

คำอธิบายข้อมูล																
รหัสของตาราง	FM_RT_013															
ชื่อตาราง	อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงธุรกรรมซื้อคืนระยะข้ามคืน (Thai Overnight Repurchase Rate: THOR) และอัตราดอกเบี้ย THOR Average															
ความถี่ของข้อมูล ความล่าช้าและกำหนดเวลาเผยแพร่	ความถี่ รายวัน ความล่าช้า - กำหนดเวลาเผยแพร่ ทุกวันทำการเวลา 16.30 น. สำหรับ THOR และทุกวันทำการเวลา 09.30 น. สำหรับ THOR Average															
หลักวิธีทางสถิติ <ul style="list-style-type: none"> • หลักการ นิยาม และการจัดกลุ่ม • ความครอบคลุม • การบันทึกข้อมูลและมาตรฐานบัญชีที่เกี่ยวข้อง • ลักษณะของข้อมูลและวิธีการจัดเก็บ • วิธีประมวลผลข้อมูล 	<p>อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR หมายถึง อัตราดอกเบี้ยที่คำนวณจากธุรกรรมซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชนระยะข้ามคืนระหว่างคู่ค้าที่เป็นธนาคาร</p> <p>อัตราดอกเบี้ย THOR Average หมายถึงอัตราดอกเบี้ยที่คำนวณจากการนำอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR มาคำนวณแบบทบต้นจากข้อมูลย้อนหลัง (compound setting in arrears) ในระยะ (tenor) 1 เดือน, 3 เดือน และ 6 เดือน</p> <p>อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR คำนวณจากข้อมูลอัตราดอกเบี้ยค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักด้วยปริมาณธุรกรรม (Volume-Weighted Average) ของธุรกรรมในตลาดซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชนระยะข้ามคืนที่เข้าข่ายเป็น Qualified Transaction</p> <p>ธุรกรรมที่เข้าเงื่อนไขในการนำมาคำนวณ (Qualified Transaction) จะต้องเข้าเงื่อนไขทั้งหมดดังต่อไปนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. เป็นธุรกรรมที่มีคู่สัญญาทั้งสองฝั่งเป็นธนาคารพาณิชย์หรือสถาบันการเงินเฉพาะกิจ 2. เป็นธุรกรรมระยะข้ามคืนที่มีการตกลงและชำระราคาในวันนั้นๆ โดยการตกลงเกิดขึ้นระหว่างเวลา 7.00 น. ถึง 15.30 น. รวมถึงธุรกรรมที่รายงานมายังสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยภายใน 16.00 น. 3. เป็นธุรกรรมที่มีขนาดตั้งแต่ 100 ล้านบาทขึ้นไป <p>ในกรณีที่ไม่มี Qualified Transaction จะเผยแพร่โดยใช้ค่าอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR ของวันทำการก่อนหน้าปรับด้วยการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ยนโยบาย (Policy Rate) ระยะข้ามคืนในวันเดียวกันจาก BIBOR ของวันทำการก่อนหน้า หรืออธิบายโดยสมการ ดังนี้</p> $THOR_t = THOR_{t-1} + (Policy Rate_t - Policy Rate_{t-1})$ <p>อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR Average คำนวณตามสูตรการคำนวณ ดังนี้</p> $THOR Average_t = \left[\prod_{i=t-d_c}^{t-1} \left(1 + \frac{THOR_i * a_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{d_c}$ <p>โดย:</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 15%; vertical-align: top;">t</td> <td style="width: 10%; vertical-align: top;">คือ</td> <td>วันเผยแพร่ข้อมูล THOR Average</td> </tr> <tr> <td style="vertical-align: top;">THOR_i</td> <td style="vertical-align: top;">คือ</td> <td>อัตราดอกเบี้ย THOR ในวันทำการ i</td> </tr> <tr> <td style="vertical-align: top;">i</td> <td style="vertical-align: top;">คือ</td> <td>วันทำการ (business day) แต่ละวันในช่วงเวลาที่คำนวณ</td> </tr> <tr> <td style="vertical-align: top;">d_c</td> <td style="vertical-align: top;">คือ</td> <td>จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ในช่วงเวลา 1 เดือน, 3 เดือน และ 6 เดือน โดยนับจำนวนวันย้อนหลังแบบวันชนวัน จาก t ไปยังวันเริ่มต้นคำนวณ และปรับวันเริ่มต้นคำนวณที่ตรงกับวันหยุดด้วยวิธี modified preceding (ในกรณีที่เมื่อนับแบบวันชนวันแล้ว วันเริ่มต้นคำนวณตรงกับวันหยุด ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณไปเป็นวันทำการก่อนหน้า แต่หากเลื่อนแล้วทำให้วันเริ่มต้นคำนวณข้ามไปเป็นเดือนก่อน ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณเป็นวันทำการถัดไปแทน)</td> </tr> <tr> <td style="vertical-align: top;">a_i</td> <td style="vertical-align: top;">คือ</td> <td>จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ที่ใช้ THOR_i (เช่นกรณี i คือวันศุกร์ THOR_i จะใช้สำหรับวันศุกร์ วันเสาร์ และวันอาทิตย์ รวม 3 วัน ดังนั้น a_i จะเท่ากับ 3)</td> </tr> </table>	t	คือ	วันเผยแพร่ข้อมูล THOR Average	THOR _i	คือ	อัตราดอกเบี้ย THOR ในวันทำการ i	i	คือ	วันทำการ (business day) แต่ละวันในช่วงเวลาที่คำนวณ	d _c	คือ	จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ในช่วงเวลา 1 เดือน, 3 เดือน และ 6 เดือน โดยนับจำนวนวันย้อนหลังแบบวันชนวัน จาก t ไปยังวันเริ่มต้นคำนวณ และปรับวันเริ่มต้นคำนวณที่ตรงกับวันหยุดด้วยวิธี modified preceding (ในกรณีที่เมื่อนับแบบวันชนวันแล้ว วันเริ่มต้นคำนวณตรงกับวันหยุด ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณไปเป็นวันทำการก่อนหน้า แต่หากเลื่อนแล้วทำให้วันเริ่มต้นคำนวณข้ามไปเป็นเดือนก่อน ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณเป็นวันทำการถัดไปแทน)	a _i	คือ	จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ที่ใช้ THOR _i (เช่นกรณี i คือวันศุกร์ THOR _i จะใช้สำหรับวันศุกร์ วันเสาร์ และวันอาทิตย์ รวม 3 วัน ดังนั้น a _i จะเท่ากับ 3)
t	คือ	วันเผยแพร่ข้อมูล THOR Average														
THOR _i	คือ	อัตราดอกเบี้ย THOR ในวันทำการ i														
i	คือ	วันทำการ (business day) แต่ละวันในช่วงเวลาที่คำนวณ														
d _c	คือ	จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ในช่วงเวลา 1 เดือน, 3 เดือน และ 6 เดือน โดยนับจำนวนวันย้อนหลังแบบวันชนวัน จาก t ไปยังวันเริ่มต้นคำนวณ และปรับวันเริ่มต้นคำนวณที่ตรงกับวันหยุดด้วยวิธี modified preceding (ในกรณีที่เมื่อนับแบบวันชนวันแล้ว วันเริ่มต้นคำนวณตรงกับวันหยุด ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณไปเป็นวันทำการก่อนหน้า แต่หากเลื่อนแล้วทำให้วันเริ่มต้นคำนวณข้ามไปเป็นเดือนก่อน ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณเป็นวันทำการถัดไปแทน)														
a _i	คือ	จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ที่ใช้ THOR _i (เช่นกรณี i คือวันศุกร์ THOR _i จะใช้สำหรับวันศุกร์ วันเสาร์ และวันอาทิตย์ รวม 3 วัน ดังนั้น a _i จะเท่ากับ 3)														

	THOR และ THOR Average แสดงค่าเป็นทศนิยม 5 ตำแหน่ง
แหล่งที่มาของข้อมูล	1. สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย 2. ธนาคารพาณิชย์และสถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่ง
สื่อที่ใช้ในการเผยแพร่	เว็บไซต์ ธนาคารแห่งประเทศไทย (https://app.bot.or.th/BTWS_STAT/statistics/BOTWEBSTAT.aspx?reportID=945&language=TH)
การปรับปรุงข้อมูล	THOR: ปรับตามข้อมูลจริง ณ เวลา 09.30 น. ของวันทำการถัดไป หากการคำนวณใหม่ส่งผลให้ THOR เปลี่ยนแปลงจากที่เผยแพร่ไปแล้วมากกว่าหรือเท่ากับ 1 basis point ขึ้นไป THOR Average: ไม่มีการปรับข้อมูล

ทีมโครงสร้างพื้นฐานตลาดการเงิน
ฝ่ายตลาดการเงิน
โทร 0-2283-5130