

ธนาคารแห่งประเทศไทย

14 กันยายน 2552

เรียน ผู้จัดการ

สถาบันการเงินผู้ค้าสำหรับการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ ผตง.(1ก)ว. ๖ /2552 เรื่อง การยกเลิกระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิลีกทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo) พ.ศ. 2546 และออกระเบียบใหม่แทน

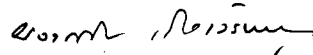
ด้วย ธปท. เห็นควรปรับปรุงระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิลีกทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo) พ.ศ. 2546 และที่แก้ไขเพิ่มเติม และการเปลี่ยนแปลงอัตรา Haircut และ Variation Margin สำหรับธุรกรรมดังกล่าว โดยดำเนินการดังนี้

1. ยกเลิก ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิลีกทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo) พ.ศ. 2546 และประกาศที่เกี่ยวข้อง

2. ออกใช้ ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) และประกาศที่เกี่ยวข้อง

ทั้งนี้ ให้ถือปฏิบัติตามระเบียบใหม่ ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2552 เป็นต้นไป ส่วนอัตรา Haircut และ Variation Margin ใหม่ให้ถือปฏิบัติตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 โดยขอให้ไพรมารี ดีลเลอร์ จัดส่งเอกสารตามแบบฟอร์มที่ (1) (2) (5) และ (6) ที่แนบมาพร้อมกับระเบียบดังกล่าว ให้ ธปท. ภายในวันที่ 24 กันยายน 2552 และกำหนดสิทธิในระบบ Electronic Financial Services ในหัวข้อบริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์ ตามแบบฟอร์มที่ (3) และ (4) ภายในวันที่ 30 กันยายน 2552

ขอแสดงความนับถือ



(นางรองเพ็ญ เรืองวิรุทธ)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายตลาดการเงินและบริหารเงินสำรอง

ผู้ว่าการ

55ยักศน์ เป็นองค์กรที่มองการณ์ไกล พนักงานมีความสามารถสูงและอุทิศตนเพื่อดูแลเศรษฐกิจให้ผ่านพ้นความผันผวนได้อย่างราบรื่น

www.bot.or.th บริการข้อมูลอัตโนมัติ 24 ชั่วโมง โทร. 0-2283-6789

สกงว90กส6400525520915

- สิ่งที่ส่งมาด้วย :
1. ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ระบุกับ ไพรมารี ดีลเลอร์)
 2. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 83/2552 เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และระบบสื่อสารในการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์
 3. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 84/2552 เรื่อง การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้ และเงินที่จะต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) โดยประกาศฉบับนี้ยังใช้ Haircut และ Variation Margin อัตราเดิมในช่วงที่สถาบันการเงินอยู่ระหว่างแก้ไขระบบงานเพื่อรองรับ Haircut และ Variation Margin อัตราใหม่
 4. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 85/2552 เรื่อง การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้ และเงินที่จะต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) (Haircut และ Variation Margin อัตราใหม่ จะเริ่มบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552)
 5. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 86/2552 เรื่อง ดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) เบี้ยปรับ และวิธีปฏิบัติในกรณีไพรมารี ดีลเลอร์ ผิดนัดส่งมอบ Margin

ส่วนธุรกิจตลาดการเงิน

สำนักตลาดการเงิน

ฝ่ายตลาดการเงินและบริหารเงินสำรอง

โทร. 0-2283-5412, 0- 2283-5408

หมายเหตุ ไม่มีการจัดประชุมชี้แจง

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สก. 82/2552

ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ สปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

1. เหตุผลในการออกระเบียบ

เพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยมีเครื่องมือในการดำเนินนโยบายการเงินที่จะปล่อยหรือดูดสภาพคล่องจากระบบการเงินได้อย่างเหมาะสม โดยทำธุรกรรมผ่านไพรมารี ดีลเลอร์ ธนาคารแห่งประเทศไทยจึงได้ปรับปรุงระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo) ให้เหมาะสมยิ่งขึ้น

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 33 (5) และ (6) แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551

3. ยกเลิก

ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายพันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo) พ.ศ. 2546 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

4. ขอบเขตการบังคับใช้

สถาบันการเงินที่ได้รับแต่งตั้งจาก สปท. เป็นไพรมารี ดีลเลอร์ สำหรับการทำธุรกรรม การซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการทำธุรกรรมซื้อตราสารหนี้ ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer)

5. เนื้อหา

ในระเบียบนี้

“ไพรมารี คิลเลอร์” หมายถึง สถาบันการเงินที่ ธปท. แต่งตั้งให้เป็นคู่ค้าของ ธปท. เพื่อทำหน้าที่เป็นตัวกลางในการปล่อยหรือดูดซับสภาพคล่องจากระบบการเงินผ่านธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี คิลเลอร์)

“ตราสารหนี้” หมายถึง

- (1) ตั๋วเงินคลัง
- (2) ตั๋วสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้
- (3) พันธบัตรรัฐบาล
- (4) พันธบัตร ธปท.
- (5) พันธบัตรหรือหุ้นกู้ที่ออกโดยองค์การของรัฐหรือรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ทั้งนี้ ตามที่ ธปท. จะเห็นสมควร

“ตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย” หมายถึง ตราสารที่ ธปท. ได้ออกเพื่อขายให้แก่ไพรมารี คิลเลอร์ ตามระเบียบนี้

“ศูนย์รับฝาก” หมายถึง บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด หรือหน่วยงานอื่นใดที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยจัดตั้งขึ้น หรือได้รับอนุญาตจากคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ เพื่อประกอบกำกับการเป็นศูนย์กลางการให้บริการรับฝากและถอนหลักทรัพย์

“บริการ EFS” หมายถึง บริการด้านการเงินด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการให้บริการด้านการเงินด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (Electronic Financial Services) พ.ศ. 2544 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

“ผู้ซื้อ” หมายถึง ผู้ที่ซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน หรือผู้ซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

“ผู้ขาย” หมายถึง ผู้ที่ขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน หรือ ธปท. ในฐานะผู้ขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

5.1 ก่อนเริ่มทำธุรกรรมกับ ธปท. ตามระเบียบนี้ ไพรมารี คิลเลอร์ ต้อง

5.1.1 เป็นผู้ให้บริการ และจะต้องแต่งตั้งบุคคลผู้มีอำนาจลงนาม ผู้จัดการสิทธิการใช้บริการ/ผู้รับรอง (Certifier) และผู้ปฏิบัติงาน (Officer) ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการให้บริการด้านการเงินด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (Electronic Financial Services) พ.ศ. 2544 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

5.1.2 ทำหนังสือแสดงความตกลงตามแบบ (1) ที่แนบท้ายระเบียบนี้

5.1.3 ทำหนังสือมอบอำนาจให้บุคคลทำหน้าที่แต่งตั้งผู้จัดการสิทธิการใช้บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดิลเลอร์ ตามแบบ (2) ที่แนบท้ายระเบียบนี้

5.1.4 ให้บุคคลผู้รับมอบอำนาจตามข้อ 5.1.3 ทำหนังสือแต่งตั้งผู้จัดการสิทธิการใช้บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดิลเลอร์ ตามแบบ (3) ที่แนบท้ายระเบียบนี้

5.1.5 ให้ผู้จัดการสิทธิตามข้อ 5.1.4 ทำหนังสือกำหนดสิทธิในการทำธุรกรรมบริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดิลเลอร์ ตามแบบ (4) ที่แนบท้ายระเบียบนี้ แต่จะกำหนดสิทธิให้ตนเองไม่ได้

5.1.6 ทำหนังสือมอบอำนาจให้บุคคลกระทำการแทนไพรมารี ดิลเลอร์ ในการติดต่อกับ ธปท. เพื่อทำธุรกรรมบริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดิลเลอร์ ตามแบบ (5) ที่แนบท้ายระเบียบนี้

5.1.7 ทำหนังสือแจ้งรายละเอียดสำหรับการส่งมอบและชำระราคาตราสารหนี้ ตามแบบ (6) ที่แนบท้ายระเบียบนี้

5.2 การแสดงเจตนา การบอกกล่าวและการสื่อสารใด ๆ ระหว่าง ธปท. กับไพรมารี ดิลเลอร์ ให้ดำเนินการผ่านบริการ EFS เว้นแต่ในกรณีที่บริการ EFS ชัดข้องหรือไม่สามารถใช้งานได้ การแจ้งข้อเสนอซื้อขาย การแจ้งผล การยืนยันหรือการติดต่อระหว่าง ไพรมารี ดิลเลอร์ กับ ธปท. ให้ดำเนินการทาง Reuters Dealing หรือ Bloomberg หรือ โทรสาร (facsimile)

ในกรณีที่ระบบบาทเน็ตต์ขัดข้อง หรือไม่สามารถรับส่งข้อความผ่านระบบบาทเน็ตต์ได้ ให้ใช้โทรสาร (facsimile) ในการสื่อสารแทน และการส่งมอบ Margin และดอกเบี้ย ให้ปฏิบัติตามวิธีการที่กำหนดไว้ในแผนฉุกเฉินของระบบบาทเน็ตต์

ในกรณีที่ไม่สามารถชำระราคาและ/หรือโอนตราสารหนี้ผ่านระบบของศูนย์รับฝากได้ ให้ปฏิบัติตามวิธีการที่กำหนดไว้ในระเบียบที่เกี่ยวข้องของศูนย์รับฝาก

5.3 ในการทำธุรกรรมแต่ละคราวนั้น ให้มีขั้นตอนดำเนินการ ดังนี้

5.3.1 ธปท. แจ้งความประสงค์ทำธุรกรรมไปยังไพรมารี ดิลเลอร์ ทุกราย ตามวิธีการและเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด

5.3.2 ไพรมารี ดิลเลอร์ ทุกรายต้องส่งข้อเสนอทำธุรกรรมกลับมายัง ธปท. ตามวิธีการและเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด โดยระบุรายละเอียดดังต่อไปนี้

5.3.2.1 ประเภทของธุรกรรม ว่าเป็นการซื้อและ/หรือขาย

5.3.2.2 ระยะเวลาของสัญญา ตามที่ ธปท. แจ้งไป

5.3.2.3 จำนวนเงินที่เสนอทำธุรกรรม ให้เป็นไปตามเงื่อนไขที่ ธปท.

ประกาศกำหนด

5.3.2.4 อัตราค่าตอบแทน ให้เป็นไปตามเงื่อนไขที่ สปท. ประกาศกำหนด
กรณีที่ไพรมารี คิลเลอร์ ต้องการเปลี่ยนแปลง หรือแก้ไข คำเสนอตาม
วรรคก่อน ไพรมารี คิลเลอร์ ต้องดำเนินการภายในเวลาที่กำหนดให้ทำคำเสนอ หากพ้นเวลา
ดังกล่าว ให้ถือว่าคำเสนอที่เสนอมารั้งหลังสุดก่อนพ้นกำหนดเวลาดังกล่าวเป็นคำเสนอที่ผูกพัน
ไพรมารี คิลเลอร์

5.3.3 สปท. จะพิจารณาซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือขาย
ตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน หรือขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี
คิลเลอร์ รายใดเป็นจำนวนเงินเท่าใดหรือไม่ก็ได้ และจะแจ้งผลการพิจารณาให้ไพรมารี คิลเลอร์
ทราบตามวิธีการและเวลาที่ สปท. ประกาศกำหนด

5.3.4 ผู้ขายจะต้องทำการยืนยันการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน
หรือขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ไปยังผู้ซื้อตามผลการพิจารณาของ สปท. ในข้อ 5.3.3
พร้อมระบุรายละเอียดของตราสารหนี้ หรือตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ตามแบบและเวลา
ที่ สปท. ประกาศกำหนด

5.3.5 ผู้ซื้อจะต้องแจ้งยืนยันการทำธุรกรรมกลับไปยังผู้ขายตามแบบและเวลาที่
สปท. ประกาศกำหนด

5.3.6 เมื่อผู้ซื้อและผู้ขายยืนยันการทำธุรกรรมเสร็จสมบูรณ์แล้ว ให้ถือว่าสัญญา
ดังต่อไปนี้ได้เกิดขึ้นทันที

5.3.6.1 สัญญาซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือขายตราสารหนี้
โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน รวมทั้งให้ถือว่าไพรมารี คิลเลอร์ และ สปท. ประสงค์ที่จะจดทะเบียน
เปลี่ยนแปลงกรรมสิทธิ์ในตราสารหนี้ตามสัญญาดังกล่าว หรือ

5.3.6.2 สัญญาขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย
เมื่อสัญญามีผลแล้ว ผู้ซื้อจะต้องชำระราคา และผู้ขายจะต้องโอนตราสารหนี้
ตามวิธีการและเวลาที่ สปท. ประกาศกำหนด สำหรับกรณีตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย
เมื่อ สปท. ได้รับการชำระราคาจากผู้ซื้อครบตามจำนวนแล้ว สปท. จะออกใบตราสารหนี้ธนาคารแห่ง
ประเทศไทยให้แก่ผู้ซื้อ

5.4 ในกรณีธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน
เมื่อเริ่มต้นวันทำการทุกวันจนถึงวันก่อนวันที่ขายคืนหรือซื้อคืน ให้ผู้ซื้อและผู้ขายเปรียบเทียบ
มูลค่าตลาดของตราสารหนี้ที่ซื้อหรือขาย กับเงินที่ได้ชำระค่าขายหรือซื้อรวมทั้งค่าตอบแทน
ตามสัญญา ตามวิธีการที่ สปท. ประกาศกำหนด

หากมูลค่าตลาดของตราสารหนี้สูงกว่าหรือต่ำกว่าเกณฑ์ที่ สปท. กำหนด และผู้ซื้อ
หรือผู้ขายประสงค์จะส่งมอบหรือรับมอบเงินเพิ่มเติม (Margin) ให้การแจ้งการหักทวงจำนวนเงิน
Margin และการส่งมอบ Margin เป็นไปตามวิธีการและภายในเวลาที่ สปท. ประกาศกำหนด

ให้ผู้ได้รับ Margin จ่ายดอกเบี้ยให้แก่ผู้ส่งมอบ Margin (Interest on Margin) ตามอัตราและวิธีการที่ ธปท. ประกาศกำหนด

5.5 ในวันที่ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หรือเวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยที่ครบกำหนด ให้มีขั้นตอนดำเนินการ ดังนี้

5.5.1 กรณีตราสารหนี้

(1) การแจ้งและการหักที่วงจํานวนเงิน Margin ที่ต้องส่งคืนหรือรับคืนของทุกสัญญาที่ครบกำหนด รวมทั้งดอกเบี้ยของจํานวนเงินที่ได้มีการส่งมอบหรือรับมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) ตลอดอายุสัญญา ให้เป็นไปตามวิธีการและเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด

(2) หากไม่มีข้อหักที่วงภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด ให้ผู้ที่มีภาระต้องส่งมอบเงินรวมสุทธิ ตามข้อ 5.5.1 (1) ทำการส่งมอบตามวิธีการและภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด ทั้งนี้ หาก ธปท. เป็นผู้จ่ายค่าตอบแทน ธปท. จะหักภาษี ณ ที่จ่ายไว้ ยกเว้นในกรณีที่ไพรมารี ดีลเลอร์ ได้รับยกเว้นไม่ต้องเสียภาษีเงินได้ตามประมวลรัษฎากร

(3) ให้ไพรมารี ดีลเลอร์ และ ธปท. ทำการขายคืนและซื้อคืนตราสารหนี้ โดยทำการชำระราคาและโอนตราสารหนี้ ตามวิธีการและเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด

5.5.2 กรณีตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

ในวันที่ตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยครบกำหนด เมื่อไพรมารี ดีลเลอร์ เวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ให้แก่ ธปท. แล้ว ธปท. จะส่งมอบเงินตามจํานวนเงินที่ไพรมารี ดีลเลอร์ ตกลงซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย พร้อมทั้งค่าตอบแทนของการถือตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ตามอัตราที่ตกลงกัน ตามวิธีการและภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด โดย ธปท. จะหักภาษี ณ ที่จ่ายไว้ ยกเว้นในกรณีที่ไพรมารี ดีลเลอร์ ได้รับยกเว้นไม่ต้องเสียภาษีเงินได้ตามประมวลรัษฎากร และให้ถือว่าสิทธิของไพรมารี ดีลเลอร์ ในตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ดังกล่าวสิ้นสุดลงทันที

5.6 ให้สิทธิและหน้าที่เกี่ยวกับการเลิกสัญญา การเรียกหรือชำระเบี้ยปรับกรณีผิดนัดเป็นดังนี้

5.6.1 หากไพรมารี ดีลเลอร์ ตกเป็นผู้ที่ถูกศาลสั่งพิทักษ์ทรัพย์ชั่วคราวหรือเด็ดขาด หรือไพรมารี ดีลเลอร์ ยื่นขอความยินยอมจาก ธปท. เพื่อขอฟื้นฟูกิจการตามกฎหมายล้มละลาย หรือ ธปท. ตรวจสอบพบว่าสถานะทางการเงินของไพรมารี ดีลเลอร์ ไม่มั่นคงเพียงพอในกรณีเช่นนี้ ให้ ธปท. มีสิทธิเลิกสัญญาซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน หรือสัญญาขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน หรือสัญญาขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ที่มีกับไพรมารี ดีลเลอร์ หน้านั้นทุกสัญญาหรือบางสัญญา หรือมีสิทธิแก้ไขเปลี่ยนแปลงสัญญาที่มีอยู่กับไพรมารี ดีลเลอร์ หน้านั้นได้ และมีสิทธิให้นำมูลหนี้ของคู่สัญญาทั้งสองฝ่ายมาหักกลบกัน

5.6.2 ในวันที่ซื้อหรือขายตราสารหนี้ (ขาแรก) หรือวันที่ขายตราสารหนี้ ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ไพรมารี คิลเลอร์ หากไพรมารี คิลเลอร์ ฝึกนัดชำระราคาหรือส่งมอบตราสารหนี้ภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด ให้ไพรมารี คิลเลอร์ ชำระเบี้ยปรับกรณีล่าช้าพร้อมชำระราคาหรือส่งมอบตราสารหนี้ผ่านระบบบาทเนตตามอัตรา และวิธีการที่ ธปท. ประกาศกำหนด ภายในเวลาทำการของระบบบาทเนตของวันที่ฝึกนัดนั้น

หากไพรมารี คิลเลอร์ ยังไม่ชำระราคาหรือส่งมอบตราสารหนี้พร้อมเบี้ยปรับกรณีล่าช้าภายในเวลาที่กำหนดตามวรรคก่อน ให้ ธปท. มีสิทธิออกเลิกสัญญาหรือดำเนินการตามที่เหมาะสม และให้ไพรมารี คิลเลอร์ ชำระเบี้ยปรับกรณีล่าช้า และเบี้ยปรับกรณีไม่ชำระราคาหรือไม่ส่งมอบตราสารหนี้ให้แก่ ธปท. ผ่านระบบบาทเนตตามอัตรา วิธีการและเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด

5.6.3 ในแต่ละวันทำการจนถึงวันก่อนวันที่ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หากไพรมารี คิลเลอร์ ฝึกนัดไม่ส่งมอบ Margin ตามข้อ 5.4 วรรคสอง ให้ไพรมารี คิลเลอร์ ชำระเบี้ยปรับพร้อมส่งมอบ Margin ให้แก่ ธปท. ผ่านระบบบาทเนตตามอัตรา วิธีการและเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด

5.6.4 ในวันที่ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หากไพรมารี คิลเลอร์ ฝึกนัดชำระราคาหรือส่งมอบตราสารหนี้ ภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด ให้ไพรมารี คิลเลอร์ ชำระเบี้ยปรับกรณีล่าช้าพร้อมชำระราคาหรือส่งมอบตราสารหนี้ผ่านระบบบาทเนตตามอัตราและวิธีการที่ ธปท. ประกาศกำหนด ภายในเวลาทำการของระบบบาทเนตของวันที่ฝึกนัดนั้น

หากไพรมารี คิลเลอร์ ยังไม่ชำระราคาหรือส่งมอบตราสารหนี้เพื่อการขายคืนหรือซื้อคืน พร้อมเบี้ยปรับกรณีล่าช้า ภายในเวลาตามวรรคก่อน ให้ไพรมารี คิลเลอร์ สิ้นสิทธิที่จะขายคืนหรือซื้อคืน ในกรณีเช่นนี้ ไพรมารี คิลเลอร์ มีภาระต้องชำระเบี้ยปรับกรณีล่าช้าและเบี้ยปรับกรณีไม่ชำระราคาหรือไม่ส่งมอบตราสารหนี้ผ่านระบบบาทเนตตามอัตรา วิธีการและเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด และให้นำภาระดังกล่าวมาเปรียบเทียบกับส่วนต่างระหว่าง

(ก) มูลค่าตลาดของตราสารหนี้ และยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) (ถ้ามี) และดอกเบี้ยของเงินที่ต้องทำการส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) (ถ้ามี) กับ

(ข) จำนวนเงินค่าขายคืนหรือซื้อคืน (Repurchase Price) และยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) (ถ้ามี) และดอกเบี้ยของเงินที่ต้องทำการส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) (ถ้ามี)

ธปท. จะแจ้งยอดเงินที่คำนวณได้ตามวรรคก่อน และให้ผู้มีภาระทำการส่งมอบเงินตามจำนวนดังกล่าวแก่อีกฝ่ายหนึ่งผ่านระบบบาทเนต ภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด สำหรับการชำระเบี้ยปรับตามวรรคก่อน

นอกจากนี้ ธปท. มีสิทธิเลิกสัญญาซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือสัญญาขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน หรือสัญญาขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ที่มีกับ ไพรมารี คีลเลอร์ รายนั้นทุกสัญญาหรือบางสัญญา หรือมีสิทธิแก้ไขเปลี่ยนแปลงสัญญาที่มีอยู่กับ ไพรมารี คีลเลอร์ รายนั้นได้ ในการนี้ การเปรียบเทียบส่วนต่างให้นำความในวรรคสองและวรรคสามมาใช้โดยอนุโลม

5.7 ในกรณีที่ ไพรมารี คีลเลอร์ รายใดผิดนัดกรณีล่าช้าตามข้อ 5.6.2 วรรคหนึ่ง ข้อ 5.6.3 หรือ 5.6.4 วรรคหนึ่ง รวมกันตั้งแต่ 2 ครั้งขึ้นไปในรอบการพิจารณาประเมินผลการเป็น ไพรมารี คีลเลอร์ ธปท. จะระงับสิทธิการทำธุรกรรมกับ ไพรมารี คีลเลอร์ รายดังกล่าวเป็นเวลา 2 เดือน นับแต่วันผิดนัดครั้งล่าสุด หรือเท่ากับจำนวนเวลาที่เหลือก่อนครบรอบการพิจารณาประเมินผลการเป็น ไพรมารี คีลเลอร์ นั้น แล้วแต่ระยะเวลาใดจะน้อยกว่า

5.8 ในกรณีที่ ไพรมารี คีลเลอร์ รายใดผิดนัดกรณีไม่ชำระราคาหรือไม่ส่งมอบตราสารหนี้ตามข้อ 5.6.2 วรรคสอง ข้อ 5.6.3 หรือ 5.6.4 วรรคสอง ธปท. มีสิทธิระงับการทำธุรกรรมกับ ไพรมารี คีลเลอร์ รายดังกล่าวเป็นระยะเวลาตามที่ ธปท. พิจารณาเห็นสมควรและสงวนสิทธิ์ในการพิจารณาให้ ไพรมารี คีลเลอร์ รายนั้นพ้นจากสถานะการเป็น ไพรมารี คีลเลอร์ ทันที และอาจไม่ได้รับการพิจารณาเป็น ไพรมารี คีลเลอร์ ของ ธปท. ในรอบการพิจารณาถัดไปด้วย

5.9 ในกรณีที่ ไพรมารี คีลเลอร์ ไม่สามารถชำระราคา ส่งมอบเงินหรือตราสารหนี้ให้แก่ ธปท. ตามข้อ 5.6.1 ข้อ 5.6.2 ข้อ 5.6.3 หรือข้อ 5.6.4 แห่งระเบียบนี้ ไพรมารี คีลเลอร์ ยินยอมให้ ธปท. หักเงินจากบัญชีเงินฝากของ ไพรมารี คีลเลอร์ รวมทั้งจำหน่ายตราสารหนี้และทรัพย์สินอื่นใดของ ไพรมารี คีลเลอร์ ที่มีอยู่ที่ ธปท. จนเพียงพอกับจำนวนที่ค้างชำระ

5.10 ธปท. สงวนสิทธิ์ที่จะปรับปรุงแก้ไข เพิ่มเติม หรือเปลี่ยนแปลงระเบียบ ประกาศ หรือเอกสารที่เกี่ยวข้องตามระเบียบนี้ได้ โดย ธปท. จะแจ้งการปรับปรุงแก้ไข เพิ่มเติม หรือเปลี่ยนแปลงดังกล่าว ให้ ไพรมารี คีลเลอร์ ทราบล่วงหน้าก่อนที่จะใช้บังคับกับ ไพรมารี คีลเลอร์

5.11 การตีความตามระเบียบ ประกาศ หรือข้อกำหนดอื่นใดที่ออกตามระเบียบนี้ให้ ธปท. เป็นผู้วินิจฉัยชี้ขาด

5.12 ธปท. อาจพิจารณาไม่ซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน หรือขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน หรือขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ตามระเบียบนี้จาก ไพรมารี คีลเลอร์ เป็นการชั่วคราวหรือถาวร ในกรณีที่ ไพรมารี คีลเลอร์ ไม่ปฏิบัติตามระเบียบนี้หรือระเบียบอื่นใดของ ธปท. และหรือดำเนินการใด ๆ ในทิศทางที่ไม่สอดคล้องและหรือส่งผลในทางลบต่อแนวทางของทางการในการดำเนินนโยบายการเงิน นโยบายอัตราแลกเปลี่ยน และหรือการสร้างเสถียรภาพในระบบการเงิน

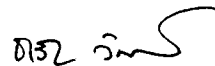
6. บทเฉพาะกาล

ให้ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขาย พันธบัตรกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนด้วยวิธี อิเล็กทรอนิกส์ (e-Bilateral Repo) พ.ศ. 2546 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ยังคงมีผลใช้บังคับต่อไปสำหรับ สัญญาซื้อหรือขายที่เกิดขึ้นแล้วตามระเบียบดังกล่าว แล้วแต่กรณีจนกว่าไพรมารี ดีลเลอร์ จะได้ ปฏิบัติตามสัญญาครบถ้วนแล้ว

7. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 14 ก.ย. 2552



(นางชาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

หนังสือแสดงความตกลง

ทำที่.....

วันที่

ข้าพเจ้า.....ได้อ่านระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญา
ว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์
(Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)
ลงวันที่ 14 กันยายน 2552 โดยละเอียดตลอดแล้ว

มีความประสงค์จะรับประโยชน์จากระเบียบดังกล่าว จึงตกลงผูกพันตนและยินยอมรับ
ปฏิบัติตามระเบียบดังกล่าวข้างต้นและที่จะแก้ไขเพิ่มเติมต่อไปในภายหน้า รวมถึงข้อกำหนดอื่นใดที่จะ
กำหนดขึ้นเพื่อให้เป็นไปตามระเบียบดังกล่าว

ข้าพเจ้าขอให้คำมั่นสัญญาต่อ ธปท.ว่าจะไม่เพิกถอนความตกลงตามหนังสือนี้ เว้นแต่
จะได้รับความเห็นชอบจาก ธปท. เป็นลายลักษณ์อักษร

ลงลายมือชื่อ

(.....)

ผู้มีอำนาจลงนาม

เพื่อ

หมายเหตุ ลงนามโดยผู้มีอำนาจตามหนังสือรับรองกระทรวงพาณิชย์ ประทับตรานิติบุคคล (ถ้ามี) แนบสำเนาหนังสือรับรองกระทรวง
พาณิชย์และสำเนาบัตรประจำตัวประชาชนของผู้มีอำนาจลงนามทุกคน หรือลงนามโดยผู้มีอำนาจลงนามตามกฎหมาย พร้อมแนบเอกสาร
หลักฐานที่เกี่ยวข้อง (แล้วแต่กรณี)

(ตามระเบียบข้อ 5.1.2)

หนังสือแต่งตั้งผู้มีอำนาจลงนามแต่งตั้งผู้จัดการสิทธิการใช้บริการ

วันที่

ตามหนังสือแสดงความตกลงใช้บริการด้านการเงินด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ ของข้าพเจ้า (ชื่อของนิติบุคคล).....ลงวันที่..... วันที่ตามความตกลงของระเบียบ EFS พ.ศ. 2544..... ซึ่งได้ตกลงผูกพันตนและยินยอมปฏิบัติตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการให้บริการด้านการเงินด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (Electronic Financial Services) พ.ศ. 2544 และที่แก้ไขเพิ่มเติม และตามหนังสือแสดงความตกลงของข้าพเจ้าตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 14 กันยายน 2552 ทั้งที่มีผลใช้บังคับอยู่ในขณะนี้และที่จะแก้ไขเพิ่มเติมต่อไปในภายหน้า รวมถึงข้อกำหนดอื่นใดที่จะกำหนดขึ้น เพื่อให้เป็นไปตามระเบียบดังกล่าว

เพื่อให้เป็นไปตามข้อ 5.1.3 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 14 กันยายน 2552 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ข้าพเจ้าขอมอบอำนาจให้บุคคลตามรายชื่อในหนังสือนี้เป็นผู้มีอำนาจลงนามสามารถทำหน้าที่แต่งตั้งผู้จัดการสิทธิการใช้บริการตามระเบียบดังกล่าว

ชื่อ-นามสกุล	ตำแหน่ง	ตัวอย่างลายมือชื่อ 1	ตัวอย่างลายมือชื่อ 2	โทรศัพท์

การใด ๆ ที่ผู้รับมอบอำนาจได้กระทำไปให้มีผลผูกพันข้าพเจ้าทุกประการ และข้าพเจ้าจะไม่เพิกถอนการมอบอำนาจตามหนังสือนี้ หากมีการเพิ่มเติมหรือเปลี่ยนแปลงบุคคลผู้รับมอบอำนาจ ข้าพเจ้าจะแจ้งให้ ธปท. ทราบล่วงหน้าตามแบบหนังสือนี้

ทั้งนี้ การมอบอำนาจดังกล่าวให้มีผลตั้งแต่วันที่.....เป็นต้นไป

ลงลายมือชื่อ.....

(.....)

ผู้มีอำนาจลงนาม

เพื่อ.....

หมายเหตุ ลงนามโดยผู้มีอำนาจตามหนังสือรับรองกระทรวงพาณิชย์ ประเภทนิติบุคคล (ถ้ามี) แบบสำเนาบัตรประจำตัวประชาชนของผู้มีอำนาจลงนามทุกคน พร้อมทั้งติดอากรแสตมป์ผู้รับมอบอำนาจท่านละ 30 บาท หรือลงนามโดยผู้มีอำนาจลงนามตามกฎหมาย พร้อมแนบเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้อง (แล้วแต่กรณี)

ชื่อของนิติบุคคล.....

หนังสือแต่งตั้งผู้จัดการสิทธิการใช้บริการ

วันที่.....

ตามที่.....

ได้แสดงความตกลงใช้บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดิลเลอร์ แล้วนั้น

ข้าพเจ้าขอแต่งตั้งให้บุคคลตามรายชื่อต่อไปนี้เป็นผู้จัดการสิทธิการใช้บริการ (Certifier)

ดังกล่าว

ชื่อ-สกุล ภาษาอังกฤษ	ชื่อ-สกุล ภาษาไทย	เลขที่บัตรประจำตัว

ทั้งนี้ ให้มีผลตั้งแต่วันที่.....เป็นต้นไป โดยแทนที่หนังสือ
แต่งตั้งผู้จัดการสิทธิการใช้บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดิลเลอร์
ที่ได้เคยลงนามก่อนหน้านี้ (ถ้ามี)

ลงลายมือชื่อ.....

(.....)

ตำแหน่ง.....

(ตามระเบียบข้อ 5.1.4)

ชื่อของนิติบุคคล.....

Reference#

หนังสือกำหนดสิทธิการทำธุรกรรม

วันที่.....

ตามที่ ได้มอบหมายให้ข้าพเจ้าเป็น
ผู้จัดการสิทธิการใช้บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์ นั้น

ข้าพเจ้าขอกำหนดสิทธิให้กับ.....ในการเป็น
Officer ดังรายละเอียดต่อไปนี้

1.	BRP_POLICY	1. ประกาศนโยบาย
2.	BRP_BIDDING	2. เสนอซื้อ/เสนอขาย
3.	BRP_RESULT	3. เรียกดูผลการจัดสรร
4.	BRP_PRINT_PN	4. พิมพ์ตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย
5.	BRP_LOG	5. เรียกดู Daily log
6.	BRP_HISTORY	6. เรียกดูข้อมูลย้อนหลัง

ทั้งนี้ ให้มีผลตั้งแต่วันที่.....เป็นต้นไป โดยให้แทนที่หนังสือ
กำหนดสิทธิการทำธุรกรรมเกี่ยวกับบริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี
ดีลเลอร์ สำหรับบุคคลนี้ที่ได้เคยลงนามก่อนหน้านี้ (ถ้ามี)

ลงลายมือชื่อ.....

(ผู้จัดการสิทธิการใช้บริการ)

(ตามระเบียบข้อ 5.1.5)

หนังสือมอบอำนาจ

วันที่.....

ตามหนังสือแสดงความตกลงของข้าพเจ้า.....
 ลงวันที่.....ซึ่งได้ตกลงผูกพันตนและยินยอมรับระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่
 สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน
 หรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer)
 (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ชปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 14 กันยายน 2552
 ทั้งที่มีผลใช้บังคับอยู่ในขณะนี้และที่จะแก้ไขเพิ่มเติมต่อไปในภายหน้า รวมถึงข้อกำหนดอื่นใดที่จะ
 กำหนดขึ้นเพื่อให้เป็นไปตามระเบียบดังกล่าว

ข้าพเจ้าขอมอบอำนาจให้บุคคลหนึ่งบุคคลใดตามรายชื่อและลายมือชื่อในหนังสือนี้
 เป็นผู้ดำเนินการแทนข้าพเจ้าในการติดต่อกับ ชปท. เพื่อประสานงานหรือดำเนินการใด ๆ อันเกี่ยวเนื่อง
 กับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนหรือซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย
 ตามระเบียบดังกล่าวข้างต้น

<u>รายชื่อผู้รับมอบอำนาจ</u>	<u>ลายมือชื่อ</u>	<u>ตำแหน่ง</u>	<u>เบอร์โทรศัพท์</u>	<u>เบอร์โทรสาร</u>
1.....
2.....
3.....

การใด ๆ ที่ผู้รับมอบอำนาจตามหนังสือฉบับนี้ได้กระทำไปให้มีผลผูกพันข้าพเจ้า
 ทุกประการ และข้าพเจ้าจะไม่เพิกถอนการมอบอำนาจตามหนังสือนี้ หากมีการเพิ่มเติมหรือเปลี่ยนแปลง
 บุคคลผู้ได้รับมอบอำนาจ ข้าพเจ้าจะแจ้งให้ ชปท. ทราบล่วงหน้าตามแบบหนังสือนี้

ลงลายมือชื่อ.....

(.....)

ผู้มีอำนาจลงนาม

เพื่อ.....

หมายเหตุ ลงนามโดยผู้มีอำนาจตามหนังสือรับรองกระทรวงพาณิชย์ ประทับตรานิติบุคคล (ถ้ามี) แบบสำเนาบัตรประจำตัวประชาชนของ
 ผู้มีอำนาจลงนามทุกคน พร้อมทั้งติดอากรแสตมป์ผู้รับมอบอำนาจท่านละ 30 บาท หรือลงนามโดยผู้มีอำนาจลงนามตามกฎหมาย พร้อม
 แนบเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้อง (แล้วแต่กรณี)

(ตามระเบียบข้อ 5.1.6)

แบบ (6)

หนังสือแจ้งรายละเอียดสำหรับการส่งมอบและชำระราคาตราสารหนี้

วันที่.....

เรียน ผู้อำนวยการ ฝ่ายบริหารความเสี่ยงและปฏิบัติการทางการเงิน
ธนาคารแห่งประเทศไทย

ข้าพเจ้า.....ขอแจ้งรายละเอียดเพื่อการส่งมอบและชำระราคาตราสารหนี้ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 14 กันยายน 2552 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ดังนี้

เลขที่บัญชีกระแสรายวัน.....

เลขที่บัญชีตราสารหนี้.....

ชื่อบัญชีภาษาไทย.....

ชื่อบัญชีภาษาอังกฤษ.....

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

ข้าพเจ้าขอให้คำมั่นสัญญาต่อ ธปท.ว่าจะไม่เพิกถอนรายละเอียดตามหนังสือนี้ หากมีการเปลี่ยนแปลงรายละเอียด ข้าพเจ้าจะแจ้งให้ ธปท. ทราบล่วงหน้าตามแบบหนังสือนี้

ขอแสดงความนับถือ

ลงลายมือชื่อ

(.....)

ผู้มีอำนาจลงนาม

เพื่อ.....

หมายเหตุ ลงนามโดยผู้มีอำนาจตามหนังสือรับรองกระทรวงพาณิชย์ ประทับตรานิติบุคคล (ถ้ามี) แบบสำเนาบัตรประจำตัวประชาชนของผู้มีอำนาจลงนามทุกคน หรือลงนามโดยผู้มีอำนาจลงนามตามกฎหมาย พร้อมแนบเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้อง (แล้วแต่กรณี)

(ตามระเบียบข้อ 5.1.7)



ตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

เลขที่ xxxxx/25xx

(...ระบุวันที่ออก...)

ตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยฉบับนี้ออกเพื่อแสดงสิทธิของ.....
 ที่ได้ซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 82/2552
 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและ
 การขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขาย
 ตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ษปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 14 กันยายน 2552 และที่แก้ไข
 เพิ่มเติมเป็นเงินจำนวน.....บาท (.....)
 อัตราค่าตอบแทนร้อยละ ต่อปี โดยตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยฉบับนี้
 ไม่สามารถโอนเปลี่ยนมือหรือ โอน โดยวิธีการ โอนสิทธิเรียกร้องได้ รวมทั้งจะใช้เป็นหลักประกัน
 ไม่ได้ด้วย

ในวันครบกำหนดวันที่.....ษปท. จะนำเงินเข้าบัญชีเงินฝาก
 กระแสรายวันของ.....ผ่านระบบบาทเน็ต เพื่อชำระค่าตราสารหนี้
 ธนาคารแห่งประเทศไทยฉบับนี้ พร้อมอัตราค่าตอบแทนตามที่ระบุข้างต้น ทั้งนี้ ให้สิทธิในตราสารหนี้
 ธนาคารแห่งประเทศไทยฉบับนี้สิ้นสุดทันทีหลังจากที่ ษปท. ได้นำเงินเข้าบัญชีให้เรียบร้อยแล้ว

เพื่อธนาคารแห่งประเทศไทย

ลงชื่อ.....

(.....)

ผู้ว่าการ^{แทน}

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 83/2552

เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และระบบสื่อสาร ในการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ รพท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตามข้อ 5.3 5.4 และ 5.5 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และตราสารหนี้ รพท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 14 กันยายน 2552 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

รพท. จึงออกประกาศเพื่อกำหนดเงื่อนไข เวลา และระบบสื่อสารในการซื้อขายตราสารหนี้หรือขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์

2. ขอบเขตการบังคับใช้

สถาบันการเงินที่ได้รับแต่งตั้งจาก รพท. เป็นไพรมารี ดีลเลอร์ สำหรับการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

3. เนื้อหา

รพท. กำหนดเงื่อนไข เวลา และระบบสื่อสารในการทำธุรกรรม ดังต่อไปนี้

- การเสนอซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน หรือซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ทุกช่วงเวลา ต้องเป็นจำนวนเงินระยะเวลาละไม่ต่ำกว่า 100 ล้านบาท และไม่มีเศษของ 10 ล้านบาท
- การเสนออัตราค่าตอบแทนให้เป็นร้อยละต่อปีและมีทศนิยมไม่เกิน 3 ตำแหน่ง
- กรณีตราสารหนี้ หากวันปิดพักสมุดทะเบียนเพื่อการจ่ายดอกเบี้ยของตราสารหนี้ที่ใช้ในการทำธุรกรรมอยู่ในช่วงระยะเวลาของสัญญา ผู้ที่ได้รับ โอนตราสารหนี้ดังกล่าวจะต้องชำระคืนดอกเบี้ยตราสารหนี้ให้แก่ผู้โอนในวันที่ได้รับดอกเบี้ย ดังนี้

3.1 หากไพรมารี คิลเลอร์ เป็นผู้ได้รับ โอนตราสารหนี้ จะต้องชำระคืนดอกเบี้ยตราสารหนี้ให้แก่ ธปท. เต็มจำนวน โดยไม่มีการหักภาษี ณ ที่จ่าย

3.2 หาก ธปท. เป็นผู้ได้รับ โอนตราสารหนี้ จะชำระคืนดอกเบี้ยตราสารหนี้ โดยมีการหักภาษี ณ ที่จ่ายให้แก่ผู้โอน ยกเว้น ผู้โอนที่ได้รับยกเว้น ไม่ต้องเสียภาษีเงินได้ตามประมวลรัษฎากร ธปท. จะชำระคืนดอกเบี้ยตราสารหนี้ให้แก่ผู้โอนเต็มจำนวน โดยไม่มีการหักภาษี ณ ที่จ่าย

4. วันที่สัญญาครบกำหนดจะต้องเป็นวันก่อนหน้าวันเริ่มปิดพักสมุดทะเบียนเพื่อการไถ่ถอนตราสารหนี้อย่างน้อย 1 วันทำการ

5. การทำธุรกรรมซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน หรือซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ตามข้อ 5.3 แห่งระเบียบฯ ให้ดำเนินการตามวิธีการและกรอบเวลา ดังนี้

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	รอบเช้า เวลา	รอบบ่าย เวลา	รอบพิเศษ เวลา
ธปท. แจ้งความประสงค์ไปยังไพรมารี คิลเลอร์	บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี คิลเลอร์	ภายใน 9.30 น.	ภายใน 14.30 น.	ภายใน 16.00 น.
ไพรมารี คิลเลอร์ ทุกรายแจ้งเสนอซื้อหรือเสนอขายมาให้ ธปท.	บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี คิลเลอร์	ภายใน 9.45 น.	ภายใน 14.45 น.	ภายใน 16.15 น.
ธปท. แจ้งผลการพิจารณาการรับซื้อหรือขายให้ไพรมารี คิลเลอร์ ทราบ	บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี คิลเลอร์	ภายใน 10.00 น.	ภายใน 15.00 น.	ภายใน 16.30 น.
ผู้ขายยื่นยันการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนหรือการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยไปยังผู้ซื้อ	แจ้งผ่านระบบบาทเน็ตโดยใช้บริการรับส่งข้อความระบบบาทเน็ต (MT298) ตามที่กำหนด	ภายใน 11.30 น.	ภายใน 15.30 น.	ภายใน 17.00 น.

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	รอบเช้า เวลา	รอบบ่าย เวลา	รอบพิเศษ เวลา
ผู้ซื้อแจ้งยืนยันธุรกรรมกลับไป ยังผู้ขาย	แจ้งผ่านระบบ บาทเน็ตโดยใช้บริการ รับส่งข้อความระบบ บาทเน็ต (MT298) ตามที่กำหนด	ภายใน 13.00 น.	ภายใน 15.45 น.	ภายใน 17.20 น.
การโอนตราสารหนี้ การออก ตราสารหนี้ธนาคารแห่ง ประเทศไทย และการชำระ ราคา	โอนตราสารหนี้ พร้อมการชำระราคา ตามระบบของศูนย์รับ ฝาก (MT541, MT543) หรือออก ตราสารหนี้ธนาคาร แห่งประเทศไทย พร้อมการชำระราคา ผ่านระบบบาทเน็ต (MT 202)	ภายใน 14.00 น.	ภายใน 16.15 น.	ภายใน 17.30 น.

6. การเรียก Margin กรณีตราสารหนี้ ตามข้อ 5.4 แห่งระเบียบฯ ให้ดำเนินการตามวิธีการ
และกรอบเวลา ดังนี้

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ฝ่ายเรียก Margin (ชปท. หรือไพรมารี ดีลเลอร์) แจ้ง จำนวนเงินที่อีกฝ่ายต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) ให้ผู้สัญญาทราบ	แจ้งผ่านระบบบาทเน็ต โดยใช้บริการรับส่งข้อความ ระบบบาทเน็ต (MT298)	ภายใน 9.45 น.
ฝ่ายส่งมอบ Margin (ไพรมารี ดีลเลอร์ หรือ ชปท.) หักท้วงหากไม่ถูกต้อง	แจ้งทางโทรศัพท์	ภายใน 10.00 น.
ผู้ที่ต้องทำการส่งมอบ Margin โอนเงินให้แก่ผู้สัญญา	ระบบบาทเน็ต (MT202)	ภายใน 11.00 น.

7. การทำธุรกรรมขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หรือเวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่ง
ประเทศไทยตามข้อ 5.5 แห่งระเบียบฯ ให้ดำเนินการตามวิธีการและกรอบเวลา ดังนี้

กรณีตราสารหนี้

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ฝ่ายเรียกคืน Margin (ชปท. หรือไพรมารี คิลเลอร์) แจ้งจำนวนเงิน Margin ที่ต้องรับคืนของทุกสัญญาที่ครบกำหนด รวมทั้งดอกเบี้ยของจำนวนเงินที่ได้มีการส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) ตลอดจนอายุสัญญาให้คู่สัญญาทราบ	แจ้งผ่านระบบบาทเน็ต โดยใช้บริการรับส่งข้อความระบบบาทเน็ต (MT298)	ภายใน 9.45 น.
ฝ่ายส่งมอบ Margin (ไพรมารี คิลเลอร์ หรือ ชปท.) ทักท้วงหากไม่ถูกต้อง	แจ้งทางโทรศัพท์	ภายใน 10.00 น.
ผู้ที่ต้องทำการส่งมอบ Margin และดอกเบี้ยโอนเงินให้แก่คู่สัญญา	ระบบบาทเน็ต (MT202)	ภายใน 11.00 น.
การโอนตราสารหนี้และการชำระราคาสำหรับสัญญาที่ครบกำหนด	โอนตราสารหนี้พร้อมการชำระราคา ตามระบบของศูนย์รับฝาก (MT541, MT543)	ภายใน 14.00 น.

กรณีตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ไพรมารี คิลเลอร์ เวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ให้ ชปท. และ ชปท. ส่งมอบเงินให้ไพรมารี คิลเลอร์	ส่งคืนที่ ชปท. และ ชปท. ส่งมอบเงินผ่านระบบบาทเน็ต (MT 202)	ภายใน 14.00 น.

4. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 14 ก.ย. 2552

ดร. วิมล

(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สก. 84/2552

เรื่อง การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้และเงินที่จะต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย กับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ สปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตามข้อ 5.4 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สก. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ สปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 14 กันยายน 2552 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

สปท. จึงออกประกาศเพื่อกำหนดหลักเกณฑ์การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้และจำนวนเงินที่จะต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) สำหรับธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้กับไพรมารีดีลเลอร์

2. ขอบเขตการบังคับใช้

สถาบันการเงินที่ได้รับแต่งตั้งจาก สปท. เป็นไพรมารี ดีลเลอร์ สำหรับการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

3. เนื้อหา

สปท. กำหนดหลักเกณฑ์การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้และจำนวนเงินที่จะต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) ดังต่อไปนี้

1. มูลค่าของตราสารหนี้ คำนวณตามราคาตลาด¹⁾ ที่ปรับลดด้วยอัตราส่วนลด (Haircut) ตามประเภทตราสารหนี้ และอายุคงเหลือของตราสารหนี้

¹⁾ ราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) คำนวณตามสูตรการคำนวณราคาตราสารหนี้ที่ประกาศโดย สปท. ใช้อัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันก่อนหน้าวันตกลงซื้อขายตราสารหนี้สำหรับการส่งมอบในวันที่ซื้อขายตราสารหนี้ (ในกรณีที่ไม่สามารถเรียกดูอัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันก่อนหน้าได้ ให้ใช้อัตราผลตอบแทน ณ วันล่าสุดที่สามารถเรียกดูได้) ในกรณีที่ไม่มีราคาตลาดที่เผยแพร่โดย ThaiBMA ให้ใช้ราคาที่คำนวณตามวิธีการที่ สปท. กำหนด ซึ่งเผยแพร่ใน website ของ สปท.

2. อัตราส่วนลด (Haircut) ในการซื้อหรือขายตราสารหนี้ และช่วงอัตราปลอดการเรียกเงินเพิ่ม (Variation Margin)

ในการพิจารณาจำนวนเงินที่จะต้องเรียกเพิ่มเติมตามข้อ 5.4 ที่เกี่ยวข้องแห่งระเบียบฯ ให้พิจารณาอัตราส่วนลดประกอบกับช่วงอัตราปลอดการเรียกเงินเพิ่มก่อนที่จะมีการเรียกเงินเพิ่มตามตารางนี้

ประเภทของตราสารหนี้และอายุคงเหลือ	อัตราส่วนลด (Haircut) (ร้อยละ)	ช่วงอัตราปลอดการเรียกเงินเพิ่ม (Variation Margin) (ร้อยละ)
อายุคงเหลือ 0 - 1 ปี - ตัวเงินคลัง - ตัวสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ - พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร ธปท. ประเภทอายุไม่เกินหนึ่งปี พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร ธปท. ประเภทอายุเกินกว่าหนึ่งปีแบบอัตราดอกเบี้ยคงที่ และแบบอัตราดอกเบี้ยลอยตัว - พันธบัตรหรือหุ้นกู้ที่ออกโดยองค์การของรัฐหรือรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ทั้งนี้ ตามที่ ธปท. จะเห็นสมควร	1	0.75
อายุคงเหลือมากกว่า 1 ปี - พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร ธปท. แบบอัตราดอกเบี้ยลอยตัว - พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร ธปท. แบบอัตราดอกเบี้ยคงที่ - พันธบัตรหรือหุ้นกู้ที่ออกโดยองค์การของรัฐหรือรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ทั้งนี้ ตามที่ ธปท. จะเห็นสมควร	1 3 3.5	0.75 2 2

Variation Margin หมายถึง ช่วงอัตราปลอดการเรียกเงินเพิ่มตามที่กำหนดไว้สำหรับตราสารหนี้แต่ละประเภทตามข้อ 2 ของประกาศนี้ และในกรณีที่มีตราสารหนี้หลายประเภทหรือหลายรุ่นในหนึ่งสัญญา Variation Margin จะเท่ากับค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Variation Margin ของตราสารหนี้เหล่านั้น

2) ในกรณีที่มีการเรียก Margin จำนวนที่ต้องส่งมอบเท่ากับ

ก. $[(1 + \text{Haircut}) \times \text{Repurchase Price}] - \text{มูลค่าตลาดของตราสารหนี้}$
หรือ
ข. $\text{มูลค่าตลาดของตราสารหนี้} - [(1 + \text{Haircut}) \times \text{Repurchase Price}]$
แล้วแต่กรณี

ทั้งนี้ มูลค่าตลาดของตราสารหนี้ที่ใช้ในการคำนวณตามสูตรใน 1) และ 2) ให้ปรับด้วย Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) ของสัญญานั้น

3) เงื่อนไขอื่น ๆ ที่เกี่ยวข้องกับการเรียก Margin มีดังต่อไปนี้

ก. ในแต่ละวัน ให้นำยอดเงิน Margin ที่ต้องส่งมอบตาม 2) ของแต่ละสัญญามาคำนวณหายอดสุทธิ โดย รพท. จะจ่ายหรือเรียก Margin ในจำนวนเท่ากับยอดสุทธิดังกล่าว

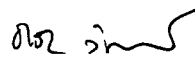
ข. ถ้ายอดสุทธิตาม ก. สำหรับไพรมารี คิลเลอร์ รายใดต่ำกว่า 100,000 บาท รพท. จะยกเว้นการจ่ายหรือเรียก Margin กับไพรมารี คิลเลอร์ รายนั้น

ค. สินทรัพย์ที่ใช้ส่งมอบระหว่างกันให้อยู่ในรูปของเงิน

4. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 14 ก.ย. 2552



(นางชาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

3. การคำนวณราคาซื้อขายตราสารหนี้ ราคาขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ และเงิน Margin

3.1 สูตรการคำนวณราคาซื้อขายตราสารหนี้

$$\text{Purchase Price} \times (1 + \text{Haircut}) \leq \text{มูลค่ารวมของตราสารหนี้}$$

ราคาซื้อขายตราสารหนี้ (Purchase Price) หมายถึง จำนวนเงินที่ใช้ในการซื้อหรือขายตราสารหนี้ ณ วันเริ่มต้นของธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้

มูลค่ารวมของตราสารหนี้ หมายถึง ผลรวมของมูลค่าตลาดของตราสารหนี้ที่ใช้ในการซื้อขาย ทั้งนี้ ตราสารหนี้แต่ละรุ่นที่ใช้ในการซื้อขายต้องมีมูลค่าตามราคาตราไม่ต่ำกว่า 100,000 บาท และไม่มีเศษของ 100,000 บาท

3.2 สูตรการคำนวณราคาขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ ณ วันประเมินราคา

$$\text{Repurchase Price} = \text{Purchase Price} \times (1 + (\text{Repurchase Rate} \times \text{จำนวนวัน}))$$

365

Repurchase Price หมายถึง ราคาขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ ณ วันประเมินราคา

Repurchase Rate หมายถึง อัตราค่าตอบแทนที่ได้ตกลงกันในวันที่ซื้อหรือขายตราสารหนี้

จำนวนวัน เท่ากับจำนวนวันนับตั้งแต่วันที่ซื้อหรือขายตราสารหนี้จนถึงวันประเมินราคา

3.3 การคำนวณเงิน Margin และเงื่อนไขอื่น ๆ ที่เกี่ยวข้อง

1) การเรียก Margin จะเกิดขึ้นในกรณีดังต่อไปนี้

$$\text{ก. } [(1 + \text{Haircut}) \times \text{Repurchase Price}] - \text{มูลค่าตลาดของตราสารหนี้} > \text{Variation Margin}$$

หรือ

$$\text{ข. } [(1 + \text{Haircut}) \times \text{Repurchase Price}] - \text{มูลค่าตลาดของตราสารหนี้} < -\text{Variation Margin}$$

FINANCIAL REGULATORY AUTHORITY

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 85/2552

เรื่อง การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้และเงินที่จะต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย กับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตามข้อ 5.4 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 14 กันยายน 2552 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

ธปท. จึงออกประกาศเพื่อกำหนดหลักเกณฑ์การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้และจำนวนเงินที่จะต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) สำหรับธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้กับไพรมารีดีลเลอร์

2. ยกเลิก

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 84/2552 เรื่อง การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้และเงินที่จะต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) ลงวันที่ 14 กันยายน 2552 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

3. ขอบเขตการบังคับใช้

สถาบันการเงินที่ได้รับแต่งตั้งจาก ธปท. เป็นไพรมารี ดีลเลอร์ สำหรับการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

4. เนื้อหา

ธปท. กำหนดหลักเกณฑ์การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้และจำนวนเงินที่จะต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) ดังต่อไปนี้

1. มูลค่าของตราสารหนี้ คำนวณตามราคาตลาด¹⁾ ที่ปรับลดด้วยอัตราส่วนลด (Haircut) ตามประเภทตราสารหนี้ และอายุคงเหลือของตราสารหนี้

วิจัยทัศน์ เป็นองค์กรที่ของกรณโกนา พนักงานมีความสามารถสูงและอุทิศตนเพื่อคุณแลเศรษฐกิจให้ผ่านพ้นความผันผวนได้อย่างราบรื่น

www.bot.or.th บริการข้อมูลอัตโนมัติ 24 ชั่วโมง โทร. 0-2283-6789

สกงป90กส6400425520915

2. อัตราส่วนลด (Haircut) ในการซื้อหรือขายตราสารหนี้ และช่วงอัตราปลอดการเรียกเงินเพิ่ม (Variation Margin)

ในการพิจารณาจำนวนเงินที่จะต้องเรียกเพิ่มเติมตามข้อ 5.4 ที่เกี่ยวข้องแห่งระเบียบฯ ให้พิจารณาอัตราส่วนลดประกอบกับช่วงอัตราปลอดการเรียกเงินเพิ่มก่อนที่จะมีการเรียกเงินเพิ่มตามตารางนี้

อัตราส่วนลด (Haircut) (ร้อยละ)

ประเภทตราสารหนี้ ²⁾	อายุคงเหลือ			
	0 - 5 ปี	> 5 ปี - 10 ปี	> 10 ปี - 20 ปี	> 20 ปี
- ตัวเงินคลัง ตัวสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร ธปท.	1	1.5	2.5	3
- พันธบัตรหรือหุ้นกู้ที่ออกโดยองค์การของรัฐ หรือรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ทั้งนี้ ตามที่ ธปท. จะเห็นสมควร	1.5	3	4.5	5.5

ช่วงอัตราปลอดการเรียกเงินเพิ่ม (Variation Margin) (ร้อยละ)

ประเภทตราสารหนี้ ²⁾	อายุคงเหลือ			
	0 - 5 ปี	> 5 ปี - 10 ปี	> 10 ปี - 20 ปี	> 20 ปี
- ตัวเงินคลัง ตัวสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร ธปท.	0.75	1	2	2
- พันธบัตรหรือหุ้นกู้ที่ออกโดยองค์การของรัฐ หรือรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ทั้งนี้ ตามที่ ธปท. จะเห็นสมควร	1	2	3	3

¹⁾ ราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) กำหนดตามสูตรการคำนวณราคาตราสารหนี้ที่ประกาศโดย ธปท. ใช้อัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันก่อนหน้าวันตกลงซื้อขายตราสารหนี้สำหรับการส่งมอบในวันที่ซื้อขายตราสารหนี้ (ในกรณีที่ไม่สามารถเรียกดูอัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันก่อนหน้าได้ ให้ใช้อัตราผลตอบแทน ณ วันล่าสุดที่สามารถเรียกดูได้) ในกรณีที่ไม่มีราคาตลาดที่เผยแพร่โดย ThaiBMA ให้ใช้ราคาที่กำหนดตามวิธีการที่ ธปท. กำหนด ซึ่งเผยแพร่ใน website ของ ธปท.

²⁾ พันธบัตรรัฐบาลและพันธบัตร ธปท. แบบอัตราดอกเบี้ยลอยตัว ให้ใช้อัตราส่วนลด (Haircut) และช่วงอัตราปลอดการเรียกเงินเพิ่ม (Variation Margin) ในอัตราเดียวกับตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือ 0 - 5 ปี

3. การคำนวณราคาซื้อขายตราสารหนี้ ราคาขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ และเงิน Margin

3.1 สูตรการคำนวณราคาซื้อขายตราสารหนี้

$$\text{Purchase Price} \times (1 + \text{Haircut}) \leq \text{มูลค่ารวมของตราสารหนี้}$$

ราคาซื้อขายตราสารหนี้ (Purchase Price) หมายถึง จำนวนเงินที่ใช้ในการซื้อหรือขายตราสารหนี้ ณ วันเริ่มต้นของธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้

มูลค่ารวมของตราสารหนี้ หมายถึง ผลรวมของมูลค่าตลาดของตราสารหนี้ที่ใช้ในการซื้อขาย ทั้งนี้ ตราสารหนี้แต่ละรุ่นที่ใช้ในการซื้อขายต้องมีมูลค่าตามราคาตราไม่ต่ำกว่า 100,000 บาท และไม่มีเศษของ 100,000 บาท

3.2 สูตรการคำนวณราคาขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ ณ วันประเมินราคา

$$\text{Repurchase Price} = \text{Purchase Price} \times (1 + (\text{Repurchase Rate} \times \frac{\text{จำนวนวัน}}{365}))$$

Repurchase Price หมายถึง ราคาขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ ณ วันประเมินราคา

Repurchase Rate หมายถึง อัตราค่าตอบแทนที่ได้ตกลงกันในวันที่ซื้อหรือขายตราสารหนี้

จำนวนวัน เท่ากับจำนวนวันนับตั้งแต่วันที่ซื้อหรือขายตราสารหนี้จนถึงวันประเมินราคา

3.3 การคำนวณเงิน Margin และเงื่อนไขอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง

1) การเรียก Margin จะเกิดขึ้นในกรณีดังต่อไปนี้

$$\text{ก. } \frac{[(1 + \text{Haircut}) \times \text{Repurchase Price}] - \text{มูลค่าตลาดของตราสารหนี้}}{\text{Repurchase Price}} > \text{Variation Margin}$$

หรือ

$$\text{ข. } \frac{[(1 + \text{Haircut}) \times \text{Repurchase Price}] - \text{มูลค่าตลาดของตราสารหนี้}}{\text{Repurchase Price}} < -\text{Variation Margin}$$

Variation Margin หมายถึง ช่วงอัตราปลอดการเรียกเงินเพิ่มตามที่กำหนดไว้สำหรับตราสารหนี้แต่ละประเภทตามข้อ 2 ของประกาศนี้ และในกรณีที่มีตราสารหนี้ หลายประเภท หรือหลายรุ่นในหนึ่งสัญญา Variation Margin จะเท่ากับค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Variation Margin ของตราสารหนี้เหล่านั้น

2) ในกรณีที่มีการเรียก Margin จำนวนที่ต้องส่งมอบเท่ากับ

ก. $[(1 + \text{Haircut}) \times \text{Repurchase Price}] - \text{มูลค่าตลาดของตราสารหนี้}$

หรือ

ข. $\text{มูลค่าตลาดของตราสารหนี้} - [(1 + \text{Haircut}) \times \text{Repurchase Price}]$

แล้วแต่กรณี

ทั้งนี้ มูลค่าตลาดของตราสารหนี้ที่ใช้ในการคำนวณตามสูตรใน 1) และ 2) ให้ปรับด้วย Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) ของสัญญานั้น

3) เงื่อนไขอื่น ๆ ที่เกี่ยวข้องกับการเรียก Margin มีดังต่อไปนี้

ก. ในแต่ละวัน ให้นำยอดเงิน Margin ที่ต้องส่งมอบตาม 2) ของแต่ละสัญญามาคำนวณหายอดสุทธิ โดย ธปท. จะจ่ายหรือเรียก Margin ในจำนวนเท่ากับยอดสุทธิดังกล่าว

ข. ถ้ายอดสุทธิตาม ก. สำหรับไพรมารี ดีลเลอร์ รายใดต่ำกว่า 100,000 บาท ธปท. จะยกเว้นการจ่ายหรือเรียก Margin กับ ไพรมารี ดีลเลอร์ รายนั้น

ค. สินทรัพย์ที่ใช้ส่งมอบระหว่างกันให้อยู่ในรูปของเงิน

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 14 ก.ย. 2552

(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 86/2552

เรื่อง ดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) เบี้ยปรับ และวิธีปฏิบัติ
ในกรณีไพรมารี ดีลเลอร์ ผิดนัดส่งมอบ Margin ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน
และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer)
(บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ๒๒๒. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตามข้อ 5.4 5.5 และ 5.6 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะ
ขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary
Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ๒๒๒. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่
14 กันยายน 2552 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

๒๒๒. จึงออกประกาศเพื่อกำหนดวิธีการคำนวณดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม
(Interest on Margin) เบี้ยปรับและวิธีปฏิบัติในกรณีที่ไพรมารี ดีลเลอร์ ผิดนัดส่งมอบ Margin
ในการซื้อขายตราสารหนี้กับไพรมารี ดีลเลอร์

2. ขอบเขตการบังคับใช้

สถาบันการเงินที่ได้รับแต่งตั้งจาก ๒๒๒. เป็นไพรมารี ดีลเลอร์ สำหรับการทำธุรกรรม
การซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ธนาคาร
แห่งประเทศไทย

3. เนื้อหา

๒๒๒. กำหนดวิธีการคำนวณดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin)
เบี้ยปรับ และวิธีปฏิบัติในกรณีไพรมารี ดีลเลอร์ ผิดนัดส่งมอบ Margin ดังนี้

1. การคำนวณดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin)

ให้คำนวณเป็นรายวัน โดยใช้ยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin)

คูณกับอัตราดอกเบี้ยนโยบาย

2. เบี้ยปรับกรณีไพรมารี ดีลเลอร์ ผิดนัดชำระเงินหรือส่งมอบตราสารหนี้ ตามข้อ 5.6
แห่งระเบียบฯ ให้มีวิธีการคำนวณและกำหนดเวลาส่งมอบในแต่ละกรณี ดังนี้

กรณีล่าช้า	เบี้ยปรับ	เวลาส่งมอบ
1. ตามข้อ 5.6.2 วรรคหนึ่ง ในวันที่ซื้อหรือขายตราสารหนี้ หากไพรมารี คีลเลอร์ ไม่ชำระราคาหรือไม่ส่งมอบตราสารหนี้ภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด	อัตราดอกเบี้ยนโยบาย x 1 วัน x จำนวนเงินค่าซื้อหรือขายตราสารหนี้ (Purchase Price) ที่ผิดนัด	ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ตของวันที่ซื้อหรือขาย
2. ตามข้อ 5.6.3 ในแต่ละวันทำการก่อนวันที่ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หากไพรมารี คีลเลอร์ ไม่ส่งมอบ Margin ภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด	อัตราดอกเบี้ยนโยบาย x 1 วัน x จำนวนเงิน Margin ที่ผิดนัด	ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ตของวันที่ต้องส่งมอบ Margin
3. ตามข้อ 5.6.4 วรรคหนึ่ง ในวันที่ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หากไพรมารี คีลเลอร์ ไม่ชำระราคาหรือส่งมอบตราสารหนี้ภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด	อัตราดอกเบี้ยนโยบาย x 1 วัน x จำนวนเงินค่าขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ที่ผิดนัด	ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ตของวันที่ขายคืนหรือซื้อคืน

กรณีไม่ชำระ	เบี้ยปรับ	เวลาส่งมอบ
1. ตามข้อ 5.6.2 วรรคสอง ในวันที่ซื้อหรือขายตราสารหนี้ หากไพรมารี คีลเลอร์ ไม่ชำระราคาหรือ ส่งมอบตราสารหนี้ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ต	ร้อยละ 0.1 ของจำนวนเงินค่าซื้อหรือขายตราสารหนี้ (Purchase Price) ที่ผิดนัด	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป
2. ตามข้อ 5.6.3 ในแต่ละวันทำการก่อนวันที่ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หากไพรมารี คีลเลอร์ไม่ส่งมอบ Margin ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ต	ร้อยละ 0.1 ของจำนวนเงินค่าขายคืนและซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ณ วันที่ผิดนัดของทุกสัญญาระหว่าง ธปท. กับไพรมารี คีลเลอร์รายนั้น	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป
3. ตามข้อ 5.6.4 วรรคสอง ในวันที่ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หากไพรมารี คีลเลอร์ ไม่ชำระราคาหรือส่งมอบตราสารหนี้ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ต	ร้อยละ 0.1 ของจำนวนเงินค่าขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ที่ผิดนัด	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

3. วิธีปฏิบัติในกรณีผิคนัดส่งมอบ Margin กรณีตราสารหนี้ ตามข้อ 5.6.3 แห่งระเบียบฯ

3.1 ในกรณีที่ไพรมารี คิลเลอร์ ไม่ส่งมอบ Margin แก่ ธปท. ภายในเวลา 11.00 น. ไพรมารี คิลเลอร์ จะต้องจ่ายเบี้ยปรับกรณีล่าช้าตามข้อ 2 พร้อมส่งมอบ Margin ภายในเวลาทำการของระบบบาทเนตของวันที่ผิคนัดนั้น

3.2 หากไม่ส่งมอบ Margin ตามข้อ 3.1 ไพรมารี คิลเลอร์ มีภาระต้องส่งมอบเงินดังต่อไปนี้ ภายในเวลา 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

- (1) Margin คงค้างล่าสุด
- (2) เบี้ยปรับกรณีล่าช้าตามข้อ 2
- (3) เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระตามข้อ 2

ทั้งนี้ ธปท. มีสิทธิเลิกสัญญาซื้อหรือขายตราสารหนี้กับไพรมารี คิลเลอร์ รายนั้น ทุกสัญญาหรือบางสัญญา หรือมีสิทธิแก้ไขเปลี่ยนแปลงสัญญาที่มีอยู่กับไพรมารี คิลเลอร์ รายนั้นได้ และมีสิทธิให้นำมูลหนี้ของคู่สัญญาทั้งสองฝ่ายมาหักกลบลบกัน

3.3 หากไม่ส่งมอบเงินตามรายการและเวลาในข้อ 3.2 ไพรมารี คิลเลอร์ มีภาระต้องส่งมอบเงินดังต่อไปนี้ภายในเวลาทำการของระบบบาทเนตของวันเดียวกัน

- (1) Margin คงค้างล่าสุด
- (2) เบี้ยปรับกรณีล่าช้าที่ค้างตามข้อ 3.2
- (3) เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระที่ค้างตามข้อ 3.2
- (4) เบี้ยปรับกรณีล่าช้าตามข้อ 2 ที่คำนวณจากยอด Margin คงค้างล่าสุด

3.4 หากไม่ส่งมอบเงินตามรายการและเวลาในข้อ 3.3 ธปท. มีสิทธิยกเลิกสัญญาบางสัญญาหรือทุกสัญญา ดังนี้

3.4.1 กรณียกเลิกบางสัญญา

(1) ไพรมารี คิลเลอร์ มีภาระต้องจ่าย

- ก. Margin คงค้างล่าสุด ของสัญญาที่ยังไม่มีการยกเลิก (ถ้ามี)
- ข. เบี้ยปรับกรณีล่าช้าที่ค้างตามข้อ 3.2
- ค. เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระที่ค้างตามข้อ 3.2
- ง. เบี้ยปรับกรณีล่าช้าตามข้อ 3.3 (4)
- จ. เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระตามข้อ 2 ที่คำนวณจากยอดรวมของค่า

ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ณ วันที่ผิคนัดล่าสุด

(2) ให้นำภาระที่ไพรมารี คิลเลอร์ ต้องจ่ายตาม (1) มาเปรียบเทียบกับ

ส่วนต่างระหว่าง

ก. มูลค่าตลาดของตราสารหนี้ + ยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) (ถ้ามี) + ดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) (ถ้ามี) และ

ข. จำนวนเงินค่าขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ณ วันยกเลิกสัญญา + ยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) (ถ้ามี) + ดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) (ถ้ามี)

(3) ธปท. จะแจ้งภาระส่วนต่างระหว่าง (1) และ (2) และให้ผู้มีภาระทำการส่งมอบเงินตามจำนวนดังกล่าวแก่อีกฝ่ายหนึ่งผ่านระบบบาทเนตภายในเวลา 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

3.4.2 กรณียกเลิกทุกสัญญา

(1) ไพรมารี ดีลเลอร์ มีภาระต้องจ่าย

ก. เบี้ยปรับกรณีล่าช้าที่ค้างตามข้อ 3.2

ข. เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระที่ค้างตามข้อ 3.2

ค. เบี้ยปรับกรณีล่าช้าตามข้อ 3.3 (4)

ง. เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระตามข้อ 2 ที่คำนวณจากยอดรวมของค่าขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ณ วันที่ผิคนัดค่าสุดท้าย

(2) ให้นำภาระที่ไพรมารี ดีลเลอร์ ต้องจ่ายตาม (1) มาเปรียบเทียบกับส่วนต่างระหว่าง

ก. มูลค่าตลาดของตราสารหนี้ + ยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) (ถ้ามี) + ดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) (ถ้ามี) และ

ข. จำนวนเงินค่าขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ณ วันยกเลิกสัญญา + ยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) (ถ้ามี) + ดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) (ถ้ามี)

(3) ธปท. จะแจ้งภาระส่วนต่างระหว่าง (1) และ (2) และให้ผู้มีภาระทำการส่งมอบเงินตามจำนวนดังกล่าวแก่อีกฝ่ายหนึ่งผ่านระบบบาทเนตภายในเวลา 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

4. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 14 ก.ย. 2552

ดร. วิ

(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย