

ภาวะตลาดตราสารหนี้ของไทย เดือน มิ.ย. 2567

- การซื้อขายตราสารหนี้ เดือน มิ.ย. 67 มูลค่า 25,503.8 Bn THB ลดลง 8.1% YoY และ 7.4% MoM โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,342.3 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 1.6% YoY แต่ลดลง 2.5% MoM หากพิจารณา 6M/67 มูลค่า 165,426.1 Bn THB เพิ่มขึ้น 1.3% YoY โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,378.6 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 2.1% YoY
- ตราสารหนี้ เดือน มิ.ย. 67 มูลค่า 16,913.7 Bn THB เพิ่มขึ้น 4.4% YoY และ 3.3% YTD แต่ลดลง 1.1% MoM โดยพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตรรัฐบาล ตราสารหนี้ภาคเอกชน และพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ คิดเป็น 13.2% 52.5% 27.5% และ 6.3% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ ส่วนมูลค่าตราสารหนี้อายุคงเหลือ (0,1Y), [1Y,5Y), [5Y,10Y), [10Y,15Y) และ [15Y,50Y) คิดเป็น 14.9% 21.3% 16.5% 19.5% และ 27.8% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ
- อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล เดือน มิ.ย. 67 อายุคงเหลือ 3M 6M 1Y 2Y 3Y 5Y และ 10Y อยู่ที่ 2.32% 2.34% 2.36% 2.35% 2.38% 2.47% และ 2.68% ตามลำดับ
- ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล เดือน มิ.ย. 67 เมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปีก่อน ลดลงเกือบทุกประเภท ยกเว้น Total Return Index หากเทียบกับเดือนก่อน เพิ่มขึ้นเกือบทุกประเภท ยกเว้น Gross Price Index

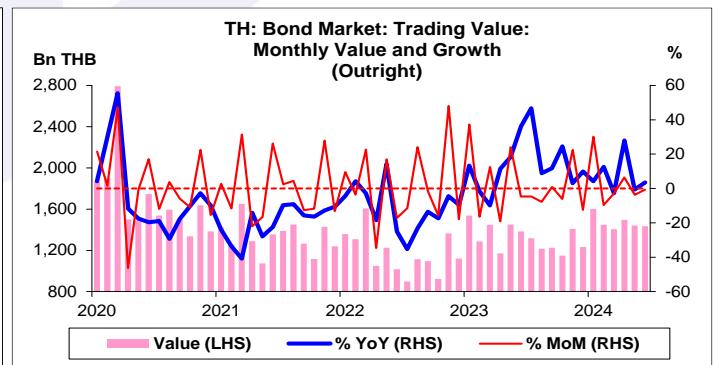
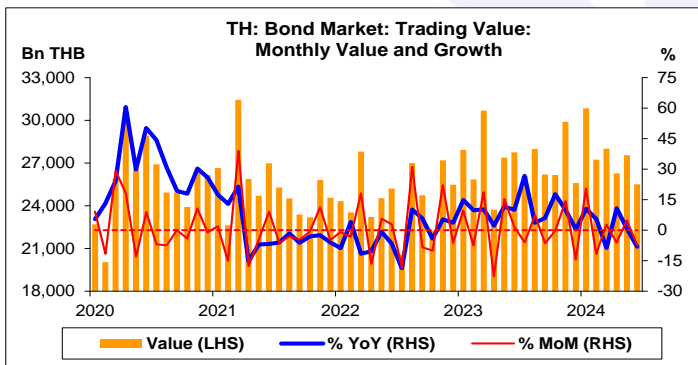
การประเมินอันดับค่า อิงค่าต่ำสุด ค่าเฉลี่ย และค่าสูงสุด (ปี 2557-67)

Bond	All Periods			Same Periods			Latest
	Month	Quarter	Year	YTD	Quarter	Month	
Bond							
Trading Value	4	4	5	5	4	4	Jun-24
Outstanding Value	5	5	5	-	5	5	Jun-24
Government Bond							
Total Return Index	4	4	4	-	4	4	Jun-24
Gross Price Index	2	2	1	-	2	2	Jun-24
Clean Price Index	2	2	1	-	2	2	Jun-24

หมายเหตุ: 5 สูง 4 ค่อนข้างสูง 3 ปานกลาง 2 ค่อนข้างต่ำ 1 ต่ำ

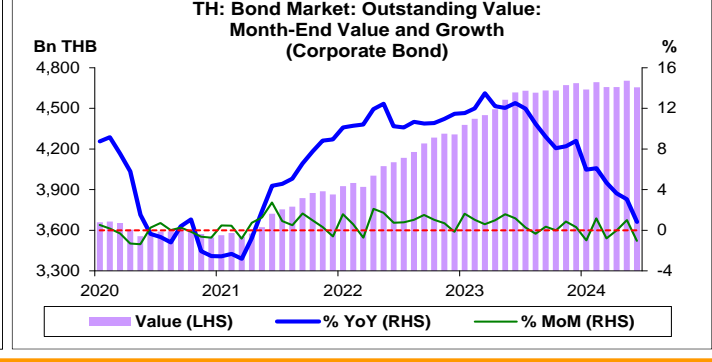
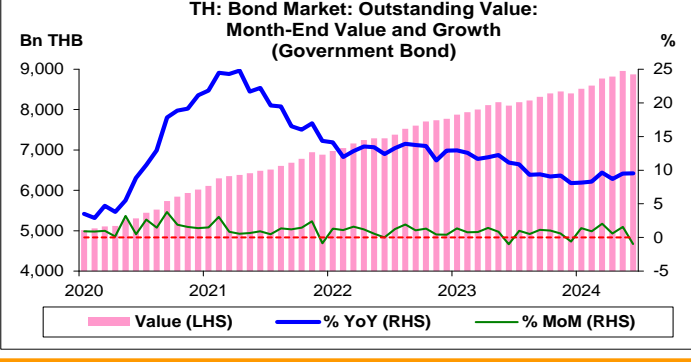
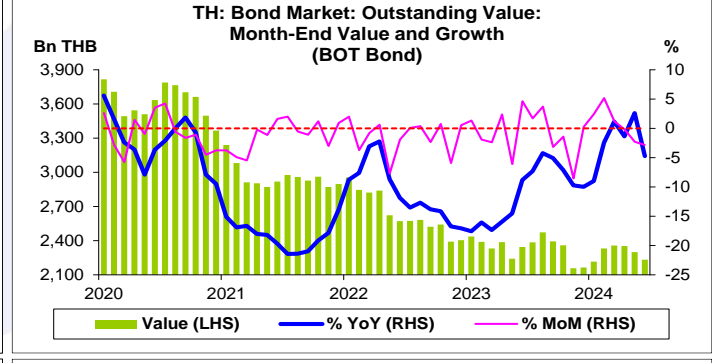
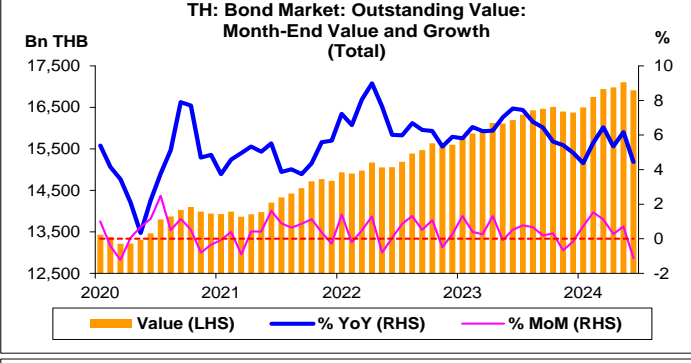
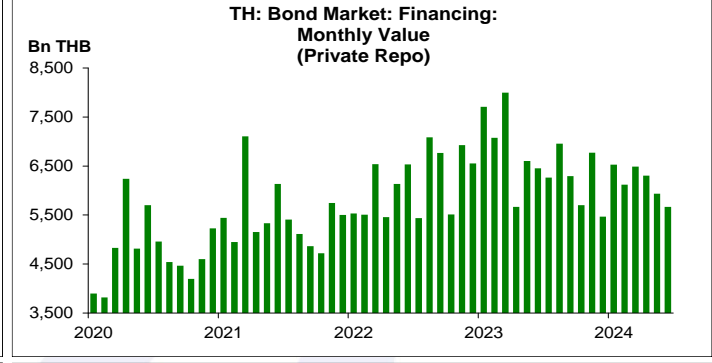
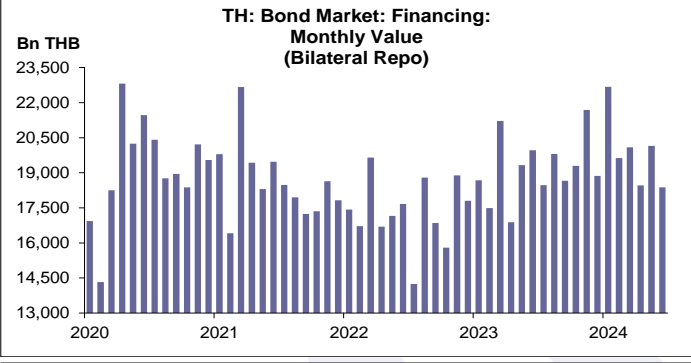
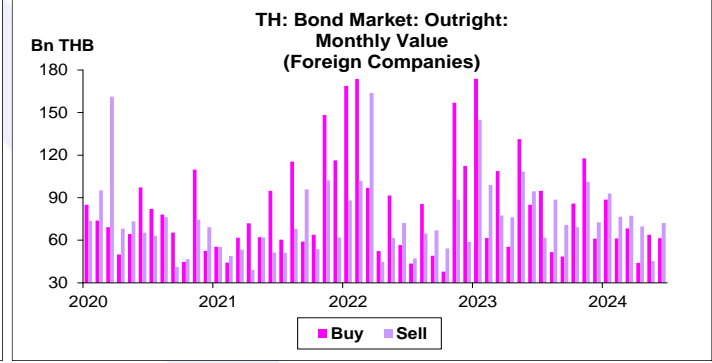
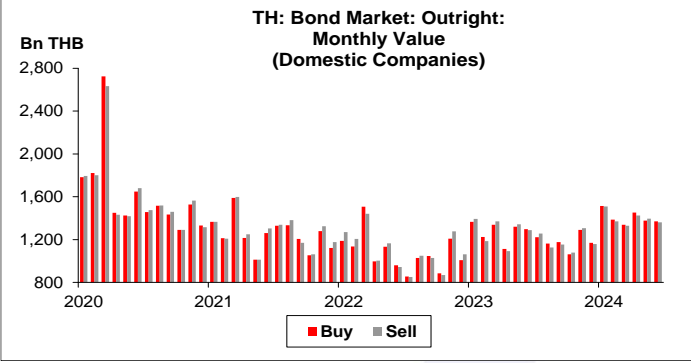
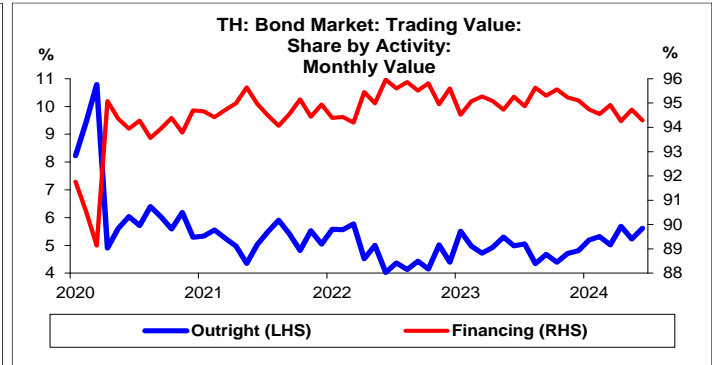
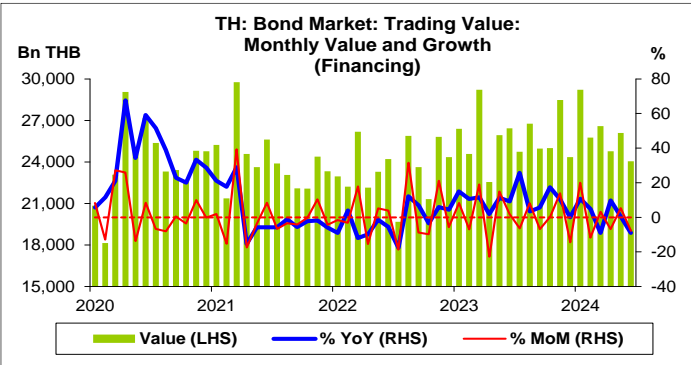
อัตราการเปลี่ยนแปลงรายปี (ปี 2557-66)

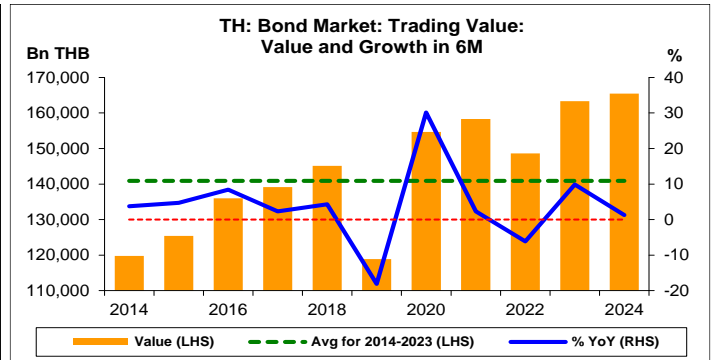
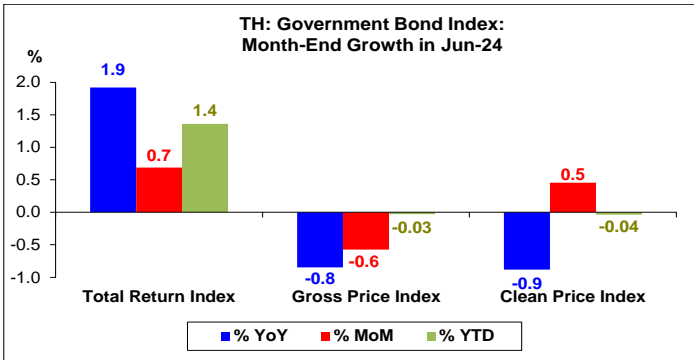
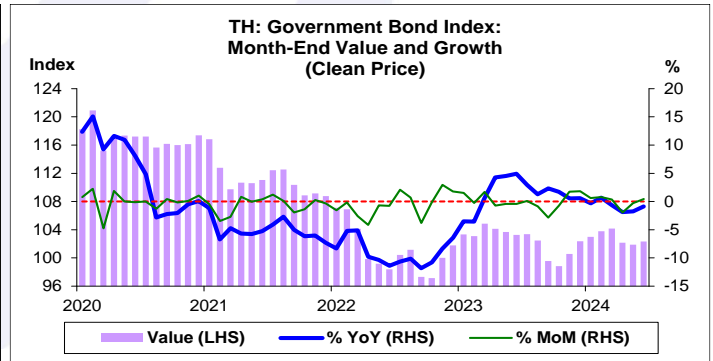
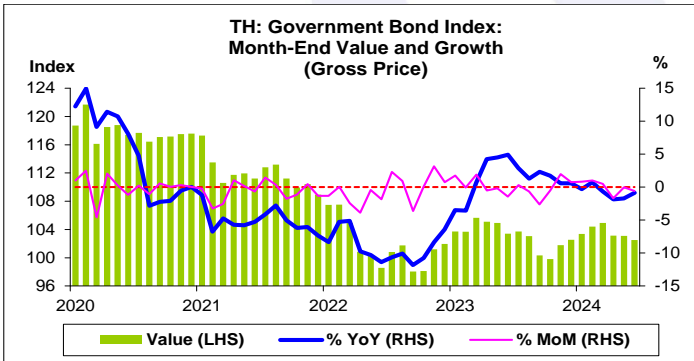
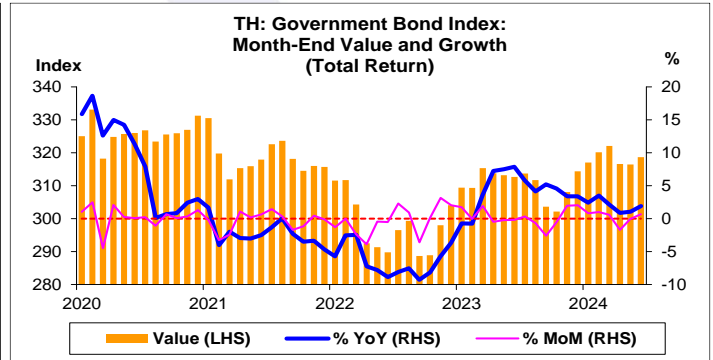
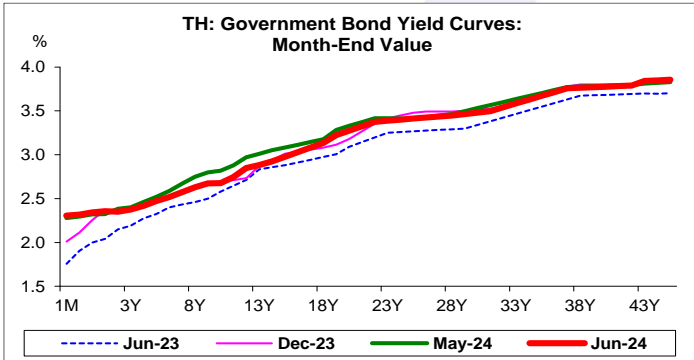
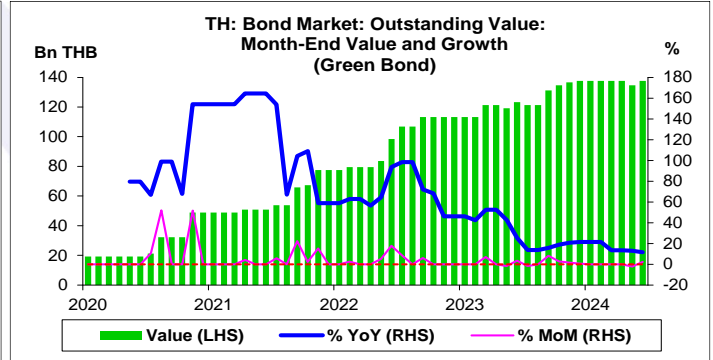
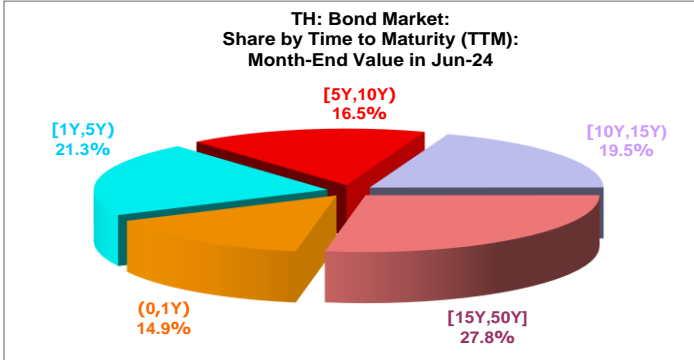
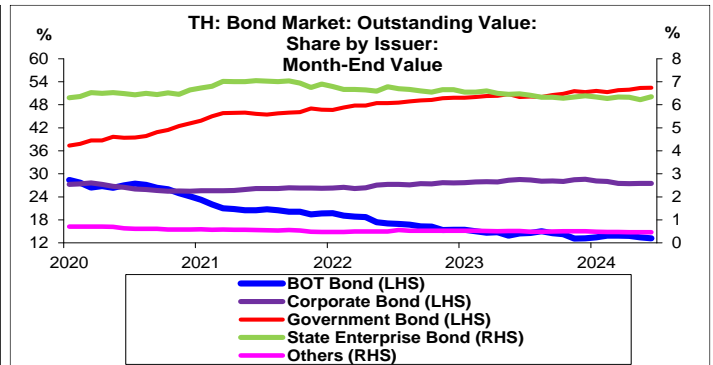
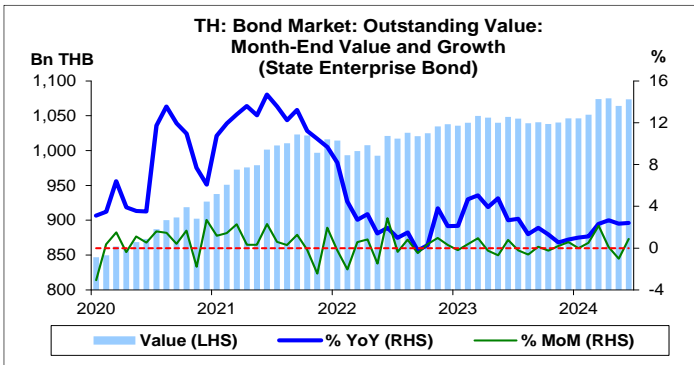
Bond	%	Average YoY Growth	CAGR
Bond			
Trading Value		4.5	3.9
Outstanding Value		6.2	6.2
Government Bond			
Total Return Index		3.5	3.3
Gross Price Index		-0.1	-0.3
Clean Price Index		0.0	-0.2

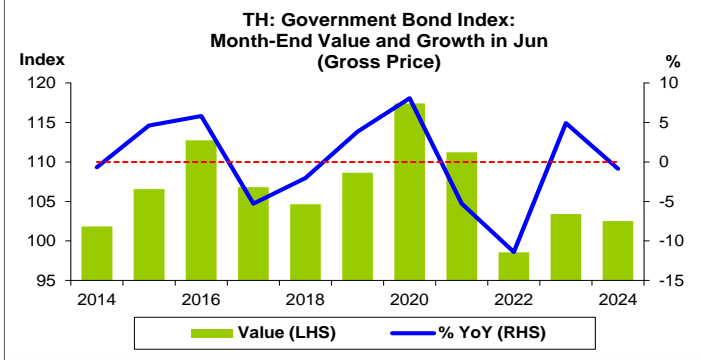
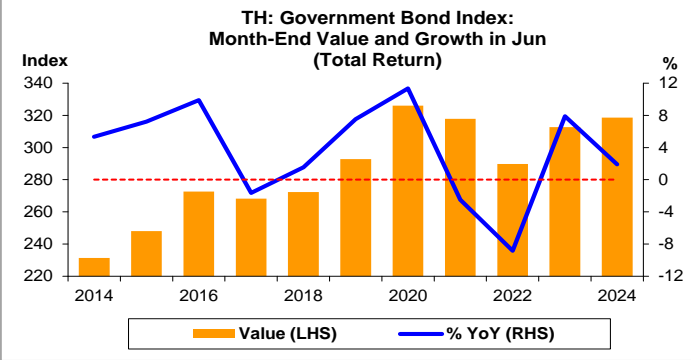
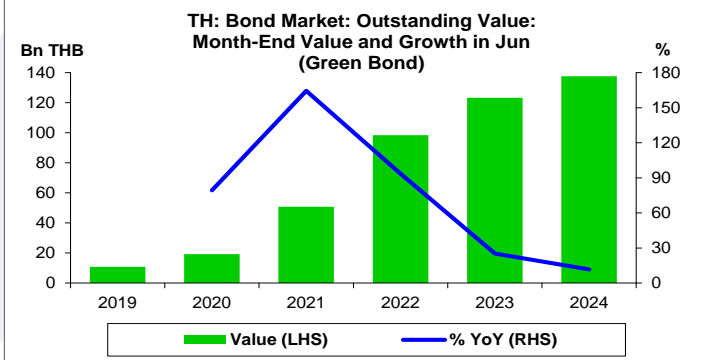
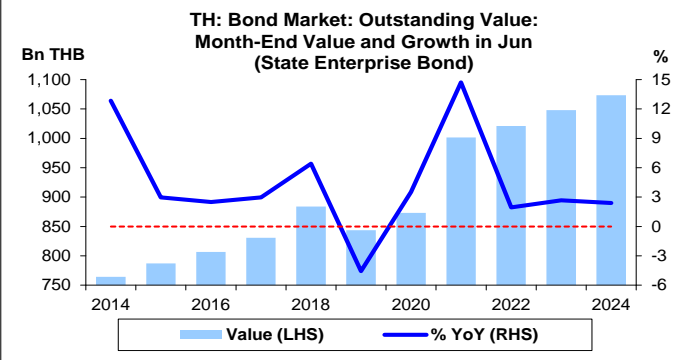
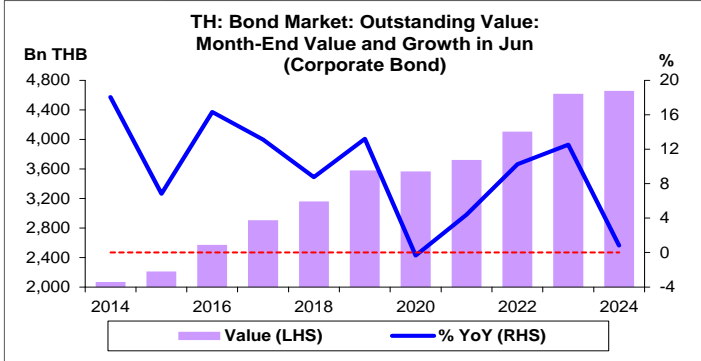
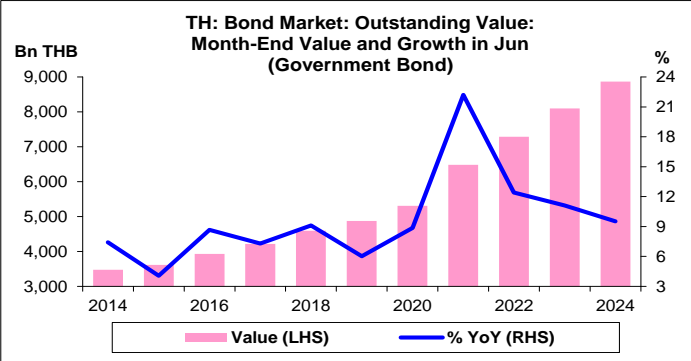
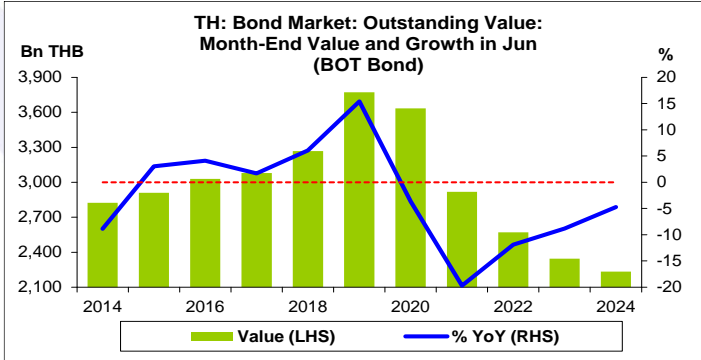
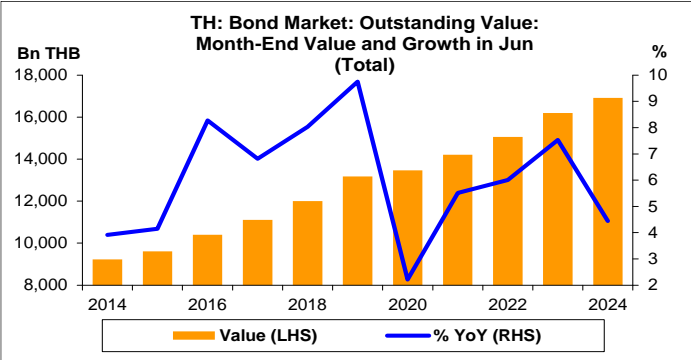
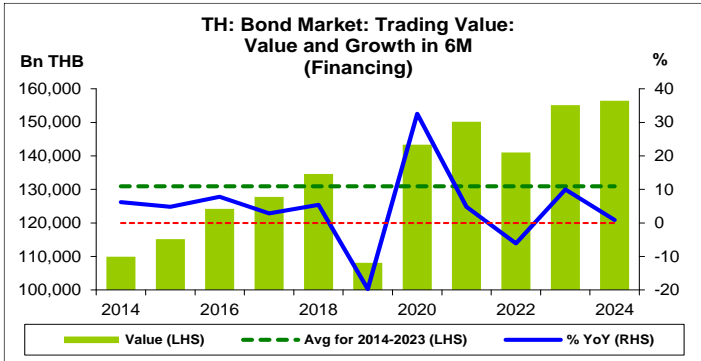
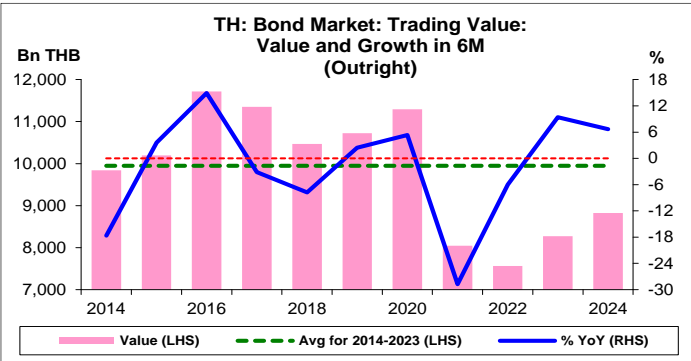


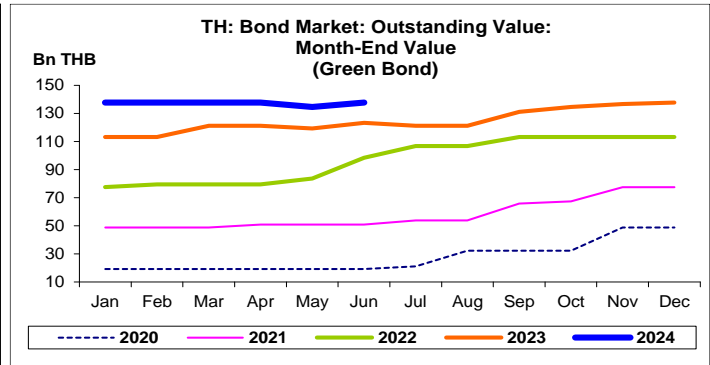
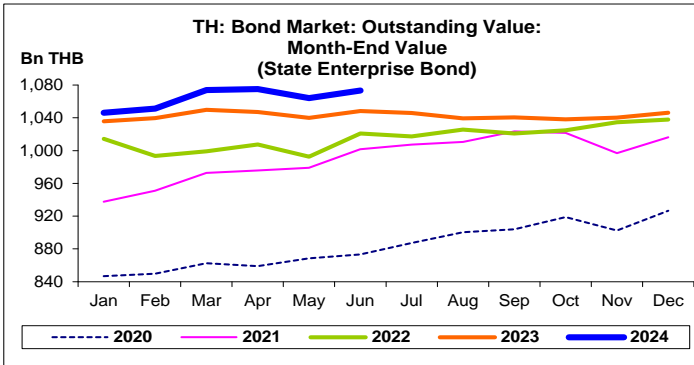
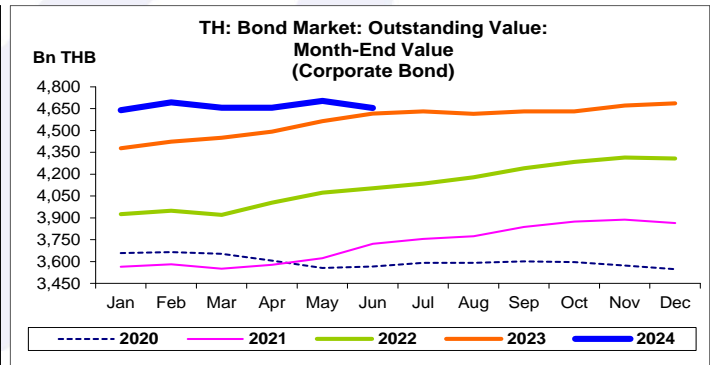
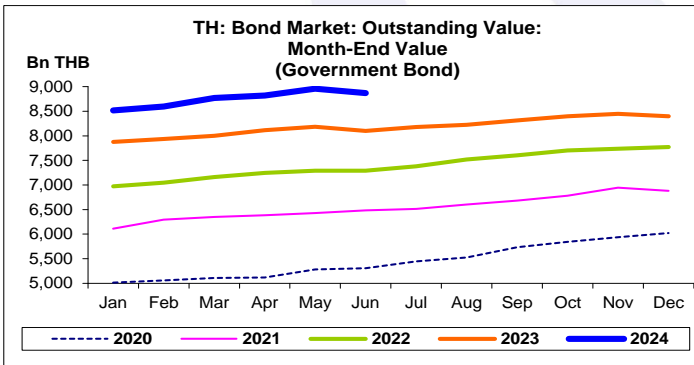
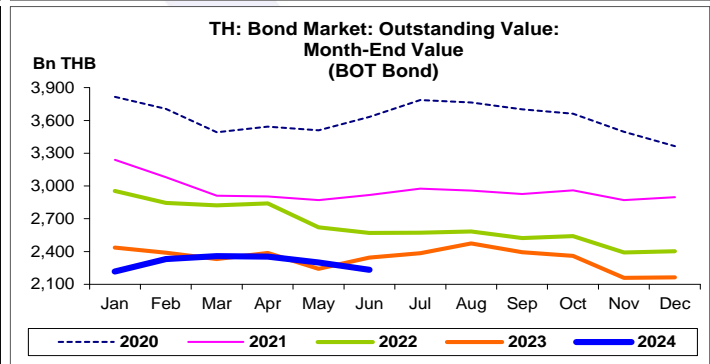
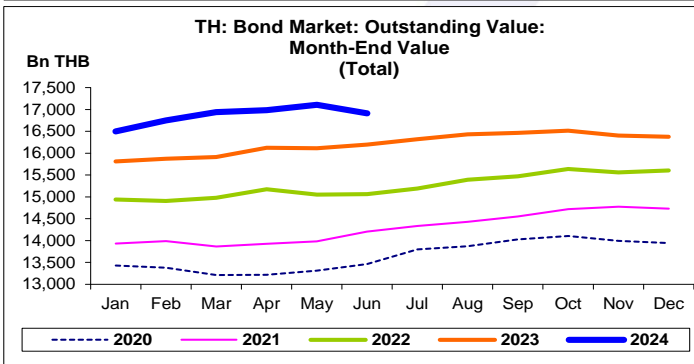
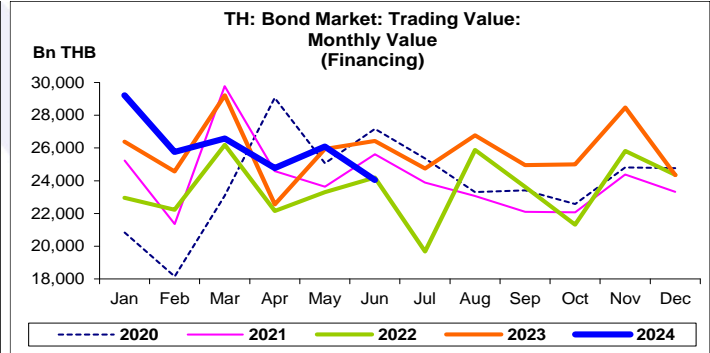
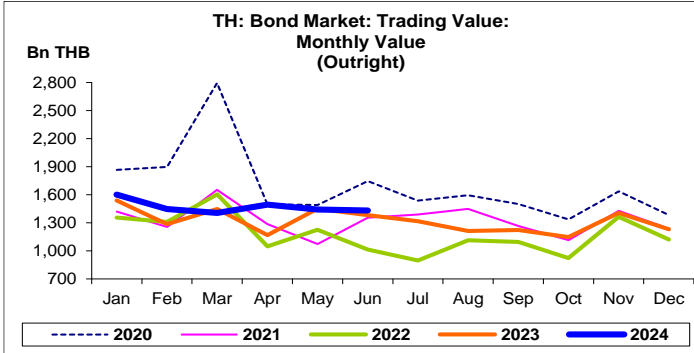
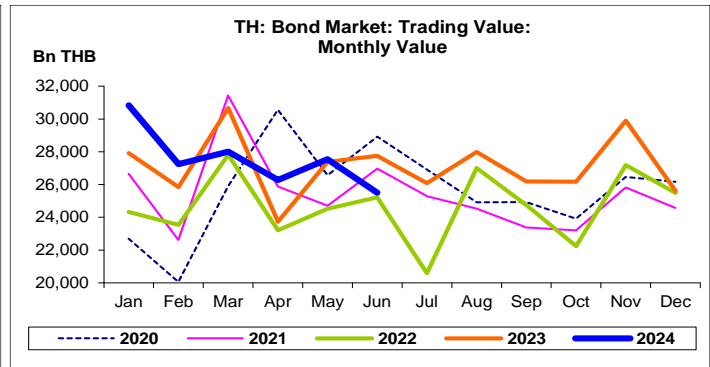
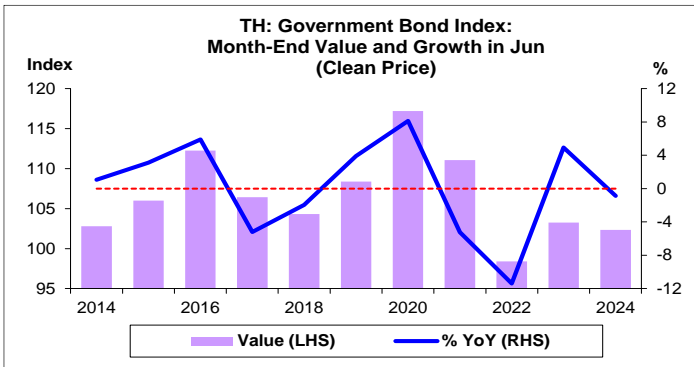
ที่มา: สมาคมตราสารหนี้ไทย

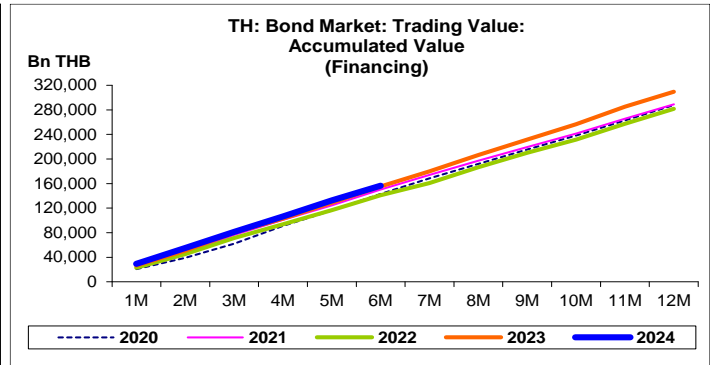
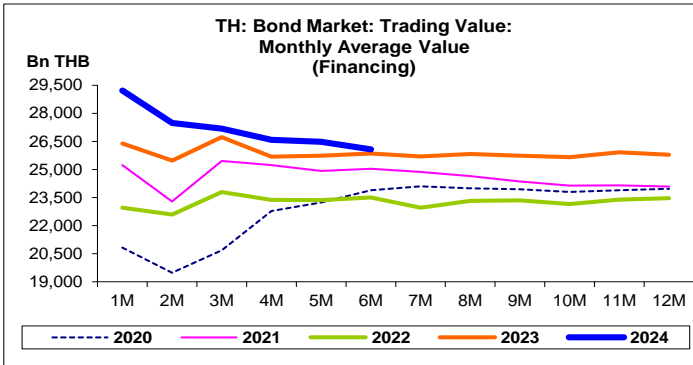
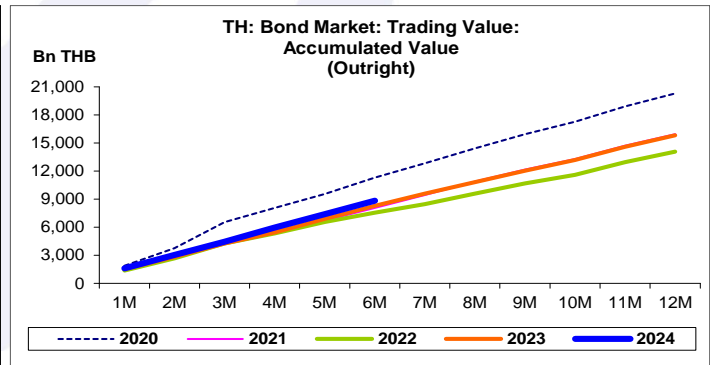
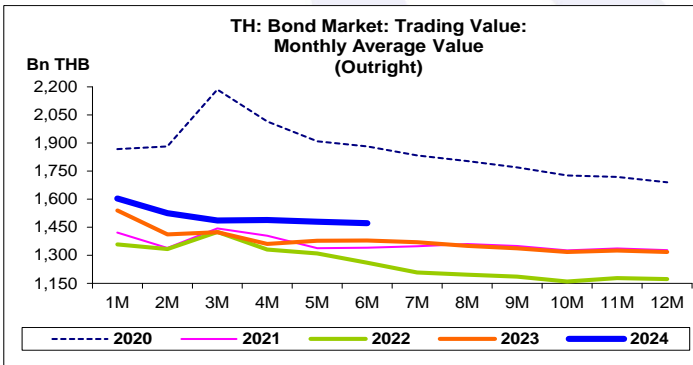
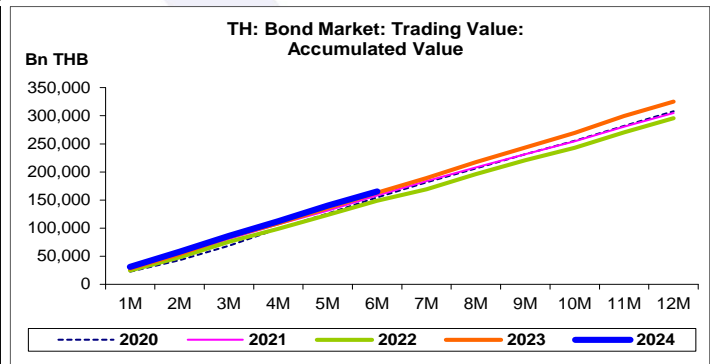
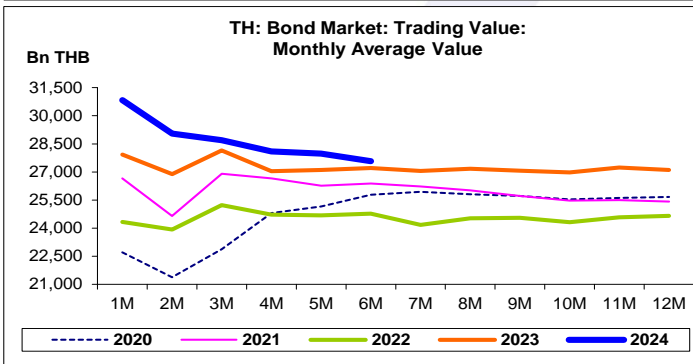
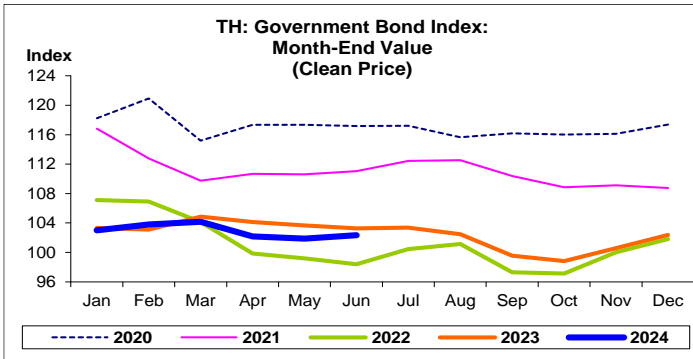
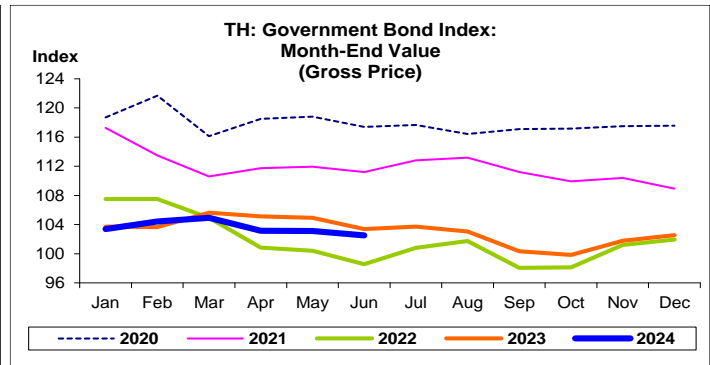
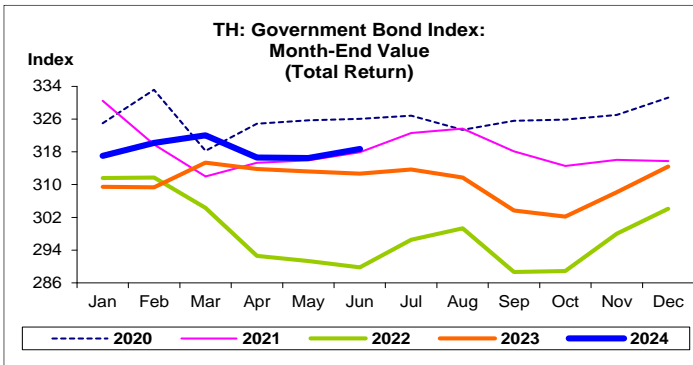
- หมายเหตุ: 1. เดือน มิ.ย. 66 พ.ค. 67 และ มิ.ย. 67 มีวันทำการเดือนละ 21 20 และ 19 วัน ตามลำดับ
 2. 6M/66 และ 6M/67 มีวันทำการ 121 และ 120 วัน ตามลำดับ
 3. มูลค่าคงค้างตราสารหนี้ตามอายุคงเหลือ 5 กลุ่ม ได้แก่ อายุคงเหลือไม่ถึง 1 ปี (0,1Y) อายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ปี และไม่ถึง 5 ปี [1Y,5Y) อายุคงเหลือตั้งแต่ 5 ปี และไม่ถึง 10 ปี [5Y,10Y) อายุคงเหลือตั้งแต่ 10 ปี และไม่ถึง 15 ปี [10Y,15Y) และอายุคงเหลือตั้งแต่ 15 ปี และถึง 50 ปี [15Y,50Y)
 4. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล เป็นอัตรา ณ ล้นเดือน
 5. CAGR คือ Compound Annual Growth Rate

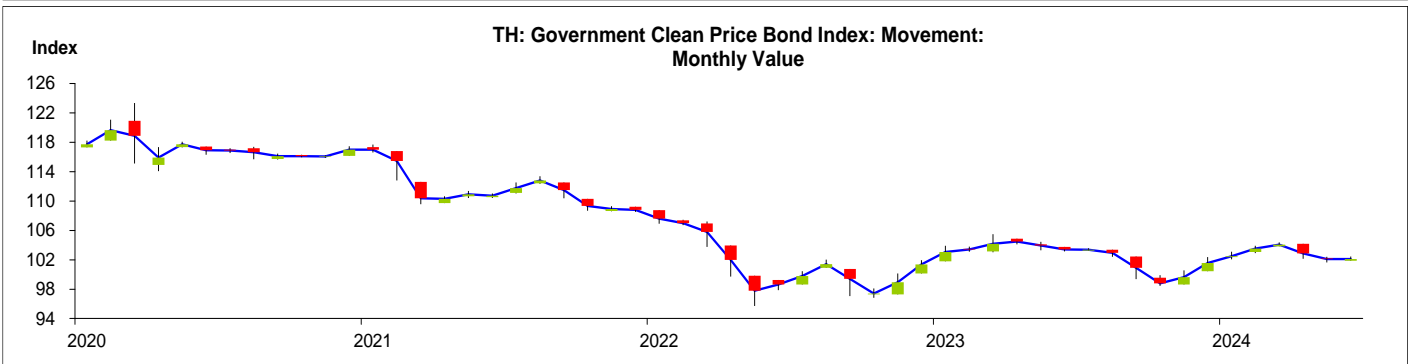
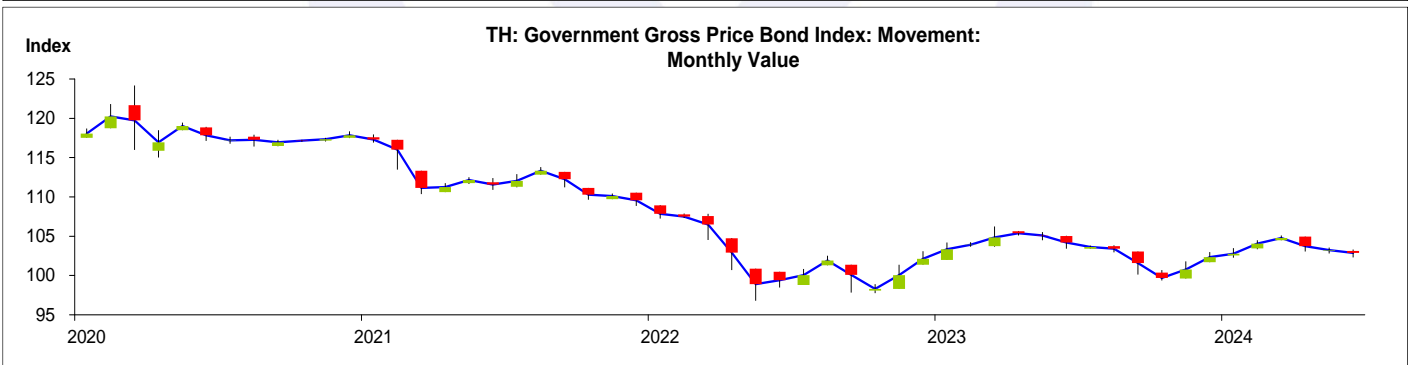
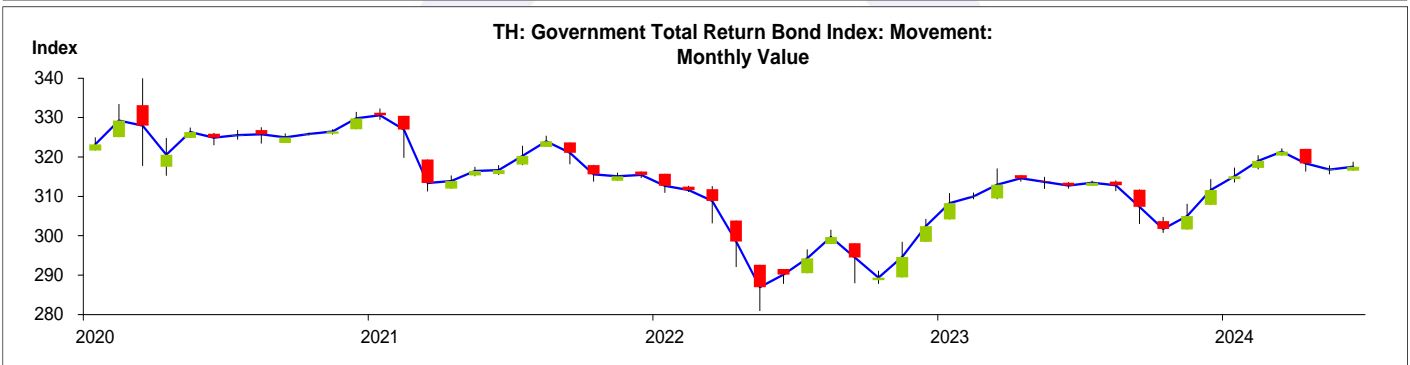
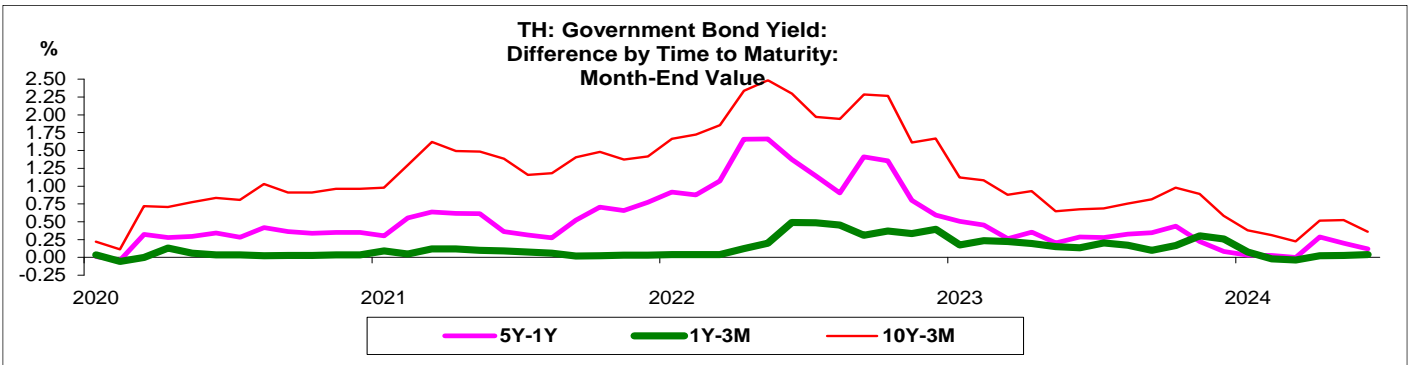
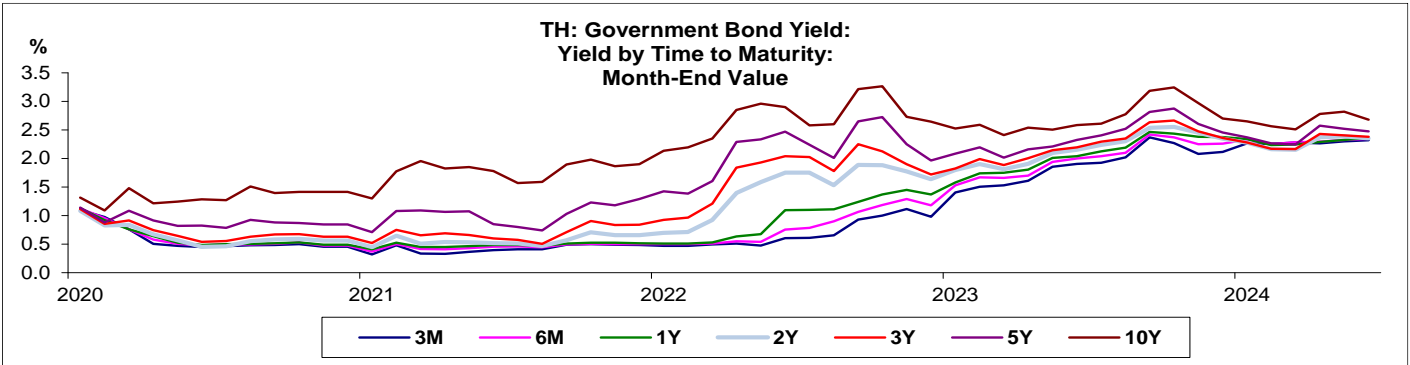












Trading Value by Transaction in Jun-24

Transaction	Monthly			Daily Average		
	Bn THB	% YoY	% MoM	Bn THB	% YoY	% MoM
Outright	1,432.3	3.6	-0.6	75.4	14.5	4.6
-Domestic Companies						
-Buy	1,370.8	5.6	-0.5	72.1	16.7	4.7
-Sell	1,360.2	5.5	-2.6	71.6	16.7	2.5
-Net	10.6					
-Foreign Companies						
-Buy	61.5	-27.6	-3.7	3.2	-20.0	1.4
-Sell	72.1	-23.7	59.4	3.8	-15.6	67.8
-Net	-10.6					
Financing	24,047.0	-9.0	-7.8	1,265.6	0.6	-3.0
-Bilateral Repo	18,371.5	-8.0	-8.8	966.9	1.7	-4.0
-Private Repo	5,664.8	-12.2	-4.6	298.1	-3.0	0.5
-Others	10.7	23.8	13.4	0.6	36.8	19.4
Others	24.5	363.0	126.3	1.3	411.8	138.2
Total	25,503.8	-8.1	-7.4	1,342.3	1.6	-2.5

Trading Value by Transaction in 6M/24

Transaction	6M/24		Daily Average	
	Bn THB	% YoY	Bn THB	% YoY
Outright	8,825.8	6.7	73.5	7.6
-Domestic Companies				
-Buy	8,438.1	10.2	70.3	11.1
-Sell	8,392.2	9.4	69.9	10.3
-Net	46.0			
-Foreign Companies				
-Buy	387.6	-37.0	3.2	-36.5
-Sell	433.6	-27.8	3.6	-27.2
-Net	-46.0			
Financing	156,475.0	0.9	1,304.0	1.7
-Bilateral Repo	119,372.6	5.1	994.8	6.0
-Private Repo	37,038.6	-10.8	308.7	-10.0
-Others	63.8	0.0	0.5	61.5
Others	125.3	189.6	1.0	192.0
Total	165,426.1	1.3	1,378.6	2.1

Outstanding Value by Issuer and Time to Maturity as of 28 Jun 2024

Issuer (Bn THB)	Time to Maturity (TTM)					Total
	TTM<1	1-5	5-10	10-15	15-50	
Government Bond	480.0	1,115.0	1,312.3	1,873.6	4,091.4	8,872.3
BOT Bond	1,768.9	464.6	0.0	0.0	0.0	2,233.5
State Enterprise Bond	0.0	83.3	366.7	326.4	297.0	1,073.5
Corporate Bond	262.0	1,910.6	1,104.1	1,071.6	306.9	4,655.2
Foreign Bond	0.0	27.2	13.2	31.8	7.0	79.2
Total	2,510.9	3,600.7	2,796.3	3,303.5	4,702.3	16,913.7

Government Bond Yield Curve (%)

Time to Maturity (TTM)	30/6/2023	31/12/2023	31/5/2024	30/6/2024			
				Rate	Change (bp)		
					YoY	MoM	YTD
1M	1.76	2.01	2.28	2.31	0.55	0.03	0.30
3M	1.90	2.11	2.30	2.32	0.41	0.02	0.20
6M	2.00	2.26	2.32	2.34	0.34	0.02	0.09
1Y	2.04	2.37	2.32	2.36	0.32	0.03	-0.02
2Y	2.15	2.34	2.38	2.35	0.20	-0.03	0.01
3Y	2.19	2.36	2.40	2.38	0.19	-0.02	0.02
4Y	2.27	2.42	2.46	2.42	0.14	-0.04	0.00
5Y	2.32	2.45	2.52	2.47	0.15	-0.05	0.02
6Y	2.40	2.51	2.59	2.52	0.12	-0.07	0.01
7Y	2.43	2.59	2.67	2.57	0.14	-0.10	-0.02
8Y	2.46	2.63	2.75	2.63	0.17	-0.12	0.00
9Y	2.50	2.67	2.80	2.67	0.17	-0.13	0.00
10Y	2.58	2.70	2.82	2.68	0.10	-0.14	-0.02
11Y	2.65	2.71	2.88	2.75	0.10	-0.13	0.04
12Y	2.71	2.73	2.97	2.85	0.13	-0.12	0.12
13Y	2.83	2.87	3.01	2.88	0.05	-0.13	0.01
14Y	2.86	2.94	3.05	2.92	0.06	-0.13	-0.01
15Y	2.88	3.01	3.08	2.98	0.09	-0.11	-0.03
16Y	2.91	3.03	3.11	3.03	0.12	-0.09	-0.01
17Y	2.94	3.06	3.15	3.08	0.14	-0.06	0.02
18Y	2.97	3.08	3.18	3.13	0.16	-0.04	0.05
19Y	3.01	3.11	3.28	3.23	0.22	-0.06	0.11
20Y	3.09	3.18	3.33	3.28	0.19	-0.05	0.10
21Y	3.14	3.27	3.37	3.33	0.18	-0.05	0.06
22Y	3.20	3.36	3.42	3.38	0.18	-0.04	0.02
23Y	3.25	3.42	3.42	3.39	0.14	-0.03	-0.03
24Y	3.26	3.45	3.41	3.40	0.14	-0.01	-0.05
25Y	3.27	3.48	3.41	3.41	0.15	0.00	-0.06
26Y	3.28	3.49	3.43	3.42	0.15	0.00	-0.07
27Y	3.28	3.49	3.45	3.43	0.15	-0.01	-0.06
28Y	3.29	3.49	3.46	3.45	0.16	-0.02	-0.05
29Y	3.30	3.50	3.50	3.46	0.16	-0.03	-0.04
30Y	3.34	3.51	3.53	3.48	0.14	-0.05	-0.03
31Y	3.38	3.53	3.57	3.50	0.12	-0.07	-0.03
32Y	3.42	3.55	3.60	3.54	0.12	-0.06	-0.01
33Y	3.46	3.60	3.64	3.58	0.12	-0.05	-0.01
34Y	3.51	3.64	3.67	3.63	0.12	-0.04	-0.02
35Y	3.55	3.69	3.70	3.67	0.12	-0.03	-0.02
36Y	3.59	3.73	3.74	3.72	0.13	-0.02	-0.02
37Y	3.63	3.78	3.77	3.76	0.13	-0.01	-0.02
38Y	3.67	3.80	3.78	3.76	0.09	-0.01	-0.04
39Y	3.68	3.80	3.78	3.77	0.09	-0.01	-0.03
40Y	3.68	3.80	3.79	3.78	0.09	-0.01	-0.03
41Y	3.69	3.80	3.79	3.78	0.09	-0.01	-0.02
42Y	3.69	3.80	3.80	3.79	0.10	-0.01	-0.01
43Y	3.70	3.82	3.81	3.84	0.14	0.03	0.02
44Y	3.70	3.84	3.82	3.85	0.15	0.03	0.00
45Y	3.70	3.85	3.83	3.85	0.15	0.03	0.01
46Y	3.71	3.85	3.83	3.86	0.15	0.03	0.01
47Y	3.71	3.85	3.84	3.87	0.16	0.03	0.02
48Y	3.72	3.85	3.85	3.88	0.16	0.03	0.02
49Y	3.72	4.27	-	-	-	-	-

TH Bond Indexes as of 28 Jun 2024

	Index	Change			
		From 31 Dec 2023 (Point)	% YoY	% MoM	% YTD
Bond Composite Index					
Total Return Index	208.02	9.31	2.5	0.6	1.5
Gross Price Index	105.31	0.23	-0.5	-0.3	0.0
Clean Price Index	104.96	0.23	-0.5	0.4	0.0
Average Yield (%)	3.16	0.05			
Government Bond Index					
Total Return Index	318.67	14.57	1.9	0.7	1.4
Gross Price Index	102.52	0.57	-0.8	-0.6	-0.03
Clean Price Index	102.35	0.55	-0.9	0.5	-0.04
Average Yield (%)	3.09	0.02			
MTM Corporate Bond A- Index					
Total Return Index	214.47	10.13	3.8	0.5	2.0
Gross Price Index	106.48	-0.07	0.4	0.3	0.3
Clean Price Index	105.81	-0.06	0.5	0.3	0.3
Average Yield (%)	3.50	0.17			

ตราสารหนี้:

จุดสูงสุดและต่ำสุดในแต่ละช่วงเวลา ในระยะเวลา 11 ปี (ปี 2557-67)

Bn THB	ค่าปัจจุบัน	% ค่าสูงสุด	% ค่าต่ำสุด	ค่าสูงสุด	Date	ค่าต่ำสุด	Date
มูลค่าซื้อขาย							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
มี.ย. 67	25,503.8	-18.8	44.0	31,427.4	มี.ค. 64	17,708.0	ก.พ. 62
Q2/67	79,334.4	-7.8	37.6	86,091.7	Q1/67	57,649.7	Q3/58
2566	325,224.1	-	36.2	325,224.1	2566	238,710.4	2562
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
มี.ย. 67	25,503.8	-11.8	34.6	28,908.1	มี.ย. 63	18,954.3	มี.ย. 58
6M/67	165,426.1	-	39.3	165,426.1	6M/67	118,795.5	6M/62
Q2/67	79,334.4	-7.8	36.7	86,037.0	Q2/63	58,037.3	Q2/57
มูลค่าตราสารหนี้							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
มี.ย. 67	16,913.7	-1.1	88.3	17,104.6	พ.ค. 67	8,980.2	ม.ค. 57
Q2/67	16,913.7	-0.1	84.3	16,938.9	Q1/67	9,177.5	Q1/57
2566	16,377.7	-	76.3	16,377.7	2566	9,287.3	2557
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
มี.ย. 67	16,913.7	-	83.4	16,913.7	มี.ย. 67	9,222.7	มี.ย. 57
Q2/67	16,913.7	-	83.4	16,913.7	Q2/67	9,222.7	Q2/57

ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ณ วันที่ 28 มิ.ย. 67:
จุดสูงสุดและต่ำสุดในแต่ละช่วงเวลา ในระยะเวลา 11 ปี (ปี 2557-67)

Index	ค่าปัจจุบัน	% ค่าสูงสุด	% ค่าต่ำสุด	ค่าสูงสุด	Date	ค่าต่ำสุด	Date
Total Return Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
มิ.ย. 67	318.67	-4.3	41.8	333.12	ก.พ. 63	224.77	ม.ค. 57
Q2/67	318.67	-3.8	39.1	331.23	Q4/63	229.02	Q2/57
2566	314.39	-5.1	28.3	331.23	2563	244.96	2557
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
มิ.ย. 67	318.67	-2.3	37.7	326.04	มิ.ย. 63	231.42	มิ.ย. 57
Q2/67	318.67	-2.3	37.7	326.04	Q2/63	231.42	Q2/67
Gross Price Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
มิ.ย. 67	102.52	-15.7	4.5	121.68	ก.พ. 63	98.07	ก.ย. 65
Q2/67	102.52	-14.4	4.5	119.78	Q3/62	98.07	Q3/65
2566	102.55	-12.8	0.6	117.58	2563	101.96	2565
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
มิ.ย. 67	102.52	-12.7	4.0	117.41	มิ.ย. 63	98.56	มิ.ย. 65
Q2/67	102.52	-12.7	4.0	117.41	Q2/63	98.56	Q2/67
Clean Price Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
มิ.ย. 67	102.35	-15.4	5.4	120.92	ก.พ. 63	97.14	ต.ค. 65
Q2/67	102.35	-13.9	5.2	118.83	Q3/62	97.30	Q3/65
2566	102.38	-12.8	0.6	117.37	2563	101.80	2565
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
มิ.ย. 67	102.35	-12.7	4.0	117.20	มิ.ย. 63	98.40	มิ.ย. 65
Q2/67	102.35	-12.7	4.0	117.20	Q2/63	98.40	Q2/67