



เรียน ผู้จัดการ

สถาบันการเงินคู่ค้าสำหรับการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและซื้อตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ ผตง.(21) ว.9/2562 เรื่อง การแก้ไขเพิ่มเติมระเบียบ ธปท. ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) และที่แก้ไขเพิ่มเติม

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้ปรับปรุงวิธีการสื่อสารในการดำเนินธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) ให้เป็นไปตามรูปแบบมาตรฐาน สอดคล้องกับพิธีปฏิบัติของตลาดสากล และเพิ่มประสิทธิภาพในการดำเนินการ โดยมีการปรับปรุงระเบียบและประกาศที่เกี่ยวข้องซึ่งมีสาระสำคัญ ดังนี้

#### สาระสำคัญที่เปลี่ยนแปลง

1. เปลี่ยนรูปแบบการแจ้งยืนยันธุรกรรม จากการรับส่งข้อความผ่านระบบบาทเน็ต (MT298) เป็นการแจ้งผ่านระบบ SWIFT (MT518) และอีเมล ตามรูปแบบที่ ธปท. กำหนด
2. กรณี Primary Dealer ขอสิ้นสุดสัญญาซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน หรือสัญญาซื้อขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยก่อนครบกำหนด ธปท. จะส่งมอบเงินสุทธิ ซึ่งคำนวณได้จากราคาขายคืนหักด้วยค่าธรรมเนียม ให้ Primary Dealer (เดิม Primary Dealer จะต้องส่งมอบค่าธรรมเนียมให้ ธปท. ก่อน ธปท. จึงจะส่งมอบเงินให้ Primary Dealer)

#### ระเบียบและประกาศที่เกี่ยวข้อง

เพื่อให้สอดคล้องกับการดำเนินการดังกล่าว ธปท. จึงแก้ไข ยกเลิก และออกใช้ระเบียบและประกาศที่เกี่ยวข้อง ดังนี้

#### ระเบียบ/ประกาศที่ออกใหม่

- ระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 1/2562 เพื่อแก้ไขเพิ่มเติมระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 82/2552 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

การปรับปรุง : ปรับข้อความตามข้อ 5.2 วรรค 2 เพื่อให้สอดคล้องกับการเปลี่ยนแปลงการสื่อสาร จากผ่านระบบบาทเน็ตเป็นระบบ SWIFT

- ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 26/2562 เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และระบบสื่อสาร ในการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

การปรับปรุง : ปรับวิธีการสื่อสารในการยืนยันธุรกรรมและการเรียก Margin ตามเนื้อหาในข้อ 4. ซ้อย่อยที่ 5-8

- ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 27/2562 เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา ระบบสื่อสาร การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้ และการส่งมอบคืนเงินที่ได้ส่งมอบเพิ่มเติมไว้ (Margin) สำหรับกรณีที่มีการสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนด ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

การปรับปรุง : ปรับวิธีการสื่อสารในการยืนยันธุรกรรมและการเรียก Margin รวมถึงวิธีการส่งมอบจำนวนเงินสุทธิที่คำนวณได้จากราคาขายคืนหักด้วยค่าธรรมเนียม สำหรับการสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนด ตามเนื้อหาในข้อ 4. ซ้อย่อยที่ 4.1.4 - 4.1.5

#### ประกาศที่ยกเลิก

- ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 43/2556 เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา และระบบสื่อสาร ในการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

- ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 68/2559 เรื่อง เงื่อนไข กำหนดเวลา ระบบสื่อสาร การประเมินมูลค่าของตราสารหนี้ และการส่งมอบคืนเงินที่ได้ส่งมอบเพิ่มเติมไว้ (Margin) สำหรับกรณีที่มีการสิ้นสุดสัญญาก่อนครบกำหนด ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์)

ทั้งนี้ ให้ถือปฏิบัติตามระเบียบและประกาศใหม่ทั้งหมด ตั้งแต่วันที่ 22 เมษายน 2562 เป็นต้นไป

ขอแสดงความนับถือ



(นางสาวชญาตี ชัยอนันต์)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายตลาดการเงิน

ผู้ว่าการแทน

สิ่งที่ส่งมาด้วย 1. ระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 1/2562 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขาย  
ตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืนหรือซื้อคืนและการขายตราสารหนี้ธนาคาร  
แห่งประเทศไทยกับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) (บริการซื้อขายตราสารหนี้  
และขายตราสารหนี้ ธปท. กับไพรมารี ดีลเลอร์) และประกาศที่เกี่ยวข้อง จำนวน 2 ฉบับ

ทีมตลาดเงินและตลาดพันธบัตร

ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน

โทรศัพท์ 0 2628 6025-7