

ประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
เรื่อง ข้อกำหนดพื้นฐานด้านงานทะเบียนของตราสารหนี้ชั้นทะเบียน (ฉบับที่ 5)

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 20(2) แห่งข้อบังคับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ลงวันที่ 21 กันยายน 2548 (และที่แก้ไขเพิ่มเติม) ประกอบกับข้อ 5 (3) แห่งประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง การขึ้นทะเบียนข้อมูลตราสารหนี้ ลงวันที่ 5 กุมภาพันธ์ 2551 (และที่แก้ไขเพิ่มเติม) คณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย จึงออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกความในข้อ 5 ของประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง ข้อกำหนดพื้นฐานด้านงานทะเบียนของตราสารหนี้ชั้นทะเบียน ลงวันที่ 10 พฤศจิกายน 2553 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 5 หลักเกณฑ์ในการชำระดอกเบี้ยของตราสารหนี้ชั้นทะเบียนเป็นดังต่อไปนี้

(1) วันชำระดอกเบี้ยในแต่ละงวดให้เป็นวันที่เดียวกันหรือ ณ วันสิ้นเดือน หากกำหนดวันชำระดอกเบี้ยในแต่ละงวดให้เป็นวันที่เดียวกัน ซึ่งตรงกับวันสิ้นเดือนกุมภาพันธ์ ให้กำหนดวันชำระดอกเบี้ย ดังนี้

(ก) กรณีตราสารหนี้กำหนดให้ชำระดอกเบี้ยทุกวันที่ 29 หากปีใดเดือนกุมภาพันธ์มี 28 วัน ให้วันชำระดอกเบี้ยเป็นวันที่ 28 กุมภาพันธ์

(ข) กรณีตราสารหนี้กำหนดให้ชำระดอกเบี้ยทุกวันที่ 30 หากปีใดกุมภาพันธ์มี 28 วัน ให้วันชำระดอกเบี้ยเป็นวันที่ 28 กุมภาพันธ์ หรือหากปีใดกุมภาพันธ์มี 29 วัน ให้วันชำระดอกเบี้ยเป็นวันที่ 29 กุมภาพันธ์

ทั้งนี้ ยกเว้นวันชำระดอกเบี้ยในงวดสุดท้าย ในกรณีที่ที่วันชำระดอกเบี้ยงวดใดตรงกับวันหยุดทำการ ให้เลื่อนเป็นวันทำการถัดไป โดยจะคำนวณดอกเบี้ยถึงวันที่กำหนดไว้เดิมเท่านั้น

(2) วันชำระดอกเบี้ยในงวดสุดท้ายให้เป็นวันที่เดียวกันกับวันไถ่ถอนตราสารหนี้ ในกรณีที่วันชำระดอกเบี้ยงวดสุดท้าย และวันไถ่ถอนตราสารหนี้ตรงกับวันหยุดทำการ ให้เลื่อนเป็นวันทำการถัดไป และในการคำนวณดอกเบี้ยให้รวมจำนวนวันที่เลื่อนออกไปด้วย โดยให้เกณฑ์ 1 ปี มี 365 วัน

กรณีตราสารหนี้ทยอยคืนเงินต้นหรือตราสารหนี้ที่มีการใช้สิทธิไถ่ถอนก่อนกำหนด (Call หรือ Put option) หากวันที่กำหนดไถ่ถอนเงินต้นบางส่วนหรือทั้งจำนวนตรงกับวันหยุดทำการ ให้เลื่อนเป็นวันทำการถัดไปและให้นำจำนวนวันที่เลื่อนออกไป จนถึง (แต่ไม่รวม) วันกำหนดชำระเงินต้นและดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่เลื่อนออกไปมารวมคำนวณดอกเบี้ยด้วย

ข้อ 2 ให้ยกเลิกความในข้อ 7 ของประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง ข้อกำหนดพื้นฐานด้านงานทะเบียนของตราสารหนี้ชั้นทะเบียน ลงวันที่ 10 พฤศจิกายน 2553 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 7 การกำหนดอัตราดอกเบี้ยตามข้อ 6 ให้กำหนดอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงตามเกณฑ์ดังนี้

(1) ในกรณีที่อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงเป็นอัตราดอกเบี้ยเงินฝากและเงินให้สินเชื่อของธนาคารพาณิชย์ และอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงอื่นที่มีลักษณะเดียวกัน เช่น

- อัตราดอกเบี้ยเงินให้สินเชื่อสำหรับลูกค้ารายใหญ่ชั้นดี ประเภทกู้แบบมีระยะเวลา (Minimum Loan Rate : MLR)

- อัตราดอกเบี้ยเงินให้สินเชื่อสำหรับลูกค้ารายใหญ่ชั้นดี ประเภทเงินเบิกเกินบัญชี (Minimum Overdraft Rate: MOR)

- อัตราดอกเบี้ยเงินให้สินเชื่อสำหรับลูกค้ารายย่อยชั้นดี (Minimum Retail Rate : MRR)

- อัตราดอกเบี้ยเงินฝากประจำ (Fix Deposit Rate)

- อัตราดอกเบี้ยเงินฝากออมทรัพย์ (Saving Rate)

โดยอัตราดอกเบี้ยดังกล่าวเป็นอัตรา ณ วันที่กำหนดนั้น

(2) ในกรณีที่อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงเป็นอัตราดอกเบี้ยที่มีการเปลี่ยนค่าเป็นรายวัน เช่น

- Thai Baht Implied Swap Rate

ข้อ 3 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ 10/1 ของประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่องข้อกำหนดพื้นฐานด้านงานทะเบียนของตราสารหนี้ชั้นทะเบียน ลงวันที่ 10 พฤศจิกายน 2553

“ ข้อ 10/1 หมวดที่ 1 ถึงหมวดที่ 3 ในประกาศนี้ ไม่ใช่บังคับกับตราสารหนี้ที่มีการกำหนดอัตราดอกเบี้ยปลายงวด (in arrears) เช่น ตราสารหนี้ที่มีการกำหนดอัตราดอกเบี้ยลอยตัวโดยใช้อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงตลาดซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชนระยะข้ามคืน (Thai Overnight Repurchase Rate (THOR))”

ข้อ 4 ประกาศนี้มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันถัดจากวันประกาศเป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 20 พฤษภาคม พ.ศ. 2564

(ลงนาม) นายสมหมาย ภาษี

(นายสมหมาย ภาษี)

ประธานกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย