

## Commercial Paper Index

### ภาพประกอบ:

### Bond Index

24/04/2023

Commercial Paper Index as of 24 April 2023

Export to Excel

Type	Index						Average				
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Yield	Simple Yield	Duration	Convexity	Average Time To Maturity
Commercial Paper Index (AA- up)	123.873801	0.00	123.937585	0.01	144.905400	0.01	1.907810	1.773038	0.137827	0.064387	0.138627
Commercial Paper Index (A- up)	128.097800	0.00	128.134574	0.01	146.980137	0.01	2.118000	1.860375	0.168224	0.100305	0.169827
Commercial Paper Index (BBB- up)	131.649682	0.01	131.684297	0.01	151.504099	0.01	2.185272	1.927122	0.170853	0.102918	0.172551

#### Remark :

1. Commercial Paper Indices are categorized into 3 types based on different securities composition in their calculation baskets. For instance, the calculation basket of Commercial Paper Index (AA-up) is composed of selected commercial papers of the issuers with rating AA- and above.
2. The base dates of Commercial Paper Indices are 1 September 2006.

ดัชนีตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้น (Commercial Paper Index) เป็นดัชนีวัดการลงทุนในตราสารหนี้ประเภทตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้น ฐานของดัชนีตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้น นี้เริ่มต้นที่ 100 ในวันที่ 1 กันยายน 2549 โดยตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่นำมาคำนวณหา ดัชนีแบ่งออกเป็น 3 กลุ่ม ได้แก่

- 1) กลุ่มที่ประกอบไปด้วยตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่มีระดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกที่ AA- หรือสูงกว่า
- 2) กลุ่มที่ประกอบไปด้วยตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่มีระดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกที่ A- หรือสูงกว่า
- 3) กลุ่มที่ประกอบไปด้วยตั๋วสัญญาใช้เงินระยะสั้นที่มีระดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกที่ BBB- หรือสูงกว่า

#### ความหมาย:

- Clean Price Index: ดัชนีที่ไม่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Clean Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Clean Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Gross Price Index: ดัชนีที่นำเอาดอกเบี้ยค้างรับเข้ามารวมในการคำนวณ
- Gross Price Chg: การเปลี่ยนแปลงของ Gross Price Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Total Return Index: Total Return Index
- Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Simple Yield: Average Simple Yield
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้