



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. 64 /2563

เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุน
ของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณี
ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 141 วรรคหนึ่ง (2) แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์
และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 โดยความเห็นชอบของคณะกรรมการกำกับตลาดทุน และ
มาตรา 14 วรรคสอง (2) มาตรา 19 และมาตรา 50 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546
และข้อ 6 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 26 /2563 เรื่อง
การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ ลงวันที่ 8 ตุลาคม พ.ศ. 2563 และข้อ 1(3) แห่ง
ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. 59/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์และกำหนดเวลาในการยื่นรายงาน
ของบริษัทหลักทรัพย์ ลงวันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2552 สำนักงานออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2564 เป็นต้นไป

ข้อ 2 ให้ยกเลิก

(1) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ สธ. 31/2557 เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับบริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้
ลงวันที่ 23 กันยายน พ.ศ. 2557

(2) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ สธ. 84/2558 เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับผู้ได้รับใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
ที่ไม่สามารถดำรงฐานะทางการเงินได้ ลงวันที่ 2 ธันวาคม พ.ศ. 2558

(3) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ สธ. 50/2560 เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ลงวันที่ 29 ธันวาคม
พ.ศ. 2560

(4) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ สธ. 51/2560 เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของผู้ได้รับ
ใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ 29 ธันวาคม พ.ศ. 2560

(5) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ สช. 14/2561 เรื่อง ข้อกำหนดสำหรับบริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้
(ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 17 มกราคม พ.ศ. 2561

(6) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ สช. 61/2562 เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่
9 ธันวาคม พ.ศ. 2562

(7) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ สช. 62/2562 เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของผู้ได้รับ
ใบอนุญาตเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 9 ธันวาคม พ.ศ. 2562

ข้อ 3 ในประกาศนี้

“ผู้ประกอบการธุรกิจ” หมายความว่า ผู้ประกอบการธุรกิจซึ่งมีหน้าที่ต้องดำรงเงินกองทุน
ตามประกาศการดำรงเงินกองทุน

“ผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ซึ่งมีหน้าที่ดำรง
เงินกองทุนตามประกาศการดำรงเงินกองทุน

“ผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า” หมายความว่า ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบ
ธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าซึ่งมีหน้าที่ดำรง
เงินกองทุนตามประกาศการดำรงเงินกองทุน

“ผู้ประกอบการธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล” หมายความว่า ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบ
ธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลซึ่งมีหน้าที่ดำรงเงินกองทุนตามประกาศการดำรงเงินกองทุน

“ประกาศการดำรงเงินกองทุน” หมายความว่า ประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์
และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบการธุรกิจ

“ดำรงเงินกองทุน” หมายความว่า ดำรงเงินกองทุนตามประกาศการดำรงเงินกองทุน

“รายงานการคำนวณเงินกองทุน” หมายความว่า รายงานดังต่อไปนี้

- (1) รายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
- (2) รายงานการคำนวณส่วนของผู้ถือหุ้น
- (3) รายงานประกอบการคำนวณเงินกองทุนสำหรับผู้ประกอบการธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล

“กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ” หมายความว่า กองทุนสำรองเลี้ยงชีพตามกฎหมายว่าด้วย
กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

หมวด 1

การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุน

ข้อ 4 ให้ผู้ประกอบธุรกิจจัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนตามแบบและคำอธิบายประกอบการรายงานการคำนวณเงินกองทุนที่จัดไว้บนเว็บไซต์ของสำนักงาน

ข้อ 5 ให้ผู้ประกอบธุรกิจจัดทำและยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนต่อสำนักงานตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้ โดยรายงานทุกฉบับต้องมีการลงลายมือชื่อรับรองความถูกต้องโดยบุคคลผู้มีอำนาจลงนาม

(1) กรณีเป็นผู้ที่มีหน้าที่ต้องดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิตามประกาศการดำรงเงินกองทุน ให้จัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเป็นรายวันให้เสร็จสิ้นภายในวันทำการถัดไป และยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของวันทำการสุดท้ายของเดือนต่อสำนักงานภายใน 5 วันทำการแรกของเดือนถัดไป

(2) กรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์หรือผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใดมีการคำนวณรายการหนี้สินโดยสิทธิหรือสัญญาเช่าที่ไม่ต้องนับรวมไว้ใน การคำนวณหนี้สินรวม หรือมีรายการเงินกู้ยืม หนี้กู้ หรือภาระผูกพันใดที่สามารถนับรวมไว้ใน การคำนวณหนี้สินพิเศษ เป็นครั้งแรก หรือทุกครั้งที่มีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงรายการดังกล่าว ให้ผู้ประกอบธุรกิจนั้นยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิและจัดส่งสำเนาสัญญาที่เกี่ยวข้องกับหนี้สินหรือภาระผูกพันนั้นเพิ่มเติมต่อสำนักงานภายในกำหนดเวลาดังนี้

(ก) ในวันทำการถัดจากวันที่ผู้ประกอบธุรกิจมีการคำนวณรายการดังกล่าวเป็นครั้งแรก

(ข) ในวันทำการถัดจากวันที่มีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงรายการดังกล่าวในแต่ละครั้ง

(3) กรณีเป็นผู้ที่มีหน้าที่ต้องดำรงส่วนของผู้ถือหุ้นตามประกาศการดำรงเงินกองทุน ให้จัดทำรายงานการคำนวณส่วนของผู้ถือหุ้นของทุกวันทำการสุดท้ายของแต่ละเดือน และยื่นรายงานต่อสำนักงานภายใน 10 วันทำการแรกของเดือนถัดไป เว้นแต่กรณีที่เกิดเหตุที่อาจทำให้ส่วนของผู้ถือหุ้นเปลี่ยนแปลงไปอย่างมีนัยสำคัญ ให้จัดทำและยื่นรายงานดังกล่าวโดยไม่ชักช้า

(4) กรณีเป็นผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล ให้จัดทำรายงานประกอบการคำนวณเงินกองทุนสำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลของทุกวันทำการสุดท้ายของแต่ละเดือน และยื่นรายงานต่อสำนักงานภายใน 10 วันทำการแรกของเดือนถัดไป

ให้ผู้ประกอบธุรกิจเก็บรักษารายงานการคำนวณเงินกองทุนตามวรรคหนึ่ง พร้อมหลักฐานที่ใช้ประกอบการคำนวณรายงานดังกล่าวไว้เป็นเวลาไม่น้อยกว่า 1 ปีในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงานตรวจสอบได้ หรือพร้อมที่จะจัดส่งให้แก่สำนักงานเมื่อได้รับการร้องขอ

ในกรณีมีเหตุจำเป็นและสมควร ผู้ประกอบธุรกิจที่ไม่สามารถยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนตามวรรคหนึ่ง ภายในระยะเวลาที่กำหนด อาจขอผ่อนผัน โดยยื่นคำขอพร้อมทั้งเอกสารหลักฐานประกอบคำขอตามคู่มือสำหรับประชาชนต่อสำนักงานก่อนครบกำหนดเวลาการยื่นรายงานดังกล่าว ทั้งนี้ ตามขั้นตอนและวิธีการที่ระบุในคู่มือสำหรับประชาชน

ข้อ 6 เมื่อปรากฏว่าผู้ประกอบธุรกิจใดมีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเมื่อสิ้นวันหนึ่งวันใดเท่ากับหรือน้อยกว่า 1.5 เท่าของเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ผู้ประกอบธุรกิจต้องดำรงไว้ ให้ผู้ประกอบธุรกิจนั้นดำเนินการดังต่อไปนี้ เว้นแต่สำนักงานจะกำหนดให้ปฏิบัติเป็นประการอื่น

(1) ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของวันที่เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของผู้ประกอบธุรกิจเท่ากับหรือน้อยกว่าอัตราดังกล่าวและของทุกวันถัดไปต่อสำนักงานภายในวันทำการถัดจากวันที่เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเท่ากับหรือน้อยกว่าอัตราดังกล่าว จนกว่าผู้ประกอบธุรกิจจะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้มากกว่าอัตราดังกล่าวเป็นเวลาไม่น้อยกว่า 2 วันทำการติดต่อกัน และผู้ประกอบธุรกิจได้ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของ 2 วันทำการนั้นต่อสำนักงานแล้ว

(2) ยื่นรายงานชี้แจงสาเหตุที่เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิลดจนถึงอัตราดังกล่าว พร้อมทั้งแจ้งแนวทางการดำเนินการที่ผู้ประกอบธุรกิจจะกลับมาดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ต่อสำนักงานภายในวันทำการถัดจากวันที่เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเท่ากับหรือน้อยกว่าอัตราดังกล่าว

ข้อ 7 เมื่อปรากฏว่าผู้ประกอบธุรกิจรายใดมีส่วนของผู้ถือหุ้นเท่ากับหรือน้อยกว่า 1.1 เท่าของส่วนของผู้ถือหุ้นที่ผู้ประกอบธุรกิจต้องดำรงไว้ ให้ผู้ประกอบธุรกิจรายนั้นยื่นรายงานชี้แจงสาเหตุที่ส่วนของผู้ถือหุ้นลดจนถึงอัตราดังกล่าว และวิเคราะห์แนวโน้มการเปลี่ยนแปลงของส่วนของผู้ถือหุ้นในอนาคต รวมถึงความสามารถในการดำเนินธุรกิจได้อย่างต่อเนื่องในช่วง 1 ปี นับแต่วันที่ยื่นรายงานชี้แจง พร้อมทั้งแจ้งแนวทางการดำเนินการที่ผู้ประกอบธุรกิจจะกลับมาดำรงส่วนของผู้ถือหุ้นได้มากกว่าอัตราดังกล่าว

ให้ผู้ประกอบธุรกิจยื่นรายงานตามวรรคหนึ่ง ภายใน 2 วันทำการนับแต่วันที่รู้ว่าส่วนของผู้ถือหุ้นลดจนถึงอัตราดังกล่าว และทุกวันทำการสุดท้ายของแต่ละเดือนจนกว่าผู้ประกอบธุรกิจจะสามารถดำรงส่วนของผู้ถือหุ้นได้มากกว่าอัตราดังกล่าว เว้นแต่สำนักงานจะกำหนดให้ปฏิบัติเป็นประการอื่น

ข้อ 8 ให้ผู้ประกอบการยื่นรายงานตามข้อ 5 ข้อ 6 และข้อ 7 และเอกสารที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี) ต่อสำนักงานในรูปแบบของข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ผ่านระบบรับส่งข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ โดยดำเนินการให้เป็นไปตามระเบียบวิธีปฏิบัติสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับส่งข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์

หมวด 2

ข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้

ข้อ 9 ความในหมวดนี้ให้ใช้บังคับกับผู้ประกอบการหลักทรัพย์และผู้ประกอบการกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ข้อ 10 ในกรณีที่ผู้ประกอบการรายใดไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ให้ผู้ประกอบการนั้นดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) จัดทำและยื่นแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนต่อสำนักงานภายใน 30 วันนับแต่วันแรกที่ผู้ประกอบการไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ เว้นแต่ก่อนครบกำหนดระยะเวลาดังกล่าวสามารถดำรงเงินกองทุนได้ไม่น้อยกว่า 7 วันทำการติดต่อกัน

(2) ดำเนินการตามแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนที่ได้ยื่นต่อสำนักงานตาม (1) เพื่อให้สามารถกลับมาดำรงเงินกองทุน ภายในระยะเวลาที่กำหนดในแผนดังกล่าวซึ่งต้องไม่เกิน 90 วันนับแต่วันแรกที่ผู้ประกอบการไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้

ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควร สำนักงานอาจผ่อนผันระยะเวลาในการดำเนินการตามวรรคหนึ่งได้ โดยให้ผู้ประกอบการที่ประสงค์จะขอผ่อนผันระยะเวลาดังกล่าวยื่นคำขอ พร้อมทั้งเอกสารหลักฐานประกอบคำขอตามคู่มือสำหรับประชาชนต่อสำนักงานล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 10 วันก่อนครบกำหนดระยะเวลาตามวรรคหนึ่ง ทั้งนี้ ตามขั้นตอนและวิธีการที่ระบุในคู่มือสำหรับประชาชน

ข้อ 11 ในระหว่างที่ผู้ประกอบการไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ หรืออยู่ในระหว่างการดำเนินการตามข้อ 10 ห้ามผู้ประกอบการนั้นดำเนินการดังต่อไปนี้ จนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนและได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ประกอบการกิจได้ตามปกติ

(1) เพิ่มวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่ลูกค้า เว้นแต่เป็นการซื้อหลักทรัพย์ที่ลูกค้าได้วางเงินไว้กับบริษัทหลักทรัพย์ หรือเป็นการขายหลักทรัพย์ของลูกค้าที่อยู่ในความครอบครองของบริษัทหลักทรัพย์แล้ว

(2) ให้บริการหรือเปิดบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแก่ลูกค้ารายใหม่

(3) เพิ่มเงินลงทุนของบริษัท (portfolio) เว้นแต่เป็นการลงทุนดังนี้

(ก) การลงทุนในเงินฝาก หรือหน่วยลงทุนกองทุนรวมตลาดเงินในประเทศ

(ข) การลงทุนเพื่อป้องกันความเสี่ยงจากเงินลงทุนหรือภาระผูกพันของบริษัท ที่มีอยู่ก่อนหรือในวันแรกที่ผู้ประกอบธุรกิจไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้

(ค) การลงทุนเนื่องจากมีภาระผูกพันในฐานะเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องในการซื้อขายหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งผู้ประกอบธุรกิจได้ทำการป้องกันความเสี่ยงจากการลงทุนดังกล่าวไว้แล้วอย่างเต็มจำนวน

(ง) การลงทุนเนื่องจากเกิดความผิดพลาดในการส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่ลูกค้า (error port)

(4) สติ๊กหลัง รับอวัล หรือให้การรับรองตัวเงิน หรือเป็นผู้ค้ำประกันในนิติกรรมใด ๆ ที่เกี่ยวเนื่องในการประกอบธุรกิจของผู้ประกอบธุรกิจแก่ลูกค้า เว้นแต่ลูกค้าได้วางเงินสดเป็นหลักประกันเต็มจำนวนไว้กับผู้ประกอบธุรกิจ

(5) กระทำอื่นใดที่มีลักษณะเป็นการเพิ่มความเสี่ยงต่อฐานะการเงิน การดำเนินงาน หรือการปฏิบัติตามข้อตกลงกับลูกค้า ทั้งนี้ ตามที่สำนักงานกำหนด

ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ ห้ามดำเนินการดังนี้ด้วย

(1) เพิ่มยอดหนี้คงค้างของลูกค้าบัญชีมาร์จินหรือลูกค้าที่ยืมหลักทรัพย์จากยอดหนี้คงค้างที่ปรากฏในวันแรกที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ เว้นแต่เป็นการเพิ่มยอดหนี้คงค้างเนื่องจากเหตุใดเหตุหนึ่งดังนี้

(ก) ดอกเบี้ยค้างรับ

(ข) หลักทรัพย์ที่ลูกค้ายืมมีมูลค่าสูงขึ้น

(ค) การซื้อหลักทรัพย์เพื่อนำมาคืนการยืมหลักทรัพย์เพื่อขายชอร์ต

(2) ทำสัญญารับประกันการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์เพิ่มเติมจากสัญญาที่มีผลผูกพันอยู่ ก่อนวันที่บริษัทหลักทรัพย์ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้

(3) เพิ่มมูลค่าเงินทุนที่รับบริหารให้แก่ลูกค้าบัญชีกองทุนส่วนบุคคล หรือเปิดบัญชีกองทุนส่วนบุคคลให้แก่ลูกค้ารายใหม่ เว้นแต่เป็นกรณีที่เกิดจากการจ่ายเงินสะสมของลูกค้าหรือการจ่ายเงินสมทบของนายจ้างสำหรับลูกค้าที่เป็นกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ห้ามให้บริการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยไม่มีการวางหลักประกันขั้นต้น (initial margin) เต็มจำนวนก่อนส่งคำสั่งซื้อสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่ลูกค้าด้วย

ข้อ 12 ในกรณีที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้แก่ผู้ประกอบการธุรกิจที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ให้ผู้ประกอบการดังกล่าวดำเนินการตามที่กำหนดในข้อ 13 ข้อ 14 ข้อ 15 ข้อ 16 และข้อ 17 แล้วแต่กรณี

(1) ไม่สามารถยื่นแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนต่อสำนักงานตามระยะเวลาที่กำหนดในข้อ 10 วรรคหนึ่ง (1) หรือวรรคสอง แล้วแต่กรณี

(2) ไม่สามารถแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนได้ตามแผนและระยะเวลาที่กำหนดตามข้อ 10 วรรคหนึ่ง (2) หรือวรรคสอง แล้วแต่กรณี

(3) มีเงินกองทุนต่ำกว่า 0 ติดต่อกันเกิน 5 วันทำการ

(4) มีการผิดนัดชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชีหรือต่อลูกค้าในกรณีเป็นการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ หรือผิดนัดชำระหนี้ต่อสำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือต่อลูกค้าในกรณีประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ข้อ 13 ให้ผู้ประกอบการธุรกิจที่ปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งตามข้อ 12 ดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) ระวังการดำเนินธุรกิจทุกประเภทจนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนได้และได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ดำเนินธุรกิจได้ตามปกติ เว้นแต่เป็นกรณีดังนี้

(ก) การป้องกันความเสี่ยงโดยรวมในเงินลงทุนของผู้ประกอบการธุรกิจหรือการดำเนินการตามภาระผูกพันที่ค้างอยู่

(ข) การดำเนินการตามความจำเป็นและสมควรเพื่อป้องกันมิให้มูลค่าทรัพย์สินของลูกค้าได้รับความเสียหาย การใช้สิทธิเพื่อประโยชน์ของลูกค้ากองทุนส่วนบุคคลหรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพในฐานะที่เป็นเจ้าของทรัพย์สินที่ลงทุน หรือเพื่อเปลี่ยนตราสารที่ครบกำหนดไถ่ถอนกับผู้ออกตราสารดังกล่าว

(ค) การบริหารเงินสะสมและเงินสมทบของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่เป็นลูกค้าอยู่แล้วในขณะนั้น หรือการจ่ายเงินให้แก่สมาชิกของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่สิ้นสมาชิกภาพ

(2) ล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีไว้เพื่อตนเอง เว้นแต่เป็นกรณีใดกรณีหนึ่งดังนี้

(ก) สัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าวมีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ป้องกันความเสี่ยงจากเงินลงทุนหรือภาระผูกพันของผู้ประกอบการธุรกิจ

(ข) การมีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้านั้นไม่ทำให้ผู้ประกอบการธุรกิจมีภาระผูกพันหรือก่อหนี้เพิ่มเติมในภายหลัง

(3) ดำเนินการดังนี้ให้แล้วเสร็จภายใน 10 วันทำการนับแต่วันที่ปรากฏเหตุตามข้อ 12

(ก) กรณีผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์ ให้โอนทรัพย์สินของลูกค้ายกบัญชีเงินสดไปยังผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์อื่นเพื่อการเก็บรักษาทรัพย์สินของลูกค้าย

(ข) กรณีผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ให้โอนทรัพย์สินและฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้ายกไปยังผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้ารายอื่นตามที่ลูกค้ายแจ้งความประสงค์ไว้

(4) กระทำการหรืองดเว้นการกระทำอื่นใดตามที่สำนักงานกำหนด เพื่อให้ผู้ประกอบการสามารถกลับมาดำรงเงินกองทุนได้

ข้อ 14 ในกรณีที่ผู้ประกอบการธุรกิจเป็นผู้ได้รับใบอนุญาตผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ การค้าหลักทรัพย์ หรือการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยลงทุน ใบทรัสต์ของทรัสต์ที่มีลักษณะทำนองเดียวกับกองทุนรวม หรือหลักทรัพย์อื่นที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนดให้เป็นหลักทรัพย์ที่มีลักษณะการลงทุนทำนองเดียวกับหน่วยลงทุน ให้ดำเนินการดังต่อไปนี้เพิ่มเติมจากการดำเนินการตามข้อ 13 ด้วย

(1) ดำเนินการให้ลูกค้ายแต่ละรายเป็นผู้มีชื่อเป็นผู้ถือหน่วยลงทุน ใบทรัสต์ หรือหลักทรัพย์อื่นโดยตรง

(2) โอนบัญชีการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้ายแต่ละรายไปยังผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทหนึ่งประเภทใดดังนี้เป็นผู้ให้บริการแทน ทั้งนี้ ตามที่ลูกค้ายแจ้งความประสงค์ไว้

(ก) ผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทเดียวกัน

(ข) ผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวมซึ่งเป็นผู้จัดตั้งและจัดการกองทุนรวมนั้น ๆ

(3) ดำเนินการตาม (1) และ (2) ให้แล้วเสร็จภายใน 5 วันทำการนับแต่วันที่ปรากฏเหตุตามข้อ 12

ข้อ 15 ในกรณีที่ผู้ประกอบการธุรกิจเป็นผู้ได้รับใบอนุญาตผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนส่วนบุคคล ให้ดำเนินการดังต่อไปนี้เพิ่มเติมจากการดำเนินการตามข้อ 13 ด้วย

(1) กรณีจัดการกองทุนส่วนบุคคล ให้ติดต่อลูกค้ายโดยเร็วเพื่อสอบถามความประสงค์ของลูกค้ายว่าจะให้ผู้ประกอบการธุรกิจจัดการทรัพย์สินของลูกค้ายอย่างไร ระหว่างวิธีการใดวิธีการหนึ่งดังนี้

(ก) เปลี่ยนแปลงทางทะเบียนเพื่อให้ลูกค้ายมีชื่อเป็นเจ้าของทรัพย์สินนั้นโดยตรง

(ข) ดำเนินการเพื่อให้ผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนส่วนบุคคลอื่นเข้าจัดการกองทุนส่วนบุคคลแทน

ในกรณีที่ไม่สามารถติดต่อลูกค้าได้ ให้ดำเนินการเปลี่ยนแปลงทางทะเบียน เพื่อให้ลูกค้ามีชื่อเป็นเจ้าของทรัพย์สินต่อไป

ให้ผู้ประกอบธุรกิจดำเนินการให้ลูกค้ามีชื่อเป็นเจ้าของทรัพย์สินหรือเปลี่ยนผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ที่จัดการกองทุนส่วนบุคคล แล้วแต่กรณี ให้แล้วเสร็จภายใน 30 วันนับแต่วันที่ปรากฏเหตุตามข้อ 12

(2) กรณีจัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้ผู้ประกอบธุรกิจแจ้งคณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ โดยเร็ว และดำเนินการเพื่อให้ผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนส่วนบุคคลอื่นเข้าจัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพแทน โดยต้องดำเนินการให้แล้วเสร็จภายใน 60 วันนับแต่วันที่ปรากฏเหตุตามข้อ 12

ข้อ 16 ให้ผู้ประกอบธุรกิจแจ้งให้ลูกค้าทราบเป็นลายลักษณ์อักษรถึงการดำเนินการตามข้อ 13(1) และ (3) ข้อ 14 หรือข้อ 15 แล้วแต่กรณี โดยไม่ชักช้า

ข้อ 17 ในกรณีที่มิใช่ค่าใช้จ่ายเกิดขึ้นจากการดำเนินการตามข้อ 13(3) ข้อ 14 หรือข้อ 15 ให้ผู้ประกอบธุรกิจที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้เป็นผู้รับผิดชอบค่าใช้จ่ายนั้น

ประกาศ ณ วันที่ 9 ตุลาคม พ.ศ. 2563



(นางสาวรีนวดี สุวรรณมงคล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์