|  |  |
| --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (20 - 22 ก.ค. 59)** |
|

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Thai BMA Market | 20 - 22 ก.ค. 59 | 11 - 15 ก.ค. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 22 ก.ค. 59 |
| มูลค่าการซื้อขายรวม(ล้านบาท) | 248,645.49 | 468,654.50 | -46.94% | 12,956,024.64 |
| มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 82,881.83 | 93,730.90 | -11.57% | 97,413.72 |
| ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 112.35 | 112.92 | -0.50% | - |
| ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.73 | 107.87 | -0.13% | - |

ภาพรวมตลาดตราสารหนี้หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 22 ก.ค. 59 มีจำนวน 3,158 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,400,230.87 ล้านบาท | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
|  การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 157,445 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย248,645.49 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 82,881.83 ล้านบาทต่อวัน ลดลงจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 11.57 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 6.14 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 93.86 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** | 116,705.00 | 74.12 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 0.00 | 0.00 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 10,000.00 | 6.35 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 30,740.00 | 19.52 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 157,445 | 100.00 |

 |

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 182,747.00 | 76.69 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 49,177.00 | 20.64 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 6,381.00 | 2.68 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 238,305.00 | 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.** |
| 11 - 15 ก.ค. 59 |   |   |   | 1.45 | 1.52 | 1.53 | 1.68 | 1.80 | 2.01 | 2.21 | 2.39 | 2.42 | 2.42 | 2.42 |
| 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 |
| เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - |  0 | 1 | 3 | 3 | 6 | 9 | 6 | 5 | 8 | 10 | 12 |

 |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** |
|  ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยลดลงเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวเพิ่มขึ้นทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะอัตราผลตอบแทนตราสารอายุ 20 ปี ที่ปรับเพิ่มขึ้น 12 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 ปี ไม่มีการปรับตัว อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 2-5 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 1 ถึง 3 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 7-15 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 5 ถึง 9 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 18-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 8 ถึง 12 bp. ทั้งนี้ จากการกระประมูลพันธบัตรที่ผ่านมา จำนวน 10,000 ล้านบาท มีผู้สนใจเพียง 1.02 เท่าของวงเงินประมูล เนื่องจากนักลงทุนเริ่มเห็นว่ายังมี Supply ตราสารหนี้ระยะยาวที่จะออกในไตรมาสนี้อีกจำนวนมากประมาณ 86,000 ล้านบาท ด้านปัจจัยต่างประเทศ ญี่ปุ่นเตรียมออกมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจวงเงินอย่างน้อย 20 ล้านล้านเยน (1.88 แสนล้านดอลลาร์สหรัฐฯ) เพื่อผลักดันเศรษฐกิจให้หลุดพ้นจากภาวะเงินฝืด และป้องกันผลกระทบจาก Brexit ขณะที่ธนาคารกลางยุโรปมีมติคงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ระดับ 0% ซึ่งเป็นระดับต่ำสุด และได้ประกาศวงเงินในการซื้อพันธบัตรตามมาตรการผ่อนคลายเชิงปริมาณ (QE) ที่ระดับ 8 หมื่นล้านยูโร/เดือน อย่างไรก็ตาม ตลาดยังติดตามการประชุมคณะกรรมการกำหนดนโยบายการเงินของธนาคารกลางสหรัฐฯ ในสัปดาห์หน้า โดยนักลงทุนต่างชาติขายสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 15,369 ล้านบาทสำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (25 – 29 ก.ค. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ ดุลการค้าและดัชนีผลผลิตอุตสาหกรรมและอัตราการใช้กำลังการผลิต และ ธปท. รายงานภาวะเศรษฐกิจ เดือน มิ.ย. ปัจจัยภายนอกที่ต้องติดตาม ได้แก่ GDP ไตรมาส 2 ปี 2016 ของเกาหลีใต้และยูโรโซน ดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภค เดือน ก.ค. ผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์และคำสั่งซื้อสินค้าคงทน เดือน มิ.ย. ของสหรัฐฯ  |
|  |