



ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. ๗๑ / 2559

เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และวิธีการปฏิบัติงานในการยืมตราสารหนี้
ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการยืมตราสารหนี้

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตาม 5.3 5.5 และ 5.6 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ที่ สกง. 3 / 2559 ว่าด้วยการยืมตราสารหนี้ ลงวันที่ 15 พฤศจิกายน 2559

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จึงออกประกาศเพื่อกำหนดเงื่อนไข กำหนดเวลา และ
วิธีการปฏิบัติงานในการยืมตราสารหนี้

2. ขอบเขตการบังคับใช้

ใช้บังคับกับผู้ให้ยืม ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 3 / 2559 ว่าด้วยการยืม
ตราสารหนี้ ลงวันที่ 15 พฤศจิกายน 2559 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

3. เนื้อหา

3.1 เงื่อนไข และรายละเอียดในการยืมตราสารหนี้

3.1.1 ผู้ให้ยืมต้องเสนอให้ยืมตราสารหนี้เป็นมูลค่าตามราคาตรา รวมไม่ต่ำกว่า
1,000 ล้านบาท และไม่มีเศษของ 10 ล้านบาท ทั้งนี้ ตราสารหนี้แต่ละรุ่นต้องมีมูลค่าตามราคาตรา
ไม่ต่ำกว่า 100 ล้านบาท และไม่มีเศษของ 10 ล้านบาท

3.1.2 ธปท. จะออกตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย เพื่อเป็นหลักประกันให้แก่
ผู้ให้ยืมเป็นจำนวนเงินเท่ากับมูลค่าตามราคาตลาด¹ รวมของตราสารหนี้ที่ผู้ให้ยืม

3.1.3 การคืนตราสารหนี้ก่อนวันครบกำหนด การคืนตราสารหนี้ก่อนครบกำหนด
และยืมตราสารหนี้ดังกล่าวใหม่ การยืมตราสารหนี้ต่อเมื่อครบกำหนด การใช้สิทธิส่งคืนหรือเรียกคืน
ตราสารหนี้ ธปท. และผู้ให้ยืม ต้องทำเต็มจำนวนทั้งสัญญา

3.2 กำหนดเวลา และวิธีการปฏิบัติงานในการทำธุรกรรมการยืมตราสารหนี้

¹ มูลค่าตามราคาตลาด อิงตามราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) จำนวนตามสูตรการคำนวณราคาตราสารหนี้
ที่ประกาศโดย ธปท. ใช้อัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันตกลงยืมตราสารหนี้สำหรับการส่งมอบในวันยืมตราสารหนี้ (ในกรณีที่
ไม่สามารถเรียกดูอัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าได้ ให้ใช้อัตราผลตอบแทน ณ วันทำการล่าสุดที่สามารถเรียกดูได้) ในกรณีที่
ไม่มีราคาตลาดที่เผยแพร่โดย ThaiBMA ให้ใช้ราคาที่คำนวณตามวิธีการที่ ธปท. กำหนด ซึ่งเผยแพร่ใน website ของ ธปท.

3.2.1 การยืมตราสารหนี้

การดำเนินการ	เวลา
(1) ผู้ให้ยืมแจ้งคำเสนอให้ยืมตราสารหนี้ รวมทั้งแจ้งรายละเอียดตราสารหนี้	ระหว่างเวลา 10.30 น. - 11.00 น.
(2) ธปท. แจ้งผลการพิจารณาการยืมตราสารหนี้	ภายใน 11.15 น.
(3) ผู้ให้ยืมโอนตราสารหนี้ให้ ธปท. และ ธปท. รับโอนตราสารหนี้จากผู้ให้ยืม	ภายใน 8.45 น. ของวันทำการถัดไป
(4) ธปท. ออกตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย เพื่อเป็นหลักประกันให้แก่ผู้ให้ยืม	ภายใน 10.00 น. ของวันทำการถัดไป

3.2.2 การทำธุรกรรมการยืมตราสารหนี้ประเภทกำหนดระยะเวลา (Term)

(1) กรณี ธปท. คืนตราสารหนี้ก่อนครบกำหนด

การดำเนินการ	เวลา
(1) ธปท. แจ้งคืนตราสารหนี้ก่อนครบกำหนด	ระหว่างเวลา 10.30 น. - 11.00 น.
(2) ผู้ให้ยืมยืนยันการรับคืนตราสารหนี้ก่อนครบกำหนด	ภายใน 11.15 น.
(3) ผู้ให้ยืมเวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ ธปท.	ภายใน 9.00 น. ของวันทำการถัดไป
(4) ธปท. คืนตราสารหนี้ให้ผู้ให้ยืม และผู้ให้ยืมรับคืนตราสารหนี้จาก ธปท.	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป
(5) ธปท. จ่ายค่าธรรมเนียมการยืมตราสารหนี้ให้แก่ผู้ให้ยืม	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

(2) กรณี ธปท. คืบตราสารหนี้ก่อนวันครบกำหนด และยืมตราสารหนี้ดังกล่าวใหม่ในระยะเวลาที่ยาวกว่าระยะเวลาคงเหลือของสัญญาเดิม

การดำเนินการ	เวลา
(1) ธปท. แจ้งคืบตราสารหนี้ก่อนครบกำหนดและขอยืมตราสารหนี้ดังกล่าวใหม่	ระหว่างเวลา 10.30 น. - 11.00 น.
(2) ผู้ให้ยืมยืนยันการรับคืบตราสารหนี้ก่อนครบกำหนดและให้ยืมตราสารหนี้ดังกล่าวใหม่	ภายใน 11.15 น.
(3) ผู้ให้ยืมเวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ ธปท.	ภายใน 9.00 น. ของวันทำการถัดไป
(4) ธปท. ออกตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยตามสัญญาใหม่ ² ให้ผู้ให้ยืม	ภายใน 10.00 น. ของวันทำการถัดไป
(5) ธปท. จ่ายค่าธรรมเนียมการยืมตราสารหนี้ตามสัญญาเดิมให้แก่ผู้ให้ยืม	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

(3) กรณี ธปท. ยืมตราสารหนี้ต่อ (Rollover)

การดำเนินการ	เวลา
(1) ธปท. แจ้งความประสงค์ขอยืมตราสารหนี้ต่อเมื่อครบกำหนด (Rollover)	ระหว่างเวลา 10.30 น. - 11.00 น. ล่วงหน้า 1 วันทำการก่อนวันครบกำหนด
(2) ผู้ให้ยืมแจ้งยืนยันการให้ยืมตราสารหนี้ต่อมายัง ธปท.	ภายใน 11.15 น.
(3) ผู้ให้ยืมเวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยตามสัญญาเดิมให้ ธปท.	ภายใน 9.00 น. ของวันทำการถัดไป
(4) ธปท. ออกตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยตามสัญญาใหม่ ² ให้ผู้ให้ยืม	ภายใน 10.00 น. ของวันทำการถัดไป
(5) ธปท. จ่ายค่าธรรมเนียมการยืมตราสารหนี้ตามสัญญาเดิมให้แก่ผู้ให้ยืม	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

3.2.3 การทำธุรกรรมการยืมตราสารหนี้ประเภทไม่กำหนดระยะเวลา (At Call)

(1) กรณี ธปท. ใช้สิทธิส่งคืนตราสารหนี้

² มูลค่าตามราคาตลาดของตราสารหนี้ตามสัญญาใหม่ อิงตามราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) จำนวนตามสูตรการคำนวณราคาตราสารหนี้ที่ประกาศโดย ธปท. ใช้อัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันตกลงคืนตราสารหนี้ก่อนครบกำหนดและยืมตราสารหนี้ดังกล่าวใหม่ หรือวันทำการก่อนหน้าวันตกลงยืมตราสารหนี้ต่อ (Rollover) (ในกรณีที่ไม่สามารถเรียกดูอัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าได้ ให้ใช้อัตราผลตอบแทน ณ วันทำการล่าสุดที่สามารถเรียกดูได้) ในกรณีที่ไม่มีราคาตลาดที่เผยแพร่โดย ThaiBMA ให้ใช้ราคาที่คำนวณตามวิธีการที่ ธปท. กำหนด ซึ่งเผยแพร่ใน website ของ ธปท.

การดำเนินการ	เวลา
(1) ธปท. แจ้งใช้สิทธิส่งคืนตราสารหนี้	ระหว่างเวลา 10.30 น. - 11.00 น.
(2) ผู้ให้ยืมยืนยันการรับคืนตราสารหนี้	ภายใน 11.15 น.
(3) ผู้ให้ยืมเวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ ธปท.	ภายใน 9.00 น. ของวันทำการถัดไป
(4) ธปท. คืนตราสารหนี้ให้ผู้ให้ยืม และผู้ให้ยืมรับคืนตราสารหนี้จาก ธปท.	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป
(5) ธปท. จ่ายค่าธรรมเนียมการยึดตราสารหนี้ให้แก่ผู้ให้ยืม	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

(2) กรณีผู้ให้ยืมใช้สิทธิเรียกคืนตราสารหนี้ เมื่อ ธปท. แจ้งยืนยันการคืนตราสารหนี้แก่ผู้ให้ยืม ธปท. จะกำหนดวันส่งมอบตราสารหนี้ ซึ่งจะเป็นวันทำการที่เร็วที่สุดที่ ธปท. สามารถส่งมอบได้ ซึ่งจะไม่เกินระยะเวลา 1 เดือนจากวันที่ ธปท. แจ้งยืนยันการคืนตราสารหนี้

การดำเนินการ	เวลา
(1) ผู้ให้ยืมแจ้งใช้สิทธิเรียกคืนตราสารหนี้	ระหว่างเวลา 10.30 น. - 11.00 น.
(2) ธปท. แจ้งยืนยันการคืนตราสารหนี้ และกำหนดวันส่งมอบตราสารหนี้	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป
(3) ผู้ให้ยืมเวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ ธปท.	ภายใน 9.00 น. ของวันส่งมอบตราสารหนี้
(4) ธปท. คืนตราสารหนี้ให้ผู้ให้ยืม และผู้ให้ยืมรับคืนตราสารหนี้จาก ธปท.	ภายใน 11.00 น. ของวันส่งมอบตราสารหนี้
(5) ธปท. จ่ายค่าธรรมเนียมการยึดตราสารหนี้ให้แก่ผู้ให้ยืม	ภายใน 11.00 น. ของวันส่งมอบตราสารหนี้

(3) การจ่ายค่าธรรมเนียมทุกสิ้นเดือน กรณีที่ ธปท. ยังไม่ใช้สิทธิส่งคืน หรือกรณีที่ผู้ให้ยืมยังไม่ใช้สิทธิเรียกคืนตราสารหนี้ หรือกรณีที่มีการใช้สิทธิดังกล่าวแล้ว แต่ยังไม่ถึงวันส่งมอบตราสารหนี้

การดำเนินการ	เวลา
ธปท. จ่ายค่าธรรมเนียมให้แก่ผู้ให้ยืมทุกสิ้นเดือน	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการสิ้นเดือน

ทั้งนี้ ธปท. จะปรับมูลค่าตราสารหนี้ให้เป็นไปตามราคาตลาด³ ณ วันทำการสิ้นเดือน เพื่อใช้ในการคำนวณค่าธรรมเนียมการยึดตราสารหนี้ในช่วงระยะเวลาต่อไป

³ มูลค่าตามราคาตลาด ณ วันทำการสิ้นเดือน อิงตามราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) จำนวนตามสูตรการคำนวณราคาตราสารหนี้ที่ประกาศโดย ธปท. ใช้อัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันทำการสิ้นเดือน สำหรับการคำนวณมูลค่าตลาดใหม่ของตราสารหนี้ (ในกรณีที่ไม่สามารถเรียกดูอัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าได้ ให้ใช้อัตราผลตอบแทน ณ วันทำการล่าสุดที่สามารถเรียกดูได้) ในกรณีที่ไม่มีราคาตลาดที่เผยแพร่โดย ThaiBMA ให้ใช้ราคาที่คำนวณตามวิธีการที่ ธปท. กำหนดซึ่งเผยแพร่ใน website ของ ธปท.

3.2.4 การส่งคืนตราสารหนี้เมื่อถึงวันครบกำหนดหรือวันสิ้นสุดสัญญา

การดำเนินการ	เวลา
(1) ผู้ให้ยืมเวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ให้ ธปท.	ภายใน 9.00 น. ของวันครบกำหนด หรือ สิ้นสุดสัญญา
(2) ธปท. คืนตราสารหนี้ให้ผู้ให้ยืมและผู้ให้ยืมรับคืนตราสารหนี้จาก ธปท.	ภายใน 11.00 น. ของวันครบกำหนด หรือ สิ้นสุดสัญญา
(3) ธปท. จ่ายค่าธรรมเนียมการยึดตราสารหนี้ให้แก่ผู้ให้ยืม	ภายใน 11.00 น. ของวันครบกำหนด หรือ สิ้นสุดสัญญา

3.3 วิธีการสื่อสารในการทำธุรกรรมตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3 /2559 ว่าด้วยการยึดตราสารหนี้ ลงวันที่ 15 พฤศจิกายน 2559 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

3.3.1 ธปท. และผู้ให้ยืมจะทำธุรกรรมการยึดตราสารหนี้ผ่านระบบงานการยึดตราสารหนี้ของบริการ EFS

3.3.2 กรณีที่ระบบงานดังกล่าวของบริการ EFS ไม่สามารถใช้งานได้ ให้ทำธุรกรรมการยึดตราสารหนี้ผ่านทางโทรศัพท์หรืออีเมล และให้ทำหนังสือยืนยันการทำธุรกรรมตามแบบที่ ธปท. กำหนด พร้อมลงนามโดยผู้มีอำนาจลงนาม ส่งทางโทรสารหรืออีเมลให้ ธปท. ภายในเวลา 13.30 น. ของวันที่ตกลง และส่งเอกสารฉบับจริงให้ ธปท. ภายในเวลา 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

4. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 21 พฤศจิกายน 2559 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 15 พ.ย. 2559



(นายวิรไท สันติประภพ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย