



# ธนาคารแห่งประเทศไทย

## ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 7/2565

### เรื่อง ธุรกรรมด้านตลาดการเงินเพื่อการบริหารสภาพคล่อง ในกรณีระบบบาทเน็ตไม่สามารถให้บริการได้โดยสิ้นเชิง (BAHTNET Offline)

#### 1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อกำหนดแนวทางและขั้นตอนการทำธุรกรรมด้านตลาดการเงินในกรณีที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ประกาศใช้ BAHTNET Offline (BNO) เพื่อเอื้อให้การบริหารสภาพคล่องใน BNO เป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ และรักษาอัตราดอกเบี้ยในตลาดเงินให้เคลื่อนไหวสอดคล้องกับอัตราดอกเบี้ยนโยบายตามที่คณะกรรมการนโยบายการเงินกำหนด

#### 2. อำนาจตามกฎหมาย

เพื่ออนุวัติตามข้อ 4.3.8 ข้อ 4.3.15 และข้อ 4.5.2 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สรข. 1/2565 ว่าด้วยการดำเนินการกรณีระบบบาทเน็ตไม่สามารถให้บริการได้โดยสิ้นเชิง (BAHTNET Offline)

#### 3. ขอบเขตการบังคับใช้

ผู้อยู่ภายใต้บังคับระเบียบและประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่เกี่ยวข้อง ได้แก่

3.1 ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer)

3.2 ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการฝากเงินกับธนาคารแห่งประเทศไทย

3.3 ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อการบริหารสภาพคล่อง

3.4 ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่อง การกำหนดให้ธนาคารพาณิชย์ดำรงเงินฝากที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (Reserve Requirement)

3.5 ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่อง การกำหนดให้บริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ดำรงเงินฝากที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (Reserve Requirement)

3.6 ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Outright) กับคู่ค้าที่ ธปท. แต่งตั้ง

3.7 ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการยึดตราสารหนี้

สกงป70-กส60001-25650331

กส 600

วันที่ 31 มี.ค. 2565

วิสัยทัศน์ เป็นองค์กรที่มองไกล มีหลักการ และร่วมมือ เพื่อความเป็นอยู่ที่ดีอย่างยั่งยืนของไทย

3.8 ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการกู้ยืมเงินจากธนาคารแห่งประเทศไทย ด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกันชั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะขายคืน

3.9 ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการออกพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย

3.10 ผู้อยู่ใต้บังคับระเบียบด้านธุรกรรมตลาดเงินอื่นที่ ธปท. ประกาศกำหนด

#### 4. เนื้อหา

4.1 เมื่อ ธปท. ประกาศใช้ BNO แล้ว ธปท. จะปรับหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไข การทำธุรกรรมด้านตลาดการเงินดังต่อไปนี้

4.1.1 ธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Bilateral Repo: BRP) ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer)

(1) ธปท. จะไม่ทำธุรกรรมใหม่ในช่วงการประกาศใช้ BNO รวมถึงจะ ยกเลิกสัญญาที่เกิดขึ้นก่อนการประกาศใช้ BNO แต่การชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้ ยังไม่สำเร็จ เพื่อลดปริมาณธุรกรรมของไพรมารี ดีลเลอร์ โดยไพรมารี ดีลเลอร์ ที่มีสภาพคล่องคงเหลือสามารถ ฝากเงินกับ ธปท. ตาม 4.1.2 และไพรมารี ดีลเลอร์ ที่ขาดสภาพคล่องสามารถขายตราสารหนี้และ เงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนตาม 4.1.3 ได้

(2) ธุรกรรม ที่ครบกำหนดในช่วงการประกาศใช้ BNO ให้การชำระราคา ขายคืนหรือซื้อคืนเป็นแบบ Non-Delivery versus Payment (Non-DvP) หรือ Non-Receive versus Payment (Non-RvP) ซึ่ง ธปท. จะต้องได้รับเงินหรือตราสารหนี้จากไพรมารี ดีลเลอร์ ก่อน จึงจะโอนตราสารหนี้หรือเงินให้กับไพรมารี ดีลเลอร์ แล้วแต่กรณี โดยให้ดำเนินการตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขดังนี้

(2.1) การโอนตราสารหนี้ให้ดำเนินการผ่านระบบงานตามวิธีการที่ ศูนย์รับฝากกำหนด และการเวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ดำเนินการตามระเบียบ ธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญา ว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) ขณะที่การโอนเงิน รวมถึงดอกเบี้ย และ Margin ให้ดำเนินการผ่านรายการโอนเงิน BNO

(2.2) เมื่อ ธปท. ได้รับเงิน หรือได้รับโอนตราสารหนี้หรือเวนคืน ตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยจากไพรมารี ดีลเลอร์ แล้ว ธปท. จะโอนตราสารหนี้หรือเงินให้กับ ไพรมารี ดีลเลอร์ แล้วแต่กรณี

(2.3) ธพท. อาจพิจารณาซื้อหรือขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน หรือขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ ที่สัญญาครบกำหนดแล้วต่อ (Rollover) โดยกำหนดอัตราค่าตอบแทนเท่ากับอัตราดอกเบี้ยนโยบายตามที่คณะกรรมการนโยบายการเงินกำหนด และ ธพท. อาจยกเว้นการประเมินมูลค่าตราสารหนี้ และให้ชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้ในจำนวนที่เท่ากับส่วนต่างระหว่างสัญญาเดิมและสัญญาใหม่ (Net settlement) ตามที่ ธพท. เห็นสมควร

(3) ไพรมารี ดีลเลอร์ สามารถแจ้งความประสงค์ขอสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนดได้ ซึ่งการขอสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนดต้องทำเต็มจำนวนทั้งสัญญา โดยให้ดำเนินการชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้ รวมถึงการจ่ายค่าตอบแทน ตามวิธีที่กำหนดใน (2) ทั้งนี้ ธพท. จะยกเว้นค่าธรรมเนียมการสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนดให้กับไพรมารี ดีลเลอร์

(4) ธพท. อาจพิจารณา ยกเว้นหลักเกณฑ์การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้ และเงินที่จะต้องส่งมอบเงินเพิ่มเติม (Margin) ของสัญญาที่ยังไม่ครบกำหนดในช่วงการประกาศใช้ BNO และอาจพิจารณา ยกเว้นการคิดเบี้ยปรับ ตามที่ ธพท. เห็นสมควร

#### 4.1.2 อุดหนุนการฝากเงินกับธนาคารแห่งประเทศไทย (Deposit Facility: DF)

ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการฝากเงินกับธนาคารแห่งประเทศไทย

(1) สมาชิกสามารถเสนอขอฝากเงินกับ ธพท. ประเภทอายุ 1 วัน ซึ่ง ธพท. จะจ่ายดอกเบี้ยจากจำนวนเงินที่ ธพท. ฝากไว้ที่อัตราดอกเบี้ยนโยบายตามที่คณะกรรมการนโยบายการเงินกำหนด โดยให้ดำเนินการตามขั้นตอนดังนี้

(1.1) สมาชิกแจ้งคำเสนอขอฝากเงินกับ ธพท. โดยไม่มีจำนวนเงินขั้นต่ำ ภายในเวลาที่กำหนด

(1.2) ธพท. จะแจ้งผลการรับฝากเงินให้สมาชิกทราบ โดย ธพท. จะตกลงรับฝากเงินเป็นจำนวนเท่าใดก็ได้ตามที่ ธพท. เห็นสมควร

(1.3) เมื่อได้รับแจ้งผลการรับฝากจาก ธพท. แล้ว ให้สมาชิกโอนเงินให้ ธพท. ผ่านรายการโอนเงิน BNO ภายในเวลาที่กำหนด

(2) อุดหนุนที่ครบกำหนดในช่วงการประกาศใช้ BNO ทั้งอุดหนุนที่ทำไว้ก่อนและหลังการประกาศใช้ BNO ธพท. จะโอนเงินฝากพร้อมดอกเบี้ยคืนให้กับสมาชิกผ่านรายการโอนเงิน BNO

สำหรับอุดหนุนที่ครบกำหนดหลังจาก ธพท. ประกาศยุติการดำเนินการ BNO แล้ว ธพท. จะโอนเงินฝากพร้อมดอกเบี้ยคืนให้กับสมาชิกผ่านระบบบาทเนตตามขั้นตอนที่กำหนดไว้ในระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการฝากเงินกับธนาคารแห่งประเทศไทย

**4.1.3** ธุรกรรมการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง (Lending Facility: LF) ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง

(1) สมาชิกสามารถเสนอขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนประเภทอายุ 1 วัน ซึ่ง ธปท. จะคิดค่าตอบแทนจากจำนวนเงินที่ตกลงรับซื้อที่อัตราดอกเบี้ยนโยบายตามที่คณะกรรมการนโยบายการเงินกำหนด ทั้งนี้ ธปท. อาจพิจารณาขยับวันลำดับการรับซื้อตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศที่กำหนดไว้ในระเบียบดังกล่าว หรืออาจขยายประเภทสินทรัพย์หลักประกันอื่นเพิ่มเติมตามที่ ธปท. เห็นสมควร โดยให้ดำเนินการตามขั้นตอน ดังนี้

(1.1) สมาชิกแจ้งคำเสนอขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศกับ ธปท. โดยไม่มีจำนวนเงินขั้นต่ำ ภายในเวลาที่กำหนด

(1.2) ธปท. จะแจ้งผลการรับซื้อตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศให้สมาชิกทราบ โดย ธปท. จะตกลงรับซื้อตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศเป็นจำนวนเท่าใดก็ได้ตามที่ ธปท. เห็นสมควร

(1.3) เมื่อได้รับแจ้งผลการรับซื้อจาก ธปท. แล้ว ให้สมาชิกดำเนินการโอนตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศเข้าบัญชีของ ธปท. ตามรายละเอียดที่ ธปท. กำหนด

(1.4) เมื่อ ธปท. ได้รับโอนตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศเข้าบัญชีของ ธปท. แล้ว ธปท. จะโอนเงินให้สมาชิกผ่านรายการโอนเงิน BNO

(2) ธุรกรรมที่ครบกำหนดในช่วงการประกาศใช้ BNO ทั้งธุรกรรมที่ทำไว้ก่อนและหลังการประกาศใช้ BNO ให้สมาชิกชำระราคาซื้อคืนผ่านรายการโอนเงิน BNO เมื่อ ธปท. ได้รับการชำระราคาซื้อคืนแล้ว ธปท. จะโอนตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศที่รับซื้อไว้คืนไปยังบัญชีของสมาชิกตามที่แจ้งไว้กับ ธปท.

สำหรับธุรกรรมที่ครบกำหนดหลังจาก ธปท. ประกาศยุติการดำเนินการ BNO แล้ว ธปท. จะหักราคาซื้อคืนจากบัญชีเงินฝากของสมาชิกผ่านระบบบาทเน็ต และโอนตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศคืนให้กับสมาชิกตามขั้นตอนที่กำหนดไว้ในระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง

(3) ธปท. อาจพิจารณารับซื้อตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนประเภทอายุ 1 วัน ที่สัญญาครบกำหนดแล้วต่อ (Rollover) โดยกำหนดอัตราค่าตอบแทนเท่ากับอัตราดอกเบี้ยนโยบายตามที่คณะกรรมการนโยบายการเงินกำหนด และสมาชิกสามารถใช้ตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศเดิมเป็นหลักประกัน ทั้งนี้ ธปท. อาจยกเว้นการประเมินมูลค่าตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศ และให้ชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศในจำนวนที่เท่ากับส่วนต่างระหว่างสัญญาเดิมและสัญญาใหม่ (Net settlement) ตามที่ ธปท. เห็นสมควร

(4) ในกรณีวันปิดสมุดทะเบียนเพื่อจ่ายดอกเบี้ยอยู่ในช่วงระยะเวลาของสัญญาการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ธปท. จะดำเนินการคืนดอกเบี้ยให้แก่สมาชิกตามที่กำหนดในพิธีปฏิบัติ เรื่อง การดำเนินการกรณีระบบบาทเน็ตไม่สามารถให้บริการได้โดยสิ้นเชิง (BAHTNET Offline) สำหรับผู้ใช้บริการบาทเน็ต

#### 4.1.4 ธุรกรรมด้านตลาดการเงินอื่น ๆ

หากผู้อยู่ภายใต้บังคับประกาศฉบับนี้มีธุรกรรมด้านตลาดการเงินอื่นกับ ธปท. นอกเหนือจากธุรกรรมข้างต้น เช่น ธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้ ให้ดำเนินการชำระราคาผ่านรายการโอนเงิน BNO ที่ ธปท. ประกาศกำหนด

4.2 เมื่อ ธปท. ประกาศใช้ BNO แล้ว ในกรณีที่ ธปท. เห็นว่ามีเหตุจำเป็นที่ธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน และบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ควรได้รับการผ่อนผันหลักเกณฑ์การดำรงเงินฝากที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (Reserve Requirement) ตามประกาศที่เกี่ยวข้อง ธปท. อาจพิจารณาผ่อนผันหรือปรับเปลี่ยนเกณฑ์การดำรงเงินฝากดังกล่าวได้ตามที่ ธปท. เห็นสมควร โดยจะแจ้งให้ธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ทราบ

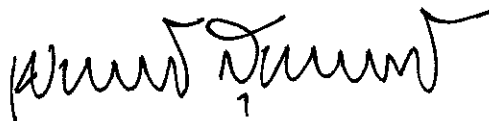
4.3 การแสดงคำเสนอ การแจ้งผล การยืนยัน หรือการติดต่อใด ๆ กับ ธปท. ตามประกาศฉบับนี้ให้ดำเนินการผ่านทางอีเมลหรือโทรศัพท์ โดย ธปท. ยกเว้นให้ผู้อยู่ภายใต้บังคับประกาศฉบับนี้ไม่ต้องแจ้งหรือส่งหนังสือยืนยันตามที่กำหนดไว้ในระเบียบหรือประกาศที่เกี่ยวข้อง

4.4 ให้นำหลักเกณฑ์ วิธีการ และเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในระเบียบและประกาศที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินการตามข้อ 4.1 และข้อ 4.2 มาใช้กับการดำเนินการตามประกาศฉบับนี้ โดยอนุโลม เท่าที่ไม่ขัดหรือแย้งกับหลักเกณฑ์ วิธีการและข้อกำหนดอื่นใดที่กำหนดไว้เป็นการเฉพาะในประกาศนี้

#### 5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 31 มีนาคม 2565 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 31 มีนาคม 2565



(นายเศรษฐวุฒิ สุทธิวาทนฤพุมิ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

งานตลาดเงินและตลาดพันธบัตร  
ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน  
โทรศัพท์ 0 2628 6025-7