

-ร่าง-

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. /2560

เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณ
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 4 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. /2560 เรื่อง การดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ลงวันที่ และข้อ 1(3) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทบ. 59/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์และกำหนดเวลาในการยื่นรายงานของบริษัทหลักทรัพย์ ลงวันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2552 สำนักงานออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิก

(1) ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 1/2559 เรื่อง การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ลงวันที่ 18 มกราคม พ.ศ. 2549

ข้อ 2 ในประกาศนี้

“บริษัทหลักทรัพย์” หมายความว่า บริษัทหลักทรัพย์ซึ่งมีหน้าที่ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

“รายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ” หมายความว่า รายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิตามแบบและคำอธิบายประกอบการคำนวณที่กำหนดตามข้อ 3

ข้อ 3 ให้บริษัทหลักทรัพย์คำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิตามแบบ บ.ล. 4/1 และคำอธิบายประกอบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิตามแบบ บ.ล. 4/1 ที่จัดไว้บนเว็บไซต์ของสำนักงาน

ข้อ 4 ให้บริษัทหลักทรัพย์จัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) จัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเป็นรายวันให้เสร็จสิ้นภายในวันทำการถัดไป โดยรายงานทุกฉบับต้องมีการลงลายมือชื่อรับรองความถูกต้องโดยบุคคลผู้มีอำนาจลงนาม

(2) ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของวันทำการสุดท้ายของเดือนต่อสำนักงานภายในวันที่ 7 ของเดือนถัดไป

(3) ในกรณีที่บริษัทหลักทรัพย์มีหนี้สินโดยสิทธิหรือสัญญาเช่าทางการเงินใดที่ไม่ต้องนับรวมไว้ใน การคำนวณหนี้สินรวม หรือมีเงินกู้ยืม หุ้นกู้ หรือภาระผูกพันใดที่นับรวมไว้ใน การคำนวณหนี้สินพิเศษทุกครั้ง ให้บริษัทหลักทรัพย์ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเพิ่มเติมและจัดส่งสำเนาสัญญาที่เกี่ยวข้องกับหนี้สินหรือภาระผูกพันนั้นต่อสำนักงานในวันทำการถัดจากวันที่บริษัทหลักทรัพย์มีการคำนวณรายการดังกล่าวเป็นครั้งแรก และในกรณีที่มีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงสัญญาดังกล่าวในภายหลัง ให้บริษัทหลักทรัพย์ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิอีกครั้งและจัดส่งสำเนาสัญญาที่มีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงต่อสำนักงานในวันทำการถัดจากวันที่มีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงด้วย

(4) เก็บรักษารายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของทุกวันพร้อมหลักฐานที่ใช้ประกอบการคำนวณรายงานดังกล่าวไว้เป็นเวลาไม่น้อยกว่า 1 ปีในลักษณะที่พร้อมให้สำนักงานตรวจสอบได้ หรือพร้อมที่จะจัดส่งให้แก่สำนักงานเมื่อได้รับการร้องขอ

ข้อ 5 เมื่อปรากฏว่าบริษัทหลักทรัพย์ใดมีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเมื่อสิ้นวันหนึ่งวันใดเท่ากับหรือน้อยกว่า 1.5 เท่าของเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิขั้นต่ำที่บริษัทหลักทรัพย์ต้องดำรงไว้ ให้บริษัทหลักทรัพย์นั้นยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของวันที่เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของบริษัทหลักทรัพย์เท่ากับหรือน้อยกว่าอัตราข้างต้นและของทุกวันถัดไปต่อสำนักงานภายในวันทำการถัดจากวันที่บริษัทหลักทรัพย์ต้องจัดทำรายงานดังกล่าวให้แล้วเสร็จตามข้อ 4(1) จนกว่าบริษัทหลักทรัพย์จะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้มากกว่าอัตราที่กำหนดข้างต้นเป็นเวลาไม่น้อยกว่า 2 วันทำการติดต่อกัน และบริษัทหลักทรัพย์ได้ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของ 2 วันทำการนั้นต่อสำนักงานแล้ว เว้นแต่สำนักงานจะกำหนดให้ปฏิบัติเป็นประการอื่น

ข้อ 6 ให้บริษัทหลักทรัพย์ยื่นรายงานการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิและ
จัดส่งสำเนาสัญญาที่เกี่ยวข้องกับหนี้สินหรือภาระผูกพันตามข้อ 4(3) ต่อสำนักงานในรูปของ
ข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ผ่านระบบรับส่งข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ โดยดำเนินการให้เป็นไปตามระเบียบ
วิธีปฏิบัติสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับส่งข้อมูล
อิเล็กทรอนิกส์

ข้อ 7 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่

เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่

(นายรพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์