

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรข. 9 /2552

เรื่อง อัตราค่าตอบแทนในการซื้อขายตราสารหนี้และวิธีคำนวณ

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อกำหนดอัตราค่าตอบแทนและวิธีคำนวณค่าตอบแทนกรณีที่สถาบันการเงินใช้เงินสภาพคล่องระหว่างวันข้ามวันและกรณีที่สถาบันการเงินสิ้นสิทธิ์ซื้อคืนตราสารหนี้จากการใช้เงินสภาพคล่องระหว่างวันข้ามวัน

2. อ้างอิงตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 44 และมาตรา 45 แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 และที่แก้ไขเพิ่มเติม และเพื่ออนุวัติตามข้อ 3 (5) และข้อ 3 (6) (6.1) แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

3. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ใช้บังคับกับสถาบันการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

4. เนื้อหา

4.1 ธนาคารแห่งประเทศไทยจะคิดค่าตอบแทนสำหรับการขายคืนตราสารหนี้ในวันทำการถัดจากวันที่รับซื้อ และค่าตอบแทนสำหรับการยึดตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินสิ้นสิทธิ์ซื้อคืนในอัตราดอกเบี้ยนโยบายของวันที่ ปรท. รับซื้อ บวกร้อยละ 0.50 ต่อปี

4.2 การคำนวณค่าตอบแทนให้เป็นไปตามวิธีต่อไปนี้

ส่วนของตราสารหนี้ที่ไม่สามารถซื้อคืนในวันที่ย้าย	X [จำนวนวันก่อนซื้อคืนหรือก่อนสิ้นสิทธิซื้อคืน (รวมวันหยุด)] X อัตราค่าผลตอบแทน	
	365	100

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 พฤศจิกายน 2552

(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย