



ธนาคารแห่งประเทศไทย

๖ ธันวาคม 2562

เรียน ผู้จัดการ

สถาบันผู้ใช้บริการบทเนต*

ที่ ๑๗ (๒) /๒๕๖๒ เรื่อง นำส่งประกาศ รบ. เรื่อง หลักเกณฑ์เพิ่มเติมเกี่ยวกับ การรับตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น และการนำตราสารหนี้ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยไม่ได้เป็นนายทะเบียนมาเป็นหลักประกัน ที่ธนาคารแห่งประเทศไทย

ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จะรับตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันและ ธปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียนมาเป็นหลักประกันธุกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน (ILF) และธุกรรมตามมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการซื้อขายดุลสุทธิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเนต (SRS) จึงได้ออกประกาศที่เกี่ยวข้องกับการใช้ตราสารหนี้ดังกล่าวและปรับปรุงระบบงานให้สอดคล้องกันด้วย โดยจะเริ่มใช้งานตั้งแต่วันที่ 16 ธันวาคม 2562 เป็นต้นไป ซึ่งได้แนบประกาศดังกล่าวและคู่มือการใช้งานระบบบาทใหม่รายละเอียด

ก่อนการใช้งานขอให้สถาบันผู้ใช้บริการบทเนตที่เป็นสมาชิกธุกรรรมเงินสภากคล่องระหว่างวัน (ILF) และธุกรรรมตามมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำรุดสูหิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบทเนต (SRS) บันทึกข้อมูลลงในแบบฟอร์ม SOE-1 ที่แนบท้ายประกาศฯ และเพิ่งมาถึงที่มีบทเนต ฝ่ายการชำระเงินและพั้นธบัตร อาคาร 2 ชั้น 4 รปท. บางขุนพรหม ภายในวันที่ 15 ธันวาคม 2562 หรือก่อนวันที่จะนำตราสารหนี้ดังกล่าวมาเป็นหลักประกัน ทั้งนี้ สมาชิกสามารถตรวจสอบมูลค่าเพดานการ擔任ตราสารหนี้ก่อนได้ ตามรายละเอียดในเอกสารการเรียกดุมลค่าเพดานการ擔任ตราสารหนี้แนบ

จังเรียนมาเพื่อทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

and organized

(นางวราภรณ์ ศุภวงศ์เสน)

ជំនាញការ

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายการชำระเงินและพันธบัตร แทน

ผู้ว่าการแทน

สิ่งที่ส่งมาด้วย 1. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สธช. 8/2562 เรื่อง หลักเกณฑ์เพิ่มเติมเกี่ยวกับการรับ
ตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น และการนำ
ตราสารหนี้ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยไม่ได้เป็นนายทะเบียนมาเป็นหลักประกัน
2. คู่มือการใช้งานระบบบทเนต กรณีนำตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงิน
ที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันและ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียน
มาเป็นหลักประกันเพื่อ ILF และ SRS
3. เอกสารการเรียกดูมูลค่าเพดานการดำเนินการดำรงตราสารหนี้

ฝ่ายการชำระเงินและพันธบัตร
โทรศัพท์ 0 2283 5045

* เนพาสถานการเงินตามระเบียบ รปท. ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อกลับเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน สถาบันผู้ส่งคำสั่ง สถาบันผู้โอน/รับโอนเงิน และสถาบันผู้ให้หลักประกันตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการซื้อขายผลิตภัณฑ์พรมกันレイฟายในระบบบทบาทเดียว

วิสัยทัศน์ เป็นองค์กรที่มองไกล มีหลักการ และร่วมมือ เพื่อความเป็นอยู่ที่ดีอย่างยั่งยืนของไทย



ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สธช. 8/2562

เรื่อง หลักเกณฑ์เพิ่มเติมเกี่ยวกับการรับตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงิน
ที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น และการนำตราสารหนี้ที่ธนาคารแห่งประเทศไทย
ไม่ได้เป็นนายทะเบียนมาเป็นหลักประกันที่ธนาคารแห่งประเทศไทย

1. เหตุผลในการออกประกาศ

ธนาคารแห่งประเทศไทย (รปท.) กำหนดหลักเกณฑ์เพิ่มเติมในการรับตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันเงินดันและดอกเบี้ย และการนำตราสารหนี้ที่ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียน มาใช้ในการทำธุรกรรม การรับซื้อตราสารหนี้เพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวันและเป็นหลักประกันตามมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำระบุลสุทธิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเนต เพื่อรองรับความต้องการที่จะนำตราสารหนี้ประเภทดังกล่าวมาเป็นหลักประกันในระบบบาทเนต

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 44 และมาตรา 45 แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติม และเพื่อนำวัติตามข้อ 71 ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการบริการบาทเนต พ.ศ. 2549 ข้อ 1 (4) ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน และข้อ 7 ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำระบุลสุทธิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเนต

3. ขอบเขตการบังคับใช้

สถาบันการเงินตามประกาศฉบับนี้

4. เนื้อหา

ในประกาศนี้

“หลักประกันที่ รปท.” หมายความว่า ตราสารหนี้ที่ได้รับเพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวัน หรือตราสารหนี้ที่ใช้เป็นหลักประกันเพื่อมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำระบุลสุทธิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเนต

“ตราสารหนี้ที่ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียน” หมายความว่า ตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นที่ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียน

“ตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน” หมายความว่า ตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ย

“สถาบันการเงิน” หมายความว่า

(1) สถาบันการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อกลับเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน

(2) สถาบันผู้ส่งคำสั่ง สถาบันผู้โอน/รับโอนเงิน และสถาบันผู้ให้หลักประกันตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำระบุคลิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเนต

ข้อ 1 สถาบันการเงินไม่สามารถนำตราสารหนี้ที่ตนเองเป็นผู้ออก (Issuer) มาใช้เป็นหลักประกันที่ รปท. เว้นแต่ รปท. กำหนดไว้เป็นอย่างอื่น

ข้อ 2 การรับตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน และที่ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียน มาเป็นหลักประกันที่ รปท. เพื่อการทำธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน หรือใช้เป็นหลักประกันตามมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำระบุคลิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเนต

2.1 สถาบันการเงินต้องแจ้งบัญชีตราสารหนี้ของตนเองที่ศูนย์รับฝากตามแบบฟอร์ม SOE-1 แบบท้ายประกาศนี้

2.2 หากในระบบงานของ รปท. ยังไม่ปรากฏข้อมูลของตราสารหนี้ที่จะนำมาเป็นหลักประกันและรายละเอียดของตราสารหนี้ให้ รปท. เพื่อให้ รปท. ดำเนินการตรวจสอบคุณสมบัติก่อนการทำธุรกรรมอย่างน้อย 2 วันทำการ ตามแบบฟอร์ม SOE-2 แบบท้ายประกาศนี้ และ รปท. จะแจ้งผลการตรวจสอบคุณสมบัติของตราสารหนี้ดังกล่าวให้สถาบันการเงินทราบ

2.3 สถาบันการเงินสามารถฝากหรือโอนตราสารหนี้ที่ผ่านการตรวจสอบคุณสมบัติตามข้อ 2.2 ที่ตนเองเป็นเจ้าของกรรมสิทธิ์ และปราศจากภาระผูกพันเข้าบัญชีตราสารหนี้ของ รปท. เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน หรือเป็นหลักประกันตามมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำระบุคลิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเนตได้

ข้อ 3 การนำตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันมาดำเนินการเป็นหลักประกันที่ รปท. ของสถาบันการเงินในบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน หรือบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระบุคลิพ

3.1 รปท. กำหนดเดือนการดำเนินการตามที่ตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันเป็นหลักประกันที่ รปท. ดังนี้

(1) สถาบันการเงินต้องมีมูลค่าตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้าประกันสูงสุดในบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงินไม่เกินร้อยละ 10 ของมูลค่าตราสารหนี้ตามเกณฑ์การดำเนินสภาพคล่องระหว่างวัน

(2) สถาบันการเงินต้องมีมูลค่าตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้าประกันสูงสุดในบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระดุลสุทธิของสถาบันการเงินไม่เกินร้อยละ 10 ของมูลค่าตราสารหนี้ตามฐานะขาดดุลสูงสุดที่อาจจะเกิดขึ้น

ทั้งนี้ รปท. จะแจ้งมูลค่าเพดานการดำเนินตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้าประกันในรายงานเกณฑ์การดำเนินตราสารหนี้ รปท. ประจำกำหนด

3.2 สถาบันการเงินมีหน้าที่ติดตามดูแลไม่ให้มูลค่าตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้าประกันในบัญชีย่อยตราสารหนี้ดังกล่าว สูงเกินกว่าที่กำหนดเพดานไว้ตามข้อ 3.1 และต้องดำเนินการโอนตราสารหนี้ส่วนที่เกินกำหนดเพดานดังกล่าว ออกจากบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน หรือบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระดุลสุทธิของตนเอง ก่อนเวลา 17.00 น. หากสถาบันการเงินไม่ดำเนินการดังกล่าวภายในเวลาที่กำหนด ให้ถือว่า สถาบันการเงินยินยอมให้ รปท. ดำเนินการโอนตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้าประกันส่วนที่เกินกว่าที่กำหนดเพดานไว้นอกจากบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน หรือบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระดุลสุทธินั้น และ รปท. จะคิดค่าธรรมเนียมในการดำเนินการเป็นรายรายการ

ข้อ 4 การดำเนินการกับตราสารหนี้ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียน ในบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน หรือบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระดุลสุทธิ

4.1 ก่อนวันปิดพักทะเบียนจ่ายเงินต้นและหรือดอกเบี้ยของตราสารหนี้ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียนหนึ่งวันทำการ สถาบันการเงินมีหน้าที่โอนตราสารหนี้ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียน ออกจากบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน หรือบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระดุลสุทธิของตนเอง ก่อนเวลา 17.00 น. หากสถาบันการเงินไม่ดำเนินการดังกล่าวภายในเวลาที่กำหนด ให้ถือว่าสถาบันการเงินยินยอมให้ รปท. ดำเนินการโอนตราสารหนี้ที่ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียนที่คงค้างอยู่ในบัญชีออกจากบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน หรือบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระดุลสุทธินั้น และ รปท. จะคิดค่าธรรมเนียมในการดำเนินการโอนตราสารหนี้ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียนออกจากบัญชีย่อยตราสารหนี้ดังกล่าว และหาก รปท. ต้องจัดการผลประโยชน์จากตราสารหนี้ดังกล่าวของสถาบันการเงินด้วย รปท. จะคิดค่าธรรมเนียมในการดำเนินการโอนผลประโยชน์จากตราสารหนี้เพิ่มเติมด้วย

4.2 สถาบันการเงินสามารถฝ่ากหรือโอนตราสารหนี้ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียนดังกล่าวเพื่อใช้เป็นหลักประกันได้อีก ภายหลังจากวันปิดพักสมุดทะเบียนจ่ายดอกเบี้ยของตราสารหนี้ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียนนั้น ๆ

ข้อ 5 รปท. สงวนสิทธิ์ดังนี้

5.1 งดรับฝากตราสารหนี้ที่ตนเองเป็นผู้ออก (Issuer) เป็นหลักประกันที่ รปท. กรณีเข้าข่ายตามข้อ 1 และตราสารหนี้ส่วนที่เกินกำหนดเพดานการชำระตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันเป็นหลักประกันที่ รปท. ตามข้อ 3.1

5.2 งดนำตราสารหนี้ที่ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียนมาจำหน่าเป็นหลักประกันในการใช้ยอดได้ดุลการหักบัญชีเช็ค

5.3 งดรับฝากตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน และหรือที่ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียนตามประกาศนี้ เป็นหลักประกันที่ รปท. สถาบันการเงินเป็นการซื้อขายหรือการ ในกรณีที่สถาบันการเงินไม่ปฏิบัติตามระเบียบหรือประกาศอื่นใดของ รปท. หรือดำเนินการใด ๆ ที่ไม่สอดคล้อง หรือส่งผลในทางลบต่อแนวทางในการดำเนินนโยบายการเงิน นโยบายอัตราแลกเปลี่ยนหรือการสร้างเสถียรภาพในระบบการเงิน

5.4 งดรับซื้อตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน และหรือที่ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียนตามประกาศนี้ ในวันทำการหนึ่งวันก่อนวันปิดพักทะเบียนจ่ายเงินต้นและหรือดอกเบี้ยของตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันดังกล่าว

5.5 รปท. สงวนสิทธิ์ที่จะปรับปรุง แก้ไข เพิ่มเติมหรือเปลี่ยนแปลงระเบียบประกาศ หรือเอกสารที่เกี่ยวข้องตามประกาศนี้ได้ โดย รปท. จะแจ้งให้สถาบันการเงินทราบล่วงหน้า

ข้อ 6 เรื่องอื่น ๆ

6.1 รปท. จะคิดค่าธรรมเนียมการฝาก ถอน โอน รับโอน และการรักษาตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันเป็นหลักประกันที่ รปท. ตามมูลค่าตราสารหนี้ในบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันเพื่อเงินสภาพคล่องระหว่างวันของสถาบันการเงิน และบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อเป็นหลักประกันในการชำระดุลสูทธิ รวมทั้งค่าใช้จ่ายอื่นใดนอกจากค่าธรรมเนียมการฝาก ถอน โอน รับโอน และการรักษาตราสารหนี้จากการดำเนินการเกี่ยวกับตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน ตามที่จ่ายจริงตามอัตราและวิธีการที่กำหนดในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยค่าธรรมเนียมและค่าปรับที่เกี่ยวข้องกับการใช้เงินสภาพคล่องระหว่างวัน

6.2 นอกจากค่าธรรมเนียมตามข้อ 6.1 แล้ว หากสถาบันการเงินไม่ปฏิบัติตามข้อ 3.2 และข้อ 4.1 ตามประกาศนี้ รปท. จะคิดค่าธรรมเนียมในการโอนตราสารหนี้อกรายการละ 200 บาท และหาก รปท. ต้องจัดการผลประโยชน์จากตราสารหนี้ดังกล่าว รปท. จะคิดค่าธรรมเนียมอีกรายการละ 500 บาท

6.3 การตีความตามระเบียบ ประกาศ หรือข้อกำหนดอื่นใดที่ออกตามประกาศ
นี้ให้ รปท. เป็นผู้นิจฉัยซึ่งขาด

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 16 ธันวาคม 2562 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 4 ธันวาคม 2562

วิริยะ พานิช

(นายวิริยะ พันติประภพ)

ผู้ว่าการ
ธนาคารแห่งประเทศไทย

ส่วนจัดการชำระเงิน ฝ่ายการชำระเงินและพันธบัตร
โทรศัพท์ 0 2283 5045

หนังสือแจ้งบัญชีตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน
และที่ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียน มาเป็นหลักประกันที่ รปท.

ทำที่.....
วันที่.....

เรื่อง แจ้งเลขที่บัญชีตราสารหนี้

เรียน ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายการชำระเงินและพัสดุบัตร

ข้าพเจ้า.....(ชื่อสถาบันการเงิน)..... มีความประสงค์ขอรับ
ประโยชน์และผูกพันตามประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์เพิ่มเติมเกี่ยวกับการรับ¹
ตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น และการนำตราสารหนี้
ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยไม่ได้เป็นนายทะเบียนมาเป็นหลักประกันที่ธนาคารแห่งประเทศไทย โดย
ยินยอมให้ธนาคารแห่งประเทศไทยโอนตราสารหนี้ตามประกาศข้างต้นไปยังบัญชีตราสารหนี้ที่บริษัท
ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด ของข้าพเจ้า ดังนี้

1. บัญชีตราสารหนี้ที่ศูนย์รับฝากฯ

รหัสสถาบัน (BIC Code)

เลขที่บัญชี

ข้าพเจ้าขอรับรองว่าเป็นเจ้าของบัญชีตราสารหนี้ข้างต้น และจะไม่เรียกร้องใด ๆ
ต่อความเสียหายทั้งปวงที่อาจมีขึ้น หากเลขที่บัญชีตราสารหนี้ข้างต้นไม่ถูกต้อง ทั้งนี้ ให้มีผล ตั้งแต่
วันที่ จนกว่าจะแจ้งการเปลี่ยนแปลงให้ รปท. ทราบ

ลงลายมือชื่อ..... (ผู้มีอำนาจลงนาม)

(.....)

เพื่อ..... (ชื่อสถาบันการเงิน)

หมายเหตุ ลงนามโดยผู้มีอำนาจลงนามตามหนังสือรับรองกระทรวงพาณิชย์

หนังสือแจ้งความประสงค์ขอนำฝากตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน
และที่ รปท. ไม่เป็นนายทะเบียน

ทำที่
วันที่

เรื่อง แจ้งความประสงค์ขอนำฝากตราสารหนี้

เรียน ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายการชำระบัญชีและการเงินและพัฒนาระบบทร

ข้าพเจ้า (ชื่อสถาบันการเงิน) ขอแจ้งความประสงค์นำฝาก
ตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน และที่ธนาคารแห่งประเทศไทยไม่เป็นนายทะเบียนมาเป็น
หลักประกันที่ธนาคารแห่งประเทศไทย ตามประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์เพิ่มเติม
เกี่ยวกับการรับตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีภาระหนี้สาธารณะจัดตั้งขึ้น และ
การนำตราสารหนี้ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยไม่ได้เป็นนายทะเบียนมาเป็นหลักประกันที่ธนาคาร
แห่งประเทศไทย

- ธุรกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน (ILF)
- หลักประกันตามมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการนำระดุลสุทธิพร้อมกัน^{หมายฝ่ายในระบบบาทเนต (SRS)}
- ธุรกรรม LF

โดยมีรายละเอียดตราสารหนี้ ดังนี้

ISIN	ThaiBMA Symbol	วันปิดสมุดทะเบียน จ่ายคืนเงินต้น	วันจ่ายคืนเงินต้น

ข้าพเจ้าขอรับรองว่าเป็นผู้ถือกรรมสิทธิ์ในตราสารหนี้ที่ใช้เป็นหลักประกัน มีคุณสมบัติ
ตามที่ รปท. ประกาศกำหนดและประกาศจากภาระผูกพัน

ลงลายมือชื่อ.....(ผู้อำนวยการลงนาม)

(.....)

เพื่อ.....(ชื่อสถาบันการเงิน)

หมายเหตุ : ลงนามโดยผู้มีอำนาจลงนามตามหนังสือรับรองกระทรวงพาณิชย์ หรือผู้รับมอบอำนาจ

คู่มือการใช้งานระบบบทเนต

กรณีนำตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันและ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียนมาเป็นหลักประกันเพื่อ ILF และ SRS

สารบัญ

ลำดับ	พิมพ์ชั้น	รายละเอียดการปรับปรุง	หน้า
1	Inquiry > SA Holding	- ระบุความสามารถของตราสารที่สามารถขายให้กับ ธปท. เพิ่มเติม	3
2	Inquiry > Securities Transfer	- เพิ่มการแสดงรายการกรณี ธปท. เป็นผู้ทำรายการ	3
3	Inquiry > Liquidity Monitoring	- แจ้งเตือนวันปิดพักสมุดทะเบียน (XI หรือ XP) - แสดงข้อมูลเพดานการถือครอง - แจ้งเตือนกรณีดำเนินเพดานถือครอง	4
4	CI > Collateral Details	- ระบุความสามารถของตราสารที่สามารถขายให้กับ ธปท. เพิ่มเติม - แสดงข้อมูลเพดานการถือครอง	4
5	CI > Collateral Summary	- แสดงข้อมูลที่เกินเพดานการถือครอง	5
6	Report>เกณฑ์สำหรับการโอนเงินผ่านระบบบทเนต	- แจ้งเพดานการถือครอง ILF	6
7	Report>รายงานเกณฑ์การดำเนินตราสารหนี้ SRS	- แจ้งเพดานการถือครอง SRS	7

1. Inquiry > SA Holding

เพิ่มการแสดงรายการ “ILF Flag” = “E” ระบุความสามารถตราสารหนี้สามารถใช้ทำธุรกรรม ELA ได้

ISIN #	BIC :	ISIN Name #	Frozen Flag #	Non-Transfer Date	Total Amt #	Avail Amt #	Held Amt #	Collateral Amt	ILF Flag #	CG Flag #	User Res Amt	Action
TH0652031450	GHB214A	GHB214A	0	29/03/2021	6,000,000.00	6,000,000.00	0.00	0.00	E	N	0.00	L.M.P.
TH1029032204	GSB222A	ทบก./อัตราดอกเบี้ย 1/60 (2.36%)	0	13/02/2022	499,700,000.00	499,700,000.00	0.00	0.00	Y	Y	0.00	L.M.P.

No. of ISIN : 2 item(s) Total Amount : 505,700,000.00 Total Available : 505,700,000.00

Remark :
ILF Flag -> Y : สามารถตัดเงินได้
N : ไม่สามารถตัดเงินได้
E : สามารถตัดเงินได้ผ่าน ELA ได้เท่านั้น

2. Inquiry > Securities Transfer

เพิ่มการแสดงรายการ

- 1) MT598/003 กรณี Team BE ทำการโอน On Behalf แทน Member
- 2) MT598/003 กรณี ระบบ Automate Transfer SOE Bond จาก BOT Sub book ไปยังบัญชีของ Member โดยระบุ Sender's Ref No = BOTYYYYMMDDXXXX* (* = Running number)

CSO Trans Id #	Sender's Ref No #	Channel #	BT #	ISIN #	BOT DrAcc #	BOT CrAcc #	TSD DrAcc #	Receiving BIC #	TSD CrAcc #	Face Amount #	Status #	Error	Time
01/01/2018/0005	BOT201810310031	W	SRP	TH064831803	9010007240	400000000019	GSBATHB0	4080000000117		10,000.00	C		17:30
01/01/2018/0006	BOT201810310030	W	SIL	TH064831803	9010033579	400000000019	GSBATHB0	4080000000117		10,000.00	C		17:30
01/01/2018/0007	BOT201810310029	W	SIL	TH064833809	9010033573	400000000019	GSBATHB0	4080000000117		10,000.00	C		17:30
01/01/2018/0008	BOT201810310028	W	SIL	TH064831803	9010033573	400000000019	GSBATHB0	4080000000117		10,000.00	C		17:30
01/01/2018/0009	BOT201810310027	W	SRP	TH064831803	901007342	400000000019	GSBATHB0	4080000000117		10,000.00	C		17:31
01/01/2018/0010	BOT201810310026	W	SNS	TH064831803	9011022001	400000000019	GSBATHB0	4080000000117		10,000.00	C		17:31

3. Inquiry > Liquidity Monitoring

- 1) เพิ่มการแจ้งเตือนตราสารหนี้ที่ รปท. ไม่เป็นนายทะเบียน ก่อนวันปิดสมุดทะเบียนໄก่ถอน และ ปิดสมุดทะเบียนจ่ายดอกเบี้ย 3 วันทำการ
- 2) เพิ่มการแจ้งเตือนตราสารหนี้ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันกรณีเกินเพดานการถือครอง
- 3) เพิ่มการแสดงข้อมูล SRS PDP
- 4) เพิ่มการแสดงข้อมูลเพดานการถือครอง ILF และ SRS

The screenshot shows the Liquidity Monitoring section of the BAHINET system. It displays account positions, transaction history, liquidity warnings (e.g., Non-BOT Registrar, SOE Non-Guarantee), and collateral measurements (e.g., ILF 10%, SRS 30%).

Account Position	Amount (Baht)	Transactions	Total Payment	Expected (Baht)	Actual (Baht)	Liquidity Warning	Description
Brought Forward	3,077,657,464.72	DR Amount - Incoming		0.00	0.00		
Account Balance	3,077,657,464.72	DR Amount - Outgoing		0.00	0.00		
Hold Amount	3,000,000.00						
Available Balance	3,068,657,464.72	Set Monitoring Parameter					
ILF Balance	0.00						
Net Balance	3,068,657,464.72	Queue Time (Minutes)		460	3,068,657,464.72	Available Balance (Minimum)	3,000

ILF	Amount (Baht)	Unsettled Transactions	Time	Description
ILF Used (Non ILF Balance)	0.01 (0.00%)	Incoming PT in Queue	8:30	Non-BOT Registrar : Please check maturity or XI date of collateral(s) for ISIN: TH065203U903
Daily Maximum ILF Used	0.00	Outgoing PT in Queue	8:30	SOE Non-Guarantee : Please check ILF concentration limit.
		Incoming NFT in CCS	8:30	SOE Non-Guarantee : Please check SRS concentration limit.
		Outgoing NFT in CCS	0.00	No Data
		Incoming MFT in CCS	0.00	
		Outgoing MFT in CCS	0.00	
		Incoming NFT in Queue	0.00	
		Outgoing NFT in Queue	0.00	
		Incoming MFT in Queue	0.00	
		Outgoing MFT in Queue	0.00	

Collateral	Amount (Baht)	Measurement	Requirement	Actual
ELA Available for Sale	18,965,473,241.87	ILF 10%	501,488,449.46	0.00
ILF Bridge	0.00	Throughput 30%	1,555,666,089.39	0.00
SRS Available for Sale	0.00			
PP Available	1,271,526,560.54			
ILF and SRS Overnight	0.00			

Measurement	Requirement	Actual
ILF 10%	501,488,449.46	0.00
Throughput 30%	1,555,666,089.39	0.00
ILF Concentration 70%	2,511,120,879.25	0.00
SRS PDP	10,0,000.00	9,388,523,364.19

SOE Concentration Limit	Bond Type	Limit	Actual
ILF		3,00	9,600,000.00
SRS		3,00	9,400,000.00

4. CI > Collateral Details

- 1) เพิ่มการแสดงรายการ “Avail. For Sell” = E ระบุความสามารถตราสารหนี้ที่สามารถใช้ทำธุรกรรม ELA ได้เท่านั้น
- 2) เพิ่มการแสดงข้อมูลการค้ำประกันโดย ก.การคลัง
- 3) เพิ่มการแสดงข้อมูลเพดานการถือครอง ILF และ SRS

The screenshot shows the Collateral Details section of the BAHINET system. It displays search criteria and a table of collateral records with columns for Account, ISIN, ThaiBMA, Registrar, Guarantee, Next X-Type, Next X Date, Number of Working Day(s) To Next X Date, Non-transfer Date, Number of Working Day(s) To Non transfer Date, Avail for Sell, Avail for CG, Total Collateral in FAmT, Total SA Holding in FAmT, Total Encumbered in FAmT, and Concentration Limit.

Account	ISIN	ThaiBMA	Registrar	Guarante	Next X-Type	Next X Date	Number of Working Day(s) To Next X Date	Non-transfer Date	Number of Working Day(s) To Non transfer Date	Avail for Sell	Avail for CG	Total Collateral in FAmT	Total SA Holding in FAmT	Total Encumbered in FAmT
ILF	TH065003U0908	SRT208A	BOT	Y	XI	30/01/2020	>30	30/07/2020	>30	Y	Y	200,000,000.00	200,000,000.00	0.00
ILF	TH4650A3U..._SRT206B	BOT	Y	XI	31/01/2020	>30	31/07/2020	>30	Y	Y	395,000,000.00	395,000,000.00	0.00	
ILF	TH0652031103_GHB211A	BOT	Y	XI	17/01/2020	>30	17/01/2021	>30	Y	Y	200,000,000.00	200,000,000.00	0.00	
ILF	TH06520311400_GHB214A	Non-BOT	N	XI	27/09/2019	29	29/03/2021	>30	E	N	9,600,000.00	9,600,000.00	0.00	
SRS	TH0652031400_GHB214A	Non-BOT	N	XI	27/09/2019	29	24/03/2021	>30	E	N	9,400,000.00	9,400,000.00	0.00	
SRS	TH465203U0908_GHB206A	BOT	Y	XI	24/11/2019	>30	25/05/2020	>30	Y	Y	300,000,000.00	300,000,000.00	0.00	

Concentration Limit ILF : 0
Concentration Limit SRS : 0

Total Collateral in FAmT (19/08/2019 17:36:29) : 15,819,496,009.00
Total SA Holding in FAmT (19/08/2019 17:36:29) : 15,619,496,009.00
Total Encumbered in FAmT (19/08/2019 17:36:29) : 0.00

5. CI > Collateral Summary

เพิ่มการแสดงข้อมูลตราสารหนี้ส่วนที่เกินเพดานการอีโคลง ILF และ SRS

The screenshot shows the BAHTNET system interface with the following details:

Collateral Summary

Total Collateral in BOT-CMF : 16,325,190,000.00		ILF : 9,489,890,000.00	SRS : 6,329,600,000.00	RP (EOD) : 505,700,000.00		
Total SA Holding in Face Amount						
Account	(1) Total FAmt	(2) Hold FAmt	(3) Collat FAmt	(4) Avail. FAmt (1)-(2)-(3)		
ILF	9,489,890,000.00	0.00	0.00	9,489,890,000.00		
SRS	6,329,600,000.00	0.00	0.00	6,329,600,000.00		
RP (EOD)	505,700,000.00	0.00	0.00	505,700,000.00		
Total	16,325,190,000.00	0.00	0.00	16,236,190,000.00		
Collateral Requirement Observation (M2M and Haircut)						
Account	(18) Actual Balance	(19) Requirement	(20) Excess/(Shortage) (18)-(19)	(21) Over Concentration Limit (FAmt)	(22) Contract with CP	(23) Contract End Date
ILF	0.00	501,508,696.46	-501,688,606.46	9,690,000	N/A	N/A
SRS	6,381,415,765.59	100,000.00	6,381,315,765.59	9,490,000	No	No
RP (EOD)	507,820,891.94	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

Bottom status bar: ห้องแม่ที่ 19 บรรจุภณฑ์ 2562, 17:51, 19/9/2562, ENG

6. Report > เกณฑ์สำหรับการโอนเงินผ่านระบบบาทเนต

เพิ่มการแสดงข้อมูลเพดานการถือครอง ILF

เริ่มแจ้งข้อมูลเพดานการถือครอง ILF ในรายงานตั้งแต่ช่วงการดำเนิน 1 มกราคม 2563 เป็นต้นไป

ผลลัพธ์สำหรับการโอนเงินผ่านระบบบาทเนตประจำวันที่ 28 ธันวาคม 2562 - 10 มกราคม 2563		
1) จำนวนเงินที่โอนให้กับบุคคลภายนอกและอื่นๆ	0.00	บาทบาท
(จำนวนเงินที่โอนให้กับบุคคลภายนอกและอื่นๆ ประจำวันที่ 31 ธันวาคม 2562 - 10 มกราคม 2563)		
2) จำนวนเงินที่โอนให้กับบุคคลภายในประเทศ		
จำนวนเงิน 12,00 ค. ไม่ถูกหัก (ส่วนตัว 1 x 30%)	0.00	บาทบาท
จำนวนเงิน 15,00 ค. ไม่ถูกหัก (ส่วนตัว 1 x 70%)	0.00	บาทบาท
3) จำนวนเงินที่โอนให้กับหน่วยงานท้องถิ่น (LF) (ส่วนตัว 1 x 10%)	0.00	บาทบาท
4) จำนวนเงินที่โอนให้กับเจ้าของ (LF) (ส่วนตัว 1 x 10%)	1,062.12	บาทบาท
(31 ธันวาคม 2562 - 10 มกราคม 2563)		
5) จำนวนเงินที่ถูกหักภาษี ณ ที่ต้น	12	
6) จำนวนเงินที่โอนให้กับเจ้าของ (LF) ที่ต้องหักภาษี ณ ที่ต้น	0	บาทบาท

หมายเหตุ: จำนวนเงินที่โอนให้กับเจ้าของ (LF) ที่ต้องหักภาษี ณ ที่ต้น ไม่ได้รวมอยู่ในจำนวนเงินที่โอนให้กับเจ้าของ (LF) ที่ต้องหักภาษี ณ ที่ต้น

7. Report > รายงานเกณฑ์การดำเนินการต่อครอง SRS

เพิ่มการแสดงข้อมูลเพดานการถือครอง SRS

เริ่มแจ้งข้อมูลเพดานการถือครอง SRS ในรายงานตั้งแต่ช่วงการดำเนิน 1 กุมภาพันธ์ 2563 เป็นต้นไป

วันที่ : 15 ก.พ. 2562 เวลา : 15:00
<p>เกณฑ์การถือครองส่วนที่คาดคะเนเมื่อสถานะแห่งปัจจุบันไทย รวมถึงมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการเข้ามาดูแลหุ้นร่วมกันหลายฝ่ายในระบบภาคเหนือ</p> <p>สถานะแห่งปัจจุบันของผู้ถือหุ้นตามเกณฑ์ PDP (Potential Debit Position) หรือ ปรับปรุงในการถือครองส่วนที่คาดคะเนที่เป็นส่วนหนึ่งของการประเมินสุทธิหุ้นร่วมกันหลักทรัพย์ในระบบภาคเหนือ¹ (Securities Requirement for Settlement: SRS) ที่สถาบันทางด้านลงทุน ดังนี้</p> <p>ระหว่างวันที่</p> <p>1) บุคลากรอ่องค่าง 0.10 ล้านบาท 2) เผดานการถือครองครัวสหกรณ์สหกรณ์ที่กระทรวงการคลังไม่ตั้งมีระดับ 0 นาท</p>
สำนักงานคณะกรรมการกำกับและส่งเสริมการประกอบธุรกิจ คณะกรรมการบริหารไทย โทร. 02-356-7380-1

ทีมบทเนต
ฝ่ายการชำระเงินและพันธบัตร
16 ธันวาคม 2562

เอกสารการเรียกดูมูลค่าเพดานการดำเนินการดำงตราสารหนี้ออกโดยรัฐวิสาหกิจ
หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันและ รปท. ไม่ได้เป็นนายทะเบียน

สถาบันผู้ใช้บริการบาทเนตที่เป็นสมาชิกธุกรรมเงินสภาพคล่องระหว่างวัน ILF และธุกรรมตามมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำระดุลสุทธิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเนต (SRS) สามารถตรวจสอบมูลค่าเพดานการดำเนินการด้วยวิธีดังนี้

1. มูลค่าเพดานการดำเนินการด้วย ILF

1.1 ก่อนวันที่ 1 มกราคม 2563 สามารถเรียกดูผ่าน BAHTNET WEB ฟังก์ชัน Inquiry > Liquidity Monitoring หรือ CI > Collateral Details

1.2 ตั้งแต่ 1 มกราคม 2563 เป็นต้นไป ดูได้จากรายงาน “เกณฑ์สำหรับการโอนเงินผ่านระบบบาทเนต” หรือเรียกดูผ่าน BAHTNET WEB ฟังก์ชัน Inquiry > Liquidity Monitoring หรือ CI > Collateral Details

2. มูลค่าเพดานการดำเนินการด้วย SRS

2.1 ก่อนวันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2563 สามารถเรียกดูผ่าน BAHTNET WEB ฟังก์ชัน Inquiry > Liquidity Monitoring หรือ CI > Collateral Details

2.2 ตั้งแต่ 1 กุมภาพันธ์ 2563 เป็นต้นไป ดูได้จากรายงาน “เกณฑ์การดำเนินการด้วยตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยมาตรการจัดการความเสี่ยงจากการชำระดุลสุทธิพร้อมกันหลายฝ่ายในระบบบาทเนต” หรือ เรียกดูผ่าน BAHTNET WEB ฟังก์ชัน Inquiry > Liquidity Monitoring หรือ CI > Collateral Details