

ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

เรื่อง การคำนวณมูลค่าหลักประกันอันเนื่องมาจากการผิดนัด

ตามข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 603.02 (1) และ 603.03 กำหนดให้สำนักหักบัญชีคำนวณมูลค่าหลักประกันที่ต้องวางอันเนื่องมาจากการผิดนัด นั้น

สำนักหักบัญชีจะคำนวณมูลค่าหลักประกันอันเนื่องมาจากการผิดนัดเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 130 ของมูลค่าที่เกิดจากจำนวนหลักทรัพย์ที่ผิดนัดส่งมอบหลักทรัพย์คู่กับราคาหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุน ที่ซื้อขายบนกระดานหลัก	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุน ที่ซื้อขายบนกระดานต่างประเทศ	ราคาที่ใช้ในการคำนวณ มูลค่าตราสารหนี้
<p>1. ให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด (Best Bid) ณ เวลาปิดตลาดในวันที่คำนวณมูลค่า</p> <p>2. ในกรณีที่ไม่มีราคาตาม 1. ให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด (Best Bid) ณ เวลาปิดตลาดในวันทำการที่ใกล้ที่สุด</p>	<p>1. ให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นที่ซื้อขายบนกระดานหลัก ในวันที่คำนวณมูลค่า</p> <p>2. ในกรณีที่ไม่มีราคาตาม 1. ให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น ณ เวลาปิดตลาดในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้นที่ซื้อขายบนกระดานหลัก ณ เวลาปิดตลาดในวันที่คำนวณมูลค่า</p> <p>3. ในกรณีที่ไม่มีราคาตาม 2. ให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นที่ซื้อขายบนกระดานหลัก ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด</p>	<p>ราคาอ้างอิงตามมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ซึ่งจัดทำและเผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย</p>

ทั้งนี้ ให้ใช้ประกาศฉบับนี้แทนประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด เรื่อง การ
คำนวณมูลค่าหลักประกันอันเนื่องมาจากการผิดนัด ลงวันที่ 9 กุมภาพันธ์ 2553 โดยมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่
27 มีนาคม 2555 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 มีนาคม 2555

(ลงนาม) (นางนงราม วงษ์วานิช)

(นางนงราม วงษ์วานิช)

ผู้รับมอบอำนาจ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด