



ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 78 /2555

ว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้
ด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Outright) กับคู่ค้าที่ ธปท. แต่งตั้ง

1. เหตุผลในการออกระเบียบ

เพื่อปรับปรุงหลักเกณฑ์ เงื่อนไข หน้าที่และสิทธิประโยชน์ของคู่ค้าของธนาคารแห่งประเทศไทยสำหรับการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ประเภท Outright ด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Outright) ซึ่งรวมทั้งการซื้อขายตราสารหนี้ประเภทอัตราดอกเบี้ยลอยตัวด้วย

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 33 (6) แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พ.ศ. 2485 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551

3. ยกเลิก

ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยบริการด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้กับไพรมารี ดีลเลอร์ (Primary Dealer) ด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Outright) พ.ศ. 2549

4. ขอบเขตการบังคับใช้

สถาบันการเงิน บริษัทหลักทรัพย์ หรือสถาบันอื่น ๆ ที่ได้รับแต่งตั้งจาก ธปท. ให้เป็นคู่ค้าสำหรับการทำธุรกรรมซื้อขายตราสารหนี้ด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Outright) ตามระเบียบฉบับนี้

5. เนื้อหา

ในระเบียบฉบับนี้

“ธปท.” หมายความว่า ธนาคารแห่งประเทศไทย

“คู่ค้า” หมายความว่า สถาบันการเงิน บริษัทหลักทรัพย์ หรือสถาบันอื่น ๆ ที่ ธปท. แต่งตั้งให้เป็นคู่ค้าของ ธปท. ในการซื้อขายตราสารหนี้เพื่อการดำเนินนโยบายการเงินโดยใช้บริการด้านการเงินด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (e-Outright)

“ตราสารหนี้” หมายความว่า ตัวเงินคลัง ตัวสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย และตราสารหนี้หรือหุ้นกู้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายจัดตั้งขึ้น ทั้งนี้ ตามที่ ธปท. กำหนด

“ศูนย์รับฝาก” หมายความว่า บริษัทศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด หรือหน่วยงานอื่นใดที่ตลาดหลักทรัพย์จัดตั้งขึ้น หรือได้รับอนุญาตจากคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์ และตลาดหลักทรัพย์ เพื่อประกอบกิจการศูนย์กลางการให้บริการรับฝากและถอนหลักทรัพย์

5.1 คู่ค้าต้องปฏิบัติดังนี้

5.1.1 ทำหนังสือแสดงความตกลงตามแบบ (1) ที่แนบท้ายระเบียบนี้

5.1.2 ก่อนวันที่คู่ค้าจะเริ่มทำธุรกรรมครั้งแรกกับ ธปท. ตามระเบียบนี้ นอกจาก คู่ค้าจะต้องแต่งตั้งผู้รับรอง (Certifier) เพื่อแต่งตั้งผู้ปฏิบัติงาน (Officer) ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการให้บริการด้านการเงินด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (Electronic Financial Services: EFS) คู่ค้ามีหน้าที่ต้องดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) ทำหนังสือมอบอำนาจให้บุคคลทำหน้าที่แต่งตั้งผู้จัดการสิทธิการใช้

บริการ e-Outright ตามแบบ (2) ที่แนบท้ายระเบียบนี้

(2) ให้บุคคลผู้รับมอบอำนาจตาม (1) ทำหนังสือแต่งตั้งผู้จัดการสิทธิการใช้ บริการ e-Outright ตามแบบ (3) ที่แนบท้ายระเบียบนี้

(3) ให้ผู้จัดการสิทธิตาม (2) ทำหนังสือกำหนดสิทธิในการทำธุรกรรม e-Outright ตามแบบ (4) ที่แนบท้ายระเบียบนี้ แต่จะกำหนดสิทธิให้ ตนเองไม่ได้

5.1.3 ทำหนังสือมอบอำนาจให้ผู้รับมอบอำนาจกระทำการแทนคู่ค้าในการติดต่อกับ ธปท. เพื่อเสนอซื้อหรือเสนอขายตราสารหนี้กับ ธปท. ในลักษณะซื้อขายเสร็จเด็ดขาด ตามแบบ (5) ที่แนบท้ายระเบียบนี้

5.1.4 ทำหนังสือแจ้งรายละเอียดสำหรับการส่งมอบและชำระราคาตราสารหนี้ ตามแบบ (6) ที่แนบท้ายระเบียบนี้

5.2 การแสดงเจตนา การบอกกล่าวและการสื่อสารใดๆ ระหว่าง ธปท. กับคู่ค้าให้เป็นไปตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการให้บริการด้านการเงินด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์ (Electronic Financial Services: EFS) เว้นแต่ในกรณีที่บริการ EFS ชัดข้องหรือไม่สามารถใช้งานได้ การแจ้งคำสั่งเสนอซื้อขาย การแจ้งผล การยืนยันหรือการติดต่อระหว่างคู่ค้า กับ ธปท. ให้ดำเนินการทาง Reuters Dealing หรือ Bloomberg หรือโทรสาร (facsimile)

ในกรณีที่ระบบบาทเน็ตขัดข้อง หรือไม่สามารถรับส่งข้อความผ่านระบบบาทเน็ตได้ ให้ใช้โทรสาร (facsimile) ในการสื่อสารแทน

ในกรณีที่ไม่สามารถชำระราคาและ/หรือโอนกรรมสิทธิ์ส่งมอบตราสารหนี้ผ่านระบบของศูนย์รับฝากได้ ให้ปฏิบัติตามวิธีการที่กำหนดไว้ในระเบียบที่เกี่ยวข้องของศูนย์รับฝาก

5.3 ในการทำธุรกรรมแต่ละคราวนั้น ให้มีขั้นตอนดำเนินการ ดังนี้

5.3.1 ธปท. แจ้งความประสงค์ทำธุรกรรมไปยังคู่ค้า ตามวิธีการ และเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด

5.3.2 คู่ค้าต้องส่งคำสั่งเสนอทำธุรกรรมกลับมายัง ธปท. ตามเงื่อนไข วิธีการ และเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด

กรณีที่ลูกค้าต้องการเปลี่ยนแปลงหรือแก้ไขคำเสนอตามวรรคก่อน ลูกค้าต้องดำเนินการภายในเวลาที่กำหนดให้ทำคำเสนอ และให้ถือว่าคำเสนอที่เสนอมารั้งหลังสุดเป็นคำเสนอที่ผูกพันลูกค้า

5.3.3 ธปท. จะพิจารณารับซื้อหรือขายตราสารหนี้กับลูกค้ารายใดเป็นจำนวนเงินเท่าใดก็ได้ โดยไม่จำเป็นต้องซื้อหรือขายกับลูกค้าทุกราย และ ธปท. จะแจ้งผลของการพิจารณาให้ลูกค้าทราบ เมื่อลูกค้าได้รับการแจ้งผลของการพิจารณาแล้วให้ลูกค้าแจ้งยืนยันการได้รับผลของการพิจารณากลับมาให้ ธปท. ทราบ ทั้งนี้ตามวิธีการและเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด โดยในกรณีที่ ธปท. แจ้งผลรับซื้อหรือขายให้กับลูกค้าทราบให้ถือว่าการแจ้งผลดังกล่าวนั้นเป็นคำสนอง และให้สัญญาซื้อขายตราสารหนี้มีผลผูกพันคู่สัญญาทันที ไม่ว่าลูกค้าจะได้แจ้งยืนยันการได้รับผลของการพิจารณากลับมาให้ ธปท. ทราบหรือไม่ก็ตาม

5.3.4 ลูกค้าต้องทำการยืนยันการซื้อขายตราสารหนี้ตามผลการพิจารณาของ ธปท. ในข้อ 5.3.3 ตามแบบและเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด โดยในการคำนวณราคาตราสารหนี้ให้ใช้สูตรการคำนวณราคาตราสารหนี้ตามประกาศของ ธปท. ทั้งนี้ เพื่อประโยชน์ในการชำระราคาและโอนกรรมสิทธิ์ส่งมอบตราสารหนี้ ธปท. จะแจ้งยืนยันการซื้อขายตราสารหนี้ให้กับลูกค้าด้วย

5.3.5 ให้ลูกค้าชำระราคาหรือโอนกรรมสิทธิ์ส่งมอบตราสารหนี้ภายใน 2 วันทำการถัดจากวันที่ได้เสนอซื้อหรือเสนอขายตราสารหนี้ ทั้งนี้ เว้นแต่จะได้ตกลงกันไว้เป็นอย่างอื่น ทั้งนี้ วิธีการชำระราคาหรือโอนกรรมสิทธิ์ส่งมอบตราสารหนี้ให้ดำเนินการตามวิธีการและเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด

5.3.6 การโอนกรรมสิทธิ์และการชำระราคาตราสารหนี้ให้ดำเนินการผ่านระบบงานของศูนย์รับฝาก

5.4 หากลูกค้าไม่สามารถชำระราคาหรือโอนกรรมสิทธิ์ส่งมอบตราสารหนี้ตามที่ตกลงซื้อขายไว้กับ ธปท. ธปท. จะดำเนินการ ดังนี้

5.4.1 หากลูกค้าผิดนัดไม่ชำระราคาหรือโอนกรรมสิทธิ์ส่งมอบตราสารหนี้ภายในเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด ให้ลูกค้าชำระเบี้ยปรับกรณีล่าช้าผ่านระบบบาทพร้อมชำระราคาหรือโอนกรรมสิทธิ์ส่งมอบตราสารหนี้ในเวลาเดียวกัน ทั้งนี้ กำหนดเบี้ยปรับวิธีการคำนวณ และเวลาชำระเบี้ยปรับให้เป็นไปตามที่ ธปท. ประกาศกำหนด

5.4.2 หากลูกค้าไม่ชำระราคาหรือโอนกรรมสิทธิ์ส่งมอบตราสารหนี้พร้อมเบี้ยปรับกรณีล่าช้าภายในเวลาตามประกาศในข้อ 5.4.1 ให้สัญญาซื้อขายนั้นเป็นอันเลิกกัน และ ธปท. มีสิทธิระงับการทำธุรกรรมกับลูกค้ารายดังกล่าวเป็นระยะเวลาตามที่ ธปท. พิจารณาเห็นสมควร และสงวนสิทธิในการพิจารณาให้ลูกค้ารายนั้นพ้นจากสถานะการเป็นลูกค้าทันที และอาจไม่ได้รับการพิจารณาเป็นลูกค้าของ ธปท. ในรอบการพิจารณาถัดไป ทั้งนี้ ลูกค้าต้องชำระเบี้ยปรับกรณีไม่ชำระราคาหรือไม่โอนกรรมสิทธิ์ส่งมอบตราสารหนี้พร้อมกับเบี้ยปรับกรณีล่าช้าตามข้อ 5.4.1 ให้แก่ ธปท. ผ่านระบบบาทเนตตามอัตรา วิธีการ และเวลาที่ ธปท. ประกาศกำหนด

5.5 ในกรณีที่คู่ค้ารายใดผิดนัดกรณีล่าช้าตามข้อ 5.4.1 ตั้งแต่ 2 ครั้งขึ้นไปในรอบ การพิจารณาประเมินผลการเป็นคู่ค้า ธปท. จะระงับสิทธิการทำธุรกรรมกับคู่ค้ารายดังกล่าวเป็นเวลา 2 เดือนนับแต่วันผิดนัดครั้งสุดท้ายหรือเท่ากับจำนวนเวลาที่เหลือก่อนครบรอบการพิจารณา ประเมินผลการเป็นคู่ค้านั้น แล้วแต่ระยะเวลาใดจะน้อยกว่า

5.6 ธปท. สงวนสิทธิที่จะปรับปรุง แก้ไข เพิ่มเติม หรือเปลี่ยนแปลงระเบียบ ประกาศ หรือเอกสารที่เกี่ยวข้องตามระเบียบนี้ได้ โดย ธปท. จะแจ้งให้คู่ค้าทราบล่วงหน้าก่อนที่จะใช้บังคับ กับคู่ค้า

5.7 หากมีปัญหาใด ๆ เกี่ยวกับการตีความหรือการดำเนินการให้เป็นไปตามระเบียบนี้ ประกาศหรือข้อกำหนดอื่นใดที่ออกตามระเบียบนี้ ธปท. จะเป็นผู้วินิจฉัยชี้ขาด

5.8 ธปท. อาจพิจารณาไม่รับซื้อหรือขายตราสารหนี้ตามระเบียบนี้กับคู่ค้ารายใด เป็นการชั่วคราวหรือถาวร ในกรณีที่คู่ค้ารายนั้นไม่ปฏิบัติตามระเบียบนี้หรือระเบียบอื่นใดของ ธปท. และหรือดำเนินการใด ๆ ในทิศทางที่ไม่สอดคล้องและหรือส่งผลในทางลบต่อแนวทางของทางการใน การดำเนินนโยบายการเงิน นโยบายอัตราแลกเปลี่ยน และหรือการสร้างเสถียรภาพในระบบการเงิน

6. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ระเบียบนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2555 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 14 กันยายน 2555

ประสาร ไตรรัตน์วรกุล

(นายประสาร ไตรรัตน์วรกุล)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย