

FAQ

Securities Market

23 มกราคม 2569

สารบัญ

FAQ: Gross Settlement.....	3
FAQ: Trade Amendment, Trade Adjustment, Give-up/Take-up และ NVDR Adjustment Extension	5
FAQ: ค่าความเสี่ยงในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ประจำวัน Early Warning (EWS)	8
FAQ: เงินกองทุนทดแทนความเสียหายในระบบชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (Clearing Fund).....	11
FAQ: การซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด (Buy-in)	13
FAQ: ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ (Securities Default)	14
FAQ: การยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL)	15

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"> สมาชิกแจ้ง Settlement Bank ของตน โดยระบุ จำนวนรายการ จำนวนเงิน และวันที่ชำระราคา Gross Settlement สมาชิกแจ้ง TCH ผ่านทาง Email: SecuritiesClearingDepartment@set.or.th โดยระบุ จำนวนรายการ จำนวนเงิน และวันที่ชำระราคา Gross Settlement พร้อมทั้ง รายชื่อและเบอร์โทรศัพท์ของเจ้าหน้าที่ผู้ประสานงานของสมาชิก และเจ้าหน้าที่ธนาคารที่สมาชิกติดต่อ ทั้งนี้ หากสมาชิกต้องการนำหลักประกัน EWS ประเภทเงินสด, หุ้น (Coverage : Margin) หรือ หุ้รอส่งมอบ (Coverage : Margin for Settlement) ที่วางไว้ มาใช้ในการชำระราคา Gross Settlement ต้องแจ้งให้ TCH ทราบเบื้องต้น 	
สร้างรายการ และรับรองรายการ	<p><u>กรณีทำรายการล่วงหน้า</u></p> <ul style="list-style-type: none"> สร้างรายการและคู่กรณีรับรองรายการ โดยระบุวันที่ต้องการ Settlement แบบ Gross (ระบุได้ไม่เกิน T+2) ซึ่งสามารถดำเนินการได้ภายในเวลา 20:00 น. <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>หน้าจอระบบ SET CLEAR ที่เกี่ยวข้อง 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	สมาชิกเตรียมเงินในบัญชี Settlement ของสมาชิก และ Email แจ้ง TCH เรื่องการดำรงเงินในบัญชีเพียงพอแล้ว พร้อม	สมาชิกเตรียมหุ้นในบัญชี Settlement (Client) ของสมาชิก และ Email แจ้ง TCH เรื่องการดำรงหุ้นในบัญชีเพียงพอแล้ว พร้อม

หัวข้อ	Buyer	Seller
	หลักฐานประกอบ หลังจากทำรายการบนระบบ SET CLEAR แล้วเสร็จ	หลักฐานประกอบ หลังจากทำรายการบนระบบ SET CLEAR แล้วเสร็จ
	<p>ทั้งนี้ หากสมาชิกต้องการนำหลักประกัน EWS ประเภทเงินสด, หุ้น (Coverage : Margin) หรือ หุ้นรอส่งมอบ (Coverage : Margin for Settlement) ที่วางไว้ มาใช้ในการชำระราคา Gross Settlement ต้องนำส่งแบบฟอร์มแจ้งความประสงค์นำหลักประกัน EWS ไปชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แบบ Gross Settlement (โดยระบุประเภท และจำนวนของหลักประกัน EWS ที่ต้องการนำไปใช้) มายัง TCH ผ่านทาง Email</p> <p>หลังจากนั้น TCH จะตรวจสอบจำนวนเงินและจำนวนหุ้น ก่อนที่จะอนุมัติรายการ และเมื่อรายการดำเนินการเสร็จเรียบร้อยแล้ว TCH จะส่ง Email เพื่อให้สมาชิกตรวจสอบข้อมูล</p>	
ตรวจสอบผลการชำระราคา Gross Settlement	<p>1. ตรวจสอบผลการทำรายการผ่านหน้าจอรระบบ SET CLEAR Screen no: 3110 [Securities Gross Settlement Status]</p> <p>Step = Payment of securities</p> <p>Status = Completed</p> <p>2. ตรวจสอบจำนวนหุ้นในบัญชี ระบบ CSD และยอดเงินในระบบธนาคาร</p>	

(รายละเอียดเพิ่มเติม: คู่มือ Gross Settlement

ปรากฏใน SET Portal >> Directory Service >> SETCLEAR BUSINESS - Securities >> Broker & Sub-Broker >> Meeting Material)

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 จึงต้องตรวจสอบความเพียงพอของหุ้นและเงินก่อนการชำระราคา

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 (Clearing Account) ประเภทบัญชีฝากหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหรือรับมอบหลักทรัพย์ (Settlement Account) 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> - สามารถดำเนินการได้ภายใน 20:00 น.</p> <p><u>กรณีแก้ไขในวันครบกำหนดการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (T+2)</u> - สามารถดำเนินการได้ภายใน 11:30 น.</p>	<p>- Screen no: 3158 [Securities Trade Amend Request]</p> <p>- Screen no: 3160 [Securities Trade Amend Approval]</p>
Trade Adjustment	<p>(1) การแก้ไขหลักทรัพย์ประเภท Local/ NVDR เป็น Foreign หรือ Foreign เป็น Local (เฉพาะด้านซื้อ) <u>กรณีแก้ไขในวันที่ซื้อขาย (T) หรือวันที่ T+1</u> - สามารถดำเนินการได้ภายใน 20:00 น.</p> <p><u>กรณีแก้ไขในวันครบกำหนดการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (T+2)</u> - สามารถดำเนินการได้ภายใน 11:30 น.</p> <p>(2) การแก้ไขหลักทรัพย์ประเภท NVDR เป็น Local หรือ Local เป็น NVDR <u>กรณีแก้ไขในวันที่ซื้อขาย (T) หรือวันที่ T+1</u> - สามารถดำเนินการได้ภายใน 20:00 น.</p> <p><u>กรณีแก้ไขในวันครบกำหนดการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (T+2) สำหรับรายการซื้อ</u> - สามารถดำเนินการได้ภายใน 11:30 น.</p> <p><u>กรณีแก้ไขในวันครบกำหนดการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (T+2) สำหรับรายการขาย</u> - สามารถดำเนินการได้ภายใน 13:15 น.</p>	<p>- Screen no: 3163 [Securities Trade Adjustment Request]</p> <p>- Screen no: 3164 [Securities Trade Adjustment Approval]</p>

Q3: หากสมาชิกต้องการโอนรายการซื้อขายของลูกค้า ไปให้สมาชิกรายอื่นทำการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนได้หรือไม่

Ans: สามารถทำได้ โดยใช้งาน Give-up /Take-up โดยที่สมาชิกทั้งสองฝ่ายต้องมี Give-up /Take-up Agreement ก่อนทำการโอน 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):** สามารถกำหนดการโอนโดยระบุเลขที่บัญชีผู้โอน สมาชิกผู้รับโอน และหลักทรัพย์ในระบบ SET CLEAR ไว้ล่วงหน้า เมื่อมีรายการซื้อขายของเลขที่บัญชีที่กำหนดไว้ ระบบจะทำการโอนรายการดังกล่าวไปยังสมาชิกผู้รับโอนโดยอัตโนมัติ
- **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/ผู้รับโอน เลขที่บัญชีผู้โอน/ผู้รับโอน 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 <u>กรณีโอนในวันที่ซื้อขาย (T) หรือวันที่ T+1</u> - สามารถดำเนินการได้ภายใน 20:00 น. <u>กรณีโอนในวันครบกำหนดการชำระราคา และส่งมอบหลักทรัพย์ (T+2)</u> - สามารถดำเนินการได้ภายใน 11:30 น.	สมาชิกผู้โอนและผู้รับโอนกำหนดข้อมูล (Configuration) ที่เกี่ยวข้องกับการโอน และรับโอน ภายใน 17:00 น. พร้อมทั้งแจ้งให้ TCH พิจารณานุมัติ
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] - หน้าจอ 3208 [Securities Give-up/Take-up Listing]

(รายละเอียดเพิ่มเติม: คู่มือ Give-up /Take up

ปรากฏใน SET Portal >> Directory Service >> SETCLEAR BUSINESS - Securities >> Broker & Sub-Broker >> Meeting Material)

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 หรือหลักประกันส่วนเกินที่อาจถอนได้ ได้อย่างไร

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

- รอบ Preliminary สามารถเลือกได้จากรอบเวลา 6:45, 7:55, 8:55, 9:55, 10:55, 12:55, 13:55, 14:55, 15:55 และ 17:10
 - แสดงข้อมูลค่าความเสี่ยงที่คาดว่าจะถูกเรียกวงหลักประกัน ที่คอลลิแมร์ Potential Call
 - คำนวณหลักประกันส่วนเกินที่คาดว่าจะขอถอนคืนได้ จากข้อมูลในคอลลิแมร์ Collateral Submitted หักด้วย Collateral Requirement
- รอบ Official สามารถเลือกได้จากรอบเวลา 11:55 และ EOD
 - รอบ 11:55
 - แสดงข้อมูลหลักประกันที่คาดว่าจะถูกเรียกวงหลักประกัน โดยตรวจสอบได้ที่คอลลิแมร์ Collateral Call
 - คำนวณหลักประกันส่วนเกินที่สามารถขอถอนคืนในรอบที่ 2 ได้ จากข้อมูลในคอลลิแมร์ Collateral Submitted หักด้วย Collateral Requirement
 - รอบ EOD
 - แสดงข้อมูลค่าความเสี่ยงที่ถูกเรียกวงหลักประกันที่ในวันทำการถัดไป โดยตรวจสอบได้ในคอลลิแมร์ Collateral Call
 - คำนวณหลักประกันส่วนเกินที่สามารถขอถอนคืนได้ ในวันทำการถัดไป ได้จากข้อมูลในคอลลิแมร์ Collateral Submitted หักด้วย Collateral Requirement

การจำลอง (Simulation) มูลค่าหลักประกันที่ต้องวาง / หลักประกันส่วนเกินที่ถอนได้

Q1: สมาชิกสามารถประมาณมูลค่าหลักประกันที่อาจถูกเรียก หรือหลักประกันส่วนเกิน สำหรับค่าความเสี่ยง EWS จากธุรกรรมซื้อขายหลักทรัพย์ที่คาดว่าจะเกิดขึ้นได้อย่างไร

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

	หลักประกันเป็นหุ้น	หลักประกันเป็นหุ้นรอส่งมอบ
Haircut	มี Haircut	ไม่มี Haircut
จำนวน Limit	จำนวนร่วมกับสมาชิกรายอื่น	จำนวนเฉพาะสมาชิกตัวเองเท่านั้น
การกำหนด Limit หุ้นที่ฝากเป็น หลักประกัน	ตามสัดส่วนของประเภท หลักทรัพย์ (Concentration Limit) ที่ TCH ประกาศ	จำนวนหุ้นที่ฝากต้องไม่เกินภาระขายสุทธิที่ จะครบกำหนดในวัน Settlement date หมายเหตุ : จำนวนจากรายการซื้อขายหุ้น คร อ บ ค ลุ ม Trade Amendment, Deal Amendment, Trade Adjustment, Give up- Take up แต่ไม่รวมรายการ Settlement Delegation และภาระอื่นๆ เช่น Return SBL with Settlement และ Pending Settlement)
การหักโอนหุ้นที่วาง เป็นหลักประกัน ไป Settlement	ไม่สามารถทำได้ สมาชิกต้องทำ รายการถอนหลักประกันใน ระบบ SET CLEAR โดย TCH จะโอนหุ้นคืนที่บัญชี Settlement Proprietary เท่านั้น	กรณีถึงวัน Settlement Date ตามที่ฝากหุ้น นั้น ระบบงานของ TCH จะโอนหุ้นคืน อัตโนมัติไปยังบัญชี Settlement (Proprietary/Client) ที่ระบุไว้ตอนฝาก เพื่อ ใช้ในการ Settlement รอบปกติ โดยสมาชิก ไม่ต้องทำรายการขอถอนหุ้นหลักประกันคืน

Q2: หากสมาชิกต้องการวางหลักประกันค่าความเสี่ยง EWS เป็นหุ้นรอส่งมอบ จะต้องดำเนินการอย่างไร

Ans: เมื่อสมาชิกตรวจสอบแล้วว่าหุ้นดังกล่าวสามารถวางเป็นหลักประกันประเภทหุ้นรอส่งมอบได้ ให้ดำรงหุ้น
ที่ต้องการวางเป็นหลักประกันที่บัญชี Settlement Proprietary ของสมาชิกในระบบงาน CSD หลังจากนั้น
จึงทำรายการบนระบบ SET CLEAR หน้าจอ 5229 [Margin for Settlement Collateral Deposit]
เมื่อสมาชิก Approve รายการที่หน้าจอ 5225 [Margin for Settlement Collateral Deposit Approval]
เรียบร้อยแล้ว ระบบจะทำการโอนหุ้นออกจากบัญชี Settlement Proprietary ของสมาชิกเข้าบัญชีของ
TCH โดยอัตโนมัติ

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

4. เมื่อสมาชิก Approve รายการเรียบร้อยแล้ว ระบบจะทำการโอนหุ้นออกจากบัญชี Settlement Proprietary ของสมาชิกเข้าบัญชีของ TCH โดยอัตโนมัติ

Q4: หากสมาชิกต้องการถอนหุ้นที่วางเป็นหลักประกัน เพื่อนำไปใช้ในการส่งมอบหลักทรัพย์ จะต้องทำอย่างไร

Ans: กรณีสมาชิกยังคงมีค่าความเสี่ยง สมาชิกต้องแลกเปลี่ยนหลักประกัน โดยการนำทรัพย์สินประเภทอื่น ได้แก่ เงินสดสกุลเงินบาท หุ้นสามัญอื่น พันธบัตรรัฐบาลไทยและพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย มาวางแทน โดยมูลค่าของทรัพย์สินใหม่หลังหักค่าความเสี่ยง (Haircut rate) ต้องไม่ต่ำกว่ามูลค่าของหุ้นหลังหักค่าความเสี่ยง (Haircut rate) ที่จะขอถอนออกไป จึงจะสามารถถอนหุ้นออกได้ โดยจะต้องดำเนินการ ดังนี้

- (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 สามารถขอถอนหลักประกันส่วนเกินได้จากระบบ SET CLEAR หน้าจอ 5210 [Collateral Withdrawal]

รอบเวลาการวางและถอนหลักประกันเป็นไปตามที่ระบุไว้ในเว็บไซต์ เรื่องตารางเวลาปฏิบัติงาน
<https://www.set.or.th/th/tch/services/equities-bond/services>

(รายละเอียดเพิ่มเติม: คู่มือ การดำเนินการที่เกี่ยวข้องกับ EWS_20260119

ปรากฏใน SET Portal >> Directory Service >> SETCLEAR BUSINESS - Securities >> Broker & Sub-Broker >> Meeting Material)

FAQ: เงินกองทุนทดแทนความเสียหายในระบบชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (Clearing Fund)

Q1: มูลค่าเงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย (Clearing Fund Contribution Amount) คำนวณมาจากอะไร?

Ans: มูลค่าเงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายของสมาชิกแต่ละรายประเมินจากค่าความเสี่ยงจากการทำธุรกรรมของสมาชิกเอง (Risk Based) เทียบกับมูลค่าแหล่งเงินทุนในส่วนของสมาชิกเอง¹ ทั้งนี้หากประเมินแล้วพบว่า สมาชิกรายใดมีค่าความเสี่ยงสูงเกินกว่ามูลค่าแหล่งเงินทุนของสมาชิกเอง สมาชิกรายนั้นจะต้องสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย โดยมีมูลค่าเงินสมทบขั้นต่ำไม่น้อยกว่า 1,000 บาท แต่หากสมาชิกรายใดมีค่าความเสี่ยงไม่เกินกว่ามูลค่าแหล่งเงินทุนของสมาชิกเอง สมาชิกรายนั้นไม่ต้องสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย ทั้งนี้ TCH จะประเมินเงินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหาย (Clearing Fund Contribution) เป็นประจำทุกเดือน โดยปัจจัยที่ใช้พิจารณาความเสี่ยงของสมาชิกคือมูลค่าความเสียหายรวมจากการเปลี่ยนแปลงด้านราคาตลาดของหลักทรัพย์ (Mark-to-Market Exposure) และมูลค่าความเสียหายรวมสูงสุดที่อาจจะเกิดขึ้น ณ ระดับความเชื่อมั่นที่กำหนด (Value at Risk) หลังหักมูลค่า Collateral Submitted ของสมาชิกแต่ละรายที่มี ณ วันนั้นๆ

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

¹ มูลค่าแหล่งเงินทุนของสมาชิกที่ใช้ประเมินเงินสมทบ ประกอบด้วย (1) ทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายในส่วนของสมาชิก เอง (2) เงินสำรองเพื่อความมั่นคงของสำนักหักบัญชีในส่วนของตลาดหลักทรัพย์ (SET Reserve Fund) และ (3) เงินกองทุนทดแทนความเสียหายในส่วนของเงินสมทบของตลาดหลักทรัพย์ โดยเงินในส่วนของ (2) และ (3) จะมีการแบ่งสัดส่วนตามมูลค่าทรัพย์สินสมทบเข้ากองทุนทดแทนความเสียหายของสมาชิกแต่ละราย

การจำลอง (Simulation) มูลค่าเงินสมทบกองทุนฯ (Clearing Fund) ที่ต้องวางเพิ่ม

Q1: สมาชิกสามารถประมาณมูลค่าเงินสมทบกองทุนฯ ที่อาจถูกเรียกจากรูกรกรมซื้อขายหลักทรัพย์ที่คาดว่า จะส่งผลกระทบต่อทำให้ถูกเรียกเงินสมทบกองทุนฯ ได้อย่างไร

Ans: สมาชิกสามารถทำการ Simulation มูลค่าเงินสมทบกองทุนฯ ที่อาจถูกเรียกวางเพิ่มได้ในระบบ SET CLEAR โดย

- เพิ่ม รายการซื้อขายหลักทรัพย์ที่อาจมีผลกระทบต่อทำให้ถูกเรียกเงินสมทบกองทุนฯ เพื่อประมาณ มูลค่าหลักประกันที่ต้องวาง โดยสามารถทำได้ทั้ง Key-in และ Upload หน้าจอที่เกี่ยวข้อง ได้แก่

หน้าจอ 9710 [Clearing Fund Contribution Simulation] เป็นหน้าจอสำหรับการเพิ่มรายการ โดยสามารถทำได้ทั้ง Key-in และ Upload

หน้าจอ 9711 [Clearing Fund Contribution Simulation Result] เป็นหน้าจอสำหรับเรียกดูผลการ จำลองการคำนวณเงินสมทบกองทุนฯ ส่วนเพิ่ม

(รายละเอียดเพิ่มเติม: คู่มือ การดำเนินการที่เกี่ยวข้องกับจำลองการคำนวณมูลค่าเงินสมทบกองทุน Clearing Fund ปรากฏใน SET Portal >> Directory Service >> SETCLEAR BUSINESS - Securities >> Broker & Sub-Broker >> Meeting Material)

FAQ: การซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด (Buy-in)

Q1: หากสมาชิกต้องการเพิ่มหรือลดเจ้าหน้าที่ในการรับข้อมูลการ Buy-in จะต้องทำอะไร

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

Q2: กรณีสมาชิกมีการผิดนัดหุ้นและต้องการทราบว่าใครมาเสนอขายรายการ Buy-in หรือไม่ สามารถตรวจสอบจากที่ใด

Ans: สมาชิกตรวจสอบว่ารายการที่ผิดนัด มีผู้เสนอขาย Buy-in หรือไม่ ได้ที่ระบบ SET CLEAR หน้าจอ 4753 [Buy-In List] ที่คอลัมน์ Offer Quantity

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

Ans: สมาชิกที่สามารถขายหลักทรัพย์ Buy-in ได้ 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 โดยใช้ราคาตามที่กำหนด ซึ่งสามารถตรวจสอบได้ที่หน้าจอ 4757 [Buy-In Result] เลือกรอบ Preliminary

ราคา Buy-in เป็นไปตามประกาศของสำนักหักบัญชี เรื่อง การซื้อเพื่อส่งมอบหลักทรัพย์ที่ผิดนัด (Buy-in)

https://media.set.or.th/rulebook/regulation/Buyin_T2_151062_TH.pdf?_gl=1*xmuy9k*_gcl_au*MTM3MzU4OTA...

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: สมาชิกสามารถตรวจสอบรายการผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ในระบบ 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] ซึ่งระบบจะแสดงค่าปรับหลังจากสมาชิกมีการคืนหลักทรัพย์ที่ผิดนัดแล้วเท่านั้น

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 SET Portal >> Directory Service >> SETCLEAR BUSINESS - Securities >> Broker & Sub-Broker >> Meeting Material)

Q5: สมาชิกผู้ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์ สามารถตรวจสอบ Cash Settlement ในระบบ SET CLEAR ที่หน้าจอใด

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

Q6: สมาชิกผู้รอรับหลักทรัพย์ 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 ดำเนินการเกี่ยวกับการผัดขันธ์ส่งมอบ

ปรากฏใน SET Portal >> Directory Service >> SETCLEAR BUSINESS - Securities >> Broker & Sub-Broker >> Meeting Material)