

วิธิปฏิบัติบริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด
เรื่อง การบริการเกี่ยวกับธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์ พ.ศ. 2550

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 6 ของระเบียบบริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด เรื่อง การบริการเกี่ยวกับธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์ พ.ศ. 2550 ลงวันที่ 15 พฤษภาคม 2550

บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด ออกวิธิปฏิบัติไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 วิธิปฏิบัตินี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 15 พฤษภาคม 2550 เป็นต้นไป

หมวด 1

สูตรคำนวณและกำหนดเวลาทำการ

ข้อ 2 ศูนย์รับฝากจะคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อขาย (Value of Purchased Securities) ราคาซื้อคืน (Repurchase Price) และมูลค่าหลักประกัน (Value of Collateral Requirement) ตามตารางสูตรคำนวณแนบท้ายวิธิปฏิบัตินี้

ข้อ 3 ผู้ใช้บริการเกี่ยวกับธุรกรรมซื้อขายหลักทรัพย์ ต้องดำเนินการภายในระยะเวลาที่ศูนย์รับฝากกำหนดตามตารางแนบท้ายวิธิปฏิบัตินี้

หมวด 2

ค่าธรรมเนียม ค่าบริหารจัดการ หรือค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้อง

ข้อ 4 ศูนย์รับฝากจะเรียกเก็บค่าธรรมเนียมการให้บริการงานเพื่อรองรับธุรกรรมซื้อขายหลักทรัพย์ตามตารางค่าธรรมเนียมการให้บริการงานเพื่อรองรับธุรกรรมซื้อขายหลักทรัพย์แนบท้ายวิธิปฏิบัตินี้

ข้อ 5 ศูนย์รับฝากจะเรียกเก็บค่าบริหารจัดการหลักประกันผันแปร (Management Fee) จากสมาชิกผู้ให้บริการในอัตราร้อยละ 0.25 ของมูลค่าหลักประกันผันแปรของสมาชิกผู้ให้บริการเป็นรายปีตามปีปฏิทิน

ประกาศ ณ วันที่ 15 พฤษภาคม 2550

(นางสาวโสภาวดี เลิศมนัสชัย)

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด

สูตรคำนวณ

| คำศัพท์ | การคำนวณ |
|--|--|
| ราคาซื้อขาย (Purchase Price) | เงินที่ผู้ซื้อชำระราคาให้แก่ผู้ขาย ณ วันเริ่มต้นธุรกรรมสัญญาซื้อคืน |
| มูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อขาย (Value of Purchased Securities) | (จำนวนหลักทรัพย์ที่ซื้อขาย X ราคาตลาดของหลักทรัพย์ที่ซื้อขาย*) + เงินชดเชยสิทธิประโยชน์จากหลักทรัพย์ที่ซื้อขาย |
| ราคาซื้อคืน (Repurchase Price) | ราคาซื้อขาย + ดอกเบี้ยที่ยังมิได้ชำระ |
| ดอกเบี้ยที่ยังมิได้ชำระ | $\left(\frac{\text{ราคาซื้อขาย} \times \text{อัตราดอกเบี้ย}}{365} \right) \times \text{จำนวนวัน}$ จำนวนวัน นับจากวันเริ่มต้นธุรกรรมสัญญาซื้อคืน หรือวันจ่ายดอกเบี้ยล่าสุด (แล้วแต่กรณี) จนถึงวันก่อนวันที่คำนวณ |
| มูลค่าหลักประกัน (Value of Collateral Requirement) | ราคาซื้อคืน (Repurchase Price) X อัตราส่วนหลักประกัน (Margin Ratio) |

* ปัจจุบันใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์โดยอ้างอิงตามรายงานของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (The Thai Bond Market Association) หรือตามราคาปิดของหลักทรัพย์ตามรายงานของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

| คำศัพท์ | การคำนวณ |
|--|--|
| <p>ช่วงยกเว้นการเรียกหลักประกัน (Margin Exemption or Threshold)</p> <ul style="list-style-type: none"> - กรณีกำหนดเป็นอัตรา - กรณีกำหนดเป็นจำนวนเงิน | <p>ราคาซื้อคืน (Repurchase Price) X อัตราการยกเว้นการเรียกหลักประกัน (Exemption Rate)</p> <p>จำนวนเงินที่ยกเว้น (Exemption Amount)</p> |
| <p>ค่าความเสียหายที่อาจเกิดขึ้น (Exposure)</p> <ul style="list-style-type: none"> - สำหรับกรณี Single Agreement ใช้มูลค่าสุทธิ (Net Exposure) และ - สำหรับกรณี Trade Agreement ใช้มูลค่าตามสัญญาที่ละรายการ (Transaction Exposure) | <p> มูลค่าหลักประกัน – มูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อขาย </p> <p>หมายเหตุ :</p> <ul style="list-style-type: none"> - ผู้ซื้อจะเป็นผู้วางหลักประกัน เมื่อมูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อขาย มากกว่ามูลค่าหลักประกัน - ผู้ขายจะเป็นผู้วางหลักประกัน เมื่อมูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อขาย น้อยกว่ามูลค่าหลักประกัน |
| <p>มูลค่าหลักประกันผันแปร (Variation Margin) ที่ต้องวางกับศูนย์รับฝาก</p> | <p>ค่าความเสียหายที่อาจเกิดขึ้น – มูลค่าหลักประกันผันแปรคงเหลือที่ศูนย์รับฝากดูแลเก็บรักษา</p> <p>หมายเหตุ :</p> <ul style="list-style-type: none"> - สมาชิกผู้ให้บริการต้องวางหลักประกันผันแปร เมื่อค่าความเสียหายที่อาจเกิดขึ้น มากกว่า มูลค่าหลักประกันผันแปรคงเหลือที่ศูนย์รับฝากดูแลเก็บรักษา และ มากกว่า ช่วงยกเว้นการเรียกหลักประกัน - สมาชิกผู้ให้บริการอาจขอคืนหลักประกันผันแปร เมื่อค่าความเสียหายที่อาจเกิดขึ้น น้อยกว่า มูลค่าหลักประกันผันแปรคงเหลือที่ศูนย์รับฝากดูแลเก็บรักษา |

กำหนดเวลาของธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์

| ธุรกรรม | เวลา |
|--|---|
| 1) หลักประกันผันแปร (Variation Margin) | |
| - ตรวจสอบข้อมูลการคำนวณ Mark to Market | ตั้งแต่ 07.00 น. |
| - แจ้งการชำระหลักประกัน (Margin Provision) หรือการยกเว้นการเรียกหลักประกัน (Margin Exemption) | 08.30 – 10.00 น. |
| - วางหลักประกันผันแปร | ภายใน 11.00 น. |
| - แจ้งการขอลดหลักประกัน (Margin Withdrawal) | 08.30 – 16.00 น. |
| - ศูนย์รับฝากสินหลักประกันที่สมาชิกผู้ใช้บริการแจ้งขอลด | 11.00 (หากขอเรียกคืนภายในเวลา 10.00 น.) 16.45 (หากขอเรียกคืนหลังเวลา 10.00 น.) |
| - คืนผลประโยชน์จากหลักประกันผันแปร กรณีคืนรายเดือน (หากสัญญายังไม่สิ้นสุด) กรณีคืน ณ วันสิ้นสุดสัญญา | 11.00 น. 11.00 น. (หากธุรกรรมสิ้นสุดสัญญาแล้วเสร็จภายในเวลา 10.00 น.) 16.45 น. (หากธุรกรรมสิ้นสุดสัญญาแล้วเสร็จหลัง 10.00 น.) |

| ธุรกรรม | เวลา |
|---|---|
| <p>2) ธุรกรรมอื่นๆ</p> <ul style="list-style-type: none"> - การแจ้งข้อมูลการชำระราคาและการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ซื้อขายในธุรกรรมเริ่มต้นสัญญาซื้อคืนและธุรกรรมสิ้นสุดสัญญาซื้อคืน (Open Leg & Close Leg Settlement) - การเปลี่ยนแปลงข้อมูลและเงื่อนไขของสัญญาซื้อคืน (Change of Trade Condition & Trade Adjustment) - การขอเปลี่ยนแปลงหลักทรัพย์ที่ซื้อขาย (Purchased Securities Exchange & Purchased Securities Substitution) - การจ่ายเงินชดเชยสิทธิประโยชน์จากหลักทรัพย์ที่ซื้อขาย (Manufactured Income Payment) | 08.30 – 16.00 น. |
| <p>3. การเปลี่ยนแปลงระยะเวลาของสัญญาซื้อคืน</p> <ul style="list-style-type: none"> - มีผลให้สัญญาซื้อคืนสิ้นสุดลงก่อนกำหนดระยะเวลาเดิม (Repurchase before Maturity) หรือมีการกำหนดระยะเวลาสิ้นสุดของสัญญา (Repurchase at Request) | <ul style="list-style-type: none"> - หลักทรัพย์ประเภททุน : แจ้งล่วงหน้าอย่างน้อย 4 วันทำการก่อนวันที่ต้องการสิ้นสุดสัญญา - หลักทรัพย์ประเภทหนี้ : แจ้งล่วงหน้าอย่างน้อย 3 วันทำการก่อนวันที่ต้องการสิ้นสุดสัญญา |
| <ul style="list-style-type: none"> - มีผลให้ขยายระยะเวลาสิ้นสุดสัญญาซื้อคืนจากกำหนดระยะเวลาเดิม | <ul style="list-style-type: none"> - หลักทรัพย์ประเภททุน : แจ้งล่วงหน้าอย่างน้อย 4 วันทำการก่อนวันที่ต้องการสิ้นสุดสัญญาเดิม - หลักทรัพย์ประเภทหนี้ : แจ้งล่วงหน้าอย่างน้อย 3 วันทำการก่อนวันที่ต้องการสิ้นสุดสัญญาเดิม |

| ธุรกรรม | เวลา |
|---|---|
| <p>4. การเปลี่ยนราคาซื้อขาย</p> <ul style="list-style-type: none"> - ผู้ซื้อหรือผู้ขายแจ้งการเปลี่ยนราคาซื้อขาย | <ul style="list-style-type: none"> - หลักทรัพย์ประเภททุน : แจ้งล่วงหน้าอย่างน้อย 4 วันทำการก่อนวันที่ต้องการเปลี่ยนราคาซื้อขาย - หลักทรัพย์ประเภทหนี้ : แจ้งล่วงหน้าอย่างน้อย 3 วันทำการก่อนวันที่ต้องการเปลี่ยนราคาซื้อขาย |
| <p>5. ดอกเบี้ยของเงินสดที่วางเป็นหลักประกันผันแปร</p> <ul style="list-style-type: none"> - การคืนดอกเบี้ยของเงินสดที่วางเป็นหลักประกันผันแปร (Interest on Cash Margin) | <p>ทุกวันทำการแรกของเดือนถัดไป</p> |

ค่าธรรมเนียมการให้บริการงานเพื่อรองรับธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์

| มูลค่าของธุรกรรม | ค่าธรรมเนียมต่อวันต่อมูลค่าของธุรกรรม 1 ล้านบาท |
|-------------------------------|---|
| ≤ 100 ล้านบาท | ล้านละ 0.50 บาท |
| > 100 ล้านบาท ~ ≤ 200 ล้านบาท | 50 บาท + ส่วนที่เกิน 100 ล้านบาท คิดล้านละ 0.40 บาท |
| > 200 ล้านบาท ~ ≤ 300 ล้านบาท | 90 บาท + ส่วนที่เกิน 200 ล้านบาท คิดล้านละ 0.30 บาท |
| > 300 ล้านบาท ~ ≤ 400 ล้านบาท | 120 บาท + ส่วนที่เกิน 300 ล้านบาท คิดล้านละ 0.20 บาท |
| > 400 ล้านบาท | 140 บาท + ส่วนที่เกิน 400 ล้านบาท คิดล้านละ 0.10 บาท |