

สารบัญ

ข้อบังคับ

หมวด 600 การผิคนัดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

	หน้า
601 หลักการดำเนินการ.....	600-1
602 เหตุผิคนัด.....	600-1
602.01 เหตุผิคนัด	600-1
602.02 มูลค่าการผิคนัดชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์.....	600-2
603 การดำเนินการกรณีผิคนัด.....	600-3
603.01 การผิคนัดชำระราคาหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ 602.01 (1).....	600-3
603.02 การผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ 602.01 (1).....	600-4
603.03 การคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและการเรียกหลักประกัน.....	600-6
603.04 การยึดหลักทรัพย์.....	600-6
603.05 การซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด (Buy - in)	600-7
603.06 การใช้และคืนเงินกองทุน Clearing fund.....	600-7
603.07 การดำเนินการต่อสมาชิกกรณีผิคนัด.....	600-7
604 การชำระเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด.....	600-8
604.01 การชำระเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์กรณีผู้ผิคนัดไม่สามารถ ส่งมอบหลักทรัพย์ได้ภายในเวลาที่กำหนด	600-8
604.02 การชำระเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์กรณีมีเหตุการณ์ที่กระทบ การส่งมอบหลักทรัพย์ในระหว่างการผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์.....	600-8
605 ความรับผิดชอบของสมาชิก.....	600-9

ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์)

หมวด 600 การผิณฑ์ชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

*** ข้อบังคับ**

หมวด 600 การผิณฑ์ชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

601 หลักการดำเนินการ

สำนักหักบัญชีจะแยกพิจารณาการดำเนินการกรณีผิณฑ์ในบัญชีของลูกค้ำออกจากบัญชีของสมาชิก โดยหากมีการผิณฑ์ในบัญชีใด สำนักหักบัญชีอาจดำเนินการใด ๆ กับบัญชีนั้น โดยจะไม่นำเงินหรือหลักประกันอื่นใดในบัญชีของลูกค้ำมาใช้ในการชำระหนี้หรือดำเนินการใดกับบัญชีของสมาชิก

602 เหตุผิณฑ์

602.01 เหตุผิณฑ์

หากเกิดกรณีดังต่อไปนี้กับสมาชิกให้ถือว่าสมาชิกผิณฑ์

(1) สมาชิกไม่ชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์หรือวางหลักประกันตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(2) สมาชิกไม่สมทบเงินกองทุน Clearing Fund ตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(3) สมาชิกไม่ชำระค่าธรรมเนียม ดอกเบี้ย ค่าปรับ ค่าเสียหาย และค่าใช้จ่ายอื่นใดที่สมาชิกมีภาระผูกพันต่อสำนักหักบัญชีตามที่สำนักหักบัญชีเรียกเก็บ

(4) สมาชิกถูกฟ้องล้มละลายและศาลมีคำสั่งพิทักษ์ทรัพย์ หรืออยู่ในช่วงดำเนินการทางกฎหมายหรือมีสภาพคล่องหรือมีฐานะทางการเงินลดลง จนเป็นเหตุให้สมาชิกรายดังกล่าวไม่สามารถดำเนินการชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ได้ตามปกติ

(5) สมาชิกไม่ชำระหนี้อื่นใดที่เกี่ยวข้องเนื่องกับการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่สมาชิกมีหน้าที่ต้องชำระต่อสำนักหักบัญชี

หากสมาชิกรายที่ผิณฑ์สามารถแสดงได้ว่าสมาชิกมีเงินหรือหลักทรัพย์เพียงพอที่จะทำการชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ในบัญชีของลูกค้ำหรือบัญชีของสมาชิก แต่การผิณฑ์นั้นเกิดจากความผิดพลาดในการปฏิบัติงานของเจ้าหน้าที่ (Human Error) ของสมาชิกและไม่ก่อให้เกิดความเสียหายต่อระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์หรือเกิดจากความผิดพลาดในการปฏิบัติงานของธนาคารที่ได้รับอนุญาตให้ทำการชำระราคาแทน (Settlement Bank) หรือเหตุสุดวิสัยต่างๆ ในระบบการประมวลผลของสมาชิกหรือของธนาคารที่ได้รับอนุญาตให้ทำการชำระราคาแทน (Settlement Bank) สำนักหักบัญชีอาจพิจารณาผ่อนผันการดำเนินการต่อสมาชิกกรณีผิณฑ์เป็นรายกรณี

***602.02 มูลค่าการผิคนัดชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์**

ในกรณีที่สมาชิกผู้มีหน้าที่ชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ตามรายงานของสำนักหักบัญชีหรือบุคคลอื่นที่สมาชิกมอบหมายให้ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกไม่ดำรงเงินในบัญชีเงินฝาก หรือไม่ได้ดำรงหลักทรัพย์ในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด ให้ถือว่าสมาชิกผิคนัดนับตั้งแต่วันที่ครบกำหนดเวลาชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนในกรณีดังต่อไปนี้

(1) กรณีผิคนัดชำระราคาหลักทรัพย์

(1.1) กรณีสมาชิกผิคนัดชำระราคาหลักทรัพย์ตามข้อมูล Net Clearing ให้ถือว่ามูลค่าการผิคนัดชำระราคาตามจำนวนเงินที่ไม่ดำรงเงินในบัญชีเงินฝากให้ครบถ้วน

(1.2) กรณีบุคคลอื่นที่สมาชิกมอบหมายให้ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกไม่ดำรงเงินในบัญชีเงินฝากไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วนตามข้อมูล Net Clearing ให้ถือว่ามูลค่าการผิคนัดชำระราคาตามจำนวนเงินทั้งจำนวน แม้ว่าจะได้ดำรงเงินในบัญชีเงินฝากดังกล่าวไว้บางส่วนแล้วก็ตาม

(1.3) กรณีสมาชิกผิคนัดชำระราคาหลักทรัพย์ตามข้อมูล Gross Clearing แต่ละรายการไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน ให้ถือว่ามูลค่าการผิคนัดชำระราคาหลักทรัพย์ตามจำนวนเงินที่มีหน้าที่ดำรงเงินในบัญชีเงินฝากทั้งจำนวนตามรายการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่มีการผิคนัดแต่ละรายการ แม้ว่าจะได้ดำรงเงินในบัญชีเงินฝากดังกล่าวไว้บางส่วนแล้วก็ตาม

(2) กรณีผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์

(2.1) กรณีสมาชิกผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามข้อมูล Net Clearing ให้ถือว่ามูลค่าการผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนที่ไม่ได้ดำรงไว้หรือตามจำนวนที่ไม่สมบูรณ์ บกพร่อง หรือถูกรอนสิทธิในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์

(2.2) กรณีบุคคลอื่นที่สมาชิกมอบหมายให้ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกไม่ดำรงหลักทรัพย์ในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ตามข้อมูล Net Clearing ไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน ให้ถือว่ามูลค่าการผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนในรายการที่ยกเลิก แม้ว่าจะได้ดำรงหลักทรัพย์ไว้บางส่วนหรือหลักทรัพย์ที่ดำรงไว้บางส่วนสมบูรณ์ ไม่บกพร่อง หรือไม่ถูกรอนสิทธิก็ตาม

(2.3) กรณีสมาชิกผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามข้อมูล Gross Clearing แต่ละรายการไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน ให้ถือว่ามูลค่าการผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนที่มีหน้าที่ดำรงหลักทรัพย์ในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ทั้งจำนวนตามรายการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่มีการผิคนัดแต่ละรายการ แม้ว่าจะได้ดำรงหลักทรัพย์ไว้บางส่วนหรือหลักทรัพย์ที่ดำรงไว้บางส่วนสมบูรณ์ ไม่บกพร่อง หรือไม่ถูกรอนสิทธิในบัญชีฝากหลักทรัพย์ดังกล่าวแล้วก็ตาม

ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์)

หมวด 600 การผิคนัดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

(*ความในหลักเกณฑ์ 602.02 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์) หมวด 600 การผิคนัดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ลงวันที่ 1 ตุลาคม 2562 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2562 เป็นต้นไป)

603 การดำเนินการกรณีผิคนัด

603.01 การผิคนัดชำระราคาหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ 602.01 (1)

*หากสมาชิกผิคนัดชำระราคาหลักทรัพย์ตามเหตุผิคนัดหลักเกณฑ์ 602.02 (1) (1.1) สมาชิกดังกล่าวต้องชำระราคาหลักทรัพย์ตามจำนวนเงินที่ผิคนัดและค่าเสียหายที่เกิดจากการผิคนัดให้แก่สำนักหักบัญชีให้ถูกต้องครบถ้วนภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยสำนักหักบัญชีอาจดำเนินการประการใดประการหนึ่งหรือหลายประการดังต่อไปนี้ซึ่งน่าจะจะได้รับชำระราคาหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและค่าเสียหายจนครบถ้วน

(1) ระวังการโอนและหักโอนหลักทรัพย์ในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ (Settlement Account) เพื่อสมาชิกหรือลูกค้าของสมาชิกผู้ผิคนัดที่มีสิทธิรับมอบในวันแรกที่เกี่ยวข้องว่าผิคนัดชำระราคาและในวันถัดไป และขายหลักทรัพย์ที่ระงับไว้ในบัญชีดังกล่าวเพื่อนำเงินมาชำระราคาหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและค่าเสียหายตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(2) ระวังการชำระราคาหลักทรัพย์ที่สมาชิกผู้ผิคนัดมีสิทธิได้รับตามรายงานในวันแรกที่เกี่ยวข้องว่าผิคนัดชำระราคาและในวันถัดไป และนำเงินที่สมาชิกผู้ผิคนัดมีสิทธิได้รับมาชำระราคาหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและค่าเสียหาย

(3) เรียกให้สมาชิกผู้ผิคนัดวางหลักประกันตามที่สำนักหักบัญชีกำหนดเพื่อเป็นประกันว่าสมาชิกผู้ผิคนัดจะชำระราคาหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและค่าเสียหายให้แก่สำนักหักบัญชี และอาจดำเนินการบังคับหลักประกันดังกล่าวเพื่อนำเงินมาชำระราคาหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและค่าเสียหาย

ในกรณีที่สมาชิกดังกล่าวไม่วางหลักประกัน วางหลักประกันไม่ครบถ้วน หรือสำนักหักบัญชีบังคับหลักประกันได้ไม่เพียงพอภายในเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด สำนักหักบัญชีอาจระงับการให้บริการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แก่สมาชิกผู้ผิคนัดนั้น

(4) บังคับชำระหนี้จากหลักประกันที่สมาชิกผู้ผิคนัดวางไว้เพื่อเป็นประกันการบริหารความเสี่ยงในระบบชำระราคาหลักทรัพย์ และนำเงินมาชำระราคาหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและค่าเสียหายที่สมาชิกผิคนัดชำระราคาเพื่อชำระราคาให้แก่สมาชิกผู้ที่มีสิทธิได้รับ

(5) ดำเนินการใช้เงินกองทุน Clearing Fund ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่กำหนดในส่วนที่เกี่ยวกับกองทุน Clearing Fund

หากบุคคลอื่นที่สมาชิกมอบหมายให้ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกไม่ดำรงเงินในบัญชีเงินฝากตามหลักเกณฑ์ 602.02 (1) (1.2) สำนักหักบัญชีอาจยกเลิกรายการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่มีการผิณัด โดยสมาชิกต้องชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ตามรายงานของสำนักหักบัญชีที่มีการแก้ไขปรับปรุงข้อมูลตามรายการที่ยกเลิกแล้ว

นอกจากการดำเนินการกับสมาชิกผู้ผิณัดชำระราคาหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ 603.01 แล้ว สำนักหักบัญชีอาจระงับการให้บริการการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แก่สมาชิกผู้ผิณัดชำระราคาหลักทรัพย์และ/หรือยังไม่ได้ชำระราคาหลักทรัพย์ที่ผิณัดและค่าเสียหายตามหลักเกณฑ์ 603.01 จนกว่าจะมีการชำระราคาหลักทรัพย์ที่ผิณัดและค่าเสียหายจนครบถ้วน

(*ความในหลักเกณฑ์ 603.01 วรรคหนึ่ง เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์) หมวด 600 การผิณัดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ลงวันที่ 1 ตุลาคม 2562 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2562 เป็นต้นไป)

603.02 การผิณัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ 602.01 (1)

*หากสมาชิกผิณัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามเหตุผิณัดหลักเกณฑ์ 602.02 (2) (2.1) สมาชิกดังกล่าวต้องส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ที่ผิณัดและค่าเสียหายที่เกิดจากการผิณัดให้แก่สำนักหักบัญชีให้ถูกต้องครบถ้วนภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยสำนักหักบัญชีหรือบุคคลตามที่สำนักหักบัญชีมอบหมายจะดำเนินการยึดหลักทรัพย์จากบุคคลอื่นให้กับสมาชิกผู้ผิณัด หรือให้ยึดหลักทรัพย์แก่สมาชิกผู้ผิณัด ตามประเภท ชนิด และจำนวนเดียวกันกับที่สมาชิกผิณัดส่งมอบเพื่อส่งมอบให้แก่สมาชิกผู้มีสิทธิได้รับตามหลักเกณฑ์และวิธีการตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด และสำนักหักบัญชีอาจดำเนินการประการใดประการหนึ่งหรือหลายประการดังต่อไปนี้ จนกว่าจะได้รับมอบหลักทรัพย์ที่ผิณัดและค่าเสียหายจนครบถ้วน

(1) ระงับการชำระราคาหลักทรัพย์ที่สมาชิกผู้ผิณัดมีสิทธิได้รับตามรายงานในวันแรก ที่ถือว่าผิณัดส่งมอบและในวันถัดไปตามอัตราที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยเป็นจำนวนหน่วยการซื้อขายตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิณัด (Buy -in) และนำเงินที่สมาชิกผู้ผิณัดมีสิทธิได้รับนั้น ไปซื้อหลักทรัพย์ตามประเภท ชนิด และจำนวนเดียวกันกับหลักทรัพย์ที่สมาชิกผิณัดส่งมอบเพื่อส่งมอบให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์

(2) ระงับการโอนหรือการหักโอนหลักทรัพย์ในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ (Settlement Account) เพื่อสมาชิกหรือลูกค้าของสมาชิกผู้ผิณัดที่มีสิทธิรับมอบในวันแรก ที่ถือว่าผิณัดส่งมอบและในวันถัดไป และขายหลักทรัพย์ที่ระงับไว้เพื่อนำเงินไปซื้อหลักทรัพย์ตามประเภท ชนิด และจำนวนเดียวกันกับหลักทรัพย์ที่สมาชิกผิณัดส่งมอบเพื่อส่งมอบให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(3) เรียกให้สมาชิกผู้ผิณัดวางหลักประกันตามหลักเกณฑ์ที่สำนักหักบัญชีกำหนดเพื่อเป็นประกันว่าสมาชิกผู้ผิณัดจะส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิณัดและค่าเสียหายให้แก่สำนักหักบัญชี และ

ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์)

หมวด 600 การผิคนัดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

สำนักหักบัญชีอาจดำเนินการบังคับหลักประกันดังกล่าวตามหลักเกณฑ์ที่สำนักหักบัญชีกำหนดเพื่อนำเงินไปซื้อหลักทรัพย์ตามประเภท ชนิด และจำนวนเดียวกันกับหลักทรัพย์ที่สมาชิกผิคนัดส่งมอบเพื่อส่งมอบให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์ หรือนำมาเป็นส่วนหนึ่งของเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด หากสมาชิกผู้ผิคนัดไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์ได้ภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

ในกรณีที่สมาชิกผู้ผิคนัดไม่วางหลักประกัน วางหลักประกันไม่ครบถ้วน หรือสำนักหักบัญชีบังคับหลักประกันได้ไม่เพียงพอตามเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด สำนักหักบัญชีอาจระงับการให้บริการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แก่สมาชิกผู้ผิคนัดนั้น

(4) บังคับชำระหนี้จากหลักประกันที่สมาชิกผู้ผิคนัดวางไว้เพื่อเป็นประกันการบริหารความเสี่ยงในระบบส่งมอบหลักทรัพย์ และนำเงินไปซื้อหลักทรัพย์ตามประเภท ชนิด และจำนวนเดียวกันกับที่สมาชิกผิคนัดส่งมอบเพื่อส่งมอบให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์

(5) ดำเนินการใช้เงินกองทุน Clearing Fund ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่กำหนดในส่วนที่เกี่ยวกับกองทุน Clearing Fund

การซื้อหลักทรัพย์เพื่อส่งมอบให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์ตาม (1) ถึง (4) ให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์และวิธีการตามหลักเกณฑ์ 603.05

หากบุคคลอื่นที่สมาชิกมอบหมายให้ทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนสมาชิกไม่ดำรงหลักทรัพย์ในบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ 602.02 (2) (2.2) สำนักหักบัญชีอาจยกเลิกรายการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่มีการผิคนัด โดยสมาชิกต้องชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ตามรายงานของสำนักหักบัญชีที่มีการแก้ไขปรับปรุงข้อมูลตามรายการที่ยกเลิกแล้ว

นอกจากการดำเนินการกับสมาชิกผู้ผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ 603.02 แล้ว สำนักหักบัญชีอาจระงับการให้บริการแก่สมาชิกผู้ผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์และ/หรือยังไม่ได้ส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและค่าเสียหายตามหลักเกณฑ์ 603.02 จนกว่าจะมีการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและค่าเสียหายจนครบถ้วน

(*ความในหลักเกณฑ์ 603.02 วรรคหนึ่ง เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์) หมวด 600 การผิคนัดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ลงวันที่ 1 ตุลาคม 2562 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2562 เป็นต้นไป)

603.03 การคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและการเรียกหลักประกัน

สำนักหักบัญชีจะคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและเรียกหลักประกันจากสมาชิกเพื่อเป็นประกันว่าสมาชิกผู้ผิคนัดจะชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและชำระค่าเสียหายให้แก่สำนักหักบัญชี โดยจะคำนวณอย่างน้อยหนึ่งครั้งทุกวันทำการและจัดทำข้อมูลแจ้งให้สมาชิกผู้ผิคนัดเพื่อการวางหลักประกันตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด

เมื่อมีการคำนวณมูลค่าที่ผิคนัดตามวรรคหนึ่งแล้ว สำนักหักบัญชีจะคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่สมาชิคนำมาวางเป็นหลักประกัน โดยจะคำนวณอย่างน้อยหนึ่งครั้งทุกวันทำการ เพื่อเปรียบเทียบกับมูลค่าหลักทรัพย์ที่ผิคนัด และหากมูลค่าทรัพย์สินที่สมาชิคนำมาวางเป็นหลักประกัน ณ ขณะใดขณะหนึ่งต่ำกว่าหรือเกินกว่ามูลค่าหลักทรัพย์ที่ผิคนัด สมาชิกที่ผิคนัดต้องวางหลักประกันเพิ่มหรือสำนักหักบัญชีต้องคืนหลักประกันส่วนเกิน ตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และภายในเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

***603.04 การยึดหลักทรัพย์**

ในกรณีที่สำนักหักบัญชีเห็นว่าสมาชิกไม่อาจส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนที่มีหน้าที่ส่งมอบตามรายงานของสำนักหักบัญชีภายในกำหนดเวลาตามหลักเกณฑ์ 603.02 หรือไม่อาจส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัดให้ครบถ้วน สำนักหักบัญชีหรือบุคคลตามที่สำนักหักบัญชีมอบหมายอาจดำเนินการยึดหลักทรัพย์จากบุคคลอื่นให้กับสมาชิสดังกล่าวหรือให้ยึดหลักทรัพย์แก่สมาชิสดังกล่าวตามหลักเกณฑ์และวิธีการตามที่สำนักหักบัญชีกำหนดเพื่อส่งมอบให้แก่สมาชิกผู้มีสิทธิได้รับ และสำนักหักบัญชีอาจดำเนินการประการใดประการหนึ่งหรือหลายประการตามหลักเกณฑ์ 603.02 ได้จนกว่าจะได้มีการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัดและค่าเสียหายจนครบถ้วน

เมื่อสำนักหักบัญชีหรือบุคคลตามที่สำนักหักบัญชีมอบหมายยึดหลักทรัพย์ให้กับสมาชิกหรือให้ยึดหลักทรัพย์แก่สมาชิกรตามวรรคหนึ่ง สมาชิสดังกล่าวต้องส่งมอบหลักทรัพย์เดียวกับหลักทรัพย์ที่ยึดคืนให้แก่สำนักหักบัญชีหรือบุคคลตามที่สำนักหักบัญชีมอบหมายตามจำนวนที่สำนักหักบัญชีหรือบุคคลตามที่สำนักหักบัญชีมอบหมายได้ดำเนินการส่งมอบให้กับสมาชิกผู้มีสิทธิได้รับดังกล่าวและปฏิบัติตามหลักเกณฑ์และวิธีการเกี่ยวกับการยึดและการคืนหลักทรัพย์ที่สำนักหักบัญชีกำหนดรวมทั้งชำระค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องคืนตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด

ในกรณีที่สมาชิกตามวรรคหนึ่งไม่ได้ส่งมอบหลักทรัพย์คืนให้แก่สำนักหักบัญชีหรือบุคคลตามที่สำนักหักบัญชีมอบหมาย สำนักหักบัญชีอาจดำเนินการตามหลักเกณฑ์ 602.02 และหลักเกณฑ์ 603.04 โดยอนุโลมจนกว่าสำนักหักบัญชีจะได้รับมอบหลักทรัพย์ที่ยึดและค่าใช้จ่ายจนครบถ้วน

(*ความในหลักเกณฑ์ 603.04 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความในฉบับนี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์) หมวด 600 การผิคนัดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ลงวันที่ 1 ตุลาคม 2562 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2562 เป็นต้นไป)

603.05 การซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด (Buy - in)

การซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัดให้แก่ผู้รับหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ 603.02 สำนักหักบัญชีจะเริ่มดำเนินการซื้อในวันทำการแรกถัดจากวันที่สมาชิกผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์ โดยซื้อเป็นจำนวนหน่วยการซื้อขายตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัดในราคาซื้อขายที่สำนักหักบัญชีกำหนดซึ่งรวมค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นและดำเนินการตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด และหากหลักทรัพย์ที่สำนักหักบัญชีดำเนินการซื้อดังกล่าวมีจำนวนมากกว่าจำนวนหลักทรัพย์ที่ผิคนัด ให้สมาชิกผู้ผิคนัดรับซื้อหลักทรัพย์จำนวนที่เกินนั้นด้วย

นอกจากการดำเนินการกับสมาชิกตามหลักเกณฑ์ 603.02 ถึง 603.04 แล้ว สำนักหักบัญชีอาจระงับการให้บริการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แก่สมาชิกผู้ผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์และ/หรือยังมีได้ส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด ค่าเสียหายและค่าใช้จ่ายตามหลักเกณฑ์ 603.02 ถึง 603.04 จนกว่าจะมีการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด ค่าเสียหายและค่าใช้จ่ายจนครบถ้วน

***603.06 การใช้และคืนเงินกองทุน Clearing Fund**

กรณีที่สมาชิกผิคนัดชำระราคาหรือผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์และได้มีการใช้เงินจากกองทุน Clearing Fund เพื่อดำเนินการให้มีการชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัดพร้อมค่าเสียหายที่เกิดจากการผิคนัดต่อสำนักหักบัญชี และสำนักหักบัญชีได้รับชำระราคาหรือได้รับมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัดพร้อมค่าเสียหายที่เกิดจากการผิคนัดทั้งหมดหรือบางส่วน ถ้าสำนักหักบัญชีได้ระงับเงินหรือหลักทรัพย์หรือยึดถือหลักประกันใดของสมาชิกผู้ผิคนัดนั้นไว้ สำนักหักบัญชีจะโอนเงินหรือหลักทรัพย์หรือหลักประกันที่ได้ระงับหรือยึดถือไว้ทั้งหมดหรือส่วนที่เหลืออยู่ให้แก่กองทุน Clearing Fund เพื่อเป็นประกันการเรียกเงินคืนกองทุนและดอกเบี้ยพร้อมค่าปรับจากสมาชิกนั้น

(*ความในหลักเกณฑ์ 603.06 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์) หมวด 600 การผิคนัดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ลงวันที่ 1 ตุลาคม 2562 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2562 เป็นต้นไป)

603.07 การดำเนินการต่อสมาชิกกรณีผิคนัด

สำนักหักบัญชีอาจดำเนินการต่อสมาชิกสำนักหักบัญชีดังต่อไปนี้

- (1) ภาคทัณฑ์
- (2) ปรับ
- (3) ระงับการให้บริการเป็นการชั่วคราว
- (4) ให้พ้นจากการเป็นสมาชิก

604 การชำระเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัด

604.01 การชำระเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์กรณีผู้ผิคนัดไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์ได้ภายในเวลาที่กำหนด

ในกรณีที่สำนักหักบัญชีได้ดำเนินการตามหลักเกณฑ์ 603 แล้วและสมาชิกผู้ผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์ไม่สามารถจัดหาหลักทรัพย์ตามประเภท ชนิด และจำนวนเดียวกันมาส่งมอบภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด สำนักหักบัญชีอาจเรียกให้สมาชิกผู้ผิคนัดดำเนินการชำระเงินค่าปรับให้แก่สำนักหักบัญชี เพื่อนำส่งให้แก่ผู้รอรับหลักทรัพย์สำหรับชดเชยความเสียหายแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัดตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยให้ถือว่าหลักประกันที่สำนักหักบัญชีเรียกไว้ในระหว่างรอรับหลักทรัพย์ที่ผิคนัดตามหลักเกณฑ์ 511.03 (1) เป็นส่วนหนึ่งของค่าปรับดังกล่าวด้วย

หากผู้รอรับหลักทรัพย์ได้รับชำระเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ตามวรรคหนึ่ง โดยถูกต้องครบถ้วนให้ถือว่าฐานะการรอรับหลักทรัพย์ของผู้รอรับรายดังกล่าวและฐานะการผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์ของสมาชิกผู้ผิคนัดเป็นอันสิ้นสุดลงเช่นเดียวกับการสิ้นสุดการเข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญาของสำนักหักบัญชี ทั้งนี้ สำนักหักบัญชีจะดำเนินการคืนหลักประกันส่วนเกินจากจำนวนที่สำนักหักบัญชีเรียกเก็บไว้ให้แก่สมาชิกผู้ผิคนัด (ถ้ามี) เมื่อได้รับการร้องขอจากสมาชิก

604.02 การชำระเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์กรณีมีเหตุการณ์ที่กระทบการส่งมอบหลักทรัพย์ในระหว่างการผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์

สำนักหักบัญชีอาจดำเนินการตามหลักเกณฑ์ 603.02 หรือเรียกให้สมาชิกผู้ผิคนัดชำระเงินค่าปรับแทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิคนัดตามหลักเกณฑ์ 604.01 ก่อนระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด ในกรณีที่มีเหตุการณ์ดังต่อไปนี้เกิดขึ้นในระหว่างการผิคนัดส่งมอบหลักทรัพย์ได้

(1) ตลาดหลักทรัพย์มีคำสั่งเพิกถอนหลักทรัพย์ที่ผิคนัดจากการเป็นหลักทรัพย์ที่ได้รับการจดทะเบียนหรือที่ได้รับอนุญาตให้ทำการซื้อขายได้ในตลาดหลักทรัพย์

(2) บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์ที่มีการผิคนัดประสงค์จะขอเพิกถอนหลักทรัพย์ของตนออกจากการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนหรือที่ได้รับอนุญาตให้ทำการซื้อขายได้ในตลาดหลักทรัพย์

(3) บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์ที่มีการผิคนัดจัดให้มีการชำระบัญชีเพื่อเลิกบริษัท

(4) หลักทรัพย์ที่ผิคนัดครบกำหนดอายุ

(5) กรณีอื่นใดตามที่สำนักหักบัญชีเห็นสมควร

การดำเนินการเมื่อมีเหตุการณ์ตามวรรคหนึ่ง ให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข วิธีการ และภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์)

หมวด 600 การคิดนัดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

605 ความรับผิดชอบของสมาชิก

หากสมาชิกคิดนัดไม่ว่าในกรณีใด สมาชิกยังคงมีหน้าที่และความรับผิดชอบชำระค่าธรรมเนียม ดอกเบี้ย ค่าปรับ ค่าเสียหาย และค่าใช้จ่ายอื่นใดที่อาจเกิดจากการดำเนินการของสำนักหักบัญชี

(*ความในข้อบังคับหมวด 600 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่
เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์) หมวด 600 การคิดนัดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ ลงวันที่ 20 ตุลาคม 2560 ซึ่งมีผลบังคับใช้
ตั้งแต่วันที่ 6 พฤศจิกายน 2560 เป็นต้นไป)