

Bond Price

ภาพประกอบ:

Bond Price

Symbol	LB666A
<input type="button" value="Search"/>	
Symbol :	LB666A
Last Traded Date :	18-Apr-2023
Last Traded Yield (%) :	3.570000
Last Quoted Date :	21-Apr-2023
Last Quoted Yield (%) :	3.567045
Date :	21 Apr 2023
Model Yield (%) :	3.567045
Market Yield (%) :	3.567045
Clean Price (%) :	109.50

Remark :

1. Market Yield is used for marking-to-market process of Fund Management Businesses according to the SEC announcement.
2. The above price is lagged 24 hours from real-time Mark to Market Price and has been displayed at 6.01 p.m. of next calendar day.
3. The prices shown in the Clean Price Column of the Traded-by-price bonds are gross price.

ความหมาย:

- Symbol: สัญลักษณ์ของตราสารหนี้ที่กำหนดขึ้นโดย ThaiBMA
- Last Trade Date: วันที่มีการซื้อขายล่าสุด
- Last Trade Yield: อัตราผลตอบแทนซื้อขายจากการซื้อขายล่าสุด (ร้อยละ)
- Last Quotation Date: วันซึ่งมีการส่งราคาเสนอซื้อจากผู้ซื้อขายตราสารหนี้ตั้งแต่ 3 รายขึ้นไปครั้งล่าสุด
- Last Quotation Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราเสนอซื้อในครั้งล่าสุด (%)
- Date: ราคา ณ สิ้นวันของวันที่อ้างอิง
- Model Yield (%): อัตราผลตอบแทนจากแบบจำลองทางทฤษฎี (ร้อยละ) และส่วนชดเชยความเสี่ยง (Spread) หน่วยเป็น bp
- Market Yield: อัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ที่ใช้อ้างอิง ณ สิ้นวัน หน่วยเป็นร้อยละ
- Clean Price (%): ราคาไม่รวมดอกเบี้ยค้างรับ หน่วยเป็นร้อยละเทียบกับมูลค่าหน้าตั๋ว

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) ซึ่งจะทำการส่งอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลมาให้ 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

