

ประกาศบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

เรื่อง อัตราค่าความเสี่ยงที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน (Haircut Rate)

ตามที่วิธีปฏิบัติของสำนักหักบัญชี (ในส่วนของที่เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า) หลักเกณฑ์ 503.03 (2) กำหนดให้สำนักหักบัญชีกำหนดหลักเกณฑ์การคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน และสำนักหักบัญชีได้ออกประกาศเรื่องอัตราค่าความเสี่ยงที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน (Haircut Rate) ลงวันที่ 22 มกราคม 2564 นั้น

สำนักหักบัญชีขอยกเลิกประกาศฉบับดังกล่าว และจะคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่สมาชิกวางเป็นหลักประกันตามประเภททรัพย์สินที่สำนักหักบัญชีกำหนดตามประกาศของสำนักหักบัญชีว่าด้วยการกำหนดทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน และแนวทางดำเนินการกรณีมีการขายสิทธิประโยชน์ในหลักทรัพย์ที่วางเป็นหลักประกัน โดยใช้อัตราค่าความเสี่ยงตามหลักเกณฑ์และวิธีการดังต่อไปนี้

1. เงินสดสกุลต่างประเทศ

รายการ	อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ)	การกำหนดอัตราแลกเปลี่ยน
เงินสดสกุลดอลลาร์สหรัฐอเมริกา (USD)	1.50	1. ให้ใช้อัตราแลกเปลี่ยนซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนของสกุลเงินนั้นที่ประกาศโดยธนาคารแห่งประเทศไทย ณ เวลา 18.00 น. ของวันที่คำนวณมูลค่า 2. หากไม่มีอัตราแลกเปลี่ยนตามข้อ 1 ให้ใช้อัตราแลกเปลี่ยนซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนของสกุลเงินนั้นที่ประกาศโดยธนาคารแห่งประเทศไทย ของวันทำการที่ใกล้ที่สุดกับวันที่คำนวณมูลค่า
เงินสดสกุลยูโรโซน (EUR)	1.70	
เงินสดสกุลเยนญี่ปุ่น (JPY)	2.00	

2. หลักทรัพย์ประเภทตราสารทุน

ประเภทตราสารทุน*	อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ)	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุน	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ
(1) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET50 INDEX	32	1. ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า	1. ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Foreign) ในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันที่คำนวณมูลค่า
(2) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 INDEX แต่ไม่อยู่ใน SET50 INDEX			

ประเภทตราสารทุน*	อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ)	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุน	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ
(3) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SSET INDEX	47	2. ในกรณีที่ไม่มีราคาตามข้อ 1 ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น ณ เวลาปิดซื้อขายในวันทำการที่ใกล้ที่สุด	2. ในกรณีที่ไม่มีราคาตามข้อ 1 ให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Foreign) ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า 3. ในกรณีที่ไม่มีราคาตามข้อ 2 ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างด้าวเป็นผู้ถือ (Foreign) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด
(4) หุ้นสามัญอื่นๆ ที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนนอกจาก (1) - (3)	70		

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

3. หลักทรัพย์ประเภทตราสารหนี้

ประเภทตราสารหนี้	อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ) ตามอายุคงเหลือของตราสารหนี้ (Time to Maturity)					ราคาที่ใช้ในการคำนวณ มูลค่าตราสารหนี้
	ไม่เกิน 1 ปี	มากกว่า 1 ปี แต่ไม่ เกิน 3 ปี	มากกว่า 3 ปี แต่ไม่ เกิน 7 ปี	มากกว่า 7 ปี แต่ไม่ เกิน 10 ปี	มากกว่า 10 ปี ขึ้นไป	
พันธบัตรรัฐบาลไทย หรือ พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	0.5	1.0	3.0	5.5	12.0	ราคาอ้างอิงตามมูลค่า ยุติธรรมของพันธบัตรซึ่ง จัดทำและเผยแพร่โดยสมาคม ตลาดตราสารหนี้ไทย

ทั้งนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 5 พฤษภาคม 2564 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 26 เมษายน 2564

(ลงนาม) กัทรวดี สุวรรณศรี

(นางสาวกัทรวดี สุวรรณศรี)

กรรมการผู้จัดการ

บริษัท สำนักหักบัญชี(ประเทศไทย) จำกัด