|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (25 - 29 ก.ค. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 25 - 29 ก.ค. 59 | 20 - 22 ก.ค. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 29 ก.ค. 59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 453,063.62 | 248,645.49 | 82.21% | 13,409,088.26 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 90,612.72 | 82,881.83 | 9.33% | 97,167.31 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 112.30 | 112.35 | -0.04% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.71 | 107.73 | -0.02% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 29 ก.ค. 59  มีจำนวน 3,215 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,448,955.03 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 170,320 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  453,063.62 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 99,612.72 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 9.33 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 8.40 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 91.60 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 3 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 460 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 44 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 41 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 362 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 12 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 117,000.00 | 68.69 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 0.00 | 0.00 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 20,000.00 | 11.74 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 9,020.00 | 5.30 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 24,300.00 | 14.27 | | **รวม** | 170,320 | 100.00 | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 322,196.00 | 76.59 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 84,747.00 | 20.15 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 13,709.00 | 3.26 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 420,652.00 | 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.** | | 20 - 22 ก.ค. 59 |  |  |  | 1.45 | 1.53 | 1.56 | 1.71 | 1.86 | 2.10 | 2.27 | 2.44 | 2.50 | 2.52 | 2.54 | | 25 - 29 ก.ค. 59 |  |  |  | 1.47 | 1.55 | 1.56 | 1.73 | 1.87 | 2.11 | 2.27 | 2.48 | 2.54 | 2.56 | 2.57 | | เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - | 2 | 2 | 0 | 2 | 1 | 1 | 0 | 4 | 4 | 4 | 3 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวเพิ่มขึ้นทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะอัตราผลตอบแทนตราสารอายุ 15-19 ปี ที่ปรับเพิ่มขึ้น 4 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 3 ปี และ 12 ปี ไม่มีการปรับตัว อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-2 ปี และ 5 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 2 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 7-10 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 1 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 15-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 3 ถึง 4 bp. ทั้งนี้ จากผลการประมูลพันธบัตรรุ่นอายุ 15 ปี จำนวน 16,000 ล้านบาท มีผลตอบแทนอยู่ที่ 2.48% เพิ่มขึ้นจากก่อนหน้า 4 bp. ด้านปัจจัยต่างประเทศ ผลการประชุมคณะกรรมการกำหนดนโยบายการเงิน (FOMC) ของธนาคารกลางสหรัฐ มีมติคงอัตราดอกเบี้ยระยะสั้นอยู่ในช่วง 0.25-0.50% ตามที่ตลาดคาดไว้ และส่งสัญญาณว่าจะปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยแบบค่อยเป็นค่อยไป โดยยังติดตามสิ่งบ่งชี้เงินเฟ้อ การพัฒนาการทางการเงิน และเศรษฐกิจโลกอย่างใกล้ชิด ในขณะที่ผลการประชุมธนาคารกลางญี่ปุ่น มีมติให้คงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ -0.1% และเพิ่มปริมาณการซื้อกองทุนหุ้น จากเดิม 3.3 ล้านล้านเยนต่อปี เป็น 6.0 ล้านล้านเยนต่อปี โดยยังคงระงับการเข้าซื้อพันธบัตรรัฐบาลที่ 80 ล้านล้านเยนต่อปีตามเดิม อย่างไรก็ตาม ตลาดยังติดตามธนาคารกลางยุโรปที่จะเปิดเผยผลการทดสอบภาวะวิกฤต ในภาคธนาคาร ซึ่งตลาดการเงินคาดว่า ธนาคารบางแห่งในอิตาลีจะถูกระบุอยู่ในภาวะขาดแคลนเงินทุน โดยนักลงทุนต่างชาติขายสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 12,6148 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (1 -5 ส.ค. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ อัตราเงินเฟ้อ ดัชนีความเชื่อมั่นภาคธุรกิจและดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภค เดือน ก.ค. กนง. ประชุม (ตลาดคาดคงดอกเบี้ยที่ 1.5%) กกพ. ประกาศรายชื่อผู้ผ่านคุณสมบัติไฟฟ้าชีวมวลภาคใต้ ปัจจัยภายนอกที่ต้องติดตาม ได้แก่ การประชุมธนาคารกลางของออสเตรเลีย GDP ไตรมาส 2 ปี 2016 ของอินโดนีเซีย การจ้างงานภาคเอกชน นอกภาคการเกษตรและอัตราว่างงาน เดือน ก.ค. ของสหรัฐฯ | | |
|  | | |