ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน

ที่ ทธ. ๓๖/๒๕๖๘

เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ ประเภทกิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา ๑๖/๖ วรรคสอง (๑) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. ๒๕๓๕ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ ๔) พ.ศ. ๒๕๕๑ และมาตรา ๑๔๐/๑ แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. ๒๕๓๕ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ ๖) พ.ศ. ๒๕๖๒ คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกประกาศไว้ ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ ๑๖ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๘ เป็นต้นไป

หมวด ๑
บททั่วไป

ข้อ ๒ ในประกาศนี้

“การขายชอร์ต” หมายความว่า การขายหลักทรัพย์ที่ต้องยืมหลักทรัพย์มาเพื่อการส่งมอบ

“ผู้ประกอบธุรกิจ” หมายความว่า ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทกิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

“บัญชีมาร์จิ้น” หมายความว่า บัญชีที่บันทึกรายการการให้ลูกค้ากู้ยืมเงินเพื่อการซื้อหลักทรัพย์หรือการให้ลูกค้ายืมหลักทรัพย์เพื่อการขายชอร์ต

คำว่า “ลูกค้าสถาบัน” ให้มีความหมายเช่นเดียวกับบทนิยามคำว่า “ผู้ลงทุนสถาบัน” ตามมาตรา ๓ แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. ๒๕๔๖ และประกาศที่ออกโดยอาศัยอำนาจตามบทบัญญัติแห่งกฎหมายดังกล่าว

ข้อ ๓ ในการประกอบกิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ของผู้ประกอบธุรกิจนอกจากการปฏิบัติตามประกาศนี้แล้ว ให้ผู้ประกอบธุรกิจปฏิบัติให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ในประกาศดังต่อไปนี้ด้วย โดยอนุโลม

(๑) ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยมาตรฐานการประกอบธุรกิจ โครงสร้างการบริหารงาน ระบบงาน และการให้บริการของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(๒) ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการมอบหมายให้บุคคลอื่นเป็นผู้รับดำเนินการในงานที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจ

(๓) ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการจัดให้มีคณะกรรมการตรวจสอบของบริษัทหลักทรัพย์

ข้อ ๔ สำนักงานอาจกำหนดแนวทาง (guideline) การปฏิบัติในรายละเอียดของข้อกำหนดตามประกาศนี้เพื่อเป็นการให้แนวทางปฏิบัติที่ถือว่าเหมาะสมและสอดคล้องตามประกาศนี้ และหากผู้ประกอบธุรกิจปฏิบัติตามแนวทางดังกล่าวแล้ว ให้ถือว่าผู้ประกอบธุรกิจได้ปฏิบัติตามข้อกำหนดในประกาศนี้แล้ว

หมวด ๒
หลักเกณฑ์การประกอบธุรกิจ

ส่วนที่ ๑
หลักเกณฑ์การดำเนินงาน

ข้อ ๕ ในการประกอบกิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ ผู้ประกอบธุรกิจต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(๑) จัดให้มีการยืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์เฉพาะที่อยู่ในระบบรับฝากหลักทรัพย์ของศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ที่ได้รับอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ หรือนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศซึ่งสามารถให้บริการเป็นศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ได้ตามกฎหมายของประเทศนั้นและอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของทางการหรือหน่วยงานที่ทำหน้าที่กำกับดูแลด้านหลักทรัพย์

(๒) จัดให้มีขั้นตอนและวิธีการในการจัดสรรการยืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์และเปิดเผยให้ลูกค้าทราบ

(๓) จัดให้มีการปฏิบัติงานเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่สำนักงานประกาศกำหนด

ข้อ ๖ ผู้ประกอบธุรกิจต้องดำเนินการให้มีการวางหรือเรียกหลักประกันจากผู้ยืมหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ ดังต่อไปนี้

(๑) การวางหลักประกันที่เป็นหลักทรัพย์ให้ทำโดยการโอนหลักประกันจากผู้ยืมไปให้แก่ผู้ให้ยืม

(๒) หลักประกันต้องปลอดจากบุริมสิทธิหรือภาระผูกพันใด ๆ โดยประเภทของหลักประกันให้เป็นไปตามที่สำนักงานประกาศกำหนด

(๓) รักษาสัดส่วนของมูลค่าหลักประกันต่อมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืมไม่ต่ำกว่าที่สำนักงานประกาศกำหนด

(๔) ปรับปรุงมูลค่าหลักประกันและมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืมให้เป็นปัจจุบันอย่างน้อยทุกสิ้นวันทำการ

ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจเป็นผู้ให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าผ่านบัญชีมาร์จิ้นตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขายหลักทรัพย์โดยที่บริษัทหลักทรัพย์ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง การวางหรือเรียกหลักประกันและการรักษาสัดส่วนของมูลค่าหลักประกันต่อมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืมจากลูกค้าดังกล่าวให้เป็นไปตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการปฏิบัติงานเกี่ยวกับการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์และการให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าที่มิใช่ลูกค้าสถาบันเพื่อขายชอร์ต

ข้อ ๗ ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจจัดให้มีการให้ยืมหลักทรัพย์ในฐานะตัวแทนของผู้ให้ยืม ผู้ประกอบธุรกิจต้องดำเนินการเพิ่มเติม ดังต่อไปนี้

(๑) ดูแลรักษาหลักประกัน และเรียกหลักประกันเพิ่มจากผู้ยืม ในกรณีที่จำเป็นต้องรักษาสัดส่วนของมูลค่าหลักประกันต่อมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืมเพื่อให้เป็นไปตามข้อ ๖ วรรคหนึ่ง (๓)

(๒) ติดตามดูแลให้ผู้ให้ยืมได้รับสิทธิประโยชน์ในหลักทรัพย์ที่ให้ยืมจากผู้ออกหลักทรัพย์

ข้อ ๘ ในกรณีที่ผู้ให้ยืมเป็นลูกค้าสถาบัน ผู้ประกอบธุรกิจและผู้ให้ยืมดังกล่าวอาจมีข้อตกลงที่ระบุไว้อย่างชัดเจนที่จะไม่นำข้อกำหนดในข้อ ๖ หรือข้อ ๗ มาใช้ในการดำเนินการ หรือมีข้อตกลงในเรื่องดังกล่าวเป็นประการอื่นก็ได้

ส่วนที่ ๒
การขอจำกัดขอบเขตการประกอบกิจการ

ข้อ ๙ ในการยื่นคำขอรับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทกิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ หากผู้ยื่นคำขอรายใดขอจำกัดขอบเขตการประกอบกิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ของตนไว้ ไม่ว่าการจำกัดขอบเขตจะเป็นไปในรูปแบบใด

เมื่อผู้ยื่นคำขอรายนั้นได้รับใบอนุญาตแล้ว การประกอบกิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ของผู้รับใบอนุญาตดังกล่าวต้องอยู่ภายในขอบเขตธุรกิจที่ขอจำกัดไว้

ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจตามวรรคหนึ่งประสงค์จะขอผ่อนคลายหรือยกเลิกการจำกัดขอบเขตในการประกอบธุรกิจ ผู้ประกอบธุรกิจรายนั้นต้องได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานก่อน ทั้งนี้ตามขั้นตอนและวิธีการที่ระบุไว้ในคู่มือสำหรับประชาชน โดยในการขอรับความเห็นชอบผู้ประกอบธุรกิจจะต้องแสดงได้ว่ามีความพร้อมและสามารถปฏิบัติงานในส่วนที่ใช้บังคับกับธุรกิจส่วนที่ขอผ่อนคลายหรือยกเลิกข้อจำกัดนั้นได้ในเรื่อง ดังต่อไปนี้

(๑) ระบบงานในการปฏิบัติการหรือการให้บริการ

(๒) ระบบการควบคุมภายใน

(๓) ระบบการบริหารความเสี่ยง

(๔) ระบบป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์

(๕) ระบบป้องกันการรั่วไหลของข้อมูลระหว่างหน่วยงานและผู้ปฏิบัติงาน

(๖) ระบบรักษาความปลอดภัยของข้อมูลและทรัพย์สินของลูกค้า

(๗) ระบบการจัดเก็บเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับการทำธุรกรรม

ประกาศ ณ วันที่ ๓๐ กันยายน พ.ศ. ๒๕๖๘

(นางพรอนงค์ บุษราตระกูล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน