



ข่าวสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย  
ฉบับที่ 13/2555

23 สิงหาคม 2555

ThaiBMA ปรับปรุงข้อมูล Transition Probability Matrix เป็นข้อมูลปี 2012

สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ได้ปรับปรุงการให้บริการข้อมูล Transition Probability Matrix ซึ่งแสดงถึงความน่าจะเป็นของการเปลี่ยนแปลงอันดับเครดิตของตราสารหนี้ไทย ซึ่งมีคุณสมบัติสอดคล้องเต็มที่กับทฤษฎีการเงิน เพื่อเป็นประโยชน์แก่นักลงทุนที่ลงทุนในตราสารหนี้ และผู้ร่วมตลาด ในการใช้เป็นเครื่องมือประกอบการตัดสินใจสำหรับการลงทุนในตราสารหนี้ ทาง ThaiBMA จะมีการปรับปรุงข้อมูลปีละหนึ่งครั้ง ซึ่งข้อมูล ณ ปัจจุบันเป็นข้อมูลของปี 2012 โดยจะเริ่มมีผลตั้งแต่วันที่ 23 สิงหาคม 2555 เป็นต้นไป

อนึ่งข้อมูล Transition Probability Matrix ได้รับความอนุเคราะห์จาก ศ.ดร.อัญญา ชันฉวีทิพย์ ภายใต้ความร่วมมือของ คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ บริษัท ทริส เรตติ้ง จำกัด และสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

Thammasat-ThaiBMA-TRIS Transition Probability Matrix (As of 2012)

[\[Download\]](#)

อันดับ ณ คำนวณ	อันดับ ณ สิ้นปี							
	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC/C	Default
AAA	88.84%	10.46%	0.50%	0.05%	0.07%	0.03%	0.05%	0.01%
AA	0.58%	90.01%	8.65%	0.56%	0.06%	0.08%	0.02%	0.02%
A	0.01%	2.85%	93.07%	3.63%	0.13%	0.06%	0.01%	0.25%
BBB	0.00%	0.10%	6.31%	88.05%	2.58%	0.70%	0.04%	2.23%
BB	0.02%	0.04%	0.25%	6.60%	82.87%	7.22%	0.75%	2.24%
B	0.00%	0.05%	0.15%	0.26%	6.31%	83.15%	5.01%	5.07%
CCC/C	0.00%	0.01%	0.20%	0.30%	0.91%	15.96%	51.30%	31.32%
Default	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	100.00%

The Matrix is engineered by Professor Anya Khanthavit of Thammasat University under the collaboration of Thammasat Business School, ThaiBMA and TRIS Rating.

ในกรณีที่ท่านต้องการข้อมูลเพิ่มเติม สามารถติดต่อฝ่ายบริการราคาตราสารหนี้และพัฒนาผลิตภัณฑ์ได้ที่เบอร์โทรศัพท์ 0-2252-3336 ต่อ 218 email address: [pricing@thaibma.or.th](mailto:pricing@thaibma.or.th)