



ธนาคารแห่งประเทศไทย

คู่มือสำหรับประชาชน : การขออนุญาตใช้วิธี **Contingent Loss Method** สำหรับธุรกรรม **Options** ในการคำนวณเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาด

หน่วยงานที่ให้บริการ : ฝ่ายกำกับธุรกิจสถาบันการเงิน ธนาคารแห่งประเทศไทย

หลักเกณฑ์ วิธีการ เงื่อนไข (ถ้ามี) ในการยื่นคำขอ และในการพิจารณาอนุญาต

1. เงื่อนไขในการยื่นคำขอ

1.1 การดำรงเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาด

1.1.1 ให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่มีธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงด้านตลาด ดำรงเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงดังกล่าวให้เพียงพอกับระดับความเสี่ยงที่เกิดขึ้นตลอดเวลา

1.1.2 ให้สถาบันการเงิน หรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่มีปริมาณธุรกรรมในบัญชีเพื่อการคำนวณระดับที่มีนัยสำคัญ ดำรงเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาดตามองค์ประกอบตามข้อ (1) ถึงข้อ (4) สำหรับสถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่มีปริมาณธุรกรรมในบัญชีเพื่อการคำนวณต่ำกว่าระดับที่มีนัยสำคัญ ให้ดำรงเงินกองทุนเฉพาะข้อ (4) เท่านั้น

- (1) ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยจากฐานะที่เกี่ยวข้องกับอัตราดอกเบี้ยที่อยู่ในบัญชีเพื่อการคำนวณ
- (2) ความเสี่ยงด้านราคาตราสารทุนจากฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุนที่อยู่ในบัญชีเพื่อการคำนวณ
- (3) ความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนจากฐานะทั้งหมดที่เกี่ยวข้องกับเงินตราต่างประเทศ
- (4) ความเสี่ยงด้านราคาสินค้าโภคภัณฑ์จากฐานะทั้งหมดที่เกี่ยวข้องกับสินค้าโภคภัณฑ์

1.1.3 ธนาคารแห่งประเทศไทยอาจพิจารณาสั่งการให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่มีปริมาณธุรกรรมในบัญชีเพื่อการคำนวณต่ำกว่าระดับที่มีนัยสำคัญ ต้องดำรงเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาดในทุกองค์ประกอบหรือองค์ประกอบใดองค์ประกอบหนึ่งเพิ่มเติมจากความเสี่ยงด้านราคาสินค้าโภคภัณฑ์ตามข้อ 1.1.2 (4) และ Credit Derivatives ที่จัดอยู่ในบัญชีเพื่อการคำนวณได้ หากพิจารณาแล้วเห็นว่าการสั่งการดังกล่าวทำให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินแห่งนั้นมีความมั่นคงยิ่งขึ้น ซึ่งกรณีนี้ ธนาคารแห่งประเทศไทยอาจพิจารณาสั่งการในภายหลัง

1.1.4 ให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินคำนวณเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาดสำหรับประเภทของความเสี่ยงด้านตลาดที่กำหนดในข้อ 1.1.2 ข้างต้น ซึ่งคำนวณตามวิธีใดวิธีหนึ่ง ดังนี้

- (1) วิธีมาตรฐาน (Standardised Approach) หรือ
- (2) วิธีแบบจำลอง (Internal Model Approach) หรือ
- (3) วิธีผสมระหว่างวิธีมาตรฐานกับวิธีแบบจำลอง

1.1.5 ให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินนำเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาดที่คำนวณได้ตามวิธีที่ระบุในข้อ 1.1.4 มาคูณด้วย 12.5 เป็นสินทรัพย์เสี่ยงด้านตลาด เพื่อนำมาใช้ในการดำรงเงินกองทุนเป็นอัตราส่วนกับสินทรัพย์เสี่ยงทั้งสิ้น ไม่ต่ำกว่าที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนดในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนสำหรับธนาคารพาณิชย์ หรือประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับดูแลด้านเงินกองทุนและการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องสำหรับบริษัทเงินทุน หรือประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ตามแต่กรณี

1.2 หลักเกณฑ์การคำนวณเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาดสำหรับ Options

1.2.1 การคำนวณเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาดสำหรับ Options ให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ถือปฏิบัติ ดังต่อไปนี้

- (1) สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่มีฐานะ Options ในแต่ละรายการเป็นฐานะซื้อเท่านั้นสามารถที่จะคำนวณเงินกองทุนสำหรับ Options โดยใช้วิธีแบบง่าย (Simplified Method) ได้
- (2) สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่มีฐานะ Options ในแต่ละรายการเป็นฐานะขายด้วยควรใช้วิธีใดวิธีหนึ่งในวิธีระดับกลาง (Intermediate Approach) ซึ่งได้แก่ Delta-Plus Method และ Contingent Loss Method หรือวิธีแบบจำลอง (Internal Model Approach) ซึ่งทั้ง 3 วิธีต้องได้รับอนุญาตจากธนาคารแห่งประเทศไทยก่อน ทั้งนี้ หากสถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินมีธุรกรรมเพื่อการค้าที่ซับซ้อนมากขึ้น ก็ควรใช้วิธีคำนวณเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงที่มีความซับซ้อนสูงขึ้นไปด้วย
- (3) สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่มีธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับ Exotic Options อาจต้องใช้วิธีคำนวณความเสี่ยงแบบ Contingent Loss Method หรือ Internal Model Approach เพื่อให้สามารถวัดความเสี่ยงได้ดียิ่งขึ้น
- (4) การซื้อ Options จากตลาด OTC ยังคงต้องดำรงเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านเครดิต (Counterparty Risk) ที่อาจเกิดจากการไม่สามารถปฏิบัติตามสัญญาของคู่สัญญาด้วยนอกเหนือจากการดำรงเงินกองทุนสำหรับความเสี่ยงด้านตลาด (Specific Risk และ General Market Risk)
- (5) วิธีที่สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินจะใช้ในการคำนวณเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงสำหรับ Options ต้องสอดคล้องตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

1.2.2 เงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงสำหรับ Options ที่คำนวณโดยใช้วิธี Scenario Analysis หรือ Contingent Loss Method จะเท่ากับ

- (1) เงินกองทุนสำหรับความเสี่ยง Specific Risk โดยการนำมูลค่า Delta-Equivalent ของแต่ละ Options คูณด้วยน้ำหนักเงินกองทุนตามวิธีมาตรฐานในส่วนเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยและราคาตราสารทุน

(2) เงินกองทุนสำหรับความเสี่ยง General Market Risk จะใช้เทคนิคการสร้างแบบจำลองในกรณีต่าง ๆ (Contingent Loss Matrix Analysis) เพื่อคำนวณการเปลี่ยนแปลงมูลค่า Portfolio ของ Options ต่อการเปลี่ยนแปลงของระดับราคาและความผันผวนของอัตราหรือราคาของตราสารอ้างอิง (Level and Volatility of the Rates or Prices of Associated Underlying) ซึ่งตามวิธีนี้เงินกองทุนสำหรับความเสี่ยง General Market Risk จะถูกกำหนดโดยผลขาดทุนสูงสุดใน Scenario Matrix ตามแบบจำลองดังกล่าว สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินสามารถเลือกใช้วิธีการคำนวณเงินกองทุนนี้สำหรับ Options Portfolio และฐานะที่ใช้ป้องกันความเสี่ยงที่เกี่ยวข้อง โดยใช้วิธี Contingent Loss Method เมื่อได้รับอนุญาตจากธนาคารแห่งประเทศไทย

1.3 การขออนุญาตใช้วิธี Contingent Loss Method สำหรับธุรกรรม Options ในการคำนวณเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาด

ให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินขออนุญาตใช้วิธี Contingent Loss Method ในการคำนวณเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาดสำหรับ Options เป็นรายธุรกรรม โดยธุรกรรม Options ที่สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินยังไม่เคยได้รับอนุญาตให้ใช้วิธี Contingent Loss Method ในการคำนวณเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาด หรือธุรกรรม Options ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยเคยอนุญาตให้ใช้วิธี Contingent Loss Method แล้ว แต่สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินประสงค์จะเปลี่ยนแปลงวิธีการคำนวณที่กระทบถึงมูลค่า Options ขอให้สถาบันการเงินหรือบริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงินยื่นคำขออนุญาตใช้วิธี Contingent Loss Method มาที่ธนาคารแห่งประเทศไทย ก่อนดำเนินการ

1.4 กรณีที่คำขออนุญาตมีประเด็นเชิงนโยบาย รวมถึงการคุ้มครองผู้ใช้บริการทางการเงิน ขอให้หารือธนาคารแห่งประเทศไทย ก่อนยื่นคำขออนุญาต เพื่อธนาคารแห่งประเทศไทยจะได้พิจารณากำหนดรูปแบบ รายละเอียด ของเอกสารที่จำเป็นเพื่อประกอบการพิจารณาต่อไป

ทั้งนี้ สามารถศึกษารายละเอียดได้ที่

- (1) พระราชบัญญัติธุรกิจสถาบันการเงิน พ.ศ. 2551 มาตรา 30
- (2) ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สนส. 94/2551 เรื่อง หลักเกณฑ์การกำกับดูแลความเสี่ยงด้านตลาด และการดำรงเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงด้านตลาดของสถาบันการเงิน ลงวันที่ 27 พฤศจิกายน 2551
- (3) ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สนส. 12/2555 เรื่อง หลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนสำหรับธนาคารพาณิชย์ ลงวันที่ 8 พฤศจิกายน 2555
- (4) ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สนส. 12/2562 เรื่อง หลักเกณฑ์การกำกับดูแลด้านเงินกองทุนและการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องสำหรับบริษัทเงินทุน ลงวันที่ 7 พฤษภาคม 2562

- (5) ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สนส. 11/2562 เรื่อง หลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ลงวันที่ 7 พฤษภาคม 2562
- (6) ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สนส. 4/2556 เรื่อง การเปิดเผยข้อมูลการดำรงเงินกองทุนสำหรับธนาคารพาณิชย์ ลงวันที่ 2 พฤษภาคม 2556
- (7) ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สนส. 1/2559 เรื่อง การเปิดเผยข้อมูลการดำรงเงินกองทุนสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ลงวันที่ 2 พฤษภาคม 2556
- (8) ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สนส. 14/2562 เรื่อง การเปิดเผยข้อมูลการดำรงเงินกองทุนสำหรับธนาคารพาณิชย์ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 7 พฤษภาคม 2562
- (9) ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สนส. 15/2562 เรื่อง การเปิดเผยข้อมูลการดำรงเงินกองทุนสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 7 พฤษภาคม 2562

2. วิธีการยื่นคำขอ

2.1 ให้ยื่นคำขอทางอิเล็กทรอนิกส์ ผ่านระบบ e-Application ในกรณีที่คำขอมีความบกพร่องไม่สมบูรณ์ หรือผู้ยื่นคำขอนำส่งข้อมูล/เอกสารหลักฐานไม่ถูกต้องครบถ้วน ธนาคารแห่งประเทศไทยจะแจ้งให้ผู้ยื่นคำขอแก้ไขคำขอหรือจัดส่งข้อมูล/เอกสารหลักฐานเพิ่มเติมภายในระยะเวลาที่กำหนด หากผู้ยื่นคำขอไม่ดำเนินการภายในกำหนดเวลาดังกล่าว จะถือว่าผู้ยื่นคำขอละทิ้งคำขอ และธนาคารแห่งประเทศไทยจะแจ้งยุติการพิจารณาซึ่งจะมีผลเป็นการคืนคำขอตั้งกล่าวผ่านระบบ e-Application

2.2 ธนาคารแห่งประเทศไทยจะยังไม่พิจารณาคำขอและยังไม่นับระยะเวลาการดำเนินการ จนกว่าผู้ยื่นคำขอจะแก้ไขคำขอหรือนำส่งข้อมูล/เอกสารหลักฐานเพิ่มเติมให้ถูกต้องครบถ้วนตามที่ได้แจ้งให้ผู้ยื่นคำขอดำเนินการตามข้อ 2.1 เรียบร้อยแล้ว

2.3 ธนาคารแห่งประเทศไทยจะแจ้งผลการพิจารณาให้ผู้ยื่นคำขอทราบภายใน 7 วัน นับแต่วันที่พิจารณาแล้วเสร็จ ตามมาตรา 10 แห่ง พ.ร.บ. การอำนวยความสะดวกในการพิจารณาอนุญาตของทางราชการ พ.ศ. 2558 ผ่านระบบ e-Application

ช่องทางการให้บริการ

<p>เว็บไซต์และช่องทางออนไลน์ สถานที่ให้บริการ www.bot.or.th (ระบบ e-Application)</p> <p>ทั้งนี้ หากยื่นคำขอในวันทำการภายหลังเวลา 15.00 น. หรือในวันหยุดทำการของธนาคารแห่งประเทศไทยจะถือว่าธนาคารแห่งประเทศไทยได้รับคำขอในวันทำการถัดไป</p>	<p>ระยะเวลาเปิดให้บริการ เปิดให้บริการตลอด 24 ชั่วโมง</p>
--	---

<p>หมายเหตุ: หากมีประเด็นสอบถามเพิ่มเติมโปรดติดต่อเจ้าหน้าที่ ที่หมายเลขโทรศัพท์ 02-356-7558 0-2283-5753 หรือ RAD-RiskTeam@bot.or.th และหมายเลขโทรศัพท์ 0 2356 7373 0 2356 7845 หรือ FIBSDept@bot.or.th</p>	
--	--

ขั้นตอน ระยะเวลา และส่วนงานที่รับผิดชอบ

ระยะเวลาในการดำเนินการรวม : 45 วัน

ลำดับ	ขั้นตอน	ระยะเวลา	ส่วนที่รับผิดชอบ
1)	<p>การตรวจสอบเอกสาร</p> <p>1. ตรวจสอบความครบถ้วนของคำขอและเอกสารหลักฐาน ประกอบตามหลักเกณฑ์ต่าง ๆ</p> <p>2. หากพบว่าเอกสารยังไม่ครบถ้วน จะแจ้งให้ผู้ยื่นจัดส่งเอกสารเพิ่มเติมหรือแก้ไขให้ถูกต้องภายในเวลาที่กำหนด หากพ้นกำหนดระยะเวลาดังกล่าว ธนาคารแห่งประเทศไทยจะถือว่าคำขอนั้นเป็นอันตกไป</p>	1 วัน	ฝ่ายตรวจสอบแบบจำลองและวิเคราะห์ความเสี่ยงสถาบันการเงิน
2)	<p>การพิจารณา</p> <p>การพิจารณาคำขอภายหลังเอกสารถูกต้องครบถ้วน</p> <p>1. เจ้าหน้าที่พิจารณาคำขอ วิเคราะห์ข้อมูลตามหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง</p> <p>2. เพื่อให้เกิดการพิจารณาที่รอบคอบและระมัดระวัง ธนาคารแห่งประเทศไทยอาจนำข้อมูลหรือข้อเท็จจริงเข้าหารือคณะกรรมการภายในธนาคารแห่งประเทศไทย เพื่อขอความคิดเห็นจากคณะกรรมการดังกล่าว หากธนาคารแห่งประเทศไทยยังคงเห็นว่ายังมีประเด็นที่ต้องการทราบข้อเท็จจริงหรืออาจส่งผลกระทบต่อเสถียรภาพของระบบสถาบันการเงิน หรือไม่สอดคล้องกับหลักเกณฑ์ที่กำหนด ธนาคารแห่งประเทศไทยอาจแจ้งให้ผู้ยื่นคำขอส่งข้อมูล/ข้อเท็จจริงเพิ่มเติม เพื่อประกอบการพิจารณา</p> <p>หมายเหตุ: จะเริ่มนับเวลาในขั้นตอนการพิจารณาเมื่อผู้ยื่นคำขอได้ชี้แจงข้อเท็จจริงเพิ่มเติม (ถ้ามี) และนำส่งเอกสารหลักฐาน</p>	30 วัน	ฝ่ายตรวจสอบแบบจำลองและวิเคราะห์ความเสี่ยงสถาบันการเงิน

ลำดับ	ขั้นตอน	ระยะเวลา	ส่วนที่รับผิดชอบ
	และข้อมูลตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนดได้อย่างครบถ้วนถูกต้องและมีคุณภาพตามมาตรฐานที่ควรจะเป็นเรียบร้อยแล้ว		
3)	การอนุญาต เสนอผลการพิจารณาเพื่อลงนาม	14 วัน	ฝ่ายกำกับธุรกิจ สถาบันการเงิน

รายการเอกสาร หลักฐานประกอบ

ลำดับ	ชื่อเอกสาร จำนวน และรายละเอียดเพิ่มเติม (ถ้ามี)	หน่วยงานภาครัฐ ผู้ออกเอกสาร
1)	รายงานการประชุมเรื่องการใช้วิธีคำนวณเงินกองทุนเป็น Contingent loss method ของคณะกรรมการที่เกี่ยวข้อง ฉบับจริง 1 ฉบับ สำเนา 0 ฉบับ หมายเหตุ -	-
2)	เอกสารรับทราบการทำผลิตภัณฑ์ใหม่ภายในสถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงิน เช่น คณะกรรมการอนุมัติ มติรับทราบในที่ประชุม ฉบับจริง 1 ฉบับ สำเนา 0 ฉบับ หมายเหตุ -	-
3)	รายละเอียดของธุรกรรมที่ขออนุญาต โดยแสดงชื่อธุรกรรม เงื่อนไข ตัวแปรอ้างอิง (Underlying asset) องค์ประกอบย่อยของธุรกรรม Pay-off diagram และกลุ่มลูกค้าหรือคู่สัญญาในการทำธุรกรรม ฉบับจริง 1 ฉบับ สำเนา 0 ฉบับ หมายเหตุ -	-
4)	แผนภาพที่แสดงถึงระบบงานทั้งหมดที่เกี่ยวข้อง และภาพ capture หน้าจอของระบบงาน (Process and system workflow) รวมถึงระบุผู้รับผิดชอบในแต่ละขั้นตอนไปจนถึงการคำนวณเงินกองทุนโดย Contingent Loss Method ทั้งนี้ หากมีการปรับเปลี่ยนระบบงาน ขอให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินแสดงตัวอย่างผลกระทบที่มีต่อเงินกองทุนของระบบเก่าและระบบใหม่ด้วย ฉบับจริง 1 ฉบับ	-

ลำดับ	ชื่อเอกสาร จำนวน และรายละเอียดเพิ่มเติม (ถ้ามี)	หน่วยงานภาครัฐ ผู้ออกเอกสาร
	<p>สำเนา 0 ฉบับ</p> <p>หมายเหตุ -</p>	
5)	<p>กระบวนการในการทำธุรกรรม Option ในแต่ละประเภท และระบุผู้รับผิดชอบในแต่ละขั้นตอน อาทิ Front, Middle, และ Back</p> <p>ฉบับจริง 1 ฉบับ</p> <p>สำเนา 0 ฉบับ</p> <p>หมายเหตุ -</p>	-
6)	<p>กรอบการบริหารความเสี่ยงและเกณฑ์ในการควบคุมความเสี่ยง โดยแสดงรายละเอียดเป็นรายการอย่างน้อย ดังนี้</p> <p>6.1) รายละเอียดค่าความเสี่ยง Limit ต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Option เช่น Sensitivity limit, Outstanding limit, VaR limit เป็นต้น</p> <p>6.2) ลักษณะของสัญญาที่อนุมัติให้ทำธุรกรรมได้ เช่น Long/Short, Tenor ขึ้นต่ำหรือขึ้นสูงของธุรกรรม, Notional ขึ้นต่ำหรือขึ้นสูงของธุรกรรม, ขอบเขตของ Underlying asset เป็นต้น</p> <p>6.3) วิธีการบริหารความเสี่ยงของธุรกรรมแต่ละประเภท เช่น Back to back, Static hedging, Dynamic hedging เป็นต้น และขอให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินระบุความเสี่ยงหรือค่า Greek หลักที่สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินไม่ได้ Hedge</p> <p>ฉบับจริง 1 ฉบับ</p> <p>สำเนา 0 ฉบับ</p> <p>หมายเหตุ -</p>	-
7)	<p>การคำนวณราคา (Pricing model) ของธุรกรรม Option เป็นรายการ โดยมีรายละเอียดอย่างน้อย ดังนี้</p> <p>7.1) รายละเอียดแหล่งที่มาของข้อมูล Market input data ที่นำมาใช้ และหากมีปัจจัยใดที่สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินคำนวณขึ้นเอง กรุณาอธิบายวิธีการที่ใช้ในการคำนวณหาปัจจัยดังกล่าวโดยละเอียด</p> <p>7.2) รายละเอียดของ Volatility ขอให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินระบุประเภทของ Volatility (เช่น Historical volatility, Implied volatility)</p> <p>7.2.1) จำนวนและความถี่ของข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ Historical volatility</p>	-

ลำดับ	ชื่อเอกสาร จำนวน และรายละเอียดเพิ่มเติม (ถ้ามี)	หน่วยงานภาครัฐ ผู้ออกเอกสาร
	<p>7.2.2) รายละเอียดการใช้ข้อมูล Implied volatility เช่น จุดใดบ้างที่ Observe บน Volatility surface (เช่น ATM, 25RR, 25BF เป็นต้น และ Tenor ไต) วิธีการ Interpolation เป็นต้น และวิธีการ Shift ค่า Volatility สำหรับการคำนวณ Contingent Loss Method</p> <p>7.2.3) หากไม่เข้าข่ายตามข้อ 7.2.1 หรือ 7.2.2 กรุณาอธิบายวิธีการกำหนดค่า Volatility และวิธี Shift ค่า Volatility โดยละเอียด</p> <p>7.3) แบบจำลองที่ใช้ในการคำนวณหามูลค่า, Sensitivity และวิธีการ Calibrate ค่า Parameter ในการทำ Simulation พร้อมทั้งแสดงตัวอย่างการคำนวณโดยละเอียดของธุรกรรมทั้งหมดที่ขออนุญาต โดยระบุเอกสารอ้างอิงถึงวิธีการที่ใช้ในการคำนวณ</p> <p>ฉบับจริง 1 ฉบับ</p> <p>สำเนา 0 ฉบับ</p> <p>หมายเหตุ -</p>	
8)	<p>การคำนวณเงินกองทุนตาม Contingent Loss Method โดยแสดงรายละเอียดอย่างน้อย ดังนี้</p> <p>8.1) รายละเอียดขั้นตอนการคำนวณ และตัวอย่างผลการคำนวณของทุกธุรกรรมที่ขออนุญาต ในทุก Scenario ตาม Contingent Loss Matrix โดยแสดงให้เห็นรายละเอียดค่าการเปลี่ยนแปลงมูลค่าของ Underlying และ Volatility</p> <p>8.2) ให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินอธิบายหลักการที่ใช้ในการแยกตาราง Contingent Loss (เช่น แยกตารางตามประเทศ แยกตารางตามสกุลเงิน เป็นต้น) เพื่อเลือกค่า Max loss</p> <p>8.3) แสดงตัวอย่างการคำนวณและการเลือก Max loss โดยแสดงแยกตารางตามหลักการดังกล่าวในข้อ 8.2 พร้อมทั้งระบุธุรกรรมที่ใช้ในการคำนวณในตัวอย่าง (ทั้งธุรกรรมที่ขออนุญาต และธุรกรรมที่ใช้ Hedge) และสรุปผลเงินกองทุนที่ต้องดำรงเพื่อรองรับ General market risk</p> <p>8.4) ในกรณีที่ไม่ได้คำนวณเงินกองทุนในระบบสำเร็จทั้งหมด (เช่น Murex) ขอให้สถาบันการเงินหรือกลุ่มธุรกิจทางการเงินระบุส่วนที่ต้องทำเองและแนวทางในการตรวจสอบความถูกต้อง รวมถึง ความถี่ในการตรวจสอบความถูกต้อง</p> <p>ฉบับจริง 1 ฉบับ</p>	-

ลำดับ	ชื่อเอกสาร จำนวน และรายละเอียดเพิ่มเติม (ถ้ามี)	หน่วยงานภาครัฐ ผู้ออกเอกสาร
	สำเนา 0 ฉบับ หมายเหตุ -	
9)	Model validation report แสดงผลการทดสอบความน่าเชื่อถือของแบบจำลอง และการคำนวณ Contingent Loss รายละเอียดวิธีการทดสอบ และแนวทางการแก้ไขประเด็นที่พบ รวมถึงระบุความถี่ที่จะทำการทดสอบ ผู้รับผิดชอบและแสดงความเป็นอิสระต่อผู้พัฒนา ฉบับจริง 1 ฉบับ สำเนา 0 ฉบับ หมายเหตุ -	-
10)	ตัวอย่าง Risk report ฉบับจริง 1 ฉบับ สำเนา 0 ฉบับ หมายเหตุ -	-
11)	เอกสารอื่น ๆ ที่เป็นประโยชน์ต่อการพิจารณา (ถ้ามี) โดยเฉพาะอย่างยิ่งในกรณีที่ลักษณะผลิตภัณฑ์หรือตัวแปรอ้างอิงมีความซับซ้อนหรือแตกต่างจากธุรกรรมส่วนใหญ่ที่เคยทำ ฉบับจริง 1 ฉบับ สำเนา 0 ฉบับ หมายเหตุ -	-

ค่าธรรมเนียม

ลำดับ	รายละเอียดค่าธรรมเนียม	ค่าธรรมเนียม (บาท / ร้อยละ)
ไม่มีค่าธรรมเนียม		

ช่องทางการร้องเรียน แนะนำบริการ

ลำดับ	ช่องทางการร้องเรียน / แนะนำบริการ
1)	ฝ่ายกำกับธุรกิจสถาบันการเงิน โทร. 0 2283 5931 หรือ FBD-SeniorDirector@bot.or.th, FBD-AllDirector@bot.or.th (หมายเหตุ: -)
2)	ศูนย์บริการประชาชน สำนักปลัดสำนักนายกรัฐมนตรี

ลำดับ	ช่องทางการร้องเรียน / แนะนำบริการ
	(เลขที่ 1 ถ.พิษณุโลก เขตดุสิต กทม. 10300 / สายด่วน 1111 / www.1111.go.th / ตู้ ปณ.1111 เลขที่ 1 ถ.พิษณุโลก เขตดุสิต กทม. 10300)
3)	<p>ศูนย์รับเรื่องร้องเรียนการทุจริตในภาครัฐ สำนักงานคณะกรรมการป้องกันและปราบปรามการทุจริตในภาครัฐ (สำนักงาน ป.ป.ท.) - 99 หมู่ 4 อาคารซอฟต์แวร์ปาร์ค ชั้น 2 ถนนแจ้งวัฒนะ ตำบลคลองเกลือ อำเภอปากเกร็ด จังหวัดนนทบุรี 11120 - สายด่วน 1206 / โทรศัพท์ 0 2502 6670-80 ต่อ 1900 , 1904- 7 / โทรสาร 0 2502 6132 www.pacc.go.th / www.facebook.com/PACC.GO.TH) ศูนย์รับเรื่องร้องเรียนสำหรับนักลงทุนต่างชาติ (The Anti-Corruption Operation center) (Tel : +66 92 668 0777 / Line : Fad.pacc / Facebook : The Anti-Corruption Operation Center / Email : Fad.pacc@gmail.com)</p>

แบบฟอร์ม ตัวอย่างและคู่มือการกรอก

ลำดับ	ชื่อแบบฟอร์ม
	<i>ไม่มีแบบฟอร์ม ตัวอย่าง และคู่มือการกรอก</i>

หมายเหตุ

-