

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. 31/2557

เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับบริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถ

ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้

(ฉบับประมวล)

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

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“บริษัทหลักทรัพย์” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ซึ่งมีหน้าที่ดำรงเงินกองทุน
สภาพคล่องสุทธิตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

“ประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ” หมายความว่า ประกาศ
คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

“กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ”¹ หมายความว่า กองทุนสำรองเลี้ยงชีพตามกฎหมายว่าด้วย
กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

ข้อ 2 ให้บริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตาม
ประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิปฏิบัติดังต่อไปนี้

(1) จัดทำและยื่นแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ต่อสำนักงานภายในสามสิบวันนับแต่วันแรกที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุน
สภาพคล่องสุทธิได้ เว้นแต่ก่อนครบกำหนดระยะเวลาดังกล่าวสามารถดำรงเงินกองทุน
สภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิไม่น้อยกว่าเจ็ดวันทำการ
ติดต่อกัน

¹ แก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สธ. 14/2561 เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับบริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถดำรง
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 17 มกราคม พ.ศ. 2561 (มีผลใช้บังคับเมื่อวันที่ 1 เมษายน พ.ศ. 2561)

(2) ดำเนินการตามแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ได้ยื่นต่อสำนักงานตาม (1) เพื่อให้สามารถกลับมาดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ภายในระยะเวลาที่กำหนดในแผนดังกล่าวซึ่งต้องไม่เกินเก้าสิบวันนับแต่วันแรกที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้

ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควร สำนักงานอาจผ่อนผันระยะเวลาในการดำเนินการตามวรรคหนึ่งได้ ทั้งนี้ ให้บริษัทหลักทรัพย์ที่ประสงค์จะขอผ่อนผันระยะเวลาดังกล่าวยื่นคำขอเป็นหนังสือพร้อมแสดงเหตุผลต่อสำนักงานล่วงหน้าไม่น้อยกว่าสิบวันก่อนครบกำหนดระยะเวลาตามวรรคหนึ่ง

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) การลงทุนเพื่อป้องกันความเสี่ยงจากเงินลงทุนหรือภาระผูกพันของบริษัท

ที่มีอยู่ก่อนหรือในวันแรกที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

(ค) การลงทุนเนื่องจากมีภาวะผูกพันในฐานะเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องในการซื้อขายหลักทรัพย์ ซึ่งบริษัทหลักทรัพย์ได้ทำการป้องกันความเสี่ยงจากการลงทุนดังกล่าวไว้แล้วอย่างเต็มจำนวน

(ง) การลงทุนเนื่องจากเกิดความผิดพลาดในการส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ให้แก่ลูกค้า (error port)

(5) การทำสัญญารับประกันการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์เพิ่มเติมจากสัญญาที่มีผลผูกพันอยู่ก่อนวันที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

(6)¹ การเพิ่มมูลค่าเงินทุนที่รับบริหารให้แก่ลูกค้าบัญชีกองทุนส่วนบุคคล หรือการเปิดบัญชีกองทุนส่วนบุคคลให้แก่ลูกค้ารายใหม่ เว้นแต่เป็นกรณีที่เกิดจากการจ่ายเงินสะสมของลูกค้าหรือการจ่ายเงินสมทบของนายจ้างสำหรับลูกค้าที่เป็นกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

(7) การสลักหลัง รับอาวัล หรือให้การรับรองตัวเงิน หรือการเป็นผู้ค้ำประกันในนิติกรรมใด ๆ ที่เกี่ยวเนื่องในการประกอบธุรกิจของบริษัทหลักทรัพย์แก่ลูกค้า เว้นแต่ลูกค้าได้วางเงินสดเป็นหลักประกันเต็มจำนวนไว้กับบริษัทหลักทรัพย์

(8) การกระทำอื่นใดที่มีลักษณะเป็นการเพิ่มความเสี่ยงต่อฐานะการเงิน การดำเนินงาน หรือการปฏิบัติตามข้อตกลงกับลูกค้า ทั้งนี้ ตามที่สำนักงานกำหนด

ข้อ 4 ในกรณีที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้แก่บริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิให้บริษัทหลักทรัพย์ดังกล่าวดำเนินการตามที่กำหนดในข้อ 5

(1) ไม่สามารถยื่นแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อสำนักงานตามระยะเวลาที่กำหนดในข้อ 2(1) หรือข้อ 2 วรรคสอง แล้วแต่กรณี

(2) ไม่สามารถแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามแผนและระยะเวลาที่กำหนดตามข้อ 2(2) หรือข้อ 2 วรรคสอง แล้วแต่กรณี

(3) มีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่ำกว่าศูนย์ติดต่อกันเกินห้าวันทำการ

(4) มีการผิन्छำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชีหรือต่อลูกค้า

¹ แก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ที่ สช. 14/2561 เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับบริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 17 มกราคม พ.ศ. 2561 (มีผลใช้บังคับเมื่อวันที่ 1 เมษายน พ.ศ. 2561)

ข้อ 5¹ ให้บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรากฏเหตุหนึ่งเหตุใดตามข้อ 4 ดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) ระวังการดำเนินธุรกิจทุกประเภทจนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ และได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ดำเนินธุรกิจได้ตามปกติ เว้นแต่เป็นกรณีดังนี้

(ก) การป้องกันความเสี่ยงโดยรวมในเงินลงทุนของบริษัทหลักทรัพย์หรือการดำเนินการตามภาระผูกพันที่ค้างอยู่

(ข) การดำเนินการตามความจำเป็นและสมควรเพื่อป้องกันมิให้มูลค่าทรัพย์สินของลูกค้าได้รับความเสียหาย การใช้สิทธิเพื่อประโยชน์ของลูกค้ากองทุนส่วนบุคคลหรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพในฐานะที่เป็นเจ้าของทรัพย์สินที่ลงทุน หรือเพื่อเปลี่ยนตราสารที่ครบกำหนด ใกล้เคียงกับผู้ออกตราสารดังกล่าว

(ค) การบริหารเงินสะสมและเงินสมทบของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่เป็นลูกค้าอยู่แล้วในขณะนั้น หรือการจ่ายเงินให้แก่สมาชิกของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่สิ้นสมาชิกภาพ

(2) สร้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีไว้เพื่อตนเอง เว้นแต่เป็นกรณีใดหนึ่งดังนี้

(ก) สัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าวมีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ป้องกันความเสี่ยงจากเงินลงทุนหรือภาระผูกพันของบริษัทหลักทรัพย์

(ข) การมีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้านั้นไม่ทำให้บริษัทหลักทรัพย์มีภาระผูกพันหรือก่อหนี้เพิ่มเติมในภายหลัง

(3) โอนทรัพย์สินของลูกค้าในบัญชีเงินสดไปยังบริษัทหลักทรัพย์อื่นเพื่อการเก็บรักษาทรัพย์สินของลูกค้าให้แล้วเสร็จภายในสิบวันทำการนับแต่วันที่ปรากฏเหตุหนึ่งเหตุใดตามข้อ 4 เว้นแต่จะได้รับการผ่อนผันระยะเวลาจากสำนักงานเนื่องจากมีเหตุจำเป็นและสมควร ทั้งนี้ หากมีค่าใช้จ่ายเกิดขึ้นจากการดำเนินการดังกล่าว ให้บริษัทหลักทรัพย์รายเดิมเป็นผู้รับผิดชอบค่าใช้จ่ายนั้น

(4) กรณีเป็นบริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ การค้าหลักทรัพย์ หรือการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยลงทุน ให้ดำเนินการดังนี้ด้วย

(ก) ดำเนินการให้ลูกค้าแต่ละรายเป็นผู้มีชื่อเป็นผู้ถือหลักทรัพย์โดยตรง

(ข) โอนบัญชีการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าแต่ละรายไปยังบริษัทหลักทรัพย์ประเภทหนึ่งประเภทใดดังนี้เป็นผู้ให้บริการแทน ทั้งนี้ ตามที่ลูกค้าแจ้งความประสงค์ไว้

¹ แก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ด. ที่ สช. 14/2561 เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับบริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 17 มกราคม พ.ศ. 2561 (มีผลใช้บังคับเมื่อวันที่ 1 เมษายน พ.ศ. 2561)

1. บริษัทหลักทรัพย์ประเภทการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ การค้าหลักทรัพย์ หรือการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ ที่สามารถให้บริการซื้อขายหน่วยลงทุนได้
2. บริษัทหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวมซึ่งเป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุนรวมนั้น ๆ

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

(5) กรณีเป็นบริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนส่วนบุคคล ให้ดำเนินการดังนี้ด้วย

(ก) กรณีจัดการกองทุนส่วนบุคคล ให้ติดต่อลูกค้าโดยเร็วเพื่อสอบถามความประสงค์ของลูกค้าว่าจะให้จัดการทรัพย์สินของลูกค้าอย่างไร ระหว่างวิธีการใดวิธีการหนึ่งดังนี้

1. เปลี่ยนแปลงทางทะเบียนเพื่อให้ลูกค้ามีชื่อเป็นเจ้าของทรัพย์สินนั้นโดยตรง
2. ให้บริษัทหลักทรัพย์ดำเนินการเพื่อให้บริษัทหลักทรัพย์อื่นเข้าจัดการกองทุนส่วนบุคคลแทน

ในกรณีที่ไม่สามารถติดต่อลูกค้าได้ ให้ดำเนินการเปลี่ยนแปลงทางทะเบียนเพื่อให้ลูกค้ามีชื่อเป็นเจ้าของทรัพย์สินต่อไป

ให้บริษัทหลักทรัพย์ดำเนินการให้ลูกค้ามีชื่อเป็นเจ้าของทรัพย์สินหรือเปลี่ยนบริษัทหลักทรัพย์ที่จัดการกองทุนส่วนบุคคล แล้วแต่กรณี ให้แล้วเสร็จภายในสามสิบวันนับแต่วันที่ปรากฏเหตุหนึ่งเหตุใดตามข้อ 4

(ข) กรณีจัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้บริษัทหลักทรัพย์ติดต่อคณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ โดยเร็ว และดำเนินการเพื่อให้บริษัทหลักทรัพย์อื่นเข้าจัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพแทน โดยต้องดำเนินการให้แล้วเสร็จภายในหกสิบวันนับแต่วันที่ปรากฏเหตุหนึ่งเหตุใดตามข้อ 4

ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควร สำนักงานอาจผ่อนผันระยะเวลาในการดำเนินการตาม (5) วรรคหนึ่ง (ก) วรรคสาม หรือ (ข) ได้ ทั้งนี้ ให้บริษัทหลักทรัพย์ที่ประสงค์จะขอผ่อนผันระยะเวลาดังกล่าวยื่นคำขอเป็นหนังสือพร้อมแสดงผลต่อสำนักงานล่วงหน้าไม่น้อยกว่าสิบวันก่อนครบกำหนดระยะเวลานั้น

ในกรณีที่มีค่าใช้จ่ายเกิดขึ้นจากการดำเนินการตาม (5) วรรคหนึ่ง ให้บริษัท
หลักทรัพย์เป็นผู้รับผิดชอบค่าใช้จ่ายดังกล่าว

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

(7) กระทบการหรืองดเว้นการกระทำอื่นใดตามที่สำนักงานกำหนด เพื่อให้บริษัทหลักทรัพย์
สามารถกลับมาดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามประกาศการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

ข้อ 6 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน พ.ศ. 2557 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 23 กันยายน พ.ศ. 2557

(นายวรพล โสคติยานุรักษ์)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์