



ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 5 /2566

เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา ระบบสื่อสาร การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้ และการส่งมอบคืนเงินที่ได้ส่งมอบเพิ่มเติมไว้ (Margin) สำหรับกรณีที่มีการสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนดตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์) (แก้ไขเพิ่มเติมครั้งที่ 1)

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อปรับปรุงมาตรฐานข้อความในการสื่อสารระหว่างธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) กับไพรมารี ดีลเลอร์ สำหรับการทำธุรกรรมการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืน และการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยให้สอดคล้องกับมาตรฐานสากลในการรับหรือส่งข้อความธุรกรรมทางการเงิน

2. แก้ไข

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 27/2562 เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา ระบบสื่อสาร การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้ และการส่งมอบคืนเงินที่ได้ส่งมอบเพิ่มเติมไว้ (Margin) สำหรับกรณีที่มีการสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนดตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 17 เมษายน 2562

3. ขอบเขตการบังคับใช้

สถาบันการเงินที่ได้รับแต่งตั้งจาก ธปท. เป็นไพรมารี ดีลเลอร์ สำหรับการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

4. เนื้อหา

ให้ยกเลิกความใน 4.1.4 และ 4.1.5 ของประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 27/2562 เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา ระบบสื่อสาร การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้ และการส่งมอบคืนเงินที่ได้ส่งมอบเพิ่มเติมไว้ (Margin) สำหรับกรณีที่มีการสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนดตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์) ลงวันที่ 17 เมษายน 2562 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

สกงป90กส6400225660309

4.1.4 การขอสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนด ให้ดำเนินการตามวิธีการและกรอบเวลาในวันที่สัญญาสิ้นสุด ดังนี้

การดำเนินการ	ระบบสื่อสาร	เวลา
1. ไพรมารี ดีลเลอร์ แจ้งความประสงค์ขอสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนด พร้อมทั้งเหตุผลความจำเป็น มายัง ธปท.	แจ้งทางโทรศัพท์และอีเมล	ระหว่างเวลา 9.00 – 15.30 น.
2. ไพรมารี ดีลเลอร์ ส่งคำเสนอโดยระบุสัญญาที่ต้องการสิ้นสุดก่อนครบกำหนดมาให้ ธปท.	บริการซื้อขายตราสารหนี้และ ขายตราสารหนี้ธนาคารแห่ง ประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์	ระหว่างเวลา 9.00 – 15.30 น.
3. ธปท. แจ้งผลการพิจารณาค่าขอสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนด ให้ไพรมารี ดีลเลอร์ ทราบ พร้อมทั้งค่าธรรมเนียม	บริการซื้อขายตราสารหนี้และ ขายตราสารหนี้ธนาคารแห่ง ประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์	โดยเร็ว ภายใน 16.00 น.
4. ธปท. แจ้งยืนยันการสิ้นสุดสัญญาที่ ไพรมารี ดีลเลอร์ ซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน หรือซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยก่อนครบกำหนด และค่าธรรมเนียมไปยัง ไพรมารี ดีลเลอร์	SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	โดยเร็ว ภายใน 16.30 น.
5. ไพรมารี ดีลเลอร์ แจ้งยืนยันการสิ้นสุดสัญญาที่ไพรมารี ดีลเลอร์ ซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน หรือซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยก่อนครบกำหนด และค่าธรรมเนียม มายัง ธปท.	SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	โดยเร็ว ภายใน 16.45 น.
6. <u>กรณีตราสารหนี้</u> ไพรมารี ดีลเลอร์ โอนตราสารหนี้คืนให้ ธปท. และ ธปท. ส่งมอบจำนวนเงินสุทธิที่คำนวณได้จากราคาขายคืนหักด้วยค่าธรรมเนียม ให้ไพรมารี ดีลเลอร์ <u>กรณีตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย</u> ไพรมารี ดีลเลอร์ เวนคืนตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย ให้ ธปท. และ ธปท. ส่งมอบจำนวนเงินสุทธิที่คำนวณได้จากราคาขายคืนหักด้วยค่าธรรมเนียม ให้ไพรมารี ดีลเลอร์	<u>กรณีตราสารหนี้</u> โอนตราสารหนี้พร้อมการชำระราคา ตามระบบของศูนย์รับฝาก <u>กรณีตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย</u> เวนคืนให้ ธปท. และ ธปท. ส่งมอบเงินผ่านระบบบาทเน็ต	โดยเร็ว ภายใน 17.00 น.

ทั้งนี้ ธปท. อาจเปลี่ยนแปลงกำหนดเวลาข้างต้น หากเห็นว่ามีความเหมาะสม

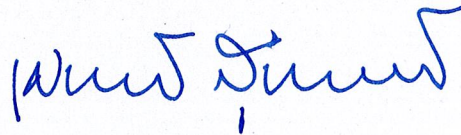
4.1.5 การส่งมอบ Margin ของสัญญาที่มีการสิ้นสุดก่อนครบกำหนด ให้ดำเนินการตามวิธีการและกรอบเวลาในวันที่สัญญาสิ้นสุด ดังนี้

การดำเนินการ	ระบบสื่อสาร	เวลา
1. ฝ่ายเรียกคืน Margin (ธปท. หรือไพรมารี ดีลเลอร์) แจ้งจำนวนเงิน Margin ที่ต้องรับคืนของทุกสัญญาที่ ธปท. ตกลงให้สิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนด รวมทั้งดอกเบี้ยของจำนวนเงินที่ได้มีการส่งมอบเพิ่มเติม (Interest on Margin) ตลอดระยะเวลาจนถึงวันสิ้นสุดสัญญา ให้คู่สัญญาทราบ	อีเมล หรือ SWIFT ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด	ภายใน 17.00 น.
2. ฝ่ายส่งมอบ Margin (ไพรมารี ดีลเลอร์ หรือ ธปท.) ทักท้วงหากไม่ถูกต้อง	แจ้งทางโทรศัพท์	ภายใน 17.15 น.
3. ผู้ที่ต้องทำการส่งมอบ Margin และดอกเบี้ยโอนเงินให้แก่คู่สัญญา	ส่งมอบเงินผ่านระบบบาทเน็ต	ภายใน 17.30 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