(7) การซื้อขายอปชันเพิ่มให้แก่ลูกค้า เว้นแต่เป็นการซื้อขายเพื่อล้างฐานะอปชันของลูกค้า

ข้อ 5 ในกรณีที่บริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ปรากฏเหตุอย่างหนึ่งอย่างใดดังต่อไปนี้

- (1) บริษัทหลักทรัพย์ไม่ยื่นแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ต่อสำนักงานภายในเวลาที่กำหนดในข้อ 2(1)
- (2) บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ได้ตามแผนและระยะเวลาที่กำหนดในข้อ 2(2)
- (3) บริษัทหลักทรัพย์มีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่ำกว่าศูนย์ติดต่อกันเกินห้าวันทำการ
หรือ
- (4) บริษัทหลักทรัพย์มีการผิन्छำราคาหรือผิन्छส่งมอบหลักทรัพย์ต่อบริษัท
ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด หรือต่อลูกค้าของบริษัทหลักทรัพย์

ให้บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรากฏเหตุอย่างหนึ่งอย่างใดตามวรรคหนึ่งกระทำการดังต่อไปนี้

- (1) ระวังการดำเนินธุรกิจทุกประเภทจนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ได้ตามเกณฑ์ที่กำหนด และได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ดำเนินธุรกิจได้ตามปกติ ทั้งนี้ ไม่รวมถึง
การลดความเสี่ยงโดยรวมในเงินลงทุนของบริษัทหรือการดำเนินการตามภาระผูกพันที่ค้างอยู่
- (2) ให้ล้างฐานะอุปชันที่มีไว้เพื่อตนเอง
- (3) ให้บริษัทหลักทรัพย์โอนฐานะอุปชันและทรัพย์สินของลูกค้าในบัญชีอุปชัน
และบัญชีเงินสดไปให้บริษัทหลักทรัพย์อื่นดำเนินการแทน ในกรณีที่ไม่สามารถดำเนินการโอนได้
เนื่องจากลูกค้ามีมูลค่าหลักประกันต่ำกว่าที่กำหนด และไม่นำหลักประกันมาวางเพิ่ม ให้บริษัท
หลักทรัพย์ล้างฐานะอุปชันของลูกค้า และในกรณีที่ไม่สามารถดำเนินการโอนได้เนื่องจากเหตุอื่น
ให้สำนักงานมีอำนาจสั่งให้บริษัทหลักทรัพย์ดำเนินการอื่นใดเพื่อป้องกันความเสียหายต่อระบบ
และลูกค้า

ข้อ 6 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันถัดจากวันที่ประกาศในราชกิจจานุเบกษา
เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 24 สิงหาคม พ.ศ. 2543

(นายธารินทร์ นิมมานเหมินท์)

รัฐมนตรีว่าการกระทรวงการคลัง

ประธานกรรมการ คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์