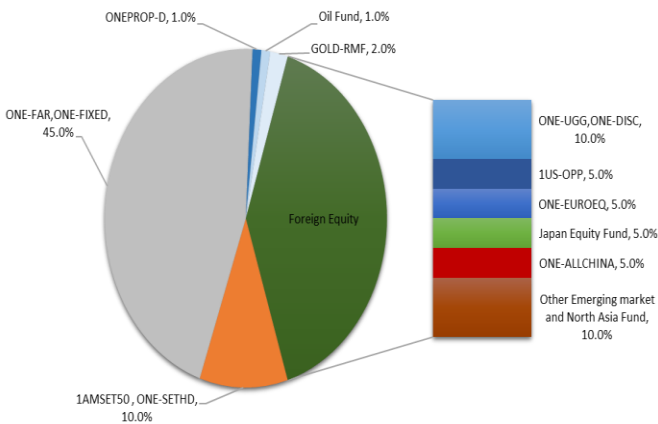


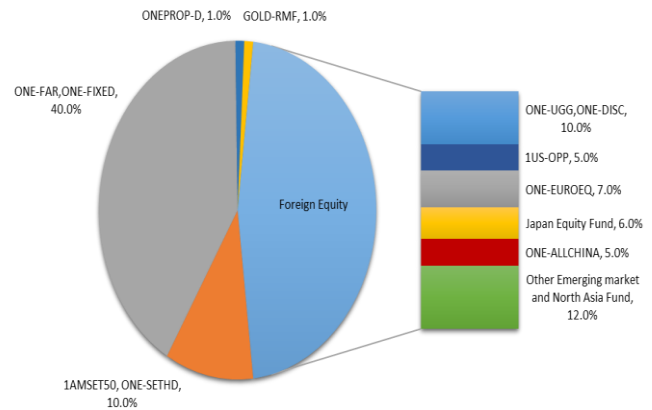
Asset Allocation

บลจ.ววรรณ คงสัดส่วนการลงทุนในพอร์ตที่ระดับความเสี่ยงปานกลาง โดยมองว่านักลงทุนทั่วโลกยังยอมรับความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากสถานการณ์การแพร่ระบาดของโรคโควิด-19 ได้ กอปรกับคาดหวังว่าวัคซีนต้านไวรัสที่รับการอนุมัติและเริ่มแจกจ่ายในประเทศพัฒนาแล้ว จะช่วยให้กิจกรรมเศรษฐกิจกลับมาดำเนินการเป็นปกติตั้งแต่กลางปีเป็นต้นไป ขณะที่ผลการเลือกตั้งซ่อมวุฒิสมาชิกในรัฐจอร์เจียที่ตัวแทนจากพรรคเดโมแครตคว้าชัยได้ทั้ง 2 ที่นั่ง ทำให้เกิดแรงขายสินทรัพย์ปลอดภัยออกมาและส่งผลกระทบต่อพันธบัตรสหรัฐฯ อายุ 10 ปี ทะยานขึ้นแตะระดับ 1.1% เป็นครั้งแรกในรอบ 10 เดือน เนื่องจากรัฐบาลชุดใหม่ภายใต้การนำของโจ ไบเดน ควบคู่กับพรรคเดโมแครตที่สามารถครองเสียงข้างมากในสภาองเกรส มีแนวโน้มผลักดันร่างงบประมาณเพื่อใช้กระตุ้นเศรษฐกิจเพิ่มเติม และอาจขับเคลื่อนแผนการลงทุนในโครงสร้างพื้นฐานได้สำเร็จในระยะข้างหน้า ซึ่งมีมูลค่ากว่า 2 ล้านล้านดอลลาร์ สหรัฐ. ส่วนตลาดหุ้นในประเทศยังคงโดดเด่น แม้ว่าสถานการณ์โควิด-19 ระลอกใหม่สร้างความกังวลต่อทิศทางเศรษฐกิจ แต่มาตรการควบคุมโรคที่แบ่งตามความเสี่ยงของการแพร่ระบาดและมาตรการเยียวยาที่คาดหวังจากภาครัฐ ช่วยลดทอนผลกระทบต่อบรรยากาศการลงทุนได้บ้าง นอกจากนี้ กระแสเงินไหลเข้าจากต่างประเทศยังเป็นอีกแรงหนุนที่ช่วยประคองตลาดหุ้นไทย โดยปัจจัยสำคัญที่ต้องติดตาม ได้แก่ การเปิดเผยแผนกระตุ้นเศรษฐกิจเพิ่มเติมของว่าที่ปธน.ไบเดน (14 ม.ค.) และสถานการณ์โควิด-19 ในประเทศที่อาจส่งผลกระทบต่อการตัดสินใจผ่อนคลายนโยบายการเงินในการประชุมครั้งถัดไป (3 ก.พ.)

Strategic Asset Allocation



Tactical Asset Allocation



Asset Class		SAA	TAA
Money Market		0.00%	0.00%
	Thai money market	0.00%	0.00%
Fixed Income		45.00%	40.00%
	Thai fixed income	45.00%	40.00%
Equity		50.00%	55.00%
	Global equity	10.00%	10.00%
	US equity	5.00%	5.00%
	Europe equity	5.00%	7.00%
	Japan equity	5.00%	6.00%
	China equity	5.00%	5.00%
	Thai equity	10.00%	10.0%
	Other Emerging markets and North Asia Fund	10.00%	12.00%
Alternative Asset		5.00%	5.00%
	PF & REITs Global	1.00%	1.00%
	PF & REITs Local	1.00%	2.00%
	Gold	2.00%	1.00%
	Oil	1.00%	1.00%

ผู้ลงทุนควรลงทุนเมื่อมีความเข้าใจในความเสี่ยงของกองทุน และผู้ลงทุนควรพิจารณาความเหมาะสมของการลงทุน โดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุน วัตถุประสงค์การลงทุนและฐานะทางการเงินของผู้ลงทุนเอง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนตัดสินใจลงทุน



มุมมองการลงทุนประจำสัปดาห์

ตลาดหุ้นไทย (Thai Equity)

บลจ.ววรรณ มองว่าดัชนีตลาดหลักทรัพย์ในสัปดาห์นี้มีแนวโน้มผันผวนสูงขึ้นในรอบ 1510 - 1570 จุด โดยกระแสเงินทุน (Fund Flow) จะยังคงไหลเข้าสินทรัพย์เสี่ยงโดยเฉพาะตลาดเกิดใหม่ จากความชัดเจนทั้งนโยบายการเงินและการคลังทั่วโลก นำโดยสหรัฐอเมริกาที่มีแนวโน้มช่วยผลักดันอัตราเงินเฟ้อให้กลับมาในอนาคต ส่งผลบวกต่อราคาสินค้าโภคภัณฑ์หนุนหุ้นกลุ่ม Cyclical ประกอบกับความคาดหวังการฟื้นตัวของเศรษฐกิจและการลงทุนหนุนมุมมองเชิงบวกต่อกลุ่มธนาคาร อีกประเด็นที่ต้องจับตาคือ หุ้นที่จะได้รับประโยชน์ในระยะข้างหน้าหากสถานการณ์ Covid-19 รอบใหม่ควบคุมได้ อาทิ กลุ่มค้าปลีก ขนส่ง ซึ่งทั้งหมดจะช่วยจำกัด Downside ของดัชนีในระยะสั้นที่อาจจะมีการขายทำกำไรออกมาตามคำเตือนของนักวิเคราะห์ว่ามูลค่าหุ้นเริ่มแพง แต่ด้วยสภาพคล่องในระบบที่สูงกว่าอดีตค่อนข้างมาก จึงเป็นไปได้ว่าราคาหุ้นจะซื้อขายด้วยมูลค่าที่สูงกว่าค่าเฉลี่ยในอดีตได้จนกว่าธนาคารกลางทั่วโลกจะส่งสัญญาณปรับเปลี่ยนนโยบายการเงินผ่นคลาย บลจ. ววรรณ แนะนำผู้ลงทุนกระจายความเสี่ยงการลงทุน ทั้งกองทุน FIF ที่แนะนำ และกองทุนหุ้นไทยสำหรับนักลงทุนที่รับความเสี่ยงได้สูง โดยแนะนำหาจังหวะซื้อสะสมกองทุน ONE-SETHD 1AMSET50 และ ONE-EC14 เมื่อหุ้นขนาดใหญ่มีการปรับฐาน

ตลาดตราสารหนี้ไทย (Thai Fixed Income)

สำหรับแนวโน้มตลาดตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้ คาดว่าอัตราผลตอบแทนพันธบัตรไทยมีแนวโน้มทรงตัวถึงปรับตัวเพิ่มขึ้นตามอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯ อายุ 10 ปีที่ปรับตัวเพิ่มขึ้นเหนือระดับ 1.10% จาก 0.91% ณ สิ้นปี 2563 ควรติดตามการแถลงแผนใช้จ่ายทางการคลังของว่าที่ปธน.ไบเดน และความเห็นของประธาน Fed ในงานสัมมนาออนไลน์ซึ่งจัดโดยมหาวิทยาลัยพรินซ์ตันในวันที่ 14 ธ.ค. หลังรายงานการประชุมนโยบายครั้งล่าสุดระบุว่ามีความเป็นไปได้เพียงเล็กน้อยในการคงโครงการซื้อพันธบัตรไว้ตามเดิมจนกว่าจะมีความคืบหน้าเพิ่มเติมอย่างมีนัยสำคัญต่อการบรรลุเป้าหมาย โดย Fed ไม่ได้แสดงท่าทีสนับสนุนอย่างชัดเจนสำหรับการเข้าซื้อพันธบัตรระยะยาวมากขึ้น แต่อาจเปลี่ยนแปลงได้ในระยะข้างหน้าหากจำเป็น แนะนำลงทุนกองทุนที่มี Duration สั้นอย่าง 1AM-DAILY 1AM-TG และ ONE-FIXED ในสัปดาห์นี้

ตลาดหุ้นต่างประเทศ (Foreign Equity)

บลจ.ววรรณ คาดว่าตลาดหุ้นทั่วโลกมีแนวโน้มปรับตัวเพิ่มขึ้นในสัปดาห์นี้ หลังประกาศผลการเลือกตั้งรัฐ Georgia ของสหรัฐฯ ซึ่งผลออกมาเป็นพรรคเดโมแครตสามารถครองเสียงข้างมากได้ทั้ง 2 สภา โดยมีการคาดการณ์ว่ารัฐบาลสหรัฐฯจะมีมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจเพิ่มเติมช่วยส่งเสริมบรรยากาศการลงทุนในตลาดหุ้น ประกอบกับความคาดหวังเกี่ยวกับการฟื้นตัวของเศรษฐกิจโลกหลังจากการแพร่ระบาดของ Covid-19 จบลง เนื่องจากการผลิตวัคซีนต้าน Covid-19 มีความคืบหน้าไปมาก และได้เริ่มใช้กับประชาชนแล้วในหลายประเทศ ส่งผลถึงความคาดหวังในการฟื้นตัวของเศรษฐกิจโลกเป็นปัจจัยหนุนสำคัญช่วยหนุนให้ตลาดหุ้นทั่วโลกโดยเฉพาะในการกลุ่มประเทศเกิดใหม่ (Emerging Market) ให้ปรับตัวเพิ่มขึ้น จึงแนะนำให้ให้นักลงทุนทยอยซื้อสะสมกองทุนที่มีศักยภาพในการแข่งขันสูง และมีแนวโน้มฟื้นตัวได้หลังจากจบการแพร่ระบาด Covid-19 โดยแนะนำให้สะสมกองทุน ONE-DISC หุ้นขนาดกลางและขนาดเล็กที่มีศักยภาพการเติบโตสูง และกระจายการลงทุนเข้าสู่หุ้นเอเชียที่มีศักยภาพการเติบโตได้แก่ ONE-ALLCHINA และ ONE-VIETNAM โดยอาจพิจารณาลงทุนในกองทุน ONE-GLOBFIN เมื่อราคาปรับลดลงมา หรือพิจารณาลงทุนในกองทุน ONE-EUROEQ ซึ่งเป็น 2 กองทุนที่มีแนวโน้มฟื้นตัวได้ดีหลังจากเศรษฐกิจโลกฟื้นตัว

ปัจจัยที่ต้องติดตาม (Economic calendar)

- 11 ม.ค. 2564
CH – ดัชนีราคาผู้ผลิตและผู้บริโภค เดือน ธ.ค.
- 12 ม.ค. 2564
US – ตำแหน่งงานเปิดใหม่ JOLTs เดือน พ.ย.
- 13 ม.ค. 2564
US – ดัชนีราคาผู้บริโภค เดือน ธ.ค.
US – สต็อกน้ำมันดิบรายสัปดาห์
- 14 ม.ค. 2564
CH – ยอดส่งออกและนำเข้า เดือน ธ.ค.
EU – รายงานการประชุม ECB
US – จำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างจากรายสัปดาห์
- 15 ม.ค. 2564
GB – ผลผลิตภาคอุตสาหกรรม เดือน พ.ย.
EU, GB – ดุลการค้า เดือน พ.ย.
US – ยอดค้าปลีก เดือน ธ.ค.
US – ดัชนีราคาผู้ผลิต เดือน ธ.ค.

ผู้ลงทุนควรลงทุนด้วยความเข้าใจในความเสี่ยงของกองทุน และผู้ลงทุนควรพิจารณาความเหมาะสมของการลงทุน โดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุน วัตถุประสงค์การลงทุนและฐานะทางการเงินของผู้ลงทุนเอง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชวนก่อนตัดสินใจลงทุน



มุมมองการลงทุนประจำสัปดาห์

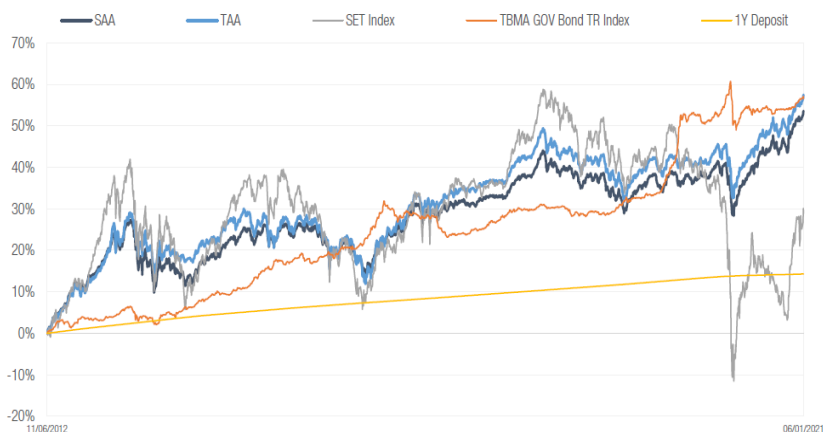
ประเทศ / สินทรัพย์	มุมมองการลงทุน	ปัจจัยต่าง ๆ
ตราสารหนี้		
ตราสารหนี้ทั่วโลก	-	<ul style="list-style-type: none"> ข่าววัคซีนต้าน Covid-19 และมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจที่มากขึ้น ส่งผลให้อัตราผลตอบแทนพันธบัตร (Yield) ระยะยาวมีโอกาสปรับตัวเพิ่มขึ้นในระยะถัดไป แม้ธนาคารกลางและรัฐบาลต่าง ๆ ยังคงมีแนวโน้มใช้มาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจอย่างต่อเนื่อง มีแนวโน้มกดดันให้อัตราผลตอบแทนพันธบัตร (Yield) ระยะสั้นปรับตัวเพิ่มขึ้นได้แต่ไม่มาก
สหรัฐอเมริกา	+	<ul style="list-style-type: none"> ความคาดหวังเกี่ยวกับการฟื้นตัวของเศรษฐกิจและมาตรการกระตุ้นขนาดใหญ่จากภาครัฐบาลมีแนวโน้มช่วยส่งเสริมบรรยากาศการลงทุนในตลาดหุ้น หลังจากพรรคเดโมแครตครองเสียงข้างมาก ติดตามการเปิดเผยผลการดำเนินงานของกลุ่มธนาคาร อาจส่งผลต่อบรรยากาศการลงทุนในระยะถัดไป
ยุโรป และสหราชอาณาจักร	+	<ul style="list-style-type: none"> PMI ภาคการผลิตและการบริการของยุโรปในเดือน ธ.ค. ที่แสดงถึงการฟื้นตัว รวมถึงความคาดหวังเกี่ยวกับการใช้นโยบายการเงินและมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจของรัฐบาล ช่วยหนุนบรรยากาศการลงทุน แม้วัคซีน Covid-19 จะเริ่มใช้ในยุโรปแล้ว แต่ด้วยจำนวนผู้ติดในยุโรปที่เพิ่มขึ้นอย่างต่อเนื่องและอาจนำไปสู่มาตรการ Lockdown อีกครั้ง อาจสร้างความผันผวนให้กับตลาด
จีน และ ฮองกง	0	<ul style="list-style-type: none"> จับตาสถานการณ์แพร่ระบาด Covid-19 ระลอกใหม่ในประเทศจีน หลังเริ่มพบจำนวนผู้ติดเชื้อรายใหม่เพิ่มขึ้นในช่วงสุดสัปดาห์ที่ผ่านมา จับตาค่าดัชนีชี้วัดทางเทคโนโลยีระหว่างจีนและสหรัฐฯ พร้อมท่าทีของประธานาธิบดีสหรัฐฯ คนใหม่
ไทย	+	<ul style="list-style-type: none"> กระแสเงินทุน จะยังคงไหลเข้าสินทรัพย์เสี่ยงโดยเฉพาะตลาดเกิดใหม่ จากความชัดเจนทั้งนโยบายการเงินและการคลังทั่วโลก ส่งผลบวกต่อราคาสินค้าโภคภัณฑ์หนุนหุ้นกลุ่ม Cyclical ความคาดหวังการฟื้นตัวของเศรษฐกิจและการลงทุนหนุนมุมมองเชิงบวกต่อกลุ่มธนาคาร จับตาคือ หุ้นที่จะได้รับประโยชน์ในระยะข้างหน้าหากสถานการณ์ Covid-19 รอบใหม่ควบคุมได้อาที กลุ่มค้าปลีก ขนส่ง
ทองคำ	-	<ul style="list-style-type: none"> เศรษฐกิจที่มีแนวโน้มฟื้นตัวขึ้น ส่งผลให้นักลงทุน Risk on มากขึ้น อาจทำให้เกิดการเทขายทองคำ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐฯ ที่เพิ่มสูงขึ้น เป็นปัจจัยกดดันราคาทองคำในระยะถัดไป
น้ำมัน	+	<ul style="list-style-type: none"> มาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจขนาดใหญ่ของสหรัฐฯ และแนวโน้มการฟื้นตัวของเศรษฐกิจโลกมีแนวโน้มช่วยหนุนราคาน้ำมัน ในการประชุม OPEC+ ซาอุดีอาระเบียประกาศลดกำลังการผลิตไปอีก 2 เดือน สนับสนุนให้ตลาดน้ำมันมีเสถียรภาพมากขึ้น
กองทุนอสังหาริมทรัพย์ / REITs ในประเทศ	0	<ul style="list-style-type: none"> กองทุนอสังหาริมทรัพย์ / REIT ในประเทศ มีแนวโน้มถูกกดดันจากการใช้มาตรการเพื่อยับยั้งการแพร่ระบาดของ Covid-19 มีแนวโน้มส่งผลกระทบต่อรายได้ของกลุ่ม ข่าวความสำเร็จของวัคซีนต้าน Covid-19 มีแนวโน้มทำให้กระแสเงินทุนไหลเข้าตลาดทุนของไทย มีโอกาสช่วยหนุนบรรยากาศการลงทุนใน กองทุนอสังหาริมทรัพย์ / REIT ไทย

ผู้ลงทุนควรลงทุนเมื่อมีความเข้าใจในความเสี่ยงของกองทุน และผู้ลงทุนควรพิจารณาความเหมาะสมของการลงทุน โดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุน วัตถุประสงค์การลงทุนและฐานะทางการเงินของผู้ลงทุนเอง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนตัดสินใจลงทุน



Asset allocation

Asset Allocation Performance Report
as of 06/01/2021



- **SAA** คือ พอร์ตการลงทุนแบบ Strategic Asset Allocation
- **TAA** คือ พอร์ตการลงทุนแบบ Tactical Asset Allocation
- กราฟทางซ้ายมือและตารางด้านล่าง แสดงให้เห็นถึงผลตอบแทนที่ได้รับจากจัดสรรเงินลงทุน (Asset Allocation) โดยแบ่งเป็น SAA และ TAA เปรียบเทียบกับผลตอบแทนของ SET Index, Government Bond Index และเงินฝากของธนาคารพาณิชย์อายุ 1 ปี

SUMMARY OF CUMULATIVE RETURN AND TRACKING ERROR

	Last TAA Rebalance 23/11/2020	YTD 30/12/2020	1M 04/12/2020	3M 06/10/2020	6M 03/07/2020	1Y Inception (A) 06/01/2020	11/06/2021
Strategic Asset Allocation (SAA)							
Return	2.71%	1.06%	1.64%	6.04%	7.94%	9.83%	5.13%
Sharpe Ratio	6.01	25.18	5.03	4.15	2.58	1.18	0.58
VaR	-9.63%						
Tactical Asset Allocation (TAA)							
Return	2.93%	1.08%	1.74%	5.56%	7.50%	9.61%	5.44%
Sharpe Ratio	6.13	26.16	5.12	3.79	2.43	1.18	0.58
VaR	-10.35%						
SET Index							
Return	5.06%	2.97%	2.93%	19.37%	8.75%	-4.85%	3.00%
Sharpe Ratio	1.81	8.69	1.44	3.28	0.98	-0.04	0.17
VaR	-40.93%						
TBMA GOV Bond TR Index							
Return	1.33%	0.03%	0.87%	1.64%	1.99%	2.24%	5.37%
Sharpe Ratio	6.79	0.52	6.04	4.19	2.21	0.42	1.42
VaR	-3.10%						
1Y Deposit Return	0.06%	0.01%	0.04%	0.12%	0.25%	0.64%	1.57%
Tracking Error p.a. (SAA vs TAA)	0.47%	0.15%	0.40%	2.26%	1.64%	1.30%	1.78%

Notes: (A) = Annualized Return
VaR is 252-day VaR (95% CL)
Risk-free Proxy = 1Y Deposit

As of 06/01/2021

ผู้ลงทุนควรลงทุนเมื่อมีความเข้าใจในความเสี่ยงของกองทุน และผู้ลงทุนควรพิจารณาความเหมาะสมของการลงทุน โดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุน วัตถุประสงค์การลงทุนและฐานะทางการเงินของผู้ลงทุนเอง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนตัดสินใจลงทุน



Market Snapshot

รายงานภาวะตลาดตราสารหนี้ไทยสัปดาห์ที่ผ่านมา (4-8 ม.ค. 2564)

ThaiBMA Market (Million Baht.)	This Week	Previous Week	Change
	4-8 Jan 2021	28-30 Dec 2020	
Total Trading Value	7,372,287.46	3,765,024.31	95.81%
Outright Trading Value	425,962.48	156,820.10	171.62%
Financing Value	6,946,312.75	3,608,062.72	92.52%
Other Value	12,227.11	141.51	8540.46%
Daily Average	1,474,457.49	1,255,008.10	17.49%
Government Bond Index (Clean Price)	117.13	117.37	-0.21%
Corporate Bond Index (Clean Price)	104.65	104.69	-0.03%

ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์เฉลี่ยต่อวันเท่ากับ 1,474,457.49 ล้านบาท เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อน 17.49% โดยปริมาณการซื้อขายในสัปดาห์นี้แบ่งเป็นสัดส่วนการทำธุรกรรม Outright 5.78% ส่วนธุรกรรม Financing และธุรกรรมอื่นๆ คิดเป็นสัดส่วน 94.22%

พันธบัตรรัฐบาล ได้แก่ รุ่น LB29DA, LB386A และ LB28DA โดยมีมูลค่าการซื้อขายในแต่ละรุ่นเท่ากับ 29,163.06 ล้านบาท 12,683.07 ล้านบาท และ 12,185.58 ล้านบาท ตามลำดับ

พันธบัตรรัฐวิสาหกิจและพันธบัตรองค์กรภาครัฐ ได้แก่ รุ่น CB21408B, CB22106A และ CB21604A โดยมีมูลค่าการซื้อขายในแต่ละรุ่นเท่ากับ 64,974.29 ล้านบาท 34,125.61 ล้านบาท และ 11,400.58 ล้านบาท ตามลำดับ

หุ้นกู้ภาคเอกชน ได้แก่ BAY211A, BAY217A และ TLT217A โดยมีมูลค่าการซื้อขายในแต่ละรุ่นเท่ากับ 914.78 ล้านบาท 783.98 ล้านบาท และ 711.88 ล้านบาท ตามลำดับ

ปริมาณการซื้อขายพันธบัตรไทยของนักลงทุนต่างชาติในสัปดาห์ที่ผ่านมา (4-8 ม.ค. 2564)

Foreign Trading (Mln Baht.)	This Week	Previous Week	Change
	4-8 Jan 2021	28-30 Dec 2020	
Outright Trading - Total	(2,152.26)	202.01	(2,354.27)
Outright Trading - TTM>1 Yrs.	(3,025.86)	(65.20)	(2,960.65)
Net Holding	854,747.00	857,151.00	(2,404.00)

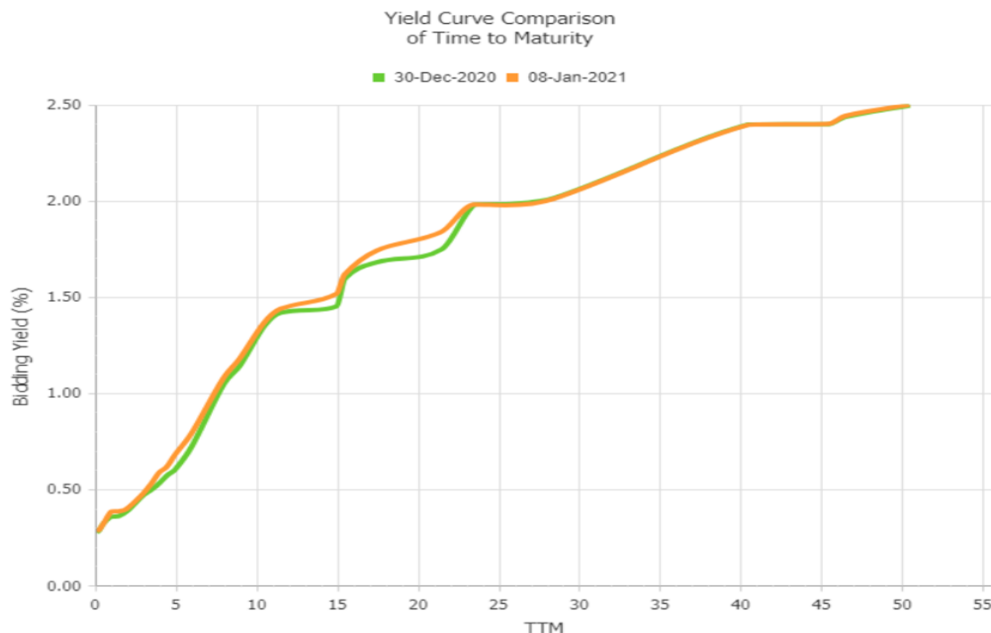
อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล

Thai BMA Reference Yield (interpolation)															
Term	1 Mth.	3 Mth.	6 Mth.	1 Yr.	2 Yr.	5 Yr.	7 Yr.	10 Yr.	12 Yr.	14 Yr.	16 Yr.	18 Yr.	20 Yr.	30 Yrs.	40 Yrs.
8 Jan 21	0.28	0.29	0.32	0.38	0.40	0.69	0.94	1.31	1.45	1.49	1.65	1.75	1.80	2.06	2.38
30 Dec 20	0.27	0.29	0.32	0.36	0.39	0.61	0.89	1.28	1.42	1.44	1.62	1.69	1.72	2.06	2.38
Change (bps)	1	0	-0	3	1	8	5	3	3	5	3	7	8	-0	-0

ผู้ลงทุนควรลงทุนด้วยความเข้าใจในความเสี่ยงของกองทุน และผู้ลงทุนควรพิจารณาความเหมาะสมของการลงทุน โดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุน วัตถุประสงค์การลงทุนและฐานะทางการเงินของผู้ลงทุนเอง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนตัดสินใจลงทุน



การเคลื่อนไหวของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล



การประมูลตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้

Auction date	Symbol	Issue Size (Mln.)	Tenor Day
12-Jan-21	CB21416A	60,000.00	92 Days
13-Jan-21	LB256A	27,500.00	4.78 Yrs.
13-Jan-21	LB496A	6,000.00	29.68 Yrs.
14-Jan-21	BOT22NA	30,000.00	2 Yrs.

ตราสารหนี้ภาคเอกชนออกใหม่

Issuer	Issue Size (MB)	Tenor (Yrs.)	Type	Book-built Date	Issuing Date	Underwriter	Issue/Issuer Rating	Spread over Govt. (bps)	Indi.Coupon (%)
AP	1,230.00	3Y 6M	II/HNW	13-Jan-21	21-Jan-21	KBANK, SCB, UOBT	A-/TRIS	220-240	2.74%-2.94%
	1,270.00	5Y	II/HNW					265-285	3.34%-3.54%

ผู้ลงทุนควรลงทุนเมื่อมีความเข้าใจในความเสี่ยงของกองทุน และผู้ลงทุนควรพิจารณาความเหมาะสมของการลงทุน โดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุน วัตถุประสงค์การลงทุนและฐานะทางการเงินของผู้ลงทุนเอง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนตัดสินใจลงทุน



Market Snapshot

ผลตอบแทนตลาดเงิน ตลาดทุนทั่วโลกย้อนหลัง (ข้อมูล ณ วันที่ 8 ม.ค. 2564)

Index	Last	1D (%)	1W (%)	1M (%)	%YTD
MSCI ACWI	663.59	0.93	2.71	5.31	2.72
MSCI WORLD	2,753.31	0.71	2.39	4.92	2.39
MSCI EM	1,353.53	2.36	4.79	7.87	4.83
MSCI AC ASIA x JAPAN	886.93	2.51	5.18	8.31	5.22
DOW JONES INDUS. AVG	31,097.97	0.18	1.66	3.50	1.66
S&P 500 INDEX	3,824.68	0.56	1.87	4.26	1.87
NASDAQ COMPOSITE	13,201.98	1.03	2.45	7.06	2.45
EURO STOXX 600	411.17	0.66	3.07	4.22	3.07
FTSE 100 INDEX (UK)	6,873.26	0.24	6.40	4.88	6.40
NIKKEI 225	28,139.03	2.36	2.53	5.03	2.53
HANG SENG INDEX	27,878.22	1.20	2.38	5.19	2.38
HSCEI INDEX (China H-Share)	10,955.55	1.47	2.03	4.47	2.03
CSI 300 INDEX (China A-share)	5,495.43	-0.33	5.45	11.19	5.45
S&P BSE SENSEX Index	48,782.51	1.43	1.91	5.84	2.16
SET INDEX	1,536.44	1.50	6.01	3.63	6.01
SET50 INDEX	977.59	2.32	7.37	1.99	7.37
SET Hi Dividend 30 Index	1,070.95	0.61	5.24	1.31	5.24
Vietnam Ho Chi Minh Index	1,167.69	0.97	5.84	12.76	5.84
FTSE EPRA Nareit Global Index	1,650.95	0.61	-1.70	0.10	-1.70
SETPREIT INDEX	168.24	-0.54	-3.03	-5.30	-3.03
WTI Crude (\$/Barrel)	52.24	2.77	9.49	11.53	7.46
BRENT Crude (\$/Barrel)	55.99	2.96	9.00	11.60	7.51
GOLD SPOT \$/OZ	1,849.01	-4.69	-5.92	-0.65	-3.71
Dollar Index	90.098	0.342	0.598	-0.627	0.521
EUR / USD	1.222	-0.319	-0.563	0.553	-0.303
GBP / USD	1.357	-0.413	-0.435	2.178	-1.156
USD / JPY	103.940	-0.230	-1.008	-0.134	-0.893
USD / THB	30.136	-0.096	-0.809	-0.136	-0.683

Source : Bloomberg

ผู้ลงทุนควรลงทุนเมื่อมีความเข้าใจในความเสี่ยงของกองทุน และผู้ลงทุนควรพิจารณาความเหมาะสมของการลงทุน โดยคำนึงถึงประสบการณ์การลงทุน วัตถุประสงค์การลงทุนและฐานะทางการเงินของผู้ลงทุนเอง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนก่อนตัดสินใจลงทุน

