

ภาวะตลาดเงินและตลาด Swap (8-12 มิถุนายน 2552)

การกู้ยืมเงินผ่านตลาดเงิน

สัปดาห์นี้ปริมาณธุรกรรมระหว่างธนาคารลดลง เนื่องจากใกล้วันปิดบัญชีในช่วงต้นสัปดาห์หน้าซึ่งธนาคารพาณิชย์ต้องบริหารสินทรัพย์สภาพคล่องอย่างรอบคอบให้ได้ตามเกณฑ์ โดยยังคงเน้นการลงทุนในช่วงสั้นและได้ผลตอบแทนสูง

สรุป ปริมาณธุรกรรมการกู้ยืมในหน้าต่างตราสารหนี้ ธปท. ตลอดสัปดาห์นี้ (8 – 12 มิ.ย. 2552) อยู่ที่ 647,600 ล้านบาท (129,520 ล้านบาทต่อวัน) อยู่ในช่วง 96,050 – 163,790 ล้านบาท โดยปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 704,090 ล้านบาท (140,818 ล้านบาทต่อวัน) อยู่ในช่วง 118,740 – 160,610 ล้านบาท

ประเภท 1 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 581,550 ล้านบาท (116,310 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.12% โดยอยู่ในช่วง 92,520 – 148,990 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 642,310 ล้านบาท (128,462 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.11% โดยอยู่ในช่วง 111,520 – 151,760 ล้านบาท

ประเภท 7 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 51,130 ล้านบาท (10,226 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.11% โดยอยู่ในช่วง 1,100 – 14,090 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 52,850 ล้านบาท (10,570 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.11% โดยอยู่ในช่วง 5,780 – 17,020 ล้านบาท

ประเภท 14 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 6,190 ล้านบาท (1,238 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.14% โดยอยู่ในช่วง 200 – 2,700 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมเพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนที่ 1,500 ล้านบาท (750 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.12% โดยอยู่ในช่วง 600 – 900 ล้านบาท

ประเภท 1 เดือน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 8,730 ล้านบาท (1,238 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.16% โดยอยู่ในช่วง 800 – 2,640 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมเพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนที่ 7,430 ล้านบาท (1,486 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.14% โดยอยู่ในช่วง 150 – 3,070 ล้านบาท

สรุป ยอดคงค้างในตลาดกู้ยืมระหว่างธนาคาร (ข้อมูล ณ สิ้นวันที่ 11 มิ.ย. 52) อยู่ที่ 22,305 ล้านบาท เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อน (5/6/09) ที่ 29,425 ล้านบาท โดยแบ่งเป็น

ประเภท At Call อยู่ที่ 2,500 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (5/6/09) ที่ 1,200 ล้านบาท

ประเภท Term อยู่ที่ 8,490 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (5/6/09) ที่ 6,790 ล้านบาท

ประเภท O/N และ T/N อยู่ที่ 11,315 ล้านบาท ลดลงเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (5/6/09) ที่ 21,435 ล้านบาท สำหรับอัตราดอกเบี้ย Interbank ประเภท O/N เฉลี่ยการกู้ยืมกันมากที่สุดอยู่ที่ 1.15% โดยอยู่ในช่วง 0.7% – 1.25% คงที่เมื่อเทียบกับเฉลี่ยการกู้ยืมกันมากที่สุดสัปดาห์ก่อน ที่ 1.15% และอยู่ในช่วง 0.7% – 1.28%

อัตราดอกเบี้ยในตลาดเงินกู้ยืมระหว่างธนาคาร (BIBOR) ณ วันที่ 12 มิ.ย. 52

ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ 1.27375% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.27625%

ประเภท 1 เดือน อยู่ที่ 1.30000% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.30625%

ประเภท 2 เดือน อยู่ที่ 1.34797% เพิ่มขึ้นจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.35000%

ประเภท 3 เดือน อยู่ที่ 1.39375% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.39750%

ประเภท 6 เดือน อยู่ที่ 1.50000% เพิ่มขึ้นจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.48984%

ประเภท 9 เดือน อยู่ที่ 1.55281% เพิ่มขึ้นจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.55000%

ประเภท 1 ปี อยู่ที่ 1.60563% เพิ่มขึ้นจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.60000%

การกู้ยืมผ่านตลาด Swap

ในสัปดาห์นี้ราคา Swap เปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้น โดยเฉพาะราคา Swap ประเภทระยะยาวที่ปรับตัวเพิ่มขึ้นเป็นอย่างมาก เป็นผลจากอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลไทยปรับตัวเพิ่มขึ้น และอัตราผลตอบแทนพันธบัตรรัฐบาลสหรัฐฯปรับตัวลดลง เนื่องจากนักลงทุนมีความเชื่อมั่นว่าเศรษฐกิจสหรัฐฯจะฟื้นตัวอย่างต่อเนื่อง ก่อนปิดตลาดวันศุกร์ที่

ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ +0.47 สตางค์ (0.95%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +0.48 สตางค์ (0.97%)

ประเภท 2 สัปดาห์ อยู่ที่ +0.95 สตางค์ (0.99%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +0.96 สตางค์ (1.00%)

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

ประเภท 2 เดือน อยู่ที่ +3.70 สตางค์ (1.12%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +3.75 สตางค์ (1.13%)

ประเภท 3 เดือน อยู่ที่ +4.90 สตางค์ (1.22%) เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +4.60 สตางค์ (1.18%)

ประเภท 6 เดือน อยู่ที่ +7.80 สตางค์ (1.69%) เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +7.10 สตางค์ (1.63%)

และประเภท 12 เดือน อยู่ที่ +15.00 สตางค์ (2.25%) เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +13.00 สตางค์ (1.98%)

ในส่วน SWAP OFF-SHORE ในวันศุกร์ ราคา Swap point ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ +0.50 (1.00%) 1 เดือน อยู่ที่ +3.00 (1.39%) 2 เดือน อยู่ที่ +6.00 สตางค์ (1.52%) 3 เดือน อยู่ที่ +9.00 สตางค์ (1.69%) 6 เดือน อยู่ที่ +18.00 สตางค์ (2.29%) และ 12 เดือน อยู่ที่ +40.00 สตางค์ (2.99%)

ในส่วนของตัวเลขทุนสำรองระหว่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยในวันที่ 5 มิ.ย. 2552 ตัวเลขเงินทุนสำรอง อยู่ที่ระดับ 120.6 พันล้านดอลลาร์ ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้ว (29 พ.ค.) ที่ 121.5 พันล้านดอลลาร์ ส่วนของ Forward Baht Commitment อยู่ที่ระดับ 7.2 พันล้านดอลลาร์ เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้ว (29 พ.ค.) ที่ 6.3 พันล้านดอลลาร์