

ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด
เรื่อง การคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์และหลักประกันการยืม
และให้ยืมหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชี

ตามที่ข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนของหลักทรัพย์) หลักเกณฑ์ 906 กำหนดให้สำนักหักบัญชี คำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ยืมหรือให้ยืมเพื่อการส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชี และสำนักหักบัญชีได้ออกประกาศ เรื่อง การคำนวณมูลค่าหลักประกันการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์เพื่อการส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชี ลงวันที่ 16 มีนาคม 2555 นั้น

สำนักหักบัญชีขอยกเลิกประกาศฉบับดังกล่าว และกำหนดการคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ยืมหรือให้ยืมเพื่อการส่งมอบหลักทรัพย์ต่อสำนักหักบัญชีดังนี้

1. ผู้ยืมมีหน้าที่วางหลักประกันให้แก่สำนักหักบัญชีในอัตราร้อยละ 130 ของมูลค่าหลักทรัพย์ที่ยืม
2. สำนักหักบัญชีจะคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์ที่ยืมหรือให้ยืมเป็นประจำทุกวันทำการ โดยใช้ราคาสำหรับการคำนวณตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุน	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารหนี้
1. ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า 2. ในกรณีที่ไม่มีราคาตามข้อ 1 ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น ณ เวลาปิดซื้อขายในวันทำการที่ใกล้ที่สุด	1. ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Foreign) ในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันที่คำนวณมูลค่า 2. ในกรณีที่ไม่มีราคาตามข้อ 1 ให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Foreign) ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า	ราคาอ้างอิงตามมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ซึ่งจัดทำและเผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุน	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารหนี้
	<p>3. ในกรณีที่ไม่มีราคาตามข้อ 2 ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Foreign) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด</p>	

3. ในกรณีผู้ให้ยืมไม่ได้รับคืนหลักทรัพย์ที่ให้ยืม ผู้ให้ยืมมีสิทธิได้รับหลักประกันในอัตราร้อยละ 130 ของมูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม โดยสำนักหักบัญชีจะเป็นผู้ดูแลหลักประกันที่ผู้ให้ยืมมีสิทธิได้รับตลอดระยะเวลาการให้ยืมหลักทรัพย์

ทั้งนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 6 พฤศจิกายน 2560 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 20 ตุลาคม 2560

(ลงนาม) ภัทรวลี สุวรรณสร

(นางสาวภัทรวลี สุวรรณสร)

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด