|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (27 - 30 มิ.ย. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 27 – 30 มิ.ย. 59 | 20 – 24 มิ.ย. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 30 มิ.ย. 59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 478,305.48 | 328,904.13 | 45.42% | 11,717,239.12 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 119,576.37 | 65,780.83 | 81.78% | 97,643.66 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 112.75 | 112.26 | 0.44% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.76 | 107.62 | 0.13% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 30 มิ.ย. 59  มีจำนวน 3,238 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,420,314.50 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 120,606.4 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  478,305.48 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 119,576.37 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 81.78 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 10.29 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 89.71 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 4 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** | 111,415.00 | 92.38 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 0.00 | 0.00 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 5,000.00 | 4.15 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 4,191.40 | 3.47 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 120,606.4 | 100.00 | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 356,701.00 | 75.98 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 104,887.00 | 22.34 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 7,904.00 | 1.68 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 469,492.00 | 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 - 24 มิ.ย. 59 |  |  |  | 1.45 | 1.58 | 1.60 | 1.79 | 1.96 | 2.11 | 2.30 | 2.49 | 2.57 | 2.58 | 2.58 | | 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 | | เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - | 1 | -1 | -3 | -5 | -11 | -9 | -8 | -4 | -8 | -10 | -10 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลงเกือบทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะอัตราผลตอบแทนตราสารอายุ 7 ปี ที่ปรับลดลง 11 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-3 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -3 ถึง 1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5-12 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -11 ถึง -5 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 15-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -10 ถึง -4 bp. ทั้งนี้ จากการที่อัตราผลตอบแทนดังกล่าวมีแนวโน้มปรับตัวลดลงต่อเนื่องมาจากผลของ Brexit ในสัปดาห์ก่อนหน้า ซึ่งนักลงทุนต่างชาติมาองว่า ตลาดตราสารหนี้ๆไทยยังคงน่าสนใจในกลุ่มประเทศ Emering Market และตราสารหนี้ถือได้ว่าเป็นสินทรัพย์ปลอดภัย ด้านปัจจัยต่างประเทศ สหรัฐฯ รายงานประมาณการ GDP ประจำไตรมาส 1/2559 มีการขยายตัว 1.1% เมื่อเทียบกับไตรมาสก่อนหน้าซึ่งสูงกว่าที่ตลาดคาดไว้ที่ระดับ 1% ขณะที่ตัวเลขจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานครั้งแรกรายสัปดาห์ของสหรัฐฯ ปรับเพิ่มขึ้น 10,000 ราย อยู่ที่ 268,000 ราย ดีกว่าที่ตลาดคาดไว้ที่ 267,000 ราย ส่วนปัจจัยในประเทศ ธปท. รายงานภาวะเศรษฐกิจ เดือน พ.ค. 59 ขยายตัวอย่างต่อเนื่องจากเดือนก่อนหน้า ตามแรงขับเคลื่อนจากภาคการท่องเที่ยว รวมทั้งอุปสงค์ในประเทศที่ปรับตัวขึ้น ทั้งนี้ ตลาดยังคงติดตามรายงานดัชนีราคาผู้ผลิต (PPI) ของสหภาพยุโรป โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 16,602 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (4 - 8 ก.ค. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ ดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภค เดือน มิ.ย. ปัจจัยภายนอกที่ต้องติดตาม ได้แก่ GDP ไตรมาส 2 ปี 2016 ของสิงคโปร์ การจ้างงานนอกภาคเกษตร เดือน มิ.ย. และคำสั่งซื้อสินค้าคงทน เดือน พ.ค. ของสหรัฐฯ ตลาดหุ้นปิดทำการของอินโดนีเซีย สิงคโปร์และอินเดีย เนื่องในวัน Idul Fitri และตลาดการเงินปิดทำการของสหรัฐฯ เนื่องในวัน Independence Day | | |
|  | | |