

ร่างแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

บริษัท .....จำกัด

ส่วนสรุป

ณ วันที่ .....

หน่วย : บาท

ข้อมูลลักษณะการประกอบธุรกิจ	
1. ประเภทธุรกิจ	(ก) หลักทรัพย์ / (ข) สัญญาซื้อขายล่วงหน้า / (ค) หลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
2. การเก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้า	(ก) เก็บทรัพย์สินลูกค้า / (ข) ไม่เก็บทรัพย์สินลูกค้า
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. อัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (%)	
8. มูลค่าหนี้สินโดยสิทธิที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวม (บาท)	
9. สัญญาเช่าทางการเงินที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวม (บาท)	
10. ส่วนของผู้ถือหุ้น (บาท)	
11. อัตราส่วนมูลค่าหนี้สินโดยสิทธิที่ไม่นับเป็นหนี้สินรวม ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น (ข้อ 8 / 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				ก - ค	
5	ลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง	ก. มูลค่าหนี้		ค. ค่าความเสี่ยง					
5.1	ลูกหนี้บัญชีเงินสด	1. cash account			5.1.1	ก1 + ก2 - ค			
5.1.1	ลูกหนี้ยังไม่พ้นกำหนดชำระ	2. cash balance							
5.1.2	ลูกหนี้พ้นกำหนดชำระภายใน 30 วัน	ก. มูลค่าหนี้	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. มูลค่าหนี้	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	ลูกหนี้ธุรกิจอิมและให้อืมหลักทรัพย์	ก. มูลค่าหนี้	ข. หลักประกัน	ค. ค่าความเสี่ยง					
6.1	ลูกหนี้อืมหลักทรัพย์			1.หลักประกัน	6.1.1	ก			
6.1.1	หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ่มหนี้			2.หลักทรัพย์ที่อืม					
6.1.2	หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ่มหนี้			1.หลักประกัน	6.1.2	ข - ค1 - ค2			
				2.หลักทรัพย์ที่อืม					
6.2	ลูกหนี้ทรัพย์สินวางประกัน	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. มูลค่าหนี้		ค. ค่าความเสี่ยง				ก - ค	
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	ก. มูลค่าหนี้	ข. ส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	ค. ค่าความเสี่ยง					
11	ลูกหนี้อื่น							ข - ค	
12	สินทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับบริษัทย่อย	ก. มูลค่าสินทรัพย์		ค. ส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง				ค	

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

การปรับค่าความเสี่ยง

13 ความเสี่ยง : จากการกระจุกตัวของลูกหนี้มาจี้น	ก. มูลหนี้	ข. 15% เงินกองทุน/15 ล้านบาท		13
14 ความเสี่ยง : จากการมีธุรกรรมขายหลักทรัพย์โดยมีสัญญาจะซื้อคืน	ก. หลักทรัพย์	ข. ราคาซื้อคืน ณ ปัจจุบัน		14
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 หนี้สินทั่วไป	(จากข้อ 19 ของส่วนที่ 2)			24
25 ทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน				25
26 อัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไป	(ข้อ 23 / ข้อ 24) (%)			26
27 อัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไป และทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน	(ข้อ 23 / ข้อ 24 + ข้อ 25) (%)			27

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	<input style="width: 80px;" type="text"/> 1

2. หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืน

 2

3. เจ้าหนี้ขายหลักทรัพย์ตามคำสั่ง (บัญชีเงินสด)

 3

4. เจ้าหนี้ธุรกิจยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

4.1 เจ้าหนี้หลักทรัพย์ยืม

4.2 เจ้าหนี้ทรัพย์สินวางประกัน

	4.1	ข้อ 4.1 + 4.2
	4.2	<input style="width: 80px;" type="text"/> 4

5. บัญชีลูกค้า

5.1 ธุรกิจหลักทรัพย์

5.2 เจ้าหนี้ธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

	5.1	
	5.2	<input style="width: 80px;" type="text"/> 5

6. เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (TCH)

 6

7. เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

 7

8. เจ้าหนี้ระหว่างบริษัทหลักทรัพย์

 8

9. หนี้และตราสารหนี้อื่น (ไม่รวมหนี้/ตราสารหนี้ด้วยสิทธิ)

 9

10. หนี้สินอื่น

10.1 ดอกเบี้ยค้างจ่าย

10.2 ภาษีและค่าใช้จ่ายค้างจ่าย

10.3 ผลต่างบัญชีระหว่างสำนักงานใหญ่และสาขา

10.4 เงินกู้ยืมจากกรรมการหรือบริษัทในเครือ

10.5 อื่น ๆ

	10.1	
	10.2	
	10.3	
	10.4	ข้อ 10.1 + 10.2 + 10.3 + 10.4 + 10.5
	10.5	<input style="width: 80px;" type="text"/> 10

11. ภาระผูกพัน

 11

12. หนี้สินอนุพันธ์ทางการเงิน

 12

13. หนี้สินรวม<sup>1</sup> (ผลรวมของข้อ 1 ถึง ข้อ 11)

 13

**หนี้สินพิเศษ**

14. เงินกู้ยืม / หนี้สิน 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. หนี้สินทั่วไป<sup>2</sup> (ข้อ 13 + ข้อ 12 หักด้วย ข้อ 18)

 19

หมายเหตุ <sup>1</sup> หนี้สินรวมในข้อ 13 ไม่รวมหนี้สินอนุพันธ์ทางการเงินในข้อ 12 เนื่องจากหนี้สินดังกล่าวถูกนำไปรวมคำนวณเป็นส่วนหนึ่งของเงินลงทุนในลักษณะ portfolio concept แล้ว

<sup>2</sup> หนี้สินทั่วไปตามข้อ 19 จะเท่ากับผลรวมของหนี้สินรวมตามข้อ 13 และหนี้สินอนุพันธ์ทางการเงินในข้อ 12 หักด้วยหนี้สินพิเศษตามข้อ 18

ทั้งนี้ จะต้องนำหนี้สินอนุพันธ์ทางการเงินมารวมด้วยเพื่อให้ผู้ประกอบธุรกิจต้องดำรง cushion สำหรับหนี้สินในส่วนนี้เพิ่มเติมด้วย