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 โดย วันทำการ คือ วันที่สถาบันการเงินโดยทั่วไปเปิดทำการในกรุงเทพมหานคร ซึ่งมิใช่วันเสาร์หรือวันอาทิตย์ หรือวันที่ธนาคารแห่งประเทศไทยประกาศให้เป็นวันหยุดทำการของสถาบันการเงิน
หลักวิธีทางสถิติ • หลักการ นิยาม และการจัดกลุ่ม • ความครอบคลุม • การบันทึกข้อมูลและมาตรฐานบัญชีที่เกี่ยวข้อง • ลักษณะของข้อมูลและวิธีการจัดเก็บ • วิธีประมวลผลข้อมูล	**อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR หมายถึง อัตราดอกเบี้ยที่คำนวณจากธุรกรรมซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชนระยะข้ามคืนระหว่างคู่ค้าที่เป็นธนาคาร** **อัตราดอกเบี้ย THOR Average หมายถึงอัตราดอกเบี้ยที่คำนวณจากการนำอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR มาคำนวณแบบทบต้นจากข้อมูลย้อนหลัง (compound setting in arrears) ในระยะ (tenor) 1 เดือน 3 เดือน และ 6 เดือน** **อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR คำนวณจากข้อมูลอัตราดอกเบี้ยค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักด้วยปริมาณธุรกรรม (Volume-Weighted Average) ของธุรกรรมในตลาดซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชนระยะข้ามคืนที่เข้าข่ายเป็น Qualified Transaction** **ธุรกรรมที่เข้าเงื่อนไขในการนำมาคำนวณ (Qualified Transaction) จะต้องเข้าเงื่อนไขทั้งหมดดังต่อไปนี้** 1. **เป็นธุรกรรมที่มีคู่สัญญาทั้งสองฝั่งเป็นธนาคารพาณิชย์หรือสถาบันการเงินเฉพาะกิจ** 2. **เป็นธุรกรรมระยะข้ามคืนที่มีการตกลงและชำระราคาในวันนั้น ๆ โดยการตกลงเกิดขึ้นระหว่างเวลา 7.00 น. ถึง 15.30 น. รวมถึงธุรกรรมที่รายงานมายังสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยภายใน 16.00 น.** 3. **เป็นธุรกรรมที่มีขนาดตั้งแต่ 100 ล้านบาทขึ้นไป** **กรณีวันทำการที่ไม่มี Qualified Transaction จะเผยแพร่โดยใช้ค่าอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR ของวันทำการก่อนหน้าปรับด้วยการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ยนโยบาย (Policy Rate) ในวันเดียวกันจากอัตราดอกเบี้ยนโยบาย ของวันทำการก่อนหน้า หรืออธิบายโดยสมการ ดังนี้ $THOR_T = THOR_{T-1} + (\text{Policy Rate}_T - \text{Policy Rate}_{T-1})$** **อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR Average คำนวณตามสูตรการคำนวณ ดังนี้** $$THOR\ Average_t = \left[\prod_{i=t-d_c}^{t-1}\left(1+\frac{THOR_i * a_i}{365}\right)-1\right]\times\frac{365}{d_c}$$ **โดย:** **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 โดยนับจำนวนวันย้อนหลังแบบวันชนวันจาก 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 และวันอาทิตย์รวม 3 วัน ดังนั้น a_i จะเท่ากับ 3)** **THOR และ THOR Average แสดงค่าเป็นทศนิยม 5 ตำแหน่ง**

แหล่งที่มาของข้อมูล	1. สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย 2. ธนาคารพาณิชย์และสถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่ง
สื่อที่ใช้ในการเผยแพร่	เว็บไซต์ ธนาคารแห่งประเทศไทย (FM_RT_013 อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR และอัตราดอกเบี้ย THOR Average 1/ 2/ 3/)
การปรับปรุงข้อมูล	THOR: ปรับตามข้อมูลจริง ณ เวลา 09.30 น. ของวันทำการถัดไป หากการคำนวณใหม่ส่งผลให้ THOR เปลี่ยนแปลงจากที่เผยแพร่ไปแล้วมากกว่าหรือเท่ากับ 1 basis point ขึ้นไป THOR Average: ไม่มีการปรับข้อมูล

ทีมโครงสร้างพื้นฐานตลาดการเงิน
ฝ่ายตลาดการเงิน
โทร 0-2283-6329