

สรุปหลักเกณฑ์และวิธีการบังคับซื้อหลักทรัพย์เพื่อส่งมอบรายการที่ผิดนัด (สำหรับตราสารทุน)

1. วันที่เริ่มมีผลบังคับใช้ : วันที่ 4 ธันวาคม 2549 เป็นต้นไป

2. หลักการ : ดำเนินการ Buy-in ในวันทำการถัดจากวันที่ผิดนัด และชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่ Buy-in ภายในวันที่ Buy-in ได้ (Next day Buy-in, Same day settlement)

3. ระยะเวลาในการ Buy-in :

เริ่มดำเนินการ Buy-in ในวันทำการถัดจากวันที่ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ (Next day buy-in) เป็นระยะเวลา 4 วัน หลังจากนั้น TSD จะยุติการ Buy-in และทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์รายการดังกล่าวจนครบ

4. ราคาซื้อขาย :

- วันแรก : บวก 5 ช่วงราคาจากราคาปิดวันก่อนหน้าหรือราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด ณ เวลา 10.30 น. แล้วแต่ราคาใดจะสูงกว่า ซึ่งจะเป็นราคา Final buy-in ในวันนั้นๆ
- วันต่อไป : บวกเพิ่มอีก 2 ช่วงราคาจากราคา Final buy-in วันก่อน หรือราคาปิดในวันก่อนหน้า หรือราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด ณ เวลา 10.30 น. แล้วแต่ราคาใดจะสูงกว่า

กรณีที่ไม่สามารถ Buy-in หลักทรัพย์ได้ครบทั้งจำนวนในวันนั้น และหลักทรัพย์นั้นมีรายการ Buy-in ในวันถัดไปด้วย จะรวมจำนวนหลักทรัพย์ที่ต้อง Buy-in เพิ่มขึ้นเข้ากับจำนวนหลักทรัพย์ที่เหลือและแสดงเป็นรายการเดี่ยว โดยใช้ราคาเดียวกับรายการที่ยังไม่สามารถ Buy-in ได้ครบจำนวน

5. การชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่ Buy-in : ภายในวันที่ Buy-in (Same day settlement) โดยจะชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์รายการดังกล่าวรวมกับรายการซื้อขายปกติ

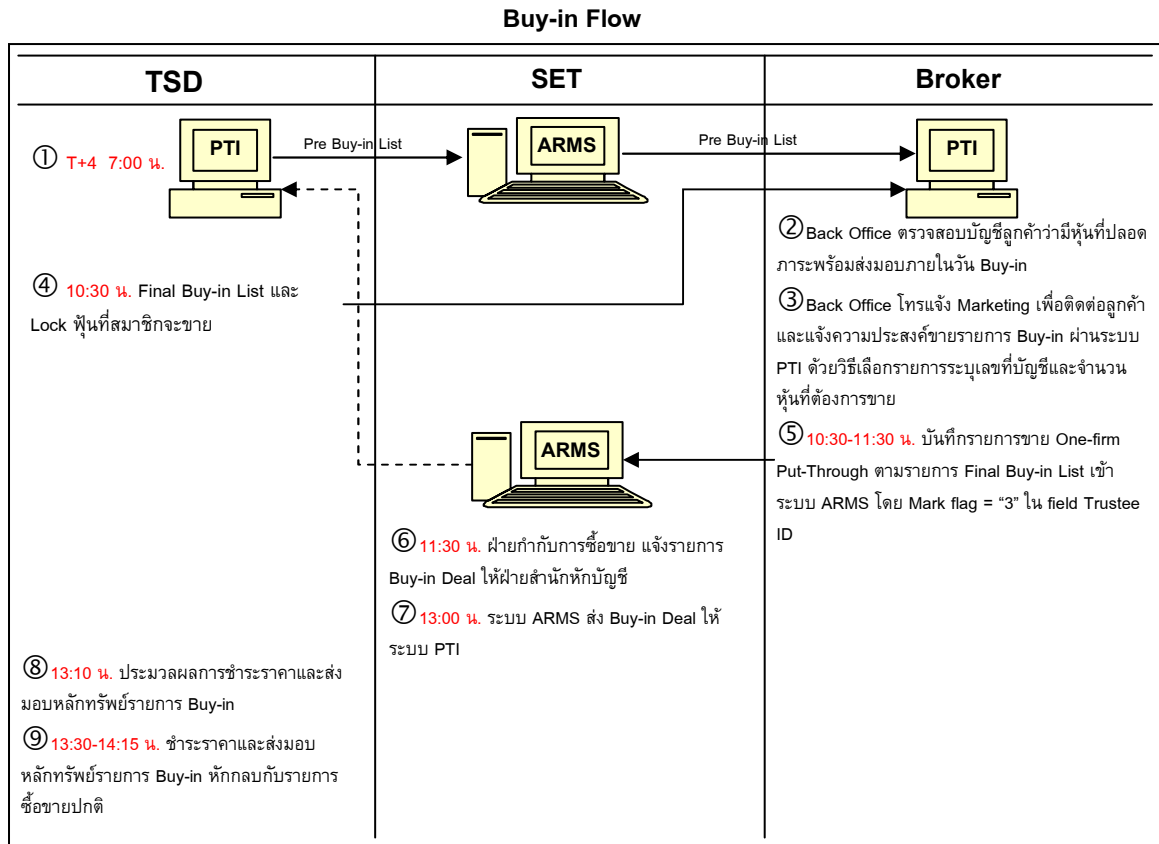
6. เกณฑ์ในการเลือกผู้ขาย : จัดสรรตาม Time Priority

7. เกณฑ์ในการเลือกผู้ผิดนัด : จัดสรรเป็น Board Lot ตามลำดับดังนี้

1. สมาชิกผู้ผิดนัดก่อน
2. กรณีไม่มีสมาชิกผิดนัดหลายรายในหลักทรัพย์เดียวกัน วันเดียวกัน จะจัดสรรตามสัดส่วนจำนวนหลักทรัพย์ที่ผิดนัดตามหน่วยการซื้อขาย (Prorate) หากจัดสรรไม่ลงตัว ระบบจะ Random

8. ผู้รับผิดชอบค่าใช้จ่าย : สมาชิกผู้ผิดนัดเป็นผู้รับผิดชอบค่าใช้จ่ายในการ Buy-in ที่เกิดขึ้นทั้งหมด

9. วิธีการ Buy-in :



- 9.1. ณ วันทำการถัดจากวันที่มีนัดเวลา 7.00 น. TSD จะส่ง Pre buy-in list แจ้งให้บริษัทสมาชิกทุกรายทราบผ่านระบบ ARMS และ PTI โดยมีรายละเอียด วันที่ซื้อขาย ตลาดที่ซื้อขาย ชื่อหลักทรัพย์ จำนวนหุ้น และราคาที่ต้องการ Buy-in
- 9.2. Back office ของบริษัทสมาชิกตรวจสอบบัญชีลูกค้าว่ามีหุ้นที่ปลดภาระพร้อมส่งมอบ ณ วันที่ทำการ Buy-in หรือไม่
- 9.3. Back office แจ้ง Front office ของสมาชิกเพื่อติดต่อลูกค้า และแจ้งความประสงค์ของลูกค้าในการขายรายการ buy-in ผ่านระบบ PTI โดยระบุเลขที่บัญชี และจำนวนหุ้นที่ต้องการขาย โดยให้ระบบตรวจสอบความเพียงพอของหุ้นในบัญชีดังกล่าวและ Lock หุ้นตามจำนวนที่ต้องการขาย เพื่อป้องกันปัญหาการผัดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ที่อาจเกิดขึ้น
- 9.4. ระบบจัดสรรตาม Time Priority ที่สมาชิกแจ้งความประสงค์ผ่านระบบ PTI และทำการปรับลดจำนวนที่ต้องการ Buy-in ลงแบบ Real time จนกว่าจะครบตามจำนวนที่ต้องการ Buy-in
- 9.5. สมาชิกแจ้งการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผัดนัดผ่านระบบ PTI ภายในเวลา 10.30 น. ว่ามาจาก
 - 9.5.1. รายการซื้อคืน สมาชิกต้องระบุ Trade Date = T+1 (T คือวันที่ขายรายการผัดนัด) และจำนวนที่ส่งมอบได้ ซึ่งต้องไม่เกินยอดซื้อทั้งหมดในวันดังกล่าว
 - 9.5.2. การโอน สมาชิกต้องระบุ Transaction no. ของรายการโอน
 - 9.5.3. การฝาก สมาชิกต้องระบุ Transaction no. ของรายการฝาก

9.5.4. การสร้างรายการ Clearing to Custodian สมาชิกต้องระบุ Transaction no. ของรายการที่สร้าง และ Settlement Date ซึ่งต้องเป็นรายการที่ Confirm ภายในช่วงเวลาหลัง Settlement time ณ Settlement Date ถึงก่อนที่ระบบจะสร้าง Buy-in List (10.30 น.) ในวันทำการถัดไป

9.6. ณ เวลา 10.30 น. ระบบจะ

9.6.1. ปรับลดยอดหลักทรัพย์ที่ต้อง Buy-in ด้วยจำนวนหลักทรัพย์ที่สมาชิกสามารถส่งมอบได้

9.6.2. ปลด Lock หุ้นในบัญชีของสมาชิกที่ไม่ต้องส่งคำสั่งซื้อขาย

9.6.3. ส่ง Buy-in List ให้บริษัทสมาชิก เพื่อยืนยันรายการที่สมาชิกต้องส่งคำสั่งซื้อขาย ทั้งชื่อหลักทรัพย์ จำนวน และราคาที่ต้องการซื้อขายผ่านระบบ ARMS โดยระบบ PTI แจ้งให้สมาชิกทราบในรูปแบบรายงาน และ Text file ซึ่งสมาชิกสามารถ inquiry และเรียกพิมพ์ได้ 2 รายงาน คือ

- รายงานแสดงรายการ Buy-in ที่สมาชิกต้องส่งคำสั่ง Put-through

- รายงานแสดงรายการ Buy-in ที่สมาชิกไม่ต้องส่งคำสั่ง Put-through เนื่องจากสมาชิกผู้ผิดนัดสามารถส่งมอบหลักทรัพย์ได้แล้วตามข้อ 9.5

9.7. สมาชิกที่ต้องการขายหลักทรัพย์บนที่กรรายการซื้อขายแบบ one-firm put-through ตามรายการ Buy-in list ที่ได้รับจาก TSD เข้าระบบ ARMS ภายในเวลา 10.30-11.30 น. ซึ่งต้องระบุในรายการซื้อขายว่าเป็นรายการ buy-in โดย mark flag = "3" ใน field "Trustee ID"

9.8. เวลา 13.00 น. ระบบ PTI รับ Buy-in Deal จากระบบ ARMS สำหรับรายการ Buy-in ที่ซื้อได้ เพื่อประมวลการชำระราคาและส่งมอบรวมกับรายการซื้อขายปกติที่ครบกำหนด Settlement ในวันนั้นทั้งสมาชิกผู้ขายและสมาชิกผู้ผิดนัด

9.9. ณ เวลา Settlement ระบบจะโอนหุ้นที่ lock ไว้เข้าบัญชี clearing ของสมาชิกผู้ขาย และจัดสรรเข้าบัญชีสมาชิกผู้ผิดนัดต่อไป