ธนาคารกรุงเทพ Bangkok Bank

Research Department

TH: Financial Report
Bond Market

4 ธันวาคม 2562

ภาวะตลาดตราสารหนี้ของไทย เดือน พ.ย. 2562

- การซื้อขายตราสารหนี้ เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 20,304.7 Bn THB เพิ่มขึ้น 1.4% YoY และ 0.1% MoM โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 966.9 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 6.2% YoY และ 0.1% MoM หากพิจารณา 11M/62 มูลค่า 217,938.6 Bn THB ลดลง 11.6% YoY โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 968.6 Bn THB/D ลดลง 10.8% YoY
- ตราสารหนี้ เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 13,362.9 Bn THB เพิ่มขึ้น 6.1% YoY 2.1% MoM และ 6.2% YTD โดยพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตรรัฐบาล ตราสารหนี้ภาคเอกชน และพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ คิดเป็น 28.4% 37.3% 27.3% และ 6.3% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ ส่วนมูลค่าตราสารหนี้อายุคงเหลือ (0,1Y), [1Y,5Y), [5Y,10Y), [10Y,15Y) และ [15Y,50Y] คิดเป็น 17.9% 24.4% 15.3% 16.8% และ 25.6% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ
- อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล เดือน พ.ย. 62 อายุคงเหลือ 3M 6M 1Y 3Y 5Y และ 10Y อยู่ที่ 1.27% 1.28% 1.28% 1.31% 1.39% และ 1.61% ตามลำดับ
- ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล เดือน พ.ย. 62 เมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปีก่อน เพิ่มขึ้นทุกประเภท หากเทียบกับเดือนก่อน ลดลงทุกประเภท

การประเมินอันดับค่า อิงค่าต่ำสุด ค่าเฉลี่ย และค่าสูงสุด (ปี 2552-62)

	All Periods			Same Periods			Latest
	Month	Quarter	Year	YTD	Quarter	Month	
Bond							
Trading Value	3	3	4	3	3	3	Nov-19
Outstanding	5	5	5	-	5	5	Nov-19
Government Bond							
Total Return Index	5	5	5	-	5	5	Nov-19
Gross Price Index	5	5	3	-	5	5	Nov-19
Clean Price Index	5	5	3	-	5	5	Nov-19

หมายเหตุ: 5 สูง 4 ค่อนข้างสูง 3 ปานกลาง 2 ค่อนข้างต่ำ 1 ต่ำ

อัตราการเปลี่ยนแปลงรายปี (ปี 2552-61)

%	Average YoY Growth	CAGR
Bond		
Trading Value	22.9	18.8
Outstanding	10.2	10.0
Government Bond		
Total Return Index	3.5	3.5
Gross Price Index	-0.7	-0.7
Clean Price Index	-0.5	-0.6

ที่มา: สมาคมตราสารหนี้ไทย

หมายเหตุ: 1. เดือน พ.ย. 61 ต.ค. 62 และ พ.ย. 62 มีวันทำการเดือนละ 22 21 และ 21 วัน ตามลำดับ

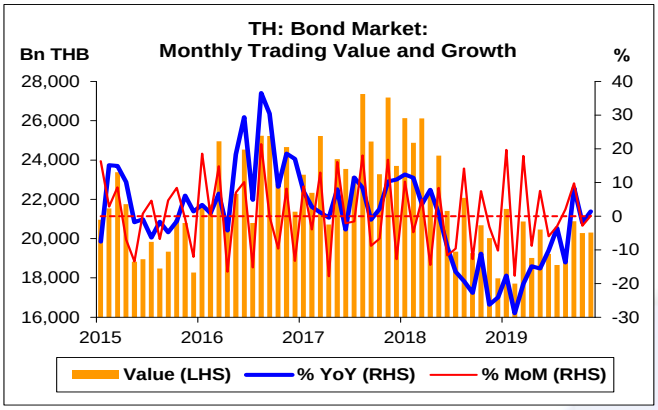
2. 11M/61 และ 11M/62 มีวันทำการ 227 และ 225 วัน ตามลำดับ

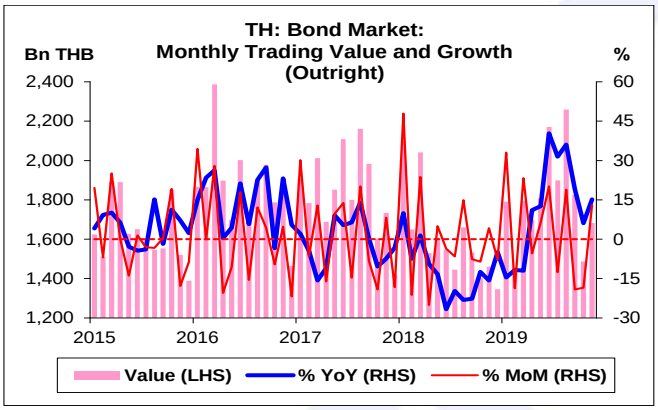
3. มูลค่าคงค้างตราสารหนี้ตามอายุคงเหลือ 5 กลุ่ม ได้แก่ อายุคงเหลือไม่ถึง 1 ปี (0,1Y) อายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ปี และไม่ถึง 5 ปี [1Y,5Y) อายุคงเหลือตั้งแต่ 5 ปี และไม่ถึง 10 ปี [5Y,10Y) อายุคงเหลือตั้งแต่ 10 ปี และไม่ถึง 15 ปี [10Y,15Y) และอายุคงเหลือตั้งแต่ 15 ปี และถึง 50 ปี [15Y,50Y]

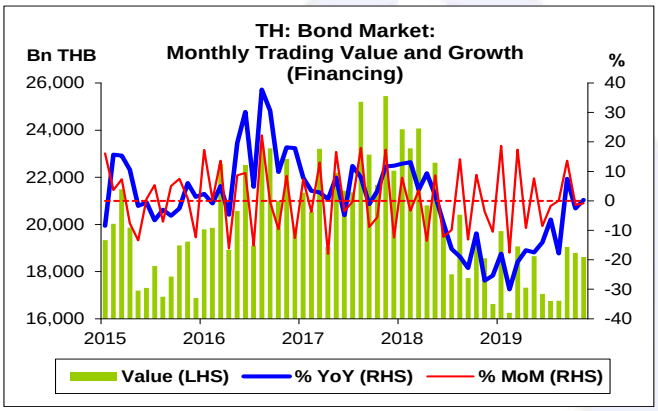
4. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล เป็นอัตรา ณ สิ้นเดือน

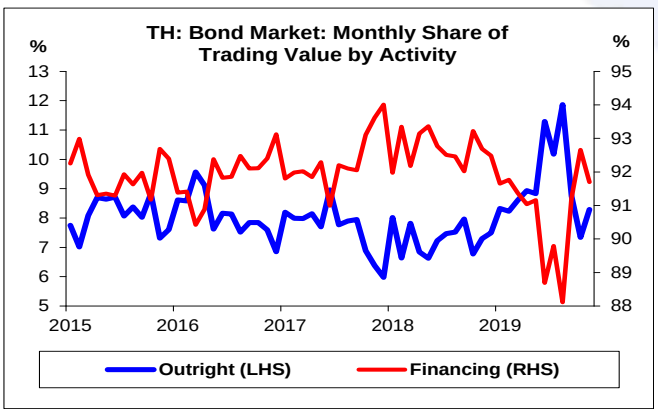
5. CAGR คือ Compound Annual Growth Rate

TH: Financial Report
Bond Market
4 ธันวาคม 2562









มูลค่าซื้อขายตราสารหนี้

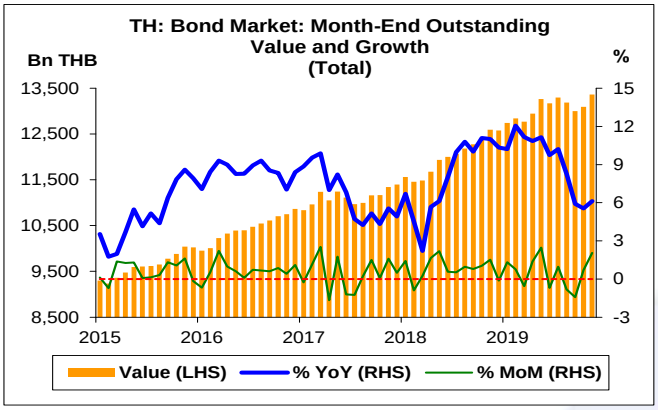
- การซื้อขายตราสารหนี้ เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 20,304.7 Bn THB เพิ่มขึ้น 1.4% YoY และ 0.1% MoM โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 966.9 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 6.2% YoY และ 0.1% MoM
- หากพิจารณา 11M/62 มูลค่า 217,938.6 Bn THB ลดลง 11.6% YoY ทั้งนี้ สูงกว่าค่าเฉลี่ยในช่วงเดียวกันของปี 52-61 ที่ 202,009.2 Bn THB อยู่ 7.9% โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 968.6 Bn THB/D ลดลง 10.8% YoY
- การซื้อขายตราสารหนี้ ตามประเภทธุรกรรม แบ่งเป็น 2 ประเภทหลัก ได้แก่ ธุรกรรมการซื้อขายเพื่อการลงทุน (Outright) และธุรกรรมเพื่อการกู้ยืม (Financing) โดยเดือน พ.ย. 62 คิดเป็น 8.3% และ 91.7% ของมูลค่าซื้อขายตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ

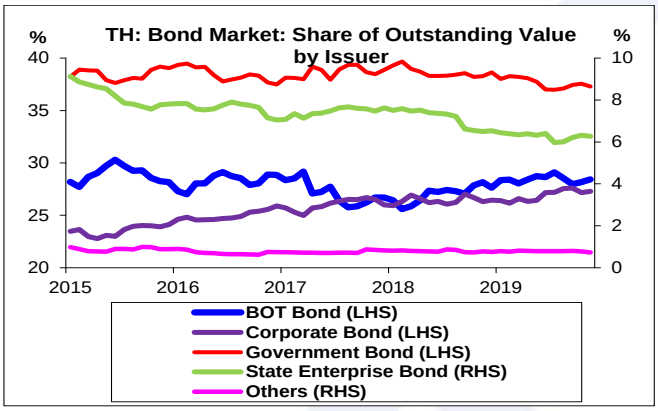
ธุรกรรมการซื้อขายเพื่อการลงทุน

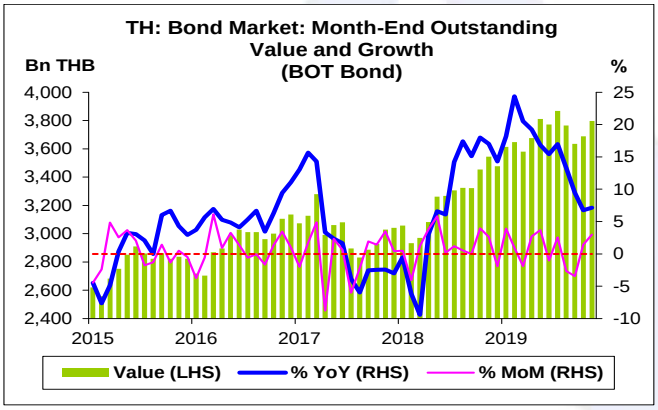
- ธุรกรรมการซื้อขายเพื่อการลงทุน เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 1,682.7 เพิ่มขึ้น 15.2% YoY เพิ่มขึ้นติดต่อกันเป็นเดือนที่ 8 และเพิ่มขึ้น 13.1% MoM โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 80.1 THB/D เพิ่มขึ้นถึง 20.7% YoY และ 13.1% MoM
- หากพิจารณา 11M/62 มูลค่า 19,874.4 Bn THB เพิ่มขึ้น 10.6% YoY ทั้งนี้ สูงกว่าค่าเฉลี่ยในช่วงเดียวกันของปี 52-61 ที่ 17,844.9 Bn THB อยู่ 11.4% และสูงกว่าช่วงเดียวกันของปี 58 อยู่ 2.1% CAGR โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 88.3 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 11.6% YoY

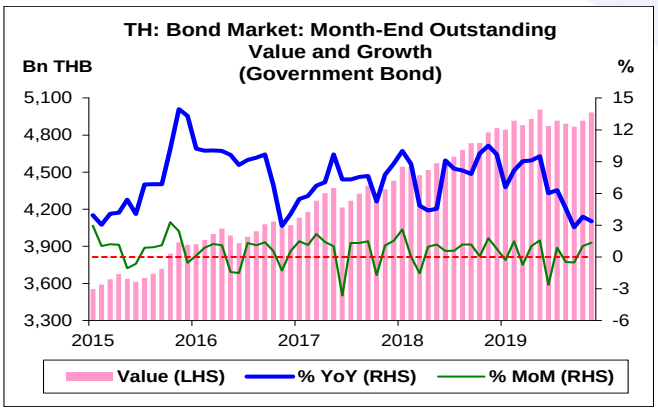
ธุรกรรมเพื่อการกู้ยืม

- ธุรกรรมเพื่อการกู้ยืม เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 18,618.1 Bn THB เพิ่มขึ้นเพียง 0.3% YoY แต่ลดลงเพียง 0.9% MoM โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 886.6 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 5.1% YoY แต่ลดลงเพียง 0.9% MoM
- หากพิจารณา 11M/62 มูลค่า 198,023.0 Bn THB ลดลง 13.3% YoY ทั้งนี้ สูงกว่าค่าเฉลี่ยในช่วงเดียวกันของปี 52-61 ที่ 184,089.8 Bn THB อยู่ 7.6% โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 880.1 Bn THB/D ลดลง 12.6% YoY







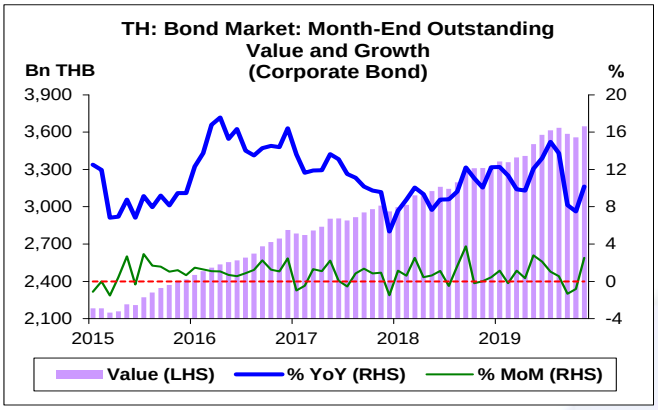


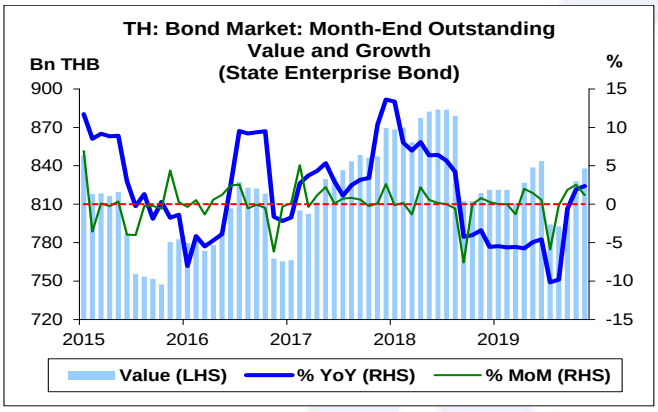
มูลค่าตราสารหนี้

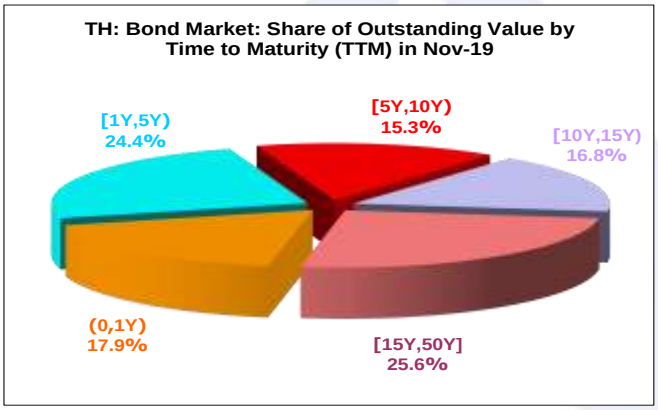
- ตราสารหนี้ เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 13,362.9 Bn THB สูงสุดนับตั้งแต่เดือน ม.ค. 52 โดยเพิ่มขึ้น 6.1% YoY เพิ่มขึ้นติดต่อกันเป็นเดือนที่ 131 และเพิ่มขึ้น 2.1% MoM และ 6.2% YTD

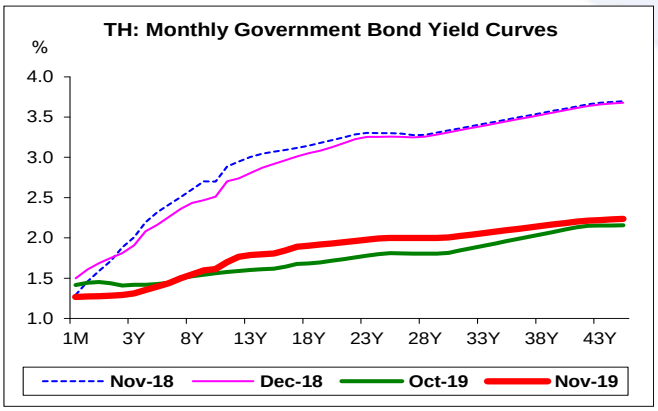
มูลค่าตราสารหนี้ตามประเภทผู้ออก

- มูลค่าตราสารหนี้ แบ่งตามประเภทผู้ออกที่สำคัญ 4 กลุ่ม ได้แก่ พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตรรัฐบาล ตราสารหนี้ภาคเอกชน และพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ โดยเดือน พ.ย. 62 คิดเป็น 28.4% 37.3% 27.3% และ 6.3% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมดตามลำดับ
- พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 3,797.3 Bn THB เพิ่มขึ้น 7.1% YoY เพิ่มขึ้นติดต่อกันเป็นเดือนที่ 20 และเพิ่มขึ้น 3.0% MoM และ 9.2% YTD
- พันธบัตรรัฐบาล เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 4,983.8 Bn THB เพิ่มขึ้น 3.4% YoY เพิ่มขึ้นติดต่อกันเป็นเดือนที่ 101 และเพิ่มขึ้น 1.3% MoM และ 2.6% YTD









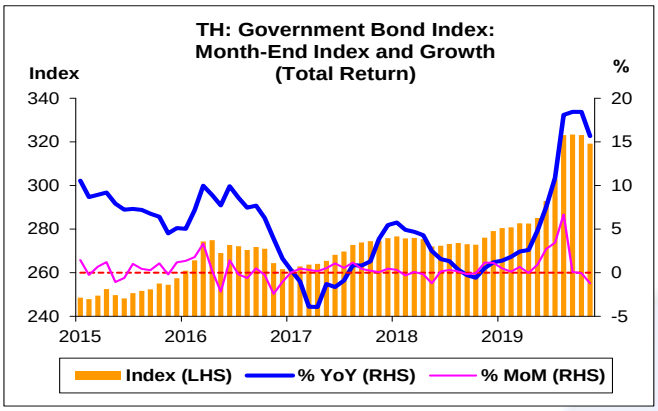
- ตราสารหนี้ภาคเอกชน เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 3,647.3 Bn THB สูงสุดนับตั้งแต่เดือน ม.ค. 52 โดยเพิ่มขึ้น 10.2% YoY เพิ่มขึ้นติดต่อกันเป็นเดือนที่ 131 และเพิ่มขึ้น 2.5% MoM และ 9.7% YTD
- พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 837.9 Bn THB เพิ่มขึ้น 2.3% YoY 1.2% MoM และ 2.0% YTD

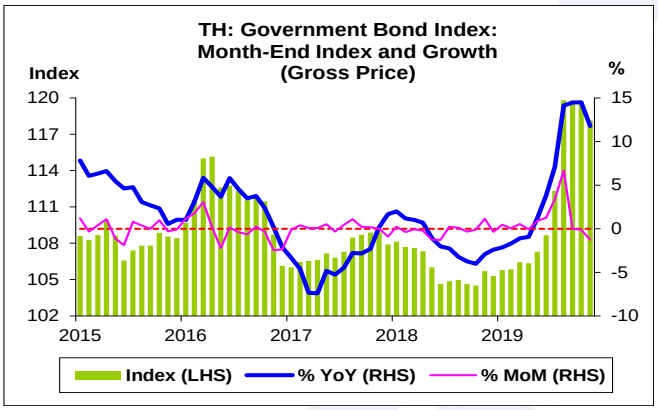
มูลค่าตราสารหนี้ตามอายุคงเหลือ (Time to Maturity: TTM)

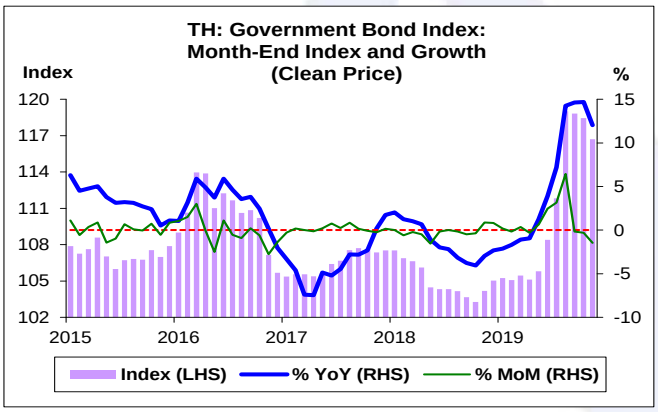
- มูลค่าตราสารหนี้ ตามอายุคงเหลือของตราสาร 5 กลุ่ม ได้แก่ (0,1Y), [1Y,5Y), [5Y,10Y), [10Y,15Y) และ [15Y,50Y] โดยเดือน พ.ย. 62 คิดเป็น 17.9% 24.4% 15.3% 16.8% และ 25.6% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ
- ตราสารหนี้อายุคงเหลือ (0,1Y) เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 2,392.4 Bn THB ลดลง 6.1% YoY และ 1.5% YTD แต่เพิ่มขึ้น 0.5% MoM
- ตราสารหนี้อายุคงเหลือ [1Y,5Y) เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 3,261.1 Bn THB เพิ่มขึ้น 14.4% YoY 3.0% MoM และ 12.2% YTD
- ตราสารหนี้อายุคงเหลือ [5Y,10Y) เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 2,047.8 Bn THB เพิ่มขึ้น 8.4% YoY 2.9% MoM และ 7.9% YTD
- ตราสารหนี้อายุคงเหลือ [10Y,15Y) เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 2,244.2 Bn THB ลดลง 0.05% YoY และ 1.1% YTD แต่เพิ่มขึ้น 1.7% MoM
- ตราสารหนี้อายุคงเหลือ [15Y,50Y] เดือน พ.ย. 62 มูลค่า 3,417.4 Bn THB เพิ่มขึ้น 11.7% YoY 2.0% MoM และ 11.2% YTD

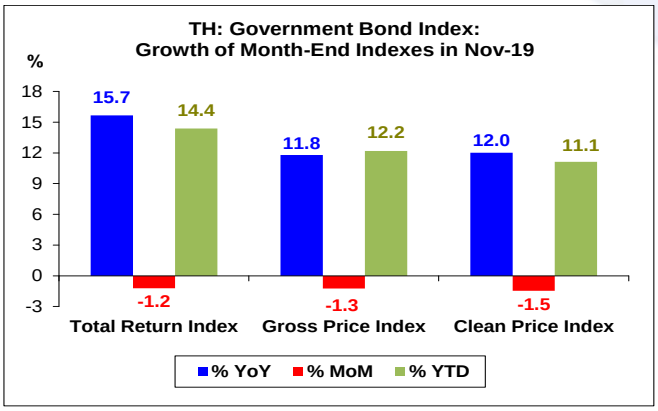
อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล

- อายุคงเหลือของพันธบัตรรัฐบาลที่พิจารณา ได้แก่ 3M 6M 1Y 3Y 5Y และ 10Y โดยเดือน พ.ย. 62 อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล อยู่ที่ 1.27% 1.28% 1.28% 1.31% 1.39% และ 1.61% ตามลำดับ เมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปีก่อน อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลลดลงทุกอายุคงเหลือ หากเทียบกับเดือนก่อน ลดลงเกือบทุกอายุคงเหลือ ยกเว้น 10Y





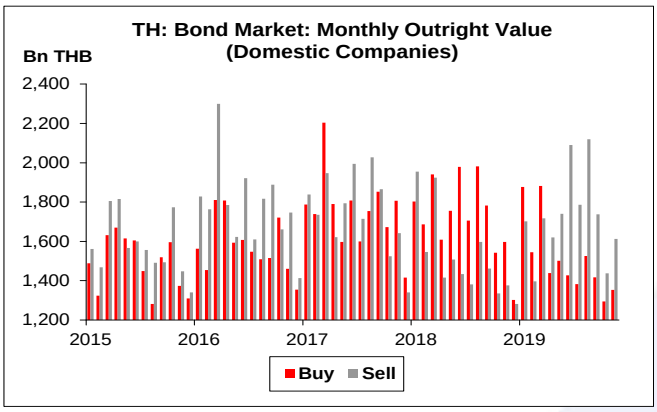


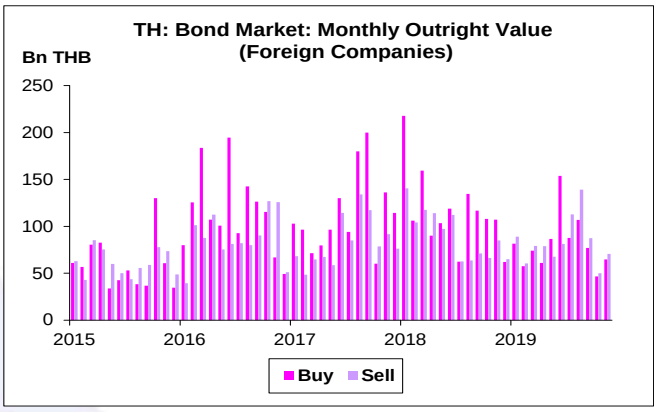


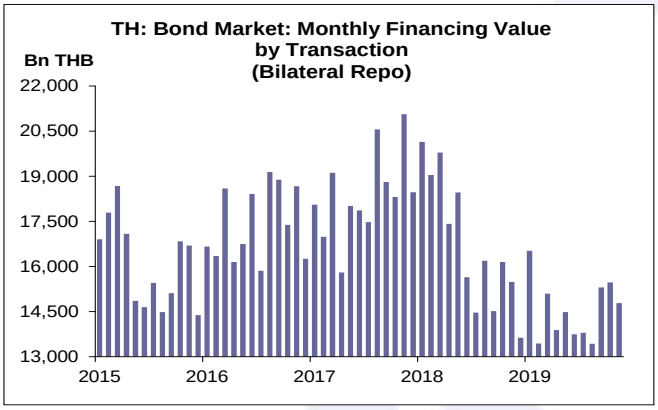
ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล

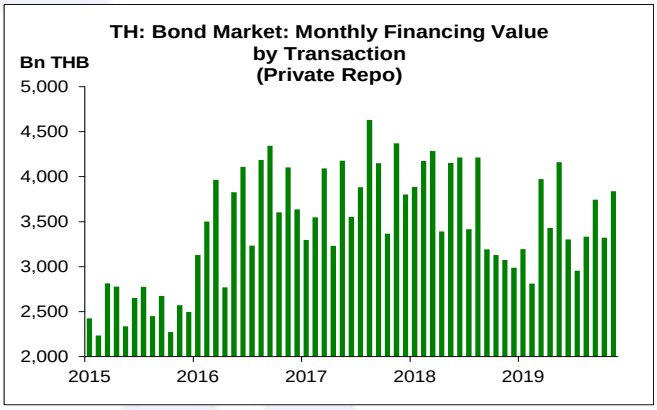
- ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล 3 ประเภท ได้แก่ Total Return Index, Gross Price Index และ Clean Price Index
- Total Return Index เดือน พ.ย. 62 เคลื่อนไหวระหว่าง 318.26-323.15 จุด และปิดที่ 319.20 จุด เพิ่มขึ้น 15.7% YoY และ 14.4% YTD แต่หดตัว 1.2% MoM
- Gross Price Index เดือน พ.ย. 62 เคลื่อนไหวระหว่าง 117.81-119.65 จุด และปิดที่ 118.15 จุด เพิ่มขึ้น 11.8% YoY และ 12.2% YTD แต่หดตัว 1.3% MoM
- Clean Price Index เดือน พ.ย. 62 เคลื่อนไหวระหว่าง 116.40-118.43 จุด และปิดที่ 116.70 จุด เพิ่มขึ้น 12.0% YoY และ 11.1% YTD แต่หดตัว 1.5% MoM

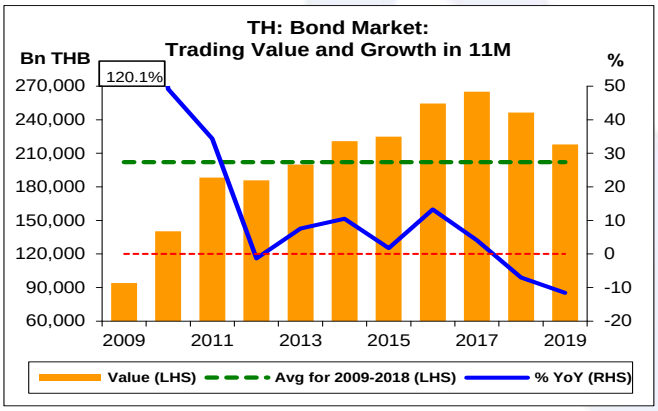
TH: Financial Report
Bond Market
4 ธันวาคม 2562

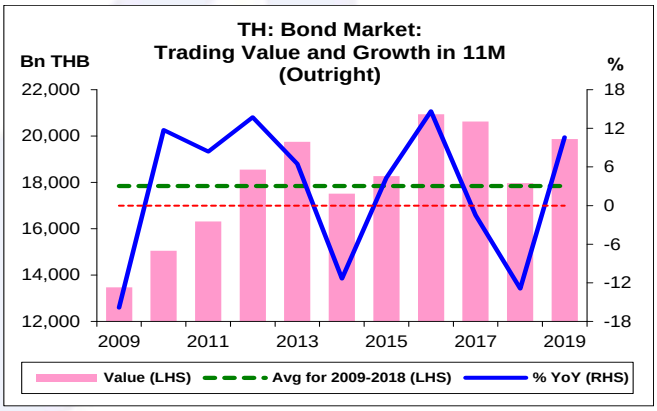


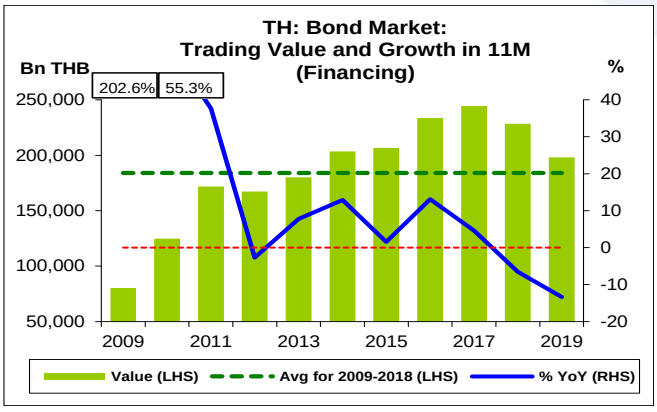


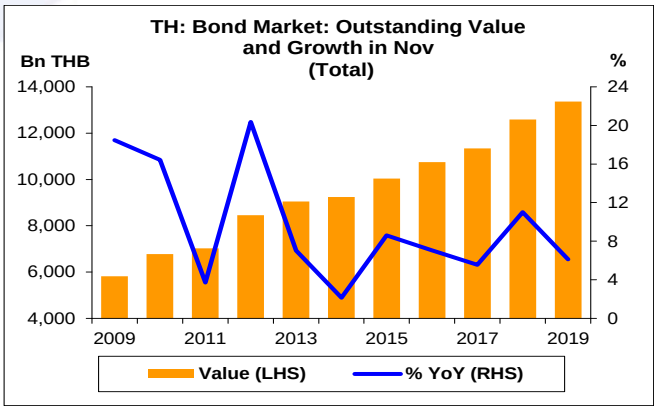


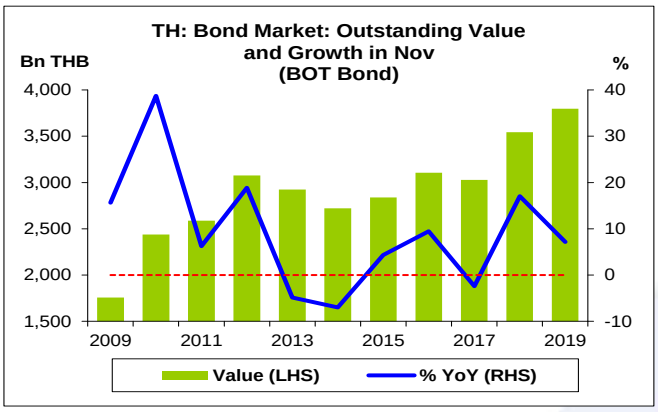


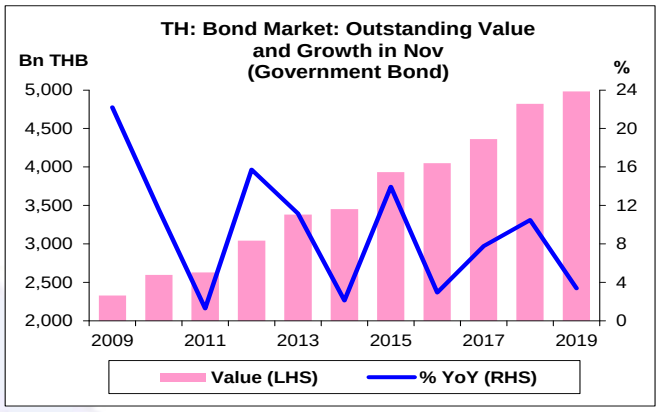


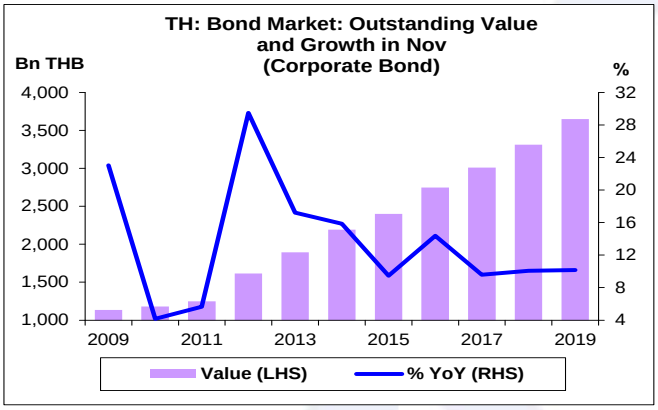


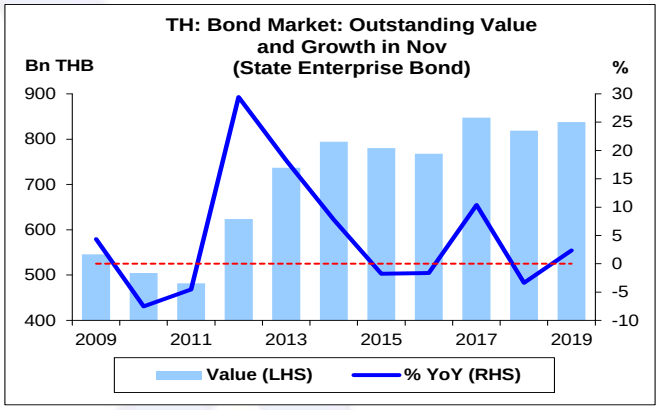


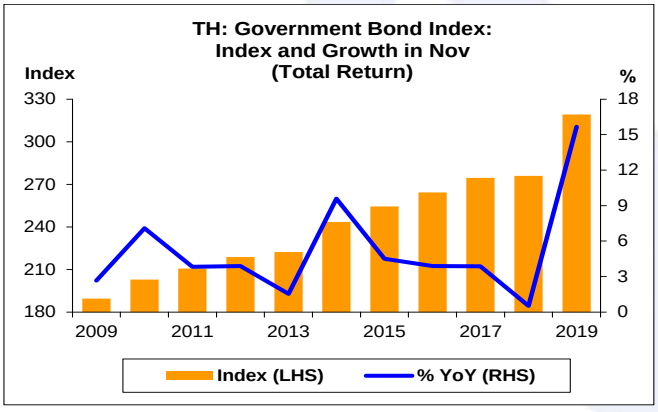


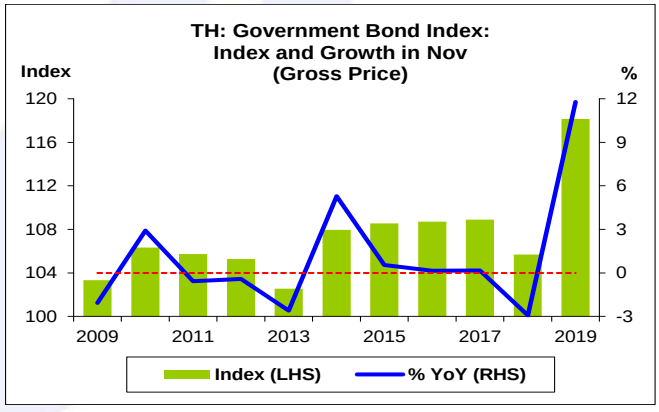

TH: Bond Market: Outstanding Value and Growth in Nov (BOT Bond)
Bn THB
%
Value (LHS)
% YoY (RHS)

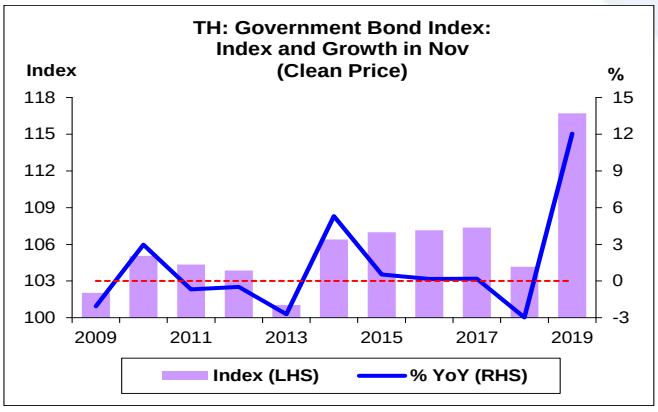

TH: Bond Market: Outstanding Value and Growth in Nov (Government Bond)
Bn THB
%
Value (LHS)
% YoY (RHS)

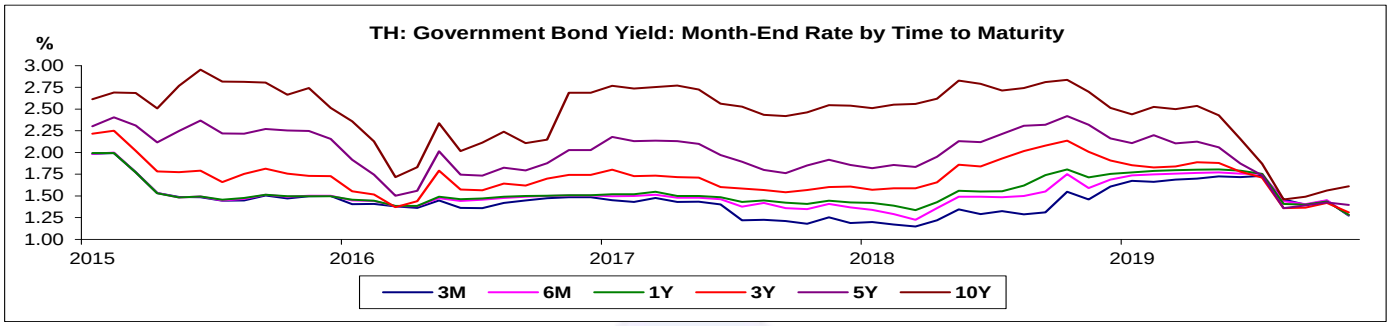

TH: Bond Market: Outstanding Value and Growth in Nov (Corporate Bond)
Bn THB
%
Value (LHS)
% YoY (RHS)

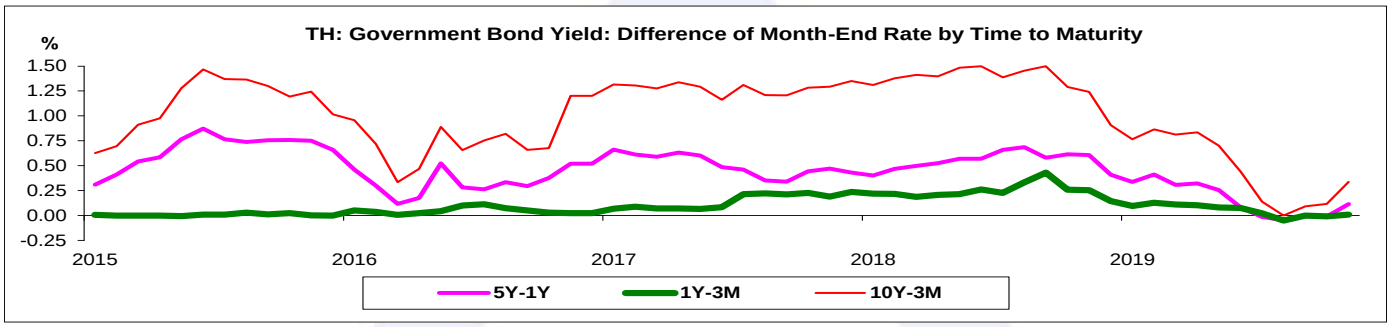

TH: Bond Market: Outstanding Value and Growth in Nov (State Enterprise Bond)
Bn THB
%
Value (LHS)
% YoY (RHS)

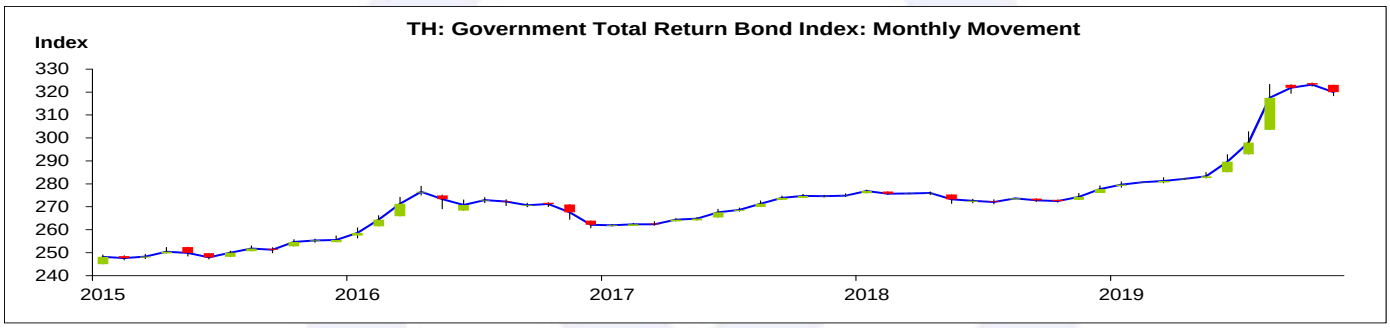

TH: Government Bond Index: Index and Growth in Nov (Total Return)
Index
%
Index (LHS)
% YoY (RHS)

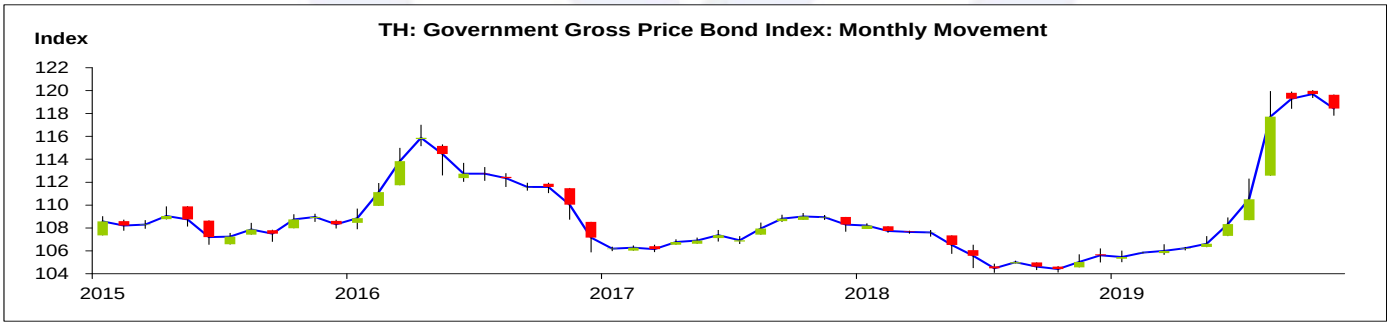

TH: Government Bond Index: Index and Growth in Nov (Gross Price)
Index
%
Index (LHS)
% YoY (RHS)

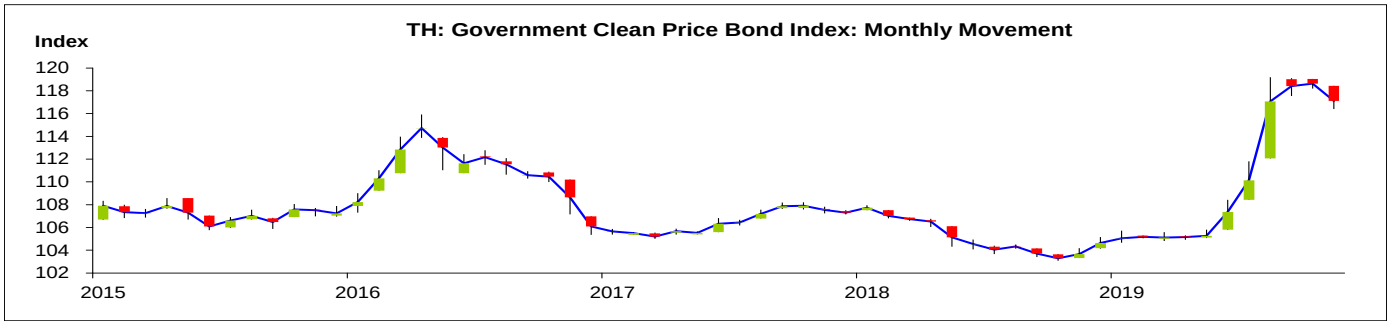

TH: Government Bond Index: Index and Growth in Nov (Clean Price)
Index
%
Index (LHS)
% YoY (RHS)

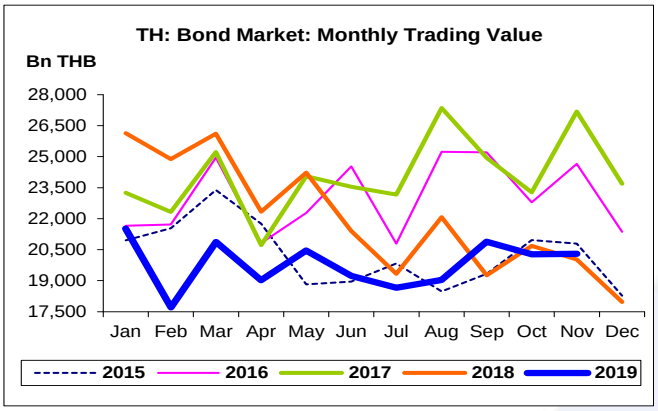

TH: Government Bond Yield: Month-End Rate by Time to Maturity
%
3.00
2.75
2.50
2.25
2.00
1.75
1.50
1.25
1.00
2015
2016
2017
2018
2019
3M
6M
1Y
3Y
5Y
10Y

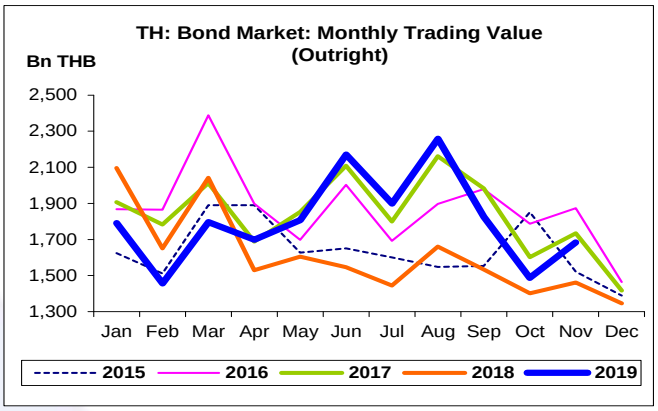

TH: Government Bond Yield: Difference of Month-End Rate by Time to Maturity
%
1.50
1.25
1.00
0.75
0.50
0.25
0.00
-0.25
2015
2016
2017
2018
2019
5Y-1Y
1Y-3M
10Y-3M

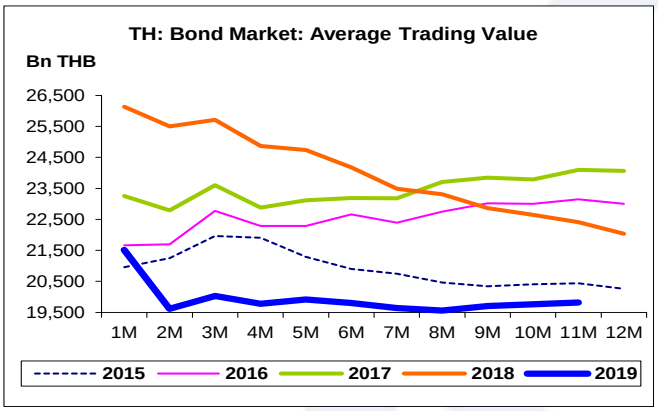

TH: Government Total Return Bond Index: Monthly Movement
Index
330
320
310
300
290
280
270
260
250
240
2015
2016
2017
2018
2019

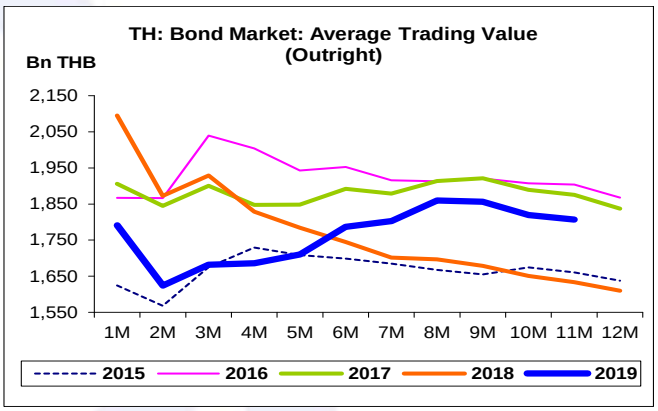

TH: Government Gross Price Bond Index: Monthly Movement
Index
122
120
118
116
114
112
110
108
106
104
2015
2016
2017
2018
2019

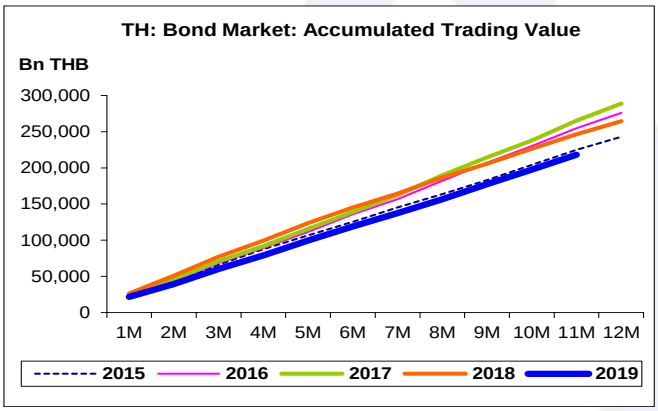

TH: Government Clean Price Bond Index: Monthly Movement
Index
120
118
116
114
112
110
108
106
104
102
2015
2016
2017
2018
2019

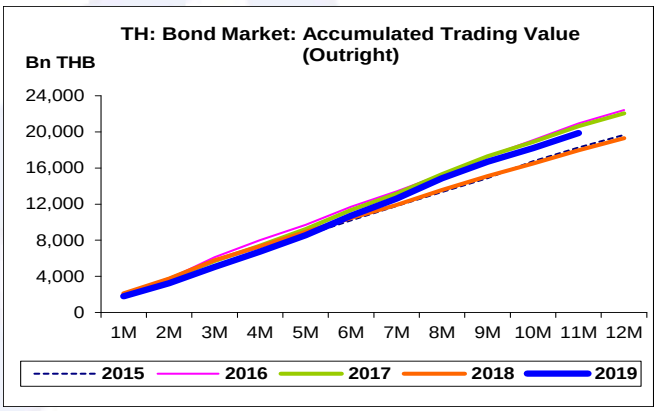

TH: Bond Market: Monthly Trading Value
Bn THB
28,000
26,500
25,000
23,500
22,000
20,500
19,000
17,500
Jan Feb Mar Apr May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec
2015 2016 2017 2018 2019

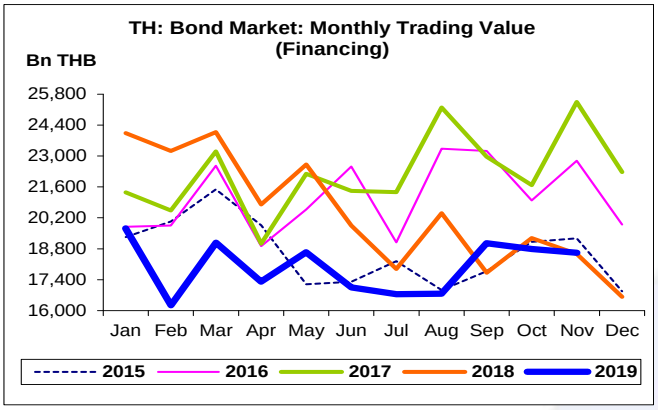

TH: Bond Market: Monthly Trading Value (Outright)
Bn THB
2,500
2,300
2,100
1,900
1,700
1,500
1,300
Jan Feb Mar Apr May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec
2015 2016 2017 2018 2019

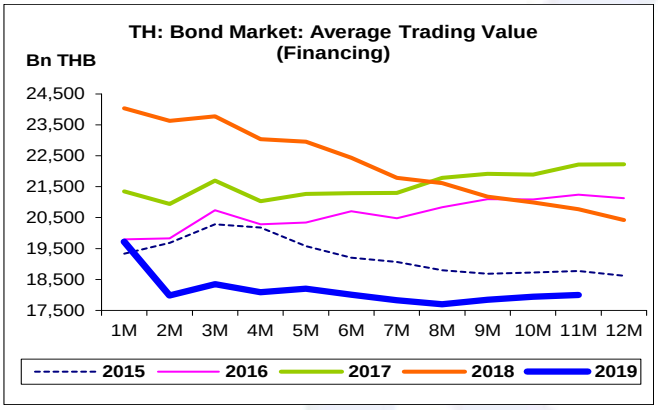

TH: Bond Market: Average Trading Value
Bn THB
26,500
25,500
24,500
23,500
22,500
21,500
20,500
19,500
1M 2M 3M 4M 5M 6M 7M 8M 9M 10M 11M 12M
2015 2016 2017 2018 2019

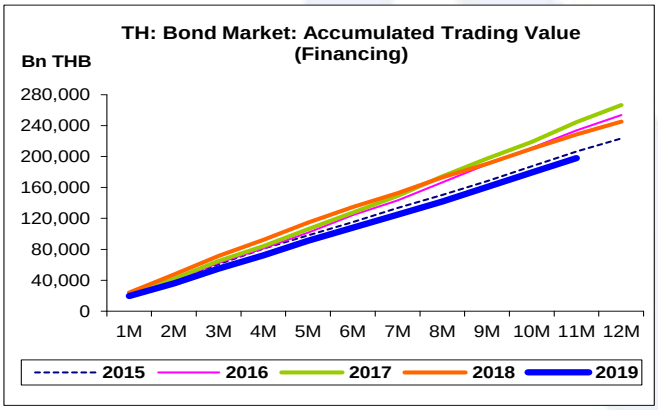

TH: Bond Market: Average Trading Value (Outright)
Bn THB
2,150
2,050
1,950
1,850
1,750
1,650
1,550
1M 2M 3M 4M 5M 6M 7M 8M 9M 10M 11M 12M
2015 2016 2017 2018 2019

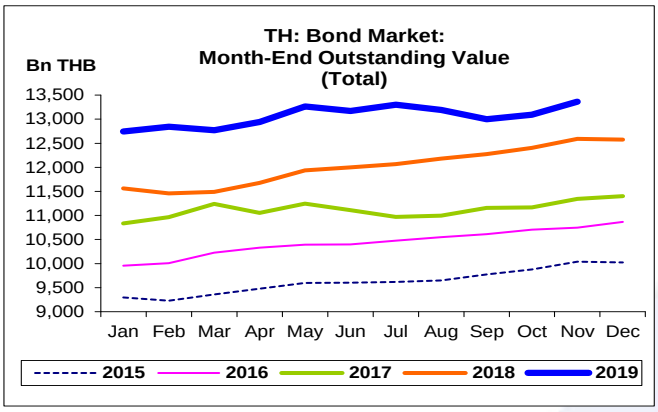

TH: Bond Market: Accumulated Trading Value
Bn THB
300,000
250,000
200,000
150,000
100,000
50,000
0
1M 2M 3M 4M 5M 6M 7M 8M 9M 10M 11M 12M
2015 2016 2017 2018 2019

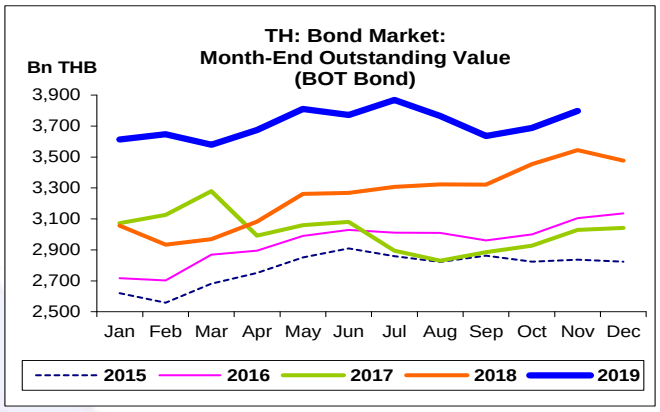

TH: Bond Market: Accumulated Trading Value (Outright)
Bn THB
24,000
20,000
16,000
12,000
8,000
4,000
0
1M 2M 3M 4M 5M 6M 7M 8M 9M 10M 11M 12M
2015 2016 2017 2018 2019

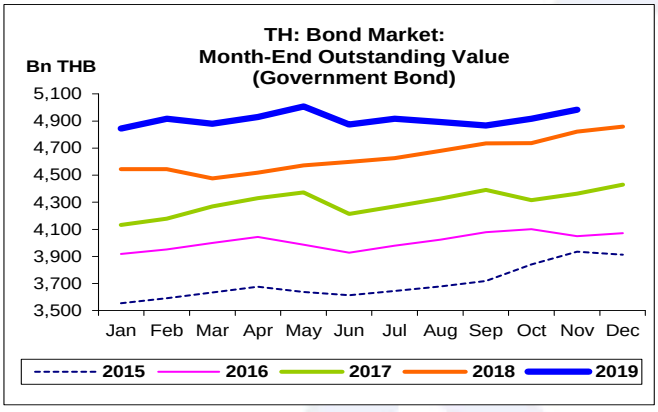

TH: Bond Market: Monthly Trading Value (Financing)
Bn THB
25,800
24,400
23,000
21,600
20,200
18,800
17,400
16,000
Jan Feb Mar Apr May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec
2015 2016 2017 2018 2019

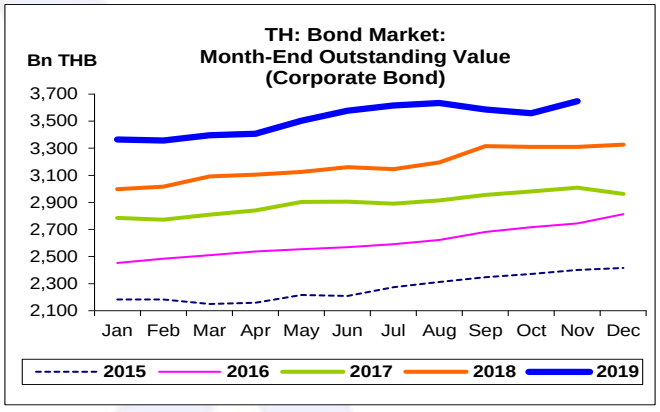

TH: Bond Market: Average Trading Value (Financing)
Bn THB
24,500
23,500
22,500
21,500
20,500
19,500
18,500
17,500
1M 2M 3M 4M 5M 6M 7M 8M 9M 10M 11M 12M
2015 2016 2017 2018 2019

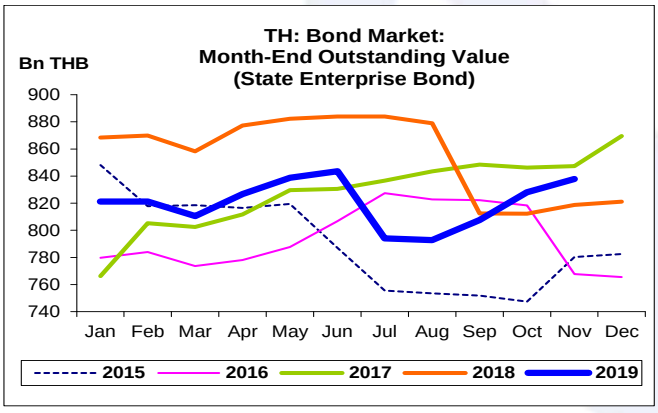

TH: Bond Market: Accumulated Trading Value (Financing)
Bn THB
280,000
240,000
200,000
160,000
120,000
80,000
40,000
0
1M 2M 3M 4M 5M 6M 7M 8M 9M 10M 11M 12M
2015 2016 2017 2018 2019

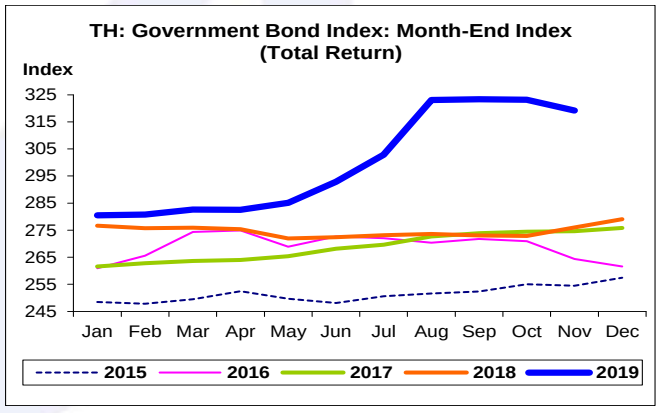

TH: Bond Market:
Month-End Outstanding Value
(Total)
Bn THB
13,500
13,000
12,500
12,000
11,500
11,000
10,500
10,000
9,500
9,000
Jan Feb Mar Apr May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec
2015 2016 2017 2018 2019

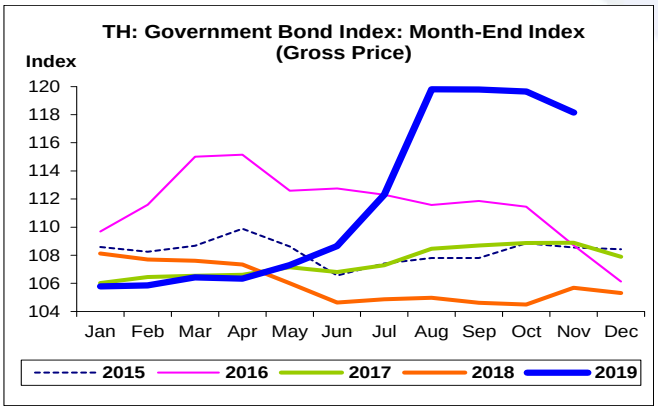

TH: Bond Market:
Month-End Outstanding Value
(BOT Bond)
Bn THB
3,900
3,700
3,500
3,300
3,100
2,900
2,700
2,500
Jan Feb Mar Apr May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec
2015 2016 2017 2018 2019

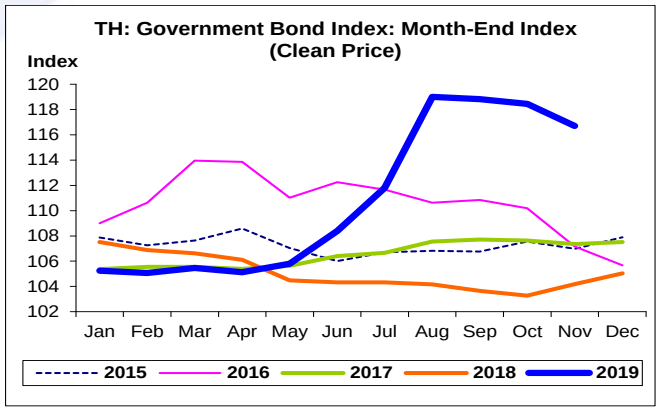

TH: Bond Market:
Month-End Outstanding Value
(Government Bond)
Bn THB
5,100
4,900
4,700
4,500
4,300
4,100
3,900
3,700
3,500
Jan Feb Mar Apr May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec
2015 2016 2017 2018 2019


TH: Bond Market:
Month-End Outstanding Value
(Corporate Bond)
Bn THB
3,700
3,500
3,300
3,100
2,900
2,700
2,500
2,300
2,100
Jan Feb Mar Apr May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec
2015 2016 2017 2018 2019


TH: Bond Market:
Month-End Outstanding Value
(State Enterprise Bond)
Bn THB
900
880
860
840
820
800
780
760
740
Jan Feb Mar Apr May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec
2015 2016 2017 2018 2019


TH: Government Bond Index: Month-End Index
(Total Return)
Index
325
315
305
295
285
275
265
255
245
Jan Feb Mar Apr May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec
2015 2016 2017 2018 2019


TH: Government Bond Index: Month-End Index
(Gross Price)
Index
120
118
116
114
112
110
108
106
104
Jan Feb Mar Apr May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec
2015 2016 2017 2018 2019


TH: Government Bond Index: Month-End Index
(Clean Price)
Index
120
118
116
114
112
110
108
106
104
102
Jan Feb Mar Apr May Jun Jul Aug Sep Oct Nov Dec
2015 2016 2017 2018 2019

Trading Value by Transaction in Nov-19

Transaction	Monthly			Daily Average		
	Bn THB	%YoY	%MoM	Bn THB	%YoY	%MoM
Outright	**1,682.7**	**15.2**	**13.1**	**80.1**	**20.7**	**13.1**
-Domestic Companies						
-Buy	1,618.0	19.5	12.3	77.0	25.2	12.3
-Sell	1,612.2	17.2	12.2	76.8	22.7	12.2
-Net	*5.8*					
-Foreign Companies						
-Buy	64.7	-39.6	39.3	3.1	-36.8	39.3
-Sell	70.4	-17.1	40.6	3.4	-13.2	40.6
-Net	*-5.8*					
Financing	**18,618.1**	**0.3**	**-0.9**	**886.6**	**5.1**	**-0.9**
-Bilateral Repo	14,777.5	-4.6	-4.4	703.7	0.0	-4.4
-Private Repo	3,838.5	24.9	15.5	182.8	30.8	15.5
-Others	2.1	-52.2	17.2	0.1	-49.9	17.2
Others	**4.0**	**-6.4**	**119.3**	**0.2**	**-1.9**	**119.3**
Total	**20,304.7**	**1.4**	**0.1**	**966.9**	**6.2**	**0.1**

Trading Value by Transaction in 11M/19

Transaction	11M/19		Daily Average	
	Bn THB	%YoY	Bn THB	%YoY
Outright	**19,874.4**	**10.6**	**88.3**	**11.6**
-Domestic Companies				
-Buy	18,977.7	14.0	84.3	15.0
-Sell	18,959.0	0.0	84.3	13.0
-Net	*18.7*			
-Foreign Companies				
-Buy	896.7	-32.3	4.0	-31.7
-Sell	915.4	-11.5	4.1	-10.7
-Net	*-18.7*			
Financing	**198,023.0**	**-13.3**	**880.1**	**-12.6**
-Bilateral Repo	159,924.4	-14.6	710.8	-13.9
-Private Repo	38,067.9	-7.4	169.2	-6.6
-Others	30.7	-30.6	0.1	-30.0
Others	**41.1**	**24.5**	**0.2**	**25.6**
Total	**217,938.6**	**-11.6**	**968.6**	**-10.8**

Outstanding Value by Issuer and Time to Maturity as of 30 Nov 2019

Issuer (Bn THB)	Time to Maturity (TTM)					
	TTM<1	1-5	5-10	10-15	15-50	Total
Government Bond	30.0	27.1	865.7	1,095.7	2,965.3	**4,983.8**
BOT Bond	2,107.1	1,690.2	0.0	0.0	0.0	**3,797.3**
State Enterprise Bond	0.0	56.0	359.4	219.9	202.6	**837.9**
Corporate Bond	255.2	1,474.0	788.3	887.2	242.5	**3,647.3**
Foreign Bond	0.0	13.9	34.4	41.4	7.0	**96.6**
Total	**2,392.4**	**3,261.1**	**2,047.8**	**2,244.2**	**3,417.4**	**13,362.9**

Government Bond Yield Curve (%)

Time to Maturity (TTM)	30/11/2018	31/12/2018	31/10/2019	30/11/2019			
				Rate	Change (bp)		
					YoY	MoM	YTD
1M	1.29	1.50	1.42	1.27	-0.03	-0.15	-0.23
3M	*1.46*	*1.61*	*1.44*	*1.27*	*-0.18*	*-0.17*	*-0.33*
6M	*1.59*	*1.69*	*1.45*	*1.28*	*-0.31*	*-0.17*	*-0.41*
1Y	*1.71*	*1.75*	*1.44*	*1.28*	*-0.43*	*-0.15*	*-0.47*
2Y	1.88	1.81	1.41	1.29	-0.59	-0.12	-0.52
3Y	*2.01*	*1.91*	*1.42*	*1.31*	*-0.70*	*-0.11*	*-0.60*
4Y	2.20	2.08	1.42	1.35	-0.84	-0.06	-0.73
5Y	*2.32*	*2.16*	*1.43*	*1.39*	*-0.92*	*-0.03*	*-0.77*
6Y	2.41	2.26	1.44	1.44	-0.97	0.00	-0.82
7Y	2.51	2.36	1.50	1.50	-1.01	0.00	-0.86
8Y	2.60	2.43	1.53	1.55	-1.05	0.02	-0.88
9Y	2.70	2.47	1.54	1.60	-1.10	0.05	-0.87
10Y	*2.70*	*2.51*	*1.56*	*1.61*	*-1.09*	*0.05*	*-0.90*
11Y	2.89	2.70	1.58	1.70	-1.19	0.13	-1.00
12Y	2.95	2.74	1.59	1.77	-1.18	0.18	-0.97
13Y	3.01	2.80	1.60	1.79	-1.22	0.18	-1.02
14Y	3.05	2.87	1.61	1.80	-1.25	0.19	-1.08
15Y	3.07	2.92	1.62	1.80	-1.26	0.19	-1.11
16Y	3.09	2.96	1.64	1.84	-1.25	0.20	-1.12
17Y	3.12	3.01	1.68	1.89	-1.23	0.21	-1.12
18Y	3.14	3.05	1.68	1.90	-1.24	0.22	-1.15
19Y	3.18	3.08	1.70	1.92	-1.26	0.22	-1.17
20Y	3.21	3.12	1.72	1.93	-1.28	0.22	-1.19
21Y	3.25	3.18	1.74	1.95	-1.30	0.21	-1.23
22Y	3.28	3.23	1.76	1.96	-1.32	0.20	-1.27
23Y	3.30	3.25	1.78	1.98	-1.33	0.20	-1.28
24Y	3.30	3.26	1.80	1.99	-1.31	0.19	-1.26
25Y	3.30	3.26	1.81	2.00	-1.30	0.19	-1.26
26Y	3.29	3.25	1.81	2.00	-1.29	0.19	-1.26
27Y	3.28	3.25	1.80	2.00	-1.28	0.19	-1.25
28Y	3.28	3.26	1.80	2.00	-1.28	0.19	-1.26
29Y	3.31	3.28	1.80	2.00	-1.31	0.19	-1.29
30Y	3.33	3.31	1.81	2.01	-1.33	0.19	-1.30
31Y	3.36	3.34	1.84	2.02	-1.34	0.18	-1.31
32Y	3.39	3.36	1.87	2.04	-1.35	0.17	-1.32
33Y	3.41	3.39	1.90	2.06	-1.36	0.16	-1.33
34Y	3.44	3.42	1.93	2.08	-1.36	0.15	-1.34
35Y	3.47	3.45	1.96	2.09	-1.37	0.14	-1.35
36Y	3.50	3.47	1.99	2.11	-1.38	0.13	-1.36
37Y	3.52	3.50	2.02	2.13	-1.39	0.11	-1.37
38Y	3.55	3.53	2.04	2.15	-1.40	0.10	-1.38
39Y	3.58	3.56	2.07	2.17	-1.41	0.09	-1.39
40Y	3.60	3.58	2.10	2.18	-1.42	0.08	-1.40
41Y	3.63	3.61	2.13	2.20	-1.43	0.07	-1.41
42Y	3.66	3.64	2.15	2.22	-1.44	0.06	-1.42
43Y	3.68	3.66	2.15	2.22	-1.46	0.07	-1.43
44Y	3.69	3.67	2.15	2.23	-1.46	0.07	-1.44
45Y	3.70	3.68	2.16	2.23	-1.46	0.08	-1.44
46Y	3.71	3.69	2.16	2.24	-1.46	0.08	-1.45
47Y	3.72	3.70	2.16	2.26	-1.46	0.10	-1.44
48Y	3.75	3.73	-	-	-	-	-

TH Bond Indexes as of 30 Nov 2019

	Index	Change		
		From 31 Dec 2018 (Point)	% YoY	% MoM
Bond Composite Index				
Total Return Index	201.44	22.21	13.5	-0.8
Gross Price Index	117.26	10.56	9.7	-0.9
Clean Price Index	116.06	9.78	10.0	-1.0
Average Yield (%)	1.95	-1.01		
Government Bond Index				
Total Return Index	319.20	40.11	15.7	-1.2
Gross Price Index	118.15	12.85	11.8	-1.3
Clean Price Index	116.70	11.68	12.0	-1.5
Average Yield (%)	1.89	-1.08		
Corporate Bond BBB+ Index				
Total Return Index	245.97	10.75	5.1	0.3
Gross Price Index	106.04	1.23	1.5	-0.1
Clean Price Index	105.41	1.44	1.5	0.0
Average Yield (%)	2.51	-0.32		

ตราสารหนี้:

จุดสูงสุดและต่ำสุดในแต่ละช่วงเวลา ในระยะเวลา 11 ปี (ปี 2552-62)

Bn THB	ค่าปัจจุบัน	% จาก ค่าสูงสุด	% จาก ค่าต่ำสุด	ค่าสูงสุด	Date	ค่าต่ำสุด	Date
มูลค่าซื้อขาย							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
พ.ย. 62	20,304.7	-25.8	355.8	27,357.1	ส.ค. 60	4,455.1	ม.ค. 52
Q3/62	58,559.7	-24.1	252.0	77,129.0	Q1/61	16,637.8	Q1/52
2561	264,438.3	-8.4	153.1	288,740.4	2560	104,478.1	2552
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
พ.ย. 62	20,304.7	-25.3	122.1	27,179.6	พ.ย. 60	9,140.7	พ.ย. 52
11M/62	217,938.6	-17.8	131.8	265,044.5	11M/60	94,005.7	11M/52
Q3/62	58,559.7	-22.4	98.7	75,468.2	Q3/60	29,473.0	Q3/52
มูลค่าตราสารหนี้							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
พ.ย. 62	13,362.9	-	167.6	13,362.9	พ.ย. 62	4,994.1	ม.ค. 52
Q3/62	13,000.5	-1.3	150.4	13,171.6	Q2/62	5,191.3	Q1/52
2561	12,576.9	-	114.3	12,576.9	2561	5,868.7	2552
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
พ.ย. 62	13,362.9	-	129.7	13,362.9	พ.ย. 62	5,817.9	พ.ย. 52
Q3/62	13,000.5	-	127.5	13,000.5	Q3/62	5,715.7	Q3/52

ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ณ วันที่ 30 พ.ย. 62:

จุดสูงสุดและต่ำสุดในแต่ละช่วงเวลา ในระยะเวลา 11 ปี (ปี 2552-62)

Index	ค่าปัจจุบัน	% จาก ค่าสูงสุด	% จาก ค่าต่ำสุด	ค่าสูงสุด	Date	ค่าต่ำสุด	Date
Total Return Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
พ.ย. 62	319.20	-1.3	70.0	323.36	ก.ย. 62	187.79	ต.ค. 52
Q3/62	323.36	-	70.9	323.36	Q3/62	189.20	Q3/52
2561	279.09	-	46.8	279.09	2561	190.06	2552
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
พ.ย. 62	319.20	-	68.5	319.20	พ.ย. 62	189.44	พ.ย. 52
Q3/62	323.36	-	70.9	323.36	Q3/62	189.20	Q3/52
Gross Price Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
พ.ย. 62	118.15	-1.4	17.4	119.80	ส.ค. 62	100.61	ส.ค. 56
Q3/62	119.78	-	17.6	119.78	Q3/62	101.85	Q2/57
2561	105.31	-2.9	2.9	108.43	2558	102.30	2556
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
พ.ย. 62	118.15	-	15.2	118.15	พ.ย. 62	102.54	พ.ย. 56
Q3/62	119.78	-	17.4	119.78	Q3/62	102.04	Q3/56
Clean Price Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
พ.ย. 62	116.70	-1.9	17.3	119.01	ส.ค. 62	99.50	ส.ค. 56
Q3/62	118.83	-	17.7	118.83	Q3/62	100.98	Q3/56
2561	105.03	-2.6	3.5	107.88	2558	101.50	2556
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
พ.ย. 62	116.70	-	15.5	116.70	พ.ย. 62	101.05	พ.ย. 56
Q3/62	118.83	-	17.7	118.83	Q3/62	100.98	Q3/56