



ธนาคารแห่งประเทศไทย

ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 1/2564

ว่าด้วยการออกพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (แก้ไขเพิ่มเติมครั้งที่ 1)

1. เหตุผลในการออกระเบียบ

เพื่อให้การดำเนินนโยบายการเงินโดยการออกพันธบัตรเป็นไปอย่างเหมาะสมและครอบคลุมการออกพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยประเภทอัตราดอกเบี้ยลอยตัว อิงอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงใหม่ คือ อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงธุรกรรมซื้อคืนระยะข้ามคืน (Thai Overnight Repurchase Rate หรือ อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR)

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามมาตรา 33 (5) และ (6) แห่งพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย พุทธศักราช 2485 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551

3. แก้ไข

ระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 1/2560 ว่าด้วยการออกพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย ลงวันที่ 17 มีนาคม 2560

4. เนื้อหา

4.1 เพิ่มนิยามดังต่อไปนี้เป็นคำนิยามในข้อ 1 ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 1/2560 ว่าด้วยการออกพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย ลงวันที่ 17 มีนาคม 2560 ต่อท้ายนิยามคำว่า “ผู้ถือกรรมสิทธิ์”

“อัตราดอกเบี้ย Compounded THOR” หมายถึง อัตราดอกเบี้ยที่ได้จากการนำอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR ในช่วงเวลาที่กำหนดสำหรับงวดดอกเบี้ย มาคำนวณแบบคิดทบ (compounding in arrears) ทั้งนี้ ตามวิธีการคำนวณอัตราดอกเบี้ย Compounded THOR สำหรับพันธบัตรประเภทอัตราดอกเบี้ยลอยตัวที่ ธปท. ประกาศกำหนด”

4.2 ยกเลิกความในข้อ 4 และข้อ 5 ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 1/2560 ว่าด้วยการออกพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย ลงวันที่ 17 มีนาคม 2560 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 4 พันธบัตรประเภทที่จำหน่ายเป็นส่วนลด อายุไม่เกินหนึ่งปี จะจำหน่ายในราคาที่ตราไว้หักด้วยส่วนลด ผู้ถือกรรมสิทธิ์จะได้รับเงินไถ่ถอนเท่ากับราคาที่ตราไว้

ข้อ 5 พันธบัตรประเภทอัตราดอกเบี้ยคงที่ อายุเกินกว่าหนึ่งปี และพันธบัตรประเภทอัตราดอกเบี้ยลอยตัว ทุกรุ่นอายุ มีวิธีคำนวณและจ่ายดอกเบี้ย ดังนี้

5.1 ประเภทอัตราดอกเบี้ยคงที่ อายุเกินกว่าหนึ่งปี คำนวณดอกเบี้ยจากราคาตราของพันธบัตรตามอัตราดอกเบี้ย และแบ่งจ่ายดอกเบี้ยตามที่ ธปท. ประกาศกำหนดสำหรับพันธบัตรแต่ละรุ่นเป็นจำนวนเงินงวดละเท่า ๆ กัน เศษของหนึ่งสตางค์ให้ปัดทิ้ง โดยดอกเบี้ยงวดสุดท้าย

จะจ่าย ณ วันไถ่ถอนพันธบัตร ทั้งนี้ หากวันกำหนดจ่ายดอกเบี้ยพันธบัตรประเภทอัตราดอกเบี้ยคงที่ ตรงกับวันหยุดทำการของ ธพท. จะเลื่อนไปจ่ายในวันทำการถัดไป

5.2 ประเภทอัตราดอกเบี้ยลอยตัว จำนวนดอกเบี้ยจากราคาตราของ พันธบัตรตามอัตราดอกเบี้ย Compounded THOR และส่วนต่างที่ ธพท. ประกาศกำหนด (ถ้ามี) โดยจ่ายเป็นสัดส่วนของจำนวนวันในงวดดอกเบี้ยต่อ 365 วัน เศษของหนึ่งสตางค์ให้ปัดทิ้ง

5.2.1 รุนอายุไม่เกินหนึ่งปี จะจ่ายดอกเบี้ยครั้งเดียว ณ วันไถ่ถอน พันธบัตร

5.2.2 รุนอายุเกินกว่าหนึ่งปี จะแบ่งจ่ายดอกเบี้ยตามที่ ธพท. ประกาศ กำหนดสำหรับพันธบัตรแต่ละรุ่น โดยดอกเบี้ยงวดสุดท้ายจะจ่าย ณ วันไถ่ถอนพันธบัตร

หากวันกำหนดจ่ายดอกเบี้ยพันธบัตรประเภทอัตราดอกเบี้ยลอยตัว ตรงกับวันหยุดทำการของ ธพท. จะเลื่อนไปจ่ายในวันทำการถัดไป โดยสำหรับการเลื่อนวันกำหนดจ่าย ดอกเบี้ยของพันธบัตรประเภทอัตราดอกเบี้ยลอยตัวอายุเกินกว่าหนึ่งปี จะคำนวณดอกเบี้ยจนถึงวัน กำหนดจ่ายดอกเบี้ยที่เลื่อนออกไปใหม่ด้วย ยกเว้นดอกเบี้ยงวดสุดท้าย

ทั้งนี้ การจ่ายดอกเบี้ยในแต่ละงวด จะจ่ายให้แก่ผู้ถือกรรมสิทธิ์ตามรายชื่อ ณ สิ้นวันทำการสุดท้ายก่อนวันปิดสมุดทะเบียนเพื่อจ่ายดอกเบี้ยตามที่นายทะเบียนประกาศกำหนด”

5. บทเฉพาะกาล

ให้นำความในข้อ 5 ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 1/2560 ว่าด้วยการออกพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย ลงวันที่ 17 มีนาคม 2560 และประกาศ ธพท. ที่ออกตาม ระเบียบข้างต้นในส่วนที่เกี่ยวข้อง มาใช้บังคับกับพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยประเภทอัตราดอกเบี้ย ลอยตัวที่ออกตามความเดิมในระเบียบข้างต้นต่อไป จนกว่าพันธบัตรดังกล่าวจะครบกำหนดไถ่ถอน

6. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 15 มีนาคม 2564 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 11 มีนาคม 2564



(นายเศรษฐพุฒิ สุทธิวาทนฤพุฒิ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

งานกลยุทธ์ตลาดการเงิน

ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน

โทรศัพท์ 0 2356 7529