



27 กรกฎาคม 2565

เรียน ผู้จัดการ

ธนาคารพาณิชย์ทุกแห่ง

สถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่ง

ที่ ผขอ.ว. 50/2565 เรื่อง การรายงานข้อมูลการทำธุรกรรม THBFX-THOR Basis Swap
ในชุดข้อมูลด้านตลาดเงิน (DMS FM)

ตามหนังสือเวียนที่ ธพท.ผตง.(41) 623/2564 เรื่องแนวปฏิบัติในการทำธุรกรรมอ้างอิง อัตราดอกเบี้ย THOR และอัตราดอกเบี้ย THBFX วันที่ 29 มิถุนายน 2564 เพื่อรองรับการยุติการเผยแพร่อัตราดอกเบี้ย THBFX และอัตราดอกเบี้ย USD LIBOR หลังจาก 30 มิถุนายน 2566 ซึ่งธนาคารแห่งประเทศไทย (ธพท.) และคณะกรรมการธนาคารพาณิชย์ได้เตรียมความพร้อม โดยสนับสนุนให้ผู้ร่วมตลาดเร่งเปลี่ยนผ่านสัญญาค้างจากการอ้างอิง THBFX เป็น THOR ด้วยราคาตลาดจากธุรกรรม THBFX-THOR Basis Swap นั้น

ในการนี้ ธพท. จึงขอความร่วมมือธนาคารพาณิชย์และสถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่งรายงานข้อมูลการทำธุรกรรม THBFX-THOR Basis Swap ในชุดข้อมูล Cross Currency and Interest Rate Swap Arrangement (DS_SWA) ที่ Element ชื่อ Description เพื่อให้ ธพท. สามารถติดตามความคืบหน้าในการเปลี่ยนผ่านได้อย่างมีประสิทธิภาพ โดยเริ่มรายงานตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม 2565 เป็นต้นไป ดังนี้

1. ธุรกรรม THBFX Interest Rate Swap (IRS) และ THOR Overnight Index Swap (OIS) ที่เป็นส่วนหนึ่งของธุรกรรม THBFX-THOR Basis Swap ให้ระบุคำว่า “THBFX-THOR” เป็นอักษรตัวพิมพ์ใหญ่

2. ธุรกรรม THOR Overnight Index Swap (OIS) ที่ไม่เป็นส่วนหนึ่งของธุรกรรม THBFX-THOR Basis Swap ให้ระบุคำว่า “THOR” เป็นอักษรตัวพิมพ์ใหญ่

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

(นายวันประชา เชาวลิตวงศ์)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายบริหารข้อมูลและดาต้าอานาไลติกส์

ผู้ว่าการแทน

งานข้อมูลตลาดการเงิน ฝ่ายบริหารข้อมูลและดาต้าอานาไลติกส์

โทรศัพท์ 0 2283 5173, 0 2356 7411, 0 2356 7724

วิสัยทัศน์ เป็นองค์กรที่มองไกล มีหลักการ และร่วมมือ เพื่อความเป็นอยู่ที่ดีอย่างยั่งยืนของไทย