

ภาวะตลาดตราสารหนี้ของไทย เดือน ก.ย. 2560

- การซื้อขายตราสารหนี้ เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 24,943.5 Bn THB ลดลง 1.1% YoY และ 8.8% MoM โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,187.8 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 3.6% YoY แต่ลดลง 4.5% MoM หากพิจารณา 9M/60 มูลค่า 214,584.7 Bn THB เพิ่มขึ้น 3.6% YoY โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,166.2 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 3.0% YoY
- ตราสารหนี้ เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 11,158.6 Bn THB เพิ่มขึ้น 5.2% YoY 1.5% MoM และ 2.7% YTD โดยพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตรรัฐบาล ตราสารหนี้ภาคเอกชน และพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ คิดเป็น 25.9% 39.3% 26.5% และ 7.6% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ ส่วนมูลค่าตราสารหนี้อายุคงเหลือ (0,1Y), [1Y,5Y), [5Y,10Y), [10Y,15Y) และ [15Y,50Y] คิดเป็น 19.5% 22.0% 16.4% 18.3% และ 23.8% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ
- อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล เดือน ก.ย. 60 อายุคงเหลือ 3M 9M 1Y 3Y 5Y และ 10Y อยู่ที่ 1.21% 1.36% 1.42% 1.54% 1.76% และ 2.42% ตามลำดับ
- ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล เดือน ก.ย. 60 เมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปีก่อน ลดลงเกือบทุกประเภท ยกเว้น Total Price Index หากเทียบกับเดือนก่อน เพิ่มขึ้นทุกประเภท

การประเมินอันดับค่า อิงค่าต่ำสุด ค่าเฉลี่ย และค่าสูงสุด (ปี 2550-60)

| | All Periods | | | Same Periods | | | Latest |
|------------------------|-------------|---------|------|--------------|---------|-------|--------|
| | Month | Quarter | Year | YTD | Quarter | Month | |
| Bond | | | | | | | |
| Trading Value | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | 5 | Sep-17 |
| Outstanding | 5 | 5 | 5 | - | 5 | 5 | Sep-17 |
| Government Bond | | | | | | | |
| Total Return Index | 5 | 5 | 5 | - | 5 | 5 | Sep-17 |
| Gross Price Index | 4 | 4 | 3 | - | 4 | 4 | Sep-17 |
| Clean Price Index | 4 | 4 | 3 | - | 4 | 4 | Sep-17 |

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

อัตราการเปลี่ยนแปลงรายปี (ปี 2550-59)

| % | Average YoY Growth | CAGR |
|------------------------|--------------------|------|
| Bond | | |
| Trading Value | 55.4 | 35.5 |
| Outstanding | 11.2 | 9.8 |
| Government Bond | | |
| Total Return Index | 5.5 | 5.1 |
| Gross Price Index | 0.9 | 0.6 |
| Clean Price Index | 1.1 | 0.8 |

ที่มา: สมาคมตราสารหนี้ไทย

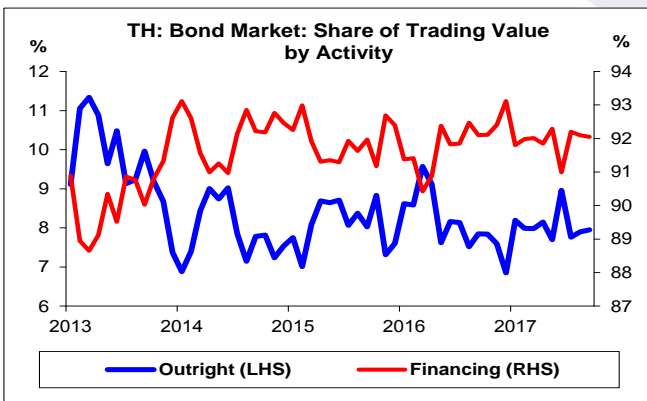
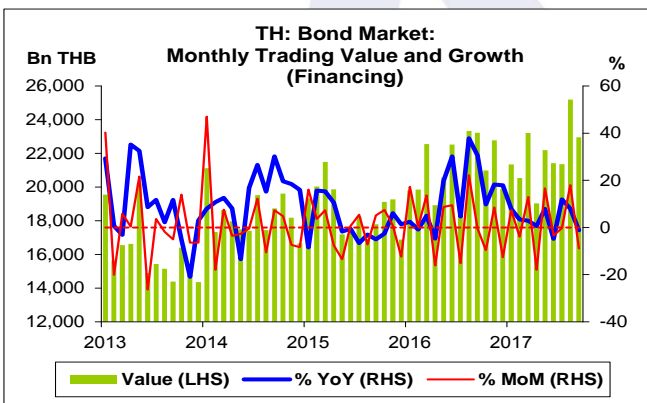
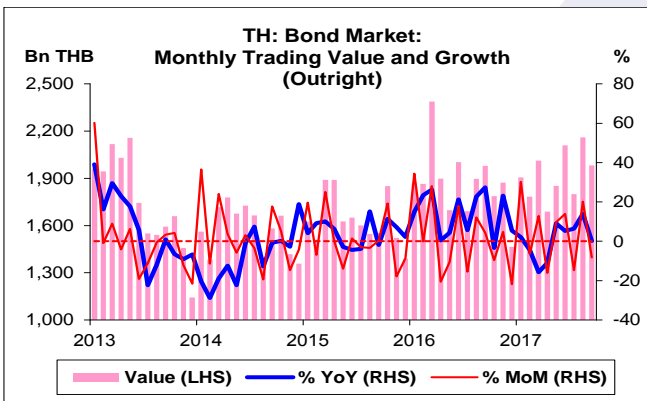
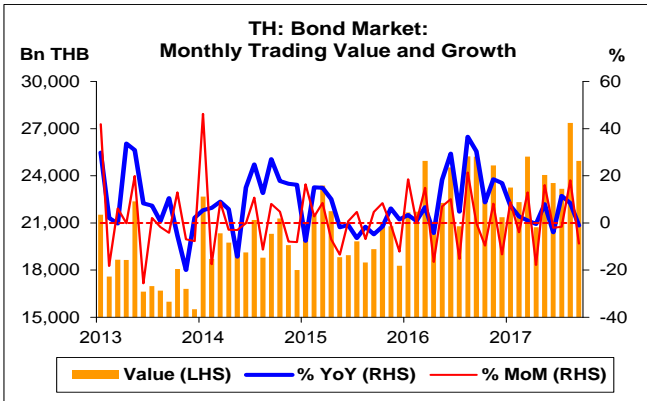
หมายเหตุ: 1. เดือน ก.ย. 59 ส.ค. 60 และ ก.ย. 60 มีวันหยุดทำการเดือนละ 22 และ 21 วัน ตามลำดับ

2. 9M/59 และ 9M/60 มีวันหยุดทำการ 183 และ 184 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



มูลค่าซื้อขายตราสารหนี้

- การซื้อขายตราสารหนี้ เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 24,943.5 Bn THB ลดลง 1.1% YoY และ 8.8% MoM โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,187.8 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 3.6% YoY แต่ลดลง 4.5% MoM
- หากพิจารณา 9M/60 การซื้อขายตราสารหนี้ มูลค่า 214,584.7 Bn THB เพิ่มขึ้น 3.6% YoY ทั้งนี้ สูงกว่าค่าเฉลี่ยในช่วงเดียวกันของปี 50-59 ที่ 126,443.9 Bn THB อยู่ถึง 69.7% และสูงสุดเมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปี 50-59 โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,166.2 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 3.0% YoY

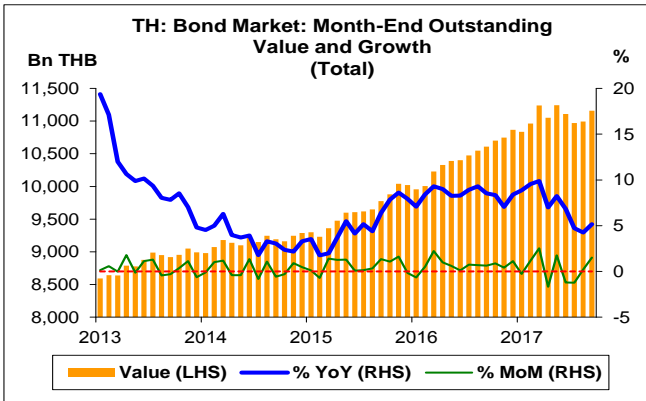
- การซื้อขายตราสารหนี้ ตามประเภทธุรกรรม 2 ประเภท ได้แก่ ธุรกรรมการซื้อขายเพื่อการลงทุน (Outright) และธุรกรรมเพื่อการกู้ยืม (Financing) โดยเดือน ก.ย. 60 คิดเป็น 8.0% และ 92.0% ของมูลค่าซื้อขายตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ

ธุรกรรมการซื้อขายเพื่อการลงทุน

- ธุรกรรมการซื้อขายเพื่อการลงทุน เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 1,982.5 Bn THB เพิ่มขึ้นเพียง 0.2% YoY เพิ่มขึ้นติดต่อกันเป็นเดือนที่ 5 แต่ลดลง 8.3% MoM โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 94.4 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 5.0% YoY แต่ลดลง 3.9% MoM
- หากพิจารณา 9M/60 ธุรกรรมการซื้อขายเพื่อการลงทุน มูลค่า 17,294.0 Bn THB เพิ่มขึ้นเพียง 0.1% YoY ทั้งนี้ สูงกว่าค่าเฉลี่ยในช่วงเดียวกันของปี 50-59 ที่ 13,636.4 Bn THB อยู่ถึง 26.8% สูงกว่าช่วงเดียวกันของปี 56 อยู่ 1.0% CAGR และสูงสุดเมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปี 50-59 โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 94.0 Bn THB/D ลดลงเพียง 0.5% YoY

ธุรกรรมเพื่อการกู้ยืม

- ธุรกรรมเพื่อการกู้ยืม เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 22,960.0 Bn THB ลดลง 1.1% YoY และ 8.9% MoM โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,093.3 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 3.6% YoY แต่ลดลง 4.5% MoM



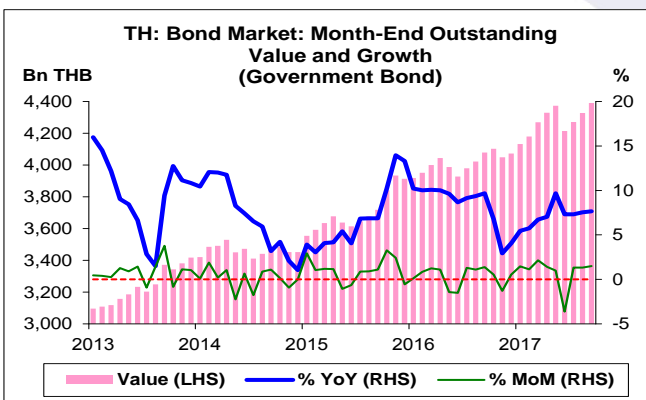
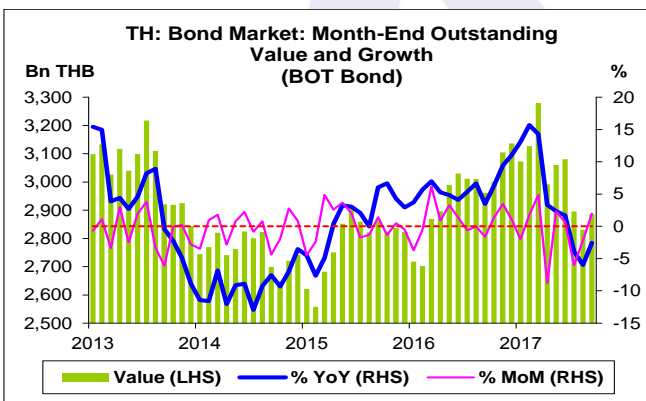
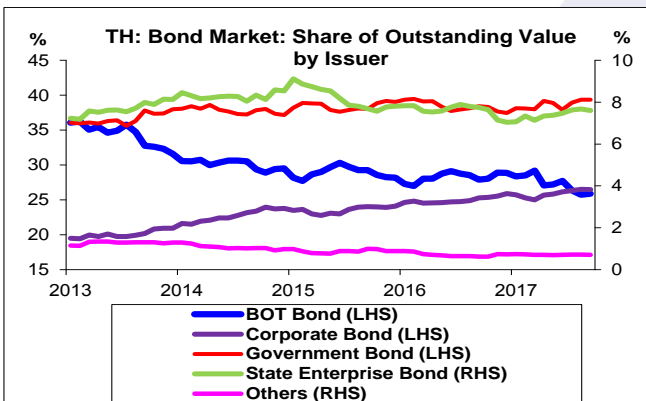
- หากพิจารณา 9M/60 ธุรกรรมเพื่อการกู้ยืม มูลค่า 197,257.7 Bn THB เพิ่มขึ้น 3.9% YoY ทั้งนี้ สูงกว่าค่าเฉลี่ยในช่วงเดียวกันของปี 50-59 ที่ 112,733.9 Bn THB อยู่ถึง 75.0% และสูงสุดเมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปี 50-59 โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,072.1 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 3.3% YoY

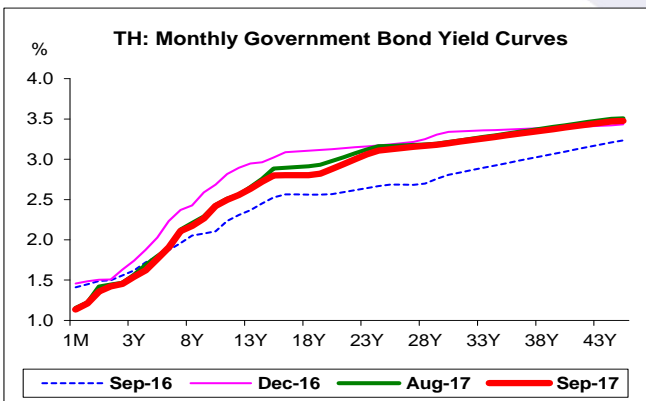
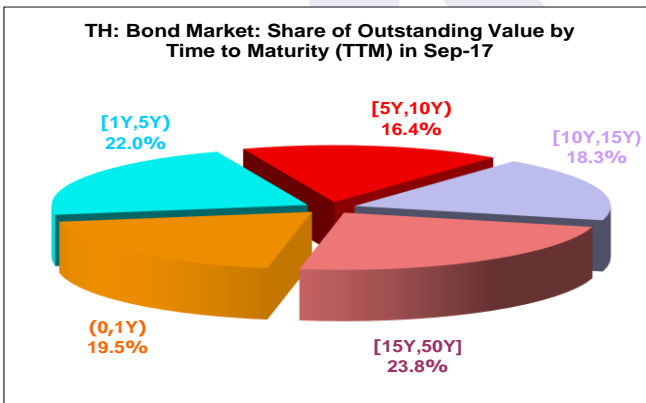
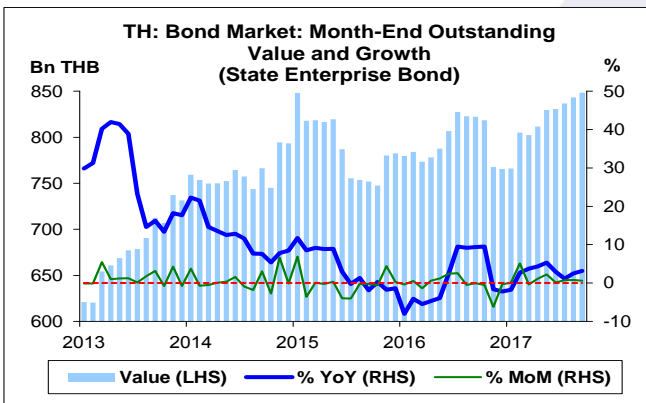
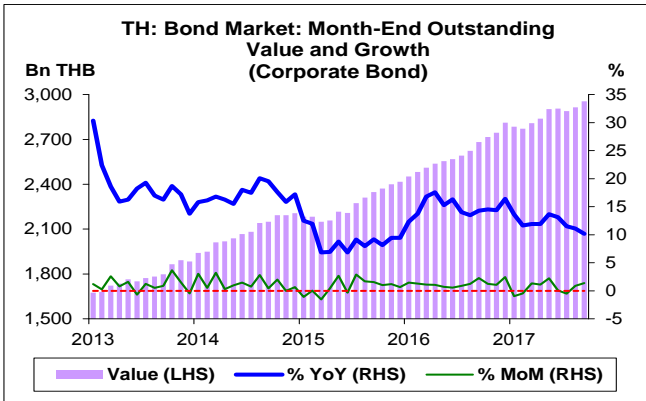
มูลค่าตราสารหนี้

- ตราสารหนี้ เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 11,158.6 Bn THB เพิ่มขึ้น 5.2% YoY เพิ่มขึ้นติดต่อกันเป็นเดือนที่ 129 และเพิ่มขึ้น 1.5% MoM และ 2.7% YTD

มูลค่าตราสารหนี้ตามประเภทผู้ออก

- มูลค่าตราสารหนี้ แบ่งตามประเภทผู้ออกที่สำคัญ 4 กลุ่ม ได้แก่ พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตรรัฐบาล ตราสารหนี้ภาคเอกชน และพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ โดยเดือน ก.ย. 60 คิดเป็น 25.9% 39.3% 26.5% และ 7.6% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมดตามลำดับ
- พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 2,886.1 Bn THB ลดลง 2.5% YoY และ 8.0% YTD แต่เพิ่มขึ้น 1.9% MoM
- พันธบัตรรัฐบาล เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 4,390.6 Bn THB สูงสุดนับตั้งแต่เดือน ม.ค. 50 โดยเพิ่มขึ้น 7.7% YoY เพิ่มขึ้นติดต่อกันเป็นเดือนที่ 75 และเพิ่มขึ้น 1.5% MoM และ 7.8% YTD





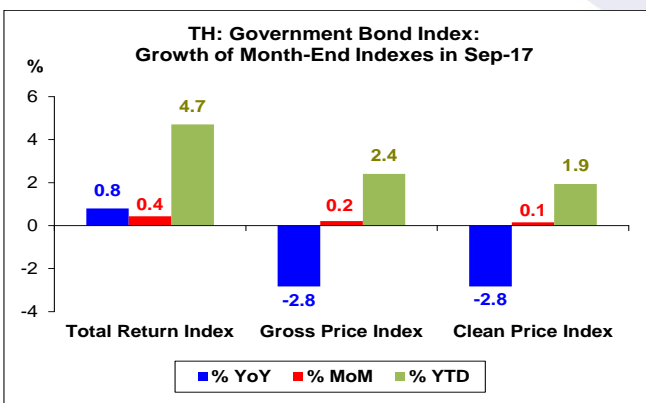
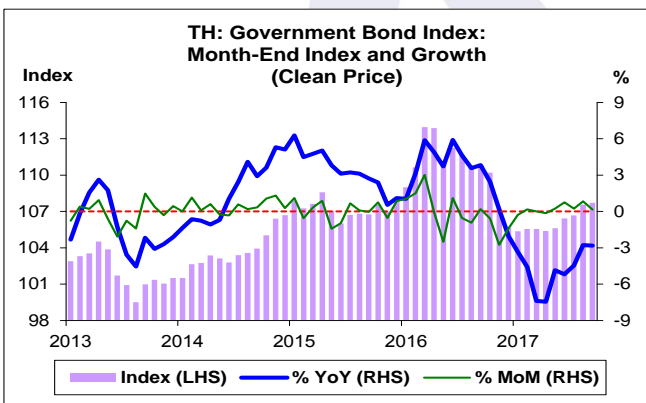
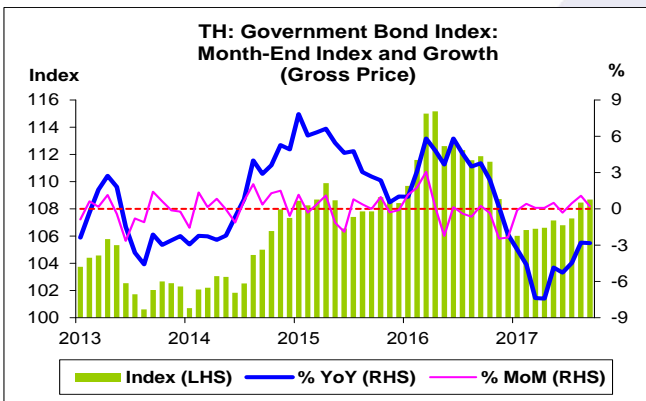
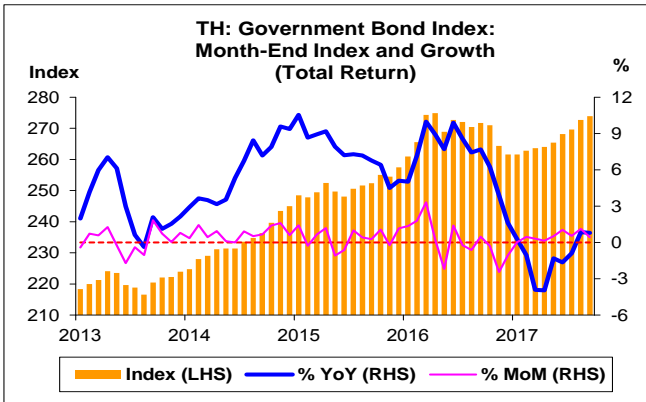
- ตราสารหนี้ภาคเอกชน เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 2,955.1 Bn THB สูงสุดนับตั้งแต่เดือน ม.ค. 50 โดยเพิ่มขึ้น 10.2% YoY เพิ่มขึ้นติดต่อกันเป็นเดือนที่ 129 และเพิ่มขึ้น 1.4% MoM และ 5.1% YTD
- พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 848.4 Bn THB เพิ่มขึ้น 3.2% YoY เพิ่มขึ้นติดต่อกันเป็นเดือนที่ 8 เพิ่มขึ้น 0.6% MoM เพิ่มขึ้นติดต่อกันเป็นเดือนที่ 6 และเพิ่มขึ้น 10.8% YTD

มูลค่าตราสารหนี้ตามอายุคงเหลือ (Time to Maturity: TTM)

- มูลค่าตราสารหนี้ ตามอายุคงเหลือของตราสาร 5 กลุ่ม ได้แก่ (0,1Y), [1Y,5Y), [5Y,10Y), [10Y,15Y) และ [15Y,50Y] โดยเดือน ก.ย. 60 คิดเป็น 19.5% 22.0% 16.4% 18.3% และ 23.8% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ
- ตราสารหนี้อายุคงเหลือ (0,1Y) เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 2,171.8 Bn THB ลดลง 9.5% YoY และ 9.6% YTD แต่เพิ่มขึ้น 1.6% MoM
- ตราสารหนี้อายุคงเหลือ [1Y,5Y) เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 2,452.8 Bn THB เพิ่มขึ้น 10.8% YoY 2.2% MoM และ 6.0% YTD
- ตราสารหนี้อายุคงเหลือ [5Y,10Y) เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 1,836.2 Bn THB เพิ่มขึ้น 7.8% YoY 2.5% MoM และ 5.5% YTD
- ตราสารหนี้อายุคงเหลือ [10Y,15Y) เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 2,046.8 Bn THB เพิ่มขึ้น 2.8% YoY 0.9% MoM และ 0.2% YTD
- ตราสารหนี้อายุคงเหลือ [15Y,50Y) เดือน ก.ย. 60 มูลค่า 2,651.0 Bn THB เพิ่มขึ้น 15.1% YoY 0.6% MoM และ 12.1% YTD

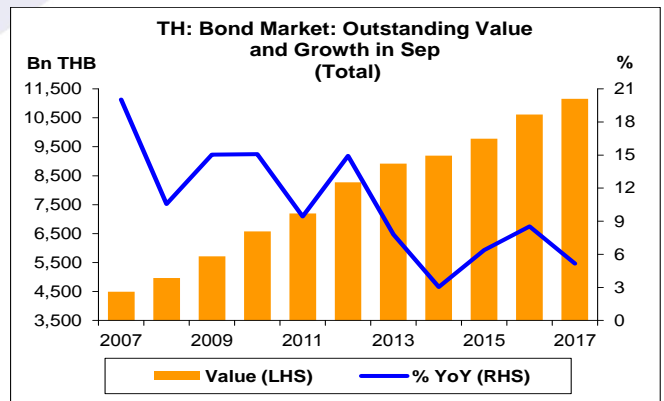
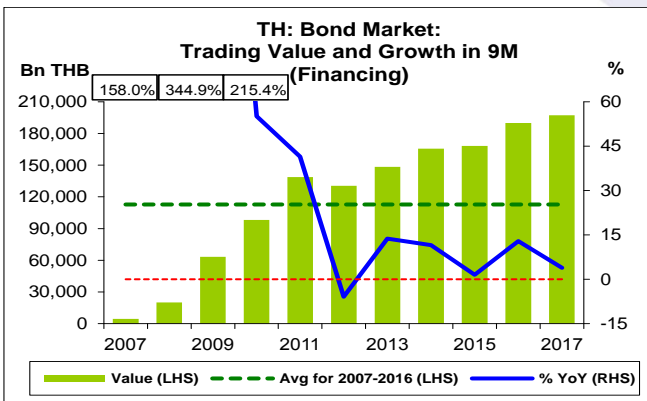
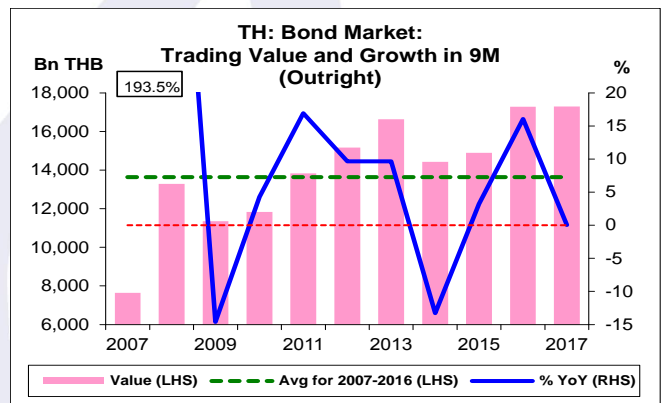
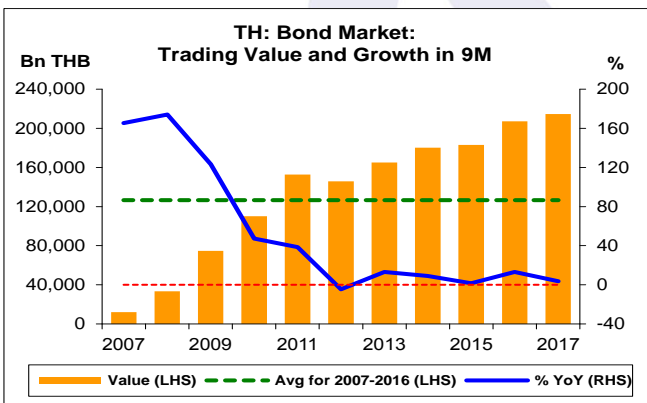
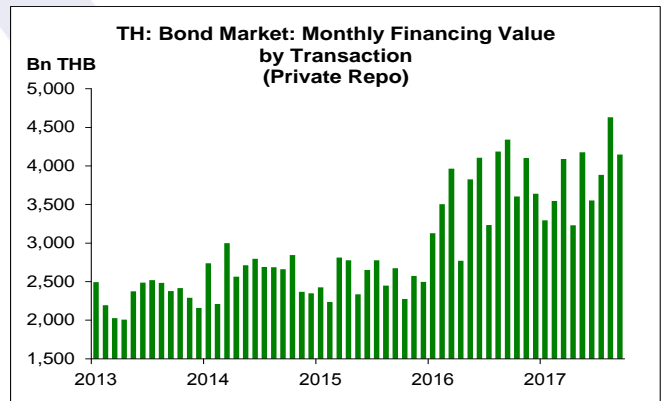
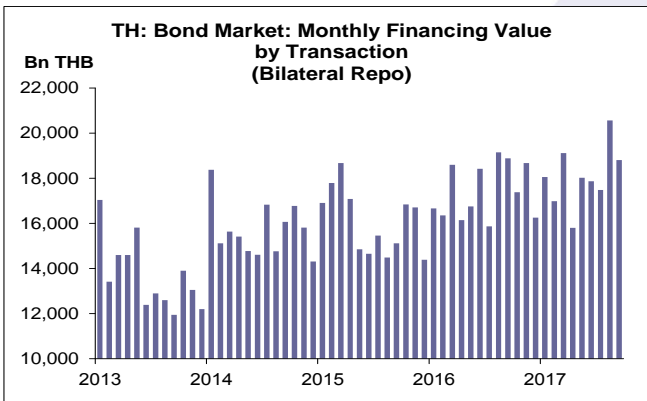
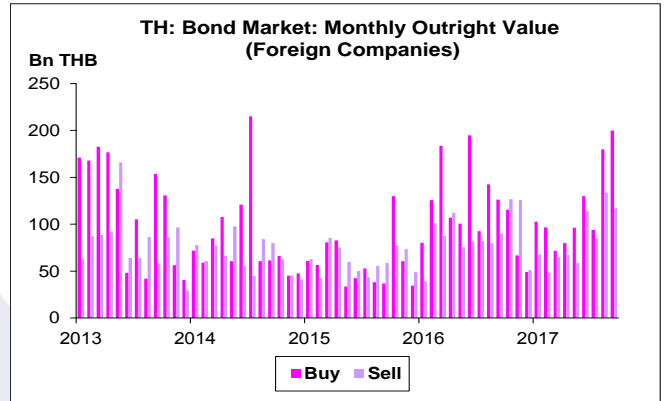
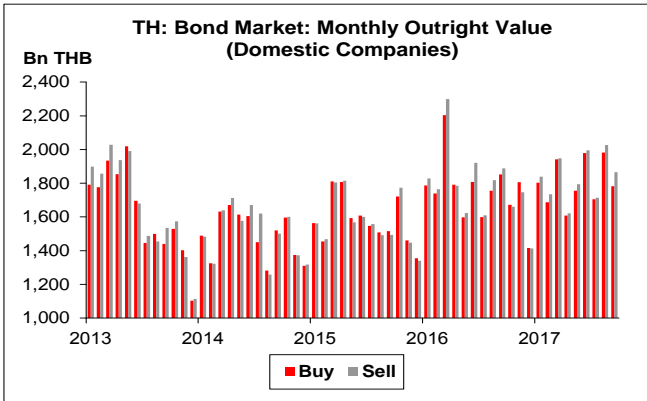
อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล

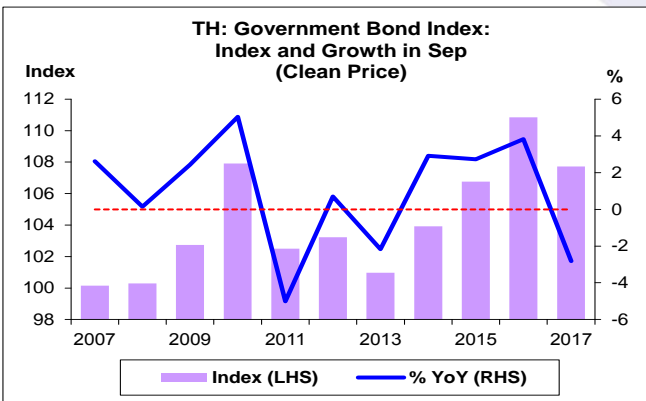
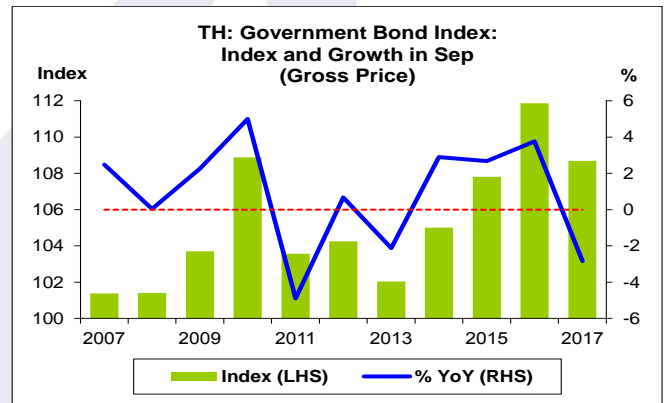
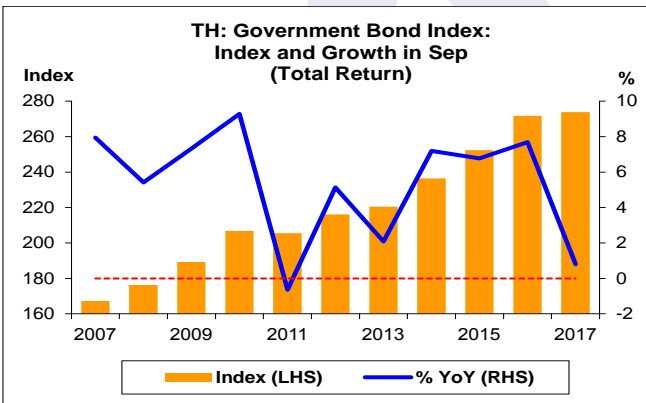
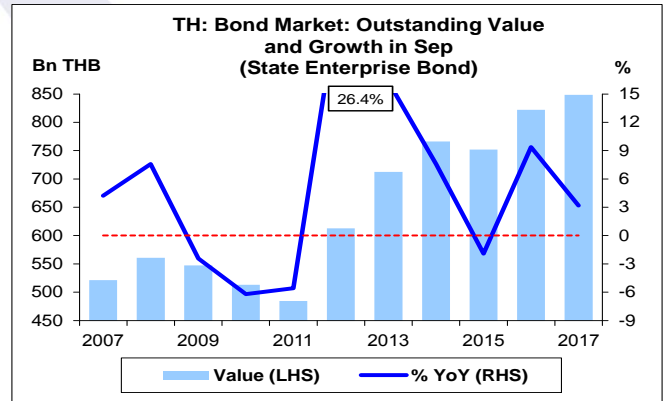
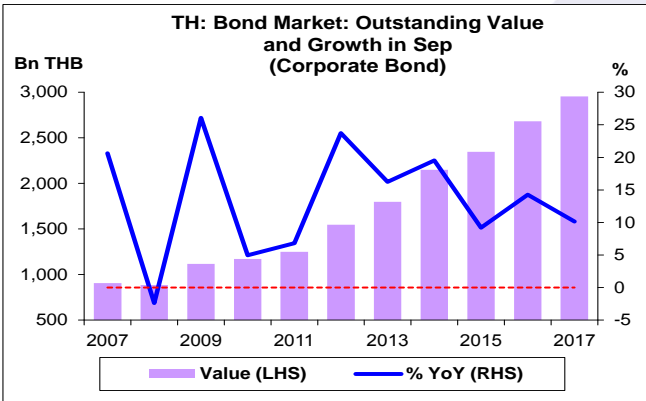
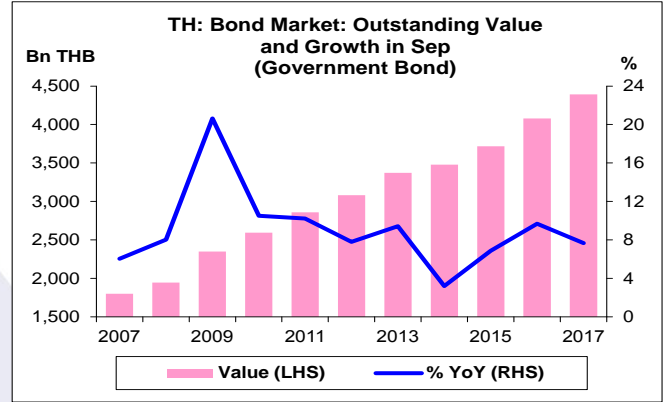
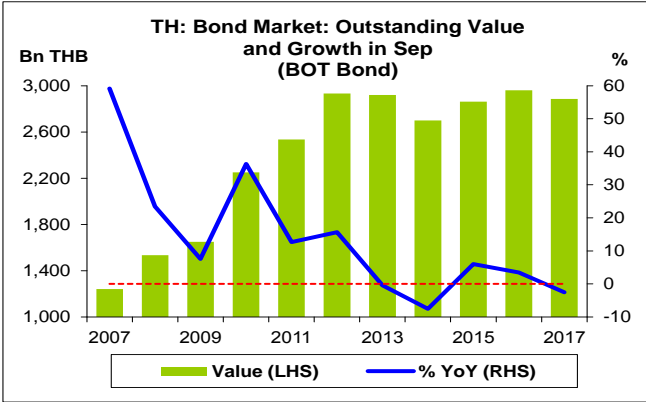
- อายุคงเหลือของพันธบัตรรัฐบาลที่พิจารณา ได้แก่ 3M 9M 1Y 3Y 5Y และ 10Y โดยเดือน ก.ย. 60 อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล อยู่ที่ 1.21% 1.36% 1.42% 1.54% 1.76% และ 2.42% ตามลำดับ เมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปีก่อน อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลลดลงเกือบทุกอายุคงเหลือ ยกเว้น 10Y หากเทียบกับเดือนก่อนลดลงทุกอายุคงเหลือ

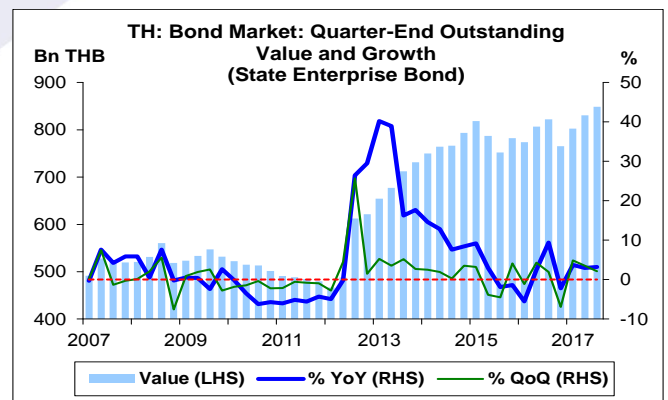
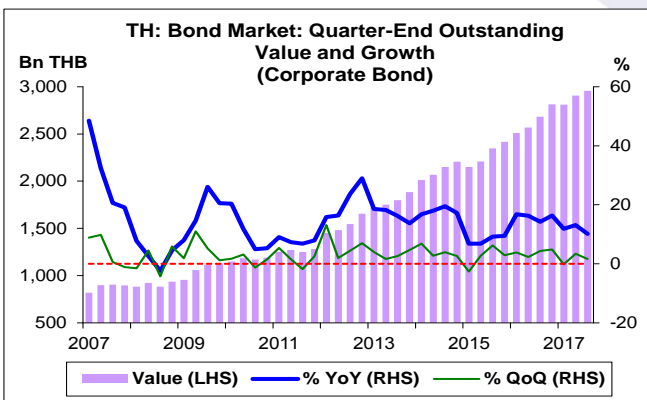
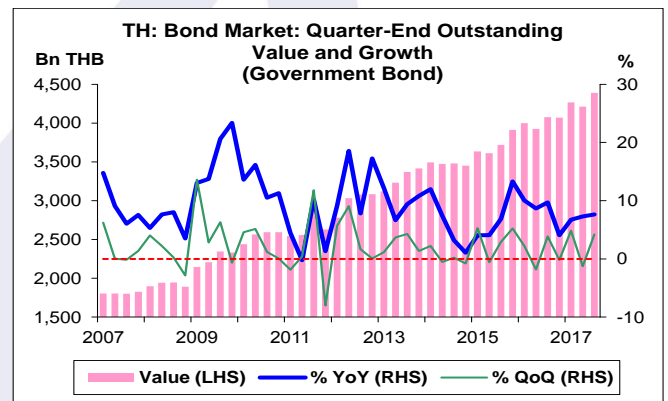
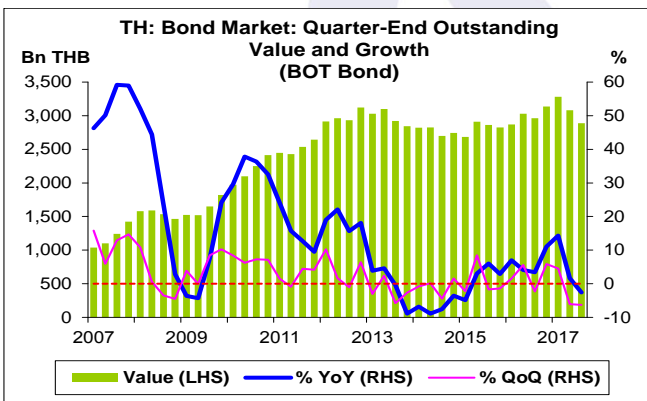
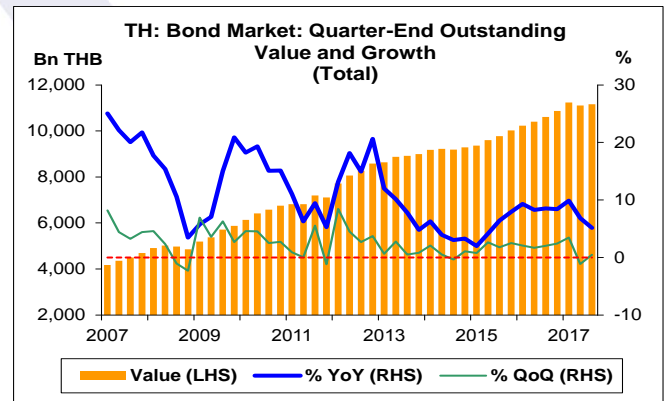
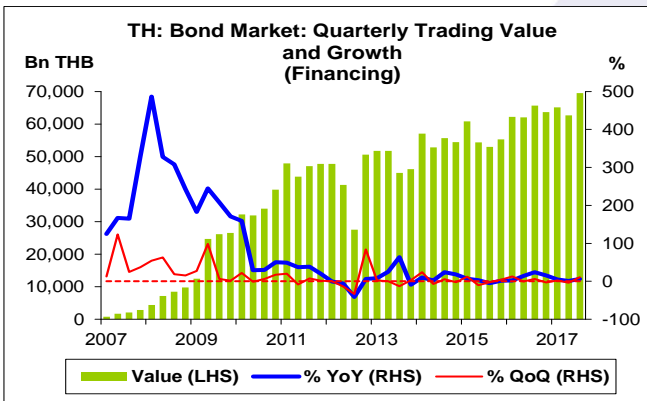
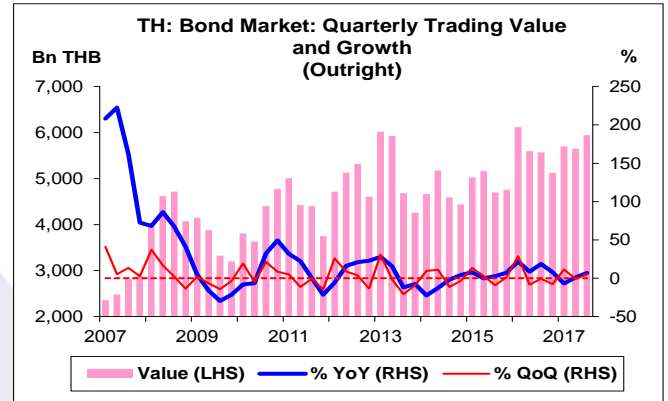
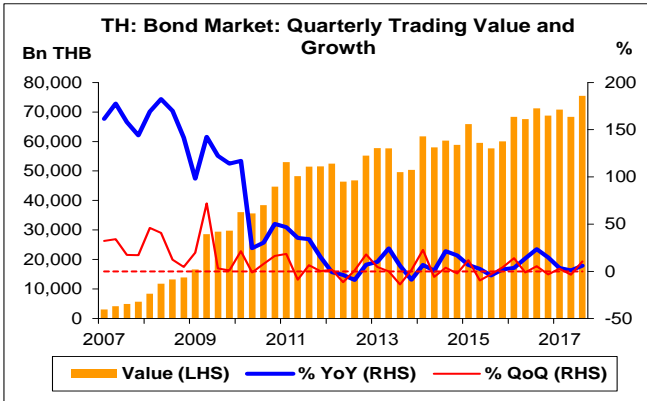


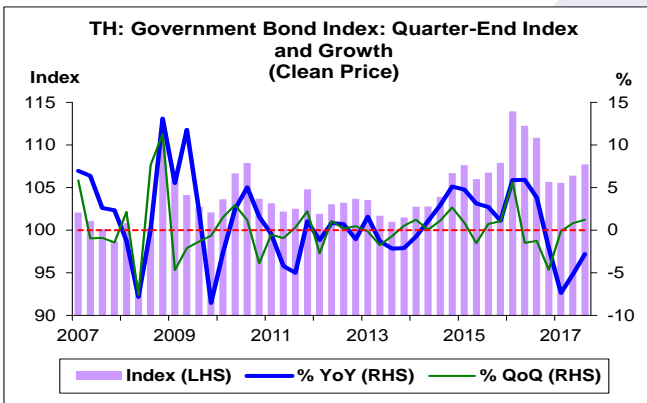
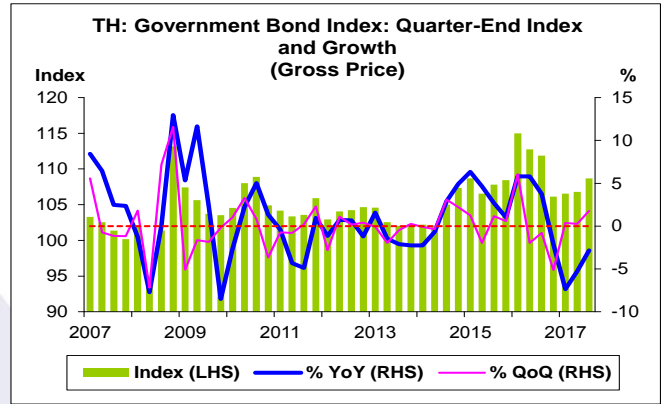
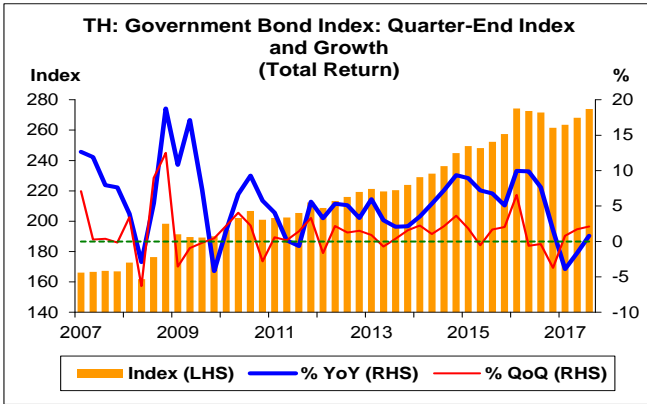
ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล

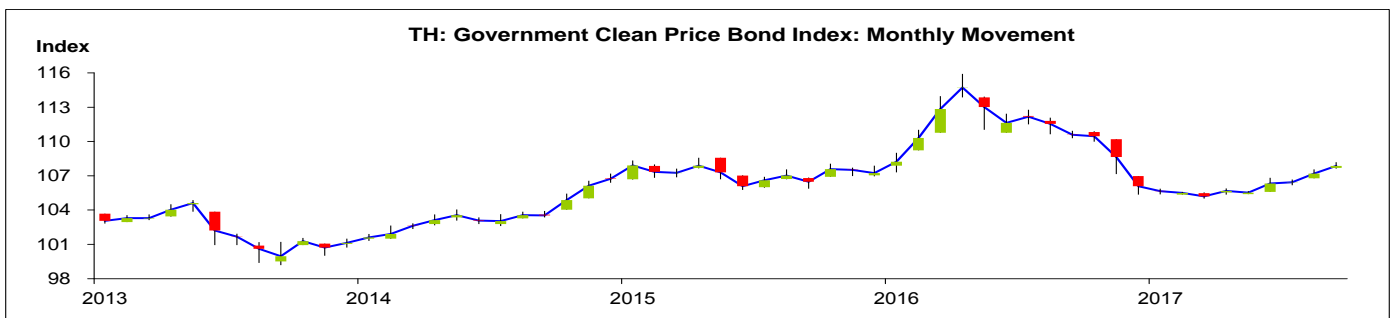
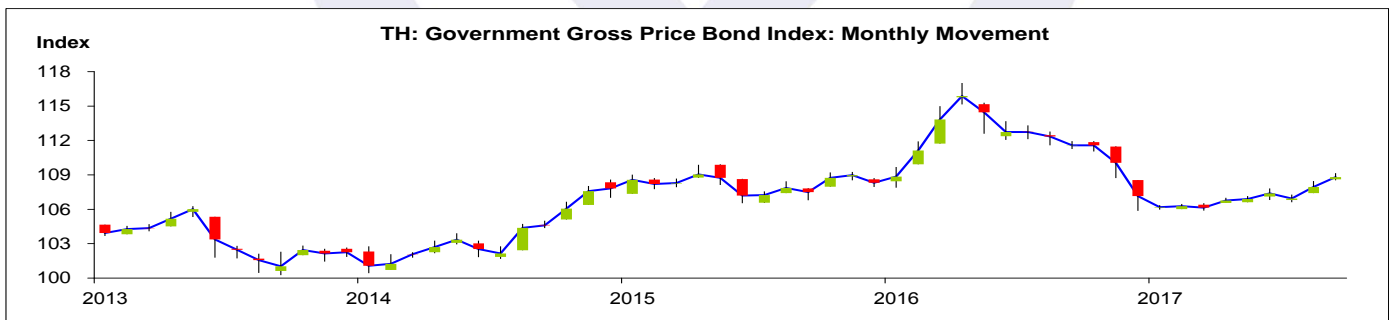
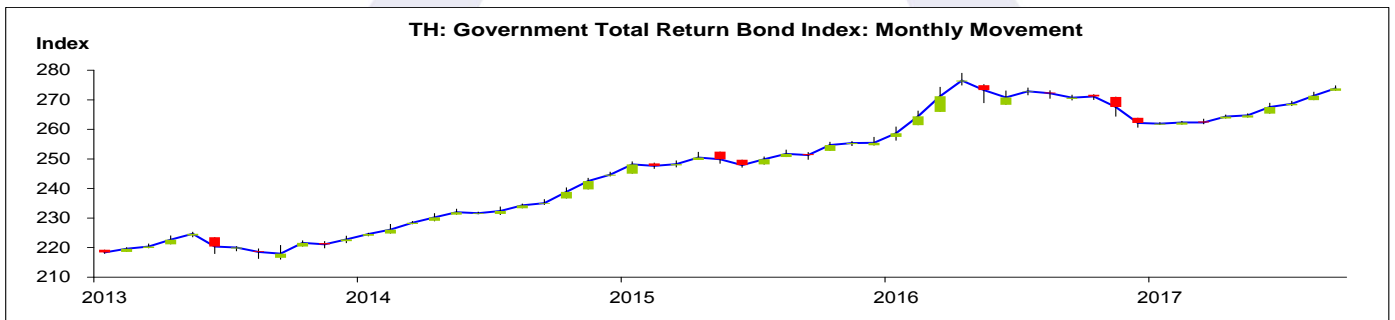
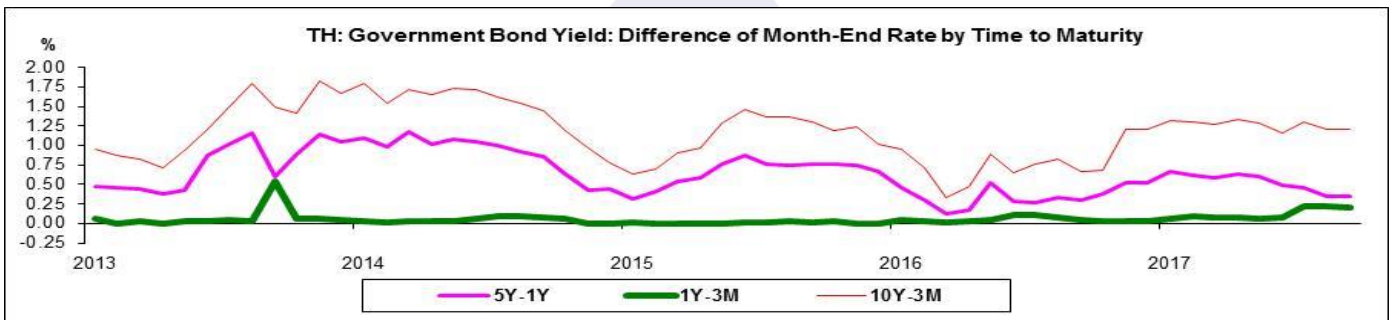
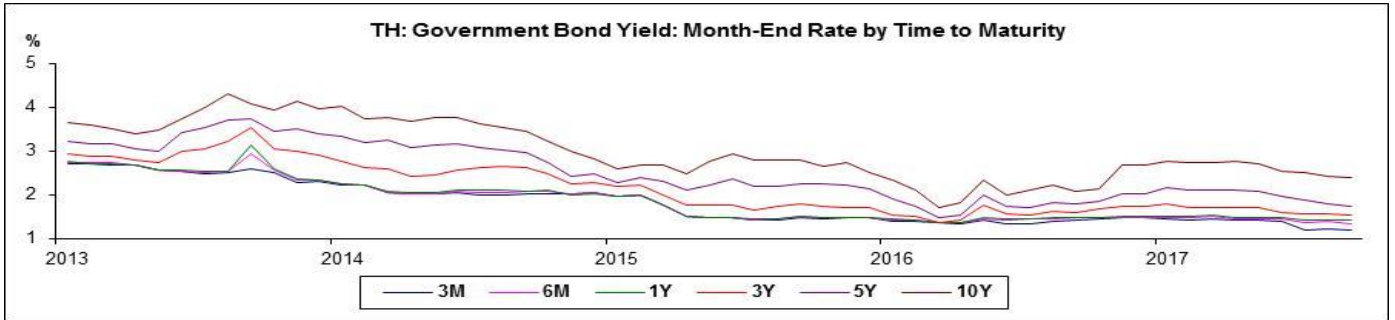
- ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล 3 ประเภท ได้แก่ Total Return Index, Gross Price Index และ Clean Price Index
- Total Return Index เดือน ก.ย. 60 เคลื่อนไหวระหว่าง 273.05-274.87 จุด และปิดที่ 273.86 จุด เพิ่มขึ้น 0.8% YoY 0.4% MoM และ 4.7% YTD
- Gross Price Index เดือน ก.ย. 60 เคลื่อนไหวระหว่าง 108.53-109.15 จุด และปิดที่ 108.69 จุด ลดลง 2.8% YoY แต่เพิ่มขึ้น 0.2% MoM และ 2.4% YTD
- Clean Price Index เดือน ก.ย. 60 เคลื่อนไหวระหว่าง 107.63-108.19 จุด และปิดที่ 107.72 จุด ลดลง 2.8% YoY แต่เพิ่มขึ้น 0.1% MoM และ 1.9% YTD

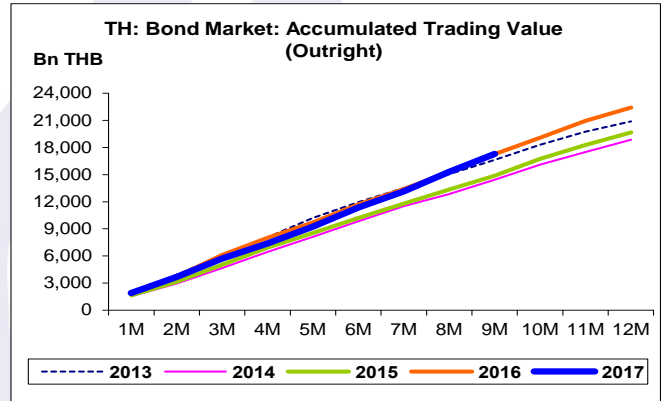
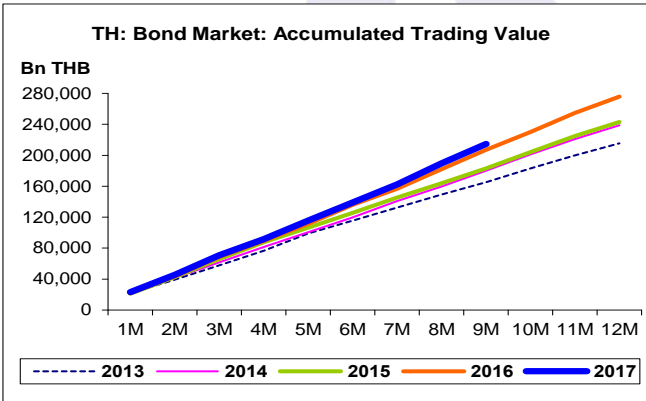
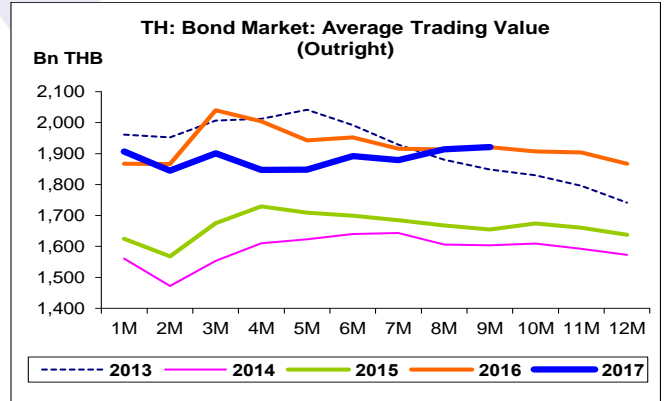
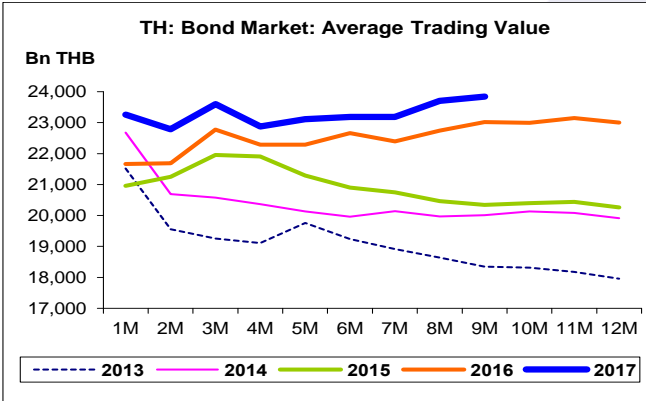
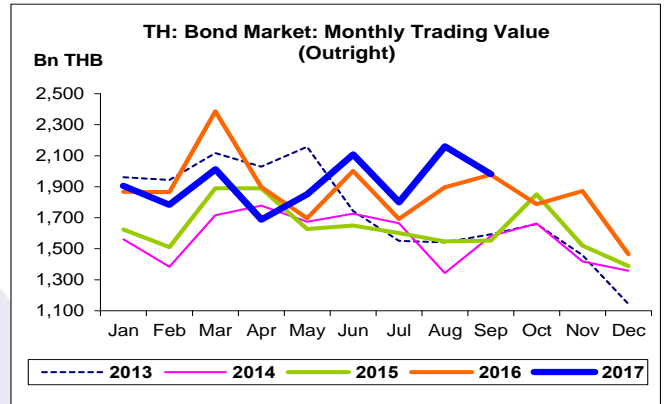
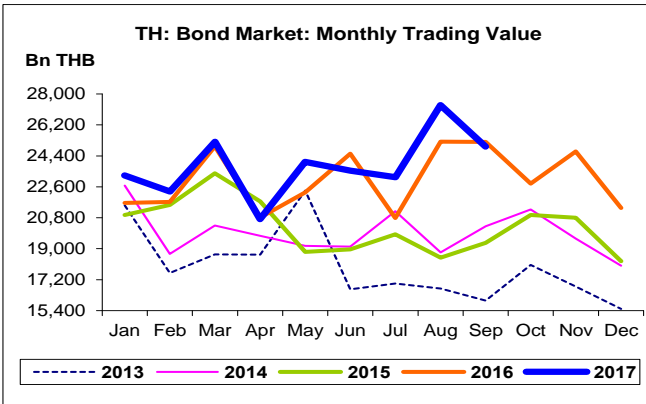


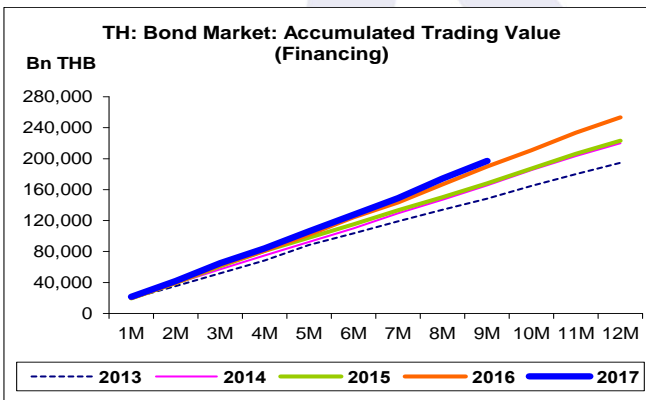
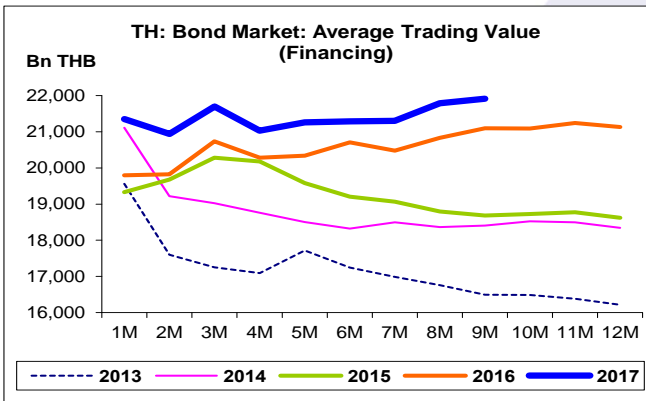
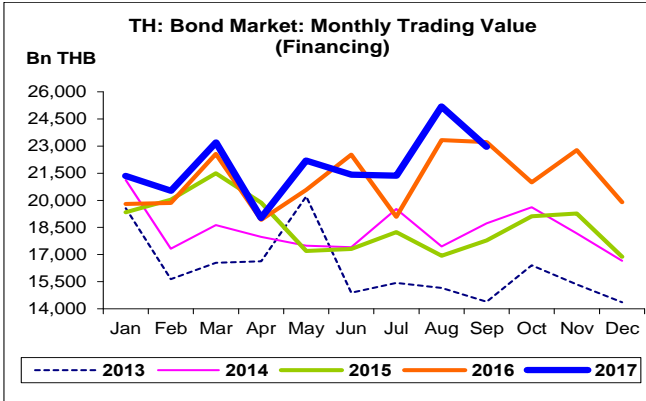


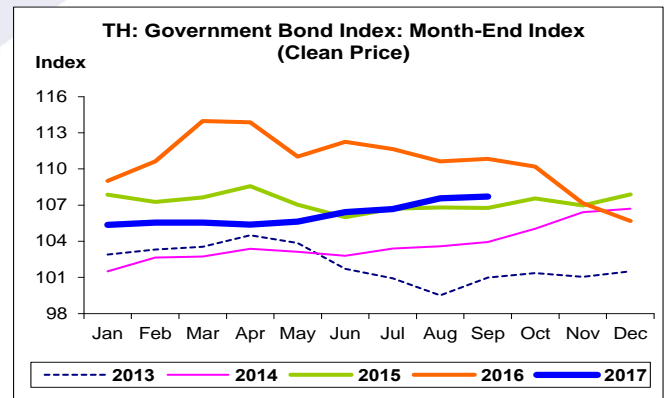
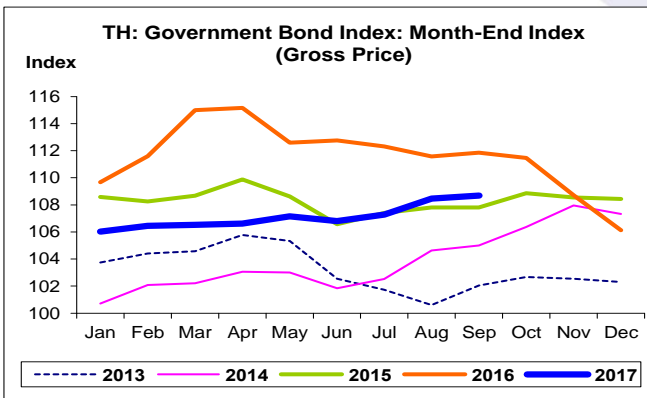
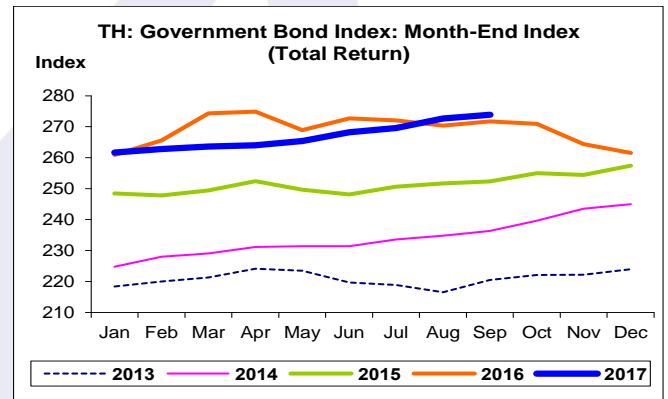
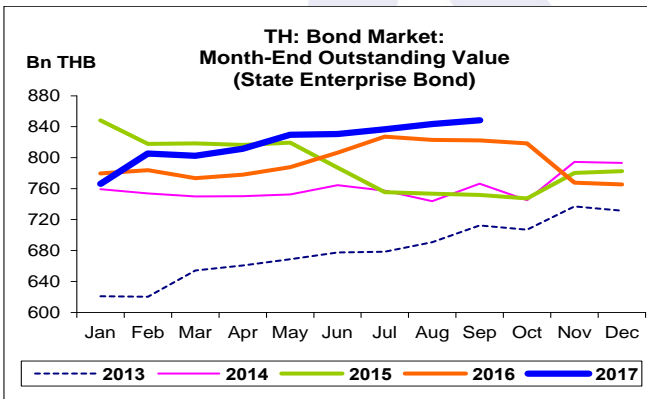
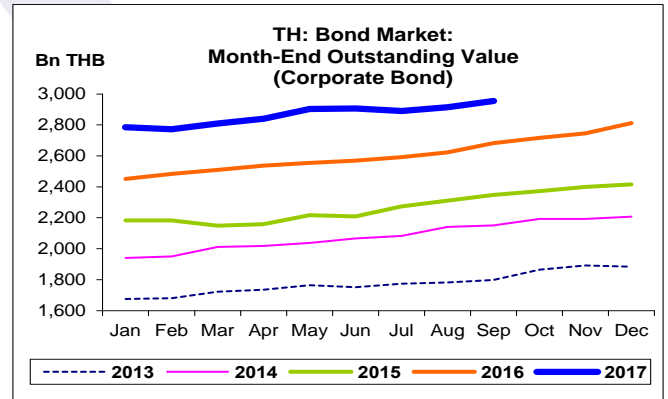
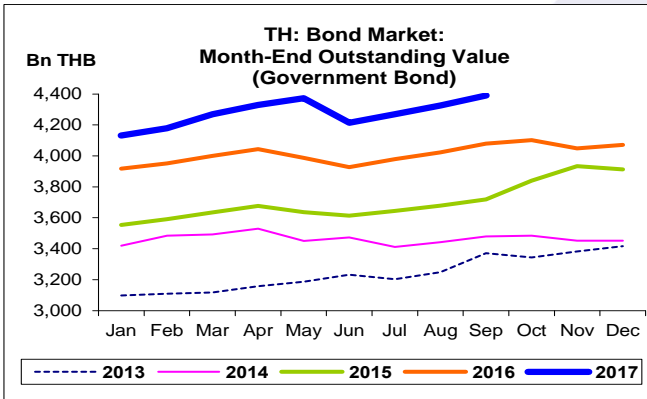
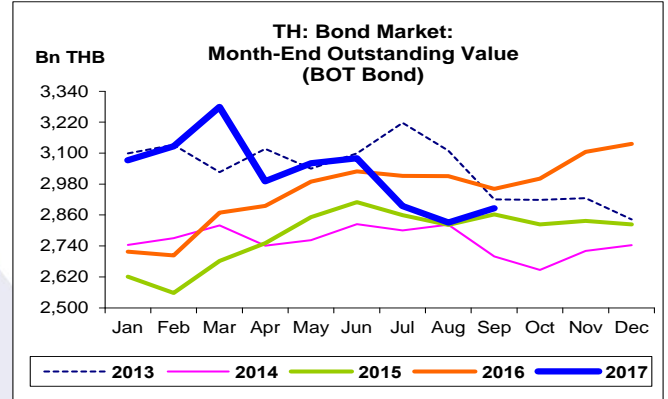
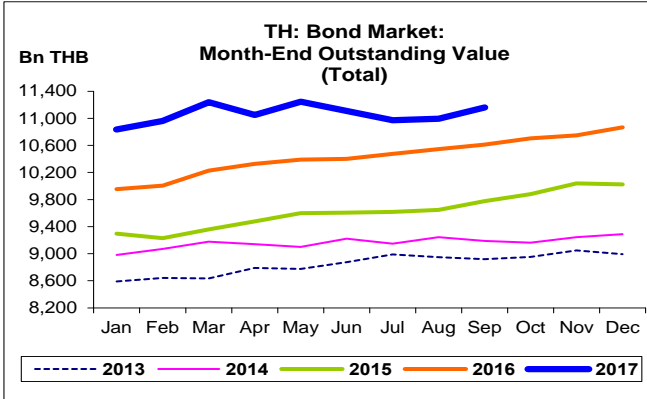












Trading Value by Transaction in Sep-17

| Transaction | Monthly | | | Daily Average | | |
|---------------------|-----------------|--------------|-------------|----------------|--------------|-------------|
| | Bn THB | % YoY | % MoM | Bn THB | % YoY | % MoM |
| Outright | 1,982.5 | 0.2 | -8.3 | 94.4 | 5.0 | -3.9 |
| -Domestic Companies | | | | | | |
| -Buy | 1,782.6 | -3.8 | -10.0 | 84.9 | 0.8 | -5.7 |
| -Sell | 1,865.3 | -1.2 | -8.0 | 88.8 | 3.5 | -3.6 |
| -Net | -82.7 | | | | | |
| -Foreign Companies | | | | | | |
| -Buy | 199.8 | 58.3 | 11.2 | 9.5 | 65.9 | 16.5 |
| -Sell | 117.1 | 29.7 | -12.6 | 5.6 | 35.9 | -8.5 |
| -Net | 82.7 | | | | | |
| Financing | 22,960.0 | -1.1 | -8.9 | 1,093.3 | 3.6 | -4.5 |
| -Bilateral Repo | 18,808.4 | -0.4 | -8.5 | 895.6 | 4.3 | -4.2 |
| -Private Repo | 4,149.5 | -4.4 | -10.4 | 197.6 | 0.1 | -6.1 |
| -Others | 2.1 | 104.0 | 104.9 | 0.1 | 113.7 | 114.7 |
| Others | 1.0 | -92.2 | 63.8 | 0.0 | -91.8 | 71.6 |
| Total | 24,943.5 | -1.1 | -8.8 | 1,187.8 | 3.6 | -4.5 |

Trading Value by Transaction in 9M/17

| Transaction | 9M/17 | | Daily Average | |
|---------------------|------------------|-------------|----------------|-------------|
| | Bn THB | % YoY | Bn THB | % YoY |
| Outright | 17,294.0 | 0.1 | 94.0 | -0.5 |
| -Domestic Companies | | | | |
| -Buy | 16,243.6 | 0.7 | 88.3 | 0.1 |
| -Sell | 16,536.5 | 0.0 | 89.9 | -0.5 |
| -Net | -292.9 | | | |
| -Foreign Companies | | | | |
| -Buy | 1,050.5 | -8.9 | 5.7 | -9.4 |
| -Sell | 757.5 | 1.1 | 4.1 | 0.5 |
| -Net | 292.9 | | | |
| Financing | 197,257.7 | 3.9 | 1,072.1 | 3.3 |
| -Bilateral Repo | 162,684.0 | 3.7 | 884.2 | 3.2 |
| -Private Repo | 34,560.4 | 4.5 | 187.8 | 4.0 |
| -Others | 13.3 | -34.3 | 0.1 | -34.6 |
| Others | 32.9 | 44.6 | 0.2 | 43.8 |
| Total | 214,584.7 | 3.6 | 1,166.2 | 3.0 |

Outstanding Value by Issuer and Time to Maturity as of 30 Sep 2017

| Issuer (Bn THB) | Time to Maturity (TTM) | | | | | Total |
|-----------------------|------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| | TTM<1 | 1-5 | 5-10 | 10-15 | 15-50 | |
| Government Bond | 175.7 | 65.5 | 637.7 | 1,176.4 | 2,335.3 | 4,390.6 |
| BOT Bond | 1,725.3 | 1,152.4 | 8.4 | 0.0 | 0.0 | 2,886.1 |
| State Enterprise Bond | 0.0 | 108.9 | 373.1 | 215.0 | 151.4 | 848.4 |
| Corporate Bond | 270.8 | 1,105.4 | 786.9 | 627.7 | 164.3 | 2,955.1 |
| Foreign Bond | 0.0 | 20.6 | 30.1 | 27.7 | 0.0 | 78.3 |
| Total | 2,171.8 | 2,452.8 | 1,836.2 | 2,046.8 | 2,651.0 | 11,158.6 |

Government Bond Yield Curve (%)

| Time to Maturity (TTM) | 30/9/2016 | 31/12/2016 | 31/8/2017 | 30/9/2017 | | | |
|------------------------|-----------|------------|-----------|-----------|-------------|-------|-------|
| | | | | Rate | Change (bp) | | |
| | | | | | YoY | MoM | YTD |
| 1M | 1.41 | 1.46 | 1.15 | 1.13 | -0.28 | -0.02 | -0.32 |
| 3M | 1.45 | 1.49 | 1.22 | 1.21 | -0.24 | -0.01 | -0.27 |
| 6M | 1.49 | 1.50 | 1.42 | 1.36 | -0.13 | -0.06 | -0.15 |
| 1Y | 1.50 | 1.51 | 1.45 | 1.42 | -0.08 | -0.02 | -0.09 |
| 2Y | 1.56 | 1.63 | 1.47 | 1.45 | -0.11 | -0.02 | -0.18 |
| 3Y | 1.62 | 1.74 | 1.57 | 1.54 | -0.08 | -0.03 | -0.20 |
| 4Y | 1.72 | 1.87 | 1.69 | 1.62 | -0.10 | -0.07 | -0.25 |
| 5Y | 1.79 | 2.03 | 1.80 | 1.76 | -0.03 | -0.04 | -0.26 |
| 6Y | 1.87 | 2.23 | 1.90 | 1.91 | 0.03 | 0.01 | -0.33 |
| 7Y | 1.96 | 2.37 | 2.13 | 2.11 | 0.15 | -0.02 | -0.27 |
| 8Y | 2.05 | 2.43 | 2.21 | 2.17 | 0.12 | -0.04 | -0.25 |
| 9Y | 2.08 | 2.59 | 2.29 | 2.27 | 0.19 | -0.02 | -0.32 |
| 10Y | 2.11 | 2.69 | 2.43 | 2.42 | 0.31 | -0.02 | -0.27 |
| 11Y | 2.23 | 2.82 | 2.51 | 2.50 | 0.26 | -0.01 | -0.32 |
| 12Y | 2.31 | 2.90 | 2.56 | 2.56 | 0.25 | 0.00 | -0.34 |
| 13Y | 2.37 | 2.95 | 2.65 | 2.63 | 0.27 | -0.02 | -0.31 |
| 14Y | 2.45 | 2.96 | 2.76 | 2.72 | 0.27 | -0.04 | -0.24 |
| 15Y | 2.53 | 3.02 | 2.88 | 2.80 | 0.27 | -0.08 | -0.22 |
| 16Y | 2.56 | 3.09 | 2.89 | 2.80 | 0.24 | -0.09 | -0.29 |
| 17Y | 2.56 | 3.10 | 2.90 | 2.80 | 0.24 | -0.10 | -0.30 |
| 18Y | 2.56 | 3.11 | 2.91 | 2.80 | 0.24 | -0.11 | -0.30 |
| 19Y | 2.56 | 3.12 | 2.93 | 2.82 | 0.26 | -0.11 | -0.30 |
| 20Y | 2.57 | 3.13 | 2.98 | 2.88 | 0.31 | -0.10 | -0.25 |
| 21Y | 2.59 | 3.14 | 3.03 | 2.94 | 0.35 | -0.09 | -0.20 |
| 22Y | 2.62 | 3.15 | 3.07 | 3.00 | 0.38 | -0.07 | -0.15 |
| 23Y | 2.64 | 3.16 | 3.12 | 3.06 | 0.42 | -0.06 | -0.10 |
| 24Y | 2.67 | 3.17 | 3.16 | 3.11 | 0.44 | -0.05 | -0.06 |
| 25Y | 2.69 | 3.18 | 3.17 | 3.12 | 0.44 | -0.04 | -0.06 |
| 26Y | 2.68 | 3.20 | 3.17 | 3.14 | 0.46 | -0.03 | -0.06 |
| 27Y | 2.68 | 3.22 | 3.18 | 3.15 | 0.47 | -0.02 | -0.06 |
| 28Y | 2.70 | 3.25 | 3.18 | 3.17 | 0.47 | -0.02 | -0.08 |
| 29Y | 2.76 | 3.31 | 3.19 | 3.18 | 0.42 | -0.01 | -0.13 |
| 30Y | 2.81 | 3.34 | 3.21 | 3.20 | 0.39 | -0.02 | -0.14 |
| 31Y | 2.84 | 3.35 | 3.24 | 3.22 | 0.38 | -0.02 | -0.13 |
| 32Y | 2.87 | 3.35 | 3.26 | 3.24 | 0.37 | -0.02 | -0.11 |
| 33Y | 2.89 | 3.36 | 3.28 | 3.26 | 0.36 | -0.02 | -0.10 |
| 34Y | 2.92 | 3.36 | 3.30 | 3.28 | 0.35 | -0.02 | -0.09 |
| 35Y | 2.95 | 3.37 | 3.32 | 3.30 | 0.35 | -0.02 | -0.07 |
| 36Y | 2.98 | 3.38 | 3.34 | 3.32 | 0.34 | -0.02 | -0.06 |
| 37Y | 3.01 | 3.38 | 3.36 | 3.34 | 0.33 | -0.02 | -0.05 |
| 38Y | 3.04 | 3.39 | 3.38 | 3.35 | 0.32 | -0.03 | -0.03 |
| 39Y | 3.07 | 3.39 | 3.40 | 3.37 | 0.31 | -0.03 | -0.02 |
| 40Y | 3.10 | 3.40 | 3.42 | 3.39 | 0.30 | -0.03 | 0.00 |
| 41Y | 3.12 | 3.40 | 3.44 | 3.41 | 0.29 | -0.03 | 0.01 |
| 42Y | 3.15 | 3.41 | 3.46 | 3.43 | 0.28 | -0.03 | 0.02 |
| 43Y | 3.18 | 3.42 | 3.48 | 3.45 | 0.27 | -0.03 | 0.04 |
| 44Y | 3.21 | 3.42 | 3.50 | 3.47 | 0.26 | -0.03 | 0.05 |
| 45Y | 3.23 | 3.43 | 3.51 | 3.48 | 0.24 | -0.03 | 0.04 |
| 46Y | 3.24 | 3.45 | 3.51 | 3.49 | 0.24 | -0.03 | 0.03 |
| 47Y | 3.25 | 3.47 | 3.52 | 3.49 | 0.25 | -0.03 | 0.02 |
| 48Y | 3.25 | 3.49 | 3.53 | 3.50 | 0.25 | -0.02 | 0.01 |
| 49Y | 3.26 | 3.51 | - | - | - | - | - |

TH Bond Indexes as of 30 Sep 2017

| | Index | Change | | |
|----------------------------------|--------|-----------------------------|-------|-------|
| | | From 31 Dec 2016 (Point) | % YoY | % MoM |
| Bond Composite Index | | | | |
| Total Return Index | 175.64 | 7.43 | 1.4 | 0.4 |
| Gross Price Index | 109.75 | 2.11 | -2.3 | 0.2 |
| Clean Price Index | 108.82 | 1.77 | -2.3 | 0.1 |
| Average Yield (%) | 2.72 | -0.26 | | |
| Government Bond Index | | | | |
| Total Return Index | 273.86 | 12.30 | 0.8 | 0.4 |
| Gross Price Index | 108.69 | 2.56 | -2.8 | 0.2 |
| Clean Price Index | 107.72 | 2.04 | -2.8 | 0.1 |
| Average Yield (%) | 2.77 | -0.24 | | |
| Corporate Bond BBB+ Index | | | | |
| Total Return Index | 228.54 | 7.11 | 3.1 | 0.4 |
| Gross Price Index | 106.82 | 0.28 | -0.9 | 0.1 |
| Clean Price Index | 105.84 | 0.28 | -0.9 | 0.1 |
| Average Yield (%) | 2.63 | -0.22 | | |

ตราสารหนี้:

จุดสูงสุดและต่ำสุดในแต่ละช่วงเวลา ในระยะเวลา 11 ปี (ปี 2550-60)

| Bn THB | ค่าปัจจุบัน | % จาก ค่าสูงสุด | % จาก ค่าต่ำสุด | ค่าสูงสุด | Date | ค่าต่ำสุด | Date |
|--------------------------|-------------|--------------------|--------------------|-----------|---------|-----------|---------|
| มูลค่าซื้อขาย | | | | | | | |
| เทียบกับทุกช่วงเวลา | | | | | | | |
| ก.ย. 60 | 24,943.5 | -8.8 | 2,608.5 | 27,357.1 | ส.ค. 60 | 920.9 | ก.พ. 50 |
| Q3/60 | 75,468.2 | - | 2,321.9 | 75,468.2 | Q3/60 | 3,116.1 | Q1/50 |
| 2559 | 276,002.8 | - | 1,437.0 | 276,002.8 | 2559 | 17,957.2 | 2550 |
| เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน | | | | | | | |
| ก.ย. 60 | 24,943.5 | -1.1 | 1,529.7 | 25,217.9 | ก.ย. 59 | 1,530.5 | ก.ย. 50 |
| 9M/60 | 214,584.7 | - | 1,657.6 | 214,584.7 | 9M/60 | 12,209.1 | 9M/50 |
| Q3/60 | 75,468.2 | - | 1,436.4 | 75,468.2 | Q3/60 | 4,912.1 | Q3/50 |
| มูลค่าตราสารหนี้ | | | | | | | |
| เทียบกับทุกช่วงเวลา | | | | | | | |
| ก.ย. 60 | 11,158.6 | -0.8 | 181.2 | 11,244.4 | พ.ค. 60 | 3,968.3 | ม.ค. 50 |
| Q3/60 | 11,158.6 | -0.7 | 167.6 | 11,238.9 | Q1/60 | 4,169.1 | Q1/50 |
| 2559 | 10,865.5 | - | 131.5 | 10,865.5 | 2559 | 4,692.9 | 2550 |
| เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน | | | | | | | |
| ก.ย. 60 | 11,158.6 | - | 148.3 | 11,158.6 | ก.ย. 60 | 4,494.6 | ก.ย. 50 |
| Q3/60 | 11,158.6 | - | 148.3 | 11,158.6 | Q3/60 | 4,494.6 | Q3/50 |

ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ณ วันที่ 30 ก.ย. 60:

จุดสูงสุดและต่ำสุดในแต่ละช่วงเวลา ในระยะเวลา 11 ปี (ปี 2550-60)

| Index | ค่าปัจจุบัน | % จาก ค่าสูงสุด | % จาก ค่าต่ำสุด | ค่าสูงสุด | Date | ค่าต่ำสุด | Date |
|---------------------------|-------------|--------------------|--------------------|-----------|----------|-----------|----------|
| Total Return Index | | | | | | | |
| เทียบกับทุกช่วงเวลา | | | | | | | |
| ก.ย. 60 | 273.86 | -0.4 | 70.6 | 274.91 | เม.ย. 59 | 160.57 | ม.ค. 50 |
| Q3/60 | 273.86 | -0.2 | 69.3 | 274.34 | Q1/59 | 161.77 | Q2/51 |
| 2559 | 261.57 | - | 56.6 | 261.57 | 2559 | 166.99 | 2550 |
| เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน | | | | | | | |
| ก.ย. 60 | 273.86 | - | 63.7 | 273.86 | ก.ย. 60 | 167.26 | ก.ย. 50 |
| Q3/60 | 273.86 | - | 63.7 | 273.86 | Q3/60 | 167.26 | Q3/50 |
| Gross Price Index | | | | | | | |
| เทียบกับทุกช่วงเวลา | | | | | | | |
| ก.ย. 60 | 108.69 | -5.6 | 14.9 | 115.16 | เม.ย. 59 | 94.63 | มิ.ย. 51 |
| Q3/60 | 108.69 | -5.5 | 14.9 | 115.00 | Q1/59 | 94.63 | Q2/51 |
| 2559 | 106.13 | -6.2 | 5.9 | 113.16 | 2551 | 100.18 | 2550 |
| เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน | | | | | | | |
| ก.ย. 60 | 108.69 | -2.8 | 7.2 | 111.86 | ก.ย. 59 | 101.37 | ก.ย. 50 |
| Q3/60 | 108.69 | -2.8 | 7.2 | 111.86 | Q3/59 | 101.37 | Q3/50 |
| Clean Price Index | | | | | | | |
| เทียบกับทุกช่วงเวลา | | | | | | | |
| ก.ย. 60 | 107.72 | -5.5 | 15.6 | 113.97 | มี.ค. 59 | 93.14 | มิ.ย. 51 |
| Q3/60 | 107.72 | -5.5 | 15.6 | 113.97 | Q1/59 | 93.14 | Q2/51 |
| 2559 | 105.67 | -5.3 | 7.1 | 111.63 | 2551 | 98.70 | 2550 |
| เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน | | | | | | | |
| ก.ย. 60 | 107.72 | -2.8 | 7.6 | 110.84 | ก.ย. 59 | 100.15 | ก.ย. 50 |
| Q3/60 | 107.72 | -2.8 | 7.6 | 110.84 | Q3/59 | 100.15 | Q3/50 |