

คำอธิบายข้อมูล	
ชื่อตาราง	อัตราดอกเบี้ย Fallback Rate (THBFIX) และองค์ประกอบ
ความถี่ของข้อมูล ความถี่รายวัน ความถี่รายชั่วโมง กำหนดเวลาเผยแพร่	ความถี่: รายวัน ความถี่รายชั่วโมง: - กำหนดเวลาเผยแพร่: ทุกวันทำการเวลา 9.00 น.
หลักวิธีทางสถิติ ● หลักการและนิยาม ● ความครอบคลุม ● ประเภทและลักษณะของข้อมูล ● วิธีประมวลผล ● มาตรการสำรอง	<p>อัตราดอกเบี้ย Fallback Rate (THBFIX) หมายถึงอัตราดอกเบี้ยการกู้ยืมเงินบาทระยะต่าง ๆ ที่คำนวณมาจากการกู้ยืมเงินดอลลาร์ สรอ. ในระยะเดียวกันและแลกเปลี่ยนเป็นเงินบาทด้วยการทำธุรกรรม FX swap โดยต้นทุนในการกู้ยืมเงินดอลลาร์ สรอ. ดังกล่าวคำนวณจากอัตราดอกเบี้ยระยะข้ามคืนแบบทบต้น (compounded overnight rate)</p> <p>อัตราดอกเบี้ย Fallback Rate (THBFIX) สามารถนำมาใช้ทดแทนอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX) ในกรณียุติการเผยแพร่อัตราดอกเบี้ย USD LIBOR ทั้งนี้ การเผยแพร่อัตราดอกเบี้ย Fallback Rate (THBFIX) จะอ้างอิง Original THBFIX Rate Record Day (วันที่กำหนดอัตราดอกเบี้ย THBFIX เดิมในแต่ละงวดดอกเบี้ยของธุรกรรม Interest Rate Swap) โดยเผยแพร่สองวันทำการก่อนวันสิ้นงวดของธุรกรรม Interest Rate Swap</p> <p>องค์ประกอบสำคัญในการคำนวณอัตราดอกเบี้ย Fallback Rate (THBFIX) ได้แก่ USDTHB Spot Rate, USDTHB Forward Points และอัตราดอกเบี้ยสกุลเงินดอลลาร์ สรอ.</p> <p>USDTHB Spot Rate และ USDTHB Forward Points คำนวณจากธุรกรรมที่เกิดขึ้นจริง (Transaction-based) ซึ่งประกอบด้วยธุรกรรม USDTHB FX spot และ USDTHB FX swap ของสถาบันการเงินที่เป็นผู้นำส่งข้อมูลสำหรับจัดทำอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THBFIX (Contributing Bank) โดย Contributing Bank และนายหน้าซื้อขายเงินตราต่างประเทศ (FX Broker) จะนำส่งข้อมูลธุรกรรม USDTHB FX spot และ USDTHB FX swap ที่เข้าข่ายเป็น Qualified Transaction ให้แก่ Refinitiv (ชื่อเดิมคือ Thomson Reuters) ซึ่งได้รับการแต่งตั้งเป็นตัวแทนในการคำนวณและเผยแพร่ (Calculation Agent) อัตราดอกเบี้ย Fallback Rate (THBFIX) และองค์ประกอบ ตามสูตรที่กำหนดไว้</p> <p>ธุรกรรมที่เข้าข่ายเป็น Qualified Transaction คือธุรกรรมที่เป็นไปตามเงื่อนไขทั้งหมด ดังต่อไปนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. มีปริมาณธุรกรรมเท่ากับหรือมากกว่า 1,000,000 ดอลลาร์ สรอ. 2. คู่ค้า (counterparty) <ul style="list-style-type: none"> ธุรกรรม USDTHB FX spot: คู่ค้าทั้งสองฝ่ายเป็น Contributing Bank หรือคู่ค้าอย่างน้อยหนึ่งฝ่ายเป็น Contributing Bank สำหรับธุรกรรมที่ได้รับการจับคู่และดำเนินการด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์จาก FX Broker ธุรกรรม USDTHB FX swap: คู่ค้าทั้งสองฝ่ายเป็น Contributing Bank 3. ธุรกรรมที่เกิดขึ้นในช่วงเวลาที่กำหนด (Qualifying Window) <ul style="list-style-type: none"> ธุรกรรม USDTHB FX spot: 14.30 – 15.00 น. ธุรกรรม USDTHB FX swap: 07.30 – 16.30 น. 4. ระยะ (Tenor) <ul style="list-style-type: none"> ธุรกรรม USDTHB FX spot: T + 2 ธุรกรรม USDTHB FX swap: 1 เดือน, 3 เดือน, 6 เดือน

การคำนวณ Fallback Rate (THBFX) มีสูตรการคำนวณดังนี้

$$\text{Fallback Rate (THBFX)} = \left\{ \left[\left(\frac{\text{Spot Rate} + \text{Forward Points}}{\text{Spot Rate}} \right) \times \left(1 + \frac{\text{USD Rate} \times \text{\#days}}{360} \right) \right] - 1 \right\} \times \frac{365}{\text{\#days}} \times 100$$

โดย

“USD Rate” หมายถึง อัตราดอกเบี้ย Fallback Rate (SOFR) ของแต่ละ Tenor (ซึ่งคือผลรวมของ SOFR compounded in-arrears และ spread adjustment) ที่คำนวณและเผยแพร่ล่าสุด บน Bloomberg screen <FBAK> <GO> ณ วันที่เผยแพร่อัตราดอกเบี้ย Fallback Rate (THBFX)

• กรณีที่ Bloomberg เผยแพร่ Fallback Rate (SOFR) หลาย Rate Record day สำหรับ Tenor หนึ่งๆ ในแต่ละวันทำการ การคำนวณ Fallback Rate (THBFX) จะใช้ค่าของ Fallback Rate (SOFR) ที่มี Original IBOR Rate Record day ล่าสุดในการคำนวณ “Spot Rate” หมายถึง USDTHB spot rate ที่คำนวณด้วยวิธีถ่วงน้ำหนักด้วยปริมาณธุรกรรม (volume weighted average) โดยคำนวณจากธุรกรรม USDTHB FX Spot ซึ่งทำธุรกรรม ณ Original THBFX Rate Record Day ที่เป็น Qualified Transaction (ไม่รวมธุรกรรมที่มีปริมาณสูงผิดปกติ หรือมีค่า Spot Rate สูงหรือต่ำผิดปกติ) “Forward Points” หมายถึง Forward points ที่คำนวณด้วยวิธีถ่วงน้ำหนักด้วยปริมาณธุรกรรม (volume weighted average) โดยคำนวณจากธุรกรรม USDTHB FX Swap ซึ่งทำธุรกรรม ณ Original THBFX Rate Record Day ที่เป็น Qualified Transaction (ไม่รวมธุรกรรมที่มีปริมาณสูงผิดปกติ หรือมีค่า Forward Points สูงหรือต่ำผิดปกติ) ของแต่ละ Tenor “#days” หมายถึง จำนวนวันปฏิทินของธุรกรรม USDTHB FX Swap ตาม Original THBFX Rate Record Day ของแต่ละ Tenor ซึ่งคือจำนวนวันระหว่างวันเริ่มต้นและวันสิ้นสุดของธุรกรรม USDTHB FX Swap ที่ใช้ในการคำนวณ

จำนวนจุดทศนิยมของข้อมูลที่เผยแพร่

Fallback Rate (THBFX):	ทศนิยม 5 ตำแหน่ง ปิดเศษทางด้านที่ใกล้ที่สุด
USDTHB Spot Rate:	ทศนิยม 4 ตำแหน่ง ปิดเศษทางด้านที่ใกล้ที่สุด
USDTHB Forward Points:	ทศนิยม 4 ตำแหน่ง ปิดเศษทางด้านที่ใกล้ที่สุด

มาตรการสำรอง

● USDTHB Spot Rate

เงื่อนไขการใช้มาตรการสำรอง: เมื่อไม่มีธุรกรรม USDTHB FX Spot ที่เป็น Qualified Transaction เกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window ณ Original THBFX Rate Record Day

ขั้นตอนการปฏิบัติ:

1. ขยายช่วง Qualifying Window อีก 25 นาที จาก 14.30 – 15.00 น. เป็น 14.30 – 15.25 น. ตามเวลาประเทศไทยผ่านช่องทางซื้อขายด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์จาก FX Broker
2. หากขยายช่วง Qualifying Window ตามขั้นที่ 1 แล้ว ไม่มีธุรกรรมที่เป็น Qualified Transaction เกิดขึ้นในช่วงเวลาดังกล่าว จะใช้อัตราแลกเปลี่ยนถ่วงน้ำหนักระหว่างธนาคาร (ที่ประกาศโดย ธพท.) ของวันทำการที่ตรงกับ Original THBFX Rate Record Day

	<ul style="list-style-type: none"> ● USDTHB Forward Points เงื่อนไขการใช้มาตรการสำรอง: เมื่อไม่มีธุรกรรม USDTHB FX Swap ที่เป็น Qualified Transaction เกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window ณ Original THBFX Rate Record Day <p>ขั้นตอนการปฏิบัติ: จะใช้ USDTHB Forward Points ของ Tenor นั้นของวันทำการล่าสุดจาก Original THBFX Rate Record Day ที่มีธุรกรรม Qualified Transaction โดยปรับด้วย Day count ของ USDTHB FX Swap ณ Original THBFX Rate Record Day ตามสูตรการคำนวณ ดังนี้</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin: 10px auto; width: fit-content;"> $\text{Adjusted forward points} = \frac{\text{Forward Points}}{\text{Day count of the Forward Points}} \times \text{Day count of the Original THBFX Rate Record day}$ </div>
สื่อที่ใช้ในการเผยแพร่	เว็บไซต์ ธนาคารแห่งประเทศไทย (https://www.bot.or.th/App/Fallbackthbfix/)
การปรับปรุงข้อมูล	ปรับตามข้อมูลจริง

ฝ่ายตลาดการเงิน
โทร. 0-2283-6349
0-2283-6321
0-2283-5471
0-2356-7534