

ภาคผนวก

[แนบท้ายประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 29/2559 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดย
ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. 58/2564 (ฉบับที่ 2)]

**หลักเกณฑ์และเงื่อนไขในการจัดทำและนำเสนอข้อมูลเกี่ยวกับการบริหารจัดการความเสี่ยง
ของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์**

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 และ (2) มูลค่าเงินกองทุนทดแทนความเสียหาย (clearing fund)	รายวัน	ภายในวันทำการถัดไป
1.2 รายงานผลการประเมินความเสี่ยงของมูลค่าแหล่งเงินทุนที่ใช้รองรับความเสี่ยงด้านเครดิต (credit risk) และความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง (liquidity risk) ซึ่งประมวลข้อมูลจาก (1) การประเมินค่าความเสี่ยงสูงสุด (stress test) และ (2) การประเมินค่าความผันผวนสูงสุดที่แหล่งเงินทุนสามารถรองรับได้ (reverse stress test)	รายไตรมาส	ภายในวันทำการที่ 15 ของเดือนแรก ของไตรมาสถัดไป

ข้อมูล		ความถี่ของข้อมูล ที่ต้องจัดทำ	กำหนดเวลา นำส่งข้อมูล
2. ข้อมูลเกี่ยวกับระบบชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ และการผิตนัดต่าง ๆ รวมถึงการฝ่าฝืนระเบียบหรือข้อบังคับของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์			
2.1	มูลค่าคงค้างชำระราคา (settlement value)	รายวัน	เป็นรายเดือน ภายในวันทำการที่ 5 ของเดือนถัดไป
2.2	(1) การผิตนัดวางหลักประกัน (2) การผิตนัดชำระราคาหลักทรัพย์ (3) การผิตนัดส่งมอบหลักทรัพย์ และ (4) การผิตนัดชำระหนี้ในส่วนอื่น ๆ นอกจาก (2) และ (3) โดยจัดทำข้อมูลตาม (1) – (4) เป็นรายสมาชิก	รายธุรกรรม	เป็นรายเดือน ภายในวันทำการที่ 5 ของเดือนถัดไป
2.3	การยืมหลักทรัพย์ (securities borrowing and lending : SBL) และการบังคับซื้อและส่งมอบหลักทรัพย์ (buy-in)	รายวัน	เป็นรายเดือน ภายในวันทำการที่ 5 ของเดือนถัดไป
2.4	รายงานผลการพิจารณาและการดำเนินการต่อสมาชิกที่ฝ่าฝืนระเบียบหรือข้อบังคับ เช่น การส่งรายงานล่าช้า เป็นต้น โดยจัดทำข้อมูลเป็นรายสมาชิก	รายไตรมาส	ภายในวันทำการที่ 15 ของเดือนแรก ของไตรมาสถัดไป
2.5	รายงานการใช้เงินกองทุนทดแทนความเสียหาย (clearing fund)	ทุกครั้งที่มีการใช้เงินกองทุนทดแทนความเสียหาย (clearing fund)	ภายในวันทำการถัดไป