

iBond User Manual

REPORT

Contact iBond:

Bond Pricing & Product Development Department,
The Thai Bond Market Association (ThaiBMA)
email address: pricing@thaibma.or.th
Tel. 0-2257-0357 ext. 451-456
Visit our website: www.ibond.thaibma.or.th

สารบัญ

หัวข้อ	หน้า
Report	1
Daily Report	
ThaiBMA Daily Report	2
Daily Market Summary	3
Weekly Report	
Foreign Trading	5
Private Repo	7
Thai Bond Update	9
ThaiBMA Corner	10
Monthly Report	
ThaiBMA Monthly Market Summary	11
Thai Bond Summary	12
Registered Bond	13
Month-end Closing Price	15
Annual Summary	16

Report

รวบรวมข้อมูลรายงาน (Report) ประเภทต่างๆ ทั้งแบบรายวัน, รายสัปดาห์, รายเดือน และรายปี ประกอบด้วยเมนูย่อยทั้งหมด 4 เมนู

1. Daily Report: ข้อมูลสรุปรายวัน ประกอบด้วยรายงาน 2 ฉบับ
 - 1.1 ThaiBMA Daily Report (PDF File): ข้อมูลอ้างอิงเพื่อการทำ Mark to Market
 - 1.2 Daily Market Summary (web page): รายงานสรุปความเคลื่อนไหวของการซื้อขายต่างๆ ในสิ้นวัน
2. Weekly Report: ข้อมูลสรุปรายสัปดาห์ ประกอบด้วยรายงาน 4 ฉบับ
 - 2.1 Foreign Trading (web page): การซื้อขายตราสารหนี้ของนักลงทุนต่างชาติ (NR) เป็นรายสัปดาห์
 - 2.2 Private Repo (web page): รายงานสรุปความเคลื่อนไหวของการทำธุรกรรมซื้อคืนภาคเอกชน
 - 2.3 Thai Bond Update (PDF File): รายงานสรุปภาวะตลาดรายสัปดาห์ ในรูปแบบตารางและรูปภาพ
 - 2.4 ThaiBMA Corner (PDF File): รายงานสรุปภาวะตลาดและบทความความเคลื่อนไหวของตลาด
3. Monthly Report: ข้อมูลสรุปรายเดือน ประกอบด้วยรายงาน 4 ฉบับ
 - 3.1 ThaiBMA Monthly Summary (web page): รายงานสรุปภาวะตลาดรายเดือน ฉบับภาษาไทยและอังกฤษ
 - 3.2 Thai Bond Summary (PDF File): ข้อมูลสรุปเกี่ยวกับตราสารหนี้ที่มีการเคลื่อนไหวในรอบ 1 เดือน
 - 3.3 Registered Bond (PDF File): รายงานที่รวบรวมข้อมูลตราสารหนี้ทุกประเภทที่ขึ้นทะเบียน
 - 3.4 Month-end Closing Price (PDF File): แสดงปริมาณและ Yield ในการซื้อขายที่เกิดขึ้นในวันทำการสุดท้าย
4. Annually Report: รายงานสรุปภาวะตลาดตราสารหนี้รายปี

ชื่อนี้: Reports > Daily Reports > ThaiBMA Daily Report

ภาพประกอบ:

ThaiBMA DAILY REPORT																		
April 30, 2019																		
Price IndexGovt.Bond				Change(bp)		Trading value				THB		Change						
Clean(%)		105.12		0.02		Outright				87,127,926,906.38		- 7,532,499,957.35						
Gross(%)		106.34		0.03		Financing & Others				792,602,226,379.79		- 83,728,407,923.42						
Total Return(%)		282.48		0.08		Total				879,730,153,286.17		- 91,260,907,880.77						
Outright Transaction Report																		
Issue Symbol	Type/rating	Maturity date	Attr/bate	TM (Yrs)	Coupon (%)	Previous executed						Indicative or Reference from Reporting Dealers						
						Last		Wk	Wk	Wk	Wk	Last executed		Wk	Wk	Wk	Wk	Total
						Yield	Price					Yield	Price					
Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	Par	
1. Government Debt Securities																		
1.1 Treasury Bill																		
TB19918A		18/09/19	0.39			05/04/19	1.690000		1.690000					1.760000		169,861,509.36	1.760000	169,861,509.36
					1,000.00		99.269188		99.269188					99.334216		99.334216		99.334216
																Total		169,861,509.36
1.2 Government Bond																		
ILB217A		14/07/21	2.21	1.2000	29/04/19	1.490000	1.476773	1.520000	1.556426	1.550000	1.465296	1.419600		221,763,223.92	1.423333	443,490,802.97		
				1,000.00		99.379030	99.407455	99.315449	99.237385	99.425251	99.432826	99.531006			99.522986			
ILB283A		12/03/28	8.87	1.2500	26/04/19	2.010000	1.935000	1.985372	1.950000	1.901340	1.930000		78,681,940.72	1.940584	254,294,895.08			
				1,000.00		93.848074	93.848074	94.440550	94.045665	94.720024	94.705434	94.479845		94.396181				
LB196A		13/06/19	0.12	3.8750	29/04/19	1.740000	1.738829				1.750000		122,085,819.60	1.742051	684,700,988.18			
				1,000.00		100.248186	100.256032				100.241265			100.242707				
LB19DA		03/12/19	0.59	5.3750	26/04/19	1.790001	1.790001				1.800000		521,500,990.00	1.797313	559,055,775.28			
				1,000.00		102.121017	102.121017				102.076568			102.078810				
LB206A		26/06/20	1.16	2.5500	26/04/19	1.725000	1.731559	1.720000	1.750330	1.730000	1.713664	1.740000	305,439,771.00	1.739785	592,235,532.48			
				1,000.00		100.942694	100.936329	100.941810	100.907237	100.949725	100.949035	100.919010		100.920299				
LB21DA		17/12/21	2.64	3.6500	29/04/19	1.850000	1.850413	1.856000	1.866071	1.855000	1.846429	1.860000	105,935,727.00	1.856690	2,022,965,639.38			
				1,000.00		104.605892	104.601215	104.576207	104.549824	104.623858	104.601287	104.565727		104.574411				
LB226A		17/06/22	3.13	1.8750	29/04/19	1.892500	1.896083	1.890000	1.893810	1.890000	1.875714	1.885000	10,067,015.00	1.887599	405,688,484.82			
				1,000.00		99.948746	99.937896	99.956463	99.944963	100.003130	99.999599	99.971520		99.963710				
LB22DA		17/12/22	3.64	2.0000	29/04/19	1.960000	1.960000	1.960000	1.965000	1.950859	1.944643	1.960000	20,178,353.20	1.954053	983,583,365.24			
				1,000.00		100.141346	100.141346	100.141081	100.122660	100.206565	100.194608	100.141081		100.161815				
LB236A		16/06/23	4.13	3.6250	29/04/19	2.030000	2.030000	2.024466	2.041786	2.040000	2.014646	2.025000	48,450,891.60	2.031175	386,569,023.55			
				1,000.00		106.281691	106.281691	106.300278	106.229685	106.337948	106.340326	106.298100		106.272965				
LB23DA		17/12/23	4.64	2.4000	29/04/19	2.085000	2.083154	2.085000	2.090000	2.080000	2.070476	2.080000	10,230,655.70	2.081610	914,232,784.97			
				1,000.00		101.384391	101.393129	101.383628	101.361527	101.440690	101.447859	101.405735		101.399028				
LB24DA		20/12/24	5.65	4.7500	11/04/19	2.200000	2.207497				2.230000		230,029,918.00	2.230000	345,044,877.00			
				1,000.00		113.532769	113.494529				113.271123			113.271123				
LB25DA		12/12/25	6.62	3.8500	29/04/19	2.272000	2.271185	2.257000	2.274643	2.253747	2.247857	2.260000	111,212,446.00	2.257681	179,899,173.66			
				1,000.00		109.641034	109.649282	109.733966	109.620354	109.834329	109.792896	109.714638		109.729582				
LB26DA		17/12/26	7.64	2.1250	29/04/19	2.350000	2.350000	2.345000	2.350476	2.340000	2.336905	2.345000	49,635,880.50	2.347005	3,527,711,766.69			
				1,000.00		98.439212	98.438994	98.474158	98.436467	98.569133	98.529906	98.474158		98.460319				

Thai Bond Market Association, Page 1

ความหมาย ที่มาของข้อมูล และการคำนวณ:

ผู้ใช้งานสามารถเลือกดาวน์โหลด ThaiBMA Daily Report ในรูปแบบไฟล์ PDF จากเมนู Reports ซึ่งผู้ใช้งานสามารถกำหนดวันที่ที่ต้องการ โดยสามารถเรียกดูย้อนหลังได้ไปจนถึงเดือนเมษายน ปี 2003

ประโยชน์:

ThaiBMA Daily Report ใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงเพื่อการทำ Mark to Market

หน้า: Reports > Daily Reports > Daily Market Summary

ภาพประกอบ:

Daily Market Summary as of 30 April 2019

30/04/2019

Market Wrap up

Total trading value decreased by 9%. SA gained the major portion or by 71% of total outright trading value, following by Govt and CORP bonds, respectively. Govt bonds yields fluctuated within a range of -1 to 1 bp. Govt clean price index ended higher by 2 bp and corp index (BBB up) closed higher by 1 bp. The most active issue was CB19514A.

Trading & Outstanding value	Mln. (THB)	Chg.(%)
Outstanding Value	12,944,692.86	+0.09
Number of issues	2,703.00	0.00
Total Trading Value	879,730.15	-9.40
Outright/Cash Trading	87,127.93	-7.96
Financing	792,602.23	-9.45
Others	0.00	-100.00
Price value of basis point (PVBP)		BAHT
PVBP of Government bond		390,027,875.54

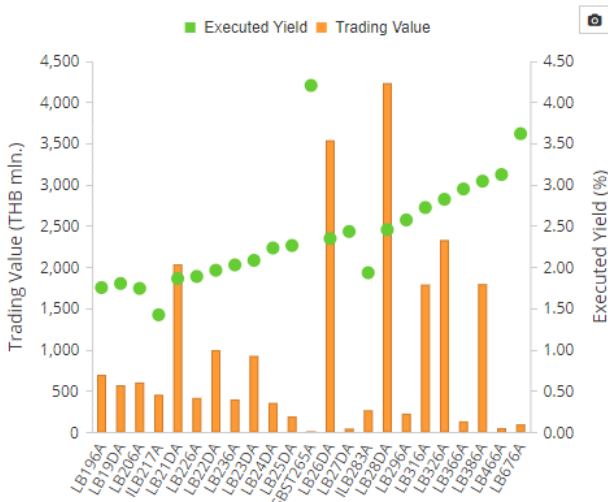
ThaiBMA Bond Index

Type	Clean Price		Gross Price		Total Return		Avg. Yield	Avg. Duration	Avg. Conv
	Index	Chg	Index	Chg	Index	Chg			
Government Bond Index	105.12	+0.02	106.34	+0.03	282.48	+0.08	2.95	8.84	161.18
Group 1 (1 < TTM <= 3)	74.67	-0.01	75.41	-0.01	203.71	-0.01	1.84	2.06	5.70
Group 2 (3 < TTM <= 7)	109.43	+0.01	110.54	+0.02	285.24	+0.05	2.08	4.13	21.04
Group 3 (7 < TTM <= 10)	138.71	-0.06	140.02	-0.04	369.95	-0.12	2.38	7.23	60.99
Group 4 (> 10)	164.71	+0.08	166.83	+0.10	443.02	+0.26	3.20	14.33	315.03
Group 5 (<= 10)	91.16	-0.01	92.12	0.00	241.79	0.00	2.18	3.97	24.64
SOE (G) Bond Index	102.01	-0.08	102.78	-0.08	168.80	-0.11	2.52	3.48	22.45
SOE (NG) Bond Index	107.82	+0.02	108.60	-0.03	183.31	+0.05	2.99	5.70	58.09
Corporate Bond Index (BBB up)	103.37	+0.01	104.15	-0.08	236.00	+0.05	2.92	2.28	11.05
Corporate Bond Index (BBB+ up)	103.89	+0.01	104.68	-0.08	237.80	+0.06	2.92	2.28	11.07

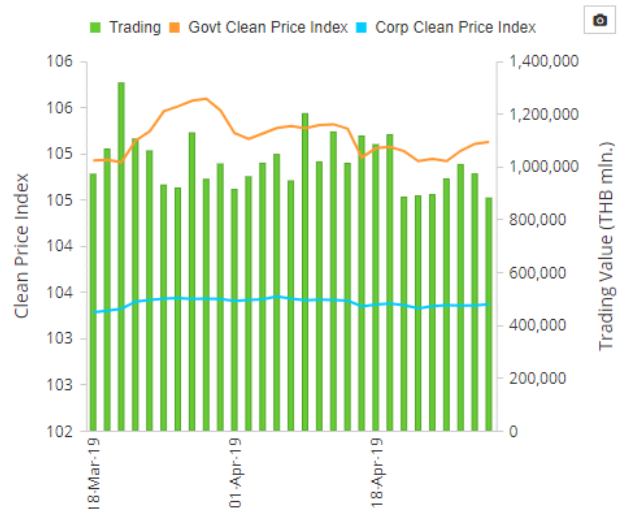
Top 5 Most Active Bond

Bond	Type/ Issue Rating	Coupon Rate(%)	Maturity Date	TTM (Years)	Last Exec.Yield(%)	Weight Avg.Price(%)	Trading Value (THB mln.)
1 CB19514A	SA	0.000000	14-May-2019	0.04	1.690000	99.936692	9,021.29
2 CB19905B	SA	0.000000	05-Sep-2019	0.35	1.750000	99.404881	6,258.53
3 BOT212A	SA	1.750000	18-Feb-2021	1.81	1.880000	99.772352	6,107.71
4 BOT213A	SA	1.620000	12-Mar-2021	1.87	1.888000	99.504489	4,335.49
5 LB28DA	GB	2.875000	17-Dec-2028	9.64	2.452000	103.686338	4,221.21

Executed Yield & Trading Value as of 30 April 2019



Clean Price Index & Trading Value as of 30 April 2019



หน้าสำหรับรายงานสรุปความเคลื่อนไหวของการซื้อขาย (Trading), อัตราผลตอบแทน (Yield), อัตราดอกเบี้ย (Interest Rate), อัตราแลกเปลี่ยน (Exchange Rate) รวมไปถึงค่าดัชนี (Index) และตัวเลขต่างๆที่เกี่ยวข้องกับตลาดเงินและตลาดทุน ในแต่ละสัปดาห์ซึ่งแสดงข้อมูล ดังนี้

- Trading & Outstanding Value
- ThaiBMA Bond Index
- Top 5 Most Active Bond
- Executed Yield & Trading Value
- Clean Price Index & Trading Value
- Government Bond Yield Curve
- Yield Movement
- Change of Bidding Yield (bp)
- Bid-Offer Spread
- ThaiBMA Govt. Bond vs US Treasury
- Corporate Static Spread
- Volatility of Government Yield based on TTM
- Volatility of Government Yield based on Duration
- Volatility of Corporate Spread based on TTM
- Volatility of Corporate Spread based on Duration
- Var of Government Bond
- THB I-IR-T-BILL
- Interbank Offered Rates
- Repo - Bibor - THB I-IR
- FED Funds Rate vs RP 1-Day
- Exchange Rates
- Stock Market

ที่มาของข้อมูล และการคำนวณ:

จากข้อมูลการซื้อขาย (Trading Transaction) ที่รายงานเข้ามายัง ThaiBMA ในแต่ละวัน และข้อมูลที่เกี่ยวข้องจากหน่วยงานอื่นๆ เช่น ธนาคารแห่งประเทศไทย (ข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยน, อัตราดอกเบี้ยประเภทต่างๆ), และตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ข้อมูลดัชนี และมูลค่าการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย)

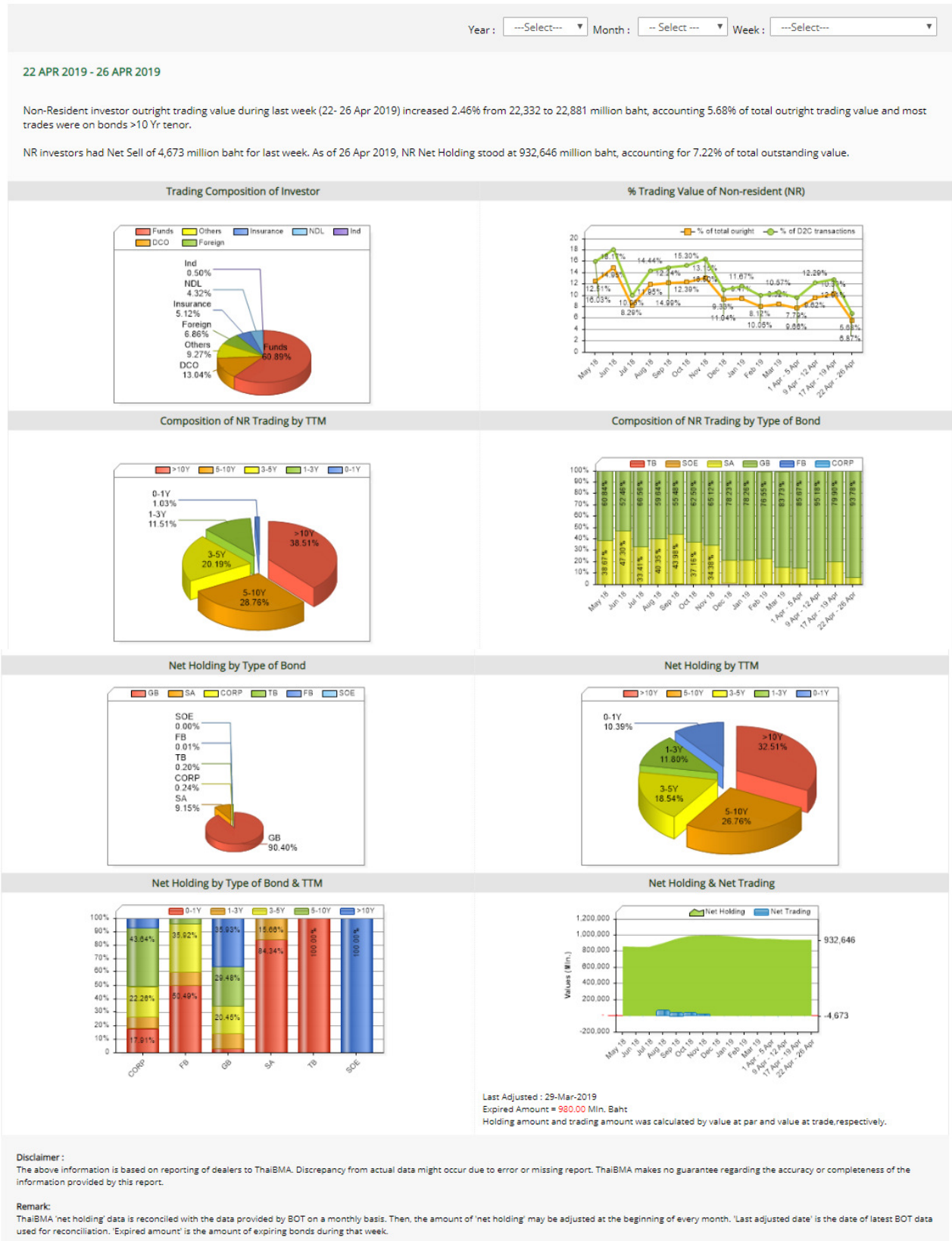
ประโยชน์:

ใช้เพื่อติดตามภาวะตลาดตราสารหนี้ในแต่ละวัน สามารถใช้เพื่อเป็นข้อมูลสรุป และอ้างอิงถึงตัวเลขต่างๆ ที่สำคัญและเกี่ยวข้องกับตลาดเงินและตลาดทุนในแต่ละวัน

ชื่อหน้า: Reports > Weekly Report > Foreign Trading

ภาพประกอบ:

Non-Resident Trading Weekly Report



ความหมาย:

แสดงการซื้อขายตราสารหนี้ของนักลงทุนต่างชาติ (Non-resident Investor - NR) เป็นรายสัปดาห์ ข้อมูลที่แสดงได้แก่

- Trading Composition of Investor: สัดส่วนการซื้อขายตราสารหนี้ของ NR เทียบกับของกลุ่มนักลงทุนอื่นๆ
- % of Trading Value of Non-resident: สัดส่วนการซื้อขายตราสารหนี้ของ NR เทียบกับการซื้อขายตราสารหนี้ทั้งหมดและเทียบกับการซื้อขายตราสารหนี้ของนักลงทุนด้วยกัน
- Composition of NR Trading by TTM: สัดส่วนการซื้อขายตราสารหนี้ของ NR แยกตามช่วงอายุของตราสารหนี้
- Composition of NR Trading by Type of Bond: สัดส่วนการซื้อขายตราสารหนี้ของ NR แยกตามประเภทของตราสารหนี้
- Net Holding by Type of Bond: สัดส่วนยอดถือครองตราสารหนี้ของ NR แยกตามประเภทของตราสารหนี้
- Net Holding by TTM: สัดส่วนยอดถือครองตราสารหนี้ของ NR แยกตามช่วงอายุของตราสารหนี้
- Net Holding by Type of Bond & TTM: สัดส่วนยอดถือครองตราสารหนี้ของ NR แยกตามประเภทและช่วงอายุของตราสารหนี้
- Net Holding & Net Trading: สัดส่วนยอดการซื้อขายสุทธิและยอดถือครองสุทธิของ NR

ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

นำมาจากรายการซื้อขายที่ Dealer ทำกับนักลงทุนต่างชาติ ที่รายงานมายัง ThaiBMA

ประโยชน์:

เพื่อติดตามภาวะการซื้อขายและการถือครองตราสารหนี้ของกลุ่มนักลงทุนต่างชาติ

ชื่อหน้า: Reports > Weekly Report > Private Repo

ภาพประกอบ:

Private Repo Weekly Report



ความหมาย:

เป็นรายงานสรุปความเคลื่อนไหวรายสัปดาห์ของการทำธุรกรรมซื้อคืนภาคเอกชน (Private Repo)

- Composition of Repo Term: สัดส่วนของระยะเวลาการกู้ยืม
- Weighted Average Repo Rate by Term: อัตราดอกเบี้ยกู้ยืมเฉลี่ย แยกตามระยะเวลาการกู้ยืม

- Composition of Investor
 - Lending: สัดส่วนของผู้ให้กู้ แยกตามประเภทของกลุ่มนักลงทุน
 - Borrowing: สัดส่วนของผู้ขอกู้ แยกตามประเภทของกลุ่มนักลงทุน
 - Total Private Repo: สัดส่วนของนักลงทุนประเภทต่างๆในธุรกรรมซื้อคืนภาคเอกชน
- % of Financing Value: สัดส่วนของการทำธุรกรรม Financing ประเภทต่างๆ ได้แก่ Sell&Buy Back, Private Repo และ Bilateral Repo
- Composition of TTM Group of Bond: สัดส่วนของธุรกรรม Private Repo แยกตามประเภทของช่วงอายุคงเหลือของตราสารหนี้ (TTM)
- Composition of Type of Bond: สัดส่วนของธุรกรรม Private Repo แยกตามประเภทของตราสารหนี้
- Outstanding Value by Type of Bond: สัดส่วนของมูลค่าคงค้างของธุรกรรม Private Repo แยกตามประเภทของตราสารหนี้
- Outstanding Value: มูลค่าคงค้างของธุรกรรม Private Repo ณ สิ้นสัปดาห์

ที่มาของข้อมูล และการคำนวณ:

จากข้อมูลการทำธุรกรรม Private repo ของสถาบันการเงินที่รายงานเข้ามายัง ThaiBMA ในแต่ละวัน

ประโยชน์:

เพื่อแสดงความเคลื่อนไหวรายสัปดาห์ของการทำธุรกรรม Private Repo และเพื่อเป็นข้อมูลสรุป และอ้างอิงถึงตัวเลขสถิติต่างๆ ที่สำคัญของธุรกรรม Private Repo ในตลาดตราสารหนี้ไทย

ชื่อหน้า: Reports > Weekly Report > Thai Bond Update

ภาพประกอบ:



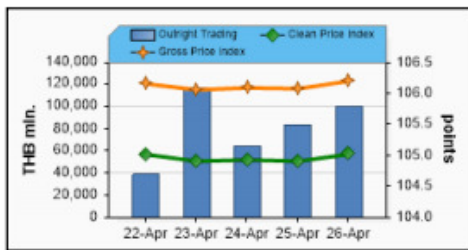
Thai Bond Update

Issue 17/2019

Apr 26, 2019

1. Weekly Trading value (Apr 22 - 26, 2019)

MARKET AT A GLANCE	This Week (5 days)	Previous Week (3 days)	Change
Total Trading Value (THB mln.)	4,623,275.67	3,316,307.91	39.41%
Outright	405,096.15	216,116.84	87.44%
Financing	4,218,074.80	3,100,191.07	36.06%
Others	104.72	0.00	n.a.
Daily Average	924,655.13	1,105,435.97	-16.35%
Government Bond Index (Clean Price)	105.03	105.07	-0.04
Corporate Bond Index (Clean Price)	103.35	103.38	-0.02



Date	Trading Value			Index	
	Outright	Fin&Other	Total	GPrice	CPrice
22-Apr-19	38,927.44	844,504.51	883,431.94	106.16	105.02
23-Apr-19	117,116.87	770,879.83	887,996.71	106.07	104.91
24-Apr-19	64,327.16	828,423.09	892,750.25	106.10	104.94
25-Apr-19	83,858.74	868,460.82	952,319.56	106.09	104.91
26-Apr-19	100,865.94	905,911.28	1,006,777.22	106.21	105.03
Total	405,096.15	4,218,179.53	4,623,275.67		

2. Weekly Movement

2.1 ThaiBMA Government Bond Yield Curve (Apr 19 & Apr 26, 2019)



Remark:

- 1) The above reference yields are based upon average bids quoted by BoT's 9 primary dealers with minimum value to THB 20 million
- 2) 1,3,6 M interpolation yields are based upon bond equivalent yields

Note: 1. ThaiBMA trading statistics carried in this publication is based on trading data reported to ThaiBMA by all dealers.
2. Data excludes FX Bond.
3. The yield on Inflation-linked bond is a real yield to maturity.

2.2 ThaiBMA Interpolation Yield (%)

Term	This Week	Last Week	Chg.(bp)
1 YR.	1.80	1.80	0
2 YR.	1.81	1.80	1
3 YR.	1.89	1.87	2
5 YR.	2.13	2.14	-1
7 YR.	2.32	2.33	-1
10 YR.	2.55	2.55	0
12 YR.	2.73	2.72	1
15 YR.	2.91	2.89	2
18 YR.	3.02	3.01	1
19 YR.	3.06	3.05	1
20 YR.	3.10	3.10	0
21 YR.	3.15	3.14	1
25 YR.	3.21	3.21	0
27 YR.	3.21	3.22	-1
28 YR.	3.23	3.24	-1
29 YR.	3.26	3.27	-1
30 YR.	3.29	3.30	-1
35 YR.	3.44	3.44	0
40 YR.	3.58	3.58	0
45 YR.	3.66	3.66	0

Thai Bond Update เป็นรายงานสรุปภาวะตลาดตราสารหนี้รายสัปดาห์ โดยสรุปข้อมูลการประมูลในตลาดแรก, การซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง, ดัชนีตราสารหนี้, การเคลื่อนไหวของเส้นอัตราผลตอบแทนในสัปดาห์ที่ผ่านมาเปรียบเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า Thai Bond Update เน้นการนำเสนอในรูปแบบตาราง และรูปภาพ ซึ่งประกอบไปด้วยข้อมูลที่สำคัญ ได้แก่

- Weekly Trading Value: ข้อมูลสรุปปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในรอบ 1 สัปดาห์
- Weekly Movement: ความเคลื่อนไหวของเส้น Yield Curve และ Index ประเภทต่างๆ รวมถึงข้อมูลการ

ซื้อขายตราสารหนี้รายตัว ในรอบ 1 สัปดาห์

- Registered Bond Information Update: ข้อมูลวันปิดสมุดทะเบียนตราสารหนี้ ในรอบ 1 สัปดาห์
- New Debt Securities: ข้อมูลตราสารหนี้ใหม่ทั้งหมดตั้งแต่ต้นเดือนจนถึงสัปดาห์ปัจจุบัน
- Market News ข่าวต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้ต่าง ๆ อาทิ ตราสารหนี้ใหม่ในสัปดาห์หน้า

ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

จากข้อมูลการขึ้นทะเบียนและการซื้อขายตราสารหนี้ที่รายงานมายัง ThaiBMA และข่าวเกี่ยวกับตราสารหนี้ที่ขึ้นบน Website ของ ThaiBMA

ประโยชน์:

เพื่อเป็นรายงานสรุปเกี่ยวกับตลาดตราสารหนี้ไทยในรอบ 1 สัปดาห์

ชื่อหน้า: Reports > Weekly Report > ThaiBMA Corner

ภาพประกอบ:



ฝ่ายกำกับดูแล
สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

ThaiBMA CORNER

“ผลตอบแทนพันธบัตรเคลื่อนไหวในกรอบแคบๆ”

ความเคลื่อนไหวในตลาดตราสารหนี้ไทย	สัปดาห์นี้ (22 - 26 เม.ย. 62)	สัปดาห์ก่อนหน้า (17 - 19 เม.ย. 62)	เปลี่ยนแปลง (%)	สะสมตั้งแต่ต้นปี (1 ม.ค. - 26 เม.ย. 62)
มูลค่าการซื้อขาย แบบปกติ - Outright Trading (ล้านบาท)	405,096.15	216,116.84	↑ 87.44%	6,561,528.36
มูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยต่อวัน (ล้านบาท)	81,019.23	72,038.95	↑ 12.47%	83,057.32
ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล (Gov Bond Gross Price index)	106.21	106.18	↑ 0.03%	
ดัชนีหุ้นกู้เอกชน (Corp Bond Gross Price index)	104.20	104.23	↓ -0.03%	

เส้นอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล (Gov Bond Yield Curve) – %								
ช่วงอายุของตราสารหนี้	1 เดือน	6 เดือน	1 ปี	3 ปี	5 ปี	10 ปี	15 ปี	30 ปี
สัปดาห์นี้ (26 เม.ย. 62)	1.62	1.76	1.80	1.89	2.13	2.55	2.91	3.29
สัปดาห์ก่อนหน้า (19 เม.ย. 62)	1.61	1.76	1.80	1.87	2.14	2.55	2.89	3.30
เปลี่ยนแปลง (basis point)	↑ 1	→ 0	→ 0	↑ 2	↓ -1	→ 0	↑ 2	↓ -1

ภาวะตลาดตราสารหนี้ (22 - 26 เมษายน 2562)

ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้ (5 วันทำการ) มีมูลค่ารวม 405,096.15 ล้านบาท หรือเฉลี่ยอยู่ที่ประมาณวันละ 81,019.23 ล้านบาท ปรับตัวเพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนหน้าประมาณ 87% ทั้งนี้เมื่อแยกตามประเภทของตราสารแล้ว จะพบว่ากว่า 74% ของมูลค่าการซื้อขายทั้งหมด หรือประมาณ 301,429 ล้านบาท เป็นการซื้อขายในตราสารหนี้ที่ออกโดยธนาคารแห่งประเทศไทย (state Agency Bond) ซึ่งส่วนใหญ่แล้วเป็นตราสารที่มีอายุคงเหลือค่อนข้างน้อย (ไม่เกิน 6 เดือน) ขณะที่พันธบัตรรัฐบาลที่ออกโดยกระทรวงการคลัง (Government Bond) มีมูลค่าการซื้อขายเท่ากับ 79,009 ล้านบาท และหุ้นกู้ที่ออกโดยภาคเอกชน (Corporate Bond) มีมูลค่าการซื้อขายเท่ากับ 11,036 ล้านบาท หรือคิดเป็น 20% และ 3% ของมูลค่าการซื้อขายทั้งหมดที่เกิดขึ้น ตามลำดับ

สำหรับพันธบัตรรัฐบาล ที่มีปริมาณการซื้อขายสูงสุด 3 อันดับแรกคือรุ่น LB326A (อายุ 13.2 ปี) LB23DA (อายุ 4.6 ปี) และ LB21DA (อายุ 2.6 ปี) โดยมีมูลค่าการซื้อขายในแต่ละรุ่นเท่ากับ 13,351 ล้านบาท 12,905 ล้านบาท และ 7,560 ล้านบาท ตามลำดับ

ขณะที่หุ้นกู้ภาคเอกชน ที่มีปริมาณการซื้อขายสูงสุด 3 อันดับแรก ได้แก่ หุ้นกู้ของบริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน) รุ่น CPN22DA (AA) มูลค่าการซื้อขาย 819 ล้านบาท หุ้นกู้ของบริษัท ไทยเบฟเวอเรจ จำกัด (มหาชน) รุ่น TBEV223A (AA(th)) มูลค่าการซื้อขาย 634 ล้านบาท และหุ้นกู้ของบริษัท อมตะ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) รุ่น AMATA24OA (A) มูลค่าการซื้อขาย 591 ล้านบาท

The information and opinions in this report are those of Thai Bond Market Association (ThaiBMA) research activity. ThaiBMA does not make any representation or warranty, express or implied, as to the fairness, accuracy, or completeness. While all reasonable care has no representation as to its accuracy or completeness and it should not be relied upon as such. ThaiBMA accepts no liability whatsoever for any loss arising from use of this report or its contents. This report is being supplied solely for informational purposes and may not be reproduced, distributed or published by recipient for any purpose.

รายงานสรุปภาวะตลาดตราสารหนี้รายสัปดาห์ โดยนำเสนอข้อมูลในรูปแบบของตาราง และบทความอธิบายความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้ในสัปดาห์ที่ผ่านมาเปรียบเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า ซึ่งเน้นผู้ที่ต้องการเห็นความเคลื่อนไหวของตลาดโดยรวม ใน ThaiBMA Corner มีการนำเสนอบทความความรู้ด้านการเงินต่าง ๆ รวมอยู่ในด้านท้ายของรายงานด้วย และจะเผยแพร่ใน Website ทุกวันอังคาร

ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

จากข้อมูลการขึ้นทะเบียนและการซื้อขายตราสารหนี้ที่รายงานมายัง ThaiBMA

ประโยชน์การใช้งาน:

เพื่อใช้ติดตาม, วิเคราะห์ความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้ในสัปดาห์ที่ผ่านมา และนำไปใช้ประกอบการตัดสินใจลงทุนในอนาคต

ภาพประกอบ:



ฝ่ายกำกับดูแล
สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

ความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้ไทย

ประจำวันที่ 1-29 มีนาคม 2562

อัตราผลตอบแทนพันธบัตรก่อนหักค่าธรรมเนียม

• **ตลาดแรก**

มูลค่าค่างวดตราสารหนี้ขึ้นทะเบียนใน ThaiBMA ณ วันที่ 29 มีนาคม 2562 (ไม่รวมตราสารหนี้สกุลเงินต่างประเทศ) มีมูลค่าค่างวดรวมทั้งสิ้น 12,769,719.39 ล้านบาท แบ่งเป็นตราสารหนี้ภาครัฐ 9,269,323.63 ล้านบาท ตราสารหนี้ภาคเอกชน 3,396,564.76 ล้านบาท และหุ้นกู้ต่างประเทศ (Foreign Bond) 103,831.00 ล้านบาท โดยมีรายละเอียดแบ่งตามประเภทของตราสารหนี้ดังนี้

ตารางที่ 1 รายละเอียดมูลค่าค่างวดตราสารหนี้ขึ้นทะเบียนใน ThaiBMA ณ วันที่ 29 มีนาคม 2562

ThaiBMA Registered Bonds
as of March 29, 2019

	No. of Issues	Outstanding Value(THB mln.)	Currency
1 Government Debt Securities	463	9,269,323.63	THB
1.1 Treasury Bill	8	105,732.00	THB
1.2 Government Bond	53	4,773,821.03	THB
1.2.1 Loan Bond	36	4,353,607.30	THB
1.2.2 Saving Bond	15	212,273.73	THB
1.2.3 Inflation-Linked Bond	2	207,940.00	THB
1.3 State Agency Bond	59	3,579,306.00	THB
1.3.1 Central Bank Bill	45	2,133,400.00	THB
1.3.2 Bank of Thailand Bond	14	1,445,906.00	THB
1.4 State Owned Enterprise Bond	343	810,464.60	THB
2 Corporate Bond	2,167	3,396,564.76	THB
2.1 Long-term Corporate Bond	1,575	3,129,431.26	THB
2.2 Commercial Paper	592	267,133.50	THB
2.2.1 Debenture	147	113,551.50	THB
2.2.2 Bill of Exchange	445	153,582.00	THB
3 Foreign Bond	48	103,831.00	THB
3.1 Foreign Bond	40	86,831.00	THB
3.2 Debenture	8	17,000.00	THB
Total	2,678	12,769,719.39	
4 Foreign Currency Denominated Bond	39		
4.1 USD Bond	38	1,090.67	USD
4.2 EUR Bond	1	80.00	EUR

The information and opinions in this report are those of Thai Bond Market Association (ThaiBMA) research activity. ThaiBMA does not make any representation or warranty, express or implied, as to the fairness, accuracy, or completeness. While all reasonable care has no representation as to its accuracy or completeness and it should not be relied upon as such. ThaiBMA accepts no liability whatsoever for any loss arising from use of this report or its contents. This report is being supplied solely for informational purposes and may not be reproduced, distributed or published by recipient for any purpose.

รายงานสรุปภาวะตลาดตราสารหนี้รายเดือน (รายงานสรุปภาวะความเคลื่อนไหวตลาดตราสารหนี้) นำเสนอข้อมูลการประมูลในตลาดแรก การซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรองตราสารหนี้ ดัชนีตราสารหนี้ ความเคลื่อนไหวของเส้นอัตราผลตอบแทนในเดือนที่ผ่านมาเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้า

สำหรับรูปแบบการนำเสนอของ รายงานสรุปภาวะความเคลื่อนไหวตลาดตราสารหนี้ และ Thai Bond Summary มีการนำเสนอรายงานข้อมูลใกล้เคียงกัน แต่ใน Thai Bond Summary จะมีข้อมูลบางส่วนแสดงการเปรียบเทียบความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้ของเดือนอื่นๆ มากกว่า 1 เดือนก่อนหน้า เพื่อให้เห็นภาพความเคลื่อนไหวของตลาดได้ชัดเจนยิ่งขึ้น อาทิ กราฟการเปรียบเทียบสัดส่วนการทำธุรกรรมระหว่างผู้ค้าตราสารหนี้และผู้ค้าตราสารหนี้กับนักลงทุนสถาบัน

ในขณะที่รายงานสรุปภาวะความเคลื่อนไหวตลาดตราสารหนี้ เน้นแสดงภาวะความเคลื่อนไหวของตราสารหนี้เปรียบเทียบระหว่างเดือนที่ผ่านมากับเดือนก่อนหน้า โดยมีรายละเอียดของการประมวลตราสารหนี้ ปัจจัยที่ส่งผลต่อการเคลื่อนไหวของเส้นอัตราผลตอบแทน และมีการนำเสนอแนวโน้มตลาดตราสารหนี้ในเดือนถัดไป ซึ่งรวมทั้งการออกตราสารหนี้ใหม่และทิศทางอัตราผลตอบแทน

ประโยชน์การใช้งาน:

เพื่อใช้ติดตามภาวะตลาดตราสารหนี้ และวิเคราะห์ภาวะความเคลื่อนไหวของตลาดในช่วงเดือนที่ผ่านมา ซึ่งจะเห็นภาพกว้างของภาวะความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้มากกว่ารายงานรายสัปดาห์ โดยสามารถนำมาวางแผนการลงทุนในเดือนถัดไป หรือนำข้อมูลไปวิเคราะห์เพิ่มเติมได้

ชื่อหน้า: Reports > Monthly Reports > Thai Bond Summary

ภาพประกอบ:



Thai Bond Summary (Part I)

Monthly Report: March 2019

1. Total Transaction Report

1.1 Outright Transaction Report (Rank by Alphabetical Order)

Unit : THB mln.

Symbol	Type/ Rating	Coupon (%)	Maturity Date	Yrs. to Maturity	Avg. Bid Yld. (%)		Executed Yield (%)		Wavg- Executed Yld. (%)	Total Trading Value	% of Total Trading Value	Turnover Ratio (%)
					Low	High	Low	High				
Treasury Bill												
TB19327A	-	-	27-Mar-19	-	-	-	1.560000	1.565000	1.562500	129.96	0.01	0.87
TB19814A	-	-	14-Aug-19	0.38	-	-	1.720000	1.740000	1.729500	913.12	0.05	9.13
TB19828A	-	-	28-Aug-19	0.42	-	-	1.700000	1.740000	1.739272	5,571.92	0.31	37.15
TB19904A	-	-	4-Sep-19	0.44	-	-	1.740000	1.740000	1.740000	1,115.92	0.06	7.44
TB19911A	-	-	11-Sep-19	0.45	-	-	1.690000	1.742500	1.713575	5,463.50	0.30	34.73
TB19918A	-	-	18-Sep-19	0.47	-	-	1.730000	1.780000	1.750134	3,306.42	0.18	22.04
TB19925A	-	-	25-Sep-19	0.49	-	-	1.650000	1.700000	1.680977	576.17	0.03	5.76
Sub Total										17,077.00		

แสดงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับตราสารหนี้ที่มีการเคลื่อนไหวในรอบ 1 เดือน ข้อมูลที่แสดง ได้แก่

- Total Transaction Report: แสดงข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ในเดือนนั้นๆ เป็นรายตราสาร
- Corporate Bond Breakdown: แสดงรายละเอียดข้อมูลเกี่ยวกับหุ้นกู้เอกชน ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน

ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

นำมาจากข้อมูลการขึ้นทะเบียนและการซื้อขายตราสารหนี้ที่รายงานมายัง ThaiBMA

ประโยชน์:

เพื่อดูข้อมูลสรุปเกี่ยวกับตราสารหนี้ในรอบ 1 เดือน

หน้า: Reports > Monthly Reports > Registered Bond

ภาพประกอบ:

List of ThaiBMA Registered Bonds
as of 30 April 2019

2 Corporate Bond

2.1 Long-term Corporate Bond
Plain Vanilla Issue

No.	issuer	Sector	Company Rating		symbol	Issue Rating	Type of Bond	Embedded Option	Distribut on Type	Issue Size THB mln.	Outstanding Value THB mln.	issued date	Maturity Date	Term (Yrs) or (Days)	Coupon		Registr ar	Lead U/W	Bond Holder REPT.
			Long	Short											(%)	Payment date			
1	A	PROP	BB		A197A		UNSECURE/Sen		I&HNW	646.80	646.80	20/10/2016	20/07/2019	2.75	5.0000	20/1, 20/4, 20/7, 20/10	CIMBT	ASPS	-
2	A	PROP	BB		A201A		UNSECURE/Sen		I&HNW	654.50	654.50	31/01/2017	31/01/2020	3.00	5.2500	30/4	CIMBT	ASPS	-
3	A	PROP	BB		A204A		FASSET/Sen	CALL	I&HNW	1,500.00	1,500.00	05/04/2017	05/04/2020	3.00	5.9500	5/1, 5/4, 5/7, 5/10	CIMBT	ASPS,CNS	BAY
4	A	PROP	BB		A200A		UNSECURE/Sen	CALL	I&HNW	1,000.00	1,000.00	05/10/2016	01/10/2020	3.99	5.4000	5/1, 5/4, 5/7, 5/10	CIMBT	CNS	-
5	A	PROP	BB		A214A		UNSECURE/Sen		I&HNW	634.20	634.20	31/10/2017	30/04/2021	3.50	5.9500	31/1, 31/7, 31/10	CIMBT	CNS	-
6	A	PROP	BB		A214B		UNSECURE/Sen		I&HNW	208.10	176.89	31/10/2017	30/04/2021	3.50	5.9500	31/1, 31/7, 31/10	CIMBT	CNS	-
7	A	PROP	BB		A210A		UNSECURE/Sen		I&HNW	250.00	250.00	19/10/2018	19/10/2021	3.00	6.0500	19/1, 19/4, 19/7, 19/10	CIMBT	YUANTA	BAY
8	A	PROP	BB		A210B		FASSET/Sen	CALL	I&HNW	2,000.00	2,000.00	01/04/2019	08/10/2021	2.52	6.7500	8/1, 8/4, 8/7, 8/10	CIMBT	ASPS,CGS,YUANTA	CGS
9	A	PROP	BB		A222A		UNSECURE/Sen		I&HNW	166.60	166.60	22/11/2018	22/02/2022	3.25	6.0500	22/2, 22/5, 22/8, 22/11	CIMBT	CNS	BAY
10	ABPSV	SPV			ABPSV204A	A-	FPERG/Sen		I&HNW	1,800.00	1,800.00	21/04/2017	21/04/2020	3.00	2.6800	21/4, 21/10	BAY	CIMBT,SCB	BAY
11	ABPSV	SPV			ABPSV214A	A-	FPERG/Sen		I&HNW	600.00	600.00	21/04/2017	21/04/2021	4.00	3.0000	21/4, 21/10	BAY	CIMBT,SCB	BAY
12	ABPSV	SPV			ABPSV224A	A-	FPERG/Sen		I&HNW	1,500.00	1,500.00	21/04/2017	21/04/2022	5.00	3.2500	21/4, 21/10	BAY	CIMBT,SCB	BAY
13	ABPSV	SPV			ABPSV234A	A-	FPERG/Sen		I&HNW	900.00	900.00	21/04/2017	21/04/2023	6.00	3.5800	21/4, 21/10	BAY	CIMBT,SCB	BAY
14	ABPSV	SPV			ABPSV244A	A-	FPERG/Sen		I&HNW	900.00	900.00	21/04/2017	21/04/2024	7.01	3.7600	21/4, 21/10	BAY	CIMBT,SCB	BAY
15	ABPSV	SPV			ABPSV264A	A-	FPERG/Sen		I&HNW	1,000.00	1,000.00	21/04/2017	21/04/2026	9.01	4.0100	21/4, 21/10	BAY	CIMBT,SCB	BAY
16	ABPSV	SPV			ABPSV274A	A-	FPERG/Sen		I&HNW	1,500.00	1,500.00	21/04/2017	21/04/2027	10.01	4.1700	21/4, 21/10	BAY	CIMBT,SCB	BAY
17	ABPSV	SPV			ABPSV284A	A-	FPERG/Sen		I&HNW	800.00	800.00	21/04/2017	21/04/2028	11.01	4.3300	21/4, 21/10	BAY	CIMBT,SCB	BAY
18	ABPSV	SPV			ABPSV294A	A-	FPERG/Sen		I&HNW	1,000.00	1,000.00	21/04/2017	21/04/2029	12.01	4.3500	21/4, 21/10	BAY	CIMBT,SCB	BAY
19	ABPSV	SPV			ABPSV304A	A-	FPERG/Sen		I&HNW	600.00	600.00	21/04/2017	21/04/2030	13.01	4.4800	21/4, 21/10	BAY	CIMBT,SCB	BAY

รายงาน ThaiBMA Registered Bonds เป็นรายงานที่รวบรวมข้อมูลตราสารหนี้ทุกประเภทที่ขึ้นทะเบียนกับ ThaiBMA โดยรายงานกำหนดออกทุกวันทำการสิ้นเดือน นำเสนอในรูปแบบของไฟล์ PDF เนื้อหาของรายงานประกอบด้วยข้อมูล 3 ส่วนดังนี้

- สรุปมูลค่าคงค้างของตราสารหนี้ โดยสรุปจำนวนและมูลค่าของตราสารหนี้ขึ้นทะเบียน ณ วันสิ้นเดือน โดยข้อมูลจำแนกตามประเภทของตราสาร

- รายชื่อและรายละเอียดตราสารขึ้นทะเบียนภาครัฐ นำเสนอข้อมูลตามประเภทของตราสารหนี้ โดยข้อมูลที่น่าเสนอประกอบด้วย

- Bond Symbol: สัญลักษณ์ตราสารหนี้
- Sign: ลักษณะพิเศษของตราสารหนี้
- Type of Bond: ประเภทของตราสารหนี้แบ่งตามการชำระคืนเงินต้นและการค้ำประกัน
- Issue Name: ชื่อตราสารหนี้ภาษาอังกฤษ
- Issue Rating: อันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร
- Current Par: มูลค่าต่อหน่วยปัจจุบัน (บาท)
- Issue Size: ปริมาณการออกตราสารหนี้ (ล้านบาท)
- Outstanding Value: มูลค่าคงค้าง (ล้านบาท)
- Issue Date: วันออกตราสารหนี้
- Maturity Date: วันครบกำหนดไถ่ถอน
- Term: อายุของตราสาร (ปี)

- Coupon and Payment Date: อัตราดอกเบี้ยและวันชำระดอกเบี้ย
- Registered Date: วันขึ้นทะเบียนตราสารหนี้
- Registrar: นายทะเบียน
- รายชื่อและรายละเอียดตราสารขึ้นทะเบียนภาคเอกชนและตราสารหนี้ต่างประเทศ นำเสนอข้อมูลตามประเภทของตราสารหนี้ เรียงลำดับตามหมวดธุรกิจ (Business Sector) โดยข้อมูลที่น่าเสนอประกอบด้วย
 - Bond Symbol: สัญลักษณ์ตราสารหนี้
 - Sign: ลักษณะพิเศษของตราสารหนี้
 - Type of Bond: ประเภทของตราสารหนี้แบ่งตามการชำระคืนเงินต้นและการค้าประกัน
 - Issue Rating: อันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร
 - Current Par: มูลค่าต่อหน่วยปัจจุบัน (บาท)
 - Issue Size: ปริมาณการออก (ล้านบาท)
 - Outstanding Value: มูลค่าคงค้าง (ล้านบาท)
 - Issue Date: วันออกตราสารหนี้
 - Maturity Date: วันครบกำหนดไถ่ถอน
 - Term: อายุของตราสาร (ปี)
 - Coupon and Payment Date: อัตราดอกเบี้ยและวันชำระดอกเบี้ย
 - Registered Date: วันขึ้นทะเบียนตราสารหนี้
 - Registrar: นายทะเบียน
 - Underwriter: ผู้จัดการการระดมทุน
 - Bondholder Representative: ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้
 - Distribution: วิธีการจัดจำหน่าย

ข้อหน้า: Reports > Monthly Reports > Month – end Closing Price

ภาพประกอบ:

ThaiBMA Month-end Closing Price

April 30, 2019

Price Index	Govt.Bond	Change(bp)
Clean(%)	105.12	0.02
Gross(%)	106.34	0.03
Total Return(%)	282.48	0.08

Trading value	THB	Change
Outright	87,127,926,906.38	- 7,532,499,957.35
Financing & Others	792,602,226,379.79	- 83,728,407,923.42
Total	879,730,153,286.17	- 91,260,907,880.77

Time : 17:35:01

Outright Transaction Report

Issue Symbol	Type/rating	Maturity date	Attribute	TTM (yrs)	Coupon (%)	Previous executed				Indicative or Reference from Reporting Dealers								
						Date	Last Yield Price	Remark Flag	WA Yield Price	BEST Bid Yield Price	WA Bid Yield Price	BEST Offer Yield Price	WA Offer Yield Price	Last executed		Gross Value (THB)		Remark Flag
1. Government Debt Securities																		
1.1 Treasury Bill																		
TB19814A		14/08/19		0.29	07/03/19	1.720000		1.728500										
				1,000.0000		99.256312		99.252665										
TB19828A		28/08/19		0.33	13/03/19	1.740000		1.739287										
				1,000.0000		99.214871		99.215109										
TB19904A		04/09/19		0.35	14/03/19	1.740000		1.740000										
				1,000.0000		99.196104		99.192803										
TB19911A		11/09/19		0.37	05/04/19	1.690000		1.690000										
				1,000.0000		99.301138		99.301138										
TB19918A		18/09/19		0.39	05/04/19	1.690000		1.690000					1.760000	169,861,509.36		1.760000	169,861,509.36	
				1,000.0000		99.269188		99.269188					99.334216			99.334216		
TB19925A		25/09/19		0.41	25/03/19	1.700000		1.680977										
				1,000.0000		99.154874		99.169330										
TB19N20A		20/11/19		0.56	12/02/19	1.795000		1.797500										
				1,000.0000		98.641717		98.639851										
TB20401A		01/04/20		0.92	01/04/19	1.798000		1.793000										
				1,000.0000		98.238511		98.243324										
TB20408A		08/04/20		0.94	23/04/19	1.785000		1.785000										
				1,000.0000		98.321888		98.321888										
																	Total	169,861,509.36
1.2 Government Bond																		
ILB217A		14/07/21		2.21	1.2000	29/04/19	1.490000	1.476773	1.520000	1.556426	1.550000	1.465296	1.419600	221,763,223.92		1.423333	443,490,802.97	
				1,000.0000		99.379030		99.407455	99.315449	99.237385	99.425251	99.432826	99.531006			99.522986		
ILB283A		12/03/28		8.87	1.2500	26/04/19	2.010000	2.010000	1.935000	1.985372	1.950000	1.901340	1.930000	78,681,940.72		1.940584	254,294,895.08	
				1,000.0000		93.848074	SL	93.848074	94.440550	94.045665	94.720024	94.705434	94.479845			94.396181		
LB196A		13/06/19		0.12	3.8750	29/04/19	1.740000	1.738829					1.750000	122,085,819.60		1.742051	684,700,988.18	
				1,000.0000		100.248186		100.256032					100.241265			100.242707		

Thai Bond Market Association, Page 1

แสดงปริมาณและ Yield ในการซื้อขายตราสารหนี้ที่เกิดขึ้นในวันทำการสุดท้ายของเดือนนั้นๆ โดยแสดงเป็นรายตราสาร ทุกตัวรวมถึงตัวที่ไม่มีการซื้อขายในวันทำการสุดท้ายของเดือนด้วย ข้อมูลที่แสดงสามารถแบ่งเป็นกลุ่มๆ ได้ดังนี้

- ส่วนที่เป็น Price Index: แสดงข้อมูล Government Bond Index ทั้งในส่วนของ Clean Price, Gross Price และ Total Return Index ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน
- ส่วนที่เป็นปริมาณการซื้อขาย (บาท): แสดงปริมาณการซื้อขายในวันสุดท้ายของเดือน แบ่งตามวัตถุประสงค์การซื้อขาย
- ส่วนที่เป็นชื่อและ Features: แสดงชื่อและ Features ของตราสาร เช่น Maturity Date, TTM
- ส่วนที่เป็น Previous Executed: แสดงวันที่และ Yield ที่ทำการซื้อขายล่าสุดก่อนหน้า
- ส่วนที่เป็นปริมาณและ Yield ที่ซื้อขายปัจจุบัน: แสดงปริมาณการซื้อขายและ Yield ทั้งที่เป็น Bid/ Offer และ Executed Yield ของวันทำการสุดท้ายของเดือน

ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

นำมาจากข้อมูลซื้อขายใน ThaiBMA Daily Report

ประโยชน์:

เพื่อดูข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายล่าสุดของตราสารรายตัว ณ วันสิ้นเดือน

ชื่อหน้า: Report > Annual Summary

ภาพประกอบ:

2018 Thai Bond Market Review

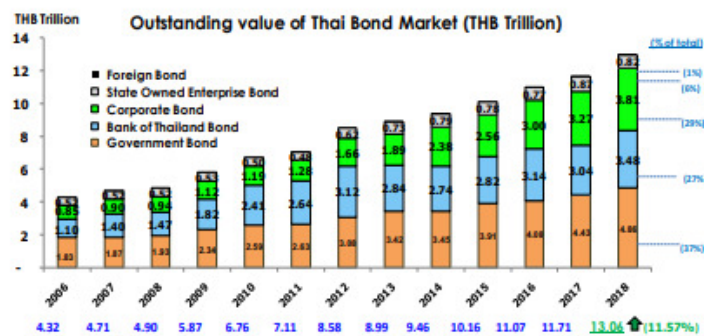
Highlights of 2018

- Total outstanding value of Thai bond market at the end of 2018 surpassed THB 13 trillion for the first time, rising 12% from last year.
- Long term corporate bond issuance hit new record high for three consecutive years, reaching THB 879 billion.
- Green bond was first issued in Thailand.
- Non-resident investor holding of Thai bond reached new all-time high and touched trillion-level to THB 1.002 trillion in November 2018.
- For the first time, since the early of the year 10-year Thai government bond yield has declined to stay below 10-year US Treasury yield until now.
- The Securities and Exchange Commission of Thailand (SEC) amended regulations effective from April 2018 to tighten selling of bill of exchange (BE) to enhance investor protection.

Outstanding Value: Totally grew by 12% while corporate bond ranked 2nd behind government bond in terms of outstanding

Total outstanding value of Thai bond market at the end of 2018 was at THB 13.06 trillion, increasing 12% from the end of last year. Government bond remained the majority at 37% of total outstanding value, while the runner-up was corporate bond with 29% portion which marked two straight years of surpassing BOT bond. The remainders were Bank of Thailand (BOT) bond for 27%, State Owned Enterprise (SOE) bond for 6% and foreign bond for 1%, respectively. (see Figure 1)

Figure 1: Outstanding Value of Thai Bond Market



รายงานสรุปภาวะตลาดตราสารหนี้รายปี โดยนำเสนอข้อมูลการประมูลในตลาดแรก, การซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง, ดัชนีตราสารหนี้, ความเคลื่อนไหวของเส้นอัตราผลตอบแทนในช่วงปีที่ผ่านมาเปรียบเทียบกับปีก่อนหน้า โดยเพิ่มเติมส่วนที่เป็นภาวะอัตราดอกเบี้ยและเศรษฐกิจเด่นๆ ในรอบปีที่ผ่านมา, แนวโน้มอัตราดอกเบี้ย, ปริมาณการออกตราสารหนี้ใหม่ และทิศทาง การซื้อขายในตลาดรองในปีถัดไป ซึ่งเป็นข้อมูลที่ได้จากผลการ Survey กลุ่มผู้ทำหน้าที่เป็น Underwriters และกลุ่ม Dealers

ที่มาของข้อมูล/ หลักการคำนวณ:

นำมาจากข้อมูลการขึ้นทะเบียนและการซื้อขายตราสารหนี้ที่รายงานมายัง ThaiBMA และข้อมูลจากองค์กรอื่นๆ

ประโยชน์การใช้งาน:

เพื่อใช้ติดตามภาวะตลาดตราสารหนี้ และวิเคราะห์ความเคลื่อนไหวของตลาดในช่วงปีที่ผ่านมา ซึ่งจะเห็นภาพกว้างของความเคลื่อนไหวของตลาดตราสารหนี้มากกว่ารายงานรายเดือน โดยสามารถนำมาวางแผนการลงทุนในปีถัดไป หรือนำข้อมูลไปวิเคราะห์เพิ่มเติมได้