

ภาคผนวก

[แนบท้ายประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 30/2559 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดย
ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 57/2564 (ฉบับที่ 2)]

**หลักเกณฑ์และเงื่อนไขในการจัดทำและนำเสนอข้อมูลเกี่ยวกับการบริหารจัดการความเสี่ยง
ของสำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า**

ข้อมูล	ความถี่ของข้อมูล ที่ต้องจัดทำ	กำหนดเวลา นำเสนอข้อมูล
1. ข้อมูลเกี่ยวกับการประเมินค่าความเสี่ยงสูงสุด (stress test) และค่าความผันผวนสูงสุดที่แหล่งเงินทุนสามารถรองรับได้ (reverse stress test)		
1.1 (1) ข้อมูลค่าความเสี่ยงสูงสุด (stress test) และค่าความผันผวนสูงสุดที่แหล่งเงินทุนสามารถรองรับได้ (reverse stress test) ทั้งนี้ เฉพาะค่าความเสี่ยงสูงสุด (stress test) ด้านเครดิต (credit risk) ให้จัดทำข้อมูลเป็นรายสมาชิก (2) มูลค่าเงินกองทุนทดแทนความเสียหาย (clearing fund) และ (3) มูลค่าหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงของสมาชิก (security deposit) โดยจัดทำข้อมูลเป็นรายสมาชิก	รายวัน	ภายในวันทำการถัดไป
1.2 รายงานผลการประเมินความเสี่ยงของมูลค่าแหล่งเงินทุนที่ใช้อยู่รับความเสี่ยงด้านเครดิต (credit risk) และความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง (liquidity risk) ซึ่งประมวลข้อมูลจาก (1) การประเมินค่าความเสี่ยงสูงสุด (stress test) และ (2) การประเมินค่าความผันผวนสูงสุดที่แหล่งเงินทุนสามารถรองรับได้ (reverse stress test)	รายไตรมาส	ภายในวันทำการที่ 15 ของเดือนแรกของไตรมาสถัดไป
2. ข้อมูลเกี่ยวกับการเรียกหลักประกัน		
2.1 (1) มูลค่าหลักประกันที่สมาชิกวางไว้กับสำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (total margin) โดยจัดทำข้อมูลเป็นรายสมาชิก และ	รายวัน	ภายในวันทำการถัดไป

ข้อมูล		ความถี่ของข้อมูล ที่ต้องจัดทำ	กำหนดเวลา นำส่งข้อมูล
	(2) มูลค่าหลักประกันที่เรียกเพิ่มจากสมาชิก กรณีสมาชิกมีทรัพย์สินไม่เพียงพอรองรับ ความเสี่ยงสูงสุด โดยจัดทำข้อมูลเป็นรายสมาชิก		
2.2	การเรียกหลักประกันระหว่างวัน (intraday margin) และการเรียกหลักประกันส่วนเพิ่ม (additional margin) เฉพาะ (1) หลักประกันพิเศษ (super margin) และ (2) หลักประกันกระจุกตัว (concentration margin)	รายวัน	เป็นรายเดือน ภายในวันทำการที่ 5 ของเดือนถัดไป
3. ข้อมูลเกี่ยวกับหลักประกันรักษาสภาพ (maintenance margin)			
3.1	การปรับเปลี่ยนอัตราหลักประกันรักษาสภาพ (maintenance margin)	ทุกครั้งที่มีการปรับเปลี่ยน อัตราหลักประกัน รักษาสภาพ	ภายในวันทำการถัดไป
4. ข้อมูลเกี่ยวกับระบบชำระหนี้ และการผัดนัดต่าง ๆ รวมถึงการฝ่าฝืนระเบียบหรือข้อบังคับของ สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า			
4.1	(1) การผัดนัดชำระหนี้ และ (2) การผัดนัดวางหลักประกัน โดยจัดทำข้อมูลตาม (1) – (2) เป็นรายสมาชิก	รายธุรกรรม	เป็นรายเดือน ภายในวันทำการที่ 5 ของเดือนถัดไป
4.2	รายงานผลการพิจารณาและการดำเนินการต่อสมาชิก ที่ฝ่าฝืนระเบียบหรือข้อบังคับ เช่น การส่งรายงาน ล่าช้า เป็นต้น โดยจัดทำข้อมูลเป็นรายสมาชิก	รายไตรมาส	ภายในวันทำการที่ 15 ของเดือนแรก ของไตรมาสถัดไป
4.3	รายงานการใช้เงินกองทุนทดแทนความเสียหาย (clearing fund) หรือการใช้หลักทรัพย์เพื่อ ความมั่นคงของสมาชิก (security deposit)	ทุกครั้งที่มีการใช้ เงินกองทุนทดแทน ความเสียหาย (clearing fund) หรือหลักทรัพย์ เพื่อความมั่นคงของ สมาชิก (security deposit)	ภายในวันทำการถัดไป