



เรื่อง ประเภทตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย
ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตาม 5.1 และ 5.4.1 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2560 ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง ลงวันที่ 21 มีนาคม 2560 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จึงออกประกาศเพื่อกำหนดตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศที่สมาชิกตามระเบียบฉบับดังกล่าว สามารถนำมาขายโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง และเพื่อกำหนดลำดับและเงื่อนไขอื่น ๆ ในการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศ รวมถึงกำหนดเงื่อนไขเพิ่มเติมเพื่อป้องกันความเสี่ยงด้านเครดิต ในกรณีสมาชิกเป็นผู้ออกหรือเป็นผู้ค้ำประกันตราสารหนี้ตัวเอง (Wrong-way risk)

2. ยกเลิก

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 21/2560 เรื่อง ประเภทตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง ลงวันที่ 21 มีนาคม 2560

3. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ให้ใช้บังคับกับสมาชิกตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2560 ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง ลงวันที่ 21 มีนาคม 2560 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

4. เนื้อหา

4.1 สมาชิกสามารถนำตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศดังต่อไปนี้ มาขายโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2560 ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง ลงวันที่ 21 มีนาคม 2560 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

- (1) ตัวเงินคลัง ตัวสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ และพันธบัตรรัฐบาล
- (2) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่กำหนดใน 4.3 ที่กระทรวงการคลังค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ย
- (3) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่กำหนดใน 4.3 ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ย

โดยตราสารหนี้ดังกล่าวหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า AAA จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด หรือไม่ต่ำกว่าอันดับเครดิตที่เทียบเท่ากับอันดับเครดิตของรัฐบาลไทยตามที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตจาก S&P หรือ Moody's

(4) พันธบัตรหรือตราสารหนี้ที่ออกโดยกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน

(5) พันธบัตร ธปท.

(6) เงินตราต่างประเทศ เฉพาะสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ

(7) ตัวเงินคลังและพันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลประเทศญี่ปุ่น ที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 30 ปี หรือตัวเงินคลังและพันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลหรือธนาคารกลางประเทศมาเลเซียที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 20 ปี ในสกุลเงินของประเทศนั้น

ในกรณีตัวเงินคลังและพันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลประเทศญี่ปุ่น สมาชิกจะต้องเป็นผู้ที่ได้รับการยกเว้นไม่ต้องเสียภาษีจากรายได้ดอกเบี้ยที่ได้รับจากตัวเงินคลังและพันธบัตรดังกล่าวภายใต้กฎหมายภาษีของประเทศญี่ปุ่น และตัวเงินคลังและพันธบัตรดังกล่าวจะต้องโอนมาจากบัญชีที่ได้รับการยกเว้นไม่ต้องเสียภาษี (Non-taxable Account)

(8) เงินตราต่างประเทศ เฉพาะสกุลเงินเยนและริงกิต

ทั้งนี้ เงินตราต่างประเทศตาม 4.1 (6) และ 4.1 (8) ข้างต้น ให้เฉพาะสมาชิกที่เป็นสถาบันการเงิน ตามพระราชบัญญัติธุรกิจสถาบันการเงิน พ.ศ. 2551 เท่านั้น ที่จะสามารถนำมาขายโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่องกับ ธปท. ได้ สมาชิกที่เป็นสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น หรือนิติบุคคลอื่นที่ ธปท. กำหนด ไม่สามารถนำเงินตราต่างประเทศดังกล่าวมาขายได้

4.2 สมาชิกจะต้องนำตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศตาม 4.1 (1) ถึง 4.1 (6) มาขายให้ ธปท. จนหมดสิ้นก่อน จึงจะสามารถนำตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศตาม 4.1 (7) และ 4.1 (8) ตามลำดับ มาทำธุรกรรมดังกล่าวกับ ธปท. ได้ ทั้งนี้ เงื่อนไขและลำดับในการรับซื้อตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศให้เป็นไปตามที่ ธปท. จะเห็นสมควร

4.3 หุ่นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้ ที่สมาชิกสามารถนำมาขายได้ตาม 4.1 (2) และ 4.1 (3) ต้องออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ดังต่อไปนี้

(1) รัฐวิสาหกิจที่ขึ้นทะเบียนกับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) โดยระบุประเภทผู้ออก (Bond Type by Issuer) เป็นประเภทรัฐวิสาหกิจ (State Own Enterprise)

(2) ธนาคารออมสิน

(3) ธนาคารอาคารสงเคราะห์

(4) ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร

(5) ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย

(6) ธนาคารพัฒนาวิสาหกิจขนาดกลางและขนาดย่อมแห่งประเทศไทย

(7) บริษัทตลาดรองสินเชื่อบริษัท

4.4 กรณีที่สมาชิกรายหนึ่งนำหุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้ตาม 4.1 (2) และ 4.1 (3) มาขาย โดยมีสัญญาจะซื้อคืนกับ ธปท. หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้ดังกล่าวจะต้องมีใช้ หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยสมาชิกรายนั้น

5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 31 มกราคม 2563 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 29 มกราคม 2563



(นายวิรไท สันติประภพ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่มตลาดเงินและตลาดพันธบัตร
ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน
โทรศัพท์ 0 2628 6025-7