



# iBond User Manual

## BOND PRICE&INDICES

Updated August 18, 2022

**Contact iBond:**

Bond Pricing & Product Development Department,  
The Thai Bond Market Association (ThaiBMA)

email address: [pricing@thaibma.or.th](mailto:pricing@thaibma.or.th)

Tel. 0-2257-0357 ext. 451-456

Visit our website: [www.ibond.thaibma.or.th](http://www.ibond.thaibma.or.th)

## สารบัญ

หัวข้อ	หน้า
<b>Bond Price/ Indices</b>	
Bond Price	1
End of day trading	
Daily Trading Movement	2
Daily Trading Movement (Fx)	4
Spread & Duration	5
Trading Movement	7
Trading Summary	8
Stressed Bonds	9
Intraday trading	
Basic view mode	10
Advanced view mode	11
Quotation	
Treasury Bills	14
Government Bonds	15
State Owned Enterprise Bonds	16
State Agency Bonds	17
Corporate Bonds	18
Foreign Bonds	19
RP Reference Yield	
RP Reference Yield (T+1)	20
RP Reference Yield (T+2)	22
RP Reference Yield (T+3)	23
Mark to Market	24
Plain Vanilla MTM Pages	25
Structure Note MTM Page	28
Notice Pending Page	30
Download Historical MTM	31
MTM Yield Movement	32
MTM Price Feedback	33
Indices	34
ThaiBMA Government Bond Index	35
Composite Bond Index	37
T-Bill Index	39

หัวข้อ	หน้า
Indices	
Zero Rate Return Index	40
SOE Zero Rate Return Index	41
Corporate Zero Rate Return Index	43
Commercial Paper Index	45
Short-term Government Bond Index	46
MTM Government Bond Index	47
MTM Corporate Bond Index	49
Fixed-Term Corporate Bond Index	51
ESG Bond Index	53
Inflation-Linked Bond Index	55
Customized Bond Index	56

## Bond Price/ Indices

### Bond Price

รวบรวมข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับราคาตราสารหนี้ ไม่ว่าจะเป็นราคาปิด, ราคาระหว่างวัน, ราคาที่เสนอโดย Dealer และราคาที่ใช้สำหรับ Mark-to-Market ประกอบไปด้วยเมนูย่อยทั้งหมด 4 เมนู

1. End of day trading:
  - 1.1 Daily Trading Movement: สรุปข้อมูลการซื้อขายในแต่ละวัน (ปริมาณการซื้อขาย, ราคาเฉลี่ย, ราคาสุดท้าย)
  - 1.2 Daily Trading Movement (Fx): สรุปของธุรกรรมการซื้อขายของตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ
  - 1.3 Spread & Duration: แสดงข้อมูล Spread และข้อมูล Duration ของแต่ละ Symbol ที่มีธุรกรรมซื้อขายในแต่ละวัน
  - 1.4 Trading Movement: ข้อมูลการเปลี่ยนแปลงของ Yield ในช่วงระยะเวลาที่กำหนด
  - 1.5 Trading Summary: ข้อมูลสรุปของธุรกรรมการซื้อขาย
2. Intraday Trading: ข้อมูลการซื้อขายที่เกิดขึ้นในช่วงระหว่างวันแบบ Real-Time
  - 2.1 Basic view mode
  - 2.2 Advanced view mode
3. Quotation: ราคาเสนอซื้อและเสนอขาย ที่ Quote โดย Dealer
  - 3.1 Treasury Bills: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อและเสนอขายเฉลี่ยของตราสารหนี้ประเภทตั๋วเงินคลัง
  - 3.2 Government Bonds: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยของพันธบัตรรัฐบาลประเภท Loan Bond (LB)
  - 3.3 State Owned Enterprise Bonds: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยของพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ
  - 3.4 State Agency Bonds: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยของพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย
  - 3.5 Corporate Bonds: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของหุ้นกู้เอกชน
  - 3.6 Foreign Bonds: อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของพันธบัตรต่างประเทศ
4. RP Reference Yield:
  - 4.1 RP Reference Yield (T+1): ราคาเพื่อใช้อ้างอิง (Reference) ในการทำธุรกรรมกู้ยืม (Repo) (T+1)
  - 4.2 RP Reference Yield (T+2): ราคาเพื่อใช้อ้างอิง (Reference) ในการทำธุรกรรมกู้ยืม (Repo) (T+2)
  - 4.3 RP Reference Yield (T+3): ราคาเพื่อใช้อ้างอิง (Reference) ในการทำธุรกรรมกู้ยืม (Repo) (T+3)

## ชื่อหน้า: Bond Price > End of day trading > Daily Trading Movement

### ภาพประกอบ:

#### Daily Trading Movement

Daily Trading Movement	Daily Trading Movement (Fx)	Spread & Duration	Trading Movement	Trading Summary								
08/08/2022												
Daily Trading Movement As of 2022-08-08												
Trading Value												
Total Trading Value (THB)	1,063,724,132,012.09											
Outright Trading Value (THB)	20,839,650,184.98											
Financing Value (THB)	1,042,850,302,859.91											
Other Value (THB)	34,178,967.20											
ThaiBMA Government Bond Index												
Clean Price :	101.08 -0.19											
Gross Price:	101.51 -0.19											
Total Return:	298.57 -0.55											
<a href="#">Download Excel</a>												
Outright Trading Transactions												
Symbol	Type	Bond Information						Previous				
		Rating	Maturity	Attribute	TTM	Coupon	PE. last Date	PE. last Yield	PE. last Price	PE. last Remark flag	PE. Weight Avg. Yield	PE. Weight Avg. Price
TB22D21A			21-Dec-2022		0.37	0.0000	05-Aug-2022	0.730000	99.732716		0.728882	99.7330
TB22N23A			23-Nov-2022		0.29	0.0000	05-Aug-2022	0.650000	99.809814		0.655000	99.8082
TB22O12A			12-Oct-2022		0.18	0.0000	04-Aug-2022	0.660000	99.875388	SL	0.660000	99.8753
TB23118A			18-Jan-2023		0.45	0.0000	01-Aug-2022	0.780000	99.644392	SL	0.780000	99.6443
1.2 Government Bond												
ESGLB35DA			17-Dec-2035		13.37	1.5850	05-Aug-2022	2.910000	85.422409		2.907862	85.4431
ILB283A			12-Mar-2028		5.60	1.2500	05-Aug-2022	0.770000	102.618718		0.770000	102.618
LB22DA			17-Dec-2022		0.36	2.0000	05-Aug-2022	0.850000	100.404930		0.824815	100.421
LB23DA			17-Dec-2023		1.36	2.4000	05-Aug-2022	1.340000	101.418586		1.343235	101.412
LB246A			17-Jun-2024		1.86	0.7500	05-Aug-2022	1.605000	98.441201		1.609155	98.4335
LB249A			17-Sep-2024		2.11	0.7500	05-Aug-2022	1.635000	98.171172		1.636332	98.1682
LB24DB			17-Dec-2024		2.36	1.4500	05-Aug-2022	1.740000	99.330737		1.740141	99.3304
LB256A			17-Jun-2025		2.86	0.9500	05-Aug-2022	1.800000	97.642190		1.800000	97.6421
LB25DA			12-Dec-2025		3.35	3.8500	04-Aug-2022	1.945000	106.133609		1.947995	106.123
LB26DA			17-Dec-2026		4.36	2.1250	05-Aug-2022	1.940000	100.765246		1.964998	100.660
LB276A			17-Jun-2027		4.86	1.0000	05-Aug-2022	2.000000	95.392220		2.009764	95.3490
LB27DA			17-Dec-2027		5.36	3.5800	05-Aug-2022	2.170000	107.086715		2.170000	107.086
LB286A			17-Jun-2028		5.86	2.6500	05-Aug-2022	1.990000	103.631052		1.997774	103.587
LB28DA			17-Dec-2028		6.36	2.8750	05-Aug-2022	2.170000	104.160924		2.198618	103.986
LB296A			22-Jun-2029		6.88	4.8750	04-Aug-2022	2.350000	115.946676	SL	2.350000	115.946

### ความหมาย ที่มาของข้อมูล และการคำนวณ:

ThaiBMA Daily Report เป็นรายงานสรุปการซื้อขายประจำวัน โดยแบ่งเป็น 4 ส่วนหลัก

ส่วนที่ 1: Trading Value (ด้านบนซ้าย) แสดงสรุปยอดรวม (Gross Value) ของธุรกรรมซื้อขายทั้งหมด และยอดรวมธุรกรรมซื้อขายแยกตามประเภท Outright Trading, Financing และ Other

ส่วนที่ 2: ThaiBMA Government Bond Index (ด้านบนขวา) แสดงข้อมูล Index แยกตาม Clean Price, Gross Price และ Total Return (รายละเอียดข้อมูลและการคำนวณสามารถดูได้จากเมนู Indices)

ส่วนที่ 3: Outright Trading Transactions แสดงรายละเอียดของธุรกรรมซื้อขายประจำวันสรุปแยกตาม Symbol โดยแสดงตามลำดับประเภทของการซื้อขาย แบ่งเป็น

(3.1) Cash Trading Transactions คือ ธุรกรรมซื้อขายแบบ Outright ข้อมูลที่แสดงของแต่ละ Symbol ประกอบด้วย

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้แยกตามประเภทของตราสารหนี้
- TTM: อายุคงเหลือ (ปี)
- Coupon: คูปอง (%)
- Bid Yield (%): ข้อมูล Quote ราคา Bid เฉพาะของ Government Bond โดยประกอบด้วย
- Best Bid (%): Bid Yield ที่ต่ำที่สุดจากการ Quote ของ Primary Dealer

- Average (%): ค่าเฉลี่ย Bid Yield จากการ Quote ของ Primary Dealer
- Best Bid Price: ราคาที่คำนวณได้จาก Best Bid Yield (Settlement date = t+2)
- Best Offer Yield (%): ข้อมูล Offer Yield ที่สูงที่สุดจากการ Quote ของ Primary Dealer
- Last : ข้อมูลราคาปิดของแต่ละ Symbol ประจำวัน ซึ่งประกอบด้วย
  - Executed Yield (%): Yield จากรายการซื้อขายล่าสุดที่ใช้เป็นราคาปิด
  - DM: Discount Margin สำหรับ Floating Rate Bonds
  - YTP/ YTC: Yield to Put และ Yield to Call สำหรับ Puttable และ Callable Bonds
  - Price (%): Clean Price ที่คำนวณจาก Last Executed Yield ตาม Settlement Date ที่ซื้อขายจริง
- Gross Value: มูลค่าการซื้อขาย (บาท) = Gross Price \* Volume
- Flag SL: สำหรับรายการที่เป็น Small Lot (น้อยกว่า 10 ล้านบาท สำหรับ Government Bonds และ น้อยกว่า 5 ล้านบาท สำหรับ Corporate Bonds)
- Flag NL: สำหรับราคาที่พิจารณาแล้วว่าน่าจะไม่ใช่อัตราผลตอบแทนที่ควรจะเป็นในภาวะตลาดช่วงนั้น (Not in Line) และอาจไม่เหมาะที่จะนำราคานั้นไปใช้ในการ Mark-To-Market
- Weighted Average:
  - Yield (%): ค่าเฉลี่ยของ Executed Yields ของรายการซื้อขายทุกรายการ
  - Price (%): ราคาเฉลี่ย (Average Clean Price) ของรายการซื้อขายทุกรายการ
  - Total Gross Value: มูลค่ารวมของรายการซื้อขายทุกรายการ (บาท)

(3.2) Financing Transactions คือ ธุรกรรมซื้อขายแบบ Financing ข้อมูลจะแสดงแยกตามประเภทของ Bond และแสดงข้อมูลจำนวนวัน (Terms) ค่าเฉลี่ยของอัตราดอกเบี้ย (Weighted Average Rate (%)) และมูลค่ารวมของธุรกรรมแยกตามจำนวนวัน (Total Gross Value)

(3.3) Other Transactions คือ ธุรกรรมซื้อขายแบบอื่นๆ ที่ไม่ใช่แบบ Outright หรือ Financing โดยข้อมูลจะแสดงแยกตามประเภทของ Bond และแสดงข้อมูลจำนวนวัน (Terms) ค่าเฉลี่ยของอัตราดอกเบี้ย (Weighted Average Rate (%)) และมูลค่ารวมของธุรกรรม

ส่วนที่ 4: สำหรับดาวน์โหลดไฟล์ ThaiBMA Daily Report ในรูปแบบ Excel

## ชื่อหน้า: Bond Price > End of day trading > Daily Trading Movement (Fx)

### ภาพประกอบ:

Daily Trading Movement

---

Daily Trading Movement (Fx)   Spread & Duration   Trading Movement   Trading Summary

08/08/2022

Daily Trading Movement (Foreign Currency Denominated Bond) As of 2022-08-08

Trading Value

Total Trading Value (THB)	0.00
Outright Trading Value (THB)	0.00
Financing Value (THB)	0.00
Other Value (THB)	0.00

[Download Excel](#)

Outright Trading Transactions

Symbol	Bond Information							Previous				
	Type	Rating	Maturity	Attribute	TTM	Coupon	PE. last Date	PE. last Yield	PE. last Price	PE. last Remark flag	PE. Weight Avg. Yield	PE. Weight Avg. Price
4 Foreign Currency Denominated Bond												
4.1 USD Bond												
4.2 CNY Bond												
4.3 EUR Bond												
4.4 JPY Bond												

กรณีที่ผู้ใช้งานต้องการข้อมูลสรุปของธุรกรรมการซื้อขายของตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ ผู้ใช้งานสามารถเลือกดูข้อมูลในส่วน Daily Trading Movement (FX) โดยสามารถเลือกวันที่ที่ต้องการบริเวณรูปปฏิทิน หรือเลือกดาวน์โหลดข้อมูลในรูปแบบ Excel โดยกดที่ Download Excel

ส่วนบนของตารางแสดงสรุปยอดรวมของธุรกรรมซื้อขายตามวันที่ที่ผู้ใช้งานกำหนด แยกตามประเภท Outright, Financing และ Other ในตารางส่วนล่างจะเพิ่มรายละเอียดของธุรกรรมประเภทต่างๆที่มีการซื้อขายในวันนั้นๆ แบ่งเป็น Cash Trading Transactions, Financial Transactions และ Other Transactions

### ประโยชน์:

ข้อมูลสรุปธุรกรรมซื้อขายของตราสารหนี้สกุลเงินตราต่างประเทศ สามารถใช้เป็นข้อมูลอ้างอิง และใช้ประกอบการวิเคราะห์สถานะหรือแนวโน้มของตลาดตราสารหนี้ได้

## ชื่อหน้า: Bond Price > End of day trading > Spread & Duration

### ภาพประกอบ:

Daily Trading Movement

Symbol	Rating TRIS Fitch (Thai...)	TTM	Last Executed Yield(%)	Weighted Avg. Executed Yield (%)	Spread(bp)	MOD Duration*	MAC Duration	Convexity*
1 Government Debt Securities								
1.1 Treasury Bill								
TB22817A		0.02	0.300000	0.301250	0	0.024656	0.024658	0.001216
TB22831A		0.06	0.520000	0.525000	0	0.062993	0.063014	0.007936
TB22007A		0.33	0.790000	0.791000	0	0.330641	0.331507	0.218647
TB22021A		0.37	0.700000	0.714999	0	0.368908	0.369863	0.272186
TB22N23A		0.29	0.739999	0.739999	0	0.292516	0.293151	0.171131
TB22O12A		0.18	0.620000	0.630000	0	0.177886	0.178082	0.063287
TB23118A		0.45	0.830000	0.832500	0	0.444926	0.446575	0.395919
1.2 Government Bond								
ESGLB35DA		13.37	2.955000	2.927775	0	11.749776	11.923379	154.546296
LB22DA		0.36	0.865000	0.856548	0	0.357359	0.358905	0.305615
LB23DA		1.36	1.300000	1.310537	0	1.332682	1.341344	2.452233
LB246A		1.86	1.580000	1.600608	0	1.833135	1.847617	4.282629
LB249A		2.11	1.642500	1.650520	0	2.073702	2.090732	5.356197
LB240B		2.36	1.725000	1.728750	0	2.303165	2.323030	6.498085
LB256A		2.86	1.830000	1.834146	0	2.797513	2.823110	9.275582
LB25DA		3.35	1.920000	1.931478	0	3.130128	3.160177	11.709523
LB26DA		4.36	2.000000	2.000000	0	4.133508	4.174843	19.613672

### ความหมาย ที่มาของข้อมูล และการคำนวณ:

Spread & Duration แสดงค่า Spread และ Duration ของแต่ละ Symbol ที่มีธุรกรรมซื้อขายในแต่ละวัน โดยแสดงข้อมูลประกอบด้วย

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้แยกตามประเภทของตราสารหนี้
- Rating TRIS/ FITCH: เกรดเครดิต
- TTM: อายุคงเหลือ (ปี)
- Last Executed Yield (%): Yield จากรายการซื้อขายล่าสุดที่ใช้เป็นราคาปิด
- Average Executed Yield (%): ค่าเฉลี่ยของ Executed Yields ของรายการซื้อขายทุกรายการแต่ละ Symbol
- Spread (bp): ค่า Nominal Spread ของSOEและCorporate Bonds คำนวณจาก Duration base
- Mod Duration: ค่า Modified Duration คำนวณจาก Last Executed Yield and Price ดังนี้

$$\text{Modified Duration} = \frac{\text{Macaulay Duration}}{\left(1 + \frac{YTM}{H}\right)}$$

โดยที่  $YTM$  = อัตราผลตอบแทนเมื่อถือจนครบกำหนดอายุ

$H$  = จำนวนงวดการจ่ายคูปองต่อปี

- Mac Duration: ค่า Macaulay Duration คำนวณจาก Last Executed Yield โดยใช้สูตร ดังนี้

$$\text{Macaulay Duration} = \sum_{n=1}^N \left(\frac{PV_n}{P}\right) t_n$$

โดยที่  $PV_n$  = มูลค่าปัจจุบันของกระแสเงินสด ณ งวดที่  $n$

$t_n$  = ระยะเวลา นับจากปัจจุบันจนถึงงวดที่  $n$

$P$  = ราคาของตราสารหนี้



- Convexity: ค่า Convexity คำนวณจาก Last Executed Yield โดยใช้สูตรดังนี้

$$Convexity = \frac{1}{H^2} \times \frac{1}{P} \times \frac{1}{\left(1 + \frac{YTM}{H}\right)^2} \times \sum_{t=1}^n \left[ \frac{CF_t}{\left(1 + \frac{YTM}{H}\right)^t} (t^2 + t) \right]$$

โดยที่  $P$  = ราคาของตราสารหนี้

$CF_t$  = กระแสเงินสด (Cash Flow) ณ เวลา  $t$

$YTM$  = อัตราผลตอบแทนเมื่อถือจนครบกำหนดอายุ

$H$  = จำนวนงวดการจ่ายคูปองต่อปี

ทั้งนี้ ข้อมูลในส่วนนี้สามารถ ดาวน์โหลด เป็นไฟล์ในรูปแบบ Excel ได้ที่มุมขวามือ

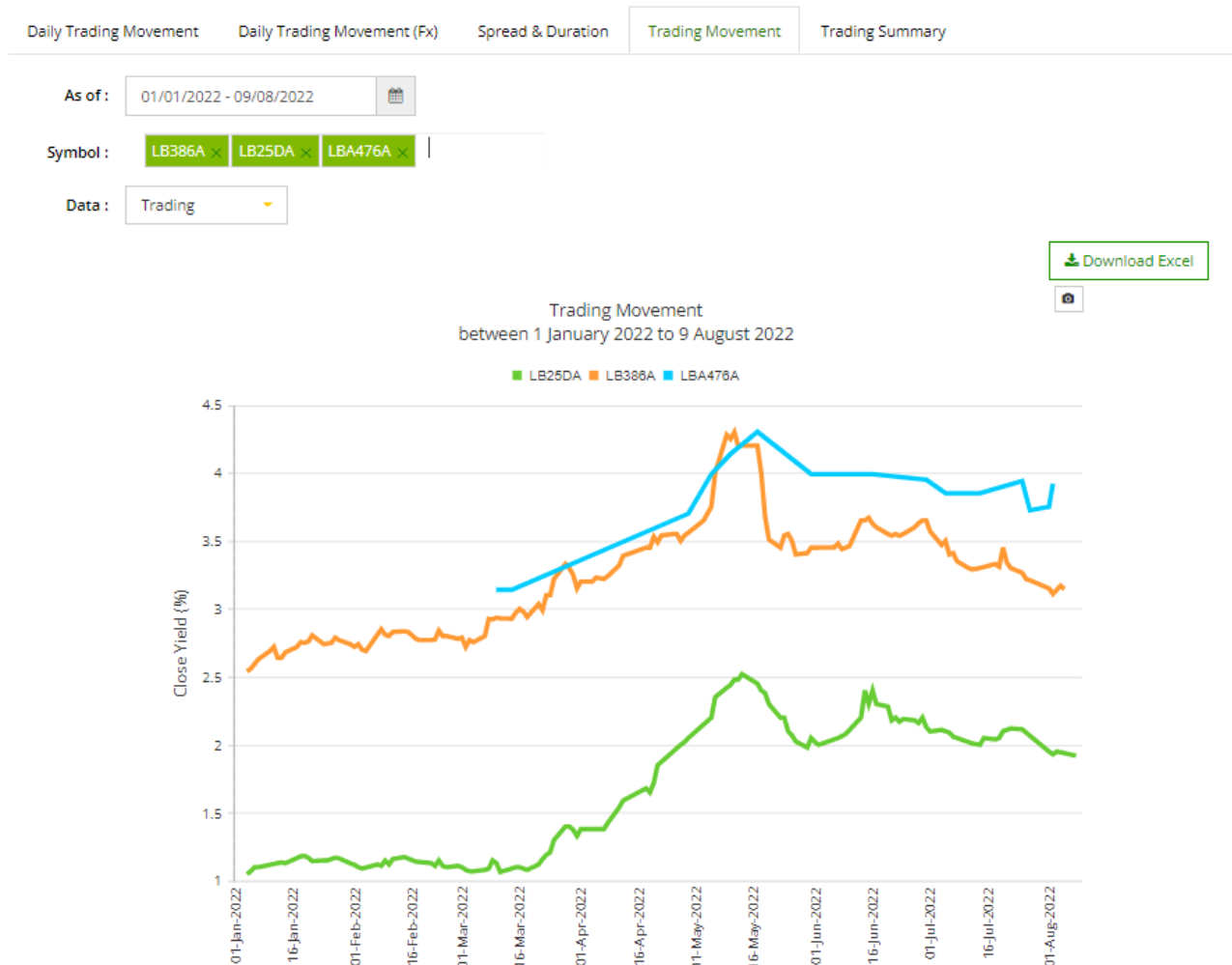
#### ประโยชน์:

ข้อมูล Spread & Duration สามารถใช้เป็นข้อมูลประกอบ ThaiBMA Daily Report และช่วยในการบริหารความเสี่ยง โดยไม่ต้องเสียเวลาคำนวณ

ชื่อหน้า: Bond Price > End of day trading > Trading Movement

### ภาพประกอบ:

#### Daily Trading Movement



ผู้ใช้งานสามารถเลือกดูข้อมูลการเปลี่ยนแปลงของ Yield ในช่วงระยะเวลาที่กำหนดพร้อมกันได้ครั้งละไม่เกิน 5 รุ่น โดยสามารถกำหนดได้ว่าต้องการข้อมูล Yield จาก Trading, Quotation หรือเป็น Spread (Nominal) และสามารถเลือกรูปแบบของ Output ได้ทั้งแสดง Graph หรือเลือกดาวน์โหลดข้อมูลในรูปแบบ Excel โดยกดที่ Download Excel

## ชื่อหน้า: Bond Price > End of day trading > Trading Summary

### ภาพประกอบ:

Daily Trading Movement

Daily Trading Movement (Fx) Spread & Duration Trading Movement Trading Summary

Trading Summary

Time Selection 01/01/2022 - 09/08/2022 Month Selection August 2022

Submit

Trading Summary - From 01-Jan-2022 To 09-Aug-2022

	Total Trading Value (THB Min.)	Outright Trading Value (THB Min.)	Financing Trading Value (THB Min.)	Other Trading Value (THB Min.)
<b>Total Trading Value (THB)</b>	176,515,268,521.527.88			
<b>Outright Trading Value (THB)</b>	8,739,012,105,762.56			
<b>Financing Value (THB)</b>	167,736,270,193,862.03			
<b>Other Value (THB)</b>	39,986,221,902.32			
<b>1 Government Debt Securities</b>				
1.1 Treasury Bill	1,078,511.92	1,055,358.39	22,500.00	653.54
1.2 Government Bond	39,290,242.22	2,316,898.50	36,997,831.92	35,511.80
1.3 State Agency Bond	135,278,521.21	4,640,001.35	130,638,282.85	237.02
1.4 State Own Enterprise Bond	172,413.54	44,840.14	125,893.68	1,679.72
<b>1.5 Government Related Entity</b>				
<b>2 Corporate Bond</b>				
2.1 Long-term Corporate Bond	374,708.54	361,040.64	11,761.75	1,904.15
2.2 Commercial Paper	320,529.37	320,529.37		
3 Foreign Bond	343.72	343.72		

กรณีที่ผู้ใช้งานต้องการข้อมูลสรุปของธุรกรรมการซื้อขาย ผู้ใช้งานสามารถเลือกดูข้อมูลในส่วน Trading Summary โดยสามารถกำหนดช่วงเวลาที่ต้องการหรือเลือกดูข้อมูลเป็นรายเดือน ส่วนบนของตารางแสดงสรุปยอดรวมของธุรกรรมซื้อขายตามช่วงเวลา que ผู้ใช้งานกำหนด แยกตามประเภท Outright, Financing และ Other ในตารางส่วนล่างจะเพิ่มการแบ่งข้อมูลตามประเภทของตราสารหนี้

### ประโยชน์:

ข้อมูลสรุปธุรกรรมซื้อขายสามารถใช้เป็นข้อมูลอ้างอิง และใช้ประกอบการวิเคราะห์สภาวะหรือแนวโน้มของตลาดตราสารหนี้

ชื่อนี้: Bond Price > Stressed Bonds

ภาพประกอบ:

Stressed Bonds

19/05/2022

Download Excel

Symbol	Date	Executed			Weighted Average Executed		
		Price (%)	Yield (%)	Value (THB)	Price (%)	Yield (%)	Value (THB)
CGD213A RS II/HNW	19-May-2022	99.818458	7.858087	1,919,545.91	99.818458	7.858087	1,919,545.91

Remark:

Pricing data displayed on this page is derived from actual reported trading transactions. The data does not represent Mark to Market prices. ThaiBMA accepts no responsibility for any inaccuracy or unsuitability of such price.

Distribution type remark :

Abbr. after Symbol	Name (ENG)	Name (TH)
PO	Public Offering	จัดสรรแก่ประชาชนโดยทั่วไป
II	Private Placement to Institutional Investors	จัดสรรแก่สถาบันการเงิน
IIHNW	Private Placement to Institutional Investors plus high net worth investors	จัดสรรแก่สถาบันการเงินและผู้มีฐานะร่ำรวย
HNW	High Net Worth Investors	จัดสรรแก่ผู้มีฐานะร่ำรวย
PS	Government debt security offering (Check with registrar if there is any transfer limitation)	จัดสรรแก่ประชาชนโดยทั่วไป (โปรดตรวจสอบกับเจ้าพนักงานรับจดทะเบียนหลักทรัพย์)
PI10	Private Placement to not more than 10 investors	จัดสรรแก่ประชาชนไม่เกิน 10 ราย
PRCC	Private Placement to the company's creditor	จัดสรรแก่เจ้าหนี้ของบริษัท
PREX	Private Placement with filing exemption from SEC	จัดสรรโดยไม่แจ้งแก่เจ้าพนักงานรับจดทะเบียน
RO	Right Offering	จัดสรรแก่ผู้ถือหุ้น

Event Sign :

Sign	Name	Explanation(ENG)	Explanation(TH)
RI	Request Information	TheBMA is requesting additional information from the issuer.	TheBMA ขอทราบข้อมูลเพิ่มเติมจาก Issuers
IC	Investor Caution	Investors must be cautious investing. ThaiBMA has guidelines for posting IC signs as follows: Determining the meeting date of bondholders' meeting that requires resolution passed by a majority of not less than 75% in the following matters: (1) Amending the redemption date or Payment due date. (2) Reduction, Cancellation or changing the amount owed, interest or payments due in accordance with the debentures. (3) Changing of currency which must be paid in accordance with the debentures. (4) Repayment of debentures by conversion of bonds to other securities. (5) Changing the rules of the bondholders' meeting regarding the quorum and the resolution of the meeting.	นักลงทุนต้องระมัดระวังการลงทุน ThaiBMA มีแนวทางที่แนะนำให้แสดง IC ดังนี้ นักลงทุนต้องระมัดระวังการลงทุน ThaiBMA มีแนวทางที่แนะนำให้แสดง IC ดังนี้ (1) การแก้ไขวันครบกำหนดชำระหนี้ หรือกำหนดชำระหนี้ (2) ลดหนี้ ยกเลิก หรือเปลี่ยนแปลงจำนวนเงินที่ชำระ ดอกเบี้ย หรือเงินต้นที่ค้างชำระหนี้ (3) การเปลี่ยนสกุลเงินชำระหนี้ (4) การชำระหนี้ด้วยการแปลงสภาพพันธบัตรเป็นหลักทรัพย์อื่น (5) การแก้ไขกฎเกณฑ์การประชุมผู้ถือหุ้น (การประชุมผู้ถือหุ้น)
RS	Restructure	The debt securities have been approved by the resolution of bondholders' meeting for debt restructuring or changing redemption date or extension redemption period of debt.	เจ้าหนี้หลักทรัพย์ได้ผ่านการอนุมัติจากผู้ถือหุ้นแล้ว สำหรับการปรับโครงสร้างหนี้ / แก้ไขวันครบกำหนดชำระหนี้ / ขยายระยะเวลาชำระหนี้ (Rebate)
DP	Default Payment	1. Debt securities do not pay principal payment or interest that including in case of an issuer company is unable to pay the principal or interest as a result of an automatic stay. Due to being in a condition of automatic stay. 2. TheBMA receive notifications from Issuers or Bond holders' Representatives which contents of the notifications are regarded to default of bonds caused by Cross Default (Event of Default).	1. ไม่สามารถชำระคืนเงินต้น หรือดอกเบี้ย ซึ่งรวมถึงกรณีเจ้าหนี้หลักทรัพย์ได้ผ่านการอนุมัติจากผู้ถือหุ้นแล้ว (Automatic stay) 2. ไทยบีเอ็มเอได้รับแจ้งจากผู้ถือหุ้นหรือตัวแทนเจ้าหนี้หลักทรัพย์เกี่ยวกับเหตุการณ์ที่ถือว่าเป็นการผิดนัดชำระหนี้โดยข้ามสัญญา (Cross Default (Event of Default))

Disclaimer :

The Bond Market Association ("ThaiBMA") publishes all signs and data appeared on this part of ThaiBMA's websites which are for general information purposes only. ThaiBMA does not intend to address the specific circumstances of any particular individual or entity as well as facilitates the users to access or use of the signs and information displayed on ThaiBMA's websites ("Users"). By accessing or using the signs and data, Users have read, understood, accepted and fully consented to this disclaimer as follows:  
 1. ThaiBMA uses reasonable efforts to publish the signs which referred to important events related to debt securities only. ThaiBMA makes no warranty, expressed or implied, representation or guarantee as to the content, sequence, currency, accuracy, timeliness, completeness or merchantability of the signs and data provided or the fitness for a particular purpose.  
 2. The signs and data appearing on this part of ThaiBMA's websites do not constitute, and shall not be construed as, any form of specific advice or recommendation, and shall not be relied upon in lieu of appropriate professional advice, whether legal, financial, tax, accounting or any other respect. The Users are recommended to exercise their own skill and judgment when considering investment decisions or taking action based on the signs or data provided and seek appropriate professional advice before making any specific or other decisions.  
 3. ThaiBMA accepts no liability for any action taken or decision made by Users through reliance upon such signs and/or data.

หมายเหตุเพิ่มเติม :

สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) เผยแพร่ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่ปรากฏบนเว็บไซต์ ThaiBMA ซึ่งข้อมูลดังกล่าวมีไว้เพื่อวัตถุประสงค์ในการให้ข้อมูลเท่านั้น และไม่ได้มีเจตนาที่จะให้คำแนะนำหรือการรับประกันใดๆ แก่ผู้ใช้งานหรือผู้อ่านข้อมูลบนเว็บไซต์ ThaiBMA (ผู้ใช้งาน) ในการเข้าถึงหรือใช้ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่ปรากฏบนเว็บไซต์ ThaiBMA โดยที่ผู้ใช้งานหรือผู้อ่านข้อมูลดังกล่าวจะต้องใช้ดุลยพินิจของตนเองในการตัดสินใจลงทุนหรือดำเนินการใดๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายตราสารหนี้ที่ปรากฏบนเว็บไซต์ ThaiBMA โดยที่ ThaiBMA ไม่สามารถรับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการใช้ข้อมูลดังกล่าวได้  
 1. สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ใช้ความพยายามอย่างเหมาะสมในการเผยแพร่ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่เกี่ยวข้องกับเหตุการณ์สำคัญเกี่ยวกับตราสารหนี้เท่านั้น ThaiBMA ไม่สามารถรับประกันหรือการรับประกันใดๆ แก่ผู้ใช้งานหรือผู้อ่านข้อมูลบนเว็บไซต์ ThaiBMA (ผู้ใช้งาน) ในการเข้าถึงหรือใช้ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่ปรากฏบนเว็บไซต์ ThaiBMA โดยที่ผู้ใช้งานหรือผู้อ่านข้อมูลดังกล่าวจะต้องใช้ดุลยพินิจของตนเองในการตัดสินใจลงทุนหรือดำเนินการใดๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายตราสารหนี้ที่ปรากฏบนเว็บไซต์ ThaiBMA โดยที่ ThaiBMA ไม่สามารถรับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการใช้ข้อมูลดังกล่าวได้  
 2. ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่ปรากฏบนเว็บไซต์ ThaiBMA ไม่สามารถถือเป็นคำแนะนำหรือการรับประกันใดๆ และข้อมูลดังกล่าวอาจไม่ใช่ข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้ที่ปรากฏบนเว็บไซต์ ThaiBMA โดยที่ ThaiBMA ไม่สามารถรับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการใช้ข้อมูลดังกล่าวได้  
 3. สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) รับผิดชอบต่อการเผยแพร่ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่ปรากฏบนเว็บไซต์ ThaiBMA โดยที่ ThaiBMA ไม่สามารถรับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการใช้ข้อมูลดังกล่าวได้

แสดงข้อมูลการซื้อขายของตราสารหนี้ที่มีเครื่องหมายที่เป็นเหตุการณ์สำคัญเกี่ยวกับตราสารหนี้ตัวนั้นๆ ได้แก่ Default Payment (DP) และ Restructure (RS) ผู้ใช้สามารถศึกษาคำอธิบายเครื่องหมายได้จากตาราง Event Sign โดยจะแสดงข้อมูลวันที่มีการซื้อขายตราสารหนี้ดังกล่าวเท่านั้น

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้และเครื่องหมายที่เกี่ยวข้อง
- Date: วันที่ทำการซื้อขาย
- Executed: รายการซื้อขายสุดท้ายของวัน
- Price (%): ราคาซื้อขายหน่วยเป็นร้อยละของราคา Par
- Yield (%): อัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ที่ซื้อขายเมื่อถือจนครบอายุ
- Value (THB): มูลค่าการซื้อขาย (บาท)
- Weighted Average Executed: รายการซื้อขายเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักโดยมูลค่าการซื้อขาย
- Price (%): ราคาเฉลี่ยของทุกรายการซื้อขาย
- Yield (%): อัตราผลตอบแทนเฉลี่ยของตราสารหนี้ทุกรายการซื้อขาย
- Value (THB): มูลค่าการซื้อขายรวมทุกรายการ (บาท)

ชื่อหน้า: Bond Price > Intraday Trading > Basic view mode

ภาพประกอบ:

### Intraday Trading

09/08/2022

Flag: L - Previous Date Trading , BL - Big Lot , [E] - Edited , [D] - Deleted

Intraday Trading as of 09 August 2022

[Download Excel](#)

Symbol	Flag	Yield	DM	Report Time	Trade Date
LB26DA		1.970000		13:59:05	09-Aug-2022
LB26DA		1.970000		13:58:04	09-Aug-2022
LB24DB		1.710000		13:56:56	09-Aug-2022
LB316A		2.420000		13:55:47	09-Aug-2022
CB22O17A		0.650000		13:51:06	09-Aug-2022
CB22O17A		0.650000		13:50:07	09-Aug-2022
CB22O17A		0.650000		13:50:06	09-Aug-2022
LB29DA		2.340000		13:49:38	09-Aug-2022
CB22D08A		0.760000		13:42:46	09-Aug-2022
CB22N10A		0.680000		13:41:53	09-Aug-2022

Remark:

1. For Inflation-Linked Bond, Coupon (%) is Real Coupon (%) and all the Yields (%) shown are Real YTM (%). The Prices of Inflation Linked Bond are shown as Unadjusted Prices, while all the Trading Value (THB) figures are in Adjusted terms.

2. BL stands for 'Big Lot' which is transaction in <5Y LB with trading volume of 500 MB up or >=5Y LB with trading volume of 300 MB up. (at par value) BL transactions will be displayed at 12.00 pm and 16.00 p.m.

3. [D] is displayed on transactions which are edited or deleted.

แสดงรายการซื้อขายระหว่างวัน ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ ตราสารหนี้ที่ทำการซื้อขาย (Symbol), อัตราผลตอบแทนที่ซื้อขาย (Yield), เวลาที่รายงานการซื้อขายมายัง ThaiBMA (Report Time) และเวลาที่เกิดรายการซื้อขายจริง (Trade Date)

ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

นำมาจากรายการซื้อขายที่ Dealer รายงานมายัง ThaiBMA โดยจัดแสดงเป็น 2 แบบ คือ

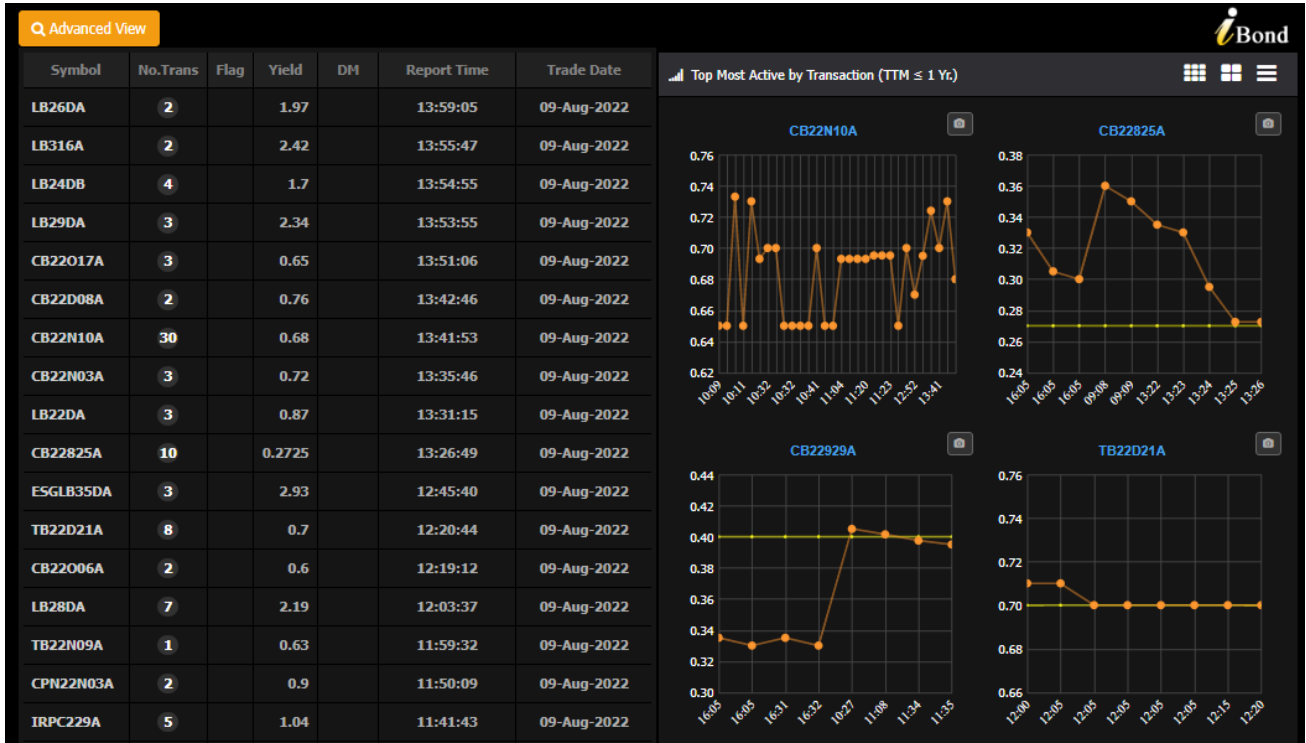
- Non-Corporate Bond: จะแสดงภายใน 15 นาทีหลังได้รับรายงาน
- Corporate Bond: จะแสดง 2 รอบ คือ 12:00 น. และ 16:00 น.

ประโยชน์:

เพื่อติดตามภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ระหว่างวันรวมถึงการเคลื่อนไหวของ Yield ที่ซื้อขาย

ชื่อหน้า: Bond Price > Intraday Trading > Advanced view mode

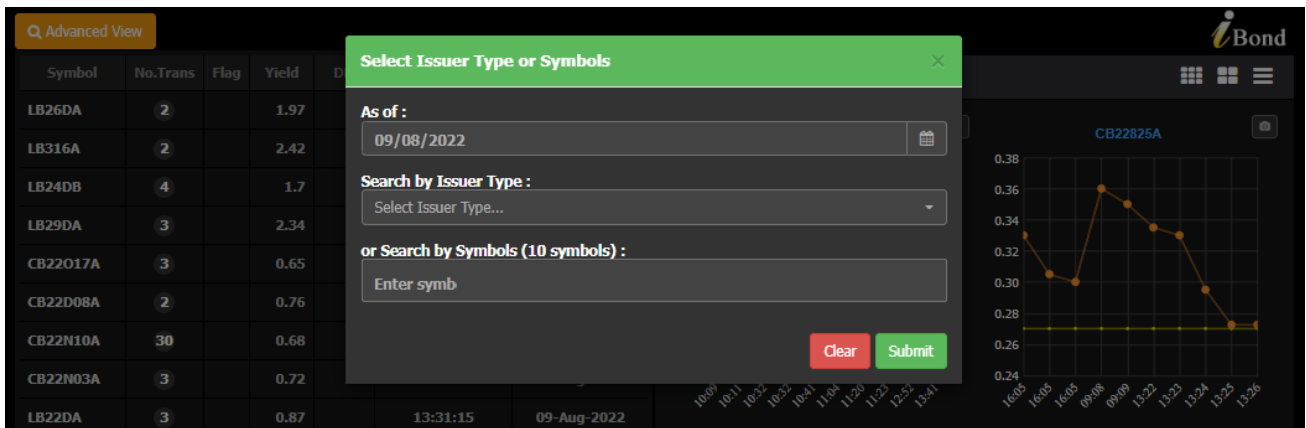
ภาพประกอบ:



แสดงรายการซื้อขายระหว่างวัน ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ ตราสารหนี้ที่ทำการซื้อขาย (Symbol), อัตราผลตอบแทนที่ซื้อขาย (Yield), เวลาที่รายงานการซื้อขายมายัง ThaiBMA (Report Time) และ เวลาที่เกิดรายการซื้อขายจริง (Trade Date) เช่นเดียวกับกับ Basic view mode แต่ด้านข้างมี Scatter Plot ตามรายรุ่นตราสารที่มีการซื้อขายมากที่สุด 5 ลำดับแรก

ผู้ใช้งานสามารถเรียกโชว์กราฟ เพื่อแสดงความเคลื่อนไหวของตราสารหนี้ตัวใดตัวหนึ่งที่สนใจเป็นพิเศษได้ โดยเริ่มต้นการแสดงผลรายการซื้อขายจะถูกตั้งค่าไว้ที่ทุกรายการ ผู้ใช้งานสามารถปรับการแสดงผลข้อมูลเพิ่มเติมโดยการกดปุ่ม Advanced View ด้านซ้ายบน ผู้ใช้สามารถเลือกดูข้อมูลได้ 2 วิธี คือ

ภาพประกอบ:

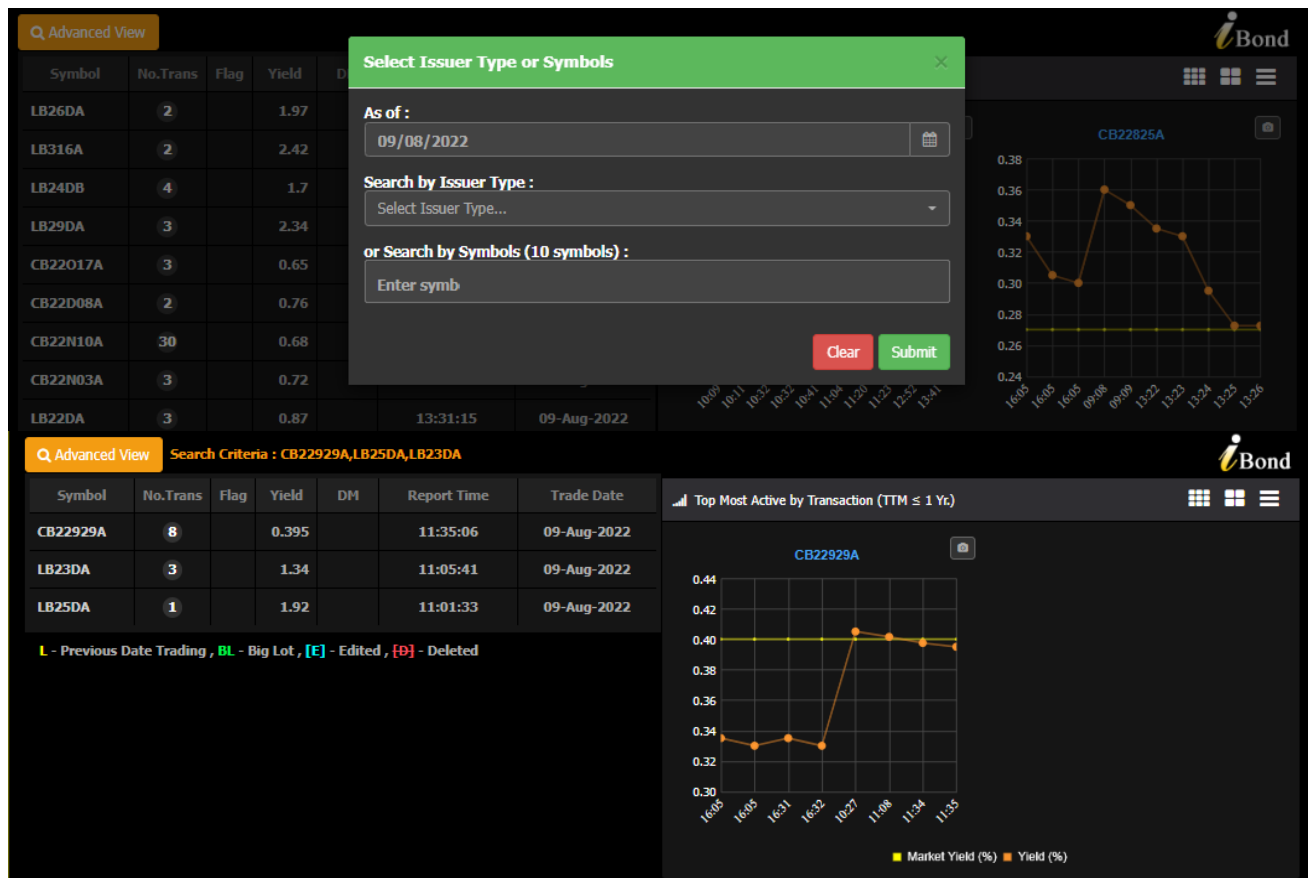


1. การเลือกดูข้อมูล Intraday ตามประเภทของตราสารหนี้ (Search by Issuer Type)

กดปุ่ม Search by Issuer Type ให้เลือกประเภทของตราสารหนี้ที่ต้องการค้นหา แล้วกด Submit หลังจากนั้นข้อมูลจะแสดงผล เฉพาะข้อมูลของกลุ่มตราสารที่ต้องการดูข้อมูล โดยสามารถเลือกดูข้อมูลเฉพาะกลุ่มตราสารหนี้ ดังนี้

- Government Debt Securities
  - Treasury Bill
  - Government Bond
  - State Agency Bond
  - State Own Enterprise Bond
  - Government Promissory Note
- Corporate Bond
  - Long-term Corporate Bond
  - Commercial Paper
- Foreign Bond
- Foreign Currency Dedominated Bond
  - USD Bond
  - CNY Bond

**ภาพประกอบ:**



**2. การเลือกดูข้อมูล Intraday เฉพาะข้อมูลตราสารหนี้ที่ตนเองสนใจ (Search by Symbols)**

ให้พิมพ์ Symbol ที่ต้องการค้นหาในช่อง Search by Symbols จากนั้นให้กด Submit การค้นหาข้อมูลตาม Symbol สามารถค้นหาข้อมูลได้สูงสุดที่ 10 Symbols

## ภาพประกอบ:



นอกจากนี้ภายในหน้านี้ยังสามารถปรับรูปแบบการแสดงผลของกราฟ ได้ 3 รูปแบบ คือ แสดงผล 1, 2 และ 3 กราฟ โดยผู้ใช้งานสามารถกดสัญลักษณ์บริเวณมุมบนด้านขวาของ Widget Top Most Active By Transaction



ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > Treasury Bills

### ภาพประกอบ:

**Bond Quotation**

Treasury Bills   Government Bonds   State Owned Enterprise Bonds   State Agency Bonds   Corporate Bonds   Foreign Bonds

Download Historical : 2022   **Go**

08/08/2022

Treasury Bills as of 08 August 2022   [Download Excel](#)

Treasury Bill	Simple Yield * (%)	
	Bid	Offer
T-BILL1M (28) days	0.512701	0.440024
T-BILL3M (91) days	0.654027	0.592611
T-BILL6M (182) days	0.858357	0.789689
T-BILL1Y (364) days	1.117136	1.055807

**Remark:**

1. The yield is based upon average bid and offer yields quoted by primary dealers.
2. The cut-off time for daily quotation of bonds is 16:00.

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อ (Bid) เสนอขาย (Offer) เฉลี่ยของตราสารหนี้ประเภทตั๋วเงินคลัง (Treasury Bills) โดยแบ่งเป็นกลุ่มช่วงอายุ ได้แก่ 1 เดือน, 3 เดือน, 6 เดือน และ 1 ปี

### ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid/Offer ที่ Dealer ที่ได้รับการแต่งตั้งจากกระทรวงการคลัง Quote มายัง ThaiBMA ทุกสิ้นวัน (16:00 น.)

### ประโยชน์:

เพื่อติดตามภาวะอัตราผลตอบแทนการเสนอซื้อเสนอขายของตราสารหนี้ระยะสั้นอายุคงเหลือไม่เกิน 1 ปี และใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับกำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสาร หรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน, ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > Government Bonds

### ภาพประกอบ:

#### Bond Quotation

Treasury Bills	Government Bonds	State Owned Enterprise Bonds	State Agency Bonds	Corporate Bonds	Foreign Bonds
08/08/2022					
<a href="#">Download Excel</a>					
Bond	Coupon (%)	Maturity	TTM (Yrs.)	Quoted Date	Quoted Yield (%)
ESGLB35DA	1.585000	17-Dec-2035	13.37	08-Aug-2022	2.965802
ILB283A	1.250000	12-Mar-2028	5.60	08-Aug-2022	0.800000
LB23DA	2.400000	17-Dec-2023	1.36	08-Aug-2022	1.381571
LB246A	0.750000	17-Jun-2024	1.86	08-Aug-2022	1.631440
LB249A	0.750000	17-Sep-2024	2.11	08-Aug-2022	1.665000
LB24DB	1.450000	17-Dec-2024	2.36	08-Aug-2022	1.776667
LB256A	0.950000	17-Jun-2025	2.86	08-Aug-2022	1.849506
LB25DA	3.850000	12-Dec-2025	3.35	08-Aug-2022	1.934568
LB26DA	2.125000	17-Dec-2026	4.36	08-Aug-2022	1.992507
LB276A	1.000000	17-Jun-2027	4.86	08-Aug-2022	2.056451
LB286A	2.650000	17-Jun-2028	5.86	08-Aug-2022	2.055720

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของพันธบัตรรัฐบาลประเภท Loan Bond (LB) โดยแสดงเป็นรายตราสาร ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ (Bond), อัตราผลตอบแทนหน้าตัว (Coupon), วันครบกำหนดอายุ (Maturity), อายุคงเหลือ (TTM - Time to Maturity), วันที่ทำการเสนอซื้อ (Quoted Date) และ Quoted Yield (Average Bid)

### ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid ที่ Dealer ที่ได้รับการแต่งตั้งจากกระทรวงการคลัง Quote มายัง ThaiBMA ทุกสิ้นวัน (16:00 น.)

### ประโยชน์:

เพื่อติดตามภาวะอัตราผลตอบแทนการเสนอซื้อของตราสารหนี้ภาครัฐทุกช่วงอายุและเป็น Yield ที่นำไปใช้ในการทำ Government Bond Yield Curve และใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับกำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสาร หรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน, ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

## ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > State Owned Enterprise Bonds

### ภาพประกอบ:

#### Bond Quotation

Treasury Bills	Government Bonds	State Owned Enterprise Bonds	State Agency Bonds	Corporate Bonds	Foreign Bonds
08/08/2022					
<a href="#">Download Excel</a>					
Bond	Coupon (%)	Maturity	TTM (Yrs.)	Quoted Date	Quoted Yield (%)
BAAC238A	4.130000	01-Aug-2023	0.98	08-Aug-2022	1.302757
BAAC238B	4.490000	30-Aug-2023	1.06	08-Aug-2022	1.360508
EXAT229A	1.830000	27-Sep-2022	0.13	08-Aug-2022	0.710360
EXAT233A	3.830000	21-Mar-2023	0.61	08-Aug-2022	1.091637
NHA228A	1.920000	28-Aug-2022	0.05	08-Aug-2022	0.663258
NHA235A	2.110000	30-May-2023	0.81	08-Aug-2022	1.202753
NHA238A	2.520000	20-Aug-2023	1.03	08-Aug-2022	1.339501
NHA243A	2.270000	28-Mar-2024	1.64	08-Aug-2022	1.743312
NHA259A	1.020000	23-Sep-2025	3.13	08-Aug-2022	2.178737
NHA268A	1.835000	13-Aug-2026	4.01	08-Aug-2022	2.310976

#### Remark:

- The yield is based upon average bid yields quoted by primary dealers on the 7<sup>th</sup>, 15<sup>th</sup>, 22<sup>nd</sup> and the last day the month. If the quotation date is non-business day, the quotation day is postponed to the next business day, except the last day of the month, the quotation day is the previous business day.
- The cut-off time for daily quotation of bonds is 16:00.

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ (SOE) โดยแสดงเป็นรายตราสาร ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ (Bond), อัตราผลตอบแทนหน้าตัว (Coupon), วันครบกำหนดอายุ (Maturity), อายุคงเหลือ (TTM - Time to Maturity), วันที่ทำการเสนอซื้อ (Quoted Date) และ Quoted Yield (Average Bid)

### ที่มาของข้อมูล:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid ที่ Dealer ที่ได้รับการแต่งตั้งจากธนาคารแห่งประเทศไทย Quote มายัง ThaiBMA ทุกๆ 7 วัน คือ ทุกวันที่ 7, 15, 22 และวันทำการสุดท้ายของเดือน โดยถ้าวันที่ 7, 15 หรือ 22 ตรงกับวันหยุดทำการ จะเลื่อนเป็นวันทำการถัดไป

### หลักการคำนวณ:

การคำนวณจะนำค่า Yield ที่ Quote เข้ามาตั้งแต่ 3 รายขึ้นไปมาหาค่า Standard Deviation (SD) หากค่าของ Yield รายใดไม่อยู่ในช่วง +/- 1 SD จะถูกตัดออก ส่วน Yield ที่เหลือจะนำมาหาค่าเฉลี่ยเพื่อแสดงเป็น Quoted Yield

### ประโยชน์:

เพื่อใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับกำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสารหรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > State Agency Bonds

### ภาพประกอบ:

**Bond Quotation**

Treasury Bills   Government Bonds   State Owned Enterprise Bonds   **State Agency Bonds**   Corporate Bonds   Foreign Bonds

Download Historical : 2022

08/08/2022

State Agency Bonds as of 08 August 2022

Symbol	Average Bidding Yield (%)*	Maturity	TTM (Yrs.)
BOT229A	0.730467	16-Sep-2022	0.11
BOT233A	1.088124	23-Mar-2023	0.62
BOT245A	1.667956	17-May-2024	1.78

**Remark:**

1. The yield is averaged from yields quoted by active dealers.
2. The cut-off time for daily quotation of bonds is 16:00.

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของตราสารหนี้ที่ออกโดยองค์กรภาครัฐ (State Agency Bonds) ได้แก่ พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย โดยแสดงเป็นรายตราสารที่มีวันที่กำหนด ข้อมูลที่แสดงได้แก่ สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ (Symbol), อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bidding Yield), วันครบกำหนดอายุ (Maturity) และ อายุคงเหลือ (TTM - Time to Maturity)

### ที่มาของข้อมูลและหลักการคำนวณ:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid ที่ Dealer ที่ได้รับการแต่งตั้งจากกระทรวงการคลัง Quote มายัง ThaiBMA ทุกสิ้นวัน (16:00 น.)

### ประโยชน์:

เพื่อติดตามภาวะอัตราผลตอบแทนการเสนอซื้อของตราสารหนี้ที่ออกโดยองค์กรภาครัฐ และใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับ กำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสาร หรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน, ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

## ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > Corporate Bonds

### ภาพประกอบ:

#### Bond Quotation

Treasury Bills	Government Bonds	State Owned Enterprise Bonds	State Agency Bonds	Corporate Bonds	Foreign Bonds
25/08/2017					
<a href="#">Download Excel</a>					
Bond	Coupon (%)	Maturity	TTM (Yrs.)	Quoted Date	Quoted Yield (%)
SPI246A	0.700000	29-Jun-2024	6.85	25-Aug-2017	-3.220000
1 20 items per page 1 - 1 of 1 items					

#### Remark:

- The yield is averaged from yields quoted by active dealers.
- The cut-off time for daily quotation of bonds is 16:00.

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของหุ้นกู้เอกชนโดยแสดงเป็นรายตราสาร ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ (Bond), อัตราผลตอบแทนหน้าตัว (Coupon), วันครบกำหนดอายุ (Maturity), อายุคงเหลือ (TTM - Time to Maturity), วันที่ทำการเสนอซื้อ (Quoted Date) และ Quoted Yield (Average Bid)

#### ที่มาของข้อมูลและหลักการคำนวณ:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid ที่ Dealer Quote มายัง ThaiBMA ทุกๆ 15 วัน คือ ทุกวันที่ 15 และวันทำการสุดท้ายของเดือน โดยถ้าวันที่ 15 ตรงกับวันหยุดทำการ จะเลื่อนเป็นวันทำการถัดไป

การคำนวณจะนำค่า Yield ที่ Quote เข้ามาตั้งแต่ 3 รายขึ้นไปมาหาค่า Standard Deviation (SD) หากค่าของ Yield รายใดไม่อยู่ในช่วง +/- 1 SD จะถูกตัดออก ส่วน Yield ที่เหลือจะนำมาหาค่าเฉลี่ยเพื่อแสดงเป็น Quoted Yield

#### ประโยชน์:

เพื่อใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับกำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสารหรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน, ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

ชื่อหน้า: Bond Price > Quotation > Foreign Bonds

### ภาพประกอบ:

**Bond Quotation**

Treasury Bills   Government Bonds   State Owned Enterprise Bonds   State Agency Bonds   Corporate Bonds   **Foreign Bonds**

31/05/2011

**Foreign Bonds as of 31 May 2011** [Download Excel](#)

Bond	Coupon (%)	Maturity	TTM (Yrs.)	Quoted Date	Quoted Yield (%)
SEK126A	2.825000	26-Jun-2012	1.07	31-May-2011	

1 20 items per page 1 - 1 of 1 items

#### Remark:

1. The yield is averaged from yields quoted by active dealers.
2. The cut-off time for daily quotation of bonds is 16:00.

แสดงอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Average Bid) ของพันธบัตรต่างประเทศโดยแสดงเป็นรายตราสาร ข้อมูลที่แสดง ได้แก่ สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ (Bond), อัตราผลตอบแทนหน้าตัว (Coupon), วันครบกำหนดอายุ (Maturity), อายุคงเหลือ (TTM - Time to Maturity), วันที่ทำการเสนอซื้อ (Quoted Date) และ Quoted Yield (Average Bid)

### ที่มาของข้อมูลและหลักการคำนวณ:

นำมาจากค่าเฉลี่ยข้อมูล Bid ที่ Dealer Quote มายัง ThaiBMA ทุกๆ 15 วัน คือ ทุกวันที่ 15 และวันทำการสุดท้ายของเดือน โดยถ้าวันที่ 15 ตรงกับวันหยุดทำการ จะเลื่อนเป็นวันทำการถัดไป

การคำนวณจะนำค่า Yield ที่ Quote เข้ามาตั้งแต่ 3 รายขึ้นไปมาหาค่า Standard Deviation (SD) หากค่าของ Yield รายใดไม่อยู่ในช่วง +/- 1 SD จะถูกตัดออก ส่วน Yield ที่เหลือจะนำมาหาค่าเฉลี่ยเพื่อแสดงเป็น Quoted Yield

### ประโยชน์:

เพื่อใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงสำหรับกำหนดราคาตราสารหนี้ โดยสามารถนำข้อมูลไปใช้อ้างอิงในการกำหนดราคาซื้อขายตราสารหรือคิดมูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ สำหรับกลุ่มกองทุน, ประกัน หรือพอร์ตการลงทุนอื่นๆ ได้

**ชื่อหน้า:** Bond Price > RP Reference Yield

**ภาพประกอบ:**

RP Reference Yield (T+1)

08/08/2022

Government Bonds | Treasury Bills | State Agency Bonds | SOE(G) | SOE(NG) | Foreign Bonds | Show All

Download All | Download Excel

Symbol	Settlement Date	Avg. Bidding Yield (%)	Clean Price (%)	Accrued Interest (%)	Gross Price (%)	Modified Duration	Convexity	Index Ratio
ESGLB35DA	09-Aug-2022	2.965802	84.860229	0.230151	85.090380	11.745295	154.445829	
ILB283A	09-Aug-2022	0.800000	102.451311	0.513699	102.965010	5.374127	32.272873	1.11771
LB22NA	09-Aug-2022	0.656810	101.089141	1.305822	102.394963	0.248499	0.185595	
LB22DA	09-Aug-2022	0.748829	100.441076	0.290411	100.731487	0.354836	0.302665	
LB233A	09-Aug-2022	0.907186	102.699708	2.245205	104.944913	0.580168	0.631686	
LB236A	09-Aug-2022	1.037355	102.187020	0.536301	102.723321	0.840276	1.128308	
LB23DA	09-Aug-2022	1.381571	101.359505	0.348493	101.707998	1.329410	2.441627	
LB244A	09-Aug-2022	1.552950	104.823448	1.504110	106.327558	1.591769	3.392072	
LB246A	09-Aug-2022	1.631440	98.393527	0.108904	98.502431	1.829943	4.269124	
LB249A	09-Aug-2022	1.665000	98.110015	0.297945	98.407960	2.070747	5.342375	

10 items per page 1 - 10 of 82 items

**Remark:**

1. Traded yield is based on 30/360 basis (on coupon payment) which might be different from yield calculated on actual payment. click here to learn more.
2. This page is designed to provide REFERENCE YIELD of State Owned Enterprise Bonds with MOF guarantee, which came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.
3. The Government interpolated yield is calculated from the interpolation method on the ThaiBMA Government Bond Yield Curve with the same maturity. However, the SOE Bonds with short-ended and long-ended issues (under and over the curve) are not included in this page.
4. T-Bill Reference Yield is calculated from Simple yields of Government Loan bond, 1-m Treasury bill, and 3-m Treasury bill with comparative term by interpolation method. Simple yield of LB is converted from average bidding yield to maturity.
5. The above prices are calculated based upon the provided reference yields on the settlement date, today plus one official day (T+1).
6. Duration and Convexity of Floating Rate Note Issues are Effective Duration and Effective Convexity.
7. For Inflation-Linked Bond, Avg. Bid Yield shown is Avg. Bid Real YTM and the Clean price (%), Accrued Interest (%), and Gross Price (%) are all in Unadjusted terms. The corresponding Adjusted terms can be obtained by multiplying the Unadjusted price or accrued interest by the Index Ratio shown in the last column. The modified duration and convexity are calculated based on Avg. Bid Real YTM.
8. Avg. bidding yield of LB22DA, LB22NA, LB233A, LB236A, LB244A, LB246A, LB267A, LB27DA, LB283A, LB296A, LB356A, LB383A, LB396A, LB406A, LB416A, LB716A are synthetic yield derived from ThaiBMA pricing model.
9. Bonds in State Owned Enterprise Bonds with non-MOF guarantee, SOE(NG), in RP Reference Yield pages are only rating AAA and Reference Yield of SOE(NG) came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.

อัตราผลตอบแทนและมูลค่าของตราสารหนี้ในหน้านี้แยกตามประเภทของตราสารหนี้เพื่อความสะดวกในการเรียกใช้ แต่ถ้าหากผู้ต้องการดูมูลค่าของตราสารหนี้ทั้งหมดก็สามารถทำได้โดยเลือกที่ Tab Show All

**ความหมาย:**

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้
- Settlement Date: วันชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้
- Avg. Bidding Yield (%): อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย หน่วยเป็นร้อยละ
- Clean Price (%): ราคาไม่รวมดอกเบี้ยค้างรับ หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋ว
- Accrued Interest (%): ดอกเบี้ยค้างรับ หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋ว
- Gross Price (%): ราคารวมดอกเบี้ยค้างรับ หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋ว
- Modified Duration: สำหรับตราสารหนี้ที่จ่ายคูปองแบบลอยตัว หน่วยเป็นปี
- Convexity: Convexity หน่วยเป็นปี<sup>2</sup>
- Index Ratio: ค่าที่ใช้ปรับเงินต้นและดอกเบี้ยเพื่อให้ชดเชยกับอัตราเงินเฟ้อ

**ที่มาของมูลค่าและหลักการคำนวณ:**

อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรุ่นต่าง ๆ ในหน้า RP Reference Yield ได้มาจากค่าเฉลี่ยของราคาเสนอซื้อที่ทางผู้ค้าหลัก (Primary Dealer) ส่งมาให้ ThaiBMA

โดยปกติผู้ค้าหลักตราสารหนี้จะส่งราคาเสนอซื้อมาให้กับทาง ThaiBMA ทุกวัน สำหรับพันธบัตรรัฐบาล ตัวเงินคลังและพันธบัตรหน่วยงานของภาครัฐ (State Agency) และสำหรับพันธบัตรรัฐวิสาหกิจที่ค้าประกันโดยกระทรวงการคลังจะมีการเสนอราคา มาทุก 7 วัน

ราคาของตราสารหนี้ ดอกเบี้ยค้ำรับ Modified Duration และ Convexity ที่แสดงในหน้านี้ ได้มาจากการคำนวณด้วยหลักการเดียวกันกับหน้า Calculation โดยใช้อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย (Avg. Bidding Yield) และกำหนดให้วันส่งมอบและชำระราคา (Settlement Date) เป็น 1 วันทำการหลังจากวันปัจจุบัน (T +1 วันทำการ)

**ประโยชน์:**

อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรุ่นต่างๆ ในหน้า RP Reference Yield ใช้เป็นอัตราผลตอบแทนอ้างอิงในการทำธุรกรรมซื้อคืนพันธบัตร (Repo)



## ชื่อหน้า: Bond Price > RP Reference Yield > RP Reference Yield (T+2)

### ภาพประกอบ:

RP Reference Yield (T+2)

08/08/2022

Government Bonds
Treasury Bills
State Agency Bonds
SOE(G)
SOE(NG)
Foreign Bonds
Show All

RP Reference Yield (T+2): Government Bonds as of 8 August 2022 16:18:09 
[Download All](#)
[Download Excel](#)

Symbol	Settlement Date	Avg. Bidding Yield (%)	Clean Price (%)	Accrued Interest (%)	Gross Price (%)	Modified Duration	Convexity	Index Ratio
ESGLB35DA	10-Aug-2022	2.965802	84.862750	0.234493	85.097243	11.742596	154.381089	
LB283A	10-Aug-2022	0.800000	102.450139	0.517123	102.967262	5.371398	32.242192	1.11803
LB22NA	10-Aug-2022	0.656810	101.076940	1.319863	102.396803	0.245768	0.182884	
LB22DA	10-Aug-2022	0.748829	100.437660	0.295890	100.733550	0.352106	0.299375	
LB233A	10-Aug-2022	0.907186	102.687241	2.260274	104.947515	0.577441	0.627171	
LB236A	10-Aug-2022	1.037355	102.180000	0.546233	102.726233	0.837551	1.122379	
LB23DA	10-Aug-2022	1.381571	101.356766	0.355068	101.711834	1.326689	2.433049	
LB244A	10-Aug-2022	1.552950	104.815626	1.516438	106.332064	1.589050	3.382076	
LB246A	10-Aug-2022	1.631440	98.395857	0.110959	98.506816	1.827226	4.257838	
LB249A	10-Aug-2022	1.665000	98.112431	0.300000	98.412431	2.068030	5.329782	

10 items per page
1 - 10 of 82 items

#### Remark:

- Traded yield is based on 30/360 basis (on coupon payment) which might be different from yield calculated on actual payment. click here to learn more.
- This page is designed to provide REFERENCE YIELD of State Owned Enterprise Bonds with MOF guarantee, which came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.
- The Government Interpolated yield is calculated from the interpolation method on the ThaiBMA Government Bond Yield Curve with the same maturity. However, the SOE Bonds with short-ended and long-ended issues (under and over the curve) are not included in this page.
- T-Bill Reference Yield is calculated from Simple yields of Government Loan bond, 1-m Treasury bill, and 3-m Treasury bill with comparative ttm by interpolation method. Simple yield of LB is converted from average bidding yield to maturity.
- The above prices are calculated based upon the provided reference yields on the settlement date, today plus one official day (T+2).
- Duration and Convexity of Floating Rate Note Issues are Effective Duration and Effective Convexity.
- For Inflation-Linked Bond, Avg. Bid Yield shown is Avg. Bid Real YTM and the Clean price (%), Accrued Interest (%), and Gross Price (%) are all in Unadjusted terms. The corresponding Adjusted terms can be obtained by multiplying the Unadjusted price or accrued interest by the Index Ratio shown in the last column. The modified duration and convexity are calculated based on Avg. Bid Real YTM.
- Avg. bidding yield of LB22DA, LB22NA, LB233A, LB236A, LB244A, LB24DA, LB267A, LB27DA, LB283A, LB296A, LB356A, LB383A, LB396A, LB406A, LB416A, LB716A are synthetic yield derived from ThaiBMA pricing model.
- Bonds in State Owned Enterprise Bonds with non-MOF guarantee, SOE(NG), in RP Reference Yield pages are only rating AAA and Reference Yield of SOE(NG) came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.

### ที่มาของมูลค่าและหลักการคำนวณ:

เช่นเดียวกับ RP Reference Yield เพียงแต่กำหนดให้วันส่งมอบและชำระราคา (Settlement Date) เป็น 2 วันทำการ หลังจากวันปัจจุบัน (T+2 วันทำการ)

### ประโยชน์:

อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรุ่นต่างๆ ในหน้า RP Reference Yield ใช้เป็นอัตราผลตอบแทนอ้างอิงในการทำธุรกรรมซื้อคืนพันธบัตร (Repo) ที่มี Settlement Date เป็น T+2 วันทำการ

ชื่อหน้า: Bond Price > RP Reference Yield > RP Reference Yield (T+3)

ภาพประกอบ:

RP Reference Yield (T+3)

08/08/2022

Government Bonds Treasury Bills State Agency Bonds SOE(G) SOE(NG) Foreign Bonds Show All

RP Reference Yield (T+3): Government Bonds as of 8 August 2022 16:18:32

Download All Download Excel

Symbol	Settlement Date	Avg. Bidding Yield (%)	Clean Price (%)	Accrued Interest (%)	Gross Price (%)	Modified Duration	Convexity	Index Ratio
ESGLB35DA	11-Aug-2022	2.965802	84.865271	0.238836	85.104107	11.739896	154.316363	
ILB283A	11-Aug-2022	0.800000	102.448966	0.520548	102.969514	5.368669	32.211525	1.11836
LB22NA	11-Aug-2022	0.656810	101.064739	1.333904	102.398643	0.243037	0.180188	
LB22DA	11-Aug-2022	0.748829	100.434243	0.301370	100.735613	0.349377	0.296101	
LB233A	11-Aug-2022	0.907186	102.674776	2.275342	104.950118	0.574713	0.622671	
LB236A	11-Aug-2022	1.037355	102.172981	0.556164	102.729145	0.834825	1.116465	
LB23DA	11-Aug-2022	1.381571	101.354027	0.361644	101.715671	1.323968	2.424486	
LB244A	11-Aug-2022	1.552950	104.807804	1.528767	106.336571	1.586332	3.372094	
LB246A	11-Aug-2022	1.631440	98.398187	0.113014	98.511201	1.824508	4.246566	
LB249A	11-Aug-2022	1.665000	98.114847	0.302055	98.416902	2.065313	5.317204	

10 items per page 1 - 10 of 82 items

Remark:

1. Traded yield is based on 30/360 basis (on coupon payment) which might be different from yield calculated on actual payment. click here to learn more.
2. This page is designed to provide REFERENCE YIELD of State Owned Enterprise Bonds with MOF guarantee, which came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.
3. The Government interpolated yield is calculated from the interpolation method on the ThaiBMA Government Bond Yield Curve with the same maturity. However, the SOE Bonds with short-ended and long-ended issues (under and over the curve) are not included in this page.
4. T-Bill Reference Yield is calculated from Simple yields of Government Loan bond, 1-m Treasury bill, and 3-m Treasury bill with comparative ttm by interpolation method. Simple yield of LB is converted from average bidding yield to maturity.
5. The above prices are calculated based upon the provided reference yields on the settlement date, today plus one official day (T+3).
6. Duration and Convexity of Floating Rate Note Issues are Effective Duration and Effective Convexity.
7. For Inflation-Linked Bond, Avg. Bid Yield shown is Avg. Bid Real YTM and the Clean price (%), Accrued Interest (%), and Gross Price (%) are all in Unadjusted terms. The corresponding Adjusted terms can be obtained by multiplying the Unadjusted price or accrued interest by the Index Ratio shown in the last column. The modified duration and convexity are calculated based on Avg. Bid Real YTM.
8. Avg. bidding yield of LB22DA, LB22NA, LB233A, LB236A, LB244A, LB24DA, LB267A, LB27DA, LB283A, LB296A, LB356A, LB383A, LB396A, LB406A, LB416A, LB716A are synthetic yield derived from ThaiBMA pricing model.
9. Bonds in State Owned Enterprise Bonds with non-MOF guarantee, SOE(NG), in RP Reference Yield pages are only rating AAA and Reference Yield of SOE(NG) came from Market Yield on Plain Vanilla MTM pages.

ที่มาของมูลค่าและหลักการคำนวณ:

เช่นเดียวกับ RP Reference Yield เพียงแต่กำหนดให้วันส่งมอบและชำระราคา (Settlement Date) เป็น 3 วันทำการ หลังจากวันปัจจุบัน (T+3 วันทำการ)

ประโยชน์:

อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรุ่นต่างๆ ในหน้า RP Reference Yield ใช้เป็นอัตราผลตอบแทนอ้างอิงในการทำธุรกรรมซื้อคืนพันธบัตร (Repo) ที่มี Settlement Date เป็น T+3 วันทำการ

## Mark-to-Market

รวบรวมข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับมูลค่ายุติธรรมหลากหลายประเภท ไว้ในหน้าเดียวกัน สำหรับนำไปบันทึกมูลค่าสินทรัพย์สุทธิ (NAV) ตามกำหนดของ กลต. ประกอบไปด้วยเมนูย่อยทั้งหมด 6 เมนู

- |                             |  |
|-----------------------------|--|
| 1. Plain Vanilla MTM Pages: | แสดงมูลค่ายุติธรรมสำหรับตราสารหนี้ทั่วไป                     |
| 2. Structure Note MTM Page: | แสดงมูลค่ายุติธรรมสำหรับตราสารหนี้อนุพันธ์ (Structured Note) |
| 3. Notice Pending Page:     | แสดงข้อมูลตราสารหนี้ที่เข้ากระบวนการผิดนัดชำระหนี้           |
| 4. Download Historical MTM: | แสดงมูลค่ายุติธรรมย้อนหลัง                                   |
| 5. MTM Yield Movement:      | แสดงความเคลื่อนไหวของราคา Mark-to-Market                     |
| 6. MTM Price Feedback:      | ช่องทางส่ง Feedback เกี่ยวกับข้อมูลตราสารหนี้ มายัง ThaiBMA  |

ชื่อหน้า: Bond Price > Mark to Market > Plain Vanilla MTM Pages

ภาพประกอบ:

ThaiBMA Mark to Market

08/08/2022

Govt. State Agency T-Bill SOE(G) SOE(NG) GRE Corp. CP FB FX TBP Show All

Download All Download Excel

ThaiBMA Mark to Market as of 8 August 2022 16:59:19

Coupon Type	Rating		Last Trade		Last Quotation			Model		Daily Reference Settlement on 08					
	TRIS	FITCH	Date	Exe.Yld %	Date	Avg.Yld (%)	Max	Min	Model Yield (%)	Spread (bp)	Market Yield (%)	BEY (%)	DM	Clean Price (%)	AI (%)
Fixed			08-Aug-2022	2.955000	08-Aug-2022	2.965802	3.000000	2.940000	2.955000		2.955000	2.955000		84.968262	0.230151
Fixed			05-Aug-2022	0.770000	08-Aug-2022	0.800000	1.500000	0.729967	0.800000		0.800000	0.800000		102.451311	0.513699
Fixed			03-Aug-2022	0.750000	03-Jan-2014	3.835000	3.940000	3.780000	0.656810		0.656810	0.656810		101.089141	1.305822
Fixed			08-Aug-2022	0.865000	26-Apr-2022	0.599481	0.700000	0.570000	0.865000		0.865000	0.865000		100.399574	0.290411
Fixed			03-Aug-2022	0.950000	05-Jul-2016	1.836521	1.880000	1.770000	0.907186		0.907186	0.907186		102.699708	2.245205
Fixed			05-Aug-2022	1.100000	27-Aug-2019	1.410900	1.430000	1.400000	1.037355		1.037355	1.037355		102.187020	0.536301
Fixed			08-Aug-2022	1.300000	08-Aug-2022	1.381571	1.500000	1.340000	1.300000		1.300000	1.300000		101.469881	0.348493
Fixed			03-Aug-2022	1.500000	31-Mar-2015	2.679235	2.750000	2.620000	1.552950		1.552950	1.552950		104.823448	1.504110
Fixed			08-Aug-2022	1.580000	08-Aug-2022	1.631440	1.674630	1.610000	1.580000		1.580000	1.580000		98.486305	0.108904
Fixed			08-Aug-2022	1.642500	08-Aug-2022	1.665000	1.708731	1.650000	1.642500		1.642500	1.642500		98.155879	0.297945

10 items per page 1 - 10 of 3,153 items

Remark:

1. Traded yield is based on 30/360 basis (on coupon payment) which might be different from yield calculated on actual payment, click here to learn more.
2. For Inflation-Linked Bond, Coupon (%) is Real coupon (%) and all the Yields(%) shown are Real YTM(%). The Clean price(%) and Accrued Interest (%) are all in Unadjusted terms. The corresponding Adjusted terms can be obtained by multiplying the Unadjusted price or accrued interest by the Index Ratio shown in the last column. Modified duration and convexity are calculated based on Real YTM
3. For Traded-by-price bonds shown Gross Price (%) only, ThaiBMA do not provide Market Yield (%), Clean Price (%) and AI (%).
4. The cut-off time for daily quotation of all bonds is 16:00.
5. Clean price, Accrued interest, Modified duration and Convexity shown in Plain vanilla MTM pages (not Trade-by-price) calculated with Market Yield and settlement date on T+1 (Calendar day).
6. Model yield of LB22DA, LB22NA, LB233A, LB236A, LB244A, LB24DA, LB267A, LB27DA, LB283A, LB296A, LB356A, LB383A, LB396A, LB406A, LB416A, LB716A are synthetic yield derived from ThaiBMA pricing model. But if there are trading transaction, model yield will be traded yield.
7. BEY (%) is Bond Equivalent Yield (calculated with semi-annually compounded yield).
8. Since 1-Apr-2020, Market Yield of Long-term corporate bond that have one time cash flow (zero-coupon bond and Coupon at maturity) is semi-annual compounding yield (BEY).

อัตราผลตอบแทน มูลค่าและข้อมูลต่าง ๆ ของตราสารหนี้ในหน้านี้แยกตามประเภทของผู้ออกเพื่อความสะดวกในการเรียกใช้ แต่ถ้าหากผู้ใช้ต้องการใช้มูลค่าของตราสารหนี้ทั้งหมดก็สามารถทำได้โดยเลือกที่ Tab “Show All” หรือถ้าหากต้องการใช้ข้อมูลที่เป็น CSV File ก็สามารถกดที่ Download Excel

ความหมาย:

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ที่กำหนดขึ้นโดย ThaiBMA
- Coupon: คูปองที่จ่าย หน่วยเป็นร้อยละต่อปี
- Maturity: วันครบกำหนดอายุตราสารหนี้
- TTM: อายุคงเหลือนับจากวัน settlement T+1 (calendar day) จนถึงวันที่หมดอายุของตราสารหนี้
- Type: ประเภทของตราสารหนี้โดยแบ่งตามการจ่ายเงินต้น
- Coupon Type: ประเภทของการจ่ายคูปอง
- Rating: อันดับความน่าเชื่อถือของบริษัทผู้ออกตราสารหนี้ซึ่งจัดอันดับโดย TRIS หรือ/และ FITCH (Thailand)
- Last Trade Date: วันที่มีการซื้อขายล่าสุด
- Last Trade Exe. Yield: อัตราผลตอบแทนซื้อขายจากการซื้อขายล่าสุด (ร้อยละ)
- Last Quotation Date: วันซึ่งมีการส่งราคาเสนอซื้อจากผู้ซื้อขายตราสารหนี้ตั้งแต่ 3 รายขึ้นไปครั้งล่าสุด
- Last Quotation Average: ค่าเฉลี่ยอัตราเสนอซื้อในครั้งล่าสุด (%)

- Last Quotation Max:	อัตราเสนอซื้อสูงสุด
- Last Quotation Min:	อัตราเสนอซื้อต่ำสุด
- Model Yield (%):	อัตราผลตอบแทนจากแบบจำลองทางทฤษฎี (ร้อยละ) และส่วนชดเชยความเสี่ยง (Spread) หน่วยเป็น bp
- Spread:	ค่าชดเชยความเสี่ยง (bp)
- Market Yield:	อัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ที่ใช้อ้างอิง ณ สิ้นวัน หน่วยเป็นร้อยละ
- BEY (%):	Bond equivalent yield
- DM (%):	ส่วนล้าของอัตราผลตอบแทน (Discount Margin) หน่วยเป็นร้อยละ และจะแสดงผลสำหรับตราสารหนี้ที่จ่ายคูปองแบบลอยตัวเท่านั้น
- Clean Price (%):	ราคาไม่รวมดอกเบี้ยค้างรับ หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋ว
- AI (%):	ดอกเบี้ยค้างรับ หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋วราคาหน้าตั๋ว
- MOD:	ค่า Modified Duration สำหรับตราสารหนี้ที่ไม่ใช่ตราสารหนี้ที่จ่ายคูปองแบบลอยตัว และค่า Effective Duration สำหรับตราสารหนี้ที่จ่ายคูปองแบบลอยตัว หน่วยเป็นปี
- CONV:	Convexity หน่วยเป็นปี <sup>2</sup>
- Par:	มูลค่าที่ตราไว้ต่อหน่วย หน่วยเป็นบาท ถ้าไม่มีการแสดงค่าหมายความว่ตราสารหนี้รุ่นนั้นไม่ได้ระบุมูลค่าที่ตราไว้
- Currency:	สกุลเงินที่ออกตราสาร
- Registration Status:	สถานะการขึ้นทะเบียนกับทาง ThaiBMA
- Index Ratio:	ค่าที่ใช้ปรับเงินต้นและดอกเบี้ยเพื่อให้ชดเชยกับอัตราเงินเฟ้อ
- Outstanding:	มูลค่าคงค้างปัจจุบัน (ล้านบาท)
- Issuer Rating:	อันดับความน่าเชื่อถือของบริษัทผู้ออกตราสารหนี้
- Distribution Type:	ลักษณะของการเสนอขายหลักทรัพย์
- ISIN Code:	ISIN code

#### ที่มาของมูลค่าและหลักการคำนวณ:

อัตราผลตอบแทนที่ใช้อ้างอิง ณ สิ้นวัน (Market Yield) จะมาจากอัตราผลตอบแทนซื้อขายล่าสุดถ้ามีการซื้อขายตราสารหนี้ในวันนั้น ๆ แต่หากไม่มีการซื้อขาย Market Yield จะมาจากอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยจากผู้ซื้อขายตราสารหนี้ตั้งแต่ 3 รายขึ้นไป และถ้าหากไม่มีทั้งการซื้อขายและไม่มีอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยจากผู้ซื้อขายเกิน 3 ราย Market Yield จะได้มาจากแบบจำลองทางทฤษฎี (Model Yield)

ผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยได้มาจากธนาคารพาณิชย์ที่เป็นคู่ค้าหลักกับธนาคารแห่งประเทศไทย (Primary Dealer) ซึ่งจะทำให้การส่งอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลมาให้ ThaiBMA ทุกวัน

ในส่วนของพันธบัตรรัฐวิสาหกิจที่ค้าประกันโดยกระทรวงการคลัง ผู้ซื้อขายตราสารหนี้ (Dealer) จะส่งราคา/อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อมาให้กับทาง ThaiBMA ทุก 7 วัน และทุก 15 วัน สำหรับพันธบัตรรัฐวิสาหกิจที่ไม่มีการค้าประกันและหุ้นกู้ของบริษัทเอกชน

ราคาของตราสารหนี้ ดอกเบี้ยค้างรับ Modified Duration และ Convexity ที่แสดงในหน้านี้ได้มาจากการคำนวณด้วยหลักการเดียวกันกับหน้า Calculation โดยใช้อัตราผลตอบแทนอ้างอิง ณ สิ้นวัน โดยกำหนดให้วันส่งมอบและชำระราคา (Settlement Date) เป็น 1 วันหลังจากวันปัจจุบัน (T +1 Calendar day) เสมอ

**ประโยชน์:**

มูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ในหน้า Mark to Market ถูกใช้เป็นมูลค่าอ้างอิงโดยกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพในการคำนวณมูลค่าสินทรัพย์สุทธิ ณ สิ้นวัน (NAV)

## ชื่อหน้า: Bond Price > Mark to Market > Structure Note MTM Page

### ภาพประกอบ:

ThaiBMA STN Mark to Market

Symbol	Maturity	TTM (Yrs.)	Type	Rating		Last Trade		Last Quotation		Model Gross Price (%)	MTM Gross Price (%)	Par	Currency	Registration Status	Outstanding (min.)	Issuer Rating	Distribution Type	Loc
				TRIS	FITCH	Date	Exe. Gross Price %	Date	Avg. Gross Price (%)									
CIMBT232A	08 Feb 2023	0.50	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	105.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041G	
CIMBT232B	14 Feb 2023	0.52	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	15.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041A	
CIMBT232C	16 Feb 2023	0.52	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	15.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041B	
CIMBT232D	16 Feb 2023	0.52	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	20.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041C	
CIMBT232E	16 Feb 2023	0.52	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	400.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041D	
CIMBT232F	16 Feb 2023	0.52	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	55.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041E	
CIMBT232G	20 Feb 2023	0.53	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	25.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041H	
CIMBT232H	23 Feb 2023	0.54	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	60.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041F	
CIMBT232I	23 Feb 2023	0.54	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	40.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041M	
CIMBT232J	28 Feb 2023	0.56	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	120.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041N	
CIMBT232K	22 Feb 2023	0.54	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	11.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041J	
CIMBT232L	27 Feb 2023	0.55	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	100.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041B	
CIMBT232M	28 Feb 2023	0.56	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	105.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041K	
CIMBT232N	28 Feb 2023	0.56	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	60.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041L	
CIMBT232O	28 Feb 2023	0.56	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	200.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041N	
CIMBT233A	02 Mar 2023	0.56	Straight									1,000,000.00	THB	Registered	37.00 AA-(tha)	PP13e	TH0041O	

### ความหมาย:

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้
- ISIN Code: ISIN code
- Maturity: วันครบกำหนดไถ่ถอน
- TTM: อายุคงเหลือนับถึงวันครบกำหนดไถ่ถอน หน่วยเป็นปี
- Type: ประเภทของตราสารหนี้โดยแบ่งตามการจ่ายเงินต้น
- Rating: อันดับความน่าเชื่อถือของบริษัทผู้ออกตราสารหนี้ซึ่งจัดอันดับโดย TRIS หรือ/และ FITCH (Thailand)
- Last Trade Date: วันที่มีการซื้อขายล่าสุด
- Last Trade Exe. Gross Price: ราคาซื้อขายล่าสุด (ร้อยละ)
- Last Quotation Date: วันที่ส่งราคาเสนอซื้อครั้งล่าสุด
- Last Quotation Avg. Gross Price: ราคาเสนอซื้อครั้งล่าสุด (ร้อยละ)
- Model Gross Price %: มูลค่าจากแบบจำลองทางทฤษฎี หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋ว
- MTM Gross Price %: มูลค่ายุติธรรมตราสารหนี้ (รวมดอกเบี้ยค้างรับ) อ้างอิง ณ สิ้นวัน
- Registration Status: สถานะการขึ้นทะเบียนกับทาง ThaiBMA
- Relevant Statistics: ข้อมูลเพิ่มเติมจากแบบจำลองทางทฤษฎี (ถ้ามี)

### ที่มาของข้อมูล:

มูลค่ายุติธรรมตราสารหนี้อ้างอิง ณ สิ้นวัน (MTM Gross Price) ได้มาจากราคาซื้อขายล่าสุดถ้ามีการซื้อขายตราสารหนี้ในวันนั้น ๆ แต่หากไม่มีการซื้อขายจะใช้ราคาเสนอซื้อจากผู้ออกตราสารหนี้หรือผู้จัดจำหน่าย (Arranger/Underwriter) แทน ซึ่งโดยปกติจากผู้ออกตราสารหนี้หรือผู้จัดจำหน่ายจะส่งราคาเสนอซื้อมาให้กับทาง ThaiBMA ทุก 15 วัน (วันที่ 15 และวันสิ้นเดือน)

### ประโยชน์:

มูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ในหน้า STN Mark to Market ถูกใช้เป็นมูลค่าอ้างอิง

ชื่อหน้า: Bond Price > Mark to Market > Notice Pending Page

ภาพประกอบ:

Notice Pending Bonds

08/08/2022

Symbol	Restructured Maturity	Current Coupon Rate	Original Coupon Rate	Expected Recovery Rate (%)	Trade By	Pending Reason
<b>Long-term Corporate Bonds</b>						
APCON20NA <sup>DP</sup> II/HNW	09-Nov-2022	-	6.5	-	Yield	This bond is default payment. For more information, please visit <a href="https://www.thaibma.or.th/EN/News/Detail.aspx?id=d60f120c-c8f2-ec11-a305-aa81153d12c7">https://www.thaibma.or.th/EN/News/Detail.aspx?id=d60f120c-c8f2-ec11-a305-aa81153d12c7</a> <a href="https://www.thaibma.or.th/EN/News/Detail.aspx?id=753fc435-d316-ed11-a306-a2bb2fcb715">https://www.thaibma.or.th/EN/News/Detail.aspx?id=753fc435-d316-ed11-a306-a2bb2fcb715</a>
APEX202A <sup>DP</sup> II/HNW	26-Sep-2022	-	6.25	-	Yield	This bond is restructured. For more information, please visit <a href="https://www.thaibma.or.th/EN/News/Detail.aspx?id=12558265-1de7-ec11-a303-e65c3da78754">https://www.thaibma.or.th/EN/News/Detail.aspx?id=12558265-1de7-ec11-a303-e65c3da78754</a>
CGD206A <sup>IS</sup> II/HNW	25-Jun-2023	7.5	7	-	Yield	This bond is restructured. For more information, please visit <a href="https://www.thaibma.or.th/EN/News/Detail.aspx?id=3815a1a9-b4e0-ec11-a303-e65c3da78754">https://www.thaibma.or.th/EN/News/Detail.aspx?id=3815a1a9-b4e0-ec11-a303-e65c3da78754</a>
CGD219A <sup>IS</sup> II/HNW	06-Sep-2023	7.5	7.25	-	Yield	This bond is restructured. For more information, please visit <a href="https://www.thaibma.or.th/EN/News/Detail.aspx?id=9ecbfadc-3c12-ed11-a306-a2bb2fcb715">https://www.thaibma.or.th/EN/News/Detail.aspx?id=9ecbfadc-3c12-ed11-a306-a2bb2fcb715</a>

Remark:

Expected Recovery rate calculated from Dealers' poll or Surveyed recovery rate that represent ONLY "indicative price".

Disclaimer:

ThaiBMA is not responsible for any direct and indirect losses and damages caused by or occurred in connection with the use of and the access to the Data and ThaiBMA's website.


แสดงข้อมูลของตราสารหนี้ที่ได้รับผลกระทบจากเหตุการณ์ที่มีนัยสำคัญ ที่ไม่สามารถประเมินราคาโดยวิธีปกติได้ โดยตราสารหนี้ดังกล่าวจะถูกนำออกจากหน้า Mark-To-Market ปกติ (Plain Vanilla MTM Pages และ Structure Note MTM Page) และแสดงผลเป็น 2 ประเภท


- ตราสารหนี้ที่ผู้ออกยังไม่เข้าสู่กระบวนการฟื้นฟูกิจการหรือล้มละลาย: แสดงอัตราที่คาดว่าจะได้รับชำระคืนเมื่อตราสารหนี้เกิดการผิดนัดชำระหนี้ Expected Recovery Rate (%) และแจ้งเหตุการณ์ที่มีนัยสำคัญนั้น
- ตราสารหนี้ที่ผู้ออกเข้าสู่กระบวนการฟื้นฟูกิจการหรือล้มละลาย: ไม่แสดงค่าทุกรูปแบบ และแจ้งเหตุการณ์ที่มีนัยสำคัญนั้น















ชื่อหน้า: Bond Price > Mark to Market > Download Historical MTM

**ภาพประกอบ:**

 ThaiBMA Mark to Market

Historical ThaiBMA Daily Report : August 2022 

Date	Plain Vanilla	Structure Note
01-Aug-2022		
02-Aug-2022		
03-Aug-2022		
04-Aug-2022		
05-Aug-2022		
08-Aug-2022		

ผู้ใช้งานสามารถดาวน์โหลดข้อมูลมูลค่ายุติธรรมสำหรับตราสารหนี้ทั่วไปและมูลค่ายุติธรรมสำหรับตราสารหนี้อนุพันธ์ (Structured Note) ย้อนหลังในรูปแบบ CSV ได้

ชื่อหน้า: Bond Price > Mark to Market > MTM Yield Movement

ภาพประกอบ:

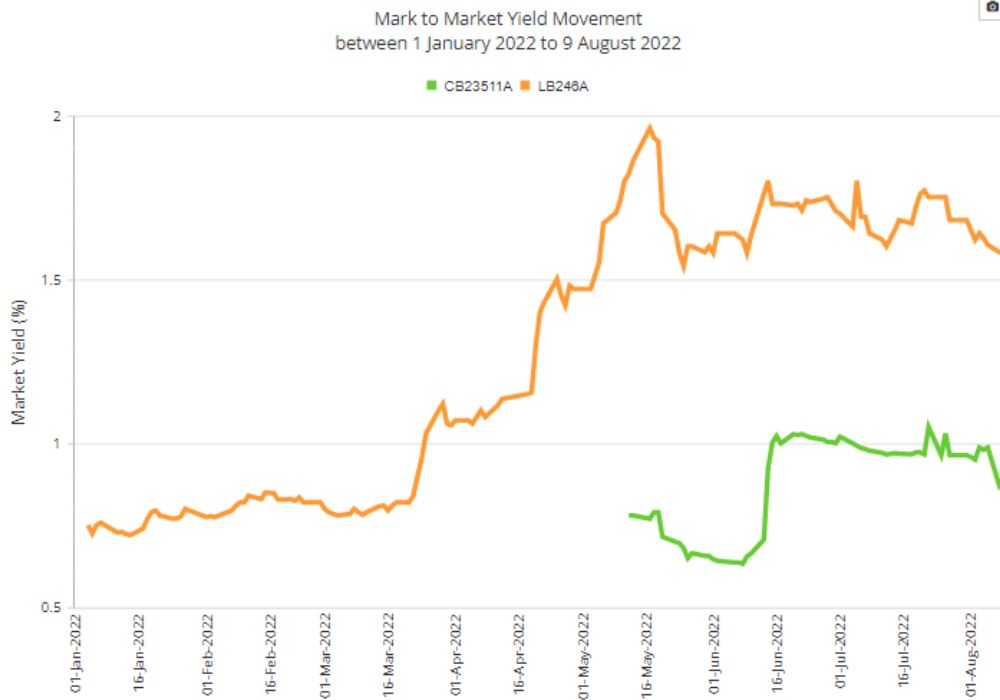
Mark to Market Yield Movement

As of: 01/01/2022 - 09/08/2022

Symbol: LB246A × CB23511A ×

Data: Market Yield

Download Excel



Remark: For Inflation-Linked Bond, all the Yields(%) shown are Real YTM(%).

ในหน้า MTM Yield Movement นี้ สามารถเรียกดูข้อมูลย้อนหลังเป็น Time Series ของข้อมูล Mark to Market โดยอาจเลือกให้แสดง Mark to Market Yield หรือ Quotation ก็ได้ สามารถเลือกแสดงผลได้ทั้งในรูปแบบกราฟ และเลือกดาวน์โหลดข้อมูลในรูปแบบ Excel โดยกดที่ Download Excel

ชื่อหน้า: Bond Price > Mark to Market > MTM Price feedback

### ภาพประกอบ:

Feedback on Mark-to-Market prices

**User Profile :**

User name	<input type="text" value="phantira"/>	E-mail address	<input type="text"/>	*
Name	<input type="text" value="Phantira Suksomnirundon"/>	Telephone	<input type="text"/>	*
Organization	<input type="text" value="THE THAI BOND MARKET ASSOCIATION"/>			

---

**Select Bond to Feedback :**

Mark-to-market date	<input type="text" value="17/08/2022"/>			
Bond Type	<input type="text" value="-- Select --"/>			*
Bond Symbol	<input type="text"/>			*
Mark-to-market yield	<input type="text"/>		%	

**Feedback Detail :**

**Remark**

1. ThaiBMA will respond your feedback to the provided e-mail.
2. User can send feedback from the time that Mark-to-Market data available until 12.00 a.m. of the next day.

ในหน้า MTM Price Feedback นี้ ผู้ใช้สามารถกรอกข้อมูลเพื่อส่งข้อมูลตราสารหนี้ที่ต้องการให้ตรวจสอบ หรือส่งข้อเสนอแนะต่างๆมายัง ThaiBMA โดยมีรายละเอียดในส่วนต่างๆดังนี้

- User Profile
  - User name: Username ของผู้ใช้ที่ Login เข้ามาใน ibond
  - Name: ชื่อของผู้ใช้ที่ Login เข้ามาใน ibond
  - Organization: หน่วยงานของผู้ใช้ที่ Login เข้ามาใน ibond
  - E-mail address: E-mail ของผู้ใช้ ที่ต้องการให้ส่งข้อมูลตอบกลับ (ผู้ใช้ต้องกรอก)
  - Telephone: หมายเลขโทรศัพท์ของผู้ใช้งาน (ผู้ใช้ต้องกรอก)
- Select bond to feedback
  - Mark-to-market date: วันที่ของ Mark-to-Market ที่ต้องการ Feedback
  - Bond Type: ชนิดของตราสารหนี้แบ่งเป็น SA, GB, GSOE, NSOE, FB, CP และ CORP (ผู้ใช้เลือกได้)
  - Bond Symbol: สัญลักษณ์ตราสารหนี้ที่ต้องการ feedback (ผู้ใช้เลือกได้)
  - Mark-to-market yield: อัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ที่ต้องการ Feedback
  - Feedback Detail: รายละเอียดต่างๆที่ผู้ใช้ต้องการส่งมาที่ ThaiBMA

## Indices

รวบรวมข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับดัชนีตราสารหนี้ (Bond Index) หลากหลายประเภท ไว้ในหน้าเดียวกัน ประกอบไปด้วยเมนูย่อยทั้งหมด 12 เมนู

- |                                      |  |
|--------------------------------------|--|
| 1. Bond Index:                       | ดัชนีของพันธบัตรรัฐบาล, พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ                                      |
| 2. Composite Bond Index:             | ดัชนีที่คำนวณรวมทั้งพันธบัตรรัฐบาล, พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ, หุ้นกู้เอกชนเข้าด้วยกัน |
| 3. T-Bill Index:                     | ดัชนีของตั๋วเงินคลัง   |
| 4. Zero Rate Return Index:           | ดัชนีอัตราผลตอบแทนของการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล ที่มีอายุคงที่                     |
| 5. SOE Zero Rate Return Index:       | ดัชนีอัตราผลตอบแทนของการลงทุนในพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ ที่มีอายุคงที่                |
| 6. Corporate Zero Rate Return Index: | ดัชนีอัตราผลตอบแทนของการลงทุนในหุ้นกู้เอกชน ที่มีอายุคงที่                       |
| 7. Commercial Paper Index:           | ดัชนีของตราสารหนี้เอกชนระยะสั้น  |
| 8. Short-term Government Bond Index  | ดัชนีของพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้น   |
| 9. MTM Government Bond Index         | ดัชนีของตราสารหนี้รัฐบาลที่คำนวณจากราคา Mark-to-Market                           |
| 10.MTM Corporate Bond Index:         | ดัชนีของตราสารหนี้เอกชนที่คำนวณจากราคา Mark-to-Market                            |
| 11.Inflation-Linked Bond Index:      | ดัชนีตราสารหนี้อ้างอิงอัตราเงินเฟ้อ  |
| 12. Fixed-Term Corporate Bond Index  | ดัชนีอัตราผลตอบแทนของการลงทุนในหุ้นกู้เอกชนประเภทกำหนดอายุ                       |
| 13. ESG Bond Index                   | ดัชนีอัตราผลตอบแทนของการลงทุนในหุ้นกู้ประเภท ESG                                 |
| 14.Customized Bond Index             | ดัชนีจำลองพอร์ตตามการลงทุนของผู้ใช้งาน   |

## ชื่อหน้า: Indices > Bond Index

### ความหมายและประโยชน์ของดัชนีตราสารหนี้:

เนื่องจากการลงทุนประเภทต่างๆ นั้น นักลงทุนมักจะนำดัชนีบางอย่างเข้ามาใช้ในการเปรียบเทียบผลตอบแทนจากการลงทุน (Benchmark Index) ซึ่งตัววัดนี้ทำให้นักลงทุนทราบถึงสถานะความเคลื่อนไหวของตลาดโดยรวมที่เกี่ยวข้องกับการลงทุน ยกตัวอย่างเช่น ถ้านักลงทุนมีพอร์ตการลงทุนในหุ้นอยู่หนึ่งพอร์ตซึ่งประกอบไปด้วยหุ้นต่างๆ ที่ได้เลือกไว้ อัตราผลตอบแทนที่ได้จากการลงทุนในพอร์ตนี้สามารถที่จะนำไปเปรียบเทียบกับดัชนีตลาดหลักทรัพย์ (SET Index) หรือดัชนีหุ้นตัวอื่นที่เราสนใจในช่วงระยะเวลาของการลงทุนที่เท่ากัน ซึ่งจะทำให้ให้นักลงทุนได้เห็นว่าการบริหารพอร์ตการลงทุนในหุ้นที่มีอยู่นั้นสามารถทำได้ดีกว่าดัชนีเปรียบเทียบหรือไม่

แนวทางในการวัดแบบนี้จะเป็นที่นิยมใช้กันมากในหมู่ผู้บริหารกองทุน (Fund manager) เนื่องจากเป็นตัววัดความสามารถในการบริหารพอร์ตแบบ Active Portfolio ของผู้บริหารกองทุนว่าจะทำได้ดีกว่าอัตราผลตอบแทนจากดัชนีที่นำมาเปรียบเทียบหรือไม่ ถ้าทำได้ดีกว่าก็แปลว่าผู้บริหารกองทุนนั้นๆ มีความสามารถที่เหนือกว่าในการคัดเลือกหลักทรัพย์ที่นำมาลงทุนในพอร์ต ซึ่งหลักการในการเปรียบเทียบการบริหารพอร์ต การลงทุนนี้สามารถนำไปใช้กับการลงทุนในตราสารหนี้ได้โดยใช้ดัชนีตราสารหนี้เป็นตัวเปรียบเทียบ


ดัชนีตราสารหนี้ (Bond Index) คือ เครื่องมือทางการเงินที่ผู้ลงทุนใช้ติดตามความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้โดยรวมหรือกลุ่มของตราสารหนี้ที่ได้จัดกลุ่มไว้ โดยดัชนีตราสารหนี้มีหลายประเภทขึ้นอยู่กับวัตถุประสงค์หรือผลตอบแทนที่ต้องการวัดจากการลงทุนในกลุ่มตราสารหนี้ต่างๆ ซึ่งประโยชน์ของดัชนีตราสารหนี้สามารถสรุปได้ดังนี้


1. เป็นเครื่องมือติดตามภาวะความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้ โดยดัชนีเป็นตัวชี้การเคลื่อนไหวของราคา และดอกเบี้ยที่นักลงทุนจะได้รับ และภาวะการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ย
  - หากอัตราดอกเบี้ยลดลง ราคาตราสารหนี้จะสูงขึ้น ค่าดัชนีจะสูงขึ้น
  - หากอัตราดอกเบี้ยเพิ่มขึ้น ราคาตราสารหนี้จะลดลง ค่าดัชนีจะลดลง
2. เป็นเครื่องมือที่ใช้เปรียบเทียบผลประกอบการจากการลงทุน โดยเปรียบเทียบผลตอบแทนที่คำนวณจากค่าดัชนีกับผลตอบแทนที่ได้รับจากการลงทุนในพอร์ตของตนเอง ในกรณีนี้อาจพิจารณาองค์ประกอบอื่นควบคู่ไปด้วย เช่น อายุเฉลี่ยของตราสารประเภทของตราสาร และ Duration ของพอร์ต
3. เป็นเครื่องมือใช้เปรียบเทียบความเคลื่อนไหวระหว่างตลาดของตราสารประเภทต่างๆ เช่น ตลาดหุ้น ตลาดตราสารหนี้ ตลาดเงิน ทั้งในด้านผลตอบแทน ความเสี่ยง ความผันผวนของตลาด เป็นต้น
4. เป็นเครื่องมือสำคัญที่รองรับธุรกรรมใหม่ๆ ที่ใช้ในการบริหารความเสี่ยง เช่น ธุรกรรมอนุพันธ์ อันได้แก่ Bond Index Option เป็นต้น

ดัชนีตราสารหนี้ที่จัดทำและเผยแพร่โดย ThaiBMA:

- ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล (ThaiBMA Government Bond Index)




















ภาพประกอบ:

 Bond Index

08/08/2022 

[Download Excel](#)

ThaiBMA Bond Index as of 08 August 2022

Type	Index								Average			Historical Download
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Net Total Return	chg. (point)	Yield	Duration	Convexity	
Government Bond Index	101.08	-0.19	101.51	-0.19	298.57	-0.55	92.01	-0.17	3.13	7.89	124.96	
Group 1 (1 < TTM <= 3)	71.32	-0.01	71.51	0.00	212.66	-0.01	101.69	-0.01	1.67	2.09	5.65	
Group 2 (3 < TTM <= 7)	106.61	-0.19	107.10	-0.18	302.83	-0.52	101.52	-0.17	2.11	4.73	26.90	
Group 3 (7 < TTM <= 10)	136.31	-0.42	136.79	-0.41	400.75	-1.22	99.09	-0.30	2.43	7.89	71.55	
Group 4 (> 10)	154.42	-0.44	155.18	-0.42	458.93	-1.25	81.86	-0.22	3.66	14.49	302.63	
Group 5 (<= 10)	88.76	-0.13	89.11	-0.12	257.94	-0.35	101.19	-0.14	2.18	4.33	29.01	
Group 6 (<= 1)	69.94	+0.02	70.44	+0.02	139.43	+0.05	100.64	+0.03	0.95	0.60	0.72	
Group 7 (10 < TTM <= 30)	126.71	-0.38	127.28	-0.37	239.72	-0.70	87.85	-0.26	3.32	13.01	215.10	
SOE (G) Bond Index	99.86	-0.14	100.42	-0.13	178.94	-0.23	100.99	-0.13	2.49	4.38	33.55	
Group 1 (1 < TTM <= 3)	90.73	-0.02	91.21	-0.02	163.04	-0.03	102.00	-0.02	1.83	2.01	5.35	
Group 2 (3 < TTM <= 7)	111.09	-0.12	111.75	-0.11	197.47	-0.20	102.09	-0.10	2.22	4.33	22.41	
Group 3 (7 < TTM <= 10)	125.32	-0.42	125.98	-0.41	222.67	-0.72	100.07	-0.32	2.62	7.54	64.63	
Group 4 (> 10)	128.29	-0.54	129.08	-0.53	230.29	-0.95	94.08	-0.39	3.16	10.93	142.11	
Group 5 (<= 10)	98.77	-0.10	99.32	-0.10	177.08	-0.17	101.65	-0.10	2.26	3.63	21.03	
SOE (NG) Bond Index	104.86	-0.23	105.67	-0.23	196.46	-0.42	99.20	-0.21	3.27	6.33	66.13	
Group 1 (1 < TTM <= 3)	91.39	-0.02	92.28	-0.01	166.63	-0.02	102.21	-0.02	2.03	1.97	5.20	
Group 2 (3 < TTM <= 7)	107.95	-0.13	108.67	-0.12	202.71	-0.22	102.05	-0.11	2.55	4.26	21.78	
Group 3 (7 < TTM <= 10)	118.69	-0.39	119.54	-0.38	226.73	-0.72	99.74	-0.32	3.07	7.41	63.56	
Group 4 (> 10)	115.21	-0.46	116.13	-0.45	219.99	-0.86	94.34	-0.37	3.70	11.02	150.75	
Group 5 (<= 10)	102.13	-0.14	102.91	-0.14	190.20	-0.25	101.62	-0.14	2.74	4.17	27.23	

Remark:

- Government Bond Indices are calculated from government Loan Bond (LB) only.
- The base date of sub group 4 's index is 12 March 1999. The base date of other indices is 4 January 1999.
- The net total return indices are calculated by applying the withholding tax rates to accrued interest and coupon payments on all coupon bonds. The tax rates may change from time to time due to changes to the withholding tax rate applicable in Thailand. The current and historical withholding tax rate is 15%.
- The base date of the net total return indices is 20 August 2019.

ดัชนีวัดความเคลื่อนไหวของพันธบัตรรัฐบาลประเภท Loan Bond (หรือที่ขึ้นต้นตามสัญลักษณ์ ThaiBMA ด้วยอักษร LB) โดยประกอบด้วยข้อมูลย่อย เช่น Average Yield, Average Duration และ Average Convexity ซึ่งเป็นค่าเฉลี่ยของ Yield, Duration และ Convexity ของกลุ่มพันธบัตรที่ใช้ในการคำนวณดัชนีถ่วงน้ำหนักด้วยมูลค่าคงค้างของพันธบัตรรัฐบาลแต่ละรุ่น

นอกจากกลุ่มดัชนีพันธบัตรรัฐบาลรวมที่ประกอบด้วยพันธบัตรรัฐบาลทุกรุ่นแล้ว ThaiBMA ยังได้จัดทำดัชนีพันธบัตรรัฐบาลแยกเป็นกลุ่มย่อยๆ อีก 7 กลุ่มโดยแบ่งตามอายุคงเหลือ ได้แก่

- 1) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี (1<TTM<=3)
- 2) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 3 ถึง 7 ปี (3<TTM<=7)
- 3) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 7 ถึง 10 ปี (7<TTM<=10)
- 4) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 10 ปี (>10)
- 5) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือน้อยกว่าหรือเท่ากับ 10 ปี แต่มากกว่า 14 วัน (<=10)
- 6) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือน้อยกว่าหรือเท่ากับ 1 ปี (<=10)
- 7) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 10 ถึง 30 ปี (10<TTM<=30)

ทั้งนี้การลงทุนในตราสารหนี้ส่วนใหญ่ มักจะมีการแบ่งการลงทุนตามช่วงอายุต่างๆ ของตราสารหนี้ เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทน และผลกระทบต่อ การเปลี่ยนแปลงราคาของตราสารหนี้ที่มีอายุสั้นและยาวจะไม่เท่ากัน การจัดทำดัชนีตราสาร

หนี้แยกเป็นกลุ่มย่อยๆ จะช่วยให้มีเครื่องมือวัดความเคลื่อนไหวที่ละเอียดขึ้นตลอดจนใช้เปรียบเทียบกองทุนที่มีนโยบายการลงทุนแตกต่างกันได้


**ความหมาย:**

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป

## ชื่อนี้: Indices > Composite Bond Index

### ภาพประกอบ:

 Composite Bond Index

Type	Index						Average			Historical Download
	Clean Price	chg.(point)	Gross Price	chg.(point)	Total Return	chg.(point)	Yield	Duration	Convexity	
Composite Bond Index	104.18	-0.17	104.70	-0.16	195.40	-0.30	3.16	6.33	87.48	

Remark:

1. Composite Bond Index is calculated from Government Bond Index, SOE(G) Bond Index, SOE(NG) Bond Index and Corporate Bond Index (BBB up).
2. The base date of Composite Bond Index is 1 September 2006.
3. Since 1-Jan-2022, Composite Bond Index is calculated from Government Bond Index, SOE(G) Bond Index, SOE(NG) Bond Index, and MTM Corporate Bond Index (BBB up).

ดัชนีตราสารหนี้ไทย (Composite Bond Index) เป็นดัชนีวัดการลงทุนตราสารหนี้ทุกประเภทในตลาดตราสารหนี้ไทย การจัดทำดัชนีตราสารหนี้ประเภทนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อวัดความเคลื่อนไหวของการลงทุนในตราสารหนี้ทั้งตลาด ฐานของดัชนีตราสารหนี้ไทยนี้เริ่มต้นที่ 100 ในวันที่ 1 กันยายน 2549 โดยดัชนีตราสารหนี้ไทยจะคำนวณจากดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ดัชนีพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ ทั้งที่ค้าประกันโดยกระทรวงการคลังและไม่ค้าประกัน และดัชนีหุ้นกู้เอกชนที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับน่าลงทุน (Corporate Bond Index BBB up)

### การวัดผลการลงทุนโดยใช้ดัชนีตราสารหนี้:

เมื่อนักลงทุนทราบแล้วว่าดัชนีตราสารหนี้ต่างๆอยู่หลายประเภทสิ่งทีนักลงทุนจำเป็นต้องทำความเข้าใจ คือ การเลือกใช้ดัชนีให้เหมาะสมกับพอร์ตการลงทุนที่พิจารณาอยู่ กรณีที่นักลงทุนพิจารณาพอร์ตตราสารหนี้ที่ลงทุนเฉพาะในพันธบัตรรัฐบาล ดัชนีที่เหมาะสมในการนำมาเป็นตัววัดผลการบริหารพอร์ตการลงทุน คือดัชนีพันธบัตรรัฐบาล โดยที่ดัชนีตัวนี้มีกลุ่มย่อย (Subgroup) ที่แยกออกเป็นช่วงอายุคงเหลือต่างๆ เช่น 1 - 3 ปี หรือว่า 3 - 7 ปี เป็นต้น ซึ่งนักลงทุนจำเป็นต้องดูว่าพันธบัตรรัฐบาลที่เรานำมาประกอบอยู่ในพอร์ตลงทุนนั้นใกล้เคียงกับพันธบัตรในกลุ่มย่อยเหล่านี้หรือไม่

ถ้าหากว่าใกล้เคียงกว่าเราก็ควรใช้ดัชนีพันธบัตรรัฐบาลที่เป็นกลุ่มย่อยเป็นตัววัดแทนซึ่งจะเหมาะสมกว่า ยกตัวอย่างเช่น ถ้าพอร์ตการลงทุนเราประกอบด้วยพันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือสิบปีขึ้นไปเท่านั้น การที่นักลงทุนใช้ดัชนีพันธบัตรรัฐบาลปกติที่คำนวณมาจากพันธบัตรรัฐบาลในทุกช่วงอายุคงเหลือก็คงไม่เหมาะสมนัก ในกรณีนี้ ดัชนีที่เป็นตัววัดที่เหมาะสมควรเป็นดัชนีพันธบัตรรัฐบาลกลุ่มย่อยที่ช่วงอายุมากกว่า 10 ปี (TTM > 10 ปี) อย่างไรก็ตาม ตัวอย่างการเลือกใช้ดัชนีตราสารหนี้ที่เหมาะสมกันได้ถูกกล่าวถึงอย่างคร่าวๆ ก่อนหน้านี้แล้วแต่สิ่งทีนักลงทุนต้องเข้าใจเกี่ยวกับการวัดผลการลงทุนโดยใช้ดัชนี คือ วัตถุประสงค์และแรงจูงใจในการใช้ดัชนีเป็นตัววัดผล

### ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index

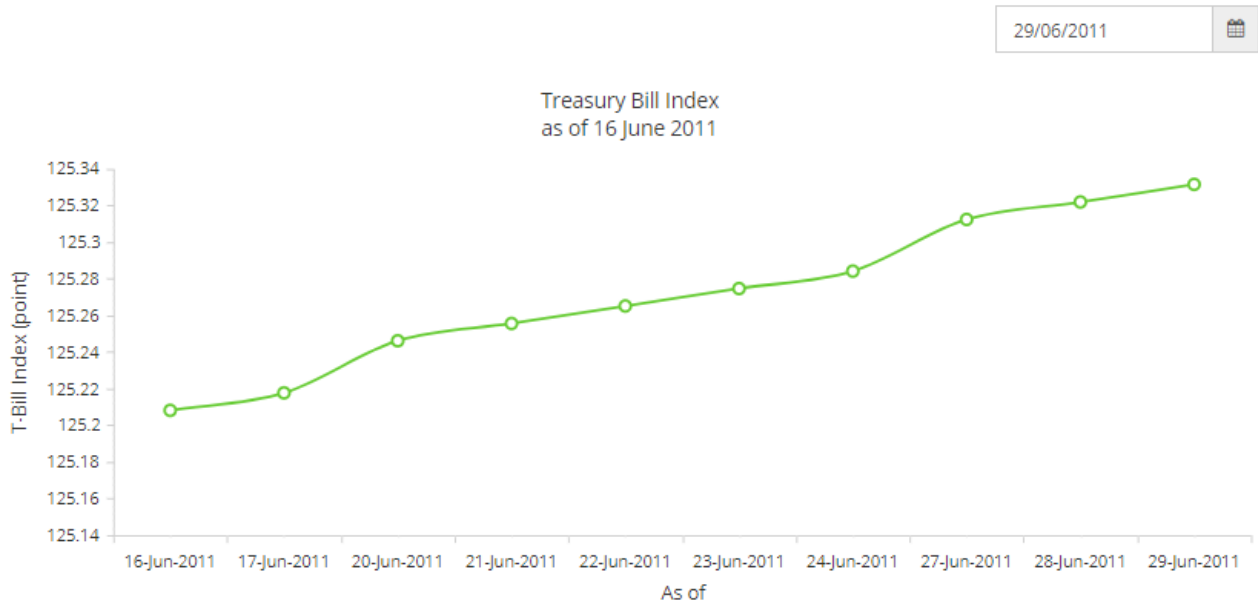


- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป

ชื่อหน้า: Indices > T-Bill Index

ภาพประกอบ:

### Treasury Bill Index



[Download Excel](#)

As of	T-Bill Index	Change (point)	Average Duration Index
29-Jun-2011	125.331233	+0.009594	0.000000
28-Jun-2011	125.321639	+0.009519	0.002740
27-Jun-2011	125.312120	+0.028169	0.005479
24-Jun-2011	125.283951	+0.009486	0.013699
23-Jun-2011	125.274465	+0.009502	0.016438
22-Jun-2011	125.264963	+0.009537	0.009589
21-Jun-2011	125.255426	+0.009416	0.012329
20-Jun-2011	125.246010	+0.028394	0.015068
17-Jun-2011	125.217616	+0.009543	0.023288
16-Jun-2011	125.208073	+0.009229	0.026027

ดัชนีตั๋วเงินคลัง (T-Bill Index) เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ระยะสั้นที่ปราศจากความเสียง คือ ตั๋วเงินคลัง โดยการเปรียบเทียบผลตอบแทนที่คำนวณจากค่าดัชนีตั๋วเงินคลังกับผลตอบแทนจากการลงทุนในพอร์ตของนักลงทุน หลักการสร้างดัชนีตั๋วเงินคลังของ ThaiBMA เปรียบเสมือนกับการลงทุนในตั๋วเงินคลังทุกรุ่นที่มีอยู่ในตลาด โดยสัดส่วนของการลงทุนในตั๋วเงินคลังแต่ละรุ่นคำนวณได้จากมูลค่าค้าง (Outstanding Value) ของตั๋วเงินคลัง

## ชื่อหน้า: Indices > Zero Rate Return Index

### ภาพประกอบ:

#### Zero Rate Return Index

08/08/2022

[Download all TTM and Date](#)    [Download Excel](#)

Zero Rate Return (ZRR) Index as of 08 August 2022

TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Historical Download
1-Month	0.511666	+0.533403	148.628856	+0.001719	
3-Month	0.653385	+0.924395	152.368409	+0.000063	
6-Month	0.858419	+1.064542	156.661250	-0.003182	
1-Year	1.115645	+0.492133	165.241472	-0.000533	
2-Year	1.656452	+0.844713	176.327334	-0.020418	
3-Year	1.890049	+1.463958	194.627213	-0.070147	
4-Year	1.992460	+1.321094	211.011051	-0.097156	
5-Year	2.073321	+4.236002	229.903577	-0.464731	

Download:  
ZRR Index Construction Methodology

ดัชนี Zero Rate Return (ZRR Index) เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้อายุคงที่ที่ปราศจากความเสียง เช่น ZRR 1 Year Index เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ที่ไร้ความเสี่ยงที่มีอายุคงที่ที่ 1 ปี โดยวันฐานของดัชนีจะเริ่มต้นที่ 100 ในวันที่ 2 มกราคม 2545 ดัชนีนี้จะมีประโยชน์สำหรับใช้เป็นดัชนีเปรียบเทียบพอร์ตการลงทุนที่มีนโยบายการลงทุนในตราสารหนี้โดยกำหนดอายุเฉลี่ยของพอร์ตลงทุนที่คงที่

### ความหมาย:

- Zero Rate: Zero Rate
- Zero Rate Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate เทียบกับวันก่อนหน้า
- Zero Rate Index: Zero Rate Index
- Zero Rate Index Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate Index เทียบกับวันก่อนหน้า

## ชื่อหน้า: Indices > SOE Zero Rate Return Index

### ภาพประกอบ:

#### SOE Zero Rate Return Index

08/08/2022

[Download all TTM and Date](#)
[Download Excel](#)

##### SOE-Guaranteed Zero Rate Return Index as of 08 August 2022

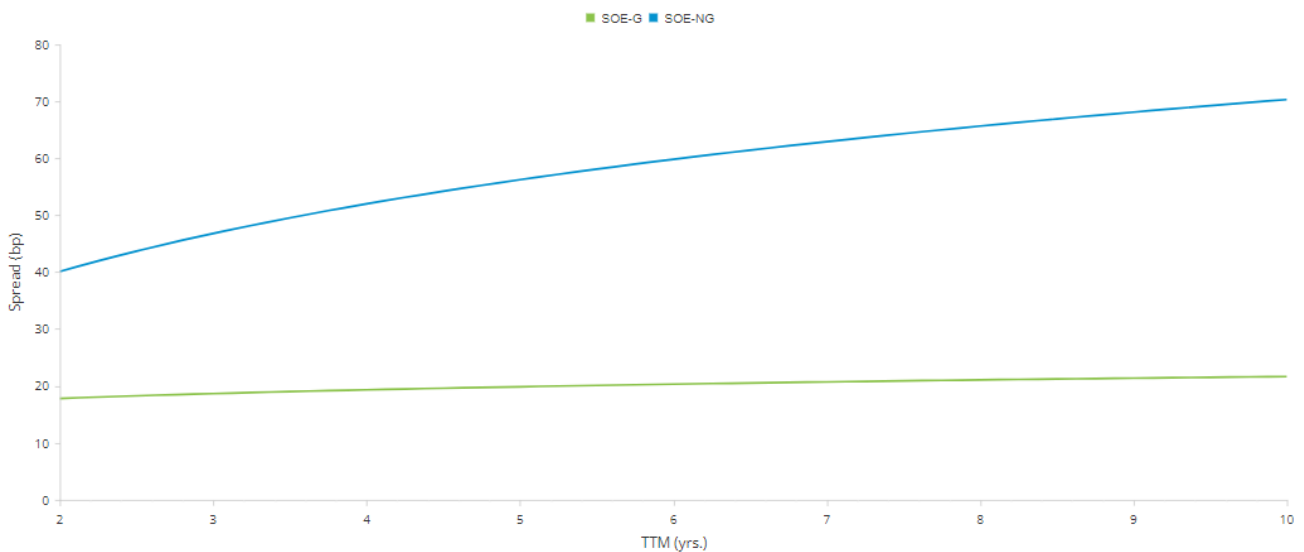
TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Historical Download
1-Year	1.115645	+0.492133	16.611414	0.000000	142.700776	+0.000246	📄
2-Year	1.656452	+0.844713	17.811685	0.000000	153.788882	-0.016946	📄
3-Year	1.890049	+1.463958	18.663008	0.000000	167.215372	-0.059203	📄
4-Year	1.992460	+1.321094	19.323226	0.000000	177.681538	-0.080603	📄
5-Year	2.073321	+4.236002	19.862603	0.000000	187.048920	-0.376226	📄

[Download all TTM and Date](#)
[Download Excel](#)

##### SOE-Non Guaranteed Zero Rate Return Index as of 08 August 2022

TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Historical Download
1-Year	1.115645	+0.492133	30.634136	0.000000	145.673122	+0.001209	📄
2-Year	1.656452	+0.844713	40.062695	0.000000	157.801909	-0.015816	📄
3-Year	1.890049	+1.463958	46.750138	0.000000	171.840053	-0.058653	📄
4-Year	1.992460	+1.321094	51.936388	0.000000	182.493388	-0.080102	📄
5-Year	2.073321	+4.236002	56.173384	0.000000	191.744707	-0.381531	📄

ThaiBMA Term Structure of Corporate Spread  
as of 27 July 2022



ดัชนีพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ประเภทพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ วันฐานของดัชนีพันธบัตรรัฐวิสาหกิจนี้เริ่มต้นที่ 100 ในวันที่ 1 สิงหาคม 2549 โดยพันธบัตรรัฐวิสาหกิจที่นำมาคำนวณหาดัชนีรวมพันธบัตรรัฐวิสาหกิจทั้งที่ค้าประกันโดยกระทรวงการคลังและไม่ค้าประกัน ทั้งนี้ พันธบัตรรัฐวิสาหกิจที่นำมาคำนวณดัชนีนั้นต้องมีเกณฑ์คัดเลือกและสูตรการคำนวณดัชนีเช่นเดียวกับดัชนีพันธบัตรรัฐบาลอาทิ ณ วันคำนวณหาดัชนี ตราสารที่นำมาคำนวณต้องมีอายุคงเหลือ (TTM) มากกว่า 14 วัน ต้องเป็นประเภทจ่ายดอกเบี้ยคงที่ (Fixed coupon) เป็นต้น

### ความหมาย:

- Zero Rate: Zero Rate
- Zero Rate Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate เทียบกับวันก่อนหน้า
- Spread: Spread ที่เกิดจากส่วนต่างของ Zero Rate

- Spread Change: การเปลี่ยนแปลงของ Spread เทียบกับวันก่อนหน้า
- Zero Rate Index: Zero Rate Index
- Zero Rate Index Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate Index เทียบกับวันก่อนหน้า

ชื่อหน้า: Indices > Corporate Zero Rate Return Index

ภาพประกอบ:

Corporate Zero Rate Return Index

08/08/2022

Corporate Zero Rate Return Index - AAA as of 08 August 2022

[Download all TTM and Date](#) [Download Excel](#)

TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Historical Download
1-Year	1.115645	+0.492133	27.955897	0.000000	150.171893	+0.001456	⬇️
2-Year	1.656452	+0.844713	43.773144	0.000000	163.539707	-0.015759	⬇️
3-Year	1.890049	+1.463958	54.991925	0.000000	178.222874	-0.059817	⬇️
4-Year	1.992460	+1.321094	63.692322	0.000000	188.985045	-0.081613	⬇️
5-Year	2.073321	+4.236002	70.800261	0.000000	197.992710	-0.391913	⬇️

Corporate Zero Rate Return Index - AA as of 08 August 2022

[Download all TTM and Date](#) [Download Excel](#)

TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Historical Download
1-Year	1.115645	+0.492133	63.188597	0.000000	155.525647	+0.003001	⬇️
2-Year	1.656452	+0.844713	79.005844	0.000000	169.306238	-0.014627	⬇️
3-Year	1.890049	+1.463958	90.224625	0.000000	184.159472	-0.059823	⬇️
4-Year	1.992460	+1.321094	98.925022	0.000000	194.791181	-0.081955	⬇️
5-Year	2.073321	+4.236002	106.032961	0.000000	203.478769	-0.399431	⬇️

Corporate Zero Rate Return Index - A as of 08 August 2022

[Download all TTM and Date](#) [Download Excel](#)

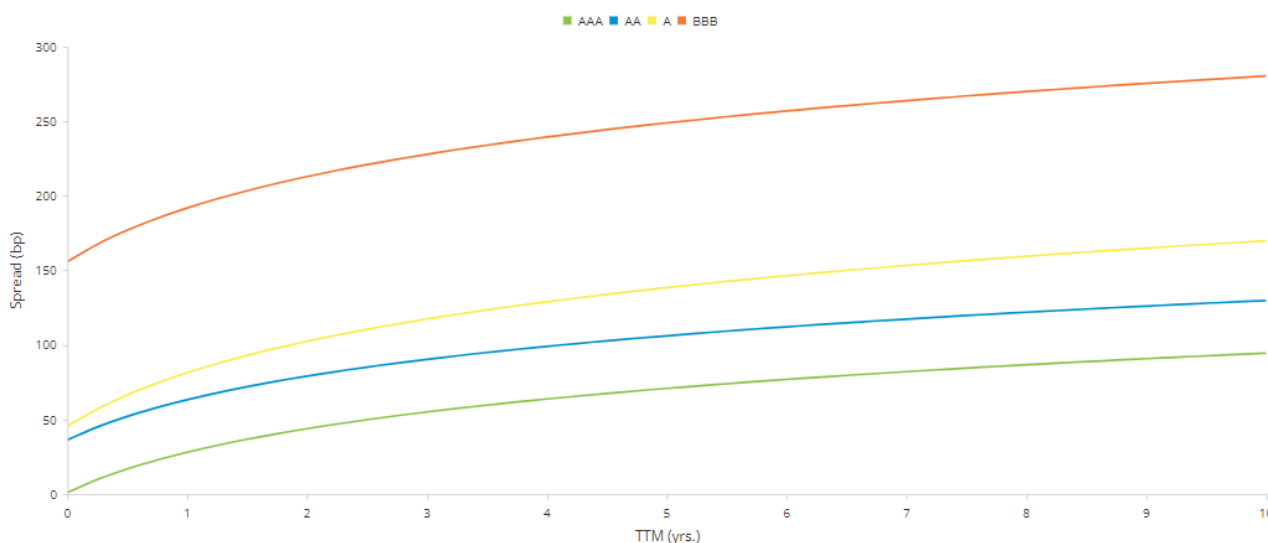
TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Historical Download
1-Year	1.115645	+0.492133	81.276240	0.000000	159.702321	+0.004144	⬇️
2-Year	1.656452	+0.844713	102.326029	0.000000	174.701806	-0.013543	⬇️
3-Year	1.890049	+1.463958	117.256120	0.000000	190.309479	-0.059762	⬇️
4-Year	1.992460	+1.321094	128.834717	0.000000	201.229275	-0.082221	⬇️
5-Year	2.073321	+4.236002	138.294049	0.000000	209.898738	-0.408294	⬇️

Corporate Zero Rate Return Index - BBB as of 08 August 2022

[Download all TTM and Date](#) [Download Excel](#)

TTM	Zero Rate	Chg.(bp)	Spread (bp)	Chg.(bp)	Zero Rate Return Index	Chg.(point)	Historical Download
1-Year	1.115645	+0.492133	191.666209	0.000000	187.350378	+0.010443	⬇️
2-Year	1.656452	+0.844713	212.716038	0.000000	210.960520	-0.009837	⬇️
3-Year	1.890049	+1.463958	227.646159	0.000000	234.347448	-0.065763	⬇️
4-Year	1.992460	+1.321094	239.224777	0.000000	251.810523	-0.094227	⬇️
5-Year	2.073321	+4.236002	248.684128	0.000000	266.475874	-0.504842	⬇️

ThaiBMA Term Structure of Corporate Spread as of 27 July 2022



ดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ประเภทหุ้นกู้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือระดับ AAA, AA, A และ BBB โดยหุ้นกูดังกล่าวที่นำมาคำนวณหาดัชนีแบ่งออกเป็น กลุ่มที่ประกอบไปด้วยหุ้นกู้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือระดับ AAA, AA, A และ BBB ตามลำดับ และในแต่ละกลุ่มที่แบ่งตามอันดับความน่าเชื่อถือ จะแบ่งเป็น 5 กลุ่มย่อย ตาม TTM ที่ 1 ปี, 2 ปี, 3 ปี, 4 ปี และ 5 ปี เพื่อให้สะท้อนถึงความแตกต่างที่ TTM ต่างๆ ซึ่งดีกว่า average spread ที่ถูกแบ่งออกเป็นช่วงอายุ ได้แก่ น้อยกว่าหรือเท่ากับ 3 ปี, ระหว่าง 3 ถึง 5 ปี, และมากกว่าหรือเท่ากับ 5 ปี ทั้งนี้วิธีการคำนวณและหลักการของ Corporate ZRR Index เป็นไปในลักษณะคล้ายกับการคำนวณและหลักการของ ZRR Index ซึ่งในกรณีของ Corporate ZRR Index จะมองไปที่ spread ที่มีค่าต่างกันที่ TTM ต่างๆ แต่ในกรณีของ ZRR Index จะมองไปที่ YTM ที่มีค่าต่างกันที่ TTM ต่างๆ

**ความหมาย:**

- Zero Rate: Zero Rate
- Zero Rate Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate เทียบกับวันก่อนหน้า
- Spread: Spread ที่เกิดจากส่วนต่างของ Zero Rate
- Spread Change: การเปลี่ยนแปลงของ Spread เทียบกับวันก่อนหน้า
- Zero Rate Index: Zero Rate Index
- Zero Rate Index Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Zero Rate Index เทียบกับวันก่อนหน้า

## ชื่อหน้า: Indices > Commercial Paper Index

### ภาพประกอบ:

#### Commercial Paper Index

08/08/2022



Commercial Paper Index as of 08 August 2022

[Download Excel](#)

Type	Index						Average				Average Time To Maturity	Historical Download
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Yield	Simple Yield	Duration	Convexity		
Commercial Paper Index (AA- up)	122.968234	+0.000931	123.041448	+0.002555	143.620055	+0.001978	0.868835	0.757143	0.146619	0.071468	0.147101	
Commercial Paper Index (A- up)	127.018643	+0.001243	127.065992	+0.001946	145.564796	+0.002012	0.987005	0.885112	0.163077	0.084360	0.163687	
Commercial Paper Index (BBB- up)	130.435180	+0.002057	130.489653	+0.002937	149.912969	+0.003079	1.271585	1.086900	0.174055	0.094518	0.174951	

#### Remark:

1. Commercial Paper Indices are categorized into 3 types based on different securities composition in their calculation baskets. For instance, the calculation basket of Commercial Paper Index (AA- up) is composed of selected commercial papers of the issuers with rating AA- and above.

2. The base dates of Commercial Paper Indices are 1 September 2006.

ดัชนีตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้น (Commercial Paper Index) เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ประเภทตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้น ฐานของดัชนีตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้น นี้เริ่มต้นที่ 100 ในวันที่ 1 กันยายน 2549 โดยตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่นำมาคำนวณหาดัชนีแบ่งออกเป็น 3 กลุ่ม ได้แก่

- 1) กลุ่มที่ประกอบไปด้วยตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่มีระดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกที่ AA- หรือสูงกว่า
- 2) กลุ่มที่ประกอบไปด้วยตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่มีระดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกที่ A- หรือสูงกว่า
- 3) กลุ่มที่ประกอบไปด้วยตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่มีระดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกที่ BBB- หรือสูงกว่า

#### ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Simple Yield: Average Simple Yield
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้



## ชื่อหน้า: Indices > Short-term Government Bond Index

### ภาพประกอบ:

Short-term Government Bond Index

08/08/2022

Short-term Government Bond Index as of 08 August 2022

Download Excel

Type	Index						Average				Average Time To Maturity	Historical Download
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Yield	Simple Yield	Duration	Convexity		
Short-term Government Bond Index	137.575462	+0.003199	137.575462	+0.003199	137.575462	+0.003199	0.760077	0.600021	0.259359	0.228868	0.260833	

Remark:

- Short-term Government Bond Indices are calculated from short term debt securities issued by The Ministry of Finance and The Bank of Thailand.
- The base date of Short-term Government Bond Indices is 1<sup>st</sup> September 2006.

ดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้น (Short Term Government Bond Index) เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ประเภทพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้น ฐานของดัชนีพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นนี้เริ่มต้นที่ 100 ในวันที่ 1 กันยายน 2549 โดยพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นที่นำมาคำนวณหาดัชนีคือพันธบัตรรัฐบาลระยะสั้นที่ออกโดยกระทรวงการคลังและธนาคารแห่งประเทศไทย

### ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Simple Yield: Average Simple Yield
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

ชื่อหน้า: Indices > MTM Government Bond Index

ภาพประกอบ:

MTM Government Bond Index

08/08/2022

[Download Excel](#)

MTM Government Bond Index as of 08 August 2022

Type	Index						Average			Average Time To Maturity	Historical Download		
	Clean Price	chg.(point)	Gross Price	chg.(point)	Total Return	chg.(point)	Net Total Return	chg.(point)	Yield			Duration	Convexity
MTM Government Bond Index	103.96	-0.23	104.41	-0.23	195.09	-0.42	91.87	-0.20	3.12	7.73	123.03	11.60	
Group 1 ( 1 < TTM <= 3 )	84.11	0.00	84.34	+0.01	158.31	+0.01	101.69	+0.01	1.67	2.08	5.64	2.14	
Group 2 ( 3 < TTM <= 7 )	102.72	-0.25	103.20	-0.24	188.04	-0.44	101.44	-0.24	2.12	4.73	26.87	5.14	
Group 3 ( 7 < TTM <= 10 )	112.69	-0.53	113.09	-0.52	211.67	-0.98	99.00	-0.46	2.44	7.89	71.50	8.96	
Group 4 ( > 10 )	123.74	-0.35	124.35	-0.33	235.17	-0.63	80.56	-0.22	3.70	15.00	323.47	25.04	
Group 5 ( <= 10 )	97.11	-0.19	97.50	-0.19	181.21	-0.35	101.14	-0.20	2.18	4.32	28.97	4.72	
Group 6 ( <= 1 )	69.80	+0.01	70.30	+0.02	140.24	+0.03	100.72	+0.02	0.97	0.60	0.71	0.60	
Group 7 ( 10 < TTM <= 30 )	127.27	-0.39	127.82	-0.38	240.83	-0.72	87.48	-0.26	3.30	13.47	229.03	18.09	

Remark:

1. MTM Government Bond Indices are calculated from government Loan Bond (LB) only.
2. The base dates of MTM Government Bond Indices are 1 September 2006.
3. MTM Government Bond Index Article
4. The net total return indices are calculated by applying the withholding tax rates to accrued interest and coupon payments on all coupon bonds. The tax rates may change from time to time due to changes to the withholding tax rate applicable in Thailand. The current and historical withholding tax rate is 15%.
5. The base date of the net total return indices is 20 August 2019.

ดัชนีวัดความเคลื่อนไหวของพันธบัตรรัฐบาลประเภท Loan Bond (LB) ที่คิดคำนวณจากข้อมูล Mark-to-Market และใช้วันฐานของดัชนีเริ่มต้นที่ 100 ณ วันที่ 01 ก.ย. 2006 โดยประกอบด้วยข้อมูลย่อย เช่น Average Yield, Average Duration และ Average Convexity ซึ่งเป็นค่าเฉลี่ยของ Yield, Duration และ Convexity ของกลุ่มพันธบัตรที่ใช้ในการคำนวณดัชนีถ่วงน้ำหนักด้วยมูลค่าคงค้างของพันธบัตรรัฐบาลแต่ละรุ่น

MTM Government Bond Index จะมีการแสดงผลข้อมูลคล้ายกับ ThaiBMA Government Bond Index โดยจัดทำดัชนีเป็นกลุ่มย่อยๆ อีก 7 กลุ่ม ดังนี้

- 1) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี (1<TTM<=3)
- 2) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 3 ถึง 7 ปี (3<TTM<=7)
- 3) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 7 ถึง 10 ปี (7<TTM<=10)
- 4) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 10 ปี (>10)
- 5) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือน้อยกว่าหรือเท่ากับ 10 ปี แต่มากกว่า 14 วัน (<=10)
- 6) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือน้อยกว่าหรือเท่ากับ 1 ปี (<=10)
- 7) กลุ่มดัชนีตราสารหนี้พันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 10 ถึง 30 ปี (10<TTM<=30)

MTM Government Bond Index ต่างจาก ThaiBMA Government Bond Index โดยหลักคือการใช้ราคา Mark-to-Market ณ สิ้นวันมาใช้ในการคำนวณดัชนีและพันธบัตรจะถูกปรับออกจากการคำนวณดัชนี 1 วันก่อนวันครบกำหนดไถ่ถอน ดังนั้น MTM Government Bond Index จะมีการเคลื่อนไหวที่สอดคล้องกับราคาตลาดของพันธบัตรรัฐบาลมากยิ่งขึ้น

ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index

- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

## ชื่อหน้า: Indices > MTM Corporate Bond Index

### ภาพประกอบ:

#### MTM Corporate Bond Index

16/08/2022



MTM Corporate Bond Index as of 16 August 2022

[Download Excel](#)

Type	Index								Average			Average Time To Maturity	Historical Download
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Net Total Return	chg.(point)	Yield	Duration	Convex...		
MTM Corporate Bond Index (A- up)	106.06	+0.08	106.76	+0.09	202.34	+0.18	104.84	+0.09	3.23	3.68	23.72	4.23	📉
Group 1 [ 1 < TTM <= 3 ]	98.85	+0.03	99.41	+0.04	181.75	+0.07	104.77	+0.04	2.39	1.93	4.97	2.01	📉
Group 2 [ 3 < TTM <= 7 ]	123.28	+0.17	124.13	+0.18	238.94	+0.36	107.12	+0.16	3.09	4.35	23.07	4.80	📉
Group 3 [ 7 < TTM <= 10 ]	129.31	+0.17	130.30	+0.19	266.78	+0.37	104.59	+0.14	3.71	7.27	62.28	8.62	📉
Group 4 [ TTM <= 10 ]	105.08	+0.09	105.76	+0.09	199.36	+0.18	105.05	+0.09	3.08	3.34	18.54	3.71	📉
Group 5 [ TTM <= 1 ]	81.60	0.00	82.07	+0.01	223.29	+0.02	102.91	+0.01	1.52	0.53	0.61	0.54	📉
MTM Corporate Bond Index (BBB+ up)	106.37	+0.09	107.01	+0.09	204.57	+0.18	105.54	+0.09	3.28	3.39	20.77	3.87	📉
Group 1 [ 1 < TTM <= 3 ]	99.98	+0.05	100.50	+0.06	186.29	+0.11	105.77	+0.06	2.66	1.92	4.86	2.01	📉
Group 2 [ 3 < TTM <= 7 ]	123.57	+0.18	124.36	+0.18	241.45	+0.36	107.81	+0.16	3.19	4.27	22.22	4.72	📉
Group 3 [ 7 < TTM <= 10 ]	129.12	+0.17	130.10	+0.19	266.82	+0.37	104.49	+0.14	3.72	7.27	62.24	8.61	📉
Group 4 [ TTM <= 10 ]	105.45	+0.09	106.07	+0.10	201.78	+0.18	105.74	+0.09	3.16	3.10	16.36	3.43	📉
Group 5 [ TTM <= 1 ]	82.41	0.00	82.85	+0.01	229.01	+0.02	103.79	+0.01	1.88	0.53	0.59	0.54	📉
MTM Corporate Bond Index (BBB up)	106.07	+0.08	106.71	+0.09	204.65	+0.18	105.43	+0.09	3.29	3.37	20.51	3.84	📉
Group 1 [ 1 < TTM <= 3 ]	100.18	+0.05	100.70	+0.06	187.55	+0.10	105.93	+0.06	2.73	1.92	4.85	2.01	📉
Group 2 [ 3 < TTM <= 7 ]	123.20	+0.18	123.99	+0.18	241.34	+0.36	107.63	+0.16	3.20	4.27	22.20	4.71	📉
Group 3 [ 7 < TTM <= 10 ]	128.07	+0.17	129.05	+0.19	264.93	+0.37	103.85	+0.14	3.72	7.27	62.24	8.61	📉
Group 4 [ TTM <= 10 ]	105.25	+0.09	105.87	+0.09	202.06	+0.18	105.72	+0.09	3.17	3.08	16.17	3.41	📉
Group 5 [ TTM <= 1 ]	82.54	0.00	82.98	+0.01	230.70	+0.02	103.98	+0.01	1.90	0.53	0.59	0.54	📉
MTM Corporate Bond Index (BBB- up)	105.91	+0.08	106.56	+0.09	205.00	+0.18	105.48	+0.09	3.39	3.33	20.16	3.80	📉
Group 1 [ 1 < TTM <= 3 ]	100.33	+0.05	100.85	+0.06	188.82	+0.10	106.14	+0.06	2.89	1.93	4.86	2.02	📉
Group 2 [ 3 < TTM <= 7 ]	123.04	+0.18	123.84	+0.18	241.35	+0.36	107.58	+0.16	3.26	4.26	22.10	4.71	📉
Group 3 [ 7 < TTM <= 10 ]	127.65	+0.17	128.64	+0.19	264.27	+0.37	103.58	+0.14	3.78	7.25	61.94	8.60	📉
Group 4 [ TTM <= 10 ]	105.14	+0.08	105.76	+0.09	202.51	+0.18	105.79	+0.09	3.26	3.04	15.87	3.37	📉
Group 5 [ TTM <= 1 ]	82.73	0.00	83.17	+0.01	232.54	+0.02	104.23	+0.01	2.10	0.54	0.59	0.54	📉

#### Remark:

1. The base date is 1 September 2006.
2. The net total return indices are calculated by applying the withholding tax rates to accrued interest and coupon payments on all coupon bonds. The tax rates may change from time to time due to changes to the withholding tax rate applicable in Thailand. The current and historical withholding tax rate is 15%.

ดัชนีหุ้นกู้ที่คิดคำนวณจากข้อมูล Mark-to-Market ดัชนีนี้จะมีความละเอียดมากกว่า Investment Grade Corporate Bond Index โดยจะแบ่งออกเป็น 4 กลุ่มย่อย คือ ตามอันดับเครดิตตั้งแต่ BBB- ขึ้นไป, ตั้งแต่ BBB ขึ้นไป, ตั้งแต่ BBB+ ขึ้นไป และตั้งแต่ A- ขึ้นไป นอกจากนี้ ยังคำนวณแยกตามช่วงอายุคงเหลือในแต่ละอันดับเครดิต เหมือนกับดัชนีหุ้นกู้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน และยังเพิ่มช่วงอายุคงเหลืออีกกลุ่มหนึ่ง คือ กลุ่มของหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 10 ปี ซึ่งกลุ่มนี้จะครอบคลุมหุ้นกู้ทั้งหมด รวมถึงหุ้นกู้ที่มีอายุไม่ถึง 1 ปีอีกด้วย ได้เริ่มจัดทำดัชนีหุ้นกู้ตั้งแต่วันที่ 1 กันยายน 2549 เป็นต้นมา โดยจัดทำดัชนีเป็นกลุ่มย่อยๆ อีก 5 กลุ่ม ดังนี้

- 1) กลุ่มดัชนีหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี (1<TTM<=3)
- 2) กลุ่มดัชนีหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 3 ถึง 7 ปี (3<TTM<=7)
- 3) กลุ่มดัชนีหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 7 ถึง 10 ปี (7<TTM<=10)
- 4) กลุ่มดัชนีหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 10 ปี (>10)
- 5) กลุ่มดัชนีหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือน้อยกว่าหรือเท่ากับ 1 ปี

MTM Corporate bond index จะต่างจาก Investment Grade Corporate bond Index โดยหลักคือจะใช้ราคา Mark-to-Market ณ สิ้นวันมาใช้ในการคำนวณดัชนีและจะไม่ได้คำนึงถึงสภาพคล่องของตราสารแต่ละตัว แต่จะใช้ตราสารทั้งหมด (Fixed coupon with no option embedded) ที่มีอันดับเครดิตมาใช้ในการคำนวณดัชนี อาจกล่าวได้ว่า Mark-to-Market Corporate Bond Index จะมีการเคลื่อนไหวที่สอดคล้องกับราคาตลาดของหุ้นกู้มากกว่าเมื่อเปรียบเทียบกับ Investment Grade Corporate Bond Index เพราะมีการนำราคา Mark-to-Market ณ สิ้นวันมาใช้ในการคำนวณค่าดัชนี

**ความหมาย:**

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

## ชื่อหน้า: Indices > Fixed-Term Corporate Bond Index

### ภาพประกอบ:

#### Fixed-Term Corporate Bond Index

16/08/2022


[Download Excel](#)

Fixed-Term Corporate Bond Index as of 16 August 2022

Type	Index								Average			Average Time To Maturity	Historical Download
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Net Total Return	chg.(point)	Yield	Duration	Convex...		
<b>Fixed-Term Corporate Bond Index (A- up)</b>													
Group 1 [ttm=1]	97.56	0.00	98.16	+0.01	101.98	+0.01	101.31	+0.01	1.76	0.89	1.28	0.91	
Group 2 [ttm=2]	97.82	+0.03	98.40	+0.04	102.31	+0.04	101.62	+0.04	2.28	1.84	4.35	1.91	
Group 3 [ttm=3]	97.38	+0.06	97.82	+0.07	101.97	+0.08	101.27	+0.07	2.72	2.78	9.21	2.93	
Group 4 [ttm=4]	99.11	+0.15	99.73	+0.16	104.14	+0.16	103.37	+0.16	2.77	3.69	15.81	3.94	
Group 5 [ttm=5]	97.87	+0.11	98.58	+0.11	103.02	+0.12	102.24	+0.12	3.08	4.45	23.06	4.91	
<b>Fixed-Term Corporate Bond Index (BBB+ up)</b>													
Group 1 [ttm=1]	98.00	-0.01	98.54	0.00	102.75	0.00	102.02	0.00	2.17	0.92	1.33	0.95	
Group 2 [ttm=2]	98.41	+0.08	98.92	+0.09	103.26	+0.09	102.52	+0.09	2.56	1.86	4.36	1.93	
Group 3 [ttm=3]	98.05	+0.07	98.47	+0.08	103.08	+0.08	102.31	+0.08	2.99	2.78	9.14	2.95	
Group 4 [ttm=4]	98.96	+0.14	99.52	+0.15	104.33	+0.16	103.51	+0.16	2.96	3.68	15.67	3.94	
Group 5 [ttm=5]	98.05	+0.11	98.72	+0.11	103.38	+0.12	102.57	+0.12	3.19	4.45	23.02	4.92	
<b>Fixed-Term Corporate Bond Index (BBB up)</b>													
Group 1 [ttm=1]	98.05	-0.01	98.58	0.00	102.89	0.00	102.15	0.00	2.24	0.93	1.33	0.95	
Group 2 [ttm=2]	98.43	+0.08	98.95	+0.09	103.37	+0.09	102.62	+0.09	2.64	1.86	4.37	1.94	
Group 3 [ttm=3]	98.05	+0.07	98.48	+0.08	103.14	+0.08	102.36	+0.08	3.01	2.78	9.10	2.94	
Group 4 [ttm=4]	98.89	+0.14	99.45	+0.15	104.30	+0.16	103.47	+0.16	2.97	3.68	15.66	3.94	
Group 5 [ttm=5]	98.04	+0.11	98.72	+0.11	103.38	+0.12	102.57	+0.12	3.19	4.45	23.01	4.92	
<b>Fixed-Term Corporate Bond Index (BBB- up)</b>													
Group 1 [ttm=1]	98.11	-0.01	98.65	0.00	103.08	0.00	102.32	0.00	2.44	0.93	1.33	0.95	
Group 2 [ttm=2]	98.43	+0.08	98.95	+0.09	103.54	+0.09	102.76	+0.09	2.76	1.86	4.37	1.94	
Group 3 [ttm=3]	98.02	+0.07	98.45	+0.08	103.26	+0.08	102.46	+0.08	3.16	2.77	9.04	2.94	
Group 4 [ttm=4]	98.64	+0.14	99.19	+0.15	104.10	+0.16	103.26	+0.16	3.05	3.67	15.58	3.94	
Group 5 [ttm=5]	98.05	+0.11	98.74	+0.11	103.41	+0.12	102.59	+0.12	3.24	4.45	23.00	4.92	

#### Remark:

- The base date is 4 January 2021.
- The net total return indices are calculated by applying the withholding tax rates to accrued interest and coupon payments on all coupon bonds. The tax rates may change from time to time due to changes to the withholding tax rate applicable in Thailand. The current and historical withholding tax rate is 15%.
- Group 1 [ttm=1] covers 0.5<ttm<=1.5. Group 2 [ttm=2] covers 1.5<ttm<=2.5. Group 3 [ttm=3] covers 2.5<ttm<=3.5. Group 4 [ttm=4] covers 3.5<ttm<=4.5. Group 5 [ttm=5] covers 4.5<ttm<=5.5.
- For the calculation manual of the index, please click [here](#).

Fixed-Term Corporate Bond Index เป็นดัชนีผลตอบแทนอ้างอิงของ term fund ที่ลงทุนในตราสารหนี้เอกชนไทยที่มีการแบ่งช่วงอายุของ index ให้เป็นไปตามช่วงอายุของ term fund และเป็น index ที่สามารถทำได้จริงใน portfolio

ThaiBMA Fixed-Term Corporate Bond Index จัดทำขึ้นโดยถ่วงน้ำหนักด้วยวิธี Market capitalization และใช้ ราคาจากหน้า Mark-To-Market ของ ThaiBMA โดย ThaiBMA Fixed-Term Corporate Bond Index มีวันฐาน (Base Date) ณ วันที่ 4 มกราคม 2564 ดัชนีดังกล่าวจะแบ่งออกได้เป็น 20 sub-group ตามช่วง TTM และ rating group ซึ่งมีรายละเอียด ดังนี้

- แบ่งตามอายุคงเหลือได้เป็น 5 กลุ่มย่อย ได้แก่

- Group 1 [ttm=1] ครอบคลุมช่วงอายุ 0.5<ttm<=1.5
- Group 2 [ttm=2] ครอบคลุมช่วงอายุ 1.5<ttm<=2.5
- Group 3 [ttm=3] ครอบคลุมช่วงอายุ 2.5<ttm<=3.5
- Group 4 [ttm=4] ครอบคลุมช่วงอายุ 3.5<ttm<=4.5
- Group 5 [ttm=5] ครอบคลุมช่วงอายุ 4.5<ttm<=5.5

- แบ่งตาม rating group ได้เป็น 4 กลุ่มย่อย ได้แก่

- กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอันดับเครดิตตั้งแต่ A- ขึ้นไป (A-up)
- กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอันดับเครดิตตั้งแต่ BBB+ ขึ้นไป (BBB+up)

3. กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอันดับเครดิตตั้งแต่ BBB ขึ้นไป (BBBup)
4. กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอันดับเครดิตตั้งแต่ BBB- ขึ้นไป (BBB-up)

**ความหมาย:**

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

## ชื่อหน้า: Indices > ESG Bond Index

### ภาพประกอบ:

#### ESG Bond Index

16/08/2022

[Download Excel](#)

ESG Bond Index as of 16 August 2022

Type	Index						Average			Average Time To Maturity	Historical Download		
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Net Total Return	chg.(point)	Yield			Duration	Convexity
ESG Bond Index	89.13	+0.04	89.52	+0.04	92.29	+0.04	91.81	+0.04	2.95	8.80	104.08	10.32	📈
Group 1 ( 1 < TTM <= 3 )	99.22	+0.02	99.67	+0.03	102.76	+0.03	102.22	+0.03	2.45	2.24	6.52	2.34	📈
Group 2 ( 3 < TTM <= 7 )	97.43	+0.16	97.98	+0.15	101.24	+0.17	100.66	+0.17	2.97	4.37	23.38	4.77	📈
Group 3 ( 7 < TTM <= 10 )	96.50	+0.12	97.32	+0.20	101.61	+0.13	100.83	+0.13	3.34	7.54	66.02	8.79	📈
Group 4 ( TTM > 10 )	84.15	0.00	84.45	+0.01	86.79	+0.01	86.39	+0.01	2.94	11.62	152.04	13.32	📈
Government Bond ESG Index	83.58	0.00	83.83	+0.01	86.04	+0.01	85.67	+0.01	2.88	11.74	154.21	13.34	📈
SOE Bond ESG Index	91.24	+0.08	91.60	+0.08	93.90	+0.09	93.50	+0.08	2.34	4.75	34.13	5.26	📈
Corporate Bond ESG Index	97.17	+0.09	97.81	+0.10	101.71	+0.10	101.02	+0.10	3.37	4.91	38.22	5.74	📈
Group 1 ( 1 < TTM <= 3 )	99.15	+0.01	99.63	+0.02	102.68	+0.02	102.15	+0.02	2.75	2.06	5.58	2.15	📈
Group 2 ( 3 < TTM <= 7 )	98.28	+0.17	98.90	+0.16	102.69	+0.19	102.02	+0.19	3.15	4.46	24.26	4.91	📈
Group 3 ( 7 < TTM <= 10 )	97.70	+0.10	98.63	+0.21	103.33	+0.11	102.47	+0.11	3.51	7.59	67.43	8.98	📈
Group 4 ( TTM > 10 )	89.92	0.00	90.75	+0.01	94.84	+0.01	94.09	+0.01	3.86	10.17	125.56	13.03	📈

#### Remark:

- The base date is 4 January 2021.
- The net total return indices are calculated by applying the withholding tax rates to accrued interest and coupon payments on all coupon bonds. The tax rates may change from time to time due to changes to the withholding tax rate applicable in Thailand. The current and historical withholding tax rate is 15%.
- ThaiBMA ESG Bond Index Article

ThaiBMA ESG Bond Index เป็นดัชนีผลตอบแทนอ้างอิงของตราสารหนี้ที่ระดมทุนเพื่อใช้ในกิจกรรมหรือการดำเนินงานที่เกี่ยวข้องกับสิ่งแวดล้อม สังคมและธรรมาภิบาล (Environmental, Social and Governance – ESG) จัดทำขึ้นโดยการถ่วงน้ำหนักด้วยวิธี Market capitalization และใช้ราคาจากหน้า Mark-To-Market ของ ThaiBMA ซึ่งมีวันฐาน (Base Date) ณ วันที่ 4 มกราคม 2564

ThaiBMA ESG Bond Index แบ่งออกเป็น 4 ประเภท คือ ESG Bond Index, Government Bond ESG Index, SOE ESG Index และ Corporate Bond ESG Index ซึ่งมีรายละเอียด ดังนี้

- ESG Bond Index ที่รวมตราสารหนี้ ESG ทุกรุ่นที่ขึ้นทะเบียนกับ ThaiBMA แบ่งตามอายุคงเหลือได้เป็น 4 กลุ่มย่อย
  - กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี (1 < ttm ≤ 3)
  - กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 3 ถึง 7 ปี (3 < ttm ≤ 7)
  - กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 7 ถึง 10 ปี (7 < ttm ≤ 10)
  - กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 10 ปี (ttm > 10)

2. Government Bond ESG Index ตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยรัฐบาล

3. SOE Bond ESG Index ตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจทั้งที่มีการค้าประกันและไม่มีการค้าประกันโดย

กระทรวงการคลัง

- Corporate Bond ESG Index ตราสารหนี้ ESG ที่ออกโดยภาคเอกชน แบ่งตามอายุคงเหลือได้เป็น 4 กลุ่มย่อย ได้แก่
  - กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี (1 < ttm ≤ 3)
  - กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 3 ถึง 7 ปี (3 < ttm ≤ 7)
  - กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 7 ถึง 10 ปี (7 < ttm ≤ 10)
  - กลุ่มดัชนีตราสารหนี้ที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 10 ปี (ttm > 10)



**ความหมาย:**

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

## ชื่อหน้า: Indices > Inflation-Linked Bond Index

### ภาพประกอบ:

#### Inflation-Linked Bond Index

16/08/2022



Inflation-Linked Bond Index as of 16 August 2022

[Download Excel](#)

Type	Index						Average			Average Time To Maturity	Historical Download
	Clean Price	chg.(point)	Gross Price	chg.(point)	Total Return	chg.(point)	Yield	Duration	Convexity		
Unadjusted Inflation-Linked Bond Index	99.84	-0.48	100.38	-0.48	113.55	-0.54	1.19	5.34	31.88	5.57	
Adjusted Inflation-Linked Bond Index	111.84	-0.51	112.44	-0.51	126.40	-0.57	1.19	5.34	31.88	5.57	

#### Remark:

1. The base dates of Inflation-Linked Bond Indices are 12 March 2013.
2. Inflation-Linked Bond Index Article

ดัชนีตราสารหนี้อ้างอิงอัตราเงินเฟ้อ (Inflation-Linked Bond Index) เป็นดัชนีวัดผลตอบแทนการลงทุนในพันธบัตรรัฐบาลประเภทอัตราดอกเบี้ยแปรผันตามการเปลี่ยนแปลงของเงินเฟ้อ (Inflation-Linked Bond) โดยใช้วันฐานของดัชนีเริ่มต้นที่ 100 ณ วันที่ 12 มีนาคม 2556 และราคาที่ใช้ในการคำนวณดัชนี มาจากราคา Mark-to-Market ณ สิ้นวัน ดัชนีดังกล่าวจะแบ่งออกได้เป็น 2 ประเภท คือ

1. Unadjusted Inflation-Linked Bond Index ดัชนีตราสารหนี้อ้างอิงอัตราเงินเฟ้อนี้ไม่คิดผลของ Index Ratio ในการคำนวณราคา Clean Price และ Gross Price
2. Adjusted Inflation-Linked Bond Index ดัชนีตราสารหนี้อ้างอิงอัตราเงินเฟ้อนี้คิดผลของ Index Ratio ในการคำนวณราคา Clean Price และ Gross Price

นอกจากนี้ยังมีข้อมูลย่อยอื่นๆ ของดัชนี ประกอบด้วย Average Yield, Average Duration และ Average Convexity ซึ่งเป็นค่าเฉลี่ยของ Yield, Duration และ Convexity ของกลุ่มพันธบัตรฯ ที่ใช้ในการคำนวณดัชนีถ่วงน้ำหนักด้วยมูลค่าคงค้างของพันธบัตรฯ แต่ละรุ่น

#### ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

## ชื่อหน้า: Indices > Customized Bond Index

Customized Bond Index เป็นเครื่องมือช่วยในการวัดผลการดำเนินงานของพอร์ตตราสารหนี้ โดย Customized Bond Index ได้รวบรวมดัชนีทุกตัวในเว็บไซต์ iBond ให้ผู้ใช้เลือกสร้างดัชนีจำลองพอร์ตตามการลงทุนของผู้ใช้งานได้เอง เพื่อความสะดวกต่อนักลงทุนในการอ้างอิงเกณฑ์มาตรฐานเทียบผลตอบแทนจากการลงทุน (Benchmark)

### วิธีการใช้งาน:

หากผู้ใช้ต้องการสร้างดัชนีชี้วัดการลงทุนจำลอง Port การลงทุนให้เลือก Create Portfolio ที่ด้านขวามือ

### ภาพประกอบ:

#### Customized Bond Index

Create Portfolio

16 August 2022

#### Performance

Download Excel

Portfolio	Historical Returns as of 16 August 2022									
	% Cumulative Return					% Annualized Return				Since Inception
	YTD	1-Day	1-Month	3-Month	6-Month	1-Year	3-Year	5-Year	10-Year	
Pech	-4.04	+0.08	+1.82	+6.27	-2.76	-6.41	-1.84	+2.27	+3.46	+3.26
ThaiBond	-0.44	+0.15	+1.89	+4.46	-0.13	-1.60	+1.77	+2.70	N/A	+3.02

#### Bond Indices

Download Excel

Portfolio	Inception Date	Total Return Index	Change	%Change	Average YTM	Average TTM	Average Duration	Average Convexity	Download Excel
Pech	05-Jan-2009	144.916011	+0.129338	+0.089330	2.896928	10.635921	7.148108	112.173786	Download
ThaiBond	01-Jan-2017	118.346255	+0.176762	+0.149583	2.395543	4.994596	4.568863	25.277834	Download

ในหน้า Edit Portfolio ผู้ใช้สามารถสร้าง Index ได้ด้วยตัวเองดังนี้

#### 1. Select Portfolio

- Portfolio: ผู้ใช้สามารถบันทึก Customized Index ได้ 5 Portfolios โดยคลิกเลือกที่ Drop down
- Portfolio Name: ผู้ใช้สามารถตั้งชื่อ Portfolio ได้
- Inception Date: วันเริ่มต้นของ Index

#### 2. Select Bond Indices

- Indices: ดัชนีที่สามารถเลือกเข้ามาใส่ใน Port
- TTM: Sub – index แบ่งตาม TTM หรืออายุคงเหลือของตราสารหนี้
- Weight (%): เปรอเซ็นต์การลงทุนของ Index ตัวนั้นใน Port\*

#### 3. + ADD: ผู้ใช้งานกดเพิ่ม Index เข้าใน Port

\*ผู้ใช้สามารถเพิ่ม Index ได้ จน Weight % ของ Index แต่ละตัวรวมกัน เท่ากับ 100%

**ตัวอย่าง:** การใส่ข้อมูลในหน้า Customized Index

### ภาพประกอบ:

#### Customized Bond Index Portfolio

[Back to Customized Index](#)

#### Select Portfolio

1. Portfolio : Pech

2. Portfolio Name : \* Pech

3. Inception Date : \* 02 March 2022

Delete Portfolio

#### Select Bond Indices

4. Indices : \* Government Bond Index

5. TTM : \* 1 < TTM ≤ 3 Year

6. Weight (%) : \* 1

+ Add

4. Composite of Portfolio: หลังจากผู้ใช้งานใส่ Index เข้าใน Port เรียบร้อยแล้ว iBond จะแสดงผลดังนี้

- ตารางแสดงรายละเอียดแต่ละตัวของ Index
- กราฟแสดงสัดส่วน index ใน Port

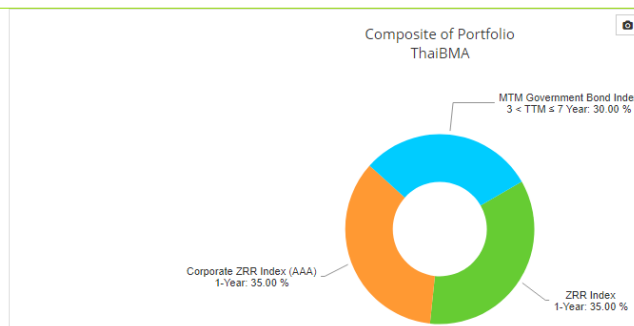
### ภาพประกอบ:

#### Composite of Portfolio

#	✖	Bond Index	TTM	Inception Date	% Weight	% Weight
1	✖	ZRR Index	1-Year	02-Jan-2002	35.00	35
2	✖	Corporate ZRR Index (AAA)	1-Year	15-Jun-2007	35.00	35
3	✖	MTM Government Bond Index	3 < TTM ≤ 7 Year	01-Sep-2006	30.00	30

Save

✖ Clear All



- ในส่วนนี้ผู้ใช้งานสามารถแก้ % Weight ของ index ใน Portfolio ได้ในช่องสุดท้ายตามที่ highlight ในรูปด้านบน
- หลังจากผู้ใช้งานตรวจสอบข้อมูลใน Portfolio ว่าถูกต้องครบถ้วน กด Save เพื่อระบบทำการบันทึกและคำนวณ

Customized Bond Index จะทำการคำนวณและแสดงผลลัพธ์ออกมาดังนี้

### ภาพประกอบ:

#### Performance

Portfolio	Historical Returns as of 16 August 2022										
	% Cumulative Return					% Annualized Return					
	YTD	1-Day	1-Month	3-Month	6-Month	1-Year	3-Year	5-Year	10-Year	Since Inception	
Pech	-4.04	+0.08	+1.82	+6.27	-2.76	-6.41	-1.84	+2.27	+3.46	+3.26	

5. Performance: ตารางนี้จะแสดงถึงผลการดำเนินงานของ Portfolio

- YTD: ผลตอบแทนของ Portfolio แบบ Cumulative Return (%) ในปีปัจจุบันจนถึงวันทำการล่าสุดและตัวเลขนี้ จะมีการ Update ทุกวัน
- % Cumulative Return: ผลตอบแทนของ Portfolio แบบ Cumulative Return (%) ใน 1 วัน, 1 เดือน, 3 เดือน และ 6 เดือน ตามลำดับ และมีการ Update ทุกวัน

- % Annualized Return: ผลตอบแทนของ Portfolio แบบ Cumulative Time Weight Return (%) ใน 1ปี, 3ปี, 5ปี และ 10ปี ตามลำดับ และจะถูกแปลงให้อยู่ในรูปแบบ หรือ Annualized ผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปี และตัวเลขจะมีการ Update ทุกวัน
- Since Inception: ผลตอบแทนของ Portfolio แบบ Cumulative Time Weight Return (%) ตั้งแต่วันก่อตั้ง Portfolio จนถึงวันทำการปัจจุบัน และจะถูกแปลงให้อยู่ในรูปแบบ หรือ Annualized ผลตอบแทนเฉลี่ยต่อปีและตัวเลขนี้ จะมีการ Update ทุกวัน

### ภาพประกอบ:

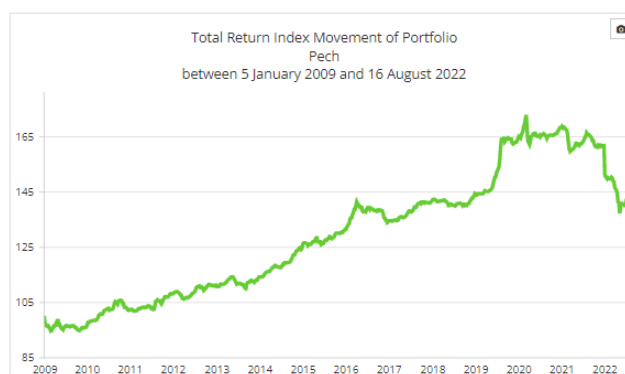
Bond Indices									
Portfolio	Inception Date	Total Return Index	Change	%Change	As of 16 August 2022				
					Average YTM	Average TTM	Average Duration	Average Convexity	
Pech	05-Jan-2009	144.916011	+0.129338	+0.089530	2.896928	10.635921	7.148108	112.173786	

### 6. Bond Indices

- Inception Date: วันเริ่มก่อตั้ง Portfolio หรือวันที่เริ่มการลงทุน
- Total Return Index (%): ดัชนีตัวชี้วัดผลการดำเนินงานของ Portfolio ตั้งวันที่ก่อตั้งจนถึงวันทำการปัจจุบัน
- Change: การเปลี่ยนแปลงของดัชนีเทียบวันทำการปัจจุบันกับวันก่อนหน้า
- Change (%): การเปลี่ยนแปลงของดัชนีเทียบวันทำการปัจจุบันกับวันก่อนหน้า (%)
- Average YTM: อัตราผลตอบแทนถึงวันครบกำหนดเฉลี่ยของ Bond ที่นำมาคำนวณใน Portfolio
- Average TTM: อายุคงเหลือเฉลี่ยของ Bond ที่นำมาคำนวณใน Portfolio
- Average Duration: อายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ที่ถ่วงน้ำหนักด้วยมูลค่าปัจจุบันของกระแสดอกเบี้ยรับที่จะได้ในอนาคต
- Average Convexity: ความผันผวนเฉลี่ยของราคาตราสารหนี้ ที่นำมาคำนวณใน Portfolio

### ภาพประกอบ:

Total Return Index Movement



Remark:

1. ZRR Index does not consider YTM, TTM, duration and convexity.
2. For more information please read Customized Bond Index Manual

7. Total Return Index Movement: กราฟแสดงความเคลื่อนไหวของ Index ตั้งแต่วันเริ่ม Portfolio ถึงวันปัจจุบัน

## ภาพประกอบ:

### Customized Index Portfolio <sup>BETA</sup>

[Back to Customized Index](#)

หลังจากที่สร้าง Portfolio Customized Index เรียบร้อยแล้ว เราสามารถกลับไปหน้าหลักโดยคลิกที่ปุ่ม Back to Customized Index มุมด้านบนขวามือ หน้าจอเปลี่ยนไปยังหน้า Main Customized Bond Index

## ภาพประกอบ:

### Customized Bond Index

[Create Portfolio](#)

16 August 2022

#### Performance

[Download Excel](#)

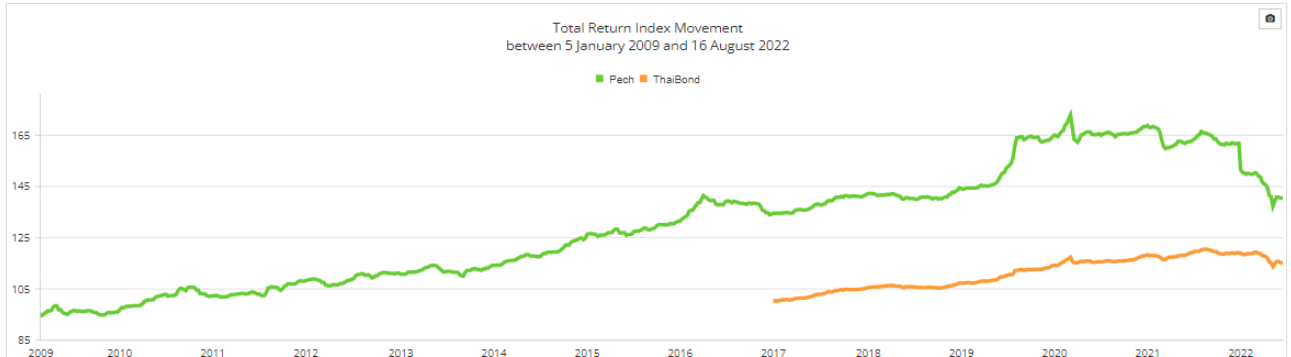
Portfolio	Historical Returns as of 16 August 2022									
	% Cumulative Return					% Annualized Return				
	YTD	1-Day	1-Month	3-Month	6-Month	1-Year	3-Year	5-Year	10-Year	
Pech	-4.04	+0.08	+1.82	+6.27	-2.76	-6.41	-1.84	+2.27	+3.46	+3.26
ThaiBond	-0.44	+0.15	+1.89	+4.46	-0.13	-1.60	+1.77	+2.70	N/A	+3.02

#### Bond Indices

[Download Excel](#)

Portfolio	Inception Date	Total Return Index	Change	%Change	Average YTM	Average TTM	Average Duration	Average Convexity	Download Excel
Pech	05-Jan-2009	144.916011	+0.129338	+0.089330	2.896928	10.635921	7.148108	112.173786	<a href="#">Download</a>
ThaiBond	01-Jan-2017	118.346255	+0.176762	+0.149583	2.395543	4.994596	4.568863	25.277834	<a href="#">Download</a>

#### Total Return Index Movement



#### Remark:



1. ZRR Index does not consider YTM, TTM, duration and convexity.
2. For more information please read Customized Bond Index Manual

หน้า Main จะแสดงผล Performance, Bond Indices และ กราฟ Total Return Index Movement ของทุก Portfolio ที่ผู้สร้างขึ้น เพื่อให้ผู้ใช้ดูข้อมูลได้สะดวก ทั้งยังสรุปความเคลื่อนไหวของดัชนีชี้วัดการลงทุนแต่ละแบบ

ผู้ใช้สามารถคลิกที่ชื่อของ Portfolio แต่ละตัวเพื่อเรียกดูข้อมูลได้ด้วยเช่นกัน โดยจะแสดงผลดังในรูป และใช้งานได้ดังนี้

1. ผู้ใช้สามารถเลือกวันที่ได้จากในช่องปฏิทิน เพื่อเลือกดูข้อมูลย้อนหลังในวันที่ต้องการได้
2. ผู้ใช้สามารถ Save รูป กราฟ Composite of Portfolio
3. ผู้ใช้สามารถเลือก Download Historical Data ได้ในตารางจากหน้านี้เช่นกัน
4. ผู้ใช้สามารถ Save รูป Total Return Index Movement of Portfolio

### วิธีการดาวน์โหลดข้อมูล:

1. ผู้ใช้สามารถ Download ข้อมูลตาราง Performance และ Bond Indices จากแถบ Download Excel ด้านบนของตารางตามเครื่องหมาย 
2. ผู้ใช้สามารถ Download Historical ของ Bond Index หรือข้อมูลย้อนหลังได้จากท้ายตาราง ตามสัญลักษณ์นี้ 

### ประโยชน์:

สรุปข้อมูลดัชนีชี้วัดการลงทุนของ Portfolio สามารถใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงและเปรียบเทียบการลงทุนตราสารแต่ละแบบ ใช้วิเคราะห์ สภาวะหรือแนวโน้มของการลงทุนในตราสารหนี้