



## ธนาคารแห่งประเทศไทย

### ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 5/2563

เรื่อง การคำนวณมูลค่าตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศกรณีสมาชิกสันสิทธิซื้อคืน  
ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศ  
โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง

#### 1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตาม 5.5.5 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2560 ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง ลงวันที่ 21 มีนาคม 2560 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จึงออกประกาศเพื่อกำหนดมูลค่าตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศกรณีสมาชิกสันสิทธิซื้อคืนตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศ โดยปรับปรุงการคำนวณมูลค่าตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศกรณีสมาชิกสันสิทธิซื้อคืนให้สอดคล้องกับพิธีปฏิบัติของตลาดสากล

#### 2. ยกเลิก

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 25/2560 เรื่อง การคำนวณมูลค่าตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศกรณีสมาชิกสันสิทธิซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง ลงวันที่ 21 มีนาคม 2560

#### 3. ขอบเขตการบังคับใช้

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

#### 4. เนื้อหา

ในกรณีสมาชิกสันสิทธิซื้อคืนตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศตามระเบียบดังกล่าว ธปท. จะคำนวณมูลค่าตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศดังกล่าวตามราคาตลาด ดังนี้

(1) ตราสารหนี้สกุลเงินบาท

$$\text{มูลค่าตราสารหนี้} = \text{มูลค่ารวมของ} \left( \text{ราคาตลาดของตราสารหนี้} \right)$$

## (2) ตราสารหนี้สกุลเงินต่างประเทศ

$$\text{มูลค่าตราสารหนี้} = \text{มูลค่ารวมของ} \left[ \text{ราคาตลาดของตราสารหนี้} \times \text{อัตราแลกเปลี่ยน} \right]$$

## (3) เงินตราต่างประเทศ

$$\text{มูลค่าเงินตราต่างประเทศ} = \text{มูลค่ารวมของ} \left[ \text{เงินตราต่างประเทศ} \times \text{อัตราแลกเปลี่ยน} \right]$$

ทั้งนี้ ธปท. กำหนดราคาตลาดของตราสารหนี้และอัตราแลกเปลี่ยน โดยมีรายละเอียดตามแนบท้ายประกาศฉบับนี้

## 5. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 31 มกราคม 2563 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 29 มกราคม 2563



(นายวิรไท สันติประภพ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่มตลาดเงินและตลาดพันธบัตร  
ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน  
โทรศัพท์ 0 2628 6025-7

ประเภทตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศตามประกาศ สปท. ที่ สกง. 4/2563	ราคาและอัตราแลกเปลี่ยน
(1) <sup>1/</sup> ตัวเงินคลัง คำสัญญาใช้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ และพันธบัตรรัฐบาล (5) <sup>1/</sup> พันธบัตร สปท.	- ราคาตลาดที่เผยแพร่โดยสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) (หน้า RP Reference Yield) โดยใช้ราคาตลาด ณ สิ้นวันทำการ ก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน
(2) <sup>2/</sup> หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายจัดตั้งขึ้น ตามที่กำหนดใน 4.3 ของประกาศดังกล่าว ที่กระทรวงการคลังกำกับระกันเงินต้นและดอกเบี้ย (3) <sup>2/</sup> หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ตามที่กำหนดใน 4.3 ของประกาศดังกล่าว ที่กระทรวงการคลังไม่กำกับระกันเงินต้นและดอกเบี้ย โดย ตราสารหนี้ดังกล่าวหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า AAA จาก TRIS หรืออันดับเครดิต ที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ สปท. กำหนด หรือไม่ต่ำกว่าอันดับเครดิตที่เทียบเท่ากับ อันดับเครดิตของรัฐบาลไทยตามที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตจาก S&P หรือ Moody's	- ราคาตลาดที่ สปท. ประกาศ ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน
(4) พันธบัตรหรือตราสารหนี้ที่ออกโดยกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน	- อัตราซื้อถั่วเฉลี่ยเงินโอนประจำวันที่เผยแพร่โดย สปท. ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน
(6) <sup>3/</sup> เงินตราต่างประเทศ / สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐ	- ราคาปิด (Clean price Bid) ต่ำน (Bloomberg) ที่เผยแพร่ในระบบ Bloomberg โดยใช้เวลาปิด ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืนบวกด้วย ดอกเบี้ยค้างรับจนถึงวันส่งมอบ (ถ้ามี)
(7.1) ตัวเงินคลังและพันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลประเทศญี่ปุ่น ในสกุลเงินเยน ที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 30 ปี	- สำหรับอัตราแลกเปลี่ยนให้ใช้ตราซื้อถั่วเฉลี่ยเงินโอนประจำวันที่เผยแพร่โดย สปท. ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน
(7.2) ตัวเงินคลังและพันธบัตรที่ออกโดยรัฐบาลหรือธนาคารกลางประเทศมาเลเซีย ในสกุลเงินริงกิต ที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 20 ปี	- อัตราซื้อถั่วเฉลี่ยเงินโอนประจำวันที่เผยแพร่โดย สปท. ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน
(8.1) <sup>3/</sup> เงินตราต่างประเทศ สกุลเยน	ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน
(8.2) <sup>3/</sup> เงินตราต่างประเทศ สกุลริงกิต	ณ สิ้นวันทำการก่อนหน้าวันครบกำหนดซื้อคืน

<sup>1/</sup> พันธบัตรรัฐบาล และพันธบัตร สปท. แบบอัตราดอกเบี้ยลอยตัว ให้ใช้ตราส่วนเสดในอัตราเดียวกับตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือ ≤ 5 ปี

<sup>2/</sup> กรณีหุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้ตาม (2) และ (3) ที่สมาชิกนำมาขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืนกับ สปท. จะต้องมิใช่ หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้ที่ออกหรือคำประกันโดยสมาชิกหรายน

<sup>3/</sup> กรณีเงินตราต่างประเทศ ให้เฉพาะสมาชิกที่เป็นสมาชิกการเงิน ตามพระราชบัญญัติธุรกิจสถาบันการเงิน พ.ศ. 2551 เท่านั้น ที่สามารถนำมาขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่องได้ ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2560 ว่าด้วยการขายตราสารหนี้และเงินตราต่างประเทศโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืนเพื่อบริหารสภาพคล่อง ลงวันที่ 21 มีนาคม 2560 และที่แก้ไขเพิ่มเติม