

ประกาศที่ ปยต. 060/2567**เรื่อง หลักเกณฑ์ในการกำหนดวงเงินจากหลักทรัพย์ที่ลูกค้านำมาแสดงและ
การคำนวณอำนาจซื้อจากหลักทรัพย์ที่วางเป็นหลักประกันในบัญชีเงินสด**

- อ้างถึง 1. หนังสือสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ที่ บล. 166/2567 เรื่อง นำส่งแนวทางการปฏิบัติงานสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ลงวันที่ 30 สิงหาคม 2567
2. หนังสือ ก.ล.ต. นป. 3554/2567 เรื่อง การให้ความเห็นชอบแนวทางการปฏิบัติงานของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย เกี่ยวกับการพิจารณากำหนดวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้า ลงวันที่ 30 สิงหาคม 2567

ตามที่ สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (“สมาคม”) ได้ปรับปรุงแนวทางการปฏิบัติงาน เรื่อง การพิจารณาวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้า ซึ่งสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“สำนักงาน ก.ล.ต.”) ได้แก้ไขเพิ่มเติมและให้ความเห็นชอบรวมถึงประกาศใช้เมื่อวันที่ 30 สิงหาคม 2567 รายละเอียดตามหนังสือที่อ้างถึงนั้น

บริษัทฯ ได้มีการนำปัจจัยด้านคุณภาพของหลักทรัพย์มาประกอบการพิจารณาวงเงินจากหลักทรัพย์ที่ลูกค้านำมาแสดงในทุกประเภทบัญชี และการคำนวณอำนาจซื้อจากหลักทรัพย์ที่วางเป็นหลักประกันในบัญชีเงินสด (Cash Account) ตามแนวทางการปฏิบัติงานที่ได้รับความเห็นชอบตามที่กล่าวมาข้างต้นแล้ว เพื่อให้เกิดความชัดเจนในการปฏิบัติงาน บริษัทฯ จึงขอประกาศหลักเกณฑ์ในการกำหนดวงเงินจากหลักทรัพย์ที่ลูกค้านำมาแสดงและการคำนวณอำนาจซื้อจากหลักทรัพย์ที่วางเป็นหลักประกันในบัญชีเงินสด โดยพิจารณาจากมูลค่าหลักทรัพย์หลังปรับลด (Haircut) ของลูกค้าบุคคลธรรมดาและนิติบุคคลที่มีใช้ผู้ลงทุนสถาบันตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด ดังต่อไปนี้

1. **กรณีปรับลดมูลค่าหลักทรัพย์สำหรับการกำหนดวงเงินจากหลักทรัพย์ที่ลูกค้านำมาแสดงและการคำนวณอำนาจซื้อจากหลักทรัพย์ที่วางเป็นหลักประกันในบัญชีเงินสด**
 - 1.1. หลักทรัพย์ในกลุ่ม SET50 กำหนดให้การปรับลด (Haircut) เท่ากับร้อยละ 0 ของมูลค่าหลักทรัพย์
 - 1.2. หลักทรัพย์ในกลุ่ม SET 51 - 100 กำหนดให้การปรับลด (Haircut) เท่ากับร้อยละ 10 ของมูลค่าหลักทรัพย์
 - 1.3. หลักทรัพย์นอกกลุ่ม SET100 (Non-SET 100) กำหนดให้การปรับลด (Haircut) เท่ากับร้อยละ 30 ของมูลค่าหลักทรัพย์
2. **กรณีปรับลดมูลค่าหลักทรัพย์สำหรับการคำนวณอำนาจซื้อจากหลักทรัพย์ที่วางเป็นหลักประกันในบัญชีเงินสดเป็นกรณีพิเศษ**
 - 2.1. กรณีหลักทรัพย์ที่ออกและเสนอขายหุ้นที่ออกใหม่ต่อประชาชน (IPO) และเข้าซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ช่วง 60 วันแรก หรือกรณีการเข้าตลาดหลักทรัพย์ทางอ้อม (Backdoor Listing) กำหนดให้การปรับลด (Haircut) ในอัตราเท่ากับ 1.5 เท่า ของอัตราที่กำหนดตามข้อ 1
 - 2.2. กรณีลูกค้ารายใดมีหลักทรัพย์ (นับรวม NVDR) ที่เป็นหลักประกันในบัญชีของลูกค้า กระจุกวัด
 - 2.2.1. กรณีกระจุกวัดมากกว่าร้อยละ 5 ของจำนวนหลักทรัพย์ที่เรียกชำระแล้วทั้งหมดของบริษัทที่ออกหลักทรัพย์นั้น กำหนดให้การปรับลด (Haircut) ในอัตราเท่ากับ 1.5 เท่า ของอัตราที่กำหนดตามข้อ 1-3 แล้วแต่กรณี
 - 2.2.2. กรณีกระจุกวัดมากกว่าร้อยละ 10 ของหลักทรัพย์ที่เรียกชำระแล้วทั้งหมดของบริษัทที่ออกหลักทรัพย์นั้น กำหนดให้การปรับลด (Haircut) ในอัตราเท่ากับ 3.0 เท่า ของอัตราที่กำหนดตามข้อ 1-3 แล้วแต่กรณี

- 2.3. กรณีหลักทรัพย์ที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยกำหนดให้ซื้อขายด้วย Cash Balance เท่านั้นกำหนดให้การปรับลด (Haircut) เท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าหลักทรัพย์
- 2.4. กรณีหลักทรัพย์ไม่มีสภาพคล่องในการซื้อขาย หรือเพิ่งถูกปลดจากการห้ามสั่งซื้อหรือขายหลักทรัพย์เป็นการชั่วคราวโดยเงินเครื่องหมาย SP ภายในระยะเวลา 30 วัน กำหนดให้การปรับลด (Haircut) เท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าหลักทรัพย์

ทั้งนี้ บริษัทฯ โดยการพิจารณาของฝ่ายบริหารความเสี่ยงมีสิทธิในการพิจารณากำหนดให้การปรับลด (Haircut) สูงกว่าอัตราที่กำหนดข้างต้นได้ จากปัจจัยที่เกี่ยวข้องของหลักทรัพย์ เช่น หลักทรัพย์มีความผันผวนสูงขึ้น หรือหลักทรัพย์มีการซื้อขายผิดปกติ หรือความเสี่ยงในการส่งมอบหลักทรัพย์สูงขึ้น หรือฐานะการดำเนินงานของบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์เปลี่ยนแปลงอย่างมีนัยสำคัญ เป็นต้น

ประกาศฉบับนี้ให้มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 15 กันยายน 2567 เป็นต้นไป ทั้งนี้ ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการคำนวณอำนาจซื้อจากหลักทรัพย์ที่หรือวางเป็นหลักประกันให้มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2568 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 29 พฤศจิกายน 2567

บริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด