

ร่างแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

บริษัทจำกัด

ณ วันที่

ส่วนสรุป

หน่วย : บาท

ข้อมูลลักษณะการประกอบธุรกิจ	
1. ประเภทธุรกิจ	<input type="checkbox"/> หลักทรัพย์ / <input type="checkbox"/> สัญญาซื้อขายล่วงหน้า / <input type="checkbox"/> สินทรัพย์ดิจิทัล
2. การเก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้า	
2.1 การเก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้าในธุรกิจหลักทรัพย์	(ก) เก็บทรัพย์สินลูกค้า / (ข) ไม่เก็บทรัพย์สินลูกค้า
2.2 การเก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้าในธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล	(ก) เก็บทรัพย์สินลูกค้า / (ข) ไม่เก็บทรัพย์สินลูกค้าหรือเก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้าแต่ไม่สามารถเข้าถึงหรือโอนทรัพย์สินดังกล่าวออกไปได้
3. มีการลงทุนเพื่อบริษัท	(ก) มีการลงทุน / (ข) ไม่มีการลงทุน
4. มีภาระความรับผิดชอบต่อระบบชำระราคา	(ก) มีภาระ / (ข) ไม่มีภาระ
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. วงเงินกู้โดยสิทธิ (บาท)	
13. อัตราส่วนมูลค่าหนี้สินและวงเงินกู้โดยสิทธิ ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น (ข้อ (8+12) / ข้อ 10) (%)	

เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

ส่วนที่ 1

หน้า 1

หน่วย : บาท

1	เงินสดและเงินฝากธนาคาร									
2	ตัวสัญญาใช้เงินและตัวแลกเงินที่ออกโดยสถาบันการเงิน									
3	หลักทรัพย์ซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน	ก. ราคาขายคืน ณ ปัจจุบัน	ข. หลักประกัน	ค. ค่าความเสี่ยง						
3.1	หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ่มหนี้				3.1	ก		ข้อ 3.1 + 3.2		
3.2	หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ่มหนี้				3.2	ข - ค				
4	เงินลงทุน (จากส่วนที่ 3)	ก. มูลค่าเงินลงทุน		ค. ค่าความเสี่ยง						
4/1	สินทรัพย์ดิจิทัล (จากส่วนที่ 9)	ก. มูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัล		ค. ค่าความเสี่ยง						
5	ลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง									
5.1	ลูกหนี้บัญชีเงินสด	ก. มูลหนี้		ค. ค่าความเสี่ยง						
5.1.1	ลูกหนี้ยังไม่พ้นกำหนดชำระ	1. cash account			5.1.1	ก1 + ก2 - ค				
		2. cash balance								
5.1.2	ลูกหนี้พ้นกำหนดชำระภายใน 30 วัน	ก. มูลหนี้	ข. หลักประกัน	ค. ค่าความเสี่ยง						
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									
5.2	ลูกหนี้บัญชีมาร์จิ้น	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		
		2.หลักทรัพย์ที่ให้อืม		2.หลักทรัพย์ที่ให้อืม				+ 5.2.1 + 5.2.2		
5.2.2	หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ่มหนี้	1.เงินกู้ยืม		1.หลักประกัน	5.2.2	ข - ค1 - ค2				
		2.หลักทรัพย์ที่ให้อืม		2.หลักทรัพย์ที่ให้อืม						
6	ลูกหนี้ธุรกิจอืมและให้อืมหลักทรัพย์									
6.1	ลูกหนี้อืมหลักทรัพย์	ก. มูลหนี้	ข. หลักประกัน	ค. ค่าความเสี่ยง						
6.1.1	หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ่มหนี้			1.หลักประกัน	6.1.1	ก				
				2.หลักทรัพย์ที่อืม						
6.1.2	หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ่มหนี้			1.หลักประกัน	6.1.2	ข - ค1 - ค2				
				2.หลักทรัพย์ที่อืม						
6.2	ลูกหนี้หลักทรัพย์สินวางประกัน	ก. หลักทรัพย์ที่อืม	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				
7	ลูกหนี้ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	ก. มูลหนี้		ค. ค่าความเสี่ยง						
8	ลูกหนี้สำนักหักบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (TCH)									
8.1	ลูกหนี้ที่เกิดจากการซื้อขายหลักทรัพย์				8.1			ข้อ 8.1 + 8.2		
8.2	ลูกหนี้ทรัพย์สินวางประกัน/เพื่อความมั่นคง				8.2					
9	ลูกหนี้สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า									
9.1	ลูกหนี้ที่เกิดจากการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า				9.1			ข้อ 9.1 + 9.2		
9.2	ลูกหนี้ทรัพย์สินวางประกัน/เพื่อความมั่นคง				9.2					
10	ลูกหนี้ระหว่างบริษัทหลักทรัพย์									
11	ลูกหนี้อื่น	ก. มูลหนี้	ข. ส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	ค. ค่าความเสี่ยง						
12	สินทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับบริษัทย่อย	ก. มูลค่าสินทรัพย์		ค. ส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						

การปรับค่าความเสี่ยง

13 ความเสี่ยง : จากการกระจุกตัวของลูกหนี้มาวจีน	ก. มุลหนี้	ข. 15% เงินกองทุน/15 ล้านบาท		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 ง 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 เงินกองทุนขั้นต่ำจากสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้า	(จากข้อ 9.2 ของส่วนที่ 9)			28

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

.....(ผู้มีอำนาจลงนาม)

()

ตำแหน่ง

วันที่

ผู้จัดทำ.....

หน่วยงาน..... โทร.

หนี้สินรวม

1. เงินกู้ยืม (ไม่รวมเงินกู้ยืมด้อยสิทธิ)

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 เจ้าหนี้ทรัพย์ลั่นวงประกัน

5. บัญชีลูกค้า

5.1 ธุรกิจหลักทรัพย์

5.2 เจ้าหนี้ธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

5.3 ธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล

6. เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (TCH)

7. เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

8. เจ้าหนี้ระหว่างบริษัทหลักทรัพย์

9. หนี้กู้และตราสารหนี้อื่น (ไม่รวมหนี้กู้/ตราสารหนี้ด้อยสิทธิ)

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 / หนี้กู้ 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 จะต้องนำหนี้สินอนุพันธ์ทางการเงินมารวมด้วยเพื่อให้ผู้ประกอบธุรกิจต้องดำรง cushion สำหรับหนี้สินในส่วนนี้เพิ่มเติมด้วย

รายละเอียดเงินลงทุน

ส่วนที่ 3

หมวดที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง

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 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	ตราสารหนี้ที่มีการมิดนิตชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ย			2.2

2.3 หนี้กู้แปลงสภาพ

	2.3
--	-----

2.4 อนุพันธ์ในตราสารหนี้ / อัตราดอกเบี้ย

2.4.1 ออปชันในตราสารหนี้ / 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

ก. มูลค่าบวก ข. มูลค่าลบ ค. มูลค่าสุทธิ

ก. มูลค่าบวก	ข. มูลค่าลบ	ค. มูลค่าสุทธิ

	2.4
--	-----

รวม ตราสารหนี้และตราสารที่อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ย

	2
--	---

3. ทองคำ / อนุพันธ์ในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

3.1 ทองคำ

3.2 ออปชันในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

3.3 สัญญาฟอว์เวิร์ดในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

3.4 สัญญาสวอปในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

3.5 อื่น ๆ

รวม ทองคำ/อนุพันธ์ในเงินตราต่างประเทศและทองคำ

ก. มูลค่าบวก ข. มูลค่าลบ ค. มูลค่าสุทธิ

ก. มูลค่าบวก	ข. มูลค่าลบ	ค. มูลค่าสุทธิ

	3
--	---

4 อนุพันธ์ในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

4.1 ออปชันในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

4.2 สัญญาฟอว์เวิร์ดในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

4.3 สัญญาสวอปในสินค้าโภคภัณฑ์และตัวแปรอื่น

4.4 อื่น ๆ

รวม สินค้าโภคภัณฑ์ / อนุพันธ์ในสินค้าและตัวแปรอื่น

ก. มูลค่าบวก ข. มูลค่าลบ ค. มูลค่าสุทธิ

ก. มูลค่าบวก	ข. มูลค่าลบ	ค. มูลค่าสุทธิ

	4
--	---

5 หน่วยลงทุน / หน่วยทรัสต์

5.1 กองทุน / กองทรัสต์ P.O. ที่จดทะเบียนในตลาดหรือได้ถอนได้ทุกวันทำการ

5.1.1 กองทุนรวมตลาดเงิน

5.1.2 กองทุนรวมตราสารแห่งหนึ่ง / กองทุนรวมอิตีเอฟที่อ้างอิงตราสารหนี้

5.1.3 กองทุน Thai trust fund

5.1.4 กองทุนรวมตราสารแห่งหนึ่ง / กองทุนรวมอิตีเอฟที่มีได้อ้างอิงกับตราสารหนี้

กองทุนรวมอื่นๆ และกองทรัสต์

5.2 กองทุน P.O. ที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดและไม่สามารถได้ถอนได้ทุกวันทำการ

5.2.1 กองทุนรวมตราสารแห่งหนึ่ง

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

	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

*ไม่ต้องนำเสนอสำนักงานแต่ให้เก็บไว้เป็นหลักฐานให้สามารถตรวจสอบได้

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)				
-	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
2.2 credit rating AAA / A-1 หรือเทียบเท่า (รัฐบาล h/c = 0% , เอกชน h/c = 0.5%)	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
-	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
2.3 credit rating AA A / A-2 หรือเทียบเท่า (รัฐบาล h/c ตามอายุคงเหลือ, เอกชน h/c = 1.5%)	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
-	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
2.4 credit rating BBB / A-3 หรือเทียบเท่า (รัฐบาล h/c ตามอายุคงเหลือ, เอกชน h/c = 8%)	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
-	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
2.5 credit rating BB B (ระยะยาว) / B (ระยะสั้น) หรือเทียบเท่า (รัฐบาล h/c = 8% , เอกชน h/c = 12%)	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
-	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
2.6 issue ที่มี risk premium ตามที่สำนักงานกำหนด (h/c = 15%)	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
-	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
2.7 อื่นๆ ที่ไม่เข้าข่ายตามข้างต้น (รัฐบาล h/c = 12% , เอกชน h/c = 75%, default h/c = 100%)	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
-	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Total Counterparty Risk	2.1 + 2.2 + 2.3 + 2.4 + 2.5 + 2.6 + 2.7				<input type="text"/> 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) 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						
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) 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)

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

⁽²⁾ หมายถึง exposure จากการมีสถานะเงินลงทุนในหลักทรัพย์หรือตราสารที่ออกโดยบุคคลตาม (ข) รวมถึงสถานะเทียบเท่าหลักทรัพย์ หรือตราสารจากการมีสถานะอนุพันธ์ทางการเงินที่อ้างอิงอยู่กับหลักทรัพย์หรือตราสารที่ออกโดยบุคคลตาม (ข) ทั้งนี้ สามารถหักกลับได้ระหว่าง long และ short position

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

⁽⁴⁾ exposure รวมไม่สามารถหักกลับระหว่าง issuer exposures และ counterparty exposures

⁽⁵⁾ หมายถึง large exposure risk ที่ทำให้ค่าความเสี่ยงรวมของหลักทรัพย์หรืออนุพันธ์ประเภทอปชั่นทั้งหมดเฉพาะด้าน long position ไม่เกินมูลค่าสินทรัพย์สภาพคล่องของหลักทรัพย์หรืออนุพันธ์ดังกล่าว

ชื่อหลักทรัพย์

ก. มูลค่าที่ใช้เป็นฐาน ในการคำนวณ ข. ค่าความเสี่ยง จากการรับประกัน การจัดจำหน่าย

1. ตราสารหนี้/ตราสารหนี้ที่มีลักษณะคล้ายทุน

1.1 หลักทรัพย์รัฐบาลหรือองค์การของรัฐ/ตราสารหนี้ ที่มีสถาบันการเงินรับรอง ค่าประกัน อวัล/มีประกันเต็ม

1.2 ตราสารหนี้ที่ไม่มีสถาบันการเงินรับรอง ค่าประกัน อวัล/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

ข. ยอดรวมสุทธิที่เป็นหนี้สิน

ค. ยอดรวมสุทธิทองคำ

ง. ค่าความเสี่ยง

2ก. ผลรวมของยอดสุทธิทุกสกุลที่เป็น บวก

2ข. ผลรวมของยอดสุทธิทุกสกุลที่เป็น ลบ (ใช้ค่าที่ไม่ค่านิ่งถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)

2ค. ผลรวมยอดดุลสุทธิทองคำที่เป็นยอดบวกหรือลบ (ใช้ค่าที่ไม่ค่านิ่งถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)

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

1. เงินลงทุน

	บริษัท	รายการ	(ก) มูลค่าสินทรัพย์
1.1	บริษัท ก.....	...หุ้นสามัญ..... ...หุ้นกู้.....	<input type="text"/> <input type="text"/>
1.2	<input type="text"/> <input type="text"/>
	รวมข้อ 1		<input type="text"/>

2. สินทรัพย์สภาพคล่องที่ใช้ในการสนับสนุนการดำเนินงานธุรกิจของบริษัทย่อย

	บริษัท	รายการ	(ก) มูลค่าสินทรัพย์	(ข) มูลค่าหลักประกัน หลังหักค่าความเสี่ยง	(ค) (ก) หรือ (ข) ที่ต่ำกว่า
2.1	บริษัท ก.....P/N.....	<input type="text"/> <input type="text"/>	<input type="text"/> <input type="text"/>	<input type="text"/> <input type="text"/>
2.2	<input type="text"/> <input type="text"/>	<input type="text"/> <input type="text"/>	<input type="text"/> <input type="text"/>
	รวมข้อ 2		<input type="text"/>		<input type="text"/>

3. เงินให้กู้ยืมแก่บริษัทย่อย

	บริษัท	รายการ	(ก) มูลหนี้	(ข) มูลค่าหลักประกัน หลังหักค่าความเสี่ยง	(ค) (ก) หรือ (ข) ที่ต่ำกว่า
3.1	บริษัท ก.....	<input type="text"/> <input type="text"/>	<input type="text"/> <input type="text"/>	<input type="text"/> <input type="text"/>
3.2	<input type="text"/> <input type="text"/>	<input type="text"/> <input type="text"/>	<input type="text"/> <input type="text"/>
	รวมข้อ 3		<input type="text"/>		<input type="text"/>
	รวม ข้อ 1 ถึง 3 (ยกไปไว้ในข้อ 11 ของส่วนที่ 1)		<input type="text"/> (ก)		<input type="text"/> (ค)

4. ค่าความเสี่ยงจากส่วนขาดของบริษัทย่อย

	บริษัท	ส่วนขาดของบริษัทย่อย
4.1	บริษัท ก.....	<input type="text"/> <input type="text"/>
4.2	<input type="text"/> <input type="text"/>
	รวมข้อ 4 (ยกไปไว้ในข้อ 17 ของส่วนที่ 1)	<input type="text"/>

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 อื่น ๆ			
รวม			9.1

9.2 เงินกองทุนขั้นต่ำจากสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้า

	ก. มูลค่า	ข. กรรมธรรม์	ค. มูลค่าสุทธิ	เงินกองทุนขั้นต่ำ
9.2.1 มูลค่าทรัพย์สินลูกค้าที่ถูกจัดเก็บอยู่ใน cold wallet				(9.2.1 ค. * 1%) +
9.2.2 มูลค่าทรัพย์สินลูกค้าที่ถูกจัดเก็บอยู่ในระบบอื่น ๆ				(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		$\Delta price = +8\%$		$\Delta price = -8\%$						
						$\Delta\sigma = +25\%$	$\Delta\sigma = -25\%$	$\Delta\sigma = +25\%$	$\Delta\sigma = -25\%$					
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 : * รายงานฉบับนี้ใช้ประกอบแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิในส่วนที่ 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	(ซ) general market risk haircuts	(ฌ) % 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 : * รายงานฉบับนี้ใช้ประกอบแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิในส่วนของ 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

(ก)	(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				
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								4.00			
	มากกว่า 7 - 10 ปี - high coupon											
	รวม								5.00			
	- low coupon											
	รวม								6.00			
	มากกว่า 10 - 15 ปี - high coupon											
	รวม								6.00			
	- low coupon											
	รวม								8.00			
	มากกว่า 15 - 20 ปี - high coupon											
	รวม								8.00			
	- low coupon											
	รวม								10.00			
	มากกว่า 20 ปี - high coupon											
	รวม								10.00			
	- low coupon											
	รวม								12.00			
	(II) รวม ตราสารหนี้โซนที่ 2											

รวมค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้โซนที่ 2

(ช) + (ญ)

รวมค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้โซนที่ 1 และโซนที่ 2
