

**ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด**  
**เรื่อง อัตราค่าความเสี่ยงที่ใช้ในการคำนวณมูลค่า**  
**ทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน (Haircut Rate)**

ตามที่ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนของหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 407.01 (4) หลักเกณฑ์ 603.03 และหลักเกณฑ์ 906 กำหนดให้สำนักหักบัญชีกำหนดหลักเกณฑ์เพื่อคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน นั้น

สำนักหักบัญชีจะคำนวณมูลค่าหลักประกันประเภทหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์และวิธีการดังต่อไปนี้

(1) ตราสารทุน

| ประเภทตราสารทุน  | อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ) | ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่ซื้อขายบนกระดานหลัก   | ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่ซื้อขายบนกระดานต่างประเทศ  |
|--|--|---|--|
| (1) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET50 INDEX   | 24   | 1. ให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นในวันที่ยื่นคำขอคำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด (Best Bid) ณ เวลาปิดตลาดในวันที่ยื่นคำขอคำนวณมูลค่า                          | 1. ให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นในวันที่ยื่นคำขอคำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้นที่ซื้อขายบนกระดานหลัก ณ เวลาปิดตลาดในวันที่ยื่นคำขอคำนวณมูลค่า |
| (2) หุ้นสามัญที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนนอกจาก (1) และ หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ (Exchange Traded Fund)                 | 32   | 2. ในกรณีที่ไม่มีราคาดังกล่าวตาม 1. ให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด (Best Bid) ณ เวลาปิดตลาดในวันทำการที่ใกล้ที่สุด | 2. ในกรณีที่ไม่มีราคาดังกล่าวตาม 1. ให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุด (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้นที่ซื้อขายบนกระดานหลัก ณ เวลาปิดตลาดในวันที่ยื่นคำขอคำนวณมูลค่า  |
| (3) ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น หุ้นบุริมสิทธิ หน่วยลงทุนตราสารทุนที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนประเภทอื่นนอกจาก (1) และ (2) | 74   |   | 3. ในกรณีที่ไม่มีราคาดังกล่าวตาม 2. ให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นที่ซื้อขายบนกระดานหลักในวันทำการที่ใกล้ที่สุด                  |

(2) ตราสารหนี้

| ประเภทตราสารหนี้   | อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ)<br>ตามอายุคงเหลือของตราสารหนี้ (Time to Maturity) |  |  |                                      |                        | ราคาที่ใช้ในการคำนวณ<br>มูลค่าตราสารหนี้  |
|--|--|--|--|--------------------------------------|------------------------|---|
|  | ไม่เกิน<br>1 ปี  | มากกว่า<br>1 ปี แต่<br>ไม่เกิน<br>3 ปี | มากกว่า<br>3 ปี แต่<br>ไม่เกิน<br>7 ปี | มากกว่า<br>7 ปี แต่ไม่<br>เกิน 10 ปี | มากกว่า<br>10 ปีขึ้นไป |   |
| พันธบัตรรัฐบาลไทย<br>หรือพันธบัตรธนาคาร<br>แห่งประเทศไทย | 0.5  | 1                                      | 1.5                                    | 2.5                                  | 4                      | ราคาอ้างอิงตามมูลค่า<br>ยุติธรรมของพันธบัตรซึ่ง<br>จัดทำและเผยแพร่โดย<br>สมาคมตลาดตราสารหนี้<br>ไทย |

ทั้งนี้ ให้ใช้ประกาศฉบับนี้แทนประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด เรื่อง อัตรา  
ค่าความเสี่ยงที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน (Haircut Rate) ลงวันที่ 6 ตุลาคม  
2557 โดยมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 2 กุมภาพันธ์ 2558 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 มกราคม 2558

(ลงนาม) นางอุดมวรา เดชสงจริต

(นางอุดมวรา เดชสงจริต)

ผู้รับมอบอำนาจ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด