|  |  |
| --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (4 - 8 ม.ค. 59)** |
|

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Thai BMA Market | 4 - 8 ม.ค. 59 | 28 - 30 ธ.ค. 58 | เปลี่ยนแปลง | 1 - 8 ม.ค. 59 |
| มูลค่าการซื้อขายรวม(ล้านบาท) | 530,034.66 | 200,988.63 | 163.71% | 530,034.66 |
| มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 106,006.93 | 66,996.21 | 58.23% | 106,006.93 |
| ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 108.07 | 108.42 | -0.32% | - |
| ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.45 | 107.68 | -0.21% | - |

ภาพรวมตลาดตราสารหนี้หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 8 ม.ค. 59 มีจำนวน 3,035 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,120,487.03 ล้านบาท | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
|  การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 149,369 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย530,034.66 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 106,006.93 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 58.23 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 9.99 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 90.01 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 | 144,369.00 | 96.65 |
| พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 |
| ตั๋วเงินคลัง | 5,000.00 | 3.35 |
| หุ้นกู้ภาคเอกชน  | 0.00 | 0.00 |
| พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 0.00 | 0.00 |
| รวม | 149,369 | 100.00 |
|  |  |  |

 |

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 374,320.00 | 76.66 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 102,390.00 | 20.97 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 11,581.00 | 2.37 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 488,291.00 | 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.** |
| 28 - 30 ธ.ค.58 | - | - | - | 1.50 | 1.57 | 1.73 | 2.16 | 2.37 | 2.51 | 2.76 | 2.94 | 3.12 | 3.14 | 3.16 |
| 4 - 8 ม.ค. 59 |   |   |   | 1.49 | 1.59 | 1.75 | 2.21 | 2.45 | 2.62 | 2.80 | 3.00 | 3.15 | 3.16 | 3.18 |
| เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - |  -1 | 2 | 2 | 5 | 8 | 11 | 4 | 6 | 3 | 2 | 2 |

 |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** |
|  ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวเพิ่มขึ้น เกือบทุกช่วงอายุประมาณ 2-11 bp. ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 ปี ปรับตัวอยู่ที่ -1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 2-3 ปี และ 19-20 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 2 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5-10 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่างที่ 5 ถึง 11 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 12-18 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง 3 ถึง 6 bp. ทั้งนี้ ได้รับผลกระทบจากในช่วงต้นสัปดาห์จากการขายทำกำไรของกองทุนรวม รวมถึงมีตารางการประมูลพันธบัตรอายุ 10 ปี (LB25DA) จำนวน 14,000 ล้านบาทในวันพุธ สำหรับปัจจัยต่างประเทศ ดัชนีผู้จัดการฝ่ายจัดซื้อ (PMI) ภาคการผลิตของจีน เดือน ธ.ค. ลดลงสู่ระดับ 48.2 จาก 48.6 ในเดือน พ.ย. ซึ่งแสดงถึงภาวะหดตัวของภาคการผลิตและต่ำกว่าที่ตลาดคาดการณ์ไว้มากที่ 48.9 ส่งผลต่อตลาดหลักทรัพย์ใน Emerging Market โดยดัชนีตลาดหลักทรัพย์ไทยปิดลดลง 24.61 จุด อยู่ที่ 1,263.41 จุด (ลดลง 1.91% จากวันก่อนหน้า) ขณะที่ราคาน้ำมันดิบปรับตัวขึ้นมาอยู่ที่ 37.17 ดอลลาร์/บาร์เรล หลังจากที่ซาอุดิอาระเบียประกาศตัดสัมพันธ์การทูต กับอิหร่านจากเหตุการณ์ความไม่สงบ ด้านค่าเงินหยวนได้อ่อนค่าลงที่ระดับ 6.5032 หยวน/ดอลลาร์ หลังจากที่ธนาคารกลางจีนปรับเปลี่ยนการอ้างอิงเงินหยวนเป็น ระบบตะกร้าเงินอิงกับสกุลเงินคู่ค้า 13 ประเทศจากที่อ้างอิงแค่ดอลลาร์สหรัฐฯ โดยนักลงทุนต่างชาติขายสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 2,266 ล้านบาทสำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (11 – 15 ม.ค. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ TISCO ประกาศผลประกอบการปี 2015 สำหรับปัจจัยภายนอก ได้แก่ **ดุลการค้า เดือน ธ.ค. ของจีน การประชุมธนาคารกลางของยูโรโซนและเกาหลีใต้ และยอดค้าปลีก เดือน ธ.ค. และการรายงาน** Beige Book **ของสหรัฐฯ** |
|  |