



ภาวะตลาดตราสารหนี้ของไทย เดือน มิ.ย. 2565

- การซื้อขายตราสารหนี้ เดือน มิ.ย. 65 มูลค่า 25,189.6 Bn THB ลดลง 6.6% YoY แต่เพิ่มขึ้น 2.7% MoM โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,199.5 Bn THB/D ลดลง 6.6% YoY และ 7.0% MoM หากพิจารณา 6M/65 มูลค่า 148,515.2 Bn THB ลดลง 6.1% YoY โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,248.0 Bn THB/D ลดลง 6.9% YoY
- ตราสารหนี้ เดือน มิ.ย. 65 มูลค่า 15,059.8 Bn THB เพิ่มขึ้น 6.0% YoY 0.1% MoM และ 8.0% YTD โดยพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตรรัฐบาล ตราสารหนี้ภาคเอกชน และพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ คิดเป็น 17.1% 48.4% 27.1% และ 6.8% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ ส่วนมูลค่าตราสารหนี้อายุคงเหลือ (0,1Y), [1Y,5Y], [5Y,10Y], [10Y,15Y] และ [15Y,50Y] คิดเป็น 16.4% 21.6% 16.4% 18.0% และ 27.6% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ
- อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล เดือน มิ.ย. 65 อายุคงเหลือ 3M 6M 1Y 3Y 5Y และ 10Y อยู่ที่ 0.60% 0.75% 1.09% 2.04% 2.47% และ 2.90% ตามลำดับ
- ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล เดือน มิ.ย. 65 เมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปีก่อน และเดือนก่อน ลดลงทุกประเภท

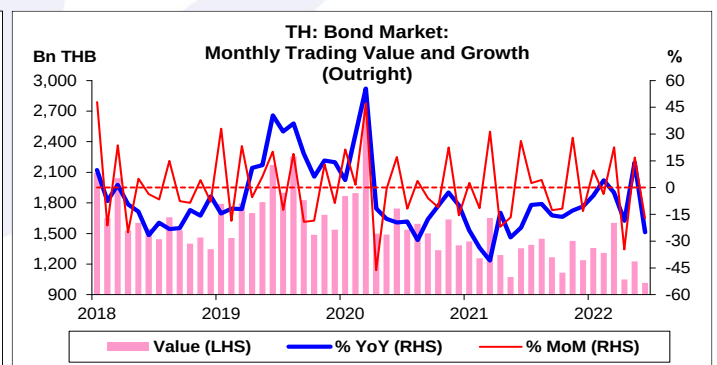
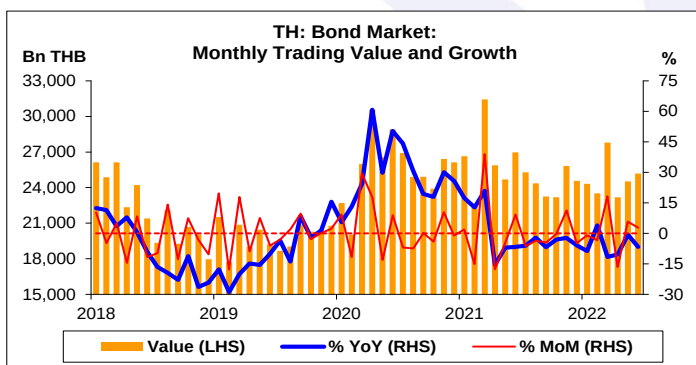
การประเมินอันดับค่า อิงค่าต่ำสุด ค่าเฉลี่ย และค่าสูงสุด (ปี 2555-65)

	All Periods			Same Periods			Latest
	Month	Quarter	Year	YTD	Quarter	Month	
Bond							
Trading Value	4	4	5	4	4	4	Jun-22
Outstanding	5	5	5	-	5	5	Jun-22
Government Bond							
Total Return Index	4	4	5	-	4	4	Jun-22
Gross Price Index	1	1	3	-	1	1	Jun-22
Clean Price Index	1	1	3	-	1	1	Jun-22

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

อัตราการเปลี่ยนแปลงรายปี (ปี 2555-64)

	%	Average YoY Growth	CAGR
Bond			
Trading Value		7.9	7.1
Outstanding		7.6	7.5
Government Bond			
Total Return Index		5.6	5.5
Gross Price Index		1.2	1.1
Clean Price Index		1.3	1.2



ที่มา: สมาคมตราสารหนี้ไทย

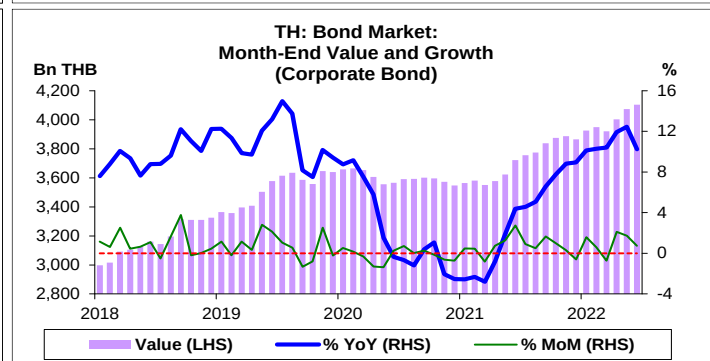
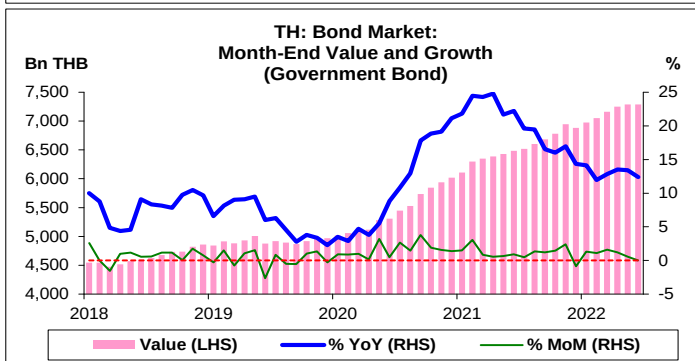
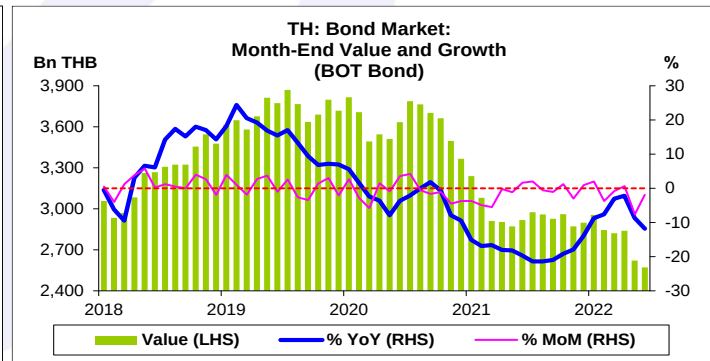
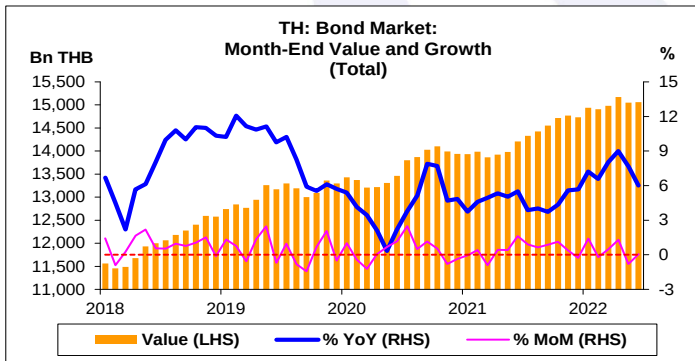
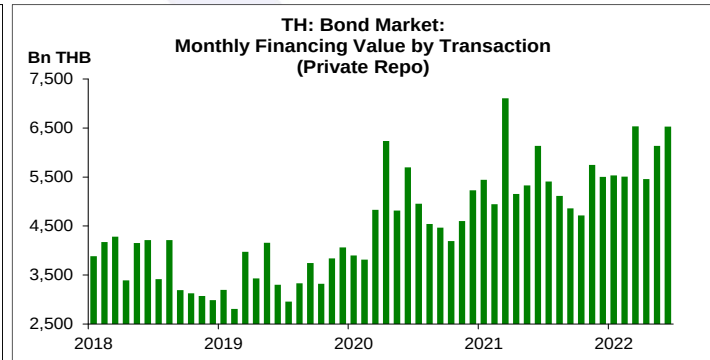
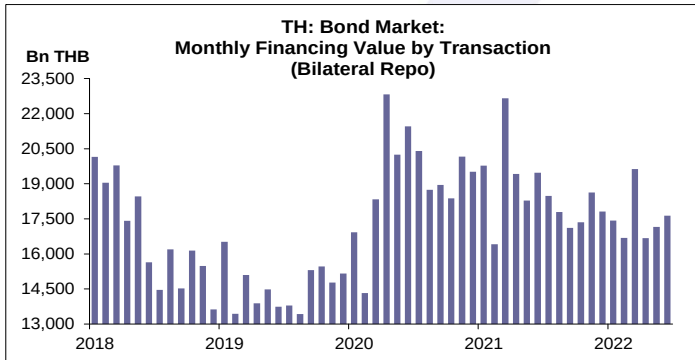
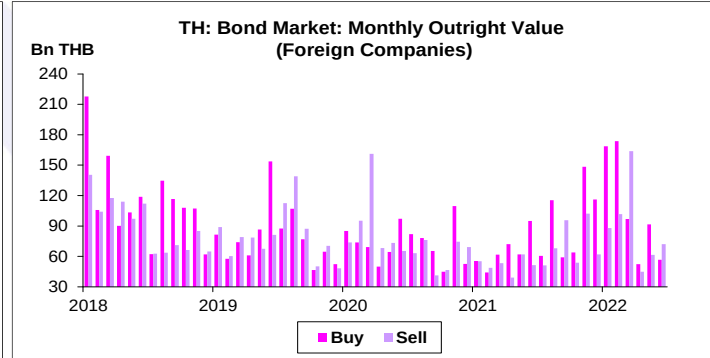
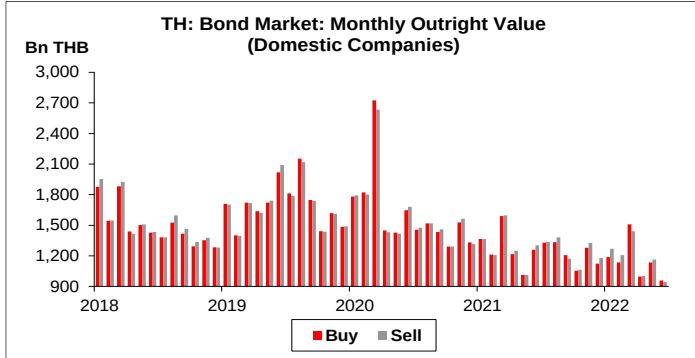
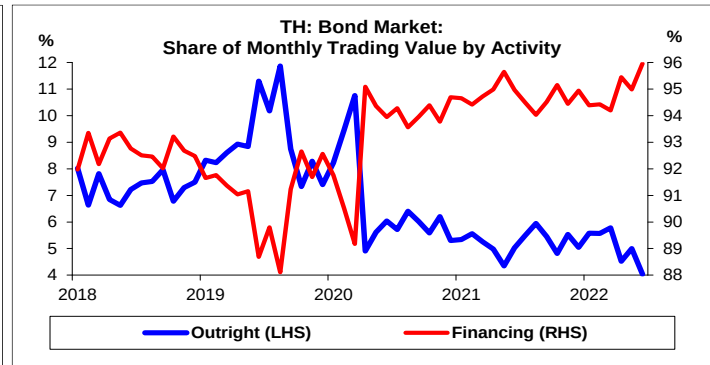
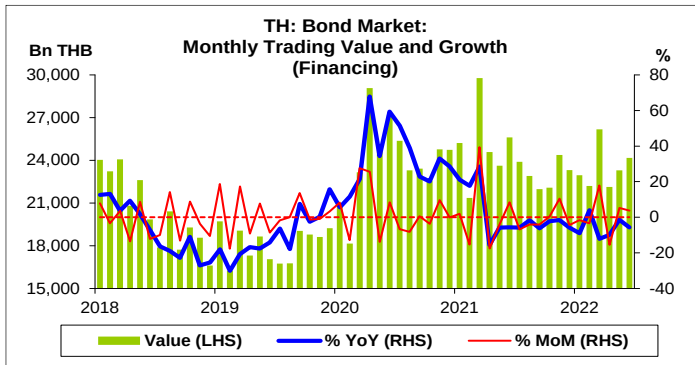
หมายเหตุ: 1. เดือน มิ.ย. 64 พ.ค. 65 และ มิ.ย. 65 มีวันทำการเดือนละ 21 วัน และ 21 วัน ตามลำดับ

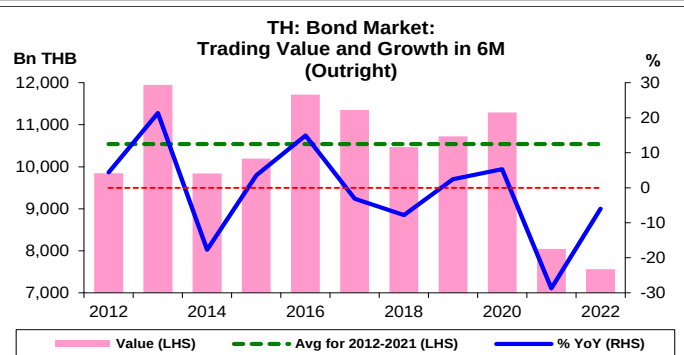
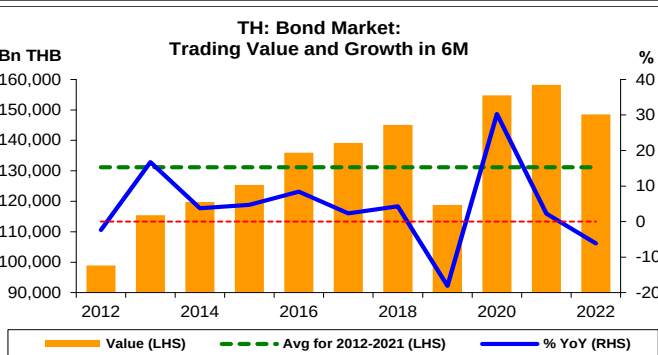
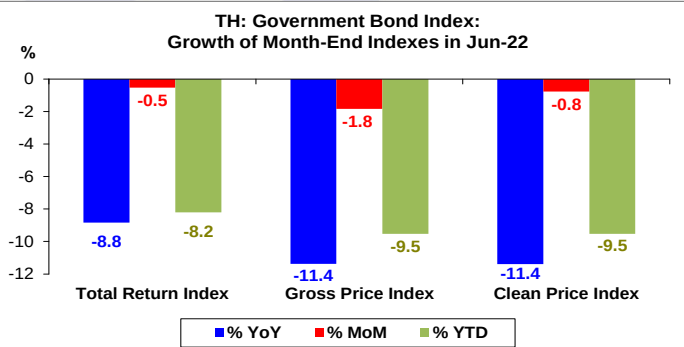
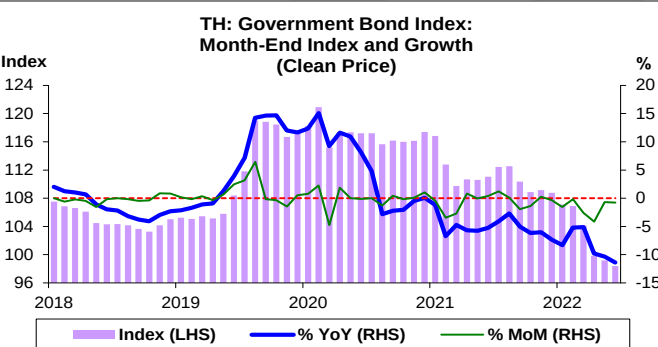
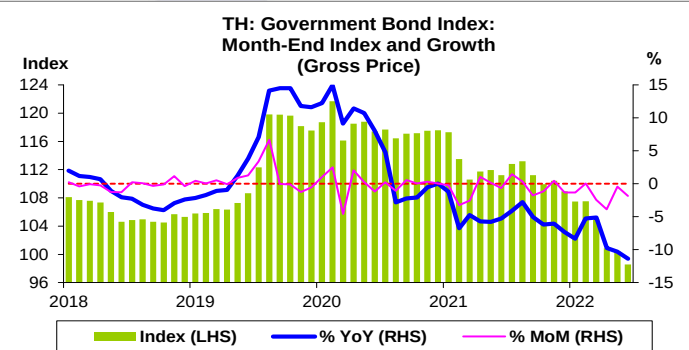
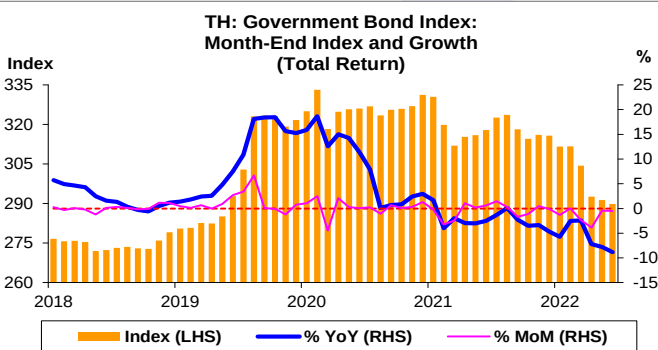
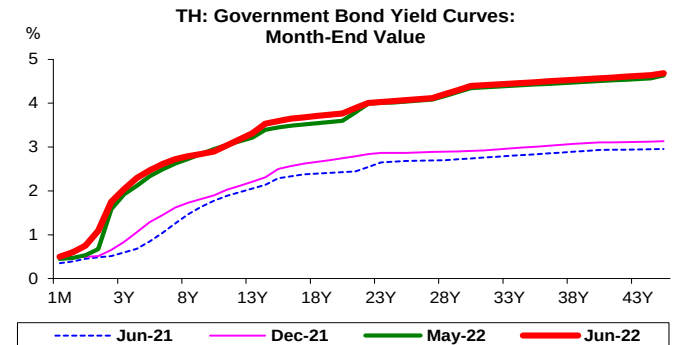
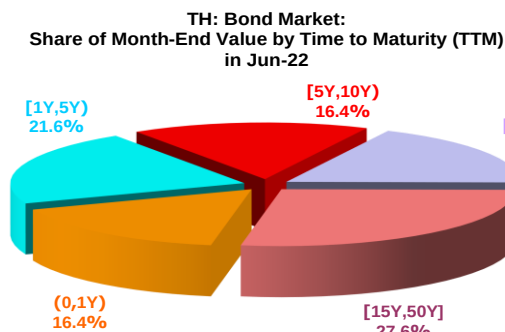
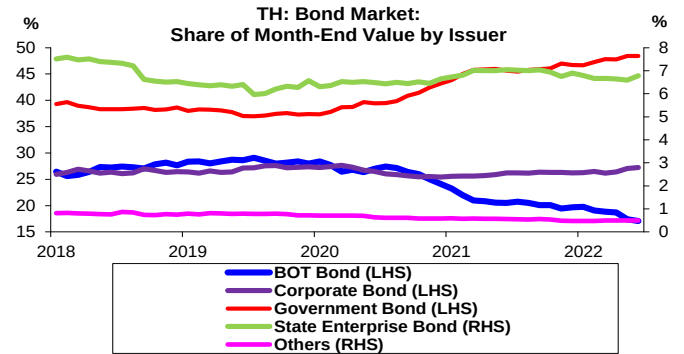
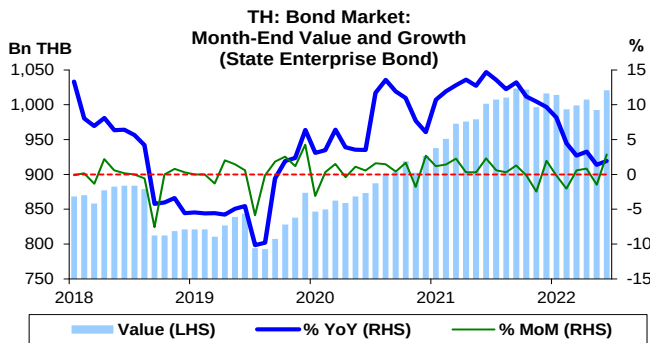
2. 6M/64 และ 6M/65 มีวันทำการ 118 และ 119 วัน ตามลำดับ

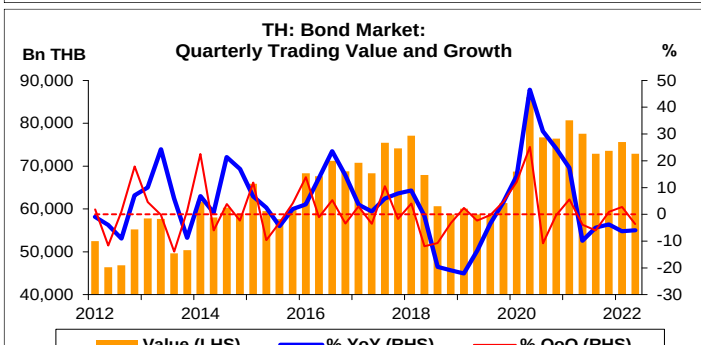
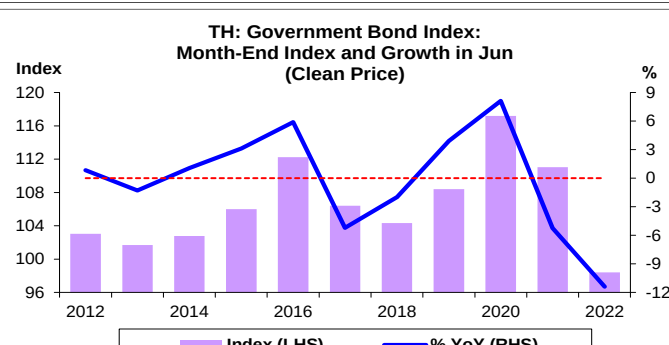
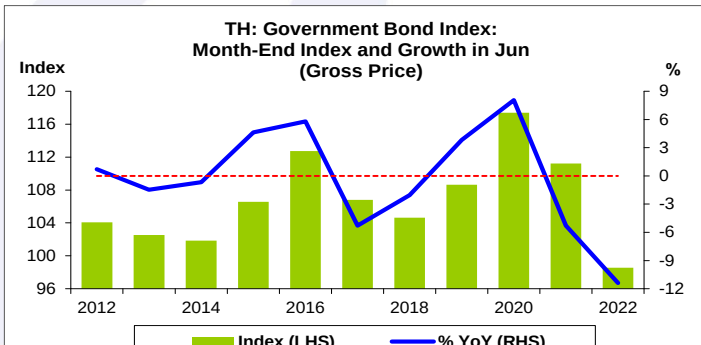
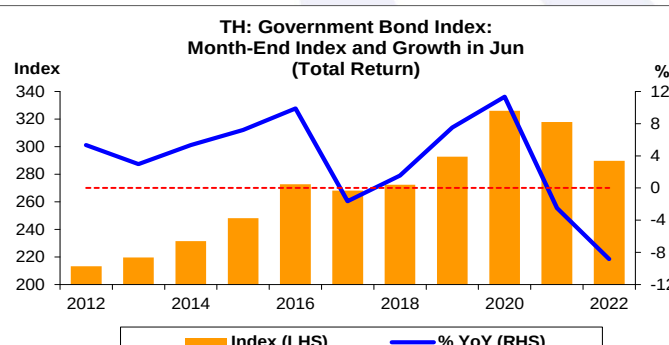
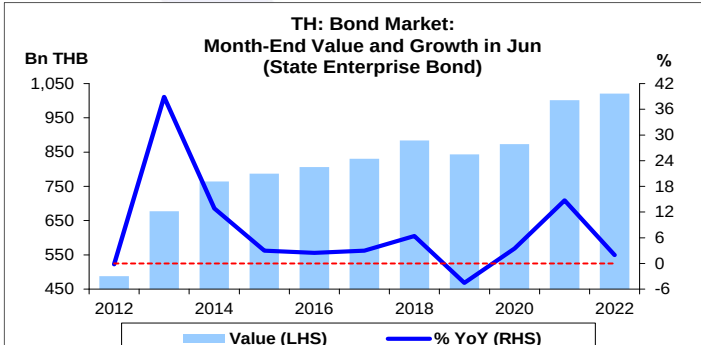
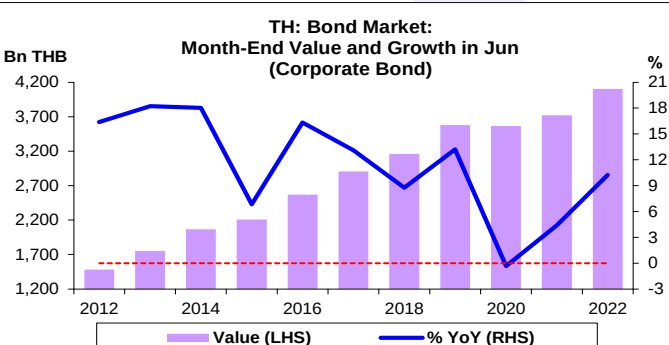
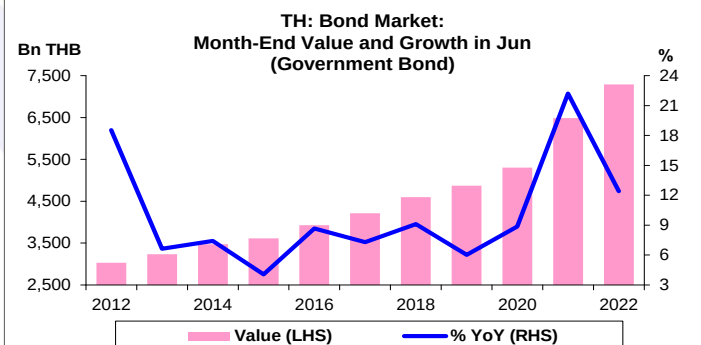
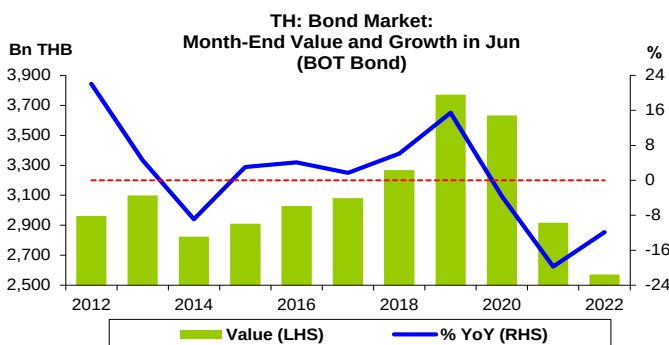
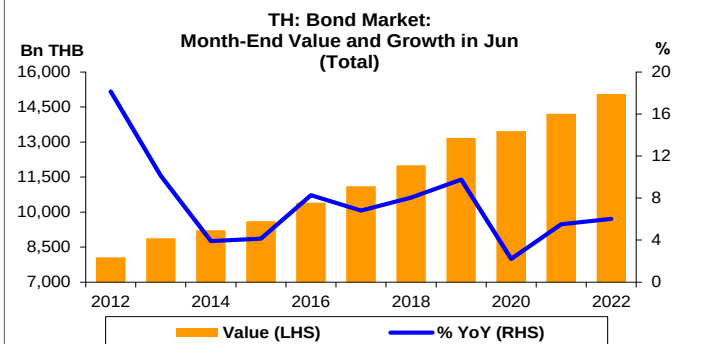
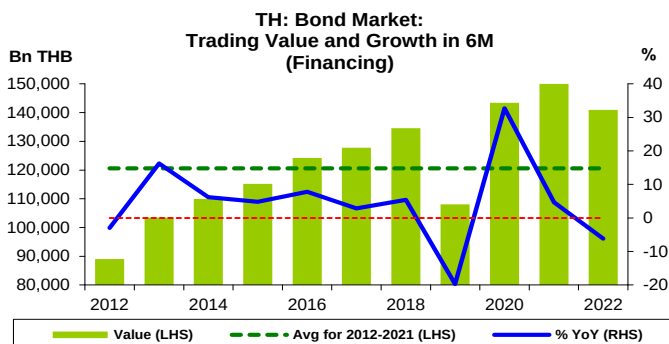
3. มูลค่าค้างตราสารหนี้ตามอายุคงเหลือ 5 กลุ่ม ได้แก่ อายุคงเหลือไม่ถึง 1 ปี (0,1Y) อายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ปี และไม่ถึง 5 ปี [1Y,5Y] อายุคงเหลือตั้งแต่ 5 ปี และไม่ถึง 10 ปี [5Y,10Y] อายุคงเหลือตั้งแต่ 10 ปี และไม่ถึง 15 ปี [10Y,15Y] และอายุคงเหลือตั้งแต่ 15 ปี และถึง 50 ปี [15Y,50Y]

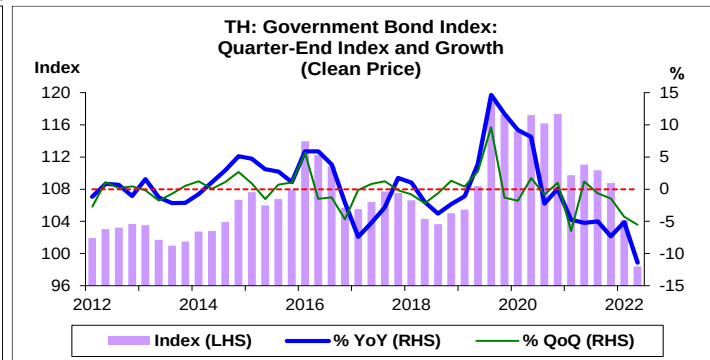
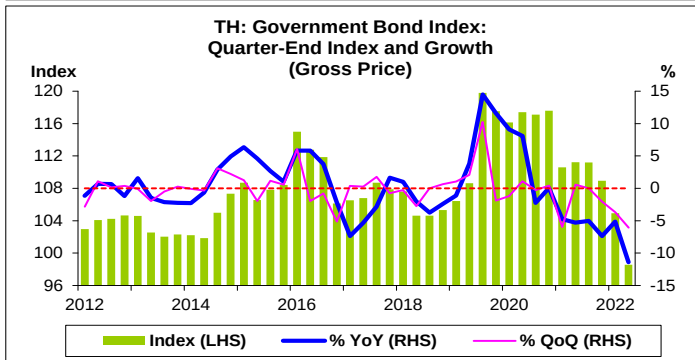
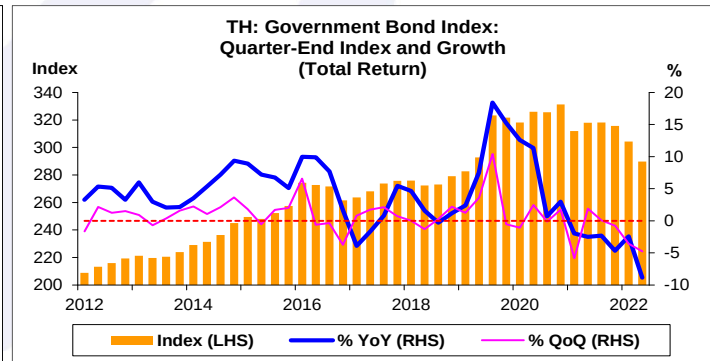
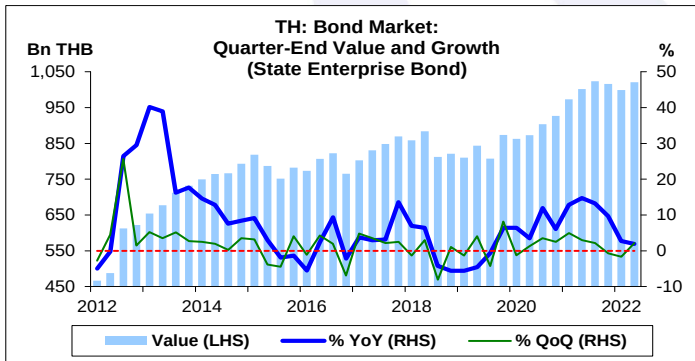
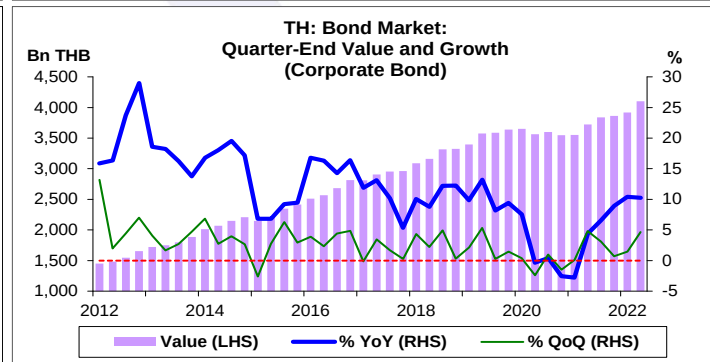
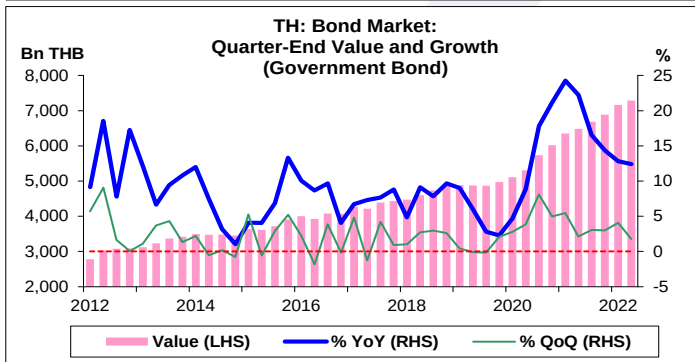
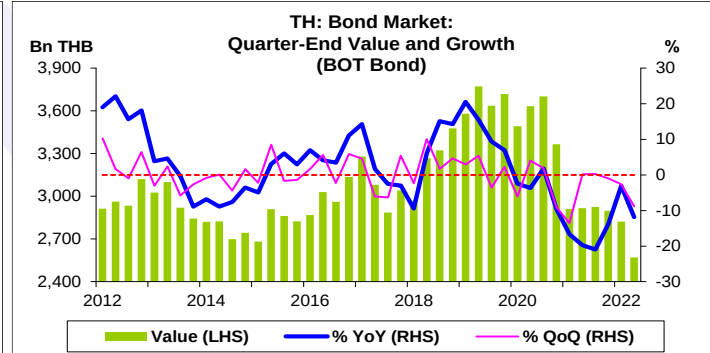
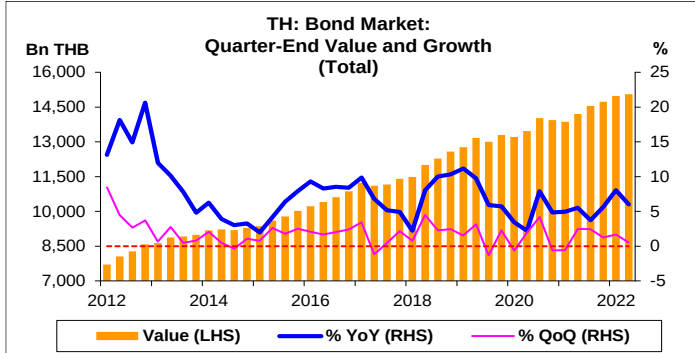
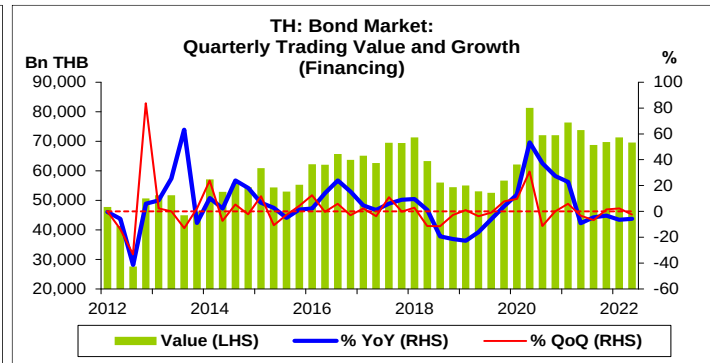
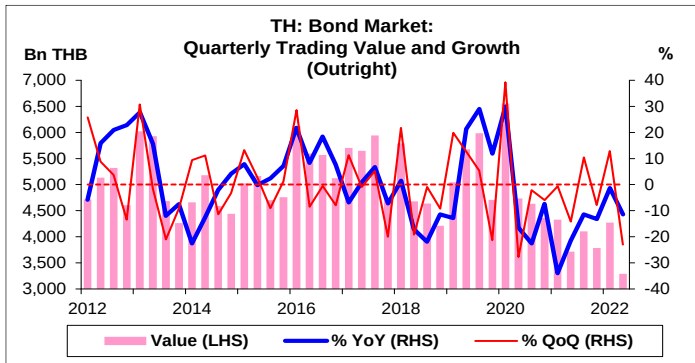
4. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล เป็นอัตรา ณ สิ้นเดือน

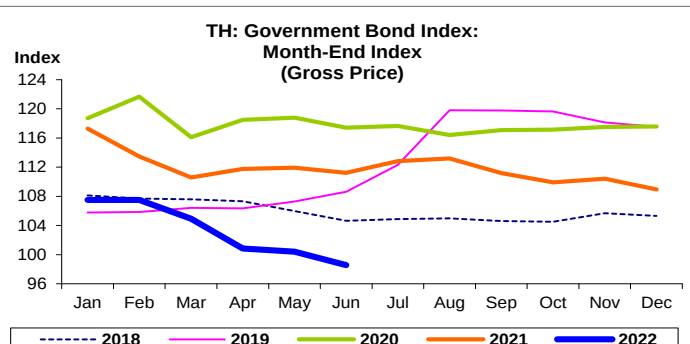
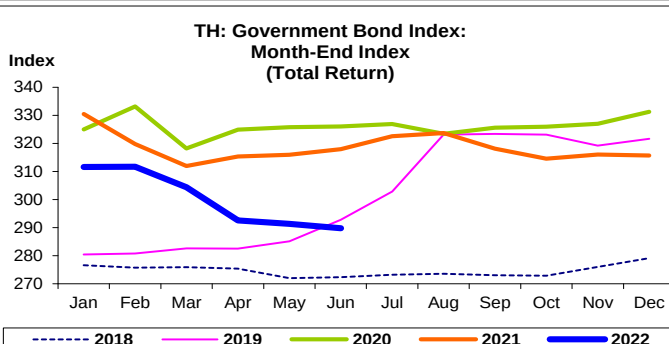
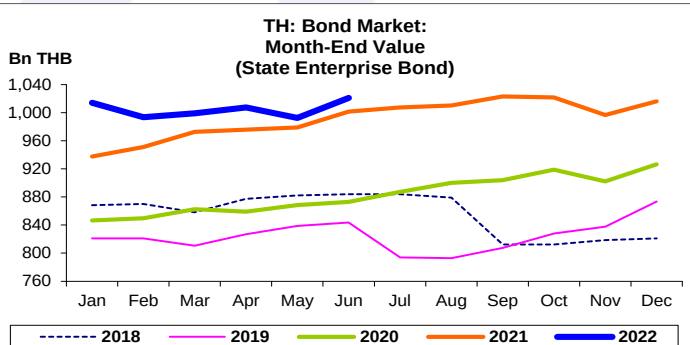
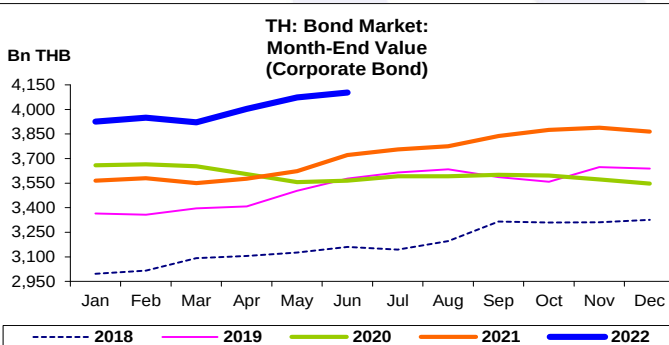
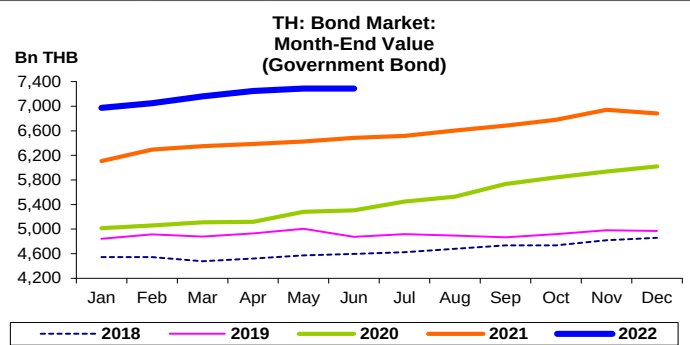
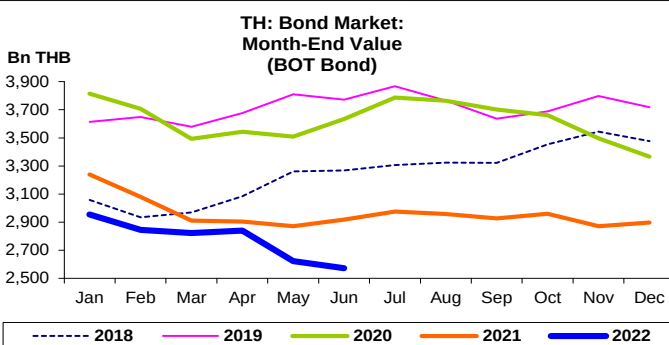
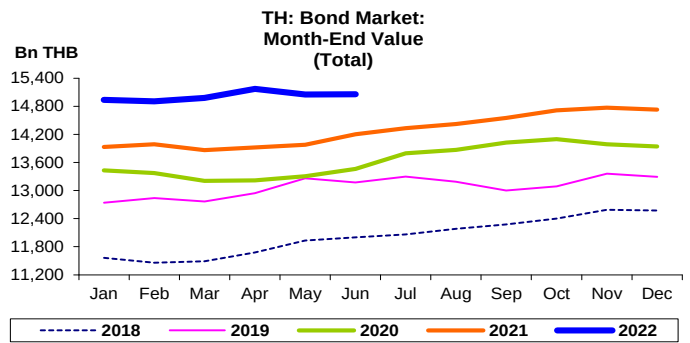
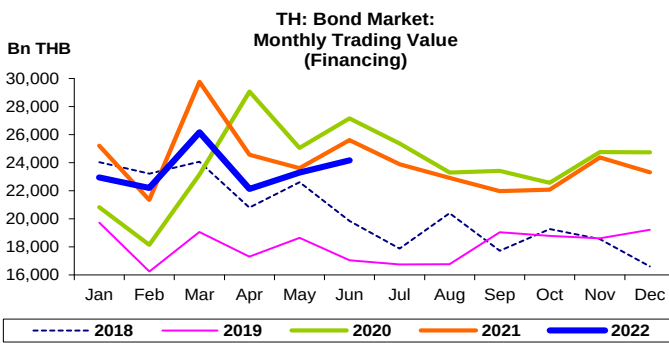
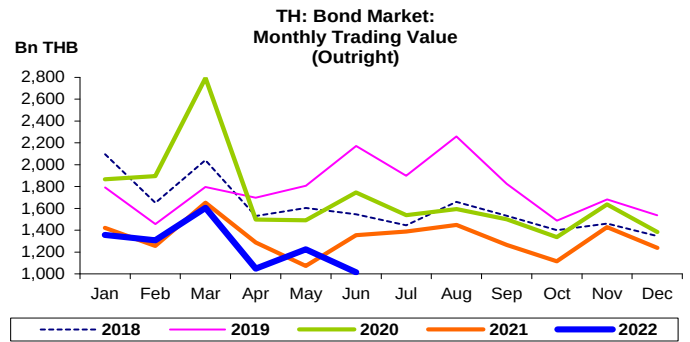
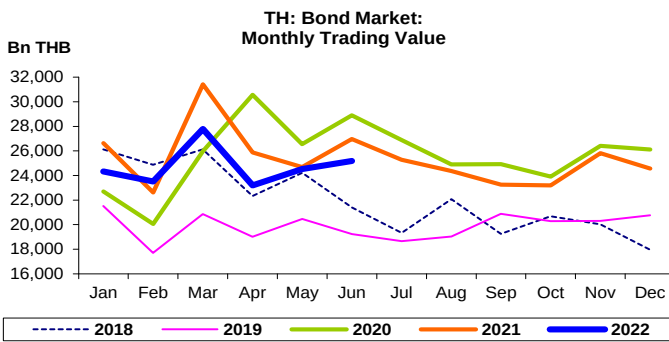
5. CAGR คือ Compound Annual Growth Rate

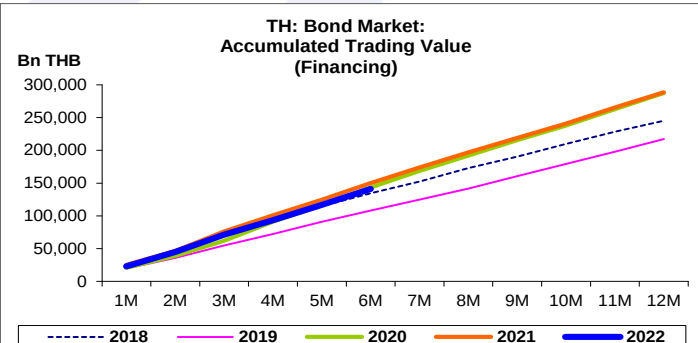
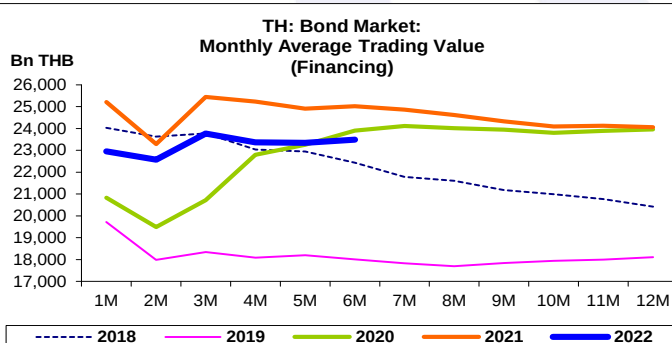
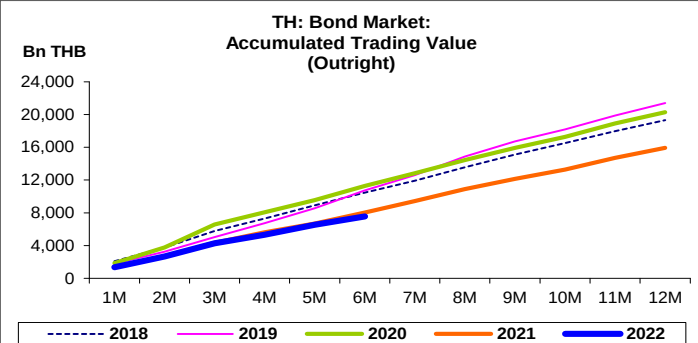
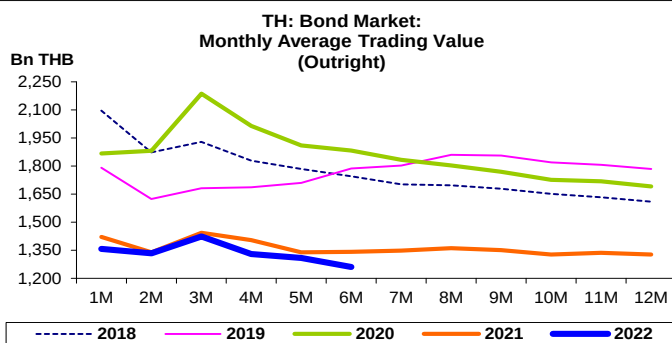
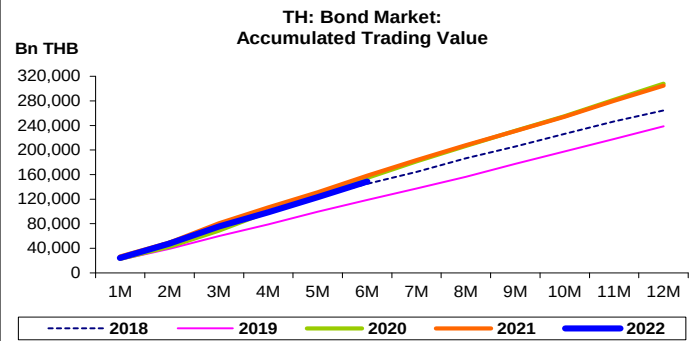
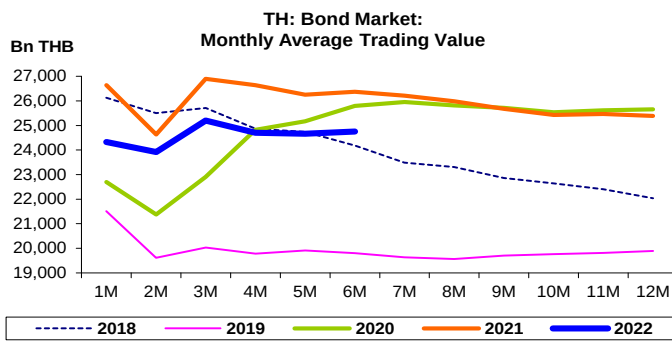
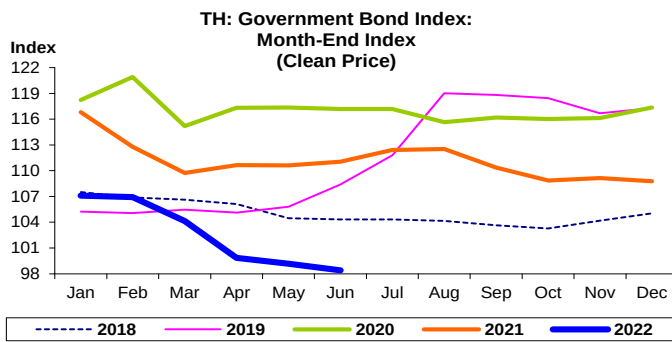






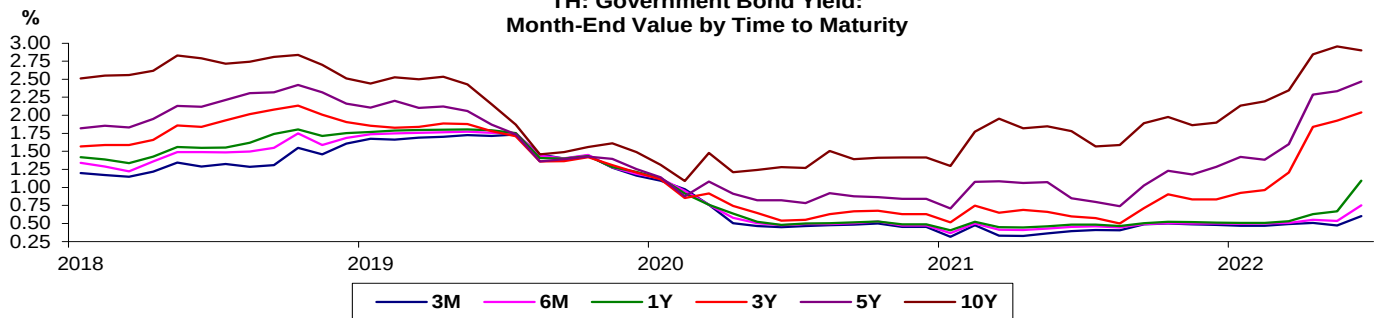




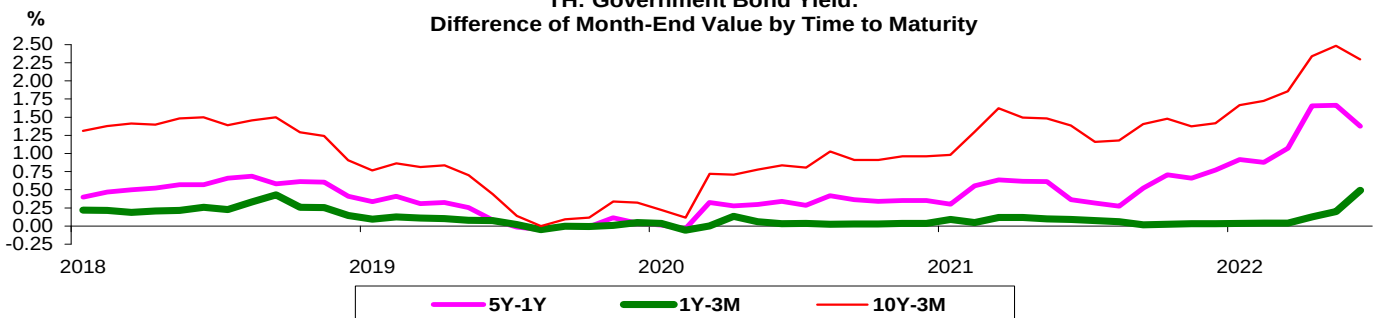




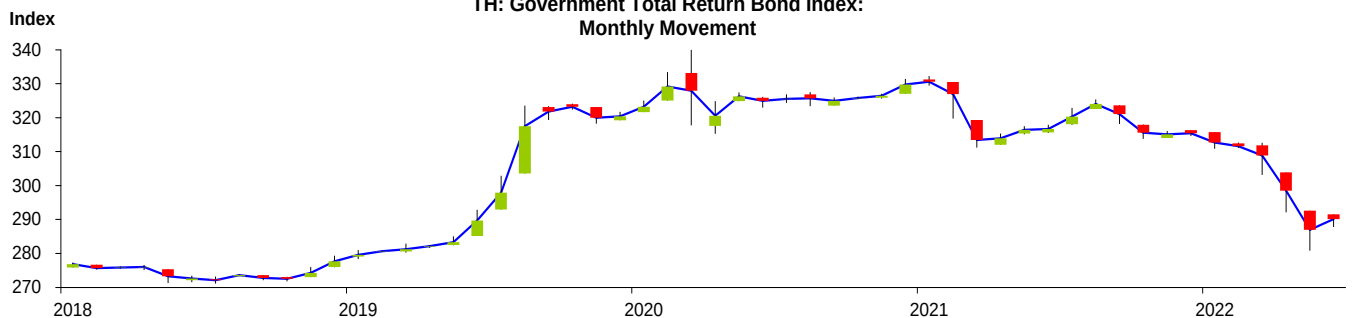
**TH: Government Bond Yield:
Month-End Value by Time to Maturity**



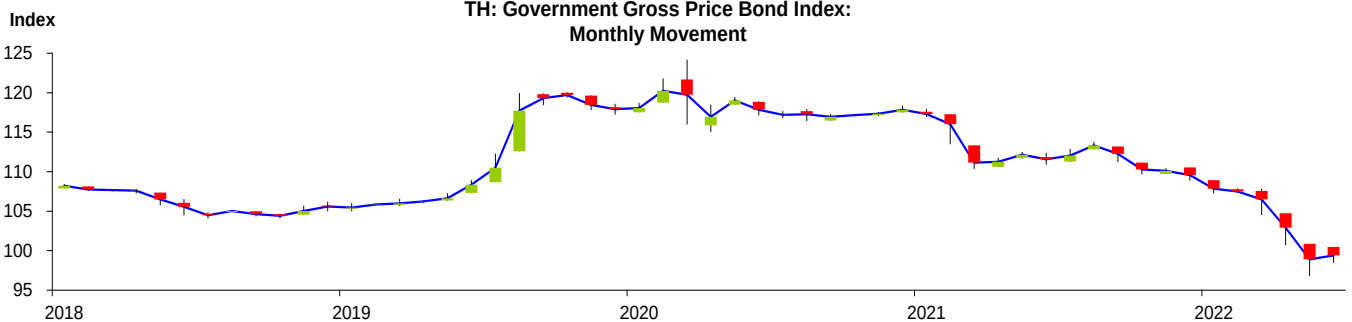
**TH: Government Bond Yield:
Difference of Month-End Value by Time to Maturity**



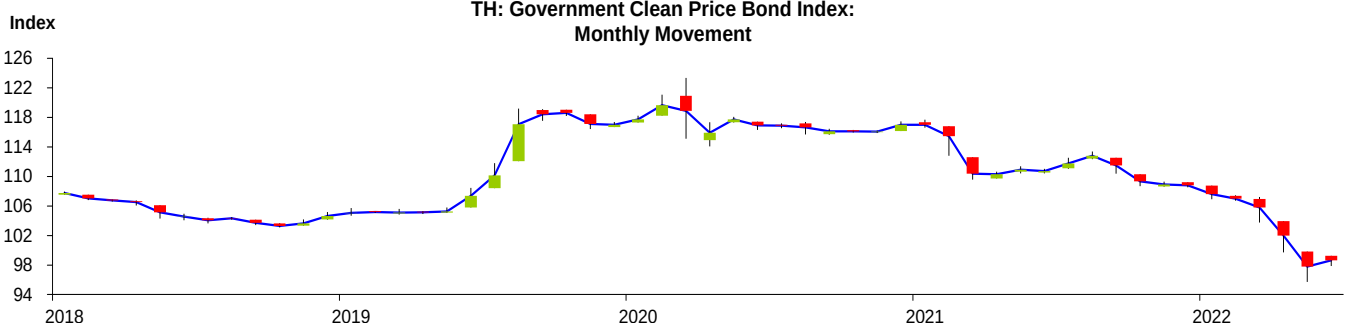
**TH: Government Total Return Bond Index:
Monthly Movement**



**TH: Government Gross Price Bond Index:
Monthly Movement**



**TH: Government Clean Price Bond Index:
Monthly Movement**



Trading Value by Transaction in Jun-22

Transaction	Monthly			Daily Average		
	Bn THB	% YoY	% MoM	Bn THB	% YoY	% MoM
Outright	1,015.8	-25.0	-17.1	48.4	-25.0	-25.0
-Domestic Companies						
-Buy	959.1	-23.9	-15.4	45.7	-23.9	-23.5
-Sell	943.7	-27.6	-19.0	44.9	-27.6	-26.7
-Net	15.4					
-Foreign Companies						
-Buy	56.7	-40.3	-38.1	2.7	-40.3	-44.0
-Sell	72.1	40.5	17.2	3.4	40.5	6.0
-Net	-15.4					
Financing	24,170.7	-5.6	3.8	1,151.0	-5.6	-6.1
-Bilateral Repo	17,636.6	-9.5	2.8	839.8	-9.5	-7.0
-Private Repo	6,531.8	6.4	6.4	311.0	6.4	-3.7
-Others	2.3	137.2	68.1	0.1	137.2	52.1
Others	3.1	16.9	-10.3	0.1	16.9	-18.8
Total	25,189.6	-6.6	2.7	1,199.5	-6.6	-7.0

Trading Value by Transaction in 6M/22

Transaction	6M/22		Daily Average	
	Bn THB	% YoY	Bn THB	% YoY
Outright	7,561.9	-6.0	63.5	-6.8
-Domestic Companies				
-Buy	6,922.1	-9.6	58.2	-10.3
-Sell	7,029.8	-9.1	59.1	-9.9
-Net	-107.8			
-Foreign Companies				
-Buy	639.9	63.9	5.4	62.5
-Sell	532.1	71.8	4.5	70.3
-Net	107.8			
Financing	140,919.8	-6.1	1,184.2	-6.9
-Bilateral Repo	105,209.0	-9.3	884.1	-10.1
-Private Repo	35,699.4	4.6	300.0	3.8
-Others	11.4	73.9	0.1	72.5
Others	33.4	2.3	0.3	1.4
Total	148,515.2	-6.1	1,248.0	-6.9

Outstanding Value by Issuer and Time to Maturity as of 30 Jun 2022

Issuer (Bn THB)	Time to Maturity (TTM)					Total
	TTM<1	1-5	5-10	10-15	15-50	
Government Bond	540.0	755.7	1,094.7	1,320.5	3,578.7	7,289.6
BOT Bond	1,676.0	895.0	0.0	0.0	0.0	2,571.1
State Enterprise Bond	0.0	95.8	341.6	291.2	292.3	1,021.0
Corporate Bond	252.6	1,486.9	1,022.2	1,062.7	278.8	4,103.2
Foreign Bond	0.0	12.9	19.0	36.1	7.0	75.0
Total	2,468.6	3,246.4	2,477.5	2,710.5	4,156.8	15,059.8

Government Bond Yield Curve (%)

Time to Maturity (TTM)	30/6/2021	31/12/2021	31/5/2022	30/6/2022			
				Rate	Change (bp)		
					YoY	MoM	YTD
1M	0.35	0.46	0.45	0.50	0.14	0.05	0.04
3M	0.39	0.48	0.47	0.60	0.21	0.13	0.12
6M	0.45	0.50	0.54	0.75	0.30	0.22	0.25
1Y	0.48	0.51	0.67	1.09	0.61	0.42	0.58
2Y	0.51	0.66	1.59	1.75	1.24	0.16	1.10
3Y	0.60	0.84	1.93	2.04	1.44	0.11	1.20
4Y	0.68	1.06	2.12	2.29	1.61	0.17	1.23
5Y	0.85	1.29	2.33	2.47	1.62	0.13	1.18
6Y	1.04	1.45	2.49	2.62	1.57	0.12	1.17
7Y	1.26	1.62	2.63	2.73	1.46	0.10	1.10
8Y	1.47	1.73	2.73	2.79	1.32	0.06	1.06
9Y	1.64	1.82	2.84	2.84	1.20	0.00	1.03
10Y	1.78	1.90	2.96	2.90	1.12	-0.06	1.00
11Y	1.89	2.03	3.05	3.04	1.15	-0.01	1.01
12Y	1.97	2.12	3.13	3.18	1.21	0.05	1.06
13Y	2.05	2.21	3.22	3.32	1.26	0.10	1.11
14Y	2.14	2.31	3.39	3.53	1.39	0.14	1.22
15Y	2.29	2.50	3.45	3.59	1.30	0.15	1.09
16Y	2.33	2.57	3.49	3.65	1.32	0.16	1.08
17Y	2.38	2.62	3.52	3.68	1.30	0.16	1.06
18Y	2.39	2.66	3.54	3.71	1.31	0.16	1.05
19Y	2.41	2.70	3.57	3.74	1.33	0.16	1.03
20Y	2.43	2.74	3.60	3.77	1.34	0.17	1.02
21Y	2.44	2.79	3.79	3.89	1.44	0.10	1.10
22Y	2.55	2.84	3.99	4.01	1.46	0.02	1.17
23Y	2.65	2.87	4.01	4.03	1.38	0.02	1.16
24Y	2.67	2.86	4.02	4.05	1.38	0.03	1.18
25Y	2.68	2.87	4.04	4.07	1.39	0.03	1.20
26Y	2.69	2.88	4.06	4.09	1.40	0.03	1.21
27Y	2.70	2.89	4.08	4.11	1.42	0.03	1.23
28Y	2.70	2.90	4.17	4.21	1.51	0.04	1.31
29Y	2.72	2.90	4.25	4.30	1.58	0.05	1.40
30Y	2.74	2.91	4.34	4.39	1.65	0.05	1.48
31Y	2.76	2.93	4.36	4.41	1.65	0.05	1.49
32Y	2.78	2.95	4.38	4.43	1.65	0.05	1.48
33Y	2.80	2.97	4.39	4.45	1.65	0.05	1.48
34Y	2.82	2.99	4.41	4.46	1.65	0.05	1.48
35Y	2.84	3.01	4.43	4.48	1.64	0.05	1.47
36Y	2.86	3.03	4.44	4.50	1.64	0.06	1.47
37Y	2.87	3.05	4.46	4.51	1.64	0.06	1.46
38Y	2.89	3.07	4.47	4.53	1.64	0.06	1.46
39Y	2.91	3.09	4.49	4.55	1.64	0.06	1.46
40Y	2.93	3.10	4.50	4.57	1.63	0.06	1.46
41Y	2.94	3.11	4.52	4.58	1.65	0.07	1.48
42Y	2.94	3.11	4.54	4.60	1.66	0.07	1.49
43Y	2.95	3.12	4.55	4.62	1.67	0.07	1.50
44Y	2.95	3.12	4.57	4.64	1.69	0.07	1.52
45Y	2.96	3.14	4.63	4.68	1.73	0.05	1.55
46Y	3.00	3.16	4.65	4.70	1.70	0.05	1.54
47Y	3.00	3.17	4.66	4.72	1.72	0.05	1.55
48Y	3.00	3.18	4.67	4.73	1.73	0.06	1.55
49Y	3.00	3.19	4.69	4.75	1.75	0.06	1.55
50Y	2.93	-	4.70	4.76	1.83	0.07	-

TH Bond Indexes as of 30 Jun 2022

	Index	Change			
		From 31 Dec 2021 (Point)	% YoY	% MoM	% YTD
Bond Composite Index					
Total Return Index	190.72	-11.85	-6.2	-0.4	-5.9
Gross Price Index	102.33	-7.96	-8.8	-1.3	-7.2
Clean Price Index	102.00	-7.96	-8.9	-0.6	-7.2
Average Yield (%)	3.47	1.12			
Government Bond Index					
Total Return Index	289.81	-25.90	-8.8	-0.5	-8.2
Gross Price Index	98.56	-10.38	-11.4	-1.8	-9.5
Clean Price Index	98.40	-10.37	-11.4	-0.8	-9.5
Average Yield (%)	3.46	1.09			
MTM Corporate Bond A- Index					
Total Return Index	198.73	-3.48	-1.0	-0.1	-1.7
Gross Price Index	105.21	-3.50	-4.0	-0.4	-3.2
Clean Price Index	104.57	-3.48	-4.0	-0.4	-3.2
Average Yield (%)	3.58	0.90			

ตราสารหนี้:

จุดสูงสุดและต่ำสุดในแต่ละช่วงเวลา ในระยะเวลา 11 ปี (ปี 2555-65)

Bn THB	ค่าปัจจุบัน	% ค่าสูงสุด	% ค่าต่ำสุด	ค่าสูงสุด	Date	ค่าต่ำสุด	Date
มูลค่าซื้อขาย							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
มี.ย. 65	25,189.6	-19.8	80.6	31,427.4	มี.ค. 64	13,950.1	เม.ย. 55
Q2/65	72,902.8	-15.3	57.1	86,037.0	Q2/63	46,398.6	Q2/55
2564	304,683.5	-1.1	51.6	307,928.1	2563	200,971.8	2555
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
มี.ย. 65	25,189.6	-12.9	64.0	28,908.1	มี.ย. 63	15,358.7	มี.ย. 55
6M/65	148,515.2	-6.1	50.2	158,222.5	6M/64	98,898.1	6M/55
Q2/65	72,902.8	-15.3	57.1	86,037.0	Q2/63	46,398.6	Q2/55
มูลค่าตราสารหนี้							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
มี.ย. 65	15,059.8	-0.8	109.3	15,173.9	เม.ย. 65	7,196.5	ม.ค. 55
Q2/65	15,059.8	-	95.3	15,059.8	Q2/65	7,711.6	Q1/55
2564	14,732.0	-	71.7	14,732.0	2564	8,580.0	2555
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
มี.ย. 65	15,059.8	-	86.9	15,059.8	มี.ย. 65	8,058.2	มี.ย. 55
Q2/65	15,059.8	-	86.9	15,059.8	Q2/65	8,058.2	Q2/55

ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ณ วันที่ 30 มิ.ย. 65:
จุดสูงสุดและต่ำสุดในแต่ละช่วงเวลา ในระยะเวลา 11 ปี (ปี 2555-65)

Index	ค่าปัจจุบัน	% ค่าสูงสุด	% ค่าต่ำสุด	ค่าสูงสุด	Date	ค่าต่ำสุด	Date
Total Return Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
มิ.ย. 65	289.81	-13.0	38.8	333.12	ก.พ. 63	208.80	มี.ค. 55
Q2/65	289.81	-12.5	38.8	331.23	Q4/63	208.80	Q1/55
2564	315.71	-4.7	44.0	331.23	2563	219.28	2555
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
มิ.ย. 65	289.81	-11.1	35.9	326.04	มิ.ย. 63	213.31	มิ.ย. 55
Q2/65	289.81	-11.1	35.9	326.04	Q2/63	213.31	Q2/55
Gross Price Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
มิ.ย. 65	98.56	-19.0	-	121.68	ก.พ. 63	98.56	มิ.ย. 65
Q2/65	98.56	-17.7	-	119.78	Q3/62	98.56	Q2/65
2564	108.94	-7.3	6.5	117.58	2563	102.30	2556
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
มิ.ย. 65	98.56	-16.1	-	117.41	มิ.ย. 63	98.56	มิ.ย. 65
Q2/65	98.56	-16.1	-	117.41	Q2/63	98.56	Q2/65
Clean Price Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
มิ.ย. 65	98.40	-18.6	-	120.92	ก.พ. 63	98.40	มิ.ย. 65
Q2/65	98.40	-17.2	-	118.83	Q3/62	98.40	Q2/65
2564	108.77	-7.3	7.2	117.37	2563	101.50	2556
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
มิ.ย. 65	98.40	-16.0	-	117.20	มิ.ย. 63	98.40	มิ.ย. 65
Q2/65	98.40	-16.0	-	117.20	Q2/63	98.40	Q2/65