



ฉบับที่ 28/2564

เรื่อง ธปท. แจง Non-Resident สามารถทำธุรกรรม Non-deliverable OIS อ้างอิง THOR ได้

นางสาวชिरา อารมย์ดี ผู้ช่วยผู้ว่าการ สายตลาดการเงิน ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) เปิดเผยว่า นับตั้งแต่เดือนเมษายน ปี 2563 ที่เริ่มมีการเผยแพร่อัตราดอกเบี้ย Thai Overnight Repurchase Rate (THOR) ธปท. ได้เห็นการใช้อัตราดอกเบี้ย THOR เป็นอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงในธุรกรรมการเงินที่หลากหลายมากขึ้น เช่น การกู้ยืมระยะสั้นระหว่างธนาคาร การออกตั๋วสัญญาใช้เงิน หุ้นกู้ หุ้นกู้อนุพันธ์ พันธบัตร ธปท. ประเภทอัตราดอกเบี้ยลอยตัว ขณะเดียวกันตลาดอนุพันธ์ Overnight Index Swap (OIS) ที่อ้างอิง THOR มีพัฒนาการดีขึ้นเป็นลำดับเช่นกัน นอกจากนี้ ยังเริ่มมีธุรกรรมอนุพันธ์ Cross-Currency Swap (CCS) ที่อ้างอิง THOR สำหรับอัตราดอกเบี้ยสกุลบาทด้วย

การที่ผู้ร่วมตลาดใช้อัตราดอกเบี้ย THOR เป็นอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงในธุรกรรมการเงินกันอย่างแพร่หลาย จะช่วยส่งเสริมให้ตลาดอนุพันธ์อ้างอิง THOR มีสภาพคล่องสูงขึ้น ซึ่งจะส่งผลให้การบริหารความเสี่ยงอัตราดอกเบี้ยมีประสิทธิภาพที่ดียิ่งขึ้น อย่างไรก็ตาม แม้ปริมาณธุรกรรม THOR OIS จะมีแนวโน้มเพิ่มขึ้น แต่ตลาดนี้ยังถือว่าอยู่ในช่วงเริ่มต้น และยังคงอาศัยความร่วมมือจากผู้ร่วมตลาดทุกฝ่ายเพื่อการพัฒนาตลาดอย่างยั่งยืน

ในโอกาสนี้ ธปท. จึงขอชี้แจงว่า ผู้ร่วมตลาดที่มีถิ่นที่อยู่นอกประเทศไทย (Non-resident) สามารถทำธุรกรรม THOR OIS ทั้งที่มีการส่งมอบและไม่ส่งมอบเป็นเงินบาท (Non-deliverable) กับสถาบันการเงินภายในประเทศไทยได้ ในลักษณะเดียวกับธุรกรรม Interest Rate Swap (IRS) อื่น ๆ โดยหวังว่าการทำธุรกรรม THOR OIS ของผู้ร่วมตลาดประเภท Non-resident นี้ จะเป็นอีกแรงหนึ่งที่จะช่วยขับเคลื่อนการพัฒนาตลาดอนุพันธ์อ้างอิง THOR ได้เช่นกัน

ธนาคารแห่งประเทศไทย

23 เมษายน 2564

ข้อมูลเพิ่มเติม: ทีมมาตรฐานตลาดการเงิน ฝ่ายตลาดการเงิน

โทรศัพท์: 0 2356 7534

E-mail: referencerate@bot.or.th