|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (29 ก.พ. – 4 มี.ค. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 29 ก.พ. – 4 มี.ค. 59 | 23 - 26 ก.พ. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 4 มี.ค.59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 491,527.37 | 381,077.10 | 28.98% | 4,157,895.64 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 98,305.47 | 95,269.27 | 3.19% | 94,497.63 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 112.83 | 111.56 | 1.14% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 108.55 | 108.33 | 0.20% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 4 มี.ค. 59  มีจำนวน 3,135 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,035,068.13 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 99,273 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  491,527.37 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 98,305.47 ล้านบาทต่อวัน ลดลงจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 3.19 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 8.84 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 91.16 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 479 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 47 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 377 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 12 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ | | | | ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท) | ร้อยละ | | พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 80,000.00 | 80.59 | | พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 | | ตั๋วเงินคลัง | 5,000.00 | 5.04 | | หุ้นกู้ภาคเอกชน | 14,273.00 | 14.38 | | พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 0.00 | 0.00 | | รวม | 99,273 | 100.00 | |  |  |  | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 340,140.00 | 72.64 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 118,127.00 | 25.23 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 9,981.00 | 2.13 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 468,248.00 | 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.** | | 23 - 26 ก.พ. 59 |  |  |  | 1.44 | 1.49 | 1.52 | 1.75 | 1.91 | 2.13 | 2.31 | 2.57 | 2.76 | 2.78 | 2.79 | | 29 ก.พ. - 4 มี.ค. 59 |  |  |  | 1.42 | 1.47 | 1.49 | 1.65 | 1.74 | 1.95 | 2.19 | 2.38 | 2.52 | 2.51 | 2.51 | | เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - | -2 | -2 | -3 | -10 | -17 | -18 | -12 | -19 | -24 | -27 | -28 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลงทุกช่วงอายุ โดยเฉพาะตราสารรุ่นอายุ 10 ปี ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-3 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -3 ถึง -2 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5-10 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -18 ถึง -10 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 12-15 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -19 ถึง -12 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 18-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -28 ถึง -24 bp. ทั้งนี้ ในสัปดาห์ที่ผ่านมา ตลาดได้รับผลกระทบหลักจากปัจจัยต่างประเทศ ได้แก่ ธนาคารกลางจีนประกาศปรับลดสัดส่วนการกันสำรองของธนาคารพาณิชย์ลง 0.5% ซึ่งนโยบายนี้ได้มีผลบังคับใช้ในวันที่ 1 มี.ค. ที่ผ่านมา ขณะที่สหรัฐฯ รายงานตัวเลขการจ้างงานภาคเอกชน เดือน ก.พ. ปรับเพิ่มขึ้น 214,000 ตำแหน่ง สูงกว่าที่คาดไว้ 190,000 ตำแหน่ง โดยทั้ง 2 ปัจจัยได้ส่งผลกระทบเชิงบวกต่อตลาดตราสารหนี้ และช่วงท้ายสัปดาห์ สหรัฐฯ ได้รายงานตัวเลขผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานครั้งแรกรายสัปดาห์ ปรับเพิ่มขึ้น 6,000 ราย  สู่ระดับ 278,000 ราย สูงกว่าที่คาดไว้ 271,000 ราย ซึ่งส่งสัญญาณว่าภาคแรงงานยังคงมีการชะลอตัว และตลาดยังติดตามการประชุมของคณะกรรมการนโยบายการเงินของ ECB  โดยคาดว่าอาจจะมีการผ่อนคลายนโยบายเพิ่มเติม โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 1,256 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (7 - 11 มี.ค. 59) ตลาดฯ จัดงาน “Thai Corporate Day 2016” สำหรับปัจจัยภายนอก ได้แก่ GDP ไตรมาส 4 ปี 2015 ของญี่ปุ่นและยูโรโซน ดุลการค้าและยอดสินเชื่อรายเดือนของจีน การประชุมธนาคารกลางของเกาหลีใต้และยูโรโซน และตลาดหุ้นอินโดนีเซียปิดทำการ | | |
|  | | |