

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

ตามที่ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนของเกี่ยวกับหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 407.01 (4) หลักเกณฑ์ 603.03 และหลักเกณฑ์ 906 กำหนดให้สำนักหักบัญชีกำหนดหลักเกณฑ์เพื่อคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน และสำนักหักบัญชีได้ออกประกาศเรื่องอัตราค่าความเสี่ยงที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน (Haircut Rate) ลงวันที่ 23 ธันวาคม 2558 นั้น

สำนักหักบัญชีขอยกเลิกประกาศฉบับดังกล่าว และจะคำนวณมูลค่าหลักประกันประเภทหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์และวิธีการดังต่อไปนี้

1. หลักทรัพย์ประเภทตราสารทุน

ประเภทตราสารทุน*	อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ)	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุน	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ
(1) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET50 INDEX	17	1. ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันที่คำนวณมูลค่า	1. ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Foreign) ในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันที่คำนวณมูลค่า
(2) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 INDEX แต่ไม่อยู่ใน SET50 INDEX	28	ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า	
(3) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี sSET INDEX	44		
(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	50		

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

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

2. หลักทรัพย์ประเภทตราสารหนี้

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

3. ทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกันตามประกาศของสำนักหักบัญชี

กรณีเป็นทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกันตามประกาศของสำนักหักบัญชีว่าด้วยการกำหนดทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน และแนวทางดำเนินการกรณีมีการขายสิทธิประโยชน์ในหลักทรัพย์ที่วางเป็นหลักประกันนั้น หากเป็นทรัพย์สินที่สมาชิกมีภาระผูกพันต้องส่งมอบต่อสำนักหักบัญชีจะไม่มีภาระหักค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) สำหรับการคำนวณมูลค่าหลักประกัน

ทั้งนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 23 เมษายน 2561 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 2 เมษายน 2561

(ลงนาม) ภัทรวลี สุวรรณศรี

(นางสาวภัทรวลี สุวรรณศรี)

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด