



เรียน ผู้จัดการ

สถาบันการเงินทุกแห่ง
สถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่ง
สถาบันอื่นที่เกี่ยวข้อง

ที่ ผตง.(21) ว.13/2563 เรื่อง การแก้ไขเพิ่มเติมระเบียบ ธปท. ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้

ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้ออกระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ (Mutual Fund Liquidity Facility, MFLF) และประกาศที่เกี่ยวข้อง ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 ซึ่งมีวัตถุประสงค์เพื่อรักษาเสถียรภาพของระบบการเงินในภาวะที่เศรษฐกิจและระบบการเงินได้รับผลกระทบจากสถานการณ์ที่ไม่ปกติ

ธปท. ได้ติดตามสถานการณ์ในตลาดการเงินอย่างต่อเนื่อง โดยเห็นว่าการขยายรูปแบบการให้ความช่วยเหลือของสถาบันการเงิน (สง.) แก่บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน (บลจ.) รวมถึงขยายประเภทหลักประกันที่ สง. สามารถนำมาทำธุรกรรมกับ ธปท. จะช่วยเพิ่มประสิทธิภาพของมาตรการในการรักษาเสถียรภาพของตลาดกองทุนรวมตราสารหนี้และตลาดการเงินโดยรวมได้ดีขึ้น ธปท. จึงพิจารณาปรับเงื่อนไขมาตรการ MFLF ให้ยืดหยุ่นเพิ่มขึ้น โดยมีรายละเอียดดังนี้

	เงื่อนไขมาตรการ MFLF ปัจจุบัน	เงื่อนไขมาตรการ MFLF ที่ ธปท. ปรับเพิ่ม	หมายเหตุ
รูปแบบการให้สภาพคล่องของ สง. แก่ บลจ. (เพื่อกำหนดวงเงินรับการสนับสนุนสภาพคล่องต่อจาก ธปท.)	1. สง. ซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีสัดส่วนสินทรัพย์คุณภาพตามเกณฑ์ ^{1/} ไม่ต่ำกว่าร้อยละ 70	3. ขยายรวมไปถึงกรณีที่ สง. ซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ Investment Grade ^{2/}	เพื่อให้ความช่วยเหลือครอบคลุมกองทุนรวมตราสารหนี้ทุกกอง ซึ่งจะช่วยสร้างความเชื่อมั่นให้กับผู้ถือหน่วยลงทุนทุกกลุ่ม
	2. สง. ปลดสภาพคล่องให้กองทุนรวมตราสารหนี้ผ่านธุรกรรม repo	4. ขยายรวมไปถึงกรณีที่ สง. ซื้อตราสารหนี้ภาคเอกชนหรือตัวเงินที่เป็นหลักทรัพย์ สกุลเงินบาทจากกองทุนรวมตราสารหนี้	เพื่อเพิ่มความยืดหยุ่นให้ สง. ในการให้สภาพคล่องแก่กองทุนรวมตราสารหนี้
		5. ขยายรวมไปถึงกรณีที่ สง. ปลดสภาพคล่องโดยตรงให้กับลูกค้าที่ถือหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ที่ถูกเลิกกองทุน (โดยที่ สง. ไม่จำเป็นต้องเกี่ยวข้องกับ บลจ. ที่บริหารกองทุนรวมนั้น) เช่น การให้สินเชื่อแก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยรับหน่วยลงทุนจากกองทุนรวมที่ถูกเลิกกองทุนเป็นหลักประกัน	เพื่อดูแลผู้ถือหน่วยลงทุนที่ถูกเลิกกองทุนที่มีความจำเป็นต้องใช้สภาพคล่อง และไม่สามารถรอ บลจ. liquidate สินทรัพย์ในกองทุนภายใน 90 วันได้

	เงื่อนไขมาตรการ MFLF เดิม	เงื่อนไขมาตรการ MFLF ที่ ธปท. ปรับเพิ่ม	เหตุผลความจำเป็น
ระยะเวลา	ระยะเวลาสัญญาไม่เกิน 6 เดือน ทั้งนี้ มาตรการสิ้นสุดภายในระยะเวลา 1 ปี โดยอาจพิจารณาทบทวนได้หากมีความจำเป็น		
อัตราดอกเบี้ย	Policy rate - 50 bps.		
คู่ค้า ธปท.	สถาบันการเงินและนิติบุคคลอื่นที่ ธปท. กำหนด		
หลักประกันที่ ธปท. รับเป็น หลักประกัน ธุรกิจ Repo	1. หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ ที่มีสัดส่วนสินทรัพย์คุณภาพตามเกณฑ์ ^{1/} 2. สินทรัพย์หลักประกันประเภทที่ 1 และ 2 ตามระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 1/2561 ว่าด้วยการกู้ยืมเงินจาก ธปท. ด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกัน ชั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ซึ่งรวมถึงตราสารหนี้ภาคเอกชน และ ตัวเงินที่เป็นหลักทรัพย์ สกุลเงินบาท ที่มี credit rating ไม่ต่ำกว่า A	3. หน่วยลงทุนของ กองทุนรวมตราสารหนี้ Investment Grade ^{2/} 4. ตราสารหนี้ภาคเอกชน สกุลเงินบาทที่มี credit rating ต่ำกว่า A แต่ไม่ต่ำกว่า BBB-	เพื่อเพิ่มความยืดหยุ่นให้กับ สง. ในการทำธุรกรรม Repo กับ ธปท. ทั้งนี้ ธปท. กำหนดอัตรา Haircut ตามประเภท หลักประกัน

หมายเหตุ 1/ สินทรัพย์คุณภาพตามเกณฑ์ ธปท. ได้แก่ (1) เงินสด เงินฝากกระแสรายวัน และเงินฝากประจำ สกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศ (2) ตัวเงินคลัง และพันธบัตรรัฐบาล (3) พันธบัตร ธปท. (4) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้ชนิดใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะ จัดตั้งขึ้นตามที่ ธปท. กำหนด ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ย หรือที่มี credit rating ไม่ต่ำกว่า A- (5) ตราสารหนี้ภาคเอกชนสกุลเงินบาทที่มี credit rating ไม่ต่ำกว่า A-

2/ กองทุนรวมตราสารหนี้ Investment Grade คือ กองทุนรวมตราสารหนี้ที่ลงทุนในเงินฝาก และ ตราสารหนี้สกุลเงินบาทหรือสกุลเงินตราต่างประเทศที่มี credit rating ไม่ต่ำกว่า BBB-

ระเบียบ/ประกาศที่ออกใช้

- ระเบียบ ธพท. ที่ สกง. 4/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ (แก้ไขเพิ่มเติมครั้งที่ 1)

- ประกาศ ธพท. ที่ สกง. 23/2563 เรื่อง กระบวนการเพิ่มเติมในการขอรับการสนับสนุนสภาพคล่องโดยการขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ตามระเบียบ ธพท. ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้

- ประกาศ ธพท. ที่ สกง. 24/2563 เรื่อง กำหนดอัตราส่วนลดเพื่อประเมินราคาขายสินทรัพย์และคำนวณมูลค่าสินทรัพย์กรณีสิ้นสุดสิทธิซื้อคืน ตามระเบียบ ธพท. ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้

ทั้งนี้ ให้ถือปฏิบัติตามระเบียบและประกาศที่แนบมานี้ ตั้งแต่วันที่ 31 มีนาคม 2563 เป็นต้นไป

ขอแสดงความนับถือ



(นางสาวชญาวดี ชัยอนันต์)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายตลาดการเงิน

ผู้ว่าการแทน

สิ่งที่ส่งมาด้วย : ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 4/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ (แก้ไขเพิ่มเติมครั้งที่ 1) และประกาศที่เกี่ยวข้องจำนวน 2 ฉบับ

ทีมตลาดเงินและตลาดพันธบัตร

ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน

โทรศัพท์ 0 2628 6025-7



ธนาคารแห่งประเทศไทย

ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 4/2563

ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้
(แก้ไขเพิ่มเติมครั้งที่ 1)

1. เหตุผลในการออกระเบียบ

เพื่อปรับเงื่อนไขในการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ให้มีความยืดหยุ่นขึ้น ซึ่งจะช่วยให้ประสิทธิภาพในการสนับสนุนทางการเงินแก่สถาบันการเงินและสถาบันอื่นที่เกี่ยวข้องในการเสริมสร้างสภาพคล่องและสนับสนุนกลไกการทำงานของตลาดการเงิน อันเป็นการดำเนินการเพื่อรักษาเสถียรภาพของระบบการเงินในภาวะที่เศรษฐกิจและระบบการเงินได้รับผลกระทบจากสถานการณ์ที่ไม่ปกติ

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 8 (11) แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย (ฉบับที่ 4) พุทธศักราช 2551

3. แก้ไข

ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563

4. ขอบเขตการบังคับใช้

ระเบียบฉบับนี้ให้ใช้บังคับกับผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563

5. เนื้อหา

5.1 ยกเลิกนิยามคำว่า “สินทรัพย์” ในข้อ 4.1 ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 และใช้ความต่อไปนี้แทน

“สินทรัพย์” หมายถึง

- (1) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ตามที่ รมท. ประกาศกำหนด
- (2) สินทรัพย์หลักประกันตามที่กำหนดในระเบียบ ธปท. ที่ สกง. 1/2561
- (3) ตราสารหนี้ภาคเอกชนสกุลเงินบาท โดยตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตต่ำกว่า A แต่ไม่ต่ำกว่า BBB- จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจาก

สถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด เฉพาะที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 30 ปี ทั้งนี้ ต้องไม่เป็นตราสารหนี้ที่ผู้ออกเกี่ยวข้องกับสถาบันการเงินที่มากู้ยืมเงินจาก ธปท.

(4) สินทรัพย์ประเภทอื่นตามที่ ธปท. กำหนด”

5.2 เพิ่มนิยามดังต่อไปนี้เป็นคำนิยามในข้อ 4.1 ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 ระหว่างนิยามคำว่า “กองทุนรวมตราสารหนี้” กับ “ประกาศ ธปท. เรื่องประเภทสินทรัพย์หลักประกัน”

“ตราสารหนี้ภาคเอกชน” หมายถึง ตราสารหนี้ภาคเอกชนสกุลเงินบาท

“ตัวเงินที่เป็นหลักทรัพย์” หมายถึง ตัวเงินที่เป็นหลักทรัพย์สกุลเงินบาท เพื่อการระดมทุนจากผู้ลงทุนทั่วไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ กำหนด หรือเป็นตัวเงินที่มีราคาเผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA)”

5.3 ยกเลิกความในวรรคหนึ่งข้อ 4.4.2 ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 และใช้ความต่อไปนี้แทน

“4.4.2 ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินสามารถเสนอขอวงเงินได้ไม่เกินประมาณการตาม (1) (2) (3) และ (4) รวมกันของการให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ และผู้ถือหน่วยลงทุนกองทุนรวมตราสารหนี้ ดังนี้

(1) มูลค่าหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ตามที่ ธปท. ประกาศกำหนด ที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินจะซื้อจากกองทุนรวมตราสารหนี้

(2) จำนวนเงินที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินจะให้กู้ยืมแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ผ่านธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาว่าจะขายคืน

(3) มูลค่าตราสารหนี้ภาคเอกชน และตัวเงินที่เป็นหลักทรัพย์ ที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินจะซื้อจากกองทุนรวมตราสารหนี้

(4) จำนวนเงินที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินจะให้กู้ยืมไม่ว่าในรูปแบบใด แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ที่ประกาศเลิกกองทุนตั้งแต่วันที่ 20 มีนาคม 2563

โดยให้ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินระบุงเงินและระยะเวลาที่ต้องการขอรับการสนับสนุน รวมถึงรายละเอียดสินทรัพย์ที่จะนำมาขายโดยมีสัญญาซื้อคืนมายัง ธปท. ภายในเวลาที่ ธปท. กำหนด”

5.4 ยกเลิกความในข้อ 4.5.1 ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 และใช้ความต่อไปนี้แทน

“4.5.1 ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินสามารถเสนอขอเบิกเงินได้ไม่เกินวงเงินที่ได้รับอนุมัติ และยอดเบิกเงินรวมต้องไม่เกินกว่ายอดคงค้างในส่วนที่เพิ่มขึ้นของการให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ และผู้ถือหน่วยลงทุนกองทุนรวมตราสารหนี้ ตาม (1) (2) (3) และ (4) รวมกัน ทั้งนี้ ยอดคงค้างส่วนที่เพิ่มขึ้นให้เทียบจากยอดคงค้าง ณ สิ้นวันที่ 20 มีนาคม 2563 จนถึงวันที่ขอเบิกเงิน ดังนี้

(1) มูลค่าหน่วยลงทุนรวมของกองทุนรวมตราสารหนี้ตามที่ ธปท. ประกาศกำหนด ที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินซื้อจากกองทุนรวมตราสารหนี้ และถือครองโดยผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน

(2) จำนวนเงินที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินให้กู้ยืมแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ผ่านธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาว่าจะขายคืน

(3) มูลค่าตราสารหนี้ภาคเอกชน และตัวเงินที่เป็นหลักทรัพย์ ที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินซื้อจากกองทุนรวมตราสารหนี้ และถือครองโดยผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน

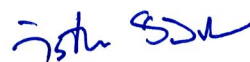
(4) จำนวนเงินที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินให้กู้ยืมไม่ว่าในรูปแบบใด แก่ผู้ถือหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ที่ประกาศเลิกกองทุนตั้งแต่ ณ สิ้นวันที่ 20 มีนาคม 2563

ทั้งนี้ หากผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินขายหน่วยลงทุนกองทุนรวมตราสารหนี้ ตราสารหนี้ภาคเอกชน หรือตัวเงินที่เป็นหลักทรัพย์ที่ถือครองไว้ รวมถึงปรับลดยอดคงค้างธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาว่าจะขายคืน หรือปรับลดยอดการให้กู้ยืมเงินแก่ผู้ถือหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ที่ถูกเลิกกองทุน ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินจะต้องชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนดตามจำนวนเงินที่ปรับลดลงดังกล่าว เว้นแต่ ธปท. จะพิจารณาอนุญาตให้ดำเนินการเป็นอย่างอื่น”

6. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 31 มีนาคม 2563 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563



(นายวิโรฒ สันติประภาพร)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ทีมตลาดเงินและตลาดพันธบัตร
ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน
โทรศัพท์ 0 2628 6025-7



ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย
ที่ สกง. 23/2563

เรื่อง กระบวนการเพิ่มเติมในการขอรับการสนับสนุนสภาพคล่องโดยการขายหน่วยลงทุน
ของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตามข้อ 4.1 4.4.2 4.5.2 และ 4.5.3 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่
กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จึงออกประกาศเพื่อกำหนดหลักเกณฑ์เพิ่มเติม
ในการขอรับการสนับสนุนทางการเงินโดยการขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้
โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน

2. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ให้ใช้บังคับกับผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินตามระเบียบ
ธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงิน
ที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

3. ยกเลิก

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 20/2563 เรื่อง กระบวนการเพิ่มเติม
ในการขอรับการสนับสนุนสภาพคล่องโดยการขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมี
สัญญาว่าจะซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับ
สถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563

4. เนื้อหา

4.1 ให้ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินใช้หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้
ตามประเภทดังต่อไปนี้ เพื่อขอรับการสนับสนุนทางการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่
กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

4.1.1 หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ประเภทกองทุนรวมตลาดเงิน
(Money market fund) และกองทุนรวมตราสารหนี้ที่เป็นกองทุนเปิด (Daily fixed income fund)
ที่มีสัดส่วนการลงทุนในสินทรัพย์ดังต่อไปนี้ ไม่ต่ำกว่าร้อยละ 70

(1) เงินสดหรือเงินฝากกระแสรายวันสกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศ

(2) เงินฝากประจำสกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศ

(3) ตัวเงินคลัง และพันธบัตรรัฐบาล

(4) พันธบัตร ธปท.

(5) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่ ธปท. กำหนด ที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน เงินต้นและดอกเบี้ย

(6) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่ ธปท. กำหนด ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน เงินต้นและดอกเบี้ย โดยตราสารหนี้ดังกล่าวหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า A- จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด

(7) ตราสารหนี้ภาคเอกชนสกุลเงินบาท โดยตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า A- จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด

4.1.2 หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ประเภทกองทุนรวมตลาดเงิน (Money market fund) และกองทุนรวมตราสารหนี้ที่เป็นกองทุนเปิด (Daily fixed income fund) ที่ลงทุนในเงินฝากและตราสารหนี้ที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตกลุ่ม Investment Grade ดังต่อไปนี้

(1) เงินสดหรือเงินฝากกระแสรายวันสกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศ

(2) เงินฝากประจำสกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศ

(3) ตัวเงินคลัง และพันธบัตรรัฐบาล

(4) พันธบัตร ธปท.

(5) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่ ธปท. กำหนด ที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน เงินต้นและดอกเบี้ย

(6) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่ ธปท. กำหนด ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน เงินต้นและดอกเบี้ย โดยตราสารหนี้ดังกล่าวหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า BBB- จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด

(7) ตราสารหนี้ภาคเอกชนสกุลเงินบาท โดยตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า BBB- จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด

(8) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดสกุลเงินตราต่างประเทศ โดยตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า BBB- จาก TRIS หรือสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด (Investment Grade)

4.2 ให้ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินทำหนังสือแจ้ง Standard Settlement Instruction (SSI) สำหรับบัญชีหน่วยลงทุน โดยให้นำแบบหนังสือที่กำหนดในข้อ 5.2.2 (9) ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 1/2561 ว่าด้วยการกักเงินจากธนาคารแห่งประเทศไทย ด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกันชั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน มาใช้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือที่กำหนดในข้อ 4.2.2 (9) ของระเบียบนี้โดยอนุโลม

4.3 วิธีการในการซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน และการส่งมอบหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้

ในการส่งมอบหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ระหว่าง ธปท. กับผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน ให้ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน และ ธปท. จัดทำหนังสือคำขอโอนหน่วยลงทุนตามแบบฟอร์มที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าให้ครบถ้วนถูกต้อง และยื่นต่อนายทะเบียนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ เมื่อ ธปท. ได้รับโอนกรรมสิทธิ์ในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ หรือได้รับการยืนยันการโอนกรรมสิทธิ์จากนายทะเบียนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้เป็นลายลักษณ์อักษร ธปท. จะนำเงินบาทเข้าบัญชีเงินฝากของผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน

ในวันครบกำหนดซื้อคืนหรือวันชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด เมื่อผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินชำระราคาซื้อคืนให้กับ ธปท. ได้ครบถ้วน ธปท. จะโอนหน่วยลงทุนคืนให้กับผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน โดยให้ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน และ ธปท. จัดทำหนังสือคำขอโอนหน่วยลงทุนตามแบบฟอร์มที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าให้ครบถ้วนถูกต้อง และยื่นต่อนายทะเบียนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้

4.4 เงินปันผลของหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้

ให้ดำเนินการเช่นเดียวกับการจัดการดอกเบี้ยของตราสารหนี้สกุลเงินบาท ตามที่กำหนดไว้ในระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 1/2561 ว่าด้วยการกักเงินจากธนาคารแห่งประเทศไทยด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกันชั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน รวมถึงประกาศ ธปท. และข้อกำหนดที่เกี่ยวข้อง

4.5 ราคาขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้

ธปท. จะรับซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้จากผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินตามมูลค่าหน่วยลงทุน (NAV) ที่ปรับลดด้วยอัตราส่วนลด (Haircut) รวมทั้งปรับด้วยอัตราค่าตอบแทน และจำนวนวันที่ ธปท. รับซื้อโดยมีสัญญาว่าจะขายคืน ตามเงื่อนไขดังต่อไปนี้

$$\text{ราคาขาย} \leq \text{มูลค่ารวมของ} \left(\frac{\text{มูลค่าหน่วยลงทุน}}{(1 + \text{อัตราส่วนลด}) \times (1 + (\text{อัตราค่าตอบแทน} \times \frac{\text{จำนวนวัน}^{1/}}{365}))} \right)$$

ราคาขาย หมายถึง จำนวนเงินที่ ธปท. ใช้ในการรับซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน ณ วันเริ่มต้นของธุรกรรม โดย ธปท. จะปิดเศษให้เหลือเป็นหลักล้าน

อัตราค่าตอบแทน หมายถึง อัตราค่าตอบแทนที่ได้ตกลงกันตามการแจ้งผลของ ธปท. ในการอนุมัติทำธุรกรรมแต่ละครั้ง

จำนวนวัน^{1/} หมายถึง จำนวนวันตามที่ ธปท. อนุมัติทำธุรกรรมแต่ละครั้ง

ทั้งนี้ ราคาและอัตราส่วนลดให้เป็นไปตามที่กำหนดไว้ในประกาศ ธปท. ที่ สกง. 24/2563 เรื่อง กำหนดอัตราส่วนลดเพื่อประเมินราคาขายสินทรัพย์และคำนวณมูลค่าสินทรัพย์กรณีสิ้นสุดสิทธิซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้

4.6 ราคาซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ ณ วันชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด หรือ ณ วันครบกำหนด

$$\text{ราคาซื้อคืน} = \left(\text{ราคาขาย} \times (1 + (\text{อัตราค่าตอบแทน} \times \frac{\text{จำนวนวัน}^{2/}}{365})) \right)$$

ราคาซื้อคืน หมายถึง จำนวนเงินที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ ณ วันชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด หรือ ณ วันครบกำหนดซื้อคืน

อัตราค่าตอบแทน หมายถึง อัตราค่าตอบแทนที่ได้ตกลงกันตามการแจ้งผลของ ธปท. ในการอนุมัติทำธุรกรรมแต่ละครั้ง

จำนวนวัน^{2/} หมายถึง จำนวนวันนับตั้งแต่วันที่ ธปท. นำเงินบาทเข้าบัญชีเงินฝากของผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน หรือวันครบกำหนดซื้อคืนของกลุ่มสัญญาเดิมในกรณีการขอกู้ยืมเงินต่อ จนถึงวันครบกำหนดซื้อคืน หรือวันชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด แล้วแต่กรณี

4.7 มูลค่าหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้กรณีสินลธิซื้อคืน

ในกรณีที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินสินลธิซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ ธปท. จะคำนวณมูลค่าหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ตามมูลค่าหน่วยลงทุน (NAV) ที่ปรับลดด้วยอัตราส่วนลดกรณีสินลธิซื้อคืน ตามเงื่อนไขดังต่อไปนี้

$$\text{ราคาขาย} \leq \text{มูลค่ารวมของ} \left[\frac{\text{มูลค่าหน่วยลงทุน}}{(1 + \text{อัตราส่วนลดกรณีสินลธิซื้อคืน})} \right]$$

ทั้งนี้ มูลค่าหน่วยลงทุนและอัตราส่วนลดให้เป็นไปตามที่กำหนดไว้ในประกาศ ธปท. ที่ สกง. 24/2563 เรื่อง กำหนดอัตราส่วนลดเพื่อประเมินราคาขายสินลธิและคำนวณมูลค่าสินลธิกรณีสินลธิซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้

5. บทเฉพาะกาล

ให้ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 20/2563 เรื่อง กระบวนการเพิ่มเติมในการขอรับการสนับสนุนสภาพคล่องโดยการขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ยังมีผลใช้บังคับต่อไปสำหรับธุรกรรมที่เกิดขึ้นแล้วตามประกาศข้างต้นจนกว่าจะมีการปฏิบัติครบถ้วนตามสัญญา

6. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 31 มีนาคม 2563 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563



(นายวิรไท สันติประภพ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ทีมตลาดเงินและตลาดพันธบัตร
ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน
โทรศัพท์ 0 2628 6025-7



ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 24/2563

เรื่อง กำหนดอัตราส่วนลดเพื่อประเมินราคาขายสินทรัพย์และคำนวณมูลค่าสินทรัพย์
กรณีสินทรัพย์ซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่อง
ให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตามข้อ 4.4.3 และ 4.5 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวม
ตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จึงออกประกาศเพื่อกำหนดอัตราส่วนลดในการ
ประเมินมูลค่าสินทรัพย์เพื่อการซื้อสินทรัพย์โดยมีสัญญาเพื่อจะขายคืน และคำนวณมูลค่าสินทรัพย์
กรณีสินทรัพย์ซื้อคืน

2. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ให้ใช้บังคับกับผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินตามระเบียบธนาคาร
แห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความ
ช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

3. ยกเลิก

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 21/2563 เรื่อง กำหนดอัตราส่วนลด
เพื่อประเมินราคาขายสินทรัพย์และคำนวณมูลค่าสินทรัพย์กรณีสินทรัพย์ซื้อคืน ตามระเบียบธนาคาร
แห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่
กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563

4. เนื้อหา

ให้ใช้อัตราส่วนลดของสินทรัพย์ตามรายละเอียดแนบท้ายประกาศฉบับนี้ เพื่อประเมิน
ราคาขายสินทรัพย์และคำนวณมูลค่าสินทรัพย์กรณีสินทรัพย์ซื้อคืนแทนอัตราส่วนลดที่กำหนดใน
รายละเอียดแนบท้ายประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 43/2561 เรื่อง ราคาขายและราคา
ซื้อคืนสินทรัพย์หลักประกัน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการกู้ยืมเงินจากธนาคาร
แห่งประเทศไทยด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกันชั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน และรายละเอียด
แนบท้ายประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 44/2561 เรื่อง การคำนวณมูลค่าสินทรัพย์
หลักประกันกรณีสถาบันการเงินสินทรัพย์ซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการกู้ยืมเงิน
จากธนาคารแห่งประเทศไทยด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกันชั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน

5. บทเฉพาะกาล

ให้ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 21/2563 เรื่อง กำหนดอัตราส่วนลดเพื่อประเมินราคาขายสินทรัพย์และคำนวณมูลค่าสินทรัพย์กรณีสินทรัพย์ซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ยังมีผลใช้บังคับต่อไปสำหรับธุรกรรมที่ได้เกิดขึ้นแล้วตามประกาศข้างต้นจนกว่าจะมีการปฏิบัติครบถ้วนตามสัญญา

6. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 31 มีนาคม 2563 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563



(นายวิโรฒ สันติประภพ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ทีมตลาดเงินและตลาดพันธบัตร
ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน
โทรศัพท์ 0 2628 6025-7

ประเภทสินทรัพย์เพิ่มเติม	อัตราส่วนลด (ร้อยละ)				ราคาและอัตราแลกเปลี่ยน ²
	อายุคงเหลือ				
	≤ 5 ปี	5 ปี < T ≤ 10 ปี	10 ปี < T ≤ 20 ปี	> 20 ปี	
หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีสัดส่วนการลงทุนในสินทรัพย์ตามเกณฑ์ ธปท. ไม่ต่ำกว่าร้อยละ 70 (ตามประกาศ ธปท. ที่ สกง. 23/2563 ข้อ 4.1.1)	8.5				- มูลค่าหน่วยลงทุนที่เผยแพร่โดย Thai Mutual Fund ในหน้ามูลค่าหน่วยลงทุน (NAV) โดยให้ใช้มูลค่าหน่วยลงทุน ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติวงเงิน/คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอสนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี
หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ที่ลงทุนในเงินฝากและตราสารหนี้ที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตกลุ่ม Investment Grade (ตามประกาศ ธปท. ที่ สกง. 23/2563 ข้อ 4.1.2)	33				- มูลค่าหน่วยลงทุนที่เผยแพร่โดย Thai Mutual Fund ในหน้ามูลค่าหน่วยลงทุน (NAV) โดยให้ใช้มูลค่าหน่วยลงทุน ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติวงเงิน/คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอสนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี
¹ ตราสารหนี้ภาคเอกชนสกุลเงินบาท โดยตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตต่ำกว่า A แต่ไม่ต่ำกว่า BBB- จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด เฉพาะที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 30 ปี ทั้งนี้ ต้องไม่เป็นตราสารหนี้ที่ผู้ออกเกี่ยวข้องกับสถาบันการเงินที่มากู้ยืมเงินจาก ธปท.	15.5	28.5	45.5	55.5	- ราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ในหน้า Mark to Market โดยให้ใช้ราคาตลาด ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติวงเงิน/คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอสนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี

¹ พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตร ธปท. และตราสารหนี้ภาคเอกชนสกุลเงินบาท แบบอัตราดอกเบี้ยลอยตัว ให้ใช้อัตราส่วนลดในอัตราเดียวกับตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือ ≤ 5 ปี

² ในกรณีที่ไม่สามารถเรียกดูราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยน ณ สิ้นวันก่อนหน้าได้ ให้ใช้ราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่มีข้อมูลล่าสุด หรือตามที่ ธปท. จะเห็นสมควร

ประเภทสินทรัพย์หลักประกันตามประกาศ ธปท. ที่ สกง. 41/2561	อัตราส่วนลด (ร้อยละ)				ราคาและอัตราแลกเปลี่ยน ²
	อายุคงเหลือ				
	≤ 5 ปี	5 ปี < T ≤ 10 ปี	10 ปี < T ≤ 20 ปี	> 20 ปี	
1.1 ¹ ตัวเงินคลัง ตัวสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ และ พันธบัตรรัฐบาล 1.5 ¹ พันธบัตร ธปท.	4	8.5	12	14.5	- ราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ในหน้า RP Reference Yield ทั้งนี้ หากไม่มีราคาในหน้าดังกล่าว ให้ใช้ราคาในหน้า Mark to Market โดยให้ใช้ราคาตลาด ณ สิ้นวันทำการ ก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติ วงเงิน/คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอสนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนด ชื้อคืน แล้วแต่กรณี

ประเภทสินทรัพย์หลักประกันตามประกาศ ธปท. ที่ สกง. 41/2561	อัตราส่วนลด (ร้อยละ)				ราคาและอัตราแลกเปลี่ยน ²
	อายุคงเหลือ				
	≤ 5 ปี	5 ปี < T ≤ 10 ปี	10 ปี < T ≤ 20 ปี	> 20 ปี	
1.2 หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่กำหนดใน 3.4 ของประกาศดังกล่าว ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ย	4.5	9	13.5	16.5	- ราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ในหน้า RP Reference Yield ทั้งนี้ หากไม่มีราคาในหน้าดังกล่าว ให้ใช้ราคาในหน้า Mark to Market โดยให้ใช้ราคาตลาด ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติวงเงิน/คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอสนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี
1.3 1.6 ¹ หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่กำหนดใน 3.4 ของประกาศดังกล่าว ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ย โดยตราสารหนี้ดังกล่าวหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า AAA จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด หรือไม่ต่ำกว่าอันดับเครดิตที่เทียบเท่ากับอันดับเครดิตของรัฐบาลไทยตามที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตจาก S&P หรือ Moody's ตราสารหนี้สกุลเงินบาทที่ออกหรือค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ยโดยรัฐบาลประเทศสหรัฐอเมริกา สหราชอาณาจักร ญี่ปุ่น เยอรมนี และฝรั่งเศส และสถาบันการเงินระหว่างประเทศที่ประเทศไทยเป็นสมาชิก โดยประเทศหรือสถาบันการเงินดังกล่าวมีอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่าประเทศไทย เฉพาะที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 30 ปี ทั้งนี้ ต้องเป็นไปตามมาตรการป้องปรามการเก็งกำไรค่าเงินบาท					

ประเภทสินทรัพย์หลักประกันตามประกาศ ธพท. ที่ สกง. 41/2561	อัตราส่วนลด (ร้อยละ)				ราคาและอัตราแลกเปลี่ยน ²
	อายุคงเหลือ				
	≤ 5 ปี	5 ปี < T ≤ 10 ปี	10 ปี < T ≤ 20 ปี	> 20 ปี	
1.4 พันธบัตรหรือตราสารหนี้ที่ออกโดยกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาาระบบสถาบันการเงิน	4.5	9	13.5	16.5	- ราคาตลาดที่ ธพท. ประกาศ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติวงเงิน/คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอสนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี
1.7 เงินตราต่างประเทศ เฉพาะสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ	8				- อัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนประจำวันที่เคยแพร่โดย ธพท. ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติวงเงิน/คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอสนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี
2.1 ตัวสัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง เฉพาะที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 30 ปี	4	8.5	12	14.5	- ราคาหน้าตัว
2.2 หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่กำหนดใน 3.4 ของประกาศดังกล่าวที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ย และตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า A จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธพท. กำหนด หรือเป็นไปตามเงื่อนไขอื่นที่ ธพท. กำหนด เฉพาะที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 30 ปี	5	9	13.5	17	- ราคาตลาดที่เคยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ในหน้า RP Reference Yield ทั้งนี้ หากไม่มีราคาในหน้าดังกล่าว ให้ใช้ราคาในหน้า Mark to Market โดยให้ใช้ราคาตลาด ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติวงเงิน/คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอสนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี

ประเภทหลักทรัพย์หลักประกันตามประกาศ ธปท. ที่ สกง. 41/2561	อัตราส่วนลด (ร้อยละ)				ราคาและอัตราแลกเปลี่ยน ²
	อายุคงเหลือ				
	≤ 5 ปี	5 ปี < T ≤ 10 ปี	10 ปี < T ≤ 20 ปี	> 20 ปี	
2.3 ¹ ตราสารหนี้ภาคเอกชนสกุลเงินบาท โดยตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า A จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด เฉพาะที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 30 ปี ทั้งนี้ ต้องไม่เป็นตราสารหนี้ที่ผู้ออกเกี่ยวข้องกับสถาบันการเงินที่มากู้ยืมเงินจาก ธปท.	8.5	16	25.5	31	- ราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ในหน้า Mark to Market โดยให้ใช้ราคาตลาด ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติวงเงิน/คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอสนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี
2.4 ตัวเงินที่เป็นหลักทรัพย์ เพื่อการระดมทุนจากผู้ลงทุนทั่วไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ กำหนด หรือเป็นตัวเงินที่มีราคาเผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) โดยเป็นตัวเงินที่ผู้ออกหรือสถาบันการเงินผู้อาวุ้ได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า A จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด ทั้งนี้ ต้องไม่เป็นตัวเงินที่ผู้ออก หรือสถาบันการเงินผู้อาวุ้เกี่ยวข้องกับสถาบันการเงินที่มากู้ยืมเงินจาก ธปท.	11				- ราคาหน้าตัว

ประเภทหลักทรัพย์หลักประกันตามประกาศ ธปท. ที่ สกง. 41/2561	อัตราส่วนลด (ร้อยละ)				ราคาและอัตราแลกเปลี่ยน ²
	อายุคงเหลือ				
	≤ 5 ปี	5 ปี < T ≤ 10 ปี	10 ปี < T ≤ 20 ปี	> 20 ปี	
2.5 ตัวเงินคลังและพันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลประเทศ สหรัฐอเมริกา สหราชอาณาจักร ญี่ปุ่น เยอรมนี และฝรั่งเศส ในสกุลเงินของประเทศนั้น เฉพาะที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 30 ปี	26.5	30	40	46.5	- ราคาปิด (Clean price ด้าน Bid) ที่เผยแพร่ในระบบ Bloomberg โดยให้ใช้ราคาปิด ณ สิ้นวันทำการ ก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำสั่งเสนอขออนุมัติ วงเงิน/คำสั่งเสนอขอเบิกเงิน/คำสั่งเสนอขอสนับสนุนทาง การเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวัน ครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี บวกด้วยดอกเบี้ยค้าง รับจนถึงวันส่งมอบ (ถ้ามี) - สำหรับอัตราแลกเปลี่ยนให้ใช้อัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอน ประจำวันที่เผยแพร่โดย ธปท. ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้า วันที่สถาบันการเงินแจ้งคำสั่งเสนอขออนุมัติวงเงิน/ คำสั่งเสนอขอเบิกเงิน/คำสั่งเสนอขอสนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี
2.6 หลักทรัพย์สกุลเงินตราต่างประเทศที่ออกหรือค้ำประกัน เงินต้นและดอกเบี้ยโดยรัฐบาลไทย เฉพาะหลักทรัพย์ สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ ปอนด์สเตอร์ลิง ยูโร และเยน เฉพาะที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 30 ปี	32.5	47.5	69.5	80.5	
2.7 เงินตราต่างประเทศ เฉพาะสกุลเงินปอนด์สเตอร์ลิง ยูโร และเยน	19.5				- อัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนประจำวันที่เผยแพร่โดย ธปท. ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำ เสนอขออนุมัติวงเงิน/คำสั่งเสนอขอเบิกเงิน/คำสั่งเสนอขอ สนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้า วันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี

ประเภทสินทรัพย์หลักประกันตามประกาศ ธปท. ที่ สกง. 41/2561	อัตราส่วนลด (ร้อยละ)				ราคาและอัตราแลกเปลี่ยน ²
	อายุคงเหลือ				
	≤ 5 ปี	5 ปี < T ≤ 10 ปี	10 ปี < T ≤ 20 ปี	> 20 ปี	
2.8 ตัวแลกเปลี่ยน หรือตัวสัญญาใช้เงินที่ออกโดยสถาบันการเงินที่มี กฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่กำหนดใน 3.4 ของประกาศ ดังกล่าว ทั้งนี้ ต้องไม่เป็นตัวแลกเปลี่ยนหรือตัวสัญญาใช้เงิน ที่ออกหรือค้ำประกันโดยสถาบันการเงินที่เกี่ยวข้องกับสถาบัน การเงินที่มากู้ยืมเงินจาก ธปท. และมีกำหนดระยะเวลาใช้เงิน คืนไม่เกิน 3 เดือน	48				- ราคาหน้าตัว
2.9 ตัวเงินคลังและพันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลหรือธนาคารกลาง ประเทศมาเลเซีย ในสกุลเงินริงกิต เฉพาะที่มีอายุคงเหลือ ไม่เกิน 20 ปี	18	24	32	-	- ราคาปิด (Clean price ด้าน Bid) ที่เผยแพร่ในระบบ Bloomberg โดยให้ใช้ราคาปิด ณ สิ้นวันทำการ ก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติ วงเงิน/คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอสนับสนุนทาง การเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวัน ครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี บวกด้วยดอกเบี้ยค้าง รับจนถึงวันส่งมอบ (ถ้ามี) - สำหรับอัตราแลกเปลี่ยนให้ใช้อัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอน ประจำวันที่เผยแพร่โดย ธปท. ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้า วันที่สถาบันการเงินแจ้งคำเสนอขออนุมัติวงเงิน/ คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอสนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี

ประเภทสินทรัพย์หลักประกันตามประกาศ ธปท. ที่ สกง. 41/2561	อัตราส่วนลด (ร้อยละ)				ราคาและอัตราแลกเปลี่ยน ²
	อายุคงเหลือ				
	≤ 5 ปี	5 ปี < T ≤ 10 ปี	10 ปี < T ≤ 20 ปี	> 20 ปี	
2.10 เงินตราต่างประเทศ เฉพาะสกุลเงินริงกิต	12				- อัตราซื้อถั่วเฉลี่ยเงินโอนประจำวันที่เคยแพร่โดย ธปท. ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันที่สถาบันการเงินแจ้งคำ เสนอขออนุมัติวงเงิน/คำเสนอขอเบิกเงิน/คำเสนอขอ สนับสนุนทางการเงินต่อ หรือ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้า วันครบกำหนดซื้อคืน แล้วแต่กรณี