



ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรข. 4/2565

เรื่อง หลักเกณฑ์การรับซื้อตราสารหนี้เพื่อเป็นเงินสภาพคล่อง
ในกรณีระบบบาทเน็ตไม่สามารถให้บริการได้โดยสิ้นเชิง (BAHTNET Offline)

1. เหตุผลในการออกประกาศ

ด้วยธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้ออกระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการดำเนินการกรณีระบบบาทเน็ตไม่สามารถให้บริการได้โดยสิ้นเชิง (BAHTNET Offline) จึงจำเป็นต้องกำหนดหลักเกณฑ์ เงื่อนไข อัตราค่าตอบแทนเกี่ยวกับการรับซื้อตราสารหนี้เพื่อใช้เป็นเงินสภาพคล่องสำหรับการทำธุรกรรมในช่วงประกาศใช้ BAHTNET Offline (BNO) สำหรับผู้ใช้บริการบาทเน็ตที่มีตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระดุลสุทธิ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำระดุลสุทธิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเน็ต เพื่อประโยชน์สำหรับการบริหารจัดการสภาพคล่องใน BNO และเพื่อให้ผู้ใช้บริการบาทเน็ตดำเนินการชำระเงินระหว่างสถาบันได้อย่างต่อเนื่อง

2. อำนาจตามกฎหมาย

เพื่ออนุวัติตาม ข้อ 4.3 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สรข. 1/2565 ว่าด้วยการดำเนินการกรณีระบบบาทเน็ตไม่สามารถให้บริการได้โดยสิ้นเชิง (BAHTNET Offline)

3. ขอบเขตการบังคับใช้

ผู้ใช้บริการบาทเน็ตตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการบริการบาทเน็ต

4. เนื้อหา

4.1 นิยาม

ในประกาศนี้

“ตราสารหนี้” หมายถึง ตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระดุลสุทธิ (Securities Requirement for Settlement: SRS) ที่ผู้ใช้บริการบาทเน็ตดำรงไว้ในบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระดุลสุทธิ สำหรับใช้เป็นเงินสภาพคล่องในการทำธุรกรรมช่วงที่ประกาศใช้ BNO ซึ่งต้องมีคุณสมบัติและเงื่อนไข ดังนี้

(1) เป็นตราสารหนี้ที่ ธปท. เป็นนายทะเบียน โดยไม่รวมถึงพันธบัตรประเภททยอยคืนเงินต้น

สรขป70-กส65101-25650331

กส 651

วันที่ 31 มี.ค. 2565

(2) เป็นตราสารหนี้ที่ปลอดภาระ ซึ่งรวมถึงตราสารหนี้ที่จะปลอดภาระเมื่อชำระคูลสำเร็จในวันที่ประกาศใช้ BNO เช่น ธุรกรรม Bulk Payment รอบ Credit Next Day และธุรกรรมการหักบัญชีเช็คด้วยภาพเช็ค ของรอบการชำระคูลหักบัญชีในวันทำการถัดไป (Next-Day Settlement)

(3) เป็นตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือไม่น้อยกว่า 6 วันทำการ ก่อนวันปิดพักทะเบียน

(4) ตราสารหนี้ที่นำมาใช้เป็นเงินสภาพคล่อง ต้องไม่เกิน 80% ของเกณฑ์การดำรงตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระคูลสุทธิ ตามประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยวิธีการดำรงตราสารหนี้ตามมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำระคูลสุทธิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเน็ต

“วันปิดพักทะเบียน” หมายถึง ระยะเวลาที่กำหนดห้ามการโอน การจำหน่าย หรือการเปลี่ยนแปลงเงื่อนไขตามที่นายทะเบียนประกาศกำหนด หรือตามประกาศการจำหน่ายตราสารหนี้แต่ละรุ่น

4.2 การรับซื้อตราสารหนี้เพื่อเป็นเงินสภาพคล่องการทำธุรกรรมในช่วงประกาศใช้ BNO

ธปท. จะพิจารณารับซื้อตราสารหนี้ของผู้ให้บริการบาทเน็ต เพื่อเป็นเงินสภาพคล่องใน BNO โดยจะนำเงินเข้าบัญชีเงินฝากกระแสรายวันของผู้ให้บริการบาทเน็ตในวันที่ประกาศใช้ BNO และโอนกรรมสิทธิ์ตราสารหนี้ที่รับซื้อนั้นเป็นของ ธปท.

4.3 การซื้อคืนตราสารหนี้ที่ใช้เป็นเงินสภาพคล่องการทำธุรกรรมในช่วงประกาศใช้ BNO

(1) ผู้ให้บริการบาทเน็ตต้องชำระราคาซื้อคืนตราสารหนี้ดังกล่าวภายในสิ้นวันที่ระบบบาทเน็ตกลับมาให้บริการได้ตามปกติ หรือสิ้นวันทำการของวันที่ 6 นับตั้งแต่วันที่ประกาศใช้ BNO แล้วแต่วันใดจะถึงก่อน ภายหลังจากที่ผู้ให้บริการบาทเน็ตชำระราคาซื้อคืนตราสารหนี้แล้วเสร็จ ธปท. จะโอนกรรมสิทธิ์ตราสารหนี้คืนให้แก่ผู้ให้บริการบาทเน็ต ในวันนั้นหรือในโอกาสแรกที่สามารถดำเนินการได้

(2) ในกรณีที่ผู้ให้บริการบาทเน็ตมีเงินในบัญชีเงินฝากไม่พอสำหรับการชำระราคาซื้อคืนตราสารหนี้ดังกล่าว ไม่ว่าจะทั้งหมดหรือบางส่วน ภายใน 17.30 น. ของวันที่ระบบบาทเน็ตกลับมาให้บริการได้ตามปกติ หรือสิ้นวันทำการของวันที่ 6 นับตั้งแต่วันที่ประกาศใช้ BNO แล้วแต่วันใดจะถึงก่อน ให้ถือว่าผู้ให้บริการบาทเน็ตสันสิทธิซื้อคืนในส่วนของตราสารหนี้ที่เหลือซึ่งซื้อคืนไม่ได้ และ ธปท. จะดำเนินการตามกระบวนการปกติที่ระบุในข้อ 21 ถึงข้อ 22 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำระคูลสุทธิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเน็ต โดยคิดค่าตอบแทนการใช้เงินสภาพคล่องตามอัตราที่ระบุในข้อ 4.4 แห่งประกาศนี้

4.4 การคิดค่าตอบแทนการใช้เงินสภาพคล่องการทำธุรกรรมในช่วงประกาศใช้ BNO

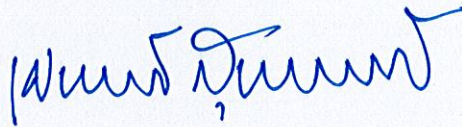
ธปท. จะคิดอัตราค่าตอบแทนสำหรับผู้ให้บริการบาทเนตในการซื้อคืนตราสารหนี้ที่ใช้เป็นเงินสภาพคล่องในการทำธุรกรรมช่วงประกาศใช้ BNO ตามอัตราดอกเบี้ยนโยบาย และจะคำนวณจำนวนวันที่ ธปท. รับซื้อในช่วงประกาศใช้ BNO โดยมีสูตรการคำนวณค่าตอบแทน ดังนี้

$\text{มูลค่าตราสารหนี้ที่ ธปท. รับซื้อ} \times \frac{\text{จำนวนวันที่ ธปท. รับซื้อในช่วงประกาศใช้ BNO}}{365} \times \frac{\text{อัตราดอกเบี้ยนโยบาย}}{100}$

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ประกาศนี้ให้มีผลบังคับตั้งแต่วันที่ประกาศเป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 31 มีนาคม 2565



(นายเศรษฐวุฒิ สุทธิวาทนฤพุมิ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ฝ่ายการชำระเงินและพันธบัตร

โทรศัพท์ 0 2283 5083