



ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 4 /2566

เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และระบบสื่อสาร ในการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย กับไพรมารี ดีลเลอร์) (แก้ไขเพิ่มเติมครั้งที่ 1)

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อปรับปรุงมาตรฐานข้อความในการสื่อสารระหว่างธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) กับไพรมารี ดีลเลอร์ สำหรับการทำธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยให้สอดคล้องกับมาตรฐานสากลในการรับหรือส่งข้อความธุรกรรมทางการเงิน

2. แก้ไข

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 26/2562 เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และระบบสื่อสาร ในการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 17 เมษายน 2562

3. ขอบเขตการบังคับใช้

สถาบันการเงินที่ได้รับแต่งตั้งจาก ธปท. เป็นไพรมารี ดีลเลอร์ สำหรับการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

4. เนื้อหา

4.1 ให้ยกเลิกความใน 5. ของข้อ 4 ของประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 26/2562 เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และระบบสื่อสาร ในการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์

สกงป90กส6400125660309

วิสัยทัศน์ เป็นองค์กรที่มองไกล มีหลักการ และร่วมมือ เพื่อความเป็นอยู่ที่ดีอย่างยั่งยืนของไทย

(Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 17 เมษายน 2562 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

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

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	รอบเช้า เวลา	รอบบ่าย เวลา	รอบพิเศษ เวลา
ธปท. แจ้งความประสงค์ไปยังไพรมารี ดีลเลอร์	บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์	ภายใน 9.30 น.	ภายใน 14.30 น.	ภายใน 16.00 น.
ไพรมารี ดีลเลอร์ ทูกรายแจ้งเสนอซื้อหรือเสนอขายมาให้ ธปท.	บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์	ภายใน 9.45 น.	ภายใน 14.45 น.	ภายใน 16.15 น.
ธปท. แจ้งผลการพิจารณาการรับซื้อหรือขายให้ไพรมารี ดีลเลอร์ ทราบ	บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์	ภายใน 10.00 น.	ภายใน 15.00 น.	ภายใน 16.30 น.
ผู้ขายยืนยันการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนหรือการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยไปยังผู้ซื้อ	SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	ภายใน 11.30 น.	ภายใน 15.30 น.	ภายใน 17.00 น.
ผู้ซื้อแจ้งยืนยันธุรกรรมกลับไปยังผู้ขาย	SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	ภายใน 13.00 น.	ภายใน 15.45 น.	ภายใน 17.20 น.
การโอนตราสารหนี้ การออกตราสารหนี้ ธนาคารแห่งประเทศไทย และการชำระราคา	โอนตราสารหนี้ พร้อม การชำระราคา ตามระบบของศูนย์รับฝาก หรือ ออกตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย พร้อม การชำระราคาผ่านระบบบาทเนต	ภายใน 14.00 น.	ภายใน 16.15 น.	ภายใน 17.30 น.

4.2 ให้ยกเลิกความใน 7. และ 8. ของข้อ 4 ของประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 26/2562 เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และระบบสื่อสาร ในการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย กับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 17 เมษายน 2562 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

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

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ฝ่ายเรียก Margin (ธปท. หรือ ไพรมารี ดีลเลอร์) แจ้งจำนวนเงิน ที่อีกฝ่ายต้องส่งมอบเพิ่มเติม (Margin) ให้คู่สัญญาทราบ	อีเมล หรือ SWIFT ตามรูปแบบ ที่ ธปท. กำหนด	ภายใน 9.45 น.
ฝ่ายส่งมอบ Margin (ไพรมารี ดีลเลอร์ หรือ ธปท.) ทักท้วง หากไม่ถูกต้อง	แจ้งทางโทรศัพท์	ภายใน 10.00 น.
ผู้ที่ต้องทำการส่งมอบ Margin โอนเงินให้แก่คู่สัญญา	ระบบบาทเน็ต	ภายใน 11.00 น.

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

กรณีตราสารหนี้

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ฝ่ายเรียกคืน Margin (ธปท. หรือ ไพรมารี ดีลเลอร์) แจ้งจำนวนเงิน Margin ที่ต้องรับคืนของทุกสัญญาที่ครบกำหนด รวมทั้งดอกเบี้ยของจำนวน	อีเมล หรือ SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	ภายใน 9.45 น.

เงินที่ได้ มีการส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) ตลอดอายุ สัญญาให้คู่สัญญาทราบ		
ฝ่ายส่งมอบ Margin (ไพรมารี ดีลเลอร์ หรือ ธปท.) ทักท้วงหาก ไม่ถูกต้อง	แจ้งทางโทรศัพท์	ภายใน 10.00 น.
ผู้ที่ต้องทำการส่งมอบ Margin และ ดอกเบี้ย โอนเงินให้แก่คู่สัญญา	ระบบบาทเน็ต	ภายใน 11.00 น.
การโอนตราสารหนี้และการชำระ ราคาสำหรับสัญญาที่ครบกำหนด	โอนตราสารหนี้พร้อมการชำระ ราคา ตามระบบของศูนย์รับฝาก	ภายใน 14.00 น.

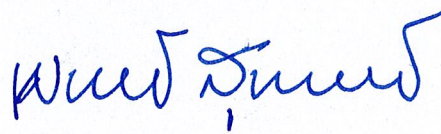
กรณีตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

ธุรกรรม	ระบบสื่อสาร	เวลา
ไพรมารี ดีลเลอร์ เวนคืนตราสารหนี้ ธนาคารแห่งประเทศไทย ให้ ธปท. และ ธปท. ส่งมอบเงินให้ไพรมารี ดีลเลอร์	ส่งคืนที่ ธปท. และ ธปท. ส่งมอบเงินผ่านระบบบาทเน็ต	ภายใน 14.00 น.

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 20 มีนาคม 2566 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 9 มีนาคม 2566



(นายเศรษฐพุฒิ สุทธิวาทนฤพุฒิ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

งานตลาดเงินและตลาดพันธบัตร
ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน
โทรศัพท์ 0 2628 6025-7