

สรุปสภาวะตลาดตราสารหนี้วันที่ 26 - 30 กันยายน 2565

- ตราสารหนี้ไทยยังคงอยู่ในสถานการณ์ผันผวนและอัตราผลตอบแทนปรับเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้าทุกช่วงอายุ 4-15 bps. โดยเกิดจากปัจจัยต่างประเทศและการปรับขึ้นดอกเบี้ยของ กนง. อีก 0.25% มาอยู่ที่ 1.00%
- กนง.ยังคง Less Hawkish ด้วยมติขึ้นดอกเบี้ยอย่างเป็นทางการเป็นเอกฉันท์ 7-0 สร้างความประหลาดใจต่อตลาดการเงิน และทำให้ค่าเงินบาทอ่อนไปทดสอบ 38.4 THB/USD หลังทราบผลการประชุมก่อนจะปรับขึ้นบ้างหลัง USD อ่อนค่า ซึ่งสอดคล้องกับกระแสการขายพันธบัตรไทยของนักลงทุนต่างประเทศกว่า 2.2 หมื่นล้านบาท ต่อเนื่องจากสัปดาห์ก่อนหน้า ทำให้นักลงทุนมียอดเงินลงทุนคงค้างในพันธบัตรไทย 9.98 แสนล้านบาท ต่ำสุดตั้งแต่ต้นปี
- การดำเนินนโยบายลดภาษี (GBP 45 พันล้าน) ของรัฐบาล UK ในสัปดาห์ก่อนหน้าเป็นปัจจัยหนึ่งที่ทำให้ตลาดอัตราแลกเปลี่ยนและตลาดตราสารหนี้ทั่วโลกผันผวนหนักมาก ก่อนที่ Bank of England จะประกาศมาตรการ QE รับซื้อพันธบัตร (วงเงิน GBP 65 พันล้าน) ช่วยทำให้ตลาดสงบลงชั่วคราว
- ในปลายสัปดาห์ สหรัฐฯ เปิดเผยข้อมูล Core PCE (ส.ค.) +0.6%MoM และ +4.9%YoY สูงกว่าที่ตลาดคาดการณ์ไว้และเร่งตัวขึ้นเมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า ประกอบกับการให้ความเห็นของ FOMC Member ที่ยังแสดงท่าที Hawkish ทำให้อัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐฯ ปรับเพิ่มและชันขึ้นโดยเฉพาะกลุ่มอายุ 5-30 ปี เพิ่ม 10-18 bps.WoW
- ส่วนต่างเครดิตของตราสารหนี้เอกชนปรับลดลงเล็กน้อย 1-3 bps. โดยเฉพาะในกลุ่มอายุไม่เกิน 3 ปี โดยตราสารหนี้เอกชนยังมีการเสนอขายในตลาดแรกต่อเนื่องและผู้ออกปรับเพิ่มผลตอบแทนตามการเพิ่มขึ้นของอัตราผลตอบแทนพันธบัตร (Risk Free Rate) แต่ความต้องการในกลุ่มนักลงทุนสถาบันยังมีจำกัดจากการสำรองสภาพคล่องของกลุ่มกองทุนรวม และกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

สามารถสอบถามข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ KTB ทุกสาขา / บลจ.กรุงไทย

“ผู้ลงทุนต้องทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทน และความเสี่ยง ก่อนตัดสินใจลงทุน”