|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (13 - 17 มิ.ย. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 13 – 17 มิ.ย. 59 | 6 – 10 มิ.ย. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 17 มิ.ย. 59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 437,374.34 | 471,544.03 | -7.25% | 10,910,029.50 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 87,474.87 | 94,308.81 | -7.25% | 98,288.55 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 112.28 | 113.68 | -1.23% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.57 | 107.68 | -0.10% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 17 มิ.ย. 59  มีจำนวน 3,239 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,419,671.36 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 131,657 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  437,374.34 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 87,474.87 ล้านบาทต่อวัน ลดลงจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 7.25 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 7.92 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 92.08 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ มีการซื้อขายจำนวน 1 หลักทรัพย์ มูลค่าประมาณ 0.5 ล้านบาท (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 464 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 44 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 40 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 366 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 13 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 117,357.00 | 89.14 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 0.00 | 0.00 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 5,000.00 | 3.80 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 5,300.00 | 4.03 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 4,000.00 | 3.04 | | **รวม** | 131,657 | 100.00 | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 286,365.00 | 68.09 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 129,722.00 | 30.85 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 4,461.00 | 1.06 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 420,548.00 | 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.** | | 6 - 10 มิ.ย. 59 |  |  |  | 1.46 | 1.56 | 1.57 | 1.79 | 1.90 | 2.10 | 2.26 | 2.46 | 2.53 | 2.54 | 2.55 | | 13 - 17 มิ.ย. 59 |  |  |  | 1.45 | 1.57 | 1.61 | 1.81 | 1.96 | 2.14 | 2.31 | 2.50 | 2.60 | 2.62 | 2.64 | | เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - | -1 | 1 | 4 | 2 | 6 | 4 | 5 | 4 | 7 | 8 | 9 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยลดลงเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวเพิ่มขึ้นเกือบทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะอัตราผลตอบแทนตราสารอายุ 20 ปี ที่ปรับเพิ่มขึ้น 9 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-2 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -1 ถึง 1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 3-7 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 2 ถึง 6 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 10-15 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 4 ถึง 5 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 18-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 7 ถึง 9 bp. ทั้งนี้ ด้านปัจจุยต่างประเทศ ผลการประชุมคณะกรรมการกำหนดนโยบายการเงินของสหรัฐฯ (FOMC) ในการประชุมที่ผ่านมา มีมติเป็นเอกฉันท์ให้คงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ 0.25-0.50% ตามที่ตลาดคาดการณ์ไว้ ขณะที่ไม่ได้ส่งสัญญาณที่ชัดเจนถึงกำหนดเวลาในการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ย และตัวเลขผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานครั้งแรกรายสัปดาห์ของสหรัฐฯ อยู่ที่ 277,000 ราย ต่ำกว่าที่ตลาดคาดไว้ที่ 270,000 ราย อย่างไรก็ตาม ตลาดยังคงติดตามการทำประชามติของสหราชอาณาจักรว่าจะออกจากสหภาพยุโรปหรือไม่ โดยนักลงทุนต่างชาติขายสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 8,223 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (20 - 24 มิ.ย. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ ยอดขายรถและดุลการค้า เดือน พ.ค. และการประชุม กนง. (ตลาดคงดอกเบี้ยที่ 1.5%) ปัจจัยภายนอกที่ต้องติดตาม ได้แก่ ดุลการค้า เดือน พ.ค. ของญี่ปุ่น Yellen แถลงนโยบายการเงินและเศรษฐกิจต่อสภาคองเกรส และยอดขายบ้านเก่า เดือน พ.ค. ของสหรัฐฯ ดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภค เดือน มิ.ย. ของยูโรโซน Brexit ของอังกฤษ และการประชุมธนาคารกลางของฟิลิปปินส์ | | |
|  | | |