|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| มFPO_new_2551_Eng | ***ส่วนนโยบายพัฒนาตลาดทุน สำนักนโยบายการออมและการลงทุน*** | |
| ***สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง*** | |
| ***โทร. 0-2273-9020 ต่อ 3648 โทรสาร 0-2273-9987*** | |
| **สรุปภาวะการซื้อขายตราสารหนี้ในภาพรวม (23 - 27 พ.ย. 58)** | | |
| |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | Thai BMA Market | 23 - 27 พ.ย. 58 | 16 -20 พ.ย. 58 | เปลี่ยนแปลง | 1 ม.ค. – 27 พ.ย. 58 | | มูลค่าการซื้อขายรวม  (ล้านบาท) | 358,045.36 | 339,818.53 | 5.36% | 18,211,531.11 | | มูลค่าเฉลี่ยต่อวัน | 71,609.07 | 67,963.71 | 5.36% | 82,033.92 | | ดัชนีพันธบัตรรัฐบาล | 109.24 | 108.93 | 0.28% | - | | ดัชนีหุ้นกู้ภาคเอกชนที่ได้รับการจัดอันดับ | 107.56 | 107.44 | 0.11% | - |   ภาพรวมตลาดตราสารหนี้  หมายเหตุ ข้อมูลข้างต้นเป็นตราสารหนี้ที่จดทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่ง ณ 27 พ.ย. 58  มีจำนวน 3,047 หลักทรัพย์ และมียอดคงค้าง 10,068,339.56 ล้านบาท | | **ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้** |
| การซื้อขายตราสารหนี้ในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมาในตลาดแรกมีปริมาณ การซื้อขาย 164,771 ล้านบาท และในตลาดรองมีปริมาณการซื้อขาย  358,045.36 ล้านบาท หรือเฉลี่ย 71,609.07 ล้านบาทต่อวัน เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนประมาณร้อยละ 5.36 โดยจำแนกเป็นการทำธุรกรรม Outright ร้อยละ 7.19 และธุรกรรม Financing และอื่นๆ รวมร้อยละ 92.81 ทั้งนี้ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในสัปดาห์นี้มี 5 วันทำการ  สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ในสัปดาห์นี้ ไม่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ (ตราสารหนี้จดทะเบียนมีทั้งสิ้นจำนวน 499 หลักทรัพย์ ประกอบด้วย หุ้นกู้ 50 หลักทรัพย์ พันธบัตรรัฐบาล 43 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจ 390 หลักทรัพย์ พันธบัตรที่ออกโดยหน่วยงานรัฐ 15 หลักทรัพย์ และกองทุนที่เกี่ยวกับตราสารหนี้-หน่วยลงทุน (BFUND) 1 หลักทรัพย์ |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดแรกประจำรอบสัปดาห์ | | | | ตราสารหนี้ | ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท) | ร้อยละ | | พันธบัตรองค์กรภาครัฐ | 70,771.00 | 42.95 | | พันธบัตรรัฐบาล | 9,000.00 | 5.46 | | ตั๋วเงินคลัง | 30,000.00 | 18.21 | | หุ้นกู้ภาคเอกชน | 17,000.00 | 10.32 | | พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ | 38,000.00 | 23.06 | | รวม | 164,771 | 100.00 | |  |  |  | | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | ปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง\* ประจำรอบสัปดาห์ | | | | **ตราสารหนี้** | **ปริมาณซื้อขาย (ล้านบาท)** | **ร้อยละ** | | **พันธบัตรองค์กรภาครัฐ** | 227,686.00 | 73.04 | | **พันธบัตรรัฐบาล** | 75,271.00 | 24.15 | | **ตั๋วเงินคลัง** | 0.00 | 0.00 | | **หุ้นกู้ภาคเอกชน** | 8,774.00 | 2.81 | | **พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ** | 0.00 | 0.00 | | **รวม** | 311,731.00 | 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.** | | 16 - 20 พ.ย.58 | - | - | - | 1.50 | 1.58 | 1.75 | 2.27 | 2.59 | 2.79 | 2.87 | 3.08 | 3.28 | 3.32 | 3.37 | | 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 | | เปลี่ยนแปลง (bp.) | - | - | - | -1 | 0 | -3 | -6 | -11 | -9 | -4 | -4 | -6 | -7 | -9 | | | |
| **อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาล** | | |
| ในสัปดาห์ที่ผ่านมามีปริมาณการซื้อขายตราสารหนี้โดยเฉลี่ยเพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับสัปดาห์ก่อนหน้า สำหรับอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลปรับตัวลดลง ในเกือบทุกช่วงอายุ ดังนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 1 ปี 12 ปี และ 15 ปี ปรับตัวอยู่ที่ -4 และ -1 bp. ตามลำดับ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 2 ปี ไม่มีการปรับตัว อัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 3-10ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -9 ถึง -3 bp. และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลอายุ 18-20 ปี ปรับตัวอยู่ระหว่าง -9 ถึง -6 bp. ทั้งนี้ อัตราผลตอบแทนพันธบัตรระยะยาวปรับตัวลดลง 1-9 bp. โดยพันธบัตรอายุ 10 ปี ปรับตัวลดลง 0.09% จาก 2.79% ในสัปดาห์ก่อนหน้าเป็น 2.70% ซึ่งในช่วงสัปดาห์ที่ผ่านมากระทรวงการคลังจัดการประมูลพันธบัตรอ้างอิงรุ่นใหม่ LB666A อายุ 50-59 ปี อัตราดอกเบี้ย 4% วงเงินประมูล 9,000 ล้านบาท โดยผลการประมูล (Average Yield) อยู่ที่ 3.86% และได้รับความสนใจจากนักลงทุน 2.81 เท่าของวงเงินประมูล ด้านปัจจัยต่างประเทศ สหรัฐฯ รายงานตัวเลข GDP ไตรมาส 3/2558 ขยายตัว 2.1% เมื่อเทียบกับไตรมาสก่อนหน้า ตามด้วยตัวเลขผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานครั้งแรกในรอบสัปดาห์ก่อนหน้า ลดลง 12,000 ราย อยู่ที่ 260,000 ราย ต่ำกว่าระดับ 300,000 รายติดต่อกันเป็นสัปดาห์ที่ 38 ซึ่งสร้างความเชื่อมั่นต่อตลาดว่า FED อาจปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายในการประชุม FOMC ในกลางเดือน ธ.ค. นี้ โดยนักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิตราสารหนี้ไทยรวม 10,083 ล้านบาท  สำหรับปัจจัยที่คาดว่าจะส่งผลกระทบในสัปดาห์นี้ (30 พ.ย. – 4 ธ.ค. 58) ปัจจัยภายในที่ต้องติดตาม ได้แก่ ดุลการค้า และดัชนีผลผลิตภาคอุตสาหกรรม เดือน ต.ค. ปัจจัยภายนอก ได้แก่ **อัตราเงินเฟ้อและอัตราการว่างงาน เดือน พ.ย. ของยูโรโซน และการจ้างงานเอกชนและนอกภาคเกษตร** ISM **นอกภาคการผลิตและผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ของสหรัฐฯ** | | |
|  | | |