

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สก. 40/2553

เรื่อง ราคารับซื้อตราสารหนี้ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงิน
เกี่ยวกับการขายตราสารหนี้เพื่อบริหารสภาพคล่องโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน (บริการขายตราสารหนี้)

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตามข้อ 5.3.1 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สก. 39/2553
ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการขายตราสารหนี้เพื่อบริหารสภาพคล่องโดยมีสัญญาว่าจะ
ซื้อคืน ลงวันที่ 12 พฤษภาคม 2553

รพท. จึงออกประกาศเพื่อกำหนดราคารับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน

2. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ให้ใช้บังคับกับสมาชิกตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สก. 39/2553
ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการขายตราสารหนี้เพื่อบริหารสภาพคล่องโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน
ลงวันที่ 12 พฤษภาคม 2553 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

3. เนื้อหา

รพท. ออกประกาศกำหนด ดังต่อไปนี้

ให้สมาชิกเสนอจำนวนเงินที่ต้องการขายตราสารหนี้ โดย รพท. จะรับซื้อตราสารหนี้จาก
สมาชิกตามราคาตลาด^๑ ที่ปรับลดด้วยอัตราส่วนลด (Haircut) ตามประเภทตราสารหนี้ และอายุคงเหลือ
ของตราสารหนี้ ดังนี้

^๑ ราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ตามวงตามสูตรการคำนวณราคาตราสารหนี้ที่ประกาศโดย
รพท. ใช้อัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันก่อนหน้าวันตกลงซื้อขายตราสารหนี้สำหรับการส่งมอบในวันที่ซื้อขายตราสารหนี้ (ในกรณี
ที่ไม่สามารถเรียกดูอัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันก่อนหน้าได้ ให้ใช้อัตราผลตอบแทน ณ วันล่าสุดที่สามารถเรียกดูได้) ในกรณีที่ไม่มี
มีราคาตลาดที่เผยแพร่โดย ThaiBMA ให้ใช้ราคาที่คำนวณตามวิธีการที่ รพท. กำหนด ซึ่งเผยแพร่ใน website ของ รพท.

สก.ป00กส6400125530513

ก. กรณีปกติ

อัตราส่วนลด (Haircut) (ร้อยละ)

ประเภทตราสารหนี้ ²⁾	อายุคงเหลือ			
	0 - 5 ปี	>5 ปี - 10 ปี	>10 ปี - 20 ปี	> 20 ปี
- ตัวเงินคลัง ตัวสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร ธปท. พันธบัตรออมทรัพย์ ธปท.	1	1.5	2.5	3
- หุ้นกู้ พันธบัตรหรือตราสารหนี้ที่ออกโดย รัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะ จัดตั้งขึ้น ตามที่ ธปท. กำหนด - พันธบัตรหรือตราสารที่ออกโดยกองทุนเพื่อ การฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน	1.5	3	4.5	5.5

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

ข. กรณีตราสารหนี้ที่มีการจ่ายดอกเบี้ยงวด หากวันปิดพักทะเบียนการจ่ายดอกเบี้ยอยู่ในช่วงเวลา
ระหว่างสัญญา (นับวันถัดจากวันที่ตามสัญญาจนถึงวันครบกำหนด) คิดอัตราส่วนลดเท่ากับ
อัตราส่วนลดตามเกณฑ์ปกติในข้อ ก. บวกด้วยดอกเบี้ยตราสารหนี้ที่จะมีการจ่ายในงวดนั้นคิด
เป็นร้อยละของราคาตลาดของตราสารหนี้

4. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 16 มิถุนายน 2553 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 12 พ.ค. 2553

(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย