

ประกาศธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย  
เรื่อง อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงใหม่เพื่อทดแทนอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง LIBOR และ THBFX  
สำหรับสัญญาสินเชื่อประเภท Trade Finance ในปัจจุบัน (Legacy Contract)

ตามที่หน่วยงานกำกับที่ดูแลการเผยแพร่อัตราดอกเบี้ย LIBOR และ THBFX ได้ประกาศวันยุติการเผยแพร่  
อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงดังกล่าว โดยมีรายละเอียดดังนี้

- ภายหลังจากวันที่ 31 ธันวาคม 2564 ได้ยุติการเผยแพร่อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงดังนี้
  - USD LIBOR ระยะ 1 สัปดาห์ และ 2 เดือน
  - GBP LIBOR, EUR LIBOR, CHF LIBOR และ JPY LIBOR ทุกระยะ
- ภายหลังจากวันที่ 30 มิถุนายน 2566 จะยุติการเผยแพร่อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงดังนี้
  - USD LIBOR ระยะ 1 เดือน, 3 เดือน, 6 เดือน และ 12 เดือน
  - THBFX ทุกระยะ

ในการนี้ ธนาคารจึงขอประกาศอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงใหม่เพื่อทดแทนอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง LIBOR และ  
THBFX สำหรับสัญญาสินเชื่อประเภท Trade Finance ในปัจจุบัน (Legacy Contract) ดังนี้

อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงเดิม	อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงใหม่	วิธีการคำนวณ
THBFX	Prime Rate	-
USD LIBOR	Term SOFR (Secured Overnight Financing Rate) + Credit Spread Adjustment*	-
EUR LIBOR	EURIBOR (Euro Interbank Offered Rate)	-
JPY LIBOR	TIBOR (Tokyo Interbank Offered Rate)	-
GBP LIBOR	Term SONIA (Sterling Overnight Index Average) + Credit Spread Adjustment*	-
CHF LIBOR	Compounded SARON (Swiss Average Rate Overnight) + Credit Spread Adjustment*	5-day lookback with observation shift

หมายเหตุ \* Credit Spread Adjustment เป็นค่าคงที่ที่ตลอดอายุสัญญา โดยมีค่าแตกต่างกันตามสกุลเงินและ Tenor ของอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง LIBOR  
ซึ่งประกาศใช้เป็นมาตรฐานเดียวกันทั้งตลาดการเงินโดย International Swaps and Derivatives Association (ISDA) ตามตารางดังนี้

Tenor	Credit Spread Adjustment		
	USD LIBOR	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1-month	0.11448%	0.0326%	-0.0571%
3-month	0.26161%	0.1193%	0.0031%
6-month	0.42826%	0.2766%	0.0741%

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่นี้เป็นต้นไป จนกว่าธนาคารจะมีประกาศเปลี่ยนแปลง

ประกาศ ณ วันที่ 8 มิถุนายน 2566

(นายรักษ์ วรกิจโกศาทร)  
กรรมการผู้จัดการ

ส่วนระดมทุน  
ฝ่ายบริหารเงิน  
โทร. 02-169-9999 ต่อ 2240, 2243-2244