

SOE Spread Matrix

ภาพประกอบ:

SOE Spread Matrix

Download Historical :

SOE Spread Matrix as of 24 April 2023

Issuer	3M	1Y	3Y	5Y	10Y	15Y
BAAC	15.0000	20.0000	34.5000	45.0000	45.0000	51.6667
BMTA	15.6667	22.3333	27.5000	43.3333	47.3333	57.3333
GGLBBAAC	10.0000	10.3333	16.0000	21.6667	28.3333	41.6667
GHB	14.0000	20.0000	30.0000	40.0000	43.3333	51.6667
GSB	13.3333	21.6667	25.0000	35.0000	40.0000	51.6667
NHA	15.0000	21.6667	27.5000	43.3333	49.3333	59.0000
PWA	10.0000	17.5000	25.0000	35.0000	45.6667	52.6667
SME	10.0000	14.0000	25.0000	34.3333	40.0000	45.0000
SRT	10.0000	17.5000	27.5000	35.0000	46.6667	55.0000

items per page 1 - 9 of 9 items

Remark :

1. This page is designed to provide the REFERENCE YIELD SPREADS for the Bilateral Repurchase Agreement between the Bank of Thailand and Primary Dealers.
2. The above reference yield spreads are averaged spreads over government bonds, quoted by BOT's Primary Dealers on weekly basis (7th, 15th, 22nd, and last business date of the month).
3. The classification of SOE bonds and Time to Maturity periods are defined by the Sub-Working Committee under the Secondary Bond Market Development Taskforce led by the Bank of Thailand.
4. Reference yields of FIDF bonds are separately quoted by issue.

SOE Spread Matrix เป็นตารางแสดงส่วนชดเชยความเสี่ยงของรัฐวิสาหกิจที่เป็นผู้ออกพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ ซึ่งส่วนชดเชยความเสี่ยงนี้จะถูกบวกเพิ่มขึ้นจากอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล เพื่อสะท้อนความเสี่ยงด้านต่างๆ ของพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ โดยตารางแบ่ง Spread ตามอายุคงเหลือ เป็นรายผู้ออกตราสาร

ที่มาของข้อมูล และหลักการคำนวณ:

ส่วนชดเชยความเสี่ยงอ้างอิงนี้ได้มาจากการ Quote ของ Primary Dealers ซึ่งจะ Quote ทุกสัปดาห์ (ทุกวันที่ 7, 15, 22 และวันทำการสุดท้ายของเดือน) Primary Dealers จะ Quote มาเป็นราย Issuer โดยแต่ละ Issuer จะแบ่ง Tenor ออกเป็น 3 เดือน, 1 ปี, 3 ปี, 5 ปี และ 7 ปี จากนั้นจึงทำการหาค่าเฉลี่ย Spread โดยที่ Spread ที่ไม่อยู่ระหว่าง ค่าเฉลี่ย +/- SD จะถูกตัดทิ้ง และทำการหาค่าเฉลี่ยอีกครั้ง

ผู้ใช้สามารถเรียกดู Spread Matrix ย้อนหลังเป็นรายวัน โดยการเลือกวัน Quote ที่ต้องการในช่องเหนือตาราง หากต้องการดาวน์โหลดข้อมูลรายวันหลังจากเลือกวันที่ต้องการแล้วกด Download Excel นอกจากนี้ผู้ใช้สามารถเรียกดู SOE Spread Matrix ย้อนหลังรายปีได้ โดยการระบุปีที่ต้องการในช่อง Download Historical แล้วกด Go

ประโยชน์:

ตารางนี้ถูกออกแบบมาเพื่อเป็นแหล่งอ้างอิงส่วนชดเชยความเสี่ยงของรัฐวิสาหกิจเพื่อประโยชน์สำหรับการทำราคา การประมูลและซื้อขาย รวมถึงการทำธุรกรรม Bilateral Repurchase Agreement ระหว่างธนาคารแห่งประเทศไทย และ Primary Dealers