|  |  |
| --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (4 - 8 ก.ค. 59)** |
|

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Thai BMA Market | 4 – 8 ก.ค. 59 | 27 – 30 มิ.ย. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 8 ก.ค. 59 |
| มูลค่าการซื้อขายรวม(ล้านบาท) | 521,485.53 | 478,305.48 | 9.03% | 12,238,724.65 |
| มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 104,297.11 | 119,576.37 | -12.78% | 97,909.80 |
| ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 113.27 | 112.75 | 0.46% | - |
| ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.85 | 107.76 | 0.08% | - |

ภาพรวมตลาดตราสารหนี้หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 8 ก.ค. 59 มีจำนวน 3,213 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,424,600.91 ล้านบาท | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
|  การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 154,990 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย521,485.53 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 104,297.11 ล้านบาทต่อวัน ลดลงจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 12.78 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 8.77 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 91.23 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 460 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 44 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 41 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 361 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 13 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
|

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 112,000.00 | 72.29 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 21,000.00 | 13.55 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 10,000.00 | 6.45 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 11,931.40 | 7.70 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 154,990 | 100.00 |

 |

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 409,251.00 | 81.10 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 82,950.00 | 16.44 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 12,442.00 | 2.47 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 504,643.00 | 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.** |
| 27 - 30 มิ.ย. 59 |   |   |   | 1.46 | 1.57 | 1.57 | 1.74 | 1.85 | 2.02 | 2.22 | 2.45 | 2.49 | 2.48 | 2.48 |
| 4 - 8 ก.ค. 59 |   |   |   | 1.45 | 1.51 | 1.50 | 1.68 | 1.80 | 1.96 | 2.14 | 2.39 | 2.41 | 2.41 | 2.41 |
| เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - |  -1 | -6 | -7 | -6 | -5 | -6 | -8 | -6 | -8 | -7 | -7 |

 |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** |
|  ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยลดลงเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลงทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะอัตราผลตอบแทนตราสารอายุ 12 ปี และ 18 ปี ที่ปรับลดลง 8 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-3 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -7 ถึง -1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5-10 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -6 ถึง -5 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 12-18 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -8 ถึง -6 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 19-20ปี ปรับตัวอยู่ที่ -7 bp. ทั้งนี้ ด้านปัจจัยต่างประเทศ ธนาคารกลางอังกฤษ (BoE) ได้เปิดเผยในรายงานเสถียรภาพทางการเงินว่า เสถียรภาพทางการเงินของสหราชอาณาจักรกำลังเผชิญกับภาวะท้าทาย ประกอบกับเริ่มมีข่าวเกี่ยวกับบริษัทประกันชีวิต 3 แห่ง ซึ่งรวมถึงสแตนดาร์ด ไลฟ์ ได้ระงับการซื้อขายกองทุนอสังหาริมทรัพย์ในสหราชอาณาจักร และ FED ได้เปิดเผยรายงานการประชุม FOMC เดือน มิ.ย. โดยกล่าวถึงจำนวนกรรมการ FED ที่มากขึ้น และคาดว่า FED จะปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยเพียง 1ครั้งในปีนี้ รวมถึงสหรัฐฯ ได้รายงานตัวเลขการจ้างงานนอกภาคเกษตรประจำเดือน มิ.ย. ปรับเพิ่มขึ้น 287,000 ตำแหน่ง ซึ่งดีกว่าคาดไว้เพียง 175,000 ตำแหน่ง อย่างไรก็ตาม ตลาดยังติดตามรายงานสรุปภาวะเศรษฐกิจของธนาคารกลางกลางสหรัฐฯ (Beige Book) ในสัปดาห์หน้า โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 10,082 ล้านบาทสำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (11 - 15 ก.ค. 59) ปัจจัยที่ต้องติดตาม ได้แก่ ดุลการค้า เดือน มิ.ย. และ GDP ไตรมาส 2 ปี 2016 ของจีน การประชุมธนาคารกลางของเกาหลีใต้ อังกฤษ และสหรัฐฯ และอัตราเงินเฟ้อ เดือน มิ.ย. ของสหรัฐฯ และยูโรโซน |