



23 มีนาคม 2560

เรียน ผู้จัดการ

สถาบันการเงินทุกแห่ง

สถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่ง

ที่ ธปท.ผตง.(21) ว. 7/2560 เรื่อง การแก้ไขเพิ่มเติมระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 35/2553 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการฝากเงินกับธนาคารแห่งประเทศไทย (บริการการฝากเงิน) การยกเลิกระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 39/2553 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการขายตราสารหนี้เพื่อบริหารสภาพคล่องโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน (บริการขายตราสารหนี้) และออกใช้ระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 3/2560 ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่องฉบับใหม่

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้ปรับปรุงหน้าต่างรับฝากเงิน (Deposit Facility) และหน้าต่างให้กู้ยืม ณ สิ้นวัน (Lending Facility) เพื่อให้สมาชิกสามารถบริหารสภาพคล่องได้อย่างมีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น โดยได้ปรับขั้นตอนและเวลาการทำธุรกรรมผ่านหน้าต่างรับฝากเงิน และขยายประเภทตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศที่สมาชิกสามารถนำมาใช้ทำธุรกรรมผ่านหน้าต่างให้กู้ยืม ณ สิ้นวัน พร้อมทั้งทบทวนและกำหนดอัตราส่วนลดที่เหมาะสมกับสถานการณ์ปัจจุบันมากยิ่งขึ้น

สรุปสาระสำคัญที่เปลี่ยนแปลง

1. ปรับปรุงขั้นตอนการทำธุรกรรมของหน้าต่างรับฝากเงิน ให้สอดคล้องกับหน้าต่างให้กู้ยืม ณ สิ้นวัน โดยเมื่อสมาชิกแจ้งคำเสนอขอฝากเงินมายัง ธปท. แล้ว สมาชิกจะไม่สามารถเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือยกเลิกคำเสนอได้ และในการทำธุรกรรมทั้งสองหน้าต่างตั้งรับ สมาชิกสามารถเลือกใช้บัญชีกระแสรายวันที่เปิดไว้กับ ธปท. แบบที่มีหรือไม่มีวงเงินสภาพคล่องระหว่างวัน (Intraday Liquidity Facilities : ILF) ก็ได้
2. ปรับปรุงเวลาการแจ้งคำเสนอทำธุรกรรมของหน้าต่างรับฝากเงิน และหน้าต่างให้กู้ยืม ณ สิ้นวัน จาก 16.30 น. - 17.30 น. และ 17.00 น. - 17.30 น. ตามลำดับ ให้ตรงกันที่เวลา 17.00 น. - 17.20 น.
3. ขยายประเภทตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศสำหรับหน้าต่างให้กู้ยืม ณ สิ้นวันให้รวมถึง
 - เงินตราต่างประเทศสกุลดอลลาร์สหรัฐ เยน และริงกิต ทั้งนี้ เฉพาะสมาชิกที่เป็นสถาบันการเงินตาม พ.ร.บ. ธปท. เท่านั้น
 - ตัวเงินคลังและพันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลหรือธนาคารกลางประเทศมาเลเซีย
4. ปรับปรุง/เพิ่มเติม อัตราส่วนลด (Haircut) และอัตราส่วนลดกรณีสินสิทธิซื้อคืน (Liquidation Haircut) ของตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศที่สมาชิกใช้ในการทำธุรกรรมผ่านหน้าต่างให้กู้ยืม ณ สิ้นวัน

ระเบียบและประกาศที่เกี่ยวข้อง

เพื่อให้สอดคล้องกับการดำเนินการดังกล่าว ธปท. จึงแก้ไข ยกเลิก และออกใช้ระเบียบและประกาศที่เกี่ยวข้อง ดังนี้

1. หน้าต่างรับฝากเงิน

1.1 ระเบียบ/ประกาศที่ออกใหม่

- ระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 2/2560 เพื่อแก้ไขเพิ่มเติม ระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 35/2553 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการฝากเงินกับธนาคารแห่งประเทศไทย (บริการการฝากเงิน) ลงวันที่ 12 พฤษภาคม 2553

- ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 20/2560 เรื่อง ประเภทยอายุการฝากเงิน ช่วงเวลาและวิธีการ ในการฝากเงิน ตามระเบียบ ธปท. ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการฝากเงินกับธนาคารแห่งประเทศไทย (บริการการฝากเงิน)

1.2 ระเบียบ/ประกาศที่ยกเลิก ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 36/2553 เรื่อง ประเภทยอายุการฝากเงิน ช่วงเวลาและวิธีการ ในการฝากเงิน ตามระเบียบ ธปท. ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการฝากเงินกับธนาคารแห่งประเทศไทย (บริการการฝากเงิน)

2. หน้าต่างให้กู้ยืม ณ สิ้นวัน

2.1 ระเบียบ/ประกาศที่ออกใหม่

- ระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 3/2560 ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง ลงวันที่ 21 มีนาคม 2560

- ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 21/2560 เรื่อง ประเภทตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศ ตามระเบียบ ธปท. ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง

- ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 22/2560 เรื่อง ขั้นตอนการดำเนินการ กำหนดเวลา และการส่งมอบตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศให้กับ ธปท. ตามระเบียบ ธปท. ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง

- ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 23/2560 เรื่อง ราคาขายและราคาซื้อคืนตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศ ตามระเบียบ ธปท. ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง

- ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 24/2560 เรื่อง อัตราค่าตอบแทน ตามระเบียบ ธปท. ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง

- ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 25/2560 เรื่อง การคำนวณมูลค่าตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศกรณีสมาชิกสิทธิซื้อคืน ตามระเบียบ ธปท. ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง

- ประกาศ ธปท. ที่ สกง. 26/2560 เรื่อง การเรียกค่าปรับกรณีสมาชิกไม่ปฏิบัติตามระเบียบ ธปท. ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง

2.2 ระเบียบ/ประกาศที่ยกเลิก

- ระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 39/2553 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการขายตราสารหนี้เพื่อบริหารสภาพคล่องโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน (บริการขายตราสารหนี้) ลงวันที่ 12 พฤษภาคม 2553 และประกาศที่เกี่ยวข้อง

การดำเนินการของสมาชิก

1. หากสมาชิกต้องการเปลี่ยนบัญชีเงินฝากกระแสรายวัน สำหรับการทำธุรกรรมการฝากเงิน ตั้งแต่วันที่ 2 พฤษภาคม 2560 โปรดดำเนินการให้ผู้มีอำนาจลงนามพิจารณาลงนาม ในหนังสือแสดงความยินยอมให้หักเงินจากบัญชีเงินฝากและนำเงินเข้าบัญชีเงินฝากตามแบบ (6) ที่แนบท้ายระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 35/2553 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการฝากเงินกับธนาคาร แห่งประเทศไทย (บริการการฝากเงิน) ลงวันที่ 12 พฤษภาคม 2553 และส่งหนังสือให้ ธปท. ภายในวันที่ 21 เมษายน 2560

2. สมาชิกทุกรายที่มีความประสงค์จะทำธุรกรรมกู้ยืม ณ สิ้นวันกับ ธปท. ตามระเบียบใหม่ ต้องให้ผู้มีอำนาจลงนามพิจารณาลงนามในหนังสือแสดงความตกลง และเอกสารตามแบบฟอร์มที่แนบมา พร้อมกับระเบียบนี้ ส่งให้ ธปท. ภายในวันที่ 17 เมษายน 2560 และกำหนดสิทธิในระบบ Electronic Financial Services ในหัวข้อบริการ LF ภายในวันที่ 21 เมษายน 2560

ทั้งนี้ ให้ถือปฏิบัติตามระเบียบและประกาศใหม่ทั้งหมด ตั้งแต่วันที่ 2 พฤษภาคม 2560 เป็นต้นไป

ขอแสดงความนับถือ



(นางรุ่ง มัลลิกะมาส)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายตลาดการเงิน
ผู้ว่าการแทน

- สิ่งที่ส่งมาด้วย :
1. ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 2/2560 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการฝากเงินกับธนาคารแห่งประเทศไทย (บริการการฝากเงิน) (แก้ไขเพิ่มเติม ครั้งที่ 1) ลงวันที่ 21 มีนาคม 2560 และประกาศที่เกี่ยวข้อง จำนวน 1 ฉบับ
 2. หนังสือแสดงความยินยอมให้หักเงินจากบัญชีเงินฝากและนำเงินเข้าบัญชีเงินฝากตามธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 35/2553 ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการฝากเงินกับธนาคารแห่งประเทศไทย (บริการการฝากเงิน) ลงวันที่ 12 พฤษภาคม 2553
 3. ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2560 ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง ลงวันที่ 21 มีนาคม 2560 และประกาศที่เกี่ยวข้อง จำนวน 6 ฉบับ

ทีมตลาดเงินและตลาดพันธบัตร

ฝ่ายตลาดการเงิน

โทร. 0-2356-7714, 0-2356-7757-8