

ธนาคารแห่งประเทศไทย

๒๐ พฤศจิกายน 2552

เรียน ผู้จัดการ

สถาบันผู้ใช้บริการบาทเน็ต

ที่ ฝรช.(12)ว. 304 /2552 เรื่อง การออกระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่อง ระหว่างวันและประกาศที่เกี่ยวข้อง

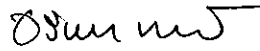
ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้ยกเลิกระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการขายตราสารหนี้เพื่อปรับสภาพคล่องสิ้นวันโดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืน พ.ศ. 2549 (ระเบียบ EOD) และออกระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับ ธุรกรรมการบริหารสภาพคล่อง (บริการบริหารสภาพคล่อง) แทน รวมทั้งจะมีการเปลี่ยนแปลง Haircut สำหรับการทำให้ธุรกรรมผ่านหน้าต่างสภาพคล่องด้านตลาดการเงิน โดยมีผลตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 เป็นต้นไป นั้น

เนื่องจาก ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน (ระเบียบ ILF) มีหลักเกณฑ์อ้างอิงกับระเบียบ EOD ธปท. จึงเห็นสมควรยกเลิกระเบียบ ILF ปัจจุบันและออกระเบียบ ILF ใหม่ โดยได้ปรับ เนื้อหาและด้อยค่าจากระเบียบปัจจุบันรวมทั้งออกประกาศที่เกี่ยวข้อง โดยสรุปสาระสำคัญได้ดังนี้

1. ปรับด้อยค่าในนิยามคำว่า “ตราสารหนี้” จากเดิมที่อ้างอิงระเบียบ EOD เป็นการกำหนดนิยามโดยอ้างอิงระเบียบบริการบริหารสภาพคล่อง
2. ปรับด้อยค่าตามระเบียบ ILF ข้อ 3 (6) (6.2) ว่าด้วยการคำนวณตราสารหนี้กรณี สถาบันการเงินสินทรัพย์ซื้อคืน จากเดิมอ้างอิงตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดไว้ในประกาศภายใต้ระเบียบ EOD เป็นการออกประกาศภายใต้ตามระเบียบ ILF
3. ตัดเนื้อหาส่วนที่รองรับการ โอนย้ายงานรวมศูนย์รับฝากหลักทรัพย์จาก ธปท. ไปยังบริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด เนื่องจากการ โอนย้ายงานได้ดำเนินการเสร็จสิ้นแล้ว
4. ออกประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ออกตามระเบียบ ILF ใหม่ทุกฉบับ โดยยังคงเนื้อหาเหมือนปัจจุบัน ยกเว้นประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่อง หลักเกณฑ์การรับซื้อตราสารหนี้เพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวันที่ได้ปรับเปลี่ยนอัตรา Haircut ใหม่ให้สอดคล้องกับการปรับเปลี่ยน Haircut สำหรับการทำให้ธุรกรรมผ่านหน้าต่างสภาพคล่องด้านตลาดการเงิน

จึงเรียนมาเพื่อ โปรดทราบ พร้อมนี้ขอส่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยและ
ประกาศที่เกี่ยวข้องตามรายชื่อในเอกสารแนบท้าย

ขอแสดงความนับถือ



(นางสาวจริญญา แก้วมณี)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายระบบการชำระเงิน

ผู้ว่าการ

- สิ่งที่ส่งมาด้วย 1. ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สรข. 2/2552 ว่าด้วยรับซื้อตราสารหนี้
โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
2. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สรข. 6/2552 เรื่อง การกำหนดสถาบัน
การเงินอื่นเป็นสถาบันการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อ
ตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
3. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สรข. 7/2552 เรื่อง ราคาตราสารหนี้
ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยจะรับซื้อในการซื้อขายตราสารหนี้กับสถาบันการเงิน
เพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
4. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สรข. 8/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์การรับซื้อ
ตราสารหนี้เพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
5. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สรข. 9/2552 เรื่อง อัตราค่าตอบแทน
ในการซื้อขายตราสารหนี้และวิธีคำนวณ
6. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สรข. 10/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์การแจ้งให้
ธนาคารแห่งประเทศไทยดำเนินการเกี่ยวกับเงินสภาพคล่องระหว่างวันในกรณีที่
เกิดเหตุขัดข้อง
7. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สรข. 11/2552 เรื่อง ค่าธรรมเนียมและ
ค่าปรับที่เกี่ยวข้องกับการใช้เงินสภาพคล่องระหว่างวัน
8. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สรข. 12/2552 เรื่อง การคำนวณมูลค่า
ตราสารหนี้กรณีสถาบันการเงินล้มเลิกการซื้อคืนตราสารหนี้

ฝ่ายระบบการชำระเงิน

โทรศัพท์ 0-2283-5056, 0-2283-5078

โทรสาร 0-2282-7717..8

ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรพ. ๒ / 2552

ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

1. เหตุผลในการออกระเบียบ

เพื่อกำหนดหลักเกณฑ์การรับซื้อตราสารหนี้เพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวันให้สอดคล้องกับการรับซื้อตราสารหนี้ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับธุรกรรมการบริหารสภาพคล่อง (บริการบริหารสภาพคล่อง)

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 44 และมาตรา 45 แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551

3. ยกเลิก

ให้ยกเลิกระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน พ.ศ. 2549 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

4. ขอบเขตการบังคับใช้

สถาบันการเงินตามระเบียบนี้

5. เนื้อหา

ในระเบียบนี้

“ธปท.” หมายความว่า ธนาคารแห่งประเทศไทย

“สถาบันการเงิน” หมายความว่า

(1) สถาบันการเงินตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน

(2) สถาบันอื่นตามที่ ธปท. ประกาศกำหนด

“ศูนย์รับฝาก” หมายความว่า บริษัทศูนย์รับฝากหลักทรัพย์

(ประเทศไทย) จำกัด หรือหน่วยงานอื่นใดที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

จัดตั้งขึ้น หรือได้รับอนุญาตจากคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาด
หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เพื่อประกอบการศูนย์กลางการให้บริการรับฝาก
และถอนหลักทรัพย์

“ตราสารหนี้” หมายความว่า

- (1) ตั๋วเงินคลัง
- (2) ตั๋วสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้
- (3) พันธบัตรรัฐบาล
- (4) พันธบัตร ธปท.
- (5) พันธบัตรหรือหุ้นกู้ที่ออกโดยองค์การของรัฐหรือ
รัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ทั้งนี้ ตามที่ ธปท.
จะเห็นสมควร

“บัญชีเงินฝาก” หมายความว่า บัญชีเงินฝากกระแสรายวันหรือ
บัญชีชำระเงินซึ่งสถาบันการเงินเปิดไว้กับ ธปท.

“บัญชีตราสารหนี้ของ ธปท. เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวัน”
หมายความว่า บัญชีตราสารหนี้ที่ ธปท. เปิดไว้ที่ศูนย์รับฝากในฐานะที่ ธปท.
ถือตราสารหนี้แทนสถาบันการเงิน เพื่อประโยชน์ในการทำธุรกรรมเงินสภาพคล่อง
ระหว่างวัน

“บัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบัน
การเงิน” หมายความว่า บัญชีตราสารหนี้ของแต่ละสถาบันการเงินภายใต้
ระบบงานและการดูแลของ ธปท. สำหรับบันทึกข้อมูลการฝากถอนตราสารหนี้
การขายและ/หรือซื้อคืนตราสารหนี้ในบัญชีดังกล่าวเพื่อธุรกรรมเงินสภาพคล่อง
ระหว่างวัน

“ธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน” หมายความว่า ธุรกรรมที่
ธปท. ทำกับสถาบันการเงินเพื่อให้สถาบันการเงินได้รับเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
ได้แก่ ธุรกรรมดังต่อไปนี้

- (1) การขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน
- (2) การซื้อคืนตราสารหนี้
- (3) ธุรกรรมอื่นใดที่เกี่ยวข้องเนื่องจากการใช้เงินสภาพคล่อง
ระหว่างวัน เช่น การกันตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินไม่ประสงค์จะให้มีการขาย
ตราสารหนี้นั้นเพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวัน หรือจำหน่ายเพื่อการใช้ยอดได้ดูแล
การหักบัญชีเช็คระหว่างธนาคารรอบปกติ การขอใช้ยอดได้ดูแลการหักบัญชีเช็ค

การใช้เงินสภาพคล่องระหว่างวันข้ามวัน (Overnight ILF) การยึดตราสารหนี้
กรณีที่ตั้งสถาบันการเงินสินทรัพย์ซื้อคืน เป็นต้น

“เงินสภาพคล่องระหว่างวัน” (Intraday Liquidity Facilities : ILF)
หมายความว่า เงินที่สถาบันการเงินได้รับจาก ธปท. เพื่อใช้เป็นเงินสภาพคล่อง
ในระบบบาทเนตตามระเบียบนี้

“บริการ EFS” หมายความว่า บริการด้านการเงินด้วยวิธี
อิเล็กทรอนิกส์ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการให้บริการด้าน
การเงินด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (Electronic Financial Services)

ข้อ 1 ธปท. จะพิจารณารับซื้อตราสารหนี้จากสถาบันการเงิน
โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเสริมสภาพคล่องการโอนเงินผ่านบาทเนต
ตามหลักเกณฑ์ดังต่อไปนี้

(1) ธปท. จะรับซื้อตราสารหนี้ในราคาซื้อตามที่ ธปท.
ประกาศกำหนด

(2) ธปท. จะคิดค่าตอบแทนในการรับซื้อตราสารหนี้
ตามอัตราที่ ธปท. ประกาศกำหนด

(3) ธปท. จะรับซื้อเฉพาะตราสารหนี้ที่สามารถคำนวณ
มูลค่าตามราคาตลาดได้

(4) ตราสารหนี้ที่ ธปท. จะพิจารณารับซื้อแต่ละคราวต้องเป็น
ตราสารหนี้ที่เข้าตามเงื่อนไขและมีราคาตราไม่ต่ำกว่าที่ ธปท. ประกาศกำหนด

(5) สำหรับตราสารหนี้ที่ได้ใช้เป็นหลักประกันการใช้จ่าย
ได้ดูแลการหักบัญชีเช็คตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการหักบัญชี
ระหว่างธนาคารในกรุงเทพมหานครด้วยอิเล็กทรอนิกส์ ธปท. จะพิจารณารับซื้อ
ตราสารหนี้ดังกล่าวเมื่อการชำระดุลรอบเช็คคืนดำเนินการแล้วเสร็จหรือรับซื้อ
เพื่อการชำระดุลรอบเช็คคืนเท่านั้น

ทั้งนี้ สถาบันการเงินมีหน้าที่ควบคุมดูแลให้มีตราสารหนี้ที่จะ
ขายเพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันให้เพียงพอกับจำนวนหรืออัตราส่วนที่ ธปท.
กำหนดไว้ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการบริการบาทเนต

ข้อ 2 สถาบันการเงินที่ประสงค์จะใช้ประโยชน์จากระเบียบนี้
ต้องปฏิบัติดังนี้

(1) ทำหนังสือแสดงความตกลงตามแบบที่แนบ

(2) ทำหนังสือมอบอำนาจตามแบบที่แนบ

เงื่อนไขการรับซื้อ
ตราสารหนี้

การดำเนินการ
ของสถาบันการเงิน
ในการรับประโยชน์
จากระเบียบนี้

(3) ทำหนังสือมอบอำนาจให้ ธปท. ดำเนินการกับตราสารหนี้ เพื่อธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

(4) ผ่าตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินมีกรรมสิทธิ์และปราศจากภาระผูกพันเพื่อการซื้อขายตามระเบียบนี้เข้าบัญชีตราสารหนี้ของ ธปท. เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวัน ตามวิธีการที่ศูนย์รับฝากกำหนด

ข้อ 3 ในการทำธุรกรรมแต่ละวัน จะมีขั้นตอนปฏิบัติดังนี้

ขั้นตอนปฏิบัติ

(1) ธปท. พิจารณารับซื้อตราสารหนี้ของสถาบันการเงินที่นำฝากไว้ในบัญชีตราสารหนี้ของ ธปท. เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวัน โดย ธปท. จะนำเงินเข้าบัญชีเงินฝากสถาบันการเงินภายในเวลา 8.30 น.

ในแต่ละวัน

(2) เมื่อ ธปท. ได้นำเงินเข้าบัญชีเงินฝากแล้ว การขายตราสารหนี้ โดยมีข้อตกลงว่าจะซื้อคืนมีผลผูกพันสถาบันการเงินทันที

(3) ธปท. จะหักเงินออกจากบัญชีเงินฝากสถาบันการเงินเพื่อการซื้อคืนภายในเวลา 17.30 น. ตามราคาที่ ธปท. รับซื้อไว้

(4) ในกรณีที่เงินในบัญชีเงินฝากสถาบันการเงินมีไม่พอให้ ธปท. หักเพื่อชำระราคาซื้อคืนตราสารหนี้ ณ สิ้นวันตามเวลาที่ ธปท. กำหนด ธปท. จะให้สถาบันการเงินซื้อคืนตราสารหนี้ตามสัดส่วนเท่าที่เงินในบัญชีเงินฝากสถาบันการเงินมีอยู่

(5) สำหรับตราสารหนี้ส่วนที่เหลือถือว่าไม่มีการซื้อคืนในวันนั้น และ ธปท. จะขายคืนตราสารหนี้ดังกล่าวภายในเวลา 12.00 น. ของวันทำการถัดไป โดย ธปท. จะขายคืนในราคาที่เท่ากับผลรวมของราคาที่ ธปท. รับซื้อกับค่าตอบแทนตามอัตราที่ ธปท. ประกาศกำหนด และจำนวนวันที่รับซื้อให้นับจากวันที่ ธปท. รับซื้อตราสารหนี้จนถึงวันที่สถาบันการเงินซื้อคืน ทั้งนี้ ตามวิธีคำนวณที่ ธปท. กำหนด แต่ถ้าในวันทำการถัดไปเงินในบัญชีเงินฝากสถาบันการเงินยังคงไม่พอให้หักชำระราคาซื้อคืนภายในเวลา 12.00 น. สถาบันการเงินนั้นเป็นอันสิ้นสิทธิ์ซื้อคืน

(6) เมื่อสถาบันการเงินสิ้นสิทธิ์ซื้อคืน ธปท. จะดำเนินการดังนี้

(6.1) คิดค่าตอบแทนจากราคารับซื้อตราสารหนี้ตามอัตราที่ ธปท. ประกาศกำหนด และจำนวนวันที่รับซื้อให้นับจากวันที่ ธปท. รับซื้อตราสารหนี้จนถึงวันที่สถาบันการเงินสิ้นสิทธิ์ซื้อคืน

(6.2) คำนวณมูลค่าตราสารหนี้ตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท. ประกาศกำหนด

(6.3) นำเงินเข้าหรือหักเงินจากบัญชีเงินฝากสถาบันการเงิน ในกรณีที่มีส่วนต่างระหว่างมูลค่าตราสารหนี้ที่คำนวณได้ตาม (6.2) กับมูลค่าตราสารหนี้ที่ ธปท. รับซื้อบวกค่าตอบแทนตาม (6.1)

(6.4) กรณีตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินซื้อคืนเป็นตราสารหนี้ที่มีการจ่ายดอกเบี้ยงวด หากวันสิ้นสิทธิซื้อคืนตรงกับวันปิดสมุดทะเบียนเพื่อการจ่ายดอกเบี้ย ธปท. จะเป็นผู้มีสิทธิได้รับดอกเบี้ยจากตราสารหนี้นั้น ทั้งนี้ หากวันปิดสมุดทะเบียนตามที่กล่าวข้างต้นตรงกับวันหยุดทำการของสถาบันการเงิน ธปท. จะเป็นผู้มีสิทธิได้รับดอกเบี้ยจากตราสารหนี้ดังกล่าวด้วย

ข้อ 4 กรณีที่สถาบันการเงินไม่สามารถชำระเงินในบัญชีเงินฝากให้พอเพียงสำหรับจำนวนเงินที่ ธปท. ต้องหักเงินจากบัญชีของสถาบันการเงินที่คำนวณได้ตามข้อ 3 (6) (6.3) สถาบันการเงินยินยอมให้ ธปท. จำหน่ายตราสารหนี้ที่ฝากไว้หรือทรัพย์สินอื่นใดของสถาบันการเงินที่มีอยู่ที่ ธปท. จนเพียงพอกับจำนวนเงินดังกล่าว

สถาบันการเงิน
ยินยอมให้ ธปท.
จำหน่ายตราสารหนี้
หรือทรัพย์สินอื่นที่
ธปท. หากเงินใน
บัญชีมีไม่เพียงพอ
ข้อสงวนสิทธิ์

ข้อ 5 ธปท. สงวนสิทธิ์ดังนี้

- (1) คิดค่าธรรมเนียมและค่าปรับตามที่ ธปท. ประกาศกำหนด
- (2) ไม่รับซื้อตราสารหนี้จากสถาบันการเงินที่ฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามข้อใดข้อหนึ่งแห่งระเบียบนี้ หรือมีพฤติกรรมที่ไม่เป็นไปตามเจตนารมณ์แห่งระเบียบนี้หรือมีเหตุไม่สมควรประการอื่น
- (3) กำหนดวงเงินที่ ธปท. จะรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
- (4) คิดค่าปรับเพิ่มเติมในกรณีที่สถาบันการเงินซื้อคืนตราสารหนี้ในวันทำการถัดจากวันที่ขายตราสารหนี้ให้ ธปท. หรือกรณีที่สถาบันการเงินสิ้นสิทธิซื้อคืนตราสารหนี้ตามที่ ธปท. ประกาศกำหนด

ข้อ 6 สถาบันการเงินที่ประสงค์จะดำเนินการดังต่อไปนี้ให้สถาบันการเงินดำเนินการด้วยตนเองโดยผ่านบริการ EFS

- (1) ขายตราสารหนี้เพิ่มเติมระหว่างวัน หรือ
 - (2) ซื้อคืนตราสารหนี้เพียงบางส่วนหรือทั้งหมดก่อนสิ้นวัน
- หรือ

กรณีต่างๆ ที่สถาบัน
การเงินสามารถ
ดำเนินการได้เอง

(3) ขอใช้ยอดได้ดูแลการหักบัญชีเช็คเพียงบางส่วน หรือ
ของคเว้นการใช้ยอดได้ดูแลการหักบัญชีเช็ค หรือ

(4) ขอถอนตราสารหนี้ในบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงิน
สภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน เพื่อใช้ประโยชน์อื่นที่มีใช้เพื่อการใช้
เงินสภาพคล่องระหว่างวันและการนำมาเพื่อการใช้ยอดได้ดูแลการหักบัญชีเช็ค

(5) โอนตราสารหนี้ในบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงิน
สภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน

ในกรณีที่เกิดเหตุขัดข้องใด ๆ ทำให้สถาบันการเงิน
ไม่สามารถดำเนินการตามวรรคหนึ่งได้ด้วยตนเอง สถาบันการเงินสามารถ
แจ้งให้ ธปท. ดำเนินการแทน ทั้งนี้ ตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่ ธปท. กำหนด

สถาบันการเงินที่ประสงค์จะฝากตราสารหนี้เข้าบัญชี
ตราสารหนี้ของ ธปท. เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวัน ให้ดำเนินการตามวิธีการ
ที่ศูนย์รับฝากกำหนด

ข้อ 7 สถาบันการเงินที่ซื้อคืนตราสารหนี้เพียงบางส่วนหรือ
ทั้งหมดก่อนสิ้นวันตามข้อ 6 (2) ธปท. จะขายคืนตามราคาที่รับซื้อไว้

ข้อ 8 มูลค่าตราสารหนี้คงเหลือหลังจากที่สถาบันการเงินซื้อคืน
บางส่วนก่อนสิ้นวันตามข้อ 6 (2) หรือซื้อคืนบางส่วน ณ สิ้นวัน เนื่องจาก
สถาบันการเงินมีเงินในบัญชีไม่พอหักตามข้อ 3 (4) ต้องมีมูลค่าพอที่จะ
ครอบคลุมยอดเงินสภาพคล่องระหว่างวันคงค้าง

ข้อ 9 สถาบันการเงินสามารถติดตาม เรียกดู และสั่งพิมพ์ข้อมูล
ธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน รายงานการทำธุรกรรมเงินสภาพคล่อง
ระหว่างวัน รวมทั้งข้อมูลสถานะและความเคลื่อนไหวของบัญชีย่อยตราสารหนี้
เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน ได้ด้วยตนเอง โดยผ่าน
บริการ EFS

สถาบันการเงินมีหน้าที่ต้องพิมพ์หนังสือยืนยันธุรกรรมเงิน
สภาพคล่องระหว่างวันจากบริการ EFS เพื่อตรวจสอบยืนยันรายการธุรกรรม
เงินสภาพคล่องระหว่างวันและลงลายมือชื่อรับรองโดยผู้มีอำนาจลงนามแล้ว
ส่งให้ ธปท. ภายในวันทำการถัดไป

ข้อ 10 กำหนดเวลาที่ระบุไว้ตามระเบียบนี้ ธปท. อาจเปลี่ยนแปลง
ได้ตามความจำเป็นและสมควร โดยจะแจ้งให้สถาบันการเงินทราบล่วงหน้า

ราคาซื้อคืน
ตราสารหนี้

มูลค่าตราสารหนี้
คงเหลือหลังจาก
สถาบันการเงิน
ซื้อคืน

สถาบันการเงิน
ติดตาม เรียกดู และ
สั่งพิมพ์ข้อมูล
เกี่ยวกับธุรกรรม
เงินสภาพคล่อง
ระหว่างวันได้

โดยผ่านบริการ EFS

ธปท. เปลี่ยนแปลง
เวลาตามระเบียบนี้ได้

ข้อ 11 ธปท. สงวนสิทธิ์ที่จะปรับปรุง แก้ไข เพิ่มเติมหรือเปลี่ยนแปลงระเบียบ ประกาศ หรือเอกสารที่เกี่ยวข้องตามระเบียบนี้ได้ โดยจะแจ้งให้สถาบันการเงินทราบล่วงหน้า

การแก้ไข เพิ่มเติมหรือเปลี่ยนแปลงระเบียบนี้

ข้อ 12 การตีความตามระเบียบหรือประกาศหรือข้อกำหนดใดที่ออกตามระเบียบนี้ ธปท. จะเป็นผู้วินิจฉัยชี้ขาด

ธปท. จะเป็นผู้วินิจฉัยชี้ขาดในการตีความ

6. บทเฉพาะกาล

ข้อ 13 สถาบันการเงินใดขายตราสารหนี้ไว้ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน พ.ศ. 2549 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ซึ่งได้ยกเลิกไปตามระเบียบนี้และยังไม่ซื้อคืนตราสารหนี้ การซื้อคืนตราสารหนี้ ให้เป็นไปตามข้อกำหนดในระเบียบดังกล่าว

ข้อ 14 ให้นำหนังสือแสดงความตกลงและเอกสารหลักฐานต่าง ๆ ที่สถาบันการเงินได้จัดทำขึ้นตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน พ.ศ. 2549 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ยังคงมีผลใช้บังคับและผูกพันสถาบันการเงินต่อไปจนกว่าสถาบันการเงินจะมีการแจ้งยกเลิก แก้ไข หรือเปลี่ยนแปลงให้ ธปท. ทราบเป็นหนังสือ

7. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 พฤศจิกายน 2552



(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรข. 6 / 2552

เรื่อง การกำหนดสถาบันอื่นเป็นสถาบันการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อกำหนดสถาบันอื่นตาม (2) ของนิยามคำว่า “สถาบันการเงิน” ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 44 และมาตรา 45 แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 และที่แก้ไขเพิ่มเติม และเพื่ออนุวัติตาม (2) ของนิยามคำว่า “สถาบันการเงิน” ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

3. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ใช้บังคับกับสถาบันอื่นตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

4. เนื้อหา

ธนาคารแห่งประเทศไทย กำหนดให้สถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นดังต่อไปนี้ เป็นสถาบันอื่นตาม (2) ของนิยามคำว่า “สถาบันการเงิน” ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

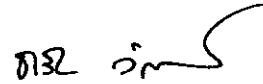
- (1) ธนาคารออมสิน
- (2) ธนาคารอาคารสงเคราะห์
- (3) ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร

- (4) ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย
- (5) ธนาคารอิสลามแห่งประเทศไทย
- (6) ธนาคารพัฒนาวิสาหกิจขนาดกลางและขนาดย่อมแห่งประเทศไทย
- (7) กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 พฤศจิกายน 2552



(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรข. ๖ /2552

เรื่อง ราคาตราสารหนี้ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยจะรับซื้อในการซื้อขายตราสารหนี้
กับสถาบันการเงินเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อกำหนดราคาตราสารหนี้ที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จะรับซื้อโดยมี
สัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนกับสถาบันการเงินเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 44 และมาตรา 45 แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย
พุทธศักราช 2485 และที่แก้ไขเพิ่มเติม และเพื่ออนุวัติตามข้อ 1 (1) แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

3. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ใช้บังคับกับสถาบันการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

4. เนื้อหา

ธปท. จะรับซื้อตราสารหนี้กับสถาบันการเงินตามราคาตลาด¹ ที่ปรับลดด้วยอัตรา
ส่วนลด (haircut) ตามประเภทตราสารหนี้และอายุคงเหลือของตราสารหนี้ดังนี้

¹ ราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) จำนวนตามสูตรการคำนวณราคาตราสารหนี้
ที่ประกาศโดย ธปท. ใช้อัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันก่อนหน้าวันตกลงซื้อขายตราสารหนี้สำหรับการส่งมอบในวันที่
ซื้อขายตราสารหนี้ (ในกรณีที่ไม่สามารถเรียกดูอัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันก่อนหน้าได้ ให้ใช้อัตราผลตอบแทน ณ
วันล่าสุดที่สามารถเรียกดูได้) ในกรณีที่ไม่มีราคาตลาดที่เผยแพร่โดย ThaiBMA ให้ใช้ราคาที่คำนวณตามวิธีการที่
ธปท. กำหนด ซึ่งเผยแพร่ใน website ของ ธปท.

ประเภทตราสารหนี้	อัตราส่วนลด (ร้อยละ) ตามอายุคงเหลือ			
	0 - 5 ปี	> 5 ปี - 10 ปี	> 10 ปี - 20 ปี	> 20 ปี
ตั๋วเงินคลัง ตั๋วสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ พันธบัตรรัฐบาล ^{2/} พันธบัตร ธปท. ^{2/}	1	1.5	2.5	3
พันธบัตรหรือหุ้นกู้ที่ออกโดยองค์การของรัฐหรือรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ทั้งนี้ ตามที่ ธปท. จะเห็นสมควร	1.5	3	4.5	5.5

^{2/} พันธบัตรรัฐบาลและพันธบัตร ธปท. แบบอัตราดอกเบี้ยลอยตัว ให้ใช้อัตราส่วนลดตาม 0 - 5 ปี

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 พฤศจิกายน 2552

(นางชาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรข. 8 /2552

เรื่อง หลักเกณฑ์การรับซื้อตราสารหนี้เพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อกำหนดเงื่อนไขการรับซื้อตราสารหนี้เพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวันให้มีความชัดเจน

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 44 และมาตรา 45 แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 และที่แก้ไขเพิ่มเติม และเพื่ออนุวัติตามข้อ 1 (4) แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

3. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ใช้บังคับกับสถาบันการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

4. เนื้อหา

4.1 ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จะรับซื้อตราสารหนี้ก่อนวันปิดพักทะเบียนของตราสารหนี้ไม่น้อยกว่า 2 วันทำการ

วันปิดพักทะเบียน หมายถึง ระยะเวลาที่กำหนดห้ามการโอน การจำหน่าย หรือการเปลี่ยนแปลงเงื่อนไขตามที่นายทะเบียนประกาศกำหนด หรือตามประกาศการจำหน่ายตราสารหนี้แต่ละรุ่น

4.2 ตราสารหนี้ที่ ธปท. จะรับซื้อในแต่ละคราวต้องมีราคารวมกันไม่ต่ำกว่า 1.0 ล้านบาท

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 พฤศจิกายน 2552



(นางชาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรข. 9 /2552

เรื่อง อัตราค่าตอบแทนในการซื้อขายตราสารหนี้และวิธีคำนวณ

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อกำหนดอัตราค่าตอบแทนและวิธีคำนวณค่าตอบแทนกรณีที่สถาบันการเงินใช้เงินสภาพคล่องระหว่างวันข้ามวันและกรณีที่สถาบันการเงินสันสิทธิ์ซื้อคืนตราสารหนี้จากการใช้เงินสภาพคล่องระหว่างวันข้ามวัน

2. อำนาจตามกฎหมาย

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

3. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ใช้บังคับกับสถาบันการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

4. เนื้อหา

4.1 ธนาคารแห่งประเทศไทยจะคิดค่าตอบแทนสำหรับการขายคืนตราสารหนี้ในวันทำการถัดจากวันที่รับซื้อ และค่าตอบแทนสำหรับการซื้อคืนตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินสันสิทธิ์ซื้อคืนในอัตราดอกเบี้ยนโยบายของวันที่ ปรท. รับซื้อ บวกร้อยละ 0.50 ต่อปี

4.2 การคำนวณค่าตอบแทนให้เป็นไปตามวิธีต่อไปนี้

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

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 พฤศจิกายน 2552

(นางชาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรข. 10 / 2552

เรื่อง หลักเกณฑ์การแจ้งให้ธนาคารแห่งประเทศไทยดำเนินการเกี่ยวกับเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
ในกรณีที่เกิดเหตุขัดข้อง

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีการแจ้งให้ ธปท. ดำเนินการเกี่ยวกับเงินสภาพคล่องระหว่างวันกรณีเกิดเหตุขัดข้องทำให้สถาบันการเงินไม่สามารถดำเนินการเกี่ยวกับเงินสภาพคล่องระหว่างวันด้วยตนเองได้

2. อ้างอิงตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 44 และมาตรา 45 แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 และที่แก้ไขเพิ่มเติม และเพื่ออนุวัติตามข้อ 6 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

3. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ใช้บังคับกับสถาบันการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

4. เนื้อหา

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้กำหนดหลักเกณฑ์และวิธีการแจ้งให้ ธปท. ดำเนินการเกี่ยวกับเงินสภาพคล่องระหว่างวัน ในกรณีที่เกิดเหตุขัดข้อง ดังนี้

4.1 สถาบันการเงินที่เกิดเหตุขัดข้อง และไม่สามารถดำเนินการดังต่อไปนี้ ได้ด้วยตนเอง

- (1) ขายตราสารหนี้เพิ่มเติมระหว่างวัน
- (2) ซื้อคืนตราสารหนี้เพียงบางส่วนหรือทั้งหมดก่อนสิ้นวัน
- (3) ขอใช้ยอดได้ดูแลการหักบัญชีเช็คเพียงบางส่วน

(4) ขอถอนตราสารหนี้ในบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
ของสถาบันการเงินเพื่อประโยชน์อื่นที่มีใช้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวัน และเพื่อการจำหน่ายออกได้
ดุลการหักบัญชีเช็ค

(5) โอนตราสารหนี้ในบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
ของสถาบันการเงิน

ให้สถาบันการเงินโทรศัพท์แจ้งทีมบริการบาทหมายเลข 0-2283-5045-7,
0-2283-5071-2, 0-2283-5139 และ 0-2283-5053

4.2 ให้สถาบันการเงินทำหนังสือแจ้งให้ ธปท. ดำเนินการเกี่ยวกับเงินสภาพคล่อง
ระหว่างวันแทนตามแบบที่แนบ เมื่อ ธปท. ได้รับเอกสารแล้วจึงจะดำเนินการให้ ทั้งนี้ ในกรณีเร่งด่วน
ให้สถาบันการเงินส่งโทรสารเอกสารดังกล่าวเพื่อให้ ธปท. เตรียมรายการไว้ก่อนได้

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 พฤศจิกายน 2552

(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรข.11 / 2552

เรื่อง ค่าธรรมเนียมและค่าปรับที่เกี่ยวข้องกับการใช้เงินสภาพคล่องระหว่างวัน

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อกำหนดค่าธรรมเนียมและค่าปรับที่เกี่ยวข้องกับการใช้เงินสภาพคล่องระหว่างวัน อันเนื่องมาจากการใช้บริการของศูนย์รับฝากที่เกี่ยวข้องกับบัญชีตราสารหนี้ที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) เปิดไว้ที่บริษัทศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด ในฐานะที่ ธปท. ถือตราสารหนี้ แทนสถาบันการเงินเพื่อประโยชน์ในการทำธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน โดยค่าธรรมเนียม และค่าปรับจะเป็นอัตราเดียวกับที่บริษัทศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด เรียกเก็บจาก ธปท.

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 44 และ มาตรา 45 แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 และที่แก้ไขเพิ่มเติม และเพื่ออนุวัติตามข้อ 5 (1) แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

3. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ใช้บังคับกับสถาบันการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

4. เนื้อหา

4.1 ธปท. จะคิดค่าธรรมเนียมที่เกี่ยวข้องกับการบันทึกรายการหรือยอดคงเหลือ ใน “บัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน” ตามอัตราเดียวกันกับที่ศูนย์รับฝากเรียกเก็บจาก ธปท. ดังนี้

(1) ค่าธรรมเนียมการฝาก การถอน การโอนและการรับโอนตราสารหนี้

บาทต่อรายการและต่อรุ่น

ประเภทรายการ	อัตราค่าธรรมเนียม
1. การฝากใบตราสารเพื่อเข้า “บัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน” ทั้งนี้ ให้รวมถึงกรณีการฝากตราสารหนี้จากการถอนจำหน่ายการใช้ยอดได้ดูแลการหักบัญชีเช็คด้วย	10
2. การถอนตราสารหนี้จาก “บัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน”	65
3. การถอนตราสารหนี้จาก “บัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน” เพื่อการจำหน่ายการใช้ยอดได้ดูแลการหักบัญชีเช็ค	30
4. การ โอนหรือรับ โอนตราสารหนี้เพื่อ “บัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน”	10

(2) ค่าธรรมเนียมการรักษาตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินนำฝากไว้ใน “บัญชีตราสารหนี้ของ ธปท. เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวัน” ที่ศูนย์รับฝาก โดยคิดทุกเดือนจากมูลค่าตราสารหนี้ในบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงินคงเหลือ ณ วันสิ้นเดือน ตามอัตราดังนี้

มูลค่าตราสารหนี้คงเหลือ	อัตรา (บาท) ต่อล้านบาท
ไม่เกิน 30,000 ล้านบาท	0.75
ส่วนที่เกิน 30,000 ล้านบาท แต่ไม่เกิน 50,000 ล้านบาท	0.50
ส่วนที่เกิน 50,000 ล้านบาทขึ้นไป	0.25

ทั้งนี้ มูลค่าตราสารหนี้คงเหลือ ณ วันสิ้นเดือน ให้คำนวณตามราคาตรา (Face Value)


4.2 ธปท. จะคิดค่าปรับกับสถาบันการเงินตามจำนวนเงินที่ศูนย์รับฝากคิดกับ ธปท. หากพิสูจน์ได้ว่าค่าปรับนั้นเกิดจากการที่สถาบันการเงินทำคำสั่งรายการ โอนตราสารหนี้จากบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของตนเอง ไปยังบัญชีตราสารหนี้ที่ศูนย์รับฝากแล้ว ศูนย์รับฝากปฏิเสธคำสั่งนั้นอันเนื่องมาจากความผิดพลาดในการทำคำสั่งของสถาบันการเงิน

4.3 ธปท. จะหักบัญชีเงินฝากของสถาบันการเงินที่ ธปท. เพื่อชำระค่าธรรมเนียมหรือค่าปรับในวันที่ 7 ของเดือนถัดไป

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 พฤศจิกายน 2552



(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรข. 12 / 2552

เรื่อง การกำหนดมูลค่าตราสารหนี้กรณีสถาบันการเงินล้มละลายซื้อคืนตราสารหนี้

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อกำหนดหลักเกณฑ์การกำหนดมูลค่าตราสารหนี้กรณีสถาบันการเงินล้มละลายซื้อคืนตราสารหนี้ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 44 และ มาตรา 45 แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 และที่แก้ไขเพิ่มเติม และเพื่ออนุวัติตามข้อ 3 (6) (6.2) แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

3. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ใช้บังคับกับสถาบันการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

4. เนื้อหา

ธนาคารแห่งประเทศไทยจะกำหนดมูลค่าตราสารหนี้กรณีสถาบันการเงินล้มละลายซื้อคืนตามหลักเกณฑ์ ดังนี้


ประเภทตราสารหนี้	อัตราที่ใช้คำนวณมูลค่าตราสารหนี้ตามราคาตลาด ^{1/}
1. พันธบัตรรัฐบาลและพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	ร้อยละ 98.5 ของราคาตลาด
2. พันธบัตรหรือหุ้นกู้ที่ออกโดยองค์การของรัฐ หรือรัฐวิสาหกิจ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น	ร้อยละ 97.0 ของราคาตลาด
3. ตัวเงินคลังและตัวสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้	ร้อยละ 99.5 ของราคาตลาด

1/ ราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) จำนวนตามสูตรการคำนวณราคาตราสารหนี้ที่ประกาศโดย ธปท. โดยใช้อัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันก่อนหน้าวันที่ครบกำหนดซื้อคืนตราสารหนี้สำหรับการส่งมอบในวันที่ ธปท. ดำเนินการยึดตราสารหนี้ที่สถาบันการเงินไม่ซื้อคืน (ในกรณีที่ไม่สามารถเรียกดูอัตราผลตอบแทน ณ สิ้นวันก่อนหน้าได้ ให้ใช้อัตราผลตอบแทน ณ วันล่าสุดที่สามารถเรียกดูได้) ในกรณีที่ไม่มีราคาตลาดที่เผยแพร่โดย ThaiBMA ให้ใช้ราคาที่คำนวณตามวิธีการที่ ธปท. กำหนด ซึ่งเผยแพร่ใน website ของ ธปท.

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 16 พฤศจิกายน 2552



(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

หนังสือแสดงความตกลง

ทำที่

วันที่.....

ข้าพเจ้า ได้ทราบและเข้าใจข้อความตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน โดยละเอียดตลอดแล้ว มีความประสงค์จะขอรับประโยชน์และผูกพันตนตามระเบียบดังกล่าว ตามรายละเอียดดังนี้

1. บัญชีเงินฝากกระแสรายวันหรือบัญชีชำระเงินที่ ธปท. เพื่อใช้สำหรับการใช้เงินสภาพคล่องระหว่างวัน

ชื่อบัญชีภาษาไทย.....

ชื่อบัญชีภาษาอังกฤษ.....

เลขที่บัญชี.....

2. ข้าพเจ้ายินยอมให้ ธปท. นำเงินเข้าบัญชีเงินฝากตาม 1. เพื่อรับชำระราคาตราสารหนี้ที่ขายหรือรับชำระส่วนต่างราคาในกรณีที่มูลค่าตราสารหนี้ที่สันสิทธิ์ซื้อคืนมากกว่ามูลค่าที่ ธปท. รับซื้อบวกด้วยค่าตอบแทน

3. ข้าพเจ้ายินยอมให้ ธปท. หักเงินจากบัญชีเงินฝากตาม 1. เพื่อชำระราคาตราสารหนี้ที่ซื้อคืนหรือชำระส่วนต่างราคาในกรณีที่มูลค่าตราสารหนี้ที่สันสิทธิ์ซื้อคืนน้อยกว่ามูลค่าที่ ธปท. รับซื้อบวกด้วยค่าตอบแทน หรือชำระค่าธรรมเนียม หรือค่าปรับ (ถ้ามี)

4. ข้าพเจ้ายินยอมให้ ธปท. ดำเนินการกับตราสารหนี้ที่ข้าพเจ้านำฝากเข้า “บัญชีตราสารหนี้ของ ธปท. เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวัน” ที่ศูนย์รับฝาก ตามที่กำหนดไว้ใน “หนังสือมอบอำนาจให้ ธปท. ดำเนินการกับตราสารหนี้เพื่อธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน” ที่แนบมาพร้อมนี้

5. ข้าพเจ้าตกลงผูกพันตนกับยินยอมปฏิบัติตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวันที่มีผลใช้บังคับอยู่ในขณะนี้และที่จะแก้ไขเพิ่มเติมหรือข้อกำหนดอื่นใดของ ธปท. เกี่ยวกับเงินสภาพคล่องระหว่างวันที่จะมีขึ้นในภายหน้าทุกประการ

ข้าพเจ้าจะไม่เปิดเผยความตกลงตามหนังสือนี้ เว้นแต่จะได้รับความเห็นชอบจาก
รพท. เป็นหนังสือ

ลงลายมือชื่อ.....

(.....)

ผู้มีอำนาจลงนาม

เพื่อ

หมายเหตุ ลงนามโดยผู้มีอำนาจตามหนังสือรับรองกระทรวงพาณิชย์ พร้อมแนบสำเนาหนังสือรับรอง
กระทรวงพาณิชย์และสำเนาบัตรประจำตัวประชาชนของผู้มีอำนาจลงนาม หรือสำเนาหนังสือเดินทาง
ของผู้มีอำนาจลงนามกรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

หนังสือมอบอำนาจ

ทำที่.....

วันที่

ตามหนังสือแสดงความตกลงของข้าพเจ้าลงวันที่
..... ซึ่งได้ตกลงผูกพันตนและยินยอมรับปฏิบัติตามระเบียบธนาคาร
แห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่อง
ระหว่างวัน นั้น

ข้าพเจ้าขอมอบอำนาจให้บุคคลตามรายชื่อในหนังสือนี้เป็นผู้ดำเนินการแทนข้าพเจ้า
ในการดำเนินการดังต่อไปนี้

1. ลงนามในหนังสือแจ้งให้ ธปท. ดำเนินการเกี่ยวกับเงินสภาพคล่องระหว่างวันแทน
ในกรณีที่ข้าพเจ้าไม่สามารถดำเนินการได้ด้วยตนเอง
2. ลงนามในหนังสือยืนยันธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน (ILF)
3. ขอร้องรับการผูกพันตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้
โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
4. ลงนามในเอกสารอื่นใดที่เกี่ยวข้องกับระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วย
การรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

<u>รายชื่อผู้รับมอบอำนาจ</u>	<u>ตัวอย่างลายมือชื่อ</u>	<u>เงื่อนไข</u>	<u>โทรศัพท์</u>
1.
2.

การใด ๆ ที่ผู้รับมอบอำนาจได้กระทำไปให้มีผลผูกพันข้าพเจ้าทุกประการ และ
ข้าพเจ้าจะไม่เพิกถอนการมอบอำนาจตามหนังสือนี้ เว้นแต่การเพิ่มเติมหรือเปลี่ยนแปลงบุคคลผู้รับ
มอบอำนาจ ซึ่งข้าพเจ้าจะแจ้งให้ ธปท. ทราบล่วงหน้าเป็นหนังสือ

ทั้งนี้ การมอบอำนาจดังกล่าวให้มีผลตั้งแต่วันที่ เป็นต้นไป

ลงลายมือชื่อ.....

(.....)

ผู้มีอำนาจลงนาม

เพื่อ

หมายเหตุ ลงนามโดยผู้มีอำนาจตามหนังสือรับรองกระทรวงพาณิชย์ และติดอากรแสตมป์ผู้รับมอบ
อำนาจท่านละ 30 บาท

หนังสือมอบอำนาจให้ ธปท. ดำเนินการกับตราสารหนี้เพื่อธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

ทำที่.....

วันที่.....

ข้าพเจ้า (.....ชื่อสถาบันภาษาอังกฤษ.....
.....) ขอมอบอำนาจให้ ธปท. ดำเนินการกับตราสารหนี้เพื่อธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
ที่ข้าพเจ้านำฝากในนาม ธปท. กับ บริษัทศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด หรือหน่วยงาน
อื่นใดซึ่งให้บริการดูแลหลักทรัพย์ (“ศูนย์รับฝาก”) ในขอบเขตการดำเนินการดังนี้

1. ดูแลรักษา โอนหรือรับโอนตราสารหนี้ ชื่อหรือขายเพื่อประโยชน์สำหรับการทำ
ธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

2. จำนำตราสารหนี้ที่ใช้เป็นหลักประกันการให้ยืมที่ได้ดูแลการหักบัญชีระหว่าง
ธนาคารตามประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่องการให้ยืมที่ได้ดูแลการหักบัญชีระหว่างธนาคาร
ในกรุงเทพมหานคร (ฉบับที่ 2) และที่แก้ไขเพิ่มเติม

การใดๆ ที่ ธปท. ได้กระทำไปภายใต้ขอบเขตของหนังสือมอบอำนาจฉบับนี้ให้มีผล
ผูกพันข้าพเจ้าทุกประการ และข้าพเจ้าจะไม่เพิกถอนหรือเปลี่ยนแปลงการมอบอำนาจตามหนังสือ
ฉบับนี้จนกว่าจะได้รับความเห็นชอบจาก ธปท. เป็นหนังสือ

ทั้งนี้ การมอบอำนาจดังกล่าวให้มีผลตั้งแต่วันที่เป็นต้นไป

ลงชื่อ.....

(.....)

ผู้มีอำนาจลงนาม

เพื่อ

หนังสือแจ้งให้ ธปท. ดำเนินการเกี่ยวกับเงินสภาพคล่องระหว่างวันแทน

ทำที่.....

วันที่.....

เรื่อง แจ้งความประสงค์ให้ ธปท. ดำเนินการเกี่ยวกับเงินสภาพคล่องระหว่างวันแทน

เรียน ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายระบบการชำระเงิน

ตามที่ข้าพเจ้า.....ได้ทำหนังสือแสดงความตกลงขอรับ
ประโยชน์และผูกพันตนตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมี
สัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน นั้น

ข้าพเจ้าขอแจ้งความประสงค์ให้ ธปท. ดำเนินการทำธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
แทนข้าพเจ้าดังนี้

ขายตราสารหนี้

ISIN.....ราคาตรา.....

ISIN.....ราคาตรา.....

ซื้อคืนตราสารหนี้

ISIN.....ราคาตรา.....

ISIN.....ราคาตรา.....

ขอใช้ยอดได้ดูแลการหักบัญชีระหว่างธนาคาร

จำนวนบาท

กัณฑ์ตราสารหนี้เพื่อไว้ใช้ประโยชน์อื่นที่มีไว้เพื่อการใช้เงินสภาพคล่องระหว่างวัน
หรือเพื่อใช้ค้ำประกันการใช้ยอดได้ดูแลการหักบัญชี

ISIN.....ราคาตรา.....

ISIN.....ราคาตรา.....

โอนตราสารหนี้เข้าบัญชีตราสารหนี้ที่ศูนย์รับฝาก

ISIN.....ราคาตรา.....

Receiving BIC.....เลขที่บัญชีตราสารหนี้ของ

สถาบันผู้รับ โอนที่ศูนย์รับฝาก.....

[] โอนตราสารหนี้เข้าบัญชีตราสารหนี้ของข้าพเจ้า
เพื่อการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนหรือขายคืน
ISIN.....ราคาตรา.....

จึงเรียนมาเพื่อ โปรดดำเนินการ

ขอแสดงความนับถือ

ลงลายมือชื่อ.....
(.....)
ผู้มีอำนาจลงนาม
เพื่อ.....

หนังสือขอฝากตราสารหนี้

วันที่

เรื่อง ขอฝากตราสารหนี้

เรียน ผู้ว่าการธนาคารแห่งประเทศไทย

ตามหนังสือแสดงความตกลงของข้าพเจ้า..... (ชื่อสถาบัน) ลงวันที่ ซึ่งข้าพเจ้าได้ตกลงผูกพันตนและยินยอมปฏิบัติตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน นั้น

ข้าพเจ้ามีความประสงค์ขอฝากตราสารหนี้เพื่อประโยชน์สำหรับการทำธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวันของข้าพเจ้า ดังรายละเอียดต่อไปนี้

<u>ประเภทตราสารหนี้</u>	<u>เลขที่ตราสารหนี้</u>	<u>ราคาที่ตราไว้ (บาท)</u>
.....
.....
.....
	รวม

(.....)

ขอแสดงความนับถือ

ลงลายมือชื่อ

(.....)

ผู้มีอำนาจลงนาม

เพื่อ.....

หนังสือขอรับคืนตราสารหนี้

วันที่

เรื่อง ขอรับคืนตราสารหนี้

เรียน ผู้ว่าการธนาคารแห่งประเทศไทย

ตามที่ข้าพเจ้า..... (ชื่อสถาบัน)..... ได้ฝาก
ตราสารหนี้เพื่อธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวันตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วย
การรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่อง นั้น

ข้าพเจ้ามีความประสงค์ขอรับคืนตราสารหนี้ ดังรายละเอียดต่อไปนี้

<u>ประเภทตราสารหนี้</u>	<u>ราคาที่ตราไว้ (บาท)</u>
.....
.....
.....
รวม
(.....)	

อนึ่ง ข้าพเจ้าขอมอบให้.....ผู้ถือบัตรประจำตัวประชาชน
เลขที่.....เขต.....จังหวัด.....หมคอายุ.....
เป็นผู้รับใบตราสารดังกล่าวข้างต้น

ขอแสดงความนับถือ

ลงลายมือชื่อ

(.....)

ผู้มีอำนาจลงนาม

เพื่อ.....

ได้รับใบตราสารเรียบร้อยแล้ว (...../...../.....)