



ข่าวจากสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
ฉบับที่ 4/2555

10 กุมภาพันธ์ 2555

ThaiBMA เตรียมเพิ่มข้อมูล Breakeven Inflation ในเว็บ iBond

สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ได้เตรียมเพิ่มการให้บริการข้อมูล Breakeven Inflation (BEI) ซึ่งแสดงถึงอัตราเงินเฟ้อที่คาดการณ์โดยผู้ค้าตราสารหนี้ของพันธบัตรชดเชยเงินเฟ้อ (Inflation Link Bond : ILB) ณ ช่วงเวลานั้นๆ ซึ่งข้อมูล Breakeven Inflation นี้สามารถประมาณการณได้จากข้อมูลอัตราผลตอบแทนเสนอซื้อที่แท้จริงเฉลี่ยของ ILB (Average Bidding Real Yield) และผลตอบแทนเสนอซื้อเฉลี่ยของพันธบัตรรัฐบาลที่มีอายุคงเหลือเท่ากัน โดยที่ข้อมูล Breakeven Inflation จะสามารถหาได้จากสูตรดังนี้

$$\text{Breakeven Inflation} = \text{Interpolated Government Yield} - \text{Average Bidding Real Yield}$$

ทั้งนี้เพื่อเป็นการส่งเสริมให้นักลงทุนและผู้ร่วมตลาดได้มีข้อมูลเพื่อใช้ในการวิเคราะห์ตราสารหนี้ประเภท ILB ที่ครบถ้วน ทาง ThaiBMA จึงได้ทำการคำนวณค่า Breakeven Inflation สำหรับ ILB เป็นรายรุ่น และจะเริ่มเผยแพร่ในเว็บไซต์ iBond ตั้งแต่วันที่ 15 กุมภาพันธ์ 2555 เป็นต้นไป

Calendar Day	Interpolated Nominal Yield	Average Bidding Real Yield	Breakeven Inflation
08-Nov-2011	3.437036	1.002857	2.434179
09-Nov-2011	3.477091	0.988571	2.488520
10-Nov-2011	3.470069	0.988571	2.481498
11-Nov-2011	3.467933	0.988571	2.479362
14-Nov-2011	3.462338	0.982857	2.479481
15-Nov-2011	3.457793	0.982857	2.474935
16-Nov-2011	3.454391	0.982857	2.471534
17-Nov-2011	3.440582	0.982857	2.457724
18-Nov-2011	3.423605	0.982857	2.440748
21-Nov-2011	3.426122	0.982857	2.443265
22-Nov-2011	3.426984	0.971657	2.455317
23-Nov-2011	3.427959	0.982857	2.445102
24-Nov-2011	3.438299	0.982857	2.455442
25-Nov-2011	3.448531	0.982857	2.463673
28-Nov-2011	3.453638	0.976000	2.477638
29-Nov-2011	3.448097	0.968333	2.479763
30-Nov-2011	3.438732	0.988333	2.450398
01-Dec-2011	3.392929	0.963333	2.429596

ในกรณีที่ท่านต้องการข้อมูลเพิ่มเติมสามารถติดต่อฝ่ายบริการราคาตราสารหนี้และพัฒนาผลิตภัณฑ์ ได้ที่เบอร์โทรศัพท์ 0-2252-3336 ต่อ 218 email address: pricing@thaibma.or.th