|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (16 - 19 พ.ค. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 16 - 19 พ.ค. 59 | 9 – 13 พ.ค. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 19 พ.ค. 59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 435,552.66 | 420,784.78 | 3.51% | 9,056,686.67 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 108,888.16 | 84,156.96 | 29.39% | 99,524.03 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 113.72 | 115.08 | -1.18% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.63 | 108.43 | -0.74% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 19 พ.ค. 59  มีจำนวน 3,185 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,381,640.33 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 163,250 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  435,552.66 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 108,888.16 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 29.39 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 8.68 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 91.32 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 4 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 468 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 44 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 41 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 369 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 13 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 121,255.00 | 74.28 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 0.00 | 0.00 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 27,900.00 | 17.09 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 11,095.00 | 6.80 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 3,000.00 | 1.84 | | **รวม** | 163,250 | 100.00 | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 301,328.00 | 75.40 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 87,241.00 | 21.83 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 11,061.00 | 2.77 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 399,630.00 | 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.** | | 9 - 13 พ.ค. 59 |  |  |  | 1.38 | 1.43 | 1.45 | 1.58 | 1.68 | 1.83 | 2.01 | 2.22 | 2.27 | 2.27 | 2.27 | | 16 - 19 พ.ค. 59 |  |  |  | 1.45 | 1.59 | 1.66 | 1.83 | 1.98 | 2.12 | 2.24 | 2.39 | 2.45 | 2.45 | 2.46 | | เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - | 7 | 16 | 21 | 25 | 30 | 29 | 23 | 17 | 18 | 18 | 19 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวเพิ่มขึ้นทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะอัตราผลตอบแทนตราสารอายุ 7 ปี ที่ปรับเพิ่ม 30 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-3 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 7 ถึง 21 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5-12 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 23 ถึง 30 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 15-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 17 ถึง 19 bp. ทั้งนี้ จากการที่ตลาดตอบรับการคาดการณ์ว่า ธนาคารกลางสหรัฐฯ (FED) อาจปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายในการประชุม FOMC เดือน มิ.ย. นี้ เนื่องจากตัวเลขเศรษฐกิจที่ทยอยประกาศออกมาเป็นไปในทางที่ดี ประกอบกับราคาน้ำมันปรับตัวเพิ่มสูงขึ้นสู่ระดับสูงสุดในปีนี้ นอกจากนี้ ตลาดเริ่มมีการคาดการณ์ถึง Supply ใหม่ในพันธบัตรรัฐบาลสำหรับการทำ Bond Switching ด้านปัจจัยในประเทศ สำนักงานคณะกรรมการพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ คงคาดการณ์อัตราการขยายตัวทางเศรษฐกิจ (GDP) ในปี 59 ขยายตัวที่ 3.3% ดีกว่าที่ตลาดคาดไว้ อย่างไรก็ดี ตลาดยังติดตามรายงานดัชนีผู้จัดการฝ่ายจัดซื้อ (PMI) เดือน พ.ค. ของสหรัฐฯ โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 1,111 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (23 - 27 พ.ค. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ กสทช. ประกาศรายชื่อผู้ผ่านคุณสมบัติเข้าประมูลคลื่น 900MHz การประมูลคลื่น 900MHz และดุลการค้า เดือน เม.ย. ปัจจัยภายนอกที่ต้องติดตาม ได้แก่ GDP ไตรมาส 1 ปี 2016 ของไต้หวัน การประชุมกลุ่ม G7 Markit Eurozone Composite PMI และ ZEW Survey Expectations เดือน พ.ค. ของยูโรโซน | | |
|  | | |