|  |  |
| --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (28 - 30 ธ.ค. 58)** |
|

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Thai BMA Market | 28 - 30 ธ.ค. 58 | 21 - 25 ธ.ค. 58 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 30 ธ.ค. 58 |
| มูลค่าการซื้อขายรวม(ล้านบาท) | 200,988.63 | 316,832.52 | -36.56% | 19,653,860.11 |
| มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 66,996.21 | 63,366.50 | 5.73% | 80,880.08 |
| ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 108.42 | 108.13 | 0.27% | - |
| ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.68 | 107.60 | 0.07% | - |

ภาพรวมตลาดตราสารหนี้หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 30 ธ.ค. 58 มีจำนวน 3,028 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,035,149.08 ล้านบาท | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
|  การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 16,500 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย200,988.63 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 66,996.21 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 5.73 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 7.92 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 92.08 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 3 วันทำการ สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 489 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 48 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 384 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 14 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
|

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ |
| ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท) | ร้อยละ |
| พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 0.00 | 0.00 |
| พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 |
| ตั๋วเงินคลัง | 14,000.00 | 84.85 |
| หุ้นกู้ภาคเอกชน  | 2,500.00 | 15.15 |
| พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 0.00 | 0.00 |
| รวม | 16,500 | 100.00 |
|  |  |  |

 |

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 151,858.00 | 84.24 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 24,453.00 | 13.57 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 3,953.00 | 2.19 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 180,264.00 | 100.00 |
| \* เฉพาะธุรกรรม Outright ซึ่งหมายถึงการซื้อขายตราสารหนี้ที่เป็นการขายขาด |

 |
|

|  |
| --- |
| **ThaiBMA Reference Yield (Interpolation)** |
|  | **1Mth.** | **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.** |
| 21 - 25 ธ.ค. 58 |   |   |   | 1.50 | 1.59 | 1.76 | 2.20 | 2.42 | 2.55 | 2.80 | 2.96 | 3.15 | 3.17 | 3.19 |
| 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 |
| เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - |  0 | -2 | -3 | -4 | -5 | -4 | -4 | -2 | -3 | -3 | -3 |

 |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** |
|  ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลง เกือบทุกช่วงอายุ ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 ปี ไม่มีการปรับตัว อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 2-5 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -4 ถึง -2 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 7-15 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่างที่ -5 ถึง -2 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 18-20 ปี ปรับตัวอยู่ที่ -3 bp. ทั้งนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลระยะยาวปรับตัวลดลงประมาณ 2-4 bp. โดยตราสารอายุ 10 ปี ลดลง 4 bp. จาก 2.55% ในสัปดาห์ก่อนหน้าเป็น 2.51% โดยในสัปดาห์ที่ผ่านมา ธปท. ปรับคาดการณ์เศรษฐกิจไทยปี 2558 ขยายตัว 2.8% สูงกว่าที่ตลาดคาดการณ์ไว้ที่ 2.7% เนื่องจากการลงทุนของภาครัฐและการบริโภคภาคเอกชนมีแนวโน้มสูงกว่าประมาณการเดิม อย่างไรก้ตาม กระทรวงพาณิชย์รายงานภาวะการค้าระหว่างประเทศเดือน พ.ย. โดยการส่งออกของไทยติดลบ 7.42% และนำเข้าติดลบ 9.35% เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า ซึ่งสะท้อนให้เห็นถึงภาวะเศรษฐกิจไทยที่ยังไม่ฟื้นตัว สำหรับปัจจัยต่างประเทศ สหรัฐฯ รายงานตัวเลขความเชื่อมั่นของผู้บริโภคเดือน ธ.ค. อยู่ที่ระดับ 96.5 เพิ่มขึ้นจากเดือนก่อนหน้าที่ระดับ 92.6 เนื่องจากตลาดแรงงานมีแนวโน้มแข็งแกร่งขึ้นในช่วงเดือนที่ผ่าน ทั้งนี้ ตลาดติดตามตัวเลขดัชนี PMI ภาคการผลิตเดือน ธ.ค. ของสหรัฐฯ ที่จะรายงานในสัปดาห์หน้า โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 844 ล้านบาทสำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (4 – 8 ธ.ค. 58) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ อัตราเงินเฟื้อ เดือน ธ.ค. ธปท. รายงานภาวะเศรษฐกิจเดือน พ.ย. สำหรับปัจจัยภายนอก ได้แก่ **ดัชนีราคาบ้าน** S&P/Case-Shiller Index **เดือน ต.ค. และ** Pending home sales **เดือน พ.ย. ของสหรัฐฯ และตลาดหุ้นปิดทำการของ ฟิลิปปินส์ ฮ่องกง อินโดนีเซีย และเกาหลีใต้** |
|  |