

ภาวะตลาดเงินและตลาด Swap (15-19 มิถุนายน 2552)

การกู้ยืมเงินผ่านตลาดเงิน

การกู้ยืมเงินในตลาดเงินกลับมาคึกคักมากขึ้นในช่วงเปิดบัญชี โดยเพิ่มการลงทุนที่มีระยะเวลายาวที่ให้ผลตอบแทนสูง และลดการลงทุนระยะสั้นที่ให้ผลตอบแทนน้อย เนื่องจากมองว่าแนวโน้มอัตราดอกเบี้ยของไทยอยู่ในระดับที่เหมาะสมแล้ว และยังมีแนวโน้มที่จะปรับเพิ่มขึ้นในเวลาอันสั้น ประกอบกับอัตราผลตอบแทนในตราสารหนี้ของไทยอยู่ในระดับที่น่าสนใจ

สรุป ปริมาณธุรกรรมการกู้ยืมในหน้าต่างตราสารหนี้ ธปท. ตลอดสัปดาห์นี้ (15 – 19 มิ.ย. 2552) อยู่ที่ 610,620 ล้านบาท (122,124 ล้านบาทต่อวัน) อยู่ในช่วง 100,630 – 152,960 ล้านบาท โดยปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 647,600 ล้านบาท (129,520 ล้านบาทต่อวัน) อยู่ในช่วง 96,050 – 163,790 ล้านบาท

ประเภท 1 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 547,600 ล้านบาท (109,520 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.12% โดยอยู่ในช่วง 87,520 – 133,060 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 581,550 ล้านบาท (116,310 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.12% โดยอยู่ในช่วง 92,520 – 148,990 ล้านบาท

ประเภท 7 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 47,240 ล้านบาท (9,448 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.12% โดยอยู่ในช่วง 4,670 – 14,580 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 51,130 ล้านบาท (10,226 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.11% โดยอยู่ในช่วง 1,100 – 14,090 ล้านบาท

ประเภท 14 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 10,530 ล้านบาท (2,106 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.14% โดยอยู่ในช่วง 370 – 3,450 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมเพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ก่อนที่ 6,190 ล้านบาท (1,238 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.14% โดยอยู่ในช่วง 200 – 2,700 ล้านบาท

ประเภท 1 เดือน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 5,250 ล้านบาท (1,313 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.17% โดยอยู่ในช่วง 1,000 – 1,870 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 8,730 ล้านบาท (1,746 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.16% โดยอยู่ในช่วง 800 – 2,640 ล้านบาท

สรุป ยอดคงค้างในตลาดกู้ยืมระหว่างธนาคาร (ข้อมูล ณ สิ้นวันที่ 18 มิ.ย. 52) อยู่ที่ 22,695 ล้านบาท ลดลงจากสัปดาห์ก่อน (12/6/09) ที่ 22,923 ล้านบาท โดยแบ่งเป็น

ประเภท At Call อยู่ที่ 1,600 ล้านบาท ลดลงเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (12/6/09) ที่ 2,500 ล้านบาท

ประเภท Term อยู่ที่ 9,920 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (12/6/09) ที่ 8,830 ล้านบาท

ประเภท O/N และ T/N อยู่ที่ 11,175 ล้านบาท ลดลงเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (12/6/09) ที่ 15,593 ล้านบาท สำหรับอัตราดอกเบี้ย Interbank ประเภท O/N เฉลี่ยการกู้ยืมกันมากที่สุดอยู่ที่ 1.15% โดยอยู่ในช่วง 0.75% – 1.17% ลงที่เมื่อเทียบกับเฉลี่ยการกู้ยืมกันมากที่สุดสัปดาห์ก่อน ที่ 1.15% และอยู่ในช่วง 0.7% – 1.25%

อัตราดอกเบี้ยในตลาดเงินกู้ยืมระหว่างธนาคาร (BIBOR) ณ วันที่ 19 มิ.ย. 52

ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ 1.27250% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.27375%

ประเภท 1 เดือน อยู่ที่ 1.30000% คงที่จากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.30000%

ประเภท 2 เดือน อยู่ที่ 1.34922% เพิ่มขึ้นจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.34797%

ประเภท 3 เดือน อยู่ที่ 1.40000% เพิ่มขึ้นจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.39375%

ประเภท 6 เดือน อยู่ที่ 1.50000% คงที่จากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.50000%

ประเภท 9 เดือน อยู่ที่ 1.57297% เพิ่มขึ้นจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.55281%

ประเภท 1 ปี อยู่ที่ 1.64250% เพิ่มขึ้นจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.60563%

การกู้ยืมผ่านตลาด Swap

ในสัปดาห์นี้ราคา Swap ไม่มีการเปลี่ยนแปลงมากนัก โดยอัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐฯ และสกุลเงินบาทเปลี่ยนแปลงไปในทิศทางเดียวกันตลอดทั้งสัปดาห์ ส่วนข่าวการพิจารณาเปลี่ยนแปลงหลักเกณฑ์การกำหนดอัตราดอกเบี้ย Libor ไม่ส่งผลกระทบต่ออัตราดอกเบี้ยสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐฯ เท่าใดนัก ก่อนปิดตลาดวันศุกร์ที่

ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ +0.47 สตางค์ (0.95%) ทรงตัวจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +0.47 สตางค์ (0.95%)

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

ประเภท 1 เดือน อยู่ที่ +2.05 สตางค์ (1.05%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +2.10 สตางค์ (1.07%)

ประเภท 2 เดือน อยู่ที่ +3.75 สตางค์ (1.11%) เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +3.70 สตางค์ (1.12%)

ประเภท 3 เดือน อยู่ที่ +4.80 สตางค์ (1.19%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +4.90 สตางค์ (1.22%)

ประเภท 6 เดือน อยู่ที่ +7.75 สตางค์ (1.66%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +7.80 สตางค์ (1.69%)

และประเภท 12 เดือน อยู่ที่ +15.00 สตางค์ (2.21%) ทรงตัวจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +15.00 สตางค์ (2.25%)

ในส่วน SWAP OFF-SHORE ในวันศุกร์ ราคา Swap point ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ +1.10 (1.91%) 1 เดือน อยู่ที่ +4.50 (1.93%) 2 เดือนอยู่ที่ +8.50 สตางค์ (1.92%) 3 เดือนอยู่ที่ +12.00 สตางค์ (2.03%) 6 เดือน อยู่ที่ +21.00 สตางค์ (2.44%) และ 12 เดือน อยู่ที่ +45.00 สตางค์ (3.10%)

ในส่วนของตัวเลขทุนสำรองระหว่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยในวันที่ 12 มิ.ย. 2552 ตัวเลขเงินทุนสำรองอยู่ที่ระดับ 122.1 พันล้านดอลลาร์ เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้ว (5 มิ.ย.) ที่ 120.6 พันล้านดอลลาร์

ส่วนของ Forward Baht Commitment อยู่ที่ระดับ 6.4 พันล้านดอลลาร์ ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้ว (5 มิ.ย.) ที่ 7.2 พันล้านดอลลาร์