

**สรุปรายการแก้ไขแบบ บ.ล. 4/1 และคำอธิบายฯ**

| หัวข้อที่แก้ไข  | รายละเอียดการแก้ไข  |
|---|---|
| <p><b>1. ค่าความเสี่ยงของตราสารทุน</b></p> <p><u>แบบ บ.ล. 4/1 :</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 1</li> <li>- ส่วนที่ 3 Sheet eq</li> </ul> <p><u>คำอธิบาย :</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 27</li> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 37 - 46</li> <li>- ส่วนที่ 3 ภาคผนวก</li> <li>- ส่วนที่ 4 หน้า 77</li> </ul>   | <ul style="list-style-type: none"> <li>- ปรับปรุง ประเภทหุ้น</li> <li>- ปรับปรุง ประเภทสินทรัพย์อ้างอิงของใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นให้สอดคล้องกับประเภทหุ้นที่ปรับปรุงใหม่</li> <li>- ปรับปรุง ตารางให้สอดคล้องกับค่าความเสี่ยงที่กำหนดขึ้นใหม่</li> <li>- ปรับปรุง ประเภทหุ้น</li> <li>- ปรับปรุง ประเภทสินทรัพย์อ้างอิงของใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นให้สอดคล้องกับประเภทหุ้นที่ปรับปรุงใหม่</li> <li>- ปรับปรุง ประเภทหุ้น</li> <li>- ปรับปรุง ประเภทสินทรัพย์อ้างอิงให้สอดคล้องกับประเภทหุ้นที่ปรับปรุงใหม่</li> <li>- ปรับปรุง เลขข้อ คำอธิบาย และตัวอย่างให้สอดคล้องกับค่าความเสี่ยงของตราสารทุนที่ปรับปรุงใหม่</li> <li>- เพิ่มเติมรายชื่อประเทศและดัชนีหลักของกลุ่มประเทศ Developed Market และ Emerging Market</li> <li>- ปรับปรุง ประเภทของหุ้นในการคิดค่าความเสี่ยงของการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ให้สอดคล้องกับค่าความเสี่ยงของหุ้นที่ปรับปรุงใหม่</li> </ul>   |
| <p><b>2. ค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้</b></p> <p><u>แบบ บ.ล. 4/1 :</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 1</li> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 3</li> <li>- ส่วนที่ 3 Sheet int</li> </ul> <p><u>คำอธิบาย :</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 29 - 30</li> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 48 - 51</li> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 56, 59, 63 - 65</li> <li>- ส่วนที่ 3 ภาคผนวก</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- ปรับปรุง ประเภทตราสารหนี้</li> <li>- ยกเลิก ตราสารหนี้ที่มีการผิมนัดชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ย ประเภทที่อยู่ภายใต้ความคุ้มครองของกองทุนฟื้นฟู</li> <li>- ปรับปรุง ประเภทคู่สัญญาให้สอดคล้องกับ specific risk ของตราสารหนี้ที่ปรับปรุงใหม่</li> <li>- ปรับปรุง ตารางให้สอดคล้องกับค่าความเสี่ยงที่กำหนดขึ้นใหม่</li> <li>- ปรับปรุง นิยามประเภทตราสารหนี้</li> <li>- ยกเลิก คำอธิบายของตราสารหนี้ในประเทศกลุ่ม OECD เนื่องจากค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้ภาครัฐคำนวณตาม credit rating</li> <li>- ยกเลิก การแบ่งประเภทตราสารหนี้ที่มีการผิมนัดชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ย ประเภทที่อยู่ภายใต้ความคุ้มครองของกองทุนฟื้นฟู</li> <li>- ปรับปรุง เลขข้อ คำอธิบาย และตัวอย่าง ให้สอดคล้องกับค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้ที่ปรับปรุงใหม่</li> <li>- ปรับปรุง คำอธิบายและตัวอย่างให้สอดคล้องกับค่าความเสี่ยงของตราสารหนี้ที่ปรับปรุงใหม่</li> <li>- ยกเลิก ภาคผนวก รายชื่อประเทศกลุ่ม OECD เนื่องจากไม่มีตราสารหนี้ประเภทดังกล่าว</li> </ul> |

| หัวข้อที่แก้ไข  | รายละเอียดการแก้ไข   |
|---|--|
| <p><b>3. ค่าความเสี่ยงของหน่วยลงทุน</b></p> <p><u>แบบ บ.ล. 4/1 :</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 2</li> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 3</li> </ul> <p><u>คำอธิบาย :</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 33 - 34</li> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 54</li> <li>- ส่วนที่ 3 หน้า 62 - 63</li> <li>- ส่วนที่ 8 หน้า 84</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- ปรับปรุง ประเภทหน่วยลงทุน</li> <li>- ปรับปรุง หัวข้อให้ครอบคลุมหน่วยทรัสต์</li> <li>- เพิ่มเติม คำนิยามให้ครอบคลุมหน่วยทรัสต์</li> <li>- ปรับปรุง นิยามประเภทหน่วยลงทุนและหน่วยทรัสต์</li> <li>- ปรับปรุง คำอธิบายให้สอดคล้องกับค่าความเสี่ยงของหน่วยลงทุนที่ปรับปรุงใหม่</li> <li>- ยกเลิก คำอธิบายเกี่ยวกับหน่วยลงทุน SLIPS/CAPS</li> <li>- ปรับปรุง ให้สอดคล้องกับค่าความเสี่ยงของหน่วยลงทุนที่ปรับปรุงใหม่</li> </ul> |
| <p><b>4. ตัวสัญญาใช้เงินและตัวแลกเงินที่ออกโดยสถาบันการเงิน</b></p> <p><u>คำอธิบาย :</u> ส่วนที่ 1 หน้า 2</p>   | <ul style="list-style-type: none"> <li>- ปรับปรุง อายุคงเหลือของตัวจากไม่เกิน 6 เดือน เป็น ไม่เกิน 3 เดือน</li> </ul>  |
| <p><b>5. ธุรกรรม arbitrage</b></p> <p><u>คำอธิบาย :</u> ส่วนที่ 3 หน้า 46 - 47</p>  | <ul style="list-style-type: none"> <li>-</li> <li>- เพิ่มเติม คำอธิบายการคิดค่าความเสี่ยงสำหรับธุรกรรม arbitrage</li> </ul>  |
| <p><b>6. หน่วยลงทุนอีทีเอฟ</b></p> <p><u>คำอธิบาย :</u> ส่วนที่ 3 หน้า 55</p>   | <ul style="list-style-type: none"> <li>- เพิ่มเติม วิธีการคำนวณค่าความเสี่ยงสำหรับหน่วยลงทุนอีทีเอฟ</li> </ul>   |
| <p><b>7. ลูกหนี้บัญชีเงินสด</b></p> <p><u>แบบ บ.ล. 4/1 :</u> ส่วนที่ 1 หน้า 1</p> <p><u>คำอธิบาย :</u> ส่วนที่ 1 หน้า 4</p>   | <ul style="list-style-type: none"> <li>- เพิ่มเติม แยกประเภทลูกหนี้บัญชีเงินสด เป็น 2 ประเภท คือ cash account และ cash balance</li> <li>- ปรับปรุง โดยแยกลูกหนี้ออกเป็น 2 ประเภทคือ บัญชี cash account และบัญชี cash balance และให้คิดค่าความเสี่ยงของบัญชี cash account เป็นร้อยละ 1.2 (cash balance ไม่คิดค่าความเสี่ยง)</li> </ul>  |
| <p><b>8. ธุรกรรม big lot</b></p> <p><u>คำอธิบาย :</u> ส่วนที่ 1 หน้า 17</p>   | <ul style="list-style-type: none"> <li>- เพิ่มเติม การเจ้าหน้าที่ขายหลักทรัพย์ ธุรกรรม big lot เป็นหนี้สินพิเศษ กรณีที่ผู้ซื้อได้วางชำระหลักทรัพย์ไว้เต็มจำนวนแล้ว</li> </ul>  |
| <p><b>9. ค่าความเสี่ยงเงินตราต่างประเทศ</b></p> <p><u>แบบ บ.ล. 4/1 :</u> ส่วนที่ 5 หน้า 1</p> <p><u>คำอธิบาย :</u> ส่วนที่ 5 หน้า 80 - 81</p>   | <ul style="list-style-type: none"> <li>- เพิ่มเติม การแสดงสินทรัพย์สกุลเงินต่างประเทศที่ไม่คิดค่าความเสี่ยง</li> <li>- เพิ่มเติม ยกเว้นการแสดงฐานะเงินตราต่างประเทศ</li> </ul>   |
| <p><b>10. การแก้ไขอื่น ๆ</b></p> <p>10.1 ลูกหนี้/เจ้าหนี้ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์</p> <p><u>แบบ บ.ล. 4/1 :</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- ส่วนที่ 1 หน้า 1</li> <li>- ส่วนที่ 2 หน้า 1</li> </ul> <p><u>คำอธิบาย :</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- ส่วนที่ 1 หน้า 9</li> <li>- ส่วนที่ 2 หน้า 15</li> </ul>                               | <ul style="list-style-type: none"> <li>- ปรับปรุง หัวข้อเป็นลูกหนี้สำนักหักบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (TCH)</li> <li>- ปรับปรุง หัวข้อเป็นเจ้าหนี้สำนักหักบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (TCH)</li> <li>- ปรับปรุง หัวข้อเป็นลูกหนี้สำนักหักบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (TCH) และแก้ไขนิยามให้สอดคล้องกัน</li> <li>- ปรับปรุง หัวข้อเป็นเจ้าหนี้สำนักหักบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ (TCH) และแก้ไขนิยามให้สอดคล้องกัน</li> </ul>   |

| หัวข้อที่แก้ไข   | รายละเอียดการแก้ไข  |
|--|---|
| <p>10.2 ลูกหนี้เจ้าหนี้บริษัท<br/>หลักทรัพย์ต่างประเทศ</p> <p><u>แบบ บ.ล. 4/1</u> :</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- ส่วนที่ 1 หน้า 1</li> <li>- ส่วนที่ 2 หน้า 1</li> </ul> <p><u>คำอธิบาย</u> :</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- ส่วนที่ 1 หน้า 10</li> <li>- ส่วนที่ 2 หน้า 15</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>- ยกเลิก ข้อความต่างประเทศ เพื่อขยายคำอธิบายให้รวมถึงบริษัทหลักทรัพย์ในประเทศด้วย</li> <li>- ยกเลิก ข้อความต่างประเทศ เพื่อขยายคำอธิบายให้รวมถึงบริษัทหลักทรัพย์ในประเทศด้วย</li> <li>- ยกเลิก ข้อความต่างประเทศ เพื่อขยายคำอธิบายให้รวมถึงบริษัทหลักทรัพย์ในประเทศด้วย</li> <li>- เพิ่มเติม นิยามของลูกหนี้บริษัทหลักทรัพย์ในประเทศ</li> <li>- ยกเลิก ข้อความต่างประเทศ เพื่อขยายคำอธิบายให้รวมถึงบริษัทหลักทรัพย์ในประเทศด้วย</li> <li>- เพิ่มเติม นิยามของเจ้าหนี้บริษัทหลักทรัพย์ในประเทศ</li> </ul> |
| <p>10.3 วิธีปฏิบัติ</p> <p><u>คำอธิบาย</u> : วิธีปฏิบัติ หน้า 1</p>  | <ul style="list-style-type: none"> <li>- ยกเลิก การกำหนดชื่อฝ่ายในการส่งรายงาน เนื่องจากบริษัทส่งแบบรายงานผ่านระบบอิเล็กทรอนิกส์</li> </ul>   |
| <p>10.4 การซื้อขายหลักทรัพย์<br/>ต่างประเทศ</p> <p><u>คำอธิบาย</u> : ส่วนที่ 2 หน้า 15</p>   | <ul style="list-style-type: none"> <li>- เพิ่มเติม ขยายนิยามให้ครอบคลุมการซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศของลูกค้า</li> </ul>   |
| <p>10.5 ประกาศเรื่องอนุพันธ์</p> <p><u>คำอธิบาย</u> : ส่วนที่ 3 หน้า 28, 30, 32</p>  | <ul style="list-style-type: none"> <li>- ปรับปรุง ประกาศที่อ้างอิงเรื่องการทำธุรกรรมอนุพันธ์ เป็นประกาศว่าด้วยเรื่องการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและการให้บริการด้านสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยบริษัทหลักทรัพย์</li> </ul>   |
| <p>10.6 นิยามของ position</p> <p><u>คำอธิบาย</u> : ส่วนที่ 3 หน้า 35</p>   | <ul style="list-style-type: none"> <li>- ปรับปรุง นิยามของ position ให้ครอบคลุมสถานะของอนุพันธ์ทั้งหมด</li> </ul>   |