

คำอธิบายข้อมูล	
รหัสของตาราง	FM_RT_012
ชื่อตาราง	อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX) และองค์ประกอบ
ความถี่ของข้อมูล ความล่าช้าและกำหนดเวลาเผยแพร่	<p>ความถี่ รายวัน</p> <p>ความล่าช้า -</p> <p>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</p>
หลักวิธีทางสถิติ <ul style="list-style-type: none"> <li>● หลักการและนิยาม</li> <li>● ความครอบคลุม</li> <li>● ประเภทและลักษณะของข้อมูล</li> <li>● วิธีประมวลผล</li> <li>● มาตรการสำรอง</li> </ul>	<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"> <li>1. มีปริมาณธุรกรรมเท่ากับหรือมากกว่า 1,000,000 ดอลลาร์ สรอ.</li> <li>2. ธุรกรรม USDTHB FX spot: คู่ค้าทั้งสองฝ่ายเป็น Contributing Bank หรือคู่ค้าอย่างน้อยหนึ่งฝ่ายเป็น Contributing Bank สำหรับธุรกรรมที่ได้รับการจับคู่และดำเนินการด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์จาก FX Broker</li> <li style="padding-left: 20px;">ธุรกรรม USDTHB FX swap: คู่ค้าทั้งสองฝ่ายเป็น Contributing Bank</li> <li>3. เป็นธุรกรรมที่เกิดขึ้นในช่วงเวลาที่กำหนด (Qualifying Window)             <ul style="list-style-type: none"> <li>ธุรกรรม USDTHB FX spot: 14.30 – 15.00 น.</li> <li>ธุรกรรม USDTHB FX swap: 07.30 – 16.30 น.</li> </ul> </li> <li>4. มีระยะ (Tenor) ตรงกับที่กำหนด             <ul style="list-style-type: none"> <li>ธุรกรรม USDTHB FX spot: T+2</li> <li>ธุรกรรม USDTHB FX swap: ข้ามคืน, 1 สัปดาห์, 1 เดือน, 3 เดือน, 6 เดือน, และ 1 ปี</li> </ul> </li> </ol> <p>Thomson Reuters (Refinitiv) จะคำนวณอัตราอ้างอิง THBFIX แต่ละ Tenor ในแต่ละวันทำการ ตามสูตรการคำนวณ ดังนี้</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin: 10px 0;"> <math display="block">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</math> </div> <p>โดย:</p> <p>“USD Rate” หมายถึง อัตราดอกเบี้ยสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. ของแต่ละ Tenor ที่ประกาศบน Reuters screen LIBOR01 (หรือหน้าอื่น ๆ ที่แสดง USD LIBOR) ณ เวลา 11.55 น. ตามเวลาสหราชอาณาจักร ในวันทำการนั้น</p> <p>“#days” หมายถึง จำนวนวันของแต่ละ Tenor ในวันทำการนั้น (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 ที่คำนวณด้วยวิธีถ่วงเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักด้วยปริมาณธุรกรรม (Volume weighted average) โดยคำนวณจากธุรกรรม USDTHB FX swap ที่เป็น Qualified Transaction (ไม่รวมธุรกรรมที่มีปริมาณสูงผิดปกติ หรือมีค่า Forward point สูงหรือต่ำผิดปกติ) ของแต่ละ Tenor ในวันทำการนั้น</p> <p><b>การกำหนดจุดทศนิยมของข้อมูลที่เผยแพร่</b>  THBFX: ทศนิยม 5 ตำแหน่ง ปิดเศษทางด้านที่ใกล้ที่สุด  USDTHB Spot Rate: ทศนิยม 4 ตำแหน่ง ปิดเศษทางด้านที่ใกล้ที่สุด  USDTHB Forward Points: ทศนิยม 4 ตำแหน่ง ปิดเศษทางด้านที่ใกล้ที่สุด</p> <p><b>มาตรการสำรอง</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● <b>USDTHB Spot Rate และ USDTHB Forward Points</b>  <b>เงื่อนไขการใช้มาตรการสำรอง:</b>  USDTHB Spot Rate: เมื่อไม่มีธุรกรรม USDTHB FX spot ที่เป็น Qualified Transaction เกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window  USDTHB Forward Points: เมื่อไม่มีธุรกรรม USDTHB FX swap ที่เป็น Qualified Transaction ใน Tenor นั้น เกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window</li> </ul> <p><b>ขั้นตอนปฏิบัติ:</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. การเผยแพร่ USDTHB Spot Rate และ USDTHB Forward Point ใน Tenor นั้น จะใช้ USDTHB Spot Rate และ USDTHB Forward Point ของวันทำการก่อนหน้า</li> <li>2. การปฏิบัติในข้อ 1 จะใช้ได้ติดต่อกันเพียง 3 วันทำการเท่านั้น หากเกิดเงื่อนไขการใช้มาตรการสำรองติดต่อกันเป็นวันทำการที่ 4 การเผยแพร่ USDTHB Spot Rate และ USDTHB Forward Point ใน Tenor นั้น จะเป็น “No Fix”</li> </ol> <ul style="list-style-type: none"> <li>● <b>อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THBFX</b>  <b>เงื่อนไขการใช้มาตรการสำรอง:</b> เมื่อเหตุการณ์ดังต่อไปนี้เกิดขึ้น 1 เหตุการณ์หรือมากกว่า <ol style="list-style-type: none"> <li>a. ไม่มีการเผยแพร่ USDTHB Spot Rate (เผยแพร่เป็น “No Fix”)</li> <li>b. ไม่มีการเผยแพร่ USDTHB Forward Point ใน Tenor นั้น (เผยแพร่เป็น “No Fix”)</li> <li>c. ไม่มีการเผยแพร่ USD Rate ใน Tenor นั้น</li> </ol> </li> </ul> <p><b>ขั้นตอนการปฏิบัติ:</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. หากไม่มีการเผยแพร่ USDTHB Spot Rate การเผยแพร่อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THBFX จะเป็น “No Fix”</li> <li>2. หากไม่มีการเผยแพร่ USDTHB Forward Point ใน Tenor ใด การเผยแพร่อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THBFX ใน Tenor นั้นจะเป็น “No Fix”</li> <li>3. หากไม่มีการเผยแพร่ USD Rate ใน Tenor ใด การคำนวณอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THBFX ใน Tenor ดังกล่าวจะใช้ USD Rate ของวันทำการก่อนหน้า อย่างไรก็ตาม การปฏิบัติดังกล่าวจะใช้ได้ติดต่อกันเพียง 3 วันทำการเท่านั้น หากไม่มีการเผยแพร่ USD Rate ใน Tenor ดังกล่าวติดต่อกันเป็นวันทำการที่ 4 การเผยแพร่อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THBFX สำหรับ Tenor นั้น จะเป็น “No Fix”</li> </ol> <p>สามารถอ่านรายละเอียดการจัดทำเพิ่มเติมได้ในภาคผนวก 1 ของแนวปฏิบัติธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรฐานการปฏิบัติงานสำหรับ Contributing Bank และ FX Broker ที่นำส่งข้อมูลเพื่อการจัดทำอัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFX)  <a href="https://www.bot.or.th/Thai/FinancialMarkets/FinancialMarketDevelopment/DocLib/THBFX%20Procedure%20and%20Conduct%20Guideline.pdf">https://www.bot.or.th/Thai/FinancialMarkets/FinancialMarketDevelopment/DocLib/THBFX%20Procedure%20and%20Conduct%20Guideline.pdf</a></p>
แหล่งที่มาของข้อมูล	<p>ข้อมูลธุรกรรม USDTHB FX spot และ USDTHB FX swap สำหรับจัดทำอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THBFX และองค์ประกอบ</p> <p>สถาบันการเงินที่เป็น Contributing Bank</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)</li> <li>2. ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)</li> <li>3. ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน)</li> <li>4. ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)</li> <li>5. ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน)</li> </ol>

	<ol style="list-style-type: none"> <li>6. ธนาคารเจพีมอร์แกน เชส</li> <li>7. ธนาคารซีทีแบงก์ เอ็น.เอ.</li> <li>8. ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย จำกัด (มหาชน)</li> <li>9. ธนาคารซูมิโตโม มิตซูบิ แบงกิ้ง คอร์ปอเรชั่น</li> <li>10. ธนาคารคอยส์แบงก์</li> <li>11. ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน)</li> <li>12. ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)</li> <li>13. ธนาคารธนาชาต จำกัด (มหาชน)</li> <li>14. ธนาคารบีเอ็นพี พารีบาส์</li> <li>15. ธนาคารมิซูโฮ จำกัด สาขากรุงเทพฯ</li> <li>16. ธนาคารยูโอบี จำกัด (มหาชน)</li> <li>17. ธนาคารสแตนดาร์ดชาร์เตอร์ด (ไทย) จำกัด (มหาชน)</li> <li>18. ธนาคารแห่งอเมริกาเนชั่นแนลแอสโซซิเอชั่น</li> <li>19. ธนาคารอินเดียเนโอเวอร์ซีส์</li> <li>20. ธนาคารโอเวอร์ซี-ไซเนิสแบงกิ้งคอร์ปอเรชั่น จำกัด</li> <li>21. ธนาคารไอซีบีซี (ไทย) จำกัด (มหาชน)</li> <li>22. ธนาคารฮ่องกงและเซี่ยงไฮ้แบงกิ้งคอร์ปอเรชั่น จำกัด</li> <li>23. ธนาคารแห่งประเทศไทย</li> </ol> <p><u>นายหน้าซื้อขายเงินตราต่างประเทศ (FX Broker)</u></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. บริษัท เทคดิชั่น สยาม (โบรกเกอร์) จำกัด</li> <li>2. บริษัท วอลล์สตรีท ทัลเลนท์ พรีบอนน์ จำกัด</li> <li>3. บริษัท ศศิธร อินเทอร์เน็ตเนชั่นแนล จำกัด</li> <li>4. บริษัท อีลิท พาร์ทเนอร์ส จำกัด</li> <li>5. บริษัท เอเอฟเอส (ประเทศไทย) จำกัด</li> <li>6. บริษัท ไอแคป-เอพี (ประเทศไทย) จำกัด</li> <li>7. รอยเตอร์ ทรานแซคชัน เซอร์วิสেস ลิมิเต็ด</li> </ol> <p>ข้อมูลอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THBFIX และองค์ประกอบ Thomson Reuters (Refinitiv)</p>
<p>สื่อที่ใช้ในการเผยแพร่</p>	<p>เว็บไซต์ ธนาคารแห่งประเทศไทย <a href="https://www.bot.or.th/App/THBFIX/">(https://www.bot.or.th/App/THBFIX/)</a></p>
<p>การปรับปรุงข้อมูล</p>	<p>ปรับตามข้อมูลจริง</p>

ทีมมาตรฐานตลาดการเงิน  
ฝ่ายตลาดการเงิน  
โทร. 0-2283-6349