

คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ กก. 16 /2538

เรื่อง การดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของบริษัทหลักทรัพย์

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 14 และมาตรา 97 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์
และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 คณะกรรมการ ก.ล.ต. ออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

"เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ" หมายความว่า เงินกองทุนสภาพคล่องหักด้วยค่าความเสี่ยง

"เงินกองทุนสภาพคล่อง" หมายความว่า ผลรวมของรายการดังต่อไปนี้หักด้วยหนี้สินรวม

(1) เงินสดและเงินฝากธนาคาร

(2) เงินลงทุนในหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ว่าด้วยการซื้อขายพันธบัตรโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนหรือขายคืน รวมดอกเบี้ยค้างรับ

(3) ตั๋วสัญญาใช้เงินและตั๋วแลกเงินที่ออกโดยสถาบันการเงินตามกฎหมายว่าด้วยดอกเบี้ย
เงินให้กู้ยืมของสถาบันการเงิน

(4) เงินลงทุนในหลักทรัพย์และตราสารแห่งอื่น

(5) ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์

(6) รายการอื่นตามที่สำนักงานประกาศกำหนด

"หนี้สินรวม" หมายความว่า ผลรวมของหนี้สินทุกประเภท แต่ไม่รวมถึงตราสารแสดงสิทธิ
ในหนี้ที่มีกำหนดสิทธิของเจ้าหนี้ไว้โดยกว่าสิทธิของเจ้าหนี้สามัญทั่วไป และหนี้สินอื่นตามที่สำนักงาน
ประกาศกำหนด

"ค่าความเสี่ยง" หมายความว่า

(1) ค่าความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการเป็นนายหน้าซื้อขาย
หลักทรัพย์

(2) ค่าความเสี่ยงจากเงินลงทุนในหลักทรัพย์และตราสารแห่งอื่น

(3) ค่าความเสี่ยงจากหลักทรัพย์ที่อาจคงเหลือจากการรับประกันการจัดจำหน่าย

(4) ค่าความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทอื่นใดตามที่สำนักงานประกาศ
กำหนด

"บริษัทหลักทรัพย์" หมายความว่า บริษัทที่ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์
แต่ไม่รวมถึง

- (1) สถาบันการเงินที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายอื่น
- (2) บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการ

กองทุนรวม

"สำนักงาน" หมายความว่า สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

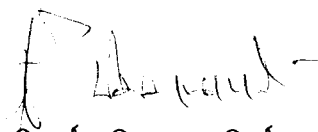
ข้อ 2 ให้บริษัทหลักทรัพย์ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเมื่อสิ้นวันหนึ่ง ๆ ไม่ต่ำกว่า

- (1) ร้อยละ 1 ของหนี้สินรวมตั้งแต่วันที่ 1 กันยายน 2538 จนถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2539
- (2) ร้อยละ 3 ของหนี้สินรวมตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2540 จนถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2541
- (3) ร้อยละ 5 ของหนี้สินรวมตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2542 จนถึงวันที่ 31 ธันวาคม 2543
- (4) ร้อยละ 7 ของหนี้สินรวมตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2544 เป็นต้นไป

การคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิตามวรรคหนึ่ง ให้บริษัทหลักทรัพย์คำนวณตามแบบ และ
รายละเอียดประกอบกรคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่สำนักงานประกาศกำหนด

ข้อ 3 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กันยายน พ.ศ. 2538 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 30 มิถุนายน พ.ศ. 2538


(นายธารินทร์ นิมมานเหมินท์)

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์