

สิ่งที่ส่งมาด้วย - ตัวอย่างการคิด company limit

ตัวอย่าง: บลจ. A ทำธุรกรรม reverse repo กับคู่สัญญา B ทั้งสิ้น 3 ธุรกรรม โดยใช้ตราสารหนี้ของบริษัท ❶ ❷ และ ❸ ตามลำดับ ทั้งนี้ มูลค่าธุรกรรมและมูลค่า mark-to-market ของตราสารหนี้ดังกล่าว ณ สิ้นวันเป็นดังนี้:

หน่วย: ล้านบาท

ตราสารหนี้	มูลค่าธุรกรรม	มูลค่า mark-to-market ของตราสารหนี้
❶	101	105
❷	101	98
❸	101	98

การคำนวณ Company limit กรณีข้างต้นตามเกณฑ์ที่ปรับปรุงใหม่สรุปได้ดังนี้:

ธุรกรรม	Company limit กรณีไม่มีข้อกำหนดเรื่อง Net exposure	Company limit กรณีมีข้อกำหนดเรื่อง Net exposure
❶	<ul style="list-style-type: none"> - คิด company limit ที่บริษัท ❶ 101 ล้านบาท - ไม่ต้องคิด company limit ที่คู่สัญญา B 	<ul style="list-style-type: none"> - คิด company limit ที่บริษัท ❶ 101 ล้านบาท - ไม่ต้องคิด company limit ที่คู่สัญญา B - นำมูลค่า mark-to-market ส่วนเกิน 4 ล้านบาท ไปชดเชยมูลค่า mark-to-market ส่วนขาดของ ❷ และ ❸ ได้
❷	<ul style="list-style-type: none"> - คิด company limit ที่บริษัท ❷ 98 ล้านบาท - คิด company limit ที่คู่สัญญา B 3 ล้านบาท 	<ul style="list-style-type: none"> - คิด company limit ที่บริษัท ❷ 98 ล้านบาท - เลือกคิด company limit ที่บริษัท ❶ เพิ่มเติมได้ โดยเมื่อรวมการคิดชดเชยสำหรับทุกธุรกรรมแล้วต้องไม่เกินมูลค่า mark-to-market ส่วนเกิน 4 ล้านบาท ของ ❶ (ตัวอย่างเช่น เลือกคิด company limit เพิ่มที่บริษัท ❶ อีก 3 ล้านบาท เพื่อชดเชยส่วนที่ขาดของ ❷) - หากภายหลังการคิด company limit ที่บริษัท ❶ แล้ว มูลค่า mark-to-market ของ ❷ ยังต่ำกว่ามูลค่าธุรกรรม ❷ ให้คิด company limit ส่วนที่ขาดที่คู่สัญญา (อย่างไรก็ดี กรณีตามตัวอย่าง

ธุรกรรม	Company limit กรณีไม่มี ข้อกำหนดเรื่อง Net exposure	Company limit กรณีมี ข้อกำหนดเรื่อง Net exposure
		ได้นำมูลค่า mark-to-market ส่วนเกิน มาคิดชดเชยครบถ้วนแล้ว จึงไม่ต้อง คิด company limit ที่คู่สัญญาอีก)
3	<ul style="list-style-type: none"> - คิด company limit ที่บริษัท 3 98 ล้านบาท - คิด company limit ที่คู่สัญญา B 3 ล้านบาท 	<ul style="list-style-type: none"> - คิด company limit ที่บริษัท 3 98 ล้านบาท - เลือกคิด company limit ที่บริษัท 1 เพิ่มเติมได้ โดยเมื่อรวมการคิดชดเชย สำหรับทุกธุรกรรมแล้วต้องไม่เกิน มูลค่า mark-to-market ส่วนเกิน 4 ล้านบาทของ 1 (จากตัวอย่างข้างต้น สามารถคิด company limit เพิ่มที่ บริษัท 1 ได้อีกเพียง 1 ล้านบาท เพื่อชดเชยส่วนที่ขาดของ 3 เนื่องจากได้นำ 1 ไปชดเชยส่วนที่ขาด ของ 2 แล้ว) - หากภายหลังการคิด company limit ที่บริษัท 1 แล้ว มูลค่า mark-to-market ของ 3 ยังต่ำกว่ามูลค่าธุรกรรม 3 ให้คิด company limit ส่วนที่ขาด ที่คู่สัญญา (กรณีตามตัวอย่างจึงต้อง คิด company limit ที่คู่สัญญา B 2 ล้านบาท)