

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

ตามที่ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนของเกี่ยวกับหลักทรัพย์) 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) โบนัสสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น หุ้นบุริมสิทธิ หน่วยลงทุนตราสารทุนที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนประเภทอื่นนอกจาก (1) และ (2)	76		3. ในกรณีที่ไม่มีราคาดังกล่าวตาม 2. ให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดของหลักทรัพย์นั้นที่ซื้อขายบนกระดานหลักในวันทำการที่ใกล้ที่สุด

(2) ตราสารหนี้

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

ทั้งนี้ ให้ใช้ประกาศฉบับนี้แทนประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด เรื่อง อัตรา
ค่าความเสี่ยงที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน (Haircut Rate) ลงวันที่ 16 มกราคม
2558 โดยมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2559 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 23 ธันวาคม 2558

(ลงนาม)ภัทรวลี สุวรรณสร

(นางสาวภัทรวลี สุวรรณสร)

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด