|  |  |
| --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (18 - 22 ม.ค. 59)** |
|

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Thai BMA Market | 18 - 22 ม.ค. 59 | 11 -15 ม.ค. 59 | เปลี่ยนแปลง | 1 - 22 ม.ค. 59 |
| มูลค่าการซื้อขายรวม(ล้านบาท) | 393,875.94 | 462,993.78 | -14.93% | 1,386,904.39 |
| มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 78,775.19 | 92,598.76 | -14.93% | 92,460.29 |
| ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 109.48 | 108.99 | 0.45% | - |
| ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 108.05 | 107.83 | 0.20% | - |

ภาพรวมตลาดตราสารหนี้หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 22 ม.ค. 59 มีจำนวน 3,028 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,987,681.93 ล้านบาท | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
|  การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 171,815 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย393,875.94 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 78,775.19 ล้านบาทต่อวัน ลดลงจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 14.93 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 7.23 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 92.77 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 | 46.56 |
| พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 |
| ตั๋วเงินคลัง | 5,000.00 | 2.91 |
| หุ้นกู้ภาคเอกชน  | 86,645.00 | 50.43 |
| พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 170.00 | 0.10 |
| รวม | 171,815 | 100.00 |
|  |  |  |

 |

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 278,850.00 | 75.22 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 81,536.00 | 21.99 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 10,347.00 | 2.79 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 370,733.00 | 100.00 |
| \* เฉพาะธุรกรรม Outright ซึ่งหมายถึงการซื้อขายตราสารหนี้ที่เป็นการขายขาด |

 |
|

|  |
| --- |
| **ThaiBMA Reference Yield (Interpolation)** |
|  | **1Mth.** | **3Mth.** | **6Mth.** | **1 Yr.** | **2 Yr.** | **3 Yr.** | **5 Yr.** | **7 Yr.** | **10 Yr.** | **12 Yr.** | **15 Yr.** | **18 Yr.** | **19 Yr.** | **20 Yr.** |
| 11 - 15 ม.ค. 59 |   |   |   | 1.47 | 1.52 | 1.62 | 2.06 | 2.32 | 2.51 | 2.67 | 2.67 | 3.04 | 3.06 | 3.07 |
| 18 - 22 ม.ค. 59 |   |   |   | 1.46 | 1.56 | 1.56 | 1.99 | 2.22 | 2.47 | 2.62 | 2.62 | 2.99 | 3.00 | 3.00 |
| เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - |  -1 | -3 | -6 | -7 | -10 | 11 | -4 | -5 | -5 | -6 | -7 |

 |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** |
|  ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยลดลงเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลงเกือบทุกช่วงอายุ ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-3 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -6 ถึง -1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5-10 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -10 ถึง 11 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 12-18 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่างที่ -5 ถึง -4 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 19-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -7 ถึง -6 bp. ทั้งนี้ ตลาดได้รับแรงกดดันจากราคาน้ำมันที่ปรับลดลงค่อนข้างมาก โดยในช่วงต้นสัปดาห์ราคาน้ำมันลดต่ำลงแตะระดับ 27.72 ดอลลาร์/บาร์เรล หลังจากที่สหรัฐฯ และสหภาพยุโรปยกเลิกมาตรการคว่ำบาตรต่ออิหร่านอย่างเป็นทางการ ประกอบกับรายงานตัวเลข GDP ของจีนประจำปี 2558 ขยายตัวอยู่ที่ 6.9% ซึ่งถือเป็นระดับต่ำสุดในรอบ 25 ปี อย่างไรก็ตาม ในช่วงปลายสัปดาห์ราคาน้ำมันมีแนวโน้มปรับตัวขึ้นมาเหนือระดับ 30 ดอลลาร์/บาร์เรล จากการที่กลุ่ม IS โจมตีคลังน้ำมันในลิเบียและสภาพอากาศที่หนาวเย็นในสหรัฐฯ และยุโรปกระตุ้นความต้องการใช้พลังงาน ทั้งนี้ ตลาดติดตามการประชุม FOMC ในวันที่ 26-27 ม.ค. ซึ่งคาดว่าจะยังไม่มีการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยในรอบนี้ โดยนักลงทุนต่างชาติขายสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 4,599 ล้านบาทสำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (25 – 29 ม.ค. 59) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ ดัชนีผลผลิตอุตสาหกรรม และ ธปท. รายงานภาวะเศรษฐกิจ เดือน ธ.ค. สำหรับปัจจัยภายนอก ได้แก่ **ตลาดหุ้นปิดทำการของมาเลเซียและอินเดีย GDP ไตรมาส 4 ปี 2015 ของเกาหลีใต้ ฟิลิปปินส์ และสหรัฐฯ ดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภค เดือน ม.ค. ของยูโรโซน และการประชุมธนาคารกลางของญี่ปุ่น** |
|  |