

ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด เรื่อง อัตราค่าความเสี่ยงที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน (Haircut Rate)

ตามที่ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนของเกี่ยวกับหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 407.01 (4) หลักเกณฑ์ 603.03 และหลักเกณฑ์ 906 กำหนดให้สำนักหักบัญชีกำหนดหลักเกณฑ์เพื่อคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน และสำนักหักบัญชีได้ออกประกาศเรื่องอัตราค่าความเสี่ยงที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน (Haircut Rate) ลงวันที่ 15 กรกฎาคม 2562 นั้น

สำนักหักบัญชีขอยกเลิกประกาศฉบับดังกล่าว และจะคำนวณมูลค่าหลักประกันประเภทหลักทรัพย์ โดยใช้อัตราค่าความเสี่ยงตามหลักเกณฑ์และวิธีการดังต่อไปนี้

1. หลักทรัพย์ประเภทตราสารทุน

| ประเภทตราสารทุน* | อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ) | ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุน | ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ |
|---|--|--|--|
| (1) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET50 INDEX | 21 | 1. ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันที่คำนวณมูลค่า | 1. ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Foreign) ในวันที่คำนวณมูลค่า |
| (2) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 INDEX แต่ไม่อยู่ใน SET50 INDEX | 45 | หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า | หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันที่คำนวณมูลค่า |
| (3) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี sSET INDEX | 47 | | |
| (4) หุ้นสามัญที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ เอ็มเอ ไอ | 51 | 2. ในกรณีที่ไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น ณ เวลาปิดซื้อขายในวันทำการที่ใกล้ที่สุด | 2. ในกรณีที่ไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Foreign) ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า |
| (5) หุ้นสามัญอื่น ๆ ที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนนอกจาก (1) - (4) หุ้นบริษัทย่อย หน่วยลงทุนของกองทุนรวม อีทีเอฟ (Exchange Traded Fund: ETF) และหน่วยทรัสต์ | 51 | | |

| ประเภทตราสารทุน* | อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ) | ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุน | ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ |
|---|--|-------------------------------------|--|
| (6) ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นสามัญหรือหุ้นบุริมสิทธิหรือหุ้นกู้ และใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ | 100 | | 3. ในกรณีที่ไม่มีราคาตามข้อ 2 ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Foreign) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าว ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด |

หมายเหตุ : * กรณีหลักทรัพย์ที่วางเป็นหลักประกันเป็นหลักประกันที่ถูกระงับหรือถูกขึ้นเครื่องหมาย SP (Suspension) เพื่อแสดงการห้ามการซื้อขายหลักทรัพย์ สำนักหักบัญชีจะคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่สมาชิกวางเป็นหลักประกัน โดยใช้อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) ที่อัตราร้อยละ 100

2. หลักทรัพย์ประเภทตราสารหนี้

| ประเภทตราสารหนี้ | อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ) | | | | | ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารหนี้ |
|--|--|------------------------------|------------------------------|-------------------------------|----------------------|---|
| | ตามอายุคงเหลือของตราสารหนี้ (Time to Maturity) | | | | | |
| | ไม่เกิน 1 ปี | มากกว่า 1 ปี แต่ไม่เกิน 3 ปี | มากกว่า 3 ปี แต่ไม่เกิน 7 ปี | มากกว่า 7 ปี แต่ไม่เกิน 10 ปี | มากกว่า 10 ปี ขึ้นไป | |
| พันธบัตรรัฐบาลไทย หรือ พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย | 0.5 | 1.5 | 2.0 | 2.5 | 4.0 | ราคาอ้างอิงตามมูลค่ายุติธรรมของพันธบัตรซึ่งจัดทำและเผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย |

3. ทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกันตามประกาศของสำนักหักบัญชี

กรณีเป็นทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกันตามประกาศของสำนักหักบัญชีว่าด้วยการกำหนดทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน และแนวทางดำเนินการกรณีมีการขายสิทธิประโยชน์ในหลักทรัพย์ที่วางเป็นหลักประกันนั้น หากเป็นทรัพย์สินที่สมาชิกมีภาระผูกพันต้องส่งมอบต่อสำนักหักบัญชีจะไม่มีภาระหักค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) สำหรับการคำนวณมูลค่าหลักประกัน

ทั้งนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 3 กุมภาพันธ์ 2563 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 24 มกราคม 2563

(ลงนาม) กัทรวดี สุวรรณศรี

(นางสาวกัทรวดี สุวรรณศรี)

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด