

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. 31 /2557

เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับบริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถ

ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 141 วรรคหนึ่ง (2) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์
และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 โดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการกำกับตลาดทุน
สำนักงานออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“บริษัทหลักทรัพย์” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ซึ่งมีหน้าที่ดำรงเงินกองทุน
สภาพคล่องสุทธิตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

“ประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ” หมายความว่า ประกาศ
คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

ข้อ 2 ให้บริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตาม
ประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิปฏิบัติดังต่อไปนี้

(1) จัดทำและยื่นแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ต่อสำนักงานภายในสามสิบวันนับแต่วันแรกที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุน
สภาพคล่องสุทธิได้ เว้นแต่ก่อนครบกำหนดระยะเวลาดังกล่าวสามารถดำรงเงินกองทุน
สภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิไม่น้อยกว่าเจ็ดวันทำการ
ติดต่อกัน

(2) ดำเนินการตามแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ที่ได้ยื่นต่อสำนักงานตาม (1) เพื่อให้สามารถกลับมาดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตาม
ประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ภายในระยะเวลาที่กำหนดในแผนดังกล่าวซึ่งต้อง
ไม่เกินเก้าสิบวันนับแต่วันแรกที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้

ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควร สำนักงานอาจผ่อนผันระยะเวลาในการดำเนินการ
ตามวรรคหนึ่งได้ ทั้งนี้ ให้บริษัทหลักทรัพย์ที่ประสงค์จะขอผ่อนผันระยะเวลาดังกล่าวยื่นคำขอ
เป็นหนังสือพร้อมแสดงเหตุผลต่อสำนักงานล่วงหน้าไม่น้อยกว่าสิบวันก่อนครบกำหนดระยะเวลา
ตามวรรคหนึ่ง

ข้อ 3 ในระหว่างที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ หรืออยู่ในระหว่างการดำเนินการตามข้อ 2 ห้ามมิให้บริษัทหลักทรัพย์นั้นดำเนินการดังต่อไปนี้ จนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิและได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ประกอบธุรกิจได้ตามปกติ

- (1) การเพิ่มวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ให้แก่ลูกค้าบัญชีเงินสด เว้นแต่เป็นการซื้อหลักทรัพย์ที่ลูกค้าได้วางเงินไว้กับบริษัทหลักทรัพย์ หรือเป็นการขายหลักทรัพย์ของลูกค้าที่อยู่ในความครอบครองของบริษัทหลักทรัพย์แล้ว
- (2) การเพิ่มยอดหนี้คงค้างของลูกค้าบัญชีมาร์จินหรือลูกค้าที่ยืมหลักทรัพย์จากยอดหนี้คงค้างที่ปรากฏในวันแรกที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ เว้นแต่เป็นการเพิ่มยอดหนี้คงค้างเนื่องจากเหตุใดเหตุหนึ่งดังนี้
 - (ก) ดอกเบี้ยค้างรับ
 - (ข) หลักทรัพย์ที่ลูกค้ายืมมีมูลค่าสูงขึ้น
 - (ค) การซื้อหลักทรัพย์เพื่อนำมาคืนการยืมหลักทรัพย์เพื่อขายชอร์ต
- (3) การให้บริการหรือการเปิดบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ แก่ลูกค้ารายใหม่
- (4) การเพิ่มเงินลงทุนของบริษัท (portfolio) เว้นแต่เป็นการลงทุนดังนี้
 - (ก) การลงทุนในเงินฝาก หรือหน่วยลงทุนกองทุนรวมตลาดเงินในประเทศ
 - (ข) การลงทุนเพื่อป้องกันความเสี่ยงจากเงินลงทุนหรือภาระผูกพันของบริษัทที่มีอยู่ก่อนหรือในวันแรกที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
 - (ค) การลงทุนเนื่องจากมีภาระผูกพันในฐานะเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องในการซื้อขายหลักทรัพย์ ซึ่งบริษัทหลักทรัพย์ได้ทำการป้องกันความเสี่ยงจากการลงทุนดังกล่าวไว้แล้วอย่างเต็มจำนวน
 - (ง) การลงทุนเนื่องจากเกิดความผิดพลาดในการส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ให้แก่ลูกค้า (error port)
- (5) การทำสัญญารับประกันการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์เพิ่มเติมจากสัญญาที่มีผลผูกพันอยู่ก่อนวันที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

(6) การเพิ่มมูลค่าเงินทุนที่รับบริหารให้แก่ลูกค้านักบัญชีกองทุนส่วนบุคคล หรือ การเปิดบัญชีกองทุนส่วนบุคคลให้แก่ลูกค้ารายใหม่

(7) การสลักหลัง รับอ่าวัด หรือให้การรับรองตัวเงิน หรือการเป็นผู้ค้ำประกัน ในนิติกรรมใด ๆ ที่เกี่ยวเนื่องในการประกอบธุรกิจของบริษัทหลักทรัพย์แก่ลูกค้า เว้นแต่ลูกค้า ได้วางเงินสดเป็นหลักประกันเต็มจำนวนไว้กับบริษัทหลักทรัพย์

(8) การกระทำอื่นใดที่มีลักษณะเป็นการเพิ่มความเสี่ยงต่อฐานะการเงิน การดำเนินงาน หรือการปฏิบัติตามข้อตกลงกับลูกค้า ทั้งนี้ ตามที่สำนักงานกำหนด

ข้อ 4 ในกรณีที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้แก่บริษัทหลักทรัพย์ ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ให้บริษัทหลักทรัพย์ดังกล่าวดำเนินการตามที่กำหนดในข้อ 5

(1) ไม่สามารถยื่นแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ต่อสำนักงานตามระยะเวลาที่กำหนดในข้อ 2(1) หรือข้อ 2 วรรคสอง แล้วแต่กรณี

(2) ไม่สามารถแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามแผน และระยะเวลาที่กำหนดตามข้อ 2(2) หรือข้อ 2 วรรคสอง แล้วแต่กรณี

(3) มีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่ำกว่าศูนย์ติดต่อกันเกินห้าวันทำการ

(4) มีการผิคนัดชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชีหรือต่อลูกค้า

ข้อ 5 ให้บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งตามข้อ 4 ดำเนินการ ดังต่อไปนี้

(1) ระงับการดำเนินธุรกิจทุกประเภทจนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ และได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ดำเนินธุรกิจ ได้ตามปกติ ทั้งนี้ ไม่รวมถึงการป้องกันความเสี่ยงโดยรวมในเงินลงทุนของบริษัทหรือการดำเนินการ ตามภาระผูกพันที่ค้างอยู่

(2) ส้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีไว้เพื่อตนเอง เว้นแต่เป็นกรณีใดหนึ่งดังนี้

(ก) สัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าวมีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ป้องกันความเสี่ยง จากเงินลงทุนหรือภาระผูกพันของบริษัทหลักทรัพย์

(ข) การมีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้านั้นไม่ทำให้บริษัทหลักทรัพย์มีภาระ ผูกพันหรือก่อหนี้เพิ่มเติมในภายหลัง

(3) โอนทรัพย์สินของลูกค้าในบัญชีเงินสดไปยังบริษัทหลักทรัพย์อื่นเพื่อการเก็บรักษา ทรัพย์สินของลูกค้า ให้แล้วเสร็จภายในสิบวันทำการนับแต่วันที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งตามข้อ 4 เว้นแต่จะได้รับการผ่อนผันระยะเวลาจากสำนักงานเนื่องจากมีเหตุจำเป็นและสมควร ทั้งนี้ หากมี ค่าใช้จ่ายเกิดขึ้นจากการดำเนินการดังกล่าว ให้บริษัทหลักทรัพย์เป็นผู้รับผิดชอบค่าใช้จ่ายนั้น

(4) กรณีเป็นบริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ การค้าหลักทรัพย์ หรือการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยลงทุน ให้บริษัทหลักทรัพย์ดำเนินการดังนี้ด้วย

(ก) ดำเนินการให้ลูกค้าแต่ละรายเป็นผู้มีชื่อเป็นผู้ถือหน่วยลงทุนของกองทุนรวมโดยตรง

(ข) โอนบัญชีการซื้อขายหน่วยลงทุนของลูกค้าแต่ละรายไปยังบริษัทหลักทรัพย์ประเภทใดประเภทหนึ่งดังต่อไปนี้เป็นผู้ให้บริการแทน ทั้งนี้ ตามที่ลูกค้าแจ้งความประสงค์ไว้

1. บริษัทหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวมซึ่งเป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุนรวมนั้น ๆ

2. บริษัทหลักทรัพย์ประเภทการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ การค้าหลักทรัพย์ หรือการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ ที่สามารถให้บริการซื้อขายหน่วยลงทุนได้

(ค) ดำเนินการตาม (ก) และ (ข) ให้แล้วเสร็จภายในห้าวันทำการนับแต่วันที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งตามข้อ 4 เว้นแต่จะได้รับการผ่อนผันระยะเวลาจากสำนักงานเนื่องจากมีเหตุจำเป็นและสมควร ทั้งนี้ หากมีค่าใช้จ่ายเกิดขึ้นจากการดำเนินการดังกล่าว ให้บริษัทหลักทรัพย์เป็นผู้รับผิดชอบค่าใช้จ่ายนั้น

(5) แจ้งให้ลูกค้าทราบเป็นลายลักษณ์อักษรถึงการดำเนินการตาม (1) (3) หรือ (4) แล้วแต่กรณี โดยไม่ชักช้า

(6) กระทำการหรืองดเว้นการกระทำอื่นใดตามที่สำนักงานกำหนด เพื่อให้บริษัทหลักทรัพย์สามารถกลับมาดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

ข้อ 6 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน พ.ศ. 2557 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 23 กันยายน พ.ศ. 2557

(นายวรพล โสคติยานุรักษ์)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์