

สารบัญ

ข้อบังคับ

หมวด 700 ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

	หน้า
701 การจัดตั้งทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-1
702 ประเภทของทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-1
702.01 ประเภทของทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-1
702.02 ความเป็นเจ้าของทรัพย์สิน.....	700-1
703 การวางหลักทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง (Security Deposit).....	700-1
704 การวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย (Clearing Fund)	700-2
704.01 การวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย.....	700-2
704.02 การเปลี่ยนแปลงมูลค่าทรัพย์สินสมทบกองทุนทดแทนความเสียหาย ของสมาชิกแต่ละราย.....	700-2
704.03 การเรียกทรัพย์สินสมทบเพิ่มเติม.....	700-2
705 การบริหารจัดการ.....	700-3
705.01 การบริหารทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงในส่วนหลักทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง ของสมาชิกและกองทุนทดแทนความเสียหาย.....	700-3
705.02 การบริหารทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงในส่วนเงินสำรองเพื่อความมั่นคง ของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์สิน.....	700-3
706 การใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-3

หน้า

707	การส่งคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง.....	700-4
707.01	การส่งคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงของสมาชิกรายที่ผิดนัด.....	700-4
707.02	การจัดสรรทรัพย์สินกรณีสมาชิกรายที่ผิดนัดส่งคืนทรัพย์สิน พร้อมดอกเบี้ยให้สำนักหักบัญชี.....	700-4
707.03	การเรียกค่าเสียหายหรือค่าปรับต่อสมาชิก.....	700-5
708	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 และอาจเรียกหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของ

สมาชิกบางรายเป็นมูลค่าที่สูงกว่าสมาชิกรายอื่นได้โดยพิจารณาความเสี่ยงจากการกระทำของสมาชิกแต่ละรายที่อาจก่อให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี

704 การวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย (Clearing Fund)

704.01 การวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย

สมาชิกมีหน้าที่ต้องวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายตามมูลค่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด ดังนี้

(1) ทรัพย์สินสมทบแรกเข้า (Initial Contribution) ให้สมาชิกวางทรัพย์สินสมทบแรกเข้าต่อสำนักหักบัญชีตามหลักเกณฑ์และภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด โดยสำนักหักบัญชีอาจเปลี่ยนแปลงมูลค่าทรัพย์สินที่วางสมทบดังกล่าวและเรียกเก็บเพิ่มเติมจากสมาชิกได้ตามที่เห็นสมควร

(2) ทรัพย์สินสมทบรายเดือน (Monthly Contribution) ให้สมาชิกวางทรัพย์สินสมทบรายเดือนต่อสำนักหักบัญชีตามมูลค่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด ทั้งนี้ สำนักหักบัญชีจะพิจารณามูลค่าที่เรียกเก็บจากความเสี่ยงที่อาจก่อให้เกิดความเสียหายจากการกระทำของสมาชิกกองทุนและในกรณีที่สำนักหักบัญชีพิจารณาแล้วพบว่ามูลค่าความเสียหายสูงสุดซึ่งสำนักหักบัญชีคำนวณมีจำนวนเกินกว่ามูลค่าของทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงที่สำนักหักบัญชีกำหนด สำนักหักบัญชีอาจปรับมูลค่าที่เรียกเก็บเพิ่มเติมและเรียกเก็บจากสมาชิกได้ตามที่เห็นสมควร

704.02 การเปลี่ยนแปลงมูลค่าทรัพย์สินสมทบกองทุนทดแทนความเสียหายของสมาชิกแต่ละราย

สำนักหักบัญชีอาจเปลี่ยนแปลงมูลค่าทรัพย์สินสมทบรายเดือนที่สมาชิกมีหน้าที่วางต่อสำนักหักบัญชีและอาจเรียกทรัพย์สินสมทบรายเดือนของสมาชิกบางรายเป็นมูลค่าที่สูงกว่าสมาชิกรายอื่นได้โดยพิจารณาความเสี่ยงจากการกระทำของสมาชิกแต่ละรายที่อาจก่อให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี

704.03 การเรียกทรัพย์สินสมทบเพิ่มเติม

ในกรณีที่มีความเสียหายเกิดขึ้นต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีและจำนวนทรัพย์สินที่สมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายมีจำนวนไม่เพียงพอต่อการรองรับความเสียหายที่อาจเกิดขึ้นได้ทั้งหมด สำนักหักบัญชีอาจเรียกให้สมาชิกวางทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายเพิ่มเติมเป็นจำนวนไม่เกิน 1 เท่าของมูลค่าปัจจุบันของทรัพย์สินสมทบแรกเข้ารวมกับทรัพย์สินสมทบรายเดือนของสมาชิกแต่ละราย โดยสมาชิกจะต้องวางทรัพย์สินเพิ่มเติมภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด หากสมาชิกไม่ดำเนินการภายในระยะเวลาดังกล่าวให้ถือว่าสมาชิกรายดังกล่าวผิดนัด

705 การบริหารจัดการ

705.01 การบริหารทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงในส่วนหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกและกองทุนทดแทนความเสียหาย

สำนักหักบัญชีหรือบุคคลที่สำนักหักบัญชีมอบหมายจะบริหารจัดการหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกและกองทุนทดแทนความเสียหายที่เป็นเงินสด โดยให้นำหลักเกณฑ์ว่าด้วยการบริหารหลักประกันมาใช้กับการบริหารหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกและกองทุนทดแทนความเสียหายโดยอนุโลม

ในกรณีที่สำนักหักบัญชีหรือบุคคลที่สำนักหักบัญชีมอบหมายบริหารจัดการหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกและกองทุนทดแทนความเสียหายและมีดอกผลเกิดขึ้น หากเป็นดอกผลที่เกิดขึ้นจากหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิก สำนักหักบัญชีจะคืนดอกผลดังกล่าวภายหลังจากหักค่าบริหารจัดการให้แก่สมาชิกตามวิธีและภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด แต่หากเป็นดอกผลที่เกิดจากทรัพย์สินที่สมทบในกองทุนทดแทนความเสียหาย สำนักหักบัญชีจะนำดอกผลดังกล่าวภายหลังจากหักค่าบริหารจัดการแล้วไปสะสมในกองทุนทดแทนความเสียหายทั้งจำนวนตามสัดส่วนที่สมาชิกแต่ละรายสมทบและรายงานให้สมาชิกทราบภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

705.02 การบริหารทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงในส่วนเงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชี

ในส่วนของตลาดหลักทรัพย์

ให้สำนักหักบัญชีหรือบุคคลที่สำนักหักบัญชีมอบหมายเป็นผู้ดูแลการบริหารเงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์ โดยให้นำหลักเกณฑ์ว่าด้วยการบริหารหลักประกันมาใช้กับการบริหารเงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์โดยอนุโลม

706 การใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

เพื่อให้การใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงเป็นไปตามข้อบังคับของสำนักหักบัญชี หรือทดแทนในกรณีที่สมาชิกผิดนัดชำระหนี้หรือมีความเสียหายที่เกิดจากการกระทำของสมาชิกในกิจการที่เกี่ยวกับการชำระหนี้ ให้สำนักหักบัญชีมีอำนาจใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง ได้ตามลำดับดังต่อไปนี้

(1) หลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี แล้วแต่กรณี

(2) ทรัพย์สินที่สมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายในส่วนของสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี

(3) เงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์ตามจำนวนที่สำนักหักบัญชีประกาศกำหนดเป็นส่วนที่หนึ่ง

(4) ทรัพย์สินที่สมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายในส่วนของสมาชิกรายอื่นที่ไม่ใช่รายที่ผิดนัดหรือรายที่ไม่ได้กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี แล้วแต่กรณี

(5) เงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์ส่วนที่เหลือภายหลังหักเงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์ส่วนที่หนึ่ง

(6) ทรัพย์สินสมทบเพิ่มเติมตามสัดส่วนที่สมาชิกแต่ละรายสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย

(7) เงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์

การใช้ทรัพย์สินตาม (4) และ (6) ให้เป็นไปตามสัดส่วนของทรัพย์สินที่สมาชิกสมทบเข้ากองทุน

การใช้เงินสมทบเข้ากองทุนตาม (3) ตามสัดส่วนที่สำนักหักบัญชีประกาศกำหนดนั้น สำนักหักบัญชีอาจประกาศเปลี่ยนแปลงสัดส่วนการใช้เงินสมทบดังกล่าวได้ตามที่เห็นสมควร

707 การส่งคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

707.01 การส่งคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงของสมาชิกรายที่ผิดนัด

สมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีมีหน้าที่ในการชำระคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงที่สำนักหักบัญชีได้ใช้ตามหลักเกณฑ์ 706

ในกรณีที่มีการใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง สำนักหักบัญชีอาจเรียกเก็บดอกเบี้ยจากการใช้ทรัพย์สินดังกล่าว โดยคำนวณตามอัตราสูงสุดตามกฎหมายว่าด้วยดอกเบี้ยเงินให้กู้ยืมของสถาบันการเงินนับแต่วันที่มีการใช้ทรัพย์สินดังกล่าวจนถึงวันที่ชำระคืน เว้นแต่สำนักหักบัญชีจะกำหนดอัตราดอกเบี้ยไว้เป็นอย่างอื่น

707.02 การจัดสรรทรัพย์สินกรณีสมาชิกรายที่ผิดนัดส่งคืนทรัพย์สินพร้อมดอกเบี้ยให้สำนักหักบัญชี

เมื่อสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีได้ชำระคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงตามจำนวนที่มีการใช้ทรัพย์สินพร้อมดอกเบี้ยแก่สำนักหักบัญชี ให้มีการจัดสรรทรัพย์สินดังกล่าวคืนตามลำดับดังต่อไปนี้

(1) เงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์

(2) ทรัพย์สินสมทบเพิ่มเติมตามสัดส่วนที่สมาชิกแต่ละรายสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย

ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า)

หมวด 700 ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

(3) เงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์ส่วนที่เหลือภายหลังหักเงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์ส่วนที่หนึ่ง

(4) ทรัพย์สินที่สมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายในส่วนของสมาชิกรายอื่นที่ไม่ใช่รายที่ผิดนัดหรือรายที่ไม่ได้กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี แล้วแต่กรณี

(5) เงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายจากตลาดหลักทรัพย์ตามจำนวนที่สำนักหักบัญชีประกาศกำหนดเป็นส่วนที่หนึ่ง

(6) ทรัพย์สินที่สทบกองทุนทดแทนความเสียหายในส่วนของสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี แล้วแต่กรณี

(7) หลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี

การจัดสรรทรัพย์สินคืนตาม (2) และ (4) ให้เป็นไปตามสัดส่วนที่ได้มีการนำทรัพย์สินดังกล่าวออกใช้ตามหลักเกณฑ์ 706

707.03 การเรียกค่าเสียหายหรือค่าปรับต่อสมาชิก

สำนักหักบัญชีอาจเรียกค่าเสียหายหรือค่าปรับจากการใช้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงจากสมาชิกรายที่ผิดนัดหรือรายที่กระทำให้เกิดความเสียหายต่อการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี ตามหลักเกณฑ์วิธีการ และเงื่อนไขที่สำนักหักบัญชีกำหนด

708 การคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคง

เมื่อสำนักหักบัญชีมีมติให้สมาชิกพ้นสมาชิกภาพ สำนักหักบัญชีจะคืนทรัพย์สินที่สมาชิกวางไว้เพื่อความมั่นคงของการชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี รวมทั้งผลประโยชน์ที่เกิดจากทรัพย์สินดังกล่าวในจำนวนที่เหลืออยู่ภายหลังหักหนี้รวมถึงค่าเสียหายและค่าปรับทั้งหมดที่สมาชิกค้างชำระต่อสำนักหักบัญชี ภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด

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