|  |  |
| --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (8 - 11 ส.ค. 59)** |
|

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Thai BMA Market | 8 - 11 ส.ค. 59 | 1 - 5 ส.ค. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. - 11 ส.ค. 59 |
| มูลค่าการซื้อขายรวม(ล้านบาท) | 394,753.77 | 463,218.00 | -14.78% | 14,267,060.03 |
| มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 98,688.44 | 92,643.60 | 6.52% | 97,054.83 |
| ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 112.55 | 112.73 | -0.16% | - |
| ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.65 | 107.71 | -0.06% | - |

ภาพรวมตลาดตราสารหนี้หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 11 ส.ค. 59 มีจำนวน 3,262 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,548,825.49 ล้านบาท | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
|  การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 151,554.8 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย394,753.77 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 98,688.44 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 6.52 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 8.65 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 91.35 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 455 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 43 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 357 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 12 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
|

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 130,000.00 | 85.78 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 0.00 | 0.00 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 2,500.00 | 1.65 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 16,754.80 | 11.04 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 2,300.00 | 1.52 |
| **รวม** | 151,554.8 | 100.00 |

 |

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 292,340.00 | 78.07 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 74,811.00 | 19.98 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 7,289.00 | 1.95 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 374,440.00 | 100.00 |
| \* เฉพาะธุรกรรม Outright ซึ่งหมายถึงการซื้อขายตราสารหนี้ที่เป็นการขายขาด |

 |
|

|  |
| --- |
| **ThaiBMA Reference Yield (Interpolation)** |
|  | **1 Mth.** | **3 Mth.** | **6 Mth.** | **1 Yr.** | **2 Yr.** | **3 Yr.** | **5 Yr.** | **7 Yr.** | **10 Yr.** | **12 Yr.** | **15 Yr.** | **18 Yr.** | **19 Yr.** | **20 Yr.** |
| 1 - 5 ส.ค. 59 |   |   |   | 1.45 | 1.53 | 1.55 | 1.69 | 1.81 | 2.05 | 2.21 | 2.41 | 2.47 | 2.48 | 2.48 |
| 8 - 11 ส.ค. 59 |   |   |   | 1.47 | 1.53 | 1.58 | 1.72 | 1.85 | 2.08 | 2.25 | 2.44 | 2.49 | 2.49 | 2.50 |
| เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - |  2 | 0 | 3 | 3 | 4 | 3 | 4 | 3 | 2 | 1 | 2 |

 |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** |
|  ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวเพิ่มขึ้นทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะอัตราผลตอบแทนตราสารอายุ 7 ปี และ 12 ปี ที่ปรับเพิ่มขึ้น 4 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 ปี 18 ปี และ 20 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 2 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 2 ปี ไม่มีการปรับตัว อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 3-15 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 3 ถึง 4 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 19 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 1 bp. ทั้งนี้ สหรัฐฯ รายงานตัวเลขการจ้างงานนอกภาคการเกษตร เดือน ก.ค. ปรับเพิ่มขึ้น 255,000 ตำแหน่ง ซึ่งดีกว่าที่ตลาดคาดไว้ที่ 180,000 ราย ในขณะที่อัตราการว่างงานคงที่ อยู่ที่ระดับ 4.9% จึงทำให้ตลาดคาดการณ์ถึงโอกาสที่ FED จะปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยอีก 1 ครั้งภายในปีนี้ ด้านปัจจัยในประเทศ ผลการออกเสียงลงประชามติร่างรัฐธรรมนูญ มีมติเห็นชอบรับร่างรัฐธรรมนูญ 61.40% ต่อ 58.11% สำหรับผลการประมูลพันธบัตรรัฐบาลรุ่น Benchmark อายุ 10 ปี ตัวใหม่ (LB26DA) จำนวน 15,000 ล้านบาท ซึ่งได้รับความสนใจจากนักลงทุน 1.78 เท่าของวงเงินประมูล และผลประมูลอยู่ที่ 2.091% ด้านปัจจัยต่างประเทศ ผลการประชุมธนาคารกลางเกาหลีใต้ ได้มีมติให้คงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ 1.25% ซึ่งเป็นระดับต่ำสุด ขณะที่ธนาคารกลางญี่ปุ่น รายงานดัชนีราคาผู้ผลิต ปรับลดลง 3.9% เมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปีก่อน โดยนักลงทุนต่างชาติขายสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 3,291 ล้านบาทสำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (15 – 19 ส.ค. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ GDP ไตรมาส 2 ปี 2016 สำหรับปัจจัยภายนอกที่ต้องติดตาม ได้แก่ GDP ไตรมาส 2 ปี 2016 ของญี่ปุ่น ฟิลิปปินส์ และไต้หวัน อัตราเงินเฟ้อ เดือน ก.ค. ของยูโรโซน FOMC Meeting Minutes ของสหรัฐฯ และการประชุมธนาคารกลางของอินโดนีเซีย |
|  |