

iBond User Manual

BOND PRICE&INDICES

Contact iBond:

Bond Pricing & Product Development Department,
The Thai Bond Market Association (ThaiBMA)
email address: pricing@thaibma.or.th
Tel. 0-2257-0357 ext. 451-456
Visit our website: www.ibond.thaibma.or.th

สารบัญ

หัวข้อ	หน้า
Bond Price/ Indices	
Bond Price	1
End of day trading	
Daily Trading Movement	2
Daily Trading Movement (Fx)	4
Spread & Duration	5
Trading Movement	7
Trading Summary	8
Stressed Bonds	9
Intraday trading	
Basic view mode	10
Advanced view mode	11
Quotation	
Treasury Bills	14
Government Bonds	15
State Owned Enterprise Bonds	16
State Agency Bonds	17
Corporate Bonds	18
Foreign Bonds	19
RP Reference Yield	
RP Reference Yield (T+1)	20
RP Reference Yield (T+2)	22
RP Reference Yield (T+3)	23
Mark to Market	24
Plain Vanilla MTM Pages	25
Structure Note MTM Page	26
Notice Pending Page	27
Download Historical MTM	31
MTM Yield Movement	32
MTM Price Feedback	33
Indices	34
ThaiBMA Government Bond Index	36
ThaiBMA Investment Grade Corporate Bond Index	38
Composite Bond Index	39

หัวข้อ**หน้า**

T-Bill Index	40
Zero Rate Return Index	42
SOE Zero Rate Return Index	43
Corporate Zero Rate Return Index	45
Commercial Paper Index	47
Short-term Government Bond Index	48
MTM Government Bond Index	49
MTM Corporate Bond Index	51
Inflation-Linked Bond Index	53
Customized Bond Index	54

Bond Price/ Indices

Bond Price

รวบรวมข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับราคาตราสารหนี้ ไม่ว่าจะเป็นราคาปิด, ราคาระหว่างวัน, ราคาที่เสนอโดย Dealer และราคาที่ใช้สำหรับ Mark-to-Market ประกอบไปด้วยเมนูย่อยทั้งหมด 4 เมนู

1. End of day trading:
 - 1.1 Daily Trading Movement: สรุปข้อมูลการซื้อขายในแต่ละวัน (ปริมาณการซื้อขาย, ราคาเฉลี่ย, ราคาสุดท้าย)
 - 1.2 Daily Trading Movement (Fx): สรุปของธุรกรรมการซื้อขายของตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ
 - 1.3 Spread & Duration: แสดงข้อมูล Spread และข้อมูล Duration ของแต่ละ Symbol ที่มีธุรกรรมซื้อขายในแต่ละวัน
 - 1.4 Trading Movement: ข้อมูลการเปลี่ยนแปลงของ Yield ในช่วงระยะเวลาที่กำหนด
 - 1.5 Trading Summary: ข้อมูลสรุปของธุรกรรมการซื้อขาย
2. Intraday Trading:
 - 2.1 Basic view mode
 - 2.2 Advanced view mode
3. Quotation:
 - 3.1 Treasury Bills: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อและเสนอขายเฉลี่ยของตราสารหนี้ประเภทตั๋วเงินคลัง
 - 3.2 Government Bonds: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยของพันธบัตรรัฐบาลประเภท Loan Bond (LB)
 - 3.3 State Owned Enterprise Bonds: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยของพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ
 - 3.4 State Agency Bonds: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยของพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย
 - 3.5 Corporate Bonds: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของหุ้นกู้เอกชน
 - 3.6 Foreign Bonds: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของพันธบัตรต่างประเทศ
4. RP Reference Yield:
 - 4.1 RP Reference Yield (T+1): ราคาเพื่อใช้อ้างอิง (Reference) ในการทำธุรกรรมกู้ยืม (Repo) (T+1)
 - 4.2 RP Reference Yield (T+2): ราคาเพื่อใช้อ้างอิง (Reference) ในการทำธุรกรรมกู้ยืม (Repo) (T+2)
 - 4.3 RP Reference Yield (T+3): ราคาเพื่อใช้อ้างอิง (Reference) ในการทำธุรกรรมกู้ยืม (Repo) (T+3)

ชื่อหน้า: Bond Price > End of day trading > Daily Trading Movement

ภาพประกอบ:

Daily Trading Movement

Daily Trading Movement	Daily Trading Movement (Fx)	Spread & Duration	Trading Movement	Trading Summary																		
04/03/2020																						
Daily Trading Movement As of 2020-03-04																						
Trading Value																						
Total Trading Value (THB)	1,092,975,835,968.28																					
Outright Trading Value (THB)	111,693,278,985.02																					
Financing Value (THB)	980,617,323,286.33																					
Other Value (THB)	665,233,696.93																					
ThaiBMA Government Bond Index																						
Clean Price :	121.78			+0.84																		
Gross Price :	122.57			+0.85																		
Total Return:	335.56			+2.31																		
Download Excel																						
Outright Trading Transactions																						
Symbol	Type	Rating	Maturity	Attribute	TTM	Coupon	PE. last Date	PE. last Yield	PE. last Price	Previous	PE. last Remark flag	PE. Weight Avg. Yield	PE. Weight Avg. Price	Best Bid Yield	Best Bid Price	WA Bid Yield	WA Bid Price	Best offer Yield	Best offer Price	WA Offer Yield	WA Offer Price	La exec Ys
1 Government Debt Securities																						
1.1 Treasury Bill																						
1.2 Government Bond																						
ILB217A			14-Jul-2021		1.36	1.2000	27-Feb-2020	0.970000	100.314846	SL		0.970000	100.314846	0.900000	100.404843	1.022207	100.240178	1.200000	100.349250	0.926218	100.369485	
ILB203A			12-Mar-2028		8.03	1.2500	02-Mar-2020	0.950000	102.312717			0.950000	102.312717	0.910000	102.622848	1.080555	101.297881	1.200000	101.991826	0.980225	102.075016	0
LB206A			26-Jun-2029		0.31	2.5500	03-Mar-2020	0.980000	100.484389			0.944747	100.484454									0
LB213A			31-Mar-2021		1.07	5.8500	03-Mar-2020	0.870000	105.289706	SL		0.870000	105.289706									0
LB214A			09-Apr-2021		1.10	6.4000	03-Mar-2020	0.900000	105.974501			0.900000	105.974501									0
LB21DA			17-Dec-2021		1.79	3.5500	03-Mar-2020	0.780000	105.087046			0.771982	105.095533	0.690000	105.228244	0.703889	105.202848	0.700000	105.245830	0.681667	105.243485	0
LB226A			17-Jun-2022		2.29	1.8750	03-Mar-2020	0.800000	102.426150			0.800671	102.426603	0.705000	102.841204	0.718333	102.610582	0.700000	102.669923	0.695833	102.662285	0
LB22DA			17-Dec-2022		2.79	2.0000	03-Mar-2020	0.825000	103.225257			0.819415	103.258825	0.720000	103.516324	0.736111	103.471103	0.737987	103.545919	0.712778	103.536603	0
LB233A			13-Mar-2023		3.02	5.9000	02-Mar-2020	0.910000	113.975789			0.910000	113.975789									0
LB236A			16-Jun-2023		3.28	3.6250	03-Mar-2020	0.830000	109.025535			0.823810	109.049495									0
LB23DA			17-Dec-2023		3.79	2.4000	03-Mar-2020	0.830000	105.834160			0.828459	105.841120	0.735000	106.195569	0.747778	106.146313	0.814444	106.212050	0.725556	106.231991	0
LB24DB			17-Dec-2024		4.79	1.4500	03-Mar-2020	0.855000	102.781392			0.862037	102.748683	0.740000	103.327617	0.765556	103.205601	0.750000	103.323943	0.745556	103.301077	0
LB25DA			12-Dec-2025		5.78	3.8500	03-Mar-2020	0.920000	116.425499			0.914156	116.461339	0.789000	117.222152	0.810000	117.092797	0.791889	117.267730	0.786667	117.238533	0
LB26DA			17-Dec-2026		6.79	2.1250	03-Mar-2020	0.955000	107.665408			0.946313	107.724909	0.830000	108.519675	0.838889	108.458462	0.834942	108.639004	0.811111	108.649881	0
LB27DA			17-Dec-2027		7.79	3.5800	03-Mar-2020	1.020000	119.105892	SL		1.020000	119.105892									1
LB28DA			17-Dec-2028		8.79	2.8750	03-Mar-2020	1.050000	115.272179			1.051032	115.260030	0.930000	116.361169	0.940556	116.264505	0.930000	116.488099	0.918889	116.463014	0
LB29DA			22-Jun-2029		9.31	4.8750	03-Mar-2020	1.095000	133.323734			1.086590	133.415860									1
LB29DA			17-Dec-2029		9.79	1.6000	03-Mar-2020	1.060000	105.003785			1.059934	105.004923	0.960000	105.959330	0.960000	105.959330	0.960000	106.191399	0.934074	106.208974	0
LB316A			20-Jun-2031		11.30	3.6500	03-Mar-2020	1.190000	125.917006			1.186844	125.953211	1.036693	127.770054	1.105556	126.931135	1.080000	127.623933	1.052222	127.580319	1

ความหมาย ที่มาของข้อมูล และการคำนวณ:

ThaiBMA Daily Report เป็นรายงานสรุปการซื้อขายประจำวัน โดยแบ่งเป็น 4 ส่วนหลัก

ส่วนที่ 1: Trading Value (ด้านบนซ้าย) แสดงสรุปยอดรวม (Gross Value) ของธุรกรรมซื้อขายทั้งหมด และยอดรวมธุรกรรมซื้อขายแยกตามประเภท Outright Trading, Financing และ Other

ส่วนที่ 2: ThaiBMA Government Bond Index (ด้านบนขวา) แสดงข้อมูล Index แยกตาม Clean Price, Gross Price และ Total Return (รายละเอียดข้อมูลและการคำนวณสามารถดูได้จากเมนู Indices)

ส่วนที่ 3: Outright Trading Transactions แสดงรายละเอียดของธุรกรรมซื้อขายประจำวันสรุปแยกตาม Symbol โดยแสดงตามลำดับประเภทของการซื้อขาย แบ่งเป็น

(3.1) Cash Trading Transactions คือ ธุรกรรมซื้อขายแบบ Outright ข้อมูลที่แสดงของแต่ละ Symbol ประกอบด้วย

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้แยกตามประเภทของตราสารหนี้
- TTM: อายุคงเหลือ (ปี)
- Coupon: คูปอง (%)
- Bid Yield (%): ข้อมูล Quote ราคา Bid เฉพาะของ Government Bond โดยประกอบด้วย
 - Best Bid (%): Bid Yield ที่ต่ำที่สุดจากการ Quote ของ Primary Dealer
 - Average (%): ค่าเฉลี่ย Bid Yield จากการ Quote ของ Primary Dealer
 - Best Bid Price: ราคาที่คำนวณได้จาก Best Bid Yield (Settlement date = t+2)
- Best Offer Yield (%): ข้อมูล Offer Yield ที่สูงที่สุดจากการ Quote ของ Primary Dealer
- Last : ข้อมูลราคาปิดของแต่ละ Symbol ประจำวัน ซึ่งประกอบด้วย

- Executed Yield (%): Yield จากรายการซื้อขายล่าสุดที่ใช้เป็นราคาปิด
 - DM: Discount Margin สำหรับ Floating Rate Bonds
 - YTP/ YTC: Yield to Put และ Yield to Call สำหรับ Puttable และ Callable Bonds
 - Price (%): Clean Price ที่คำนวณจาก Last Executed Yield ตาม Settlement Date ที่ซื้อขายจริง
 - Gross Value: มูลค่าการซื้อขาย (บาท) = Gross Price * Volume
 - Flag SL: สำหรับรายการที่เป็น Small Lot (น้อยกว่า 10 ล้านบาท สำหรับ Government Bonds และ น้อยกว่า 5 ล้านบาท สำหรับ Corporate Bonds)
 - Flag NL: สำหรับราคาที่พิจารณาแล้วว่าน่าจะไม่ใช่อัตราผลตอบแทนที่ควรจะเป็นในภาวะตลาดช่วงนั้น (Not in Line) และอาจไม่เหมาะที่จะนำราคานี้ไปใช้ในการ Mark-To-Market
- **Weighted Average**
 - Yield (%): ค่าเฉลี่ยของ Executed Yields ของรายการซื้อขายทุกรายการ
 - Price (%): ราคาเฉลี่ย (Average Clean Price) ของรายการซื้อขายทุกรายการ
 - Total Gross Value: มูลค่ารวมของรายการซื้อขายทุกรายการ (บาท)

(3.2) Financing Transactions คือ ธุรกิจซื้อขายแบบ Financing ข้อมูลจะแสดงแยกตามประเภทของ Bond และแสดงข้อมูลจำนวนวัน (Terms) ค่าเฉลี่ยของอัตราดอกเบี้ย (Weighted Average Rate (%)) และมูลค่ารวมของธุรกรรมแยกตามจำนวนวัน (Total Gross Value)

(3.3) Other Transactions คือ ธุรกิจซื้อขายแบบอื่นๆ ที่ไม่ใช่แบบ Outright หรือ Financing โดยข้อมูลจะแสดงแยกตามประเภทของ Bond และแสดงข้อมูลจำนวนวัน (Terms) ค่าเฉลี่ยของอัตราดอกเบี้ย (Weighted Average Rate (%)) และมูลค่ารวมของธุรกรรม

ส่วนที่ 4: สำหรับดาวน์โหลดไฟล์ ThaiBMA Daily Report ในรูปแบบ Excel

ชื่อหน้า: Bond Price > End of day trading > Daily Trading Movement (Fx)

ภาพประกอบ:

Daily Trading Movement

Daily Trading Movement (Fx) Spread & Duration Trading Movement Trading Summary

04/03/2020

Daily Trading Movement (Foreign Currency Denominated Bond) As of 2020-03-04

Trading Value

Total Trading Value (THB)	0.00
Outright Trading Value (THB)	0.00
Financing Value (THB)	0.00
Other Value (THB)	0.00

[Download Excel](#)

Outright Trading Transactions

Symbol	Bond Information						Previous					Bid						
	Type	Rating	Maturity	Attribute	TTH	Coupon	PE. last Date	PE. last Yield	PE. last Price	PE. last Remark flag	PE. Weight Avg. Yield	PE. Weight Avg. Price	Best Bid Yield	Best Bid Price	WA Bid Yield	WA Bid Price	Best offer Yield	Best offer Price
4 Foreign Currency Denominated Bond																		
4.1 USD Bond																		
4.2 CNY Bond																		
4.3 EUR Bond																		

กรณีที่ผู้ใช้งานต้องการข้อมูลสรุปของธุรกรรมการซื้อขายของตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ ผู้ใช้งานสามารถเลือกดูข้อมูลในส่วน Daily Trading Movement (FX) โดยสามารถเลือกวันที่ที่ต้องการบริเวณรูปปฏิทิน หรือเลือกดาวน์โหลดข้อมูลในรูปแบบ Excel โดยกดที่ Download Excel

ส่วนบนของตารางแสดงสรุปยอดรวมของธุรกรรมซื้อขายตามวันที่ที่ผู้ใช้งานกำหนด แยกตามประเภท Outright, Financing และ Other ในตารางส่วนล่างจะเพิ่มรายละเอียดของธุรกรรมประเภทต่างๆที่มีการซื้อขายในวันนั้นๆ แบ่งเป็น Cash Trading Transactions, Financial Transactions และ Other Transactions

ประโยชน์:

ข้อมูลสรุปธุรกรรมซื้อขายของตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ สามารถใช้เป็นข้อมูลอ้างอิง และใช้ประกอบการวิเคราะห์สถานะหรือแนวโน้มของตลาดตราสารหนี้ได้

ข้อหน้า: Bond Price > End of day trading > Spread & Duration

ภาพประกอบ:

Daily Trading Movement

Daily Trading Movement (Fx) Spread & Duration Trading Movement Trading Summary

04/03/2020

Download Excel

Symbol	Rating		TTM	Last Executed Yield(%)	Weighted Avg. Executed Yield (%)	Spread(bp)	MOD Duration*	MAC Duration	Convexity*
	TRIS	Fitch (Tha...							
1 Government Debt Securities									
1.1 Treasury Bill									
1.2 Government Bond									
ILB293A			8.03	0.910000	0.910000	0	7.630995	7.665716	63.738852
LB206A			0.31	0.895000	0.920110	0	0.319945	0.312329	0.251471
LB213A			1.07	0.900000	0.900000	0	1.028720	1.033249	1.602254
LB214A			1.10	0.770000	0.765946	0	1.050523	1.054568	1.661376
LB21DA			1.79	0.690000	0.713010	0	1.730283	1.736252	3.913046
LB226A			2.29	0.700000	0.722022	0	2.234616	2.242437	6.172345
LB22DA			2.79	0.730000	0.748210	0	2.706124	2.716001	8.796792
LB233A			3.02	0.750000	0.754999	0	2.834779	2.845409	9.742865
LB236A			3.28	0.720000	0.719800	0	3.102434	3.113603	11.510839
LB23DA			3.79	0.750000	0.738885	0	3.618100	3.631668	15.256783
LB24DB			4.79	0.750000	0.760240	0	4.614793	4.632098	24.061451
LB25DA			5.78	0.800000	0.800389	0	5.223185	5.234078	31.626955
LB26DA			6.79	0.820000	0.885595	0	6.236598	6.352537	44.939371
LB27DA			7.79	1.070000	1.044957	0	6.876513	6.913302	54.449949
LB28DA			8.79	0.920000	1.012558	0	7.837301	7.873353	69.815374
LB296A			9.31	1.110000	1.109056	0	7.757355	7.800408	71.036841
LB29DA			9.79	0.940000	0.958164	0	9.052995	9.095544	90.477860
LB316A			11.30	1.100000	1.230460	0	9.509572	9.561875	105.180569
LB326A			12.32	1.120000	1.214698	0	10.190558	10.247625	121.549653

Remark:

1. Macaulay Duration, Modified Duration and Convexity are calculated from the last executed yields of the traded date. Prices in the calculation are base on the yield conversion on settlement in the same day.
2. Spread over government bond (bidding yields) with comparative duration is calculated on an interpolation method.
3. Effective Duration and Effective Convexity for floating rate bond are calculated by 10 bp change of indicator rate.
4. For Inflation-Linked Bond, all the Yields shown are Real YTM. Duration and convexity measures are calculated based on Real YTM.

ความหมาย ที่มาของข้อมูล และการคำนวณ:

Spread & Duration แสดงค่า Spread และ Duration ของแต่ละ Symbol ที่มีธุรกรรมซื้อขายในแต่ละวัน โดยแสดงข้อมูลประกอบด้วย

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้แยกตามประเภทของตราสารหนี้
- Rating TRIS/ FITCH: เครดิตเรทติ้ง
- TTM: อายุคงเหลือ (ปี)
- Last Executed Yield (%): Yield จากรายการซื้อขายล่าสุดที่ใช้เป็นราคาปิด
- Average Executed Yield (%): ค่าเฉลี่ยของ Executed Yields ของรายการซื้อขายทุกรายการแต่ละ Symbol
- Spread (bp): ค่า Nominal Spread ของSOEและCorporate Bonds คำนวณจาก Duration base
- Mod Duration: ค่า Modified Duration คำนวณจาก Last Executed Yield and Price ดังนี้

$$Modified\ Duration = \frac{Macauley\ Duration}{\left(1 + \frac{YTM}{H}\right)}$$

โดยที่ YTM = อัตราผลตอบแทนเมื่อถือจนครบกำหนดอายุ

H = จำนวนงวดการจ่ายคูปองต่อปี

- Mac Duration: ค่า Macaulay Duration คำนวณจาก Last Executed Yield โดยใช้สูตร ดังนี้

$$Macauley\ Duration = \sum_{n=1}^N \left(\frac{PV_n}{P}\right) t_n$$

โดยที่ PV_n = มูลค่าปัจจุบันของกระแสเงินสด ณ งวดที่ n

t_n = ระยะเวลา นับจากปัจจุบันจนถึงงวดที่ n

P = ราคาของตราสารหนี้

- Convexity: ค่า Convexity คำนวณจาก Last Executed Yield โดยใช้สูตรดังนี้

$$Convexity = \frac{1}{H^2} \times \frac{1}{P} \times \frac{1}{\left(1 + \frac{YTM}{H}\right)^2} \times \sum_{t=1}^n \left[\frac{CF_t}{\left(1 + \frac{YTM}{H}\right)^t} (t^2 + t) \right]$$

โดยที่ P = ราคาของตราสารหนี้

CF_t = กระแสเงินสด (Cash Flow) ณ เวลา t

YTM = อัตราผลตอบแทนเมื่อถือจนครบกำหนดอายุ

H = จำนวนงวดการจ่ายคูปองต่อปี

ทั้งนี้ ข้อมูลในส่วนนี้สามารถ ดาวน์โหลด เป็นไฟล์ในรูปแบบ Excel ได้ที่มุมขวาบน

ประโยชน์:

ข้อมูล Spread & Duration สามารถใช้เป็นข้อมูลประกอบ ThaiBMA Daily Report และช่วยในการบริหารความเสี่ยง โดยไม่ต้องเสียเวลาคำนวณ

ชื่อหน้า: Bond Price > End of day trading > Trading Movement

ภาพประกอบ:

Daily Trading Movement



ผู้ใช้งานสามารถเลือกดูข้อมูลการเปลี่ยนแปลงของ Yield ในช่วงระยะเวลาที่กำหนดพร้อมกันได้ครั้งละไม่เกิน 5 รุ่น โดยสามารถกำหนดได้ว่าต้องการข้อมูล Yield จาก Trading, Quotation หรือเป็น Spread (Nominal) และสามารถเลือกรูปแบบของ Output ได้ทั้งแสดง Graph หรือเลือกดาวน์โหลดข้อมูลในรูปแบบ Excel โดยกดที่ Download Excel

ชื่อหน้า: Bond Price > End of day trading > Trading Summary

ภาพประกอบ:

Daily Trading Movement

Daily Trading Movement (Fx) Spread & Duration Trading Movement **Trading Summary**

Trading Summary

Time Selection: 01/01/2020 - 05/03/2020 Month Selection: March 2020

Submit

Trading Summary - From 01-Jan-2020 To 05-Mar-2020

	Total Trading Value (THB Min.)	Outright Trading Value (THB Min.)	Financing Trading Value (THB Min.)	Other Trading Value (THB Min.)
Total Trading Value (THB)		45,804,343,178.437.38		
Outright Trading Value (THB)		4,100,309,716,061.93		
Financing Value (THB)		41,696,163,954,594.13		
Other Value (THB)		7,869,507,781.35		
1 Government Debt Securities				
1.1 Treasury Bill				
1.2 Government Bond	7,219,761.16	1,133,849.75	6,079,078.89	6,832.52
1.3 State Agency Bond	38,209,355.17	2,728,848.62	35,480,506.54	
1.4 State Own Enterprise Bond	170,379.13	36,924.51	132,446.83	1,007.79
1.5 Government Related Entity				
2 Corporate Bond				
2.1 Long-term Corporate Bond	121,596.44	117,435.56	4,131.69	29.20
2.2 Commercial Paper	83,018.41	83,018.41		
3 Foreign Bond	232.88	232.88		

กรณีที่ผู้ใช้งานต้องการข้อมูลสรุปของธุรกรรมการซื้อขาย ผู้ใช้งานสามารถเลือกดูข้อมูลในส่วน Trading Summary โดยสามารถกำหนดช่วงเวลาที่ต้องการหรือเลือกดูข้อมูลเป็นรายเดือน ส่วนบนของตารางแสดงสรุปยอดรวมของธุรกรรมซื้อขายตามช่วงเวลา ที่ผู้ใช้งานกำหนด แยกตามประเภท Outright, Financing และ Other ในตารางส่วนล่างจะเพิ่มการแบ่งข้อมูลตามประเภทของตราสารหนี้

ประโยชน์:

ข้อมูลสรุปธุรกรรมซื้อขายสามารถใช้เป็นข้อมูลอ้างอิง และใช้ประกอบการวิเคราะห์สถานะหรือแนวโน้มของตลาดตราสารหนี้

ชื่อนี้: Bond Price > Stressed Bonds

ภาพประกอบ:

Stressed Bonds

03/07/2020

Download Excel

Symbol	Date	Price (%)	Executed Yield (%)	Value (THB)	Price (%)	Weighted Average Executed Yield (%)	Value (THB)
CB0208A kg 11MHW	03-Jul-2020	99.982711	7.500000	92,063.87	99.982711	7.500000	92,063.87

Remark: Pricing data displayed on this page is derived from actual reported trading transactions. The data does not represent Market to Market prices. TheBMA accepts no responsibility for any inaccuracy or unavailability of such price.

Distribution type remark:

Abbr. after Symbol	Name (ENG)	Name (TH)
PO	Public Offering	การเสนอขายเปิดต่อสาธารณะ
II	Private Placement to institutional investors	การเสนอขายเปิดต่อสถาบัน
II/MHW	Private Placement to institutional investors plus high net worth investors	การเสนอขายเปิดต่อสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่
HWSI	High Net Worth Investors	การเสนอขายเปิดต่อรายใหญ่
PG	Government debt security offering (Check with registrar if there is any transfer limitation)	การเสนอขายพันธบัตรรัฐบาล (โปรดตรวจสอบว่าจำกัดการโอนสิทธิ์หรือไม่)
PP10	Private Placement to not more than 10 investors	การเสนอขายเปิดต่อสถาบันไม่เกิน 10 ราย
PPCC	Private Placement to the company's creditor	การเสนอขายเปิดต่อเจ้าหนี้ของบริษัทจดทะเบียน
PFEX	Private Placement with filing exemption from SEC	การเสนอขายเปิดแบบไม่ขึ้นทะเบียน
RO	Right Offering	การเสนอขายหุ้นเพิ่ม

Event Sign:

Sign	Name	Explanation(ENG)	Explanation(TH)
RI	Request Information	TheBMA is requesting additional information from the issuer.	TheBMA ขอทราบข้อมูลเพิ่มเติมจาก Issuers
IC	Investor Caution	Investors must be cautious investing. TheBMA has guidelines for posting IC signs as follows: Determining the meeting date of bondholders' meeting that requires resolution passed by a majority of not less than 75% in the following matters: (1) Amendment of the redemption date or payment due date. (2) Reduction, cancellation or changing the amount owed, interest or payments due in accordance with the debentures. (3) Changing of currency which must be paid in accordance with the debentures. (4) Repayment of debentures by conversion of bonds to other securities. (5) Changing the rules of the bondholders' meeting regarding the quorum and the resolution of the meeting.	นักลงทุนต้องระวังการลงทุน. TheBMA มีแนวทางสำหรับโพสต์ IC ดังนี้: 1. กำหนดวันที่ประชุมผู้ถือหุ้นที่ต้องมีการแก้ไขมติของเจ้าหนี้กว่า 75% ในเรื่องต่อไปนี้: (1) การแก้ไขวันครบกำหนดชำระหนี้/วันจ่ายดอกเบี้ย (2) การลด/ยกเลิก/หรือเปลี่ยนแปลงจำนวนเงินต้น ดอกเบี้ย หรือเงินที่ต้องจ่ายตามสัญญา (3) การเปลี่ยนสกุลเงินที่ต้องชำระหนี้ตามสัญญา (4) การชำระหนี้ด้วยการแปลงสภาพพันธบัตรเป็นหลักทรัพย์อื่น (5) การแก้ไขและกำหนดกฎการประชุมผู้ถือหุ้นและมติการประชุม
RS	Restructure	The debt securities have been approved by the resolution of bondholders' meeting for debt restructuring or changing redemption date or extension redemption period of debt.	หลักทรัพย์ได้ผ่านการแก้ไขมติของเจ้าหนี้แล้วในวาระแก้ไข หรือ ปรับวันครบกำหนดชำระหนี้/วันจ่ายดอกเบี้ย หรือ การขยายระยะเวลาชำระหนี้/วันจ่ายดอกเบี้ย
DP	Default Payment	1. Debt securities do not pay principal payment or interest in case of an issuer company is unable to pay the principal or interest as a result of an automatic stay. Due to being in a condition of automatic stay. 2. TheBMA receives notifications from issuers or bondholders' representatives which contents of the notifications are regarded to default of bonds caused by Cross Default (Event of Default).	1. ไม่สามารถชำระคืนเงินต้น หรือดอกเบี้ย ซึ่งรวมถึงกรณีที่มีข้อบังคับในสัญญาชำระหนี้ถึงผลบังคับโดยอัตโนมัติเนื่องจากเจ้าหนี้ขอพักชำระหนี้ (Automatic stay) 2. ได้รับแจ้งข้อผิดพลาดจากผู้แทนบริษัท/ผู้แทนเจ้าหนี้ที่ผิดเงื่อนไข Cross Default

Disclaimer:

The Bond Market Association ("TheBMA") publishes all signs and data appeared on the part of TheBMA's websites which are for general information purposes only. TheBMA does not intend to address the specific circumstances of any particular individual or entity as well as facilitates the users to access or use of the signs and information displayed on TheBMA's websites ("Users"). By accessing or using the signs and data, Users have read, understood, accepted and fully consented to this disclaimer as follows:

- TheBMA uses reasonable efforts to publish the signs which referred to important events related to debt securities only. TheBMA makes no warranty, expressed or implied, representation or guarantee as to the content, sequence, currency, accuracy, timeliness, completeness or merchantability of the signs and data provided or the fitness for a particular purpose.
- The signs and data appearing on this part of TheBMA's websites do not constitute, and shall not be construed as, any form of specific advice or recommendation, and shall not be relied upon in lieu of appropriate professional advice, whether legal, financial, tax, accounting or any other respect. The users are recommended to exercise their own skill and judgment when considering investment decisions or taking action based on the signs or data provided and seek appropriate professional advice before making any specific or other decisions.
- TheBMA accepts no liability for any action taken or decision made by users through reliance upon such signs and/or data.

คำเตือนสำหรับผู้ใช้งาน ("Disclaimer") บริษัทสมาคมและดัชนีราคาหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (TheBMA) เผยแพร่ข้อมูลข่าวสารบนเว็บไซต์ของตนเอง โดยไม่ได้มีเจตนาที่จะให้คำแนะนำหรือชี้แนะการลงทุนแก่ผู้ใช้งานรายบุคคลหรือรายสถาบัน หรือจะพิจารณาเฉพาะรายบุคคลโดยไม่คำนึงถึงลักษณะเฉพาะของหลักทรัพย์ที่ลงทุนในหลักทรัพย์ (TheBMA) โดยปราศจากการพิจารณาถึงความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นได้จากการใช้ข้อมูลดังกล่าว ผู้ใช้เว็บไซต์ฯ เข้าใจและยอมรับข้อจำกัดของข้อมูลข่าวสารที่เผยแพร่ไว้

- สมาคมฯ ให้ความสำคัญในการเผยแพร่ข้อมูลข่าวสารที่เกี่ยวข้องกับเหตุการณ์สำคัญเกี่ยวกับตราสารหนี้เป็นหลัก โดยไม่รับประกันว่าข้อมูลที่เผยแพร่จะมีลักษณะเฉพาะเจาะจงหรือเหมาะสมกับความต้องการของผู้ใช้งานรายบุคคลหรือรายสถาบัน หรือจะพิจารณาเฉพาะรายบุคคลโดยไม่คำนึงถึงลักษณะเฉพาะของหลักทรัพย์ที่ลงทุนในหลักทรัพย์
- ข้อมูลข่าวสารที่ปรากฏบนเว็บไซต์ฯ ของสมาคมฯ ไม่ถือเป็นคำแนะนำหรือการชี้แนะการลงทุน และผู้ใช้งานควรปรึกษาผู้เชี่ยวชาญก่อนตัดสินใจลงทุนในหลักทรัพย์ หรือตราสารหนี้ใดๆ โดยปราศจากการพิจารณาถึงความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นได้จากการใช้ข้อมูลดังกล่าว ผู้ใช้เว็บไซต์ฯ เข้าใจและยอมรับข้อจำกัดของข้อมูลข่าวสารที่เผยแพร่ไว้
- สมาคมฯ ไม่รับผิดชอบต่อผลใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการที่ผู้ใช้งานรายบุคคลหรือรายสถาบันใช้ข้อมูลข่าวสารที่เผยแพร่ไว้บนเว็บไซต์ฯ โดยปราศจากการพิจารณาถึงความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นได้จากการใช้ข้อมูลดังกล่าว

แสดงข้อมูลการซื้อขายของตราสารหนี้ที่มีเครื่องหมายที่เป็นเหตุการณ์สำคัญเกี่ยวกับตราสารหนี้ตัวนั้นๆ ได้แก่ Default Payment (DP) และ Restructure (RS) ผู้ใช้สามารถศึกษาคำอธิบายเครื่องหมายได้จากตาราง Event Sign โดยจะแสดงข้อมูลวันที่มีการซื้อขายตราสารหนี้ดังกล่าวเท่านั้น

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้และเครื่องหมายที่เกี่ยวข้อง
- Date: วันที่ทำการซื้อขาย
- Executed: รายการซื้อขายสุดท้ายของวัน
- Price (%): ราคาซื้อขายหน่วยเป็นร้อยละของราคา Par
- Yield (%): อัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ที่ซื้อขายเมื่อถึงจนครบอายุ
- Value (THB): มูลค่าการซื้อขาย (บาท)
- Weighted Average Executed: รายการซื้อขายเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักโดยมูลค่าการซื้อขาย
- Price (%): ราคาเฉลี่ยของทุกรายการซื้อขาย
- Yield (%): อัตราผลตอบแทนเฉลี่ยของตราสารหนี้ทุกรายการซื้อขาย
- Value (THB): มูลค่าการซื้อขายรวมทุกรายการ (บาท)

ชื่อหน้า: Bond Price > Intraday Trading > Basic view mode

ภาพประกอบ:

Intraday Trading

05/03/2020

Flag: L - Previous Date Trading , BL - Big Lot , [E] - Edited , [D] - Deleted

Intraday Trading as of 05 March 2020

[Download Excel](#)

Symbol	Flag	Yield	Report Time	Trade Date
LB316A		1.140000	14:41:41	05-Mar-2020
LB676A		1.920000	14:35:26	05-Mar-2020
LB466A		1.520000	14:35:23	05-Mar-2020
BOT208A		0.820000	14:33:35	05-Mar-2020
LB23DA		0.755000	14:33:33	05-Mar-2020
CB20716A		0.820000	14:32:50	05-Mar-2020
CB20312B		0.920000	14:32:34	05-Mar-2020
LB29DA		0.980000	14:31:52	05-Mar-2020
CB20716A		0.825000	14:31:49	05-Mar-2020
LB496A		1.485000	14:31:20	05-Mar-2020
LB26DA		0.850000	14:31:06	05-Mar-2020

Remark:

1. For Inflation-Linked Bond, Coupon (%) is Real Coupon (%) and all the Yields (%) shown are Real YTM (%). The Prices of Inflation Linked Bond are shown as Unadjusted Prices, while all the Trading Value (THB) figures are in Adjusted terms.

2. BL stands for 'Big Lot' which is transaction in <5Y LB with trading volume of 500 MB up or >=5Y LB with trading volume of 300 MB up. (at par value) BL transactions will be displayed at 12.00 pm and 16.00 p.m.

3. [D] is displayed on transactions which are edited or deleted.

แสดงรายการซื้อขายระหว่างวัน ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ ตราสารหนี้ที่ทำการซื้อขาย (Symbol), อัตราผลตอบแทนที่ซื้อขาย (Yield), เวลาที่รายงานการซื้อขายมายัง ThaiBMA (Report Time) และเวลาที่เกิดรายการซื้อขายจริง (Trade Date)

ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

นำมาจากรายการซื้อขายที่ Dealer รายงานมายัง ThaiBMA โดยจัดแสดงเป็น 2 แบบ คือ

- Non-Corporate Bond: จะแสดงภายใน 15 นาทีหลังได้รับรายงาน
- Corporate Bond: จะแสดง 2 รอบ คือ 12:00 น. และ 16:00 น.

ประโยชน์:

เพื่อติดตามภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ระหว่างวันรวมถึงการเคลื่อนไหวของ Yield ที่ซื้อขาย

ชื่อหน้า: Bond Price > Intraday Trading > Advanced view mode

ภาพประกอบ:



แสดงรายการซื้อขายระหว่างวัน ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ ตราสารหนี้ที่ทำการซื้อขาย (Symbol), อัตราผลตอบแทนที่ซื้อขาย (Yield), เวลาที่รายงานการซื้อขายมายัง ThaiBMA (Report Time) และ เวลาที่เกิดรายการซื้อขายจริง (Trade Date) เช่นเดียวกันกับ Basic view mode แต่ด้านข้างมี Scatter Plot ตามรายรุ่นตราสารที่มีการซื้อขายมากที่สุด 5 ลำดับแรก

ผู้ใช้งานสามารถเรียกใช้กราฟ เพื่อแสดงความเคลื่อนไหวของตราสารหนี้ตัวใดตัวหนึ่งที่สนใจเป็นพิเศษได้ โดยเริ่มต้นการแสดงผลรายการซื้อขายจะถูกตั้งค่าไว้ที่ทุกรายการ ผู้ใช้งานสามารถปรับการแสดงผลข้อมูลเพิ่มเติมโดยการกดปุ่ม Advanced View ด้านซ้ายบน ผู้ใช้สามารถเลือกดูข้อมูลได้ 2 วิธี คือ

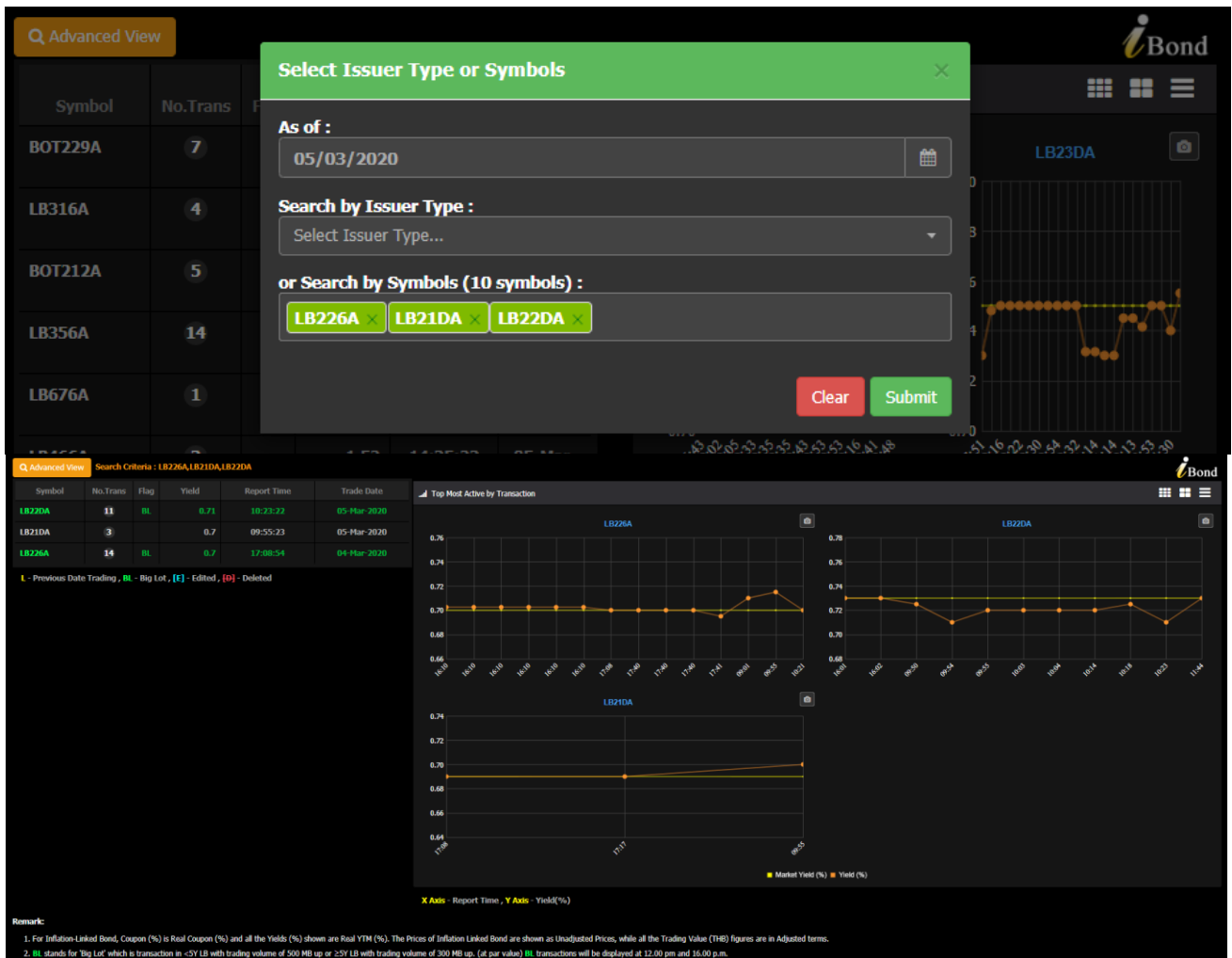
ภาพประกอบ:

1. การเลือกดูข้อมูล Intraday ตามประเภทของตราสารหนี้ (Search by Issuer Type)

กดปุ่ม Search by Issuer Type ให้เลือกประเภทของตราสารหนี้ที่ต้องการค้นหา แล้วกด Submit หลังจากนั้นข้อมูลจะแสดงผล เฉพาะข้อมูลของกลุ่มตราสารที่ต้องการดูข้อมูล โดยสามารถเลือกดูข้อมูลเฉพาะกลุ่มตราสารหนี้ ดังนี้

- Government Debt Securities
 - Treasury Bill
 - Government Bond
 - State Agency Bond
 - State Own Enterprise Bond
 - Government Promissory Note
- Corporate Bond
 - Long-term Corporate Bond
 - Commercial Paper
- Foreign Bond
- Foreign Currency Dedominated Bond
 - USD Bond
 - CNY Bond

ภาพประกอบ:



2. การเลือกดูข้อมูล Intraday เฉพาะข้อมูลตราสารหนี้ที่ตนเองสนใจ (Search by Symbols)

ให้พิมพ์ Symbol ที่ต้องการค้นหาในช่อง Search by Symbols จากนั้นให้กด Submit การค้นหาข้อมูลตาม Symbol สามารถค้นหาข้อมูลได้สูงสุดที่ 10 Symbols

ภาพประกอบ:



นอกจากนี้ภายในหน้ายังสามารถปรับรูปแบบการแสดงผลของกราฟ ได้ 3 รูปแบบ คือ แสดงผล 1, 2 และ 3 กราฟ โดยผู้ใช้งานสามารถกดสัญลักษณ์บริเวณมุมบนด้านขวาของ Widget Top Most Active By Transaction

ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > Treasury Bills

ภาพประกอบ:

Bond Quotation

Treasury Bills	Government Bonds	State Owned Enterprise Bonds	State Agency Bonds	Corporate Bonds	Foreign Bonds
Download Historical : 2020 Go					
04/03/2020 📅					
Download Excel					
Treasury Bill		Simple Yield * (%)			
		Bid	Offer		
T-BILL1M (28) days		0.958026	0.917115		
T-BILL3M (91) days		0.921825	0.878284		
T-BILL6M (182) days		0.884893	0.840521		
T-BILL1Y (364) days		0.827006	0.781848		

Remark:

1. The yield is based upon average bid and offer yields quoted by primary dealers.
2. The cut-off time for daily quotation of bonds is 16:00.

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อ (Bid) เสนอขาย (Offer) เฉลี่ยของตราสารหนี้ประเภทตั๋วเงินคลัง (Treasury Bills) โดยแบ่งเป็นกลุ่มช่วงอายุ ได้แก่ 1 เดือน, 3 เดือน, 6 เดือน และ 1 ปี

ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid/Offer ที่ Dealer ที่ได้รับการแต่งตั้งจากกระทรวงการคลัง Quote มายัง ThaiBMA ทุกสิ้นวัน (16:00 น.)

ประโยชน์:

เพื่อติดตามภาวะอัตราผลตอบแทนการเสนอซื้อเสนอขายของตราสารหนี้ระยะสั้นอายุคงเหลือไม่เกิน 1 ปี และใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับกำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสาร หรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน, ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > Government Bonds

ภาพประกอบ:

Bond Quotation

Treasury Bills	Government Bonds	State Owned Enterprise Bonds	State Agency Bonds	Corporate Bonds	Foreign Bonds
04/03/2020					
Download Excel					
Government Bonds as of 04 March 2020					
Bond	Coupon (%)	Maturity	TTM (Yrs.)	Quoted Date	Quoted Yield (%)
ILB217A	1.200000	14-Jul-2021	1.36	04-Mar-2020	1.022207
ILB283A	1.250000	12-Mar-2028	8.03	04-Mar-2020	1.080555
LB21DA	3.650000	17-Dec-2021	1.79	04-Mar-2020	0.703889
LB226A	1.875000	17-Jun-2022	2.29	04-Mar-2020	0.718333
LB22DA	2.000000	17-Dec-2022	2.79	04-Mar-2020	0.736111
LB23DA	2.400000	17-Dec-2023	3.79	04-Mar-2020	0.747778
LB24DB	1.450000	17-Dec-2024	4.79	04-Mar-2020	0.765556
LB25DA	3.850000	12-Dec-2025	5.78	04-Mar-2020	0.810000
LB26DA	2.125000	17-Dec-2026	6.79	04-Mar-2020	0.838889
LB28DA	2.875000	17-Dec-2028	8.79	04-Mar-2020	0.940556
LB29DA	1.600000	17-Dec-2029	9.79	04-Mar-2020	0.960000
LB316A	3.650000	20-Jun-2031	11.30	04-Mar-2020	1.105556
LB326A	3.775000	25-Jun-2032	12.32	04-Mar-2020	1.142222
LB356A	1.600000	17-Jun-2035	15.30	04-Mar-2020	1.240000
LB366A	3.400000	17-Jun-2036	16.30	04-Mar-2020	1.286667
LB386A	3.300000	17-Jun-2038	18.30	04-Mar-2020	1.325185
LB446A	4.675000	29-Jun-2044	24.34	04-Mar-2020	1.591111
LB466A	2.875000	17-Jun-2046	26.30	04-Mar-2020	1.586667
LB496A	1.875000	17-Jun-2049	29.31	04-Mar-2020	1.576667
LB616A	4.850000	17-Jun-2061	41.32	04-Mar-2020	1.967556
LB666A	4.000000	17-Jun-2066	46.32	04-Mar-2020	1.966667
LB676A	3.600000	17-Jun-2067	47.32	04-Mar-2020	1.970000
LBA37DA	4.260000	12-Dec-2037	17.79	04-Mar-2020	1.684208

Remark:

1. The yield is based upon average bid yields quoted by primary dealers.
2. The cut-off time for daily quotation of bonds is 16:00.
3. The yield of Inflation-linked bond (ILB) is real yield.

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของพันธบัตรรัฐบาลประเภท Loan Bond (LB) โดยแสดงเป็นรายตราสาร ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ (Bond), อัตราผลตอบแทนหน้าตัว (Coupon), วันครบกำหนดอายุ (Maturity), อายุคงเหลือ (TTM - Time to Maturity), วันที่ทำการเสนอซื้อ (Quoted Date) และ Quoted Yield (Average Bid)

ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid ที่ Dealer ที่ได้รับการแต่งตั้งจากกระทรวงการคลัง Quote มายัง ThaiBMA ทุกสิ้นวัน (16:00 น.)

ประโยชน์:

เพื่อติดตามภาวะอัตราผลตอบแทนการเสนอซื้อของตราสารหนี้ภาครัฐทุกช่วงอายุและเป็น Yield ที่นำไปใช้ในการทำ Government Bond Yield Curve และใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับกำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสาร หรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน, ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > State Owned Enterprise Bonds

ภาพประกอบ:

Bond Quotation

Treasury Bills		Government Bonds		State Owned Enterprise Bonds		State Agency Bonds		Corporate Bonds		Foreign Bonds	
28/02/2020											
Download Excel											
State Owned Enterprise Bonds as of 28 February 2020											
Bond	Coupon (%)	Maturity	TTM (Yrs.)	Quoted Date	Quoted Yield (%)						
BAAC208A	4.050000	15-Aug-2020	0.46	28-Feb-2020	1.023782						
BAAC238A	4.130000	01-Aug-2023	3.42	28-Feb-2020	1.025668						
BAAC238B	4.490000	30-Aug-2023	3.50	28-Feb-2020	1.028151						
BMTA204A	3.545000	29-Apr-2020	0.16	28-Feb-2020	1.060151						
BMTA205A	3.660000	06-May-2020	0.18	28-Feb-2020	1.058978						
BMTA207A	3.850000	02-Jul-2020	0.34	28-Feb-2020	1.050970						
BMTA208A	3.940000	05-Aug-2020	0.43	28-Feb-2020	1.046863						
BMTA20DA	4.030000	17-Dec-2020	0.80	28-Feb-2020	1.039559						
BMTA211A	2.600000	23-Jan-2021	0.90	28-Feb-2020	1.038078						
BMTA216A	3.750000	16-Jun-2021	1.30	28-Feb-2020	1.007732						

Remark:

- The yield is based upon average bid yields quoted by primary dealers on the 7th, 15th, 22nd and the last day the month. If the quotation date is non-business day, the quotation day is postponed to the next business day, except the last day of the month, the quotation day is the previous business day.
- The cut-off time for daily quotation of bonds is 16:00.

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ (SOE) โดยแสดงเป็นรายตราสาร ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ (Bond), อัตราผลตอบแทนหน้าตัว (Coupon), วันครบกำหนดอายุ (Maturity), อายุคงเหลือ (TTM - Time to Maturity), วันที่ทำการเสนอซื้อ (Quoted Date) และ Quoted Yield (Average Bid)

ที่มาของข้อมูล:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid ที่ Dealer ที่ได้รับการแต่งตั้งจากรงการแห่งประเทศไทย Quote มายัง ThaiBMA ทุกๆ 7 วัน คือ ทุกวันที่ 7, 15, 22 และวันทำการสุดท้ายของเดือน โดยถ้าวันที่ 7, 15 หรือ 22 ตรงกับวันหยุดทำการ จะเลื่อนเป็นวันทำการถัดไป

หลักการคำนวณ:

การคำนวณจะนำค่า Yield ที่ Quote เข้ามาตั้งแต่ 3 รายขึ้นไปมาหาค่า Standard Deviation (SD) หากค่าของ Yield รายใดไม่อยู่ในช่วง +/- 1 SD จะถูกตัดออก ส่วน Yield ที่เหลือจะนำมาหาค่าเฉลี่ยเพื่อแสดงเป็น Quoted Yield

ประโยชน์:

เพื่อใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับกำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสารหรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > State Agency Bonds

ภาพประกอบ:

Bond Quotation

Treasury Bills	Government Bonds	State Owned Enterprise Bonds	State Agency Bonds	Corporate Bonds	Foreign Bonds
Download Historical : 2020 Go					
04/03/2020 📅					
Download Excel					
Symbol	Average Bidding Yield (%)*	Maturity	TTM (Yrs.)		
BOT203A	0.991905	27-Mar-2020	0.06		
BOT209A	0.859235	25-Sep-2020	0.56		
BOT215A	0.776752	27-May-2021	1.23		
BOT223A	0.757778	25-Mar-2022	2.06		
BOT229A	0.759444	16-Sep-2022	2.54		

Remark:

1. The yield is averaged from yields quoted by active dealers.
2. The cut-off time for daily quotation of bonds is 16:00.

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของตราสารหนี้ที่ออกโดยองค์การภาครัฐ (State Agency Bonds) ได้แก่ พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย โดยแสดงเป็นรายตราสารที่มีในวันที่กำหนด ข้อมูลที่แสดงได้แก่ สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ (Symbol), อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bidding Yield), วันครบกำหนดอายุ (Maturity) และ อายุคงเหลือ (TTM - Time to Maturity)

ที่มาของข้อมูลและหลักการคำนวณ:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid ที่ Dealer ที่ได้รับการแต่งตั้งจากกระทรวงการคลัง Quote มายัง ThaiBMA ทุกสิ้นวัน (16:00 น.)

ประโยชน์:

เพื่อติดตามภาวะอัตราผลตอบแทนการเสนอซื้อของตราสารหนี้ที่ออกโดยองค์การภาครัฐ และใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับ กำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสาร หรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน, ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > Corporate Bonds

ภาพประกอบ:

Bond Quotation

Treasury Bills	Government Bonds	State Owned Enterprise Bonds	State Agency Bonds	Corporate Bonds	Foreign Bonds
25/08/2017					
Download Excel					
Bond	Coupon (%)	Maturity	TTM (Yrs.)	Quoted Date	Quoted Yield (%)
SPI246A	0.700000	29-Jun-2024	6.85	25-Aug-2017	-3.220000
1 <input type="text" value="20"/> items per page					1 - 1 of 1 items

Remark:

1. The yield is averaged from yields quoted by active dealers.
2. The cut-off time for daily quotation of bonds is 16:00.

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของหุ้นกู้เอกชนโดยแสดงเป็นรายตราสาร ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ (Bond), อัตราผลตอบแทนหน้าตัว (Coupon), วันครบกำหนดอายุ (Maturity), อายุคงเหลือ (TTM - Time to Maturity), วันที่ทำการเสนอซื้อ (Quoted Date) และ Quoted Yield (Average Bid)

ที่มาของข้อมูลและหลักการคำนวณ:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid ที่ Dealer Quote มายัง ThaiBMA ทุกๆ 15 วัน คือ ทุกวันที่ 15 และวันทำการสุดท้ายของเดือน โดยถ้าวันที่ 15 ตรงกับวันหยุดทำการ จะเลื่อนเป็นวันทำการถัดไป

การคำนวณจะนำค่า Yield ที่ Quote เข้ามาตั้งแต่ 3 รายขึ้นไปมาหาค่า Standard Deviation (SD) หากค่าของ Yield รายใดไม่อยู่ในช่วง +/- 1 SD จะถูกตัดออก ส่วน Yield ที่เหลือจะนำมาหาค่าเฉลี่ยเพื่อแสดงเป็น Quoted Yield

ประโยชน์:

เพื่อใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับกำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสารหรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน, ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > Foreign Bonds

ภาพประกอบ:

Bond Quotation

Treasury Bills	Government Bonds	State Owned Enterprise Bonds	State Agency Bonds	Corporate Bonds	Foreign Bonds
31/05/2011					
Download Excel					
Bond	Coupon (%)	Maturity	TTM (Yrs.)	Quoted Date	Quoted Yield (%)
SEK126A	2.825000	26-Jun-2012	1.07	31-May-2011	
1 20 items per page					1 - 1 of 1 items

Remark:

1. The yield is averaged from yields quoted by active dealers.
2. The cut-off time for daily quotation of bonds is 16:00.

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของพันธบัตรต่างประเทศโดยแสดงเป็นรายตราสาร ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ (Bond), อัตราผลตอบแทนหน้าตัว (Coupon), วันครบกำหนดอายุ (Maturity), อายุคงเหลือ (TTM - Time to Maturity), วันที่ทำการเสนอซื้อ (Quoted Date) และ Quoted Yield (Average Bid)

ที่มาของข้อมูลและหลักการคำนวณ:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid ที่ Dealer Quote มายัง ThaiBMA ทุกๆ 15 วัน คือ ทุกวันที่ 15 และวันทำการสุดท้ายของเดือน โดยถ้าวันที่ 15 ตรงกับวันหยุดทำการ จะเลื่อนเป็นวันทำการถัดไป

การคำนวณจะนำค่า Yield ที่ Quote เข้ามาตั้งแต่ 3 รายขึ้นไปมาหาค่า Standard Deviation (SD) หากค่าของ Yield รายใดไม่อยู่ในช่วง +/- 1 SD จะถูกตัดออก ส่วน Yield ที่เหลือจะนำมาหาค่าเฉลี่ยเพื่อแสดงเป็น Quoted Yield

ประโยชน์:

เพื่อใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับกำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสารหรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน, ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

ชื่อนำ: Bond Price > RP Reference Yield

ภาพประกอบ:

RP Reference Yield (T+1)

04/03/2020

Government Bonds Treasury Bills State Agency Bonds SOE(G) SOE(NG) Foreign Bonds Show All

RP Reference Yield (T+1): Government Bonds as of 4 March 2020
16:12:02

Download All Download Excel

Symbol	Settlement Date	Avg. Bidding Yield (%)	Clean Price (%)	Accrued Interest (%)	Gross Price (%)	Modified Duration	Convexity	Index Ratio
ILB217A	05-Mar-2020	1.022207	100.240661	0.167671	100.408332	1.343124	2.479409	1.09002
ILB283A	05-Mar-2020	1.080555	101.298315	-0.023973	101.274342	7.618874	63.556869	1.04579
LB206A	05-Mar-2020	0.912109	100.501031	0.489041	100.990072	0.308184	0.248369	
LB213A	05-Mar-2020	0.815306	105.350237	2.516301	107.866538	1.026452	1.596685	
LB214A	05-Mar-2020	0.811288	106.075420	2.595068	108.670488	1.047565	1.653584	
LB21DA	05-Mar-2020	0.703889	105.2110807	0.790000	106.000807	1.727425	3.901682	
LB226A	05-Mar-2020	0.718333	102.613695	0.405822	103.019517	2.231670	6.157625	
LB22NA	05-Mar-2020	0.734801	111.615438	1.656849	113.272287	2.497541	7.761047	
LB22DA	05-Mar-2020	0.736111	103.474490	0.432877	103.907367	2.703304	8.780100	
LB233A	05-Mar-2020	0.739612	114.200215	-0.120548	114.079667	2.832227	9.727181	

Remark:

1. Traded yield is based on 30/360 basis (on coupon payment) which might be different from yield calculated on actual payment. [click here to learn more.](#)
2. This page is designed to provide REFERENCE YIELD of State Owned Enterprise Bonds with MOF guarantee, which came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.
3. The Government interpolated yield is calculated from the interpolation method on the ThaiBMA Government Bond Yield Curve with the same maturity. However, the SOE Bonds with short-ended and long-ended issues (under and over the curve) are not included in this page.
4. T-Bill Reference Yield is calculated from Simple yields of Government Loan bond, 1-m Treasury bill, and 3-m Treasury bill with comparative ttm by interpolation method. Simple yield of LB is converted from average bidding yield to maturity.
5. The above prices are calculated based upon the provided reference yields on the settlement date, today plus one official day (T+1).
6. Duration and Convexity of Floating Rate Note Issues are Effective Duration and Effective Convexity.
7. For Inflation-Linked Bond, Avg. Bid Yield shown is Avg. Bid Real YTM and the Clean price (%), Accrued Interest (%), and Gross Price (%) are all in Unadjusted terms. The corresponding Adjusted terms can be obtained by multiplying the Unadjusted price or accrued interest by the Index Ratio shown in the last column. The modified duration and convexity are calculated based on Avg. Bid Real YTM.
8. Avg. bidding yield of LB206A, LB213A, LB214A, LB22NA, LB233A, LB236A, LB244A, LB247A, LB27DA, LB283A, LB296A, LB383A, LB396A, LB406A, LB416A are synthetic yield derived from ThaiBMA pricing model.
9. Bonds in State Owned Enterprise Bonds with non-MOF guarantee, SOE(NG), in RP Reference Yield pages are only rating AAA and Reference Yield of SOE(NG) came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.

อัตราผลตอบแทนและมูลค่าของตราสารหนี้ในหน้านี้แยกตามประเภทของตราสารหนี้เพื่อความสะดวกในการเรียกใช้ แต่ถ้าหากผู้ต้องการดูมูลค่าของตราสารหนี้ทั้งหมดก็สามารถทำได้โดยเลือกที่ Tab Show All

ความหมาย:

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้
- Settlement Date: วันชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้
- Avg. Bidding Yield (%): อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย หน่วยเป็นร้อยละ
- Clean Price (%): ราคาไม่รวมดอกเบี้ยค้างรับ หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋ว
- Accrued Interest (%): ดอกเบี้ยค้างรับ หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋ว
- Gross Price (%): ราคารวมดอกเบี้ยค้างรับ หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋ว
- Modified Duration: สำหรับตราสารหนี้ที่จ่ายคูปองแบบลอยตัว หน่วยเป็นปี
- Convexity: Convexity หน่วยเป็นปี²
- Index Ratio: ค่าที่ใช้ปรับเงินต้นและดอกเบี้ยเพื่อให้สอดคล้องกับอัตราเงินเฟ้อ

ที่มาของมูลค่าและหลักการคำนวณ:

อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรุ่นต่าง ๆ ในหน้า RP Reference Yield ได้มาจากค่าเฉลี่ยของราคาเสนอซื้อที่ทางผู้ค้าหลัก (Primary Dealer) ส่งมาให้ ThaiBMA

โดยปกติผู้ค้าหลักตราสารหนี้จะส่งราคาเสนอซื้อมาให้กับทาง ThaiBMA ทุกวัน สำหรับพันธบัตรรัฐบาล ตัวเงินคลังและพันธบัตรหน่วยงานของภาครัฐ (State Agency) และสำหรับพันธบัตรรัฐวิสาหกิจที่ค้าประกันโดยกระทรวงการคลังจะมีการเสนอราคา มาทุก 7 วัน

ราคาของตราสารหนี้ ดอกเบี้ยค้ำรับ Modified Duration และ Convexity ที่แสดงในหน้านี้ ได้มาจากการคำนวณด้วยหลักการเดียวกันกับหน้า Calculation โดยใช้อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Avg. Bidding Yield) และกำหนดให้วันส่งมอบและชำระราคา (Settlement Date) เป็น 1 วันทำการหลังจากวันปัจจุบัน (T +1 วันทำการ)

ประโยชน์:

อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรุ่นต่างๆ ในหน้า RP Reference Yield ใช้เป็นอัตราผลตอบแทนอ้างอิงในการทำธุรกรรมซื้อคืนพันธบัตร (Repo)

ชื่อหน้า: Bond Price > RP Reference Yield > RP Reference Yield (T+2)

ภาพประกอบ:

RP Reference Yield (T+2)

04/03/2020

Government Bonds
Treasury Bills
State Agency Bonds
SOE(G)
SOE(NG)
Foreign Bonds
Show All

Download All
Download Excel

RP Reference Yield (T+2): Government Bonds as of 4 March 2020
16:15:30

Symbol	Settlement Date	Avg. Bidding Yield (%)	Clean Price (%)	Accrued Interest (%)	Gross Price (%)	Modified Duration	Convexity	Index Ratio
ILB217A	06-Mar-2020	1.022207	100.240178	0.170959	100.411137	1.340398	2.470738	1.09007
ILB283A	06-Mar-2020	1.080555	101.297881	-0.020548	101.277333	7.616149	63.513998	1.04584
LB206A	06-Mar-2020	0.912109	100.496563	0.496027	100.992590	0.305456	0.245338	
LB213A	06-Mar-2020	0.815306	105.336614	2.532329	107.868943	1.023723	1.589733	
LB214A	06-Mar-2020	0.811288	106.060295	2.612603	108.672898	1.044836	1.646516	
LB21DA	06-Mar-2020	0.703889	105.202848	0.800000	106.002848	1.724695	3.890897	
LB226A	06-Mar-2020	0.718333	102.610582	0.410959	103.021541	2.228940	6.144088	
LB22NA	06-Mar-2020	0.734801	111.603673	1.670890	113.274563	2.494811	7.746059	
LB22DA	06-Mar-2020	0.736111	103.471103	0.438356	103.909459	2.700575	8.763989	
LB233A	06-Mar-2020	0.739612	114.187454	-0.105479	114.081975	2.829497	9.710367	

10 items per page
 1 - 10 of 58 items

Remark:

1. Traded yield is based on 30/360 basis (on coupon payment) which might be different from yield calculated on actual payment. [click here](#) to learn more.
2. This page is designed to provide REFERENCE YIELD of State Owned Enterprise Bonds with MOF guarantee, which came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.
3. The Government interpolated yield is calculated from the interpolation method on the ThaiBMA Government Bond Yield Curve with the same maturity. However, the SOE Bonds with short-ended and long-ended issues (under and over the curve) are not included in this page.
4. T-Bill Reference Yield is calculated from Simple yields of Government Loan bond, 1-m Treasury bill, and 3-m Treasury bill with comparative ttm by interpolation method. Simple yield of LB is converted from average bidding yield to maturity.
5. The above prices are calculated based upon the provided reference yields on the settlement date, today plus one official day (T+2).
6. Duration and Convexity of Floating Rate Note Issues are Effective Duration and Effective Convexity.
7. For Inflation-Linked Bond, Avg. Bid Yield shown is Avg. Bid Real YTM and the Clean price (%), Accrued Interest (%), and Gross Price (%) are all in Unadjusted terms. The corresponding Adjusted terms can be obtained by multiplying the Unadjusted price or accrued interest by the Index Ratio shown in the last column. The modified duration and convexity are calculated based on Avg. Bid Real YTM.
8. Avg. bidding yield of LB206A, LB213A, LB214A, LB22NA, LB233A, LB236A, LB244A, LB24DA, LB267A, LB27DA, LB283A, LB296A, LB383A, LB396A, LB406A, LB416A are synthetic yield derived from ThaiBMA pricing model.
9. Bonds in State Owned Enterprise Bonds with non-MOF guarantee, SOE(NG), in RP Reference Yield pages are only rating AAA and Reference Yield of SOE(NG) came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.

ที่มาของมูลค่าและหลักการคำนวณ:

เช่นเดียวกับ RP Reference Yield เพียงแต่กำหนดให้วันส่งมอบและชำระราคา (Settlement Date) เป็น 2 วันทำการ หลังจากวันปัจจุบัน (T+2 วันทำการ)

ประโยชน์:

อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรุ่นต่างๆ ในหน้า RP Reference Yield ใช้เป็นอัตราผลตอบแทนอ้างอิงในการทำธุรกรรมซื้อคืนพันธบัตร (Repo) ที่มี Settlement Date เป็น T+2 วันทำการ

ชื่อหน้า: Bond Price > RP Reference Yield > RP Reference Yield (T+3)

ภาพประกอบ:

RP Reference Yield (T+3)

04/03/2020

Government Bonds
Treasury Bills
State Agency Bonds
SOE(G)
SOE(NG)
Foreign Bonds
Show All

[Download All](#)
[Download Excel](#)

RP Reference Yield (T+3): Government Bonds as of 4 March 2020
16:15:37

Symbol	Settlement Date	Avg. Bidding Yield (%)	Clean Price (%)	Accrued Interest (%)	Gross Price (%)	Modified Duration	Convexity	Index Ratio
ILB217A	09-Mar-2020	1.022207	100.238730	0.180822	100.419552	1.332221	2.444816	1.09024
ILB283A	09-Mar-2020	1.080555	101.296577	-0.010274	101.286303	7.607974	63.385475	1.04600
LB206A	09-Mar-2020	0.912109	100.483159	0.516986	101.000145	0.297274	0.236334	
LB213A	09-Mar-2020	0.815306	105.295746	2.580411	107.876157	1.015537	1.568963	
LB214A	09-Mar-2020	0.811288	106.014925	2.665205	108.680130	1.036650	1.625401	
LB21DA	09-Mar-2020	0.703889	105.178970	0.830000	106.008970	1.716505	3.858632	
LB226A	09-Mar-2020	0.718333	102.601243	0.426370	103.027613	2.220750	6.103566	
LB22NA	09-Mar-2020	0.734801	111.568378	1.713014	113.281392	2.486622	7.701186	
LB22DA	09-Mar-2020	0.736111	103.460939	0.454795	103.915734	2.692386	8.715746	
LB233A	09-Mar-2020	0.739612	114.149171	-0.060274	114.088897	2.821308	9.660013	

10 items per page
1 - 10 of 58 items

Remark:

1. Traded yield is based on 30/360 basis (on coupon payment) which might be different from yield calculated on actual payment. [click here](#) to learn more.
2. This page is designed to provide REFERENCE YIELD of State Owned Enterprise Bonds with MOF guarantee, which came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.
3. The Government interpolated yield is calculated from the interpolation method on the ThaiBMA Government Bond Yield Curve with the same maturity. However, the SOE Bonds with short-ended and long-ended issues (under and over the curve) are not included in this page.
4. T-Bill Reference Yield is calculated from Simple yields of Government Loan bond, 1-m Treasury bill, and 3-m Treasury bill with comparative ttm by interpolation method. Simple yield of LB is converted from average bidding yield to maturity.
5. The above prices are calculated based upon the provided reference yields on the settlement date, today plus one official day (T+3).
6. Duration and Convexity of Floating Rate Note Issues are Effective Duration and Effective Convexity.
7. For Inflation-Linked Bond, Avg. Bid Yield shown is Avg. Bid Real YTM and the Clean price (%), Accrued Interest (%), and Gross Price (%) are all in Unadjusted terms. The corresponding Adjusted terms can be obtained by multiplying the Unadjusted price or accrued interest by the Index Ratio shown in the last column. The modified duration and convexity are calculated based on Avg. Bid Real YTM.
8. Avg. bidding yield of LB206A, LB213A, LB214A, LB22NA, LB233A, LB236A, LB244A, LB24DA, LB267A, LB27DA, LB283A, LB296A, LB383A, LB396A, LB406A, LB416A are synthetic yield derived from ThaiBMA pricing model.
9. Bonds in State Owned Enterprise Bonds with non-MOF guarantee, SOE(NG), in RP Reference Yield pages are only rating AAA and Reference Yield of SOE(NG) came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.

ที่มาของมูลค่าและหลักการคำนวณ:

เช่นเดียวกับ RP Reference Yield เพียงแต่กำหนดให้วันส่งมอบและชำระราคา (Settlement Date) เป็น 3 วันทำการหลังจากวันปัจจุบัน (T+3 วันทำการ)

ประโยชน์:

อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรุ่นต่างๆ ในหน้า RP Reference Yield ใช้เป็นอัตราผลตอบแทนอ้างอิงในการทำธุรกรรมซื้อคืนพันธบัตร (Repo) ที่มี Settlement Date เป็น T+3 วันทำการ

Mark-to-Market

รวบรวมข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับมูลค่ายุติธรรมหลากหลายประเภท ไว้ในหน้าเดียวกัน สำหรับนำไปบันทึกมูลค่าสินทรัพย์สุทธิ (NAV) ตามกำหนดของ กตต. ประกอบไปด้วยเมนูย่อยทั้งหมด 6 เมนู

- | | |
|-----------------------------|--|
| 1. Plain Vanilla MTM Pages: | แสดงมูลค่ายุติธรรมสำหรับตราสารหนี้ทั่วไป |
| 2. Structure Note MTM Page: | แสดงมูลค่ายุติธรรมสำหรับตราสารหนี้อนุพันธ์ (Structured Note) |
| 3. Notice Pending Page: | แสดงข้อมูลตราสารหนี้ที่เข้ากระบวนการผิดนัดชำระหนี้ |
| 4. Download Historical MTM: | แสดงมูลค่ายุติธรรมย้อนหลัง |
| 5. MTM Yield Movement: | แสดงความเคลื่อนไหวของราคา Mark-to-Market |
| 6. MTM Price Feedback: | ช่องทางส่ง Feedback เกี่ยวกับข้อมูลตราสารหนี้ มายัง ThaiBMA |

ชื่อหน้า: Bond Price > Mark to Market > Plain Vanilla MTM Pages

ภาพประกอบ:

ThaiBMA Mark to Market

04/03/2020

Govt. State Agency T-Bill SOE(G) SOE(NG) GRE Corp. CP FB FX TBP Show All

Download All Download Excel

ThaiBMA Mark to Market as of 4 March 2020 17:13:44

Symbol	Coupon	Maturity	TTM (Yrs.)	Type	Coupon Type	Rating		Last Trade		Last Quotation			
						TRIS	FITCH	Date	Exe.Yld %	Date	Avg.Yld (%)	Max	Min
Government Bonds													
ILB217A	1.2	14-Jul-2021	1.36	Straight	Fixed			18-Feb-2020	0.980000	04-Mar-2020	1.022207	1.270000	0.900000
ILB283A	1.25	12-Mar-2028	8.02	Straight	Fixed			04-Mar-2020	0.910000	04-Mar-2020	1.080555	1.320000	0.910000
LB206A	2.55	26-Jun-2020	0.31	Straight	Fixed			04-Mar-2020	0.890000	27-Jun-2019	1.753393	1.780000	1.738000
LB213A	5.85	31-Mar-2021	1.07	Straight	Fixed			02-Mar-2020	0.900000	14-Aug-2018	1.926884	2.000000	1.800000
LB214A	6.4	09-Apr-2021	1.10	Straight	Fixed			04-Mar-2020	0.770000	03-Jan-2014	3.683750	3.830000	3.600000
LB21DA	3.65	17-Dec-2021	1.79	Straight	Fixed			04-Mar-2020	0.690000	04-Mar-2020	0.703889	0.720000	0.690000
LB226A	1.875	17-Jun-2022	2.28	Straight	Fixed			04-Mar-2020	0.700000	04-Mar-2020	0.718333	0.730000	0.705000
LB22NA	5.125	08-Nov-2022	2.68	Straight	Fixed			03-Feb-2020	1.100000	03-Jan-2014	3.835000	3.940000	3.780000
LB22DA	2	17-Dec-2022	2.79	Straight	Fixed			04-Mar-2020	0.730000	04-Mar-2020	0.736111	0.762987	0.720000
LB233A	5.5	13-Mar-2023	3.02	Straight	Fixed			04-Mar-2020	0.750000	05-Jul-2016	1.836521	1.880000	1.770000

Remark:

1. Traded yield is based on 30/360 basis (on coupon payment) which might be different from yield calculated on actual payment. [click here](#) to learn more.
2. For Inflation-Linked Bond, Coupon (%) is Real coupon (%) and all the Yields(%) shown are Real YTM(%). The Clean price(%) and Accrued Interest (%) are all in Unadjusted terms. The corresponding Adjusted terms can be obtained by multiplying the Unadjusted price or accrued interest by the Index Ratio shown in the last column. Modified duration and convexity are calculated based on Real YTM
3. The prices shown in the Clean Price Column of the Traded-by-price bonds are gross price.
4. The cut-off time for daily quotation of all bonds is 16:00.
5. Clean price, Accrued interest, Modified duration and Convexity shown in Plain vanilla MTM pages (not Trade-by-price) calculated with Market Yield and settlement date on T+1 (Calendar day).
6. Model yield of LB206A, LB213A, LB214A, LB22NA, LB233A, LB236A, LB244A, LB24DA, LB267A, LB27DA, LB283A, LB296A, LB383A, LB396A, LB406A, LB416A are synthetic yield derived from ThaiBMA pricing model. But if there are trading transaction, model yield will be traded yield.
7. BEY (%) is Bond Equivalent Yield (calculated with semi-annually compounded yield).

อัตราผลตอบแทน มูลค่าและข้อมูลต่าง ๆ ของตราสารหนี้ในหน้านี้แยกตามประเภทของผู้ออกเพื่อความสะดวกในการเรียกใช้ แต่ถ้าหากผู้ใช้ต้องการใช้มูลค่าของตราสารหนี้ทั้งหมดก็สามารถทำได้โดยเลือกที่ Tab “Show All” หรือถ้าหากต้องการใช้ข้อมูลที่เป็น CSV File ก็สามารถกดที่ Download Excel

ความหมาย:

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ที่กำหนดขึ้นโดย ThaiBMA
- Coupon: คูปองที่จ่าย หน่วยเป็นร้อยละต่อปี
- Maturity: วันครบกำหนดอายุตราสารหนี้
- TTM: อายุคงเหลือนับจากวัน settlement T+1 (calendar day) จนถึงวันที่หมดอายุของตราสารหนี้
- Type: ประเภทของตราสารหนี้โดยแบ่งตามการจ่ายเงินต้น
- Coupon Type: ประเภทของการจ่ายคูปอง
- Rating: อันดับความน่าเชื่อถือของบริษัทผู้ออกตราสารหนี้ซึ่งจัดอันดับโดย TRIS หรือ/และ FITCH (Thailand)
- Last Trade Date: วันที่มีการซื้อขายล่าสุด
- Last Trade Exe. Yield: อัตราผลตอบแทนซื้อขายจากการซื้อขายล่าสุด (ร้อยละ)
- Last Quotation Date: วันซึ่งมีการส่งราคาเสนอซื้อจากผู้ซื้อขายตราสารหนี้ตั้งแต่ 3 รายขึ้นไปครั้งล่าสุด

- Last Quotation Average: ค่าเฉลี่ยอัตราเสนอซื้อในครั้งล่าสุด (%)
- Last Quotation Max: อัตราเสนอซื้อสูงสุด
- Last Quotation Min: อัตราเสนอซื้อต่ำสุด
- Model Yield (%): อัตราผลตอบแทนจากแบบจำลองทางทฤษฎี (ร้อยละ) และส่วนชดเชยความเสี่ยง (Spread) หน่วยเป็น bp
- Spread: ค่าชดเชยความเสี่ยง (bp)
- Market Yield: อัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ที่ใช้อย่างอิง ณ สิ้นวัน หน่วยเป็นร้อยละ
- BEY (%): Bond equivalent yield
- DM (%): ส่วนล้าของอัตราผลตอบแทน (Discount Margin) หน่วยเป็นร้อยละ และจะแสดงผลสำหรับตราสารหนี้ที่จ่ายคูปองแบบลอยตัวเท่านั้น
- Clean Price (%): ราคาไม่รวมดอกเบี้ยค้างรับ หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋ว
- AI (%): ดอกเบี้ยค้างรับ หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋วราคาหน้าตั๋ว
- MOD: ค่า Modified Duration สำหรับตราสารหนี้ที่ไม่ใช่ตราสารหนี้ที่จ่ายคูปองแบบลอยตัว และค่า Effective Duration สำหรับตราสารหนี้ที่จ่ายคูปองแบบลอยตัว หน่วยเป็นปี
- CONV: Convexity หน่วยเป็นปี²
- Par: มูลค่าที่ตราไว้ต่อหน่วย หน่วยเป็นบาท ถ้าไม่มีการแสดงค่าหมายความว่าตราสารหนี้รุ่นนั้นไม่ได้ระบุมูลค่าที่ตราไว้
- Currency: สกุลเงินที่ออกตราสาร
- Registration Status: สถานะการขึ้นทะเบียนกับทาง ThaiBMA
- Index Ratio: ค่าที่ใช้ปรับเงินต้นและดอกเบี้ยเพื่อให้ชดเชยกับอัตราเงินเฟ้อ
- Outstanding: มูลค่าคงค้างปัจจุบัน (ล้านบาท)
- Issuer Rating: อันดับความน่าเชื่อถือของบริษัทผู้ออกตราสารหนี้
- Distribution Type: ลักษณะของการเสนอขายหลักทรัพย์
- ISIN Code: ISIN code

ที่มาของมูลค่าและหลักการคำนวณ:

อัตราผลตอบแทนที่ใช้อย่างอิง ณ สิ้นวัน (Market Yield) จะมาจากอัตราผลตอบแทนซื้อขายล่าสุดถ้ามีการซื้อขายตราสารหนี้ในวันนั้น ๆ แต่หากไม่มีการซื้อขาย Market Yield จะมาจากอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยจากผู้ซื้อขายตราสารหนี้ตั้งแต่ 3 รายขึ้นไป และถ้าหากไม่มีทั้งการซื้อขายและไม่มีอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยจากผู้ซื้อขายเกิน 3 ราย Market Yield จะได้จากแบบจำลองทางทฤษฎี (Model Yield)

ผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยได้มาจากธนาคารพาณิชย์ที่เป็นคู่ค้าหลักกับธนาคารแห่งประเทศไทย (Primary Dealer) ซึ่งจะทำการส่งอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลมาให้ ThaiBMA ทุกวัน

ในส่วนของพันธบัตรรัฐวิสาหกิจที่ค้าประกันโดยกระทรวงการคลัง ผู้ซื้อขายตราสารหนี้ (Dealer) จะส่งราคา/อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อมาให้กับทาง ThaiBMA ทุก 7 วัน และทุก 15 วัน สำหรับพันธบัตรรัฐวิสาหกิจที่ไม่มีการค้าประกันและหุ้นกู้ของบริษัทเอกชน

ราคาของตราสารหนี้ ดอกเบี้ยค้างรับ Modified Duration และ Convexity ที่แสดงในหน้านี้ได้มาจากการคำนวณด้วยหลักการเดียวกันกับหน้า Calculation โดยใช้อัตราผลตอบแทนอ้างอิง ณ สิ้นวัน โดยกำหนดให้วันส่งมอบและชำระราคา (Settlement Date) เป็น 1 วันหลังจากวันปัจจุบัน (T +1 Calendar day) เสมอ

ประโยชน์:

มูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ในหน้า Mark to Market ถูกใช้เป็นมูลค่าอ้างอิงโดยกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพในการคำนวณมูลค่าสินทรัพย์สุทธิ ณ สิ้นวัน (NAV)

ชื่อหน้า: Bond Price > Mark to Market > Structure Note MTM Page

ภาพประกอบ:

ThaiBMA STN Mark to Market

04/03/2020



ThaiBMA STN Mark to Market as of 4 March 2020
17:19:52

Download All

Download Excel

Symbol	Maturity	TTM (Yrs.)	Type	Rating		Last Trade		Last Quotation	
				TRIS	FITCH	Date	Exe.Gross Price %	Date	Avg.Gross Price (%)
CIMBT20DA	18-Dec-2020	0.79	Straight						
CIMBT20DB	18-Dec-2020	0.79	Straight						
CIMBT212A	11-Feb-2021	0.94	Straight						
CIMBT212B	11-Feb-2021	0.94	Straight						
CIMBT21NA	15-Nov-2021	1.70	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NB	15-Nov-2021	1.70	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NC	17-Nov-2021	1.70	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21ND	15-Nov-2021	1.70	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NE	17-Nov-2021	1.70	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NF	22-Nov-2021	1.72	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NG	22-Nov-2021	1.72	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NH	22-Nov-2021	1.72	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NI	22-Nov-2021	1.72	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NJ	24-Nov-2021	1.72	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NK	24-Nov-2021	1.72	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NL	25-Nov-2021	1.73	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NM	30-Nov-2021	1.74	Straight					07-Dec-2017	100.000000
CIMBT21NN	29-Nov-2021	1.74	Straight					07-Dec-2017	100.000000

ความหมาย:

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ทุน
- ISIN Code: ISIN code
- Maturity: วันครบกำหนดไถ่ถอน
- TTM: อายุคงเหลือนับถึงวันครบกำหนดไถ่ถอน หน่วยเป็นปี
- Type: ประเภทของตราสารหนี้โดยแบ่งตามการจ่ายเงินต้น
- Rating: อันดับความน่าเชื่อถือของบริษัทผู้ออกตราสารหนี้ซึ่งจัดอันดับโดย TRIS หรือและ FITCH (Thailand)
- Last Trade Date: วันที่มีการซื้อขายล่าสุด
- Last Trade Exe. Gross Price: ราคาซื้อขายล่าสุด (ร้อยละ)
- Last Quotation Date: วันที่ส่งราคาเสนอซื้อครั้งล่าสุด
- Last Quotation Avg. Gross Price: ราคาเสนอซื้อครั้งล่าสุด (ร้อยละ)
- Model Gross Price %: มูลค่าจากแบบจำลองทางทฤษฎี หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋ว
- MTM Gross Price %: มูลค่ายุติธรรมตราสารหนี้ (รวมดอกเบี้ยค้างรับ) อ้างอิง ณ สิ้นวัน
- Registration Status: สถานะการขึ้นทะเบียนกับทาง ThaiBMA
- Relevant Statistics: ข้อมูลเพิ่มเติมจากแบบจำลองทางทฤษฎี (ถ้ามี)

ที่มาของข้อมูล:

มูลค่ายุติธรรมตราสารหนี้อ้างอิง ณ สิ้นวัน (MTM Gross Price) ได้มาจากราคาซื้อขายล่าสุดถ้ามีการซื้อขายตราสารหนี้ในวันนั้น ๆ แต่หากไม่มีการซื้อขายจะใช้ราคาเสนอซื้อจากผู้ออกตราสารหนี้หรือผู้จัดจำหน่าย (Arranger/Underwriter) แทน ซึ่งโดยปกติจากผู้ออกตราสารหนี้หรือผู้จัดจำหน่ายจะส่งราคาเสนอซื้อมาให้กับทาง ThaiBMA ทุก 15 วัน (วันที่ 15 และวันสิ้นเดือน)

ประโยชน์:

มูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้อ่อนพันธบัตรในหน้า STN Mark to Market ถูกใช้เป็นมูลค่าอ้างอิง

ข้อหน้า: Bond Price > Mark to Market > Notice Pending Page

ภาพประกอบ:

Notice Pending Bonds

Symbol	Maturity	Expected Recovery Rate (%)	Pending Reason
+ Long-term Corporate Bonds			
ACAP190A	06-Oct-2020	-	This bond is restructured. Please note that the bond's maturity date is extended for 366 days from 6 October 2019 to 6 October 2020 with the increase interest rate from 6.00% to 7.50% per annum according to the Terms and Conditions Clause 2.1 For More Information: https://www.set.or.th/set/newsdetails.do?newsId=15701461821470&language=en&country=US
APEX202A	26-Aug-2020	-	This bond is restructured. According to APEX Development PCL meeting resolution 1/2563 for the bond APEX202A, the maturity date for debenture redemption is extended from 28 February 2020 to 26 August 2020. The coupon payment is increased from 6.25% per annum to 8.25% per annum commencing from 28 February 2020 until the redemption date. In addition, APEX may redeem the bond before it reaches the stated maturity. For more information, please visit https://www.set.or.th/set/newsdetails.do?newsId=156206969115591&language=th&country=TH
PACE202A	23-Feb-2023	-	This bond is restructured. Please note that, according to the amendment of clause 1 of the terms and conditions, the maturity date for debenture redemption is extended from 23 February 2020 to 23 February 2023. According to the amendment of clause 2.1 of the terms and conditions, the coupon payment is reduced from 6.5% per annum to 3.0% per annum commencing from the interest payment round May 2020 until the redemption date. In addition, the issuer shall pay the difference of the interest of 3.5% per annum in every round of interest payment commencing from May 2020 upon the redemption of debentures. For more information, please visit https://www.set.or.th/set/newsdetails.do?newsId=1573081815770&language=en&country=US (EN) or https://www.set.or.th/set/newsdetails.do?newsId=1573081815771&language=th&country=TH (TH)
TLUXE205A	08-May-2021	-	This bond is restructured. According to PP Prime PCL's Resolution of the Bondholders' Meeting No. 1/2020 (TLUXE205A), the bond's maturity date is extended from 8 May 2020 to 8 May 2021. In addition, the terms and conditions of the bond issuers and bondholders for maintaining the debt to equity ratio (D/E Ratio) of 3 : 1 has been exempted. For more information: https://www.set.or.th/set/newsdetails.do?newsId=1582755993560&language=en&country=US
TLUXE198A	02-Jul-2021	-	This bond is restructured. According to PP Prime PCL's Resolution of the Bondholders' Meeting No. 1/2020 (TLUXE198A), the bond's maturity date is extended from 2 July 2020 to 2 July 2021. However, the meeting resolved not to approve the amendment of the terms and conditions of the bond issuers and bondholders to exempt conditions for maintaining the debt to equity ratio (D/E ratio) of 3 : 1. Therefore, the Company shall maintain the debt to equity ratio (D/E ratio) as previously specified. For more information: https://www.set.or.th/set/newsdetails.do?newsId=1582755994220&language=en&country=US

Remark:

Expected Recovery rate calculated from Dealers' poll or Surveyed recovery rate that represent ONLY "indicative price".

Disclaimer:

ThaBMA is not responsible for any direct and indirect losses and damages caused by or occurred in connection with the use of and the access to the Data and ThaBMA's website.


แสดงข้อมูลของตราสารหนี้ที่ได้รับผลกระทบจากเหตุการณ์ที่มีนัยสำคัญ ที่ไม่สามารถประเมินราคาโดยวิธีปกติได้ โดยตราสารหนี้ดังกล่าวจะถูกนำออกจากหน้า Mark-To-Market ปกติ (Plain Vanilla MTM Pages และ Structure Note MTM Page) และแสดงผลเป็น 2 ประเภท


1. ตราสารหนี้ที่ผู้ออกยังไม่เข้าสู่กระบวนการฟื้นฟูกิจการหรือล้มละลาย: แสดงอัตราที่คาดว่าจะได้รับชำระคืนเมื่อตราสารหนี้เกิดการผิดนัดชำระหนี้ Expected Recovery Rate (%) และแจ้งเหตุการณ์ที่มีนัยสำคัญนั้น

2. ตราสารหนี้ที่ผู้ออกเข้าสู่กระบวนการฟื้นฟูกิจการหรือล้มละลาย: ไม่แสดงค่าทุกรูปแบบ และแจ้งเหตุการณ์ที่มีนัยสำคัญนั้น

ชื่อหน้า: Bond Price > Mark to Market > Download Historical MTM

ภาพประกอบ:

 ThaiBMA Mark to Market

Historical ThaiBMA Daily Report : 

Date	Plain Vanilla	Structure Note
02-Mar-2020	↓	↓
03-Mar-2020	↓	↓
04-Mar-2020	↓	↓

ผู้ใช้งานสามารถดาวน์โหลดข้อมูลมูลค่ายุติธรรมสำหรับตราสารหนี้ทั่วไปและมูลค่ายุติธรรมสำหรับตราสารหนี้อนุพันธ์ (Structured Note) ย้อนหลังในรูปแบบ CSV ได้

ชื่อหน้า: Bond Price > Mark to Market > MTM Yield Movement

ภาพประกอบ:

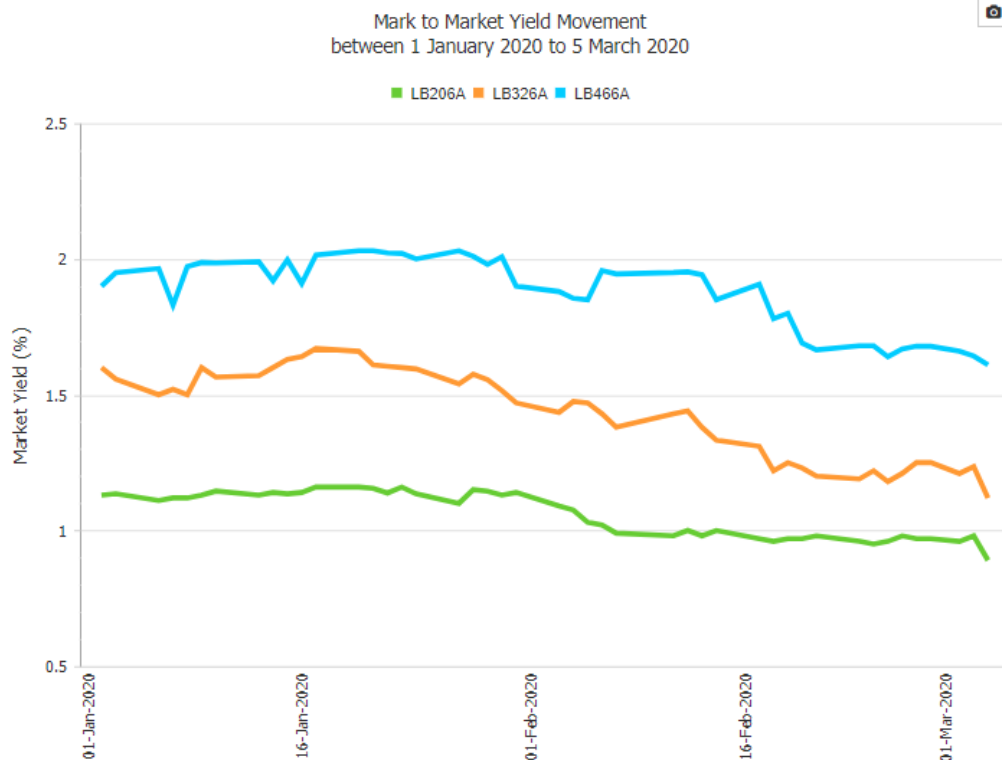
Mark to Market Yield Movement

As of : 01/01/2020 - 05/03/2020

Symbol : LB206A x LB326A x LB466A x

Data : Market Yield

[Download Excel](#)



Remark: For Inflation-Linked Bond, all the Yields(%) shown are Real YTM(%).

ในหน้า MTM Yield Movement นี้ สามารถเรียกดูข้อมูลย้อนหลังเป็น Time Series ของข้อมูล Mark to Market โดยอาจเลือกให้แสดง Mark to Market Yield หรือ Quotation ก็ได้ สามารถเลือกแสดงผลได้ทั้งในรูปแบบกราฟ และเลือกดาวน์โหลดข้อมูลในรูปแบบ Excel โดยกดที่ Download Excel

ชื่อหน้า: Bond Price > Mark to Market > MTM Price feedback

ภาพประกอบ:

Feedback on Mark-to-Market prices

ในหน้า MTM Price Feedback นี้ ผู้ใช้สามารถกรอกข้อมูลเพื่อส่งข้อมูลตราสารหนี้ที่ต้องการให้ตรวจสอบ หรือส่งข้อเสนอแนะต่างๆมายัง ThaiBMA โดยมีรายละเอียดในส่วนต่างๆดังนี้

- User Profile
 - User name: Username ของผู้ใช้ที่ Login เข้ามาใน ibond
 - Name: ชื่อของผู้ใช้ที่ Login เข้ามาใน ibond
 - Organization: หน่วยงานของผู้ใช้ที่ Login เข้ามาใน ibond
 - E-mail address: E-mail ของผู้ใช้ ที่ต้องการให้ส่งข้อมูลตอบกลับ (ผู้ใช้ต้องกรอก)
 - Telephone: หมายเลขโทรศัพท์ของผู้ใช้งาน (ผู้ใช้ต้องกรอก)
- Select bond to feedback
 - Mark-to-market date: วันที่ของ Mark-to-Market ที่ต้องการ Feedback
 - Bond Type: ชนิดของตราสารหนี้แบ่งเป็น SA, GB, GSOE, NSOE, FB, CP และ CORP (ผู้ใช้เลือกได้)
 - Bond Symbol: สัญลักษณ์ตราสารหนี้ที่ต้องการ feedback (ผู้ใช้เลือกได้)
 - Mark-to-market yield: อัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ที่ต้องการ Feedback
 - Feedback Detail: รายละเอียดต่างๆที่ผู้ใช้ต้องการส่งมาที่ ThaiBMA

Indices

รวบรวมข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับดัชนีตราสารหนี้ (Bond Index) หลากหลายประเภท ไว้ในหน้าเดียวกัน ประกอบไปด้วยเมนูย่อยทั้งหมด 12 เมนู

- | | |
|--------------------------------------|---|
| 1. Bond Index: | ดัชนีของพันธบัตรรัฐบาล, พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ, หุ้นกู้เอกชน |
| 2. Composite Bond Index: | ดัชนีที่คำนวณรวมทั้งพันธบัตรรัฐบาล, พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ, หุ้นกู้เอกชน เข้าด้วยกัน |
| 3. T-Bill Index: | ดัชนีของตั๋วเงินคลัง |
| 4. Zero Rate Return Index: | ดัชนีอัตราผลตอบแทนของการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล ที่มีอายุคงที่ |
| 5. SOE Zero Rate Return Index: | ดัชนีอัตราผลตอบแทนของการลงทุนในพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ ที่มีอายุคงที่ |
| 6. Corporate Zero Rate Return Index: | ดัชนีอัตราผลตอบแทนของการลงทุนในหุ้นกู้เอกชน ที่มีอายุคงที่ |
| 7. Commercial Paper Index: | ดัชนีของตราสารหนี้เอกชนระยะสั้น |
| 8. Short-term Government Bond Index | ดัชนีของพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้น |
| 9. MTM Government Bond Index | ดัชนีของตราสารหนี้รัฐบาลที่คำนวณจากราคา Mark-to-Market |
| 10.MTM Corporate Bond Index: | ดัชนีของตราสารหนี้เอกชนที่คำนวณจากราคา Mark-to-Market |
| 11.Inflation-Linked Bond Index: | ดัชนีตราสารหนี้อ้างอิงอัตราเงินเฟ้อ |
| 12.Customized Bond Index | ดัชนีจำลองพอร์ตตามการลงทุนของผู้ใช้งาน |

ชื่อหน้า: Indices > Bond Index

ความหมายและประโยชน์ของดัชนีตราสารหนี้:

เนื่องจากการลงทุนประเภทต่างๆ นั้น นักลงทุนมักจะนำดัชนีบางอย่างเข้ามาใช้ในการเปรียบเทียบผลตอบแทนจากการลงทุน (Benchmark Index) ซึ่งตัววัดนี้ทำให้นักลงทุนทราบถึงสถานะความเคลื่อนไหวของตลาดโดยรวมที่เกี่ยวข้องกับการลงทุน ยกตัวอย่างเช่น ถ้านักลงทุนมีพอร์ตการลงทุนในหุ้นอยู่หนึ่งพอร์ตซึ่งประกอบไปด้วยหุ้นต่างๆ ที่ได้เลือกไว้ อัตราผลตอบแทนที่ได้จากการลงทุนในพอร์ตนี้สามารถที่จะนำไปเปรียบเทียบกับดัชนีตลาดหลักทรัพย์ (SET Index) หรือดัชนีหุ้นตัวอื่นที่เราสนใจในช่วงระยะเวลาของการลงทุนที่เท่ากัน ซึ่งจะทำให้นักลงทุนได้เห็นว่าการบริหารพอร์ตการลงทุนในหุ้นที่มีอยู่นั้นสามารถทำได้ดีกว่าดัชนีเปรียบเทียบหรือไม่

แนวทางในการวัดแบบนี้จะเป็นที่นิยมใช้กันมากในหมู่ผู้บริหารกองทุน (Fund manager) เนื่องจากเป็นตัววัดความสามารถในการบริหารพอร์ตแบบ Active Portfolio ของผู้บริหารกองทุนว่าจะทำได้ดีกว่าอัตราผลตอบแทนจากดัชนีที่นำมาเปรียบเทียบหรือไม่ ถ้าทำได้ดีกว่าก็แปลว่าผู้บริหารกองทุนนั้นๆ มีความสามารถที่เหนือกว่าในการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่นำมาลงทุนในพอร์ต ซึ่งหลักการในการเปรียบเทียบการบริหารพอร์ต การลงทุนนี้สามารถนำไปใช้กับการลงทุนในตราสารหนี้ได้โดยใช้ดัชนีตราสารหนี้เป็นตัวเปรียบเทียบ

ดัชนีตราสารหนี้ (Bond Index) คือ เครื่องมือทางการเงินที่ผู้ลงทุนใช้ติดตามความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้โดยรวมหรือกลุ่มของตราสารหนี้ที่ได้จัดกลุ่มไว้ โดยดัชนีตราสารหนี้มีหลายประเภทขึ้นอยู่กับวัตถุประสงค์หรือผลตอบแทนที่ต้องการวัดจากการลงทุนในกลุ่มตราสารหนี้ นั้นๆ ซึ่งประโยชน์ของดัชนีตราสารหนี้สามารถสรุปได้ดังนี้

1. เป็นเครื่องมือติดตามภาวะความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้ โดยดัชนีเป็นตัวชี้การเคลื่อนไหวของราคา และดอกเบี้ยที่นักลงทุนจะได้รับ และภาวะการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ย
 - หากอัตราดอกเบี้ยลดลง ราคาตราสารหนี้จะสูงขึ้น ค่าดัชนีจะสูงขึ้น
 - หากอัตราดอกเบี้ยเพิ่มขึ้น ราคาตราสารหนี้จะลดลง ค่าดัชนีจะลดลง
2. เป็นเครื่องมือที่ใช้เปรียบเทียบผลประกอบการจากการลงทุน โดยเปรียบเทียบผลตอบแทนที่คำนวณจากค่าดัชนีกับผลตอบแทนที่ได้รับจากการลงทุนในพอร์ตของตนเอง ในกรณีนี้อาจพิจารณาองค์ประกอบอื่นควบคู่ไปด้วย เช่น อายุเฉลี่ยของตราสารประเภทของตราสาร และ Duration ของพอร์ต
3. เป็นเครื่องมือใช้เปรียบเทียบความเคลื่อนไหวระหว่างตลาดของตราสารประเภทต่างๆ เช่น ตลาดหุ้น ตลาดตราสารหนี้ ตลาดเงิน ทั้งในด้านผลตอบแทน ความเสี่ยง ความผันผวนของตลาด เป็นต้น
4. เป็นเครื่องมือสำคัญที่รองรับธุรกรรมใหม่ๆ ที่ใช้ในการบริหารความเสี่ยง เช่น ธุรกรรมอนุพันธ์ อันได้แก่ Bond Index Option เป็นต้น

ดัชนีตราสารหนี้ที่จัดทำและเผยแพร่โดย ThaiBMA:

- ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล (ThaiBMA Government Bond Index)

ภาพประกอบ:

Bond Index

04/03/2020

Download Excel

ThaiBMA Bond Index as of 04 March 2020

Type	Index							Average			Download Excel	
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Net Total Return	chg. (point)	Yield	Duration		Convexity
Government Bond Index	121.78	+0.84	122.57	+0.85	335.56	+2.31	104.49	+0.72	1.47	10.62	222.03	⬇️
Group 1 (1 < TTM <= 3)	75.25	+0.10	75.88	+0.11	211.20	+0.30	101.90	+0.14	0.73	2.03	5.52	⬇️
Group 2 (3 < TTM <= 7)	114.46	+0.47	115.25	+0.47	306.01	+1.26	103.52	+0.43	0.80	4.55	25.56	⬇️
Group 3 (7 < TTM <= 10)	153.80	+1.29	154.97	+1.30	420.70	+3.53	105.15	+0.88	0.95	7.68	68.72	⬇️
Group 4 (> 10)	212.59	+2.01	213.78	+2.03	585.68	+5.56	105.66	+1.00	1.63	16.83	417.16	⬇️
Group 5 (<= 10)	95.83	+0.41	96.54	+0.42	260.90	+1.14	103.35	+0.45	0.86	4.53	30.43	⬇️
Group 6 (<= 1)	75.64	0.00	76.01	+0.01	137.61	+0.01	100.69	+0.01	0.92	0.31	0.25	⬇️
Group 7 (10 < TTM <= 30)	161.34	+1.18	162.25	+1.19	283.61	+2.08	105.08	+0.77	1.43	13.59	235.79	⬇️
SOE (G) Bond Index	107.08	+0.44	107.69	+0.44	181.28	+0.75	103.18	+0.42	1.05	3.94	26.52	⬇️
Group 1 (1 < TTM <= 3)	95.40	+0.16	95.99	+0.16	161.43	+0.28	101.90	+0.17	0.87	1.95	5.01	⬇️
Group 2 (3 < TTM <= 7)	118.11	+0.60	118.72	+0.61	199.48	+1.02	103.92	+0.53	0.95	4.74	27.14	⬇️
Group 3 (7 < TTM <= 10)	138.73	+1.35	139.36	+1.36	233.94	+2.28	105.96	+1.03	1.17	7.96	72.31	⬇️
Group 4 (> 10)	151.66	+1.51	152.47	+1.52	257.48	+2.57	106.08	+1.06	1.40	10.12	117.94	⬇️
Group 5 (<= 10)	104.99	+0.38	105.59	+0.39	177.82	+0.66	102.94	+0.38	0.98	3.48	19.69	⬇️
SOE (NG) Bond Index	116.74	+0.80	117.66	+0.79	203.67	+1.40	103.94	+0.71	1.60	6.17	65.12	⬇️
Group 1 (1 < TTM <= 3)	97.40	+0.15	98.18	+0.16	164.49	+0.26	102.06	+0.16	0.98	1.87	4.82	⬇️
Group 2 (3 < TTM <= 7)	115.48	+0.46	116.49	+0.47	203.49	+0.83	103.42	+0.42	1.10	4.11	20.63	⬇️
Group 3 (7 < TTM <= 10)	132.17	+1.22	133.55	+1.18	235.73	+2.17	104.76	+0.96	1.44	7.41	64.04	⬇️
Group 4 (> 10)	138.00	+1.79	138.81	+1.77	244.32	+3.17	105.96	+1.37	1.86	11.29	154.06	⬇️
Group 5 (<= 10)	109.82	+0.43	110.80	+0.43	190.84	+0.76	103.02	+0.41	1.22	3.73	22.65	⬇️

Remark:

1. Government Bond Indices are calculated from government Loan Bond (LB) only.
2. The base date of sub group 4 's index is 12 March 1999. The base date of other indices is 4 January 1999.
3. The net total return indices are calculated by applying the withholding tax rates to accrued interest and coupon payments on all coupon bonds. The tax rates may change from time to time due to changes to the withholding tax rate applicable in Thailand. The current and historical withholding tax rate is 15%.
4. The base date of the net total return indices is 20 August 2019.

ดัชนีวัดความเคลื่อนไหวของพันธบัตรรัฐบาลประเภท Loan Bond (หรือที่ขึ้นต้นตามสัญลักษณ์ ThaiBMA ด้วยอักษร LB) โดยประกอบด้วยข้อมูลย่อย เช่น Average Yield, Average Duration และ Average Convexity ซึ่งเป็นค่าเฉลี่ยของ Yield, Duration และ Convexity ของกลุ่มพันธบัตรที่ใช้ในการคำนวณดัชนีถ่วงน้ำหนักด้วยมูลค่าคงค้างของพันธบัตรรัฐบาลแต่ละรุ่น

นอกจากกลุ่มดัชนีพันธบัตรรัฐบาลรวมที่ประกอบด้วยพันธบัตรรัฐบาลทุกรุ่นแล้ว ThaiBMA ยังได้จัดทำดัชนีพันธบัตรรัฐบาลแยกเป็นกลุ่มย่อยๆ อีก 7 กลุ่มโดยแบ่งตามอายุคงเหลือ ได้แก่

- 1) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี (1<TTM<=3)
- 2) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 3 ถึง 7 ปี (3<TTM<=7)
- 3) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 7 ถึง 10 ปี (7<TTM<=10)
- 4) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 10 ปี (>10)
- 5) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือน้อยกว่าหรือเท่ากับ 10 ปี แต่มากกว่า 14 วัน (<=10)
- 6) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือน้อยกว่าหรือเท่ากับ 1 ปี (<=10)
- 7) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 10 ถึง 30 ปี (10<TTM<=30)

ทั้งนี้การลงทุนในตราสารหนี้ส่วนใหญ่ มักจะมีการแบ่งการลงทุนตามช่วงอายุต่างๆ ของตราสารหนี้ เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทน และผลกระทบต่อ การเปลี่ยนแปลงราคาของตราสารหนี้ที่มีอายุสั้นและยาวจะไม่เท่ากัน การจัดทำดัชนีตราสารหนี้แยกเป็นกลุ่มย่อยๆ จะช่วยให้มีเครื่องมือวัดความเคลื่อนไหวที่ละเอียดขึ้นตลอดจนใช้เปรียบเทียบกองทุนที่มีนโยบายการลงทุนแตกต่างกันได้

ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป

- ดัชนีหุ้นกู้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน (Investment Grade Corporate Bond Index)

ภาพประกอบ:

ThaiBMA Investment Grade Corporate Bond Index [Download Excel](#)

Type	Index								Average			Average Time To Maturity	Download Excel
	Clean Price	chg. (poi...)	Gross Price	chg. (poi...)	Total Return	chg. (poi...)	Net Total Return	chg. (point)	Yield	Durat...	Conve...		
Corporate Bond Index (BBB+ up)	106.26	+0.03	107.10	+0.03	249.94	+0.09	102.31	+0.03	2.13	3.00	18.37	3.28	
Group 1 (1 < TTM <= 3)	97.93	+0.02	98.63	+0.03	224.19	+0.07	101.83	+0.03	1.54	1.69	3.92	1.75	
Group 2 (3 < TTM <= 7)	127.05	+0.03	128.23	+0.04	297.35	+0.09	102.98	+0.03	2.02	4.13	20.94	4.53	
Group 3 (7 < TTM <= 10)	137.03	+0.10	138.37	+0.11	378.39	+0.30	104.77	+0.08	2.47	7.22	61.57	8.52	
Corporate Bond Index (BBB up)	105.72	+0.03	106.55	+0.03	248.04	+0.08	102.30	+0.03	2.13	3.00	18.31	3.27	
Group 1 (1 < TTM <= 3)	98.16	+0.02	98.87	+0.03	224.26	+0.07	101.83	+0.03	1.55	1.69	3.92	1.75	
Group 2 (3 < TTM <= 7)	125.88	+0.03	127.06	+0.04	295.12	+0.09	102.98	+0.03	2.04	4.13	20.90	4.53	
Group 3 (7 < TTM <= 10)	139.36	+0.10	140.72	+0.11	384.29	+0.31	104.77	+0.08	2.47	7.22	61.57	8.52	

ดัชนีหุ้นกู้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน (ThaiBMA Investment Grade Corporate Bond Index) แบ่งออกเป็น 2 กลุ่มย่อยด้วยกันคือ หุ้นกู้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือตั้งแต่ BBB ขึ้นไป และ BBB+ ขึ้นไป แยกเป็นกลุ่มย่อยๆ อีก 3 กลุ่มโดยแบ่งตามอายุคงเหลือ ได้แก่

- 1) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ของหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี (1<TTM<=3)
- 2) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ของหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 3 ถึง 7 ปี (3<TTM<=7)
- 3) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ของหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 7 ถึง 10 ปี (7<TTM<=10)

โดยหุ้นกู้อ้างอิงจะเป็นแบบจ่ายดอกเบี้ยแบบคงที่ การจัดทำดัชนีหุ้นกู้แยกต่างหากจากดัชนีพันธบัตรรัฐบาลเพื่อให้สามารถวัดความเคลื่อนไหวของการลงทุนในหุ้นกู้เอกชนซึ่งเป็นเครื่องมือวัดผลการดำเนินงานของพอร์ตการลงทุนหรือของกองทุนต่างๆได้อย่างละเอียดยิ่งขึ้น เนื่องจากการเคลื่อนไหวของราคาหุ้นกู้มีลักษณะเฉพาะและอาจแตกต่างจากความเคลื่อนไหวของพันธบัตรรัฐบาล ThaiBMA ได้เริ่มจัดทำดัชนีหุ้นกู้ตั้งแต่วันที่ 2 กรกฎาคม 2544 เป็นต้นมา


ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

ชื่อหน้า: Indices > Composite Bond Index

ภาพประกอบ:

 Composite Bond Index

Type	Index						Average			Download Excel
	Clean Price	chg.(point)	Gross Price	chg.(point)	Total Return	chg.(point)	Yield	Duration	Convexity	
Composite Bond Index	119.95	+0.61	120.77	+0.62	209.75	+1.08	1.51	8.13	152.57	

Remark:

1. Composite Bond Index is calculated from Government Bond Index, SOE(G) Bond Index, SOE(NG) Bond Index and Corporate Bond Index (BBB up).
2. The base date of Composite Bond Index is 1 September 2006.

ดัชนีตราสารหนี้ไทย (Composite Bond Index) เป็นดัชนีวัดการลงทุนตราสารหนี้ทุกประเภทในตลาดตราสารหนี้ไทย การจัดทำดัชนีตราสารหนี้ประเภทนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อวัดความเคลื่อนไหวของการลงทุนในตราสารหนี้ทั้งตลาด ฐานของดัชนีตราสารหนี้ไทยนี้เริ่มต้นที่ 100 ในวันที่ 1 กันยายน 2549 โดยดัชนีตราสารหนี้ไทยจะคำนวณจากดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ดัชนีพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ ทั้งที่ค้าประกันโดยกระทรวงการคลังและไม่ค้าประกัน และดัชนีหุ้นกู้เอกชนที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับนำลงทุน (Corporate Bond Index BBB up)

การวัดผลการลงทุนโดยใช้ดัชนีตราสารหนี้:

เมื่อนักลงทุนทราบแล้วว่าดัชนีตราสารหนี้ต่างๆอยู่หลายประเภทสิ่งที่คุณจำเป็นต้องทำความเข้าใจ คือ การเลือกใช้ดัชนีที่เหมาะสมกับพอร์ตการลงทุนที่พิจารณาอยู่ กรณีที่นักลงทุนพิจารณาพอร์ตตราสารหนี้ที่ลงทุนเฉพาะในพันธบัตรรัฐบาล ดัชนีที่เหมาะสมในการนำมาเป็นตัววัดผลการบริหารพอร์ตการลงทุน คือดัชนีพันธบัตรรัฐบาล โดยที่ดัชนีตัวนี้มีกลุ่มย่อย (Subgroup) ที่แยกออกเป็นช่วงอายุคงเหลือต่างๆ เช่น 1 - 3 ปี หรือว่า 3 - 7 ปี เป็นต้น ซึ่งนักลงทุนจำเป็นต้องดูว่าพันธบัตรรัฐบาลที่เรานำมาประกอบอยู่ในพอร์ตลงทุนนั้นใกล้เคียงกับพันธบัตรในกลุ่มย่อยเหล่านี้หรือไม่

ถ้าหากว่าใกล้เคียงกว่าเราก็ควรใช้ดัชนีพันธบัตรรัฐบาลที่เป็นกลุ่มย่อยเป็นตัววัดแทนซึ่งจะเหมาะสมกว่า ยกตัวอย่างเช่น ถ้าพอร์ตการลงทุนเราประกอบด้วยพันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือสิบปีขึ้นไปเท่านั้น การที่นักลงทุนใช้ดัชนีพันธบัตรรัฐบาลปกติที่คำนวณมาจากพันธบัตรรัฐบาลในทุกช่วงอายุคงเหลือก็คงไม่เหมาะสมนัก ในกรณีนี้ ดัชนีที่เป็นตัววัดที่เหมาะสมควรเป็นดัชนีพันธบัตรรัฐบาลกลุ่มย่อยที่ช่วงอายุมากกว่า 10 ปี (TTM > 10 ปี) อย่างไรก็ตาม ตัวอย่างการเลือกใช้ดัชนีตราสารหนี้ที่เหมาะสมกันได้ถูกกล่าวถึงอย่างคร่าวๆ ก่อนหน้านี้แล้วแต่สิ่งที่คุณต้องเข้าใจเกี่ยวกับการวัดผลการลงทุนโดยใช้ดัชนี คือ วัตถุประสงค์และแรงจูงใจในการใช้ดัชนีเป็นตัววัดผล

ความหมาย:

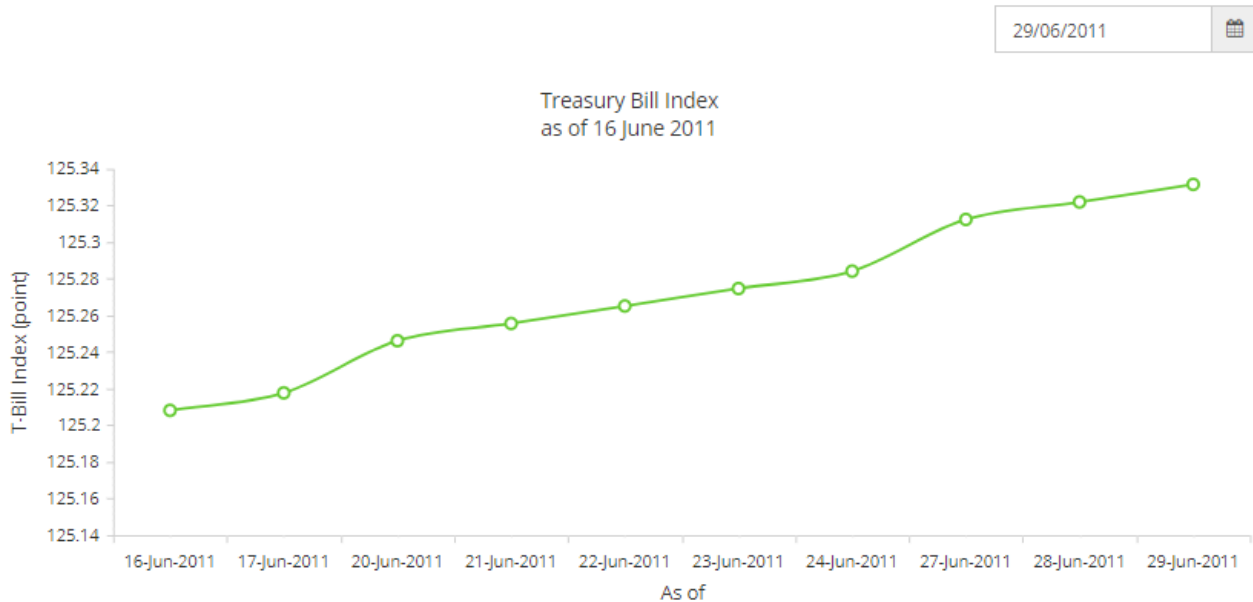
- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index

- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป

ชื่อหน้า: Indices > T-Bill Index

ภาพประกอบ:

Treasury Bill Index




[Download Excel](#)


As of	T-Bill Index	Change (point)	Average Duration Index
29-Jun-2011	125.331233	+0.009594	0.000000
28-Jun-2011	125.321639	+0.009519	0.002740
27-Jun-2011	125.312120	+0.028169	0.005479
24-Jun-2011	125.283951	+0.009486	0.013699
23-Jun-2011	125.274465	+0.009502	0.016438
22-Jun-2011	125.264963	+0.009537	0.009589
21-Jun-2011	125.255426	+0.009416	0.012329
20-Jun-2011	125.246010	+0.028394	0.015068
17-Jun-2011	125.217616	+0.009543	0.023288
16-Jun-2011	125.208073	+0.009229	0.026027

ดัชนีตั๋วเงินคลัง (T-Bill Index) เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ระยะสั้นที่ปราศจากความเสี่ยง คือ ตั๋วเงินคลัง โดยการเปรียบเทียบผลตอบแทนที่คำนวณจากค่าดัชนีตั๋วเงินคลังกับผลตอบแทนจากการลงทุนในพอร์ตของนักลงทุน หลักการสร้างดัชนีตั๋วเงินคลังของ ThaiBMA เปรียบเสมือนกับการลงทุนในตั๋วเงินคลังทุกรุ่นที่มีอยู่ในตลาด โดยสัดส่วนของการลงทุนในตั๋วเงินคลังแต่ละรุ่นคำนวณได้จากมูลค่าค้าง (Outstanding Value) ของตั๋วเงินคลัง

ชื่อหน้า: Indices > Zero Rate Return Index









ภาพประกอบ:

 Zero Rate Return Index

04/03/2020 

[Download all TTM and Date](#) [Download Excel](#)

Zero Rate Return (ZRR) Index as of 04 March 2020

TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Download Excel
1-Month	0.962937	-2.199118	146.951277	+0.006288	
3-Month	0.925517	-4.299915	150.408641	+0.019658	
6-Month	0.887228	-4.930004	154.495063	+0.041128	
1-Year	0.827383	-5.846524	163.120716	+0.097721	
2-Year	0.706512	-8.770468	174.998721	+0.308412	
3-Year	0.740186	-8.666744	194.950856	+0.506409	
4-Year	0.752024	-8.812624	212.623721	+0.747137	
5-Year	0.774669	-10.175791	233.701383	+1.183493	

Download:

ZRR Index Construction Methodology

ดัชนี Zero Rate Return (ZRR Index) เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้อายุคงที่ที่ปราศจากความเสี่ง เช่น ZRR 1 Year Index เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ที่ไร้ความเสี่ยงที่มีอายุคงที่ที่ 1 ปี โดยวันฐานของดัชนีจะเริ่มต้นที่ 100 ในวันที่ 2 มกราคม 2545 ดัชนีนี้จะมีประโยชน์สำหรับใช้เป็นดัชนีเปรียบเทียบพอร์ตการลงทุนที่มีนโยบายการลงทุนในตราสารหนี้โดยกำหนดอายุเฉลี่ยของพอร์ตลงทุนที่คงที่

ความหมาย:

- Zero Rate: Zero Rate
- Zero Rate Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate เทียบกับวันก่อนหน้า
- Zero Rate Index: Zero Rate Index
- Zero Rate Index Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate Index เทียบกับวันก่อนหน้า

ชื่อหน้า: Indices > SOE Zero Rate Return Index

ภาพประกอบ:

SOE Zero Rate Return Index

04/03/2020

SOE-Guaranteed Zero Rate Return Index as of 04 March 2020

Download all TTM and Date

Download Excel

TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Download Excel
1-Year	0.827383	-5.846524	11.682484	0.000000	140.459237	+0.084705	📄
2-Year	0.706512	-8.770468	16.126236	0.000000	152.091107	+0.268583	📄
3-Year	0.740186	-8.666744	19.278080	0.000000	166.763476	+0.433611	📄
4-Year	0.752024	-8.812624	21.722399	0.000000	178.080940	+0.625890	📄
5-Year	0.774669	-10.175791	23.719329	0.000000	188.903663	+0.956077	📄

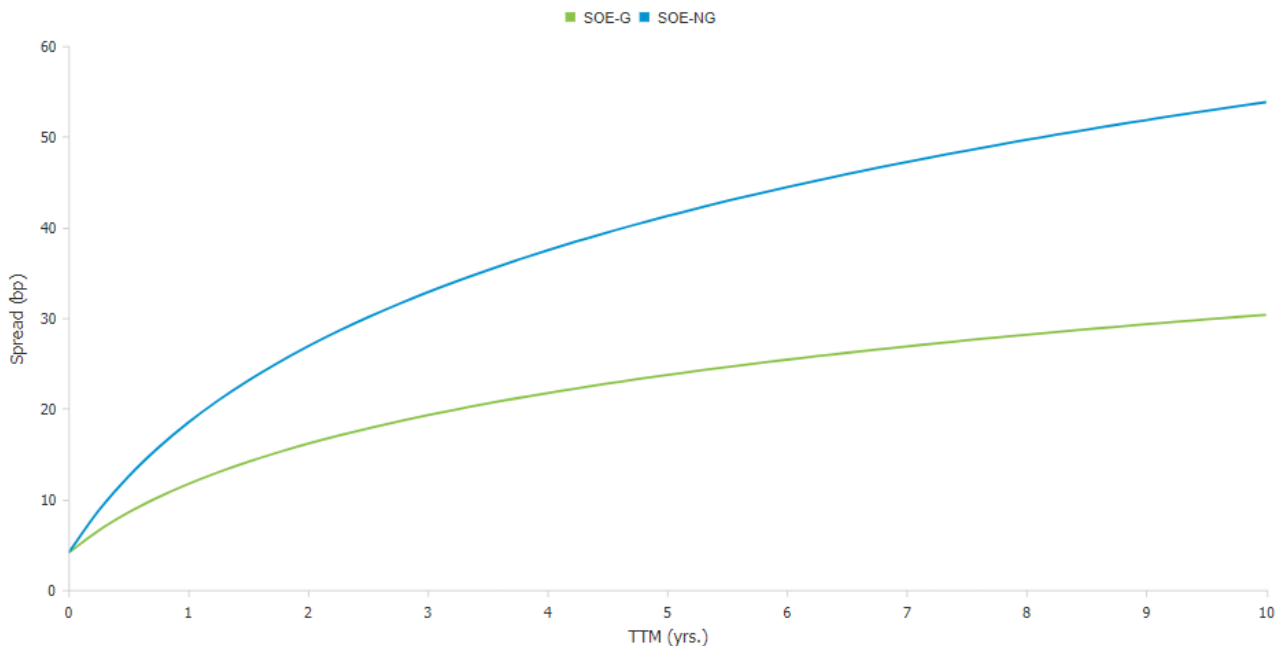
SOE-Non Guaranteed Zero Rate Return Index as of 04 March 2020

Download all TTM and Date

Download Excel

TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Download Excel
1-Year	0.827383	-5.846524	18.450339	0.000000	142.485491	+0.086323	📄
2-Year	0.706512	-8.770468	26.865351	0.000000	154.823700	+0.273846	📄
3-Year	0.740186	-8.666744	32.833910	0.000000	170.006244	+0.442417	📄
4-Year	0.752024	-8.812624	37.462651	0.000000	181.590875	+0.638399	📄
5-Year	0.774669	-10.175791	41.244181	0.000000	192.520703	+0.974042	📄

ThaiBMA Term Structure of Corporate Spread
as of 28 February 2020



Download:

ZRR Index Construction Methodology

ดัชนีพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ประเภทพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ วันฐานของดัชนีพันธบัตรรัฐวิสาหกิจนี้เริ่มต้นที่ 100 ในวันที่ 1 สิงหาคม 2549 โดยพันธบัตรรัฐวิสาหกิจที่นำมาคำนวณหาดัชนีรวมพันธบัตรรัฐวิสาหกิจทั้งที่ค้าประกันโดยกระทรวงการคลังและไม่ค้าประกัน ทั้งนี้ พันธบัตรรัฐวิสาหกิจที่นำมาคำนวณดัชนีนั้นต้องมีเกณฑ์คัดเลือกและสูตรการคำนวณดัชนีเช่นเดียวกับดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอาทิ ณ วันคำนวณหาดัชนี ตราสารที่นำมาคำนวณต้องมีอายุคงเหลือ (TTM) มากกว่า 14 วัน ต้องเป็นประเภทจ่ายดอกเบี้ยคงที่ (Fixed coupon) เป็นต้น

ความหมาย:

- Zero Rate: Zero Rate
- Zero Rate Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate เทียบกับวันก่อนหน้า
- Spread: Spread ที่เกิดจากส่วนต่างของ Zero Rate
- Spread Change: การเปลี่ยนแปลงของ Spread เทียบกับวันก่อนหน้า
- Zero Rate Index: Zero Rate Index
- Zero Rate Index Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate Index เทียบกับวันก่อนหน้า

หน้า: Indices > Corporate Zero Rate Return Index

ภาพประกอบ:

Corporate Zero Rate Return Index

04/03/2020

Corporate Zero Rate Return Index - AAA as of 04 March 2020

Download all TTM and Date Download Excel

TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Download Excel
1-Year	0.827383	-5.846524	28.778834	0.000000	145.673008	+0.088958	Download
2-Year	0.706512	-8.770468	45.078967	0.000000	158.646220	+0.281447	Download
3-Year	0.740186	-8.666744	56.640246	0.000000	173.868162	+0.453219	Download
4-Year	0.752024	-8.812624	65.606258	0.000000	184.962922	+0.650645	Download
5-Year	0.774669	-10.175791	72.931195	0.000000	195.044296	+0.986268	Download

Corporate Zero Rate Return Index - AA as of 04 March 2020

Download all TTM and Date Download Excel

TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Download Excel
1-Year	0.827383	-5.846524	64.283234	0.000000	149.864443	+0.092652	Download
2-Year	0.706512	-8.770468	80.583367	0.000000	163.018929	+0.289775	Download
3-Year	0.740186	-8.666744	92.144646	0.000000	178.227501	+0.464688	Download
4-Year	0.752024	-8.812624	101.110658	0.000000	189.049727	+0.664535	Download
5-Year	0.774669	-10.175791	108.435595	0.000000	198.704851	+1.003206	Download

Corporate Zero Rate Return Index - A as of 04 March 2020

Download all TTM and Date Download Excel

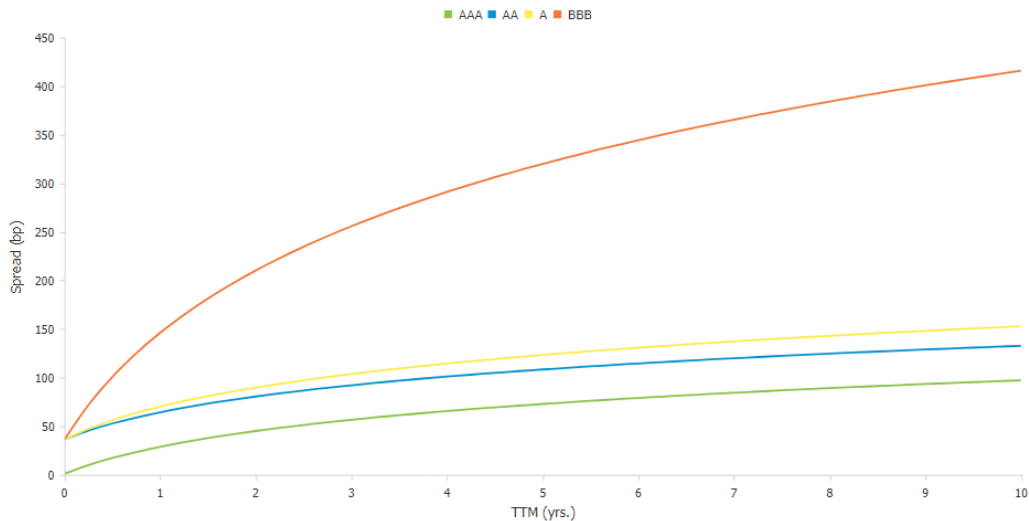
TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Download Excel
1-Year	0.827383	-5.846524	70.060950	0.000000	152.796396	+0.094825	Download
2-Year	0.706512	-8.770468	89.751346	0.000000	166.895494	+0.297066	Download
3-Year	0.740186	-8.666744	103.717254	0.000000	182.783239	+0.476910	Download
4-Year	0.752024	-8.812624	114.548105	0.000000	193.975126	+0.682009	Download
5-Year	0.774669	-10.175791	123.396555	0.000000	203.815608	+1.028713	Download

Corporate Zero Rate Return Index - BBB as of 04 March 2020

Download all TTM and Date Download Excel

TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Download Excel
1-Year	0.827383	-5.846524	145.973792	0.000000	173.628412	+0.113099	Download
2-Year	0.706512	-8.770468	210.208512	0.000000	193.745128	+0.350935	Download
3-Year	0.740186	-8.666744	255.768603	0.000000	213.872221	+0.563298	Download
4-Year	0.752024	-8.812624	291.101399	0.000000	227.313683	+0.801756	Download
5-Year	0.774669	-10.175791	319.967132	0.000000	238.258970	+1.198240	Download

ThaiBMA Term Structure of Corporate Spread as of 28 February 2020



Download:

ZRR Index Construction Methodology

ดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ประเภทหุ้นกู้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือระดับ AAA, AA, A และ BBB โดยหุ้นกูดังกล่าวที่นำมาคำนวณหาดัชนีแบ่งออกเป็น กลุ่มที่ประกอบไปด้วยหุ้นกู้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือระดับ AAA, AA, A และ BBB ตามลำดับ และในแต่ละกลุ่มที่แบ่งตามอันดับความน่าเชื่อถือ จะแบ่งเป็น 5 กลุ่มย่อย ตาม TTM ที่ 1 ปี, 2 ปี, 3 ปี, 4 ปี และ 5 ปี เพื่อให้สะท้อนถึงความแตกต่างที่ TTM ต่างๆ ซึ่งดีกว่า average spread ที่ถูกแบ่งออกเป็นช่วงอายุ ได้แก่ น้อยกว่าหรือเท่ากับ 3 ปี, ระหว่าง 3 ถึง 5 ปี, และมากกว่าหรือเท่ากับ 5 ปี ทั้งนี้วิธีการคำนวณและหลักการของ Corporate ZRR Index เป็นไปในลักษณะคล้ายกับการคำนวณและหลักการของ ZRR Index ซึ่งในกรณีของ Corporate ZRR Index จะมองไปที่ spread ที่มีค่าต่างกันที่ TTM ต่างๆ แต่ในกรณีของ ZRR Index จะมองไปที่ YTM ที่มีค่าต่างกันที่ TTM ต่างๆ

ความหมาย:

- Zero Rate: Zero Rate
- Zero Rate Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate เทียบกับวันก่อนหน้า
- Spread: Spread ที่เกิดจากส่วนต่างของ Zero Rate
- Spread Change: การเปลี่ยนแปลงของ Spread เทียบกับวันก่อนหน้า
- Zero Rate Index: Zero Rate Index
- Zero Rate Index Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate Index เทียบกับวันก่อนหน้า

ชื่อหน้า: Indices > Commercial Paper Index

ภาพประกอบ:

[Commercial Paper Index](#)

Type	Index						Average				Average Time To Maturity	Download Excel
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Yield	Simple Yield	Duration	Convexity		
Commercial Paper Index (AA- up)	120.458188	+0.011586	120.508469	+0.011872	140.075435	+0.014122	1.329726	1.242436	0.111293	0.058990	0.111842	📄
Commercial Paper Index (A- up)	124.009012	+0.014910	124.091326	+0.015572	141.507138	+0.017583	1.229300	1.230700	0.201864	0.154081	0.203261	📄
Commercial Paper Index (BBB- up)	126.843147	+0.015772	126.940988	+0.012910	145.078736	+0.018844	1.343796	1.325421	0.209253	0.158672	0.210784	📄

Remark:

1. Commercial Paper Indices are categorized into 3 types based on different securities composition in their calculation baskets. For instance, the calculation basket of Commercial Paper Index (AA- up) is composed of selected commercial papers of the issuers with rating AA- and above.

2. The base dates of Commercial Paper Indices are 1 September 2006.

ดัชนีตัวสัญญาใช้เงินระยะสั้น (Commercial Paper Index) เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ประเภทตัวสัญญาใช้เงินระยะสั้น วันฐานของดัชนีตัวสัญญาใช้เงินระยะสั้น นี้เริ่มต้นที่ 100 ในวันที่ 1 กันยายน 2549 โดยตัวสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่นำมาคำนวณหาดัชนีแบ่งออกเป็น 3 กลุ่ม ได้แก่

- 1) กลุ่มที่ประกอบไปด้วยตัวสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่มีระดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกที่ AA- หรือสูงกว่า
- 2) กลุ่มที่ประกอบไปด้วยตัวสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่มีระดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกที่ A- หรือสูงกว่า
- 3) กลุ่มที่ประกอบไปด้วยตัวสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่มีระดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกที่ BBB- หรือสูงกว่า

ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Simple Yield: Average Simple Yield
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

ชื่อหน้า: Indices > Short-term Government Bond Index

ภาพประกอบ:

Short-term Government Bond Index

04/03/2020

Download Excel

Short-term Government Bond Index as of 04 March 2020

Type	Index						Average				Average Time To Maturity	Download Excel
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Yield	Simple Yield	Duration	Convexity		
Short-term Government Bond Index	135.916970	+0.029219	135.916970	+0.029219	135.916970	+0.029219	0.838175	0.869947	0.275082	0.255981	0.276575	

Remark:

- Short-term Government Bond Indices are calculated from short term debt securities issued by The Ministry of Finance and The Bank of Thailand.
- The base date of Short-term Government Bond Indices is 1st September 2006.

ดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้น (Short Term Government Bond Index) เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ประเภทพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้น ฐานของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นนี้เริ่มต้นที่ 100 ในวันที่ 1 กันยายน 2549 โดยพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นที่นำมาคำนวณหาดัชนีคือพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นที่ออกโดยกระทรวงการคลังและธนาคารแห่งประเทศไทย

ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Simple Yield: Average Simple Yield
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

ชื่อนี้: Indices > MTM Government Bond Index

ภาพประกอบ:

MTM Government Bond Index

04/03/2020

[Download Excel](#)

MTM Government Bond Index as of 04 March 2020

Type	Index							Average			Average Time To Maturity	Download Excel	
	Clean Price	chg.(point)	Gross Price	chg.(point)	Total Return	chg.(point)	Net Total Return	chg.(point)	Yield	Duration			Convexity
MTM Government Bond Index	125.17	+1.16	125.91	+1.17	219.30	+2.03	104.34	+0.97	1.45	10.50	222.16	13.01	
Group 1 (1 < TTM <= 3)	88.77	+0.16	89.53	+0.17	157.29	+0.30	101.95	+0.19	0.72	2.03	5.51	2.10	
Group 2 (3 < TTM <= 7)	110.42	+0.57	111.07	+0.58	190.32	+1.00	103.60	+0.54	0.78	4.56	25.59	4.90	
Group 3 (7 < TTM <= 10)	127.50	+1.35	128.18	+1.37	222.82	+2.37	105.34	+1.12	0.92	7.70	68.87	8.90	
Group 4 (> 10)	172.40	+2.32	173.34	+2.34	304.12	+4.10	105.34	+1.42	1.64	17.28	439.81	24.73	
Group 5 (<= 10)	104.98	+0.58	105.65	+0.59	183.54	+1.02	103.44	+0.58	0.84	4.53	30.47	4.83	
Group 6 (<= 1)	75.42	+0.02	75.79	+0.02	138.31	+0.04	100.70	+0.03	0.89	0.31	0.25	0.31	
Group 7 (10 < TTM <= 30)	162.76	+1.98	163.64	+1.99	286.80	+3.49	105.30	+1.28	1.38	13.81	244.35	17.77	

Remark:

1. MTM Government Bond Indices are calculated from government Loan Bond (LB) only.
2. The base dates of MTM Government Bond Indices are 1 September 2006.
3. MTM Government Bond Index Article
4. The net total return indices are calculated by applying the withholding tax rates to accrued interest and coupon payments on all coupon bonds. The tax rates may change from time to time due to changes to the withholding tax rate applicable in Thailand. The current and historical withholding tax rate is 15%.
5. The base date of the net total return indices is 20 August 2019.

ดัชนีวัดความเคลื่อนไหวของพันธบัตรรัฐบาลประเภท Loan Bond (LB) ที่คิดคำนวณจากข้อมูล Mark-to-Market และใช้วันฐานของดัชนีเริ่มต้นที่ 100 ณ วันที่ 01 ก.ย. 2006 โดยประกอบด้วยข้อมูลย่อย เช่น Average Yield, Average Duration และ Average Convexity ซึ่งเป็นค่าเฉลี่ยของ Yield, Duration และ Convexity ของกลุ่มพันธบัตรที่ใช้ในการคำนวณดัชนีถ่วงน้ำหนักด้วยมูลค่าค่างของพันธบัตรรัฐบาลแต่ละรุ่น

MTM Government Bond Index จะมีการแสดงผลข้อมูลคล้ายกับ ThaiBMA Government Bond Index โดยจัดทำดัชนีเป็นกลุ่มย่อยๆ อีก 7 กลุ่ม ดังนี้

- 1) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี (1<TTM<=3)
- 2) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 3 ถึง 7 ปี (3<TTM<=7)
- 3) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 7 ถึง 10 ปี (7<TTM<=10)
- 4) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 10 ปี (>10)
- 5) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือน้อยกว่าหรือเท่ากับ 10 ปี แต่มากกว่า 14 วัน (<=10)
- 6) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือน้อยกว่าหรือเท่ากับ 1 ปี (<=10)
- 7) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 10 ถึง 30 ปี (10<TTM<=10)

MTM Government Bond Index ต่างจาก ThaiBMA Government Bond Index โดยหลักคือการใช้ราคา Mark-to-Market ณ สิ้นวันมาใช้ในการคำนวณดัชนีและพันธบัตรจะถูกปรับออกจากการคำนวณดัชนี 1 วันก่อนวันครบกำหนดไถ่ถอน ดังนั้น MTM Government Bond Index จะมีการเคลื่อนไหวที่สอดคล้องกับราคาตลาดของพันธบัตรรัฐบาลมากยิ่งขึ้น

ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค่างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค่างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า

- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

ชื่อหน้า: Indices > MTM Corporate Bond Index

ภาพประกอบ:

MTM Corporate Bond Index

13/05/2020



MTM Corporate Bond Index as of 13 May 2020

Download Excel

Type	Index								Average			Average Time To Maturity	Historical Download
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Net Total Return	chg. (point)	Yield	Duration	Conve...		
MTM Corporate Bond Index (A- up)	109.52	+0.04	110.13	+0.05	194.71	+0.09	101.96	+0.05	2.41	3.29	21.18	3.66	↓
Group 1 [1 < TTM <= 3]	101.04	-0.02	101.52	-0.01	174.43	-0.01	101.50	-0.01	1.81	1.85	4.60	1.92	↓
Group 2 [3 < TTM <= 7]	125.61	+0.08	126.37	+0.09	226.17	+0.16	102.51	+0.07	2.27	4.31	22.77	4.74	↓
Group 3 [7 < TTM <= 10]	136.59	+0.24	137.54	+0.26	259.51	+0.48	103.00	+0.19	2.75	7.24	61.51	8.53	↓
Group 4 [TTM <= 10]	108.13	+0.04	108.72	+0.05	191.34	+0.08	101.87	+0.04	2.30	2.94	16.32	3.20	↓
Group 5 [TTM <= 1]	84.63	-0.01	85.05	+0.01	216.94	0.00	100.96	0.00	1.52	0.55	0.63	0.55	↓
MTM Corporate Bond Index (BBB+ up)	109.45	+0.05	110.02	+0.05	195.68	+0.10	102.06	+0.05	2.49	3.11	19.18	3.44	↓
Group 1 [1 < TTM <= 3]	101.76	-0.01	102.20	-0.01	177.22	0.00	101.65	0.00	2.05	1.84	4.51	1.91	↓
Group 2 [3 < TTM <= 7]	125.69	+0.09	126.40	+0.11	227.46	+0.19	102.73	+0.08	2.44	4.23	21.86	4.65	↓
Group 3 [7 < TTM <= 10]	136.52	+0.24	137.46	+0.26	259.80	+0.48	103.00	+0.19	2.75	7.24	61.51	8.53	↓
Group 4 [TTM <= 10]	108.15	+0.04	108.70	+0.05	192.52	+0.09	101.99	+0.04	2.40	2.80	14.89	3.03	↓
Group 5 [TTM <= 1]	85.09	-0.01	85.50	+0.01	220.78	0.00	101.09	0.00	1.62	0.53	0.59	0.53	↓
MTM Corporate Bond Index (BBB up)	109.42	+0.05	110.01	+0.05	196.08	+0.10	102.14	+0.05	2.57	3.09	19.07	3.44	↓
Group 1 [1 < TTM <= 3]	102.00	-0.01	102.45	-0.01	178.26	+0.01	101.72	0.00	2.15	1.84	4.51	1.92	↓
Group 2 [3 < TTM <= 7]	125.69	+0.09	126.44	+0.11	227.93	+0.19	102.83	+0.09	2.49	4.22	21.73	4.64	↓
Group 3 [7 < TTM <= 10]	136.45	+0.24	137.40	+0.26	259.77	+0.49	103.09	+0.19	2.81	7.22	61.24	8.52	↓
Group 4 [TTM <= 10]	108.14	+0.04	108.70	+0.05	192.95	+0.09	102.06	+0.05	2.46	2.78	14.66	3.01	↓
Group 5 [TTM <= 1]	85.19	-0.01	85.61	+0.01	222.08	0.00	101.14	0.00	1.68	0.52	0.58	0.53	↓
MTM Corporate Bond Index (BBB- up)	109.33	+0.05	109.92	+0.05	196.32	+0.10	102.15	+0.05	2.59	3.06	18.83	3.40	↓
Group 1 [1 < TTM <= 3]	102.13	0.00	102.57	-0.01	179.11	+0.01	101.75	0.00	2.18	1.84	4.49	1.91	↓
Group 2 [3 < TTM <= 7]	125.66	+0.09	126.41	+0.11	228.00	+0.19	102.82	+0.09	2.50	4.21	21.66	4.64	↓
Group 3 [7 < TTM <= 10]	136.45	+0.24	137.40	+0.26	259.77	+0.49	103.09	+0.19	2.81	7.22	61.24	8.52	↓
Group 4 [TTM <= 10]	108.06	+0.04	108.63	+0.05	193.24	+0.09	102.07	+0.04	2.48	2.75	14.47	2.98	↓
Group 5 [TTM <= 1]	85.31	-0.01	85.73	+0.01	223.41	0.00	101.20	0.00	1.73	0.52	0.58	0.53	↓

Remark:

1. The base date is 1 September 2006.

2. The net total return indices are calculated by applying the withholding tax rates to accrued interest and coupon payments on all coupon bonds. The tax rates may change from time to time due to changes to the withholding tax rate applicable in Thailand. The current and historical withholding tax rate is 15%.

3. The base date of the net total return indices is 20 August 2019.

ดัชนีหุ้นกู้ที่คิดคำนวณจากข้อมูล Mark-to-Market ดัชนีนี้จะมีความละเอียดมากกว่า Investment Grade Corporate Bond Index โดยจะแบ่งออกเป็น 4 กลุ่มย่อย คือ ตามอันดับเครดิตตั้งแต่ BBB- ขึ้นไป, ตั้งแต่ BBB ขึ้นไป, ตั้งแต่ BBB+ ขึ้นไป และตั้งแต่ A- ขึ้นไป นอกจากนี้ ยังคำนวณแยกตามช่วงอายุคงเหลือในแต่ละอันดับเครดิต เหมือนกับดัชนีหุ้นกู้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน และยังเพิ่มช่วงอายุคงเหลืออีกกลุ่มหนึ่ง คือ กลุ่มของหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 10 ปี ซึ่งกลุ่มนี้จะครอบคลุมหุ้นกู้ทั้งหมด รวมถึงหุ้นกู้ที่มีอายุไม่ถึง 1 ปีอีกด้วย ได้เริ่มจัดทำดัชนีหุ้นกู้ตั้งแต่วันที่ 1 กันยายน 2549 เป็นต้นมา

MTM Corporate bond index จะต่างจาก Investment Grade Corporate bond Index โดยหลักคือจะใช้ราคา Mark-to-Market ณ สิ้นวันมาใช้ในการคำนวณดัชนีและจะไม่ได้คำนึงถึงสภาพคล่องของตราสารแต่ละตัว แต่จะใช้ตราสารทั้งหมด (Fixed coupon with no option embedded) ที่มีอันดับเครดิตมาใช้ในการคำนวณดัชนี อาจกล่าวได้ว่า Mark-to-Market Corporate Bond Index จะมีการเคลื่อนไหวที่สอดคล้องกับราคาตลาดของหุ้นกู้มากกว่าเมื่อเปรียบเทียบกับ Investment Grade Corporate Bond Index เพราะมีการนำราคา Mark-to-Market ณ สิ้นวันมาใช้ในการคำนวณค่าดัชนี

ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า

- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

ชื่อหน้า: Indices > Inflation-Linked Bond Index

ภาพประกอบ:

Inflation-Linked Bond Index

04/03/2020

Download Excel

Inflation-Linked Bond Index as of 04 March 2020

Type	Index						Average		Average Time To Maturity	Download Excel	
	Clean Price	chg.(point)	Gross Price	chg.(point)	Total Return	chg.(point)	Yield	Duration			Convexity
Unadjusted Inflation-Linked Bond Index	100.44	+1.11	100.51	+1.11	110.33	+1.22	0.92	4.78	35.92	4.96	📄
Adjusted Inflation-Linked Bond Index	104.99	+1.14	105.06	+1.15	114.80	+1.25	0.92	4.71	35.29	4.96	📄

Remark:

- The base dates of Inflation-Linked Bond Indices are 12 March 2013.
- Inflation-Linked Bond Index Article

ดัชนีตราสารหนี้อ้างอิงอัตราเงินเฟ้อ (Inflation-Linked Bond Index) เป็นดัชนีวัดผลตอบแทนการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาลประเภทอัตราดอกเบี้ยแปรผันตามการเปลี่ยนแปลงของเงินเฟ้อ (Inflation-Linked Bond) โดยใช้วันฐานของดัชนีเริ่มต้นที่ 100 ณ วันที่ 12 มีนาคม 2556 และราคาที่ใช้ในการคำนวณดัชนี มาจากราคา Mark-to-Market ณ สิ้นวัน ดัชนีดังกล่าวจะแบ่งออกได้เป็น 2 ประเภท คือ

1. Unadjusted Inflation-Linked Bond Index ดัชนีตราสารหนี้อ้างอิงอัตราเงินเฟ้อนี้ไม่คิดผลของ Index Ratio ในการคำนวณราคา Clean Price และ Gross Price

2. Adjusted Inflation-Linked Bond Index ดัชนีตราสารหนี้อ้างอิงอัตราเงินเฟ้อนี้คิดผลของ Index Ratio ในการคำนวณราคา Clean Price และ Gross Price

นอกจากนี้ยังมีข้อมูลย่อยอื่นๆ ของดัชนี ประกอบด้วย Average Yield, Average Duration และ Average Convexity ซึ่งเป็นค่าเฉลี่ยของ Yield, Duration และ Convexity ของกลุ่มพันธบัตรฯ ที่ใช้ในการคำนวณดัชนีถ่วงน้ำหนักด้วยมูลค่าคงค้างของพันธบัตรฯ แต่ละรุ่น

ความหมาย:

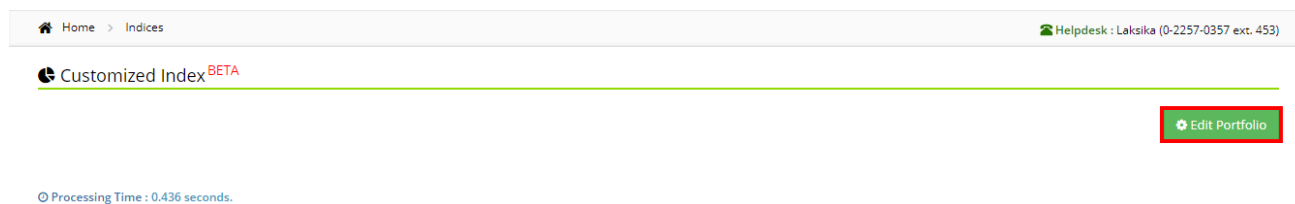
- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

ชื่อหน้า: Indices > Customized Bond Index

Customized Bond Index เป็นเครื่องมือช่วยในการวัดผลการดำเนินงานของพอร์ตตราสารหนี้ โดย Customized Bond Index ได้รวบรวมดัชนีทุกตัวในเว็บไซต์ iBond ให้ผู้ใช้เลือกสร้างดัชนีจำลองพอร์ตตามการลงทุนของผู้ใช้งานตัวเอง เพื่อความสะดวกต่อนักลงทุนในการอ้างอิงเกณฑ์มาตรฐานเทียบผลตอบแทนจากการลงทุน (Benchmark)

วิธีการใช้งาน:

ภาพประกอบ:



หากผู้ใช้ต้องการสร้างดัชนีชีวิตการลงทุนจำลอง Port การลงทุนให้คลิกที่ **Edit Portfolio** ที่ด้านขวามือ

ภาพประกอบ:

ในหน้า Edit Portfolio ผู้ใช้สามารถสร้าง Index ได้ด้วยตัวเองดังนี้

- Select Portfolio
 - Portfolio: ผู้ใช้สามารถบันทึก Customized Index ได้ 5 Portfolios โดยคลิกเลือกที่ Drop down
 - Portfolio Name: ผู้ใช้สามารถตั้งชื่อ Portfolio ได้
 - Inception Date: วันเริ่มต้นของ Index
- Select Bond Indices
 - Indices: ดัชนีที่สามารถเลือกเข้ามาใส่ใน Port
 - TTM: Sub – index แบ่งตาม TTM หรืออายุคงเหลือของตราสารหนี้
 - Weight (%): เปรอร์เซ็นต์ การลงทุนของ Index ตัวนั้นใน Port*
- + ADD: ผู้ใช้งานกดเพิ่ม Index เข้าใน Port

*ผู้ใช้สามารถเพิ่ม Index ได้ จน Weight % ของ Index แต่ละตัวรวมกัน เท่ากับ 100%

ตัวอย่าง: การใส่ข้อมูลในหน้า Customized Index

ภาพประกอบ:

Customized Index Portfolio **BETA**

Back to Customized Index

Select Portfolio

1. Portfolio : ThaiBMA

2. Portfolio Name : * ThaiBMA

3. Inception Date : * 02 February 2012

Delete P

Select Bond Indices

4. Indices : * MTM Government Bond Index

5. TTM : * 3 < TTM ≤ 7 Year

6. Weight (%) : * 30

+ Add

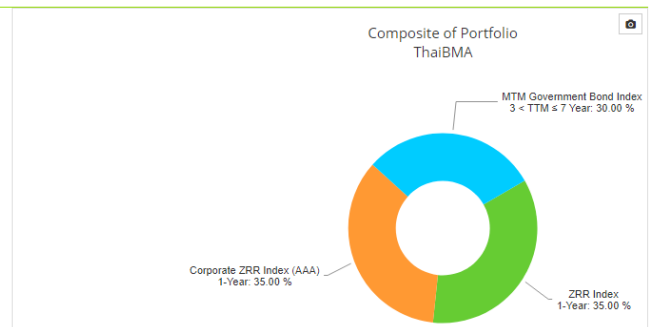
- Composite of Portfolio: หลังจากผู้ใช้งานใส่ Index เข้าใน Port เรียบร้อยแล้ว iBond จะแสดงผลดังนี้
 1. ตารางแสดงรายละเอียดแต่ละตัวของ Index
 2. กราฟแสดงสัดส่วน index ใน Port

ภาพประกอบ:

Composite of Portfolio

#	x	Bond Index	TTM	Inception Date	% Weight	% Weight
1	x	ZRR Index	1-Year	02-Jan-2002	35.00	35
2	x	Corporate ZRR Index (AAA)	1-Year	15-Jun-2007	35.00	35
3	x	MTM Government Bond Index	3 < TTM ≤ 7 Year	01-Sep-2006	30.00	30

Save Clear All



3. ในส่วนนี้ผู้ใช้งานสามารถแก้ไข % Weight ของ index ใน Portfolio ได้ในช่องสุดท้ายตามที่ highlight ในรูปด้านบน
4. หลังจากผู้ใช้งานตรวจสอบข้อมูลใน Portfolio ว่าถูกต้องครบถ้วน กด Save เพื่อระบบทำการบันทึกและคำนวณ

Customized Bond Index จะทำการคำนวณและแสดงผลพร้อมออกมาดังนี้

ภาพประกอบ:

Performance

Portfolio	Historical Returns as of 10 May 2018										
	% Cumulative Return					% Annualized Return					Since Inception
	YTD	1-Day	1-Month	3-Month	6-Month	1-Year	3-Year	5-Year	10-Year		
ThaiBMA	+0.46	0.00	-0.01	+0.28	+0.66	+1.58	+1.71	N/A	N/A	+1.96	

- Performance: ตารางนี้จะแสดงถึงผลการดำเนินงานของ Portfolio
 - YTD: ผลตอบแทนของ Portfolio แบบ Cumulative Return (%) ในปัจจุบันจนถึงวันทำการล่าสุดและตัวเลขนี้ จะมีการ Update ทุกวัน
 - 1-Day, 1-Month, 3- Month, 6 Month: ผลตอบแทนของ Portfolio แบบ Cumulative Return (%) ใน 1 วัน, 1 เดือน, 3 เดือน และ 6 เดือน ตามลำดับ และมีการ Update ทุกวัน

- 1-Year, 3-year, 5-year, 10 Year: ผลตอบแทนของ Portfolio แบบ Cumulative Time Weight Return (%) ใน 1ปี, 3ปี, 5ปี และ 10ปี ตามลำดับ และจะถูกแปลงให้อยู่ในรูปแบบ หรือ Annualized ผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปี และตัวเลขจะมีการ Update ทุกวัน
- Since Inception: ผลตอบแทนของ Portfolio แบบ Cumulative Time Weight Return (%) ตั้งแต่วันก่อตั้ง Portfolio จนถึงวันทำการปัจจุบัน และจะถูกแปลงให้อยู่ในรูปแบบ หรือ Annualized ผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปี และตัวเลขนี้ จะมีการ Update ทุกวัน

ภาพประกอบ:

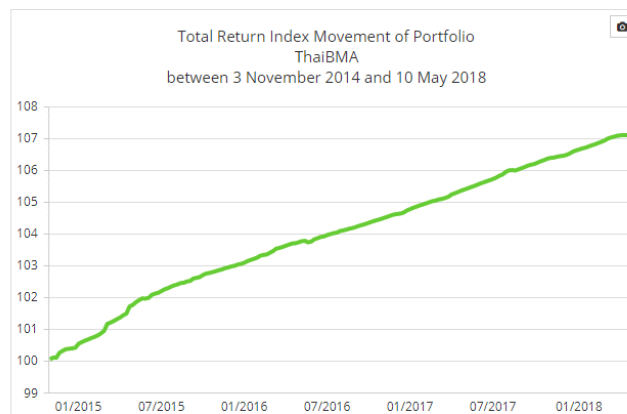
Bond Indices

Portfolio	Inception Date	As of 10 May 2018						
		Total Return Index	Change	%Change	Average YTM	Average TTM	Average Duration	Average Convexity
ThaiBMA	03-Nov-2014	107.059888	-0.002878	-0.002688	N/A ¹	N/A ¹	N/A ¹	N/A ¹

- Bond Indices
 - Inception Date: วันเริ่มก่อตั้ง Portfolio หรือวันที่เริ่มการลงทุน
 - Total Return Index (%): ดัชนีตัวชี้วัดผลการดำเนินงานของ Portfolio ตั้งวันที่ก่อตั้งจนถึงวันทำการปัจจุบัน
 - Change: การเปลี่ยนแปลงของดัชนีเทียบวันทำการปัจจุบันกับวันก่อนหน้า
 - Change (%): การเปลี่ยนแปลงของดัชนีเทียบวันทำการปัจจุบันกับวันก่อนหน้า (%)
 - Average YTM: อัตราผลตอบแทนถึงวันครบกำหนดเฉลี่ยของ Bond ที่นำมาคำนวณใน Portfolio
 - Average TTM: อายุคงเหลือเฉลี่ยของ Bond ที่นำมาคำนวณใน Portfolio
 - Average Duration: อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ที่ถ่วงน้ำหนักด้วยมูลค่าปัจจุบันของกระแสดอกเบี้ยรับที่จะได้ในอนาคต
 - Average Convexity: ความผันผวนเฉลี่ยของราคาตราสารหนี้ ที่นำมาคำนวณใน Portfolio

ภาพประกอบ:

Total Return Index Movement



Remark:

ZRR Index does not consider YTM, TTM, duration and convexity.

- Total Return Index Movement: กราฟแสดงความเคลื่อนไหวของ Index ตั้งแต่วันเริ่ม Portfolio ถึงวันปัจจุบัน

ภาพประกอบ:

Customized Index Portfolio **BETA**

[Back to Customized Index](#)

หลังจากที่สร้าง Portfolio Customized Index เรียบร้อยแล้ว เราสามารถกลับไปหน้าหลักโดยคลิกที่ปุ่ม Back to Customized Index มุมด้านบนขวามือ หน้าจอเปลี่ยนไปยังหน้า Main Customized Bond Index

ภาพประกอบ:

Customized Index **BETA**

[Edit Portfolio](#)

10 May 2018

Performance

[Download Excel](#)

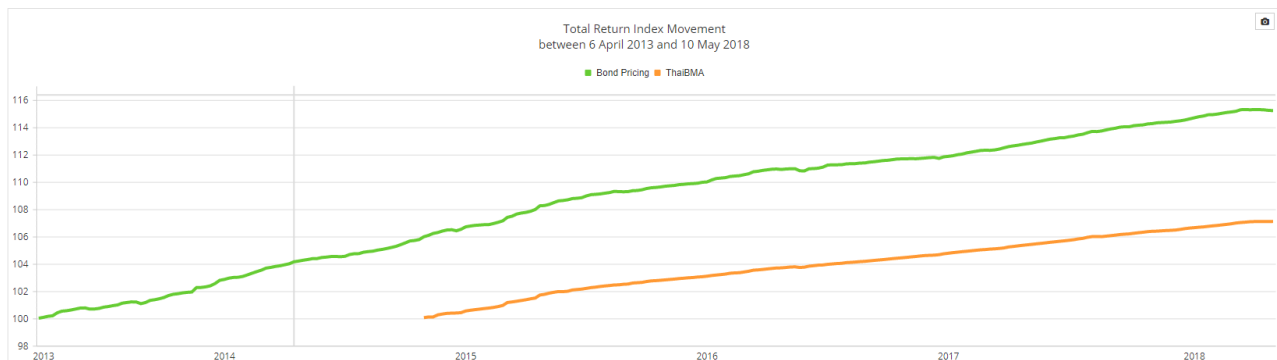
Portfolio	Historical Returns as of 10 May 2018						% Annualized Return			
	YTD	1-Day	1-Month	3-Month	6-Month	1-Year	3-Year	5-Year	10-Year	
Bond Pricing	+0.54	0.00	-0.10	+0.20	+0.78	+2.06	+2.06	+2.74	N/A	+2.79
ThaiBMA	+0.46	0.00	-0.01	+0.28	+0.66	+1.58	+1.71	N/A	N/A	+1.96

Bond Indices

[Download Excel](#)

Portfolio	Inception Date	Total Return Index	Change	%Change	Average YTM	Average TTM	Average Duration	Average Convexity
Bond Pricing	06-Apr-2013	115.142282	+0.001664	+0.001445	1.673717	1.418515	1.364659	3.329923
ThaiBMA	03-Nov-2014	107.059888	-0.002878	-0.002688	N/A ¹	N/A ¹	N/A ¹	N/A ¹

Total Return Index Movement



Remark:

ZRR Index does not consider YTM, TTM, duration and convexity.

หน้า Main จะแสดงผล Performance, Bond Indices และ กราฟ Total Return Index Movement ของทุก Portfolio ที่ผู้สร้างขึ้น เพื่อให้ผู้ใช้ดูข้อมูลได้สะดวก ทั้งยังสรุปความเคลื่อนไหวของดัชนีชี้วัดการลงทุนแต่ละแบบ

วิธีการดาวน์โหลดข้อมูล:

1. ผู้ใช้สามารถ Download ข้อมูลตาราง Performance และ Bond Indices จากแถบ Download Excel ด้านบนของตารางตามเครื่องหมาย [Download Excel](#)
2. ผู้ใช้สามารถ Download Historical ของ Bond Indice หรือข้อมูลย้อนหลังได้จากท้ายตาราง ตามสัญลักษณ์นี้

ประโยชน์:

สรุปข้อมูลดัชนีชี้วัดการลงทุนของ Portfolio สามารถใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงและเปรียบเทียบการลงทุนตราสารแต่ละแบบ ใช้วิเคราะห์ สภาวะหรือแนวโน้มของการลงทุนในตราสารหนี้

ภาพประกอบ:

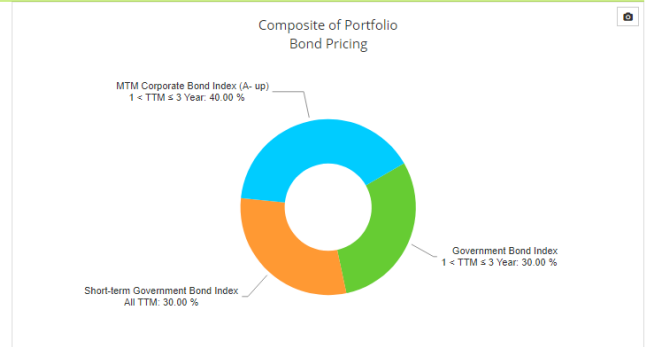
Customized Index Portfolio ^{BETA}
[Edit Portfolio](#)
[Back to Customized Index](#)

10 May 2018

Bond Pricing

Composite of Portfolio

#	Bond Index	TTM	Inception Date	% Weight
1	Government Bond Index	1 < TTM ≤ 3 Year	04-Jan-1999	30
2	Short-term Government Bond Index	All TTM	01-Sep-2006	30
3	MTM Corporate Bond Index (A- up)	1 < TTM ≤ 3 Year	01-Sep-2006	40



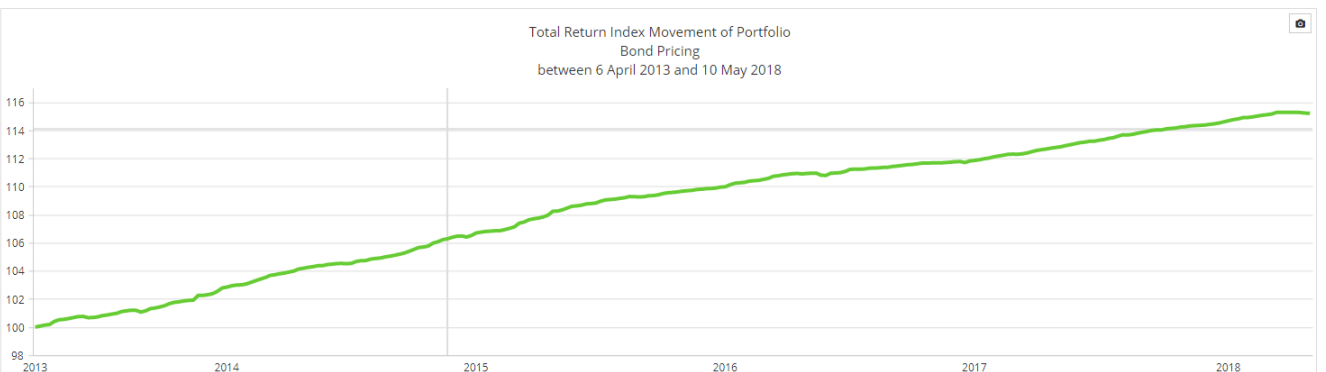
Performance

Portfolio	Historical Returns as of 10 May 2018										
	% Cumulative Return					% Annualized Return					Since Inception
	YTD	1-Day	1-Month	3-Month	6-Month	1-Year	3-Year	5-Year	10-Year		
Bond Pricing	+0.54	0.00	-0.10	+0.20	+0.78	+2.06	+2.06	+2.74	N/A	+2.79	

Bond Indices

Portfolio	Inception Date	As of 10 May 2018							Download Excel
		Total Return Index	Change	%Change	Average YTM	Average TTM	Average Duration	Average Convexity	
Bond Pricing	06-Apr-2013	115.142282	+0.001664	+0.001445	1.673717	1.418515	1.364659	3.329923	

Total Return Index Movement



Remark:

ZRR Index does not consider YTM, TTM, duration and convexity.

ผู้ใช้งานสามารถคลิกที่ชื่อของ Portfolio แต่ละตัวเพื่อเรียกดูข้อมูลได้ด้วยเช่นกัน โดยจะแสดงผลดังในรูป และใช้งานได้ดังนี้

1. ผู้ใช้งานสามารถเลือกวันที่ได้จากในช่องปฏิทิน เพื่อเลือกดูข้อมูลย้อนหลังในวันที่ต้องการได้
2. ผู้ใช้งานสามารถ Save รูป กราฟ Composite of Portfolio
3. ผู้ใช้งานสามารถเลือก Download Historical Data ได้ในตารางจากหน้านี้เช่นกัน
4. ผู้ใช้งานสามารถ Save รูป Total Return Index Movement of Portfolio