|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (25 - 29 ม.ค. 59)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 25 - 29 ม.ค. 59 | 18 – 22 ม.ค. 58 | เปลี่ยนแปลง | 1 - 29 ม.ค. 59 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 480,229.26 | 393,875.94 | 21.92% | 1,867,133.65 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 96,045.85 | 78,775.19 | 21.92% | 93,356.68 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 109.67 | 109.48 | 0.17% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 108.17 | 108.05 | 0.11% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 29 ม.ค. 59  มีจำนวน 3,077 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,995,862.07 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 101,300 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  480,229.26 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 96,045.85 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 21.92 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 8.54 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 91.46 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 488 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 48 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 383 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 14 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ | | | | ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท) | ร้อยละ | | พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 80,000.00 | 78.97 | | พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 | | ตั๋วเงินคลัง | 5,000.00 | 4.94 | | หุ้นกู้ภาคเอกชน | 16,300.00 | 16.09 | | พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 0.00 | 0.00 | | รวม | 101,300 | 100.00 | |  |  |  | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 350,423.00 | 76.83 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 93,870.00 | 20.58 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 11,828.00 | 2.59 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 456,121.00 | 100.00 | | \* เฉพาะธุรกรรม Outright ซึ่งหมายถึงการซื้อขายตราสารหนี้ที่เป็นการขายขาด | | | |
| |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | | **ThaiBMA Reference Yield (Interpolation)** | | | | | | | | | | | | | | | |  | **1 Mth.** | **3Mth.** | **6Mth.** | **1 Yr.** | **2 Yr.** | **3 Yr.** | **5 Yr.** | **7 Yr.** | **10 Yr.** | **12 Yr.** | **15 Yr.** | **18 Yr.** | **19 Yr.** | **20 Yr.** | | 18 - 22 ม.ค.58 | - | - | - | 1.46 | 1.49 | 1.56 | 1.99 | 2.22 | 2.47 | 2.62 | 2.84 | 2.99 | 3.00 | 3.00 | | 25 - 29 ม.ค. 59 |  |  |  | 1.46 | 1.50 | 1.55 | 1.92 | 2.11 | 2.36 | 2.60 | 2.81 | 2.95 | 2.95 | 2.96 | | เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - | 0 | 1 | -1 | -7 | -11 | -11 | -2 | -3 | -4 | -5 | -4 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลง เกือบทุกช่วงอายุ ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 ปี ไม่มีการปรับตัว อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 2-5 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -7 ถึง 1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 7-12 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -11 ถึง -2 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 15-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -5 ถึง -3 bp. ทั้งนี้ โดยเป็นการปรับลดลงภายในวันศุกร์วันเดียวจากผลกระทบของการที่ธนาคารกลางญี่ปุ่น (BOJ) มีมติให้ใช้นโยบายอัตราดอกเบี้ยติดลบเป็นครั้งแรกโดยจะเรียกเก็บดอกเบี้ยในอัตรา 0.1% จากสถาบันการเงินที่นำเงินมาฝากไว้เพิ่มเติมกับ BOJ ซึ่งมีผลบังคับใช้ในวันที่ 16 ก.พ. นี้ ส่งผลให้ Bond Yield อายุ 10 ปี ของญี่ปุ่นลดลงจาก 0.229% มาอยู่ที่ 0.10% และค่าเงินเยนอ่อนค่าลงมาอยู่ที่ 120.72 เยน/ดอลลาร์สหรัฐฯ โดยในการประชุม FOMC ของสหรัฐฯ เมื่อวันพุธที่ผ่านมามีมติให้คงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ 0.25-0.50 % ตามที่ตลาดคาดการณ์ไว้ ด้านราคาน้ำมันปรับเพิ่มขึ้นมาอยู่ที่ระดับ 33.62 ดอลลาร์/บาร์เรล (เพิ่มขึ้น 10.81% เทียบกับช่วงต้นสัปดาห์) จากข่าวที่รัสเซียเตรียมเจรจาปรับลดกำลังการผลิตกับกลุ่ม OPEC และซาอุดิอาระเบีย แม้ในวันต่อมาซาอุดิอาระเบียได้ปฏิเสธข่าวดังกล่าว ทั้งนี้ ตลาดติดตามรายงานการประชุมของธนาคารกลางญี่ปุ่นซึ่งจะเปิดเผยในวันที่ 3 ก.พ. นี้ โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 41,412 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (1 – 5 ก.พ. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ ดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภคและอัตราเงินเฟ้อ เดือน ม.ค. การประชุมของ กนง. และ DTAC ประกาศผลประกอบการ สำหรับปัจจัยภายนอก ได้แก่ **การประชุมธนาคารกลางของอินเดียและออสเตรเลีย การจ้างงานนอกภาคเกษตรและเอกชน และอัตราการว่างงาน เดือน ม.ค. ของสหรัฐฯ** GDP **ไตรมาส 4 ปี** 2015 **ของอินโดนีเซีย** | | |
|  | | |