

คู่มือการกำกับดูแลการปฏิบัติงานของสมาชิก
Check List –ข้อกำหนดที่เกี่ยวข้องกับการกำกับบริษัทสมาชิก
ของตลาดหลักทรัพย์ฯ

ฝ่ายกำกับบริษัทสมาชิก

มีนาคม 2564

สารบัญ

| | |
|--|----|
| 1. การซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 2 |
| 2. การซื้อขายมาร์จิน | 14 |
| 3. การขายชอร์ตในตลาดหลักทรัพย์ | 20 |
| 4. การซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ | 23 |
| 5. การบังคับจำหน่ายหรือบังคับชำระหนี้ | 25 |
| 6. Sub Broker | 27 |
| 7. การซื้อขายหุ้นของสมาชิกหรือบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้อง..... | 29 |
| 8. บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย | 31 |
| 9. การจัดส่งรายงาน..... | 34 |

การซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|---|-----------------|-----------------|
| 1. ข้อบังคับ ตลท. เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 14 มกราคม 2540 | 23 มกราคม 2540 |
| 2. ประกาศสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ที่ กส. 1/2556 เรื่อง หลักเกณฑ์ และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 29 กรกฎาคม 2556 | 1 สิงหาคม 2556 |
| 3. กส.(ว) 4/2558 เรื่อง การซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ลูกค้าของสมาชิกผิดนัด (Member buy-in) | 21 สิงหาคม 2558 | 24 สิงหาคม 2558 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|--|--|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>การทำสัญญา สัญญาที่ทำกับลูกค้ามีสาระสำคัญขั้นต่ำดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> กรณีลูกค้าไม่จ่ายค่าซื้อภายในกำหนด ให้สมาชิกสามารถขายหุ้นนั้นได้ทันที และลูกค้ายินยอมชดใช้ค่าเสียหายที่เกิดขึ้น กรณีลูกค้าไม่ส่งมอบหุ้นภายในกำหนด ให้สมาชิกสามารถซื้อหุ้นมาส่งมอบแทนได้ทันที และลูกค้ายินยอมชดใช้ค่าเสียหายที่เกิดขึ้น | <p>จัดทำสัญญาโดยมีข้อความที่เป็นสาระสำคัญขั้นต่ำตามที่กำหนด ให้ลูกค้าลงนามและจัดเก็บให้ครบถ้วน</p> | <ol style="list-style-type: none"> มีข้อสัญญาอื่นเพิ่มเติมที่ครอบคลุมความเสี่ยงด้านอื่นที่อาจเกิดขึ้นกับบริษัท เช่น การให้สิทธิบริษัทสามารถขายหลักทรัพย์อื่นที่อยู่ในความครอบครอง เพื่อนำไปชำระหนี้ที่ค้างของลูกค้าได้ มีระบบการจัดเก็บหรือเบิกใช้เอกสารสัญญาที่รัดกุมเพื่อป้องกันการสูญหายหรือแก้ไขข้อมูล |
| <p>วงเงินซื้อขาย</p> <p>กำหนดวงเงินในการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าและควบคุมการสั่งซื้อหลักทรัพย์ของลูกค้าให้เป็นไปตามที่กำหนดในหลักเกณฑ์สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย</p> <p>โดยสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย กำหนดดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> กำหนดวงเงินเหมาะสมกับฐานะการเงินและความสามารถชำระหนี้ของลูกค้า การสั่งซื้อ ณ ขณะใดขณะหนึ่งไม่เกินวงเงินที่กำหนด | <ol style="list-style-type: none"> จัดทำหลักเกณฑ์การพิจารณากำหนดวงเงินเป็นลายลักษณ์อักษร โดยอย่างน้อยต้องคำนึงถึงรายได้ ทรัพย์สิน และหนี้สินของลูกค้า และมีเอกสารหลักฐานประกอบการพิจารณาครบถ้วน มีการกำหนดขั้นตอนและผู้มีอำนาจอนุมัติวงเงินในแต่ละระดับ โดยแบ่งแยกหน่วยงานที่ทำหน้าที่รับลูกค้ากับหน่วยงานที่พิจารณาอนุมัติวงเงิน การพิจารณาวงเงินเป็นไปตามเกณฑ์ KYC และ CDD มีนโยบายทบทวนวงเงินเป็นลายลักษณ์อักษรขั้นต่ำปีละครั้งและเมื่อมีการเปลี่ยนแปลงที่สำคัญ เช่น ข้อมูลลูกค้า ภาวะเศรษฐกิจ นอกจากนี้ควร | <ol style="list-style-type: none"> มีการตรวจสอบการเสี่ยงเกินวงเงินโดยวิธีการต่าง ๆ เช่น การโอนรายการซื้อขายระหว่างลูกค้า มีการจัดเก็ตรisk ความเสี่ยงลูกค้าโดยปัจจัยที่ใช้ในการประเมินเช่น Default Risk มีการตรวจสอบข้อมูลทางการเงินจากหน่วยงานอื่น เช่น Credit Bureau, ธนาคารพาณิชย์ |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|-----------|---|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| | <p>พิจารณาปัจจัยอื่นประกอบ เช่น ประวัติการชำระเงินล่าช้า</p> <p>5. มีระบบควบคุมการเกินวงเงิน และค้ำวงเงินได้ ไม่เกินวงเงินอนุมัติ</p> | |

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|--|------------------|-----------------|
| 1. ข้อบังคับ ตลท. เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 14 มกราคม 2540 | 23 มกราคม 2540 |
| - หนังสือเวียน ที่ กส.(ว) 11/2547 เรื่อง การวางหลักประกันในบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 27 พฤษภาคม 2547 | 1 กรกฎาคม 2547 |
| - หนังสือเวียน ที่ กส.(ว) 15/2547 เรื่อง แนวทางปฏิบัติสำหรับหลักเกณฑ์การวางหลักประกันในบัญชีเงินสด | 18 มิถุนายน 2547 | 1 กรกฎาคม 2547 |
| - หนังสือเวียน ที่ กส.(ว) 8/2549 เรื่อง การผ่อนผันการวางหลักประกันในส่วนของบัญชีตราสารหนี้ | 17 พฤษภาคม 2549 | 22 พฤษภาคม 2549 |
| - หนังสือเวียน ที่ กส.(ว) 6/2551 เรื่อง การเพิ่มอัตราการวางหลักประกันในบัญชีเงินสด | 17 มีนาคม 2551 | 1 มิถุนายน 2551 |
| - หนังสือเวียน ที่ กส.(ว) 20/2551 เรื่อง การกำหนดทรัพย์สินเพิ่มเติมที่สามารถนำมาวางเป็นหลักประกันในบัญชีเงินสด | 8 สิงหาคม 2551 | 15 สิงหาคม 2551 |
| - หนังสือเวียน ที่ กส.(ว) 2/2556 เรื่อง การปรับปรุงอัตราการวางหลักประกันในบัญชีเงินสด | 3 เมษายน 2556 | 2 พฤษภาคม 2556 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|--|---|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>การวางหลักประกัน</p> <p>1. ลูกค้ำวางหลักประกันก่อนซื้อ $\geq 20\%$ ของจำนวนเงินที่อาจซื้อได้ ซึ่งไม่เกินวงเงินที่กำหนด ยกเว้นลูกค้ำประเภทดังนี้</p> <p>1) ผู้ได้รับ License การจัดการกองทุนส่วนบุคคล เฉพาะการซื้อขายเพื่อการจัดการกองทุนส่วนบุคคล</p> <p>2) บริษัทที่สมาชิกถือหุ้นทางตรงหรือทางอ้อม $\geq 90\%$ ของทุนชำระแล้ว เฉพาะการซื้อขายที่สมาชิกนั้นเป็นนายหน้าหรือตัวแทน</p> <p>3) บริษัทที่ถือหุ้นในสมาชิกทางตรงหรือทางอ้อม $\geq 90\%$ ของทุนชำระแล้ว เฉพาะการซื้อขายที่สมาชิกนั้นเป็นนายหน้าหรือตัวแทน</p> | <p>1. ต้องให้ลูกค้ำวางหลักประกันก่อนสั่งซื้อ และกรณีขอเพิ่มวงเงินระหว่างวัน (ไม่เกินวงเงินอนุมัติ) ต้องตรวจสอบว่าลูกค้ำนำหลักประกันมาวางเพิ่มแล้วครบถ้วน</p> <p>2. หลักการพิจารณาวงเงินต้องขึ้นกับฐานะการเงินลูกค้ำ มิใช่จากหลักประกันที่นำมาวางเพียงอย่างเดียว</p> <p>3. กำหนดหลักเกณฑ์ ขั้นตอน ผู้มีอำนาจอนุมัติ ถอนหลักประกัน โดยมีเอกสารหลักฐานเป็นลายลักษณ์อักษร</p> <p>4. มีระบบการคำนวณวงเงินต้นวันที่ถูกต้อง และการแก้ไขระบบต้องมีผู้มีอำนาจอนุมัติ</p> | <p>1. อาจกำหนดอัตราหลักประกันสูงกว่าที่ตลท. กำหนด โดยพิจารณาจากเครดิตลูกค้ำ, พฤติกรรมการซื้อขาย, หน้าที่มีความเสี่ยง, ช่วงภาวะตลาดหรือเศรษฐกิจผันผวน โดยกำหนดหลักเกณฑ์เป็นลายลักษณ์อักษร รวมทั้งมีการทบทวนอยู่เสมอ</p> <p>2. อาจกำหนดประเภทหลักประกันที่นำมาวาง โดยคำนึงถึงสภาพคล่องและความเสี่ยง หรือกำหนด Haircut หลักประกันแต่ละประเภท</p> <p>3. มีการสอบทานระบบการคำนวณวงเงินต้นวันอย่างสม่ำเสมอ และทุกครั้งเมื่อมีการแก้ไข</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|--|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>4) สถาบันการเงิน (ตามพรบ.ดอกเบี้ยเงินให้กู้ยืมของสถาบันการเงิน) ¹</p> <p>5) ผู้ลงทุนประเภทสถาบัน (ตามประกาศ ก.ล.ต. เรื่อง การยื่นและการยกเว้นการยื่นแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายหลักทรัพย์) ²</p> <p>6) บริษัทจดทะเบียนที่ไม่อยู่ระหว่างแก้ไขเหตุแห่งการเพิกถอน หรือฟื้นฟูกิจการตามกฎหมายล้มละลาย</p> <p>7) นิติบุคคลอื่นที่ตกลงกำหนด</p> <p>2. ผ่อนผันการวางหลักประกันในส่วนของการซื้อขายตราสารหนี้</p> <p>3. ประเภทของหลักประกัน เป็นไปตามประกาศ ก.ล.ต. เรื่อง การปฏิบัติงานเกี่ยวกับการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์และการให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าที่มีใช้ลูกค้าสถาบันเพื่อขายชอร์ต หรือตามที่ตกลงกำหนด ซึ่งได้แก่</p> <ul style="list-style-type: none"> - เงินสด - หลักทรัพย์จดทะเบียน - หน่วยลงทุนของกองทุนรวมเปิดที่กำหนดวันทำการซื้อขายหน่วยลงทุนทุกวันทำการ - ตั๋วเงินคลัง - พันธบัตรรัฐบาลไทย - พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย - พันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งที่กระทรวงการคลังเป็นผู้รับอวัลทั้งจำนวน หรือเป็นผู้ค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข หรือที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงินเป็นผู้ออกหรือค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข - ตราสารแห่งหนึ่งที่ตัวตราสารนั่นเอง หรือผู้ออกตราสาร ผู้ค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข ผู้รับรองโดยเป็นการรับรองตลอดไป ผู้รับอวัลทั้งจำนวน หรือผู้สลับหลังโอนประเภทมีสิทธิไล่เบี้ยทั้งจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือตั้งแต่ระดับ BBB ขึ้นไปหรือเทียบเท่า - บัตรเงินฝากที่ธนาคารพาณิชย์หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก | <p>5. มีการปรับปรุงประเภทลูกค้าที่ได้รับการยกเว้นไม่ต้องวางหลักประกัน, ประเภทและวิธีการคำนวณมูลค่าหลักประกัน ให้ข้อมูลเป็นปัจจุบันอยู่เสมอ</p> | <p>ระบบงาน</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|--|----------------------|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>- หนังสือค้ำประกันที่สถาบันการเงินออกให้ไว้แก่บริษัทหลักทรัพย์เพื่อเป็นประกันการชำระหนี้ในบัญชีมาร์จิ้นของลูกค้า โดยสถาบันการเงินนั้นยินยอมรับผิดชอบในฐานะลูกหนี้ชั้นต้น ทั้งนี้ ไม่ว่าหนังสือนั้นจะออกเป็นเช็คเดอริออฟเครดิตหรือหนังสือค้ำประกัน</p> <p>4. วิธีคำนวณมูลค่าหลักประกันเป็นไปตามประกาศ ก.ล.ต. เรื่อง การปฏิบัติงานเกี่ยวกับการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์และการให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าที่มีใช้ลูกค้าสถาบันเพื่อขายชอร์ต ซึ่งกำหนดดังนี้</p> <p>1) ให้ใช้ราคาปิด ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าที่ประกาศโดยตลท. หรือราคาอ้างอิง ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าที่ประกาศโดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย, Reuters, Bloomberg หรือผู้ประกอบการธุรกิจให้บริการข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ที่ ก.ล.ต. ยอมรับ <u>หรือ</u></p> <p>2) ให้ใช้ราคาที่เห็นว่าสามารถสะท้อนมูลค่าตลาดในปัจจุบัน</p> <p>5. กำหนดวงเงินต้นวันตามสูตรดังนี้³</p> $\text{วงเงินต้นวัน} = [(\text{เงินสด (T-1)} + \{\text{หลักทรัพย์ในบัญชีคำนวณตามราคาตลาด (T-1) - ภาระหนี้ (T-1)}\}) / 20\%] - \text{ภาระหนี้ (T-1)}$ <p>⇔ เทียบกับวงเงินอนุมัติ - ภาระหนี้ (T-1) แล้วใช้ค่าที่ต่ำกว่า</p> <p>6. ลูกค้านอนหลักประกันได้ไม่เกินกว่าหลักประกันที่เหลือจากการที่ได้ใช้วงเงินไปแล้ว หรือภาระหนี้ที่มีอยู่ เว้นแต่มีเหตุจำเป็น เช่น Tender Offer</p> | | |

APPENDIX

¹ สถาบันการเงิน (ตามพรบ. ดอกเบี้ยเงินให้กู้ยืมของสถาบันการเงิน)

- (1) ธนาคารแห่งประเทศไทย
- (2) ธนาคารพาณิชย์
- (3) บริษัทเงินทุน
- (4) บริษัทหลักทรัพย์
- (5) บริษัทเครดิตฟองซิเอร์
- (6) สถาบันการเงินอื่นตามประกาศกระทรวงการคลัง ซึ่งได้แก่
 - 1) ธนาคารออมสิน
 - 2) ธนาคารอาคารสงเคราะห์
 - 3) บรรษัทเงินทุนอุตสาหกรรมแห่งประเทศไทย
 - 4) ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร
 - 5) สถาบันการเงินระหว่างประเทศที่ประเทศไทยเป็นสมาชิก
 - 6) ธนาคารหรือสถาบันการเงินอื่นที่จดทะเบียนและตั้งอยู่ในต่างประเทศ
 - 7) สหกรณ์ออมทรัพย์
 - 8) ชุมนุมสหกรณ์ออมทรัพย์
 - 9) บริษัทประกันชีวิต
 - 10) ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย
 - 11) บรรษัทบริหารสินทรัพย์สถาบันการเงิน
 - 12) บรรษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย
 - 13) ธนาคารพัฒนาวิสาหกิจขนาดกลางและขนาดย่อมแห่งประเทศไทย
 - 14) สหกรณ์เครดิตยูเนียน
 - 15) กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน
 - 16) ผู้ประกอบธุรกิจสินเชื่อรายย่อยเพื่อการประกอบอาชีพภายใต้การกำกับ
 - 17) ผู้ประกอบธุรกิจสินเชื่อส่วนบุคคลภายใต้การกำกับ
 - 18) ผู้ประกอบธุรกิจสินเชื่อรายย่อยระดับจังหวัดภายใต้การกำกับ

² ผู้ลงทุนประเภทสถาบัน (ตามประกาศ ก.ล.ต. ที่ กจ. 4/2560 เรื่อง การกำหนดบทนิยามผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษและผู้ลงทุนรายใหญ่)

- (1) ธนาคารแห่งประเทศไทย
- (2) ธนาคารพาณิชย์
- (3) ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น
- (4) บริษัทเงินทุน
- (5) บริษัทเครดิตฟองซิเอร์
- (6) บริษัทหลักทรัพย์
- (7) บริษัทประกันวินาศภัย
- (8) บริษัทประกันชีวิต
- (9) กองทุนรวม
- (10) กองทุนส่วนบุคคลซึ่งบริษัทหลักทรัพย์บริหารจัดการเงินทุนของผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ ผู้ลงทุนรายใหญ่ หรือผู้ลงทุนตาม (1) ถึง (9) หรือ (11) ถึง (25)
- (11) กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
- (12) กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ
- (13) กองทุนประกันสังคม
- (14) กองทุนการออมแห่งชาติ
- (15) กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน
- (16) ผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (17)¹ ยกเลิก
- (18) สถาบันการเงินระหว่างประเทศ
- (19) สถาบันคุ้มครองเงินฝาก
- (20) ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- (21) นิติบุคคลประเภทบรรษัท
- (22) นิติบุคคลซึ่งมีผู้ลงทุนตาม (1) ถึง (21) ถือหุ้นรวมกันเกินกว่าร้อยละ 75 ของจำนวนหุ้นที่มีสิทธิออกเสียงทั้งหมด
- (23) ผู้ลงทุนต่างประเทศซึ่งมีลักษณะทำนองเดียวกับผู้ลงทุนตาม (1) ถึง (22)
- (24) ผู้จัดการกองทุน หรือผู้จัดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์เกี่ยวกับบุคลากรในธุรกิจตลาดทุน
- (25) ผู้ลงทุนอื่นใดตามที่สำนักงานประกาศกำหนด

¹ ยกเลิกโดยประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ต.ที่ กจ. 4/2562 เรื่อง การกำหนดบทนิยามผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และผู้ลงทุนรายใหญ่ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 4 เมษายน พ.ศ. 2562 (มีผลใช้บังคับเมื่อวันที่ 1 พฤษภาคม พ.ศ. 2562)

³ การคำนวณวงเงินตามมูลค่าหลักประกันในบัญชีเงินสด

- 1) การค้ำวงเงินจะมีผลในต้นวันที่ T+2
- 2) กรณีลูกค้าไม่ฝากค่าขายเป็นหลักประกัน ให้ถือว่าบริษัทจ่ายค่าขายในวันที่ T+1
- 3) เงินสด หมายถึงรวมถึง
 - เช็คค่าขายกรณีลูกค้าให้ฝากเป็นหลักประกัน
 - เช็คค่าหลักประกันที่ฝากหัก Clearing
 - ตัวเงินคลัง
 - พันธบัตรรัฐบาลไทย
 - พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย
 - พันธบัตรหรือตราสารแห่งหนึ่งที่กระทรวงการคลังเป็นผู้รับอวัลทั้งจำนวน หรือเป็นผู้ค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข หรือที่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนา

ระบบสถาบันการเงินเป็นผู้ออกหรือค้ำประกันต้นเงินและดอกเบี้ยเต็มจำนวนอย่างไม่มีเงื่อนไข

 - บัตรเงินฝากที่ธนาคารพาณิชย์หรือบริษัทเงินทุนเป็นผู้ออก
 - หนังสือค้ำประกันที่สถาบันการเงินออกให้ไว้แก่บริษัทหลักทรัพย์เพื่อเป็นประกันการชำระหนี้ในบัญชีมาร์จินของลูกค้า โดยสถาบันการเงินนั้นยินยอมรับผิดชอบในฐานะลูกหนี้ชั้นต้น ทั้งนี้

ไม่ว่าหนังสือนั้นจะออกเป็นเลตเตอร์ออฟเครดิตหรือหนังสือค้ำประกัน
- 4) ภาระหนี้ = Cumulative ค่าซื้อ - ค่าขาย ที่มากกว่า 0
- 5) ค่าที่ได้จากการคำนวณของ{หลักทรัพย์ในบัญชีคำนวณตามราคาตลาด (T-1) - ภาระหนี้ (T-1)} จะใช้เฉพาะค่าที่ ≥ 0

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|---|--------------------|-----------------|
| 1. ข้อบังคับ ตลท. เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 14 มกราคม 2540 | 23 มกราคม 2540 |
| - หนังสือเวียน ที่ กส.(ว) 12/2549 เรื่อง การแก้ไขหลักเกณฑ์การซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 14 มิถุนายน 2549 | 3 กรกฎาคม 2549 |
| - หนังสือเวียน ที่ กส.(ว) 1/2551 เรื่อง การชำระราคาซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านกองทุน | 9 มกราคม 2551 | 9 มกราคม 2551 |
| - หนังสือเวียน ที่ กส.(ว) 2/2561 เรื่อง แจ้งกำหนดเริ่มใช้รอบระยะเวลาชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แบบ 2 วัน (T+2) | 14 กุมภาพันธ์ 2561 | 2 มีนาคม 2561 |
| 2. ประกาศสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ที่ กส. 1/2556 เรื่อง หลักเกณฑ์ และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 29 กรกฎาคม 2556 | 1 สิงหาคม 2556 |
| - วิธีปฏิบัติ เรื่อง วิธีการชำระราคาซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านกองทุน | 29 กรกฎาคม 2556 | 1 สิงหาคม 2556 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|--|--|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>การชำระราคาซื้อขาย</p> <p>1. ลูกค้าจ่ายค่าซื้อภายในกำหนดดังนี้</p> <p>1) ตราสารทุน : ภายในวันที่ T+2</p> <p>2) ตราสารหนี้ :</p> <ul style="list-style-type: none"> - กรณี Net Clearing : ภายในวันที่ T+2 - กรณี Gross Clearing : <ul style="list-style-type: none"> - หากเลือก Clearing วันที่ T : ภายในวันที่ T ก่อนเวลาที่ TCH กำหนด - หากเลือก Clearing วันที่ T+1 : ภายในวันที่ T - หากเลือก Clearing วันที่ T+2 : ภายในวันที่ T+1 3) Buy-in หรือ Member Buy-in : ภายในวันที่ B (วันที่ Buy-in) <p>2. ลูกค้าจ่ายค่าซื้อตามวิธีการที่สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย กำหนด ดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> - บุคคลธรรมดา : ATS, Cash Balance , การชำระราคาผ่านกองทุน - นิติบุคคล : ATS, Cash Balance, เช็คขีดคร่อม, โอนเงิน (กรณีเช็ค ถือว่าจ่ายค่าซื้อในวันที่ธนาคารเรียกเก็บเงินได้) หรือการชำระราคาผ่านกองทุน ⁴ | <p>1. กำหนดมาตรการดำเนินการเป็นลายลักษณ์อักษร</p> <p>กรณีดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> - ลูกค้าชำระเงินล่าช้า - ลูกค้าไม่จ่ายค่าซื้อ (Default) - ลูกค้าไม่จ่ายค่าซื้อหรือรับค่าขายตามวิธีที่กำหนด <p>2. จัดทำรายงานเพื่อใช้ติดตามการชำระเงินของลูกค้า</p> <p>3. มีระบบควบคุมการซื้อเพิ่ม และการจ่ายค่าขายก่อนรับค่าซื้อหรือรับมอบหุ้น</p> <p>4. มีวิธีการควบคุมการปฏิบัติตามเกณฑ์ Gross Settlement อย่างเคร่งครัด และจัดเก็บเอกสารหลักฐานครบถ้วนให้ตรวจสอบได้</p> | <p>1. บันทึกประวัติการชำระเงินล่าช้าหรือ Default พร้อมระบุเหตุผลและการดำเนินการ</p> <p>2. บันทึกประวัติลูกค้าที่ไม่จ่ายค่าซื้อหรือรับค่าขายตามวิธีที่กำหนด พร้อมระบุเหตุผลและการดำเนินการ</p> <p>3. ควรมีการจัดทำ Report เพื่อประโยชน์สำหรับผู้บริหารในการ Monitor การชำระราคาซื้อขายให้มีประสิทธิภาพ</p> <p>4. กำหนดนโยบาย หลักเกณฑ์ วิธีการบังคับขายชัดเจนเป็นลายลักษณ์อักษรและแจ้งให้ลูกค้าทราบ</p> <p>5. อาจกำหนดให้ลูกค้าที่ Fail Settlement วางหลักประกัน 100% ก่อนซื้อในช่วงระยะเวลาหนึ่ง</p> <p>6. ก่อนทำรายการ Gross Settlement ควรมีการติดต่อกับหน่วยงานของตลท.ที่เกี่ยวข้องได้แก่ ฝ่ายกำกับบริษัทสมาชิก, ฝ่ายกำกับการซื้อขาย, ฝ่ายปฏิบัติการซื้อขาย, ฝ่ายชำระราคา เพื่อให้จัดทำรายการได้ถูกต้องและเป็นไปตามเกณฑ์</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|----------------------|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>3. สมาชิกจ่ายค่าขายภายในกำหนดดังนี้</p> <p>1) ตราสารทุน :</p> <ul style="list-style-type: none"> - กรณี Net Clearing : T+2 - กรณี Gross Clearing : ภายในวันที่ T+2 โดยมีเงื่อนไขดังนี้ <ul style="list-style-type: none"> - ได้รับอนุมัติรายการจากกรรมการผู้จัดการหรือผู้รับมอบอำนาจ ก่อนทำรายการ - เป็นรายการซื้อขายบนกระดานรายใหญ่มูลค่า ≥ 50 ล้านบาท - เป็นรายการซื้อขายของลูกค้าเท่านั้น ไม่เกี่ยวข้องกับบัญชี Port - รายงานการซื้อขายมายังตลท. ภายใน 3 วันทำการถัดจากวันที่ชำระราคาและส่งมอบ <p>2) ตราสารหนี้ :</p> <ul style="list-style-type: none"> - กรณี Net Clearing : วันที่ T+2 - กรณี Gross Clearing : <ul style="list-style-type: none"> - หากเลือก Clearing วันที่ T : วันที่ T - หากเลือก Clearing วันที่ T+1 : วันที่ T+1 <p>3) Buy-in หรือ Member Buy-in : ภายในวันที่ B+1</p> <p>4. สมาชิกจ่ายค่าขายตามวิธีการที่สมาคมหลักทรัพย์ไทย กำหนดดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> - บุคคลธรรมดา : ATS, Cash Balance , การชำระราคาผ่านกองทุน - นิติบุคคล : ATS, Cash Balance, เช็คขีดคร่อม, โอนเงิน, ชื้อตัว P/N หรือการชำระราคาผ่านกองทุน⁴ - จ่ายค่าขายโดยเข้าบัญชีลูกค้าเท่านั้น <p>5. การดำเนินการกรณีลูกค้าผิดนัดค่าซื้อ</p> <ul style="list-style-type: none"> - ไม่ให้ลูกค้าซื้อเพิ่ม จนกว่าจะได้รับค่าซื้อนั้นครบถ้วน - ไม่จ่ายค่าขายออกไปก่อนจะได้รับค่าซื้อหุ้นนั้น (ยกเว้นลูกค้าเป็น Sub-broker) | | |

⁴วิธีการชำระราคาผ่านกองทุน

- 1) การชำระราคาผ่านกองทุนให้ทำได้เฉพาะกรณีที่ลูกค้ามีวิธีปฏิบัติในการรับค่าขายหน่วยลงทุนเข้าบัญชีลูกค้าเท่านั้น
- 2) กรณีลูกค้าเปิดบัญชีกับกองทุน
 - ลูกค้าซื้อหุ้น : สมาชิกแจ้งให้กองทุนขายหน่วยลงทุนของลูกค้า และกองทุนจะจ่ายค่าขายเข้าบัญชีที่ลูกค้าใช้ตัด ATS และสมาชิกจะรับค่าซื้อโดยวิธีตัด ATS จากบัญชีนั้น
 - ลูกค้าขายหุ้น : สมาชิกนำค่าขายไปจ่ายกองทุนเพื่อซื้อหน่วยลงทุนในนามลูกค้า
 - ชื่อบัญชีกองทุนเป็นชื่อเดียวกับชื่อบัญชีลูกค้า และลูกค้าจะมี Standing Order ในการซื้อขายหน่วยลงทุนเพื่อประโยชน์ในการชำระราคาค่าซื้อขายหลักทรัพย์เท่านั้น ให้ไว้กับสมาชิก
- 3) กรณีลูกค้ามอบอำนาจให้สมาชิกจัดการ (Omnibus Account)
 - สมาชิกจัดทำบัญชีแสดงรายละเอียดความเคลื่อนไหว และยอดคงค้างของหน่วยลงทุนของลูกค้าแต่ละราย เพื่อตรวจสอบได้ตลอดเวลา

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|---|----------------|-----------------|
| 1. ข้อบังคับ ตลท. เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 14 มกราคม 2540 | 23 มกราคม 2540 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|--|--|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>การรับ-ส่งมอบหลักทรัพย์</p> <p>1. สมาชิกรับมอบหุ้นจากลูกค้าภายในกำหนดดังนี้</p> <p>1) ตราสารทุน :</p> <ul style="list-style-type: none"> - ลูกค้ายกไป : ภายใน 12.00 ของวันที่ T+1 - Sub-broker : ภายในวันที่ T+1 - Sub-broker ที่เป็นสมาชิก TCH และสามารถ Clearing โดยตรง : ภายในวันที่ T+2 - บลจ. ที่เป็นสมาชิก TCH และสามารถ Clearing โดยตรง : ภายในวันที่ T+2 - ลูกค้าต่างประเทศหรือนิติบุคคลอื่นที่ตลท. กำหนด มอบหมายให้ Custodian ที่เป็นสมาชิก TCH ชำระราคาและส่งมอบแทน และสามารถ Clearing โดยตรง : ภายในวันที่ T+2 <p>2) ตราสารหนี้ :</p> <ul style="list-style-type: none"> - กรณี Net Clearing : ภายใน 12.00 ของวันที่ T+1 - กรณี Gross Clearing : <ul style="list-style-type: none"> - หากเลือก Clearing วันที่ T : ภายในวันที่ T ก่อนเวลาที่ TCH กำหนด - หากเลือก Clearing วันที่ T+1 : ภายในวันที่ T - หากเลือก Clearing วันที่ T+2 : ภายในวันที่ T+1 <p>3) Buy-in หรือ Member Buy-in : ภายในวันที่ B (หุ้นที่ส่งมอบต้องชำระเงินแล้วและปลอดจำนำ การรอนสิทธิ หรือภาวะติดพัน)</p> <p>2. สมาชิกส่งมอบหุ้นให้ลูกค้าภายในกำหนดดังนี้</p> <p>1) ตราสารทุน : ภายในวันที่ T+3</p> <p>2) ตราสารหนี้ :</p> <ul style="list-style-type: none"> - กรณี Net Clearing : ภายในวันที่ T+3 | <p>1. มีระบบควบคุมการขายโดยไม่มีหุ้น และหากมีนโยบายอนุมัติให้ลูกค้าขายโดยไม่มีหุ้นฝากไว้กับบริษัท ต้องกำหนดหลักเกณฑ์ ขั้นตอน ผู้มีอำนาจอนุมัติไว้เป็นลายลักษณ์อักษร โดยอย่างน้อยต้องกำหนดให้มีการแสดงหลักฐานว่ามีหุ้นก่อนขาย</p> <p>2. กำหนดมาตรการดำเนินการกรณีลูกค้าส่งมอบหุ้นล่าช้าเป็นลายลักษณ์อักษร</p> <p>3. จัดทำรายงานเพื่อใช้ติดตามการรับมอบหุ้นจากลูกค้า</p> | <p>1. บันทึกประวัติการส่งมอบหุ้นล่าช้าพร้อมระบุเหตุผลและการดำเนินการ</p> <p>2. ควรมีการจัดทำ Report เพื่อประโยชน์สำหรับผู้บริหารในการ Monitor การรับ-ส่งมอบหลักทรัพย์ให้มีประสิทธิภาพ</p> <p>3. กำหนดนโยบาย หลักเกณฑ์ วิธีการบังคับซื้อขายชัดเจนเป็นลายลักษณ์อักษร และแจ้งให้ลูกค้าทราบ</p> <p>4. อาจกำหนดให้ลูกค้าที่ส่งมอบหุ้นล่าช้าส่งมอบหุ้นก่อนขายในช่วงระยะเวลาหนึ่ง</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|----------------------|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <ul style="list-style-type: none"> - กรณี Gross Clearing : - หากเลือก Clearing วันที่ T : ภายในวันที่ T - หากเลือก Clearing วันที่ T+1 : ภายในวันที่ T+1 - หากเลือก Clearing วันที่ T+2 : ภายในวันที่ T+2 <p>3) Buy-in หรือ Member Buy-in : ภายในวันที่ B</p> | | |

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|---|-------------------|-----------------|
| 1. ข้อบังคับ ตลท. เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 14 มกราคม 2540 | 23 มกราคม 2540 |
| 2. ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการรายงานเหตุการณ์ และการจัดส่งรายงานของสมาชิก พ.ศ. 2564 | 4 กุมภาพันธ์ 2564 | 15 มีนาคม 2564 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|--|---|--|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| การจัดทำรายงานการซื้อขายหลักทรัพย์แบบชำระราคาสุทธิ (Net Settlement) <ul style="list-style-type: none"> 1. รายงาน : มีรายละเอียดตามที่กำหนด และจัดเก็บไว้ที่บริษัทเพื่อตรวจสอบได้ 2. รายเดือน: จัดทำถูกต้อง และจัดส่งตลท.ภายในเวลาที่กำหนด | จัดทำรายงานถูกต้องตามเกณฑ์ และจัดส่งให้ครบถ้วนภายในเวลาที่กำหนด | มีมาตรการในการติดตามและระมัดระวังลูกค้าที่มีการซื้อขายในลักษณะหักกลบสูง เช่น การพิจารณาการเงิน, การวางหลักประกัน, Churning |

หมายเหตุ : ลูกค้าที่ได้รับยกเว้นไม่ต้องปฏิบัติตามข้อบังคับฯ

1. Sub-broker ที่เป็นสมาชิก TCH และสามารถ Clearing โดยตรง
2. บลจ. ที่เป็นสมาชิก TCH และสามารถ Clearing โดยตรง
3. ลูกค้าต่างประเทศ หรือ นิติบุคคลอื่นที่ตลท.กำหนด มอบหมายให้ Custodian ที่เป็นสมาชิก TCH ชำระราคาและส่งมอบแทน และสามารถ Clearing โดยตรง
4. บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนต่างด้าว (TTF)
5. บริษัท ไทยเอ็นวีดีอาร์ จำกัด (NVDR)

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|---|------------------|------------------|
| 1. ข้อบังคับ ตลท. เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 14 มกราคม 2540 | 23 มกราคม 2540 |
| - หนังสือเวียน ที่ กส.(ว) 12/2549 การแก้ไขหลักเกณฑ์การซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด | 14 มิถุนายน 2549 | 14 มิถุนายน 2549 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|---|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| การชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แบบที่ละรายการ (Gross Clearing) 1. ต้องได้รับอนุมัติจากกรรมการผู้จัดการหรือผู้รับมอบหมายอำนาจดำเนินการ 2. ซื้อขายบนกระดานรายใหญ่ที่มีมูลค่าตั้งแต่ 50 ล้านบาทขึ้นไป 3. เป็นการทำการรายการของลูกค้ำเท่านั้น ซึ่งไม่เกี่ยวข้องกับ Port บริษัท | มีคู่มือดำเนินการที่ระบุขั้นตอนชัดเจนให้เป็นไปตามข้อบังคับของทาง ตลท. | จัดเก็บเอกสารที่เกี่ยวข้องให้ครบถ้วน เพื่อเป็นหลักฐานในการตรวจสอบ |

การซื้อขายมาร์จิ้น

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|---|--------------------|--------------------|
| 1. ข้อบังคับ ตลท. เรื่อง การซื้อขายหลักทรัพย์ประเภทมาร์จิ้น พ.ศ. 2543 | 15 กันยายน 2543 | 18 กันยายน 2543 |
| 2. ประกาศ ตลท. เรื่อง อัตรามาร์จิ้นเริ่มต้น อัตราที่สมาชิกต้องเรียกให้ลูกค้านำเงินหรือทรัพย์สินมาวางเป็นประกันเพิ่ม และอัตราที่สมาชิกต้องดำเนินการบังคับชำระหนี้ สำหรับการซื้อขายหลักทรัพย์ประเภทมาร์จิ้น (ฉบับที่ 1) พ.ศ. 2541 | 16 กุมภาพันธ์ 2541 | 2 มีนาคม 2541 |
| 3. ประกาศ ตลท. เรื่อง บัญชีหลักทรัพย์จดทะเบียนที่บริษัทหลักทรัพย์ยึดถือไว้เป็นประกันการชำระหนี้เงินกู้ | 17 กุมภาพันธ์ 2540 | 17 กุมภาพันธ์ 2540 |
| 4. ประกาศ ตลท. เรื่อง กรณียกเว้นให้บริษัทหลักทรัพย์ไม่ต้องรักษาหลักทรัพย์จดทะเบียน | 17 กุมภาพันธ์ 2540 | 17 กุมภาพันธ์ 2540 |
| 5. หนังสือเวียนที่ กส.ว) 19/2551 เรื่องขอให้จัดส่งสำเนารายงานการทำธุรกรรม (แบบ บ.ล. 9) | 8 สิงหาคม 2551 | 8 สิงหาคม 2551 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|--|---|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>อัตรามาร์จิ้น</p> <p>สมาชิกกำหนดอัตรามาร์จิ้นแต่ละประเภทไม่ต่ำกว่าอัตราที่ทางการประกาศกำหนด ดังนี้</p> <p>1.1 อัตรามาร์จิ้นเริ่มต้น (Initial Margin Rate) = 50%</p> <p>1.2 อัตรามาร์จิ้นที่ต้องเรียกให้ลูกค้านำเงินหรือทรัพย์สินมาวางเป็นประกันเพิ่ม (Call Margin Rate)</p> <ul style="list-style-type: none"> - กรณีกู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์ เท่ากับ 35% - กรณีขายชอร์ต เท่ากับ 40% <p>1.3 อัตรามาร์จิ้นที่ต้องดำเนินการบังคับชำระหนี้ (Force Margin Rate)</p> <ul style="list-style-type: none"> - กรณีกู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์ เท่ากับ 25% - กรณีขายชอร์ต เท่ากับ 30% | <ol style="list-style-type: none"> 1. สมาชิกต้องกำหนดอัตรามาร์จิ้น ได้แก่ I.M. (Initial Margin) ไม่ต่ำกว่าอัตราที่ทางการประกาศกำหนด และ M.M. (Maintenance Margin) ต้องเท่ากับอัตราที่ทางการประกาศกำหนด 2. มีระบบการคำนวณ M.M. อย่างถูกต้อง และมีการสอบทาน การคำนวณเมื่อมีการเปลี่ยนแปลงอัตราหรือหลักเกณฑ์ดังกล่าว | <p>คำนึงถึงความเสี่ยงของหลักทรัพย์และความผันผวนของตลาดเป็นสำคัญ รวมทั้งมีการทบทวนอยู่เสมอ</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|-----------------------------|--|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| อำนาจซื้อและมูลหนี้มาร์จิ้น | <ol style="list-style-type: none"> ต้องเป็นไปตามเกณฑ์ที่ ก.ล.ต. กำหนด เช่น มูลหนี้มาร์จิ้นของลูกค้ายุบรวมกัน หักหนี้สงสัยจะสูญ ณ สิ้นวันหนึ่งๆ ต้องไม่เกิน 5 เท่าของเงินกองทุนของสมาชิก เป็นต้น มีระบบการคำนวณมูลหนี้ อำนาจซื้ออย่างถูกต้องตามวิธีการที่ ตลท.กำหนด มีการสอบทานระบบทุกครั้งที่มีการแก้ไขเปลี่ยนแปลง | <ol style="list-style-type: none"> สมาชิกควรควบคุมยอดหนี้มาร์จิ้นรวมให้อยู่ในระดับที่เหมาะสม และประเมินความเสี่ยงที่การปล่อยกู้มาร์จิ้นจะส่งผลกระทบต่อฐานะการเงินของบริษัทอย่างสม่ำเสมอ ในการพิจารณาปล่อยกู้มาร์จิ้น สมาชิกอาจพิจารณาปัจจัยต่างๆ ดังนี้ <ol style="list-style-type: none"> มูลค่าลูกหนี้มาร์จิ้นรวมต่อเงินกองทุนของบริษัท ระดับหนี้ที่กระจุกตัวในหุ้นหรือในรายลูกค้า ระดับ Illiquid collateral ของลูกหนี้มาร์จิ้นต่อมูลหนี้รวม ระดับ NCR ณ ขณะใดขณะหนึ่ง ซึ่งอาจอ่อนไหวต่อการเพิ่มขึ้นของลูกหนี้มาร์จิ้น ระดับของมูลหนี้มาร์จิ้นรวมของบริษัทเปรียบเทียบกับ Credit Line ที่บริษัทได้รับจากแหล่งเงินกู้ เช่น มีมูลหนี้มาร์จิ้นรวมประมาณ 80% ของ Credit Line อาจต้องติดตามคุณภาพลูกหนี้อย่างใกล้ชิด ควรมีการจัดทำ Report เพื่อประโยชน์สำหรับผู้บริหารในการ Monitor การปล่อยกู้มาร์จิ้นให้มีประสิทธิภาพ เช่น มีข้อมูลมูลหนี้มาร์จิ้นรวม ระดับมูลหนี้มาร์จิ้นต่อเงินกองทุน หลักทรัพย์ที่มีการปล่อยกู้สูงสุดของบริษัท และของอุตสาหกรรม เป็นต้น |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|--|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>การเรียกให้ลูกค้านำเงินหรือทรัพย์สินมาวางเป็นประกันเพิ่ม (Call Margin)</p> <p>1. หากมูลค่าทรัพย์สินของลูกค้าลดลงจนต่ำกว่ามูลค่าหลักประกันที่ต้องดำรงไว้ สมาชิกต้องเรียกเป็นหนังสือให้ลูกค้านำเงินหรือทรัพย์สินมาวางเป็นประกันเพิ่ม หรือดำเนินการอื่นใดจนทำให้ทรัพย์สินของลูกค้าไม่ต่ำกว่ามูลค่าหลักประกันที่ต้องดำรงไว้ โดยให้เรียกภายในวันทำการถัดไป</p> <p>2. มูลค่าหลักประกันที่ต้องดำรงไว้ = มูลค่าหลักทรัพย์สินและหลักทรัพย์สินที่ลูกค้าขายชอร์ต x Call Margin Rate</p> <p>3. หากลูกค้าไม่วางหลักประกันเพิ่มภายใน 5 วันทำการนับจากวันที่เรียก สมาชิกอาจบังคับชำระหนี้จากทรัพย์สินที่เป็นหลักประกันในวันทำการถัดจากวันครบกำหนดดังกล่าว จนทำให้ทรัพย์สินของลูกค้าไม่ต่ำกว่ามูลค่าหลักประกันที่ต้องดำรงไว้ ทั้งนี้ สมาชิกต้องแจ้งการบังคับชำระหนี้เป็นหนังสือให้ลูกค้าทราบภายในวันทำการถัดจากวันที่ดำเนินการ</p> <p>4. ประเภททรัพย์สินที่ลูกค้าอาจนำมาวางเพื่อเป็นประกันเพิ่มในบัญชีมาร์จิ้นเป็นไปตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด</p> | <p>1. สมาชิกต้องปฏิบัติให้เป็นไปตามเกณฑ์ที่ ตลท. กำหนด</p> <p>2. กำหนดหลักเกณฑ์และวิธีการในการเรียกหลักประกันเพิ่มและการดำเนินการกรณีลูกค้าไม่นำหลักประกันมาวางเพิ่มอย่างชัดเจนเป็นลายลักษณ์อักษร</p> <p>3. มีระบบการคำนวณมูลค่าหลักประกันที่ลูกค้าต้องวางเพิ่มอย่างถูกต้อง และการแก้ไขต้องมีผู้มีอำนาจอนุมัติ</p> <p>4. มีรายงานลูกค้ามาร์จิ้นที่ต้องเรียกหลักประกันเพิ่มพร้อมรายละเอียด เพื่อประโยชน์สำหรับเจ้าหน้าที่ที่รับผิดชอบในการติดตามให้ลูกค้าวางหลักประกันเพิ่ม</p> <p>5. มีการ update ประเภททรัพย์สินที่ลูกค้าสามารถนำมาวางเป็นหลักประกันได้ตามเกณฑ์ของสำนักงาน ก.ล.ต.</p> | <p>1. สมาชิกควรกำหนดประเภทของทรัพย์สินที่ลูกค้าสามารถนำมาวางเป็นหลักประกันได้ โดยคำนึงถึงสภาพคล่องของทรัพย์สินในการบังคับชำระหนี้ และสมาชิกควรระมัดระวังในการรับทรัพย์สินที่ค่านวนราคาขาย หรือมีโอกาสที่จะขายไม่ได้เป็นหลักประกัน</p> <p>2. สมาชิก / เจ้าหน้าที่การตลาดควรบอกกล่าวหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติในการเรียกหลักประกันเพิ่มให้ลูกค้ามาร์จิ้นทราบ รวมถึงการดำเนินการกรณีลูกค้าไม่นำหลักประกันมาวางเพิ่ม</p> <p>3. มีการสอบทานระบบการคำนวณหลักประกันที่ลูกค้าต้องวางเพิ่มอย่างสม่ำเสมอ และทุกครั้งที่มีการแก้ไขระบบ</p> <p>4. ควรให้เจ้าหน้าที่การตลาดแจ้งอัตรามาร์จิ้น ณ สิ้นวันให้ลูกค้าทราบทุกวันเมื่ออัตราดังกล่าวลดลงจนเข้าใกล้อัตรา Call Margin Rate</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|--|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>การบังคับชำระหนี้ (Force Margin)</p> <p>1. หากมูลค่าทรัพย์สินของลูกค้านลดลงจนเท่ากับหรือต่ำกว่ามูลค่าหลักประกันขั้นต่ำ</p> <p>1.1 สมาชิกต้องดำเนินการบังคับชำระหนี้จากทรัพย์สินที่เป็นหลักประกันในวันทำการถัดจากวันที่ทรัพย์สินของลูกค้าน \leq มูลค่าหลักประกันขั้นต่ำ จนทำให้ทรัพย์สินของลูกค้านสูงกว่ามูลค่าหลักประกันขั้นต่ำ</p> <p>1.2 สมาชิกต้องแจ้งการบังคับชำระหนี้ให้ลูกค้าทราบเป็นหนังสือภายในวันทำการถัดจากวันที่ดำเนินการ</p> <p>2. มูลค่าหลักประกันขั้นต่ำ = มูลค่าหลักทรัพย์และหลักทรัพย์ที่ลูกค้าขายชอร์ต x Force Margin Rate</p> <p>3. หาก ตลท. เห็นว่าสมาชิกมียอดหนี้ที่ถึงเกณฑ์บังคับชำระหนี้คงค้างในบัญชีมาร์จินมากจนอาจก่อให้เกิดความเสี่ยงต่อฐานะการเงินและความมั่นคงของบริษัท ตลท. อาจสั่งให้สมาชิกนั้นดำเนินการอย่างใดอย่างหนึ่ง ดังนี้</p> <p>3.1 ลดยอดหนี้ให้อยู่ในปริมาณที่เหมาะสมภายในเวลาที่กำหนด</p> <p>3.2 ห้ามสมาชิกให้ลูกค้าซื้อขายหลักทรัพย์ประเภทมาร์จินอีก</p> <p>3.3 กั้นเงินสำรองสำหรับหนี้ดังกล่าวให้เพียงพอ</p> <p>3.4 อื่นๆ ตามที่ ตลท. เห็นสมควร</p> | <p>1. สมาชิกต้องดำเนินการบังคับชำระหนี้ตามเกณฑ์ ตลท. โดยเคร่งครัด เพื่อป้องกันความเสี่ยงต่อฐานะการเงินของสมาชิก</p> <p>2. กำหนดหลักเกณฑ์และวิธีการในการบังคับขายที่ชัดเจนเป็นลายลักษณ์อักษร</p> <p>3. มีระบบการคำนวณมูลค่าที่ต้องบังคับขายอย่างถูกต้องและการแก้ไขต้องมีผู้มีอำนาจอนุมัติ</p> <p>4. มีรายงานลูกค้ามาร์จินที่ต้องถูกบังคับขายพร้อมรายละเอียดเพื่อให้เจ้าหน้าที่ใช้ประกอบการดำเนินการอย่างถูกต้องครบถ้วน</p> <p>5. กรณีที่มีการสั่งการให้สมาชิกดำเนินการอย่างใดอย่างหนึ่งจาก ตลาดหลักทรัพย์ บริษัทต้องมีขั้นตอน / วิธีการในการดำเนินการตามคำสั่งของ ตลท. โดยรวดเร็ว</p> | <p>1. สมาชิก / เจ้าหน้าที่การตลาดควรบอกกล่าวหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติในการบังคับชำระหนี้ของบริษัทให้ลูกค้ามาร์จิน ทราบ</p> <p>2. ควรให้เจ้าหน้าที่การตลาดแจ้งอัตรามาร์จิน ณ สิ้นวันให้ลูกค้าทราบทุกวันเมื่ออัตราดังกล่าวลดลงจนเข้าใกล้อัตรา Force Margin Rate</p> <p>3. มีการสอบทานระบบการคำนวณมูลค่าที่ต้องบังคับขายอย่างสม่ำเสมอ และทุกครั้งที่มีการแก้ไขระบบ</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|--|---|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>บัญชีคุมหลักทรัพย์ที่สมาชิกยึดถือไว้เป็นประกันการชำระหนี้เงินกู้</p> <p>1. สมาชิกต้องจัดให้มีบัญชีหลักทรัพย์ที่ตนยึดถือไว้เป็นประกันการชำระหนี้เงินกู้ โดยอย่างน้อยต้องมีรายการดังต่อไปนี้</p> <p>1.1 ชื่อและประเภทหลักทรัพย์</p> <p>1.2 วันที่ยึดถือหลักทรัพย์เป็นประกันการชำระหนี้เงินกู้</p> <p>1.3 จำนวนหลักทรัพย์ที่รับมาและจ่ายไปตามความเป็นจริง และยอดคงเหลือสุทธิ ณ สิ้นวันทำการ</p> <p>1.4 ชื่อเจ้าของหลักทรัพย์ที่สมาชิกยึดหลักทรัพย์ไว้เป็นประกันการชำระหนี้</p> <p>1.5 จำนวนหลักทรัพย์ที่สมาชิกนำไปลงทะเบียนการโอนหรือขอยกใบหลักทรัพย์ใหม่กับบริษัทที่ออกหลักทรัพย์ และสมาชิกยังไม่ได้รับหลักทรัพย์ดังกล่าวจากบริษัทที่ออกหลักทรัพย์</p> <p>1.6 จำนวนหลักทรัพย์ที่สมาชิกฝากไว้กับ TSD ในบัญชีฝากหลักทรัพย์ที่เป็นชื่อของสมาชิกเอง หรือของ TSFC</p> <p>1.7 จำนวนหลักทรัพย์ที่สมาชิกฝากไว้กับสถาบันการเงินอื่นที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p> <p>หากสมาชิกไม่สามารถลงรายการตามข้อ 1.2 และ 1.3 ได้ อาจใช้วันที่และจำนวนหลักทรัพย์ตามที่ซื้อหรือขายแทนได้ แต่หากในวันที่ยึดถือกำหนดรับหรือจ่ายหลักทรัพย์ดังกล่าว สมาชิกไม่ได้รับหลักทรัพย์เข้ามาหรือจ่ายออกไปตามจำนวนที่ลงรายการไว้ สมาชิกต้องลงวันที่และจำนวนหลักทรัพย์ที่รับเข้ามาหรือจ่ายออกไปตามจริง พร้อมเหตุผลที่ทำให้สมาชิกไม่ได้รับหรือจ่ายหลักทรัพย์นั้น</p> | <p>1. บัญชีหลักทรัพย์ที่สมาชิกจัดทำต้องมีข้อมูลสำคัญครบถ้วน และ update ทุกครั้งที่มีการเปลี่ยนแปลง โดย</p> <p>1.1 มั่นใจในความมีอยู่จริงของหลักทรัพย์ที่ยึดไว้เป็นหลักประกัน</p> <p>1.2 มียอดตรงกันกับบัญชีรายตัวลูกหนี้ที่นำหลักทรัพย์นั้นมาวางค้ำประกัน</p> <p>2. มีการกำหนดผู้มีอำนาจอนุมัติในการเบิกถอนหลักประกัน</p> | <p>ควรแบ่งแยกเจ้าหน้าที่ที่จัดทำบัญชีคุมหลักทรัพย์กับเจ้าหน้าที่ที่เก็บรักษาหลักทรัพย์อย่างชัดเจน</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|---|--|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>2. สมาชิกต้องจัดทำบัญชีหลักทรัพย์โดยมีรายละเอียดตามข้อ 1 สำหรับแต่ละหลักทรัพย์ และต้องลงรายการให้ถูกต้องครบถ้วน ให้แล้วเสร็จภายในวันทำการถัดไป และต้องพร้อมที่จะให้เรียกตรวจสอบบัญชีหลักทรัพย์ได้ตลอดเวลา</p> <p>หมายเหตุ : กรณียกเว้น ให้สมาชิกไม่ต้องรักษาหลักทรัพย์ไว้ให้ตรงตามประเภท ชนิด และจำนวนสุทธิตามที่ปรากฏในบัญชีหลักทรัพย์ ได้แก่</p> <ul style="list-style-type: none"> • สมาชิกนำหลักทรัพย์ไปลงทะเบียนการโอน หรือขอยกไปหลักทรัพย์ใหม่กับบริษัทที่ออกหลักทรัพย์ และสมาชิกยังไม่ได้รับหลักทรัพย์ดังกล่าวจากบริษัทที่ออกหลักทรัพย์ • สมาชิกนำหลักทรัพย์ไปฝากไว้กับ TSD ในบัญชีฝากหลักทรัพย์ที่เป็นชื่อของสมาชิกเอง หรือของ TSFC • สมาชิกนำหลักทรัพย์ไปฝากไว้กับสถาบันการเงินอื่นที่ ตลท. กำหนด | | |
| <p>การรายงาน ให้รายงานการทำธุรกรรมของสมาชิก (ตามแบบ บล. 9) และปริมาณการ Call-Force ในบัญชีมาร์จินตามแบบที่กำหนด และส่งไปยัง ตลท. ผ่านระบบ SCP</p> | <ol style="list-style-type: none"> 1. จัดทำรายงานถูกต้องตามเกณฑ์ และเช็คสอบกรณีมีการเปลี่ยนแปลงหลักเกณฑ์ 2. จัดส่งครบถ้วนทุกงวดและภายในเวลาที่กำหนด | <ol style="list-style-type: none"> 1. มีการเช็คสอบรายการที่ผิดปกติในรายงาน 2. กำหนดผู้มีอำนาจในการจัดส่งรายงาน และมาตรการสำรองกรณีผู้มีอำนาจไม่อยู่หรือระบบมีปัญหา |

การขายชอร์ตในตลาดหลักทรัพย์

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|---|-----------------|-----------------|
| 1. ข้อบังคับ ตลท. เรื่อง การขายชอร์ตในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2544 (ปรับปรุง 2 กรกฎาคม 2550) | 3 มกราคม 2544 | 3 มกราคม 2544 |
| 2. ข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ.2555 หมวด การปฏิบัติงานของสมาชิกที่เกี่ยวกับการซื้อขาย ข้อ 39 (1) ขายหลักทรัพย์โดยที่สมาชิกหรือลูกค้ายังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง หรือมิได้มีบุคคลใดมอบหมายให้ขายหลักทรัพย์นั้น ยกเว้นกฎหมายจะอนุญาตให้กระทำได้ (ห้ามทำ Naked Short Sell) | 16 กรกฎาคม 2555 | 3 กันยายน 2555 |
| 3. กต.(ว) 53 /2540 เรื่อง หลักเกณฑ์การขายชอร์ต วันที่ 31 ตุลาคม 2540 (Short Sell เฉพาะ SET 50) | 31 ตุลาคม 2540 | 1 มกราคม 2541 |
| 4. บส./ช 01-01 ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่องกำหนดหลักทรัพย์ที่สามารถขายชอร์ตได้ พ.ศ. 2553 (เพิ่มเป็นให้ Short Sell หุ้นในSET100) | 16 ธันวาคม 2553 | 4 มกราคม 2554 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|---|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>1. หลักทรัพย์ที่อนุญาตให้ขายชอร์ต เฉพาะในตลาดหลักทรัพย์ประกาศกำหนด ยกเว้น ผู้ดูแลสภาพคล่อง (MM) สามารถขายชอร์ตในหลักทรัพย์ที่ตนทำหน้าที่ดูแลอยู่ได้ด้วย</p> <p>☛ ปัจจุบันกำหนดให้หลักทรัพย์ที่ขายชอร์ตได้ ได้แก่ หลักทรัพย์ที่อยู่ใน SET 100 Index , Market cap.เฉลี่ยในระยะเวลา 3 เดือนไม่น้อยกว่า 5,000 ล้านบาท และมีการกระจายการถือหุ้นไม่น้อยกว่าร้อยละ 20 ของทุนชำระแล้ว, ETF, DR, NVDR และ หลักทรัพย์อ้างอิงของ ETF/DW/SSF</p> <p>2. หลักเกณฑ์ราคา สมาชิกจะเสนอขายชอร์ตได้เฉพาะในราคาที่ไม่ต่ำกว่าราคาซื้อขายครั้งสุดท้าย (Zero plus tick)</p> | <p>1. สมาชิกมีการควบคุมหลักทรัพย์ที่อนุญาตให้ขายชอร์ตและวิธีการส่งคำสั่งตามวิธีการที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p> <p>2. สมาชิกต้องพิจารณาเครดิตลูกค้าที่ให้ขายชอร์ต ลูกค้าที่ยืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์ โดยพิจารณาความเสี่ยงของลูกค้าอย่างรอบคอบและเป็นไปตามเกณฑ์ที่ ก.ล.ต.กำหนด</p> <p>3. การขายชอร์ตต้องไม่ทำให้การซื้อขายหลักทรัพย์นั้นผิดไปจากสภาพปกติ เช่น การขายที่มีผลต่อราคาอย่างมีนัยสำคัญและสมาชิกควรรู้ได้ เป็นต้น</p> | <p>1. หลักทรัพย์ที่สามารถขายชอร์ตได้ ควรเป็นหลักทรัพย์ที่มีสภาพคล่องสูง</p> <p>2. มีหลักเกณฑ์การพิจารณาหลักทรัพย์ที่อนุญาตให้ขายชอร์ตอย่างชัดเจน โดยพิจารณาถึงความเสี่ยงทั้งต่อบริษัทและตลาดโดยรวม และตรวจสอบการปฏิบัติตามเกณฑ์ที่บริษัทกำหนดอย่างสม่ำเสมอ</p> <p>3. มีการทำสัญญายืมและให้ยืมหลักทรัพย์นอกจากสาระสำคัญที่ ก.ล.ต.กำหนดแล้วควรมีสาระสำคัญที่ครอบคลุมความเสี่ยงในเรื่องต่าง ๆ เช่น การเรียกคืนหลักประกันจากผู้ให้ยืมคืนให้กับผู้ยืม การบังคับซื้อคืนหลักทรัพย์เมื่อผู้ให้ยืมเรียกคืนหลักทรัพย์ของตนหรือเมื่อหลักทรัพย์ดังกล่าว</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|---|--|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>3. การส่งคำสั่งขายชอร์ต</p> <p>สมาชิกต้องส่งคำสั่งขายชอร์ตผ่านระบบการซื้อขายโดยอัตโนมัติ (Automated Order Matching : AOM) ตามหลักเกณฑ์ดังนี้</p> <p>3.1 กรณีสมาชิกขายชอร์ต ให้เสนอขายในระหว่างเวลาทำการประจำวัน ยกเว้นช่วงก่อนปิดทำการซื้อขายช่วงที่ 2 และให้ระบุอักษร "S"</p> <p>3.2 กรณี PD และ MM ให้เสนอขายได้ในช่วงเวลาก่อนเปิดการซื้อขายเพื่อคำนวณหาราคาเปิด (Pre-open) และช่วงเวลาทำการประจำวัน</p> <p>4. การห้ามการขายชอร์ต</p> <p>4.1 ตลาดหลักทรัพย์จะกำหนดปริมาณสูงสุดของหลักทรัพย์ใดหลักทรัพย์หนึ่งที่ขายชอร์ตไว้และยังมิได้ซื้อคืน ซึ่งในเบื้องต้นได้กำหนดไว้ที่ร้อยละ 10 ของจำนวนหุ้นจดทะเบียนทั้งหมดของบริษัทนั้น ในกรณีที่มีการขายชอร์ตเกินกว่าจำนวนดังกล่าว ตลาดหลักทรัพย์อาจสั่งห้ามการขายชอร์ตหลักทรัพย์นั้นในวันทำการถัดไปจนกว่าจำนวนดังกล่าวจะลดลง</p> <p>4.2 ตลาดหลักทรัพย์อาจสั่งห้ามการขายชอร์ตในหลักทรัพย์ใดหลักทรัพย์หนึ่งเป็นการชั่วคราว หากเห็นว่าการขายชอร์ตในหลักทรัพย์นั้นต่อไปอาจก่อให้เกิดความเสี่ยงหรือความเสียหายต่อสภาพการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์</p> <p>4.3 ตลาดหลักทรัพย์อาจสั่งห้ามสมาชิกขายชอร์ตเป็นการชั่วคราวหรือสั่งให้สมาชิกซื้อคืนหลักทรัพย์ที่ขายชอร์ต หากเห็นว่าสมาชิกนั้นมีปริมาณหลักทรัพย์ที่ขายชอร์ตแล้วยังไม่ได้ซื้อคืนในหลักทรัพย์ใดหลักทรัพย์หนึ่งมากจนอาจก่อให้เกิดความเสี่ยงต่อฐานะการเงินและความมั่นคงของสมาชิก</p> <p>4.4 ตลาดหลักทรัพย์อาจสั่งห้ามสมาชิกขายชอร์ตได้ หากสมาชิกฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามความที่กำหนดไว้ในข้อบังคับนี้</p> | <p>4. การขายชอร์ตต้องมีการยืมหุ้นก่อนทุกครั้ง และสมาชิกต้องมั่นใจว่ามีหุ้นไว้ส่งมอบได้ทันก่อน clearing</p> <p>5. มีระบบการคำนวณปรับมูลค่าหลักประกันให้เป็นปัจจุบันอย่างถูกต้อง และการแก้ไขระบบต้องมีผู้อนุมัติ</p> <p>6. ต้องจัดทำรายงานที่ถูกต้อง เพื่อให้ ตลท. สามารถตรวจสอบและควบคุมปริมาณการขายชอร์ตในหลักทรัพย์ใด ๆ และหรือควบคุมสมาชิกที่ทำการขายชอร์ต เพื่อไม่ให้ส่งผลกระทบต่อธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ หรือธุรกิจหลักทรัพย์โดยรวม</p> | <p>มีมูลค่าสูงขึ้นอย่างมาก</p> <p>4. มีมาตรการป้องกันการกระจุกตัวในลูกค้าแต่ละราย</p> <p>5. มีการสอบทานระบบการคำนวณปรับมูลค่าหลักประกันอยู่เสมอ โดยเฉพาะในช่วงที่มีการปรับแก้ระบบงาน</p> <p>6. มีการควบคุมปริมาณหุ้นที่บริษัทขายชอร์ตไว้ โดยพิจารณาถึงผลกระทบต่อฐานะการเงินและสภาพคล่องของบริษัท</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|----------------------|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>5. การรายงาน</p> <p>ให้สมาชิกรวมถึงสมาชิกที่เป็น PD และ MM จัดทำรายงานดังต่อไปนี้</p> <p>5.1 รายงานการขายชอร์ตที่ยังมิได้มีการซื้อคืนทุกสิ้นวันตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดและส่งไปยังตลาดหลักทรัพย์ผ่านระบบ SCP</p> <p>5.2 บันทึกการขายชอร์ตตามแบบที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด โดยปรับปรุงให้เป็นปัจจุบันอยู่เสมอและเก็บไว้ที่บริษัทเพื่อให้ตลาดหลักทรัพย์เข้าตรวจสอบได้</p> | | |

การซื้อขายหลักทรัพย์ในบัญชีแคชบาลานซ์

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|---|------------------|------------------|
| 1. ข้อบังคับ ตลท. เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสด (ความหมายของ บัญชีแคชบาลานซ์(Cash Balance)) | 14 มกราคม 2540 | 23 มกราคม 2540 |
| 2. ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์(Cash Balance) พ.ศ.2551 | 21 พฤษภาคม 2551 | 1 กรกฎาคม 2551 |
| 3. ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่องการให้สมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์(Cash Balance) (ฉบับที่ 4)พ.ศ.2554 ลงวันที่ 15 มิถุนายน 2554 | 15 มิถุนายน 2554 | 15 มิถุนายน 2554 |
| 4. หนังสือเวียนที่ กล.(ว) 10 /2551 เรื่องปรับปรุงมาตรการกำกับการซื้อขายหลักทรัพย์ ลงวันที่ 21 พฤษภาคม 2551 | 21 พฤษภาคม 2551 | 21 พฤษภาคม 2551 |
| 5. หนังสือเวียน ที่ กล.(ว) 12 /2551 เรื่อง ชี้แจงวิธีการปฏิบัติของสมาชิกในการซื้อหลักทรัพย์ที่เข้าข่ายต้องวางเงินสดไว้ล่วงหน้าเต็มจำนวนที่จะซื้อหลักทรัพย์ก่อนการซื้อหลักทรัพย์นั้น ลงวันที่ 16 มิถุนายน 2551 | 16 มิถุนายน 2551 | 16 มิถุนายน 2551 |
| 6. หนังสือเวียนที่ กข.(ว) 2/2561 เรื่อง มาตรการเตือนผู้ลงทุน กรณีบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจกระทบต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจ | 6 มีนาคม 2561 | 2 กรกฎาคม 2561 |
| 7. ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์(Cash Balance) พ.ศ.2562 | 21 มีนาคม 2562 | 1 เมษายน 2562 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|--|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>1. หลักทรัพย์ที่เข้าข่ายมาตรการกำกับการซื้อขาย</p> <p>ระดับ 1: ต้องซื้อในบัญชี Cash Balance</p> <p>ระดับ 2: ต้องซื้อในบัญชี Cash Balance และห้ามนำหลักทรัพย์นั้นมาเป็นหลักประกันเพื่อค้ำวงเงินซื้อขาย</p> <p>ระดับ 3: ต้องซื้อในบัญชี Cash Balance ห้ามนำหลักทรัพย์นั้นมาเป็นหลักประกันเพื่อค้ำวงเงินซื้อขาย และห้าม Net settlement</p> <p><u>หมายเหตุ</u></p> <p>1. Cash Balance หมายความว่าบัญชีที่ลูกค้าต้องวางเงินสดไว้ล่วงหน้ากับสมาชิกเต็มจำนวนก่อนซื้อหลักทรัพย์</p> <p>2. การห้ามค้ำวงเงินซื้อขาย หมายความว่า ห้ามสมาชิกใช้หลักทรัพย์เป็นหลักประกันในการค้ำวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ ในทุกประเภทบัญชี</p> | <p>1. มีระบบที่ควบคุมไม่ให้หลักทรัพย์ที่ตลาดหลักทรัพย์ประกาศให้ซื้อในบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ไปซื้อในบัญชีประเภทอื่น ตามระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด เช่น วิธีควบคุมด้วยระบบคอมพิวเตอร์</p> | <p>กรณีที่บริษัทมีนโยบาย กำหนดให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์ในบัญชีแคชบาลานซ์ มากกว่าหลักทรัพย์ที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ต้องมั่นใจว่าบริษัทมีระบบที่ควบคุมไม่ให้เกิดปัญหาหรือความเสี่ยงที่กระทบต่อข้อบังคับของตลาดหลักทรัพย์</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|--|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>3. ห้าม Net settlement หมายความว่า ห้ามสมาชิกหักกลบลบราคาซื้อหรือราคาขาย หลักทรัพย์เดียวกันในวันเดียวกัน (ซื้อและขายหลักทรัพย์เดียวกันในวันเดียวกัน ค่าขาย คำนวณเป็นเงินในวันทำการถัดไป)</p> <p>2. ให้ลูกค้าซื้อหลักทรัพย์ด้วยบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ตามหลักเกณฑ์ ดังต่อไปนี้</p> <p>1) หลักทรัพย์อยู่ภายใต้มาตรการดำเนินการตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ ว่าด้วยมาตรการดำเนินการกรณีบริษัทจดทะเบียนมีเหตุการณ์ที่อาจมีผลกระทบต่อฐานะการเงินและการดำเนินธุรกิจ</p> <p>2) หลักทรัพย์ที่ให้มีการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ กรณีบริษัทจดทะเบียนอยู่ระหว่าง ดำเนินการตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดเรื่องแนวทางการดำเนินการต่อบริษัทจดทะเบียนที่มีการดำเนินงานหรือฐานะทางการเงินที่เข้าข่ายอาจถูกเพิกถอน</p> <p>3) หลักทรัพย์ที่ให้มีการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ก่อนวัน ที่มีผลเป็นการเพิกถอน ตามที่ คณะกรรมการกำหนดตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการเพิกถอน หลักทรัพย์</p> <p>4) หลักทรัพย์ที่ให้มีการซื้อหรือขายหลักทรัพย์กรณีมีการสั่งห้ามซื้อหรือขาย หลักทรัพย์ใดหลักทรัพย์หนึ่งในตลาดหลักทรัพย์เป็นการชั่วคราว โดยการขึ้นเครื่องหมาย SP ไว้ที่หลักทรัพย์นั้นครบตามระยะเวลาที่กำหนดตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่า ด้วยหลักเกณฑ์เงื่อนไขและวิธีการเกี่ยวกับการห้ามซื้อหรือขายหลักทรัพย์จดทะเบียนเป็น การชั่วคราว</p> | <p>2. ก่อนการซื้อหลักทรัพย์ ลูกค้าต้องวางเงิน สดไว้ ล่วงหน้าเต็มจำนวนที่จะซื้อหลักทรัพย์ หรือ ขายหลักทรัพย์ในบัญชีแคชบาลานซ์ หรือขายหลักทรัพย์ที่ปลอดภาระซึ่งโอนมา จากบัญชีอื่น</p> <p>3. มีระบบที่ควบคุมการซื้อต้องไม่เกินกว่า เงินสดที่วางเป็นประกัน และการคืนเงิน จากการขาย</p> <p>4. สุ่มตรวจสอบหลักทรัพย์ที่ตลาดหลักทรัพย์ ประกาศให้ซื้อในบัญชีแคชบาลานซ์ (Cash Balance) ไปซื้อในบัญชีประเภทอื่น วงเงินที่ ซื้อ และการเลี้ยงซื้อเกินวงเงินโดยวิธีการ ต่าง ๆ เช่น การโอนรายการซื้อขายระหว่าง ลูกค้า หรือโอนหุ้นที่ยังไม่ปลอดภาระจาก บัญชีอื่น มาขายเพื่อเป็นเงินในบัญชี แคชบาลานซ์ (Cash Balance)</p> <p>5. มีระบบที่ควบคุมไม่ให้หลักทรัพย์ที่ตลาด หลักทรัพย์ประกาศให้ซื้อในบัญชีแคชบา ลานซ์ (Cash Balance) ไปซื้อในบัญชี ประเภทอื่น ตามระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์ กำหนด เช่น วิธีควบคุมด้วยระบบ คอมพิวเตอร์</p> <p>6. มีการควบคุมให้ลูกค้าซื้อขายหลักทรัพย์ ภายใต้มาตรการที่ ตลท.กำหนด</p> | |

การบังคับจำหน่ายหรือบังคับชำระหนี้

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|--|----------------|-----------------|
| 1. ประกาศ ตลท. เรื่อง การขายหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เพื่อการบังคับจำหน่ายหรือบังคับชำระหนี้ พ.ศ. 2555 | 3 กันยายน 2555 | 16 กรกฎาคม 2555 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|--|---|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>การขายหลักทรัพย์¹ในตลาดหลักทรัพย์เพื่อการบังคับจำหน่ายหรือบังคับชำระหนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> ให้กระทำด้วยระบบการซื้อขายและโดยสมาชิก ให้นำข้อบังคับ ตลท. ว่าด้วยการซื้อขาย การชำระราคา และการส่งมอบหลักทรัพย์จดทะเบียน และประกาศ ตลท. ที่ออกตามข้อกำหนดดังกล่าว มาใช้บังคับกับการขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์เพื่อบังคับจำหน่ายหรือบังคับชำระหนี้ การชำระราคา และการส่งมอบหลักทรัพย์ดังกล่าว เท่าที่ไม่ขัดแย้งกับประกาศนี้ | <ol style="list-style-type: none"> มีการตรวจสอบเพื่อให้มั่นใจว่า การขายหลักทรัพย์นี้เป็นการบังคับชำระหนี้ตามขั้นตอนของกฎหมายที่เกี่ยวข้อง สมาชิกดำเนินการบังคับจำหน่ายหรือบังคับชำระหนี้ตามเกณฑ์ที่ ตลท. กำหนด หลังจากบังคับชำระหนี้แล้ว สมาชิกต้องแจ้งไปยังเจ้าของหลักทรัพย์ ผู้บังคับจำหน่าย หรือบุคคลที่เกี่ยวข้อง ตามเกณฑ์ที่กำหนด | - |
| <p>กรณีที่สมาชิกผู้ขายหลักทรัพย์ด้วยวิธีการบันทึกการซื้อขายประเภท Trade Report - Big Lot หรือ Trade Report – Foreign</p> <ol style="list-style-type: none"> สมาชิกผู้ขายต้องประกาศโฆษณาเสนอขายหลักทรัพย์ในระบบซื้อขายเป็นเวลาไม่น้อยกว่าหนึ่งชั่วโมง ก่อนที่จะมีการเจรจาตกลงกับสมาชิกที่ต้องการซื้อ สมาชิกผู้ขายต้องเจรจากับสมาชิกที่ต้องการซื้อ และต้องตกลงขายหลักทรัพย์ให้แก่สมาชิกที่เสนอราคาซื้อสูงสุด | | |

¹ หลักทรัพย์ หมายถึง หลักทรัพย์จดทะเบียนที่จำหน่ายหรือถูกยึดไว้เป็นประกันการชำระหนี้

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|----------------------|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>3. สมาชิกต้องบันทึกการซื้อขายเข้าสู่ระบบการซื้อขายภายใน 10 นาทีนับแต่เวลาที่สมาชิกตกลงกันได้</p> <p>4. เมื่อสมาชิกขายหลักทรัพย์แล้ว ต้องบอกกล่าวเป็นหนังสือไปยังเจ้าของหลักทรัพย์ภายในวันทำการถัดจากวันที่ขายหลักทรัพย์นั้น ทั้งนี้ ผู้บังคับจำหน่าย / ผู้บังคับชำระหนี้ / บุคคลที่เกี่ยวข้องกับผู้บังคับจำหน่ายหรือผู้บังคับชำระหนี้² มีสิทธิซื้อหลักทรัพย์ดังกล่าวเพื่อตนเองได้ เมื่อมีหนังสือบอกกล่าวไปยังเจ้าของหลักทรัพย์นั้นว่าตนถือสิทธิซื้อหลักทรัพย์นั้น</p> <p>5. ให้สมาชิกผู้ขายหลักทรัพย์เพื่อการบังคับจำหน่ายหรือบังคับชำระหนี้ออกหลักฐานรับรองการขายหลักทรัพย์ให้แก่ผู้บังคับจำหน่ายหรือผู้บังคับชำระหนี้ภายในวันทำการถัดจากวันที่ขายหลักทรัพย์นั้น โดยระบุว่าเป็นการขายเพื่อบังคับจำหน่ายหรือบังคับชำระหนี้ และมีรายการที่นายทะเบียนหลักทรัพย์กำหนด ทั้งนี้ ไม่ให้ใช้บังคับกับกรณีที่เป็นการขายหลักทรัพย์ที่เจ้าของหลักทรัพย์มีสัญญาให้บริษัทหลักทรัพย์ยึดถือไว้เป็นประกันการชำระหนี้เงินกู้</p> | | |

² บุคคลที่เกี่ยวข้องกับผู้บังคับจำหน่ายหรือผู้บังคับชำระหนี้ หมายถึง

- (1) ห้างหุ้นส่วนจำกัดที่ผู้บังคับจำหน่ายหรือผู้บังคับชำระหนี้เป็นหุ้นส่วนที่มีหุ้นรวมกันเกิน 30% ของหุ้นทั้งหมดของห้างหุ้นส่วนจำกัด หรือ
- (2) บริษัทจำกัดหรือบริษัทมหาชนจำกัดที่ผู้บังคับจำหน่ายหรือผู้บังคับชำระหนี้หรือห้างหุ้นส่วนตาม (1) ถือหุ้นรวมกันเกิน 30% ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น หรือ
- (3) บริษัทจำกัดหรือบริษัทมหาชนจำกัดที่ผู้บังคับจำหน่ายหรือผู้บังคับชำระหนี้หรือห้างหุ้นส่วนตาม (1) หรือบริษัทตาม (2) ถือหุ้นรวมกันเกิน 30% ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น

Sub Broker

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|--|-----------------|-----------------|
| 1. ข้อบังคับ ตลท. เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการทำสัญญาเป็นนายหน้าหรือตัวแทนซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ให้แก่บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก พ.ศ. 2543 | 31 สิงหาคม 2543 | 1 กันยายน 2543 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|--|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>1. ต้องทำสัญญาให้ Sub Broker ยินยอมปฏิบัติตามกฎระเบียบของ ตลท. ที่บังคับใช้กับบริษัทสมาชิก โดยมีเนื้อหาสัญญาขึ้นต่อกับแบบที่ ตลท. กำหนดรายละเอียดในสัญญาโดยสังเขป</p> <p>1) บริษัทรับรองการได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์</p> <p>2) บริษัทตกลงยินยอมปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ข้อบังคับ ประกาศ หรือหนังสือเวียนของตลาดหลักทรัพย์ หรือมติคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ในส่วนที่ใช้บังคับกับสมาชิก ตลอดจนมติที่ประชุมสมาชิก เช่นเดียวกับที่สมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ต้องปฏิบัติ</p> <p>3) บริษัทตกลงยินยอมให้ตลาดหลักทรัพย์ตรวจสอบเอกสารและสมุดบัญชีของบริษัทตามที่ตลาดหลักทรัพย์ใช้บังคับกับสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ รวมทั้งยินยอมให้ตลาดหลักทรัพย์ดำเนินการติดต่อบริษัทเช่นเดียวกับที่ตลาดหลักทรัพย์ดำเนินการต่อสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์</p> <p>4) หากบริษัทฝ่าฝืนไม่ปฏิบัติตามข้อ (2) และ (3) บริษัทตกลงยินยอมให้สมาชิกดำเนินการใด ๆ ตามคำสั่งของตลาดหลักทรัพย์</p> <p>5) หากบริษัทไม่ปฏิบัติตามสัญญาข้อใดข้อหนึ่ง บริษัทจะดำเนินการปรับปรุงแก้ไขให้ถูกต้องตามคำสั่งของสมาชิก หรือให้สมาชิกบอกเลิกสัญญาได้ทันที โดยไม่เรียกร้องค่าเสียหายใด ๆ</p> | <p>1. มีการทำสัญญาระหว่างสมาชิกกับ Sub Broker ที่มีผลบังคับให้ตลาดหลักทรัพย์ดำเนินการกับ Sub Broker นั้นได้ตามกฎหมาย ทั้งนี้เพื่อ</p> <ul style="list-style-type: none"> - ให้ Sub broker มีการปฏิบัติตามกฎ ระเบียบ ของ ตลท. เช่นเดียวกับบริษัทสมาชิก - ตลท. หรือหน่วยงานกำกับดูแลของทางการสามารถกำกับตรวจสอบการปฏิบัติงาน และดำเนินการลงโทษ Sub Broker ที่ไม่ปฏิบัติตามเกณฑ์ได้ เพื่อให้เกิดความเท่าเทียมกันในอุตสาหกรรม - ลูกค้าที่ใช้บริการกับ Sub Broker จะได้รับการคุ้มครองและกำกับดูแลจากหน่วยงานทางการ เช่นเดียวกับลูกค้าของบริษัทสมาชิก <p>2. มีการตรวจสอบคุณสมบัติของ Sub Broker เป็นไปตามเงื่อนไขที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด ได้แก่</p> <ul style="list-style-type: none"> - ได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ | <p>1. นอกจากรายละเอียดขั้นต่ำที่ ตลท. กำหนดแล้ว มีข้อสัญญาอื่นเพิ่มเติมที่ครอบคลุมความเสี่ยงในด้านอื่น ๆ</p> <p>2. มีมาตรการรองรับกรณี Sub Broker มีคุณสมบัติไม่ครบถ้วนในการเป็นสมาชิกสำนักหักบัญชีและเกิดการผิดนัดชำระราคา</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|---|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>2. สมาชิกต้องดำเนินการเพื่อให้ Sub Broker ปฏิบัติตามข้อตกลงและเงื่อนไขในสัญญาตามข้อ 1</p> <p>3. Sub Broker ต้องเป็นสมาชิกสำนักหักบัญชีและเป็นสมาชิกของกองทุนเพื่อการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์</p> <p>ยกเว้น : Sub Broker นั้นมีคุณสมบัติไม่ครบถ้วนตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด</p> <p>4. ให้สมาชิกแจ้งตลาดหลักทรัพย์ทราบเป็นหนังสือภายใน 3 วันนับแต่วันที่ทำหรือบอกเลิกสัญญากับ Sub Broker โดยส่งสำเนาสัญญาพร้อมกับการแจ้งด้วย</p> | <p>- เป็นสมาชิกสมาชิกสำนักหักบัญชีและเป็นสมาชิกของกองทุนเพื่อการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์</p> <p>3. มีมาตรการควบคุมระบบการรับส่งคำสั่งซื้อขายระหว่างสมาชิกกับ Sub Broker ให้เป็นไปตามเกณฑ์ที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p> <p>4. ต้องทำหนังสือแจ้งตลาดหลักทรัพย์เมื่อมีการทำหรือบอกเลิกสัญญาภายในเวลาที่กำหนด</p> | |

การซื้อขายหุ้นของสมาชิกหรือบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้อง

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|---|-------------------|-----------------|
| 1. ข้อบังคับ ตลท. เรื่อง การซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2555 | 16 กรกฎาคม 2542 | 3 กันยายน 2555 |
| 2. ประกาศ ตลท. เรื่อง การซื้อขาย การชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2555 | 16 กรกฎาคม 2542 | 3 กันยายน 2555 |
| 3. ประกาศสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ที่ กส. 2/2556 เรื่อง การซื้อขายหลักทรัพย์ของสมาชิกหรือบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิกในฐานะนายหน้าหรือตัวแทนของลูกค้า | 29 กรกฎาคม 2556 | 1 สิงหาคม 2556 |
| 4. ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการรายงานเหตุการณ์และการจัดส่งรายงานของสมาชิก พ.ศ. 2564 | 4 กุมภาพันธ์ 2564 | 4 มกราคม 2564 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|---|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>1. กรณีสมาชิกเป็นนายหน้าซื้อขายหุ้นของสมาชิกเอง</p> <p>1.1 ซื้อขายในบัญชีเงินสด</p> <p>1.2 มีมาตรการแก้ไข Trading Error ที่เหมาะสมและชัดเจน โดยไม่ทำให้สมาชิกเป็นผู้ถือหุ้นของบริษัทตนเอง เช่น จัดตั้งบัญชีเฉพาะขึ้น</p> <p>1.3 เปิดเผยให้ลูกค้าทราบถึงลักษณะที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ (Conflict of Interest) ตามที่กำหนดในหลักเกณฑ์สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ได้แก่</p> <p>1.3.1 เปิดเผยให้ลูกค้าทราบถึง Conflict of Interest เมื่อให้คำแนะนำหรือคำปรึกษา การลงทุนหุ้นนั้น</p> <p>1.3.2 เปิดเผย Conflict of Interest ในรายงานหรือบทวิเคราะห์การลงทุนหุ้นนั้น</p> <p>2. กรณีสมาชิกเป็นนายหน้าซื้อขายหุ้นของบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องกับสมาชิก</p> <p>เปิดเผยให้ลูกค้าทราบถึงลักษณะที่อาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ (Conflict of Interest) ตามที่กำหนดในหลักเกณฑ์สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ได้แก่</p> <p>2.1 เปิดเผยให้ลูกค้าทราบถึง Conflict of Interest เมื่อให้คำแนะนำหรือคำปรึกษา การลงทุนหุ้นนั้น</p> | <p>1. มีระบบควบคุมไม่ให้ลูกค้าซื้อหุ้นของบริษัทในบัญชีมาร์จิ้น และไม่ให้บริษัทซื้อหุ้นตนเองเข้า Port</p> <p>2. มีมาตรการควบคุมการให้คำแนะนำหุ้นดังกล่าวแก่ลูกค้า โดยควรจัดให้มีเอกสารหรือหลักฐานในการให้คำแนะนำ</p> <p>3. มีการปรับปรุง List รายชื่อบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องให้ข้อมูลเป็นปัจจุบันอยู่เสมอ</p> <p>4. จัดทำรายงานถูกต้องตามเกณฑ์และจัดส่งภายในเวลาที่กำหนด</p> | <p>1. จัดอบรมหรือจัดทำคู่มือ Marketing โดยแจ้ง List รายชื่อบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้อง กฎเกณฑ์ และบทลงโทษให้ทราบ</p> <p>2. กำหนดกฎระเบียบในเรื่องการรักษาความลับข้อมูลที่เป็น Non Public Information ของบริษัทและบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้อง</p> <p>3. มีระบบป้องกันการล่วงรู้ข้อมูลภายใน (Chinese Wall) เช่น การแบ่งแยกหน้าที่ พื้นที่ และอุปกรณ์ของหน่วยงานที่มีข้อมูลประเภท Non Public Information</p> <p>4. มีระบบจัดการรายการ Trading Error หุ้นของตนเอง เช่น กำหนดผู้มีหน้าที่รับผิดชอบโดยตรง</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|--|----------------------|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>2.2 เปิดเผย Conflict of Interest ในรายงานหรือบทวิเคราะห์การลงทุนหุ้นนั้น</p> <p>2.3 ลักษณะของบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้อง</p> <ul style="list-style-type: none"> - บริษัทที่ถือหุ้นในสมาชิก หรือสมาชิกถือหุ้น ที่ทำให้บริษัทหรือสมาชิกมีสิทธิออกเสียงเกินกึ่งหนึ่งไม่ว่าทางตรงหรือทางอ้อม - บริษัทที่มีอำนาจควบคุมสมาชิก หรือสมาชิกมีอำนาจควบคุม โดยมีอิทธิพลต่อการกำหนดนโยบายดำเนินงานอย่างมีนัยสำคัญ - ผู้แทนบริษัทเป็นกรรมการเกินกึ่งหนึ่งของสมาชิก หรือผู้แทนสมาชิกเป็นกรรมการเกินกึ่งหนึ่งของบริษัทนั้น <p>3. จัดทำหลักเกณฑ์การห้ามใช้ Insider Trading กับลูกค้า และการห้ามซื้อขายหุ้นที่ทำให้เกิด Conflict of Interest ระหว่างสมาชิกกับลูกค้า รวมทั้งบทลงโทษพนักงานที่ไม่ปฏิบัติตาม</p> <p>4. จัดส่งรายงานความสัมพันธ์กับบริษัทจดทะเบียนที่มีส่วนเกี่ยวข้อง : ภายใน 14 วันนับจากวันที่เริ่มมีความเกี่ยวข้องหรือมีการเปลี่ยนแปลง</p> <p>5. ประกาศรายชื่อบริษัทที่มีส่วนเกี่ยวข้องไว้ในที่เปิดเผย ณ สำนักงานของสมาชิก : ภายใน 7 วันนับจากวันที่เริ่มมีความเกี่ยวข้องหรือมีการเปลี่ยนแปลง</p> <p>6. จัดให้มีระบบกำกับดูแลและตรวจสอบการปฏิบัติตามประกาศนี้ หากพบการฝ่าฝืนให้รายงานตลท.ทราบทันที</p> | | |

บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|--|-----------------------------------|---------------------------------|
| 1. ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย พ.ศ. 2555 | 16 กรกฎาคม 2555 | 3 กันยายน 2555 |
| 2. ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2556 | 16 กรกฎาคม 2556 28 ตุลาคม 2559 | 1 สิงหาคม 2556 1 มกราคม 2560 |
| 3. หนังสือเวียนที่ กส.(ว) 5 /2559 เรื่องการจัดทำและนำเสนอรายงานกรณีบริษัทสมาชิกไม่ได้เปิดเผยการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต (Trader ID) ภายในระยะเวลาตามที่ข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ฯ | 4 กุมภาพันธ์ 2564 | 15 มีนาคม 2564 |
| 4. ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง บุคคลที่เกี่ยวข้องในระบบการซื้อขาย (ฉบับที่ 6) พ.ศ. 2564 | | |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|--|---|--|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>1. ผู้ดูแลสภาพคล่อง</p> <p>1.1 ต้องมีคุณสมบัติดังต่อไปนี้</p> <p>(1) เป็นสมาชิก หรือเป็นนิติบุคคลที่มีใช้สมาชิก ซึ่งได้รับการรับรองการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องจากสมาชิก โดยนิติบุคคลดังกล่าวต้องทำธุรกรรมชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ผ่านสมาชิก</p> <p>(2) มีประสบการณ์ในการเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง หรือมีบุคลากรผู้ปฏิบัติงานที่มีความรู้และความสามารถที่เชื่อถือได้ว่าจะปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลสภาพคล่องได้</p> <p>(3) มีระบบงานหรือกระบวนการที่แสดงให้เห็นได้ว่ามีความพร้อมในการปฏิบัติหน้าที่เป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง รวมถึงมีนโยบายและมาตรการการจัดการความเสี่ยงที่เพียงพอ</p> <p>(4) ไม่อยู่ระหว่างการไม่อนุญาตให้ขึ้นทะเบียนเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องที่อยู่ในระหว่างการถูกลงโทษ</p> <p>(5) มีคุณสมบัติอื่นใดตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p> | <p>1. ปรับปรุง List รายชื่อหลักทรัพย์ที่สมาชิกทำหน้าที่เป็นผู้ดูแลสภาพคล่องให้มีข้อมูลเป็นปัจจุบันอยู่เสมอและมีการเปิดเผยต่อผู้ลงทุนตามเกณฑ์</p> <p>2. มีการตรวจสอบบทวิเคราะห์ที่ออกโดยบริษัทว่ามี การเปิดเผยต่อนักลงทุนกรณีที่สมาชิกจัดทำบทวิเคราะห์ในหลักทรัพย์ที่สมาชิกทำหน้าที่เป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง</p> <p>3. มีระบบการตรวจสอบการทำหน้าที่เสนอซื้อขาย ในฐานะผู้ดูแลสภาพคล่องว่ามีการส่งคำสั่งอย่างต่อเนื่อง (Continuous Quotes) เพื่อให้หลักทรัพย์มีสภาพคล่อง</p> <p>4. สุ่มตรวจสอบการปฏิบัติงานให้เป็นไปตามข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์</p> | <p>1. ควรกำกับดูแลการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องให้เป็นไปตามแนวทางในการปฏิบัติหน้าที่ของบุคลากรในธุรกิจตลาดทุนของหน่วยงานที่ทำหน้าที่กำกับดูแล</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|---|--|--|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>1.2 ประกาศชื่อหลักทรัพย์ที่ผู้ดูแลสภาพคล่องทำหน้าที่ไว้ในที่เปิดเผยและในกรณีที่ผู้ดูแลสภาพคล่องจัดทำบทวิเคราะห์หลักทรัพย์ให้กับลูกค้า ต้องระบุชื่อหลักทรัพย์ที่ตนเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องในบทวิเคราะห์นั้นด้วย</p> <p>1.3 ต้องทำหน้าที่ตามเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในสารสนเทศที่ได้แจ้งตลาดหลักทรัพย์ฯ และมีหน้าที่ทำการเสนอซื้อขายอย่างต่อเนื่อง (Continuous Quotes)</p> | | |
| <p>2. เจ้าหน้าที่รับอนุญาต</p> <p>2.1 ต้องมีและดำรงคุณสมบัติ ดังต่อไปนี้</p> <p>(1) เป็นผู้บรรลุนิติภาวะ</p> <p>(2) ไม่เคยถูกเพิกถอน Trader ID ภายในรอบระยะเวลา 5 ปีก่อนการขอแต่งตั้ง เพราะการลงโทษของตลท.</p> <p>(3) เป็นพนักงานหรือลูกจ้างประจำที่ปฏิบัติหน้าที่เต็มเวลาของบุคคลดังต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> - สมาชิกที่ขอแต่งตั้งเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต หรือ - บริษัทในกลุ่มเดียวกันกับสมาชิก หรือนิติบุคคลอื่นที่ทำสัญญาเป็นผู้ดูแลสภาพคล่องให้แก่สมาชิก เฉพาะกรณีเพื่อทำหน้าที่ดูแลสภาพคล่อง หรือธุรกรรมอื่นที่กำหนด โดยสมาชิกต้องกำหนดขอบเขตความรับผิดชอบและควบคุมดูแลการปฏิบัติหน้าที่ของเจ้าหน้าที่รับอนุญาตให้เป็นไปตามข้อกำหนดของตลท.ด้วย - บริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก หรือตัวแทนสนับสนุนการซื้อขายหน่วยลงทุนที่ทำสัญญาเป็นตัวแทนสนับสนุนการซื้อขายหน่วยลงทุนกับบริษัทหลักทรัพย์ที่มีใช้สมาชิก ที่ขอแต่งตั้งเป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาต <p>(4) ในกรณีที่เป็นเจ้าหน้าที่รับอนุญาตของบริษัทหลักทรัพย์อื่นมาก่อน ต้องแสดงได้ว่า ไม่เคยประพฤติผิดจรรยาบรรณหรือก่อให้เกิดความเสียหายต่อลูกค้าตามแนวทางที่ ASCO กำหนดโดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ต.</p> <p>(5) มีคุณสมบัติทางการศึกษาหรือมีประสบการณ์ตามที่ตลท.กำหนด</p> | <p>1. กรณีที่เกิดเหตุการณ์ที่สมาชิกต้องเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาตต่อ ตลท. ต้องตรวจสอบว่าบริษัทมีการยื่นขอเพิกถอนภายใน 7 วัน ผ่านระบบรวมทั้งจัดส่งเอกสารหลักฐานมายังตลท.</p> <p>2. มีระบบป้องกันและตรวจสอบให้แน่ใจได้ว่าเจ้าหน้าที่ Trader ID ไม่มีการเปิดเผยหมายเลขประจำตัวให้แก่บุคคลอื่นล่วงรู้</p> <p>3. ตรวจสอบพฤติกรรมกรรมการส่งคำสั่งซื้อขายที่ไม่เหมาะสม ของเจ้าหน้าที่รับอนุญาต เช่น Insider Trading , False Market , Front Running เป็นต้น</p> <p>4. ตรวจสอบให้แน่ใจว่าเจ้าหน้าที่รับอนุญาตไม่มีลักษณะเข้าข่ายการเข้าไปยุ่งเกี่ยวกับบัญชีลูกค้าเพื่อตนเองหรือผู้อื่น</p> <p>5. ตรวจสอบการรับคำสั่งซื้อขายจากลูกค้าว่าไม่เข้าข่ายการวิเคราะห์การลงทุนหรือแนะนำการลงทุนแก่ผู้ลงทุนโดยไม่ได้รับความเห็นชอบให้ปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าวจาก ก.ล.ต.</p> | <p>1. กำหนดขั้นตอนในการแจ้งและเพิกถอน Trader ID ว่าเป็นลายลักษณ์อักษร</p> <p>2. มีระบบที่สามารถเช็คสอบฝั่งที่หนึ่ง (IP Address) เพื่อเปรียบเทียบกับทะเบียน Order รวมทั้งทะเบียนที่การรับคำสั่งซื้อขายจากลูกค้า เพื่อตรวจสอบว่ามีการเปิดเผย Trader ID ให้บุคคลอื่นล่วงรู้</p> |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|--|---|---------------------|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>(6) ไม่เป็นบุคคลที่มีลักษณะต้องห้ามของบุคลากรในธุรกิจตลาดทุนตามที่ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนกำหนด</p> <p>2.2 สมาชิกขอเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต</p> <ul style="list-style-type: none"> - เมื่อเจ้าหน้าที่รับอนุญาตหยุดปฏิบัติหน้าที่เกี่ยวกับการส่งคำสั่งซื้อขาย หรือ ไม่มีความจำเป็นต้องใช้ Trader ID ในการปฏิบัติงาน หรือ ขาดคุณสมบัติการเป็นพนักงานหรือลูกจ้างประจำ ให้สมาชิกยื่นขอเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาตต่อตลาดหลักทรัพย์ตามแบบที่กำหนดภายใน 7 วัน นับแต่วันที่เกิดเหตุการณ์ <p>2.3 ห้ามเปิดเผยหมายเลขประจำตัวแก่บุคคลอื่น</p> <p>2.4 หน้าที่ของเจ้าหน้าที่รับอนุญาต</p> <ul style="list-style-type: none"> - ปฏิบัติตามกฎหมายและหรือให้ความร่วมมือแก่ตลาดหลักทรัพย์ในการป้องกันการกระทำที่ฝ่าฝืนกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ รวมทั้งไม่ร่วมมือหรือให้ความช่วยเหลือแก่บุคคลอื่นในการกระทำที่ฝ่าฝืนกฎหมาย เช่นกัน - ไม่ส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสม หรือส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์ที่รู้หรือควรรู้ว่าอาจเข้าข่ายเป็นความผิดตามกฎหมาย - ไม่ใช่ข้อมูลของลูกค้าหรือข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์ที่ได้จากการปฏิบัติหน้าที่ของตนในการแสวงหาประโยชน์เพื่อตนเองหรือบุคคลอื่น - ไม่ส่งคำสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์เพื่อตนเองหรือบุคคลอื่นโดยใช้บัญชีของลูกค้า - ไม่วิเคราะห์การลงทุนหรือแนะนำการลงทุนแก่ผู้ลงทุนโดยไม่ได้รับความเห็นชอบให้ปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าวจาก กสท. | | |
| <p>3.การจัดทำรายงานการเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต (Trader ID) ลำช้า</p> <ul style="list-style-type: none"> - ต้องส่งรายงานการเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต (Trader ID) ลำช้าพร้อมชำระค่าปรับตามแบบ กต.2/11 | จัดทำรายงานถูกต้องตามเกณฑ์ และจัดส่งให้ครบถ้วนภายในเวลาที่กำหนด | |

การจัดส่งรายงาน

| ข้อกำหนด | ลงวันที่ | วันที่บังคับใช้ |
|---|-------------------|-----------------|
| I. ประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการรายงานเหตุการณ์ และการจัดส่งรายงานของสมาชิก พ.ศ. 2564 | 4 กุมภาพันธ์ 2564 | 15 มีนาคม 2564 |
| II. หนังสือเวียนที่ กส.ว) 8/2563 เรื่อง แนวปฏิบัติเกี่ยวกับการรายงานการขายชอร์ตที่ยังมีได้มีการซื้อคืน | 18 ธันวาคม 2563 | 4 มกราคม 2564 |

| สาระสำคัญ | ความคาดหวัง | |
|--|---|---|
| | แนวทางที่ต้องปฏิบัติ | แนวทางที่ควรปฏิบัติ |
| <p>จัดทำรายงานถูกต้อง และจัดส่ง ตลท.ภายในเวลาที่กำหนด</p> <p>1. รายงานตามเหตุการณ์ พร้อมระบุเหตุผล ดังนี้</p> <p>1) บริษัทประสบความเสียหายร้ายแรง หยุดกิจการทั้งหมดหรือบางส่วน เปลี่ยนแปลงวัตถุประสงค์หรือลักษณะธุรกิจ กระทำหรือถูกกระทำในลักษณะครอบงำกิจการ : รายงานทันที</p> <p>2) ทำสัญญาให้บุคคลอื่นมีอำนาจทั้งหมดหรือบางส่วนในการบริหารงาน : ภายในวันทำการถัดไป โดยรายงานสาระสำคัญของสัญญาพร้อมจัดส่งสำเนาสัญญา</p> <p>3) Board มีมติเพิ่มทุน-ลดทุน-ควบกิจการ : ภายในวันทำการถัดไป และจัดส่งหลักฐานการจดทะเบียนภายใน 7 วันถัดจากวันจดทะเบียน</p> <p>4) Board มีมติเข้าถือหุ้นในกิจการใด > 10% ของทุนจดทะเบียน : ภายในวันทำการถัดไป</p> <p>5) เปลี่ยนกรรมการ ผู้จัดการ พนักงานหรือผู้มีอำนาจในการจัดการย้ายสำนักงานใหญ่, เปิด-ปิด-ย้ายสาขา : ภายใน 3 วันทำการ โดยจัดส่งหลักฐานการได้รับอนุญาตจาก ก.ล.ต. ภายใน 7 วันถัดจากวันได้รับอนุญาต และหลักฐานการจดทะเบียนภายใน 7 วันถัดจากวันจดทะเบียน</p> <p>6) ที่ประชุมผู้ถือหุ้นมีมติให้แก้ไขหรือเพิ่มเติมหนังสือบริคณห์สนธิหรือข้อบังคับบริษัท แจ้งเปลี่ยนแปลงชื่อบริษัท หรือชื่อย่อบริษัท : ภายใน 3 วันทำการ และจัดส่งหลักฐานการจดทะเบียนภายใน 7 วันถัดจากวันจดทะเบียน</p> <p>2. รายงานฐานะการเงิน รายงานการทำธุรกรรม และรายงานอื่น ๆ</p> <p>รายละเอียดตาม APPENDIX</p> | <p>1. จัดทำรายงานถูกต้องตามเกณฑ์และตามแนวทางที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด รวมถึง จัดทำตามแบบฟอร์ม และคำอธิบายแบบรายงานที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด</p> <p>2. จัดส่งรายงานและคำปรับครบถ้วนทุกงวดและภายในเวลาที่กำหนด (แม้ว่างวดนั้นจะไม่มีรายการยกเว้นบางรายการมีเกณฑ์ระบุว่าไม่ต้องจัดส่ง)</p> <p>3. กรณีบริษัททำธุรกรรมใหม่หรือหยุดทำธุรกรรม ต้องตรวจสอบว่ามีแบบรายงานที่ต้องจัดทำและหรือจัดส่ง หรือแจ้งหยุดจัดส่งหรือไม่</p> | <p>1. มีการเช็คสอบรายการที่ผิดปกติในรายงานเพื่อที่จะจัดทำรายงานได้อย่างถูกต้อง</p> <p>2. กำหนดผู้จัดทำรายงานและผู้อนุมัติ/ผู้มีอำนาจในการจัดส่งรายงาน และมาตรการสำรองกรณีผู้จัดทำรายงานและผู้อนุมัติ/ผู้มีอำนาจในการจัดส่งรายงาน ไม่อยู่หรือระบบข้อมูลมีปัญหาไม่สามารถจัดส่งรายงานได้</p> <p>3. กรณีทางการเปลี่ยนแปลงแบบรายงานใหม่ ต้องจัดให้มีขั้นตอนและกำหนดผู้มีหน้าที่รับผิดชอบ เพื่อให้สามารถแก้ไขระบบรวมถึงทดสอบความถูกต้องของข้อมูลและจัดส่งรายงานได้ทันตามเวลาที่กำหนด</p> <p>4. ติดตามแบบฟอร์มและคำอธิบายของรายงานต่าง ๆ บนเว็บไซต์ www.set.or.th ในหัวข้อ กฎเกณฑ์/การกำกับ → กฎเกณฑ์ → แบบฟอร์ม → ส่วนที่เกี่ยวกับสมาชิก</p> |

APPENDIX

| ประเภทรายงาน | ระยะเวลาจัดส่ง |
|--|--|
| 1. รายงานการขายชอร์ตที่ยังมิได้ซื้อคืน | จัดส่งภายในวันทำการแต่ละวัน |
| 2. รายงานการขายชอร์ต ETF และกลุ่มหลักทรัพย์อ้างอิง สำหรับธุรกรรมของ Participating Dealers (PD) และ Market Maker (MM) | |
| 3. รายงานการ Create และ Redeem ระหว่างวันที่มีหลักทรัพย์พร้อมส่งมอบเต็มจำนวน สำหรับธุรกรรมของ Participating Dealers (PD) | |
| 4. รายงานฐานะการเงินและรายงานงบการเงิน | จัดส่งตามแบบและระยะเวลาที่สำนักงานกำหนดตามประกาศสำนักงานที่เกี่ยวข้องกับแบบ รายงานของบริษัทหลักทรัพย์ ทั้งนี้ ในกรณีที่สมาชิกได้จัดทำและจัดส่งรายงานดังกล่าวให้แก่สำนักงานผ่านช่องทางที่สำนักงาน กำหนดแล้ว ให้ถือว่าสมาชิกได้นำส่งรายงานนั้นต่อตลาดหลักทรัพย์ฯ แล้ว |
| 5. รายงานรายได้และค่าใช้จ่าย | |
| 6. แบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ | |
| 7. รายงานทรัพย์สินของลูกค้า | |
| 8. รายงานการทำธุรกรรม | |
| 9. รายงานการขายหลักทรัพย์จดทะเบียนโดยไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง | |
| 10. รายงานการรับชำระเงินค่าซื้อหลักทรัพย์จากลูกค้าล่าช้า | |
| 11. รายงานการส่งมอบหลักทรัพย์ของลูกค้าล่าช้า | |
| 12. รายงานการไม่ชำระราคาซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยวิธี ATS | จัดส่งภายใน 14 วันถัดจากวันสิ้นเดือนที่ต้องรายงาน |
| 13. รายงานการเพิกถอนการขึ้นทะเบียนเจ้าหน้าที่รับอนุญาต (Trader ID) ล่าช้า | |
| 14. รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์แบบชำระราคาสุทธิ (Net Settlement) | |
| 15. รายงานข้อมูลของลูกค้าทุกรายและทุกประเภทบัญชีเพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์ โดยมีรายละเอียด ดังนี้ | |
| (1) ชื่อ นามสกุล ชื่อนิติบุคคล | |
| (2) เลขที่บัญชีลูกค้า (Client ID) | |
| (3) ข้อมูลแสดงตัวตน เช่น เลขประจำตัวประชาชน เลขที่หนังสือเดินทาง ทะเบียนกองทุน หรือทะเบียนนิติบุคคล เป็นต้น | |
| 16. รายงานการดำเนินงานด้านธุรกิจหลักทรัพย์ | |

| ประเภทรายงาน | ระยะเวลาจัดส่ง |
|---|---|
| 17. รายงานการกำกับดูแลการปฏิบัติงานประจำปี (Annual Compliance Report) | จัดส่งภายใน 2 เดือนถัดจากวันสิ้นปีปฏิทิน |
| 18. รายงานข้อมูลการบันทึกการซื้อขายรายใหญ่ (Trade Report-Big Lot) | จัดส่งทันที ภายหลังจากมีการบันทึกการซื้อขายที่ถึงจุดหรือข้ามจุดซึ่งต้องทำคำเสนอซื้อหลักทรัพย์ทั้งหมดของกิจการตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ หรือการซื้อหลักทรัพย์ที่สมาชิกหรือมีเหตุอันควรรู้ว่าเป็นผลให้ผู้ซื้อได้มาหรือเป็นผู้ถือหลักทรัพย์เพิ่มขึ้นจนถึงหรือข้ามจุดซึ่งต้องทำคำเสนอซื้อหลักทรัพย์ดังกล่าว |
| 19. รายงานการเรียกหลักประกันและการบังคับขาย (Call/Force) | จัดส่งภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดจากวันที่เกิดเหตุการณ์ |
| 20. รายงานเกี่ยวกับการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน ดังต่อไปนี้ - รายงานประจำวัน - รายงานสรุปการซื้อเพื่อส่งมอบหุ้นที่จัดสรรเกิน | จัดส่งภายใน 12.00 น. ของวันทำการถัดไป |
| 21. รายงานการซื้อขายที่ชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่ละรายการ (Gross Settlement) | จัดส่งภายใน 14 วันถัดจากวันที่ได้ชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ |
| 22. รายงานความสัมพันธ์กับบริษัทจดทะเบียนที่มีส่วนเกี่ยวข้อง | จัดส่งภายใน 14 วันถัดจากวันที่มีการเปลี่ยนแปลง หรือวันที่เริ่มมีความเกี่ยวข้อง |
| 23. รายงานรายชื่อผู้ถือหุ้นรายใหญ่ 20 ลำดับแรก ณ วันสิ้นเดือนของเดือนสุดท้ายของไตรมาส คือ เดือนมีนาคม มิถุนายน กันยายน และธันวาคม และ ณ วันประชุมผู้ถือหุ้น | จัดส่งภายใน 15 วันถัดจากวันสิ้นเดือนของเดือนสุดท้ายของไตรมาส หรือภายใน 15 วันถัดจากวันประชุมผู้ถือหุ้น แล้วแต่กรณี |