

แนวทางการดำเนินการกรณีมีการผิดนัดการส่งมอบหลักทรัพย์ ตามข้อกำหนดของบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

บริษัทหลักทรัพย์ โนมูระ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน) ขอแจ้งให้ทราบถึงแนวทางการดำเนินการกรณีมีการผิดนัดการส่งมอบหลักทรัพย์ดังนี้

1. บริษัท สำนักหักบัญชี(ประเทศไทย)จำกัด (TCH) ได้มีข้อกำหนดการจัดสรรหลักทรัพย์ให้กับบริษัทหลักทรัพย์ผู้รับมอบหลักทรัพย์ (“บริษัทหลักทรัพย์ผู้รับมอบฯ”) ในกรณีที่บริษัทหลักทรัพย์ผู้ส่งมอบหลักทรัพย์ (“บริษัทหลักทรัพย์ผู้ส่งมอบฯ”) มีหลักทรัพย์ไม่เพียงพอสำหรับส่งมอบต่อ TCH โดยใช้หลักการ Pending Settlement ตามมาตรฐานสากล ซึ่งจะมีผลใช้บังคับตั้งแต่การชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ตั้งแต่วันที่ 6 พฤศจิกายน 2560 เป็นต้นไป ซึ่งมีหลักการ ดังต่อไปนี้

1.1 เมื่อบริษัทหลักทรัพย์ผู้ส่งมอบฯมีหลักทรัพย์ไม่เพียงพอสำหรับการส่งมอบต่อ TCH จะส่งผลให้ TCH ไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์ต่อให้กับบริษัทหลักทรัพย์ผู้รับมอบฯได้ครบถ้วน ดังนั้น TCH จึงกำหนดหลักการการจัดสรรหลักทรัพย์ให้กับบริษัทหลักทรัพย์ผู้รับมอบฯในวัน Settlement date ตามลำดับ ดังนี้

- ลำดับที่ 1 เป็นผู้รับมอบฯนานที่สุด (Oldest Pending Receive Position)
- ลำดับที่ 2 เป็นผู้รับมอบฯที่ราคาซื้อสูงสุด (Highest Price)
- ลำดับที่ 3 เป็นผู้รับมอบฯที่จำนวนน้อยที่สุด (Smallest Quantities)
- ลำดับที่ 4 เป็นการสุ่มเลือก (Random)

การดำเนินการเรื่อง pending settlement จะมีผลตั้งแต่วันที่วันที่ 6 พฤศจิกายน 2560 เป็นต้นไป

1.2 บริษัทหลักทรัพย์ผู้ส่งมอบฯที่มีหลักทรัพย์ไม่เพียงพอสำหรับการส่งมอบต่อ TCH จะถูกปรับการผิดนัดส่งมอบตาม ข้อกำหนดของ TCH

1.3 บริษัทหลักทรัพย์ผู้รับมอบฯที่ไม่ได้รับการจัดสรรหลักทรัพย์ตามข้อ 1.1 จะเป็น “ผู้มีสถานะรอรับหลักทรัพย์ (Pending Receive)” และเมื่อครบ 4 วันทำการ หลังจากวันครบกำหนดการชำระราคา (Settlement Date+4) TCH จะยุติรายการผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ข้างต้นด้วยการชำระเงิน (Cash Settlement) แทนการส่งมอบหลักทรัพย์ โดย TCH จะนำเงินหลักประกันที่ได้รับจากบริษัทหลักทรัพย์ผู้ส่งมอบฯซึ่งเป็นผู้ผิดนัดไปชำระให้กับผู้มีสถานะรอรับหลักทรัพย์ โดยใช้ราคา ดังนี้

“ราคา Buy-in หรือ 130% ของ Mark to Market Price ของวันทำการก่อนหน้าแล้วแต่ราคาใดจะสูงกว่า “

การยุติรายการผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ดังกล่าวด้วยการชำระเงิน (Cash Settlement) จะมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 10 พฤศจิกายน 2560 เป็นต้นไป

1.4 การดำเนินการเกี่ยวกับสิทธิประโยชน์กรณีผู้ที่มีสถานะรอรับหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดสิทธิ (Record Date) ผู้มีสถานะรอรับหลักทรัพย์จะไม่ได้รับสิทธิประโยชน์เนื่องจากไม่มีหลักทรัพย์ในครอบครอง แต่จะได้รับเงินชดเชยสิทธิประโยชน์ในอัตรา 115 % ของมูลค่าสิทธิประโยชน์ที่ควรจะได้รับ จำนวน 8 ประเภท ตามหลักการประเมินสิทธิประโยชน์ที่ TCH กำหนด อันได้แก่

เครื่องหมาย	คำอธิบาย	เครื่องหมาย	คำอธิบาย
XD	ผู้ซื้อหลักทรัพย์ไม่ได้สิทธิรับเงินปันผล	XR	ผู้ซื้อหลักทรัพย์ไม่ได้สิทธิจองซื้อหุ้นออกใหม่
XI	ผู้ซื้อหลักทรัพย์ไม่ได้สิทธิรับดอกเบี้ย	XN	ผู้ซื้อหลักทรัพย์ไม่ได้สิทธิในการรับเงินคืนจากการลดทุน
XA	ผู้ซื้อหลักทรัพย์ไม่ได้สิทธิทุกประเภทที่บริษัทประกาศไว้ในคราวนั้น	XE	แสดงการปิดสมุดทะเบียนพักโอนหุ้น เพื่อให้สิทธิแก่ผู้ถือหุ้นในการนำตราสารสิทธิไปแปลง
XP	ผู้ซื้อหลักทรัพย์ไม่ได้สิทธิรับเงินต้นที่บริษัทประกาศจ่ายคืนในคราวนั้น	XB	ผู้ซื้อหลักทรัพย์ไม่ได้สิทธิจองซื้อหุ้นออกใหม่

1.4 เมื่อมีการปรับลดระยะเวลาการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์จาก 3 วันทำการเป็น 2 วันทำการ (T+3 เป็น T+2) ซึ่งจะมีผลตั้งแต่วันที่ 2 มีนาคม 2561 และครบกำหนดชำระราคาวันที่ 6 มีนาคม 2561 การยุติรายการผิมนัดส่งมอบหลักทรัพย์ดังกล่าวด้วยการชำระเงิน (Cash Settlement) จะถูกปรับจาก 4 วันทำการ หลังจากวันครบกำหนดการชำระราคา (Settlement Date+4) เป็น 3 วันทำการ หลังจากวันครบกำหนดการชำระราคา(Settlement Date+3)

2. บริษัทจะดำเนินการในการจัดสรรหลักทรัพย์ให้กับลูกค้าของบริษัทในกรณีที่ได้รับมอบหลักทรัพย์ไม่ครบถ้วนตามแนวทางเดียวกับการจัดสรรของ TCH ที่จัดสรรให้กับบริษัทผู้รับมอบฯ ตามข้อ 1.1 และบริษัทสงวนสิทธิ์ในการพิจารณาจัดสรรเพื่อประโยชน์สูงสุดต่อลูกค้าทุกราย และในกรณีที่ลูกค้ามีหลักทรัพย์ไม่เพียงพอต่อการส่งมอบหลักทรัพย์ให้กับบริษัท บริษัทจะคิดค่าปรับการผิมนัดส่งมอบหลักทรัพย์ในแนวทางเดียวกับข้อกำหนดของ TCH ตามข้อ 1.2

3. ลูกค้าต้องรับผิดชอบค่าปรับของทางการ กรณีที่ไม่ส่งมอบหลักทรัพย์ตามเวลาที่กำหนด

- 3.1 อัตราค่าปรับที่เรียกเก็บจาก TSD ตั้งแต่ 0.50% – 3.75%
- 3.2 อัตราค่าปรับจาก SET วันละ 1000 บาท ต่อหลักทรัพย์
- 3.3 อัตราค่าปรับจาก TCH ตามที่ระบุในข้อ 1
- 3.4 ค่าปรับอื่นใดอันเกิดจากการไม่ส่งมอบหลักทรัพย์