

Workflow สำหรับการทำ Pre-fund รอบ Bulk Payment Credit Next Day

วันที่ Day -1

เวลา	สมาชิก	ธปท.
ภายใน 8.30 น.	1.1 ตรวจสอบ CA ^{1/} และ SA ^{2/} ได้จาก Web	1. ธปท. ทำรายการรับซื้อตราสารหนี้ ILF ^{3/} - นำเงินเข้าบัญชี CA สมาชิก - โอนตราสารหนี้จากบัญชีของสมาชิกเข้าบัญชีของ ธปท.
ภายใน 16.00 น.	2. รับแจ้ง Report Settlement รอบ Bulk Payment จาก NITMX	3. รับแจ้งข้อมูล Settlement (MFT) จาก NITMX และเตรียมการ Pre-fund
ภายใน 17.00 น.	4. สมาชิกบริหารเงินสำหรับยอดขาดดุลเช็ค ICAS รอบ Same-day และเตรียมตราสารหนี้และเงินฝากให้เพียงพอสำหรับ Pre-fund Bulk Payment	5. ชำระดุลเช็ค ICAS รอบ Same-day
ภายใน 17.15 น.		6. จำนำตราสารหนี้ SRS ^{4/} และ ILF เพื่อการใช้อยอดได้ดุลเช็ค ICAS ตามลำดับ ส่วนที่เหลือนำไปใช้ Pre-fund ได้ ↓ 7. นำยอดได้ดุลไปซื้อคืนตราสารหนี้ SRS/ILF ที่ใช้ไประหว่างวัน
ภายใน 17.30 น.		8. ซื้อคืนตราสารหนี้ SRS/ILF ส่วนที่เหลือ ↓ 8.1 เงินในบัญชีเพียงพอหรือไม่ พอ → 8.2 หักเงิน CA และโอนตราสารหนี้คืนสมาชิก ไม่พอ → 8.3 ใช้ SRS/ILF Overnight

หมายเหตุ : ^{1/}CA หมายถึง Current Account (บัญชีเงินฝากกระแสรายวันที่ ธปท.)

^{2/}SA หมายถึง Securities Account (บัญชีตราสารหนี้เพื่อ ILF ที่ ธปท.)

^{3/}ILF หมายถึง Intraday Liquidity Facilities

^{4/}SRS หมายถึง Securities Requirement for Settlement

เวลา	สมาชิก	รบท.
หลังซื้อคืน ตราสารหนี้ SRS และ ILF ลื่นวัน		9. ดำเนินการ Pre-fund ดังนี้ <pre> graph TD A[9.1 Pre-fund ตราสารหนี้ SRS ส่วนของตนเองที่ปราศจากภาระผูกพัน] --> B{9.2 ตราสารหนี้ SRS (ไม่นับหลักประกันร่วม) เพียงพอหรือไม่} B -- พอ --> C[9.3 ทำ Pre-fund ตราสารหนี้ SRS ส่วนของตนเอง] B -- ไม่พอ --> D[9.4 Pre-fund เงินในบัญชี CA คงเหลือ] D --> E{9.5 เงินใน CA เพียงพอหรือไม่} E -- พอ --> F[9.6 ทำ Pre-fund ตราสารหนี้ SRS ส่วนของตนเอง และเงินในบัญชี CA] E -- ไม่พอ --> G[9.7 Pre-fund ตราสารหนี้ ILF ส่วนที่ปราศจากภาระผูกพัน] G --> H{9.8 ตราสารหนี้ ILF เพียงพอหรือไม่} H -- พอ --> I[9.9 ทำ Pre-fund ตราสารหนี้ SRS ส่วนของตนเอง เงินในบัญชี CA และ ตราสารหนี้ ILF] H -- ไม่พอ --> J[9.10 Pre-fund ตราสารหนี้ SRS ส่วนที่เป็นหลักประกันร่วม ซึ่งปราศจากภาระผูกพันของสถาบันผู้ให้หลักประกัน (CP)] J --> K{9.11 ตราสารหนี้ SRS ส่วนที่เป็นหลักประกันร่วม (ถ้ามี) เพียงพอหรือไม่} K -- พอ --> L[9.12 ทำ Pre-fund ตราสารหนี้ SRS ส่วนของตนเอง เงินในบัญชี CA ตราสารหนี้ ILF และตราสารหนี้ SRS ส่วนที่เป็นหลักประกันร่วม] K -- ไม่พอ --> M[9.13 แจ้ง NITMX unwind] </pre>

วันที่ Day 0

เวลา	สมาชิก	รพท.
ภายใน 8.30 น.	10.1 ตรวจสอบ CA และ SA ได้จาก Web	10. รพท. ทำรายการรับซื้อตราสารหนี้ ILF ทั้งหมด (รวมทั้งส่วนที่ถูก Pre-fund ไว้) - นำเงินเข้าบัญชี CA สมาชิก - ระบบกันเงินในบัญชี CA ของสมาชิกแทนที่การใช้ตราสารหนี้ ILF ในการ Pre-fund เมื่อวันก่อน
ภายใน 8.30 น.		11. รับ File MFT จาก NITMX ผ่านระบบ CSS (CSS : Central Settlement System)
9.00 น.	13. ตรวจสอบ CA และ SA ได้จาก Web	12. ชำระดุลรอบ Bulk Payment 12.1 เงินในบัญชีเพียงพอหรือไม่ 12.2 ถ้าเงินไม่พอ ให้นำเงิน CA ตราสารหนี้ SRS ทั้งส่วนของตนเองและส่วนที่เป็นหลักประกันร่วมที่ Pre-fund มาชำระดุล 12.3 ปลด Pre-fund เงิน CA ตราสารหนี้ SRS ทั้งส่วนของตนเองและส่วนที่เป็นหลักประกันร่วม