|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (1 - 5 ก.พ. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 1 – 5 ก.พ. 59 | 25 – 29 ม.ค. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 5 ก.พ. 59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 480,051.60 | 480,229.26 | -0.04% | 2,347,185.26 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 96,010.32 | 96,045.85 | -0.04% | 93,887.41 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 110.08 | 109.67 | 0.37% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 108.05 | 108.17 | -0.11% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 5 ก.พ. 59  มีจำนวน 3,117 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,082,130.24 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 91,995 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  480,015.60 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 96,010.32 ล้านบาทต่อวัน ลดลงจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 0.04 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 8.70 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 91.30 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (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 | 86.96 | | พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 | | ตั๋วเงินคลัง | 0.00 | 0.00 | | หุ้นกู้ภาคเอกชน | 11,995.00 | 13.04 | | พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 0.00 | 0.00 | | รวม | 91,995 | 100.00 | |  |  |  | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 359,667.00 | 78.33 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 85,840.00 | 18.69 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 13,690.00 | 2.98 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 459,197.00 | 100.00 | | \* เฉพาะธุรกรรม Outright ซึ่งหมายถึงการซื้อขายตราสารหนี้ที่เป็นการขายขาด | | | |
| |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | | **ThaiBMA Reference Yield (Interpolation)** | | | | | | | | | | | | | | | |  | **1Mth.** | **3Mth.** | **6Mth.** | **1 Yr.** | **2 Yr.** | **3 Yr.** | **5 Yr.** | **7 Yr.** | **10 Yr.** | **12 Yr.** | **15 Yr.** | **18 Yr.** | **19 Yr.** | **20 Yr.** | | 25 - 29 ม.ค.59 | - | - | - | 1.46 | 1.50 | 1.55 | 1.92 | 2.11 | 2.36 | 2.60 | 2.81 | 2.95 | 2.95 | 2.96 | | 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 | | เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - | -1 | -1 | 2 | 1 | -3 | -6 | -5 | -9 | -6 | -6 | -6 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยลดลงเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลงเกือบทุกช่วงอายุ ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-3 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -1 ถึง 2 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5-7 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -3 ถึง 1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 10 ปี และ 18-20 ปี ปรับตัวอยู่ที่ -6 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 12-15 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -9 ถึง -5 bp. ทั้งนี้ เป็นผลต่อเนื่องจากการที่ธนาคารกลางญี่ปุ่นใช้นโยบายอัตราดอกเบี้ยติดลบ 0.1% ในวันศุกร์ที่ 29 ม.ค. ที่ผ่านมา สำหรับการประชุมคณะกรรมการนโยบายการเงิน (กนง.) เมื่อวันพุธที่ผ่านมามีมติเป็นเอกฉันท์ให้คงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ 1.50% ต่อปี โดยเห็นว่าเศรษฐกิจไทยไตรมาส 4 ปี 2015 ได้ทยอยฟื้นตัวต่อเนื่องใกล้เคียงกับที่ประเมินไว้ ด้านปัจจัยต่างประเทศ ผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานประจำสัปดาห์ของสหรัฐฯ เพิ่มขึ้น 8,000 ราย อยู่ที่ 285,000 ราย สูงกว่าที่ตลาดคาดการณ์ไว้ที่ 280,000 ราย และตัวเลขการจ้างงานนอกภาคเกษตรประจำเดือน ม.ค. เพิ่มขึ้น 151,000 ตำแหน่ง ต่ำกว่าที่ตลาดคาดการณ์ไว้ที่ประมาณ 200,000 ตำแหน่ง ทำให้นักลงทุนคาดว่า สหรัฐฯ น่าจะยังไม่พิจารณาปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายในเร็วๆ นี้ ทั้งนี้ ตลาดยังติดตามตัวเลขสต็อกน้ำมันรายสัปดาห์ของสหรัฐฯ โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 15,569 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (8 – 12 ก.พ. 59) ปัจจัยที่ต้องติดตาม ได้แก่ GDP ไตรมาส 4 ปี 2015 ของอินเดียและยูโรโซน ยอดสินเชื่อเดือน ม.ค. ของจีน ยอดค้าปลีก เดือน ม.ค. ของสหรัฐฯ การประชุมธนาคารกลางของฟิลิปปินส์ และ Industrial Production เดือน ธ.ค. ของยูโรโซน | | |
|  | | |