

FAQ

Securities Market

25 มิถุนายน 2564

FAQ

Gross Settlement	1
Trade Amendment, Trade Adjustment, Give-up/Take-up และ NVDR Adjustment Extension	3
ค่าความเสี่ยงในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ประจำวัน Early Warning (EWS)	6
เงินกองทุนทดแทนความเสียหายในระบบชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (Clearing Fund)	9
การซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด (Buy-in)	10
ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ (Securities default).....	11
การยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL).....	12

FAQ

Gross Settlement	1
Trade Amendment, Trade Adjustment, Give-up/Take-up และ NVDR Adjustment Extension	3
ค่าความเสี่ยงในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ประจำวัน Early Warning (EWS)	6
เงินกองทุนทดแทนความเสียหายในระบบชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (Clearing Fund)	9
การซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด (Buy-in)	10
ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ (Securities default).....	11
การยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL).....	12

FAQ: Gross Settlement

Q1: กรณีสมาชิกต้องการชำระราคาแบบ Gross Settlement กับ TCH สมาชิกต้องดำเนินการอย่างไร

Ans: (1) สมาชิกต้องตรวจสอบว่ารายการของสมาชิกเป็นไปตามเงื่อนไขการทำรายการ Gross Settlement

ดังต่อไปนี้หรือไม่

- เป็นรายการซื้อขายแบบ Trade report ที่มีมูลค่าตั้งแต่ 50 ล้านบาทขึ้นไป
- เป็นรายการซื้อขายของบัญชีลูกค้ำเท่านั้น

(2) เมื่อรายการของสมาชิกเป็นไปตามเงื่อนไข ให้ดำเนินการดังนี้:

หัวข้อ	Buyer	Seller
แจ้งผู้ที่เกี่ยวข้องเพื่อเตรียมความพร้อม	<p>ก่อนวันชำระราคา Gross Settlement 1 วันทำการ</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. สมาชิกแจ้ง Settlement Bank ของตน โดยระบุ จำนวนรายการ จำนวนเงิน และวันที่ชำระราคา Gross Settlement 2. สมาชิกแจ้ง TCH ผ่านทาง Email : SecuritiesClearingDepartment@set.or.th โดยระบุ จำนวนรายการ จำนวนเงิน และวันที่ชำระราคา Gross Settlement พร้อมทั้ง รายชื่อและเบอร์โทรศัพท์ของเจ้าหน้าที่ผู้ประสานงานของสมาชิก และเจ้าหน้าที่ธนาคารที่สมาชิกติดต่อ 	
สร้างรายการ และรับรองรายการ	<p><u>กรณีทำรายการล่วงหน้า</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • สร้างรายการและคู่กรณีรับรองรายการ ภายในเวลา 20.00 น. เพื่อชำระราคาวันทำการถัดไป <p><u>กรณีทำรายการ ณ วันชำระราคาแบบ Gross Settlement</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • รายการ Trade report ที่ยังไม่ถึงกำหนด Settlement Date (T และ T+1) : สามารถสร้างรายการและคู่กรณีรับรองรายการได้ภายในเวลา 14.00 น. เพื่อชำระราคาแล้วเสร็จภายใน 15.00 น. • รายการ Trade report ที่ถึงกำหนด Settlement Date (T+2) แล้ว : สามารถสร้างรายการและคู่กรณีรับรองรายการได้ภายในเวลา 10.00 น. เพื่อชำระราคาแล้วเสร็จภายใน 12.30 น. <p>หน้าจอที่เกี่ยวข้อง ได้แก่</p> <ul style="list-style-type: none"> - Screen No. 3103 [Securities Deal Amendment Request] - Screen No. 3111 [Securities Deal Amendment Approval] 	
ณ วันที่ชำระราคา Gross Settlement	<p>สมาชิกเตรียมเงินในบัญชี Settlement ของสมาชิก และ Email แจ้ง TCH เรื่องการดำรงเงินในบัญชีเพียงพอแล้ว หลังจากทำรายการบนระบบ SET CLEAR แล้วเสร็จ</p>	<p>สมาชิกเตรียมหุ้นในบัญชี Settlement (Client) ของสมาชิก และ Email แจ้ง TCH เรื่องการดำรงหุ้นในบัญชีเพียงพอแล้ว หลังจากทำรายการบนระบบ SET CLEAR แล้วเสร็จ</p>
<p>หลังจากนั้น TCH จะตรวจสอบจำนวนเงินและจำนวนหุ้น ก่อนที่จะอนุมัติรายการ และเมื่อรายการดำเนินการเสร็จเรียบร้อยแล้ว TCH จะส่ง Email เพื่อให้สมาชิกตรวจสอบข้อมูล</p>		

หัวข้อ	Buyer	Seller
ตรวจสอบผลการชำระ ราคา Gross Settlement	1. ตรวจสอบผลการทำรายการผ่านหน้าจอ Screen no. 3110 [Securities Gross Settlement Status] Step = Payment of securities Status = Completed 2. ตรวจสอบจำนวนหุ้นในบัญชีและยอดเงินในระบบธนาคาร	

(รายละเอียดเพิ่มเติม: คู่มือ Gross Settlement

ปรากฏใน SETPortal >> Directory Service >> SETCLEAR BUSINESS >> Securities)

Q2: กรณีสมาชิกทำรายการ Gross Settlement ในระบบ SET CLEAR และแจ้งมายัง TCH เรียบร้อยแล้ว สมาชิกสามารถยกเลิกการชำระราคาแบบ Gross Settlement เพื่อเปลี่ยนกลับเป็น Net Settlement ได้หรือไม่

Ans: สมาชิกขอยกเลิกรายการได้ในกรณีที่ TCH ยังไม่อนุมัติรายการ Gross Settlement เท่านั้น

Q3: กรณีสมาชิกทำรายการ Gross Settlement ที่ผู้ซื้อและผู้ขายอยู่ภายในสมาชิกเดียวกัน ไม่ต้องเตรียมเงินและหุ้นเพื่อ Settlement ได้หรือไม่

Ans: สมาชิกต้องเตรียมเงินและหุ้นให้พร้อม เนื่องจากรายการ Gross Settlement เป็นการชำระราคาแบบที่ละรายการ TCH จึงต้องตรวจสอบความเพียงพอของหุ้นและเงินพร้อมก่อนการชำระราคา

FAQ: Trade Amendment, Trade Adjustment, Give-up/Take-up และ NVDR Adjustment Extension

Q1: หากมีการส่งรายการซื้อขายไม่ถูกต้อง สามารถแก้ไขรายการซื้อขายที่ระบบ SET CLEAR ได้หรือไม่

Ans: ปัจจุบันสมาชิกสามารถแก้ไขรายการซื้อขายได้ โดย

- (1) Trade Amendment ใช้ในการแก้ไขเลขที่บัญชี (Account Code) และประเภทผู้ซื้อขาย (Investor type)
- (2) Trade Adjustment ใช้ในการแก้ไขประเภทของหลักทรัพย์ Local, NVDR และ Foreign

Q2: หากต้องการใช้งาน Trade Amendment และ Trade Adjustment มีกำหนดเวลาการทำรายการอย่างไร

Ans: เงื่อนไขของการทำรายการ และหน้าจอที่เกี่ยวข้อง มีดังนี้

หัวข้อ	เงื่อนไขการทำรายการ	หน้าจอระบบ SET CLEAR
Trade Amendment	<p><u>กรณีแก้ไขในวันที่ซื้อขาย (T) หรือวันที่ T+1</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • สามารถดำเนินการได้ภายใน 20.00 น. <p><u>กรณีแก้ไขในวันครบกำหนดการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (T+2)</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • สามารถดำเนินการได้ภายใน 11.30 น. 	<ul style="list-style-type: none"> • Screen no. 3158 [Securities Trade Amend Request] • Screen no. 3160 [Securities Trade Amend Approval]
Trade Adjustment	<p>(1) การแก้ไขหลักทรัพย์ประเภท Local/ NVDR เป็น Foreign หรือ Foreign เป็น Local (เฉพาะด้านซื้อ)</p> <p><u>กรณีแก้ไขในวันที่ซื้อขาย (T) หรือวันที่ T+1</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • สามารถดำเนินการได้ภายใน 20.00 น. <p><u>กรณีแก้ไขในวันครบกำหนดการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (T+2)</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • สามารถดำเนินการได้ภายใน 11.30 น. <p>(2) การแก้ไขหลักทรัพย์ประเภท NVDR เป็น Local หรือ Local เป็น NVDR</p> <p><u>กรณีแก้ไขในวันที่ซื้อขาย (T) หรือวันที่ T+1</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • สามารถดำเนินการได้ภายใน 20.00 น. <p><u>กรณีแก้ไขในวันครบกำหนดการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (T+2)</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • สามารถดำเนินการได้ภายใน 11.30 น. <p><u>กรณีแก้ไขรายการขายในวันครบกำหนดการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (T+2)</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • สามารถดำเนินการได้ภายใน 13.15 น. 	<ul style="list-style-type: none"> • Screen no. 3163 [Securities Trade Adjustment Request] • Screen no. 3164 [Securities Trade Adjustment Approval]

Q3: หากสมาชิกต้องการโอนรายการซื้อขายของลูกค้าไปให้สมาชิกรายอื่นทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนได้หรือไม่

Ans: สามารถทำได้ โดยใช้งาน Give-up/ Take-up โดยที่สมาชิกทั้งสองฝ่ายต้องมี Give-up / Take-up Agreement ก่อนทำรายการ และต้องเป็นการโอนของลูกค้าผู้รับผลประโยชน์ทอดสุดท้ายเป็นรายเดียวกัน

Q4: รูปแบบการทำรายการ Give-up/ Take-up เป็นอย่างไร

Ans: สมาชิกสามารถทำการโอนรายการซื้อขายได้ 2 แบบ คือ

(1) กำหนดให้โอนรายการในลักษณะ Auto Give-up/ Take-up ไว้ล่วงหน้า กล่าวคือ

- สมาชิกผู้โอน (Give-up member) : สามารถกำหนดการโอนโดยระบุสมาชิกผู้รับโอน เลขที่บัญชีผู้โอน และหลักทรัพย์ในระบบ SET CLEAR ไว้ล่วงหน้า เมื่อมีรายการซื้อขายของได้รายการซื้อขายตามเลขที่บัญชีที่กำหนดไว้ ระบบจะทำการโอนไปยังสมาชิกผู้รับโอนโดยอัตโนมัติ
- สมาชิกผู้รับโอน (Take-up member) : สามารถกำหนดรายการรับโอนโดยระบุสมาชิกผู้โอน เลขที่บัญชีผู้โอน เลขที่บัญชีผู้รับโอน ประเภทหลักทรัพย์ และหลักทรัพย์ในระบบ SET CLEAR ไว้ล่วงหน้า เมื่อมีรายการซื้อขายของผู้โอนตามข้อมูลกำหนดไว้ ระบบจะรับโอนรายการซื้อขายดังกล่าวโดยอัตโนมัติ

(2) สมาชิกผู้โอน หรือผู้รับโอน ทำรายการโอน/รับโอนรายการซื้อขายในลักษณะ Manual

Q5: เงื่อนไขและกำหนดเวลาการทำรายการ Give-up/ Take-up เป็นอย่างไร

Ans: เงื่อนไขการทำรายการ และหน้าจอที่เกี่ยวข้อง มีดังนี้

	Manually Give-up/ Take-up	Auto Give-up/ Take-up
เงื่อนไขการทำรายการ	สมาชิกผู้โอนและผู้รับโอนแจ้งรายละเอียด สมาชิกผู้โอน สมาชิกผู้รับโอน เลขที่บัญชีผู้โอน/รับโอน ชื่อหลักทรัพย์ และเหตุผลในการทำ Give-up/Take-up รวมทั้งยืนยันว่าผู้โอนและผู้รับโอนมีผู้รับผลประโยชน์ทอดสุดท้ายเป็นรายเดียวกัน พร้อมแนบสำเนา Give-up / Take-up Agreement มายัง TCH ล่วงหน้าอย่างน้อย 3 วันทำการ ผ่าน Email: SecuritiesClearingDepartment@set.or.th	
กำหนดเวลาการทำรายการ	สมาชิกผู้โอนและผู้รับโอนสามารถทำรายการได้โดยสมาชิกเอง กรณีโอนในวันที่ซื้อขาย (T) หรือวันที่ T+1 • สามารถดำเนินการได้ภายใน 20.00 น. กรณีโอนในวันครบกำหนดการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (T+2) สามารถดำเนินการได้ภายใน 11.30 น.	สมาชิกผู้โอนและผู้รับโอนกำหนดข้อมูล (Configuration) ที่เกี่ยวข้องกับการโอน และรับโอน ภายใน 17.00 น. พร้อมทั้งแจ้งให้ TCH พิจารณานอุมัติ
หน้าจอในระบบ SET CLEAR	• หน้าจอ 3204 [Securities Trade Give-up Request]	• หน้าจอ 3201 [Automatic Give-up Configuration]

	Manually Give-up/ Take-up	Auto Give-up/ Take-up
	<ul style="list-style-type: none"> • หน้าจอ. 3206 [Securities Give-up/Take-up Approval] • หน้าจอ 3208 [Securities Give-up/Take-up Listing] 	<ul style="list-style-type: none"> • หน้าจอ 3202 [Automatic Allocation/ Take-up Configuration]

(รายละเอียดเพิ่มเติม: คู่มือ Give-up /Take up

ปรากฏใน SETPortal >> Directory Service >> SETCLEAR BUSINESS >> Securities)

Q6: หากพบว่ารายการที่ Settlement ไปแล้ว เป็นการซื้อขายผิดประเภทหลักทรัพย์ สมาชิกสามารถแก้ไขได้อย่างไรบ้าง

Ans: สมาชิกสามารถแก้ไขประเภทหลักทรัพย์จาก Local เป็น NVDR หรือ NVDR เป็น Local ได้เท่านั้น โดยใช้งานที่ NVDR Adjustment Extension และเลือกรายการที่ Settlement ไปแล้ว โดยมีเงื่อนไขของการทำรายการ ดังนี้

งาน	เงื่อนไขการทำรายการ	หน้าจอระบบ SET CLEAR
NVDR Adjustment Extension	<ul style="list-style-type: none"> • ไม่มีการแก้ไขรายการก่อนการ Settlement • เป็นรายการซื้อขายย้อนหลังที่ไม่เกิน 3 เดือน • เป็นหลักทรัพย์ที่ไม่เคยใช้สิทธิปิดสมุดทะเบียนประเภทใดๆ มาก่อน • สามารถดำเนินการได้ภายใน 19.00 น. ของวันที่ทำรายการ • ต้องมีหุ้น Local หรือ NVDR พร้อมในบัญชี <p><u>กรณีต้องการแก้ไขจาก Local เป็น NVDR</u> เลือก Deal ซื้อ Local หรือ Deal ขาย NVDR</p> <p><u>กรณีต้องการแก้ไขจาก NVDR เป็น Local</u> เลือก Deal ซื้อ NVDR หรือ Deal ขาย Local</p>	<ul style="list-style-type: none"> • หน้าจอ 3165 [Securities NVDR Adjustment Extension Request] • หน้าจอ 3166 [Securities NVDR Adjustment Extension Approval]

FAQ : ค่าความเสี่ยงในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ประจำวัน Early Warning (EWS)

การ Monitor ค่าความเสี่ยง (EWS)

Q1: สมาชิกสามารถตรวจสอบค่าความเสี่ยง EWS เพื่อเตรียมหลักประกันที่อาจถูกเรียก หรือ หลักประกันส่วนเกินที่อาจถอนได้ ได้อย่างไร

Ans: สมาชิกสามารถตรวจสอบค่าความเสี่ยงได้จากระบบ SET CLEAR หน้าจอ 9966 [Securities Market Risk Collateral Call] ดังนี้

- รอบ Preliminary สามารถเลือกได้จากรอบเวลา 9:45, 10:45, 12:45, 13:45, 14:45, 15:45, 16:45 และ 17:10
 - แสดงข้อมูลค่าความเสี่ยงที่คาดว่าจะถูกเรียกวงหลักประกัน ที่คอลลิมน์ Potential Call
 - คำนวณหลักประกันส่วนเกินที่คาดว่าจะขอถอนคืนได้ จากข้อมูลในคอลลิมน์ Collateral Submitted หักด้วย Collateral Requirement
- รอบ Official สามารถเลือกได้จากรอบเวลา 11:45 และ EOD
 - รอบ 11.45
 - (1) แสดงข้อมูลหลักประกันที่คาดว่าจะถูกเรียกวงหลักประกัน โดยตรวจสอบได้ที่คอลลิมน์ Collateral Call
 - (2) คำนวณหลักประกันส่วนเกินที่สามารถขอถอนคืนในรอบที่ 2 ได้จากข้อมูลในคอลลิมน์ Collateral Submitted หักด้วย Collateral Requirement
 - รอบ EOD
 - (1) แสดงข้อมูลค่าความเสี่ยงที่ถูกเรียกวงหลักประกันที่ในวันทำการถัดไป โดยตรวจสอบได้ในคอลลิมน์ Collateral Call
 - (2) คำนวณหลักประกันส่วนเกินที่สามารถขอถอนคืนได้ ในวันทำการถัดไป ได้จากข้อมูลในคอลลิมน์ Collateral Submitted หักด้วย Collateral Requirement

การจำลอง (Simulation) มูลค่าหลักประกันที่ต้องวาง / หลักประกันส่วนเกินที่ถอนได้

Q1: สมาชิกสามารถประมาณมูลค่าหลักประกันที่อาจถูกเรียก หรือหลักประกันส่วนเกิน สำหรับค่าความเสี่ยง EWS จากรูกรกรมซื้อขายหลักทรัพย์ที่คาดว่าจะเกิดขึ้นได้อย่างไร

Ans: สมาชิกสามารถทำการ Simulation ค่าความเสี่ยง EWS โดย

- เพิ่ม รายการซื้อขายหลักทรัพย์จากเดิมที่มีอยู่ (รอชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์) เพื่อประมาณมูลค่าหลักประกันที่ต้องวาง
 - ลด รายการซื้อขายหลักทรัพย์จากเดิมที่มีอยู่ (รอชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์) เพื่อประมาณหลักประกันส่วนเกินที่อาจถอนได้
- หน้าจอที่เกี่ยวข้อง ได้แก่
- หน้าจอ 9943 [Input Transactions for EWS Simulation]
- หน้าจอ 9944 [EWS Simulation Result]

การวางและถอนหลักประกันค่าความเสี่ยง (EWS)

Q1: การวางหลักประกันเป็นหุ้นกับวางหลักประกันเป็นหุ้นรอส่งมอบเพื่อเป็นหลักประกันค่าความเสี่ยง EWS แตกต่างกันอย่างไรร

Ans: มีความแตกต่างกัน ดังนี้

	หลักประกันเป็น <u>หุ้น</u>	หลักประกันเป็น <u>หุ้นรอส่งมอบ</u>
Haircut	มี Haircut	ไม่มี Haircut
จำนวน Limit	จำนวนร่วมกับสมาชิกรายอื่น	ไม่จำนวนร่วมกับสมาชิกรายอื่น
การกำหนด Limit หุ้นที่ฝากเป็นหลักประกัน	ตามสัดส่วนของประเภทหลักทรัพย์ (Concentration Limit) ที่ TCH ประกาศ	จำนวนหุ้นที่ฝากต้องไม่เกินภาระขายสุทธิที่จะครบกำหนดในวัน Settlement date หมายเหตุ : จำนวนจากรายการซื้อขายหุ้นครอบคลุม -Trade/ Deal Amendment/ Adjustment, Give up/ Take up แต่ไม่รวมรายการ Settlement Delegation และภาระอื่นๆ เช่น Return SBL with SettlementและPending Settlement)
การหักโอนหุ้นที่วางเป็นหลักประกันไป Settlement	- ไม่สามารถทำได้ สมาชิกต้องทำรายการถอนหลักประกันในระบบ SET CLAR โดย TCH จะโอนหุ้นคืนที่บัญชี Settlement Proprietary เท่านั้น	กรณีถึงวัน Settlement Date ตามที่ฝากหุ้นนั้น ระบบงานของ TCH จะโอนหุ้นคืนอัตโนมัติไปยังบัญชี Settlement (Proprietary/Client) ที่ระบุไว้ตอนฝากเพื่อใช้ในการ Settlement รอบปกติ โดยสมาชิกไม่ต้องทำรายการขอถอนหุ้นหลักประกันคืน

Q2: หากสมาชิกต้องการวางหลักประกันค่าความเสี่ยง EWS เป็นหุ้นรอส่งมอบ จะต้องดำเนินการอย่างไร

Ans: เมื่อสมาชิกตรวจสอบแล้วว่าหุ้นดังกล่าวสามารถวางเป็นหลักประกันประเภทหุ้นรอส่งมอบได้ ให้ดำรงหุ้นที่ต้องการวางเป็นหลักประกันที่บัญชี Settlement Proprietary ของสมาชิกในระบบงาน CSD หลังจากนั้น จึงทำรายการในระบบ SET CLEAR หน้าจอ 5225 [Margin for Settlement Collateral Deposit]

Q3: สมาชิกต้องการวางหลักประกันค่าความเสี่ยง EWS เป็นหุ้นที่ไม่มีภาระส่งมอบจะต้องดำเนินการอย่างไร

Ans: สมาชิกดำเนินการ ดังนี้

1. ตรวจสอบ Limit ของหุ้นที่ต้องการฝากจากระบบ SET CLEAR หน้าจอ 5328 [Collateral Instrument - Limit Status for Margin Coverage]
2. ดำรงหุ้นที่ต้องการวางเป็นหลักประกันที่บัญชี Settlement Proprietary ของสมาชิกในระบบงาน CSD
3. ทำรายการฝากหุ้นในระบบ SET CLEAR หน้าจอ [5208] Collateral Deposit

Q4: หากสมาชิกต้องการถอนหุ้นที่วางเป็นหลักประกันเพื่อนำไปใช้ในการส่งมอบหลักทรัพย์ จะต้องทำอย่างไร

Ans: กรณีสมาชิกยังคงมีค่าความเสี่ยง สมาชิกต้องแลกเปลี่ยนหลักประกัน โดยการนำทรัพย์สินประเภทอื่น ได้แก่ เงินสดสกุลเงินบาท หุ้นสามัญอื่น พันธบัตรรัฐบาลไทยและพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย มาวางโดยมูลค่าของทรัพย์สินใหม่หลังหักค่าความเสี่ยง (Haircut rate) ต้องไม่ต่ำกว่ามูลค่าของหุ้นหลังหักค่าความเสี่ยง (Haircut rate) ที่จะขออนุญาตออกไป จึงจะสามารถถอนหุ้นออกได้ และจะต้องดำเนินการดังนี้

- (1) การแลกเปลี่ยนหุ้น: สมาชิกทำรายการแลกเปลี่ยนหุ้นได้จากระบบ SETCLEAR ที่หน้าจอ Screen no. 5214 [Collateral Exchange] โดยระบุชื่อหุ้นและจำนวนหุ้นที่ต้องการฝากและหุ้นที่ต้องการถอนออก
- (2) นำเงินมาแลกหุ้น: สมาชิกทำรายการฝากเงินสดสกุลเงินบาทเข้าบัญชีของ TCH ตาม Settlement Bank ที่สมาชิกใช้บริการ และทำรายการฝากเงินผ่านระบบ SETCLEAR ที่หน้าจอ 5201 [Cash deposit] และแจ้ง TCH อนุมัติรายการฝาก จากนั้นจึงทำรายการถอนหุ้นที่วางเป็นหลักประกัน ที่หน้าจอ. 5210 [Collateral Withdrawal]

กรณีสมาชิกไม่มีค่าความเสี่ยงแล้ว สามารถขออนุญาตหลักประกันส่วนเกินได้จากระบบ SET CLEAR หน้าจอ 5210 [Collateral Withdrawal]

รอบเวลาการวางและถอนหลักประกันเป็นไปตามประกาศ TCH เรื่องกำหนดระยะเวลาการให้บริการงานของสำนักหักบัญชี : <https://www.set.or.th/rulebook/#/regulation/content/26325>

(รายละเอียดเพิ่มเติม: คู่มือ การดำเนินการที่เกี่ยวข้องกับ EWS_V2
ปรากฏใน SETPortal >> Directory Service >> SETCLEAR BUSINESS >> Securities)

FAQ: เงินกองทุนทดแทนความเสียหายในระบบชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (Clearing Fund)

Q1: เงินสมทบรายเดือนกองทุนทดแทนความเสียหายในระบบชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (Clearing Fund) ของสมาชิกคำนวณมาจากอะไร

Ans: เงินสมทบรายเดือน Clearing Fund ของสมาชิกคำนวณโดยใช้หลักเกณฑ์

เงินสมทบรายเดือน = อัตราเงินสมทบรายเดือน * มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์สุทธิ (Net Trading) รายเดือน

- อัตราเงินสมทบรายเดือน จะพิจารณาจากมูลค่าความเสียหายรวมจากการเปลี่ยนแปลงด้านราคาตลาดของหลักทรัพย์ (Mark to-Market Exposure) และมูลค่าความเสียหายรวมสูงสุดที่อาจจะเกิดขึ้น ณ ระดับความเชื่อมั่นที่กำหนด (Value at Risk) ของสมาชิกในไตรมาสที่ผ่านมา
- เงินสมทบรายเดือนขั้นต่ำไม่น้อยกว่า 1,000 บาท (ไม่ว่าสมาชิกจะมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์สุทธิในเดือนที่คำนวณเงินสมทบนั้นหรือไม่)
- สมาชิกสามารถเรียกดูเงินสมทบรายเดือนและอัตราเงินสมทบรายเดือน Clearing Fund ได้จากระบบ SET CLEAR หน้าจอ 9709 [Clearing Fund Contribution Amount]

Q2: สมาชิกสามารถเรียกดูเงินสมทบกองทุนฯ และผลประโยชน์เงินกองทุนฯ (Clearing Fund) ได้จากที่ใด

Ans: สมาชิกสามารถดูข้อมูลเงินกองทุน Clearing Fund ได้จากระบบ SET CLEAR

- หน้าจอ 5313 [Asset Holdings] เพื่อเรียกดูเงินกองทุน Clearing Fund สะสมของสมาชิก
 - Settlement Domain : ระบุ Securities Domain
 - Coverage : ระบุ Clearing Fund
- หน้าจอ 5516 [Monthly SD and CF Report] เพื่อเรียกดูผลประโยชน์ Clearing Fund รายเดือน
 - Settlement Domain : ระบุ Securities Domain
 - Month : ระบุ เดือน ที่ต้องการเรียกดูผลประโยชน์
- หน้าจอ 5519 [Semi-Annual SD and CF Report] เพื่อดูผลประโยชน์ Clearing Fund ราย 6 เดือน
 - Settlement Domain : ระบุ Securities Domain
 - Year : ระบุ ปี ที่ต้องการเรียกดูผลประโยชน์
 - Semi Annual Type : ระบุ First Half – Year หรือ Second Half - Year

FAQ: การซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด (Buy-in)

Q1: หากสมาชิกต้องการเพิ่มหรือลดเจ้าหน้าที่ในการรับข้อมูลการ Buy-in จะต้องทำอย่างไร

Ans: สมาชิกสามารถเพิ่มหรือลด Email เจ้าหน้าที่ได้โดยสมาชิกเองที่ระบบ SET CLEAR หน้าจอ 1133 [Additional Email by Participant] โดยระบุ Market Type = Securities

Q2: กรณีสมาชิกมีการผิดนัดหุ้นและต้องการทราบว่ามีการเสนอขายรายการ Buy-in หรือไม่สามารถตรวจสอบจากที่ใด

Ans: สมาชิกตรวจสอบว่ารายการที่ผิดนัด มีสมาชิกเสนอขาย Buy-in ได้ที่ระบบ SET CLEAR หน้าจอ 4753 [Buy-In List] ที่คอลัมภ์ Offer Quantity

Q3: กรณีที่สมาชิกประสงค์ขายหลักทรัพย์ Buy-in กับ TCH จะต้องเข้ามาทำรายการ Offer ที่ระบบ SET CLEAR ที่หน้าจอใดและต้องใช้ราคาใดในการส่งคำสั่งขาย

Ans: สมาชิกสามารถขายหลักทรัพย์ Buy-in ต้องเป็นสมาชิกที่ทำสัญญา Buy-in กับ TCH เท่านั้น โดยมีขั้นตอนการทำรายการ ดังนี้

1. ทำรายการ Offer Buy-in ที่ระบบ SET CLEAR หน้าจอ 4754 [Buy-in Offer-Request] และหน้าจอ 4755 [Buy-in Offer-Approve]
2. เมื่อสมาชิกได้รับยืนยันรายการขายจากสำนักหักบัญชีที่เวลา 11.30 น.แล้ว ให้สมาชิกส่งคำสั่งซื้อขายที่ระบบซื้อขายภายในเวลา 11.30 – 12.30 น. ของวันที่ทำรายการ โดยใช้ราคาหน้าจอ 4757 [Buy-In Result] เลือกรอบ Preliminary

ราคา Buy-in เป็นไปตามประกาศของสำนักหักบัญชี เรื่อง การซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด (Buy-in) https://www.set.or.th/tch/th/equity/rules/Buyin_T2_151062_TH.pdf

Q4: การชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์รายการ Buy-in แยกต่างหากกับการชำระราคาและส่งมอบปกติหรือไม่

Ans: การชำระราคารายการ Buy-in จะรวมกับการชำระราคาปกติโดย ณ วันที่ Buy-in สมาชิกต้องส่งมอบหุ้นสำหรับรายการ Buy-in เวลา 13.25 น. และมีกำหนดเวลาชำระราคาที่ 14.00 น.

FAQ: ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ (Securities Default)

Q1: สมาชิกสามารถตรวจสอบรายการผิดนัดหลักทรัพย์ที่ระบบ SET CLEAR ที่หน้าจอใด เวลาใด

Ans: สมาชิกสามารถตรวจสอบได้ที่ระบบ SET CLEAR หน้าจอ 4853 [Securities Default Position] เวลาประมาณ 13.40 น. สำหรับผล Settlement รอบ 1 และประมาณ 15.20 น. สำหรับผลการ Settlement รอบ 2

Q2: สมาชิกสามารถตรวจสอบรายการ Pending Receive ในระบบ SET CLEAR ที่หน้าจอใด เวลาใด

Ans: สมาชิกสามารถตรวจสอบได้ที่ระบบ SET CLEAR หน้าจอ 4862 [Securities Pending Receiving Position] เวลาประมาณ 13.40 น. สำหรับผล Settlement รอบ 1 และประมาณ 15.20 น. สำหรับผลการ Settlement รอบ 2

Q3: สมาชิกสามารถตรวจสอบค่าปรับผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ ในระบบ SET CLEAR ที่หน้าจอใด

Ans: สมาชิกตรวจสอบที่หน้าจอ 4858 [Securities Default Penalty Detail] และ 4857 [Securities Default Penalty]

Q4: ผู้ผิดนัดทำรายการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัดในระบบ SET CLEAR ที่หน้าจอใด

Ans: สมาชิกทำรายการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด ที่ระบบ SET CLEAR
-หน้าจอ 4855 [Return Securities Defaulted – Request]
-หน้าจอ 4856 [Return Securities Defaulted – Approve]

(รายละเอียดเพิ่มเติม: คู่มือ ดำเนินการเกี่ยวกับการผิดนัดส่งมอบ
ปรากฏใน SETPortal >> Directory Service >> SETCLEAR BUSINESS >> Securities)

Q5: สมาชิกผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ สามารถตรวจสอบ Cash Settlement ในระบบ SET CLEAR ที่หน้าจอใด

Ans: สมาชิกตรวจสอบที่ระบบ SET CLEAR หน้าจอ 4854 [Securities Default Ledger]

Q6: สมาชิกผู้รับหลักทรัพย์ สามารถตรวจสอบ Cash Settlement ในระบบ SET CLEAR ที่หน้าจอใด

Ans: สมาชิกตรวจสอบที่ระบบ SET CLEAR หน้าจอ 4866 [Reconcile Pending for Pending Receive Side]

FAQ: การยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL)

Q1: สมาชิกสามารถตรวจสอบรายการ SBL ที่ระบบ SET CLEAR ที่หน้าจอใด เวลาใด

Ans: สมาชิกสามารถตรวจสอบรายการ SBL ได้ที่ระบบ SET CLEAR หน้าจอ 4655 [Borrower Position Management] Settlement รอบ 1 เวลาประมาณ 13.40 น. และรอบ EOD เวลาประมาณ 19.00 น.

Q2: สมาชิกสามารถตรวจสอบค่าธรรมเนียมจากรายการ SBL ในระบบ SET CLEAR ที่หน้าจอใด

Ans: สมาชิกตรวจสอบได้ที่ระบบ SET CLEAR หน้าจอ 4514 [SBL Rental Fee]

Q3: สมาชิกทำรายการส่งมอบหลักทรัพย์สำหรับรายการ SBL ในระบบ SET CLEAR ที่หน้าจอใด

Ans: สมาชิกสามารถทำรายการส่งมอบหลักทรัพย์ของรายการ SBL ที่ระบบ SET CLEAR ได้ที่

-หน้าจอ 4659 [Return SBL Request]

-หน้าจอ 4660 [Return SBL Approve]

(รายละเอียดเพิ่มเติม: คู่มือ ดำเนินการเกี่ยวกับการผัดนัดส่งมอบ

ปรากฏใน SETPortal >> Directory Service >> SETCLEAR BUSINESS >> Securities)