

แบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

บริษัทจำกัด

ณ วันที่

ส่วนสรุป
หน่วย : บาท

ข้อมูลลักษณะการประกอบธุรกิจ	
1. ประเภทธุรกิจ	☐ หลักทรัพย์ / ☐ สัญญาซื้อขายล่วงหน้า / ☐ สินทรัพย์ดิจิทัล
2.1 การเก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้านั้นในธุรกิจหลักทรัพย์	(ก) เก็บทรัพย์สินลูกค้า / (ข) ไม่เก็บทรัพย์สินลูกค้า
2.2 การเก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้านั้นในธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล	(ก) เก็บทรัพย์สินลูกค้า / (ข) ไม่เก็บทรัพย์สินลูกค้า
3. มีการลงทุนเพื่อบริษัท	(ก) มีการลงทุน / (ข) ไม่มีการลงทุน
4. มีการะความรับผิดชอบต่อระบบชำระราคา	(ก) มีการะ / (ข) ไม่มีการะ
5. วิธีการคำนวณค่าความเสี่ยง	(ก) Fixed-haircut approach / (ข) Standardized approach

ข้อมูลสรุปการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ	
6. เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (บาท)	
7. อัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (%)	
8. เงินกองทุนที่ต้องดำรง (บาท)	
9. มูลค่าหนี้สินโดยสิทธิที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวม (บาท)	
10. สัญญาเช่าที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวม (บาท)	
11. ส่วนของผู้ถือหุ้น (บาท)	
12. อัตราส่วนมูลค่าหนี้สินโดยสิทธิที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวม ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น (ข้อ 9 / ข้อ 11) (%)	
13. วงเงินกู้โดยสิทธิ (บาท)	
14. อัตราส่วนมูลค่าหนี้สินโดยสิทธิและวงเงินกู้โดยสิทธิ ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น (ข้อ (9+13) / ข้อ 11) (%)	

เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

ส่วนที่ 1

หน้า 1

หน่วย : บาท

1	เงินสดและเงินฝากธนาคาร								1
2	ตั๋วสัญญาใช้เงินและตั๋วแลกเงินที่ออกโดยสถาบันการเงิน								2
ก. ราคาขายคืน ณ ปัจจุบัน ข. หลักประกัน ค. ค่าความเสี่ยง									
3	หลักทรัพย์ซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน								
3.1	หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ่มหนี้				3.1	ก	ข้อ 3.1 + 3.2		
3.2	หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ่มหนี้				3.2	ข - ค			3
ก. มูลค่าเงินลงทุน ค. ค่าความเสี่ยง									
4	เงินลงทุน (จากส่วนที่ 3 และข้อ 1 ของส่วนที่ 9)							ก - ค	4
5 ลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง 5.1 ลูกหนี้บัญชีเงินสด ก. มูลหนี้ ข. หลักประกัน ค. ค่าความเสี่ยง 5.1.1 ลูกหนี้ยังไม่พ้นกำหนดชำระ 1. cash account 5.1.1 ก1 + ก2 - ค 5.1.2 ลูกหนี้พ้นกำหนดชำระภายใน 30 วัน 2. cash balance 5.1.2 ข - ค 5.1.2.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ่มหนี้ 5.1.2.1 ก 5.1.2.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ่มหนี้ 5.1.2.2 ข - ค 5.1.3 ลูกหนี้พ้นกำหนดมากกว่า 30 วัน 5.1.3 ข - ค 5.2 ลูกหนี้บัญชีมารจิ้น ก. มูลหนี้ ข. หลักประกัน ค. ค่าความเสี่ยง 5.2.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ่มหนี้ 1.เงินกู้ยืม 1.หลักประกัน 5.2.1 ก1 + ก2 ข้อ 5.1.1 + 5.1.2.1 + 5.1.2.2 + 5.2.1 + 5.2.2 5.2.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ่มหนี้ 2.หลักทรัพย์ที่ให้อืม 2.หลักทรัพย์ที่ให้อืม 5.2.2 ข - ค1 - ค2 5 5.2.2.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ่มหนี้ 1.เงินกู้ยืม 1.หลักประกัน 5.2.2.1 ก1 + ก2 ข้อ 5.1.1 + 5.1.2.1 + 5.1.2.2 + 5.2.1 + 5.2.2 5.2.2.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ่มหนี้ 2.หลักทรัพย์ที่ให้อืม 2.หลักทรัพย์ที่ให้อืม 5.2.2.2 ข - ค1 - ค2 5 6 ลูกหนี้ธุรกิจยืมและให้อืมหลักทรัพย์ ก. มูลหนี้ ข. หลักประกัน ค. ค่าความเสี่ยง 6.1 ลูกหนี้ยืมหลักทรัพย์ 1.หลักประกัน 6.1.1 ก 6.1.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ่มหนี้ 2.หลักทรัพย์ที่อืม 6.1.1 ก 6.1.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ่มหนี้ 1.หลักประกัน 6.1.2 ข - ค1 - ค2 6.1.2.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ่มหนี้ 2.หลักทรัพย์ที่อืม 6.1.2.1 ข - ค1 - ค2 6.2 ลูกหนี้ทรัพย์สินวางประกัน ก. หลักทรัพย์สิน ข. หลักประกัน ค. ค่าความเสี่ยง 6.2.1 กรณีปกติ 6.2.1 ข ข้อ 6.1.1 + 6.1.2 + 6.2.1 + 6.2.2 6.2.2 กรณีวางหลักประกันไว้เกิน 6.2.2 120% ก + ค 6 7 ลูกหนี้ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ก. มูลหนี้ ค. ค่าความเสี่ยง 7 ก - ค 8 ลูกหนี้สำนักหักบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (TCH) 8.1 ข้อ 8.1 + 8.2 8.1 ลูกหนี้ที่เกิดจากการซื้อขายหลักทรัพย์ 8.2 8 8.2 ลูกหนี้ทรัพย์สินวางประกัน/เพื่อความมั่นคง 8.2 8 9 ลูกหนี้สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า 9.1 ข้อ 9.1 + 9.2 9.1 ลูกหนี้ที่เกิดจากการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า 9.2 9 9.2 ลูกหนี้ทรัพย์สินวางประกัน/เพื่อความมั่นคง 9.2 9 10 ลูกหนี้ระหว่างบริษัทหลักทรัพย์ 10 10 10.1 ลูกหนี้ระหว่างบริษัทหลักทรัพย์ 10.1 10 11 ลูกหนี้อื่น 11 11 11.1 ลูกหนี้อื่น 11.1 11 12 สินทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับบริษัทย่อย 12 12 12.1 สินทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับบริษัทย่อย 12.1 12									

หมายเหตุ ในการจัดทำรายงานในหน้า 1 ของส่วนที่ 1 ให้แยกสินทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับบริษัทย่อยออกจากข้อ 1-11 โดยให้แสดงในข้อ 12 แทน

การปรับค่าความเสี่ยง

13 ความเสี่ยง : จากการกระจุกตัวของลูกหนี้มาร์จิ้น	ก. มูลหนี้	ข. 3.5 เท่าของเงินกองทุน	ก. - ข.	13
14 ความเสี่ยง : จากการมีธุรกรรมขายหลักทรัพย์โดยมีสัญญาจะซื้อคืน	ก. หลักทรัพย์	ข. ราคาซื้อคืน ณ ปัจจุบัน		
14.1 กรณีปกติ				
14.2 กรณีหลักทรัพย์ที่ขาย > 150% ราคาซื้อคืน			14.2 ก - 150% 14.2 ข	14
15 ความเสี่ยง : จากการรับประกันการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์	(จากข้อ 3 ข ของส่วนที่ 4)			15
16 ความเสี่ยง : จากการมีฐานะเงินตราต่างประเทศและทองคำ	(จากข้อ 2 ของส่วนที่ 5)			16
17 ความเสี่ยง : จากส่วนขาดของบริษัทย่อย	(จากข้อ 4 ของส่วนที่ 6)			17
18 ความเสี่ยง : จากการเป็นผู้ประกันของกองทุนรวมมีประกัน	(จากวิธีที่ 1 หรือวิธีที่ 2 ของส่วนที่ 8)			18
19 ความเสี่ยง : จากการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า				19
20 ความเสี่ยง : จากการจัดการลงทุน	ก. มูลค่าความเสี่ยง	ข. PII		20
21 สินทรัพย์สภาพคล่องสุทธิ	(ผลรวมตั้งแต่ข้อ 1 ถึง ข้อ 12) หักด้วย (ผลรวมตั้งแต่ข้อ 13 ถึง ข้อ 20)			21
22 หัก หนี้สินรวม	(จากข้อ 13 ของส่วนที่ 2)			22
23 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ	(ข้อ 21 - ข้อ 22)			23
24 เงินกองทุนขั้นต่ำคงที่				24
25 หนี้สินทั่วไป	(จากข้อ 19 ของส่วนที่ 2)			25
26 ทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน				26
27 เงินกองทุนขั้นต่ำจากธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	(7% ของ ข้อ 25 + ข้อ 26)			27
28 เงินกองทุนขั้นต่ำจากธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล	(จากข้อ 2.1 ของส่วนที่ 9 หรือข้อ 4 ของส่วนที่ 9 แล้วแต่กรณี)			28
29 เงินกองทุนขั้นต่ำที่ต้องดำรงเพิ่มเติมจากการเก็บสินทรัพย์ดิจิทัลใน hot wallet ที่เกิน adjusted NC	(จากข้อ 2.3ข. ของส่วนที่ 9)			29
30 อัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน	(ข้อ 23 / ข้อ 25 + ข้อ 26) (%)			30

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

.....(ผู้มีอำนาจลงนาม)

()

ตำแหน่ง

วันที่

ผู้จัดทำ.....

หน่วยงาน..... โทร.

หนี้สินรวม

1. เงินกู้ยืม (ไม่รวมเงินกู้ยืมด้วยสิทธิ)

1.1 จากสถาบันการเงินในประเทศ

1.1.1 ธนาคารพาณิชย์

1.1.2 สถาบันการเงินอื่น

1.2 จากต่างประเทศ

2. หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืน

3. เจ้าหนี้ขายหลักทรัพย์ตามคำสั่ง (บัญชีเงินสด)

4. เจ้าหนี้ธุรกิจยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

4.1 เจ้าหนี้หลักทรัพย์ยืม

4.2 เจ้าหนี้ทรัพย์สินวางประกัน

5. บัญชีลูกค้า

5.1 ธุรกิจหลักทรัพย์

5.2 เจ้าหนี้ธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

5.3 ธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล

6. เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (TCH)

7. เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

8. เจ้าหนี้ระหว่างบริษัทหลักทรัพย์

9. หุ้นกู้และตราสารหนี้อื่น (ไม่รวมหุ้นกู้/ตราสารหนี้ด้วยสิทธิ)

10. หนี้สินอื่น

10.1 ดอกเบี้ยค้างจ่าย

10.2 ภาษีและค่าใช้จ่ายค้างจ่าย

10.3 ผลต่างบัญชีระหว่างสำนักงานใหญ่และสาขา

10.4 เงินกู้ยืมจากกรรมการหรือบริษัทในเครือ

10.5 อื่นๆ

11. ภาระผูกพัน

12. หนี้สินอนุพันธ์ทางการเงิน

13. หนี้สินรวม¹ (ผลรวมของข้อ 1 ถึง ข้อ 11)

หนี้สินพิเศษ

14. เงินกู้ยืม / หุ้นกู้ ส่วนที่ได้มีการวางหลักประกันไว้กับเจ้าหนี้แล้ว

15. หนี้สินพิเศษตามที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศกำหนด

16. ภาระผูกพัน ส่วนที่ได้มีการวางหลักประกันไว้กับเจ้าหนี้แล้ว

17. หนี้สินพิเศษอื่น

18. รวมหนี้สินพิเศษ (ผลรวมของข้อ 14 ถึง ข้อ 17)

หนี้สินทั่วไป

19. หนี้สินทั่วไป² (ข้อ 13 + ข้อ 12 หักด้วย ข้อ 18)

หมายเหตุ ¹ หนี้สินรวมในข้อ 13 ไม่รวมหนี้สินอนุพันธ์ทางการเงินในข้อ 12 เนื่องจากหนี้สินดังกล่าวถูกนำไปรวมคำนวณเป็นส่วนหนึ่งของเงินลงทุนในลักษณะ

portfolio concept แล้ว

² หนี้สินทั่วไปตามข้อ 19 จะเท่ากับผลรวมของหนี้สินรวมตามข้อ 13 และหนี้สินอนุพันธ์ทางการเงินในข้อ 12 หักด้วยหนี้สินพิเศษตามข้อ 18

ทั้งนี้ จะต้องนำหนี้สินอนุพันธ์ทางการเงินมารวมด้วยเพื่อให้ผู้ประกอบการธุรกิจต้องดำรง cushion สำหรับหนี้สินในส่วนนี้เพิ่มเติมด้วย

รายละเอียดเงินลงทุน
หมวดที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง

ส่วนที่ 3

หน้า 1

หน่วย : บาท

1 ตราสารทุนและตราสารที่อ้างอิงกับตราสารทุน (equity and equity-linked instruments)

มูลค่าสินทรัพย์

1.1 หุ้นสามัญ / หุ้นบุริมสิทธิ

1.1.1 หุ้นใน SET 50 และหุ้นต่างประเทศในกลุ่ม I

1.1.2 หุ้นใน SET 100 แต่อยู่นอก SET 50 และหุ้นต่างประเทศในกลุ่ม II

1.1.3 หุ้นนอก SET 100 และหุ้นต่างประเทศในกลุ่ม III

1.1.4 หุ้นใน LIVE Exchange

1.1.5 หุ้นซึ่งจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศนอกกลุ่ม I II และ III

1.1.6 หุ้นอื่น ๆ

	1.1

1.2 ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น โดยมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็น

1.2.1 หุ้นใน SET 50 และหุ้นต่างประเทศในกลุ่ม I

1.2.2 หุ้นนอก SET 50 และหุ้นต่างประเทศนอกกลุ่ม I ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์

1.2.3 หุ้นอื่น ๆ

	1.2

1.3 อนุพันธ์ในตราสารทุน

1.3.1 ออปชันในตราสารทุน / ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ก. มูลค่าบวก ข. มูลค่าลบ ค. มูลค่าสุทธิ

1.3.1.1 stock options / derivative warrants on individual stock

1.3.1.2 basket options / basket warrants

1.3.1.3 index options / index warrants

1.3.2 สัญญาฟอร์เวิร์ดในตราสารทุน

1.3.3 สัญญาสวอปในตราสารทุน

1.3.4 อื่น ๆ

			1.4

รวม ตราสารทุนและตราสารที่อ้างอิงกับตราสารทุน

	1
--	---

2 ตราสารหนี้และตราสารที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ย (debt and interest rate-linked instruments)

2.1 ตราสารหนี้ทั่วไป

2.1.1 หลักทรัพย์รัฐบาลไทย และที่รัฐบาลไทยค้ำประกัน

2.1.2 credit rating AAA / A-1 หรือเทียบเท่า

2.1.3 credit rating AA A / A-2 หรือเทียบเท่า

2.1.4 credit rating BBB / A-3 หรือเทียบเท่า

2.1.5 credit rating BB B (ระยะยาว) / B (ระยะสั้น) หรือเทียบเท่า

2.1.6 issue ที่มี risk premium ตามที่สำนักงานกำหนด

2.1.7 อื่น ๆ ที่ไม่เข้าข่ายตามข้างต้น

	2.1

2.2 ตราสารหนี้ที่มีการผิมนัดชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ย

	2.2
--	-----

2.3 หุ่นแปลงสภาพ

2.4 อนุพันธ์ในตราสารหนี้ / อัตราดอกเบี้ย

2.4.1 ออปชั่นในตราสารหนี้ / อัตราดอกเบี้ย

2.4.1.1 bond options

2.4.1.2 bond basket options

2.4.1.3 bond index options

2.4.1.4 interest rate options

2.4.2 สัญญาฟอว์เวิร์ดในตราสารหนี้ / อัตราดอกเบี้ย

2.4.3 สัญญาสวอปในตราสารหนี้ / อัตราดอกเบี้ย

2.4.4 อื่น ๆ

รวม ตราสารหนี้และตราสารที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ย

ก. มูลค่าบวก ข. มูลค่าลบ ค. มูลค่าสุทธิ

--	--	--

2.3

2.4

2

3. ทองคำ / อนุพันธ์ในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

3.1 ทองคำ

3.2 ออปชั่นในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

3.3 สัญญาฟอว์เวิร์ดในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

3.4 สัญญาสวอปในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

3.5 อื่น ๆ

รวม ทองคำ/อนุพันธ์ในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

ก. มูลค่าบวก ข. มูลค่าลบ ค. มูลค่าสุทธิ

3.1

3.2

3.3

3.4

3.5

3

4 อนุพันธ์ในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

4.1 ออปชั่นในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

4.2 สัญญาฟอว์เวิร์ดในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

4.3 สัญญาสวอปในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

4.4 อื่น ๆ

รวม สินค้าโภคภัณฑ์ / อนุพันธ์ในสินค้าและตัวแปรอื่น

ก. มูลค่าบวก ข. มูลค่าลบ ค. มูลค่าสุทธิ

4.1

4.2

4.3

4.4

4

5 หน่วยลงทุน / หน่วยทรัสต์

5.1 กองทุน / กองทรัสต์ P.O. ที่จดทะเบียนในตลาดหรือได้ถอนได้ทุกวันทำการ

5.1.1 กองทุนรวมตลาดเงิน

5.1.2 กองทุนรวมตราสารแห่งหนี้ / กองทุนรวมอิตีเอฟที่อ้างอิงตราสารหนี้

5.1.3 กองทุนรวมตราสารแห่งทุน / กองทุนรวมอิตีเอฟที่มีได้อ้างอิงกับตราสารหนี้

กองทุนรวมอื่นๆ และกองทรัสต์

5.2 กองทุน P.O. ที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดและไม่สามารถถอนได้ทุกวันทำการ

5.2.1 กองทุนรวมตราสารแห่งหนี้

5.2.2 กองทุนรวมอื่นๆ

5.3 กองทุน / กองทรัสต์ P.P.

รวม หน่วยลงทุน / หน่วยทรัสต์

5.1

5.2

5.3

5

รวม สินทรัพย์สภาพคล่อง (ให้นำไปใส่ไว้ในข้อ 4 ก ของส่วนที่ 1)

1 + 2 + 3 + 4 + 5

หมวดที่ 2 : ค่าความเสี่ยง

1. Position Risk

ค่าความเสี่ยง

1.1 ตราสารทุนและตราสารที่อ้างอิงกับตราสารทุน

1.1.1 ตราสารตามข้อ 1 ของหมวดที่ 1 ยกเว้น ข้อ 1.1.6 และ 1.2.3

(รายละเอียดการคำนวณดูตามตารางแสดง position risk สำหรับ equity และ equity-linked instruments)*

1.1.2 ตราสารตาม ข้อ 1.1.6 และ 1.2.3 ของหมวดที่ 1 (ตราสารที่มีอัตราความเสี่ยง 100%)

1.2 ตราสารหนี้และตราสารที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ย

1.2.1 ตราสารตามข้อ 2.1 2.3 และ 2.4 ของหมวดที่ 1

(รายละเอียดการคำนวณดูตามตารางแสดง position risk สำหรับ debt และ interest rate-linked instruments)*

1.2.2 ตราสารตามข้อ 2.2 ของหมวดที่ 1 (ตราสารหนี้ที่มีการผิมนัดชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ย)

1.3 อนุพันธ์ในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

1.4 อนุพันธ์ในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

1.5 หน่วยลงทุน / หน่วยทรัสต์

Total Position Risk

*ไม่ต้องนำส่งสำนักงานแต่ให้เก็บไว้เป็นหลักฐานให้สามารถตรวจสอบได้

2. Counterparty Risk on Derivatives

คู่สัญญา	(ก) counterparty exposure รวม ⁽¹⁾	(ข) nettable amount ⁽²⁾	(ค) acceptable collateral ⁽³⁾	(ง) net counterparty exp.	(จ) ค่าความเสี่ยง (ง) * %h/c
2.1 หลักทรัพย์รัฐบาลไทย และที่รัฐบาลไทยค้ำประกัน (h/c = 0%)	(ก)-(ข)-(ค)				
-					
2.2 credit rating AAA / A-1 หรือเทียบเท่า (รัฐบาล h/c = 0% , เอกชน h/c = 0.5%)					
-					
2.3 credit rating AA A / A-2 หรือเทียบเท่า (รัฐบาล h/c ตามอายุคงเหลือ, เอกชน h/c = 2.5%)					
-					
2.4 credit rating BBB / A-3 หรือเทียบเท่า (รัฐบาล h/c ตามอายุคงเหลือ, เอกชน h/c = 8%)					
-					
2.5 credit rating BB B (ระยะยาว) / B (ระยะสั้น) หรือเทียบเท่า (รัฐบาล h/c = 8% , เอกชน h/c = 12%)					
-					
2.6 issue ที่มี risk premium ตามที่สำนักงานกำหนด (h/c = 15%)					
-					
2.7 อื่น ๆ ที่ไม่เข้าข่ายตามข้างต้น (รัฐบาล h/c = 12% , เอกชน h/c = 45%, default h/c = 100%)					
-					
Total Counterparty Risk	2.1 + 2.2 + 2.3 + 2.4 + 2.5 + 2.6 + 2.7				2

หมายเหตุ

⁽¹⁾ counterparty exposure รวม เท่ากับ ผลรวมของ counterparty exposure ที่คำนวณได้ของทุกคู่สัญญา ตามตารางที่ 9 : Counterparty exposure สำหรับการคำนวณ Counterparty risk

⁽²⁾ nettable amount หมายถึง จำนวนที่น้อยกว่าระหว่างผลรวมของ positive replacement cost กับ absolute value ของผลรวมของ negative replacement cost ของทุกคู่สัญญา

⁽³⁾ acceptable collateral หมายถึง หลักประกันตามที่สำนักงานกำหนดหลังหักค่าความเสี่ยง

3. Large Exposure Risk

3.1 วิธีที่ 1

(ก)	(ข)	(ค)	(ง)	(จ)	(ฉ)	(ช)
รายชื่อหลักทรัพย์	long	short	net	ฐานในการคำนวณ ⁽¹⁾	(ง) / (จ)	ค่าความเสี่ยง
หุ้น A						
warrant A						
derivative warrant A						
หุ้นกู้ B						
หุ้นกู้แปลงสภาพ C						
Large Exposure Risk ตามวิธีที่ 1						3.1

หมายเหตุ ⁽¹⁾ ฐานในการคำนวณ หมายถึง มูลค่าหุ้นที่ออกและเรียกชำระแล้ว หรือ issue amount แล้วแต่กรณี

3.2 วิธีที่ 2 (เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของบริษัท ⁽¹⁾ =(ก).....)

(ข)	(ค)	(ง)	(จ)	(ฉ)	(ช)
รายชื่อบุคคล	issuer	counterparty	exposure	(จ) / (ก)	ค่าความเสี่ยง
	exposures ⁽²⁾	exposures ⁽³⁾	รวม ⁽⁴⁾	(%)	
(ค) + (ง)					
Large Exposure Risk ตามวิธีที่ 2					
Total Large Exposure Risk (ผลรวมของจำนวนที่สูงกว่าระหว่างวิธีที่ 1 และ วิธีที่ 2 สำหรับ large exposure risk ที่มีต่อบุคคลเดียวกัน)					
Net Large Exposure Risk (3 ก หักด้วย excess large exposure risk) ⁽⁵⁾					
รวม ค่าความเสี่ยง (Position risk + Counterparty risk + Large exposure risk) (ให้นำไปใส่ไว้ในข้อ 4 ข ของส่วนที่ 1) 1 + 2 + 3 ข					

หมายเหตุ ⁽¹⁾ เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของบริษัท ณ วันทำการก่อนวันที่จัดทำรายงาน 1 วัน (T-1) ก่อนหักค่าความเสี่ยง large exposure risk ของวันดังกล่าว

⁽²⁾ หมายถึง exposure จากการมีสถานะเงินลงทุนในหลักทรัพย์หรือตราสารที่ออกโดยบุคคลตาม (ข) รวมถึงสถานะเทียบเท่าหลักทรัพย์หรือตราสารจากการมีสถานะอนุพันธ์ทางการเงินที่อ้างอิงอยู่กับหลักทรัพย์หรือตราสารที่ออกโดยบุคคลตาม (ข) ทั้งนี้ สามารถหักลบได้ระหว่าง long และ short position

⁽³⁾ ยกมาจากการคำนวณ counterparty exposure ตามข้อ 2 (ง) : net counterparty exposure

⁽⁴⁾ exposure รวมไม่สามารถหักลบระหว่าง issuer exposures และ counterparty exposures

⁽⁵⁾ หมายถึง large exposure risk ที่ทำให้ค่าความเสี่ยงรวมของหลักทรัพย์หรืออนุพันธ์ประเภทอปชั่นเฉพาะด้าน long position ไม่เกินมูลค่าสินทรัพย์สภาพคล่องของหลักทรัพย์หรืออนุพันธ์ดังกล่าว

ชื่อหลักทรัพย์

ก. มูลค่าที่ใช้เป็นฐาน ข. ค่าความเสี่ยง
ในการคำนวณ จากการรับประกัน
การจัดจำหน่าย

1. ตราสารหนี้/ตราสารหนี้ที่มีลักษณะคล้ายทุน

1.1 หลักทรัพย์รัฐบาลหรือองค์การของรัฐ/ตราสารหนี้

ที่มีสถาบันการเงินรับรอง ค่าประกัน อ่าวล/มีประกันเต็ม

1.2 ตราสารหนี้ที่ไม่มีสถาบันการเงินรับรอง ค่าประกัน อ่าวล/มีประกันไม่เต็ม

2. ตราสารทุน/หลักทรัพย์อื่น

2.1 หลักทรัพย์ที่ไม่มีราคาตลาด

2.2 หลักทรัพย์ที่มีราคาตลาด

2.2.1 มูลค่าตามราคาเสนอขาย <= มูลค่าตามราคาตลาดหลังหักค่าความเสี่ยง

	มูลค่าตาม ราคาเสนอขาย	มูลค่าตาม ราคาตลาด	ค่าความเสี่ยง ของหลักทรัพย์	
				} 0%

2.2.2 มูลค่าตามราคาเสนอขาย > มูลค่าตามราคาตลาดหลังหักค่าความเสี่ยง

	มูลค่าตาม ราคาเสนอขาย	มูลค่าตาม ราคาตลาด	ค่าความเสี่ยง ของหลักทรัพย์	
				} (มูลค่าตามราคาเสนอขาย - มูลค่าตามราคาตลาด หลังหักค่าความเสี่ยง)

3. รวม

 3 ข

หมายเหตุ ให้บริษัททวงเลืบท่อย้ายชื่อหลักทรัพย์ด้วยว่าเป็นรายการที่เกิดขึ้นตามกรณีที่ 1 2 หรือ 3 ในคำอธิบาย

1. ฐานะเงินตราต่างประเทศแยกรายสกุลและทองคำ

1.1 ฐานะเงินตราต่างประเทศที่ไม่นำมาคำนวณค่าความเสี่ยง แยกรายสกุล

สกุลเงิน (US\$)		(US\$)(spot rate)		
ก. สิ้นทรัพย์ / long		ก.	ข.	ก. x ข.
1.				
2.				
รวม				

1.2 ฐานะเงินตราต่างประเทศที่นำมาคำนวณค่าความเสี่ยง แยกรายสกุล และทองคำ

สกุลเงิน (US\$)		(US\$)(spot rate)			ข. หนี้สิน / short		(US\$) (spot rate)		
ก. สิ้นทรัพย์ / long		ก.	ข.	ก. x ข.			ก.	ข.	ก. x ข.
1.					1.				
2.					2.				
3.					3.				
รวม					รวม				

สกุลเงิน (YEN)		(YEN) (spot rate)			ข. หนี้สิน / short		(YEN) (spot rate)		
ก. สิ้นทรัพย์ / long		ก.	ข.	ก. x ข.			ก.	ข.	ก. x ข.
1.					1.				
2.					2.				
3.					3.				
รวม					รวม				

ทองคำ

ก. สิ้นทรัพย์ / long		หน่วยทองคำ (spot rate)			ข. หนี้สิน / short		หน่วยทองคำ (spot rate)		
		ก.	ข.	ก. x ข.			ก.	ข.	ก. x ข.
1.					1.				
รวม					รวม				

2. สรุปฐานะเงินตราต่างประเทศและทองคำ เพื่อการคำนวณค่าความเสี่ยง

	(1)	(2)	(3) = (1) - (2)
สกุลเงิน/ทองคำ	สิ้นทรัพย์ / long	หนี้สิน / short	ยอดสุทธิ (บาท)
1. US\$			
2. YEN			
3. ทองคำ			

สกุลเงินหลัก

	บาท	
ก. ยอดรวมสุทธิที่เป็นสินทรัพย์		2ก. ผลรวมของยอดสุทธิของสกุลที่เป็น บวก
ข. ยอดรวมสุทธิที่เป็นหนี้สิน		2ข. ผลรวมของยอดสุทธิของสกุลที่เป็น ลบ (ใช้ค่าที่ไม่คำนึงถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)
ค. ค่าความเสี่ยง		2ค. 4% ของค่าที่มากกว่าระหว่าง 2ก. และ 2ข. (ใช้ค่าที่ไม่คำนึงถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)

สกุลเงินอื่น ๆ

	บาท	
ง. ยอดรวมสุทธิที่เป็นสินทรัพย์		2ง. ผลรวมของยอดสุทธิของสกุลที่เป็น บวก
จ. ยอดรวมสุทธิที่เป็นหนี้สิน		2จ. ผลรวมของยอดสุทธิของสกุลที่เป็น ลบ (ใช้ค่าที่ไม่คำนึงถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)
ฉ. ค่าความเสี่ยง		2ฉ. 8% ของค่าที่มากกว่าระหว่าง 2ง. และ 2จ. (ใช้ค่าที่ไม่คำนึงถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)

ทองคำ

	บาท	
ช. ยอดรวมสุทธิทองคำ		2ช. ผลรวมยอดดุลสุทธิทองคำที่เป็นยอดบวกหรือลบ (ใช้ค่าที่ไม่คำนึงถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)
ซ. ค่าความเสี่ยง		2ซ. 10% ของค่า 2ช. (ใช้ค่าที่ไม่คำนึงถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)
รวมค่าความเสี่ยง	$2ค + 2ฉ + 2ซ$	2

1. เงินลงทุน

	บริษัท	รายการ	(ก) มูลค่าสินทรัพย์
1.1	บริษัท ก.....	...หุ้นสามัญ..... ...หุ้นกู้.....	
1.2			
	รวมข้อ 1		

2. สินทรัพย์สภาพคล่องที่ใช้ในการสนับสนุนการดำเนินธุรกิจของบริษัทย่อย

	บริษัท	รายการ	(ก) มูลค่าสินทรัพย์	(ข) มูลค่าหลักประกัน หลังหักค่าความเสี่ยง	(ค) (ก) หรือ (ข) ที่ต่ำกว่า
2.1	บริษัท ก.....	P/N.....			
2.2					
	รวมข้อ 2				

3. เงินให้กู้ยืมแก่บริษัทย่อย

	บริษัท	รายการ	(ก) มูลหนี้	(ข) มูลค่าหลักประกัน หลังหักค่าความเสี่ยง	(ค) (ก) หรือ (ข) ที่ต่ำกว่า
3.1	บริษัท ก.....				
3.2					
	รวมข้อ 3				
	รวม ข้อ 1 ถึง 3 (ยกเว้นข้อ 12 ของส่วนที่ 1)		(ก)		(ค)

4. ค่าความเสี่ยงจากส่วนขาดของบริษัทย่อย

	บริษัท	ส่วนขาดของบริษัทย่อย
4.1	บริษัท ก.....	
4.2		
	รวมข้อ 4 (ยกเว้นข้อ 17 ของส่วนที่ 1)	

1.สินทรัพย์สภาพคล่องสุทธิ

(จากข้อ 21 ของ ส่วนที่ 1)

1

2.หนี้สินระยะสั้น

2

2.1 เงินเบิกเกินบัญชี

2.1

2.2 เงินกู้ยืมประเภททวงถาม

2.2

2.3 เงินกู้ยืมที่จะครบกำหนดชำระภายใน 1 เดือน

2.3.1

2.3.2

2.3.3

2.3.1

2.3.2

2.3.3

2.4 หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืนที่จะครบกำหนดสัญญาภายใน 1 เดือน

2.4

2.5 เจ้าหนี้ขายหลักทรัพย์ตามคำสั่ง (บัญชีเงินสด)

(จากข้อ 3 ของ ส่วนที่ 2)

2.5

2.6 เจ้าหนี้ธุรกิจยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

(จากข้อ 4 ของ ส่วนที่ 2)

2.6

2.7 บัญชีลูกค้า

(จากข้อ 5 ของ ส่วนที่ 2)

2.7

2.8 เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (TCH)

(จากข้อ 6 ของ ส่วนที่ 2)

2.8

2.9 เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(จากข้อ 7 ของ ส่วนที่ 2)

2.9

2.10 หนี้สินระยะสั้นอื่น ๆ (ที่จะครบกำหนดชำระภายใน 1 เดือน)

2.10

3.สินทรัพย์สภาพคล่องสุทธิหักด้วยหนี้สินระยะสั้น

(ข้อ 1 หักด้วย ข้อ 2)

3

4.วงเงินกู้ยืมคงเหลือ

4

4.1

4.1

4.2

4.2

4.3

4.3

แบบฟอร์ม ณ วันที่ 1 ก.ย. 68

1. สินทรัพย์ดิจิทัลของบริษัท (สำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลทุกประเภท)

	ก. มูลค่า	ข. ค่าความเสี่ยง	ค. มูลค่าสุทธิ
1.1 สินทรัพย์ดิจิทัล กลุ่มที่ 1			
1.2 สินทรัพย์ดิจิทัล กลุ่มที่ 2			
1.3 สินทรัพย์ดิจิทัล กลุ่มที่ 3			
1.4 สินทรัพย์ดิจิทัล กลุ่มที่ 4			
1.5 สินทรัพย์ดิจิทัล กลุ่มที่ 5			
1.6 สินทรัพย์ดิจิทัลที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการดำรงเงินกองทุน (same coin)			
รวม			

หมายเหตุ : ข้อ 1.6 สินทรัพย์ดิจิทัลที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการดำรงเงินกองทุน โดยเป็นชนิดเดียวกับของลูกค้า ไม่มีค่าความเสี่ยง

2. เงินกองทุนขั้นต่ำจากธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล กรณีเป็นผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลประเภทอื่นที่ไม่ใช่ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัล

		ค. มูลค่าของโทเคนดิจิทัล ที่เข้าเงื่อนไข				
2.1	เงินกองทุนขั้นต่ำจากทรัพย์สินลูกค้าและมูลค่าการซื้อขาย	ก. มูลค่า	ข. กรมธรรม์	ง. อัตรา	จ. เงินกองทุนขั้นต่ำ	
2.1.1	เงินกองทุนส่วนที่รองรับความเสี่ยงการเก็บรักษาสินทรัพย์ดิจิทัลใน hot wallet			การดำรง NC	ที่รองรับความเสี่ยงแต่ละประเภท	
2.1.1.1	สินทรัพย์ดิจิทัลใน hot wallet สำหรับสัดส่วนการเก็บสินทรัพย์ดิจิทัลใน hot wallet 0-5%					
2.1.1.2	สินทรัพย์ดิจิทัลใน hot wallet สำหรับสัดส่วนการเก็บสินทรัพย์ดิจิทัลใน hot wallet มากกว่า 5-10%					
2.1.1.3	สินทรัพย์ดิจิทัลใน hot wallet สำหรับสัดส่วนการเก็บสินทรัพย์ดิจิทัลใน hot wallet มากกว่า 10%					
	รวม					2.1.1
2.1.2	เงินกองทุนส่วนที่รองรับความเสี่ยงการเก็บรักษาสินทรัพย์ดิจิทัลใน cold wallet / 3rd party custodian					
2.1.2.1	สินทรัพย์ดิจิทัลใน cold wallet ส่วนที่เก็บเอง					
2.1.2.2	สินทรัพย์ดิจิทัลที่ฝากไว้กับ 3rd party custodian ในต่างประเทศ					
2.1.2.3	สินทรัพย์ดิจิทัลที่ฝากไว้กับ 3rd party custodian ที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของสำนักงาน					
	รวม					2.1.2
2.1.3	เงินกองทุนส่วนที่รองรับ trading service risk	ก. มูลค่า	ข. น้ำหนัก	ค. มูลค่าถ่วงน้ำหนัก	ง. กรมธรรม์	จ. เงินกองทุนขั้นต่ำ
						ที่รองรับความเสี่ยงแต่ละประเภท
2.1.3.1	trading value รายวันเฉลี่ยย้อนหลัง 90 วัน (30 วันที่ใกล้ปัจจุบันที่สุด)		50%	(ก. x ข.)		
2.1.3.2	trading value รายวันเฉลี่ยย้อนหลัง 90 วัน (30 วันถัดไป)		30%	(ก. x ข.)		
2.1.3.3	trading value รายวันเฉลี่ยย้อนหลัง 90 วัน (30 วันที่ไกลจากปัจจุบันที่สุด)		20%	(ก. x ข.)		
	เงินกองทุนที่ต้องดำรง (คิดจาก trading value เฉลี่ยถ่วงน้ำหนัก)			รวม 2.1.3.1ค. ถึง 2.1.3.3ค.		(ค. - ง.) x 2%
	รวมเงินกองทุนขั้นต่ำจากทรัพย์สินลูกค้าและมูลค่าการซื้อขาย			2.1.1 + 2.1.2 + 2.1.3		
2.2	มูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลสูงสุดที่สามารถเก็บได้ใน hot wallet แต่ละกระเป๋า (adjusted NC)			ข้อ 23 ของส่วนที่ 1 - ข้อ 27 ของส่วนที่ 1 - ข้อ 2.1.3 ของส่วนที่ 9		2.2
				ก. จำนวนกระเป๋า hot wallet ทั้งหมด		ข. รวมมูลค่าที่เกิน adjusted NC
2.3	เงินกองทุนขั้นต่ำที่ต้องดำรงเพิ่มเติมจากการเก็บสินทรัพย์ดิจิทัลใน hot wallet ที่เกิน adjusted NC (จากข้อ 3 ของส่วนที่ 9)					2.3ข.

4. เงินกองทุนขั้นต่ำจากธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล กรณีเป็นผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัล

		ค. มูลค่าของโทเคนดิจิทัล			ง. อัตราการดำรง NC	จ. เงินกองทุนขั้นต่ำ
		ก. มูลค่า	ข. กรมธรรม์	ที่เข้าเงื่อนไข		
4.1	มูลค่าทรัพย์สินลูกค้าที่ถูกจัดเก็บอยู่ใน hot wallet				100%	
4.2	มูลค่าทรัพย์สินลูกค้าที่ถูกจัดเก็บอยู่ใน cold wallet				1%	
รวม						4.

5. รายละเอียดโทเคนดิจิทัลที่เข้าเงื่อนไข (สำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลทุกประเภท)

ผลรวมมูลค่าของโทเคนดิจิทัลที่เข้าเงื่อนไขใน hot wallet (ให้นำไปใส่ไว้ในข้อ 2.1.1ค. หรือ ข้อ 4.1ค. ของส่วนที่ 9 แล้วแต่กรณี)

ผลรวมมูลค่าของโทเคนดิจิทัลที่เข้าเงื่อนไขใน cold wallet/3rd party custodian (ให้นำไปใส่ไว้ในข้อ 2.1.2ค. หรือ ข้อ 4.2ค. ของส่วนที่ 9 แล้วแต่กรณี)

ชื่อ	ชื่อย่อ	ประเภทของโทเคนดิจิทัล	ปริมาณโทเคนดิจิทัล (หน่วย)	ราคาซื้อขายสุดท้ายของวัน (บาทต่อหน่วย)	มูลค่าโทเคนดิจิทัลที่เข้าเงื่อนไข (บาท)
		Investment Token			
		Utility Token			

ตารางแสดง Position Risk สำหรับ Equity และ Equity-Linked Instruments
สำหรับบริษัทที่คำนวณ Position Risk ตามแบบที่ 2 วิธี Standardised Approach*

หน่วย : บาท

(ก)		(ค)			(ง)	(จ)				(ฉ)	(ช)	(ซ)	(ณ)	(ญ)
ลำดับที่	ตราสารทุน/อนุพันธ์	มูลค่าการลงทุน			ความผันผวน	กำไร/ขาดทุน (เพื่อคำนวณ general market risk)				ราคา	delta	สถานะเทียบเท่า	% specific risk	specific risk haircuts
		long	short	net	ของราคา (s)	Δprice = +8%		Δprice = -8%		สินทรัพย์อ้างอิง				
						Δσ = +25%	Δσ = -25%	Δσ = +25%	Δσ = -25%					
1	(หุ้น A)													
2	(หุ้น B)													
3	(หุ้น C)													
4	(หุ้น D)													
	(Warrant D)													
	(Derivative warrant D)													
	รวม													
5	(หุ้น E)													
	Forwards on หุ้น E													
	รวม													
6														
														
														
	รวม													
รวม										รวม				

หมายเหตุ : * รายงานฉบับนี้ใช้ประกอบแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิในส่วนของ 3 หมวดที่ 2 : ค่าความเสี่ยง ข้อ 1.1.1

บริษัทไม่ต้องยื่นรายงานฉบับนี้ต่อสำนักงาน แต่ต้องเก็บไว้เป็นหลักฐานเพื่อให้สำนักงานตรวจสอบได้

ตารางแสดง Position Risk สำหรับ Debt และ Interest Rate-Linked Instruments
สำหรับบริษัทที่คำนวณ Position Risk ตามแบบที่ 2 วิธี Standardised Approach*

หน่วย : บาท

(ก)	(ข)	(ค)		(ง)	(จ)	(ฉ)			(ช)	(ซ)	(ณ)	(ญ)
ลำดับที่	ตราสารหนี้/ สถานะเทียบเท่าตราสารหนี้	อายุคงเหลือ		อัตรา ดอกเบี้ย (%)	credit rating	สถานะ/สถานะเทียบเท่า			% general market risk	general market risk haircuts	% specific risk	specific risk haircuts
		ปี	เดือน			long	short	net				
1.	โซนที่ 1 (อายุคงเหลือ 0-12 เดือน) 0-3 เดือน - high coupon (หุ้นกู้ A) (long position ในหุ้นกู้ A จาก FRA)											
	รวม								0.10			
2.	- low coupon (หุ้นกู้ B)											
	รวม								0.10			
3.	- high coupon (หุ้นกู้ C)											
	รวม								0.15			
	มากกว่า 3 - 6 เดือน - high coupon											
	รวม								0.15			
	- low coupon											
	รวม								0.15			

หมายเหตุ : * รายงานฉบับนี้ใช้ประกอบแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิในส่วนที่ 3 หมวดที่ 2 : ค่าความเสี่ยง ข้อ 1.2.1

บริษัทไม่ต้องยื่นรายงานฉบับนี้ต่อสำนักงาน แต่ต้องเก็บไว้เป็นหลักฐานเพื่อให้สำนักงานตรวจสอบได้

	มากกว่า 6 - 9 เดือน - high coupon											
	รวม								0.25			
	- low coupon											
	รวม								0.25			
	มากกว่า 9 - 12 เดือน - high coupon											
	รวม								0.50			
	- low coupon											
	รวม								0.50			
(I) รวม ตราสารหนี้โซนที่ 1												

รวมค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้โซนที่ 1

(ซ) + (ญ)

ตารางแสดง Position Risk สำหรับ Debt และ Interest Rate-Linked Instruments
สำหรับบริษัทที่คำนวณ Position Risk ตามแบบที่ 2 วิธี Standardised Approach*

หน่วย : บาท

(n)	(ข)	(ค)		(ง)	(จ)	(ฉ)			(ช)	(ซ)	(ณ)	(ญ)
ลำดับที่	ตราสารหนี้/ สถานะเทียบเท่าตราสารหนี้	อายุคงเหลือ		อัตรา ดอกเบี้ย (%)	credit rating	สถานะ/สถานะเทียบเท่า			% general market risk	general market risk haircuts	% specific risk	specific risk haircuts
		ปี	เดือน			long	short	net				
1.	โซนที่ 2 (อายุคงเหลือ > 1 ปี) มากกว่า 1 - 3 ปี - high coupon (หุ้นกู้ D) (long position ในหุ้นกู้ D จาก FRA)											
	รวม								1.25			
2.	- low coupon (หุ้นกู้ E)											
	รวม								1.25			
3.	(หุ้นกู้ F)											
	รวม								1.25			
	มากกว่า 3 - 5 ปี - high coupon											
	รวม								2.50			
	- low coupon											
	รวม								2.50			
	มากกว่า 5 - 7 ปี - high coupon											
	รวม								3.50			
	- low coupon											
	รวม								3.50			
	มากกว่า 7 - 10 ปี - high coupon											
	รวม								4.00			
	- low coupon											
	รวม								5.00			
	มากกว่า 10 - 15 ปี - high coupon											
	รวม								5.00			
	- low coupon											
	รวม								6.50			
	มากกว่า 15 - 20 ปี - high coupon											
	รวม								6.00			
	- low coupon											
	รวม								8.50			
	มากกว่า 20 ปี - high coupon											
	รวม								7.00			
	- low coupon											
	รวม								10.00			
(II) รวม ตราสารหนี้โซนที่ 2												

รวมค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้โซนที่ 2

(ช) + (ญ)

รวมค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้โซนที่ 1 และโซนที่ 2