

MTM Corporate Bond Index

ภาพประกอบ:

Bond Index

[Export to Excel](#)

MTM Corporate Bond Index as of 17 November 2024

Type	Index				Average			Average TimeTo Maturity		
	Clean Price	chg. (point)	Gross Price	chg. (point)	Total Return	chg. (point)	Yield		Duration	Convexity
MTM Corporate Bond Index (A- up)	106.73	-0.00	107.33	-0.04	219.09	0.02	3.25	3.10	17.62	3.48
Group 1 [1 < TTM <= 3]	99.08	-0.00	99.58	-0.02	194.99	0.02	2.85	1.91	4.85	2.00
Group 2 [3 < TTM <= 7]	124.78	-0.00	125.52	-0.08	261.35	0.02	3.19	4.19	21.44	4.62
Group 3 [7 < TTM <= 10]	132.82	-0.00	133.76	-0.05	298.48	0.03	3.61	7.15	60.98	8.65
Group 4 [TTM <= 10]	105.63	-0.00	106.22	-0.04	215.44	0.02	3.18	2.91	14.93	3.22
Group 5 [TTM <= 1]	80.91	-0.00	81.33	-0.02	235.85	0.02	2.67	0.55	0.60	0.56
MTM Corporate Bond Index (BBB+ up)	106.76	-0.00	107.35	-0.04	221.27	0.02	3.31	3.01	16.83	3.38
Group 1 [1 < TTM <= 3]	100.14	-0.00	100.65	-0.02	200.37	0.02	2.99	1.90	4.78	1.99
Group 2 [3 < TTM <= 7]	124.58	-0.00	125.32	-0.07	263.41	0.02	3.27	4.18	21.35	4.61
Group 3 [7 < TTM <= 10]	131.55	-0.00	132.48	-0.05	296.17	0.03	3.62	7.15	60.98	8.65
Group 4 [TTM <= 10]	105.74	-0.00	106.33	-0.04	217.92	0.02	3.26	2.84	14.30	3.14
Group 5 [TTM <= 1]	81.82	-0.00	82.23	-0.02	242.86	0.02	2.82	0.55	0.60	0.56
MTM Corporate Bond Index (BBB up)	106.45	-0.00	107.04	-0.03	221.44	0.02	3.32	2.99	16.63	3.35
Group 1 [1 < TTM <= 3]	100.33	-0.00	100.84	-0.02	201.91	0.02	3.03	1.90	4.76	1.99
Group 2 [3 < TTM <= 7]	124.20	-0.00	124.94	-0.07	263.29	0.02	3.28	4.18	21.35	4.62
Group 3 [7 < TTM <= 10]	130.49	-0.00	131.41	-0.05	294.07	0.03	3.62	7.15	60.98	8.65
Group 4 [TTM <= 10]	105.54	-0.00	106.13	-0.04	218.33	0.02	3.27	2.82	14.13	3.11
Group 5 [TTM <= 1]	81.96	-0.00	82.37	-0.02	244.89	0.02	2.87	0.55	0.59	0.56
MTM Corporate Bond Index (BBB- up)	106.33	-0.00	106.93	-0.03	222.13	0.02	3.33	2.97	16.51	3.33
Group 1 [1 < TTM <= 3]	100.52	-0.00	101.03	-0.02	203.67	0.02	3.05	1.89	4.74	1.98
Group 2 [3 < TTM <= 7]	124.07	-0.00	124.81	-0.07	263.48	0.02	3.28	4.18	21.35	4.62
Group 3 [7 < TTM <= 10]	130.12	-0.00	131.05	-0.05	293.77	0.03	3.62	7.15	60.98	8.65
Group 4 [TTM <= 10]	105.48	-0.00	106.06	-0.03	219.13	0.02	3.28	2.81	14.03	3.10
Group 5 [TTM <= 1]	82.21	-0.00	82.62	-0.02	247.37	0.02	2.91	0.55	0.59	0.56

Remark :

- The base date is 1 September 2006.
- The net total return indices are calculated by applying the withholding tax rates to accrued interest and coupon payments on all coupon bonds. The tax rates may change from time to time due to changes to the withholding tax rate applicable in Thailand. The current and historical withholding tax rate is 15%.
- The base date of the net total return indices is 20 August 2019.
- For the manual of MTM Corporate Bond Index , [please click here](#).

ดัชนีหุ้นกู้ที่คิดคำนวณจากข้อมูล Mark-to-Market ดัชนีนี้จะมีความละเอียดมากกว่า Investment Grade Corporate Bond Index โดยจะแบ่งออกเป็น 4 กลุ่มย่อย คือ ตามอันดับเครดิตตั้งแต่ BBB- ขึ้นไป, ตั้งแต่ BBB ขึ้นไป, ตั้งแต่ BBB+ ขึ้นไป และตั้งแต่ A- ขึ้นไป นอกจากนี้ ยังคำนวณแยกตามช่วงอายุคงเหลือในแต่ละอันดับเครดิต เหมือนกับดัชนีหุ้นกู้ที่มีอันดับความน่าเชื่อถือในระดับนำลงทุน และยังเพิ่มช่วงอายุคงเหลืออีกกลุ่มหนึ่ง คือ กลุ่มของหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 10 ปี ซึ่งกลุ่มนี้จะครอบคลุมหุ้นกู้ทั้งหมด รวมถึงหุ้นกู้ที่มีอายุไม่ถึง 1 ปีอีกด้วย ได้เริ่มจัดทำดัชนีหุ้นกู้ตั้งแต่วันที่ 1 กันยายน 2549 เป็นต้นมา โดยจัดทำดัชนีเป็นกลุ่มย่อยๆ อีก 5 กลุ่ม ดังนี้

- 1) กลุ่มดัชนีหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ถึง 3 ปี (1<TTM<=3)
- 2) กลุ่มดัชนีหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 3 ถึง 7 ปี (3<TTM<=7)
- 3) กลุ่มดัชนีหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือตั้งแต่ 7 ถึง 10 ปี (7<TTM<=10)
- 4) กลุ่มดัชนีหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 10 ปี (>10)
- 5) กลุ่มดัชนีหุ้นกู้ที่มีอายุคงเหลือน้อยกว่าหรือเท่ากับ 1 ปี

MTM Corporate bond index จะต่างจาก Investment Grade Corporate Bond Index โดยหลัก คือ จะใช้ราคา Mark-to-Market ณ สิ้นวันมาใช้ในการคำนวณดัชนีและจะไม่ได้คำนึงถึงสภาพคล่องของตราสารแต่ละตัว แต่จะใช้ตราสารทั้งหมดที่มีอันดับเครดิตมาใช้ในการคำนวณดัชนี (รวมถึงตราสารหนี้ที่มีการจ่ายคูปองคงที่ที่ไม่มีสิทธิแปลง และครอบคลุมถึงหุ้นกู้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-Linked Bond (SLB)) ที่ออกตั้งแต่วันที่ 18 พฤศจิกายน 2567) อาจกล่าวได้ว่า Mark-to-Market Corporate Bond Index จะมีการเคลื่อนไหวที่สอดคล้องกับราคาตลาดของหุ้นกู้มากกว่าเมื่อเปรียบเทียบกับ Investment Grade Corporate Bond Index เพราะมีการนำราคา Mark-to-Market ณ สิ้นวันมาใช้ในการคำนวณค่าดัชนี

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
- Net Total Return Index: Net Total Return Index
- Net Total Return Change: การเปลี่ยนแปลงของ Net Total Return Index เทียบกับวันก่อนหน้า
- Average Yield: ค่าเฉลี่ยอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้ คำนวณถึงวันครบกำหนดอายุ
- Average Duration: ค่าเฉลี่ยของ Modified Duration
- Average Convexity: ค่าเฉลี่ยของดัชนีชี้วัดค่าความอ่อนไหวของราคาตราสารหนี้เมื่ออัตราผลตอบแทนเปลี่ยนแปลงไป
- Average TTM: ค่าเฉลี่ยอายุคงเหลือของตราสารหนี้

