



ธนาคารแห่งประเทศไทย

ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรข. 2/2566

ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน
(แก้ไขเพิ่มเติม ครั้งที่ 3)

1. เหตุผลในการออกระเบียบ

เพื่อกำหนดเงื่อนไขเพิ่มเติม กรณีสถาบันการเงินนำตราสารหนี้บางประเภทมาเป็นหลักประกัน ทำธุรกรรมกับธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) โดยห้ามนำตราสารหนี้ที่ตนเองเป็นผู้ออกหรือผู้ค้ำประกัน มาเป็นหลักประกัน เพื่อป้องกันความเสี่ยงด้านเครดิต (Wrong-way risk) และเพื่อให้เป็นมาตรฐานเดียวกับการรับหลักประกันในเครื่องมือการดำเนินการของ ธปท. ผ่านตลาดการเงิน (Open market operations)

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 44 และมาตรา 45 แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551

3. แก้ไข

ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สรข. 2/2552 ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน ลงวันที่ 16 พฤศจิกายน 2552 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

4. ขอบเขตการบังคับใช้

ระเบียบนี้ให้ใช้บังคับกับสถาบันการเงินที่ได้ทำหนังสือแสดงความตกลงขอรับประโยชน์ และผูกพันตนตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน ลงวันที่ 16 พฤศจิกายน 2552

5. เนื้อหา

ให้ยกเลิกนิยามคำว่า “ตราสารหนี้” แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สรข. 2/2552 ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน ลงวันที่ 16 พฤศจิกายน 2552 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สรข. 1/2558 ว่าด้วยการรับซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวัน (แก้ไขเพิ่มเติม ครั้งที่ 2) ลงวันที่ 6 พฤษภาคม 2558 และให้ใช้นิยามต่อไปนี้แทน

“ตราสารหนี้” หมายความว่า ตราสารหนี้สำหรับขายโดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืน เพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวันในระบบบาทเน็ต ดังนี้

- (1) ตัวเงินคลัง ตัวสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ และพันธบัตรรัฐบาล
- (2) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่ ธปท. กำหนด ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ย

- (3) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่ ธปท. กำหนด ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน เงินต้นและดอกเบี้ย โดยตราสารหนี้ดังกล่าวหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า AAA จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด หรือไม่ต่ำกว่าอันดับเครดิตที่เทียบเท่ากับอันดับเครดิตของรัฐบาลไทยตามที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตจาก S&P หรือ Moody's
- (4) พันธบัตรหรือตราสารหนี้ที่ออกโดยกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน
- (5) พันธบัตร ธปท.
- (6) พันธบัตรหรือตราสารหนี้อื่นใดที่ ธปท. เห็นสมควร

โดย หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้ตาม (2) และ (3) ของนิยามคำว่าตราสารหนี้ต้องออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ดังต่อไปนี้

1. รัฐวิสาหกิจที่ขึ้นทะเบียนกับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) โดยระบุประเภทผู้ออก (Bond Type by Issuer) เป็นประเภทรัฐวิสาหกิจ (State Own Enterprise)
2. ธนาคารออมสิน
3. ธนาคารอาคารสงเคราะห์
4. ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร
5. ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย
6. ธนาคารพัฒนาวิสาหกิจขนาดกลางและขนาดย่อมแห่งประเทศไทย
7. บริษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย

ทั้งนี้ กรณีที่สถาบันการเงิน นำหุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้ตาม (2) และ (3) ของนิยามคำว่าตราสารหนี้มาทำธุรกรรมขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าผู้ขายจะซื้อคืนเพื่อเป็นเงินสภาพคล่องระหว่างวันในระบบบาทเนตกับ ธปท. หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้ดังกล่าวจะต้องมีใช้หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยสถาบันการเงินรายนั้น”

6. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 25 ธันวาคม 2566 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 25 ธันวาคม 2566



(นายเศรษฐพุฒิ สุทธิวิธาทนฤพุมิ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ส่วนจัดการชำระเงิน

ฝ่ายการชำระเงินและพันธบัตร

โทรศัพท์ 0 2283 5045