|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (8 - 12 ก.พ. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 8 – 12 ก.พ. 59 | 1 - 5 ก.พ. 58 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 12 ก.พ.59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 449,665.58 | 480,051.60 | -6.33% | 2,796,840.84 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 89,931.12 | 96,010.32 | -6.33% | 93,228.03 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 111.52 | 110.08 | 1.31% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 108.41 | 108.05 | 0.33% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 12 ก.พ. 59  มีจำนวน 3,111 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,052,172.45 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 81,200 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  449,665.58 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 89,931.12 ล้านบาทต่อวัน ลดลงจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 6.33 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 8.63 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 91.36 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ มีการซื้อขาย 2 หลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 490 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 48 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 385 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 14 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ | | | | ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท) | ร้อยละ | | พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 80,000.00 | 98.52 | | พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 | | ตั๋วเงินคลัง | 0.00 | 0.00 | | หุ้นกู้ภาคเอกชน | 200.00 | 0.25 | | พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 1,000.00 | 1.23 | | รวม | 81,200 | 100.00 | |  |  |  | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 301,934.00 | 70.63 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 112,649.00 | 26.35 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 12,922.00 | 3.02 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 427,505.00 | 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.** | | 1 - 5 ก.พ. 59 | - | - | - | 1.45 | 1.49 | 1.57 | 1.93 | 2.08 | 2.30 | 2.55 | 2.72 | 2.89 | 2.89 | 2.90 | | 8 - 12 ก.พ. 59 |  |  |  | 1.41 | 1.48 | 1.52 | 1.78 | 1.92 | 2.06 | 2.34 | 2.55 | 2.73 | 2.73 | 2.74 | | เปลี่ยนแปลง (bp.) | - | - | - | -4 | -1 | -5 | -15 | -16 | -24 | -21 | -17 | -16 | -16 | -16 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยลดลงเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลงทุกช่วงอายุ ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-3 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -5 ถึง -1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5-10 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -24 ถึง -15 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 12-15 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -21 ถึง -17 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 18-20 ปี ปรับตัวอยู่ที่ -16 bp. ทั้งนี้ จากการที่ตลาดรับรู้ Sentiment ในเชิงลบ ไม่ว่าจะเป็นรายงานตัวเลขการจ้างงานนอกภาคการเกษตรของสหรัฐฯ เดือน ม.ค. ซึ่งปรับเพิ่มขึ้นเพียง 151,000 ตำแหน่ง น้อยกว่าที่ตลาดคาดไว้ที่ 200,000 ตำแหน่ง โดยนักลงทุนเริ่มเข้าถือสินทรัพย์ปลอดภัยที่ไม่ใช่เงินดอลลาร์สหรัฐฯ มีผลทำให้ดัชนี Nikkei ปรับลดลง 918.86 จุด อยู่ที่ 16,085.44 จุด (5.40%) และมีการเข้าซื้อพันธบัตรรัฐบาลญี่ปุ่นอายุ 10 ปี กดดันให้อัตราผลตอบแทนพันธบัตรปรับลดลงระดับต่ำสุดที่ -0.08% ส่วนค่าเงินเยนแข็งค่าขึ้นระดับ 115.41 เยน/ดอลลาร์สหรัฐฯ (แข็งค่าขึ้น 0.43 เยน หรือ 0.37%) รวมถึงประธาน FED ได้ส่งสัญญาณชะลอการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยในการประชุม FOMC ในเดือน มี.ค. จากการที่เศรษฐกิจโลกมีแนวโน้มชะลอตัวซึ่งอาจส่งผลต่อเศรษฐกิจสหรัฐฯ นักลงทุนจึงเริ่มกระจายการลงทุนกลับเข้าสู่กลุ่มประเทศ Emerging Market อีกครั้ง โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 13,987 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (15 - 19 ก.พ. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ GDP ไตรมาส 4 ปี 2015 สำหรับปัจจัยภายนอก ได้แก่ **อัตราเงินเฟ้อ เดือน ม.ค. ของจีนและสหรัฐฯ การประชุมธนาคารกลางของเกาหลีใต้และอินโดนีเซีย ดุลการค้า เดือน ม.ค. ของจีน และ** GDP **ไตรมาส 4 ปี 2015 ของไต้หวัน ญี่ปุ่น และสิงคโปร์** | | |
|  | | |