|  |  |
| --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (8 - 11 ธ.ค. 58)** |
|

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Thai BMA Market | 8 - 11 ธ.ค. 58 | 30 พ.ย. – 4 ธ.ค. 58 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 11 ธ.ค. 58 |
| มูลค่าการซื้อขายรวม(ล้านบาท) | 216,268.04 | 359,137.71 | -39.78% | 18,786,936.85 |
| มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 72,089.35 | 71,827.54 | 0.36% | 81,682.33 |
| ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 108.65 | 108.56 | 0.08% | - |
| ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.51 | 107.47 | 0.04% | - |

ภาพรวมตลาดตราสารหนี้หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 11 ธ.ค. 58 มีจำนวน 3,045 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,070,391.77 ล้านบาท | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
|  การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 86,150 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย216,268.04 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 72,089.35 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 0.36 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 7.44 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 92.56 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 3 วันทำการ สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ มีการซื้อขายจำนวน 1 หลักทรัพย์ มูลค่าประมาณ 0.1 ล้านบาท (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 493 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 48 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 387 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 15 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
|

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ |
| ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท) | ร้อยละ |
| พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 60,000.00 | 69.65 |
| พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 |
| ตั๋วเงินคลัง | 24,000.00 | 27.86 |
| หุ้นกู้ภาคเอกชน  | 2,150.00 | 2.50 |
| พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 0.00 | 0.00 |
| รวม | 86,150 | 100.00 |
|  |  |  |

 |

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 176,213.00 | 87.95 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 20,536.00 | 10.25 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 3,603.00 | 1.80 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 200,352.00 | 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.** |
| 30 พ.ย.-4 ธ.ค.58 | - | - | - | 1.50 | 1.59 | 1.73 | 2.23 | 2.52 | 2.71 | 2.85 | 3.06 | 3.23 | 3.26 | 3.29 |
| 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 |
| เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - |  0 | 0 | 1 | 0 | -1 | -4 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |

 |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** |
|  ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลง บางช่วงอายุ ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1-2 ปี 5 ปี และ 15-20 ปี ไม่มีการปรับตัว อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 3 ปี และ 12 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 1 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 7-10 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่างที่ -4 ถึง-1 bp. ทั้งนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรระยะยาวอายุ 10 ปี ปรับตัวลดลง 4 bp. จาก 2.71% ในสัปดาห์ก่อนหน้าเป็น 2.67% โดยในสัปดาห์ที่ผ่านมามีวันทำการเพียง 3 วัน อย่างไรก็ตาม ปริมาณการซื้อขายโดยรวมถือว่าอยู่ในระดับปกติ ด้านปัจจัยต่างประเทศในช่วงกลางสัปดาห์ที่ผ่านมามีการรายงานตัวเลข GDP ของยูโรโซนไตรมาส 3 ปี 2015 ขยายตัว 0.3% เมื่อเทียบกับไตรมาสก่อนหน้า ตามด้วยการรายงานตัวเลขผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานครั้งแรกรายสัปดาห์ของสหรัฐฯ ในช่วงปลายสัปดาห์ ปรับเพิ่มขึ้น 16,000 ราย อยู่ที่ 282,000 ราย ทั้งนี้ ตลาดติดตามรายงานตัวเลขดัชนีผู้บริโภค (CPI) ของสหรัฐฯ ซึ่งจะรายงานในวันอังคารหน้า และการประชุม FOMC เกี่ยวกับดอกเบี้ยนโยบายของสหรัฐฯ ในวันที่ 15-16 ธ.ค. นี้ สำหรับปัจจัยในประเทศ นักลงทุนติดตามการประชุม กนง. ในวันที่ 16 ธ.ค. นี้ โดยนักลงทุนต่างชาติขายสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 27,282 ล้านบาทสำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (14 – 18 ธ.ค. 58) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ AMATAV เทรด (ราคา IPO 7.50 บาท) ไทยประมูล 4G คลื่น 900 MHz กกพ. จับฉลากผู้ได้ใบอนุญาตรับซื้อไฟฟ้า (PPA) ในโครงการโซลาร์ฟาร์มราชการและสหกรณ์ 600 MW และ กนง. ประชุมครั้งสุดท้ายของปี |
|  |