

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 43/2553

เรื่อง การคำนวณมูลค่าตราสารหนี้กรณีสมาชิกไม่ซื้อคืนตราสารหนี้ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการขายตราสารหนี้เพื่อบริหารสภาพคล่อง โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน (บริการขายตราสารหนี้)

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตาม ข้อ 5.4.5 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 39/2553 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการขายตราสารหนี้เพื่อบริหารสภาพคล่อง โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ลงวันที่ 12 พฤษภาคม 2553

ธปท. จึงออกประกาศเพื่อกำหนดการคำนวณมูลค่าตราสารหนี้กรณีสมาชิกไม่ซื้อคืนตราสารหนี้

2. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ให้ใช้บังคับกับสมาชิกตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 39/2553 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการขายตราสารหนี้เพื่อบริหารสภาพคล่อง โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ลงวันที่ 12 พฤษภาคม 2553 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

3. เนื้อหา

ธปท. จะคำนวณมูลค่าตราสารหนี้กรณีสมาชิกไม่ซื้อคืนตราสารหนี้ตามหลักเกณฑ์ ดังนี้

สกงป00กส6400425530513

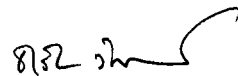
ประเภทตราสารหนี้	อัตราที่ใช้คำนวณมูลค่าตราสารหนี้ตามราคาตลาด ¹⁾
1. พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร ธปท. พันธบัตรออมทรัพย์ ธปท.	ร้อยละ 98.5 ของราคาตลาด
2. หุ้นกู้ พันธบัตรหรือตราสารหนี้ที่ออกโดย รัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมาย เฉพาะจัดตั้งขึ้น ตามที่ ธปท. กำหนด พันธบัตรหรือตราสารที่ออกโดยกองทุนเพื่อการ ฟื้นฟูและพัฒนาาระบบสถาบันการเงิน	ร้อยละ 97.0 ของราคาตลาด
3. ตัวเงินคลังและตัวสัญญาใช้เงินเพื่อปรับ โครงสร้างหนี้	ร้อยละ 99.5 ของราคาตลาด

¹⁾ ราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) คำนวณตามสูตรการคำนวณราคาตราสารหนี้
ที่ประกาศโดย ธปท. โดยใช้อัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันก่อนหน้าวันที่ครบกำหนดซื้อคืนตราสารหนี้สำหรับการ
ส่งมอบในวันที่ ธปท. ดำเนินการซื้อตราสารหนี้ที่สมาชิกไม่ซื้อคืน (ในกรณีที่ไม่สามารถเรียกดูอัตราผลตอบแทน
ณ สิ้นวันก่อนหน้าได้ ให้ใช้อัตราผลตอบแทน ณ วันล่าสุดที่สามารถเรียกดูได้) ในกรณีที่ไม่มีราคาตลาดที่เผยแพร่
โดย ThaiBMA ให้ใช้ราคาที่คำนวณตามวิธีการที่ ธปท. กำหนด ซึ่งเผยแพร่ใน website ของ ธปท.

4. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 16 มิถุนายน 2553 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 12 พ.ค. 2553



(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย