

## สารบัญ

### ข้อบังคับ

#### หมวด 700 ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

	หน้า
<b>701</b> การจัดตั้งทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-1
<b>702</b> ประเภทของทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-1
702.01 ประเภทของทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-1
702.02 ความเป็นเจ้าของทรัพย์สิน.....	700-1
<b>703</b> การวางหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคง (Security Deposit).....	700-1
<b>704</b> การวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย (Clearing Fund)....	700-2
704.01 การวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย.....	700-2
704.02 การเปลี่ยนแปลงมูลค่าทรัพย์สินสมทบกองทุนทดแทนความเสียหาย ของสมาชิกแต่ละราย.....	700-2
704.03 การเรียกทรัพย์สินสมทบเพิ่มเติม.....	700-2
<b>705</b> การบริหารทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-3
705.01 การบริหารทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงในส่วนของหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคง ของสมาชิกและกองทุนทดแทนความเสียหาย.....	700-3
705.02 การบริหารทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงในส่วนเงินสำรองเพื่อความมั่นคง ของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์.....	700-3
<b>706</b> การใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-3

	หน้า
<b>707</b> การส่งคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-4
707.01 การส่งคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงของสมาชิกรายที่ผิดนัด.....	700-4
707.02 การจัดสรรทรัพย์สินกรณีสมาชิกรายที่ผิดนัดส่งคืนทรัพย์สินพร้อมดอกเบี้ย ให้สำนักหักบัญชี.....	700-4
707.03 การเรียกค่าเสียหายหรือค่าปรับต่อสมาชิก.....	700-5
<b>708</b> การคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-5

## \*ข้อบังคับ

### หมวด 700

### ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

#### 701 การจัดตั้งทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

สำนักหักบัญชีอาจจัดให้มีทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงเพื่อเป็นประกันความเสียหายที่อาจเกิดจากการผิดนัดชำระหนี้หรือความเสียหายอื่นที่อาจเกิดจากการกระทำของสมาชิกในการดำเนินการที่เกี่ยวกับการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี

#### 702 ประเภทของทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

##### 702.01 ประเภทของทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงในการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีหมายความถึง เงินสด พันธบัตรรัฐบาล ตั๋วเงินคลัง หรือทรัพย์สินอื่นตามที่สำนักหักบัญชีประกาศกำหนด โดยแบ่งได้เป็น 3 ประเภท ดังต่อไปนี้

- (1) หลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิก (Security Deposit)
- (2) กองทุนทดแทนความเสียหาย (Clearing Fund) ซึ่งประกอบด้วยทรัพย์สินสมทบจากตลาดหลักทรัพย์และสมาชิก
- (3) เงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์ (SET Reserve Fund)

##### 702.02 ความเป็นเจ้าของทรัพย์สิน

ตลาดหลักทรัพย์และสมาชิกเป็นเจ้าของทรัพย์สินตามสัดส่วนที่สมทบเข้าทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงในการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี

#### 703 การวางหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคง (Security Deposit)

สมาชิกมีหน้าที่วางหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงตามหลักเกณฑ์และภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยสำนักหักบัญชีอาจเปลี่ยนแปลงมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงที่วางได้ตามที่เห็นสมควร

ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงตามวรรคหนึ่ง สำนักหักบัญชีอาจเรียกหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงเพิ่มเติมจากสมาชิกได้ตามที่เห็นสมควร และอาจเรียกหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกบางรายเป็นมูลค่าที่สูงกว่าสมาชิกรายอื่นได้โดยพิจารณาความเสี่ยงจากการกระทำของสมาชิกแต่ละรายที่อาจก่อให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี

## \*704 การวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย (Clearing Fund)

### 704.01 การวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย

สมาชิกมีหน้าที่ต้องวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายตามมูลค่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด ดังนี้

(1) ทรัพย์สินสมทบคงที่ (Fixed Contribution) ให้สมาชิกวางทรัพย์สินสมทบคงที่ตามมูลค่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยสำนักหักบัญชีอาจเปลี่ยนแปลงมูลค่าทรัพย์สินที่วางสมทบดังกล่าว และเรียกเก็บเพิ่มเติมจากสมาชิกได้ตามที่เห็นสมควร

(2) ทรัพย์สินสมทบผันแปร (Variable Contribution) ให้สมาชิกวางทรัพย์สินสมทบผันแปรตามมูลค่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยสำนักหักบัญชีอาจเปลี่ยนแปลงมูลค่าทรัพย์สินสมทบผันแปรที่สมาชิกมีหน้าที่ต้องวางต่อสำนักหักบัญชี และเรียกเก็บเพิ่มเติมจากสมาชิกได้ตามที่เห็นสมควร

### 704.02 การเปลี่ยนแปลงมูลค่าทรัพย์สินสมทบกองทุนทดแทนความเสียหายของสมาชิกแต่ละราย

สำนักหักบัญชีอาจเปลี่ยนแปลงมูลค่าทรัพย์สินสมทบผันแปรที่สมาชิกมีหน้าที่วางต่อสำนักหักบัญชี และอาจเรียกทรัพย์สินสมทบผันแปรจากสมาชิกบางรายเป็นมูลค่าที่สูงกว่าสมาชิกรายอื่นได้ โดยพิจารณาความเสี่ยงจากการกระทำของสมาชิกแต่ละรายที่อาจก่อให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี

### 704.03 การเรียกทรัพย์สินสมทบเพิ่มเติม

ในกรณีที่มีความเสียหายเกิดขึ้นต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี และทรัพย์สินที่สมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายมีมูลค่าไม่เพียงพอต่อการรองรับความเสียหายที่อาจเกิดขึ้นได้ทั้งหมด สำนักหักบัญชีอาจเรียกให้สมาชิกวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายเพิ่มเติมเป็นจำนวนไม่เกิน 1 เท่าของมูลค่าปัจจุบันของทรัพย์สินสมทบคงที่ร่วมกับทรัพย์สินสมทบผันแปรของสมาชิกแต่ละราย โดยสมาชิกจะต้องวางทรัพย์สินสมทบเพิ่มเติมภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด หากสมาชิกไม่ดำเนินการภายในระยะเวลาดังกล่าวให้ถือว่าสมาชิกรายดังกล่าวผิดนัด

(\*ความในหลักเกณฑ์ 704 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 700 ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง ลงวันที่ 16 ธันวาคม 2565 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 3 มกราคม 2566 เป็นต้นไป)

## 705 การบริหารทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

### 705.01 การบริหารทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงในส่วนหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกและกองทุนทดแทนความเสียหาย

สำนักหักบัญชีหรือบุคคลที่สำนักหักบัญชีมอบหมายจะบริหารจัดการหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกและกองทุนทดแทนความเสียหายที่เป็นเงินสด โดยให้นำหลักเกณฑ์ว่าด้วยการบริหารหลักประกันมาใช้ในการบริหารหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกและกองทุนทดแทนความเสียหายโดยอนุโลม

\*ในกรณีที่สำนักหักบัญชีหรือบุคคลที่สำนักหักบัญชีมอบหมายบริหารหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกและกองทุนทดแทนความเสียหาย และมีผลประโยชน์เกิดขึ้นไม่ว่าจะเป็นผลกำไรหรือผลขาดทุน หากเป็นผลประโยชน์จากการบริหารหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิก สำนักหักบัญชีอาจจัดสรรผลประโยชน์ดังกล่าวภายหลังหักค่าบริหารจัดการแล้ว ให้แก่สมาชิกตามวิธีและภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด แต่หากเป็นผลประโยชน์จากการบริหารทรัพย์สินสมทบในกองทุนทดแทนความเสียหาย สำนักหักบัญชีอาจจัดสรรผลประโยชน์ดังกล่าวภายหลังหักค่าบริหารจัดการแล้ว เข้ากองทุนทดแทนความเสียหายในส่วนที่เป็นทรัพย์สินสมทบของตลาดหลักทรัพย์ และเป็นทรัพย์สินสมทบผันแปรของสมาชิก โดยเฉลี่ยตามสัดส่วนที่ตลาดหลักทรัพย์และสมาชิกแต่ละรายได้สมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย และรายงานให้สมาชิกทราบภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

(\*ความในวรรคสองของหลักเกณฑ์ 705.01 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 700 ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง ลงวันที่ 16 ธันวาคม 2565 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 3 มกราคม 2566 เป็นต้นไป)

### 705.02 การบริหารทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงในส่วนเงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์

ให้สำนักหักบัญชีหรือบุคคลที่สำนักหักบัญชีมอบหมายเป็นผู้ดูแลการบริหารเงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์ โดยให้นำหลักเกณฑ์ว่าด้วยการบริหารหลักประกันมาใช้ในการบริหารเงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์โดยอนุโลม

## 706 การใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

เพื่อให้การใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงเป็นไปตามข้อบังคับของสำนักหักบัญชี หรือทดแทนในกรณีที่สมาชิกผิดนัดชำระหนี้หรือมีความเสียหายที่เกิดจากการกระทำของสมาชิกในกิจการที่เกี่ยวข้องกับการชำระหนี้ ให้สำนักหักบัญชีมีอำนาจใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง ได้ตามลำดับดังต่อไปนี้

(1) หลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี แล้วแต่กรณี

(2) ทรัพย์สินที่สมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายในส่วนของสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี

(3) เงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์สินตามจำนวนที่สำนักหักบัญชีประกาศกำหนดเป็นส่วนที่หนึ่ง

(4) ทรัพย์สินที่สมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายในส่วนของสมาชิกรายอื่นที่ไม่ใช่รายที่ผิดนัดหรือรายที่ไม่ได้กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี แล้วแต่กรณี

(5) เงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์สินส่วนที่เหลือภายหลังหักเงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์สินส่วนที่หนึ่ง

(6) ทรัพย์สินสมทบเพิ่มเติมตามสัดส่วนที่สมาชิกแต่ละรายสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย

(7) เงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์สิน

การใช้ทรัพย์สินตาม (4) และ (6) ให้เป็นไปตามสัดส่วนของทรัพย์สินที่สมาชิกสมทบเข้ากองทุน

การใช้เงินสมทบเข้ากองทุนตาม (3) ตามสัดส่วนที่สำนักหักบัญชีประกาศกำหนดนั้น สำนักหักบัญชีอาจประกาศเปลี่ยนแปลงสัดส่วนการใช้เงินสมทบดังกล่าวได้ตามที่เห็นสมควร

## 707 การส่งคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

### 707.01 การส่งคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงของสมาชิกรายที่ผิดนัด

สมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีมีหน้าที่ในการชำระคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงที่สำนักหักบัญชีได้ใช้ตามหลักเกณฑ์ 706

ในกรณีที่มีการใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง สำนักหักบัญชีอาจเรียกเก็บดอกเบี้ยจากการใช้ทรัพย์สินดังกล่าว โดยคำนวณตามอัตราสูงสุดตามกฎหมายว่าด้วยดอกเบี้ยเงินให้กู้ยืมของสถาบันการเงินนับแต่วันที่มีการใช้ทรัพย์สินดังกล่าวจนถึงวันที่ชำระคืน เว้นแต่สำนักหักบัญชีจะกำหนดอัตรดอกเบี้ยไว้เป็นอย่างอื่น

### 707.02 การจัดสรรทรัพย์สินกรณีสมาชิกรายที่ผิดนัดส่งคืนทรัพย์สินพร้อมดอกเบี้ยให้สำนักหักบัญชี

เมื่อสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีได้ชำระคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงตามจำนวนที่มีการใช้ทรัพย์สินพร้อมดอกเบี้ยแก่สำนักหักบัญชี ให้มีการจัดสรรทรัพย์สินดังกล่าวคืนตามลำดับดังต่อไปนี้

(1) เงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์สิน

(2) ทรัพย์สินสมทบเพิ่มเติมตามสัดส่วนที่สมาชิกแต่ละรายสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย

(3) เงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์สินส่วนที่เหลือภายหลังหักเงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์สินส่วนที่หนึ่ง

ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า)

หมวด 700 ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

(4) ทรัพย์สินที่สมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายในส่วนของสมาชิกรายอื่นที่ไม่ใช่รายที่ผิดนัดหรือรายที่ไม่ได้กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี แล้วแต่กรณี

(5) เงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์สินตามจำนวนที่สำนักหักบัญชีประกาศกำหนดเป็นส่วนที่หนึ่ง

(6) ทรัพย์สินที่สมทบกองทุนทดแทนความเสียหายในส่วนของสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี แล้วแต่กรณี

(7) หลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี

การจัดสรรทรัพย์สินคืนตาม (2) และ (4) ให้เป็นไปตามสัดส่วนที่ได้มีการนำทรัพย์สินดังกล่าวออกใช้ตามหลักเกณฑ์ 706

#### 707.03 การเรียกค่าเสียหายหรือค่าปรับต่อสมาชิก

สำนักหักบัญชีอาจเรียกค่าเสียหายหรือค่าปรับจากการใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงจากสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี ตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนด

#### 708 การคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

เมื่อสำนักหักบัญชีมีมติให้สมาชิกพ้นสมาชิกภาพ สำนักหักบัญชีจะคืนทรัพย์สินที่สมาชิกวางไว้เพื่อความมั่นคงของการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี รวมทั้งผลประโยชน์ที่เกิดจากทรัพย์สินดังกล่าวในจำนวนที่เหลืออยู่ภายหลังจากหักหนี้รวมถึงค่าเสียหายและค่าปรับทั้งหมดที่สมาชิกค้างชำระต่อสำนักหักบัญชี ภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

\*\*\*\*\*

(\*ความในหมวด 700 เดิมถูกยกเลิก และให้ใช้ความใหม่นี้แทน โดยข้อบังคับสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หมวด 700 ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง ลงวันที่ 13 ธันวาคม 2559 ซึ่งมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2560 เป็นต้นไป)