



ที่ วพ. 010/2553

12 พฤศจิกายน 2553

เรียน สมาชิกสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

เรื่อง การทำธุรกรรมซื้อคืนภาคเอกชน กรณีตรงกับวันหยุดพิเศษ

ตามที่ สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ได้หารือร่วมกับผู้ร่วมตลาดที่เกี่ยวข้องเกี่ยวกับแนวทางปฏิบัติในการทำธุรกรรมซื้อคืนภาคเอกชนกรณีตรงกับวันหยุดพิเศษ เพื่อกำหนดเป็นมาตรฐานของตลาด โดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการมาตรฐานปฏิบัติงานของตลาด และผ่านการรับฟังความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้องแล้วนั้น

ThaiBMA จึงขอเสนอมาตรฐานการปฏิบัติในตลาดตราสารหนี้ เรื่อง การทำธุรกรรมซื้อคืนภาคเอกชน กรณีตรงกับวันหยุดพิเศษ (โดยมีรายละเอียดตามเอกสารแนบ) มายังสมาชิกเพื่อใช้เป็นมาตรฐานในการดำเนินธุรกรรมในตลาดต่อไป โดยประกอบด้วยกรณีต่างๆดังนี้

1. กรณีวันหยุดพิเศษตรงกับวันชำระราคา และส่งมอบตราสารหนี้ (Settlement date) ของธุรกรรมขาแรก (Opening leg)
2. กรณีวันหยุดพิเศษตรงกับ Settlement date ของธุรกรรมขาหลัง (Closing leg)
3. กรณีธุรกรรมทั้งขาแรก และขาหลังตรงกับวันหยุดพิเศษยาวติดต่อกัน

ขอแสดงความนับถือ

(นายนิวัฒน์ กาญจนภูมิินทร์)
กรรมการผู้จัดการ

สิ่งที่ส่งมาด้วย 1. มาตรฐานการปฏิบัติในตลาดตราสารหนี้ เรื่องการทำธุรกรรมซื้อคืนภาคเอกชน
กรณีตรงกับวันหยุดพิเศษ

ฝ่ายวิจัยและพัฒนา

สายชล ลิขิตส์ดี

โทรศัพท์ 02-252-3336 ต่อ 211

มาตรฐานการปฏิบัติในตลาดตราสารหนี้
เรื่อง การทำธุรกรรมซื้อคืนภาคเอกชน กรณีตรงกับวันหยุดพิเศษ

เพื่อให้การปฏิบัติในตลาดตราสารหนี้เป็นมาตรฐานเดียวกัน สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย กำหนดมาตรฐานการปฏิบัติ เรื่องการทำธุรกรรมซื้อคืนภาคเอกชน (Private repo) กรณีตรงกับวันหยุดพิเศษ ซึ่งได้รับความเห็นชอบจากมติที่ประชุมของคณะกรรมการมาตรฐานปฏิบัติงานของตลาด ไว้ดังนี้

ข้อ 1 ในมาตรฐานการปฏิบัติฉบับนี้

“สมาคม”	หมายความว่า	สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
“วันหยุดพิเศษ”	หมายความว่า	วันที่ธนาคารแห่งประเทศไทย กำหนดให้เป็นวันหยุดทำการของสถาบันการเงินเป็นกรณีพิเศษซึ่งไม่อาจคาดหมายหรือทราบได้ล่วงหน้านอกเหนือวันหยุดทำการประจำปีของสถาบันการเงิน

ข้อ 2 ในกรณีที่มีการประกาศวันหยุดพิเศษ ให้มีแนวทางปฏิบัติ ดังนี้

2.1 กรณีวันหยุดพิเศษตรงกับวันชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้ (Settlement date) ของธุรกรรมขาแรก (Opening leg) ให้เลื่อน Settlement date ออกไปเป็นวันเปิดทำการถัดไป โดยให้คงมูลค่าธุรกรรม ณ วันเริ่มต้นสัญญา (Purchase Price) และหลักทรัพย์ที่ใช้ในการทำธุรกรรม (Collateral) เดิมตามที่คู่สัญญาได้ตกลงไว้

2.2 กรณีวันหยุดพิเศษตรงกับ Settlement date ของธุรกรรมขาหลัง (Closing leg) ให้เลื่อน Settlement date ออกไปเป็นวันเปิดทำการถัดไป โดยคำนวณมูลค่าธุรกรรม ณ วันครบกำหนดสัญญา (Repurchase price) ในส่วนอัตราผลตอบแทนของธุรกรรมซื้อคืน (Repo interest) ใหม่ตามจำนวนวันที่เพิ่มขึ้นจากวันที่ครบกำหนดสัญญา (Repurchase date) ที่คู่สัญญาได้ตกลงไว้เดิม

2.3 กรณีธุรกรรมทั้งขาแรก และขาหลังตรงกับวันหยุดพิเศษยาวติดต่อกัน ทำให้คู่สัญญาไม่สามารถส่งมอบกันได้ทั้งขาแรกและขาหลัง ให้ยกเลิกธุรกรรมดังกล่าว

ข้อ 3 มาตรฐานการปฏิบัตินี้เริ่มใช้ตั้งแต่วันที่ 15 พฤศจิกายน พ.ศ. 2553 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 12 พฤศจิกายน พ.ศ. 2553



(นายนิวัฒน์ กาญจนภูมิินทร์)

กรรมการผู้จัดการ

สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย