

คำอธิบายข้อมูล	
รหัสของตาราง	FM_RT_012
ชื่อตาราง	อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX) และองค์ประกอบ
ความถี่ของข้อมูล ความถี่และกำหนดเวลาเผยแพร่	ความถี่ รายวัน ความถี่ซ้ำ เผยแพร่ forward points เข้าวันทำการถัดไป กำหนดเวลาเผยแพร่ ทุกวันทำการเวลา 19.00 น. หรือ 20.00 น. (ขึ้นกับเวลาเผยแพร่ USD Rate) สำหรับ THBFIX และ USDTHB Spot Rate และทุกวันทำการเวลา 09.30 น. สำหรับ USDTHB Forward Points
หลักวิธีทางสถิติ ● หลักการและนิยาม ● ความครอบคลุม ● ประเภทและลักษณะของข้อมูล ● วิธีประมวลผล ● มาตรการสำรอง	<p>อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX) หมายถึงอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงในการกู้ยืมเงินบาทในระยะต่าง ๆ ที่คำนวณมาจากการกู้ยืมเงินดอลลาร์ สรอ. ในระยะเดียวกัน และแลกเปลี่ยนเป็นเงินบาทด้วยการทำธุรกรรม FX swap</p> <p>องค์ประกอบสำคัญในการคำนวณอัตราอ้างอิง THBFIX ได้แก่ USDTHB Spot Rate, USDTHB Forward Points และอัตราดอกเบี้ยสกุลเงินดอลลาร์ สรอ.</p> <p>อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THBFIX และองค์ประกอบ ได้แก่ USDTHB Spot Rate และ USDTHB Forward Points คำนวณจากข้อมูลธุรกรรมที่เกิดขึ้นจริง (Transaction-based) ซึ่งประกอบด้วยธุรกรรม USDTHB FX spot และ USDTHB FX swap ของสถาบันการเงินที่เป็นผู้นำส่งข้อมูลสำหรับจัดทำอัตราอ้างอิง THBFIX (Contributing Bank) โดย Contributing Bank และนายหน้าซื้อขายเงินตราต่างประเทศ (FX Broker) จะนำส่งข้อมูลธุรกรรม USDTHB FX spot และ USDTHB FX swap ที่เข้าข่ายเป็น Qualified Transaction ให้แก่ Thomson Reuters (Refinitiv) ซึ่งได้รับการแต่งตั้งเป็นตัวแทนในการคำนวณและเผยแพร่อัตราอ้างอิง THBFIX (Calculation Agent) เพื่อคำนวณอัตราอ้างอิง THBFIX และองค์ประกอบ ตามสูตรที่กำหนดไว้</p> <p>ธุรกรรมที่เข้าข่ายเป็น Qualified Transaction จะต้องเข้าเงื่อนไขทั้งหมดดังต่อไปนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> มีปริมาณธุรกรรมเท่ากับหรือมากกว่า 1,000,000 ดอลลาร์ สรอ. ธุรกรรม USDTHB FX spot: คู่ค้าทั้งสองฝ่ายเป็น Contributing Bank หรือคู่ค้าอย่างน้อยหนึ่งฝ่ายเป็น Contributing Bank สำหรับธุรกรรมที่ได้รับการจับคู่และดำเนินการด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์จาก FX Broker เป็นธุรกรรมที่เกิดขึ้นในช่วงเวลาที่กำหนด (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. มีระยะ (Tenor) ตรงกับที่กำหนด <ul style="list-style-type: none"> ธุรกรรม USDTHB FX spot: T+2 ธุรกรรม USDTHB FX swap: ข้ามคืน, 1 สัปดาห์, 1 เดือน, 3 เดือน, 6 เดือน, และ 1 ปี <p>Thomson Reuters (Refinitiv) จะคำนวณอัตราอ้างอิง THBFIX แต่ละระยะ ในแต่ละวันทำการ ตามสูตรการคำนวณดังนี้</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin: 10px 0;"> $THBFIX = \left\{ \left[\left(\frac{Spot\ Rate + Forward\ Points}{Spot\ Rate} \right) \times \left(1 + \frac{USD\ Rate \times \#days}{360} \right) \right] - 1 \right\} \times \frac{365}{\#days} \times 100$ </div> <p>โดย:</p> <p>“USD Rate” หมายถึง อัตราดอกเบี้ยสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. ของแต่ละระยะที่ประกาศบน Reuters screen LIBOR01 (หรือหน้าอื่น ๆ ที่แสดง USD LIBOR) ณ เวลา 11.55 น. ตามเวลาสหราชอาณาจักร ในวันทำการนั้น</p> <p>“#days” หมายถึง จำนวนวันของแต่ละระยะในวันทำการนั้น (อาจแตกต่างกันในแต่ละวันทำการ)</p> <p>“Spot Rate” (USDTHB Spot Rate) หมายถึง USDTHB spot rate ที่คำนวณด้วยวิธีถ่วงน้ำหนักด้วยปริมาณธุรกรรม (Volume weighted average) โดยคำนวณจากธุรกรรม USDTHB FX spot ที่เป็น Qualified Transaction (ไม่รวมธุรกรรมที่มีปริมาณสูงผิดปกติ หรือมีค่า Spot rate สูงหรือต่ำผิดปกติ) ในวันทำการนั้น</p> <p>“Forward Points” (USDTHB Forward Points) หมายถึง Forward points ที่คำนวณด้วยวิธีถ่วงน้ำหนักด้วยปริมาณธุรกรรม (Volume weighted average) โดยคำนวณจากธุรกรรม USDTHB FX swap</p>

ที่เป็น Qualified Transaction (ไม่รวมธุรกรรมที่มีปริมาณสูงผิดปกติ หรือมีค่า Forward point สูงหรือต่ำผิดปกติ) ของแต่ละระยะในวันทำการนั้น

การกำหนดจุดทศนิยมของข้อมูลที่เผยแพร่

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

ขั้นตอนปฏิบัติ:

1. ขยายช่วง Qualifying Window อีก 25 นาที จาก 14.30 – 15.00 น. เป็น 14.30 – 15.25 น. ตามเวลาประเทศไทยผ่านช่องทางซื้อขายด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์จาก FX Broker โดยหากมี Qualified Transaction ของ USDTHB Spot Rate ในช่วงเวลาดังกล่าว ธปท. จะเผยแพร่ USDTHB Spot Rate บน Thomson Reuters screen ณ เวลา 15.30 น. ตามเวลาประเทศไทย
2. หากขยายช่วง Qualifying Window ตามขั้นที่ 1 แล้ว ไม่มีธุรกรรมที่เป็น Qualified Transaction เกิดขึ้นในช่วงเวลาดังกล่าว การเผยแพร่ USDTHB Spot Rate จะใช้อัตราแลกเปลี่ยนถ่วงเฉลี่ยล่วงหน้าระหว่างธนาคาร (ที่ประกาศโดย ธปท.) ของวันทำการปัจจุบัน ซึ่ง USDTHB Spot Rate จะเผยแพร่บน Thomson Reuters screen ณ เวลา 18.00 น. ตามเวลาประเทศไทย

● **USDTHB Forward Points**

เงื่อนไขการใช้มาตรการสำรอง: เมื่อไม่มีธุรกรรม USDTHB FX swap ที่เป็น Qualified Transaction ในระยะใด เกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window

ขั้นตอนปฏิบัติ:

การเผยแพร่ USDTHB Forward Point ในระยะดังกล่าว จะใช้ USDTHB Forward Point ในระยะนั้นของวันทำการล่าสุดที่มีธุรกรรม Qualified Transaction โดยปรับด้วย Day count ของวันทำการปัจจุบัน ตามสูตรการคำนวณ ดังนี้

$$\text{Adjusted forward point} = \left(\frac{\text{Forward Points}}{\text{Day count of the latest business day}} \right) \times (\text{Day count of the relevant day})$$

● **อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THBFX**

เงื่อนไขการใช้มาตรการสำรอง: มาตรการสำรองจะถูกนำมาใช้เมื่อไม่มีการเผยแพร่ USD Rate ในระยะใด

ขั้นตอนการปฏิบัติ:

กรณีไม่มีการเผยแพร่ USD Rate ในระยะใดเป็นการชั่วคราว การคำนวณอัตราอ้างอิง THBFX ในระยะดังกล่าวจะใช้ USD Rate ของวันทำการก่อนหน้า อย่างไรก็ตาม การปฏิบัติดังกล่าวจะใช้ได้ติดต่อกันเพียง 3 วันทำการเท่านั้น หากไม่มีการเผยแพร่ USD Rate ในระยะดังกล่าวติดต่อกันเป็นวันทำการที่ 4 การเผยแพร่อัตราอ้างอิง THBFX สำหรับระยะนั้น จะเป็น “No Fix”

กรณีเกิดการยุติการเผยแพร่ USD LIBOR ระยะ 1 สัปดาห์เป็นการถาวร

- ธปท. จะคำนวณหา USD LIBOR ระยะ 1 สัปดาห์ด้วยวิธี Interpolation (โดยใช้ข้อมูลจากระยะข้ามคืน (Overnight) และ 1 เดือน) เพื่อใช้ในการคำนวณอัตราอ้างอิง THBFX ระยะ 1 สัปดาห์ (การดำเนินการนี้จะเกิดขึ้นในช่วงมกราคม 2565 ถึงมิถุนายน 2566)

- หากไม่มีการเผยแพร่ USD LIBOR ระยะข้ามคืนหรือ 1 เดือน เป็นการชั่วคราว ธปท. จะใช้ข้อมูล USD LIBOR ระยะ 1 สัปดาห์ที่คำนวณด้วยวิธี Interpolation ของวันทำการก่อนหน้าในการคำนวณอัตราอ้างอิง

	<p>THBFIX อย่างไรก็ตาม การปฏิบัติดังกล่าวจะใช้ได้ติดต่อกันเพียง 3 วันทำการเท่านั้น หากไม่มีการเผยแพร่ USD LIBOR ในระยะข้ามคืนหรือ 1 เดือนติดต่อกันเป็นวันทำการที่ 4 การเผยแพร่อัตราอ้างอิง THBFIX ระยะ 1 สัปดาห์จะเป็น “No Fix”</p> <p>สามารถอ่านรายละเอียดการจัดทำเพิ่มเติมได้ในภาคผนวก 1 ของแนวปฏิบัติธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรฐานการปฏิบัติงานสำหรับ Contributing Bank และ FX Broker ที่นำส่งข้อมูลเพื่อการจัดทำอัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX) (https://www.bot.or.th/App/thbfix/)</p>
สื่อที่ใช้ในการเผยแพร่	<p>เว็บไซต์ ธนาคารแห่งประเทศไทย (https://www.bot.or.th/App/THBFIX/)</p>
การปรับปรุงข้อมูล	<p>ปรับตามข้อมูลจริง</p>

ทีมมาตรฐานตลาดการเงิน
ฝ่ายตลาดการเงิน
โทร. 0-2283-6349
0-2356-7534