|  |  |
| --- | --- |
| 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% | - |

ภาพรวมตลาดตราสารหนี้หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 18 มี.ค. 59 มีจำนวน 3,161 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,187,720.77 ล้านบาท | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
|  การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 126,290 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย572,482.14 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 |
|  |