

4 พฤษภาคม 2549

เรียน ผู้จัดการ

สถาบันการเงินคู่ค้าสำหรับการทำธุรกรรมซื้อคืนประเภท Bilateral Repo

ที่ ผตง.(1ก)ว. 11 /2549 เรื่อง การแก้ไขระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วย
บริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer)
โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo)

เพื่อรองรับการรวมศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (Central Securities Depository) และการส่งมอบ
และชำระราคาตราสารหนี้ (Clearing & Settlement System) ภาครัฐและเอกชน ไว้ที่บริษัทศูนย์รับฝาก
หลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด ตามแผนพัฒนาตราสารหนี้ฉบับที่ 2 (พ.ศ. 2548-2557) ของกระทรวง
การคลัง ธปท. จึงเห็นควรแก้ไขเพิ่มเติมระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงิน
เกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน
ด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo) พ.ศ. 2546 และประกาศที่เกี่ยวข้อง โดยสาระสำคัญของระเบียบ
และประกาศใหม่ที่ต่างไปจากเดิม สรุปได้ดังนี้

1. เพิ่มคำนิยาม “ศูนย์รับฝาก”
2. เปลี่ยนวิธีการโอนพันธบัตรและการชำระราคา จากเดิมใช้วิธีตามระเบียบ ธปท. ว่าด้วย
การบริการบาทเนต เปลี่ยนเป็น โอนพันธบัตรพร้อมการชำระราคาตามระบบของศูนย์รับฝากหลักทรัพย์
3. เปลี่ยนเวลาการทำธุรกรรมซื้อหรือขายพันธบัตร (ธุรกรรมขาแรก) ดังนี้

ธุรกรรม	เวลาตามระเบียบเดิม	เวลาตามระเบียบใหม่
ธปท. แจ้งความประสงค์ไปยัง ไพรมารี ดีลเลอร์	ภายใน 9.15 น.	ภายใน 9.30 น.
ไพรมารี ดีลเลอร์ ทุกรายแจ้งเสนอซื้อหรือ เสนอขายพันธบัตรมาให้ ธปท.	ภายใน 9.30 น.	ภายใน 9.45 น.
ธปท. แจ้งผลการพิจารณาการรับซื้อหรือขาย พันธบัตรให้ไพรมารี ดีลเลอร์ ทราบ	ภายใน 9.45 น.	ภายใน 10.00 น.
ผู้ขายยืนยันการขายและซื้อคืน ไปยังผู้ซื้อ	ภายใน 11.00 น.	ภายใน 11.15 น.

รพท. ขอส่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo) (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2549 และประกาศที่เกี่ยวข้องจำนวน 1 ฉบับ ทั้งนี้โปรดแจ้งรายละเอียดสำหรับการส่งมอบและชำระราคาตราสารหนี้ที่แนบมาพร้อมนี้และส่งให้ รพท. ภายในวันที่ 15 พฤษภาคม 2549

ขอแสดงความนับถือ



(นางมองเพ็ญ เรืองวิรุทธ)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายตลาดการเงินและบริหารเงินสำรอง

ผู้ว่าการ^{สม}

- สิ่งที่ส่งมาด้วย:
1. ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo) (ฉบับที่ 2) พ.ศ. 2549 และประกาศที่เกี่ยวข้องจำนวน 1 ฉบับ
 2. หนังสือแจ้งรายละเอียดสำหรับการส่งมอบและชำระราคาตราสารหนี้

ส่วนธุรกิจตลาดการเงิน

สำนักตลาดการเงิน

ฝ่ายตลาดการเงินและบริหารเงินสำรอง

โทร. 0-2283-5412, 0-2283-5408

หมายเหตุ ไม่มีการจัดประชุมชี้แจง

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย

ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer)

โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (ฉบับที่ 2)

พ.ศ. 2549

ตามแผนพัฒนาตราสารหนี้ฉบับที่ 2 (พ.ศ. 2548-2557) ของกระทรวงการคลังที่ให้รวมศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (Central Securities Depository) และการส่งมอบและชำระราคาตราสารหนี้ (Clearing & Settlement System) ของภาครัฐและเอกชนไว้แห่งเดียวกันคือที่ บริษัทศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด ธนาคารแห่งประเทศไทยเห็นสมควรแก้ไขเพิ่มเติมระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ พ.ศ. 2546 ดังนี้

1. ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นบทนิยามคำว่า “ศูนย์รับฝาก” ใน ข้อ 2 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ พ.ศ. 2546

“ศูนย์รับฝาก” หมายความว่า บริษัทศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด หรือหน่วยงานอื่นใดที่ตลาดหลักทรัพย์จัดตั้งขึ้น หรือได้รับอนุญาตจากคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ เพื่อประกอบบริการศูนย์กลางการให้บริการรับฝากและถอนหลักทรัพย์

2. ในกรณีที่การรวมศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ และการชำระราคาและการโอนพันธบัตรไม่สามารถดำเนินการได้ที่ศูนย์รับฝากในช่วงการปรับเปลี่ยนระบบนั้น ให้

(1) การชำระราคาหรือโอนพันธบัตรดำเนินการผ่านระบบบาทเนตโดยใช้บัญชีตราสารหนี้ของไพรมารีดีลเลอร์ที่ ธปท. ทั้งนี้ โดยให้เป็นไปตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการบริการบาทเนต พ.ศ. 2544 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

(2) การใช้บริการอื่นของบาทเนตที่เกี่ยวข้องเนื่องกับการชำระราคาหรือโอนพันธบัตร เช่น การสอบถามสถานะรายการในคิว การสอบถามข้อมูลบัญชีตราสารหนี้ของไพรมารีดีลเลอร์ที่ ธปท. ดำเนินการผ่านบริการ EFS โดยเป็นไปตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการบริการบาทเนต พ.ศ. 2544 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

3. ทั้งนี้ตั้งแต่วันที่ 15 พฤษภาคม 2549 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 เมษายน 2549

(ม.ร.ว.ปรีดิยาธร เทวกุล)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และระบบสื่อสาร ในการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน (e-Bilateral Repo) (ฉบับที่ 2)

ตามแผนพัฒนาตราสารหนี้ฉบับที่ 2 (พ.ศ. 2548-2557) ของกระทรวงการคลังที่ให้รวมศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (Central Securities Depository) และการส่งมอบและชำระราคาตราสารหนี้ (Clearing & Settlement System) ของภาครัฐและเอกชนไว้แห่งเดียวกันคือที่ บริษัทศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด และเพื่อปฏิบัติตาม ข้อ 4 ข้อ 5 ข้อ 6 และ ข้อ 7 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo) พ.ศ. 2546 และที่แก้ไขเพิ่มเติมธนาคารแห่งประเทศไทยออกประกาศกำหนด ดังต่อไปนี้

1. ให้ยกเลิกประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และระบบสื่อสาร ในการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน (e-Bilateral Repo) ลงวันที่ 28 กรกฎาคม 2546
2. ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนดเงื่อนไข เวลา และระบบสื่อสาร ในการทำธุรกรรม ดังต่อไปนี้
 - 2.1 ให้ไพรมารี ดีลเลอร์เสนอซื้อหรือขายพันธบัตรทุกระยะเวลาที่ ธปท. แจ้งความประสงค์จะซื้อหรือขายและเป็นจำนวนเงินระยะเวลาละไม่ต่ำกว่า 100 ล้านบาท และไม่มีเศษของ 10 ล้านบาท
 - 2.2 ให้ไพรมารี ดีลเลอร์เสนออัตราค่าตอบแทนเป็นร้อยละต่อปีและมีทศนิยม ไม่เกิน 5 ตำแหน่ง
 - 2.3 ช่วงระยะเวลาของสัญญาจะต้องไม่ตรงกับวันเริ่มปิดพักสมุดทะเบียนเพื่อการจ่ายดอกเบี้ยของพันธบัตรที่ใช้ในการทำธุรกรรม ยกเว้นวันแรกแห่งระยะเวลาของสัญญา
 - 2.4 วันที่สัญญาครบกำหนดจะต้องเป็นวันก่อนหน้าวันเริ่มปิดพักสมุดทะเบียนเพื่อการไถ่ถอนพันธบัตรอย่างน้อย 1 วันทำการ

สงกป10กส6460325490503

วิสัยทัศน์ เป็นองค์กรที่โปร่งใสและซื่อสัตย์

www.bot.or.th โทรสาร 0-2283-6789

2.5 การทำธุรกรรมซื้อหรือขายพันธบัตร (ธุรกรรมขาแรก) (ตามข้อ 5 แห่งระเบียบฯ)

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ธปท. แจ้งความประสงค์ไปยัง ไพรมารี ดีลเลอร์	e-Bilateral Repo	ภายใน 9.30 น.
ไพรมารี ดีลเลอร์ ทุกรายแจ้งเสนอ ซื้อหรือเสนอขายพันธบัตรมาให้ ธปท.	e-Bilateral Repo	ภายใน 9.45 น.
ธปท. แจ้งผลการพิจารณาการรับ ซื้อหรือขายพันธบัตรให้ไพรมารี ดีลเลอร์ ทราบ	e-Bilateral Repo	ภายใน 10.00 น.
ผู้ขายยืนยันการขายและซื้อคืนไปยัง ผู้ซื้อ	แจ้งผ่านระบบบาทเนต โดยใช้บริการ รับส่งข้อความระบบบาทเนต (MT298) ตามที่กำหนด	ภายใน 11.15 น.
ผู้ซื้อแจ้งยืนยันธุรกรรมกลับไปยัง ผู้ขาย	แจ้งผ่านระบบบาทเนต โดยใช้บริการ รับส่งข้อความระบบบาทเนต (MT298) ตามที่กำหนด	ภายใน 12.00 น.
การโอนพันธบัตรและการชำระราคา	โอนพันธบัตรพร้อมการชำระราคา ตามระบบของศูนย์รับฝาก (MT541, MT543)	ภายใน 14.00 น.

2.6 การเรียก Margin (ตามข้อ 6. แห่งระเบียบฯ)

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ธปท. แจ้งให้ไพรมารี ดีลเลอร์ทราบ จำนวนเงินที่ไพรมารี ดีลเลอร์ต้อง ส่งมอบหรือรับมอบเพิ่มเติม (Margin)	แจ้งผ่านระบบบาทเนต โดยใช้บริการ รับส่งข้อความระบบบาทเนต (MT298)	ภายใน 9.45 น.
ไพรมารี ดีลเลอร์ ทักท้วงหากไม่ ถูกต้อง	แจ้ง ธปท. ทางโทรศัพท์	ภายใน 10.00 น.
ผู้ที่ต้องทำการส่งมอบ Margin โอนเงินให้แก่คู่สัญญา	ระบบบาทเนต (MT202)	ภายใน 11.00 น.

2.7 การทำธุรกรรมขายคืนหรือซื้อคืนพันธบัตร (ธุรกรรมขาหลัง) (ตามข้อ 7 แห่งระเบียบฯ)

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ธปท.จะแจ้งจำนวนเงิน Margin ที่ต้องส่งคืนหรือรับคืนของทุกสัญญาที่ครบกำหนด รวมทั้งดอกเบี้ยของจำนวนเงินที่ได้มีการส่งมอบหรือรับมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) ตลอดจนอายุสัญญาให้ไพรมารี คิลเลอร์ทราบ	แจ้งผ่านระบบบาทเนตโดยใช้บริการรับส่งข้อความระบบบาทเนต (MT298)	ภายใน 9.45 น.
ไพรมารี คิลเลอร์ทักท้วงหากไม่ถูกต้อง	แจ้ง ธปท. ทางโทรศัพท์	ภายใน 10.00 น.
ผู้ที่ต้องทำการส่งมอบ Margin และดอกเบี้ย โอนเงินให้แก่คู่สัญญา	ระบบบาทเนต (MT202)	ภายใน 11.00 น.
การโอนพันธบัตรและการชำระราคาสำหรับสัญญาที่ครบกำหนด	โอนพันธบัตรพร้อมการชำระราคาตามระบบของศูนย์รับฝาก (MT541, MT543)	ภายใน 14.00 น.

หมายเหตุ : - ในกรณีระบบสื่อสารที่เป็นระบบ e-Bilateral Repo ชัดข้อ ให้ใช้ Reuters Dealing หรือ Bloomberg หรือ โทรสาร (facsimile) แทน

- ในกรณีที่ไม่สามารถรับส่งข้อความผ่านระบบบาทเนต ให้ใช้โทรสาร (facsimile) ในการสื่อสารแทน

- ในกรณีที่ไม่สามารถชำระราคาและ/หรือโอนพันธบัตรผ่านระบบของศูนย์รับฝากได้ ให้ปฏิบัติตามวิธีการที่กำหนดไว้ในระเบียบที่เกี่ยวข้องของศูนย์รับฝาก

ทั้งนี้ ตั้งแต่วันที่ 15 พฤษภาคม 2549 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 เมษายน 2549



(ม.ร.ว.ปรีดิยาธร เทวกุล)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

สงกป.10กส6460325490503

หนังสือแจ้งรายละเอียดสำหรับการส่งมอบและชำระราคาตราสารหนี้

วันที่.....

เรียน ผู้บริหารส่วน ส่วนธุรกิจบริหารเงิน

ฝ่ายบริหารความเสี่ยงและปฏิบัติการทางการเงิน

ข้าพเจ้า.....ขอแจ้งรายละเอียด

เพื่อการส่งมอบและชำระราคาตราสารหนี้ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้กับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) ด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Outright) พ.ศ. 2549 ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับ ไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo) พ.ศ. 2546 และที่แก้ไขเพิ่มเติม และระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการซื้อขายพันธบัตร โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนและซื้อคืนเพื่อปรับฐานะพันธบัตรของไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) พ.ศ. 2546 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ดังนี้

เลขที่บัญชีกระแสรายวัน.....

เลขที่บัญชีตราสารหนี้.....

ชื่อบัญชีภาษาไทย.....

ชื่อบัญชีภาษาอังกฤษ.....

BIC Code S.W.I.F.T.

ทั้งนี้ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่..... เป็นต้นไป หากมีการเปลี่ยนแปลงรายละเอียดดังกล่าวข้างต้น ข้าพเจ้าจะแจ้งให้ ทรปท. ทราบล่วงหน้าเป็นลายลักษณ์อักษร

ลงลายมือชื่อ.....

(.....)

ผู้มีอำนาจลงนาม

เพื่อ.....