



ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สก. 42/2561

เรื่อง ขั้นตอนการดำเนินการ กำหนดเวลา และการส่งมอบสินทรัพย์หลักประกันให้กับ ธปท.
ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการกู้ยืมเงินจากธนาคารแห่งประเทศไทย
ด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกันขั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตาม 5.3 5.4 5.5 5.7 5.8 และ 5.9 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ที่ สก. 1/2561 ว่าด้วยการกู้ยืมเงินจากธนาคารแห่งประเทศไทยด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกัน
ขั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ลงวันที่ 27 มิถุนายน 2561

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จึงออกประกาศเพื่อกำหนดขั้นตอนการดำเนินการ
กำหนดเวลา และการส่งมอบสินทรัพย์หลักประกันให้กับ ธปท. ในการกู้ยืมเงินจาก ธปท. ด้วยวิธีขาย
สินทรัพย์หลักประกันขั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน

2. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ให้ใช้บังคับกับสถาบันการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ที่ สก. 1/2561 ว่าด้วยการกู้ยืมเงินจากธนาคารแห่งประเทศไทยด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกัน
ขั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ลงวันที่ 27 มิถุนายน 2561

3. เนื้อหา

3.1 ขั้นตอนและกำหนดเวลาการดำเนินการ

การดำเนินการ	เวลา
3.1.1 การขออนุมัติวงเงินกู้ยืม	
1. สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขอ อนุมัติวงเงินกู้ยืม และ รายละเอียดสินทรัพย์หลักประกัน	ระหว่างเวลา 9.00 - 17.00 น. ของวันที่เสนอขออนุมัติวงเงินกู้ยืม
2. ธปท. แจ้งผลการพิจารณาการ อนุมัติวงเงินกู้ยืมให้สถาบัน การเงินทราบ และสถาบันการเงิน แจ้งยืนยันการได้รับแจ้งผลการ อนุมัติให้ ธปท. ทราบ	โดยเร็ว นับจากเวลาที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติวงเงินกู้ยืม และรายละเอียดสินทรัพย์หลักประกันครบถ้วน ทั้งนี้ ขึ้นอยู่กับ ประเภทสินทรัพย์หลักประกัน

การดำเนินการ	เวลา
3. สถาบันการเงินส่งหนังสือตามแบบ (12) และแบบ (13) ที่แนบท้ายระเบียบ ในกรณีที่บริการ EFS ชัดข้อง หรือไม่ สามารถใช้งานได้	ภายในเวลา 10.30 น. ของวันทำการถัดจากวันที่เสนอขออนุมัติวงเงินกู้ยืม
3.1.2 การขอเบิกเงินกู้ยืม - ธุรกรรมขาแรก	
4. สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขอเบิกเงินกู้ยืม และรายละเอียดสินทรัพย์หลักประกัน	ระหว่างเวลา 9.00 - 17.00 น. ของวันที่เสนอขอเบิกเงินตามวงเงินกู้ยืมที่ได้รับอนุมัติจาก ธปท.
5. ธปท. แจ้งผลการอนุมัติการเบิกเงินกู้ยืมให้สถาบันการเงินทราบ และสถาบันการเงินแจ้งยืนยันการได้รับแจ้งผลการอนุมัติให้ ธปท. ทราบ	โดยเร็ว นับจากเวลาที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขอเบิกเงินกู้ยืม และรายละเอียดสินทรัพย์หลักประกันครบถ้วน ทั้งนี้ ขึ้นอยู่กับประเภทสินทรัพย์หลักประกัน
6. สถาบันการเงินจะต้องโอนสินทรัพย์หลักประกันให้แก่ ธปท. หรือเข้าบัญชียอยตราสารหนี้เพื่อการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนหรือขายคืน	ตามประเภทสินทรัพย์หลักประกัน ดังนี้ (1) ตราสารหนี้สกุลเงินบาททั้งประเภท Scripless และ Scrip โดยเร็ว (2) ตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ ประเภทตั๋วเงินคลังและพันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลประเทศสหรัฐอเมริกา สหราชอาณาจักร ญี่ปุ่น เยอรมนี และฝรั่งเศส (ก) สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ภายในวันทำการเดียวกับวันที่ทำธุรกรรม (ข) สกุลเงินปอนด์สเตอร์ลิง และยูโร ภายใน 1 วันทำการของ Custodian ในแต่ละสกุลเงินนับจากวันที่ทำธุรกรรม (ค) สกุลเงินเยน ภายใน 2 วันทำการของ Custodian ในสกุลเงินดังกล่าว นับจากวันที่ทำธุรกรรม (3) ตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ ประเภทหลักทรัพย์ที่ออกหรือค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ยโดยรัฐบาลไทย เฉพาะหลักทรัพย์สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ปอนด์สเตอร์ลิง ยูโร และเยน ภายใน 1 วันทำการของ Custodian ในแต่ละสกุลเงินนับจากวันที่ทำธุรกรรม (4) ตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ ประเภทตั๋วเงินคลังและพันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลหรือธนาคารกลางประเทศมาเลเซีย ในสกุลเงินริงกิต ภายในวันทำการเดียวกับวันที่ทำธุรกรรม

การดำเนินการ	เวลา
	(5) เงินตราต่างประเทศ (ก) สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ และปอนด์สเตอร์ลิง ภายในวันทำการเดียวกับวันที่ทำธุรกรรม (ข) สกุลเงินยูโร และเยน ภายใน 1 วันทำการของ Agent Bank ในแต่ละสกุลเงินนับจากวันที่ทำธุรกรรม (ค) สกุลเงินริงกิต ภายในวันทำการเดียวกับวันที่ทำธุรกรรม ทั้งนี้ ในกรณีวันที่โอนสินทรัพย์หลักประกันสกุลเงินใดตรงกับวันหยุดทำการของ Custodian/Agent Bank สกุลเงินนั้น ให้สถาบันการเงินโอนสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวในวันทำการถัดไป สำหรับสินทรัพย์หลักประกันประเภทตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ ให้สถาบันการเงินมีหน้าที่แจ้งให้ Custodian ระบุ SWIFT BIC ของสถาบันการเงินในคำสั่งโอนตราสารหนี้ทุกครั้ง
7. รพท. นำเงินบาทเข้าบัญชีเงินฝากของสถาบันการเงิน	ภายในวันทำการเดียวกัน หรือวันทำการถัดจากวันที่รับโอนกรรมสิทธิ์ ขึ้นอยู่กับประเภทสินทรัพย์หลักประกัน
8. สถาบันการเงินส่งหนังสือตามแบบ (14) และแบบ (13) ที่แนบท้ายระเบียบ ในกรณีที่บริการ EFS ชัดช่อง หรือไม่สามารถใช้งานได้	ภายในเวลา 10.30 น. ของวันทำการถัดจากวันที่เสนอขอเบิกเงินกู้ยืม
3.1.3 การซื้อคืน - ธุรกรรมขาหลัง	
9. รพท. นำดอกเบียตราสารหนี้สกุลเงินบาท และเงินส่วนต่างในกรณีสันสิทธิซื้อคืน (ถ้ามี) ชำระราคาซื้อคืนและค่าตอบแทนค้างชำระ (ถ้ามี)	ภายใน 12.00 น. ของวันที่ครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกัน
10. รพท. หักเงินจากบัญชีเงินฝากของสถาบันการเงินมาชำระราคาซื้อคืนและค่าตอบแทนค้างชำระ (ถ้ามี) ในส่วนที่เหลือทั้งหมด	ภายใน 12.00 น. ของวันที่ครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกัน

การดำเนินการ	เวลา
11. ธปท. โอนกรรมสิทธิ์ในสินทรัพย์หลักประกัน และดอกเบี้ย ตราสารหนี้สกุลเงินต่างประเทศ คืนให้สถาบันการเงิน	ตามประเภทสินทรัพย์หลักประกัน ดังนี้ (1) ตราสารหนี้สกุลเงินบาท (ก) ประเภท Scrippless ภายในวันเดียวกันกับวันที่ครบกำหนด ซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกัน (ข) ประเภท Scrip โดยเร็ว (2) ตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ ประเภทตั๋วเงินคลังและ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลประเทศสหรัฐอเมริกา สหราชอาณาจักร ญี่ปุ่น เยอรมนี และฝรั่งเศส (ก) สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ภายในวันทำการเดียวกับวันที่ ครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกัน (ข) สกุลเงินปอนด์สเตอร์ลิง และยูโร ภายใน 1 วันทำการของ Custodian ในแต่ละสกุลเงินนับจากวันที่ครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์ หลักประกัน (ค) สกุลเงินเยน ภายใน 2 วันทำการของ Custodian ในสกุลเงิน ดังกล่าว นับจากวันที่ครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกัน (3) ตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ ประเภทหลักทรัพย์ที่ออกหรือ ค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ยโดยรัฐบาลไทย เฉพาะหลักทรัพย์สกุล เงินดอลลาร์สหรัฐ ปอนด์สเตอร์ลิง ยูโร และเยน ภายใน 1 วันทำการ ของ Custodian ในแต่ละสกุลเงินนับจากวันที่ครบกำหนดซื้อคืน สินทรัพย์หลักประกัน (4) ตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ ประเภทตั๋วเงินคลังและ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลหรือธนาคารกลางประเทศมาเลเซีย ในสกุล เงินริงกิต ภายในวันทำการเดียวกับวันที่ครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์ หลักประกัน (5) เงินตราต่างประเทศ (ก) สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ และปอนด์สเตอร์ลิง ภายในวันทำการ เดียวกับวันที่ครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกัน (ข) สกุลเงินยูโร และเยน ภายใน 1 วันทำการของ Agent Bank ในแต่ละสกุลเงินนับจากวันที่ครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกัน (ค) สกุลเงินริงกิต ภายในวันทำการเดียวกับวันที่ครบกำหนดซื้อคืน สินทรัพย์หลักประกัน ทั้งนี้ ในกรณีวันที่โอนสินทรัพย์หลักประกันสกุลเงินใดตรงกับ วันหยุดทำการของ Custodian/Agent Bank สกุลเงินนั้น ธปท. จะ โอนสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวในวันทำการถัดไป

การดำเนินการ	เวลา
3.1.4 การขอชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด	
12. สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขอชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด	ระหว่างเวลา 9.00 - 17.00 น. ก่อนหน้าวันที่ประสงค์จะชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนดตามกลุ่มสัญญาไม่น้อยกว่า 1 วันทำการ เว้นแต่ ธปท. พิจารณาเป็นอย่างอื่น
13. ธปท. แจ้งผลการพิจารณาการขอชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนดให้สถาบันการเงินทราบและสถาบันการเงินแจ้งยืนยันการได้รับแจ้งผลการอนุมัติให้ ธปท. ทราบ	โดยเร็ว นับจากเวลาที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขอชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด
14. ธปท. นำดอกเบี้ยตราสารหนี้สกุลเงินบาท มาชำระราคาซื้อคืนและค่าตอบแทนค้างชำระ (ถ้ามี)	ภายใน 12.00 น. ของวันที่กำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกันก่อนครบกำหนด
15. ธปท. หักเงินจากบัญชีเงินฝากของสถาบันการเงินมาชำระราคาซื้อคืนและค่าตอบแทนค้างชำระ (ถ้ามี) ในส่วนที่เหลือทั้งหมด	ภายใน 12.00 น. ของวันที่ครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกันก่อนครบกำหนด
16. ธปท. โอนกรรมสิทธิ์ในสินทรัพย์หลักประกัน และดอกเบี้ยตราสารหนี้สกุลเงินต่างประเทศคืนให้สถาบันการเงิน	ให้ดำเนินการตามที่กำหนดในข้อ 11. โดยให้ใช้ข้อความ “วันที่กำหนดให้สถาบันการเงินซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกันก่อนครบกำหนด” แทน “วันครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกัน”
17. สถาบันการเงินส่งหนังสือตามแบบ (15) ที่แนบท้ายระเบียบ ในกรณีที่บริการ EFS ขัดข้อง หรือไม่สามารถใช้งานได้	ภายในเวลา 10.30 น. ของวันทำการถัดจากวันที่เสนอขอชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด
3.1.5 การขอกู้ยืมเงินต่อ	
18. สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขอกู้ยืมเงินต่อ และรายละเอียดสินทรัพย์หลักประกันเพิ่มเติม (ถ้ามี)	ระหว่างเวลา 9.00 - 17.00 น. ก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกันตามกลุ่มสัญญาเดิม 2 วันทำการ เว้นแต่ ธปท. พิจารณาเป็นอย่างอื่น
19. ธปท. แจ้งผลการพิจารณาการขอกู้ยืมเงินต่อ ให้สถาบันการเงินทราบและสถาบันการเงินแจ้งยืนยันการได้รับแจ้งผลการอนุมัติให้ ธปท. ทราบ	โดยเร็ว นับจากเวลาที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขอกู้ยืมเงินต่อ และรายละเอียดสินทรัพย์หลักประกันครบถ้วน ทั้งนี้ ขึ้นอยู่กับประเภทสินทรัพย์หลักประกัน

การดำเนินการ	เวลา
20. ธปท. นำดอกเบี้ยยตราสารหนี้สกุลเงินบาท มาชำระค่าตอบแทนค้างชำระ (ถ้ามี) และราคาซื้อคืน และในกรณีสถาบันการเงินประสงค์จะชำระค่าตอบแทนค้างชำระ (ถ้ามี) และราคาซื้อคืนบางส่วน ธปท. จะหักเงินจากบัญชีเงินฝากของสถาบันการเงิน	ภายใน 12.00 น. ของวันครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกันตามกลุ่มสัญญาเดิม
21. ธปท. จะคืนดอกเบี้ยยตราสารหนี้สกุลเงินบาท ตามที่ ธปท. พิจารณาเห็นสมควร	ภายในวันครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกันตามกลุ่มสัญญาเดิม
22. สถาบันการเงินจะต้องโอนสินทรัพย์หลักประกันให้แก่ ธปท. หรือเข้าบัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนหรือขายคืน	ดำเนินการผ่านระบบงานตามวิธีการ และกำหนดเวลาที่ศูนย์รับฝาก Agent bank และ Custodian กำหนด โดยให้ ธปท. สามารถตรวจสอบผลการรับโอนสินทรัพย์หลักประกันได้ครบถ้วนภายในวันครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกันของกลุ่มสัญญาเดิม
23. ธปท. โอนกรรมสิทธิ์ในสินทรัพย์หลักประกันและดอกเบี้ยของตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศคืนให้สถาบันการเงิน	ให้ดำเนินการตามที่กำหนดในข้อ 11. โดยให้ใช้ข้อความ “วันครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกันตามกลุ่มสัญญาเดิม” แทน “วันครบกำหนดซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกัน”
24. สถาบันการเงินส่งหนังสือตามแบบ (16) และแบบ (13) ที่แนบท้ายระเบียบ ในกรณีที่บริการ EFS ชัดข้อง หรือไม่สามารถใช้งานได้	ภายในเวลา 10.30 น. ของวันทำการถัดจากวันที่เสนอขอกู้ยืมเงินต่อ
3.1.6 กรณีสถาบันการเงินสันสิทธิ์ซื้อคืน	
25. ธปท. นำเงินเข้า/หักเงินจากบัญชีเงินฝากของสถาบันการเงิน	ภายในเวลา 12.00 น. ของวันทำการถัดจากวันครบกำหนดซื้อคืน โดยในกรณีเป็นหนี้ค้างชำระ ธปท. จะหักเงินจากบัญชีเงินฝากของสถาบันการเงินจนกว่า ธปท. จะได้รับเงินครบจำนวน เว้นแต่ ธปท. จะพิจารณาเป็นอย่างอื่น

ทั้งนี้ ธปท. อาจเปลี่ยนแปลงกำหนดเวลาข้างต้น หากเห็นว่ามีเหตุอันสมควร

3.2 วิธีการในการซื้อขาย และการส่งมอบสินทรัพย์หลักประกันให้กับ ธปท.

3.2.1 สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอ รับทราบผลการอนุมัติ และแจ้งยืนยัน การได้รับแจ้งผลการอนุมัติ ผ่านทางบริการ EFS ทั้งนี้ การแจ้งยืนยันของสถาบันการเงินไม่กระทบต่อ ความสมบูรณ์ของการแจ้งผลการอนุมัติของ ธปท. ตามที่กำหนดไว้ในระเบียบว่าด้วยการกู้ยืมเงินจาก ธนาคารแห่งประเทศไทยด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกันชั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ซึ่งผูกพันสถาบัน การเงินแล้ว

3.2.2 เมื่อสัญญาขายสินทรัพย์หลักประกันโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนมีผลผูกพัน ตาม 5.5.2 และ 5.9.3 ในระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการกู้ยืมเงินจากธนาคารแห่งประเทศไทย ด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกันโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน สถาบันการเงินต้องส่งมอบสินทรัพย์หลักประกัน ให้กับ ธปท. ตามวิธีการ ดังนี้

ประเภทสินทรัพย์หลักประกัน	การโอนสินทรัพย์หลักประกัน
1. ตราสารหนี้สกุลเงินบาท ประเภท Scripless	โอนเข้า “บัญชีย่อยตราสารหนี้เพื่อการซื้อขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนหรือขายคืน” ที่บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด
2. ตราสารหนี้สกุลเงินบาท ประเภท Scrip	โอนสลักหลัง แจ้งนายทะเบียนเปลี่ยนแปลงกรรมสิทธิ์ และส่งมอบตราสาร พร้อมใบยืนยันจากนายทะเบียนมายัง ธปท.
3. ตราสารหนี้สกุลเงินตรา ต่างประเทศ ประเภทตั๋วเงิน คลังและพันธบัตรของรัฐบาล ประเทศสหรัฐอเมริกา สหราชอาณาจักร ญี่ปุ่น เยอรมนี และฝรั่งเศส	โอนเข้าบัญชีตราสารหนี้ของ ธปท. ที่ Custodian ดังนี้ (1) สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ: Federal Reserve Bank of New York (2) สกุลเงินปอนด์สเตอร์ลิง: Bank of England (3) สกุลเงินยูโร ก. ตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐบาลฝรั่งเศส: Banque De France ข. ตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐบาลเยอรมนี: Euroclear (4) สกุลเงินเยน : Bank of Japan
4. ตราสารหนี้สกุลเงินตรา ต่างประเทศ ประเภท หลักทรัพย์ที่ออกหรือค้า ประกันเงินต้นและดอกเบี้ย โดยรัฐบาลไทย เฉพาะ หลักทรัพย์สกุลเงินดอลลาร์ สหรัฐ ปอนด์สเตอร์ลิง ยูโร และเยน	โอนเข้าบัญชีตราสารหนี้ของ ธปท. ที่ Euroclear สำหรับทุกสกุลเงิน

ประเภทสินทรัพย์หลักประกัน	การโอนสินทรัพย์หลักประกัน
5. ตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ ประเภทตั๋วเงินคลังและพันธบัตรของรัฐบาลหรือธนาคารกลางประเทศมาเลเซีย ในสกุลเงินริงกิต	โอนเข้าบัญชีตราสารหนี้ของ ธปท. ที่ Bank Negara Malaysia
6. เงินตราต่างประเทศ	โอนเข้าบัญชีเงินตราต่างประเทศของ ธปท. ที่ Agent bank ดังนี้ (1) สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ: - Bank of America (ผ่านระบบ USD CHATS) หรือ - Federal Reserve Bank of New York (2) สกุลเงินปอนด์สเตอร์ลิง: Bank of England (3) สกุลเงินยูโร: Banque De France (4) สกุลเงินเยน: Bank of Japan (5) สกุลเงินริงกิต: Bank Negara Malaysia

4. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2561 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 มิถุนายน 2561



(นายวิรไท สันติประภพ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ทีมตลาดเงินและตลาดพันธบัตร
ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน
โทรศัพท์ 0 2628 6025-7