

ภาวะตลาดตราสารหนี้ของไทย เดือน เม.ย. 2567

- การซื้อขายตราสารหนี้ เดือน เม.ย. 67 มูลค่า 26,283.5 Bn THB เพิ่มขึ้น 10.8% YoY แต่ลดลง 6.2% MoM โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,460.2 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 4.6% YoY และ 9.5% MoM หากพิจารณา 4M/67 มูลค่า 112,375.2 Bn THB เพิ่มขึ้น 3.9% YoY โดยมีมูลค่าเฉลี่ย 1,387.3 Bn THB/D เพิ่มขึ้น 2.6% YoY
- ตราสารหนี้ เดือน เม.ย. 67 มูลค่า 16,984.5 Bn THB เพิ่มขึ้น 5.3% YoY 0.3% MoM และ 3.7% YTD โดยพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตรรัฐบาล ตราสารหนี้ภาคเอกชน และพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ คิดเป็น 13.9% 51.9% 27.4% และ 6.3% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ ส่วนมูลค่าตราสารหนี้อายุคงเหลือ (0,1Y), [1Y,5Y], [5Y,10Y], [10Y,15Y] และ [15Y,50Y] คิดเป็น 14.7% 22.8% 16.3% 19.1% และ 27.1% ของมูลค่าตราสารหนี้ทั้งหมด ตามลำดับ
- อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล เดือน เม.ย. 67 อายุคงเหลือ 3M 6M 1Y 2Y 3Y 5Y และ 10Y อยู่ที่ 2.26% 2.29% 2.29% 2.37% 2.43% 2.57% และ 2.78% ตามลำดับ
- ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล เดือน เม.ย. 67 เมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปีก่อน ลดลงเกือบทุกประเภท ยกเว้น Total Return Index หากเทียบกับเดือนก่อน ลดลงทุกประเภท

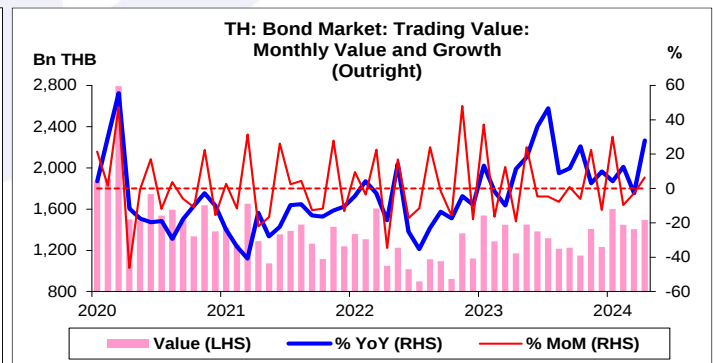
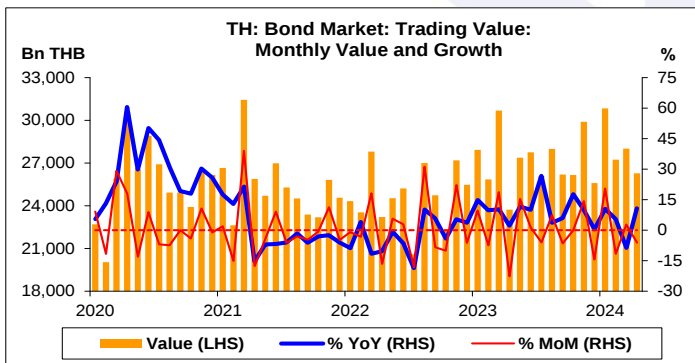
การประเมินอันดับค่า อิงค่าต่ำสุด ค่าเฉลี่ย และค่าสูงสุด (ปี 2557-67)

	All Periods			Same Periods			Latest
	Month	Quarter	Year	YTD	Quarter	Month	
Bond							
Trading Value	4	5	5	5	5	4	Apr-24
Outstanding Value	5	5	5	-	5	5	Apr-24
Government Bond							
Total Return Index	4	5	4	-	5	4	Apr-24
Gross Price Index	2	2	1	-	2	2	Apr-24
Clean Price Index	2	2	1	-	2	2	Apr-24

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

อัตราการเปลี่ยนแปลงรายปี (ปี 2557-66)

	%	Average YoY Growth	CAGR
Bond			
Trading Value		4.5	3.9
Outstanding Value		6.2	6.2
Government Bond			
Total Return Index		3.5	3.3
Gross Price Index		-0.1	-0.3
Clean Price Index		0.0	-0.2



ที่มา: สมาคมตราสารหนี้ไทย

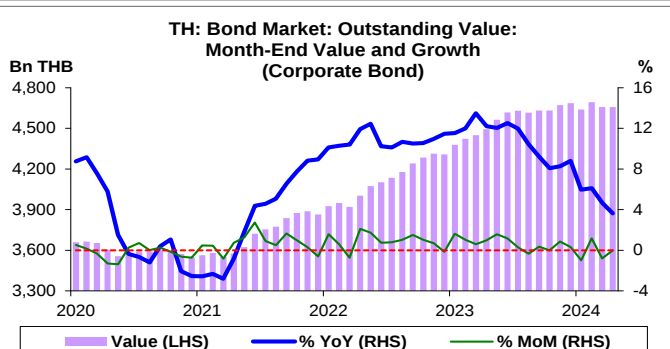
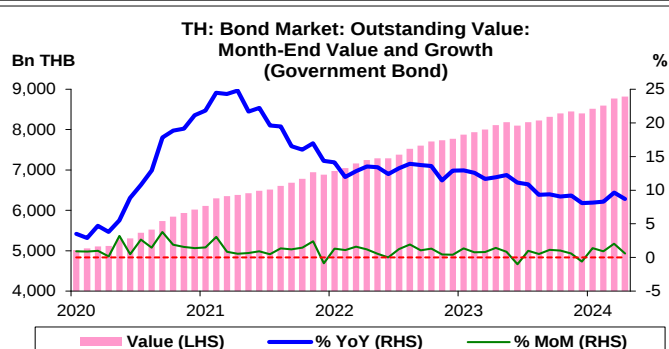
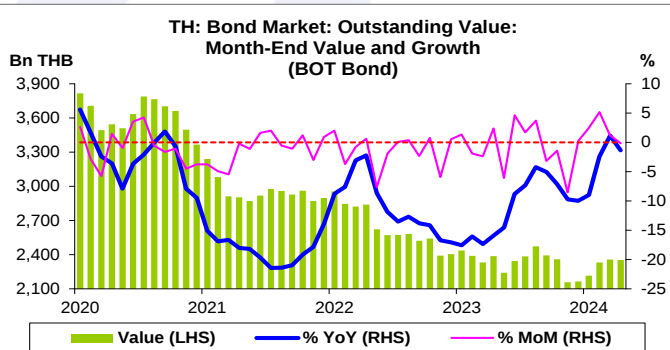
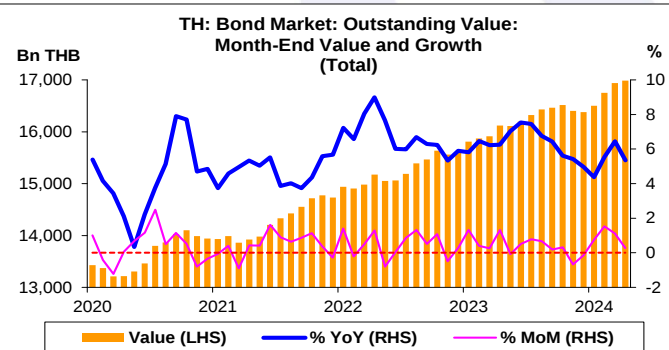
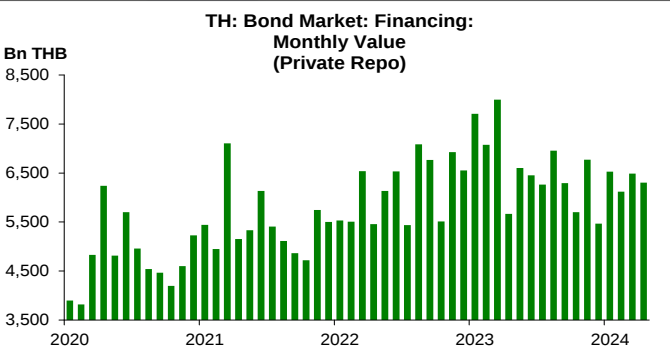
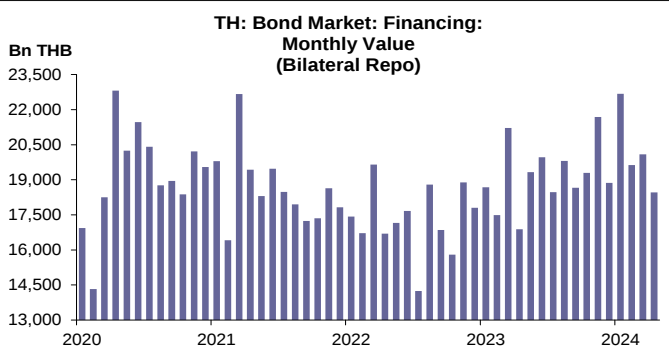
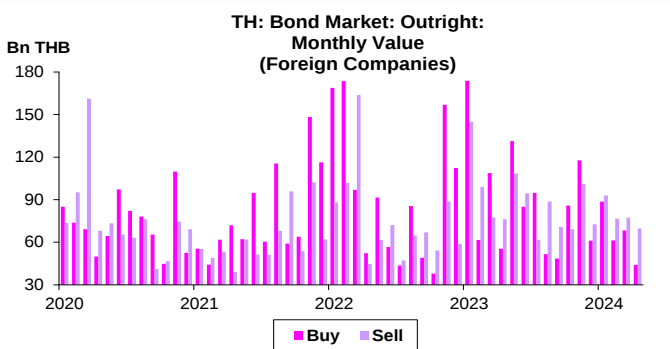
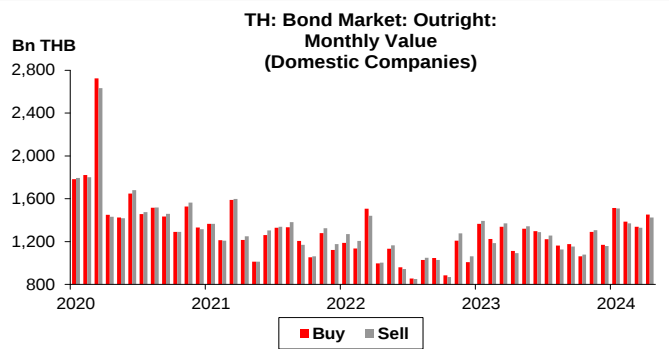
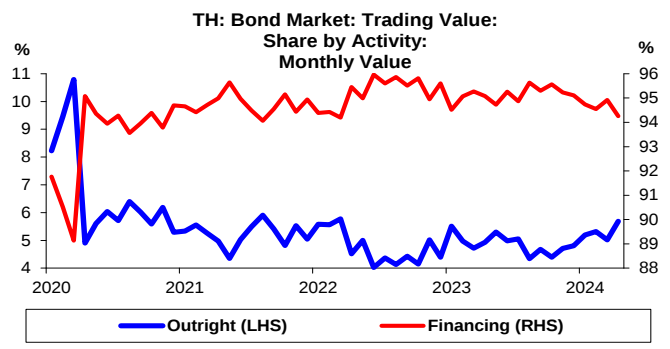
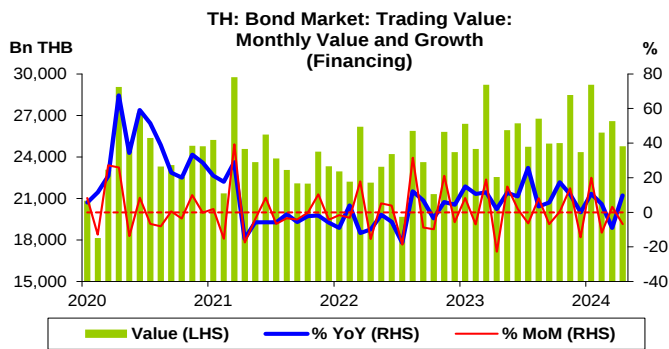
หมายเหตุ: 1. เดือน เม.ย. 66 มี.ค. 67 และ เม.ย. 67 มีวันทำการเดือนละ 17 21 และ 18 วัน ตามลำดับ

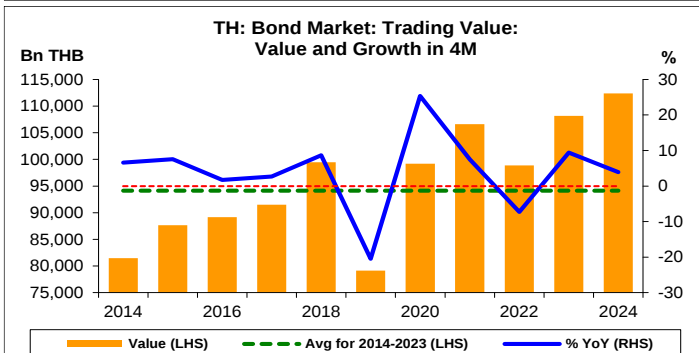
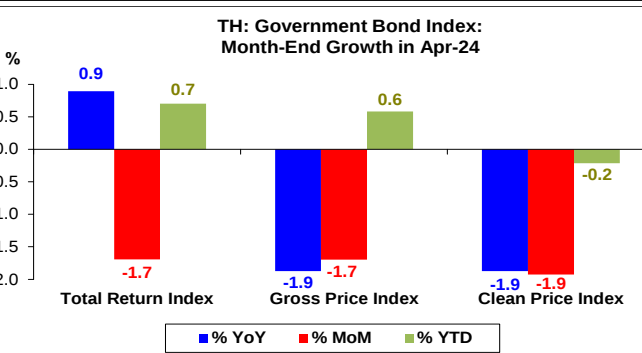
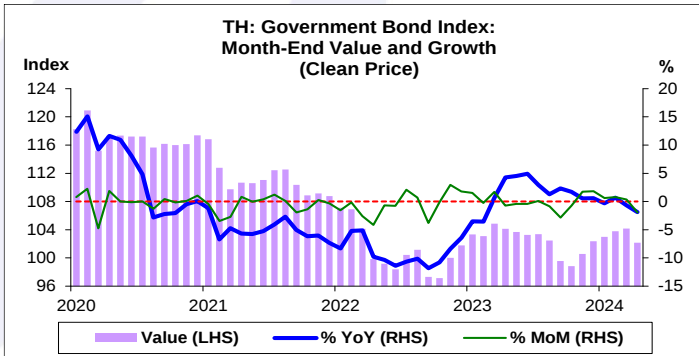
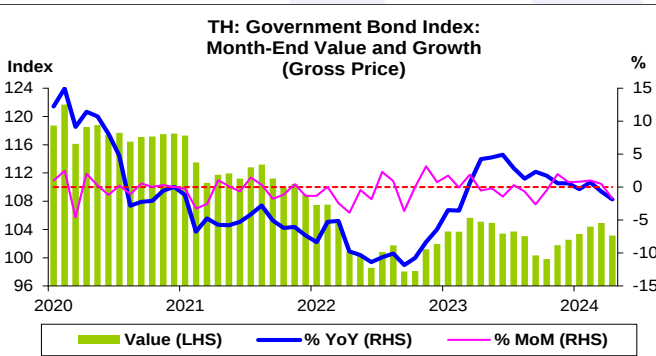
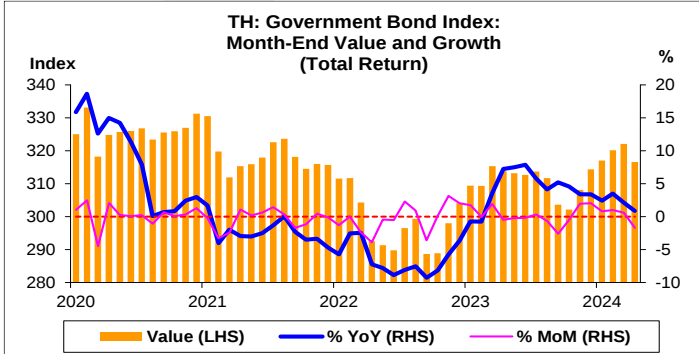
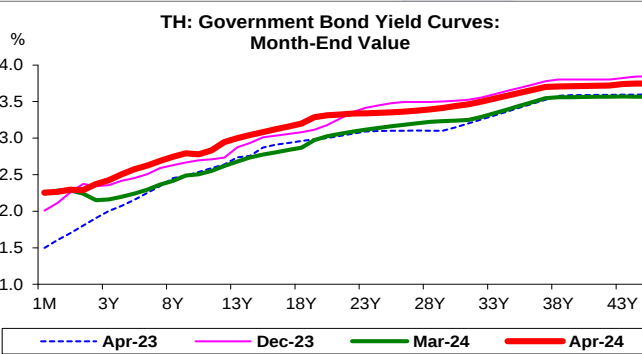
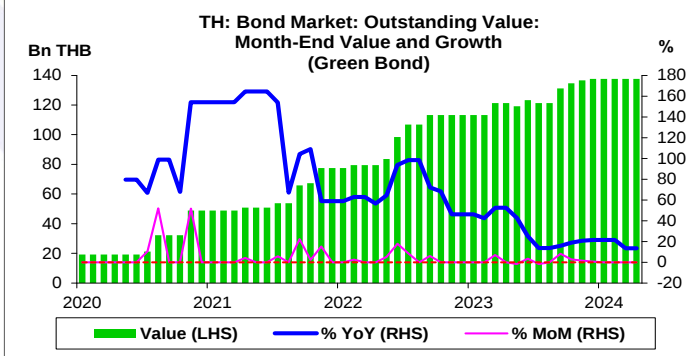
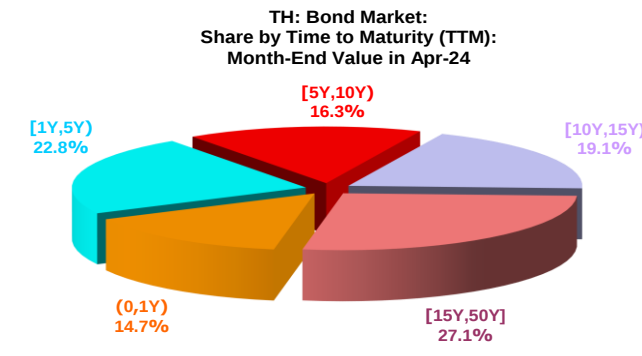
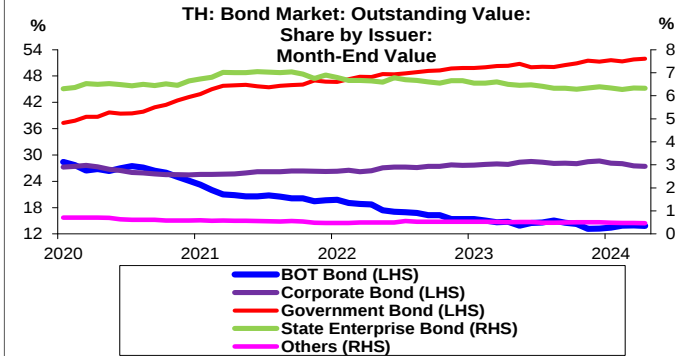
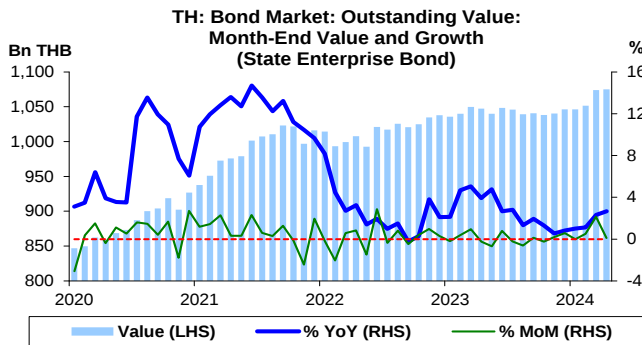
2. 4M/66 และ 4M/67 มีวันทำการ 80 และ 81 วัน ตามลำดับ

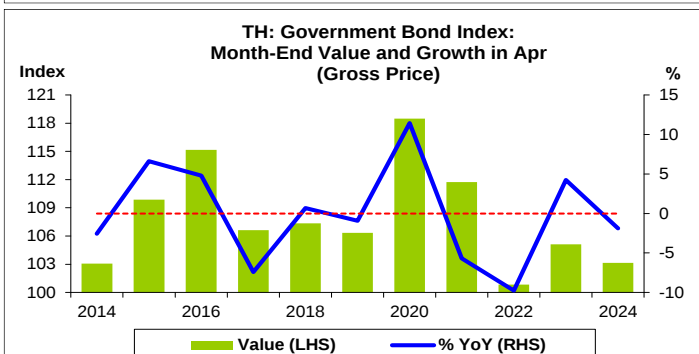
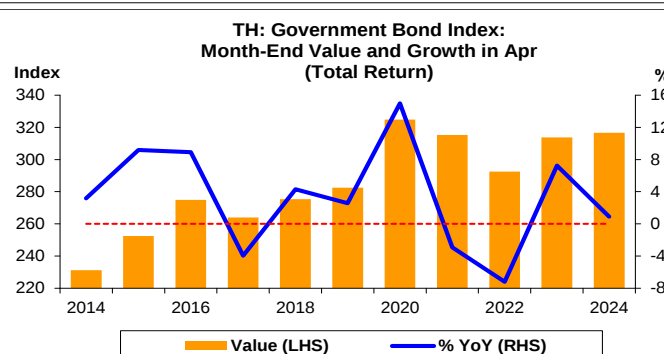
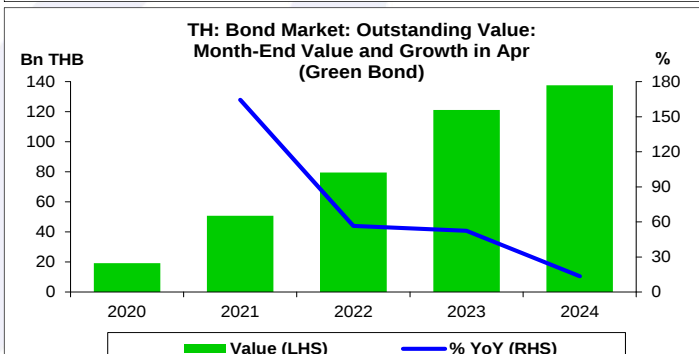
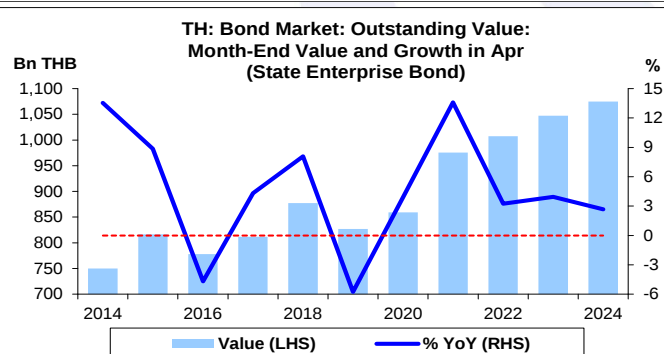
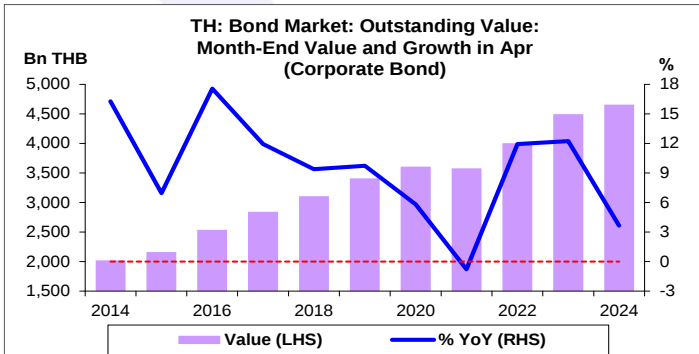
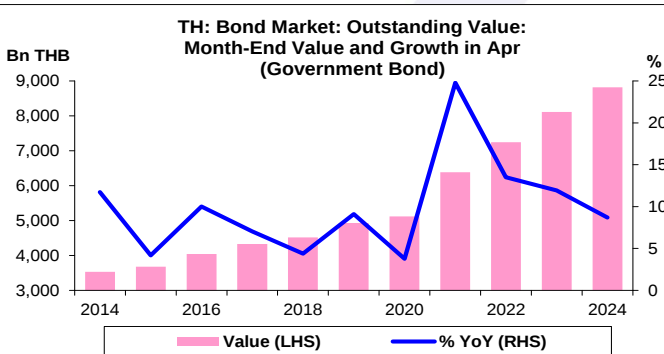
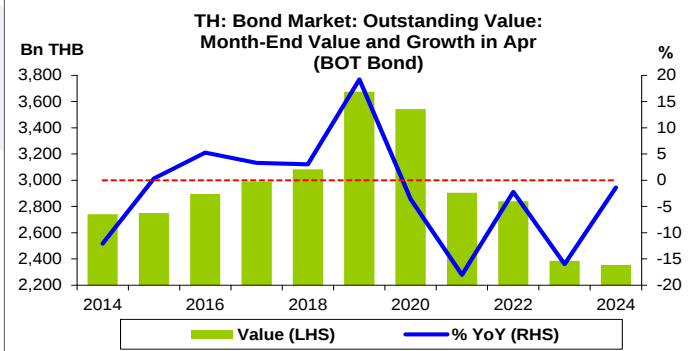
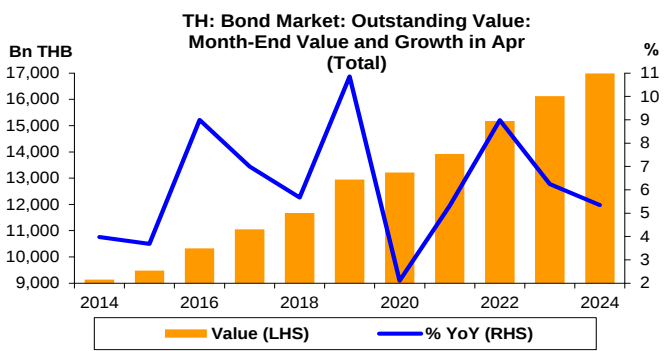
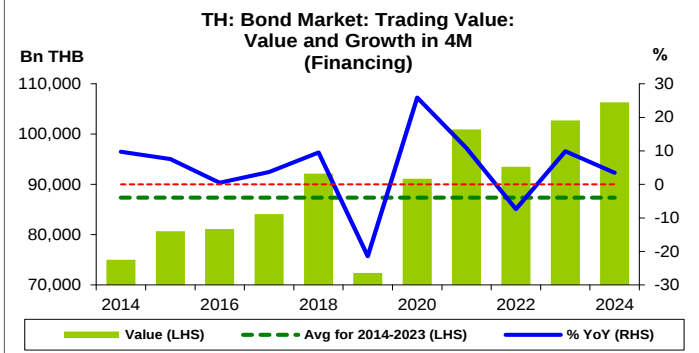
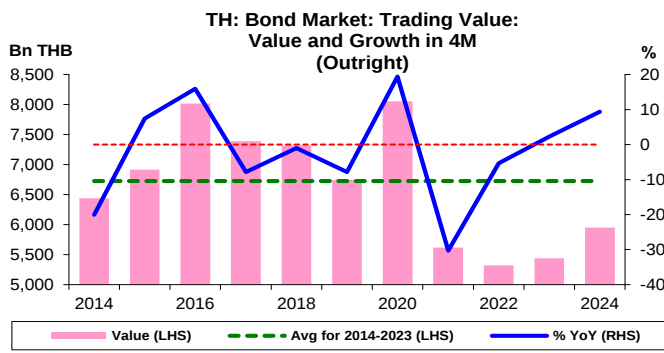
3. มูลค่าคงค้างตราสารหนี้ตามอายุคงเหลือ 5 กลุ่ม ได้แก่ อายุคงเหลือไม่ถึง 1 ปี (0,1Y) อายุคงเหลือตั้งแต่ 1 ปี และไม่ถึง 5 ปี [1Y,5Y] อายุคงเหลือตั้งแต่ 5 ปี และไม่ถึง 10 ปี [5Y,10Y] อายุคงเหลือตั้งแต่ 10 ปี และไม่ถึง 15 ปี [10Y,15Y] และอายุคงเหลือตั้งแต่ 15 ปี และถึง 50 ปี [15Y,50Y]

4. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล เป็นอัตรา ณ สิ้นเดือน

5. CAGR คือ Compound Annual Growth Rate

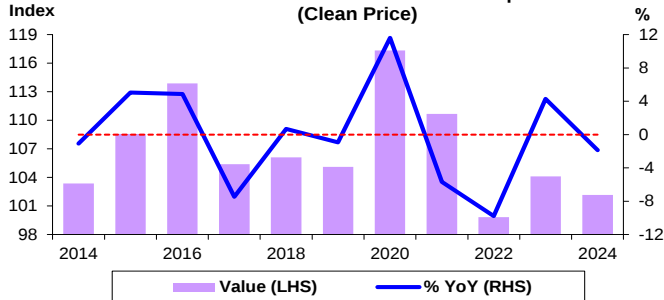




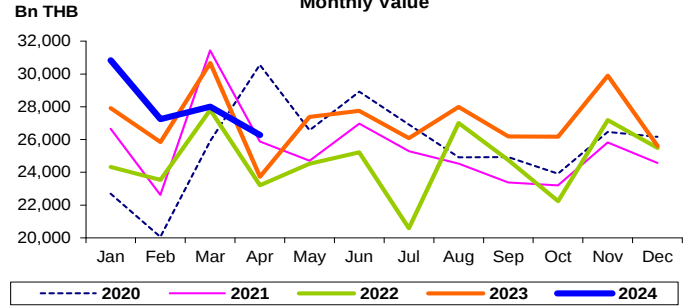




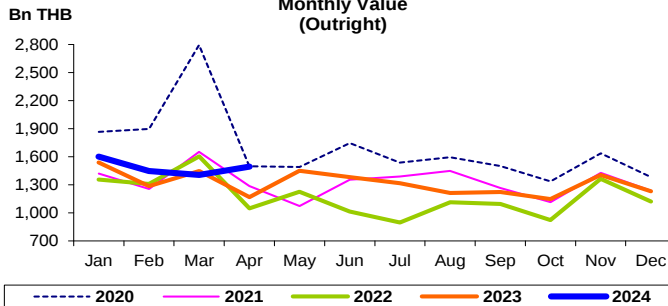
TH: Government Bond Index:
Month-End Value and Growth in Apr
(Clean Price)



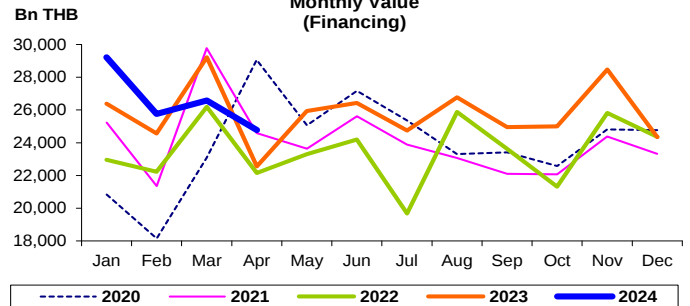
TH: Bond Market: Trading Value:
Monthly Value



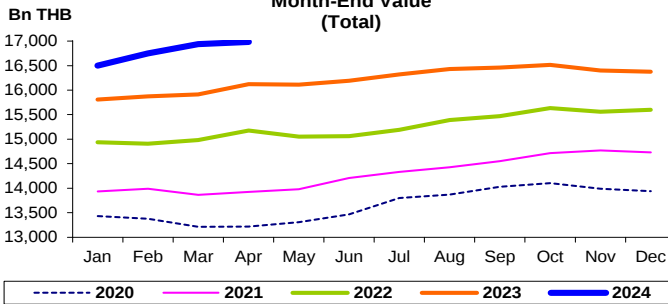
TH: Bond Market: Trading Value:
Monthly Value
(Outright)



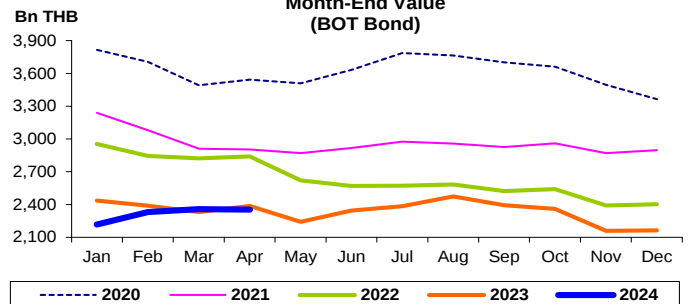
TH: Bond Market: Trading Value:
Monthly Value
(Financing)



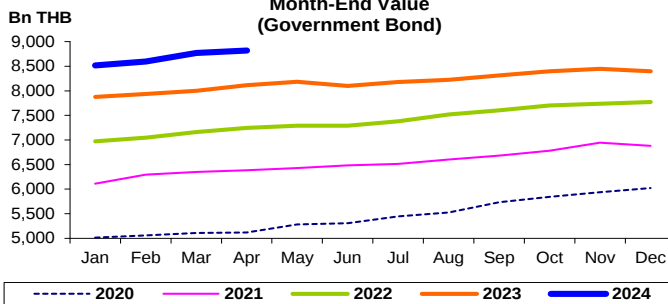
TH: Bond Market: Outstanding Value:
Month-End Value
(Total)



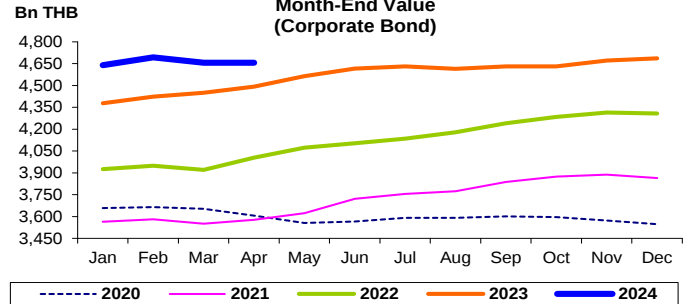
TH: Bond Market: Outstanding Value:
Month-End Value
(BOT Bond)



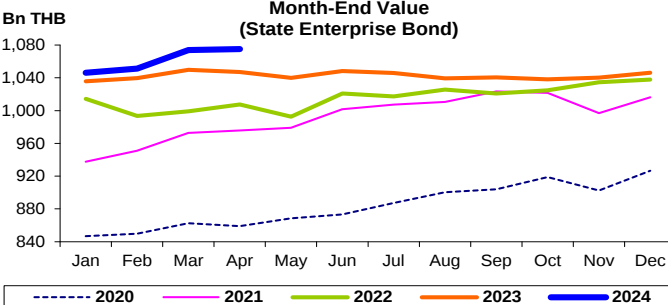
TH: Bond Market: Outstanding Value:
Month-End Value
(Government Bond)



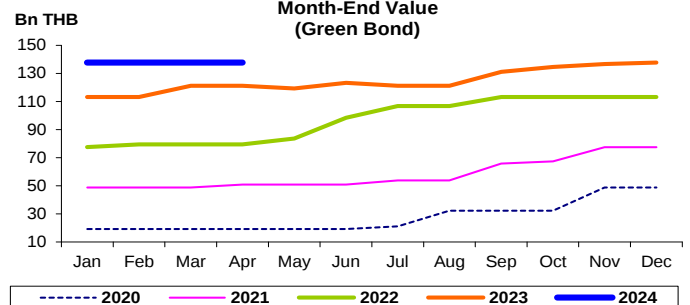
TH: Bond Market: Outstanding Value:
Month-End Value
(Corporate Bond)



TH: Bond Market: Outstanding Value:
Month-End Value
(State Enterprise Bond)

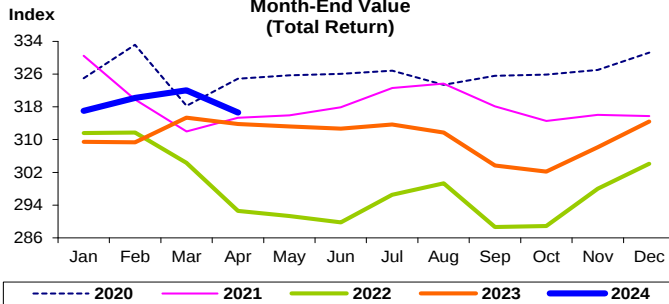


TH: Bond Market: Outstanding Value:
Month-End Value
(Green Bond)

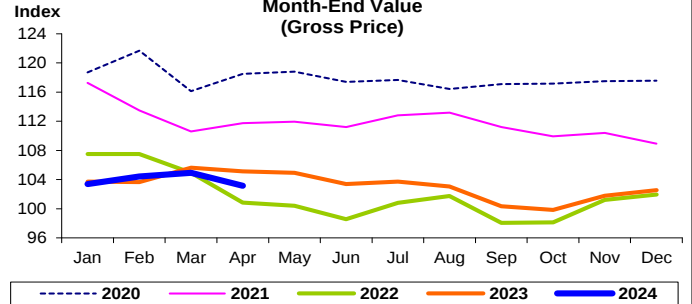




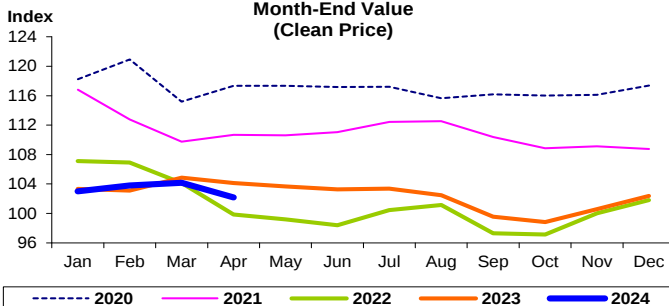
**TH: Government Bond Index:
Month-End Value
(Total Return)**



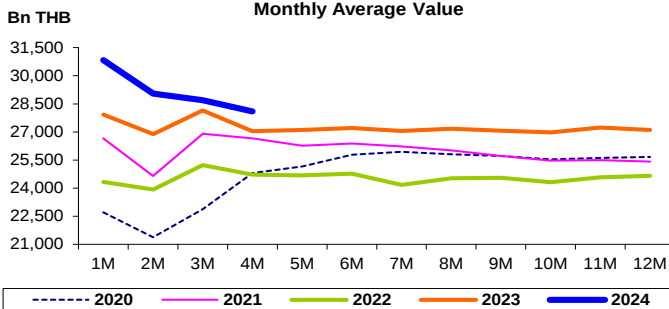
**TH: Government Bond Index:
Month-End Value
(Gross Price)**



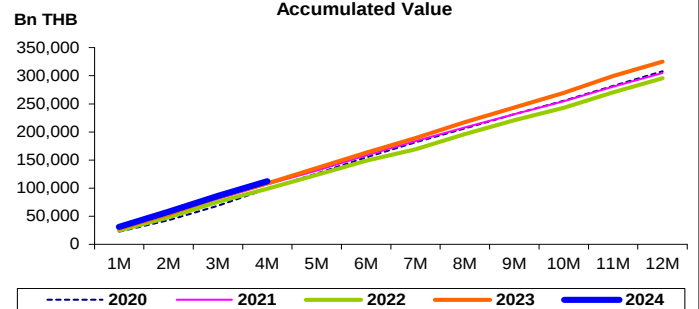
**TH: Government Bond Index:
Month-End Value
(Clean Price)**



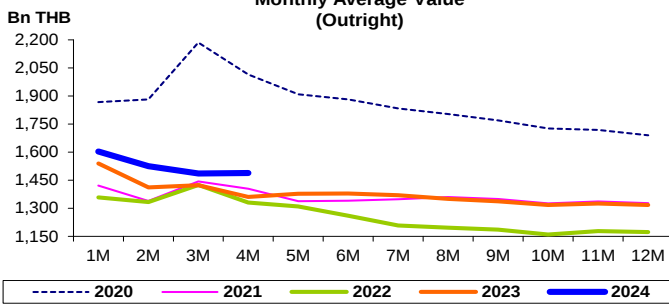
**TH: Bond Market: Trading Value:
Monthly Average Value**



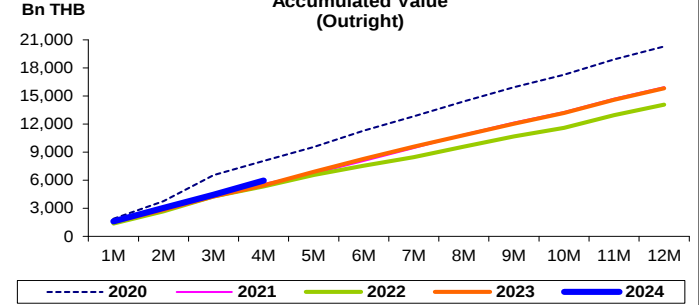
**TH: Bond Market: Trading Value:
Accumulated Value**



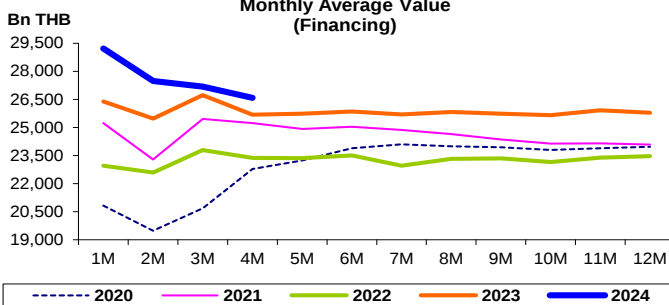
**TH: Bond Market: Trading Value:
Monthly Average Value
(Outright)**



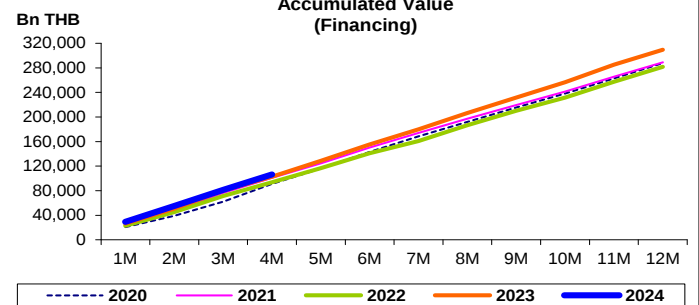
**TH: Bond Market: Trading Value:
Accumulated Value
(Outright)**



**TH: Bond Market: Trading Value:
Monthly Average Value
(Financing)**

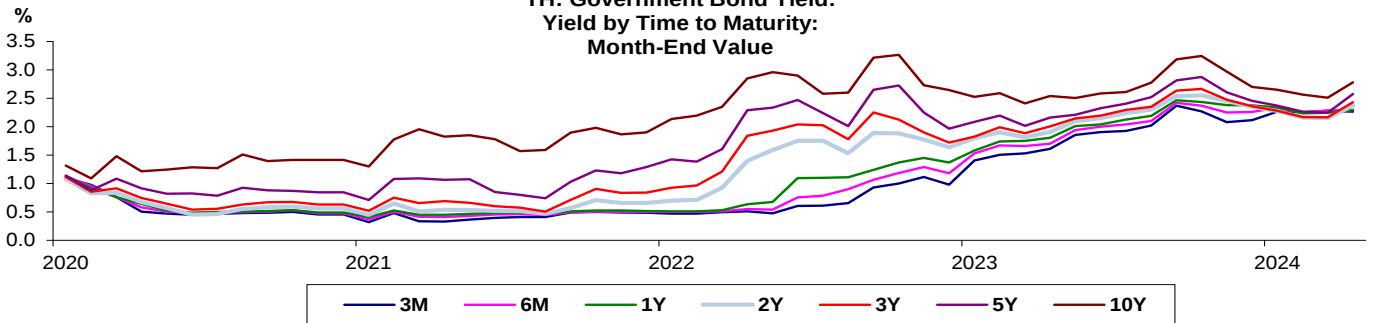


**TH: Bond Market: Trading Value:
Accumulated Value
(Financing)**

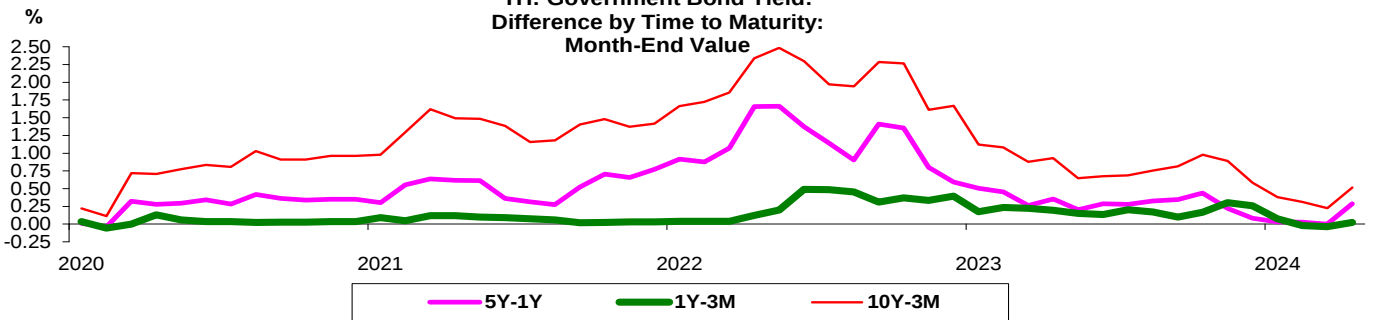




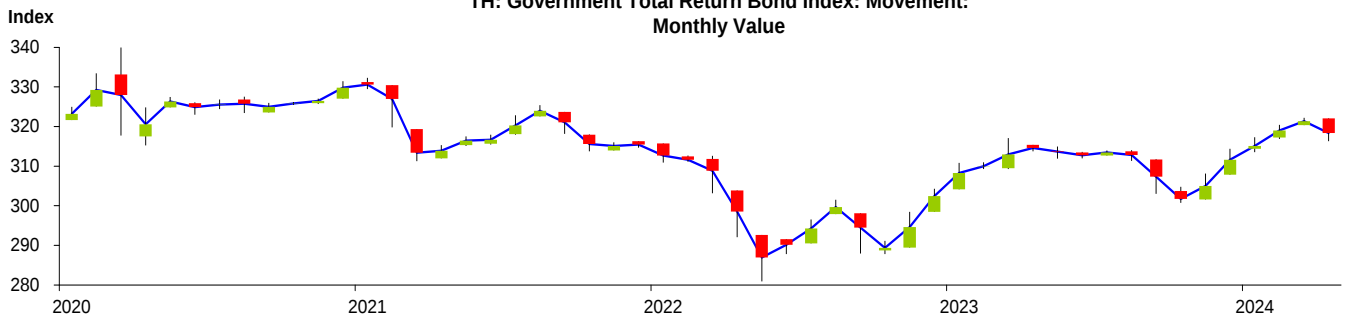
TH: Government Bond Yield:
Yield by Time to Maturity:
Month-End Value



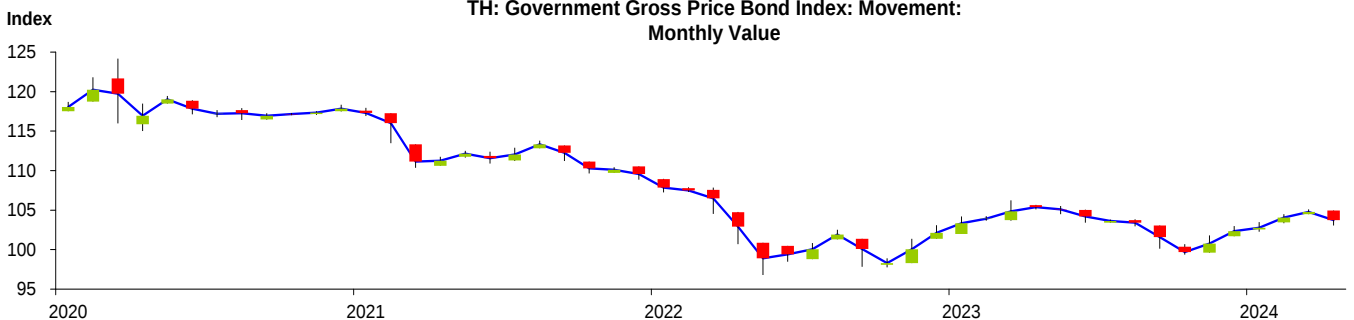
TH: Government Bond Yield:
Difference by Time to Maturity:
Month-End Value



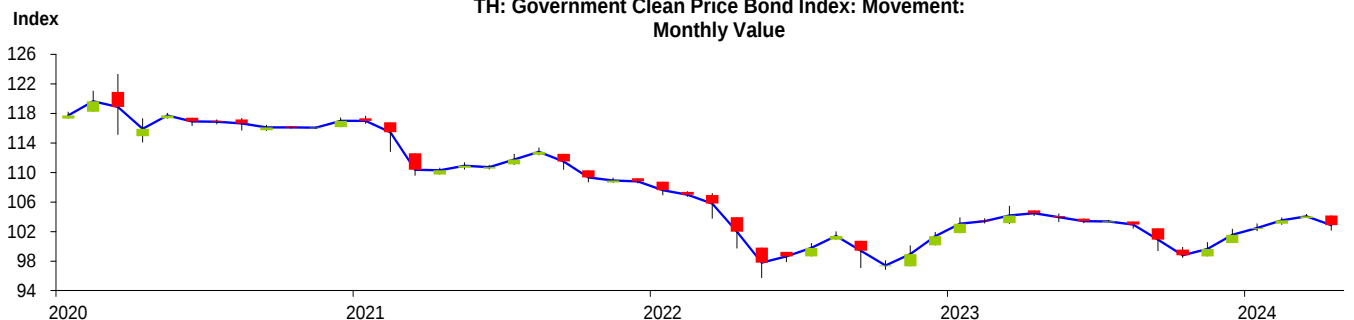
TH: Government Total Return Bond Index: Movement:
Monthly Value



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



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



Trading Value by Transaction in Apr-24

Transaction	Monthly			Daily Average		
	Bn THB	% YoY	% MoM	Bn THB	% YoY	% MoM
Outright	1,495.7	27.9	6.4	83.1	20.8	24.1
-Domestic Companies						
-Buy	1,451.6	30.3	8.5	80.6	23.1	26.6
-Sell	1,426.1	30.5	7.3	79.2	23.2	25.2
-Net	25.5					
-Foreign Companies						
-Buy	44.1	-20.5	-35.4	2.5	-24.9	-24.6
-Sell	69.6	-8.8	-9.9	3.9	-13.8	5.1
-Net	-25.5					
Financing	24,772.7	9.8	-6.8	1,376.3	3.7	8.7
-Bilateral Repo	18,457.9	9.3	-8.1	1,025.4	3.2	7.2
-Private Repo	6,303.4	11.2	-2.9	350.2	5.1	13.3
-Others	11.4	24.7	21.3	0.6	17.8	41.6
Others	15.1	180.7	-5.0	0.8	165.1	10.8
Total	26,283.5	10.8	-6.2	1,460.2	4.6	9.5

Trading Value by Transaction in 4M/24

Transaction	4M/24		Daily Average	
	Bn THB	% YoY	Bn THB	% YoY
Outright	5,952.0	9.4	73.5	8.1
-Domestic Companies				
-Buy	5,689.7	12.9	70.2	11.5
-Sell	5,635.7	11.8	69.6	10.4
-Net	54.0			
-Foreign Companies				
-Buy	262.3	-34.3	3.2	-35.2
-Sell	316.3	-20.4	3.9	-21.4
-Net	-54.0			
Financing	106,333.1	3.5	1,312.8	2.2
-Bilateral Repo	80,851.7	8.9	998.2	7.5
-Private Repo	25,437.8	-10.6	314.0	-11.7
-Others	43.7	0.0	0.5	84.8
Others	90.1	291.0	1.1	286.2
Total	112,375.2	3.9	1,387.3	2.6

Outstanding Value by Issuer and Time to Maturity as of 30 Apr 2024

Issuer (Bn THB)	Time to Maturity (TTM)					Total
	TTM<1	1-5	5-10	10-15	15-50	
Government Bond	440.0	1,281.4	1,293.4	1,816.0	3,989.2	8,820.0
BOT Bond	1,797.3	556.1	0.0	0.0	0.0	2,353.4
State Enterprise Bond	0.0	111.8	351.7	317.3	294.2	1,075.1
Corporate Bond	261.8	1,896.9	1,108.6	1,082.3	307.4	4,656.8
Foreign Bond	0.0	27.2	13.2	31.8	7.0	79.2
Total	2,499.1	3,873.4	2,766.9	3,247.3	4,597.8	16,984.5

Government Bond Yield Curve (%)

Time to Maturity (TTM)	30/4/2023	31/12/2023	31/3/2024	30/4/2024			
				Rate	Change (bp)		
					YoY	MoM	YTD
1M	1.50	2.01	2.24	2.25	0.76	0.01	0.24
3M	1.61	2.11	2.28	2.26	0.66	-0.02	0.15
6M	1.70	2.26	2.28	2.29	0.60	0.01	0.04
1Y	1.80	2.37	2.24	2.29	0.49	0.05	-0.08
2Y	1.90	2.34	2.15	2.37	0.47	0.22	0.03
3Y	2.00	2.36	2.16	2.43	0.42	0.26	0.07
4Y	2.07	2.42	2.20	2.50	0.43	0.31	0.09
5Y	2.16	2.45	2.24	2.57	0.42	0.33	0.12
6Y	2.25	2.51	2.29	2.63	0.38	0.33	0.12
7Y	2.34	2.59	2.36	2.69	0.35	0.32	0.10
8Y	2.45	2.63	2.42	2.75	0.29	0.33	0.12
9Y	2.49	2.67	2.49	2.79	0.31	0.30	0.12
10Y	2.54	2.70	2.51	2.78	0.24	0.27	0.08
11Y	2.59	2.71	2.55	2.83	0.24	0.28	0.12
12Y	2.64	2.73	2.62	2.95	0.30	0.33	0.21
13Y	2.74	2.87	2.68	3.00	0.26	0.32	0.13
14Y	2.76	2.94	2.74	3.04	0.29	0.31	0.11
15Y	2.87	3.01	2.77	3.08	0.21	0.31	0.07
16Y	2.91	3.03	2.81	3.12	0.21	0.31	0.09
17Y	2.93	3.06	2.84	3.16	0.23	0.32	0.10
18Y	2.96	3.08	2.87	3.20	0.24	0.33	0.12
19Y	2.98	3.11	2.97	3.29	0.30	0.32	0.17
20Y	3.00	3.18	3.02	3.31	0.31	0.29	0.13
21Y	3.03	3.27	3.06	3.32	0.29	0.27	0.06
22Y	3.06	3.36	3.09	3.33	0.27	0.24	-0.02
23Y	3.09	3.42	3.12	3.34	0.25	0.23	-0.08
24Y	3.10	3.45	3.14	3.35	0.25	0.21	-0.10
25Y	3.10	3.48	3.16	3.35	0.25	0.19	-0.13
26Y	3.10	3.49	3.18	3.36	0.26	0.18	-0.13
27Y	3.10	3.49	3.20	3.38	0.28	0.18	-0.12
28Y	3.10	3.49	3.22	3.39	0.29	0.17	-0.10
29Y	3.10	3.50	3.23	3.41	0.31	0.18	-0.09
30Y	3.15	3.51	3.24	3.44	0.29	0.20	-0.07
31Y	3.20	3.53	3.25	3.46	0.26	0.22	-0.06
32Y	3.26	3.55	3.29	3.50	0.25	0.21	-0.05
33Y	3.31	3.60	3.34	3.54	0.23	0.20	-0.06
34Y	3.36	3.64	3.39	3.58	0.22	0.19	-0.06
35Y	3.42	3.69	3.44	3.62	0.20	0.18	-0.07
36Y	3.47	3.73	3.49	3.66	0.19	0.17	-0.07
37Y	3.52	3.78	3.54	3.70	0.17	0.15	-0.08
38Y	3.58	3.80	3.56	3.71	0.13	0.15	-0.09
39Y	3.59	3.80	3.56	3.71	0.12	0.15	-0.09
40Y	3.59	3.80	3.56	3.71	0.12	0.15	-0.09
41Y	3.59	3.80	3.57	3.72	0.13	0.15	-0.09
42Y	3.59	3.80	3.57	3.72	0.13	0.15	-0.08
43Y	3.59	3.82	3.57	3.74	0.15	0.17	-0.08
44Y	3.60	3.84	3.57	3.75	0.15	0.18	-0.10
45Y	3.60	3.85	3.57	3.75	0.15	0.18	-0.10
46Y	3.60	3.85	3.56	3.75	0.14	0.18	-0.10
47Y	3.61	3.85	3.56	3.75	0.14	0.19	-0.10
48Y	3.61	3.85	3.56	3.75	0.13	0.19	-0.10
49Y	3.62	4.27	-	-	-	-	-

TH Bond Indexes as of 30 Apr 2024

	Index	Change			
		From 31 Dec 2023 (Point)	% YoY	% MoM	% YTD
Bond Composite Index					
Total Return Index	206.49	7.78	1.6	-1.3	0.8
Gross Price Index	105.57	0.49	-1.3	-1.4	0.3
Clean Price Index	104.70	-0.02	-1.4	-1.5	-0.2
Average Yield (%)	3.19	0.08			
Government Bond Index					
Total Return Index	316.60	12.50	0.9	-1.7	0.7
Gross Price Index	103.15	1.19	-1.9	-1.7	0.6
Clean Price Index	102.17	0.37	-1.9	-1.9	-0.2
Average Yield (%)	3.11	0.03			
MTM Corporate Bond A- Index					
Total Return Index	212.37	8.03	3.0	-0.4	1.0
Gross Price Index	105.97	-0.58	-0.3	-0.7	-0.2
Clean Price Index	105.36	-0.51	-0.3	-0.7	-0.1
Average Yield (%)	3.63	0.30			

ตราสารหนี้:

จุดสูงสุดและต่ำสุดในแต่ละช่วงเวลา ในระยะเวลา 11 ปี (ปี 2557-67)

Bn THB	ค่าปัจจุบัน	% ค่าสูงสุด	% ค่าต่ำสุด	ค่าสูงสุด	Date	ค่าต่ำสุด	Date
มูลค่าซื้อขาย							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
เม.ย. 67	26,283.5	-16.4	48.4	31,427.4	มี.ค. 64	17,708.0	ก.พ. 62
Q1/67	86,091.7	-	49.3	86,091.7	Q1/67	57,649.7	Q3/58
2566	325,224.1	-	36.2	325,224.1	2566	238,710.4	2562
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
เม.ย. 67	26,283.5	-14.0	38.2	30,569.8	เม.ย. 63	19,020.6	เม.ย. 62
4M/67	112,375.2	-	42.0	112,375.2	4M/67	79,114.2	4M/58
Q1/67	86,091.7	-	43.3	86,091.7	Q1/67	60,093.7	Q1/62
มูลค่าตราสารหนี้							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
เม.ย. 67	16,984.5	-	89.1	16,985.5	เม.ย. 67	8,980.2	ม.ค. 57
Q1/67	16,938.9	-	84.6	16,938.9	Q1/67	9,177.5	Q1/57
2566	16,377.7	-	76.3	16,377.7	2566	9,287.3	2557
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
เม.ย. 67	16,984.5	-	85.9	16,985.5	เม.ย. 67	9,138.8	เม.ย. 57
Q1/67	16,938.9	-	84.6	16,938.9	Q1/67	9,177.5	Q1/57



ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล ณ วันที่ 30 เม.ย. 67:
จุดสูงสุดและต่ำสุดในแต่ละช่วงเวลา ในระยะเวลา 11 ปี (ปี 2557-67)

Index	ค่าปัจจุบัน	% ค่าสูงสุด	% ค่าต่ำสุด	ค่าสูงสุด	Date	ค่าต่ำสุด	Date
Total Return Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
เม.ย. 67	316.60	-5.0	40.9	333.12	ก.พ. 63	224.77	ม.ค. 57
Q1/67	322.05	-2.8	40.6	331.23	Q4/63	229.02	Q2/57
2566	314.39	-5.1	28.3	331.23	2563	244.96	2557
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
เม.ย. 67	316.60	-2.5	37.0	324.85	เม.ย. 63	231.17	เม.ย. 57
Q1/67	322.05	-	40.6	322.05	Q1/67	229.02	Q1/57
Gross Price Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
เม.ย. 67	103.15	-15.2	5.2	121.68	ก.พ. 63	98.07	ก.ย. 65
Q1/67	104.93	-12.4	7.0	119.78	Q3/62	98.07	Q3/65
2566	102.55	-12.8	0.6	117.58	2563	101.96	2565
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
เม.ย. 67	103.15	-13.0	2.3	118.50	เม.ย. 63	100.84	เม.ย. 65
Q1/67	104.93	-9.6	2.7	116.12	Q1/63	102.21	Q1/57
Clean Price Index							
เทียบกับทุกช่วงเวลา							
เม.ย. 67	102.17	-15.5	5.2	120.92	ก.พ. 63	97.14	ด.ค. 65
Q1/67	104.17	-12.3	7.1	118.83	Q3/62	97.30	Q3/65
2566	102.38	-12.8	0.6	117.37	2563	101.80	2565
เทียบกับช่วงเวลาเดียวกัน							
เม.ย. 67	102.17	-12.9	2.3	117.33	เม.ย. 63	99.84	เม.ย. 65
Q1/67	104.17	-9.6	1.4	115.19	Q1/63	102.74	Q1/57