

ภาวะตลาดเงินและตลาด Swap (25-29 พฤษภาคม 2552)

การกู้ยืมเงินผ่านตลาดเงิน

สัปดาห์นี้อยู่ในช่วงท้ายปีงบประมาณที่ธนาคารพาณิชย์จำเป็นต้องบริหารสินทรัพย์สภาพคล่องให้ได้ตามเกณฑ์ ประกอบกับธนาคารต่างๆ เพิ่มการลงทุนในธุรกรรมที่ให้ผลตอบแทนสูงและมีระยะยาวเพิ่มขึ้น ส่งผลให้มีการกู้ยืมในหน้าต่างตราสารหนี้ ธปท. และการกู้ยืมระหว่างธนาคารลดลง

สรุป ปริมาณธุรกรรมการกู้ยืมในหน้าต่างตราสารหนี้ ธปท. ตลอดสัปดาห์นี้ (25 – 29 พ.ค. 2552) อยู่ที่ 945,300 ล้านบาท (189,060 ล้านบาทต่อวัน) อยู่ในช่วง 163,810 – 213,640 ล้านบาท โดยปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 1,096,086 ล้านบาท (219,217 ล้านบาทต่อวัน) อยู่ในช่วง 184,310 – 285,190 ล้านบาท

ประเภท 1 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 896,790 ล้านบาท (179,358 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.11% โดยอยู่ในช่วง 153,480 – 205,740 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 1,040,180 ล้านบาท (208,036 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.11% โดยอยู่ในช่วง 181,270 – 266,280 ล้านบาท

ประเภท 7 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 38,690 ล้านบาท (7,738 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.10% โดยอยู่ในช่วง 3,600 – 11,620 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 41,656 ล้านบาท (8,331 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.07% โดยอยู่ในช่วง 740 – 18,010 ล้านบาท

ประเภท 14 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 2,290 ล้านบาท (763 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.10% โดยอยู่ในช่วง 300 – 1,190 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 11,600 ล้านบาท (2,900 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.07% โดยอยู่ในช่วง 800 – 6,000 ล้านบาท

ประเภท 1 เดือน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 7,530 ล้านบาท (1,506 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.13% โดยอยู่ในช่วง 630 – 3,000 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมเพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนที่ 2,550 ล้านบาท (638 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.04% โดยอยู่ในช่วง 100 – 2,100 ล้านบาท

สรุป ยอดคงค้างในตลาดกู้ยืมระหว่างธนาคาร (ข้อมูล ณ สิ้นวันที่ 28 พ.ค. 52) อยู่ที่ 19,470 ล้านบาท ลดลงจากสัปดาห์ก่อน (22/5/09) ที่ 21,751 ล้านบาท โดยแบ่งเป็น

ประเภท At Call อยู่ที่ 1,850 ล้านบาท คงที่เมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (22/5/09) ที่ 1,850 ล้านบาท

ประเภท Term อยู่ที่ 4,100 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (22/5/09) ที่ 3,415 ล้านบาท

ประเภท O/N และ T/N อยู่ที่ 13,520 ล้านบาท ลดลงเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (22/5/09) ที่ 16,486 ล้านบาท สำหรับอัตราดอกเบี้ย Interbank ประเภท O/N เฉลี่ยการกู้ยืมกันมากที่สุดอยู่ที่ 1.15% โดยอยู่ในช่วง 0.7% – 1.27% ลงที่เมื่อเทียบกับเฉลี่ยการกู้ยืมกันมากที่สุดสัปดาห์ก่อน ที่ 1.15% และอยู่ในช่วง 0.7% – 1.18%

อัตราดอกเบี้ยในตลาดเงินกู้ยืมระหว่างธนาคาร (BIBOR) ณ วันที่ 29 พ.ค. 52

ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ 1.27906% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.29031%

ประเภท 1 เดือน อยู่ที่ 1.31906% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.34094%

ประเภท 2 เดือน อยู่ที่ 1.36375% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.38250%

ประเภท 3 เดือน อยู่ที่ 1.40406% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.42547%

ประเภท 6 เดือน อยู่ที่ 1.50000% คงที่เมื่อเทียบกับวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.50000%

ประเภท 9 เดือน อยู่ที่ 1.56406% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.59094%

ประเภท 1 ปี อยู่ที่ 1.62688% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.65281%

การกู้ยืมผ่านตลาด Swap

ในสัปดาห์นี้ราคา Swap ไม่เปลี่ยนแปลงมากนัก โดยอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรสหรัฐฯ และอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลไทยปรับตัวเพิ่มขึ้นในทิศทางเดียวกัน ส่งผลให้ราคา Swap เปลี่ยนแปลงในช่วงแคบ ๆ ก่อนปิดตลาดวันศุกร์ที่

ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ +0.50 สตางค์ (0.99%) ทรงตัวจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +0.50 สตางค์ (1.00%)

ประเภท 2 สัปดาห์ อยู่ที่ +0.97 สตางค์ (1.00%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +1.00 สตางค์ (1.02%)

ประเภท 1 เดือน อยู่ที่ +2.10 สตางค์ (1.07%) ทรงตัวจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +2.10 สตางค์ (1.04%)

ประเภท 2 เดือน อยู่ที่ +3.75 สตางค์ (1.16%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +4.00 สตางค์ (1.20%)

ประเภท 3 เดือน อยู่ที่ +4.75 สตางค์ (1.24%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +5.00 สตางค์ (1.25%)

ประเภท 6 เดือน อยู่ที่ +7.75 สตางค์ (1.73%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +8.00 สตางค์ (1.70%)

และประเภท 12 เดือน อยู่ที่ +14.50 สตางค์ (2.07%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +15 สตางค์ (2.00%)

ในส่วน SWAP OFF-SHORE ในวันศุกร์ ราคา Swap point ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ +0.50 (0.99%) 1 เดือน อยู่ที่ +3.00 (1.39%) 2 เดือนอยู่ที่ +6.00 สตางค์ (1.54%) 3 เดือนอยู่ที่ +10.00 สตางค์ (1.84%) 6 เดือน อยู่ที่ +24.00 สตางค์ (2.68%) และ 12 เดือน อยู่ที่ +55.00 สตางค์ (3.27%)

ในส่วนของตัวเลขทุนสำรองระหว่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยในวันที่ 22 พ.ค. 2552 ตัวเลขเงินทุนสำรองอยู่ที่ระดับ 120.5 พันล้านดอลลาร์ เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้ว (15 พ.ค.) ที่ 118.5 พันล้านดอลลาร์ ส่วนของ Forward Baht Commitment อยู่ที่ระดับ 6.1 พันล้านดอลลาร์ เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้ว (15 พ.ค.) ที่ 4.4 พันล้านดอลลาร์