



ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สกง. 23/2563

เรื่อง กระบวนการเพิ่มเติมในการขอรับการสนับสนุนสภาพคล่องโดยการขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้

1. เหตุผลในการออกประกาศ

เพื่อให้เป็นไปตามข้อ 4.1 4.4.2 4.5.2 และ 4.5.3 แห่งระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) จึงออกประกาศเพื่อกำหนดหลักเกณฑ์เพิ่มเติมในการขอรับการสนับสนุนทางการเงินโดยการขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน

2. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ให้ใช้บังคับกับผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

3. ยกเลิก

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 20/2563 เรื่อง กระบวนการเพิ่มเติมในการขอรับการสนับสนุนสภาพคล่องโดยการขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563

4. เนื้อหา

4.1 ให้ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินใช้หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ตามประเภทดังต่อไปนี้ เพื่อขอรับการสนับสนุนทางการเงินตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 3/2563 ว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ลงวันที่ 24 มีนาคม 2563 และที่แก้ไขเพิ่มเติม

4.1.1 หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ประเภทกองทุนรวมตลาดเงิน (Money market fund) และกองทุนรวมตราสารหนี้ที่เป็นกองทุนเปิด (Daily fixed income fund) ที่มีสัดส่วนการลงทุนในสินทรัพย์ดังต่อไปนี้ ไม่ต่ำกว่าร้อยละ 70

(1) เงินสดหรือเงินฝากกระแสรายวันสกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศ

(2) เงินฝากประจำสกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศ

(3) ตัวเงินคลัง และพันธบัตรรัฐบาล

(4) พันธบัตร ธปท.

(5) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่ ธปท. กำหนด ที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน เงินต้นและดอกเบีย

(6) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่ ธปท. กำหนด ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน เงินต้นและดอกเบีย โดยตราสารหนี้ดังกล่าวหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า A- จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด

(7) ตราสารหนี้ภาคเอกชนสกุลเงินบาท โดยตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า A- จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด

4.1.2 หน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ประเภทกองทุนรวมตลาดเงิน (Money market fund) และกองทุนรวมตราสารหนี้ที่เป็นกองทุนเปิด (Daily fixed income fund) ที่ลงทุนในเงินฝากและตราสารหนี้ที่ได้รับการจัดอันดับเครดิตกลุ่ม Investment Grade ดังต่อไปนี้

(1) เงินสดหรือเงินฝากกระแสรายวันสกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศ

(2) เงินฝากประจำสกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศ

(3) ตัวเงินคลัง และพันธบัตรรัฐบาล

(4) พันธบัตร ธปท.

(5) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่ ธปท. กำหนด ที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน เงินต้นและดอกเบีย

(6) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นตามที่ ธปท. กำหนด ที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกัน เงินต้นและดอกเบีย โดยตราสารหนี้ดังกล่าวหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า BBB- จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด

(7) ตราสารหนี้ภาคเอกชนสกุลเงินบาท โดยตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า BBB- จาก TRIS หรืออันดับเครดิตที่เทียบเท่าจากสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด

(8) หุ้นกู้ พันธบัตร หรือตราสารหนี้อื่นใดสกุลเงินตราต่างประเทศ โดยตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า BBB- จาก TRIS หรือสถาบันจัดอันดับเครดิตที่ ธปท. กำหนด (Investment Grade)

4.2 ให้ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินทำหนังสือแจ้ง Standard Settlement Instruction (SSI) สำหรับบัญชีหน่วยลงทุน โดยให้นำแบบหนังสือที่กำหนดในข้อ 5.2.2 (9) ของระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 1/2561 ว่าด้วยการกักเงินจากธนาคารแห่งประเทศไทย ด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกันชั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน มาใช้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือที่กำหนดในข้อ 4.2.2 (9) ของระเบียบนี้โดยอนุโลม

4.3 วิธีการในการซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน และการส่งมอบหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้

ในการส่งมอบหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ระหว่าง ธปท. กับผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน ให้ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน และ ธปท. จัดทำหนังสือคำขอโอนหน่วยลงทุนตามแบบฟอร์มที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าให้ครบถ้วนถูกต้อง และยื่นต่อนายทะเบียนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ เมื่อ ธปท. ได้รับโอนกรรมสิทธิ์ในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ หรือได้รับการยืนยันการโอนกรรมสิทธิ์จากนายทะเบียนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้เป็นลายลักษณ์อักษร ธปท. จะนำเงินบาทเข้าบัญชีเงินฝากของผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน

ในวันครบกำหนดซื้อคืนหรือวันชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด เมื่อผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินชำระราคาซื้อคืนให้กับ ธปท. ได้ครบถ้วน ธปท. จะโอนหน่วยลงทุนคืนให้กับผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน โดยให้ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน และ ธปท. จัดทำหนังสือคำขอโอนหน่วยลงทุนตามแบบฟอร์มที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าให้ครบถ้วนถูกต้อง และยื่นต่อนายทะเบียนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้

4.4 เงินปันผลของหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้

ให้ดำเนินการเช่นเดียวกับการจัดการดอกเบี้ยของตราสารหนี้สกุลเงินบาท ตามที่กำหนดไว้ในระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 1/2561 ว่าด้วยการกักเงินจากธนาคารแห่งประเทศไทยด้วยวิธีขายสินทรัพย์หลักประกันชั้นหนึ่งโดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน รวมถึงประกาศ ธปท. และข้อกำหนดที่เกี่ยวข้อง

4.5 ราคาขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้

ธปท. จะรับซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้จากผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินตามมูลค่าหน่วยลงทุน (NAV) ที่ปรับลดด้วยอัตราส่วนลด (Haircut) รวมทั้งปรับด้วยอัตราค่าตอบแทน และจำนวนวันที่ ธปท. รับซื้อโดยมีสัญญาว่าจะขายคืน ตามเงื่อนไขดังต่อไปนี้

$$\text{ราคาขาย} \leq \text{มูลค่ารวมของ} \left(\frac{\text{มูลค่าหน่วยลงทุน}}{(1 + \text{อัตราส่วนลด}) \times (1 + (\text{อัตราค่าตอบแทน} \times \frac{\text{จำนวนวัน}^{1/}}{365}))} \right)$$

ราคาขาย หมายถึง จำนวนเงินที่ ธปท. ใช้ในการรับซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน ณ วันเริ่มต้นของธุรกรรม โดย ธปท. จะปิดเศษให้เหลือเป็นหลักล้าน

อัตราค่าตอบแทน หมายถึง อัตราค่าตอบแทนที่ได้ตกลงกันตามการแจ้งผลของ ธปท. ในการอนุมัติทำธุรกรรมแต่ละครั้ง

จำนวนวัน^{1/} หมายถึง จำนวนวันตามที่ ธปท. อนุมัติทำธุรกรรมแต่ละครั้ง

ทั้งนี้ ราคาและอัตราส่วนลดให้เป็นไปตามที่กำหนดไว้ในประกาศ ธปท. ที่ สกง. 24/2563 เรื่อง กำหนดอัตราส่วนลดเพื่อประเมินราคาขายสินทรัพย์และคำนวณมูลค่าสินทรัพย์กรณีสิ้นสุดสิทธิซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้

4.6 ราคาซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ ณ วันชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด หรือ ณ วันครบกำหนด

$$\text{ราคาซื้อคืน} = \left(\text{ราคาขาย} \times (1 + (\text{อัตราค่าตอบแทน} \times \frac{\text{จำนวนวัน}^{2/}}{365})) \right)$$

ราคาซื้อคืน หมายถึง จำนวนเงินที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ ณ วันชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด หรือ ณ วันครบกำหนดซื้อคืน

อัตราค่าตอบแทน หมายถึง อัตราค่าตอบแทนที่ได้ตกลงกันตามการแจ้งผลของ ธปท. ในการอนุมัติทำธุรกรรมแต่ละครั้ง

จำนวนวัน^{2/} หมายถึง จำนวนวันนับตั้งแต่วันที่ ธปท. นำเงินบาทเข้าบัญชีเงินฝากของผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงิน หรือวันครบกำหนดซื้อคืนของกลุ่มสัญญาเดิมในกรณีการขอกู้ยืมเงินต่อ จนถึงวันครบกำหนดซื้อคืน หรือวันชำระราคาซื้อคืนก่อนครบกำหนด แล้วแต่กรณี

4.7 มูลค่าหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้กรณีสินลธิซื้อคืน

ในกรณีที่ผู้ได้รับการสนับสนุนทางการเงินสินลธิซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ ธปท. จะคำนวณมูลค่าหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้ตามมูลค่าหน่วยลงทุน (NAV) ที่ปรับลดด้วยอัตราส่วนลดกรณีสินลธิซื้อคืน ตามเงื่อนไขดังต่อไปนี้

$$\text{ราคาขาย} \leq \text{มูลค่ารวมของ} \left[\frac{\text{มูลค่าหน่วยลงทุน}}{(1 + \text{อัตราส่วนลดกรณีสินลธิซื้อคืน})} \right]$$

ทั้งนี้ มูลค่าหน่วยลงทุนและอัตราส่วนลดให้เป็นไปตามที่กำหนดไว้ในประกาศ ธปท. ที่ สกง. 24/2563 เรื่อง กำหนดอัตราส่วนลดเพื่อประเมินราคาขายสินลธิและคำนวณมูลค่าสินลธิกรณีสินลธิซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้

5. บทเฉพาะกาล

ให้ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สกง. 20/2563 เรื่อง กระบวนการเพิ่มเติมในการขอรับการสนับสนุนสภาพคล่องโดยการขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน ตามระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยการสนับสนุนสภาพคล่องให้กับสถาบันการเงินที่ให้ความช่วยเหลือแก่กองทุนรวมตราสารหนี้ ยังมีผลใช้บังคับต่อไปสำหรับธุรกรรมที่ได้เกิดขึ้นแล้วตามประกาศข้างต้นจนกว่าจะมีการปฏิบัติครบถ้วนตามสัญญา

6. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ตั้งแต่วันที่ 31 มีนาคม 2563 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563



(นายวิรไท สันติประภพ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ทีมตลาดเงินและตลาดพันธบัตร
ส่วนธุรกิจและกลยุทธ์ตลาดการเงิน
โทรศัพท์ 0 2628 6025-7