



ข่าวจากสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย  
ฉบับที่ 10/2554

6 มิถุนายน 2554

การเปลี่ยนแปลงข้อมูลในระบบ ThaiBMA, iBond, Mark-to-Market และการรายงานข้อมูล  
เพื่อรองรับพันธบัตรชดเชยเงินเฟ้อ (Inflation Linked Bond: ILB)

สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ได้เตรียมการให้บริการข้อมูลพันธบัตรชดเชยเงินเฟ้อ (Inflation Linked Bond: ILB) ที่กระทรวงการคลังเตรียมออกภายในเดือนกรกฎาคม 2554 นี้ ซึ่งจะส่งผลให้มีการเพิ่มและปรับเปลี่ยนการแสดงผล ทำให้ผู้ใช้งานระบบ ThaiBMA, iBond, Mark-to-Market และการรายงานข้อมูล อาจได้รับผลกระทบในการปฏิบัติงาน โดยมีรายละเอียดต่างๆ ดังนี้

1. Inflation Linked Bond: แสดงข้อมูลต่างๆ ที่เกี่ยวข้อง เช่น แนวทางปฏิบัติและการคำนวณราคา, อัตราเงินเฟ้อ (Headline CPI) จากกระทรวงพาณิชย์, Reference CPI, Index Ratio, อัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ย, ข้อมูล Real Yield จากธนาคารแห่งประเทศไทย

The screenshot shows the ThaiBMA website interface. At the top, there is a navigation menu with items: Home, Bond info., Yield Curve, Calculation, Bond Price / Indices, Analysis, Reports, Fact & Figures, Composite Page, User Profile, and Log out. Below the menu, there is a dropdown menu for 'Bond info.' with the following items: Registered Bond, Auction & Result, Bond Search, Issuer Information, Inflation-Linked Bond (highlighted with a red arrow), Bond Update, FRN Rate Search, and News. To the right of the dropdown, there is a 'Service Manager: Kasidit' label. Below the dropdown, there is a section titled 'Inflation-Linked Bond Knowledge' with a list of links: Introduction to ILB (with sub-links for Inflation-Linked Bond and Inflation-Linked Bond Calculation), ILB Calculation Convention (with sub-link for Calculation Convention for Inflation Linked Bond (Draft)), and ILB Articles and Presentations (with sub-links for การลงนามสัญญาพันธบัตรซึ่งพักชำระดอกเบี้ย โดย ศ.ดร.อภัย สินธุวิทย์ and Market Convention for Inflation Linked Bond (ILB) presentation).

ตัวอย่างหน้าแสดงข้อมูลสำหรับ ILB

โดยมีรายละเอียด 4 หัวข้อ ดังนี้

1) Inflation Linked Bond Knowledge

- Introduction to ILB
- ILB Calculation Convention
- ILB Articles and Presentations

2) Information & Tools for Inflation Linked Bond Investment and Trading

- CPI, Reference CPI and Index Ratio
- Bond Info/ Feature
- Price/ Yield Calculation
- RP Reference Yield
- Mark-to-Market Price

3) Real Yield

- Indicative Real Yield Quoted by Primary Dealers
- Real Yield Estimation by The Bank of Thailand

4) Useful Links

2. ILB Calculation: คำนวณราคาพันธบัตร ILB โดยกำหนดให้ใส่ Real YTM(%) หรือ Unadjusted Price(%) อย่างไม่อย่างหนึ่งในการคำนวณ ซึ่งจะแสดงข้อมูล Index Ratio และ Settlement Amount(THB) แต่ในกรณีที่ Settlement Date เกินกว่าข้อมูล Index Ratio ที่ประกาศ ระบบจะทำการคำนวณโดยไม่แสดงข้อมูล Index Ratio และ Settlement Amount(THB)

Calculation

Excel Calculation

**ILB Calculation**

Service Manager : Kasidit (0-2252-3336 # 212 )

Home > ILB Calculation

Bond Calculation		ILB165X	
Symbol : ILB165X	Settlement Date : 08/06/2011 (dd/mm/yyyy)	Trade/Reference Date : 06/06/2011 17:45	Unit : 1
Settlement Date : 08/06/2011 (dd/mm/yyyy)	Real Yield(%) : 1.500000	Index Ratio : 1.006700	Settlement Amount (THB) : 983.65
Trade/Ref. Date : 06/06/2011 (dd/mm/yyyy)	Unadjusted GrossPrice(%) : 97.710057	Unadjusted Clean Price(%) : 97.630605	Unadjusted AI(%) : 0.079452
Trade/Ref. Time : 17 45 h:mm	DSC : 155	DCS : 29	
Real Yield (%) : 1.5	<b>Sensitivity</b>		
No. Unit : 1	PVBP : 0.046660	Macaulay Duration (Yr) : 4.812491	Modified Duration : 4.776666
Unadjusted Price (%) : Clean	Convexity : 25.526632	<b>Term and Feature</b>	
Calc.	Real Coupon Rate/K (%) : 1	Coupon Type : Fixed	Unadjusted Par (THB) : 1,000.00
	XI Period : 10	Frequency of Payment : 2	TTM (Yr) : 4.93

Report to ThaiBMA

ตัวอย่างหน้าแสดง ILB Calculation: กำหนด Real YTM(%)

Service Manager : Kasidit (0-2252-3336 # 212 )

Home > ILB Calculation

Bond Calculation		ILB165X	
Symbol : ILB165X	Settlement Date : 08/06/2011 (dd/mm/yyyy)	Trade/Reference Date : 06/06/2011 17:45	Unit : 1
Settlement Date : 08/06/2011 (dd/mm/yyyy)	Real Yield(%) : 1.304043	Index Ratio : 1.006700	Settlement Amount (THB) : 992.90
Trade/Ref. Date : 06/06/2011 (dd/mm/yyyy)	Unadjusted GrossPrice(%) : 98.629451	Unadjusted Clean Price(%) : 98.549999	Unadjusted AI(%) : 0.079452
Trade/Ref. Time : 17 45 h:mm	DSC : 155	DCS : 29	
Real Yield (%) :	<b>Sensitivity</b>		
No. Unit : 1	PVBP : 0.047152	Macaulay Duration (Yr) : 4.813160	Modified Duration : 4.781980
Unadjusted Price (%) : 98.549999 Clean	Convexity : 25.580822	<b>Term and Feature</b>	
Calc.	Real Coupon Rate/K (%) : 1	Coupon Type : Fixed	Unadjusted Par (THB) : 1,000.00
	XI Period : 10	Frequency of Payment : 2	TTM (Yr) : 4.93

Report to ThaiBMA

ตัวอย่างหน้าแสดง ILB Calculation: กำหนด Unadjusted Price(%)

Service Manager : Kasidit (0-2252-3336 # 212 )

Home > ILB Calculation

Bond Calculation		ILB165X	
Symbol : ILB165X	Settlement Date : 08/12/2011 (dd/mm/yyyy)	Trade/Reference Date : 06/06/2011 17:45	Unit : 1
Settlement Date : 08/12/2011 (dd/mm/yyyy)	Real Yield(%) : 1.400000	Index Ratio : -	Settlement Amount (THB) : -
Trade/Ref. Date : 06/06/2011 (dd/mm/yyyy)	Unadjusted GrossPrice(%) : 98.368515	Unadjusted Clean Price(%) : 98.291803	Unadjusted AI(%) : 0.076712
Trade/Ref. Time : 17 45 h:mm	DSC : 154	DCS : 28	
Real Yield (%) : 1.4	<b>Sensitivity</b>		
No. Unit : 1	PVBP : 0.042311	Macaulay Duration (Yr) : 4.332422	Modified Duration : 4.302306
Unadjusted Price (%) : Clean	Convexity : 20.889388	<b>Term and Feature</b>	
Calc.	Real Coupon Rate/K (%) : 1	Coupon Type : Fixed	Unadjusted Par (THB) : 1,000.00
	XI Period : 10	Frequency of Payment : 2	TTM (Yr) : 4.42

Index Ratio is not available for the input settlement date.

Report to ThaiBMA

ตัวอย่างหน้าแสดง ILB Calculation: กำหนด Real YTM(%) แต่ Settlement Date เกินกว่าข้อมูล Index Ratio ที่ประกาศ

3. Mark-to-Market: การเผยแพร่ราคา Mark-to-Market ของ ILB จะแสดงเป็น Unadjusted Clean Price(%) และ Unadjusted AI(%) โดยจะมีการเพิ่มคอลัมน์สุดท้ายที่แสดงข้อมูล Index Ratio ณ Settlement Date ของพันธบัตร ILB นั้นๆ เพื่อให้ผู้ใช้งานนำไปคำนวณราคาพันธบัตร ILB ที่ถูกปรับโดยเงินเฟ้อแล้ว หากเป็นพันธบัตรอื่นๆ จะแสดงเป็น “-”

The screenshot shows the TBMA website interface. The navigation menu includes Home, Bond info, Yield Curve, Calculation, Bond Price / Indices, Analysis, Reports, Fact & Figures, Composite Page, User Profile, and Log out. The 'Bond Price / Indices' menu is expanded, showing options like End of day trading, Intraday trading, Quotation, Firm Quotation, Mark to Market (selected), Plain Vanilla MTM Pages, Structured Note MTM Page, and RP Reference Yield. The 'Mark to Market' sub-menu is also expanded, showing Download Historical MTM, MTM Pre-paid, and MTM Yield Movement. The main table displays bond data for various maturities and types, with the Index Ratio column highlighted in red.

ตัวอย่างหน้าแสดง Mark-to-Market โดยเพิ่มคอลัมน์ Index Ratio

หาก Download File จะมีการเพิ่มคอลัมน์สุดท้าย (column Z) ที่แสดงข้อมูล Index Ratio ของพันธบัตร ILB นั้นๆ หากเป็นพันธบัตรอื่นๆ จะแสดงเป็น “-”

The screenshot shows a CSV file with columns labeled A through Z. The data includes bond details such as Coupon, Maturity, TTM, Type, Coupon Type, Rating, Last Trade, Last Quotation, Model, Spread, Market Yield, DM, Unadjusted Clean Price, Unadjusted AI, MOD, CONV, Par, Currency, Registration Status, and Index Ratio. The Index Ratio column (Z) contains numerical values for ILB bonds and dashes for other bond types.

ตัวอย่างหน้าแสดงไฟล์ csv จากการ download ในหน้า Mark-to-Market

4. Download Historical MTM: แสดงข้อมูลย้อนหลังของ Mark-to-Market ณ สิ้นวัน ในรูปแบบไฟล์ csv โดยเพิ่มคอลัมน์สุดท้าย (column Z) ที่แสดงข้อมูล Index Ratio ณ Settlement Date ของพันธบัตร ILB นั้นๆ เพื่อให้ผู้ใช้งานนำไปคำนวณราคาพันธบัตร ILB ที่ถูกปรับโดยเงินเฟ้อแล้ว หากเป็นพันธบัตรอื่นๆ จะแสดงเป็น “-”

Home Bond info. Yield Curve Calculation **Bond Price / Indices** Analysis Reports Fact & Figures Composite Page User Profile Log out

Bond Price End of day trading  
 Indices Intraday trading  
 Quotation  
 Firm Quotation  
 Mark to Market  
 RP Reference Yield

Plain Vanilla MTM Pages  
 Structured Note MTM Page  
 Download Historical MTM Plain Vanilla  
 MTM Pre-paid Structured Note  
 MTM Yield Movement

Service Manager

Home > Bond Price > Mark to Market > Download Historical MTM

Historical Mark to Market in CSV Format (Year)  
 (Month) 2011 Go

ThaiBMA Mark to Market		
Date		Download
1 Jun 2011		CSV Format
2 Jun 2011		CSV Format
3 Jun 2011		CSV Format
6 Jun 2011		CSV Format

ตัวอย่างหน้าแสดง Download Historical MTM

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P	Q	R	S	T	U	V	W	X	Y	Z		
1	24-May-11																										
2	BOND	Coupon	Maturity	Source:ThaiBMA																							
3	Government Bonds			TTM (Yrs. Type)	Coupon T	TRIS	FITCH	Last Trade	Last Exec.	Quoted Da	Quoted Yr	Max	Min	Model Yie	Static Spr	Market Yr	DM	Clean Pric	AI %	Modified C	Convexity	Par	Currency	Registrar	Index Ratio		
4	ILB15X	1	10-May-16	4.96	Straight	Fixed		20-May-11	17	24-May-11	1.628571	1.8	1.5	1.628571				97.01054	0.041096	4.81123	25.07465	1000	THB	Register	1.00237		
5	ILB215X	1	10-May-21	3.97	Straight	Fixed		24-May-11	19	24-May-11	1.814286	2	1.8	1.9				91.86163	0.041096	9.389276	95.71571	1000	THB	Register	1.00237		
6	LB116A	1.75	17-Jun-11	0.06	Straight	Fixed		24-May-11	2.57	24-May-11	2.994286	2.9	2.35	2.57				2.57		99.95048	0.762329	0.06224	0.034583	1000	THB	Register	-
7	LB111A	5.375	30-Nov-11	0.52	Straight	Fixed		24-May-11	2.9	24-May-11	2.807143	3.13	2.5	2.9				2.9		101.2525	-0.07363	0.506256	0.505956	1000	THB	Register	-
8	LB123A	4.5	11-Mar-12	0.8	Straight	Fixed		23-May-11	3.08	24-May-11	3.014286	3.25	2.35	3.014286				3.014286		101.1412	0.924658	0.77601	0.369621	1000	THB	Register	-
9	LB121A	4.125	01-Nov-12	1.44	Straight	Fixed		01-Apr-11	2.95	24-May-11	3.098571	3.3	2.95	3.098571				3.098571		101.4145	0.27133	1.307003	2.330065	1000	THB	Register	-
10	LB132A	4.25	13-Mar-13	1.8	Straight	Fixed		24-May-11	3.25	24-May-11	3.247143	3.3	3.05	3.25				3.25		101.6394	0.95	1.7825	3.851145	1000	THB	Register	-
11	LB135A	1.85	29-May-13	2.01	Straight	Floated		09-Jun-10	1.383857	24-May-11	3.166709	3.172721	3.132641	3.166709	-0.6	3.166709	-0.006	99.69657	-0.02027	0.011206	0.020055	1000	THB	Register	-		
12	LB137A	5.25	13-Jul-13	2.14	Straight	Floated		19-May-11	3.33	24-May-11	3.287143	3.37	3.19	3.287143				3.287143		104.0313	1.89863	1.980316	5.058723	1000	THB	Register	-
13	LB137B	2.3475	31-Jul-13	2.18	Straight	Floated		29-Jul-09	1.449994	24-May-11	3.145137	3.15142	3.1111	3.145137	-0.6	3.145137	-0.006	99.61612	0.733192	0.173214	0.059791	1000	THB	Register	-		
14	LB138A	2.64375	18-Sep-13	2.32	Straight	Floated		16-Sep-09	1.470006	24-May-11	3.143137	3.155322	3.11529	3.143137	-0.6	3.143137	-0.006	99.57466	0.825234	0.31038	0.169872	1000	THB	Register	-		
15	LB139A	2.95125	13-Nov-13	2.47	Straight	Floated		29-Nov-10	1.984526	24-May-11	3.158962	3.162963	3.122965	3.158962	-0.6	3.158962	-0.006	99.62508	0.97027	0.461016	0.411143	1000	THB	Register	-		
16	LB130A	4	17-Oct-13	2.4	Straight	Fixed		25-Jan-11	3.12	24-May-11	3.302857	3.42	3.2	3.302857				3.302857		101.586	0.416438	2.264651	6.372766	1000	THB	Register	-
17	LB141A	2.3475	29-Jan-14	2.68	Straight	Floated		01-Dec-10	1.942102	24-May-11	3.153826	3.153826	3.1138	3.153826	0	3.153826	0	99.53904	0.746055	0.17196	0.038886	1000	THB	Register	-		
18	LB143A	8.25	05-Mar-14	2.78	Straight	Fixed		25-Apr-11	3.23	24-May-11	3.328571	3.43	3.2	3.328571				3.328571		112.9324	1.830622	2.479605	7.768633	1000	THB	Register	-
19	LB144A	2.66375	02-Apr-14	2.86	Straight	Floated		31-Mar-10	1.535158	24-May-11	3.158209	3.158209	3.118186	3.158209	0	3.158209	0	99.48953	0.366791	0.347098	0.230294	1000	THB	Register	-		
20	LB145A	4.975	14-May-14	2.97	Straight	Fixed		19-May-10	2.735	24-May-11	3.364286	3.4	3.3	3.364286				3.364286		104.2205	0.146318	2.769306	9.248445	1000	THB	Register	-
21	LB145B	5.25	12-May-14	2.97	Straight	Fixed		24-May-11	3.35	24-May-11	3.36	3.4	3.21	3.35				3.35		105.3342	1.913014	2.690272	8.959315	1000	THB	Register	-
22	LB145C	1.85	31-May-14	3.02	Straight	Floated		26-May-10	1.545158	24-May-11	3.167596	3.167596	3.12758	3.167596	0	3.167596	0	99.54909	-0.03041	0.009973	-0.01005	1000	THB	Register	-		
23	LB145D	2.3475	26-Jun-14	3.02	Straight	Floated		26-May-10	1.545158	24-May-11	3.167596	3.167596	3.12758	3.167596	0	3.167596	0	99.54909	-0.03041	0.009973	-0.01005	1000	THB	Register	-		

ตัวอย่างหน้าแสดงไฟล์ csv จากการ download ในหน้า Download Historical MTM

5. RP Reference Yield: แสดงอัตราผลตอบแทนอ้างอิงในการทำธุรกรรมกู้ยืม (Repo) ในกรณีพันธบัตร ILB คำนวณมาจากอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยจาก Real Yield ที่ได้จาก Primary Dealers (PD) ซึ่งราคาในคอลัมน์ Clean Price(%), Accrued Interest(%) และ Gross Price(%) จะแสดงเป็น Unadjusted Clean Price(%), Unadjusted Accrued Interest(%) และ Unadjusted Gross Price(%) โดยเพิ่มคอลัมน์สุดท้ายที่แสดงข้อมูล Index Ratio ณ Settlement Date ของพันธบัตร ILB นั้นๆ เพื่อให้ผู้ใช้งานนำไปคำนวณราคาพันธบัตร ILB ที่ถูกปรับโดยเงินเฟ้อแล้ว หากเป็นพันธบัตรอื่นๆ จะแสดงเป็น “-”

Home Bond info. Yield Curve Calculation **Bond Price / Indices** Analysis Reports Fact & Figures Composite Page User Profile Log out

Bond Price End of day trading  
 Indices Intraday trading  
 Quotation  
 Firm Quotation  
 Mark to Market  
 RP Reference Yield

Service Manager: Kasidit (0-2252-3336 # 212)

Home > Bond Price > RP Reference Yield > Government bonds

Government Bonds >> 26/05/2011 Go! (dd/mm/yyyy)

Symbol	Settlement Date	Avg Bid Yield	Clean Price(%)	Accrued Interest(%)	Gross Price(%)	Modified Duration	Convexity	Index Ratio
ILB15X	27-May-11	1.628571	97.013690	0.046575	97.060265	4.805794	25.819708	1.002690
ILB215X	27-May-11	1.814286	92.608191	0.046575	92.654766	9.390320	95.724340	1.002690
ILB265X	30-May-11	2.500000	81.325016	0.000000	81.325016	13.653122	203.448940	1.000000
LB116A	27-May-11	2.594286	99.953595	0.771918	100.725513	0.056798	0.031261	-
LB111A	27-May-11	2.807143	101.267136	-0.044178	101.242958	0.501185	0.498310	-
LB123a	27-May-11	3.014286	101.133262	0.949315	102.082577	0.770612	0.978614	-
LB121A	27-May-11	3.098571	101.409994	0.293936	101.702830	1.381607	2.612420	-
LB132A	27-May-11	3.247143	101.710000	0.073700	101.783700	1.706035	0.936004	-

ตัวอย่างหน้าแสดง RP Reference Yield โดยเพิ่มคอลัมน์ Index Ratio

หาก Download File จะมีการเพิ่มคอลัมน์สุดท้าย (column O) ที่แสดงข้อมูล Index Ratio ของพันธบัตร ILB นั้นๆ หากเป็นพันธบัตรอื่นๆ จะแสดงเป็น “-”

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O
1	26-May-11			Source:ThaiBMA											
2	Symbol	Maturity	Avg.Bid	Govt.Inter	TTM (Yrs.)	Spread	Qt Spread	Reference	Settlemer	AI %	Gross Pric	Clean Pric	Modified	Convexity	Index Ratio
3	Government Bonds														
4	ILB165X	10-May-16	1.628571		4.958904	-	-	1.628571	27/05/11	0.046575	97.06027	97.01369	4.805794	25.81971	1.00269
5	ILB215X	10-May-21	1.814286		9.961644	-	-	1.814286	27/05/11	0.046575	92.65477	92.60819	9.39032	95.72434	1.00269
6	ILB265X	30-May-26	2.5		15	-	-	2.5	30/05/11	0	81.32502	81.32502	13.65312	203.4489	1
7	LB116A	17-Jun-11	2.594286		0.057534	-	-	2.594286	27/05/11	0.771918	100.7255	99.9536	0.056798	0.031261	-
8	LB11NA	30-Nov-11	2.807143		0.512329	-	-	2.807143	27/05/11	-0.04418	101.243	101.2871	0.501185	0.49831	-
9	LB123A	11-Mar-12	3.014286		0.791781	-	-	3.014286	27/05/11	0.949315	102.0826	101.1333	0.770612	0.978614	-
10	LB12NA	01-Nov-12	3.098571		1.435616	-	-	3.098571	27/05/11	0.293836	101.7028	101.409	1.381607	2.61242	-
11	LB133A	13-Mar-13	3.247143		1.79726	-	-	3.247143	27/05/11	0.873288	102.5901	101.7169	1.709975	3.830804	-
12	LB135A	29-May-13	3.1668		2.008219	-	-	3.1668	27/05/11	-0.01014	99.69329	99.70342	0.499492	0.501538	-
13	LB137A	13-Jul-13	3.287143		2.131507	-	-	3.287143	27/05/11	1.927397	105.9488	104.0214	1.974925	5.034749	-
14	LB137B	21-Jul-13	3.144824		2.180872	-	-	3.144824	27/05/11	0.746055	100.2671	99.63107	0.172797	0.049817	-

ตัวอย่างหน้าแสดงไฟล์ csv จากการ download ในหน้า RP Reference Yield

### การรายงานข้อมูลการซื้อขายของตราสารหนี้ประเภท ILB

การรายงานข้อมูลการซื้อขายดังกล่าว สามารถรายงานข้อมูลได้ทุกช่องทางในระบบ One-stop Reporting & Self-monitoring System (ORS) โดยมีเงื่อนไขในการรายงานข้อมูลแตกต่างจากตราสารหนี้ทั่วไป ดังนี้

ข้อมูลที่รายงาน	ตราสารหนี้ทั่วไป	ตราสารหนี้ ILB	หมายเหตุ
<b>กรณีการซื้อขาย ILB มี Settlement Date อยู่ในช่วงที่มีข้อมูล Index Ratio</b>			
Yield (%)	YTM (%) เช่น 3%	Real Yield (%) เช่น 1%	
Price (%)	Clean Price (%)	Unadjusted Clean Price (%)	<ul style="list-style-type: none"> <li>กรณีรายงานข้อมูลผ่านช่องทาง Upload Excel File ต้องใส่ค่า Price (%) นี้</li> <li>กรณีรายงานข้อมูลผ่านช่องทางอื่น ไม่ต้องใส่ค่านี้ได้ เนื่องจาก ระบบจะนำค่า Yield (%) มาคำนวณราคาให้โดยอัตโนมัติหลังจากส่งข้อมูลแล้ว</li> </ul>
<b>กรณีการซื้อขาย ILB มี Settlement Date อยู่นอกช่วงที่มีข้อมูล Index Ratio</b>			
Yield (%)	YTM (%) เช่น 3%	ไม่ต้องใส่ข้อมูล (เว้นว่างไว้)	
Price (%)	Clean Price (%)	Adjusted Gross Price (%) (คือราคาที่ส่งมอบต่อหน่วยโดยคิดเป็นร้อยละของ PAR)	ต้องใส่ค่านี้ทุกช่องทางการรายงานข้อมูล

ทั้งนี้ ข้อมูลอื่นๆ ที่ต้องรายงานสำหรับการซื้อขาย ILB จะรายงานเหมือนตราสารหนี้ทั่วไป และไม่มีกรรายงานข้อมูลเพิ่มเติมแต่อย่างใด เช่น วันที่ทำการซื้อขาย (Trade Date), วันที่ส่งมอบ (Settlement Date), วัตถุประสงค์การซื้อขาย (Purpose), ปริมาณการซื้อขาย (Volume) ฯลฯ

## การคำนวณราคา ILB ผ่านระบบ ORS

**One-stop Reporting & Self-monitoring System**

Reporting Channel | List Transactions | Late / Error | Reporting Statistics | Ranking | Dealer's Trading Summary | Contact ThaiBMA | Log out

Upload Excel File  
One-by-One  
Calculation  
Inflation-Linked Bond Calculation

**ILB Calculation**

Symbol: [ ]  
 Settlement Date: 08/06/2011 (dd/mm/yyyy)  
 Trade/Ref. Date: 06/06/2011 (dd/mm/yyyy)  
 Trade/Ref. Time: 09:48:00  
 Real Yield (%): [ ]  
 No. Unit: 1  
 Unadjusted Price (%): [ ] Clean

Settlement Date: [ ] Trade/Reference Date: [ ] Unit: [ ]  
 Real Yield(%): [ ] Index Ratio: [ ] Settlement Amount (THB): [ ]  
 Unadjusted Gross Price(%): [ ] Unadjusted Clean Price(%): [ ] Unadjusted AI(%): [ ]  
 DSC: [ ] DCS: [ ]

Sensitivity  
 PVBP: [ ] Macaulay Duration (Yr): [ ] Modified Duration: [ ]  
 Convexity: [ ]

Term and Feature  
 Real Coupon Rate/K (%): [ ] Coupon Type: [ ] Unadjusted Par (THB): [ ]  
 XI Period: [ ] Frequency of Payment: [ ] TTM (Yr): [ ]

CashFlow >>

Report to ThaiBMA

Symbol	Sett. Date	Traded Date	Real Yield (%)	Unit	Unadjusted Clean price (%)	Unadjusted Gross Price (%)	Unadjusted AI (%)	DSC	DCS	Settlement Amount (THB)	MDD	Convexity
Sum												

Download Excel

**Remark for LB/BOT FRN Re-Open**

- The Re-Open calculation option is applicable for only Floating Rate Note issued by the Thai government (LB FRN) or the Bank of Thailand (BOT FRN).
- If the "Re-Open (LB/BOT FRN)" box is checked, the calculation for LB/BOT FRN will use a set of BIBOR interest rates after 11:00 A.M. as of 2 business days prior to the trade date (T-2).
- The Re-Open calculation option is only available for trade dates from the day after the issue date to the fixing date of last coupon payment.

การคำนวณราคาตราสารหนี้ประเภท ILB นั้น นอกจากจะคำนวณผ่านหน้า Website iBond แล้ว ยังสามารถคำนวณได้จากระบบ ORS ที่เมนู "Reporting Channel" และเลือก "ILB Calculation" โดยให้ใส่ข้อมูลสำหรับการคำนวณเหมือนตราสารหนี้ทั่วไป ทุกประการ ยกเว้น ค่า Yield (%) ให้ใส่ค่า Real Yield (%) แทน นอกจากนี้ ยังสามารถรายงานการซื้อขายดังกล่าวมาที่ ThaiBMA ได้โดยการกดปุ่ม Report to ThaiBMA

## การส่งข้อมูล ILB Quotation

Primary Dealer มีหน้าที่ต้อง Quote "Real Yield" ของตราสาร ILB นี้ ผ่านช่องทางการ Quote เดียวกันกับการ Quote ตราสาร LB ทั่วไป (Website ThaiBMA/ Mkt. Watch/ Quotation Page) และจัดส่งมาพร้อมกันก่อน 16:00 น. ของทุกวันทำการ ซึ่งรายชื่อตราสาร ILB ที่จะ Quote จะอยู่ส่วนล่างของรายชื่อตราสาร LB ทั่วไป

LB233A		*	*
LB236A		*	*
LB244A		*	*
LB24DA		*	*
LB25DA		*	*
LB267A		*	*
LB283A		*	*
LB296A		*	*
LB316A		*	*
LB383A		*	*
LB396A		*	*
LB406A		*	*
LB416A		*	*
LB616A		*	*
Quotes for Government ILB			
ILB165X		*	*
ILB215X		*	*
ILB265X		*	*

RESET SUBMIT

ในกรณีที่ท่านต้องการข้อมูลเพิ่มเติมสามารถติดต่อโทรศัพท์ 0-2 252-3336

ฝ่ายบริการราคาตราสารหนี้และพัฒนาผลิตภัณฑ์ ต่อ 212, 215, 217, 218 email address: [pricing@thaibma.or.th](mailto:pricing@thaibma.or.th)

ฝ่ายกำกับดูแล ต่อ 310, 312, 315 email address: [report@thaibma.or.th](mailto:report@thaibma.or.th)

ฝ่ายบริการและสื่อสารองค์กร ต่อ 110, 115, 119 email address: [bis@thaibma.or.th](mailto:bis@thaibma.or.th)