

10 มกราคม 2552

เรียน ผู้จัดการ

สถาบันการเงินที่เป็น Primary Dealers สำหรับการทำธุรกรรมซื้อขายพันธบัตรประเภท Outright ที่ ฝตง.(11)ว. 2 /2552 เรื่อง การปรับเปลี่ยนรุ่นพันธบัตรในการเสนออัตราผลตอบแทนด้านซื้อและด้านขาย (2-way Quotation) ของ Primary Dealers สำหรับธุรกรรมซื้อขายประเภท Outright

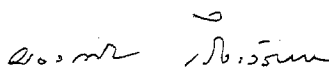
ตามที่ธนาคารท่านได้รับแต่งตั้งเป็น Primary Dealers สำหรับธุรกรรมซื้อขายพันธบัตรประเภท Outright และหน้าที่ประการหนึ่งของการเป็น Primary Dealers คือ การเสนออัตราผลตอบแทนทั้งด้านซื้อและด้านขาย (2-way Quotation) สำหรับรุ่นที่เป็น Benchmark ในตลาดรองในภาวะปกติ นั้น

ขณะนี้สำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ กระทรวงการคลัง ได้เปลี่ยนแปลงการออกพันธบัตร Benchmark รุ่นอายุ 5 ปี จาก LB133A เป็น LB145B แล้ว ตั้งแต่วันที่ 5 มกราคม 2552

รพท. จึงใคร่ขอให้ธนาคารท่านเปลี่ยนรุ่นพันธบัตรที่เสนออัตราผลตอบแทนด้านซื้อและด้านขาย (2-way Quotation) เป็นพันธบัตร Benchmark รุ่น 5 ปี LB145B เพื่อให้สอดคล้องกับ Benchmark ใหม่ดังกล่าว ทั้งนี้ ตั้งแต่วันที่ 26 มกราคม 2552 เป็นต้นไป ส่วนการเสนออัตราผลตอบแทนด้านซื้อและด้านขายพันธบัตร Benchmark รุ่น 10 ปี ยังคงเป็นรุ่น LB183B เช่นเดิม โดยมีรายละเอียดประกอบการเสนออัตราผลตอบแทนโดยสรุป ดังนี้

1. รุ่นของพันธบัตร : พันธบัตรรัฐบาลรุ่น LB145B และ รุ่น LB183B
2. วงเงินขั้นต่ำในการ quote : 30 ล้านบาท ต่อรุ่น
3. Bid-ask Spread สูงสุด : ไม่เกิน 5 bps. ในภาวะปกติ
4. ความถี่ : ทุกวัน อย่างน้อยวันละ 1 ครั้ง
5. เวลาในการ quote : 11.15 น. – 11.30 น. ของทุกวันทำการ
6. การสิ้นสุดของหน้าที่ : เมื่อมีการซื้อหรือขาย (Hit) ข้างใดข้างหนึ่ง หรือเมื่อถึงเวลา 12.00 น.
7. ช่องทางการเสนอราคา : ระบบ FIRSTs ของตลาดตราสารหนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ

ขอแสดงความนับถือ



(นางผ่องเพ็ญ เรืองวีรยุทธ)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายตลาดการเงินและบริหารเงินสำรอง

ผู้ว่าการแทน

ทีมพัฒนาตลาดการเงิน ฝ่ายตลาดการเงินและบริหารเงินสำรอง
โทร. 0-2356-7942 โทรสาร. 0-2356-7455

สกงว10กส6460125520123