

อัตราค่าความเสี่ยงที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินที่วางเป็นหลักประกัน (Haircut Rate)

1. เงินสดสกุลต่างประเทศ

Effective from 3 December 2024 onwards

รายการ	อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ)	การกำหนดอัตราแลกเปลี่ยน
เงินสดสกุลดอลลาร์สหรัฐอเมริกา (USD)	3.0	1. ให้ใช้อัตราแลกเปลี่ยนซื้อตัวเฉลี่ยเงินโอนของสกุลเงินนั้นที่ประกาศโดยธนาคารแห่งประเทศไทย ณ เวลา 18.00 น. ของวันที่คำนวณมูลค่า
เงินสดสกุลยูโรโซน (EUR)	2.4	2. หากไม่มีอัตราแลกเปลี่ยนตามข้อ 1 ให้ใช้อัตราแลกเปลี่ยนซื้อตัวเฉลี่ยเงินโอนของสกุลเงินนั้นที่ประกาศโดยธนาคารแห่งประเทศไทย ของวันทำการที่ใกล้ที่สุดกับวันที่คำนวณมูลค่า
เงินสดสกุลเยนญี่ปุ่น (JPY)	3.1	

2. หลักทรัพย์ประเภทตราสารทุน

Effective from 3 December 2024 onwards

ประเภทตราสารทุน*	อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ)	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุน	ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารทุนที่บุคคลต่างตัวเป็นผู้ถือ
(1) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET50 INDEX	22	1. ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า	1. ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างตัว เป็นผู้ถือ (Foreign) ในวันที่คำนวณมูลค่า หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันที่คำนวณมูลค่า
(2) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 INDEX แต่ไม่อยู่ใน SET50 INDEX	35	2. ในกรณีที่ไม่มีราคตามข้อ 1 ให้ใช้ราคาปิดในตลาด หลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น ณ เวลาปิดซื้อขายในวันทำการที่ใกล้ที่สุด	2. ในกรณีที่ไม่มีราคตามข้อ 1 ให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างตัวเป็นผู้ถือ (Foreign) ณ เวลาปิดซื้อขายในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาเสนอซื้อที่ดีที่สุดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ณ เวลาปิดซื้อขายในวันที่คำนวณมูลค่า
(3) หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี sSET INDEX	53	3. ในกรณีที่ไม่มีราคตามข้อ 1 ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ (Best Bid) ของหลักทรัพย์นั้น ณ เวลาปิดซื้อขายในวันทำการที่ใกล้ที่สุด	3. ในกรณีที่ไม่มีราคตามข้อ 2 ให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ ของหลักทรัพย์ที่บุคคลต่างตัวเป็นผู้ถือ (Foreign) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด หากไม่มีราคาดังกล่าวให้ใช้ราคาปิดในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์นั้น (Local) ในวันทำการที่ใกล้ที่สุด
(4) หุ้นสามัญอื่นๆ ที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนนอกจาก (1) - (3)	74		

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

3. หลักทรัพย์ประเภทตราสารหนี้

Effective from 3 December 2024 onwards

ประเภทตราสารหนี้	อัตราค่าความเสี่ยง (Haircut Rate) (ร้อยละ) ตามอายุคงเหลือของตราสารหนี้ (Time to Maturity)					ราคาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่าตราสารหนี้
	ไม่เกิน 1 ปี	มากกว่า 1 ปี แต่ไม่เกิน 3 ปี	มากกว่า 3 ปี แต่ไม่เกิน 7 ปี	มากกว่า 7 ปี แต่ไม่เกิน 10 ปี	มากกว่า 10 ปีขึ้นไป	
พันธบัตรรัฐบาลไทย หรือพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	0.5	2.5	1.0	1.0	2.0	ราคาอ้างอิงตามมูลค่ายุติธรรมของพันธบัตรซึ่งจัดทำและเผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย