

ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

เรื่อง การคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์และหลักประกัน

การยืมและให้ยืมหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชี

ตามที่ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนของที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 906 กำหนดให้สำนักหักบัญชีคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ยืมหรือให้ยืมเพื่อการส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชี นั้น

สำนักหักบัญชีกำหนดการคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ยืมหรือให้ยืมเพื่อการส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชีดังนี้

- ผู้ยืมมีหน้าที่วางหลักประกันให้แก่สำนักหักบัญชีในอัตราร้อยละ 130 ของมูลค่าหลักทรัพย์ที่ยืม
- สำนักหักบัญชีจะคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ยืมหรือให้ยืมเป็นประจำทุกวันทำการ โดยใช้ราคาสำหรับการคำนวณตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่ซื้อขายบนกระดานหลัก	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่ซื้อขายบนกระดานต่างประเทศ	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารหนี้
<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>

3. ในกรณีผู้ให้ยืมไม่ได้รับคืนหลักทรัพย์ที่ให้ยืม ผู้ให้ยืมมีสิทธิได้รับหลักประกันในอัตราร้อยละ 130 ของมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม โดยสำนักหักบัญชีจะเป็นผู้ดูแลหลักประกันที่ผู้ให้ยืมมีสิทธิได้รับตลอดระยะเวลาการให้ยืมหลักทรัพย์

ทั้งนี้ ให้ใช้ประกาศฉบับนี้แทนประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด เรื่อง การคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์และหลักประกัน การยืมและให้ยืมหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชี 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