|  |  |
| --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (14 - 18 ธ.ค. 58)** |
|

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Thai BMA Market | 14 - 18 ธ.ค. 58 | 8 - 11 ธ.ค. 58 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 18 ธ.ค. 58 |
| มูลค่าการซื้อขายรวม(ล้านบาท) | 349,102.11 | 216,268.04 | 61.42% | 19,136,038.96 |
| มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 69,820.42 | 72,089.35 | -3.15% | 81,429.95 |
| ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 107.99 | 108.65 | -0.61% | - |
| ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.54 | 107.51 | 0.03% | - |

ภาพรวมตลาดตราสารหนี้หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 18 ธ.ค. 58 มีจำนวน 3,036 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,083,792.08 ล้านบาท | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
|  การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 127,766 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย349,102.11 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 69,820.42 ล้านบาทต่อวัน ลดลงจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 3.15 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 7.21 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 92.79 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ มีการซื้อขายจำนวน 1 หลักทรัพย์ มูลค่าประมาณ 0.1 ล้านบาท (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 489 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 48 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 384 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 14 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
|

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ |
| ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท) | ร้อยละ |
| พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 60,000.00 | 47.33 |
| พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 |
| ตั๋วเงินคลัง | 24,000.00 | 18.93 |
| หุ้นกู้ภาคเอกชน  | 38,400.00 | 30.29 |
| พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 4,366.00 | 3.44 |
| รวม | 127,766 | 100.00 |
|  |  |  |

 |

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 239,006.00 | 78.37 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 53,488.00 | 17.54 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 12,487.00 | 4.09 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 304,981.00 | 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.** |
| 8 - 11 ธ.ค.58 | - | - | - | 1.50 | 1.59 | 1.74 | 2.23 | 2.51 | 2.67 | 2.86 | 3.06 | 3.23 | 3.26 | 3.29 |
| 14 - 18 ธ.ค.58 | - | - | - | 1.51 | 1.60 | 1.76 | 2.24 | 2.48 | 2.59 | 2.85 | 3.02 | 3.20 | 3.22 | 3.25 |
| เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - |  1 | 1 | 2 | 1 | -3 | -8 | -1 | -4 | -3 | -4 | -4 |

 |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** |
|  ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยลดลงเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลง บางช่วงอายุ ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-5 ปี มีการปรับตัวอยู่ระหว่าง 1 ถึง 2 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 7-12 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -8 ถึง -1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 15-18 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่างที่ -4 ถึง -3 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 19-20 ปี ปรับตัวอยู่ที่ -4 bp. ทั้งนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรระยะยาวอายุ 10 ปี ปรับตัวลดลง 8 bp. จาก 2.67% ในสัปดาห์ก่อนหน้าเป็น 2.59% โดยทั้งสัปดาห์ตลาดติดตามการประชุม FOMC ของสหรัฐฯ ในวันที่ 15-16 ธ.ค. ซึ่งได้เปิดเผยผลการประชุมดังกล่าวในวันพฤหัสฯ ที่ 17 ที่ผ่านมา และที่ประชุมมีมติให้ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายสหรัฐฯ 0.25% จาก 0-0.25% เป็น 0.25-0.50% ตามที่ตลาดคาดการณ์ไว้ นับเป็นการปรับขึ้นครั้งแรกในรอบ 9 ปี และส่งสัญญาณจะปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยอย่างค่อยเป็นค่อยไปในปีหน้า ด้านปัจจัยในประเทศ ที่ผ่านมาคณะกรรมการนโยบายการเงิน (กนง.) มีมติเป็นเอกฉันท์ให้คงดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ 1.5% ตามที่ตลาดคาดการณ์ไว้ นอกจากนี้ ตลาดยังคงติดตามการประมูล 4G คลื่นความถี่ 900 MHz ตั้งแต่วันที่ 15 ธ.ค. และสิ้นสุดวันที่ 19 ธ.ค. โดยมีมูลค่ารวมสูงถึง 151,952 ล้านบาท โดยนักลงทุนต่างชาติขายสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 6,550 ล้านบาทสำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (21 - 25 ธ.ค. 58) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ ยอดขายรถและดุลการค้า เดือน พ.ย. กกพ. จับฉลากผู้ได้รับใบอนุญาตรับซื้อไฟฟ้า (PPA) ในโครงการโซลาร์ฟาร์มราชการและสหกรณ์ 600 MW และดัชนีผลผลิตอุตสาหกรรมและอัตราการใช้กำลัง เดือน พ.ย. สำหรับปัจจัยภายนอก ได้แก่ **อัตราเงินเฟ้อและตัวเลขการก่อสร้างบ้านใหม่ เดือน พ.ย. ของญี่ปุ่น และตลาดหุ้นปิดทำการเนื่องในวัน** Christmas **ของอินโดนีเซีย มาเลเซีย ฟืลิปปินส์ อินเดีย ฮ่องกง สิงคโปร์ เกาหลีใต้ และสหรัฐฯ** |
|  |