

คำอธิบายข้อมูล																
รหัสของตาราง	FM_RT_013															
ชื่อตาราง	อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงธุรกรรมซื้อคืนระยะข้ามคืน (Thai Overnight Repurchase Rate: THOR) และอัตราดอกเบี้ย THOR Average															
ความถี่ของข้อมูล ความล่าช้าและกำหนดเวลาเผยแพร่	ความถี่ รายวัน ความล่าช้า - กำหนดเวลาเผยแพร่ ทุกวันทำการเวลา 17.00 น. สำหรับ THOR และทุกวันทำการเวลา 09.30 น. สำหรับ THOR Average															
<p>หลักวิธีทางสถิติ</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• หลักการ นิยาม และการจัดกลุ่ม</li> <li>• ความครอบคลุม</li> <li>• การบันทึกข้อมูลและมาตรฐานบัญชีที่เกี่ยวข้อง</li> <li>• ลักษณะของข้อมูลและวิธีการจัดเก็บ</li> <li>• วิธีประมวลผลข้อมูล</li> </ul>	<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"> <li>1. เป็นธุรกรรมที่มีคู่สัญญาทั้งสองฝั่งเป็นธนาคารพาณิชย์หรือสถาบันการเงินเฉพาะกิจ</li> <li>2. เป็นธุรกรรมระยะข้ามคืนที่มีการตกลงและชำระราคาในวันนั้นๆ โดยการตกลงเกิดขึ้นระหว่างเวลา 7.00 น. ถึง 16.00 น. รวมถึงธุรกรรมที่รายงานมายังสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยภายใน 16.30 น.</li> <li>3. เป็นธุรกรรมที่มีขนาดตั้งแต่ 100 ล้านบาทขึ้นไป</li> </ol> <p>ในกรณีที่ไม่มี Qualified Transaction จะเผยแพร่โดยใช้ค่าอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง THOR ของวันทำการก่อนหน้าปรับด้วยการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงระยะสั้นตลาดกรุงเทพ (BIBOR) ระยะข้ามคืนในวันเดียวกันจาก BIBOR ของวันทำการก่อนหน้า หรืออธิบายโดยสมการ ดังนี้ <math>THOR_t = THOR_{t-1} + (BIBOR_t - BIBOR_{t-1})</math></p> <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> <tr> <td>t</td> <td>คือ</td> <td>วันเผยแพร่ข้อมูล THOR Average</td> </tr> <tr> <td>THOR<sub>i</sub></td> <td>คือ</td> <td>อัตราดอกเบี้ย THOR ในวันทำการ i</td> </tr> <tr> <td>i</td> <td>คือ</td> <td>วันทำการ (business day) แต่ละวันในช่วงเวลาที่คำนวณ</td> </tr> <tr> <td>d<sub>c</sub></td> <td>คือ</td> <td>จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ในช่วงเวลา 1 เดือน, 3 เดือน และ 6 เดือน โดยนับจำนวนวันย้อนหลังแบบวันชนวันจาก t ไปยังวันเริ่มต้นคำนวณ และปรับวันเริ่มต้นคำนวณที่ตรงกับวันหยุดด้วยวิธี modified preceding (ในกรณีที่เมื่อนับแบบวันชนวันแล้ว วันเริ่มต้นคำนวณตรงกับวันหยุด ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณไปเป็นวันทำการก่อนหน้า แต่หากเลื่อนแล้วทำให้วันเริ่มต้นคำนวณข้ามไปเป็นเดือนก่อน ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณเป็นวันทำการถัดไปแทน)</td> </tr> <tr> <td>a<sub>i</sub></td> <td>คือ</td> <td>จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ที่ใช้ THOR<sub>i</sub> (เช่นกรณี i คือวันศุกร์ THOR<sub>i</sub> จะใช้สำหรับวันศุกร์ วันเสาร์ และวันอาทิตย์ รวม 3 วัน ดังนั้น a<sub>i</sub> จะเท่ากับ 3)</td> </tr> </table>	t	คือ	วันเผยแพร่ข้อมูล THOR Average	THOR <sub>i</sub>	คือ	อัตราดอกเบี้ย THOR ในวันทำการ i	i	คือ	วันทำการ (business day) แต่ละวันในช่วงเวลาที่คำนวณ	d <sub>c</sub>	คือ	จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ในช่วงเวลา 1 เดือน, 3 เดือน และ 6 เดือน โดยนับจำนวนวันย้อนหลังแบบวันชนวันจาก t ไปยังวันเริ่มต้นคำนวณ และปรับวันเริ่มต้นคำนวณที่ตรงกับวันหยุดด้วยวิธี modified preceding (ในกรณีที่เมื่อนับแบบวันชนวันแล้ว วันเริ่มต้นคำนวณตรงกับวันหยุด ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณไปเป็นวันทำการก่อนหน้า แต่หากเลื่อนแล้วทำให้วันเริ่มต้นคำนวณข้ามไปเป็นเดือนก่อน ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณเป็นวันทำการถัดไปแทน)	a <sub>i</sub>	คือ	จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ที่ใช้ THOR <sub>i</sub> (เช่นกรณี i คือวันศุกร์ THOR <sub>i</sub> จะใช้สำหรับวันศุกร์ วันเสาร์ และวันอาทิตย์ รวม 3 วัน ดังนั้น a <sub>i</sub> จะเท่ากับ 3)
t	คือ	วันเผยแพร่ข้อมูล THOR Average														
THOR <sub>i</sub>	คือ	อัตราดอกเบี้ย THOR ในวันทำการ i														
i	คือ	วันทำการ (business day) แต่ละวันในช่วงเวลาที่คำนวณ														
d <sub>c</sub>	คือ	จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ในช่วงเวลา 1 เดือน, 3 เดือน และ 6 เดือน โดยนับจำนวนวันย้อนหลังแบบวันชนวันจาก t ไปยังวันเริ่มต้นคำนวณ และปรับวันเริ่มต้นคำนวณที่ตรงกับวันหยุดด้วยวิธี modified preceding (ในกรณีที่เมื่อนับแบบวันชนวันแล้ว วันเริ่มต้นคำนวณตรงกับวันหยุด ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณไปเป็นวันทำการก่อนหน้า แต่หากเลื่อนแล้วทำให้วันเริ่มต้นคำนวณข้ามไปเป็นเดือนก่อน ให้เลื่อนวันเริ่มต้นคำนวณเป็นวันทำการถัดไปแทน)														
a <sub>i</sub>	คือ	จำนวนวันปฏิทิน (calendar day) ที่ใช้ THOR <sub>i</sub> (เช่นกรณี i คือวันศุกร์ THOR <sub>i</sub> จะใช้สำหรับวันศุกร์ วันเสาร์ และวันอาทิตย์ รวม 3 วัน ดังนั้น a <sub>i</sub> จะเท่ากับ 3)														

	THOR และ THOR Average แสดงค่าเป็นทศนิยม 5 ตำแหน่ง
แหล่งที่มาของข้อมูล	1. สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย 2. ธนาคารพาณิชย์และสถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกแห่ง
สื่อที่ใช้ในการเผยแพร่	เว็บไซต์ ธนาคารแห่งประเทศไทย ( <a href="https://www.bot.or.th/App/BTWS_STAT/statistics/BOTWEBSTAT.aspx?reportID=945&amp;language=th">https://www.bot.or.th/App/BTWS_STAT/statistics/BOTWEBSTAT.aspx?reportID=945&amp;language=th</a> )
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