



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. 1 /2559

เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณ

เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 3 วรรคสาม แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 18/2549 เรื่อง การดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ลงวันที่ 2 พฤษภาคม พ.ศ. 2549 และข้อ 1(3) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. 59/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์และกำหนดเวลาในการยื่นรายงานของบริษัทหลักทรัพย์ ลงวันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2552 สำนักงานออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิก

- (1) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 23/2549 เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ลงวันที่ 8 พฤษภาคม พ.ศ. 2549
- (2) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 24/2550 เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 20 สิงหาคม พ.ศ. 2550
- (3) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 2/2552 เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 14 มกราคม พ.ศ. 2552
- (4) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 2/2553 เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ฉบับที่ 4) ลงวันที่ 22 มกราคม พ.ศ. 2553
- (5) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 30/2554 เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ฉบับที่ 5) ลงวันที่ 23 มิถุนายน พ.ศ. 2554
- (6) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 20/2556 เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ฉบับที่ 6) ลงวันที่ 30 กรกฎาคม พ.ศ. 2556

(7) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ สร. 85/2558 เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ฉบับที่ 7)
ลงวันที่ 2 ธันวาคม พ.ศ. 2558

ข้อ 2 ในประกาศนี้

“บริษัทหลักทรัพย์” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ซึ่งมีหน้าที่ดำรงเงินกองทุน
สภาพคล่องสุทธิตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรง
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

“รายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ” หมายความว่า รายงานการคำนวณ
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิตามแบบและคำอธิบายประกอบการคำนวณที่กำหนดตามข้อ 3

ข้อ 3 ให้บริษัทหลักทรัพย์คำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิตามแบบ บ.ล. 4/1
และคำอธิบายประกอบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิตามแบบ บ.ล. 4/1 ที่จัดไว้บนเว็บไซต์
ของสำนักงาน

ข้อ 4 ให้บริษัทหลักทรัพย์จัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) จัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเป็นรายวันให้เสร็จสิ้น
ภายในวันทำการถัดไป โดยรายงานทุกฉบับต้องมีการลงลายมือชื่อรับรองความถูกต้อง โดยบุคคล
ผู้มีอำนาจลงนาม

(2) ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของวันทำการสุดท้ายของเดือน
ต่อสำนักงานภายในวันที่ 7 ของเดือนถัดไป

(3) ในกรณีที่บริษัทหลักทรัพย์มีหนี้สินค้ำประกันหรือสัญญาเช่าทางการเงินใด
ที่ไม่ต้องนับรวมไว้ใน การคำนวณหนี้สินรวม หรือมีเงินกู้ยืม หนี้กู้ หรือภาระผูกพันใดที่นับรวมไว้
ในการคำนวณหนี้สินพิเศษ ให้บริษัทหลักทรัพย์ส่งสำเนาสัญญาที่เกี่ยวข้องกับหนี้สินหรือภาระผูกพัน
ดังกล่าวต่อสำนักงานพร้อมกับแบบรายงานในงวดแรกที่บริษัทหลักทรัพย์นับรายการดังกล่าวรวมไว้
ในรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ และทุกครั้งที่มีการเปลี่ยนแปลงสัญญาดังกล่าว

(4) เก็บรักษารายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของทุกวันพร้อมหลักฐาน
ที่ใช้ประกอบการคำนวณรายงานดังกล่าวไว้เป็นเวลาไม่น้อยกว่า 1 ปีในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงาน
ตรวจสอบได้ หรือพร้อมที่จะจัดส่งให้แก่สำนักงานเมื่อได้รับการร้องขอ

ข้อ 5 เมื่อปรากฏว่าบริษัทหลักทรัพย์ใดมีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเมื่อสิ้นวันหนึ่งวันใดเท่ากับหรือน้อยกว่า 1.5 เท่าของเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิขั้นต่ำที่บริษัทหลักทรัพย์ต้องดำรงไว้ ให้บริษัทหลักทรัพย์นั้นยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของวันการเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของบริษัทหลักทรัพย์เท่ากับหรือน้อยกว่าอัตราข้างต้นและของทุกวันถัดไปต่อสำนักงานภายในวันทำการถัดจากวันที่บริษัทหลักทรัพย์ต้องจัดทำรายงานดังกล่าวไปแล้วเสร็จตามข้อ 4(1) จนกว่าบริษัทหลักทรัพย์จะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้มากกว่าอัตราที่กำหนดข้างต้นเป็นเวลาไม่น้อยกว่า 2 วันทำการติดต่อกัน และบริษัทหลักทรัพย์ได้ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของ 2 วันทำการนั้นต่อสำนักงานแล้ว เว้นแต่สำนักงานจะกำหนดให้ปฏิบัติเป็นประการอื่น

ข้อ 6 ในกรณีที่บริษัทหลักทรัพย์ประสงค์จะยื่นรายงานการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อสำนักงานในรูปของข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ ให้บริษัทหลักทรัพย์ยื่นรายงานดังกล่าวผ่านระบบรับส่งข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ โดยดำเนินการให้เป็นไปตามระเบียบวิธีปฏิบัติสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับส่งข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ พ.ศ. 2557

ข้อ 7 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม พ.ศ. 2559 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 18 มกราคม พ.ศ. 2559



(นายรพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์