|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (7 - 11 มี.ค. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 7 - 11 มี.ค. 59 | 29 ก.พ. – 4 มี.ค. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 11 มี.ค. 59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 568,946.59 | 491,527.37 | 15.75% | 4,726,842.23 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 113,789.32 | 98,305.47 | 15.75% | 96,466.17 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 113.63 | 112.83 | 0.71% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 108.63 | 108.55 | 0.07% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 11 มี.ค. 59  มีจำนวน 3,140 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,056,714.58 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 134,102 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  568,946.59 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 113,789.32 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 15.75 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 10.06 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 89.94 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 478 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 47 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 376 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 12 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ | | | | ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท) | ร้อยละ | | พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 80,000.00 | 71.68 | | พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 | | ตั๋วเงินคลัง | 20,732.00 | 18.58 | | หุ้นกู้ภาคเอกชน | 20,370.00 | 7.05 | | พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 3,000.00 | 2.69 | | รวม | 134,102 | 100.00 | |  |  |  | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 402,338.00 | 74.26 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 123,037.00 | 22.71 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 16,391.00 | 3.03 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 541,766.00 | 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.** | | 29 ก.พ. - 4 มี.ค. 59 |  |  |  | 1.42 | 1.47 | 1.49 | 1.65 | 1.74 | 1.95 | 2.19 | 2.38 | 2.52 | 2.51 | 2.51 | | 7 - 11 มี.ค. 59 |  |  |  | 1.40 | 1.46 | 1.50 | 1.61 | 1.72 | 1.97 | 2.12 | 2.30 | 2.43 | 2.45 | 2.47 | | เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - | -2 | -1 | 1 | -4 | -2 | 2 | -7 | -8 | -9 | -6 | -4 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลงเกือบทุกช่วงอายุ ประมาณ 2-6 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-3 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -2 ถึง -1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5-10 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -4 ถึง 2 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 12-18 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -9 ถึง -7 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 19-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -6 ถึง -4 bp. ทั้งนี้ ในสัปดาห์ที่ผ่านมา ตลาดได้รับผลกระทบจากการประมูลพันธบัตรรัฐบาล ได้แก่ การประมุลพันธบัตรรุ่นอายุ 50 ปี (LB666A) จำนวน 10,000 ล้านบาท ซี่งมีความต้องการสูงกว่าวงเงินประมูลถึง 3.21 เท่า ส่งผลให้อัตราผลตอบแทนพันธบัตรอยู่ที่ 3.24% ลดลงจากวันก่อน 25 bp. และส่งผลต่ออัตราผลตอบแทนในระยะยาวตั้งแต่รุ่น 30 ปีขึ้นไป ปรับตัวลดลง 5-15 bp. แต่ตลาดยังเตรียมประมูลพันธบัตรรุ่นอายุ 15 ปี (LB296A) จำนวน 10,000 ล้านบาท ทำให้อัตราผลตอบแทนปรับตัวเพิ่มขึ้น 3-4 bp. ด้านปัจจัยต่างประเทศ จีนรายงานยอดส่งออกเดือน ก.พ. ปรับตัวลดลง 25.4% เมื่อเทียบกับช่วงเดียวกันของปีก่อน และต่ำกว่าที่คาดไว้ 12.5% ส่งผลต่อตลาดหลักทรัพย์ไทยที่ปรับลดลง 21.13 จุด ส่วนด้านการประชุม ECB ได้มีมติปรับลดดอกเบี้ยนโยบายสู่ระดับ 0% จากระดับก่อนหน้านี้ 0.05% รวมทั้งตลาดยังติดตามการประชุมของ BOJ ที่คาดว่าน่าจะยังคงดอกเบี้ยเงินฝากที่ธนาคารพาณิชย์นำมาฝากไว้กับ BOJ ที่ -0.1% โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 47,608 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (14 - 18 มี.ค. 59) ปัจจัยที่ต้องติดตาม ได้แก่ GDP อัตราเงินเฟ้อ เดือน ก.พ. ของยูโรโซน การประชุมธนาคารกลางของญี่ปุ่นและอินโดนีเซีย การประชุม FOMC ของสหรัฐฯ ยอดค้าปลีกและ Housing starts, Building permits เดือน ก.พ. ของสหรัฐฯ | | |
|  | | |