

คำอธิบายข้อมูล	
รหัสของตาราง	FM_RT_012
ชื่อตาราง	อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX) และองค์ประกอบ
ความถี่ของข้อมูล ความถี่และกำหนดเวลาเผยแพร่	ความถี่ รายวัน ความถี่ซ้ำ เผยแพร่ forward points เช้าวันทำการถัดไป 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	อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX) หมายถึงอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงในการกู้ยืมเงินบาทในระยะต่าง ๆ ที่คำนวณมาจากการกู้ยืมเงินดอลลาร์ สรอ. ในระยะเดียวกัน และแลกเปลี่ยนเป็นเงินบาทด้วยการทำธุรกรรม FX swap
<ul style="list-style-type: none"> <li>● หลักการและนิยาม</li> <li>● ความครอบคลุม</li> <li>● ประเภทและลักษณะของข้อมูล</li> <li>● วิธีประมวลผล</li> <li>● มาตรการสำรอง</li> </ul>	<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 ธุรกรรม USDTHB FX swap: คู่ค้าทั้งสองฝ่ายเป็น Contributing Bank</li> <li>3. เป็นธุรกรรมที่เกิดขึ้นในช่วงเวลาที่กำหนด (Qualifying Window) ธุรกรรม USDTHB FX spot: 14.30 – 15.00 น. ธุรกรรม USDTHB FX swap: 07.30 – 16.30 น.</li> <li>4. มีระยะ (Tenor) ตรงกับที่กำหนด ธุรกรรม USDTHB FX spot: T+2 ธุรกรรม USDTHB FX swap: ข้ามคืน, 1 สัปดาห์, 1 เดือน, 3 เดือน, 6 เดือน, และ 1 ปี</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 ที่คำนวณด้วยวิธีถ่วงน้ำหนักด้วยปริมาณธุรกรรม (Volume weighted average) โดยคำนวณจากธุรกรรม USDTHB FX swap</p>

ที่เป็น Qualified Transaction (ไม่รวมธุรกรรมที่มีปริมาณสูงผิดปกติ หรือมีค่า Forward point สูงหรือต่ำผิดปกติ) ของแต่ละ Tenor ในวันทำการนั้น

**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 จะใช้อัตราแลกเปลี่ยนถ่วงน้ำหนักระหว่างธนาคาร (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 ใน Tenor นั้น เกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window

**ขั้นตอนปฏิบัติ:**

การเผยแพร่ USDTHB Forward Point ใน Tenor ดังกล่าว จะใช้ USDTHB Forward Point ใน Tenor นั้น ของวันทำการล่าสุดที่มีธุรกรรม 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 ใน Tenor นั้น

**ขั้นตอนการปฏิบัติ:**

หากไม่มีการเผยแพร่ USD Rate ใน Tenor ใด การคำนวณอัตราอ้างอิง THBFX ใน Tenor ดังกล่าวจะใช้ USD Rate ของวันทำการก่อนหน้า อย่างไรก็ตาม การปฏิบัติดังกล่าวจะใช้ได้ติดต่อกันเพียง 3 วันทำการเท่านั้น หากไม่มีการเผยแพร่ USD Rate ใน Tenor ดังกล่าวติดต่อกันเป็นวันทำการที่ 4 การเผยแพร่อัตราอ้างอิง THBFX สำหรับ Tenor นั้น จะเป็น “No Fix”

สามารถอ่านรายละเอียดการจัดทำเพิ่มเติมได้ในภาคผนวก 1 ของแนวปฏิบัติธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรฐานการปฏิบัติงานสำหรับ Contributing Bank และ FX Broker ที่นำเสนอข้อมูลเพื่อการจัดทำอัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFX) (<https://www.bot.or.th/App/thbfix>)

สื่อที่ใช้ในการเผยแพร่	เว็บไซต์ ธนาคารแห่งประเทศไทย ( <a href="https://www.bot.or.th/App/THBFIX/">https://www.bot.or.th/App/THBFIX/</a> )
การปรับปรุงข้อมูล	ปรับตามข้อมูลจริง

ทีมมาตรฐานตลาดการเงิน  
ฝ่ายตลาดการเงิน  
โทร. 0-2283-6349  
0-2283-6321