คู่มือผู้ใช้งานระบบ Smart Funding Solution

ระบบสนับสนุนบริษัทผู้ออกตราสารหนี้ในการบริหารจัดการตราสารหนี้ การวิเคราะห์จังหวะ โอกาส และจำลองการออกตราสารหนี้รุ่นใหม่ แสดงข่าวสารที่เกี่ยวข้อง

เอกสารเวอร์ชัน 2.0







สารบัญ

การเข้าสู่ระบบ Smart Funding Solution	3
การดู Maturity profile ข้อมูลตราสารหนี้คงค้างทั้งหมด	4
การดู Payment ข้อมูลการจ่ายเงินต้นและดอกเบี้ยของบริษัท	6
การจำลอง New issue simulation ออกตราสารหนี้รุ่นใหม่	7
การดู Issuance information ข้อมูลประกอบการออกตราสารหนี้	12
การดู News ข้อมูลข่าวสารที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้	15



ระบบ Smart Funding Solution คือ ระบบสนับสนุนบริษัทผู้ออกตราสารหนี้ในการบริหาร จัดการตราสารหนี้คงค้างทั้งเงินต้นและดอกเบี้ยแต่ละงวด การวิเคราะห์จังหวะ โอกาส และจำลอง การออกตราสารหนี้รุ่นใหม่ด้วยต้นทุนที่เหมาะสม รวมถึงแสดงข่าวสารที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้ เพื่อให้ผู้ออกไม่พลาดทุกความความเคลื่อนไหวในตลาด ซึ่งประกอบด้วย 5 ฟังก์ชันมีรายละเอียด ดังต่อไปนี้

การเข้าสู่ระบบ Smart Funding Solution

- 1. เข้าสู่ระบบผ่านทางเว็ปไซต์ Smart Funding Solution ที่ <u>https://trogon.thaibma.or.th/sf</u>
- 2. กรอกรหัสผู้ใช้และรหัสผ่าน
- 3. กดปุ่ม Login เพื่อเข้าสู่ระบบ

SFS -	
Smart Funding Solution	
Username	
Password	
Login Logout	

 ผู้ใช้อ่านข้อจำกัดความรับผิด ถ้าหากท่านเห็นด้วยและยอมรับเงื่อนใขการใช้งานระบบแล้ว ผู้ใช้ทำการ กด ปุ่ม Yes, I agree เพื่อเข้าใช้ระบบงาน แต่หากท่านผู้ใช้ไม่เห็นด้วยหรือไม่ยอมรับสามารถกดปุ่ม No, I Decline เพื่อออกจากระบบ



<section-header><text><text><text><text><text><list-item><list-item><list-item><list-item><list-item><list-item>

การดู Maturity profile ข้อมูลตราสารหนี้คงค้างทั้งหมด

คลิกเมนู Maturity Profile แล้วหน้าจอจะแสดงมูลค่าหนี้คงค้างของตราสารหนี้ปัจจุบันในช่วงเวลาและการ นำเสนอในหลากหลายรูปแบบดังนี้

- 1. แสดงมูลค่าหนี้, วันที่และตราสารหนี้ใกล้จะครบกำหนดที่สุด
- แสดงมูลค่าหนี้, วันที่และตราสารหนี้ที่จะครบกำหนดภายในเดือนปัจจุบันนี้
- 3. แสดงมูลค่าหนี้, วันที่และตราสารหนี้ที่จะครบกำหนดภายในเดือนหน้าหรือถัดไป
- กราฟแท่งแสดงมูลค่าหนี้คงค้างโดยแสดงตามปี และเดือนที่ครบกำหนดอายุชำระคืน ซึ่งครั้งแรกจะแสดง ข้อมูล 3 ปี และต้องการดูข้อมูลเพิ่มสามารถกดปุ่ม Load more เพิ่มเติม หรือคลิ๊กลิ้ง All เพื่อดูกราฟสรุป หนี้คงค้างรายปีเท่านั้น
- แสดงมูลค่าสรุปมูลค่าของหนี้คงค้างทั้งหมด แสดงสัดส่วนของหนี้ระยะสั้นและยาว และแสดงอัตราดอกเบี้ย และอายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ของบริษัท
 - 5.1. ถ้าคลิกลิ้ง Group by TTM จะแสดงข้อมูลตามอายุคงเหลือ
 - 5.2. ถ้าคลิกลิ้ง Group by Tenor จะแสดงข้อมูลตามอายุตราสาร ณ วันออก
- แสดงมูลค่าสรุปหนี้คงค้างทั้งหมด และอัตราดอกเบี้ยและอายุเฉลี่ยของตราสารหนี้ ของกลุ่มธุรกิจและมีเรท ติ้งเท่ากันบริษัทท่านผู้ใช้งาน
- 7. ตารางแสดงรายการวันที่ครบกำหนดของแต่ละตราสารหนี้แต่ละรุ่น พร้อมมูลค่าหนี้คงค้างที่เหลือ
- 8. คลิกลิ้ง All Detail จะแสดงตารางรายละเอียดข้อมูลตราสารหนี้แต่ละรุ่นแสดงรายละเอียด ได้แก่ สัญลักษณ์ตราสารหนี้ วันที่วันออก วันที่ครบกำหนด อายุคงเหลือ มูลค่าการออก และคงค้าง





Maturity F	rofile Payment Simula	tion Saved Simulation I	ssuance Information News				Include Perps Until N	ext Call Profile Logout
RR-MK PUBLIC	COMPANY LIMITED							Position Date : 16-Jan-2021
Short term bond								
	6-2-00A	Includes in a lot		The last state and the second states and a	and a start start start start			Print Print
	STMBOL	ISSUED DATE	MATCHOTT DATE	TIME TO MALORITY (THG.)	ISSUE SIZE (MLN.)	OUTSTANDING (MCR.)	BUND HOLDER NEW.	HEMARK
•	RRMK212A	13 May 2020	13 Feb 2021	0.76	3,632.00	3,632.00	KIB	
	NOMA212G	29 Sep 2020	20 Peb 2021	0.39	3,450.00	3,450.00	KID	
Long term bond								
	SYMBOL	ISSUED DATE	MATURITY DATE	TIME TO MATURITY (YRS.)	ISSUE SIZE (MLN.)	OUTSTANDING (MLN.)	BOND HOLDER REP.	REMARK
	RRMK213C	18 Mar 2016	18 Jan 2021	4.84	1,382.00	1,382.00		
	RRMK2128	18 Jan 2019	18 Feb 2021	2.09	5,614.00	5,614.00	ктв	
•	RRMK213A	27 Mar 2014	27 Mar 2021	7.01	4,049.10	4,049.10	ктв	
	RRMK2138	27 Mar 2014	27 Mar 2021	7.01	5,835.00	5,835.00	ктв	
	RRMK2188	22 Aug 2014	22 Aug 2021	7.01	3,236.00	3,236.00	КТВ	
	CPALLIGPA	30 Nov 2016	30 Nov 2021	100.07	10,000.00	10,000.00	КТВ	Call Option
) a (RRMK221A	18 Jan 2019	18 Jan 2022	3.00	5,000.00	5,000.00	КТВ	
	RRMK226A	30 Jun 2015	30 Jun 2022	7,01	3,000.00	3,000.00		
	CPALL17PA	22 Aug 2017	22 Aug 2022	100.07	10,000.00	10,000.00	ктв	Call Option
	RRMK22NA	30 Nov 2017	30 Nov 2022	5.00	9,000.00	2,000.00	ктв	Call Option
	RRMK233A	18 Mar 2016	18 Mar 2023	7.00	937.00	937.00		
	RRMK2338	29 Sep 2020	18 Mar 2023	2.47	6,000.00	8,000.00	ктв	
	RRMK238A	26 Aug 2016	26 Aug 2023	7.00	500.00	500.00		
	RRMK230A	31 Oct 2013	31 Oct 2023	10.01	4,132.00	4,132.00	SCB	
	RRMK230B	31 Oct 2013	31 Oct 2023	10.01	10,990.00	10,990.00	SC8	
+	RRMK243A	27 Mar 2014	27 Mar 2024	10.01	5,379.20	5,379,20	KTB	
	RRMK2438	27 Mar 2014	27 Mar 2024	10.01	9,934.50	8,934.50	ктв	
	RRMK256B	29 Sep 2020	30 Jun 2025	4.75	13,200.00	13,200.00	ктв	
*	RRMK263A	18 Mar 2016	18 Mar 2026	10.01	2,074.00	2,074.00		Call Option
	RRMK268A	26 Aug 2016	26 Aug 2026	10.01	748.00	748.00		
	RRMK26DA	26 Dec 2014	26 Dec 2026	12.01	4,000.00	4,000.00	КТВ	Call Option
			Total		122,092.80	122,092,80		



การดู Payment ข้อมูลการจ่ายเงินต้นและดอกเบี้ยของบริษัท

คลิกเมนู Payment หน้าจอจะประกอบด้วยการแสดงมูลค่าเงินต้นและดอกเบี้ยที่บริษัทต้องชำระในแต่ละปี แต่ ละเดือน รวมถึงรายละเอียดของมูลค่าและวันที่ต้องชำระ ดังต่อไปนี้

- 1. แสดงมูลค่าเงินต้นและดอกเบี้ย พร้อมทั้งชื่อและจำนวนตราสารหนี้ ที่ต้องจ่ายที่กำลังจะมาถึง
- 2. แสดงมูลค่าเงินต้นและดอกเบี้ย พร้อมทั้งชื่อและจำนวนตราสารหนี้ ที่ต้องจ่ายทั้งหมดในเดือนนี้
- แสดงมูลค่าเงินต้นและดอกเบี้ย พร้อมทั้งชื่อและจำนวนตราสารหนี้ ที่ต้องจ่ายทั้งหมดในเดือนหน้าหรือ เดือนถัดไป
- 4. กราฟแท่งแสดงมูลค่าเงินต้นและดอกเบี้ย ซึ่งต้องชำระโดยแสดงตามปีและแต่ละเดือน
- ตารางวันที่ต้องชำระคืนเงินต้นและดอกเบี้ย พร้อมชื่อบริษัทนายทะเบียน บริษัทผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้
- ตารางสรุปจำนวนดอกเบี้ยและเงินต้นที่ต้องชำระหนี้รายเดือน และคลิกลิ้ง more detail เพื่อดู รายละเอียดการงวดชำระเงินต้นและดอกเบี้ย ได้แก่ วันที่ชำระเงิน สัญลักษณ์ตราสารหนี้ ดอกเบี้ย เงิน ต้น ความถี่ของการชำระดอกเบี้ย วันออกและครบกำหนดของตราสาร พร้อมสรุปยอดรวมรายเดือนและ รายปี





การจำลอง New issue simulation ออกตราสารหนี้รุ่นใหม่

คลิกเมนู Simulation และผู้ใช้สามารถเลือกช่วงอายุที่เหมาะสมกับโครงสร้างหนี้สินปัจจุบันของบริษัท ระบบ จะแสดงอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงของตราสารหนี้รุ่นเทียบเคียงให้ เพื่อช่วยประมาณการต้นทุนและกระแสเงินสด จ่ายโดยสามารถจำลองการออกตราสารหนี้ใหม่ได้หลาย scenario

- 1. สามารถดูกราฟแท่งแสดงมูลหนี้คงค้างทั้งหมดในปัจจุบัน แบ่งตามรายเดือน
 - 1.1. เมาส์วางและเลื่อนบนแท่งกราฟ เพื่อแสดงมูลค่าหนี้ที่ต้องชำระ และประมาณการยอดที่จะทำการออก เพิ่มเติม โดยมูลค่าหนี้ของตราสารหนี้ออกใหม่จะรวมอยู่ในแท่งกราฟด้วย
 - 1.2. ขยายขนาดของแท่งกราฟโดยลากเพื่อเพิ่มหรือลดช่วงระยะเวลาการชำระคืนหนึ่
 - 1.3. สามารถเลือกได้ว่าจะแสดงแท่งกราฟเฉพาะมูลค่าหนี้คงค้างปัจจุบันหรือตราสารหนี้ออกใหม่
- 2. ทดลองจำลองการออกตราสารหนี้ ได้โดยระบุข้อมูล ได้แก่
 - 2.1. จำนวน ปี เดือน วัน ที่ต้องการออกตราสารหนี้
 - 2.2. หรือวันครบกำหนดชำระหนี้
 - 2.3. หรือวันออกตราสารหนี้
 - 2.4. ปริมาณการออกตราสารหนี้
 - 2.5. ระบบจะแสดงอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงของตราสารหนี้รุ่นเทียบเคียงให้ โดยผู้ใช้งานสามารถปรับเพิ่มหรือ ลดค่าดอกเบี้ยตามที่ต้องการได้
 - 2.6. ความถี่ของการจ่ายดอกเบี้ย
- 3. ระบบจะสร้างงวดชำระคืนจ่ายดอกเบี้ยและคืนเงินต้น (Cashflow) ให้อัตโนมัติ
- ถ้าต้องการจำลองการออกตราสารหนี้รุ่นใหม่ถัดๆ มา ให้ทำการกดปุ่ม Add more scenario พร้อมทั้งทำ ตามขั้นตอนในข้อที่ 2 ใหม่อีกครั้ง
- 5. ระบบจะแสดงกราฟผลการจำลองของการออกตราสารใหม่ ซึ่งจะประกอบด้วยกราฟแท่ง 3 รูป ได้แก่
 - 5.1. กราฟแสดงมูลค่าชำระคืนเงินต้น แบ่งตามรายปี หรือ รายเดือน
 - 5.2. กราฟแสดงมูลค่าชำระคืนเงินต้น แบ่งตามรายปี หรือ รายเดือน
- 5.3. กราฟแสดงมูลค่ารวมชำระคืนดอกเบี้ยและเงินต้น แบ่งตามรายปี หรือ รายเดือน

ผู้ใช้งานสามารถคลิกเลือกการแสดงผลกราฟข้อมูลในรูปแบบรวมหรือแยกระหว่าง มูลค่าหนี้ปัจจุบันและการ จำลองได้

- 6. หากท่านผู้ใช้งานต้องการบันทึกการจำลองการออกนั้น ผู้ใช้งานต้องทำการกรอกข้อมูล ดังต่อไปนี้
 - 6.1. กรอกชื่อแบบจำลอง
 - 6.2. กรอกชื่อนายทะเบียน
 - 6.3. กรอกชื่อ Tag เพื่อใช้สำหรับในการค้นหา



- ทำการกดปุ่ม Save เพื่อบันทึกข้อมูลจำลองการออกตราสารหนี้ โดยที่ข้อมูลการจำลองที่ผู้ใช้งานบันทึกไว้ จะจัดเก็บบนเครื่องของผู้ใช้งานเท่านั้น เพื่อปกป้องความเป็นส่วนตัว
- 8. **กดปุ่ม Export** ผลการจำลองการออกตราสารหนี้ เก็บไว้ภายนอกระบบ
- 9. **กดปุ่ม Import** ข้อมูลการจำลองการออกตราสารหนี้ จากไฟล์ซึ่งเก็บไว้จากข้อที่ 8 หากต้องการรวมหลายๆ การจำลองที่เคยทำผ่านมาและเก็บไว้ในรูปแบบไฟล์
 - 9.1. เลือกไฟล์ที่เคยต้องการเรียกข้อมูลการจำลองขึ้นมาแสดง ยกตัวอย่างเช่น export.sav ซึ่งผู้ใช้สามารถ ปรับเปลี่ยนชื่อไฟล์ได้ตามที่ต้องการ พร้อมทั้งบริหารจัดการเพื่อการจัดเก็บไปในเครื่องคอมพิวเตอร์ได้ ด้วยตนเอง
 - 9.2. กดปุ่ม Open
- 10. ระบบทำการโหลดข้อมูลที่บันทึกไว้ในไฟล์ export.sav ขึ้นมาแสดงผลที่หน้าจอ
- สามารถคลิกตารางสรุปข้อมูลการออกตราสารใหม่ เพื่อแสดงการจ่ายคืนดอกเบี้ยและเงินต้นในแต่ละงวด
 11.1. ระบบทำการแสดงตารางจำนวนงวดของวันที่ อัตราดอกเบี้ย มูลค่าดอกเบี้ยและเงินต้นที่ต้องจ่ายคืน





- 9 -



Maturity Profile Payment Simulation Saved Simulat	ion Issuance Information	News		Include Perps Until Next Call	Profile Logout
RR-MK PUBLIC COMPANY LIMITED				Position	Date : 17-Jan-2021
Scenario: BondSimulation1				Average C Average T	ost 2.32% erm 4.50Yrs.
CODE	ISSUE DATE	MATURITY DATE	SIZE(MLN.)	CASHFLOWS(LENGTH)	
BondSimulation1 Scenario 1	17 Jan 2021	19 Jul 2025	10,000.00	9	
Simulation Results					
Yearly Monthly 3 Month 6 Month 1 Year 5 Y	Year 10 Year All	Total Payment ng Principal 🧧 Simulated Interest 🔳 S	Simulated Principal	□Interest □ Principal ☑ Total	Export Excel
Torong 1000000	Jul 25 Simulate Principal 10,000,00 M Simulate Internat 115.89 M	A) A) A) A) 27 Où 27 A) 28 Où 28 A) 29 A)) 0el 29 Agr 30 0el 31	0 Aý21 0431 Aý22 0422 Aý2	3 Oct 33 Apt 34 O
Scenario; Bond Simulation1				Average Cost Average Term	2.32% 4.50Yrs.
CODE	ISSUE DATE	MATURITY DATE	SIZE(MLN.)	CASHFLOWS(LENGTH)	
BondSimulation1[Scenario 1	17 Jan 2021	19 Jul 2025	10,000.00	9	
Simulation Results					
Yearly Monthly	Tota	I Payment	Lated Drinsipal	terest Principal Total Ex	port Excel
	Existing interest Existing P	nincipal a Sindiated interest a Sind	uated Frincipai		
8 in xin xin xin xin xin	2006 2017	adas ados ados	2d31	zelis zelis	2005
EXPORT IMPORT 9					







	11/ Jan 2021	- 19 Jul 20	25 11.	1
RMK	(256A)			
ndex	payment date	coupon (%)	interest (MIn.)	principal (MIn.)
1	18 Jul 2021	2.324225	115.89	0.00
2	18 Jan 2022	2.324225	117.17	0.00
3	18 Jul 2022	2.324225	115.26	0.00
4	18 Jan 2023	2.324225	117.17	0.00
5	18 Jul 2023	2.324225	115.26	0.00
6	18 Jan 2024	2.324225	117.17	0.00
7	18 Jul 2024	2.324225	115.89	0.00
8	18 Jan 2025	2.324225	117.17	0.00
9	19 Jul 2025	2.324225	115.89	10,000.00



การดู Issuance information ข้อมูลประกอบการออกตราสารหนี้

คลิกเมนู Issuance information เพื่อเรียกดูข้อมูลที่จำเป็นเบื้อต้นสำหรับเตรียมการออกหุ้นกู้ เช่น เส้นอัตรา ผลตอบแทนพันธบัตรและหุ้นกู้ ส่วนชดเชยความเสี่ยงของหุ้นกู้ในเรทติ้งและช่วงอายุต่างๆ ต้นทุนการออกหุ้นกู้ ในเรทติ้งหรือกลุ่มธุรกิจเดียวกันย้อนหลัง เป็นต้น

- คลิกเมนู Corporate bond yield curve เพื่อดูกราฟอัตราผลตอบแทนหุ้นกู้ ณ ปัจจุบัน แบ่งตามช่วง อายุคงเหลือและอันดับความน่าเชื่อถือของบริษัทผู้ออก
- 2. คลิกเมนู Government bond yield curve กราฟอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล ณ ปัจจุบัน
- คลิกเมนู Credit spread by rating กราฟแสดงส่วนชดเชยความเสี่ยงของหุ้นกู้ล่าสุด (หน่วยเป็น basis point) เมื่อเปรียบเทียบกับอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลในช่วงอายุคงเหลือเดียวกัน (spread over government bond) แบ่งตามอันดับความน่าเชื่อถือ โดยจะ update ทุกสัปดาห์
- 4. คลิกเมนู Credit spread movement กราฟแสดงความเคลื่อนไหวของ credit spread สามารถเลือก แสดงตามช่วงเวลาที่สนใจได้ โดยแบ่งตามอายุคงเหลือและอันดับความน่าเชื่อถือ
- คลิกเมนู Coupon movement กราฟแสดงข้อมูลต้นทุน (coupon) ของหุ้นกู้ที่เคยออกมาในอดีต สามารถเลือกแสดงตามกลุ่มธุรกิจ โดยแบ่งตามอายุของหุ้นกู้ ณ วันออก (issue term) และอันดับความ น่าเชื่อถือ
- คลิกเมนู Credit spread at issue by sector กราฟแสดงข้อมูล spread ของหุ้นกู้ ณ วันออก สามารถ เลือกแสดงตามกลุ่มธุรกิจในแต่ละรายไตรมาสได้
- คลิกเมนู Issuance history กราฟแสดงประวัติข้อมูล spread ของหุ้นกู้ ณ วันออก ของบริษัทผู้ใช้งาน สามารถเลือกแสดงตามอายุของหุ้นกู้ ณ วันออก (issue term)





- 13 -













- 14 -



Corporate bond yield curve	Governm	ent bond yield	curve Cr	edit spread by	ating Credit sp	read movement C	oupon movement Credi	it spread at issue by sector	uance history	
					RR-MI	As of 17	Jan 2021	10++ Yrs,	13	
	240.00					•			•	
(Investigation	180.00-	• :		:	•	• :	•	:		
Street	120.00-	•	8	•		•		•	•	
	60.00 -		•							

การดู News ข้อมูลข่าวสารที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้

คลิกเมนู News เพื่อเรียกดูข้อมูลข่าวสารเกี่ยวข้องกับความความเคลื่อนไหวในตลาด



สามารถค้นหาระบุช่วงวันที่ข่าวที่ต้องการค้นหา กลุ่มธุรกิจ และชื่อบริษัท เป็นต้น

10 * < 1 >