

## ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 86/2552

เรื่อง ดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) เบี้ยปรับ และวิธีปฏิบัติ  
ในกรณีไพรมารี ดีลเลอร์ ฝึกนักส่งมอบ Margin ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย  
ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน  
และการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer)  
(บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

### 1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตามข้อ 5.4 5.5 และ 5.6 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย  
ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะ  
ขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary  
Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่  
14 กันยายน 2552 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

ธปท. จึงออกประกาศเพื่อกำหนดวิธีการคำนวณดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม  
(Interest on Margin) เบี้ยปรับและวิธีปฏิบัติในกรณีที่ไพรมารี ดีลเลอร์ ฝึกนักส่งมอบ Margin  
ในการซื้อขายตราสารหนี้กับไพรมารี ดีลเลอร์

### 2. ขอบเขตการบังคับใช้

สถาบันการเงินที่ได้รับแต่งตั้งจาก ธปท. เป็นไพรมารี ดีลเลอร์ สำหรับการทำธุรกรรม  
การซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ธนาคาร  
แห่งประเทศไทย

### 3. เนื้อหา

ธปท. กำหนดวิธีการคำนวณดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin)  
เบี้ยปรับ และวิธีปฏิบัติในกรณีไพรมารี ดีลเลอร์ ฝึกนักส่งมอบ Margin ดังนี้

1. การคำนวณดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin)

ให้คำนวณเป็นรายวัน โดยใช้ยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin)

คูณกับอัตราดอกเบี้ยนโยบาย

2. เบี้ยปรับกรณีไพรมารี ดีลเลอร์ ฝึกนักชำระเงินหรือส่งมอบตราสารหนี้ ตามข้อ 5.6  
แห่งระเบียบฯ ให้มีวิธีคำนวณและกำหนดเวลาส่งมอบในแต่ละกรณี ดังนี้

กรณีล่าช้า	เบี้ยปรับ	เวลาส่งมอบ
1. ตามข้อ 5.6.2 วรรคหนึ่ง ในวันที่ซื้อหรือขายตราสารหนี้ หากไพรมารี ดีลเลอร์ ไม่ชำระราคาหรือไม่ส่งมอบ ตราสารหนี้ภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด	อัตราดอกเบี้ยนโยบาย x 1 วัน x จำนวนเงินค่าซื้อหรือขายตราสารหนี้ (Purchase Price) ที่ผิดนัด	ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ตของวันที่ซื้อหรือขาย
2. ตามข้อ 5.6.3 ในแต่ละวันทำการก่อนวันที่ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หากไพรมารี ดีลเลอร์ ไม่ส่งมอบ Margin ภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด	อัตราดอกเบี้ยนโยบาย x 1 วัน x จำนวนเงิน Margin ที่ผิดนัด	ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ตของวันที่ต้องส่งมอบ Margin
3. ตามข้อ 5.6.4 วรรคหนึ่ง ในวันที่ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หากไพรมารี ดีลเลอร์ ไม่ชำระราคาหรือส่งมอบตราสารหนี้ภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด	อัตราดอกเบี้ยนโยบาย x 1 วัน x จำนวนเงินค่าขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ที่ผิดนัด	ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ตของวันที่ขายคืนหรือซื้อคืน

กรณีไม่ชำระ	เบี้ยปรับ	เวลาส่งมอบ
1. ตามข้อ 5.6.2 วรรคสอง ในวันที่ซื้อหรือขายตราสารหนี้ หากไพรมารี ดีลเลอร์ ไม่ชำระราคาหรือ ส่งมอบตราสารหนี้ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ต	ร้อยละ 0.1 ของจำนวนเงินค่าซื้อหรือขายตราสารหนี้ (Purchase Price) ที่ผิดนัด	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป
2. ตามข้อ 5.6.3 ในแต่ละวันทำการก่อนวันที่ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หากไพรมารี ดีลเลอร์ไม่ส่งมอบ Margin ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ต	ร้อยละ 0.1 ของจำนวนเงินค่าขายคืนและซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ณ วันที่ผิดนัดของทุกสัญญาาระหว่าง ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์ รายนั้น	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป
3. ตามข้อ 5.6.4 วรรคสอง ในวันที่ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ หากไพรมารี ดีลเลอร์ ไม่ชำระราคาหรือส่งมอบตราสารหนี้ภายในเวลาทำการของระบบบาทเน็ต	ร้อยละ 0.1 ของจำนวนเงินค่าขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ที่ผิดนัด	ภายใน 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

3. วิธีปฏิบัติในกรณีคิดส่งมอบ Margin กรณีตราสารหนี้ ตามข้อ 5.6.3 แห่งระเบียบฯ

3.1 ในกรณีที่ไพรมารี คิลเลอร์ ไม่ส่งมอบ Margin แก่ ธปท. ภายในเวลา 11.00 น. ไพรมารี คิลเลอร์ จะต้องจ่ายเบี้ยปรับกรณีล่าช้าตามข้อ 2 พร้อมส่งมอบ Margin ภายในเวลาทำการของระบบบาทเนตของวันที่ผิคนัดนั้น

3.2 หากไม่ส่งมอบ Margin ตามข้อ 3.1 ไพรมารี คิลเลอร์ มีภาระต้องส่งมอบเงินดังต่อไปนี้ ภายในเวลา 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

- (1) Margin คงค้างล่าสุด
- (2) เบี้ยปรับกรณีล่าช้าตามข้อ 2
- (3) เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระตามข้อ 2

ทั้งนี้ ธปท. มีสิทธิเลิกสัญญาซื้อหรือขายตราสารหนี้กับไพรมารี คิลเลอร์ รายนั้น ทุกสัญญาหรือบางสัญญา หรือมีสิทธิแก้ไขเปลี่ยนแปลงสัญญาที่มีอยู่กับไพรมารี คิลเลอร์ รายนั้น ได้ และมีสิทธิให้นำมูลหนี้ของคู่สัญญาทั้งสองฝ่ายมาหักกลบลบกัน

3.3 หากไม่ส่งมอบเงินตามรายการและเวลาในข้อ 3.2 ไพรมารี คิลเลอร์ มีภาระต้องส่งมอบเงินดังต่อไปนี้ภายในเวลาทำการของระบบบาทเนตของวันเดียวกัน

- (1) Margin คงค้างล่าสุด
- (2) เบี้ยปรับกรณีล่าช้าที่ค้างตามข้อ 3.2
- (3) เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระที่ค้างตามข้อ 3.2
- (4) เบี้ยปรับกรณีล่าช้าตามข้อ 2 ที่คำนวณจากยอด Margin คงค้างล่าสุด

3.4 หากไม่ส่งมอบเงินตามรายการและเวลาในข้อ 3.3 ธปท. มีสิทธิยกเลิกสัญญาบางสัญญาหรือทุกสัญญา ดังนี้

3.4.1 กรณียกเลิกบางสัญญา

(1) ไพรมารี คิลเลอร์ มีภาระต้องจ่าย

- ก. Margin คงค้างล่าสุด ของสัญญาที่ยังไม่มีการยกเลิก (ถ้ามี)
- ข. เบี้ยปรับกรณีล่าช้าที่ค้างตามข้อ 3.2
- ค. เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระที่ค้างตามข้อ 3.2
- ง. เบี้ยปรับกรณีล่าช้าตามข้อ 3.3 (4)
- จ. เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระตามข้อ 2 ที่คำนวณจากยอดรวมของค่า

ขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ณ วันที่ผิคนัดล่าสุด

(2) ให้นำภาระที่ไพรมารี คิลเลอร์ ต้องจ่ายตาม (1) มาเปรียบเทียบกับ

ส่วนต่างระหว่าง

ก. มูลค่าตลาดของตราสารหนี้ + ยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) (ถ้ามี) + ดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) (ถ้ามี) และ

ข. จำนวนเงินค่าขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ณ วันยกเลิกสัญญา + ยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) (ถ้ามี) + ดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) (ถ้ามี)

(3) ธปท. จะแจ้งภาระส่วนต่างระหว่าง (1) และ (2) และให้ผู้มีภาระทำการส่งมอบเงินตามจำนวนดังกล่าวแก่อีกฝ่ายหนึ่งผ่านระบบบาทเนตภายในเวลา 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

### 3.4.2 กรณียกเลิกทุกสัญญา

(1) ไพรมารี คิลเลอร์ มีภาระต้องจ่าย

ก. เบี้ยปรับกรณีล่าช้าที่ค้างตามข้อ 3.2

ข. เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระที่ค้างตามข้อ 3.2

ค. เบี้ยปรับกรณีล่าช้าตามข้อ 3.3 (4)

ง. เบี้ยปรับกรณีไม่ชำระตามข้อ 2 ที่คำนวณจากยอดรวมของค่าขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ณ วันที่ผิคนัดล่าสุด

(2) ให้นำภาระที่ไพรมารี คิลเลอร์ ต้องจ่ายตาม (1) มาเปรียบเทียบกับส่วนต่างระหว่าง

ก. มูลค่าตลาดของตราสารหนี้ + ยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) (ถ้ามี) + ดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) (ถ้ามี) และ

ข. จำนวนเงินค่าขายคืนหรือซื้อคืนตราสารหนี้ (Repurchase Price) ณ วันยกเลิกสัญญา + ยอด Margin สุทธิที่มีการส่งมอบแล้ว (Net Margin) (ถ้ามี) + ดอกเบี้ยของเงินที่ส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) (ถ้ามี)

(3) ธปท. จะแจ้งภาระส่วนต่างระหว่าง (1) และ (2) และให้ผู้มีภาระทำการส่งมอบเงินตามจำนวนดังกล่าวแก่อีกฝ่ายหนึ่งผ่านระบบบาทเนตภายในเวลา 11.00 น. ของวันทำการถัดไป

## 4. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2552 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 14 ก.ย. 2552

ดร. วิเศษ

(นางธาริษา วัฒนเกส)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย