

## ประกาศ

### Announcement

#### หลักเกณฑ์การเรียกหลักประกันลูกค้าในบัญชีตราสารอนุพันธ์ (เพิ่มเติม)

#### Criteria for call derivative account (additional)

ตามมติที่ประชุมคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงครั้งที่ 64/2010 (วันที่ 3 ธันวาคม 2553) เกี่ยวกับหลักเกณฑ์เพิ่มเติมสำหรับการเรียกหลักประกันลูกค้าในบัญชีตราสารอนุพันธ์ ซึ่งมีดังนี้

กรณีเมื่อลูกค้าถูก Call ในวันที่ T+1 แล้ว ลูกค้าได้มีการดำเนินการบางส่วน เช่น โอนหลักประกัน หรือ ปิดสถานะ ในวันที่ T+2 บริษัทจะมีการดำเนินการตามระดับ Equity Balance ของลูกค้า ดังนี้

ระดับ Equity Balance	การดำเนินการ
สูงกว่า IM	ไม่ต้อง Force close และ ไม่ Call และปลด Lock ได้
สูงกว่า MM แต่ไม่เกิน IM	ไม่ต้อง Force close แต่ต้อง Lock ห้ามสร้างสถานะเพิ่ม จนกว่าลูกค้าดำเนินการ ผ่าหลักประกัน หรือ ปิดสถานะ ให้ EB ขึ้นมาจนถึงระดับ IM
สูงกว่า FM แต่ไม่เกิน MM	ต้อง Call ลูกค้าให้ดำเนินการ ผ่าหลักประกัน หรือ ปิดสถานะ ให้ EB ขึ้นมาจนถึงระดับ IM "
ต่ำกว่า FM	Force close ให้ EB ขึ้นมาที่ระดับ IM

"ในกรณีที่ลูกค้าดำเนินการอย่างใดอย่างหนึ่งในวันที่ T+2 ทำให้ EB ขึ้นมาสูงกว่าระดับ MM แต่ไม่ถึง IM ไม่ต้อง Force Close แต่ต้อง Lock ห้ามสร้างสถานะเพิ่ม จนกว่าลูกค้าดำเนินการ ผ่าหลักประกัน หรือ ปิดสถานะ ให้ EB ขึ้นมาจนถึงระดับ IM แต่หากในวันที่ T+3 หรือ วันที่ T+X ระดับ EB ของลูกค้า ลดต่ำกว่า MM อีกครั้ง แม้จะไม่ถึงระดับ FM ลูกค้าจะถูกเรียก Call อีกครั้ง โดยที่ลูกค้าไม่ดำเนินการผ่าหลักประกันเพิ่มเข้ามาภายในเวลา 9.45 น. เพื่อให้ EB ขึ้นมาที่ระดับ IM บริษัทจะดำเนินการ Force Close บางส่วน/ทั้งหมด เพื่อให้ EB ขึ้นมาที่ระดับ IM

สำหรับกรณีที่จะมีการ Force close นั้น กำหนดให้เวลาลูกค้าจนถึงเวลา 9.45 น. เพื่อให้ลูกค้าต้องดำเนินการผ่าหลักประกันเพิ่มเข้ามา มิฉะนั้น ทางฝ่ายบริหารความเสี่ยง จะแจ้งให้ฝ่ายตลาดอนุพันธ์ ดำเนินการ Force close ตั้งแต่ เวลา 10.00 น. ของวันที่สถานะของลูกค้าเข้าเงื่อนไขการถูก Force close แล้ว

According to Risk Management Committee Meeting No.64/2010 (December 3, 2010) about additional criteria for call derivative account as follow:

In case of customer is called in day T+1 and customer takes some actions such as transfer the collateral or close some positions, company will operate according to the level of customer's Equity Balance (EB) in day T+2 as following:

Equity Balance level	Operation
Above IM	Have no Force close, no Call and unlock
Above MM but less than IM	No Force close but position is not allowed to be opened until Equity Balance of customer is equal to IM level
Above FM but less than MM	Must call, customers to deposit collateral or close some position until Equity Balance is equal to IM level <sup>1)</sup>
Less than FM	Force close until Equity Balance is equal to IM level

<sup>1)</sup> In case that customer takes some actions in day T+2 and EB is increased above MM but less than IM, Force Close is no needed but account must be locked until customer deposit more collateral or close position until EB is equal to IM level .On day T+3 or day T+X, if EB level is lower than MM again, customer would be called. Although EB is over FM, if customer does not deposit collateral up to IM, company will force close some or all positions to increase EB up to IM level.

In case of Force close, customer must deposit collateral within 9.45 a.m., otherwise Risk Management Officer would inform Derivatives Department to force close, starting from 10.00 a.m. on that day.

ทั้งนี้เกณฑ์เพิ่มเติมนี้จะมีผลตั้งแต่วันที่ 15 ธันวาคม 2553 เป็นต้นไป จนกว่าบริษัทฯ จะมีประกาศเปลี่ยนแปลง

This additional criteria will become effective on December 15, 2010 or until further announcement.

ประกาศ ณ วันที่ 3 ธันวาคม 2553  
Announced on December 3, 2010

  
(Mr. Jeremy Kim San Liao)  
Managing Director