ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. ๓๖/๒๕๖๘

เรื่อง ข้อกำหนดเกี่ยวกับระบบงานและหลักประกัน
ในธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

อาศัยอำนาจตามความในข้อ ๕ (๓) และข้อ ๖ วรรคหนึ่ง (๒) และ (๓) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๓๖/๒๕๖๘ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทกิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ ลงวันที่ ๓๐ กันยายน พ.ศ. ๒๕๖๘ และข้อ ๒ (๓) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๒๙/๒๕๖๗ เรื่อง หลักเกณฑ์และกำหนดเวลาในการยื่นรายงานของบริษัทหลักทรัพย์ ลงวันที่ ๖ กันยายน พ.ศ. ๒๕๖๗ สำนักงานออกประกาศไว้ ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ ๑๖ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๘ เป็นต้นไป เว้นแต่ข้อ ๔ และข้อ ๕ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ ๑๖ เมษายน พ.ศ. ๒๕๖๙ เป็นต้นไป

ข้อ ๒ ในประกาศนี้

“ผู้ประกอบธุรกิจ” หมายความว่า ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทกิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

“หลักประกันเริ่มต้น” หมายความว่า จำนวนทรัพย์สินขั้นต่ำที่ผู้ยืมต้องวางเป็นประกันก่อนที่จะยืมหลักทรัพย์รายการใดรายการหนึ่ง

“มูลค่าการลงทุนสุทธิ” (net exposure) หมายความว่า มูลค่าการลงทุนสุทธิในทรัพย์สินไม่ว่าเป็นการลงทุนโดยตรงหรือโดยอ้อมผ่านการลงทุนในตราสาร สัญญา หรือคริปโทแอสเซ็ทที่ให้ผลตอบแทนโดยอ้างอิงอยู่กับทรัพย์สิน ซึ่งเป็นผลให้กองทุนรวมมีความเสี่ยงในทรัพย์สินนั้น

“คริปโทแอสเซ็ท” หมายความว่า ทรัพย์สิน ดังต่อไปนี้

(๑) คริปโทเคอร์เรนซีตามกฎหมายว่าด้วยการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล

(๒) โทเคนดิจิทัลเพื่อการใช้ประโยชน์ที่มิได้มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อการอุปโภคบริโภค หรือเป็นการรับรอง (certificate) หรือแทนเอกสารสิทธิใด ๆ

“โทเคนดิจิทัลเพื่อการใช้ประโยชน์” (utility token) หมายความว่า หน่วยข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ซึ่งถูกสร้างขึ้นบนระบบหรือเครือข่ายอิเล็กทรอนิกส์โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อกำหนดสิทธิในการได้มาซึ่งสินค้าหรือบริการหรือสิทธิอื่นใดที่เฉพาะเจาะจง ทั้งนี้ ตามที่กำหนดในข้อตกลงระหว่างผู้ออกและผู้ถือ

“วันทำการ” หมายความว่า วันเปิดทำการตามปกติของบริษัทจัดการกองทุนรวม

“วันทำการซื้อขายหน่วยลงทุน” หมายความว่า วันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนที่กำหนดไว้ในโครงการ

คำว่า “เงินกองทุน” ให้มีความหมายเช่นเดียวกับบทนิยามของคำดังกล่าวที่กำหนดไว้ในประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการปฏิบัติงานเกี่ยวกับการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์และการให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าที่มิใช่ลูกค้าสถาบันเพื่อขายชอร์ต

หมวด ๑
ข้อกำหนดทั่วไป

ข้อ ๓ ผู้ประกอบธุรกิจต้องจัดให้มีระบบบริหารความเสี่ยงอย่างน้อยในเรื่อง ดังต่อไปนี้

(๑) การวางหรือเรียกหลักประกันที่สอดคล้องกับผลการวิเคราะห์ความเสี่ยงของคู่สัญญา

(๒) การคัดเลือกหลักทรัพย์ที่ยืมหรือให้ยืม หรือที่เป็นหลักประกันอย่างเหมาะสม โดยคำนึงถึงสภาพคล่องและผลกระทบที่จะมีต่อการประกอบธุรกิจในภาพรวม

(๓) การประมวลผลและรายงานข้อมูลให้ผู้บริหารทราบถึงระดับความเสี่ยงในธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

(๔) การปรับปรุงการบริหารความเสี่ยงให้สอดคล้องกับปริมาณและความซับซ้อนของการทำธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์อย่างสม่ำเสมอ

ข้อ ๔ ห้ามมิให้ผู้ประกอบธุรกิจมียอดหนี้คงค้างเนื่องจากการให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าที่มิใช่ลูกค้าสถาบันรายใดรายหนึ่ง เมื่อสิ้นวันหนึ่ง ๆ เกินกว่าร้อยละ ๒๐ ของเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ และห้ามมิให้ผู้ประกอบธุรกิจมียอดหนี้คงค้างของลูกค้าที่มิใช่ลูกค้าสถาบันทุกรายรวมกันภายหลังหักค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญแล้ว เมื่อสิ้นวันหนึ่ง ๆ เกินกว่า ๔ เท่าของเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ

การให้ยืมหลักทรัพย์แก่บุคคลที่เกี่ยวข้องกับลูกค้ารายใดตามนัยมาตรา ๒๕๘ แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. ๒๕๓๕ ให้นับรวมเป็นการให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าตามวรรคหนึ่งด้วย โดยอนุโลม

เพื่อประโยชน์ในการคำนวณยอดหนี้คงค้างตามวรรคหนึ่ง ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจมีการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์แก่ลูกค้าที่มิใช่ลูกค้าสถาบันตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการปฏิบัติงานเกี่ยวกับการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์และการให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าที่มิใช่ลูกค้าสถาบันเพื่อขายชอร์ต ให้ผู้ประกอบธุรกิจนับรวมยอดหนี้คงค้างเนื่องจากการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์ดังกล่าวเป็นยอดหนี้คงค้างตามวรรคหนึ่งด้วย โดยอนุโลม

ความในวรรคหนึ่งมิให้นำมาใช้กับกรณีที่ยอดหนี้คงค้างของลูกค้ารายใดรายหนึ่งหรือทุกรายรวมกันสูงกว่าอัตราที่กำหนดเนื่องจากเหตุใดเหตุหนึ่ง ดังต่อไปนี้

(๑) หลักทรัพย์ที่ยืมมีมูลค่าสูงขึ้น

(๒) การเรียกเก็บดอกเบี้ยตามข้อ ๕ (๖) ของประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๔๕/๒๕๖๑ เรื่อง การปฏิบัติงานเกี่ยวกับการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์และการให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าที่มิใช่ลูกค้าสถาบันเพื่อขายชอร์ต ลงวันที่ ๑๔ กันยายน พ.ศ. ๒๕๖๑

(๓) การซื้อหลักทรัพย์เพื่อนำมาคืนการยืมหลักทรัพย์เพื่อขายชอร์ต

(๔) เงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจลดลง

ในกรณีที่ยอดหนี้คงค้างของลูกค้าที่มิใช่ลูกค้าสถาบันรายใดรายหนึ่งหรือทุกรายรวมกันสูงเกินกว่าอัตราที่กำหนดตามวรรคหนึ่ง ไม่ว่าการนั้นจะเกิดขึ้นเนื่องจากเหตุใด ห้ามมิให้ผู้ประกอบธุรกิจให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้ารายดังกล่าวเพิ่มขึ้นอีกจนกว่ายอดหนี้คงค้างของลูกค้ารายนั้นจะเป็นไปตามอัตราที่กำหนด และห้ามมิให้ผู้ประกอบธุรกิจให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้ารายใดเพิ่มเติมอีกจนกว่ายอดหนี้คงค้างของลูกค้าทุกรายรวมกันภายหลังหักค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญจะเป็นไปตามอัตราที่กำหนดแล้วแต่กรณี

ข้อ ๕ ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจมียอดหนี้คงค้างเนื่องจากการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์แก่ลูกค้าทุกรายรวมกันภายหลังหักค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญแล้ว เมื่อสิ้นวันหนึ่ง ๆ เกินกว่า ๓.๕ เท่าของเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ ให้ผู้ประกอบธุรกิจจัดทำแผนเพื่อกำหนดแนวทางการแก้ไขปัญหายอดหนี้คงค้างเกินกว่าอัตราดังกล่าว ซึ่งต้องได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการของผู้ประกอบธุรกิจหรือคณะกรรมการที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการของผู้ประกอบธุรกิจ โดยมีรายละเอียด ดังต่อไปนี้

(๑) การดำเนินการเพื่อให้มียอดหนี้คงค้างกลับมาอยู่ในอัตราที่ไม่เกิน ๓.๕ เท่าของเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ

(๒) การบริหารความเสี่ยงและการป้องกันเพื่อไม่ให้มียอดหนี้คงค้างเกินกว่า ๓.๕ เท่าของเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ

ให้ผู้ประกอบธุรกิจจัดส่งแผนกำหนดแนวทางการแก้ไขปัญหายอดหนี้คงค้างตามวรรคหนึ่งต่อสำนักงานภายใน ๓๐ วันนับแต่วันที่ผู้ประกอบธุรกิจมียอดหนี้คงค้างเกินกว่าอัตราที่กำหนด เว้นแต่ก่อนครบกำหนดระยะเวลาจัดส่งแผนดังกล่าว ผู้ประกอบธุรกิจมียอดหนี้คงค้างไม่เกินอัตราที่กำหนดตามวรรคหนึ่งเป็นระยะเวลา ๗ วันทำการติดต่อกัน

ในกรณีมีเหตุจำเป็นและสมควรทำให้ผู้ประกอบธุรกิจไม่สามารถจัดส่งแผนตามวรรคหนึ่งภายในระยะเวลาที่กำหนด ให้ผู้ประกอบธุรกิจยื่นคำขอขยายระยะเวลาการจัดส่งแผน พร้อมทั้งเอกสารหลักฐานประกอบคำขอตามคู่มือสำหรับประชาชนต่อสำนักงานก่อนครบกำหนดเวลาการยื่นแผนดังกล่าว ทั้งนี้ ตามขั้นตอนและวิธีการที่ระบุไว้ในคู่มือสำหรับประชาชน

หมวด ๒
ประเภทของหลักประกัน การรักษาสัดส่วนของมูลค่าหลักประกันต่อมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม และการคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์และหลักประกัน

ข้อ ๖ ให้ทรัพย์สิน ตราสารทางการเงิน และหนังสือสัญญา ดังต่อไปนี้ สามารถนำไปใช้เป็นหลักประกันการให้ยืมหลักทรัพย์ที่ผู้ประกอบธุรกิจอาจดำเนินการให้มีการวางหรือเรียกหลักประกันได้

(๑) เงินสด

(๒) หลักทรัพย์จดทะเบียน

(๓) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมเปิดตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการลงทุนของกองทุน ดังนี้ แต่ไม่รวมถึงหน่วยลงทุนที่มีข้อจำกัดการโอน

(ก) กองทุนรวมดัชนี

(ข) กองทุนรวมหน่วยลงทุน

(ค) กองทุนรวมฟีดเดอร์

กองทุนรวมตามวรรคหนึ่ง ต้องมีนโยบายการลงทุนซึ่งจะส่งผลให้มีมูลค่าการลงทุนสุทธิที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงต่างประเทศโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ ๘๐ ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม มีการกำหนดวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนทุกวันทำการ (daily redemption

fund) และมีการกำหนดให้ชำระค่าขายคืนหน่วยลงทุนให้แก่ผู้ขายคืนหน่วยลงทุนในระยะเวลาไม่เกิน ๕ วันทำการนับแต่วันรับซื้อคืนหน่วยลงทุน

(๔) ตั๋วเงินคลัง

(๕) พันธบัตรรัฐบาลไทย

(๖) พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย

(๗) พันธบัตรหรือตราสารแห่งหนี้ที่กระทรวงการคลังเป็นผู้รับอาวัลทั้งจำนวน หรือเป็นผู้ค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข หรือที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงินเป็นผู้ออกหรือค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข

(๘) ตราสารแห่งหนี้ที่ตัวตราสารนั้นเอง หรือผู้ออกตราสาร ผู้ค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข ผู้รับรองโดยเป็นการรับรองตลอดไป ผู้รับอาวัลทั้งจำนวน หรือผู้สลักหลังโอนประเภทมีสิทธิไล่เบี้ยทั้งจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือตั้งแต่ระดับ BBB ขึ้นไปหรือเทียบเท่า

(๙) บัตรเงินฝากที่ธนาคารพาณิชย์หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก

(๑๐) หนังสือค้ำประกันที่สถาบันการเงินออกให้ไว้แก่ผู้ให้ยืมหลักทรัพย์เพื่อเป็นประกันการยืมหลักทรัพย์ของผู้ยืม โดยสถาบันการเงินนั้นยินยอมรับผิดในฐานะลูกหนี้ชั้นต้น ทั้งนี้ ไม่ว่าหนังสือนั้นจะออกเป็นเล็ตเตอร์ออฟเครดิตหรือหนังสือค้ำประกัน

ข้อ ๗ ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจให้ยืมหลักทรัพย์แก่ผู้ยืมที่มิใช่ลูกค้าสถาบัน ผู้ประกอบธุรกิจต้องดำเนินการเรียกหลักประกันและรักษาสัดส่วนของมูลค่าหลักประกันต่อมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืมตามหลักเกณฑ์ ดังต่อไปนี้

(๑) เรียกให้ผู้ยืมวางหลักประกันเริ่มต้นไม่ต่ำกว่าร้อยละ ๑๕๐ ของมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม

ผู้ประกอบธุรกิจอาจดำเนินการเรียกหลักประกันเริ่มต้นต่ำกว่าอัตราที่กำหนดในวรรคหนึ่งได้ ภายใต้หลักเกณฑ์ดังนี้

(ก) ผู้ประกอบธุรกิจทำหน้าที่เป็นนายหน้าหรือตัวแทนของผู้ยืมในการขายหลักทรัพย์ที่ยืมดังกล่าว และสามารถขายหลักทรัพย์นั้นได้ภายในวันที่ยืมหลักทรัพย์

(ข) ผู้ยืมมีข้อตกลงยินยอมให้ผู้ประกอบธุรกิจนำเงินค่าขายหลักทรัพย์ที่ผู้ยืมจะได้รับจากการขายตาม (ก) มาเป็นหลักประกัน โดยเงินค่าขายหลักทรัพย์ดังกล่าวเมื่อรวมกับหลักประกันเริ่มต้นต้องไม่ต่ำกว่าร้อยละ ๑๕๐ ของมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม

(๒) เมื่อมูลค่าหลักประกันอยู่ในระดับต่ำกว่าร้อยละ ๑๔๐ ของมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม ผู้ประกอบธุรกิจต้องเรียกให้ผู้ยืมวางหลักประกันเพิ่มเพื่อให้สัดส่วนมูลค่าหลักประกันต่อมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืมไม่ต่ำกว่าร้อยละ ๑๔๐ ของมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม

(๓) ดำเนินการให้ผู้ยืมวางหลักประกันเพิ่มตาม (๒) ให้แล้วเสร็จก่อนเวลาปิดทำการซื้อขายหลักทรัพย์ที่ยืมไม่น้อยกว่า ๑ ชั่วโมงในวันทำการถัดจากวันที่ได้เรียกให้ผู้ยืมวางหลักประกันเพิ่ม

(๔) ในกรณีที่ผู้ยืมไม่สามารถวางหลักประกันเพิ่มตาม (๓) ได้ ห้ามมิให้ผู้ประกอบธุรกิจให้ยืมหลักทรัพย์แก่ผู้ยืมรายนั้นเพิ่มอีกจนกว่าจะได้ดำเนินการให้เป็นไปตาม (๒) แล้ว

ข้อ ๘ ผู้ประกอบธุรกิจที่กระทำการในฐานะ ดังต่อไปนี้ ต้องดำรงมูลค่าหลักประกันที่ผู้ให้ยืมได้รับให้อยู่ในระดับไม่ต่ำกว่าร้อยละ ๑๐๐ ของมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม

(๑) ตัวแทนของผู้ให้ยืม

(๒) ผู้ยืมหรือตัวแทนของผู้ยืม ในกรณีที่ผู้ให้ยืมมิได้เป็นผู้ประกอบธุรกิจหรือมิได้มีการแต่งตั้งผู้ประกอบธุรกิจเป็นตัวแทนในการให้ยืมหลักทรัพย์

ข้อ ๙ ในกรณีที่เป็นการยืมหลักทรัพย์โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ให้แก่ผู้ได้รับการจัดสรรหุ้นส่วนเกินสำหรับการจองซื้อหุ้นเกินกว่าจำนวนที่จัดจำหน่ายตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้ ให้ผู้ประกอบธุรกิจที่กระทำการในฐานะเดียวกับที่กำหนดในข้อ ๘ ดำรงมูลค่าหลักประกันที่ผู้ให้ยืมได้รับให้อยู่ในระดับไม่ต่ำกว่าราคาใช้สิทธิซื้อหลักทรัพย์ตามสิทธิที่ผู้จัดหาหุ้นส่วนเกินตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการจัดสรรหุ้นเกินกว่าจำนวนที่จัดจำหน่าย ได้รับจากบริษัทมหาชนจำกัดหรือจากผู้ถือหุ้นเดิมของบริษัทดังกล่าวคูณด้วยจำนวนหลักทรัพย์ที่ให้ยืม

(๑) ผู้ยืมเป็นผู้จัดหาหุ้นส่วนเกิน และได้ดำเนินการดังนี้

(ก) วางเงินสดไว้แก่ผู้ให้ยืมเพื่อเป็นหลักประกันการยืมหลักทรัพย์

(ข) เปิดเผยข้อมูลความเสี่ยงต่อผู้ให้ยืมเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงมูลค่าของหลักทรัพย์ที่ให้ยืมซึ่งอาจทำให้หลักประกันที่ผู้ให้ยืมได้รับไว้ไม่เพียงพอที่จะไปซื้อหลักทรัพย์ดังกล่าวคืนในกรณีที่ผู้ยืมไม่สามารถคืนหลักทรัพย์แก่ผู้ให้ยืมได้ รวมทั้งดำเนินการให้ผู้ให้ยืมรับทราบความเสี่ยงดังกล่าวเป็นลายลักษณ์อักษรเป็นรายกรณี

(ค) แยกหลักทรัพย์ที่ได้ซื้อมาเพื่อการส่งคืนให้แก่ผู้ให้ยืมไว้ต่างหากจากทรัพย์สินของผู้ยืมและได้จัดทำบัญชีทรัพย์สินดังกล่าวแยกออกจากบัญชีทรัพย์สินของตนในระหว่างที่ผู้ยืมทำการทยอยซื้อหลักทรัพย์คืนแก่ผู้ให้ยืม โดยผู้ยืมจะไม่นำหลักทรัพย์ที่แยกไว้เพื่อการส่งคืนดังกล่าวไปใช้เพื่อการอื่น

(๒) ผู้ยืมที่มิได้เป็นผู้จัดหาหุ้นส่วนเกิน แต่ได้ยืมหลักทรัพย์เพื่อนำมาให้ผู้จัดหาหุ้นส่วนเกินยืมต่ออีกทอดหนึ่ง โดยผู้ยืมและผู้จัดหาหุ้นส่วนเกินดังกล่าวได้ดำเนินการตามเงื่อนไขใน (๑) (ก) และ (ข) และผู้จัดหาหุ้นส่วนเกินนั้นได้ดำเนินการตามเงื่อนไขใน (๑) (ค) ด้วยแล้ว

ข้อ ๑๐ ในการคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืมและมูลค่าหลักประกันที่มิใช่เงินสด เล็ตเตอร์ออฟเครดิต หรือหนังสือค้ำประกันที่ออกโดยสถาบันการเงิน ที่เป็นสกุลเงินบาท ให้ผู้ประกอบธุรกิจคำนวณตามวิธีใดวิธีหนึ่ง ดังต่อไปนี้

(๑) ให้ใช้ราคาปิด ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่คำนวณมูลค่าที่ประกาศโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย หรือราคาอ้างอิง ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่คำนวณมูลค่าที่ประกาศโดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย Reuters Bloomberg หรือผู้ประกอบธุรกิจให้บริการข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สำนักงานยอมรับ

(๒) ให้ใช้ราคาที่เห็นว่าสามารถสะท้อนถึงมูลค่าตลาดในปัจจุบันของหลักทรัพย์หรือหลักประกันแต่ละประเภท

บทเฉพาะกาล

ข้อ ๑๑ ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจมีลูกค้าที่นำหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอื่นนอกจากที่กำหนดไว้ในข้อ ๖ (๓) มาเป็นหลักประกันการให้ยืมหลักทรัพย์ก่อนวันที่ประกาศนี้มีผลใช้บังคับ ผู้ประกอบธุรกิจอาจรับหน่วยลงทุนดังกล่าวไว้เป็นหลักประกันการให้ยืมหลักทรัพย์ต่อไปได้

ข้อ ๑๒ ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจมียอดหนี้คงค้างเนื่องจากการให้ยืมหลักทรัพย์เกินกว่าอัตราที่กำหนดตามข้อ ๔ ก่อนวันที่ประกาศนี้มีผลใช้บังคับ ให้ผู้ประกอบธุรกิจดำเนินการแก้ไขให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในข้อ ๔ ภายใน ๑ ปีนับแต่วันที่ประกาศนี้มีผลใช้บังคับ

ประกาศ ณ วันที่ ๓๐ กันยายน พ.ศ. ๒๕๖๘

(นางพรอนงค์ บุษราตระกูล)
เลขาธิการ
สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์