|  |  |
| --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (30 พ.ย. – 4 ธ.ค. 58)** |
|

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Thai BMA Market | 30 พ.ย. – 4 ธ.ค. 58 | 23 - 27 พ.ย. 58 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 4 ธ.ค. 58 |
| มูลค่าการซื้อขายรวม(ล้านบาท) | 359,137.71 | 358,045.36 | 0.31% | 18,570,668.81 |
| มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 71,827.54 | 71,609.07 | 0.31% | 81,809.11 |
| ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 108.56 | 109.24 | -0.62% | - |
| ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.47 | 107.56 | -0.08% | - |

ภาพรวมตลาดตราสารหนี้หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 4 ธ.ค. 58 มีจำนวน 3,040 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,020,896.21 ล้านบาท | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
|  การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 109,383 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย359,137.71 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 71,827.54 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 0.31 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 7.87 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 92.13 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 498 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 50 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 42 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 390 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 15 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
|

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ |
| ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท) | ร้อยละ |
| พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 90,000.00 | 82.28 |
| พันธบัตรรัฐบาล | 0.00 | 0.00 |
| ตั๋วเงินคลัง | 14,000.00 | 12.80 |
| หุ้นกู้ภาคเอกชน  | 5,382.50 | 4.92 |
| พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 0.00 | 0.00 |
| รวม | 109,383 | 100.00 |
|  |  |  |

 |

|  |
| --- |
| ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ |
| **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย(ล้านบาท)** | **ร้อยละ** |
| **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 251,022.00 | 79.36 |
| **พันธบัตรรัฐบาล** | 57,081.00 | 18.05 |
| **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 |
| **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 8,215.00 | 2.60 |
| **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 |
| **รวม** | 316,318.00 | 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 - 27 พ.ย.58 | - | - | - | 1.49 | 1.58 | 1.72 | 2.21 | 2.48 | 2.70 | 2.83 | 3.04 | 3.22 | 3.25 | 3.28 |
| 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 |
| เปลี่ยนแปลง(bp.) | - | - | - |  1 | 1 | 1 | 2 | 4 | 1 | 2 | 2 | 1 | 1 | 1 |

 |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** |
|  ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวเพิ่มขึ้น ในเกือบทุกช่วงอายุ ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1- 3 ปี 10 ปี และ 18-20 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 1 bp. อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5 ปี 12 ปี และ 15 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 2 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 7 ปี ปรับตัวอยู่ที่ 4 bp. ทั้งนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรระยะยาวปรับตัวเพิ่มขึ้น 1-2 bp. โดยพันธบัตรอายุ 5 ปี ปรับตัวเพิ่มขึ้น 2 bp. จาก 2.21% ในสัปดาห์ก่อนหน้าเป็น 2.23% โดยในช่วงต้นสัปดาห์ที่ผ่านมาได้รับแรงหนุนจากปัจจัยในประเทศจีนอย่างต่อเนื่อง เช่น การอัดฉีดเม็ดเงิน 1 แสนล้านหยวน (1.56 หมื่นล้านดอลลาร์) ให้สถาบันการเงิน 11 แห่ง ผ่านโครงการเงินกู้ระยะกลางของธนาคารกลางจีน เพื่อกระตุ้นเศรษฐกิจที่อยู่ในสภาวะชะลอตัว การที่ IMF ประกาศให้สกุลเงินหยวนเข้าอยู่ในตะกร้าเงิน SDRs ร่วมกับสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐฯ ยูโร ปอนด์และเยน ส่งผลให้ตลาดคาดว่า จะมีการใช้เงินหยวนเพื่อชำระค่าสินค้าบริการและการลงทุนเพิ่มขึ้นอย่างต่อเนื่อง และไทยอาจได้รับประโยชน์ในเรื่องดังกล่าวด้วย ด้านยุโรปในการประชุมธนาคารกลางยุโรปในคืนวันพฤหัสฯ ที่ผ่านมา ECB ประกาศขยายระยะเวลาในการซื้อพันธบัตรตามมาตรการผ่อนคลายเชิงปริมาณ (QE) ไปจนถึงเดือน มี.ค. 2560 จากเดิมที่มีกำหนดสิ้นสุดในเดือน ก.ย. 2559 และประกาศลดอัตราดอกเบี้ยเงินฝากที่ธนาคารพาณิชย์ฝากไว้กับ ECB สู่ระดับ -0.3% จากเดิมที่ -0.2% ซึ่งมาตรการดังกล่าวไม่เป็นไปตามที่นักลงทุนคาดไว้ แต่นักลงทุนยังคงติดตามการประชุม FOMC ของสหรัฐฯ ในวันที่ 15-16 ธ.ค. นี้ โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 11,496 ล้านบาทสำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (8-11 ธ.ค. 58) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ ร.ฟ.ท. เปิดประกวดราคาการก่อสร้างรถไฟรางคู่ จิระ-ขอนแก่น ระยะทาง 185 กม. วงเงิน 2.6 หมื่นลบ. และ EASA ประกาศผลตรวจสอบมาตรฐานการบินไทย ส่วนปัจจัยภายนอก ได้แก่ ดุลการค้าเดือน พ.ย. ของจีน GDP ไตรมาส 3 ปี 2015 ของญี่ปุ่นและยูโรโซน และการประชุมธนาคารกลางของเกาหลีใต้ |
|  |