

## ภาวะตลาดเงินและตลาด Swap (22-26 มิถุนายน 2552)

### การกู้ยืมเงินผ่านตลาดเงิน

การกู้ยืมเงินระหว่างธนาคารลดลง โดยลดการกู้ยืมระยะสั้นและเพิ่มการกู้ยืมระยะยาว หลังจากที่ได้รับอัตราผลตอบแทนในตราสารหนี้ของไทยอยู่ในระดับที่น่าพอใจ ประกอบกับอยู่ในช่วงกลางปีฯ ที่ผู้อำนวยการบริหารจัดการ นอกจากนี้ยังส่งผลให้ปริมาณธุรกรรมการกู้ยืมในหน้าต่างตราสารหนี้ ธปท. ลดลง

สรุป ปริมาณธุรกรรมการกู้ยืมในหน้าต่างตราสารหนี้ ธปท. ตลอดสัปดาห์นี้ (22 – 26 มิ.ย. 2552) อยู่ที่ 559,680 ล้านบาท (111,936 ล้านบาทต่อวัน) อยู่ในช่วง 92,900 – 142,220 ล้านบาท โดยปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 610,620 ล้านบาท (122,124 ล้านบาทต่อวัน) อยู่ในช่วง 100,630 – 152,960 ล้านบาท

ประเภท 1 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 507,710 ล้านบาท (101,542 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.12% โดยอยู่ในช่วง 87,190 – 130,310 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 547,600 ล้านบาท (109,520 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.12% โดยอยู่ในช่วง 87,520 – 133,060 ล้านบาท

ประเภท 7 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 40,580 ล้านบาท (8,116 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.13% โดยอยู่ในช่วง 5,060 – 11,170 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 47,240 ล้านบาท (9,448 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.12% โดยอยู่ในช่วง 4,670 – 14,580 ล้านบาท

ประเภท 14 วัน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 7,950 ล้านบาท (1,988 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.14% โดยอยู่ในช่วง 1,300 – 2,800 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 10,530 ล้านบาท (2,106 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.14% โดยอยู่ในช่วง 370 – 3,450 ล้านบาท

ประเภท 1 เดือน ปริมาณธุรกรรมอยู่ที่ 3,440 ล้านบาท (860 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.16% โดยอยู่ในช่วง 150 – 2,190 ล้านบาท ทั้งนี้ปริมาณธุรกรรมลดลงจากสัปดาห์ก่อนที่ 5,250 ล้านบาท (1,313 ล้านบาทต่อวัน) และมีอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยอยู่ที่ 1.17% โดยอยู่ในช่วง 1,000 – 1,870 ล้านบาท

สรุป ยอดคงค้างในตลาดกู้ยืมระหว่างธนาคาร (ข้อมูล ณ สิ้นวันที่ 25 มิ.ย. 52) อยู่ที่ 24,560 ล้านบาท ลดลงจากสัปดาห์ก่อน (19/6/09) ที่ 29,015 ล้านบาท โดยแบ่งเป็น

ประเภท At Call อยู่ที่ 3,000 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (19/6/09) ที่ 2,200 ล้านบาท

ประเภท Term อยู่ที่ 12,470 ล้านบาท เพิ่มขึ้นเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (19/6/09) ที่ 9,320 ล้านบาท

ประเภท O/N และ T/N อยู่ที่ 9,090 ล้านบาท ลดลงเมื่อเทียบกับปลายสัปดาห์ก่อน (19/6/09) ที่ 17,495 ล้านบาท สำหรับอัตราดอกเบี้ย Interbank ประเภท O/N เฉลี่ยการกู้ยืมกันมากที่สุดอยู่ที่ 1.15% โดยอยู่ในช่วง 0.72% – 1.18% คงที่เมื่อเทียบกับเฉลี่ยการกู้ยืมกันมากที่สุดสัปดาห์ก่อน ที่ 1.15% และอยู่ในช่วง 0.75% – 1.17%

อัตราดอกเบี้ยในตลาดเงินกู้ยืมระหว่างธนาคาร (BIBOR) ณ วันที่ 26 มิ.ย. 52

ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ 1.27500% เพิ่มขึ้นจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.27250%

ประเภท 1 เดือน อยู่ที่ 1.30000% คงที่จากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.30000%

ประเภท 2 เดือน อยู่ที่ 1.34797% ลดลงจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.34922%

ประเภท 3 เดือน อยู่ที่ 1.40000% คงที่จากวันศุกร์ที่แล้ว 1.40000%

ประเภท 6 เดือน อยู่ที่ 1.50000% คงที่จากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.50000%

ประเภท 9 เดือน อยู่ที่ 1.58922% เพิ่มขึ้นจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.57297%

ประเภท 1 ปี อยู่ที่ 1.67188% เพิ่มขึ้นจากวันศุกร์ที่แล้วที่ 1.64250%

#### การกู้ยืมผ่านตลาด Swap

ในสัปดาห์นี้ราคา Swap ไม่มีการเปลี่ยนแปลงมากนัก โดยภายหลังการประชุมของเฟดซึ่งคงอัตราดอกเบี้ยนโยบายไว้ที่ระดับ 0-0.25% และผลประกาศตัวเลขเศรษฐกิจต่าง ๆ สะท้อนถึงภาพรวมเศรษฐกิจที่ยังไม่ดีขึ้น ส่งผลให้มีแรงซื้อพันธบัตรรัฐบาล ทำให้อัตราผลตอบแทนของพันธบัตรรัฐบาลสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐฯ และสกุลเงินบาทเปลี่ยนแปลงลดลงในทิศทางเดียวกัน ก่อนปิดตลาดวันศุกร์ที่

ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ +0.57 สตางค์ (1.00%) เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +0.47 สตางค์ (0.95%)

ประเภท 2 สัปดาห์ อยู่ที่ +0.99 สตางค์ (1.02%) เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +0.96 สตางค์ (0.95%)

ประเภท 1 เดือน อยู่ที่ +2.10 สตางค์ (1.04%) เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +2.05 สตางค์ (1.05%)

ประเภท 2 เดือน อยู่ที่ +3.75 สตางค์ (1.09%) ทรงตัวจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +3.75 สตางค์ (1.11%)

ประเภท 3 เดือน อยู่ที่ +5.00 สตางค์ (1.20%) เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +4.80 สตางค์ (1.19%)

ประเภท 6 เดือน อยู่ที่ +7.50 สตางค์ (1.57%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +7.75 สตางค์ (1.66%)

และประเภท 12 เดือน อยู่ที่ +14.00 สตางค์ (2.08%) ลดลงจากสัปดาห์ที่แล้วที่อยู่ +15.00 สตางค์ (2.21%)

ในส่วน SWAP OFF-SHORE ในวันศุกร์ ราคา Swap point ประเภท 1 สัปดาห์ อยู่ที่ +1.20 (1.84%) 1 เดือน อยู่ที่ +4.50 (1.87%) 2 เดือนอยู่ที่ +8.00 สตางค์ (1.81%) 3 เดือนอยู่ที่ +11.00 สตางค์ (1.89%) 6 เดือน อยู่ที่ +20.00 สตางค์ (2.30%) และ 12 เดือน อยู่ที่ +45.00 สตางค์ (3.00%)

ในส่วนของตัวเลขทุนสำรองระหว่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยในวันที่ 19 มิ.ย. 2552 ตัวเลขเงินทุนสำรองอยู่ที่ระดับ 122.4 พันล้านดอลลาร์ เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้ว (12 มิ.ย.) ที่ 122.1 พันล้านดอลลาร์ ส่วนของ Forward Baht Commitment อยู่ที่ระดับ 6.5 พันล้านดอลลาร์ เพิ่มขึ้นจากสัปดาห์ที่แล้ว (12 มิ.ย.) ที่ 6.4 พันล้านดอลลาร์