

ภาวะตลาดเงินและตลาด Swap (1-5 มิถุนายน 2552)

การกู้ยืมเงินผ่านตลาดเงิน

สัปดาห์นี้ธนาคารต่างๆ ยังให้ความสนใจลงทุนในธุรกรรมที่ให้ผลตอบแทนสูงและมีระยะยาว โดยยังคงเนื่องจาก สัปดาห์ที่ผ่านมา เนื่องจากตลาดคาดการณ์ว่าอัตราดอกเบี้ยนโยบายน่าจะถึงจุดต่ำสุด ดังนั้นตลาดจึงลดการทำธุรกรรมที่ให้ผลตอบแทนน้อย

สรุป ปริมาณธุรกรรมการกู้ยืมในหน้าต่างตราสารหนี้ ธปท. ตลอดสัปดาห์นี้ (1 – 5 มิ.ย. 2552) อยู่ที่ 704,090 ล้านบาท (140,818 ล้านบาทต่อวัน) อยู่ในช่วง 118,740 – 160,610 ล้านบาท โดยปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 945,300 ล้านบาท (189,060 ล้านบาทต่อวัน) อยู่ในช่วง 163,810 – 213,640 ล้านบาท

ประเภท 1 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 642,310 ล้านบาท (128,462 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.11% โดยอยู่ในช่วง 111,520 – 151,760 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 896,790 ล้านบาท (179,358 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.11% โดยอยู่ในช่วง 153,480 – 205,740 ล้านบาท

ประเภท 7 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 52,850 ล้านบาท (10,570 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.11% โดยอยู่ในช่วง 5,780 – 17,020 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมเพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนที่ 38,690 ล้านบาท (7,738 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.10% โดยอยู่ในช่วง 3,600 – 11,620 ล้านบาท

ประเภท 14 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 1,500 ล้านบาท (750 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.12% โดยอยู่ในช่วง 600 – 900 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 2,290 ล้านบาท (763 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.10% โดยอยู่ในช่วง 300 – 1,190 ล้านบาท

ประเภท 1 เดือน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 7,430 ล้านบาท (1,486 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.14% โดยอยู่ในช่วง 150 – 3,070 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงเล็กน้อยจากสัปดาห์ก่อนที่ 7,530 ล้านบาท (1,506 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.13% โดยอยู่ในช่วง 630 – 3,000 ล้านบาท

สรุป ยอดคงค้างในตลาดกู้ยืมระหว่างธนาคาร (ข้อมูล ณ สิ้นวันที่ 4 มิ.ย. 52) อยู่ที่ 23,175 ล้านบาท เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อน (29/5/09) ที่ 16,320 ล้านบาท โดยแบ่งเป็น

ประเภท At Call อยู่ที่ 700 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (29/5/09) ที่ 200 ล้านบาท

ประเภท Term อยู่ที่ 6,790 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (29/5/09) ที่ 4,150 ล้านบาท

ประเภท O/N และ T/N อยู่ที่ 15,685 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (29/5/09) ที่ 11,970 ล้านบาท สำหรับอัตราดอกเบี้ย Interbank ประเภท O/N เฉลี่ยการกู้ยืมกันมากที่สุดอยู่ที่ 1.15% โดยอยู่ในช่วง 0.7% – 1.28% ลงที่เมื่อเทียบกับเฉลี่ยการกู้ยืมกันมากที่สุดสัปดาห์ก่อน ที่ 1.15% และอยู่ในช่วง 0.7% – 1.27%

อัตราดอกเบี้ยในตลาดเงินกู้ยืมระหว่างธนาคาร (BIBOR) ณ วันที่ 5 มิ.ย. 52

ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ 1.27625% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.27906%

ประเภท 1 เดือน อยู่ที่ 1.30625% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.31906%

ประเภท 2 เดือน อยู่ที่ 1.35000% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.36375%

ประเภท 3 เดือน อยู่ที่ 1.39750% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.40406%

ประเภท 6 เดือน อยู่ที่ 1.48984% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.50000%

ประเภท 9 เดือน อยู่ที่ 1.55000% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.56406%

ประเภท 1 ปี อยู่ที่ 1.60000% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.62688%

การกู้ยืมผ่านตลาด Swap

ในสัปดาห์นี้ราคา Swap เปลี่ยนแปลงลดลง โดยเฉพาะราคา Swap ประเภทระยะยาวที่ปรับตัวลดลงเป็นอย่างมาก เป็นผลจากอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลไทยปรับตัวลดลงตลอดทั้งสัปดาห์ ก่อนปิดตลาดวันศุกร์ที่

ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ +0.48 สตางค์ (0.97%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +0.50 สตางค์ (0.99%)

ประเภท 2 สัปดาห์ อยู่ที่ +0.96 สตางค์ (1.00%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +0.97 สตางค์ (1.00%)

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

ประเภท 2 เดือน อยู่ที่ +3.75 สตางค์ (1.13%) ทรงตัวจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +3.75 สตางค์ (1.16%)

ประเภท 3 เดือน อยู่ที่ +4.60 สตางค์ (1.18%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +4.75 สตางค์ (1.24%)

ประเภท 6 เดือน อยู่ที่ +7.10 สตางค์ (1.63%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +7.75 สตางค์ (1.73%)

และประเภท 12 เดือน อยู่ที่ +13.00 สตางค์ (1.98%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +14.50 สตางค์ (2.07%)

ในส่วน SWAP OFF-SHORE ในวันศุกร์ ราคา Swap point ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ +1.00 (1.76%) 1 เดือน อยู่ที่ +3.50 (1.57%) 2 เดือนอยู่ที่ +7.00 สตางค์ (1.69%) 3 เดือนอยู่ที่ +10.00 สตางค์ (1.81%) 6 เดือน อยู่ที่ +21.00 สตางค์ (2.44%) และ 12 เดือน อยู่ที่ +45.00 สตางค์ (2.93%)

ในส่วนของตัวเลขทุนสำรองระหว่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยในวันที่ 29 พ.ค. 2552 ตัวเลขเงินทุนสำรองอยู่ที่ระดับ 121.5 พันล้านดอลลาร์ เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้ว (22 พ.ค.) ที่ 120.5 พันล้านดอลลาร์ ส่วนของ Forward Baht Commitment อยู่ที่ระดับ 6.3 พันล้านดอลลาร์ เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้ว (22 พ.ค.) ที่ 6.1 พันล้านดอลลาร์