

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	(ฌ) general market risk haircuts	(ฌ) % specific risk	(ญ) specific risk haircuts
		ปี	เดือน			long	short	net				
1.	โชนที่ 1 (อายุคงเหลือ 0-12 เดือน) 0-3 เดือน - high coupon (หุ้นกู้ A) (long position ในหุ้นกู้ A จาก FRA)											
	รวม							0.08				
2.	- low coupon (หุ้นกู้ B)											
	รวม							0.08				
3.	(หุ้นกู้ C)											
	รวม							0.08				
4.	- zero coupon											
	รวม							0.08				
	มากกว่า 3 - 6 เดือน - high coupon											
	รวม							0.15				
	- low coupon											
	รวม							0.15				
	- zero coupon											
	รวม							0.15				

หมายเหตุ : * รายงานฉบับนี้ใช้ประกอบแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิในส่วนของ 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) ลำดับที่	(ข) ตราสารหนี้/ สถานะเทียบเท่าตราสารหนี้	(ค) อายุคงเหลือ		(ง) อัตรา ดอกเบี้ย (%)	(จ) credit rating	(ฉ) สถานะ/สถานะเทียบเท่า			(ช) % general market risk	(ฌ) general market risk haircuts	(ฌ) % specific risk	(ญ) specific risk haircuts
		ปี	เดือน			long	short	net				
	มากกว่า 6 - 9 เดือน											
	- high coupon											
	รวม								0.36			
	- low coupon											
	รวม								0.36			
	- zero coupon											
	รวม								0.36			
	มากกว่า 9 - 12 เดือน											
	- high coupon											
	รวม								0.82			
	- low coupon											
	รวม								0.83			
	- zero coupon											
	รวม								0.84			
	(I) รวม ตราสารหนี้โซนที่ 1											

รวมค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้โซนที่ 1

(ช) + (ญ)

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	(ฌ) 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							2.83				
2.	- low coupon (หุ้นกู้ E) (หุ้นกู้ F)											
		รวม							2.91			
4.	- zero coupon											
		รวม							3.08			
	มากกว่า 3 - 5 ปี - high coupon											
		รวม							3.99			
	- low coupon											
		รวม							4.25			
	- zero coupon											
		รวม							4.81			

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	(ฌ) general market risk haircuts	(ฎ) % specific risk	(ญ) specific risk haircuts
		ปี	เดือน			long	short	net				
	มากกว่า 5 - 7 ปี											
	- high coupon											
	รวม								4.94			
	- low coupon											
	รวม								5.36			
	- zero coupon											
	รวม								6.53			
	มากกว่า 7 - 10 ปี											
	- high coupon											
	รวม								5.46			
	- low coupon											
	รวม								5.98			
	- zero coupon											
	รวม								7.55			
	มากกว่า 10 ปี											
	- high coupon											
	รวม								6.38			
	- low coupon											
	รวม								7.10			
	- zero coupon											
	รวม								10.03			
	(II) รวม ตราสารหนี้โซนที่ 2											

รวมค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้โซนที่ 2

(ช) + (ญ)

รวมค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้โซนที่ 1 และโซนที่ 2