|  |  |
| --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (28 มี.ค. – 1 เม.ย. 59)** |
|

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Thai BMA Market | 28 มี.ค. – 1 เม.ย. 59 | 21 – 25 มี.ค. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 1 เม.ย. 59 |
| มูลค่าการซื้อขายรวม(ล้านบาท) | 570,035.61 | 403,074.60 | 41.42% | 6,272,434.57 |
| มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 114,007.12 | 80,614.92 | 41.42% | 98,006.79 |
| ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 115.77 | 114.54 | 1.07% | - |
| ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 108.91 | 108.85 | 0.06% | - |

ภาพรวมตลาดตราสารหนี้หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 1 เม.ย. 59 มีจำนวน 3,190 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,236,401.42 ล้านบาท | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
|  การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 187,213 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย570,035.61 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 114,007.12 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 41.42 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 11.22 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 88.78 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 477 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 46 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 375 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 13 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
|

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ |
| ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท) | ร้อยละ |
| พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 149,060.00 | 79.62 |
| พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 |
| ตั๋วเงินคลัง | 5,000.00 | 2.67 |
| หุ้นกู้ภาคเอกชน  | 33,153.20 | 17.71 |
| พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 0.00 | 0.00 |
| รวม | 187,213 | 100.00 |
|  |  |  |

 |

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 395,176.00 | 73.17 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 105,861.00 | 19.60 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 39,018.00 | 7.22 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 540,055.00 | 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.** |
|  21 - 25 มี.ค. 59 |   |   |   | 1.37 | 1.39 | 1.39 | 1.53 | 1.65 | 1.84 | 2.01 | 2.19 | 2.30 | 2.30 | 2.30 |
|  28 มี.ค. - 1 เม.ย. 59 |   |   |   | 1.38 | 1.37 | 1.37 | 1.49 | 1.53 | 1.63 | 1.86 | 2.07 | 2.13 | 2.12 | 2.11 |
| เปลี่ยนแปลง (bp.) | - | - | - |  1 | -2 | -2 | -4 | -12 | -21 | -15 | -12 | -17 | -18 | -19 |

 |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** |
|  ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลงเกือบทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะตราสารอายุ 10 ปี ปรับลดลง 21 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 2-5 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -4 ถึง -2 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 7-15 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -21 ถึง -12 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 18-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -19 ถึง -17 bp. ทั้งนี้ ตลาดมีความต้องการตราสารระยะยาวอยู่ค่อนข้างมาก และมีความกังวลถึงจำนวน Supply ในตลาด โดยจะมีการประมูลพันธบัตรรัฐบาลรุ่นอายุ 30 ปี จำนวน 10,000 ล้านบาท และภายใน 2 เดือนข้างหน้าจะมีการประมูลตราสารระระยาวอีก 30 ปีขึ้นไปอีกเพียง 2 ครั้งเท่านั้น คือ พันธบัตรรุ่นอายุ 50 ปี และอายุ 30 ปี ด้านปัจจัยต่างประเทศ ได้แก่ ประธานธนาคารกลางสหรัฐฯ (FED) ส่งสัญญาณว่าจะยังคงขึ้นอัตราดอกเบี้ยอย่างค่อยเป็นค่อยไป ส่งผลให้ตลาดคาดการณ์ว่า FED น่าจะยังไม่ขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายในการประชุม FOMC ในวันที่ 26-27 เม.ย. นี้ ส่งผลต่อกระแสเงินไหลเข้ามายังตลาดเกิดใหม่ รวมถึงรายงานตัวเลขการจ้างงานภาคเอกชนของสหรัฐฯ เดือน มี.ค. ปรับเพิ่มขึ้น 200,000 ตำแหน่ง เท่ากับที่ตลาดคาดการณ์ไว้ ซึ่งตลาดติดตามรายงานดัชนีราคาผู้ผลิต เดือน ก.พ. ของสหภาพยุโรป โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 25,241 ล้านบาทสำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (4 - 8 เม.ย. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ ดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภค เดือน มี.ค. ตลาดหุ้นไทยปิดทำการเนื่องในวันจักรี สำหรับปัจจัยภายนอก ได้แก่ การรายงานการประชุม Fed Minutes ของสหรัฐฯ GDP ไตรมาส 1 ปี 2016 ของสิงคโปร์ การประชุมธนาคารกลางของออสเตรเลียและอินเดีย การปิดทำการของตลาดหุ้นไต้หวัน จีน ฮ่องกง และอินเดีย  |
|  |