

## ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

### เรื่อง การกำหนดสัดส่วนของประเภทหลักทรัพย์ (Concentration Limit) ที่วางเป็นหลักประกัน

ตามที่ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนของหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 308 กำหนดให้สำนักหักบัญชีอาจพิจารณาลงโทษสมาชิก หากสมาชิกฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามหน้าที่ตามข้อกำหนด หนังสือเวียน หรือคำสั่งของสำนักหักบัญชี และหลักเกณฑ์ 407.01 (3) (2) กำหนดให้สำนักหักบัญชีกำหนดหลักเกณฑ์ และเงื่อนไขสำหรับสัดส่วนของประเภทหลักทรัพย์ (Concentration Limit) ที่สมาชิคนำมาวางเพื่อเป็นหลักประกันในการบริหารความเสี่ยงในระบบงานชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์นั้น

สำนักหักบัญชีขอกำหนดสัดส่วนของหลักทรัพย์แต่ละประเภท (Concentration Limit) ตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขดังนี้

#### 1. หลักทรัพย์ประเภทตราสารทุน

ต้องมีสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 20 ของปริมาณการซื้อขาย (Trading Volume) เฉลี่ยรายวันในไตรมาสที่ผ่านมา

#### 2. หลักทรัพย์ประเภทตราสารหนี้

ต้องมีสัดส่วนไม่เกินร้อยละ 20 ของมูลค่ารวมของตราสารหนี้ที่ออกและเสนอขาย (Issued Size) ทั้งหมดและต้องมีมูลค่าไม่เกิน 500 ล้านบาท

โดยสำนักหักบัญชีจะพิจารณาจากหลักทรัพย์ทั้งหมดที่สมาชิคนำมาวางเพื่อเป็นหลักประกันกับสำนักหักบัญชีทั้งในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์และในส่วนที่เกี่ยวข้องกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ทั้งนี้สัดส่วนดังกล่าวไม่นำมาใช้กับหลักทรัพย์ที่สมาชิกมีภาระผูกพันต้องส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชี

ในกรณีหลักทรัพย์ที่สมาชิกวางเป็นหลักประกันมีสัดส่วนเกินกว่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด สมาชิกมีหน้าที่ดำเนินการเพื่อเปลี่ยนหลักประกันดังกล่าวภายใน 5 วันทำการ ตามจำนวนที่ได้รับแจ้งจากสำนักหักบัญชี หากสมาชิกไม่ดำเนินการเปลี่ยนหลักประกันภายในระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนดหรือดำเนินการเปลี่ยนหลักประกันไม่ครบถ้วนตามจำนวนที่ได้รับแจ้งจากสำนักหักบัญชี แล้วแต่กรณี สำนักหักบัญชีจะดำเนินการถอนหลักประกันตามจำนวนที่เกินจากสัดส่วนดังกล่าวและเรียกค่าปรับจากสมาชิกเป็นจำนวน 500 บาทต่อรายหลักทรัพย์

ทั้งนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 23 เมษายน 2561 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 2 เมษายน 2561

(ลงนาม) ภัทรวลี สุวรรณสร

(นางสาวภัทรวลี สุวรรณสร)

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด