



ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สก. 4 /2564

เรื่อง กำหนดการออกพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย

ประจำเดือนมีนาคม พ.ศ. 2564

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อกำหนดแผนการออกพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย ประจำเดือนมีนาคม พ.ศ. 2564

2. อำนาจตามกฎหมาย

เพื่ออนุวัติตามข้อ 2 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สก. 1/2560 ว่าด้วยการออกพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย และที่แก้ไขเพิ่มเติม

3. เนื้อหา

ธนาคารแห่งประเทศไทย ได้กำหนดแผนการประมูลพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย ประจำเดือนมีนาคม พ.ศ. 2564 โดยจะเริ่มประมูลพันธบัตรประเภทอัตราดอกเบี้ยลอยตัว อิงอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงธุรกรรมซื้อคืนระยะข้ามคืน (Thai Overnight Repurchase Rate: THOR) รุ่นอายุ 182 วัน เป็นครั้งแรก วงเงิน 30,000 ล้านบาท และวางแผนประมูลพันธบัตรประเภทใหม่ดังกล่าว อย่างสม่ำเสมอในระยะต่อไป

รุ่นที่	อัตราดอกเบี้ยหน้าตัว (ร้อยละต่อปี)	วงเงิน (ล้านบาท)	ประมูลวันที่	วันที่ชำระเงิน	วันครบ กำหนด	ประเภท อายุ	อายุ คงเหลือ
9/92/64	-	55,000	2 มี.ค. 64	4 มี.ค. 64	4 มิ.ย. 64	92 วัน	92 วัน
3/364/64	-	50,000	2 มี.ค. 64	4 มี.ค. 64	3 มี.ค. 65	364 วัน	364 วัน
10/91/64	-	55,000	9 มี.ค. 64	11 มี.ค. 64	10 มิ.ย. 64	91 วัน	91 วัน
11/91/64	-	55,000	16 มี.ค. 64	18 มี.ค. 64	17 มิ.ย. 64	91 วัน	91 วัน
3/2ปี/2563	0.56	25,000	18 มี.ค. 64	22 มี.ค. 64	23 พ.ย. 65	2 ปี	1.67 ปี
12/91/64	-	55,000	23 มี.ค. 64	25 มี.ค. 64	24 มิ.ย. 64	91 วัน	91 วัน
1/FRB182/64	Compounded THOR + 0.05	30,000	25 มี.ค. 64	29 มี.ค. 64	27 ก.ย. 64	182 วัน	182 วัน
13/91/64	-	55,000	30 มี.ค. 64	1 เม.ย. 64	1 ก.ค. 64	91 วัน	91 วัน

โดยพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย รุ่นที่ 1/FRB182/64 มีรายละเอียด ดังนี้

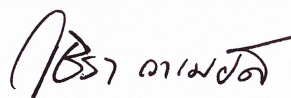
อัตราดอกเบี้ย	Compounded THOR ^{1/} + 0.05% โดย ธปท. จะเผยแพร่ Compounded THOR 5 วันทำการก่อนหน้าวันจ่ายดอกเบี้ย
การจ่ายดอกเบี้ย	ครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดไถ่ถอน
วันกำหนดอัตราดอกเบี้ย	5 วันทำการก่อนหน้าวันจ่ายดอกเบี้ย
วันจ่ายดอกเบี้ย	วันที่ 27 กันยายน 2564
วันครบกำหนดไถ่ถอน	วันที่ 27 กันยายน 2564 เป็นการไถ่ถอนครั้งเดียวเต็มจำนวนที่ออกและจะไม่มี การไถ่ถอนก่อนกำหนด

^{1/} Compounded THOR คือ อัตราดอกเบี้ยแบบทบต้นของอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR ตั้งแต่ 5 วันทำการก่อนหน้าวันเริ่มงวดการจ่ายดอกเบี้ย จนถึง 5 วันทำการก่อนหน้าวันเริ่มงวดการจ่ายดอกเบี้ยถัดไปหรือวันไถ่ถอนพันธบัตร (5-day backward shifted observation period)

4. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 1 มีนาคม 2564

ประกาศ ณ วันที่ 25 กุมภาพันธ์ 2564



(นางสาวชिरา อารมย์ดี)

ผู้ช่วยผู้ว่าการ สายตลาดการเงิน

ผู้ว่าการแทน

ธนาคารแห่งประเทศไทย

งานกลยุทธ์ตลาดการเงิน

โทรศัพท์ 0 2356 7529