

ร่างแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

บริษัทจำกัด

ส่วนสรุป

ณ วันที่

หน่วย : บาท

ข้อมูลลักษณะการประกอบธุรกิจ	
1. ประเภทธุรกิจ	<input type="checkbox"/> หลักทรัพย์ / <input type="checkbox"/> สัญญาซื้อขายล่วงหน้า / <input type="checkbox"/> สินทรัพย์ค้ำประกัน
2. การเก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้า	(ก) เก็บทรัพย์สินลูกค้า / (ข) ไม่เก็บทรัพย์สินลูกค้า
3. มีการลงทุนเพื่อบริษัท	(ก) มีการลงทุน / (ข) ไม่มีการลงทุน
4. มีการระดมรับผิดชอบต่อระบบชำระราคา	(ก) มีการระ / (ข) ไม่มีการระ
5. วิธีการคำนวณค่าความเสี่ยง	(ก) Fixed-haircut approach / (ข) Standardized approach

ข้อมูลสรุปการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ	
6. เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (บาท)	
7. เงินกองทุนที่ต้องดำรง (มูลค่าที่สูงที่สุดระหว่างข้อ 24 27 และ 28) (บาท)	
8. มูลค่าหนี้สินโดยสิทธิที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวม (บาท)	
9. สัญญาเช่าที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวม (บาท)	
10. ส่วนของผู้ถือหุ้น (บาท)	
11. อัตราส่วนมูลค่าหนี้สินโดยสิทธิที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวม ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น (ข้อ 8 / ข้อ 10) (%)	
12. วงเงินผู้ถือหุ้น (บาท)	
13. อัตราส่วนมูลค่าหนี้สินและวงเงินผู้ถือหุ้น ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น (ข้อ (8+12) / ข้อ 10) (%)	

การปรับค่าความเสี่ยง

	ก. มูลหนี้	ข. 15% เงินกองทุน/15 ล้านบาท	
13 ความเสี่ยง : จากการระงับตัวของลูกหนี้มีาร์จัน	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/> 13
14 ความเสี่ยง : จากการมีธุรกรรมขายหลักทรัพย์โดยมีสัญญาจะซื้อคืน	ก. หลักทรัพย์	ข. ราคาซื้อคืน ณ ปัจจุบัน	
14.1 กรณีปกติ	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
14.2 กรณีหลักทรัพย์ที่ขาย > 150% ราคาซื้อคืน	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/> 14.2 ก - 150% 14.2 ข 14
15 ความเสี่ยง : จากการรับประกันการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์	(จากข้อ 3 ข ของส่วนที่ 4)	<input type="text"/>	<input type="text"/> 15
16 ความเสี่ยง : จากการมีฐานะเงินตราต่างประเทศและทองคำ	(จากข้อ 2 ง ของส่วนที่ 5)	<input type="text"/>	<input type="text"/> 16
17 ความเสี่ยง : จากส่วนขาดของบริษัทย่อย	(จากข้อ 4 ของส่วนที่ 6)	<input type="text"/>	<input type="text"/> 17
18 ความเสี่ยง : จากการเป็นผู้ประกันของกองทุนรวมมีประกัน	(จากวิธีที่ 1 หรือวิธีที่ 2 ของส่วนที่ 8)	<input type="text"/>	<input type="text"/> 18
19 ความเสี่ยง : จากการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า		<input type="text"/>	<input type="text"/> 19
	ก. มูลค่าความเสี่ยง	ข. PII	
20 ความเสี่ยง : จากการจัดการลงทุน	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/> 20
21 สินทรัพย์สภาพคล่องสุทธิ (ผลรวมตั้งแต่ข้อ 1 ถึง ข้อ 12)	หักด้วย (ผลรวมตั้งแต่ข้อ 13 ถึง ข้อ 20)	<input type="text"/>	<input type="text"/> 21
22 หัก หนี้สินรวม	(จากข้อ 13 ของส่วนที่ 2)	<input type="text"/>	<input type="text"/> 22
23 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ	(ข้อ 21 - ข้อ 22)	<input type="text"/>	<input type="text"/> 23
24 เงินกองทุนขั้นต่ำคงที่		<input type="text"/>	<input type="text"/> 24
25 หนี้สินทั่วไป	(จากข้อ 19 ของส่วนที่ 2)	<input type="text"/>	<input type="text"/> 25
26 ทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน		<input type="text"/>	<input type="text"/> 26
27 เงินกองทุนขั้นต่ำจากธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	(7% ของ ข้อ 24 + ข้อ 25)	<input type="text"/>	<input type="text"/> 27
28 เงินกองทุนขั้นต่ำจากสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้า	(จากข้อ 9.2 ของส่วนที่ 9)	<input type="text"/>	<input type="text"/> 28

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

	1.1.1		
	1.1.2	ข้อ 1.1.1 + 1.1.2 + 1.2	
	1.2		1

2. หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืน

2

3. เจ้าหนี้ขายหลักทรัพย์ตามคำสั่ง (บัญชีเงินสด)

3

4. เจ้าหนี้ธุรกิจยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

4.1 เจ้าหนี้หลักทรัพย์ยืม

4.1

ข้อ 4.1 + 4.2

4.2 เจ้าหนี้ทรัพย์สินวางประกัน

4.2

4

5. บัญชีลูกค้า

5.1 ธุรกิจหลักทรัพย์

5.1

5.2 เจ้าหนี้ธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

5.2

5.3 ธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล

5.3

5

6. เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (TCH)

6

7. เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

7

8. เจ้าหนี้ระหว่างบริษัทหลักทรัพย์

8

9. หุ้นกู้และตราสารหนี้อื่น (ไม่รวมหุ้นกู้ตราสารหนี้ด้วยสิทธิ)

9

10. หนี้สินอื่น

10.1 ดอกเบี้ยค้างจ่าย

10.1

10.2 ภาษีและค่าใช้จ่ายค้างจ่าย

10.2

10.3 ผลต่างบัญชีระหว่างสำนักงานใหญ่และสาขา

10.3

10.4 เงินกู้ยืมจากกรรมการหรือบริษัทในเครือ

10.4

ข้อ 10.1 + 10.2 + 10.3 + 10.4 + 10.5

10.5 อื่นๆ

10.5

10

11. ภาระผูกพัน

11

12. หนี้สินอนุพันธ์ทางการเงิน

12

13. หนี้สินรวม¹ (ผลรวมของข้อ 1 ถึง ข้อ 11)

13

หนี้สินพิเศษ

14. เงินกู้ยืม / หุ้นกู้ ส่วนที่ได้มีการวางหลักประกันไว้กับเจ้าหนี้แล้ว

14

15. หนี้สินพิเศษตามที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศกำหนด

15

16. ภาระผูกพัน ส่วนที่ได้มีการวางหลักประกันไว้กับเจ้าหนี้แล้ว

16

17. หนี้สินพิเศษอื่น

17

18. รวมหนี้สินพิเศษ (ผลรวมของข้อ 14 ถึง ข้อ 17)

18

หนี้สินทั่วไป

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

19

หมายเหตุ ¹ หนี้สินรวมในข้อ 13 ไม่รวมหนี้สินอนุพันธ์ทางการเงินในข้อ 12 เนื่องจากหนี้สินดังกล่าวถูกนำไปรวมคำนวณเป็นส่วนหนึ่งของเงินลงทุนในลักษณะ

portfolio concept แล้ว

² หนี้สินทั่วไปตามข้อ 19 จะเท่ากับผลรวมของหนี้สินรวมตามข้อ 13 และหนี้สินอนุพันธ์ทางการเงินในข้อ 12 หักด้วยหนี้สินพิเศษตามข้อ 18

ทั้งนี้ จะต้องนำหนี้สินอุปพันธ์ทางการเงินมารวมด้วยเพื่อให้ผู้ประกอบการธุรกิจต้องดำรง cushion สำหรับหนี้สินในส่วนนี้เพิ่มเติมด้วย

รายละเอียดเงินลงทุน
หมวดที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง

ส่วนที่ 3

หน้า 1

หน่วย : บาท

1 <u>ตราสารทุนและตราสารที่อ้างอิงกับตราสารทุน</u> (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 หุ้นซึ่งจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศนอกกลุ่ม I II และ III				
1.1.5 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				1.3
รวม ตราสารทุนและตราสารที่อ้างอิงกับตราสารทุน				1

2 <u>ตราสารหนี้และตราสารที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ย</u> (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

2.3 หุ้นกู้แปลงสภาพ

	2.3
--	-----

2.4 อนุพันธ์ในตราสารหนี้ / อัตราดอกเบี้ย

2.4.1 ออปชันในตราสารหนี้ / อัตราดอกเบี้ย

ก. มูลค่าบวก ข. มูลค่าลบ ค. มูลค่าสุทธิ

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

--	--	--

	2.4
--	-----

รวม ตราสารหนี้และตราสารที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ย

	2
--	---

3. ทองคำ / อนุพันธ์ในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

ก. มูลค่าบวก ข. มูลค่าลบ ค. มูลค่าสุทธิ

3.1 ทองคำ

	3.1
--	-----

3.2 ออปชันในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

--	--	--

3.2

3.3 สัญญาฟอว์เวิร์ดในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

--	--	--

3.3

3.4 สัญญาสวอปในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

--	--	--

3.4

3.5 อื่น ๆ

--	--	--

3.5

รวม ทองคำ/อนุพันธ์ในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

	3
--	---

4 อนุพันธ์ในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

ก. มูลค่าบวก ข. มูลค่าลบ ค. มูลค่าสุทธิ

4.1 ออปชันในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

--	--	--

4.1

4.2 สัญญาฟอว์เวิร์ดในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

--	--	--

4.2

4.3 สัญญาสวอปในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

--	--	--

4.3

4.4 อื่น ๆ

--	--	--

4.4

รวม สินค้าโภคภัณฑ์ / อนุพันธ์ในสินค้าและตัวแปรอื่น

	4
--	---

5 หน่วยลงทุน / หน่วยทรัสต์

5.1 กองทุน / กองทรัสต์ P.O. ที่จดทะเบียนในตลาดหรือได้ถอนได้ทุกวันทำการ

5.1.1 กองทุนรวมตลาดเงิน

--

5.1.2 กองทุนรวมตราสารแห่งนี้ / กองทุนรวมอิตีเอฟที่อ้างอิงตราสารหนี้

--

5.1.3 กองทุน Thai trust fund

--

5.1.4 กองทุนรวมตราสารแห่งทุน / กองทุนรวมอิตีเอฟที่มีได้อ้างอิงกับตราสารหนี้

--

	5.1
--	-----

กองทุนรวมอื่น ๆ และกองทรัสต์

5.2 กองทุน P.O. ที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดและไม่สามารถได้ถอนได้ทุกวันทำการ

5.2.1 กองทุนรวมตราสารแห่งนี้

--

5.2.2 กองทุนรวมอื่น ๆ

--

	5.2
--	-----

5.3 กองทุน / กองทรัสต์ P.P.

	5.3
--	-----

รวม หน่วยลงทุน / หน่วยทรัสต์

	5
--	---

รวม สินทรัพย์สภาพคล่อง (ให้นำไปใส่ไว้ในข้อ 4 ก ของส่วนที่ 1)

1 + 2 + 3 + 4 + 5

	5
--	---

หมวดที่ 2 : ค่าความเสี่ยง

1. Position Risk

ค่าความเสี่ยง

1.1	ตราสารทุนและตราสารที่อ้างอิงกับตราสารทุน				
1.1.1	ตราสารตามข้อ 1 ของหมวดที่ 1 ยกเว้น ข้อ 1.1.5 และ 1.2.3 (รายละเอียดการคำนวณดูตามตารางแสดง position risk สำหรับ equity และ equity-linked instruments)*				
1.1.2	ตราสารตาม ข้อ 1.1.5 และ 1.2.3 ของหมวดที่ 1 (ตราสารที่มีอัตราความเสี่ยง 100%)				1.1
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 (ตราสารหนี้ที่มีการผิดนัดชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ย)				1.2
1.3	อนุพันธ์ในเงินตราต่างประเทศและทองคำ				1.3
1.4	อนุพันธ์ในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น				1.4
1.5	หน่วยลงทุน / หน่วยทรัสต์				1.5
Total Position Risk		1.1 + 1.2 + 1.3 + 1.4 + 1.5			1

*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 อื่นๆ 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 ที่คำนวณได้ของทุกสัญญา ตามตารางที่ 9 : Counterparty exposure สำหรับการคำนวณ Counterparty risk

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

⁽³⁾ acceptable collateral หมายถึง หลักประกันตามที่สำนักงานกำหนดหลังหักค่าความเสี่ยง

3. Large Exposure Risk

3.1 วิธีที่ 1

(ก) รายชื่อหลักทรัพย์	(ข) long	(ค) short	(ง) net	(จ) ฐานในการ คำนวณ ⁽¹⁾	(ฉ) (ง) / (จ) (%)	(ช) ค่าความเสี่ยง
หุ้น A						
warrant A						
derivative warrant A						
หุ้น B						
หุ้นแปลงสภาพ 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) รายชื่อบุคคล	(ค) issuer exposures ⁽²⁾	(ง) counterparty exposures ⁽³⁾	(จ) exposure รวม ⁽⁴⁾	(ฉ) (จ) / (ก) (%)	(ช) ค่าความเสี่ยง
			(ค) + (ง)		
Large Exposure Risk ตามวิธีที่ 2					3.2
Total Large Exposure Risk (ผลรวมของจำนวนที่สูงกว่าระหว่างวิธีที่ 1 และ วิธีที่ 2 สำหรับ large exposure risk ที่มีต่อบุคคลเดียวกัน)					3 ก
Net Large Exposure Risk (3 ก หักด้วย excess large exposure risk) ⁽⁵⁾					3 ข
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

⁽²⁾ หมายถึง exposure จากการมีสถานะเงินลงทุนในหลักทรัพย์หรือตราสารที่ออกโดยบุคคลตาม (ข) รวมถึงสถานะเทียบเท่าหลักทรัพย์หรือตราสารจากการมีสถานะอนุพันธ์ทางการเงินที่อ้างอิงอยู่กับหลักทรัพย์หรือตราสารที่ออกโดยบุคคลตาม (ข) ทั้งนี้ สามารถหักกลบได้ระหว่าง 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 ที่ทำให้ค่าความเสี่ยงรวมของหลักทรัพย์หรืออนุพันธ์ประเภทอปชั่นทั้งหมดเฉพาะด้าน long position ไม่เกิน

มูลค่าสินทรัพย์สภาพคล่องของหลักทรัพย์หรืออนุพันธ์ดังกล่าว

ชื่อหลักทรัพย์

ก. มูลค่าที่ใช้เป็นฐาน
ในการคำนวณ

ข. ค่าความเสี่ยง
จากการรับประกัน
การจัดจำหน่าย

1. ตราสารหนี้/ตราสารหนี้ที่มีลักษณะคล้ายหุ้น

1.1 หลักทรัพย์รัฐบาลหรือองค์การของรัฐ/ตราสารหนี้

ที่มีสถาบันการเงินรับรอง ค่าประกัน อ่าวัด/มีประกันเต็ม

1.2 ตราสารหนี้ที่ไม่มีสถาบันการเงินรับรอง ค่าประกัน อ่าวัด/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

 } (มูลค่าตามราคาเสนอขาย
- มูลค่าตามราคาตลาด
หลังหักค่าความเสี่ยง)

3. รวม

 } 3 ข

หมายเหตุ ให้บริษัทวงเล็บต่อท้ายชื่อหลักทรัพย์ด้วยว่าเป็นรายการที่เกิดขึ้นตามกรณีที่ 1 2 หรือ 3 ในคำอธิบาย

1. ฐานะเงินตราต่างประเทศแยกรายสกุลและทองคำ

1.1 ฐานะเงินตราต่างประเทศที่ไม่นำมาคำนวณค่าความเสี่ยง แยกรายสกุล

สกุลเงิน (US\$)

	(US\$)(spot rate)		
	ก.	ข.	ก. x ข.
1.			
2.			
รวม			

1.2 ฐานะเงินตราต่างประเทศที่นำมาคำนวณค่าความเสี่ยง แยกรายสกุล และทองคำ

สกุลเงิน (US\$)

ก. สินทรัพย์ / long	(US\$)(spot rate)		
	ก.	ข.	ก. x ข.
1.			
2.			
3.			
รวม			

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

สกุลเงิน (YEN)

ก. สินทรัพย์ / long	(YEN) (spot rate)		
	ก.	ข.	ก. x ข.
1.			
2.			
3.			
รวม			

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

ทองคำ

ก. สินทรัพย์ / long	หน่วยทองคำ (spot rate)		
	ก.	ข.	ก. x ข.
1.			
รวม			

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

2. สรุปฐานะเงินตราต่างประเทศและทองคำ เพื่อการคำนวณค่าความเสี่ยง

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

บาท

ก. ยอดรวมสุทธิที่เป็นสินทรัพย์

--

2ก. ผลรวมของยอดสุทธิทุกสกุลที่เป็น บวก

ข. ยอดรวมสุทธิที่เป็นหนี้สิน

--

2ข. ผลรวมของยอดสุทธิทุกสกุลที่เป็น ลบ (ใช้ค่าที่ไม่ค่านิ่งถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)

ค. ยอดรวมสุทธิทองคำ

--

2ค. ผลรวมยอดสุทธิทองคำที่เป็นยอดบวกหรือลบ (ใช้ค่าที่ไม่ค่านิ่งถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)

ง. ค่าความเสี่ยง

--

2ง. 8% ของค่าที่มากกว่าระหว่าง 2 ก และ 2 ข บวกกับ 10% ของค่า 2ค. (ใช้ค่าที่ไม่ค่านิ่งถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)

1. เงินลงทุน

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

2. สินทรัพย์สภาพคล่องที่ใช้ในการสนับสนุนการดำเนินงานธุรกิจของบริษัทย่อย

	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 (ยกไปไว้ในข้อ 11 ของส่วนที่ 1)		(ก)	(ค)	

4. ค่าความเสี่ยงจากส่วนขาดของบริษัทย่อย

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

1. สินทรัพย์สภาพคล่องสุทธิ	(จากข้อ 19 ของ ส่วนที่ 1)	<input type="text"/>	1
2. หนี้สินระยะสั้น		<input type="text"/>	2
2.1 เงินเบิกเกินบัญชี		<input type="text"/>	2.1
2.2 เงินกู้ยืมประเภททวงถาม		<input type="text"/>	2.2
2.3 เงินกู้ยืมที่จะครบกำหนดชำระภายใน 1 เดือน			
2.3.1		<input type="text"/>	2.3.1
2.3.2		<input type="text"/>	2.3.2
2.3.3		<input type="text"/>	2.3.3
2.4 หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืนที่จะครบกำหนดสัญญาภายใน 1 เดือน		<input type="text"/>	2.4
2.5 เจ้าหนี้ขายหลักทรัพย์ตามคำสั่ง	(จากข้อ 3 ของ ส่วนที่ 2)	<input type="text"/>	2.5
2.6 เจ้าหนี้ธุรกิจยืมและให้ยืมหลักทรัพย์	(จากข้อ 4 ของ ส่วนที่ 2)	<input type="text"/>	2.6
2.7 บัญชีลูกค้า	(จากข้อ 5 ของ ส่วนที่ 2)	<input type="text"/>	2.7
2.8 เจ้าหนี้ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์	(จากข้อ 6 ของ ส่วนที่ 2)	<input type="text"/>	2.8
2.9 เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	(จากข้อ 7 ของ ส่วนที่ 2)	<input type="text"/>	2.9
2.10 หนี้สินระยะสั้นอื่น ๆ		<input type="text"/>	2.10
3. สินทรัพย์สภาพคล่องสุทธิหักด้วยหนี้สินระยะสั้น	(ข้อ 1 หักด้วย ข้อ 2)	<input type="text"/>	3
4. วงเงินกู้ยืมคงเหลือ		<input type="text"/>	4
4.1		<input type="text"/>	4.1
4.2		<input type="text"/>	4.2
4.3		<input type="text"/>	4.3

9.1 สินทรัพย์ดิจิทัลของบริษัท

	ก. มูลค่า	ข. ค่าความเสี่ยง	ค. มูลค่าสุทธิ	
9.1.1 สินทรัพย์ดิจิทัล กลุ่มที่ 1				
9.1.2 สินทรัพย์ดิจิทัล กลุ่มที่ 2				
9.1.3 สินทรัพย์ดิจิทัล กลุ่มที่ 3				
9.1.4 สินทรัพย์ดิจิทัล กลุ่มที่ 4				
9.1.5 อื่นๆ				9.1

9.2 เงินกองทุนชั้นต่ำจากสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้า

	ก. มูลค่า	ข. กรรมธรรม์	ค. มูลค่าสุทธิ	เงินกองทุนชั้นต่ำ
9.2.1 มูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลใน cold wallet				(9.2.1 ค. * 1%) +
9.2.2 มูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลใน hot wallet				(9.2.2 ค. * 5%)
				9.2

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

หน่วย : บาท

ลำดับที่	ตราสารทุน/อนุพันธ์	(ค) มูลค่าการลงทุน			(ง) ความผันผวน ของราคา (s)	(จ) กำไร/ขาดทุน (เพื่อคำนวณ general market risk)				(ฉ) ราคา สินทรัพย์ อ้างอิง	(ช) delta	(ซ) สถานะเทียบเท่า	(ฌ) % specific risk	(ญ) specific risk haircuts
		long	short	net		$\Delta\text{price} = +8\%$		$\Delta\text{price} = -8\%$						
						$\Delta\sigma = +25\%$	$\Delta\sigma = -25\%$	$\Delta\sigma = +25\%$	$\Delta\sigma = -25\%$					
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 : * รายงานฉบับนี้ใช้ประกอบแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิใน ส่วนที่ 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) ตราสารหนี้/ สถานะเทียบเท่าตราสารหนี้	(ค) อายุคงเหลือ		(ง) อัตรา ดอกเบี้ย (%)	(จ) credit rating	(ฉ) สถานะ/สถานะเทียบเท่า			(ช) % general market risk	(ฌ) general market risk haircuts	(ฎ) % specific risk	(ญ) 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)											
3.	(หุ้นกู้ C)											
	รวม								0.10			
	มากกว่า 3 - 6 เดือน - high coupon											
	รวม								0.15			
	- low coupon											
	รวม								0.15			

หมายเหตุ : * รายงานฉบับนี้ใช้ประกอบแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิในตอนที่ 3 หมวดที่ 2 : ค่าความเสี่ยง ข้อ 1.2.1

บริษัทไม่ต้องยื่นรายงานฉบับนี้ต่อสำนักงาน แต่ต้องเก็บไว้เป็นหลักฐานเพื่อให้สำนักงานตรวจสอบได้

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

หน่วย : บาท

(ก)	(ข) ตราสารหนี้/ สถานะเทียบเท่าตราสารหนี้	(ค) อายุคงเหลือ		(ง) อัตรา ดอกเบี้ย (%)	(จ) credit rating	(ฉ) สถานะ/สถานะเทียบเท่า			(ซ) % general market risk	(ฌ) general market risk haircuts	(ฎ) % specific risk	(ญ) specific risk haircuts
		ปี	เดือน			long	short	net				
	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

(ก)	(ข) ตราสารหนี้/ สถานะเทียบเท่าตราสารหนี้	(ค) อายุคงเหลือ		(ง) อัตรา ดอกเบี้ย (%)	(จ) credit rating	(ฉ) สถานะ/สถานะเทียบเท่า			(ช) % general market risk	(ฌ) general market risk haircuts	(ฉ) % specific risk	(ญ) 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)											
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				

ตารางแสดง Position Risk สำหรับ Debt และ Interest Rate-Linked Instruments

สำหรับบริษัทที่คำนวณ Position Risk ตามแบบที่ 2 วิธี Standardised Approach*

หน่วย : บาท

(ก) ลำดับที่	(ข) ตราสารหนี้/ สถานะเทียบเท่าตราสารหนี้	(ค) อายุคงเหลือ		(ง) อัตรา ดอกเบี้ย (%)	(จ) credit rating	(ฉ) สถานะ/สถานะเทียบเท่า			(ช) % general market risk	(ซ) general market risk haircuts	(ฌ) % specific risk	(ญ) specific risk haircuts
		ปี	เดือน			long	short	net				
	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

(ซ) + (ญ)

รวมค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้โซนที่ 1 และโซนที่ 2