



เรียน ผู้จัดการ

สถาบันการเงินทุกแห่ง

สถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่ง

ที่ ผขอ.(ว)๕๓/2563 เรื่อง ขอความร่วมมือการรายงานข้อมูลอัตราดอกเบี้ย  
อ้างอิงเพิ่มเติมในชุดข้อมูลด้านตลาดการเงิน (DMS FM)

ตามที่อัตราดอกเบี้ย LIBOR จะยุติบทบาทการเป็นอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงในตลาดการเงินโลก ส่งผลกระทบกับประเทศไทยที่มีการนำอัตราดอกเบี้ย LIBOR มาใช้ในการคำนวณอัตราดอกเบี้ย THBFIX ดังนั้น ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) และผู้ร่วมตลาดจึงได้พัฒนาอัตราดอกเบี้ย THOR หรือ Thai Overnight Repurchase Rate ซึ่งคำนวณจากอัตราดอกเบี้ยกู้ยืมระยะข้ามคืนระหว่างธนาคารในตลาดซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชน เพื่อใช้เป็นอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงใหม่สำหรับใช้ในธุรกรรมการเงิน เช่น สินเชื่อ หนี้อุกู้ และตราสารอนุพันธ์

ธปท. จึงขอความร่วมมือธนาคารพาณิชย์และสถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่ง นำส่งข้อมูลการทำสัญญาตราสารอนุพันธ์ที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ย (Interest Derivatives) และการทำสัญญาสินเชื่อเงินตราต่างประเทศที่มีการอ้างอิงอัตราดอกเบี้ย THOR หรืออัตราดอกเบี้ยอ้างอิงในต่างประเทศ (ที่ไม่ได้แสดงใน Classification Interest Rate Type) ที่ชุดข้อมูล (Data Set) บนระบบงาน DMS FM จำนวน 3 ชุดข้อมูล ตามรายการด้านล่าง ตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2563 เป็นต้นไป เพื่อให้ ธปท. สามารถติดตามพัฒนาการการใช้อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงดังกล่าวและใช้ในการประเมินผลกระทบของการเปลี่ยนแปลงวัฏจักรอัตราดอกเบี้ยที่มีผลต่อตลาดการเงินไทย

1. Foreign Currency Loan Arrangement (DS\_FLA)
2. Forward Rate Agreement Arrangement (DS\_FRA)
3. Cross Currency and Interest Rate Swap Arrangement (DS\_SWA)

โดยการรายงานข้อมูลอัตราดอกเบี้ย THOR และ อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงในต่างประเทศที่ชุดข้อมูลดังกล่าว ให้รายงานที่ Element Interest Rate Type สำหรับ DS\_FLA , DS\_FRA และที่ Element Payment Interest Rate Type และ Received Interest Rate Type สำหรับ DS\_SWA ซึ่งอ้างอิงรายละเอียดจาก Classification Interest Rate Type โดยระบุรหัส 162038 (Others) และระบุประเภทดอกเบี้ยที่ Element Description เป็นอักษรภาษาอังกฤษตัวพิมพ์ใหญ่ติดกัน อาทิ THOR SOFR SONIA SARON ESTR TONA เป็นต้น ทั้งนี้สามารถอ้างอิงการรายงานข้อมูลของทั้ง 3 ชุดได้จากเอกสาร FM Data Set Manual และ DMS Classification Document ซึ่งเผยแพร่ที่ [www.bot.or.th](http://www.bot.or.th) ภายใต้สัถิตี> การรับส่งข้อมูลกับ ธปท.> แบบรายงานและเอกสารชี้แจง ข้อมูลสถาบันการเงิน> ข้อมูลสถาบันการเงิน (Data set)



ธนาคารแห่งประเทศไทย

รพท. หวังเป็นอย่างยิ่งว่าจะได้รับความร่วมมือเป็นอย่างดี และขอขอบคุณ  
เป็นอย่างสูงมา ณ โอกาสนี้

ขอแสดงความนับถือ

(นายวันประชา เชาวลิทวงศ์)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายบริหารข้อมูลและดาต้าอานาไลติกส์  
ผู้ว่าการแทน

ทีมข้อมูลตลาดการเงิน  
สำนักจัดการข้อมูล ฝ่ายบริหารข้อมูลและดาต้าอานาไลติกส์  
โทรศัพท์ 0 2283 5119