



ธนาคารแห่งประเทศไทย

20 กุมภาพันธ์ 2563

เรียน ผู้จัดการ

ธนาคารพาณิชย์ทุกธนาคาร
สถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่ง

ที่ ธปท.ผตง.(41) ว. 236 /2563 เรื่อง ขอความร่วมมือนำเสนอส่งข้อมูลธุรกรรมซื้อคืน
พันธบัตรภาคเอกชนให้กับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยเพื่อการจัดทำอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง

ด้วยธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ร่วมมือกับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (The Thai Bond Market Association: ThaiBMA) อยู่ระหว่างการพัฒนาอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงตลาดซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชน ระยะข้ามคืน (Thai Overnight Repurchase Rate: THOR) เพื่อใช้เป็นอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงสำหรับธุรกรรม ตลาดการเงินไทย โดยมุ่งหวังว่าอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงดังกล่าวจะสะท้อนภาวะตลาดการเงินในประเทศ เป็นที่น่าเชื่อถือ และป้องกันการถูกบิดเบือนได้ ซึ่งการจัดทำและเผยแพร่อัตราดอกเบี้ย THOR จะต้องคำนวณจาก ธุรกรรมในตลาดซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชนระยะข้ามคืน ระหว่างสถาบันการเงิน (Interbank)

ธปท. จึงขอความร่วมมือธนาคารพาณิชย์และสถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่งนำเสนอส่งข้อมูล ธุรกรรมซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชนให้กับ ThaiBMA เพื่อคำนวณอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงดังกล่าว ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2563 เป็นต้นไป ตามแนวทางการนำเสนอส่งดังต่อไปนี้

1. ธนาคารมีหน้าที่นำเสนอส่งข้อมูลธุรกรรมซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชนที่เกิดขึ้นระหว่างเวลา 7.00 น. ถึง 16.00 น. ให้กับ ThaiBMA ภายในเวลา 16.30 น. ของวันทำการเดียวกัน ตามแบบรายงานผ่าน ระบบ One-Stop Reporting System (ORS) ของ ThaiBMA
2. ธนาคารต้องดำเนินการเพื่อให้มั่นใจว่าการนำเสนอส่งข้อมูลมีความถูกต้อง ครบถ้วน โดยใน กรณีที่พบความผิดพลาดของข้อมูลที่นำเสนอ ให้ธนาคารยกเลิกหรือแก้ไขตามขั้นตอนของ ThaiBMA โดยเร็ว

สำหรับธนาคารที่ยังไม่มีระบบการส่งข้อมูลให้ ThaiBMA ขอให้ติดต่อ ฝ่ายกำกับดูแล ThaiBMA ผ่านอีเมล report@thaibma.or.th หรือโทรศัพท์ 0 2257 0357 ต่อ 501 (คุณสุภาวดี)

ธปท. หวังเป็นอย่างยิ่งว่าจะได้รับความร่วมมือเป็นอย่างดี และขอขอบคุณเป็นอย่างสูง มา ณ โอกาสนี้

ขอแสดงความนับถือ

(นางสาวชिरา อารมย์ดี)

ผู้ช่วยผู้จัดการ สายตลาดการเงิน

ผู้ว่าการแทน

ทีมโครงสร้างพื้นฐานตลาดการเงิน

ฝ่ายตลาดการเงิน

โทรศัพท์ 0 2356 7795