|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (30 พ.ค. – 3 มิ.ย. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 30 พ.ค. – 3 มิ.ย. 59 | 23 - 27 พ.ค. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 3 มิ.ย. 59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 469,570.39 | 474,854.07 | -1.11% | 10,001,111.13 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 93,914.08 | 94,970.81 | -1.11% | 99,020.90 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 112.66 | 113.63 | -0.85% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.29 | 107.59 | -0.28% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 3 มิ.ย. 59  มีจำนวน 3,239 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,395,513.86 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 136,302 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  469,570.39 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 93,914.08 ล้านบาทต่อวัน ลดลงจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 1.11 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 8.39 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 91.60 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 465 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 44 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 40 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 367 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 13 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 124,552.00 | 91.38 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 0.00 | 0.00 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 5,000.00 | 3.67 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 4,750.00 | 3.48 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 2,000.00 | 1.47 | | **รวม** | 136,302 | 100.00 | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 328,320.00 | 72.83 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 113,499.00 | 25.18 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 9,001.00 | 2.00 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 450,820.00 | 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.** | | 23 - 27 พ.ค. 59 |  |  |  | 1.49 | 1.60 | 1.67 | 1.83 | 1.97 | 2.11 | 2.25 | 2.42 | 2.46 | 2.47 | 2.48 | | 30 พ.ค. - 3 มิ.ย. 59 |  |  |  | 1.49 | 1.65 | 1.70 | 1.96 | 2.10 | 2.24 | 2.41 | 2.58 | 2.62 | 2.63 | 2.63 | | เปลี่ยนแปลง (bp.) | - | - | - | 0 | 5 | 3 | 13 | 13 | 13 | 16 | 16 | 16 | 16 | 15 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยลดลงเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวเพิ่มขึ้น ทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะอัตราผลตอบแทนตราสารอายุ 12-20 ปี ที่ปรับเพิ่มขึ้น 16 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 ปี ไม่มีการปรับตัวอยู่ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 2-3 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 3 ถึง 5 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5-10 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 13 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 12-20 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 16 bp. ทั้งนี้ จากการที่ตลาดกังวลเกี่ยวกับแนวโน้มของ Yield ที่ปรับตัวสูงขึ้นอย่างต่อเนื่องในช่วงสัปดาห์ก่อนหน้า และประธานธนาคารกลางสหรัฐฯ (FED) ให้ความเห็นว่า FED ควรขึ้นอัตราดอกเบี้ยในช่วงไม่กี่เดือนข้างหน้า หากเศรษฐกิจมีการขยายตัวตามที่คาดการณ์ไว้ รวมถึงแรงเทขายเพื่อลดผลขาดทุนในช่วงต้นสัปดาห์ ส่งผลการประชุมกลุ่มสมาชิก OPEC ที่กรุงเวียนนา ซึ่งไม่สามารถตกลงกันได้เกี่ยวกับการควบคุมราคาและปริมาณน้ำมันในตลาดตามที่ตลาดคาดไว้ ขณะที่ราคาน้ำมันในตลาด WTI ไม่เปลี่ยนแปลงมากนัก อยู่ที่ 49.18 ดอลลาร์/บาร์เรล เนื่องจากสต็อกน้ำมันของสหรัฐฯ ที่ประกาศออกมาในช่วงเดียวกันน้อยกว่าที่คาดไว้ อย่างไรก็ตาม ตลาดยังติดตามรายงานตัวเลขการจ้างงานนอกภาคเกษตรของสหรัฐฯ โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 1,595 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (6 - 10 มิ.ย. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ ดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภค เดือน พ.ค. ปัจจัยภายนอกที่ต้องติดตาม ได้แก่ GDP ไตรมาส 1 ปี 2016 ของยูโรโซนและญี่ปุ่น ดุลการค้าและอัตราเงินเฟ้อ เดือน พ.ค. ของจีน การประชุมธนาคารกลางของเกาหลีใต้และอินเดีย และผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ของสหรัฐฯ | | |
|  | | |