



## ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 26/2562

เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และระบบสื่อสาร ในการซื้อขายตราสารหนี้  
โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับ  
ไพรมารี ดีลเลอร์ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงิน  
เกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้  
ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer)  
(บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

### 1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตามข้อ 5.3 5.4 และ 5.5 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง.  
82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน  
หรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer)  
(บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 14 กันยายน 2552  
และที่แก้ไขเพิ่มเติม

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จึงออกประกาศเพื่อกำหนดเงื่อนไข เวลา และระบบ  
สื่อสาร ในการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้  
ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ โดยให้รองรับการทำธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้  
โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี  
ดีลเลอร์ ประเภทอัตราผลตอบแทนอ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่คณะกรรมการนโยบายการเงิน  
กำหนด

### 2. ยกเลิก

ให้ยกเลิกประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 43/2556 เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา  
และระบบสื่อสาร ในการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้  
ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการ  
ด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขาย  
ตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้  
และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 12 มิถุนายน 2556

### 3. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ให้ใช้บังคับกับสถาบันการเงินที่ได้รับแต่งตั้งจาก ธปท. เป็นไพรมารี  
ดีลเลอร์ สำหรับการทำธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและ  
การทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

#### 4. เนื้อหา

รพท. กำหนดเงื่อนไข เวลา และระบบสื่อสารในการทำธุรกรรม ดังต่อไปนี้

1. การเสนอซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน หรือการเสนอซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ทุกระยะเวลา ต้องเป็นจำนวนเงินระยะเวลาละไม่ต่ำกว่า 100 ล้านบาท และไม่มีเศษของ 10 ล้านบาท

2. การเสนออัตราค่าตอบแทนให้เสนอเป็นส่วนต่างจากอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่คณะกรรมการนโยบายการเงินกำหนด ในรูปแบบ basis point (s) และมีทศนิยมไม่เกิน 1 ตำแหน่ง (1 basis point = ร้อยละ 0.01) ซึ่งเมื่อคำนวณค่าตอบแทนเป็นร้อยละต่อปี จะมีทศนิยมไม่เกิน 3 ตำแหน่ง ทั้งนี้ ส่วนต่างที่เป็นลบ (-) หมายถึง อัตราค่าตอบแทนต่ำกว่าอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่คณะกรรมการนโยบายการเงินกำหนด ส่วนต่างที่เป็นบวก (+) หมายถึง อัตราค่าตอบแทนสูงกว่าอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่คณะกรรมการนโยบายการเงินกำหนด และส่วนต่างที่เป็นศูนย์ หมายถึง อัตราค่าตอบแทนเท่ากับอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่คณะกรรมการนโยบายการเงินกำหนด

3. กรณีตราสารหนี้ หากวันปิดพักสมุดทะเบียนเพื่อการจ่ายดอกเบี้ยของตราสารหนี้ที่ใช้ในการทำธุรกรรมอยู่ในช่วงระยะเวลาของสัญญา ผู้ที่ได้รับโอนตราสารหนี้ดังกล่าวจะต้องชำระคืนดอกเบี้ยตราสารหนี้ให้แก่ผู้โอนในวันที่ได้รับดอกเบี้ย ดังนี้

3.1 หากไพรมารี ดีลเลอร์ เป็นผู้ได้รับโอนตราสารหนี้ จะต้องชำระคืนดอกเบี้ยตราสารหนี้ให้แก่ รพท. เต็มจำนวน โดยไม่มีการหักภาษี ณ ที่จ่าย

3.2 หาก รพท. เป็นผู้ได้รับโอนตราสารหนี้ จะชำระคืนดอกเบี้ยตราสารหนี้ให้แก่ผู้โอน โดยมีการหักภาษี ณ ที่จ่ายไว้ ยกเว้นในกรณีที่ผู้โอนได้รับยกเว้นไม่ต้องเสียภาษีเงินได้ตามประมวลรัษฎากร รพท. จะชำระคืนดอกเบี้ยตราสารหนี้ให้แก่ผู้โอนเต็มจำนวน โดยไม่มีการหักภาษี ณ ที่จ่าย

4. วันที่สัญญาครบกำหนดจะต้องเป็นวันก่อนหน้าวันเริ่มปิดพักสมุดทะเบียนเพื่อการไถถอนตราสารหนี้อย่างน้อย 1 วันทำการ

5. การทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน หรือการซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ตามข้อ 5.3 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ รพท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) และที่แก้ไขเพิ่มเติม ให้ดำเนินการตามวิธีการและกรอบเวลา ดังนี้

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	รอบเช้า เวลา	รอบบ่าย เวลา	รอบพิเศษ เวลา
ธปท. แจ้งความประสงค์ ไปยังไพรมารี ดีลเลอร์	บริการซื้อขายตราสาร หนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์	ภายใน 9.30 น.	ภายใน 14.30 น.	ภายใน 16.00 น.
ไพรมารี ดีลเลอร์ ทุกราย แจ้งเสนอซื้อหรือเสนอขาย มาให้ ธปท.	บริการซื้อขายตราสาร หนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์	ภายใน 9.45 น.	ภายใน 14.45 น.	ภายใน 16.15 น.
ธปท. แจ้งผลการพิจารณา การรับซื้อหรือขายให้ ไพรมารี ดีลเลอร์ ทราบ	บริการซื้อขายตราสาร หนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์	ภายใน 10.00 น.	ภายใน 15.00 น.	ภายใน 16.30 น.
ผู้ขายยืนยันการขาย ตราสารหนี้โดยมีสัญญา ว่าจะซื้อคืนหรือการขาย ตราสารหนี้ธนาคารแห่ง ประเทศไทยไปยังผู้ซื้อ	SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	ภายใน 11.30 น.	ภายใน 15.30 น.	ภายใน 17.00 น.
ผู้ซื้อแจ้งยืนยันธุรกรรม กลับไปยังผู้ขาย	SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	ภายใน 13.00 น.	ภายใน 15.45 น.	ภายใน 17.20 น.
การโอนตราสารหนี้ การ ออกตราสารหนี้ธนาคาร แห่งประเทศไทย และการ ชำระราคา	โอนตราสารหนี้ พร้อม การชำระราคา ตาม ระบบของศูนย์รับฝาก (MT541, MT543) หรือออกตราสารหนี้ ธนาคารแห่งประเทศไทย พร้อมการชำระ ราคาผ่านระบบ บาทเน็ต (MT202)	ภายใน 14.00 น.	ภายใน 16.15 น.	ภายใน 17.30 น.

6. กรณีอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่คณะกรรมการนโยบายการเงินกำหนดเปลี่ยนแปลง ให้ดำเนินการเพื่อยืนยันการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่คณะกรรมการนโยบายการเงิน กำหนด สำหรับธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน หรือการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ยังไม่ครบกำหนด ตามวิธีการและกรอบเวลา ดังนี้

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ธปท. จะยืนยันการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยนโยบายที่คณะกรรมการนโยบายการเงินกำหนด ของสัญญาซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยไปยังไพรมารี ดีลเลอร์	SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	- ภายใน 17.15 น. ของวันที่มีการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยนโยบายดังกล่าว สำหรับธุรกรรมที่ครบกำหนดในวันทำการถัดไป - ภายใน 11.30 น. ของวันทำการถัดไปจากวันที่มีการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยนโยบายดังกล่าว สำหรับธุรกรรมที่ครบกำหนดในวันอื่น ๆ
ไพรมารี ดีลเลอร์ แจ้งยืนยันกลับไปยัง ธปท.	SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	- ภายใน 17.30 น. ของวันที่มีการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยนโยบายดังกล่าว สำหรับธุรกรรมที่ครบกำหนดในวันทำการถัดไป - ภายใน 13.00 น. ของวันทำการถัดไปจากวันที่มีการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยนโยบายดังกล่าว สำหรับธุรกรรมที่ครบกำหนดในวันอื่น ๆ

7. การเรียก Margin กรณีตราสารหนี้ ตามข้อ 5.4 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) และที่แก้ไขเพิ่มเติม ให้ดำเนินการตามวิธีการและกรอบเวลา ดังนี้

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ฝ่ายเรียก Margin (ธปท. หรือ ไพรมารี ดีลเลอร์) แจ้งจำนวนเงินที่อีกฝ่ายต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) ให้คู่สัญญาทราบ	อีเมล หรือ SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	ภายใน 9.45 น.
ฝ่ายส่งมอบ Margin (ไพรมารี ดีลเลอร์ หรือ ธปท.) ทักท้วงหากไม่ถูกต้อง	แจ้งทางโทรศัพท์	ภายใน 10.00 น.
ผู้ที่ต้องทำการส่งมอบ Margin โอนเงินให้แก่คู่สัญญา	ระบบบาทเน็ต (MT202)	ภายใน 11.00 น.

8. การขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หรือเวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ตามข้อ 5.5 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงิน เกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) และที่แก้ไขเพิ่มเติม ให้ดำเนินการตามวิธีการและกรอบเวลา ดังนี้

กรณีตราสารหนี้

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ฝ่ายเรียกคืน Margin (ธปท. หรือ ไพรมารี ดีลเลอร์) แจ้งจำนวนเงิน Margin ที่ต้องรับคืนของทุกสัญญาที่ครบกำหนด รวมทั้งดอกเบี้ยของจำนวนเงินที่ได้ มีการส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) ตลอดอายุสัญญาให้คู่สัญญาทราบ	อีเมล หรือ SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	ภายใน 9.45 น.
ฝ่ายส่งมอบ Margin (ไพรมารี ดีลเลอร์ หรือ ธปท.) ทักท้วงหากไม่ถูกต้อง	แจ้งทางโทรศัพท์	ภายใน 10.00 น.
ผู้ที่ต้องทำการส่งมอบ Margin และดอกเบี้ย โอนเงินให้แก่คู่สัญญา	ระบบบาทเนต (MT202)	ภายใน 11.00 น.
การโอนตราสารหนี้และการชำระราคาสำหรับสัญญาที่ครบกำหนด	โอนตราสารหนี้พร้อมการชำระราคา ตามระบบของศูนย์รับฝาก (MT541, MT543)	ภายใน 14.00 น.

กรณีตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ไพรมารี ดีลเลอร์ เวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ให้ ธปท. และ ธปท. ส่งมอบเงินให้ไพรมารี ดีลเลอร์	ส่งคืนที่ ธปท. และ ธปท. ส่งมอบเงินผ่านระบบบาทเนต (MT202)	ภายใน 14.00 น.

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 22 เมษายน 2562 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 17 เมษายน 2562



(นายวิโรฒ สันติประภาพ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่มตลาดเงินและตลาดพันธบัตร  
ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน  
โทรศัพท์ 0 2628 6025-7