|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (14 - 18 มี.ค. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 14 - 18 มี.ค. 59 | 7 - 11 มี.ค. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 18 มี.ค. 59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 572,482.14 | 568,946.59 | 0.62% | 5,299,324.36 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 114,496.43 | 113,789.32 | 0.62% | 98,135.64 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 114.53 | 113.63 | 0.79% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 108.84 | 108.63 | 0.19% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 18 มี.ค. 59  มีจำนวน 3,161 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,187,720.77 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 126,290 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  572,482.14 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 114,496.43 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 0.62 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 10.51 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 89.49 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ มีการซื้อขายจำนวน 3 หลักทรัพย์ มูลค่าประมาณ 1.4 ล้านบาท (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 478 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 47 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 375 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 13 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ | | | | ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท) | ร้อยละ | | พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 80,000.00 | 63.35 | | พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 | | ตั๋วเงินคลัง | 15,000.00 | 11.88 | | หุ้นกู้ภาคเอกชน | 30,700.00 | 24.31 | | พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 590.00 | 0.47 | | รวม | 126,290 | 100.00 | |  |  |  | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 384,373.00 | 72.30 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 132,359.00 | 24.90 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 14,900.00 | 2.80 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 531,632.00 | 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.** | | 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 | | 14 - 18 มี.ค. 59 |  |  |  | 1.36 | 1.39 | 1.39 | 1.53 | 1.60 | 1.81 | 1.99 | 2.17 | 2.30 | 2.29 | 2.29 | | เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - | -4 | -7 | -11 | -8 | -12 | -16 | -13 | -13 | -13 | -16 | -18 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลงเกือบทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะตราสารอายุ 10 ปี ปรับลดลงถึง 16 bp. โดยอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-3 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -11 ถึง -4 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5-10 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -16 ถึง -8 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 12-18 ปี ปรับตัวอยู่ที่ -13 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 19-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -18 ถึง -16 bp. ทั้งนี้ เนื่องจากได้รับผลกระทบจากการประมูลพันธบัตรรัฐบาลอ้างอิงอายุ 15 ปี (LB296A) จำนวน 10,000 ล้านบาท และพันธบัตร ธปท. อายุ 3 ปี (BOT193A) จำนวน 40,000 ล้านบาท ซึ่งมีความต้องการสูงกว่าวงเงินประมูล 2.53 เท่า และ 4.26 เท่า ตามลำดับ ซึ่งสะท้อนให้เห็นความต้องการตราสารหนี้ในระยะยาวมีจำนวนมาก ด้านปัจจัยต่างประเทศ ได้แก่ การประชุมธนาคารกลางของญี่ปุ่นที่มีมติเสียงข้างมากให้คงอัตราดอกเบี้ยที่ธนาคารพาณิชย์นำมาฝากไว้กับธนาคารกลางไว้ที่ -0.1% และคงขนาด QE ไว้ที่ระดับ  80 ล้านล้านเยนต่อปี ส่วนการประชุมธนาคารกลางของสหรัฐฯ ที่ได้มีมติให้คงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ 0.25-0.50% ตามที่คาดไว้ และได้ลดคาดการณ์ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบาย 0.25% จำนวน 4 ครั้ง เหลือเพียง 2 ครั้ง ด้านราคาน้ำมัน WTI ในช่วงท้ายสัปดาห์กลับมาอยู่ที่ 40 ดอลลาร์/บาร์เรล หลังประเทศในกลุ่ม OPEC และผู้ผลิตนอกกลุ่มจะจัดการประชุมที่กาตาร์ในวันที่ 17 เม.ย.  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (21 – 25 มี.ค. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ การครบกำหนดชำระ license ของผู้ชนะประมูล 4G และการประชุมของ กนง. (คาดคงดอกเบี้ยที่ 1.5%) สำหรับปัจจัยภายนอก ได้แก่ GDP ไตรมาส 4 ปี 2015 ของสหรัฐฯ การประชุมธนาคารกลางของฟิลิปปินส์ ตลาดหุ้นปิดทำการของสหรัฐฯ ญี่ปุ่น สิงคโปร์ ฟิลิปปินส์ อินโดนีเซีย และอินเดีย เนื่องในวัน Good Friday และยอดขายบ้านเก่าและใหม่ เดือน ก.พ. ของสหรัฐฯ | | |
|  | | |