**เอกสารแนบ 3**

**แบบฟอร์มการขอความเห็นชอบทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต**

 ธนาคารพาณิชย์ต้องขอความเห็นชอบในการทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่อาจมีรายละเอียดของธุรกรรมบางประการต่างจากหลักเกณฑ์ในประกาศ โดยต้องชี้แจงข้อมูลตามแบบฟอร์มที่กำหนดนี้ รวมถึงข้อมูลอื่น ๆ ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยอาจร้องขอ ทั้งนี้ ธนาคารแห่งประเทศไทยขอสงวนสิทธิที่จะไม่พิจารณา หากธนาคารพาณิชย์ให้ข้อมูลตามที่กำหนดในแบบฟอร์มนี้ไม่ครบถ้วน

|  |
| --- |
| **1. ประเภทธุรกรรมที่ขอความเห็นชอบ** |
|  1.1 ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ผู้รับโอนความเสี่ยงด้านเครดิต (Protection seller) ยังไม่มีการชำระเงินเพื่อวางเป็นประกันในการรับความเสี่ยงของตนเอง (Unfunded credit derivatives) 1.2 ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ Protection seller ชำระเงินทั้งจำนวนเพื่อวางเป็นประกันในการรับความเสี่ยงของตนเอง (Funded credit derivatives) |
| **2. เอกสารประกอบ**  |
| 2.1 ระเบียบผลิตภัณฑ์ (Product program)  2.2 Term sheet 2.3 เอกสารประกอบอื่น ๆ (โปรดระบุ) 2.3.1 \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 2.3.2 \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
| **3. รายละเอียดของธุรกรรม** |
|  **3.1 ชื่อธุรกรรม**3.1.1 ชื่อทางวิชาการหรือชื่อทั่วไป \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 3.1.2 ชื่อทางการค้า \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
|  **3.2 เงื่อนไขที่กำหนดตามข้อตกลงรับประกันความเสี่ยง**3.2.1 บทบาทของธนาคารพาณิชย์ตามข้อตกลงรับประกันความเสี่ยง Protection buyer หรือผู้โอนความเสี่ยงด้านเครดิต Protection seller หรือผู้รับโอนความเสี่ยงด้านเครดิต 3.2.2 Reference entity หรือผู้ออกสินทรัพย์อ้างอิง ได้แก่ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 3.2.3 Obligation categories หรือสินทรัพย์หรือภาระผูกพันภายใต้ข้อตกลงรับประกันความเสี่ยง Payment Borrowed money Reference obligations only โปรดระบุ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Bond Loan Bond or loan Others โปรดระบุ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Reference obligation หรือสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ใช้อ้างอิงสำหรับการจ่ายชำระเงิน ได้แก่ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Obligation characteristics \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ หากมี Underlying obligation หรือสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ธนาคารมีอยู่และต้องการป้องกันความเสี่ยงโดยใช้ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต โปรดระบุ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 3.2.4 Credit event : เหตุการณ์ที่เกี่ยวข้องกับความสามารถในการชำระหนี้ที่ระบุภายใต้สัญญาธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต ซึ่งเป็นผลให้ Protection seller ต้องมี Credit event payment ให้แก่ Protection buyer ได้แก่ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 3.2.5 โปรดระบุวิธีการจ่ายชำระราคาเมื่อเกิด Credit event วิธี Physical settlement  วิธี Cash settlement3.2.6 รายละเอียดเพิ่มเติมกรณีเป็นธุรกรรม Funded credit derivatives โปรดระบุประเภทของเงินกู้ยืม (เช่น ตราสารหนี้ พันธบัตร ตราสารหนี้ พันธบัตร หุ้นกู้ ตั๋วสัญญาใช้เงิน ตั๋วแลกเงิน และสินเชื่อ เป็นต้น) ได้แก่ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
|  **3.3 วัตถุประสงค์และกลุ่มลูกค้าหรือคู่สัญญาในการทำธุรกรรม**3.3.1 วัตถุประสงค์ในการทำธุรกรรมของธนาคารพาณิชย์ Bank’s funding เป็นการทำเพื่อจัดหาแหล่งเงินทุนหรือบริหารสภาพคล่องของธนาคารพาณิชย์ Bank’s hedging เป็นการทำเพื่อป้องกันความเสี่ยงของธนาคารพาณิชย์ Bank’s trading เป็นการทำเพื่อการค้า การเก็งกำไร หรือเพื่อเพิ่มผลตอบแทนของธนาคารพาณิชย์ Counterparty’s hedging เป็นการทำเพื่อป้องกันความเสี่ยงของคู่สัญญา Counterparty’s trading เป็นการทำเพื่อการค้า การเก็งกำไร หรือเพื่อเพิ่มผลตอบแทนของคู่สัญญา  อื่น ๆ โปรดระบุ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_  3.3.2 กลุ่มลูกค้าหรือคู่สัญญาของธนาคารพาณิชย์ (1) ประเภทของลูกค้าหรือคู่สัญญา (สามารถเลือกได้มากกว่า 1 ข้อ)  ผู้ลงทุนสถาบัน  ผู้ลงทุนรายใหญ่ (ประเภท นิติบุคคล บุคคลธรรมดา)  ผู้ลงทุนรายย่อย (2) ข้อมูลเพิ่มเติม เช่น ชื่อ ประเภทธุรกิจ หรือระดับความรู้และความชำนาญในการทำธุรกรรมของลูกค้าหรือคู่สัญญา เป็นต้น  |
|  **3.4 องค์ประกอบย่อยของธุรกรรม** 3.4.1 ในกรณีที่สามารถแยกองค์ประกอบย่อยได้ โปรดแสดงองค์ประกอบย่อยของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต  3.4.2 ในกรณีที่ไม่สามารถแยกองค์ประกอบย่อยได้ โปรดอธิบายโครงสร้างของธุรกรรม รวมถึงแสดงองค์ประกอบย่อยซึ่งเป็นธุรกรรมที่ธนาคารแห่งประเทศไทยอนุญาตเท่าที่สามารถทำได้ 3.4.3 โปรดแสดง Pay-off diagram ทั้งด้านธนาคารพาณิชย์และคู่สัญญา โดยให้แสดง Pay-off ถึงในระดับของธุรกรรมอนุพันธ์ที่เป็นองค์ประกอบย่อยหากสามารถแยกองค์ประกอบย่อยได้ Pay-off diagram ด้านธนาคารพาณิชย์ Pay-off diagram ด้านคู่สัญญา สำหรับธุรกรรมที่ไม่สามารถเขียน Pay-off diagram ได้ โปรดอธิบายการเปลี่ยนแปลงมูลค่ากำไรหรือขาดทุนของธนาคารพาณิชย์และคู่สัญญา จากมูลค่าที่เป็นไปได้ของตัวแปรและดัชนีทางการเงินที่อ้างอิง  |
|  **3.5 การบริหารความเสี่ยงที่เกิดจากการทำธุรกรรม** 3.5.1 โปรดอธิบายวิธีการกำหนดราคา (Pricing) ของธุรกรรมโดยละเอียด 3.5.2 โปรดอธิบายวิธีการหามูลค่ายอดคงค้าง (Exposure) ที่เกิดจากการทำธุรกรรมซึ่งหากมีการทำ Simulation โปรดชี้แจงรายละเอียด เช่น กระบวนการ แบบจำลอง สมมติฐาน หรือปริมาณข้อมูลย้อนหลังที่ใช้ เป็นต้น 3.5.3 โปรดอธิบายวิธีการพิจารณาการมีภาระสอดคล้องหรือสินทรัพย์อ้างอิงของลูกค้าหรือคู่สัญญา กรณีเป็นธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับเงินตราต่างประเทศ 3.5.4 โปรดระบุความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากการทำธุรกรรม รวมถึงแนวทางในการบริหารความเสี่ยง (สามารถเลือกได้มากกว่า 1 ข้อ) ความเสี่ยงด้านตลาด ความเสี่ยงด้านเครดิต ความเสี่ยงด้านเครดิตของคู่สัญญา ความเสี่ยงด้านอื่น ๆ (โปรดระบุ) |
|  **3.6 การดำรงเงินกองทุนและปฏิบัติตามหลักเกณฑ์การกำกับดูแล**โปรดระบุแนวทางการดำรงเงินกองทุนเพื่อรองรับความเสี่ยงของธุรกรรมที่ทำ รวมถึงการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์การกำกับดูแลอื่น ๆ ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด (โปรดแสดงวิธีการคำนวณโดยละเอียด) 3.6.1 การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านตลาด 3.6.2 การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต (หากนำธุรกรรมที่ขอความเห็นชอบมาใช้เป็นเครื่องมือปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต โปรดแสดงการคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสินทรัพย์ที่ต้องการป้องกันความเสี่ยงด้วย) 3.6.3 การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของคู่สัญญา 3.6.4 การดำรงอัตราส่วนลูกหนี้รายใหญ่ |
|  **3.7 ข้อมูลอื่น ๆ**โปรดชี้แจงข้อมูลอื่น ๆ นอกเหนือจากที่กล่าวเพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยใช้ประกอบการพิจารณา |