

สารบัญ

ข้อบังคับ

หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า

	หน้า
401 การเข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญา.....	400-1
402 การชำระหนี้ด้วยระบบการชำระหนี้.....	400-1
403 การจัดทำและเก็บรักษาทรัพย์สิน.....	400-2
403.01 การจัดทำและเก็บรักษาบัญชีทรัพย์สินของสำนักหักบัญชี.....	400-2
403.02 การเปิดบัญชี.....	400-2
403.03 การบันทึกบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า.....	400-2
403.04 การปรับมูลค่าทรัพย์สินในบัญชีหลักประกัน.....	400-4
404 รายงานการชำระหนี้.....	400-4
404.01 การจัดทำและจัดส่งรายงานการชำระหนี้.....	400-4
404.02 การผูกพันปฏิบัติตามรายงานเพื่อการชำระหนี้.....	400-5
405 การชำระหนี้.....	400-6
405.01 กระบวนการชำระหนี้.....	400-6
405.02 มูลค่าการซื้อขายออพชั่น.....	400-6
405.02/1 มูลค่าเงินชดเชยการเลื่อนการส่งมอบสินค้า.....	400-6
405.03 มูลค่าการตั้งฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์ส.....	400-6
405.04 มูลค่าการใช้สิทธิ.....	400-7
405.05 วิธีการชำระหนี้.....	400-8

	หน้า
405.06 กำหนดเวลาชำระหนี้.....	400-8
406 การใช้สิทธิตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่น.....	400-8
406.01 การขอใช้สิทธิตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่น ของสมาชิก (Exercise Request)	400-9
406.02 การใช้สิทธิตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่นแทนสมาชิก ของสำนักหักบัญชี (Automatic Exercise)	400-9
406.03 การเลือกผู้ขายออปชั่นเพื่อการชำระหนี้ตาม สัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่น (Assign)	400-9
407 การโอนฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า.....	400-10
408 การแก้ไขรายการซื้อขาย.....	400-10
409 การยกเลิกรายการซื้อขาย.....	400-10
410 การส่งมอบสินค้า.....	400-10
410.01 การแจ้งความประสงค์ในการส่งมอบสินค้า (Tender Notification Request).....	400-11
410.02 การจับคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่กำหนดให้ส่งมอบสินค้า.....	400-11
410.03 การสิ้นสุดการเข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญา.....	400-12
410.04 การวางทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit).....	400-12
410.05 การชำระราคาสินค้าและค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้อง.....	400-12
410.06 การผัดนัดส่งมอบสินค้า.....	400-13
410.07 การส่งมอบสินค้าโดยทางเลือกอื่น (Alternative Delivery Procedures)..	400-13
410.08 บุคคลที่เกี่ยวข้องกับการส่งมอบสินค้า.....	400-14

***ข้อบังคับ**

หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า

401 การเข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญา

การชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชีจะให้บริการเฉพาะสมาชิกตามประเภทที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยสำนักหักบัญชีจะเข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญาในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับสมาชิกทันทีที่การซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกิดขึ้น ทั้งนี้ ให้นำรวมถึงรายการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่สามารถรับ โอนเพื่อการชำระหนี้แทนด้วย

การเข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญาในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับสมาชิกของสำนักหักบัญชีตามความในวรรคหนึ่งจะสิ้นสุดลงทันทีเมื่อสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีการจับคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามหลักเกณฑ์ 410

402 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้าด้วยระบบการชำระหนี้

การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้าด้วยระบบการชำระหนี้ให้กระทำโดยสมาชิกที่ได้รับอนุญาตจากสำนักหักบัญชีตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด

เพื่อกำกับดูแลการใช้ระบบคอมพิวเตอร์ของสมาชิกให้เป็นไปตามมาตรฐานที่สำนักหักบัญชีกำหนดและเพื่อมิให้เกิดความเสียหายต่อระบบการชำระหนี้ สำนักหักบัญชีอาจดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) ทำการตรวจสอบอุปกรณ์คอมพิวเตอร์หรือชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการเชื่อมต่อกับระบบการชำระหนี้

(2) กำหนดให้สมาชิกดำเนินการเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขเพิ่มเติมอุปกรณ์คอมพิวเตอร์หรือชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการเชื่อมต่อกับระบบการชำระหนี้

(3) ห้ามสมาชิกใช้งานทั้งหมดหรือบางส่วนของอุปกรณ์คอมพิวเตอร์หรือชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ที่ใช้ในการเชื่อมต่อกับระบบการชำระหนี้ภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีเห็นสมควร

สมาชิกต้องรับผิดชอบต่อการกระทำใดๆ ที่ได้กระทำขึ้นในระบบการชำระหนี้ทั้งโดยการกระทำของสมาชิกเองหรือตัวแทนของสมาชิกที่ได้รับอนุญาตจากสมาชิกหรือสำนักหักบัญชีให้ใช้ระบบคอมพิวเตอร์ของสมาชิก

ในกรณีที่สมาชิกมีปัญหาเกี่ยวกับการเชื่อมต่อระบบงานของสมาชิกเพื่อใช้บริการระบบการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี สมาชิกอาจร้องขอให้สำนักหักบัญชีดำเนินการในระบบการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีแทนสมาชิกได้ โดยสมาชิกต้องรับผิดชอบในความเสียหายใดๆ ที่อาจเกิดขึ้นแก่สำนักหักบัญชีจากการดำเนินการดังกล่าวแทนสมาชิก

403 การจัดทำและเก็บรักษาทรัพย์สิน

403.01 การจัดทำและเก็บรักษาบัญชีทรัพย์สินของสำนักหักบัญชี

การให้บริการของสำนักหักบัญชี สำนักหักบัญชีจะจัดทำและเก็บรักษาบัญชีทรัพย์สินของสำนักหักบัญชีแยกออกจากบัญชีทรัพย์สินของสมาชิกและบัญชีทรัพย์สินของลูกค้าของสมาชิก โดยสำนักหักบัญชีอาจอนุญาตให้สมาชิกเปิดบัญชีเพื่อการเก็บรักษาทรัพย์สินมากกว่าหนึ่งบัญชีก็ได้

403.02 การเปิดบัญชี

เมื่อสำนักหักบัญชีอนุญาตให้บุคคลใดเป็นสมาชิกแล้ว สมาชิกนั้นต้องมีบัญชีกับสำนักหักบัญชีซึ่งแยกตามวัตถุประสงค์ในการดำเนินการได้เป็นบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า บัญชีหลักประกัน และบัญชีอื่นตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยแยกบัญชีของสมาชิกออกจากบัญชีของลูกค้าของสมาชิก ทั้งนี้สมาชิกสามารถเปิดบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามประเภทลูกค้าของสมาชิกได้ตามหลักเกณฑ์เงื่อนไขและวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยสมาชิกมีหน้าที่ดูแลความถูกต้องของบัญชีและข้อมูลที่ระบุในบัญชีที่สมาชิกขอเปิดด้วย

ในการดำเนินการให้มีบัญชีตามวรรคหนึ่ง ให้สมาชิกเปิดบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับสำนักหักบัญชีตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนด และเมื่อสมาชิกเปิดบัญชีดังกล่าวแล้ว สำนักหักบัญชีจะจัดให้มีบัญชีหลักประกันเพื่อรองรับฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกี่ยวข้องที่สมาชิกเปิดดังกล่าว โดยสมาชิกอาจเลือกเปิดเพียงบางประเภทบัญชีหรือทุกประเภทบัญชีตามที่สำนักหักบัญชีกำหนดได้ และสมาชิกต้องปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขในการบันทึก การเก็บรักษาทรัพย์สิน การวางหลักประกัน และการคำนวณหลักประกัน ซึ่งแตกต่างกันในแต่ละประเภทบัญชีตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด

*403.03 การบันทึกบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สำนักหักบัญชีจะบันทึกบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่สมาชิกลงในแต่ละบัญชีที่สมาชิกเปิดไว้ในระบบงานของสำนักหักบัญชีตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) กรณีที่สมาชิกซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยมีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชีจะดำเนินการลงบันทึกบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกหรือของลูกค้าของสมาชิก แล้วแต่กรณี

ในกรณีที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีการเปลี่ยนแปลงสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เนื่องจากผู้ออกสินค้าอ้างอิงมีการดำเนินการที่เกิดผลกระทบต่อมูลค่าสินค้าอ้างอิง (Corporate Action) หรือมีการจ่ายคืนหรือชดเชยสิทธิประโยชน์ที่เกิดจากสินค้าอ้างอิง (Corporate Entitlement) นั้น สำนักหักบัญชีจะบันทึกฐานะ

สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ยังค้างอยู่ให้สอดคล้องตามการเปลี่ยนแปลงดังกล่าว ตามวิธีการคำนวณที่สำนักหักบัญชีประกาศกำหนดเป็นคราว ๆ

(2) กรณีที่สมาชิกซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยมีวัตถุประสงค์เพื่อล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชีจะดำเนินการหักบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกหรือของลูกค้าของสมาชิกแล้วแต่กรณี ยกเว้นกรณีที่สมาชิกไม่มีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพียงพอสำหรับการล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและมิได้ดำเนินการแก้ไขรายการซื้อขายผ่านระบบการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี สำนักหักบัญชีจะลงบันทึกบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกหรือของลูกค้าของสมาชิกแล้วแต่กรณีและให้ถือว่าสมาชิกได้ดำเนินการสร้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตาม (1)

** (2/1) กรณีที่รายการซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกไม่ได้มีการระบุว่ามีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตาม (1) หรือเพื่อล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตาม (2) ให้ถือว่ารายการซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าวของสมาชิกมีวัตถุประสงค์เพื่อสร้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และสำนักหักบัญชีจะดำเนินการกับรายการซื้อหรือขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าวของสมาชิกตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดไว้ใน (1)

(3) เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งมีผลให้ฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ยังค้างอยู่ในบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกหรือลูกค้าของสมาชิกหมดภาวะหรือสิทธิตามสัญญา สำนักหักบัญชีจะหักบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าวออกทั้งหมด

(4) กรณีที่สมาชิกมีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีฐานะตรงข้ามกันอยู่ในบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกหรือลูกค้าของสมาชิก หากสมาชิกประสงค์จะหักกลบฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าว สมาชิกสามารถดำเนินการดังนี้

(4.1) กรณีที่สมาชิกต้องการดำเนินการหักกลบเอง สมาชิกอาจหักกลบที่ละรายการหรือทั้งจำนวนได้ไม่เกินจำนวนฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีฐานะตรงข้ามกันอยู่

(4.2) กรณีที่สมาชิกร้องขอให้สำนักหักบัญชีเป็นผู้ดำเนินการหักกลบ สำนักหักบัญชีจะดำเนินการหักกลบโดยอัตโนมัติในแต่ละบัญชีตามจำนวนฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีฐานะตรงข้ามกันตามเงื่อนไขที่สมาชิกระบุไว้ต่อสำนักหักบัญชีตั้งแต่เปิดบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ภายในเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

ในกรณีที่การทำรายการหักกลบตามวรรคหนึ่งผิดพลาด สมาชิกสามารถร้องขอต่อสำนักหักบัญชีเพื่อพิจารณาการยกเลิกรายการดังกล่าวได้ตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนด ทั้งนี้ ในการพิจารณาสำนักหักบัญชีอาจไม่ดำเนินการตามที่สมาชิกร้องขอหรืออาจกำหนดเงื่อนไขเพิ่มเติมเพื่อให้สมาชิกต้องปฏิบัติตามที่สำนักหักบัญชีเห็นสมควร

(5) กรณีที่สมาชิกแจ้งความประสงค์ในการส่งมอบสินค้าและได้รับการจับคู่ตามหลักเกณฑ์ 410 สำนักหักบัญชีจะดำเนินการล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์ดังกล่าว

(6) ในกรณีที่เป็นการตั้งฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกหรือลูกค้าของสมาชิกตามผลของกฎหมายหรือโดยคำสั่งศาล สำนักหักบัญชีจะดำเนินการตั้งฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าดังกล่าวออกทั้งหมดในวันดังกล่าว

ในการบันทึกบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้แก่สมาชิกตามวรรคหนึ่ง สำนักหักบัญชีจะดำเนินการโดยใช้รายละเอียดข้อมูลการซื้อขายของสมาชิกที่ได้รายงานผ่านระบบซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งในการคำนวณฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกและลูกค้าของสมาชิก หากสมาชิกไม่แก้ไขข้อมูลการซื้อขายดังกล่าวในระบบของสำนักหักบัญชี ให้ถือว่าสมาชิกยอมรับและผูกพันตามข้อมูลที่ได้รายงานผ่านระบบการชำระหนี้ดังกล่าวแล้ว ทั้งนี้ หากปรากฏว่าข้อมูลที่สำนักหักบัญชีได้รับจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าไม่ตรงกับข้อมูลที่สำนักหักบัญชีมีในระบบการชำระหนี้ สมาชิกตกลงให้สำนักหักบัญชีเปิดบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกแยกต่างหากจากบัญชีที่สมาชิกขอเปิดตามหลักเกณฑ์ 403.02 เพื่อบันทึกข้อมูลดังกล่าวโดยแยกของสมาชิกและของลูกค้าของสมาชิกตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(*ความในหลักเกณฑ์ 403.03 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า ลงวันที่ 26 กันยายน 2559 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 3 ตุลาคม 2559 เป็นต้นไป)

(*เพิ่มความในหลักเกณฑ์ 403.03 (2/1) โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า ลงวันที่ 31 มกราคม 2566 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 8 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป)

403.04 การปรับมูลค่าทรัพย์สินในบัญชีหลักประกัน

สำนักหักบัญชีจะปรับมูลค่าทรัพย์สินในบัญชีหลักประกันตามหลักเกณฑ์การวางหลักประกันในระบบการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่สำนักหักบัญชีกำหนด

404 รายงานการชำระหนี้

404.01 การจัดทำและจัดส่งรายงานการชำระหนี้

สำนักหักบัญชีจะจัดทำรายงานการชำระหนี้ให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

*(1) สำนักหักบัญชีจะประมวลผลเพื่อคำนวณมูลค่าดังต่อไปนี้ในทุกวันทำการภายในเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

- (1.1) มูลค่าการซื้อขายออพชั่น ตามหลักเกณฑ์ 405.02
- (1.2) มูลค่าเงินชดเชยการเลื่อนการส่งมอบสินค้า ตามหลักเกณฑ์ 405.02/1
- (1.3) มูลค่าการตั้งฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์ส ตามหลักเกณฑ์ 405.03
- (1.4) มูลค่าการใช้สิทธิ ตามหลักเกณฑ์ 405.04

(1.5) มูลค่าหลักประกันที่สมาชิกต้องชำระตามฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าปรากฏอยู่ในบัญชีสมาชิกและบัญชีของลูกค้าของสมาชิกตามหลักเกณฑ์การวางหลักประกันในระบบการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชีกำหนด

มูลค่าหลักประกันตามวรรคหนึ่ง สำนักหักบัญชีจะคำนวณตามเงื่อนไขของแต่ละบัญชีที่สมาชิกระบุเมื่อสมาชิกเปิดบัญชีกับสำนักหักบัญชี

** ในกรณีที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจัดให้มีการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในช่วงเวลา กลางคืน (Night session) สำนักหักบัญชีจะนำรายการซื้อขายที่เกิดขึ้นในช่วงดังกล่าว ประมวลผล รวมกับรายการซื้อขายของวันทำการถัดจากวันที่เริ่มซื้อขายในช่วงเวลากลางคืน (Night session) นั้น เพื่อจัดทำรายงานการชำระหนี้ให้สมาชิกตามวรรคหนึ่ง

(2) สำนักหักบัญชีจะจัดทำรายงานการชำระหนี้โดยแยกระหว่างบัญชีสมาชิกและบัญชีของลูกค้า ของสมาชิก ซึ่งประกอบด้วยข้อมูลฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าคงค้าง ข้อมูลหลักประกัน และข้อมูลอื่นเพื่อ การชำระหนี้ตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(3) สำนักหักบัญชีจะจัดทำรายงานอื่นนอกจากรายงานการชำระหนี้ตามที่กำหนดไว้ใน (2) เพื่อ แจกให้สมาชิกทราบและดำเนินการชำระหนี้อื่นใดที่มีได้แจ้งไว้ในรายงานการชำระหนี้ก็ได้

สำนักหักบัญชีจะจัดส่งรายงานเพื่อการชำระหนี้ให้สมาชิกด้วยระบบอิเล็กทรอนิกส์ที่สำนักหักบัญชี จัดให้มีขึ้น และในกรณีที่เครื่องคอมพิวเตอร์ที่ต่อเชื่อมระหว่างระบบงานของสมาชิกกับระบบงานของ สำนักหักบัญชีเกิดขัดข้อง สมาชิกอาจแจ้งขอรับรายงานเพื่อการชำระหนี้ดังกล่าวจากสำนักหักบัญชีได้

(*ความในหลักเกณฑ์ 404.01 (1) เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่ เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า ลงวันที่ 26 กันยายน 2559 ซึ่งมีผลบังคับใช้ ตั้งแต่วันที่ 3 ตุลาคม 2559 เป็นต้นไป)

(* เพิ่มเติมความในหลักเกณฑ์ 404.01 (1) วรรคสอง โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญา ซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า ลงวันที่ 29 มกราคม 2563 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 24 กุมภาพันธ์ 2563 เป็นต้นไป)

404.02 การผูกพันปฏิบัติตามรายงานการชำระหนี้

ในการชำระหนี้และวางหลักประกันของสมาชิก ให้ถือว่าข้อมูลรายงานการชำระหนี้และรายงานอื่น ตามหลักเกณฑ์ 404.01 เป็นข้อมูลและรายงานที่ถูกต้องและสมาชิกตกลงยอมรับและผูกพันตามข้อมูลและ รายงานดังกล่าว

405 การชำระหนี้

405.01 กระบวนการชำระหนี้

สมาชิกต้องดำเนินการชำระหนี้โดยแยกระหว่างบัญชีสมาชิกและบัญชีของลูกค้าของสมาชิก และต้องไม่นำฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในบัญชีสมาชิกและบัญชีของลูกค้าของสมาชิกหรือบัญชีของลูกค้าต่างรายมาหักกลบลบกัน

405.02 มูลค่าการซื้อขายอปชั่น

สมาชิกผู้ซื้อที่มีหน้าที่ชำระเงินค่าซื้อให้แก่ผู้ขายโดยคำนวณจากราคาซื้อขายอปชั่นตามข้อกำหนดของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตามรายงานการชำระหนี้ที่สำนักหักบัญชีจัดทำขึ้น โดยสำนักหักบัญชีจะคำนวณมูลค่าการซื้อขายตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) ราคาซื้อขายอปชั่นคูณด้วยจำนวนอปชั่นที่มีการซื้อขายและจำนวนสินค้าอ้างอิงต่อสัญญาสำหรับอปชั่นที่ส่งมอบสินค้า (Physical Delivery)

(2) ราคาซื้อขายอปชั่นคูณด้วยจำนวนอปชั่นที่มีการซื้อขายและค่าตัวคูณดัชนี (Multiplier) สำหรับอปชั่นที่ชำระด้วยเงิน (Cash Settlement)

สมาชิกผู้ขายมีสิทธิได้รับชำระเงินค่าซื้อขายอปชั่นตามรายงานการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี

*405.02/1 มูลค่าเงินชดเชยการเลื่อนการส่งมอบสินค้า

สมาชิกมีหน้าที่ชำระหรือมีสิทธิได้รับชำระเงินชดเชยการเลื่อนการส่งมอบสินค้าตามรายงานการชำระหนี้ โดยสำนักหักบัญชีจะคำนวณมูลค่าเงินชดเชยการเลื่อนการส่งมอบสินค้าตามหลักเกณฑ์วิธีการ เงื่อนไข และภายในเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(*เพิ่มเติมความในหลักเกณฑ์ 405.02/1 โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า ลงวันที่ 26 กันยายน 2559 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 3 ตุลาคม 2559 เป็นต้นไป)

*405.03 มูลค่าการตั้งฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์ส

สำหรับฐานะที่เกิดจากสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่ทำการซื้อขายเป็นวันสุดท้าย สำนักหักบัญชีจะดำเนินการตั้งฐานะภายหลังสิ้นสุดช่วงเวลาซื้อขายของวันสุดท้ายของการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์ส ยกเว้นฐานะที่เกิดจากสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงสินค้าหรือตัวแปรจากตลาดต่างประเทศและสำนักหักบัญชีกำหนดให้วันอื่นเป็นวันคำนวณมูลค่าเพื่อดำเนินการตั้งฐานะ สำนักหักบัญชีจะดำเนินการคำนวณมูลค่าเพื่อดำเนินการตั้งฐานะตามวันและเวลาที่สำนักหักบัญชีประกาศกำหนด โดยคำนวณมูลค่าตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) กรณีฐานะฟิวเจอร์สคงค้าง

สำนักหักบัญชีจะคำนวณผลต่างระหว่างราคาสำหรับการชำระราคา (Settlement price) ของวันทำการก่อนหน้ากับราคาสำหรับการส่งมอบหรือที่ใช้อ้างอิงเพื่อคำนวณส่วนต่างของราคาเพื่อใช้ในการชำระหนี้ในวันซื้อขายวันสุดท้าย (Final Settlement Price) หรือราคาสำหรับการส่งมอบสินค้า (Delivery Price) คูณด้วยจำนวนสัญญาคงค้างและจำนวนสินค้าอ้างอิงต่อสัญญาหรือค่าตัวคูณดัชนี (Multiplier) แล้วแต่กรณี

(2) กรณีฐานะฟิวเจอร์สที่สร้างขึ้นใหม่

สำนักหักบัญชีจะคำนวณผลต่างระหว่างราคาจับคู่ของฟิวเจอร์ส (Executed Price) กับราคาสำหรับการส่งมอบหรือที่ใช้อ้างอิงเพื่อคำนวณส่วนต่างของราคาเพื่อใช้ในการชำระหนี้ในวันซื้อขายวันสุดท้าย (Final Settlement Price) หรือราคาสำหรับการส่งมอบสินค้า (Delivery Price) คูณด้วยจำนวนสัญญาคงค้างและจำนวนสินค้าอ้างอิงต่อสัญญาหรือค่าตัวคูณดัชนี (Multiplier) แล้วแต่กรณี

การคำนวณมูลค่าการล้างฐานะตามวรรคหนึ่ง หากคำนวณ โดยอ้างอิงสกุลเงินต่างประเทศและมีการปรับมูลค่าเป็นสกุลเงินบาท สำนักหักบัญชีอาจคำนวณตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(*ความในหลักเกณฑ์ 405.03 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า ลงวันที่ 26 กันยายน 2559 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 3 ตุลาคม 2559 เป็นต้นไป)

405.04 มูลค่าการใช้สิทธิ

เมื่อมีการเรียกร้องให้มีการปฏิบัติตามภาระผูกพันตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออกป้อนในวันที่กำหนดให้มีการใช้สิทธิตามข้อกำหนดของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สำนักหักบัญชีจะคำนวณมูลค่าการใช้สิทธิตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) ออกป้อนที่ส่งมอบสินค้า (Physical Delivery)

ราคาใช้สิทธิ (Strike Price) คูณด้วยจำนวนออกป้อนที่มีการใช้สิทธิและจำนวนสินค้าอ้างอิงต่อสัญญา เพื่อให้สมาชิกผู้มีฐานะซื้อคอลออกป้อนและสมาชิกผู้มีฐานะขายพุทออกป้อนชำระมูลค่าการใช้สิทธิแก่สำนักหักบัญชี และสมาชิกดังกล่าวจะได้รับมอบสินค้าอ้างอิงจากสำนักหักบัญชี

สมาชิกผู้มีฐานะขายคอลออกป้อนและสมาชิกผู้มีฐานะซื้อพุทออกป้อนมีหน้าที่ส่งมอบสินค้าอ้างอิงให้แก่สำนักหักบัญชีและสมาชิกดังกล่าวจะได้รับชำระเงินตามมูลค่าการใช้สิทธิจากสำนักหักบัญชี

(2) ออกป้อนที่ชำระด้วยเงิน (Cash Settlement)

ส่วนต่างของราคาเพื่อการชำระราคา (Settlement Price) กับราคาใช้สิทธิ (Strike Price) คูณด้วยจำนวนออกป้อนที่มีการใช้สิทธิและค่าตัวคูณดัชนี (Multiplier) เพื่อให้สมาชิกผู้มีฐานะขายหรือฐานะซื้อออกป้อนชำระมูลค่าการใช้สิทธิแก่สำนักหักบัญชี

สมาชิกผู้มีฐานะซื้อหรือฐานะขายออปชั่นมีสิทธิได้รับชำระมูลค่าการใช้สิทธิจากสำนักหักบัญชี

405.05 วิธีการชำระหนี้

สมาชิกอาจชำระหนี้เป็นเงินสดหรือทรัพย์สินอื่นที่มีใช้เงินสดเป็นหลักประกันตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(1) การชำระหนี้เป็นเงินสด

(1.1) การชำระหนี้ ให้สมาชิกชำระหนี้โดยดำรงเงินในบัญชีเงินฝากธนาคารของสมาชิกกับธนาคารพาณิชย์ที่ทำหน้าที่เป็นตัวแทนในการชำระหนี้ที่สำนักหักบัญชีกำหนดให้ครบถ้วนถูกต้องตามรายงานการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี ภายในเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

การชำระหนี้เป็นเงินสดจะถือว่าเสร็จสมบูรณ์เมื่อสำนักหักบัญชีได้รับโอนเงินเข้าบัญชีเงินฝากธนาคารของสำนักหักบัญชี โดยถูกต้องครบถ้วนตามรายงานการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีแล้ว ทั้งนี้ สมาชิกผู้ชำระหนี้จะเพิกถอนการ โอนเงินมิได้

(1.2) การขอรับชำระหนี้ ให้สมาชิกยื่นคำขอรับชำระหนี้เพื่อขอรับโอนเงินเข้าบัญชีเงินฝากธนาคารของสมาชิกตามรายงานการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี ตามวิธีการและภายในเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(2) การชำระหนี้เป็นทรัพย์สินอื่นที่มีใช้เงินสด

สมาชิกที่ประสงค์จะชำระหนี้หรือขอรับชำระหนี้เป็นทรัพย์สินอื่นที่ไม่ใช่เงินสด จะต้องได้รับอนุญาตจากสำนักหักบัญชีก่อน ทั้งนี้ สมาชิกต้องดำเนินการตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนด

*405.06 กำหนดเวลาชำระหนี้

สมาชิกมีหน้าที่ชำระหนี้และวางหลักประกันตามรายงานการชำระหนี้หรือรายงานอื่นใดภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(*ความในหลักเกณฑ์ 405.06 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า ลงวันที่ 29 มกราคม 2563 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 24 กุมภาพันธ์ 2563 เป็นต้นไป)

406 การใช้สิทธิตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่น

สมาชิกผู้มีฐานะซื้อในบัญชีสมาชิกหรือบัญชีของลูกค้าของสมาชิก สามารถเรียกร้องให้มีการปฏิบัติตามภาระผูกพันตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่นในวันที่กำหนดให้มีการใช้สิทธิตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่นตามเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่นตามข้อกำหนดของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการดังต่อไปนี้

406.01 การขอใช้สิทธิตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออपชั่นของสมาชิก (Exercise Request)

สมาชิกผู้มีฐานะซื้อในบัญชีสมาชิกหรือบัญชีของลูกค้าของสมาชิกอาจใช้สิทธิตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่น โดยส่งคำขอแจ้งการใช้สิทธิผ่านระบบการชำระหนี้ภายในเวลาและตามวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด

เมื่อสำนักหักบัญชีได้รับคำขอใช้สิทธิตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่นของสมาชิกแล้ว สำนักหักบัญชีจะดำเนินการตามคำขอของสมาชิก ทั้งนี้ สำนักหักบัญชีอาจปฏิเสธการดำเนินการตามคำขอของสมาชิกหากสำนักหักบัญชีเห็นว่ามิชอบเท็จจริงหรือมีเหตุอันควรเชื่อได้ว่าการใช้สิทธิของสมาชิกดังกล่าวจะขัดหรือแย้งกับหลักเกณฑ์ของสำนักหักบัญชีหรือส่งผลกระทบต่อระบบการชำระหนี้ โดยแจ้งสมาชิกผ่านระบบการชำระหนี้

สมาชิกอาจยกเลิกคำขอใช้สิทธิตามวรรคหนึ่งได้โดยส่งคำสั่งยกเลิกผ่านระบบการชำระหนี้ภายในเวลาและวิธีการตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด

406.02 การใช้สิทธิตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่นแทนสมาชิกของสำนักหักบัญชี (Automatic Exercise)

เพื่อประโยชน์ของสมาชิกผู้มีฐานะซื้อในบัญชีสมาชิกหรือบัญชีของลูกค้าของสมาชิก เมื่อปรากฏต่อสำนักหักบัญชีว่าฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่นของสมาชิกผู้มีฐานะซื้อรายใด มีผลต่างระหว่างราคาสำหรับการชำระราคา (Settlement Price) กับราคาใช้สิทธิ (Strike Price) ในวันครบกำหนดอายุสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่น อันเป็นเหตุให้สมาชิกผู้มีฐานะซื้อที่มีสิทธิได้รับเงินจากการใช้สิทธิดังกล่าวในจำนวนที่สูงกว่าอัตราหรือมูลค่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด หากสมาชิกผู้มีฐานะซื้อไม่แจ้งปฏิเสธการใช้สิทธิตามวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด สำนักหักบัญชีจะถือว่าสมาชิกผู้มีฐานะซื้อได้ดำเนินการใช้สิทธิตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่นผ่านระบบการชำระหนี้ตามวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนดแล้ว

สมาชิกผู้มีฐานะซื้อต้องผูกพันปฏิบัติตามการใช้สิทธิตามวรรคหนึ่ง

406.03 การเลือกผู้ขายออปชั่นเพื่อการชำระหนี้ตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าออปชั่น (Assign)

สำนักหักบัญชีจะพิจารณาสุ่มเลือกสมาชิกผู้มีฐานะขายในบัญชีสมาชิกและบัญชีของลูกค้าของสมาชิก เพื่อปฏิบัติตามภาระผูกพันหากมีการใช้สิทธิของสมาชิกผู้มีฐานะซื้อตามวิธีการที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยสำนักหักบัญชีจะแจ้งผลการสุ่มเลือกดังกล่าวพร้อมผลการคำนวณมูลค่าการใช้สิทธิไปยังสมาชิกผู้มีฐานะซื้อหรือขายผ่านระบบการชำระหนี้

สมาชิกผู้มีฐานะขายที่ได้รับเลือกตามวรรคหนึ่ง ต้องผูกพันปฏิบัติตามรายงานการชำระหนี้เพื่อการใช้สิทธิตามที่สำนักหักบัญชีจัดให้มีขึ้น

407 การโอนฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สมาชิกอาจโอนฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ยังค้างในบัญชีฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกหรือของลูกค้าของสมาชิกเพื่อการชำระหนี้แทนได้ตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนด ในกรณีดังต่อไปนี้

- (1) กรณีที่เป็นการโอนโดยผลของกฎหมาย โดยคำสั่งศาล หรือเนื่องจากการเป็นผู้ที่เกี่ยวข้อง หรือกรณีที่เป็นของลูกค้ารายเดียวกัน
- (2) กรณีที่เป็นการซื้อขายผิดพลาด ทั้งนี้ ห้ามมิให้โอนฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ยังค้างในบัญชีสมาชิกไปยังบัญชีของลูกค้าของสมาชิก
- (3) กรณีมีเหตุขัดข้องจากระบบคอมพิวเตอร์ของสมาชิก

408 การแก้ไขรายการซื้อขาย

*สมาชิกหรือบุคคลที่สมาชิกมอบหมายอาจแก้ไขรายการซื้อขายผ่านระบบการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี เฉพาะรายการและตามหลักเกณฑ์ วิธีการ เงื่อนไข และภายในเวลาที่สำนักหักบัญชีประกาศกำหนด การแก้ไขรายการซื้อขายอื่นนอกจากที่สำนักหักบัญชีประกาศกำหนดตามวรรคหนึ่ง ให้สมาชิกดำเนินการได้เมื่อได้รับอนุญาตจากสำนักหักบัญชีแล้ว

(*ความในวรรคหนึ่งของหลักเกณฑ์ 408 เดิมถูกยกเลิกและให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า ลงวันที่ 26 กันยายน 2559 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 3 ตุลาคม 2559 เป็นต้นไป)

409 การยกเลิกรายการซื้อขาย

สำนักหักบัญชีอาจยกเลิกรายการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิก เมื่อสำนักหักบัญชีได้รับคำร้องขอจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้ดำเนินการยกเลิก ทั้งนี้ สมาชิกคู่กรณียังคงต้องรับผิดชอบค่าใช้จ่ายที่เกิดจากการให้บริการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีหรือค่าปรับจนครบถ้วน

*410 การส่งมอบสินค้า

เพื่อให้การส่งมอบสินค้าสำหรับสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่กำหนดให้ส่งมอบสินค้าเป็นไปด้วยความเรียบร้อย สมาชิกมีหน้าที่ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ วิธีการ เงื่อนไข และภายในเวลา ตลอดจนชำระค่าธรรมเนียม ค่าใช้จ่าย และค่าปรับ ตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด

ในการส่งมอบสินค้าบางประเภทที่ต้องนำฝากสินค้ากับผู้รับฝากทรัพย์สินตามรายชื่อที่สำนักหักบัญชีกำหนด สมาชิกมีหน้าที่ดำเนินการฝาก ถอน และโอนสินค้าตามหลักเกณฑ์ของสำนักหักบัญชี

โดยสมาชิกอาจส่งมอบสินค้าตามประเภทและชนิดเดียวกัน จำนวน และน้ำหนัก ที่เทียบเท่ากันแทนกันได้ ตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด

410.01 การแจ้งความประสงค์ในการส่งมอบสินค้า (Tender Notification Request)

ให้สมาชิกตรวจสอบความสามารถในการส่งมอบสินค้าของสมาชิกหรือลูกค้าของสมาชิกก่อน แจ้งความประสงค์ในการส่งมอบสินค้าต่อสำนักหักบัญชี ตามหลักเกณฑ์ วิธีการ เงื่อนไข และภายในเวลา ตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด ทั้งนี้ สมาชิกมีหน้าที่แจ้งความประสงค์ในการส่งมอบสินค้าให้ครบหน่วย การส่งมอบสินค้าตามหลักเกณฑ์ที่สำนักหักบัญชีกำหนด

หากสมาชิกมีเหตุอันควรเชื่อได้ว่าสมาชิกหรือลูกค้าไม่สามารถส่งมอบสินค้าได้ สมาชิกจะไม่มี สิทธิแจ้งความประสงค์ในการส่งมอบสินค้า และให้สมาชิกแจ้งให้ลูกค้าทราบพร้อมข้อเท็จจริงอันเป็นเหตุ ที่ทำให้สมาชิกไม่มีสิทธิแจ้งความประสงค์ดังกล่าว และอาจดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) ดำเนินการแจ้งสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิก หรือแจ้งให้ลูกค้าดำเนินการแจ้งสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้า หากลูกค้าไม่ดำเนินการดังกล่าว สมาชิกอาจทำการแจ้งสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า

(2) ดำเนินการอื่นใดเพื่อไม่ให้กระทบต่อระบบการชำระหนี้ตามที่สำนักหักบัญชีกำหนด

ในวันสุดท้ายของการซื้อขาย หากสมาชิกหรือลูกค้าของสมาชิกมีการถือครองฐานะสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าคงค้าง สมาชิกยังคงมีหน้าที่ต้องตรวจสอบความสามารถในการส่งมอบสินค้าของสมาชิกหรือลูกค้า ของสมาชิก ในกรณีที่มีเหตุอันควรเชื่อได้ว่าสมาชิกหรือลูกค้าไม่สามารถส่งมอบสินค้าได้ ให้สมาชิกแจ้งสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกหรือแจ้งให้ลูกค้าดำเนินการแจ้งสัญญาซื้อขายล่วงหน้า แล้วแต่กรณี หากลูกค้าไม่ดำเนินการดังกล่าว สมาชิกอาจทำการแจ้งสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้า ทั้งนี้ ให้สมาชิกดำเนินการดังกล่าวให้แล้วเสร็จภายในเวลาซื้อขายก่อนเวลาแจ้งความประสงค์ในการส่งมอบ สินค้าที่สำนักหักบัญชีกำหนด

ภายหลังเวลาซื้อขายตามวรรคสาม หากสมาชิกหรือลูกค้าของสมาชิกไม่แจ้งความประสงค์ ในการส่งมอบสินค้า สำนักหักบัญชีอาจดำเนินการอย่างใดอย่างหนึ่งหรือหลายอย่างดังต่อไปนี้

(1) ทำการจับคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ยังคงค้างตามหลักเกณฑ์ 410.02 โดยให้ถือว่าสมาชิกได้แจ้ง ความประสงค์ในการส่งมอบสินค้าต่อสำนักหักบัญชีตามวรรคหนึ่งแล้ว

(2) บังคับชำระเป็นเงินสด

(3) ดำเนินการอื่นใดเพื่อไม่ให้กระทบต่อระบบการชำระหนี้ตามที่สำนักหักบัญชีเห็นสมควร

410.02 การจับคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่กำหนดให้ส่งมอบสินค้า

สำนักหักบัญชีจะดำเนินการจับคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามการแจ้งความประสงค์ในการส่งมอบ สินค้าระหว่างสมาชิกผู้มีฐานะซื้อและสมาชิกผู้มีฐานะขายตามหลักเกณฑ์ วิธีการ เงื่อนไข และภายในเวลาที่ สำนักหักบัญชีกำหนด การจับคู่โดยสำนักหักบัญชีให้ถือเป็นที่สุดและผูกพันสมาชิกให้ปฏิบัติตามภาวะ

ผูกพันที่เกิดขึ้นในการส่งมอบสินค้าตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยสำนักหักบัญชีจะดำเนินการล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับการจับคู่เพื่อให้สมาชิกชำระหนี้ที่ค้างชำระกับสำนักหักบัญชีและเรียกเก็บค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นและค่าปรับตามหลักเกณฑ์ที่สำนักหักบัญชีกำหนดหรือสำนักหักบัญชีอาจดำเนินการอื่นใดตามที่เห็นสมควร

410.03 การสิ้นสุดการเข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญา

(1) การสิ้นสุดความผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญาของสำนักหักบัญชี

การเข้าผูกพันหรือแทนที่เป็นคู่สัญญาในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสำนักหักบัญชีกับสมาชิกตามหลักเกณฑ์ 401 จะสิ้นสุดลงเมื่อสำนักหักบัญชีได้จับคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามหลักเกณฑ์ 410.02 โดยสำนักหักบัญชีจะหลุดพ้นจากภาระหนี้และความรับผิดชอบทั้งปวงตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และสมาชิกยังคงมีหน้าที่ชำระหนี้ที่ค้างชำระต่อสำนักหักบัญชีให้เสร็จสิ้น

(2) ความผูกพันของสมาชิกในการส่งมอบสินค้าตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่จับคู่

เมื่อสำนักหักบัญชีได้จับคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามหลักเกณฑ์ 410.02 แล้ว สมาชิกผู้มีฐานะซื้อจะมีภาระผูกพันตามสัญญาในการส่งมอบสินค้ารวมถึงการชำระราคาโดยตรงกับสมาชิกผู้มีฐานะขายที่ได้รับการจับคู่ โดยสมาชิกคู่กรณีที่ได้รับการจับคู่มีหน้าที่ดูแลให้ลูกค้าผู้ซื้อและลูกค้าผู้ขายปฏิบัติตามภาระผูกพันที่เกิดขึ้นตามสัญญาที่ได้รับการจับคู่ในการส่งมอบสินค้าโดยมีสิทธิ หน้าที่ และความรับผิดชอบในการส่งมอบสินค้าตามรายละเอียดที่สำนักหักบัญชีกำหนด

410.04 การวางทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

สมาชิกที่ได้รับการจับคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีหน้าที่วางทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าต่อสำนักหักบัญชีตามหลักเกณฑ์ วิธีการ เงื่อนไข และภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยสำนักหักบัญชีอาจกำหนดประเภททรัพย์สินและหลักเกณฑ์การวางทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าไว้แตกต่างกันตามแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและตามผู้ซื้อหรือผู้ขายได้ และสมาชิกต้องวางทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าแยกระหว่างบัญชีสมาชิกและบัญชีของลูกค้าของสมาชิก และต้องไม่นำทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าในบัญชีของลูกค้าต่างรายมาหักกลบลบกัน

ให้นำความในหลักเกณฑ์หมวด 500 เรื่องการบริหารและการคืนหลักประกันมาบังคับใช้โดยอนุโลม ยกเว้นสำนักหักบัญชีจะกำหนดเป็นอย่างอื่น

410.05 การชำระราคาสินค้าและค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้อง

สมาชิกมีหน้าที่ชำระและรับชำระราคาสินค้าและค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนด ทั้งนี้ สำนักหักบัญชีอาจกำหนดแตกต่างกันตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้

410.06 การผัดนัดส่งมอบสินค้า

หากสมาชิกฝ่ายใดฝ่ายหนึ่ง ไม่ปฏิบัติตามหน้าที่หรือภาระผูกพันที่เกี่ยวข้องกับการส่งมอบสินค้าหรือปฏิบัติไม่ถูกต้องตามหลักเกณฑ์ วิธีการ เงื่อนไข และภายในเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด ให้ถือว่าสมาชิกรายดังกล่าวผัดนัดส่งมอบสินค้า โดยสมาชิกฝ่ายที่ผัดนัดส่งมอบสินค้าตกลงยินยอมให้สำนักหักบัญชีบังคับทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าเพื่อนำมาชำระค่าเสียหายและค่าใช้จ่ายอันเนื่องมาจากการผัดนัดส่งมอบสินค้า ตามความเสียหายที่เกิดขึ้นจริงให้แก่สมาชิกฝ่ายที่ไม่ผัดนัดส่งมอบสินค้า ทั้งนี้ การบังคับทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าดังกล่าวไม่กระทบถึงสิทธิของสมาชิกฝ่ายที่ไม่ผัดนัดส่งมอบสินค้าที่จะได้รับชดเชยค่าเสียหายจากสมาชิกฝ่ายที่ผัดนัดส่งมอบสินค้า

การผัดนัดส่งมอบสินค้าตามวรรคหนึ่ง สำนักหักบัญชีมีสิทธิเรียกค่าบริหารจัดการและค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องรวมถึงค่าปรับอันเกิดจากการที่สมาชิกผัดนัดส่งมอบสินค้าจากทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนด ทั้งนี้ สำนักหักบัญชีอาจกำหนดให้แตกต่างกันได้ตามแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และหากทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าไม่เพียงพอ สมาชิกฝ่ายที่ผัดนัดส่งมอบสินค้านี้มีหน้าที่ชำระค่าบริหารจัดการและค่าใช้จ่ายรวมถึงค่าปรับจนครบถ้วน ทั้งนี้ สำนักหักบัญชีไม่มีหน้าที่และความรับผิดชอบในการจัดหาสินค้ามาส่งมอบหรือรับมอบสินค้านี้รวมถึงค่าเสียหายและค่าใช้จ่ายใดๆ ที่เกิดขึ้นกับสมาชิกคู่กรณี

เพื่อความเรียบร้อยในการชำระราคาและส่งมอบสินค้า สมาชิกมีหน้าที่แจ้งรายการที่ผัดนัดส่งมอบสินค้าทั้งในส่วนการชำระราคาและส่งมอบสินค้าผ่านระบบการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีตามเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยหากสมาชิกไม่แจ้งรายการที่ผัดนัดดังกล่าวต่อสำนักหักบัญชี สำนักหักบัญชีจะดำเนินการสุ่มเลือกรายการส่งมอบสินค้าของสมาชิกและให้ถือว่ารายการดังกล่าวเป็นรายการที่ผัดนัดส่งมอบสินค้าและสำนักหักบัญชีจะดำเนินการตามกระบวนการที่เกี่ยวข้องกับการผัดนัดส่งมอบสินค้าต่อไป

410.07 การส่งมอบสินค้าโดยทางเลือกอื่น (Alternative Delivery Procedures)

เมื่อนักหักบัญชีแจ้งผลการจับคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้สมาชิกผู้มีฐานะซื้อและสมาชิกผู้มีฐานะขายทราบแล้ว หากสมาชิกคู่กรณีประสงค์จะส่งมอบสินค้าโดยทางเลือกอื่น และไม่ขอใช้บริการของสำนักหักบัญชี สมาชิกคู่กรณีดังกล่าวมีหน้าที่แจ้งสำนักหักบัญชีตามวิธีการและภายในเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนดเพื่อให้สำนักหักบัญชีปลดภาระผูกพันของสมาชิกที่ได้รับการจับคู่ดังกล่าว

410.08 บุคคลที่เกี่ยวข้องกับการส่งมอบสินค้า

เพื่อให้การส่งมอบสินค้าเป็นไปด้วยความเรียบร้อย สมาชิกอาจมอบหมายบุคคลดังต่อไปนี้ โดยปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และรายชื่อที่สำนักหักบัญชีกำหนดเพื่อดำเนินการแทนสมาชิก เพื่อประโยชน์ในการส่งมอบสินค้า โดยสำนักหักบัญชีอาจกำหนดไว้แตกต่างกันตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแต่ละประเภท

- (1) ผู้ดูแลการส่งมอบสินค้า
- (2) ตัวแทนการส่งมอบสินค้า
- (3) ผู้รับฝากทรัพย์สิน
- (4) ผู้ตรวจสอบคุณภาพสินค้า

ในการมอบหมายบุคคลตามวรรคหนึ่ง สมาชิกยังคงมีสิทธิ หน้าที่ และความรับผิดชอบในการดำเนินการใดๆ เพื่อประโยชน์ในการส่งมอบสินค้าแม้จะมีการมอบหมายบุคคลตามวรรคหนึ่งก็ตาม

(*ความในหมวด 410 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า ลงวันที่ 26 กันยายน 2559 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 3 ตุลาคม 2559 เป็นต้นไป)

(*ความในหมวด 400 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 400 การชำระหนี้และการส่งมอบสินค้า ลงวันที่ 18 ธันวาคม 2558 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 4 มกราคม 2559 เป็นต้นไป)