

คำอธิบายข้อมูล	
รหัสของตาราง	FM_RT_014
ชื่อตาราง	ดัชนีอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR (THOR Index)
ความถี่ของข้อมูล ความล่าช้าและกำหนดเวลาเผยแพร่	ความถี่ รายวัน (รวมวันหยุด) ความล่าช้า - กำหนดเวลาเผยแพร่ ทุกวันทำการเวลา 9.30 น. (ข้อมูลของวันหยุดจะเผยแพร่ในวันทำการถัดไป)
หลักวิธีทางสถิติ • หลักการ นิยาม และการจัดกลุ่ม • ความครอบคลุม • การบันทึกข้อมูลและมาตรฐานบัญชีที่เกี่ยวข้อง • ลักษณะของข้อมูลและวิธีการจัดเก็บ • วิธีประมวลผลข้อมูล	<p>ดัชนีอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR หมายถึง ดัชนีวัดมูลค่าสะสมของอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR (อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงตลาดซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชนระยะข้ามคืน: Thai Overnight Repurchase Rate) จากมูลค่าเริ่มต้นในวันที่ 1 เมษายน 2563 ซึ่งกำหนดให้เท่ากับ 100 จำนวนโดยการหาค่าเฉลี่ยแบบคิดทบ (compound average) ในวันทำการและแบบถัวเฉลี่ย (simple average) ในวันหยุด ตามสูตรการคำนวณ ดังนี้</p> $THOR Index_t = 100 \text{ เมื่อ } t \text{ คือ วันที่ 1 เมษายน 2563}$ $= THOR Index_b \times \left(1 + \frac{THOR_b \cdot d_b}{365}\right) \text{ เมื่อ } t \text{ คือ วันอื่นใดตั้งแต่วันที่ 2 เมษายน 2563 เป็นต้นไป}$ <p>โดย:</p> <p>t คือ วันที่ของ THOR Index</p> <p>b คือ วันทำการ (business day) ก่อนหน้า t</p> <p>THOR_b คือ อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR ในวันทำการ b</p> <p>THOR Index_b คือ THOR Index ในวันทำการ b (ทศนิยม 20 ตำแหน่ง)</p> <p>d_b คือ จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ที่ใช้ THOR_b ในการคำนวณ ทั้งนี้ กำหนดให้ $\left(1 + \frac{THOR_b \cdot d_b}{365}\right)$ มีทศนิยม 20 ตำแหน่ง</p> <p>THOR Index_t แสดงค่าเป็นทศนิยม 10 ตำแหน่ง</p> <p>ตัวอย่างการคำนวณ</p> <ol style="list-style-type: none"> การคำนวณ THOR Index ของวันศุกร์ที่ 17 เมษายน 2563: THOR Index_b และ THOR_b ที่ใช้คำนวณคือข้อมูลของวันทำการก่อนหน้า ซึ่งได้แก่ วันพฤหัสบดีที่ 16 เมษายน 2563 โดย THOR_b หรือ THOR ของวันพฤหัสบดีที่ 16 เมษายน 2563 จะใช้สำหรับวันพฤหัสบดีเพียงวันเดียว ดังนั้น d_b = 1 การคำนวณ THOR Index ของวันเสาร์ที่ 18 เมษายน 2563: THOR Index_b และ THOR_b ที่ใช้คำนวณคือข้อมูลของวันทำการก่อนหน้า ซึ่งได้แก่ วันศุกร์ที่ 17 เมษายน 2563 โดย THOR_b หรือ THOR ของวันศุกร์ที่ 17 เมษายน 2563 จะใช้สำหรับวันศุกร์เพียงวันเดียว ดังนั้น d_b = 1 การคำนวณ THOR Index ของวันอาทิตย์ที่ 19 เมษายน 2563: THOR Index_b และ THOR_b ที่ใช้คำนวณคือข้อมูลของวันทำการก่อนหน้า ซึ่งยังคงเป็นวันศุกร์ที่ 17 เมษายน 2563 โดย THOR_b หรือ THOR ของวันศุกร์ที่ 17 เมษายน 2563 จะใช้สำหรับวันศุกร์และวันเสาร์ ดังนั้น d_b = 2 การคำนวณ THOR Index ของวันจันทร์ที่ 20 เมษายน 2563: THOR Index_b และ THOR_b ที่ใช้คำนวณคือข้อมูลของวันทำการก่อนหน้า ซึ่งยังคงเป็นวันศุกร์ที่ 17 เมษายน 2563 โดย THOR_b หรือ THOR ของวันศุกร์ที่ 17 เมษายน 2563 จะใช้สำหรับวันศุกร์ วันเสาร์ และวันอาทิตย์ ดังนั้น d_b = 3
แหล่งที่มาของข้อมูล	1. สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย 2. ธนาคารพาณิชย์และสถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่ง
สื่อที่ใช้ในการเผยแพร่	เว็บไซต์ ธนาคารแห่งประเทศไทย (https://www.bot.or.th/App/BTWS_STAT/statistics/BOTWEBSTAT.aspx?reportID=946&language=TH)
การปรับปรุงข้อมูล	ไม่มีการปรับข้อมูล

ทีมโครงสร้างพื้นฐานตลาดการเงิน
ฝ่ายตลาดการเงิน
โทร 0-2283-5130