



ฉบับที่ 171/2559

วันที่ 22 ธันวาคม 2559

รายงานสถานะหนี้สาธารณะคงค้าง ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2559

นายธีรชัย อัดนวนิช รองผู้อำนวยการสำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ รักษาการในตำแหน่งที่ปรึกษา ด้านตลาดตราสารหนี้ ได้รายงานสถานะหนี้สาธารณะคงค้าง ดังนี้

หนี้สาธารณะคงค้าง ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2559 มีจำนวน 5,985,175.01 ล้านบาท หรือคิดเป็น ร้อยละ 42.71 ของ GDP โดยแบ่งเป็น หนี้รัฐบาล 4,491,860.05 ล้านบาท หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบัน การเงิน 984,958.41 ล้านบาท หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน) 487,049.87 ล้านบาท และ หนี้หน่วยงานของรัฐ 21,306.68 ล้านบาท และเมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้า หนี้สาธารณะคงค้างลดลง เล็กน้อย 3,211.52 ล้านบาท โดยมีรายละเอียด ดังนี้

❖ **หนี้รัฐบาล** จำนวน 4,491,860.05 ล้านบาท เพิ่มขึ้นสุทธิ 20,639.83 ล้านบาท โดยการเปลี่ยนแปลง ที่สำคัญเกิดจาก

- การกู้เงินเพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณ จำนวน 52,714 ล้านบาท โดยการออกพันธบัตร รัฐบาลทั้งจำนวน

- การลดลงของตัวเงินคลัง จำนวน 30,000 ล้านบาท

- การกู้เงินเพื่อการลงทุนจากแหล่งเงินกู้ในประเทศ จำนวน 2,178.97 ล้านบาท

โดยแบ่งเป็น (1) การกู้เงินเพื่อให้ผู้ต่อแ่การรถไฟแห่งประเทศไทย จำนวน 1,150.11 ล้านบาท สำหรับดำเนิน โครงการก่อสร้างรถไฟทางคู่ ช่วงชุมทางถนนจิระ – ขอนแก่น จำนวน 776.02 ล้านบาท โครงการรถไฟชานเมือง สายสีแดง ช่วงบางซื่อ – รังสิต จำนวน 138.67 ล้านบาท โครงการก่อสร้างทางคู่ในเส้นทางรถไฟ สายชายฝั่งทะเล ตะวันออก ช่วงฉะเชิงเทรา – คลองสิบเก้า – แก่งคอย จำนวน 118.26 ล้านบาท และ โครงการปรับปรุงทางรถไฟที่ไม่ปลอดภัยต่อการเดินรถ จำนวน 117.16 ล้านบาท และ (2) การกู้เงินเพื่อให้ผู้ต่อแ่การรถไฟฟ้าขนส่งมวลชน แห่งประเทศไทย จำนวน 1,028.86 ล้านบาท โครงการรถไฟฟ้าสายสีเขียว จำนวน 619.18 ล้านบาท สายสีน้ำเงิน จำนวน 391.62 ล้านบาท และสายสีม่วง จำนวน 18.06 ล้านบาท

- การชำระหนี้เงินต้นและดอกเบี้ยจากหนี้ที่รัฐบาลกู้โดยตรง จำนวน 5,542.80 ล้านบาท แบ่งเป็น

- การชำระหนี้ที่รัฐบาลให้ผู้ต่อแ่การรถไฟแห่งประเทศไทย จำนวน 2,209.58 ล้านบาท การชำระหนี้ที่กระทรวงการคลังได้รับโครงสร้างหนี้แทนการรถไฟฟ้าขนส่งมวลชนแห่งประเทศไทย จำนวน 516.67 ล้านบาท และการชำระหนี้ต่างประเทศ จำนวน 327.78 ล้านบาท

- การชำระดอกเบี้ย จำนวน 2,488.77 ล้านบาท โดยเป็นการชำระดอกเบี้ยหนี้ในประเทศ จำนวน 2,386.84 ล้านบาท และ ดอกเบี้ยต่างประเทศ จำนวน 101.93 ล้านบาท

- การชำระหนี้ที่รัฐบาลกู้เพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนา ระบบสถาบันการเงิน จำนวน 2,798.53 ล้านบาท โดยใช้เงินจากบัญชีสะสมเพื่อการชำระคืนเงินกู้ซึ่งใช้ความเสียหายของกองทุนเพื่อการฟื้นฟูฯ แบ่งเป็นชำระเงินต้น จำนวน 460.10 ล้านบาท และชำระดอกเบี้ย จำนวน 2,338.43 ล้านบาท

- หนี้ต่างประเทศลดลง 1,066.79 ล้านบาท เนื่องจากผลจากการเบิกจ่ายน้อยกว่าการชำระคืนหนี้สกุลเงินเยน และผลการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน

❖ หนี้ของรัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน จำนวน 984,958.41 ล้านบาท ลดลงสุทธิ 9,835.88 ล้านบาท โดยการเปลี่ยนแปลงที่สำคัญเกิดจาก

- บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) ใ้ถ่ถอนหุ้นกู้ จำนวน 8,000 ล้านบาท

- หนี้ต่างประเทศลดลง 2,172.73 ล้านบาท เนื่องจากผลจากการชำระคืนหนี้สกุลเงินต่างๆ และ ผลการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน

❖ หนี้ของรัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน) จำนวน 487,049.87 ล้านบาท ลดลงสุทธิ 13,004.46 ล้านบาท โดยรายการที่สำคัญเกิดจากการชำระคืนเงินกู้ของธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์ การเกษตรจำนวน 13,004 ล้านบาท

❖ หนี้หน่วยงานของรัฐ จำนวน 21,306.68 ล้านบาท ลดลงสุทธิ 1,011.01 ล้านบาท โดยรายการที่สำคัญเกิดจากการเบิกจ่ายจากแหล่งเงินกู้ที่น้อยกว่าชำระคืนเงินกู้ของสำนักงานกองทุนอ้อยและน้ำตาลทราย จำนวน 934.56 ล้านบาท

หนี้สาธารณะ ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2559 จำนวน 5,985,175.01 ล้านบาท แบ่งออกเป็น หนี้ในประเทศ 5,641,976.79 ล้านบาท หรือร้อยละ 94.27 และหนี้ต่างประเทศ 343,198.22 ล้านบาท (ประมาณ 9,931.69 ล้านดอลลาร์สหรัฐ) หรือร้อยละ 5.73 ของหนี้สาธารณะคงค้างทั้งหมดและแบ่งออกเป็นหนี้ระยะยาว 5,146,374.05 ล้านบาท หรือร้อยละ 85.99 และหนี้ระยะสั้น 838,800.96 ล้านบาท หรือร้อยละ 14.01 ของหนี้สาธารณะคงค้างทั้งหมด

คณะโฆษกสำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ

โทร. 02 265 8050 ต่อ 5505 5518 และ 5520

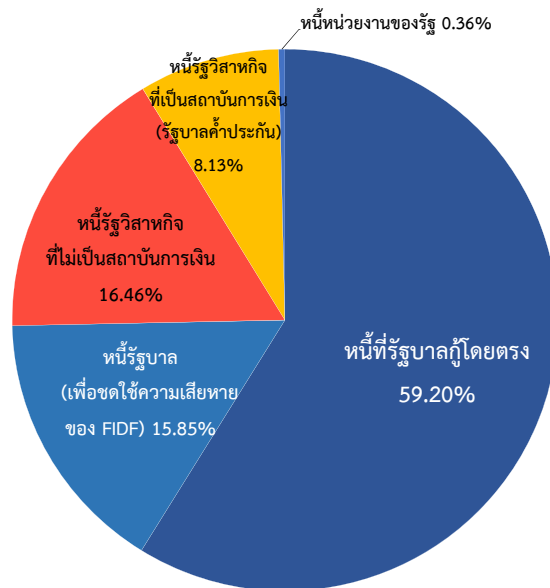
สำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ (สบน.) ขอรายงานสถานะหนี้สาธารณะคงค้าง ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2559 ดังนี้

ยอดหนี้สาธารณะคงค้าง ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2559 มีจำนวน 5,985,175.01 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 42.71 ของ GDP เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้า หนี้สาธารณะลดลงสุทธิ 3,211.52 ล้านบาท โดยมีรายละเอียด ดังนี้

1. หนี้รัฐบาล 4,491,860.05 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 20,639.83 ล้านบาท
2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน 984,958.41 ล้านบาท ลดลง 9,835.88 ล้านบาท
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน) 487,049.87 ล้านบาท ลดลง 13,004.46 ล้านบาท
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ 21,306.68 ล้านบาท ลดลง 1,011.01 ล้านบาท

ทั้งนี้ สัดส่วนและรายละเอียดของหนี้สาธารณะ ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2559 ปรากฏตามแผนภาพที่ 1 และตารางที่ 1 ตามลำดับ

แผนภาพที่ 1 สัดส่วนหนี้สาธารณะจำแนกตามประเภท



1. หนี้รัฐบาล

1.1 หนี้ที่รัฐบาลกู้โดยตรง เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าเพิ่มขึ้นสุทธิ 21,099.93 ล้านบาท เนื่องจาก

1.1.1 หนี้ต่างประเทศ ลดลงสุทธิ 1,066.79 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า โดยเป็นผลจากการเบิกจ่ายและชำระคืนหนี้สกุลเงินเยน และผลการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 2

ตารางที่ 2 การเปลี่ยนแปลงของหนี้ต่างประเทศที่รัฐบาลกู้โดยตรง

สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ ก.ย. 59 (1)	หนี้คงค้าง ณ ต.ค. 59 (2)	ผลจากการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 59		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 59 (7) + (4)	อัตราแลกเปลี่ยน ²			
			ด้าน CAD/EUR/JPY/USD (3)	ด้านบาท (4) = (3)×(ข)	หนี้เดือน ก.ย. 59 (ล้านบาท) (5) = (1)×(ก)	หนี้เดือน ต.ค. 59 (ล้านบาท) (6) = (1)×(ข)	เพิ่ม/ลด (7) = (6) - (5)		สกุลเงิน	ก.ย. 59 (ก)	ต.ค. 59 (ข)	
เงินกู้ที่ไปเป็นเงินบาท/โครงการของรัฐบาล												
หนี้ที่ยังไม่ได้มีการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	CAD	26.64	26.35
	EUR	-	-	-	-	-	-	-	-	EUR	39.28	38.78
	JPY	-	-	-	-	-	-	-	-	JPY	0.35	0.34
	USD	359.94	359.94	-	-	12,553.16	12,663.80	110.65	110.65	USD	34.88	35.18
หนี้ที่ได้มีการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ³	JPY	41,148.35	40,135.20	(1,013.15)	(327.78)	-	-	-	(327.78)			
	USD	456.57	456.57	-	-	-	-	-	-			
เงินกู้ให้กู้												
หนี้ที่ยังไม่ได้มีการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	CAD	8.71	8.71	-	-	231.92	229.45	(2.48)	(2.48)			
	EUR	-	-	-	-	-	-	-	-			
	JPY	109,099.75	109,463.83	364.09	122.96	37,862.08	36,845.82	(1,016.26)	(893.30)			
	USD	150.00	150.00	-	-	5,231.33	5,277.44	46.11	46.11			
หนี้ที่ได้มีการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ³	JPY	-	-	-	-	-	-	-	-			
	USD	500.00	500.00	-	-	-	-	-	-			
รวม					(204.82)			(861.97)	(1,066.79)			

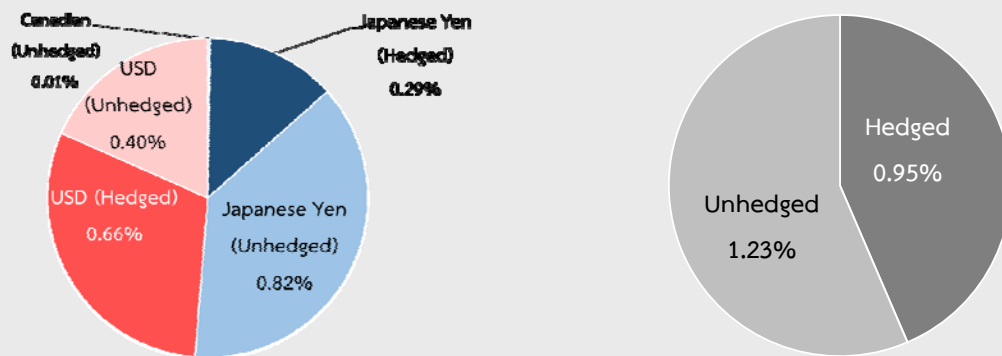
- CAD=สกุลเงินเหรียญแคนาดา EUR=สกุลเงินยูโร JPY=สกุลเงินเยน และ USD=สกุลเงินเหรียญสหรัฐ
- อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราตัวเฉลี่ย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน
- หนี้ต่างประเทศที่มีการบริหารความเสี่ยงแล้ว ใช้อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่ทำการบริหารความเสี่ยง

หากพิจารณาในรูปเงินบาท หนี้ที่รัฐบาลกู้โดยตรงจำแนกเป็นสกุลเงินต่างๆ หลังจากที่ได้บริหารความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนแล้วมีรายละเอียดปรากฏตามแผนภาพที่ 2

แผนภาพที่ 2 หนี้ต่างประเทศที่รัฐบาลกู้โดยตรงที่บริหารความเสี่ยงและจำแนกเป็นสกุลเงินต่างๆ

สกุลเงิน	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)		
		รวม	Hedged	Unhedged
เยน	149,599.04	49,854.68	12,885.89	36,968.78
เหรียญสหรัฐ	1,466.51	47,584.99	29,643.75	17,941.24
เหรียญแคนาดา	8.71	229.45	-	229.45
ยูโร	-	-	-	-
รวมหนี้ต่างประเทศของรัฐบาล (1)		97,669.12	42,529.65	55,139.47
หนี้ของรัฐบาลทั้งหมด (2)		4,491,860.05		
ร้อยละของหนี้ต่างประเทศต่อหนี้ทั้งหมด ของรัฐบาล (%) = (1)/(2)		2.18	0.95	1.23

ร้อยละของหนี้ต่างประเทศที่รัฐบาลกู้โดยตรงต่อหนี้รัฐบาลทั้งหมด โดยจำแนกเป็นหนี้ที่ยังไม่ได้มีการบริหารความเสี่ยง และหนี้ที่ได้มีการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน



1.1.2 หนี้ในประเทศ เพิ่มขึ้นสุทธิ 22,166.72 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า เนื่องจาก

- การกู้เงินเพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณและการบริหารหนี้สาธารณะ เพิ่มขึ้น 22,714 ล้านบาท โดยมีรายละเอียด ดังนี้
 - การกู้เงินเพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณ จำนวน 52,714 ล้านบาท โดยการออกพันธบัตรรัฐบาลทั้งจำนวน
 - การลดลงของตั๋วเงินคลัง จำนวน 30,000 ล้านบาท
 - เงินกู้ให้กู้ต่อลดลง 30.61 ล้านบาท เนื่องจาก
 - การชำระหนี้ของการรถไฟแห่งประเทศไทย จำนวน 2,209.58 ล้านบาท

- การรถไฟแห่งประเทศไทยเบิกจ่ายเงินกู้จำนวน 1,150.11 ล้านบาท เพื่อจัดทำโครงการก่อสร้างรถไฟทางคู่ ช่วงชุมทางถนนจิระ – ขอนแก่น จำนวน 776.02 ล้านบาท โครงการรถไฟชานเมืองสายสีแดง ช่วงบางซื่อ – รังสิต จำนวน 138.67 ล้านบาท โครงการก่อสร้างทางคู่ในเส้นทางรถไฟ สายชายฝั่งทะเลตะวันออก ช่วงฉะเชิงเทรา – คลองสิบเก้า – แก่งคอย จำนวน 118.26 ล้านบาท และ โครงการปรับปรุงทางรถไฟที่ไม่ปลอดภัยต่อการเดินรถ จำนวน 117.16 ล้านบาท

- การรถไฟฟ้านครหลวงแห่งประเทศไทยเบิกจ่ายเงินกู้จำนวน 1,028.86 ล้านบาท เพื่อจัดทำโครงการรถไฟฟ้านครหลวงสายสีเขียว จำนวน 619.18 ล้านบาท สายสีน้ำเงิน จำนวน 391.62 ล้านบาท และสายสีม่วง จำนวน 18.06 ล้านบาท

• เงินกู้เพื่อปรับโครงสร้างหนี้ต่างประเทศที่กระทรวงการคลังค้ำประกันลดลง 516.67 ล้านบาท โดยการไถ่ถอนตัวสัญญาใช้เงินทั้งจำนวน ซึ่งหนี้ที่ชำระคืนดังกล่าวเป็นหนี้ที่กระทรวงการคลังได้ปรับโครงสร้างหนี้แทนการรถไฟฟ้านครหลวงแห่งประเทศไทย

1.2 หนี้ที่รัฐบาลกู้เพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูฯ ลดลงจากเดือนก่อนหน้า จำนวน 460.10 ล้านบาท จากการชำระหนี้ที่กู้มาภายใต้พระราชกำหนดให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินและจัดการเงินกู้ เพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาาระบบสถาบันการเงิน ระยะที่สอง พ.ศ. 2545 (FIDF 3) โดยใช้เงินจากบัญชีสะสมเพื่อการชำระคืนต้นเงินกู้ชดใช้ความเสียหายของกองทุนเพื่อการฟื้นฟูฯ

2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน

2.1 หนี้ที่รัฐบาลค้ำประกัน

2.1.1 หนี้ต่างประเทศ ลดลงสุทธิ 1,315.23 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า โดยเป็นผลจากการชำระคืนหนี้สกุลเงินเยนและผลการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 3

ตารางที่ 3 การเปลี่ยนแปลงของหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)

สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ ก.ย. 59	หนี้คงค้าง ณ ต.ค. 59	ผลจากการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 59		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 59	อัตราแลกเปลี่ยน ²		
			ล้าน CAD/EUR/JPY/USD	ล้านบาท	หนี้สิ้นเดือน ก.ย. 59 (ล้านบาท)	หนี้สิ้นเดือน ต.ค. 59 (ล้านบาท)	เพิ่ม/(ลด)		สกุลเงิน	ก.ย. 59 (ก)	ต.ค. 59 (ข)
	(1)	(2)	(3)	(4) = (3)×(ข)	(5) = (1)×(ก)	(6) = (1)×(ข)	(7) = (6) - (5)	(7) + (4)			
หนี้ที่ยังไม่มีการบริหาร	EUR 39.32	39.32	-	-	1,544.58	1,524.69	(19.88)	(19.88)	EUR	39.28	38.78
ความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	JPY 86,219.39	86,171.29	(48.10)	(16.24)	29,921.66	29,118.53	(803.13)	(819.38)	JPY	0.35	0.34
	USD -	-	-	-	-	-	-	-	USD	34.88	35.18
หนี้ที่ได้มีการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ³	JPY 205,190.26	204,090.71	(1,099.55)	(352.32)	4,606.56	4,482.92	(123.64)	(475.96)			
	USD -	-	-	-	-	-	-	-			
	รวม			(368.56)			(946.67)	(1,315.23)			

1. EUR=สกุลเงินยูโร JPY=สกุลเงินเยน และ USD=สกุลเงินเหรียญสหรัฐ
2. อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราถ่วงเฉลี่ยขาย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน
3. หนี้คงค้างต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจบางส่วนได้มีการบริหารจัดการความเสี่ยงแล้ว (Partial Hedge)

2.1.2 หนี้ในประเทศ เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าเพิ่มขึ้นสุทธิ 755.55 ล้านบาท เนื่องจากรัฐวิสาหกิจมีการเบิกจ่ายจากแหล่งเงินกู้ต่างๆ มากกว่าชำระคืนต้นเงินกู้ โดยเป็นการเบิกจ่ายเงินกู้ 3,447.09 ล้านบาท และชำระคืนต้นเงินกู้ 2,691.54 ล้านบาท

2.2 หนี้ที่รัฐบาลไม่ค้ำประกัน

2.2.1 หนี้ต่างประเทศ ลดลงสุทธิ 857.50 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า โดยเป็นผลจากการชำระคืนหนี้สกุลเงินต่างๆ ของบริษัท การบินไทย จำกัด (มหาชน) และผลการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 4

ตารางที่ 4 การเปลี่ยนแปลงของหนี้ต่างประเทศของรัฐบาลกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลไม่ค้ำประกัน)

สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ ก.ย. 59 (1)	หนี้คงค้าง ณ ต.ค. 59 (2)	ผลจากการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 59		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 59 (7) + (4)	อัตราแลกเปลี่ยน ²		
			ล้าน CAD/EUR/JPY/USD (3)	ล้านบาท (4) = (3)×(ข)	หนี้สิ้นเดือน ก.ย. 59 (ล้านบาท) (5) = (1)×(ก)	หนี้สิ้นเดือน ต.ค. 59 (ล้านบาท) (6) = (1)×(ข)	เพิ่ม/(ลด) (7) = (6) - (5)		สกุลเงิน	ก.ย. 59 (ก)	ต.ค. 59 (ข)
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการบริหาร	EUR 1,237.98	1,221.93	(16.05)	(622.36)	48,630.24	48,004.32	(625.92)	(1,248.29)	EUR	39.28	38.78
ความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ³	JPY 34,373.47	34,182.08	(191.39)	(64.64)	11,929.00	11,608.81	(320.19)	(384.83)	JPY	0.35	0.34
	USD 2,109.35	2,108.71	(0.64)	(22.65)	73,564.68	74,213.09	648.41	625.77	USD	34.88	35.18
หนี้ที่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	JPY 59,000.00	59,000.00	-	-	17,000.17	17,150.01	149.84	149.84			
รวม				(709.63)			(147.87)	(857.50)			

- EUR=สกุลเงินยูโร JPY=สกุลเงินเยน และ USD=สกุลเงินเหรียญสหรัฐ
- อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราตัวเฉลี่ยขาย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน
- หนี้ที่ยังไม่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน เนื่องจากรัฐบาลกิจมีรายรับและรายจ่ายหนี้ต่างประเทศเป็นสกุลเงินตราต่างประเทศ (Natural Hedged) โดยประกอบไปด้วย บริษัท การบินไทย จำกัด (มหาชน) และ บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)

2.2.2 หนี้ในประเทศ เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าลดลงสุทธิ 8,418.70 ล้านบาท เนื่องจาก

- บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) ไถ่ถอนหุ้นกู้ จำนวน 8,000 ล้านบาท
- การไฟฟ้าส่วนภูมิภาค ไถ่ถอนพันธบัตรที่ครบกำหนด จำนวน 93 ล้านบาท
- รัฐบาลกิจมีการเบิกจ่ายจากแหล่งเงินกู้ต่างๆ น้อยกว่าชำระคืนต้นเงินกู้ จำนวน 325.70 ล้านบาท

โดยเป็นการเบิกจ่ายเงินกู้ 1,959.66 ล้านบาท และชำระคืนต้นเงินกู้ 2,285.36 ล้านบาท

3. หนี้รัฐบาลกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)

3.1 หนี้ต่างประเทศ ลดลงสุทธิ 0.46 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า โดยเป็นผลจากผลการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 5

ตารางที่ 5 การเปลี่ยนแปลงของหนี้ต่างประเทศของรัฐบาลกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)

สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ ก.ย. 59 (1)	หนี้คงค้าง ณ ต.ค. 59 (2)	ผลจากการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 59		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 59 (7) + (4)	อัตราแลกเปลี่ยน ²		
			ล้าน CAD/EUR/JPY/USD (3)	ล้านบาท (4) = (3)×(ข)	หนี้สิ้นเดือน ก.ย. 59 (ล้านบาท) (5) = (1)×(ก)	หนี้สิ้นเดือน ต.ค. 59 (ล้านบาท) (6) = (1)×(ข)	เพิ่ม/(ลด) (7) = (6) - (5)		สกุลเงิน	ก.ย. 59 (ก)	ต.ค. 59 (ข)
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการบริหาร	EUR 3.10	3.10	-	-	121.83	120.26	(1.57)	(1.57)	EUR	39.28	38.78
ความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	USD 3.58	3.58	-	-	124.97	126.07	1.11	1.11	USD	34.88	35.18
หนี้ที่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	EUR -	-	-	-	-	-	-	-			
	JPY 2,120.25	2,120.25	-	-	-	-	-	-			
รวม							(0.46)	(0.46)			

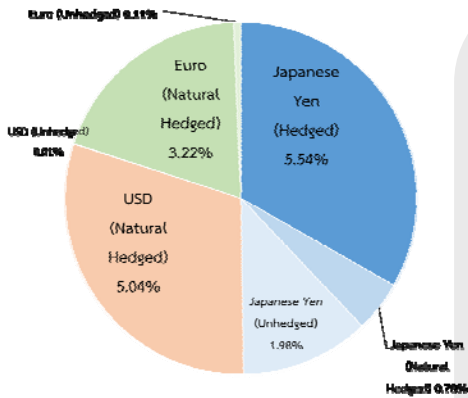
- EUR=สกุลเงินยูโร JPY=สกุลเงินเยน และ USD=สกุลเงินเหรียญสหรัฐ
- อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราตัวเฉลี่ยขาย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน

3.2 หนี้ในประเทศ เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าลดลง 13,004 ล้านบาท เนื่องจากธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตรชำระคืนต้นเงินกู้ จำนวน 11,004 ล้านบาท และไถ่ถอนพันธบัตร จำนวน 2,000 ล้านบาท

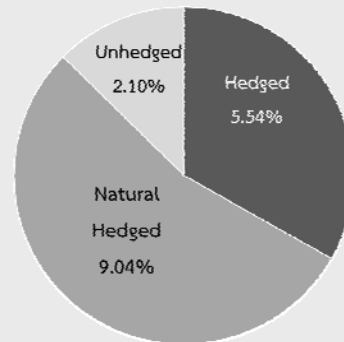
ทั้งนี้ หากพิจารณาในรูปเงินบาท หนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน และรัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน) หลังจากได้บริหารความเสี่ยงของอัตราแลกเปลี่ยนแล้วมีรายละเอียดปรากฏตามแผนภาพที่ 3

แผนภาพที่ 3 หนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน และรัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน) ที่บริหารความเสี่ยงและจำแนกเป็นสกุลเงินต่างๆ

สกุลเงิน	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)			
		รวม	Hedged	Natural Hedged	Unhedged
เยน	385,564.33	122,185.67	81,539.21	11,544.18	29,102.28
เหรียญสหรัฐ	2,112.29	74,316.52	-	74,190.45	126.07
ยูโร	1,264.36	49,026.91	-	47,381.95	1,644.96
รวมหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจ (1)		245,529.10	81,539.21	133,116.58	30,873.31
หนี้รัฐวิสาหกิจทั้งหมด (2)		1,472,008.28			
ร้อยละของหนี้ต่างประเทศต่อหนี้ทั้งหมดของรัฐวิสาหกิจ (%) = (1)/(2)		16.68	5.54	9.04	2.10



ร้อยละของหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจต่อหนี้ทั้งหมดของรัฐวิสาหกิจ โดยจำแนกเป็นหนี้ที่ยังไม่ได้มีการบริหารความเสี่ยง หนี้ที่ได้มีการบริหารความเสี่ยง และหนี้ที่บริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนโดยวิธี Natural Hedged



4. หนี้หน่วยงานของรัฐ ลดลงสุทธิ 1,011.01 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า เนื่องจากหน่วยงานของรัฐมีการเบิกจ่ายจากแหล่งเงินกู้ 12.07 ล้านบาท น้อยกว่าการชำระคืนต้นเงินกู้ 1,023.08 ล้านบาท

หนี้สาธารณะคงค้าง ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2559 มีจำนวน 5,985,175.01 ล้านบาท ซึ่งสามารถแบ่งประเภทเป็นหนี้ต่างประเทศ-หนี้ในประเทศ และหนี้ระยะยาว-หนี้ระยะสั้นได้ ดังนี้

หนี้ต่างประเทศและหนี้ในประเทศ แบ่งออกเป็น หนี้ต่างประเทศ 343,198.22 ล้านบาท หรือร้อยละ 5.73 และหนี้ในประเทศ 5,641,976.79 ล้านบาท หรือร้อยละ 94.27 ของยอดหนี้สาธารณะคงค้าง รายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 6

ตารางที่ 6 สัดส่วนหนี้ต่างประเทศและหนี้ในประเทศ

	หนี้สาธารณะ	หนี้ต่างประเทศ		หนี้ในประเทศ	
	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)	%	(ล้านบาท)	%
1. หนี้รัฐบาล	4,491,860.05	97,669.12	2.17	4,394,190.93	97.83
2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน	984,958.41	244,763.64	24.85	740,194.77	75.15
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	487,049.87	765.46	0.16	486,284.41	99.84
4. หนี้หน่วยงานอื่นของรัฐ	21,306.68	-	-	21,306.68	100.00
รวม	5,985,175.01	343,198.22	5.73	5,641,976.79	94.27

หนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น แบ่งออกเป็น 2 ประเภท ดังนี้

- หนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุของเครื่องมือการกู้เงิน) แบ่งออกเป็น หนี้ระยะยาว 5,871,084.08 ล้านบาท หรือร้อยละ 98.09 และหนี้ระยะสั้น 114,090.93 ล้านบาท หรือร้อยละ 1.91 ของยอดหนี้สาธารณะคงค้าง รายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 7

ตารางที่ 7 สัดส่วนหนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุของเครื่องมือการกู้เงิน)

	หนี้สาธารณะ	หนี้ระยะยาว		หนี้ระยะสั้น	
	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)	%	(ล้านบาท)	%
1. หนี้รัฐบาล	4,491,860.05	4,388,345.79	97.70	103,514.26	2.30
2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน	984,958.41	974,441.77	98.93	10,516.64	1.07
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	487,049.87	487,049.87	100.00	-	-
4. หนี้หน่วยงานอื่นของรัฐ	21,306.68	21,246.65	99.72	60.03	0.28
รวม	5,985,175.01	5,871,084.08	98.09	114,090.93	1.91

- หนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุคงเหลือ) แบ่งออกเป็น หนี้ระยะยาว 5,146,374.05 ล้านบาท หรือร้อยละ 85.99 และหนี้ระยะสั้น 838,800.96 ล้านบาท หรือร้อยละ 14.01 ของยอดหนี้สาธารณะคงค้าง รายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 8

ตารางที่ 8 สัดส่วนหนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุคงเหลือ)

	หนี้สาธารณะ	หนี้ระยะยาว		หนี้ระยะสั้น	
	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)	%	(ล้านบาท)	%
1. หนี้รัฐบาล	4,491,860.05	3,941,342.39	87.74	550,517.66	12.26
2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน	984,958.41	866,337.68	87.96	118,620.73	12.04
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	487,049.87	319,520.12	65.60	167,529.75	34.40
4. หนี้หน่วยงานอื่นของรัฐ	21,306.68	19,173.86	89.99	2,132.82	10.01
รวม	5,985,175.01	5,146,374.05	85.99	838,800.96	14.01

หมายเหตุ: การนำข้อมูลและ/หรือบทวิเคราะห์ของสำนักงานบริหารหนี้สาธารณะไปใช้และ/หรือเผยแพร่ต่อ ขอความกรุณาอ้างอิงแหล่งที่มาของข้อมูลด้วย

ส่วนวิจัยนโยบายหนี้สาธารณะ สำนักนโยบายและแผน

สำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ โทร. 0 2265 8050 ต่อ 5518 และ 5520

สำนักงานบริหารหนี้สาธารณะขอสรุปผลการบริหารจัดการหนี้ภาครัฐที่ดำเนินการโดยสำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ ประจำเดือนตุลาคม 2559 วงเงินรวม 71,322.26 ล้านบาท โดยแบ่งเป็นหนี้รัฐบาล 63,357.26 ล้านบาท และหนี้รัฐวิสาหกิจ 7,965 ล้านบาท ดังนี้

1. การบริหารจัดการหนี้รัฐบาล วงเงินรวม 63,357.26 ล้านบาท ประกอบด้วย

- 1.1 การกู้เงินในประเทศ 54,892.97 ล้านบาท
- 1.2 การเบิกจ่ายเงินกู้ต่างประเทศ 122.96 ล้านบาท
- 1.3 การชำระหนี้ 8,341.33 ล้านบาท

1.1 การกู้เงินในประเทศ กระทรวงการคลังกู้เงินและเบิกจ่ายเงินกู้ จำนวน 54,892.97 ล้านบาท โดยมีรายละเอียด ดังนี้ (โปรดดูตารางที่ 1 ประกอบ)

1.1.1 การกู้เงินเพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณ จำนวน 52,714 ล้านบาท โดยการออกพันธบัตรรัฐบาลทั้งจำนวน

1.1.2 การเบิกจ่ายเงินกู้ให้กู้ต่อ จำนวน 2,178.97 ล้านบาท โดยแบ่งเป็น

(1) การให้กู้ต่อแก่การรถไฟแห่งประเทศไทย วงเงินรวม 1,150.11 ล้านบาท เพื่อจัดทำโครงการก่อสร้างรถไฟทางคู่ ช่วงชุมทางถนนจิระ - ขอนแก่น จำนวน 776.02 ล้านบาท โครงการรถไฟชานเมืองสายสีแดง ช่วงบางซื่อ - รังสิต จำนวน 138.67 ล้านบาท โครงการก่อสร้างทางคู่ในเส้นทางรถไฟสายชายฝั่งทะเลตะวันออก ช่วงฉะเชิงเทรา - คลองสิบเก้า - แก่งคอย จำนวน 118.26 ล้านบาท และ โครงการปรับปรุงทางรถไฟที่ไม่ปลอดภัยต่อการเดินรถ จำนวน 117.16 ล้านบาท

(2) การให้กู้ต่อแก่การรถไฟฟ้ามหานครแห่งประเทศไทย วงเงินรวม 1,028.86 ล้านบาท เพื่อจัดทำโครงการรถไฟฟ้ามหานครสายสีเขียว จำนวน 619.18 ล้านบาท สายสีน้ำเงิน จำนวน 391.62 ล้านบาท และสายสีม่วง จำนวน 18.06 ล้านบาท

ตารางที่ 1 การกู้เงินในประเทศของรัฐบาล เดือนตุลาคม 2559		หน่วย: ล้านบาท
1. เงินกู้เพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณ		52,714.00
- พันธบัตรรัฐบาล		52,714.00
2. เงินกู้เพื่อวางระบบบริหารจัดการน้ำ		-
3. เงินกู้ให้กู้ต่อ		2,178.97
4. เงินกู้บาททดแทนการกู้เงินตราต่างประเทศ		-
	รวม	54,892.97

1.2 การเบิกจ่ายเงินกู้ต่างประเทศ กระทรวงการคลังได้มีการเบิกจ่ายเงินกู้จากต่างประเทศ จำนวน 122.96 ล้านบาท โดยเป็นการเบิกจ่ายจากองค์การความร่วมมือระหว่างประเทศของญี่ปุ่น เพื่อให้กู้ต่อแก่การรถไฟแห่งประเทศไทย สำหรับโครงการรถไฟชานเมืองสายสีแดง ช่วงบางซื่อ - รังสิต

1.3 การชำระหนี้ กระทรวงการคลังได้ชำระหนี้ จำนวน 8,341.33 ล้านบาท โดยแบ่งเป็น

1.3.1 การชำระหนี้ที่รัฐบาลกู้โดยตรง จำนวน 5,542.80 ล้านบาท โดยมีรายละเอียด ดังนี้

- ชำระเงินต้น จำนวน 3,054.03 ล้านบาท แบ่งเป็น (1) การชำระหนี้ที่รัฐบาลให้กู้ต่อแก่การรถไฟแห่งประเทศไทย จำนวน 2,209.58 ล้านบาท (2) การชำระหนี้ที่กระทรวงการคลังได้ปรับโครงสร้างหนี้แทนการรถไฟฟ้ายานส่งมวลชนแห่งประเทศไทย จำนวน 516.67 ล้านบาท ซึ่งหนี้ดังกล่าวเป็นหนี้ต่างประเทศที่กระทรวงการคลัง ค้ำประกันและรับประกันแทน (3) การชำระหนี้ต่างประเทศ จำนวน 327.78 ล้านบาท

- ชำระดอกเบี้ย จำนวน 2,488.77 ล้านบาท แบ่งเป็น (1) การชำระดอกเบี้ยในประเทศ จำนวน 2,386.84 ล้านบาท (2) ดอกเบี้ยต่างประเทศ จำนวน 101.93 ล้านบาท

1.3.2 การชำระหนี้ที่รัฐบาลกู้เพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน จำนวน 2,798.53 ล้านบาท โดยใช้เงินจากบัญชีสะสมเพื่อการชำระคืนต้นเงินกู้ชดเชยความเสียหายของกองทุนเพื่อการฟื้นฟูฯ แบ่งออกเป็น

(1) การชำระหนี้ที่กู้มาภายใต้พระราชกำหนดให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินและจัดการเงินกู้เพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน พ.ศ. 2541 (FIDF 1) จำนวน 1,283.50 ล้านบาท โดยเป็นการชำระดอกเบี้ยทั้งจำนวน

(2) การชำระหนี้ที่กู้มาภายใต้พระราชกำหนดให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินและจัดการเงินกู้เพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน ระยะที่สอง พ.ศ. 2545 (FIDF 3) จำนวน 1,515.03 ล้านบาท แบ่งออกเป็น เงินต้น จำนวน 460.10 ล้านบาท และดอกเบี้ย จำนวน 1,054.93 ล้านบาท

2. การบริหารจัดการหนี้รัฐวิสาหกิจ วงเงินรวม 7,965 ล้านบาท

2.1 การกู้เงินในประเทศ จำนวน 1,251.62 ล้านบาท

ในเดือนตุลาคม 2559 กระทรวงการคลังมีการจัดหาเงินกู้ให้แก่รัฐวิสาหกิจ จำนวน 1,251.62 ล้านบาท โดยเป็นการกู้เงินขององค์การขนส่งมวลชนกรุงเทพสำหรับเป็นเงินทุนหมุนเวียน

2.2 การปรับโครงสร้างหนี้ในประเทศ จำนวน 6,713.38 ล้านบาท

ในเดือนตุลาคม 2559 กระทรวงการคลังได้ดำเนินการปรับโครงสร้างหนี้ในประเทศให้แก่รัฐวิสาหกิจวงเงินรวม 6,713.38 ล้านบาท โดยการขยายอายุสัญญาเงินกู้ (Roll Over) ประกอบด้วย การรถไฟแห่งประเทศไทย วงเงิน 3,565 ล้านบาท และองค์การขนส่งมวลชนกรุงเทพ วงเงิน 3,148.38 ล้านบาท (โปรดดูตารางที่ 2 ประกอบ)

ตารางที่ 2 การปรับโครงสร้างหนี้ในประเทศของรัฐวิสาหกิจ เดือนตุลาคม 2559					หน่วย: ล้านบาท
หน่วยงาน	การกู้ใหม่ชำระหนี้เดิม		การขยายอายุสัญญาเงินกู้		รวม
	ค้ำประกัน	ไม่ค้ำประกัน	ค้ำประกัน	ไม่ค้ำประกัน	
1. การรถไฟแห่งประเทศไทย	-	-	3,565.00	-	3,565.00
2. องค์การขนส่งมวลชนกรุงเทพ	-	-	3,148.38	-	3,148.38
รวม	-	-	6,713.38	-	6,713.38