

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ สธ. 13/2543

เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการสำหรับสถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์
ในการให้กู้ยืมเงินแก่นักลงทุนเพื่อซื้อหลักทรัพย์
หรือให้ยืมหลักทรัพย์แก่นักลงทุนเพื่อขายชอร์ต

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 4(3) และข้อ 6(4) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับ
หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 5/2539 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการประกอบ
ธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ ลงวันที่ 13 กรกฎาคม พ.ศ. 2539
ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 1/2543
เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการให้สินเชื่อเพื่อ
ธุรกิจหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 4 มกราคม พ.ศ. 2543 สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์
และตลาดหลักทรัพย์ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“สถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์” หมายความว่า บริษัทจำกัดหรือบริษัทมหาชนจำกัด
ที่ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์

“นักลงทุน” หมายความว่า ผู้ที่ทำสัญญากู้ยืมเงินกับสถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์
เพื่อใช้ในการซื้อหลักทรัพย์ หรือผู้ที่ทำสัญญายืมหลักทรัพย์กับสถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์
เพื่อใช้ในการขายชอร์ต แต่ไม่รวมถึงผู้ยืมหลักทรัพย์ที่มีฐานะเป็นลูกค้าสถาบันตามบทนิยามในประกาศ
คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการขายหลักทรัพย์โดยที่บริษัทหลักทรัพย์
ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง

“บัญชีมาร์จิน” หมายความว่า บัญชีที่บันทึกรายการการให้นักลงทุนกู้ยืมเงินเพื่อการ
ซื้อหลักทรัพย์หรือการให้นักลงทุนยืมหลักทรัพย์เพื่อการขายชอร์ต

“การขายชอร์ต” หมายความว่า การขายหลักทรัพย์ที่ต้องยืมหลักทรัพย์มาเพื่อการส่งมอบ

“ทรัพย์สินของนักลงทุน” หมายความว่า มูลค่าสุทธิของเงินสด หลักทรัพย์ และทรัพย์สินอื่น
ที่เป็นประกันการชำระหนี้ในบัญชีมาร์จินของนักลงทุนรายใดรายหนึ่ง เมื่อหักภาระหนี้ที่เกิดจากการซื้อหรือ
ขายหลักทรัพย์ในบัญชีมาร์จินของนักลงทุนรายนั้นแล้ว

“สำนักงาน” หมายความว่า สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 2 นอกจากเรื่องที่กำหนดไว้เป็นการเฉพาะในประกาศนี้ ในการให้กู้ยืมเงินแก่นักลงทุนเพื่อซื้อหลักทรัพย์หรือให้ยืมหลักทรัพย์แก่นักลงทุนเพื่อขายชอร์ต ให้สถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ปฏิบัติให้เป็นไปตามข้อกำหนดตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการปฏิบัติงานเกี่ยวกับการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์และการให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าที่มีหลักทรัพย์สถาบันเพื่อขายชอร์ต ด้วยโดยอนุโลม

ความตอนใดของประกาศตามวรรคหนึ่งที่กล่าวถึง “ลูกค้า” ให้หมายถึง “นักลงทุน” ตามประกาศนี้ และให้บทนิยามคำว่า “เงินกองทุน” ตามประกาศตามวรรคหนึ่งหมายถึง ส่วนของผู้ถือหุ้นตามงบการเงินของสถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ ตามวงดบัญชีล่าสุดที่ผ่านการตรวจสอบจากผู้สอบบัญชีที่สำนักงานให้ความเห็นชอบ

ข้อ 3 ให้สถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์คำนวณมูลค่าหลักประกันที่นักลงทุนต้องดำรงไว้และมูลค่าหลักประกันขั้นต่ำในบัญชีมาร์จินตามหลักเกณฑ์ดังนี้

(1) มูลค่าหลักประกันที่นักลงทุนต้องดำรงไว้เท่ากับผลรวมของ

(ก) มูลค่าของหลักทรัพย์จดทะเบียนและหลักทรัพย์ที่ซื้อขายในศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่บันทึกอยู่ในบัญชีมาร์จินของนักลงทุน คุณด้วยอัตราที่สถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์กำหนด ซึ่งต้องไม่ต่ำกว่าอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนดให้สมาชิกต้องเรียกให้ลูกค้าบัญชีมาร์จินนำเงินหรือทรัพย์สินมาวางเป็นประกันเพิ่ม และ

(ข) มูลค่าของหลักทรัพย์ที่ขายชอร์ตคุณด้วยอัตราที่สถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์กำหนด ซึ่งต้องไม่ต่ำกว่าอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนดให้สมาชิกต้องเรียกให้ลูกค้าบัญชีมาร์จินนำเงินหรือทรัพย์สินมาวางเป็นประกันเพิ่ม

(2) มูลค่าหลักประกันขั้นต่ำในบัญชีมาร์จินเท่ากับผลรวมของ

(ก) มูลค่าของหลักทรัพย์จดทะเบียนและหลักทรัพย์ที่ซื้อขายในศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่บันทึกอยู่ในบัญชีมาร์จินของนักลงทุน คุณด้วยอัตราที่สถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์กำหนด ซึ่งต้องไม่ต่ำกว่าอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนดให้สมาชิกต้องดำเนินการบังคับชำระหนี้จากทรัพย์สินที่เป็นหลักประกัน และ

(ข) มูลค่าของหลักทรัพย์ที่ขายชอร์ตคุณด้วยอัตราที่สถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์กำหนด ซึ่งต้องไม่ต่ำกว่าอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนดให้สมาชิกต้องดำเนินการบังคับชำระหนี้จากทรัพย์สินที่เป็นหลักประกัน

ข้อ 4 ในกรณีที่ทรัพย์สินของนักลงทุนมีมูลค่าต่ำกว่ามูลค่าหลักประกันที่นักลงทุนต้องดำรงไว้ซึ่งคำนวณได้ตามข้อ 3 (1) ให้สถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์แจ้งต่อนักลงทุนภายในวันทำการถัดจากวันที่หลักประกันของนักลงทุนมีมูลค่าต่ำกว่ามูลค่าหลักประกันที่นักลงทุนต้องดำรงไว้ โดยเรียกให้นักลงทุนนำเงินหรือทรัพย์สินมาวางเป็นประกันเพิ่มหรือดำเนินการอื่นใดจนทำให้ทรัพย์สินของนักลงทุนมีมูลค่าไม่ต่ำกว่ามูลค่าหลักประกันที่นักลงทุนต้องดำรงไว้ และต้องบอกกล่าวให้นักลงทุนทราบว่าหากนักลงทุนไม่ดำเนินการให้เสร็จสิ้นภายในวันทำการที่ห้า นับจากวันที่สถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์แจ้งต่อนักลงทุน ในวันทำการที่หกสถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์อาจดำเนินการบังคับชำระหนี้จากทรัพย์สินที่เป็นหลักประกันเพื่อให้ทรัพย์สินของนักลงทุนมีมูลค่าไม่ต่ำกว่ามูลค่าหลักประกันที่นักลงทุนต้องดำรงไว้ต่อไป

ข้อ 5 ในกรณีที่ทรัพย์สินของนักลงทุนมีมูลค่าเท่ากับหรือต่ำกว่ามูลค่าหลักประกันขั้นต่ำที่คำนวณได้ตามข้อ 3 (2) ให้สถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ดำเนินการบังคับชำระหนี้จากทรัพย์สินที่เป็นหลักประกันเพื่อให้ทรัพย์สินของนักลงทุนมีมูลค่าสูงกว่ามูลค่าหลักประกันขั้นต่ำ โดยให้ดำเนินการในวันทำการถัดจากวันที่ทรัพย์สินของนักลงทุนมีมูลค่าเท่ากับหรือต่ำกว่ามูลค่าหลักประกันขั้นต่ำ

ข้อ 6 ให้สถาบันสินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์แจ้งการบังคับชำระหนี้ตามข้อ 4 หรือข้อ 5 แล้วแต่กรณี ให้นักลงทุนทราบเป็นหนังสือภายในวันทำการถัดจากวันที่ดำเนินการบังคับชำระหนี้

ข้อ 7 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันถัดจากวันประกาศในราชกิจจานุเบกษาเป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 เมษายน พ.ศ. 2543

(นายประสาร ไตรรัตน์วรกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์