|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (21 - 25 มี.ค. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 21 – 25 มี.ค. 59 | 14 – 18 มี.ค. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 25 มี.ค. 59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 403,074.60 | 572,482.14 | -29.59% | 5,702,398.96 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 80,614.92 | 114,496.43 | -29.59% | 96,650.83 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 114.54 | 114.53 | 0.01% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 108.85 | 108.84 | 0.01% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 25 มี.ค. 59  มีจำนวน 3,174 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,186,455.77 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 206,000 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  403,074.60 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 80,614.92 ล้านบาทต่อวัน ลดลงจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 29.59 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 7.41 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 92.59 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ มีการซื้อขายจำนวน 1 หลักทรัพย์ มูลค่าประมาณ 0.2 ล้านบาท (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 478 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 47 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 375 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 13 หลักทรัพย์ และกองทุน ที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ | | | | ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท) | ร้อยละ | | พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 185,000.00 | 89.91 | | พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 | | ตั๋วเงินคลัง | 15,000.00 | 7.28 | | หุ้นกู้ภาคเอกชน | 6,000.00 | 2.91 | | พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 0.00 | 0.00 | | รวม | 206,000 | 100.00 | |  |  |  | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 256,819.00 | 68.58 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 85,076.00 | 22.72 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 32,585.00 | 8.70 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 374,480.00 | 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.** | | 14 - 18 มี.ค. 59 |  |  |  | 1.36 | 1.39 | 1.39 | 1.53 | 1.60 | 1.81 | 1.99 | 2.17 | 2.30 | 2.29 | 2.29 | | 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 | | เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - | 1 | 0 | 0 | 0 | 5 | 3 | 2 | 2 | 0 | 1 | 1 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยลดลงเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวเพิ่มขึ้นเกือบทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะตราสารอายุ 10 ปี ปรับเพิ่มขึ้น 3 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1ปี และอายุ 19-20 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 2-5 ปี และอายุ 18 ปี ไม่มีการปรับตัว และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 7-15 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 2 ถึง 5 bp. ทั้งนี้ คณะกรรมการนโยบายการเงิน (กนง.) มีมติเป็นเอกฉันท์ให้คงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ 1.50% ต่อปี ซึ่งเป็นไปตามคาด และปรับลด GDP ปีนี้เหลือเติบโต 3.1% จากเดิมที่คาดไว้ที่ 3.5% เนื่องจากการส่งออกชะลอตัวลงมากกว่าที่คาด ด้านปัจจัยต่างประเทศ FED ได้ออกมาส่งสัญญาณว่ามีความเป็นไปได้ที่อาจจะมีการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายเดือนหน้า จากตัวเลขเศรษฐกิจของสหรัฐฯ ที่มีแนวโน้มปรับตัวขึ้นซึ่งสอดคล้องกับตัวเลขผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานของสหรัฐฯ ที่ปรับเพิ่มขึ้นเพียง 60,000 ราย มาอยู่ที่ 265,000 ราย ส่วนเหตุระเบิดในประเทศเบลเยียม ไม่ได้ส่งผลกระทบต่อตลาดตราสารหนี้ของไทย และตลาดยังคงติดตามรายงานดัชนีผู้จัดการฝ่ายจัดซื้อภาคบริการ-รวมภาคการผลิตและบริการ เดือน มี.ค. ของสหรัฐฯ โดยตัวเลขดังกล่าวหากออกมาดีกว่าคาด น่าจะเพิ่มความมั่นใจของตลาดที่มีต่อการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยของ FED โดยนักลงทุนต่างชาติขายสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 16,091 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (28 มี.ค. – 1 เม.ย. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ การส่งออก ดัชนีผลผลิตอุตสาหกรรมและอัตราการใช้กำลังการผลิต และ ธปท. รายงานภาวะเศรษฐกิจ เดือน ก.พ. และอัตราเงินเฟ้อ เดือน มี.ค. สำหรับปัจจัยภายนอก ได้แก่ GDP ไตรมาส 4 ปี 2015 และการจ้างงานภาคเอกชน นอกภาคเกษตรและอัตราการว่างงาน เดือน มี.ค. ของสหรัฐฯ ตลาดหุ้นปิดทำการของ สหรัฐฯ ญี่ปุ่น สิงคโปร์ ฟิลิปปินส์ อินโดนีเซีย และอินเดีย เนื่องในวัน Good Friday และอัตราเงินเฟื้อ เดือน มี.ค. ของยูโรโซน | | |
|  | | |