

รายงานสถานะหนี้สาธารณะคงค้างรายเดือน

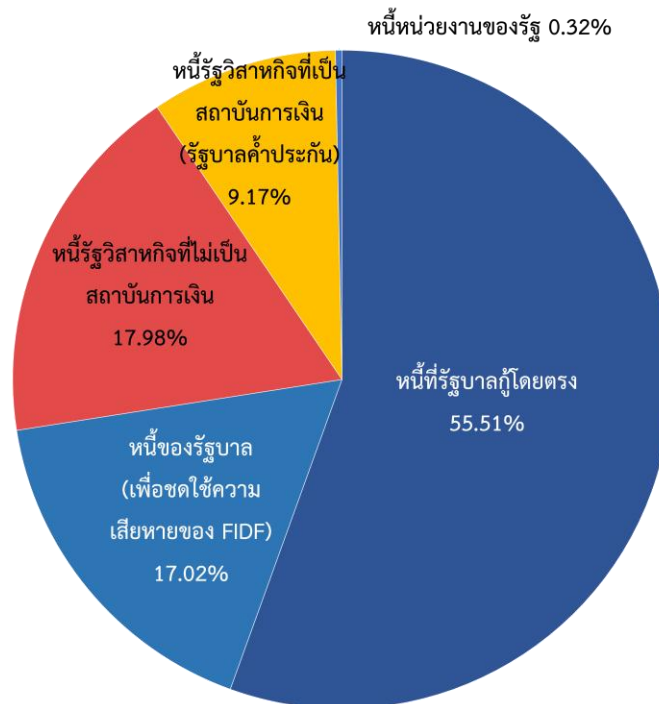
สำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ (สบน.) ขอแถลงสถานะหนี้สาธารณะคงค้าง ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2558 ดังนี้

ยอดหนี้สาธารณะคงค้าง ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2558 มีจำนวน 5,867,372.68 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 43.80 ของ GDP เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้า หนี้สาธารณะเพิ่มขึ้นสุทธิ 84,049.49 ล้านบาท โดยมีรายละเอียด ดังนี้

1. หนี้ของรัฐบาล 4,255,904.86 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 98,510.08 ล้านบาท
2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน 1,054,887.68 ล้านบาท ลดลง 10,311.50 ล้านบาท
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน) 538,201.12 ล้านบาท ลดลง 4,095.23 ล้านบาท
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ 18,379.02 ล้านบาท ลดลง 53.86 ล้านบาท

ทั้งนี้ รายละเอียดและสัดส่วนของหนี้สาธารณะ ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2558 ปรากฏตามแผนภาพที่ 1 และตารางที่ 1 ตามลำดับ

แผนภาพที่ 1 สัดส่วนหนี้สาธารณะจำแนกตามประเภท



ตารางที่ 1 รายงานหนี้สาธารณะคงค้าง ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2558

	ณ 30 ก.ย.	^{2,3} % GDP	ณ 31 ต.ค.	^{2,3} % GDP	หน่วย: ล้านบาท
	(1)	(2)	(3)	(4)	เพิ่ม/(ลด) (3)-(1)
1. หนี้ของรัฐบาล (1.1+1.2+1.3)	4,157,394.78	31.10	4,255,904.86	31.77	98,510.08
1.1 หนี้ที่รัฐบาลกู้โดยตรง	3,134,824.97	23.45	3,233,335.05	24.14	98,510.08
- หนี้ต่างประเทศ	84,676.70		83,422.72		(1,253.98)
- หนี้ในประเทศ	3,050,148.27		3,149,912.33		99,764.06
- เงินกู้เพื่อชดเชยการขาดดุลเงินงบประมาณและการบริหารหนี้ ⁴	2,571,879.01		2,670,973.27		99,094.26
- ระยะสั้น (ตัวเงินคลังและเงินกู้อื่น)	100,385.00		126,702.00		26,317.00
- ระยะยาว (พันธบัตรและเงินกู้อื่น)	2,471,494.01		2,544,271.27		72,777.26
- เงินกู้เพื่อฟื้นฟูและเสริมสร้างความมั่นคงทางเศรษฐกิจ	373,483.29		373,483.29		-
- เงินกู้เพื่อนำเข้ากองทุนส่งเสริมการประกันภัยพิบัติ	-		-		-
- เงินกู้เพื่อวางระบบบริหารจัดการน้ำ	18,639.00		18,779.00		140.00
- เงินกู้ให้กู้ต่อ	55,833.64		50,527.11		(5,306.53)
- เงินกู้เพื่อปรับโครงสร้างหนี้ต่างประเทศที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน ⁵	10,033.33		9,516.66		(516.67)
- เงินกู้บาททดแทนการกู้เงินตราต่างประเทศ	20,280.00		26,633.00		6,353.00
- เพื่อใช้ในโครงการ DPL	6,280.00		6,633.00		353.00
- เพื่อการพัฒนาการบริหารจัดการทรัพยากรน้ำและระบบขนส่งทางถนนระยะเร่งด่วน	14,000.00		20,000.00		6,000.00
1.2 หนี้ที่รัฐบาลกู้เพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่กองทุนเพื่อการฟื้นฟู⁶	998,790.81	7.47	998,790.81	7.46	-
- FIDF 1	403,112.97		403,112.97		-
- FIDF 3	595,677.84		595,677.84		-
1.3 หนี้เงินกู้ล่วงหน้าเพื่อปรับโครงสร้างหนี้⁷	23,779.00	0.18	23,779.00	0.18	-
- หนี้เงินกู้เพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณ	23,779.00		23,779.00		-
- หนี้เงินกู้เพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่กองทุนเพื่อการฟื้นฟู	-		-		-
- FIDF 1	-		-		-
- FIDF 3	-		-		-
2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน (2.1 + 2.2)	1,065,199.18	7.97	1,054,887.68	7.87	(10,311.50)
2.1 หนี้ที่รัฐบาลค้ำประกัน	425,119.72	3.18	423,748.10	3.16	(1,371.62)
- หนี้ต่างประเทศ	100,551.84		99,115.96		(1,435.88)
- หนี้ในประเทศ	324,567.88		324,632.14		64.26
2.2 หนี้ที่รัฐบาลไม่ค้ำประกัน	640,079.46	4.79	631,139.58	4.71	(8,939.88)
- หนี้ต่างประเทศ	172,700.39		167,832.98		(4,867.41)
- หนี้ในประเทศ	467,379.07		463,306.60		(4,072.47)
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	542,296.35	4.06	538,201.12	4.02	(4,095.23)
- หนี้ต่างประเทศ	2,354.14		2,341.71		(12.43)
- หนี้ในประเทศ	539,942.21		535,859.41		(4,082.80)
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ (4.1+4.2)	18,432.88	0.14	18,379.02	0.14	(53.86)
4.1 หนี้ที่รัฐบาลค้ำประกัน	-		-		-
4.2 หนี้ที่รัฐบาลไม่ค้ำประกัน	18,432.88		18,379.02		(53.86)
รวม (1+2+3+4)	5,783,323.19	43.26³	5,867,372.68	43.80	84,049.49

หมายเหตุ:

1. ตัวเลขในตารางเป็นตัวเลขเบื้องต้น (Preliminary) และไม่รวมหนี้ของ SPV จำนวน 22,499.90 ล้านบาท ที่รัฐบาลมีภาระผูกพันต้องจ่ายภายใต้สัญญาเช่าพื้นที่อาคาร สัญญาบริการจัดหาเฟอร์นิเจอร์ และสัญญาโอนสิทธิเรียกร้องของโครงการศูนย์ราชการกรุงเทพมหานคร ถ. แจ้งวัฒนะ
2. GDP ปี 2557 เท่ากับ 13,148.60 พันล้านบาท และประมาณการ GDP ปี 2558 เท่ากับ 13,451 พันล้านบาท (สำนักงานคณะกรรมการพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ (สศช.) ณ 16 พฤศจิกายน 2558)
3. สบн. ได้ปรับวิธีการคำนวณ GDP ในแต่ละเดือน เพื่อให้สัดส่วน Debt/GDP สะท้อนค่าที่ใกล้เคียงความเป็นจริงที่สุด โดย GDP ของเดือนกันยายน 2558 เท่ากับ 13,368.45 พันล้านบาท ซึ่ง สบн. ได้ปรับตัวเลขยอดหนี้สาธารณะคงค้างต่อ GDP ณ สิ้นเดือนกันยายน 2558 จากร้อยละ 42.99 เป็นร้อยละ 43.26 เนื่องจากสำนักงานคณะกรรมการพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ (สศช.) ได้ประกาศตัวเลข GDP ไตรมาสที่ 3 ของปี 2558 เมื่อวันที่ 16 พฤศจิกายน 2558 ทำให้ได้ตัวเลข GDP จริงของปีงบประมาณ พ.ศ. 2558 และ GDP ของเดือนตุลาคม 2558 คำนวณดังนี้ $[(GDP \text{ ไตรมาส } 4 \text{ ปี } 57)/3]*2 + (GDP \text{ ไตรมาส } 1 - 3 \text{ ปี } 58) + (\text{ประมาณการ GDP ปี } 58 - GDP \text{ ไตรมาส } 1 - 3 \text{ ปี } 58)/3$ เท่ากับ 13,395.97 พันล้านบาท
4. รัฐบาลมีหนี้อัตราดอกเบี้ยแปรผันตามเงินเฟ้อ จำนวน 207,940 ล้านบาท ประกอบไปด้วย พันธบัตรชดเชยเงินเฟ้อ (Inflation-Linked Bond) รุ่น ILB217A จำนวน 100,872 ล้านบาท และ รุ่น ILB283A จำนวน 107,068 ล้านบาท โดยตามประมาณการภาระหนี้ที่จะครบกำหนดชำระในอนาคต รัฐบาลจะมีภาระหนี้ส่วนชดเชยเงินเฟ้อเพิ่มเติมจากเงินต้นที่จะครบกำหนดในปี 2564 จำนวน 18,850 ล้านบาท และ ในปี 2571 จำนวน 32,970 ล้านบาท
5. มาตรา 24 (2) ตามพระราชบัญญัติการบริหารหนี้สาธารณะ พ.ศ. 2548 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ได้ให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้สาธารณะ เพื่อเป็นการประหยัด ลดความเสี่ยงในอัตราแลกเปลี่ยน หรือกระจายภาระการชำระหนี้ โดยที่ผ่านมากระทรวงการคลังได้มีการกู้เงินในประเทศเพื่อชำระหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่กระทรวงการคลังค้ำประกันไม่เกินจำนวนเงินที่ยังมีภาระค้ำประกันอยู่ ทำให้หนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่กระทรวงการคลังค้ำประกันลดลงและหนี้ในประเทศของรัฐบาลเพิ่มขึ้น
6. เงินกู้ที่ออกภายใต้พระราชกำหนดให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินและจัดการเงินกู้เพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน พ.ศ. 2541 (FIDF1) และพระราชกำหนดให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินและจัดการเงินกู้เพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน ระยะที่สอง พ.ศ. 2545 (FIDF3) นั้น ต่อมาได้มีการตราพระราชกำหนดปรับปรุงการบริหารหนี้เงินกู้ที่กระทรวงการคลังกู้เพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน (กองทุนฯ) พ.ศ. 2555 มาตรา 4 ให้กองทุนฯ มีหน้าที่รับผิดชอบเกี่ยวกับการชำระคืนต้นเงินกู้และการชำระดอกเบี้ยเงินกู้
7. มาตรา 24/1 ตามพระราชบัญญัติการบริหารหนี้สาธารณะ พ.ศ. 2548 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ได้ให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ที่มีจำนวนมากและเห็นว่าไม่สมควรกู้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ดังกล่าวในคราวเดียวกัน โดยให้สามารถทยอยกู้เงินล่วงหน้าได้ไม่เกิน 12 เดือนก่อนวันที่หนี้ครบกำหนดชำระ และให้นำเงินกู้ดังกล่าวส่งเข้ากองทุนบริหารเงินกู้เพื่อปรับโครงสร้างหนี้สาธารณะและพัฒนาตลาดตราสารหนี้ในประเทศให้เป็นผู้บริหารเงิน โดยจะนำไปลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความมั่นคงสูง เช่น ตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยกระทรวงการคลัง ตราสารหนี้ที่ออกเป็นเงินตราสกุลหลักและออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลต่างประเทศ การทำธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืนซึ่งตราสารหนี้ที่ออกโดยกระทรวงการคลัง หรือลงทุนในตราสารหนี้อื่น ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือสูงสุดจากบริษัทจัดอันดับความน่าเชื่อถือ เพื่อให้เกิดผลตอบแทนและเป็นการลดต้นทุนของการกู้เงิน

1. หนี้ของรัฐบาล

1.1 หนี้ที่รัฐบาลกู้โดยตรง เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าเพิ่มขึ้นสุทธิ 98,510.08 ล้านบาท เนื่องจาก

1.1.1 หนี้ต่างประเทศ ลดลงจากเดือนก่อนหน้า จำนวน 1,253.98 ล้านบาท โดยเป็นผลจากการเบิกจ่ายและชำระคืนหนี้สกุลเงินต่างๆ ทำให้อุดหนี้คงค้างในรูปเงินบาทลดลงสุทธิ 196.24 ล้านบาท ประกอบกับการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนที่ทำให้ยอดหนี้คงค้างในรูปเงินบาทลดลง 1,057.74 ล้านบาท ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 2 ตารางที่ 2 การเปลี่ยนแปลงของหนี้ต่างประเทศที่รัฐบาลกู้โดยตรง

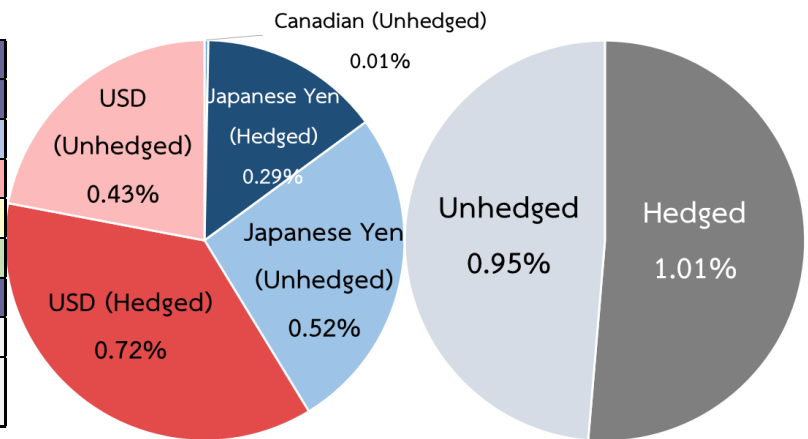
สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ ก.ย. 58	หนี้คงค้าง ณ ต.ค. 58	ผลการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 58		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 58	อัตราแลกเปลี่ยน ²			
			ล้าน CAD/EUR/JPY/USD	ล้านบาท	หนี้สิ้นเดือน ก.ย. 58 (ล้านบาท)	หนี้สิ้นเดือน ต.ค. 58 (ล้านบาท)	เพิ่ม/ลด		สกุลเงิน	ก.ย. 58	ต.ค. 58	
	(1)	(2)	(3)	(4) = (3)×(ข)	(5) = (1)×(ก)	(6) = (1)×(ข)	(7) = (6) - (5)	(7) + (4)				
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	CAD	9.38	9.38	-	-	256.48	256.05	(0.43)	(0.43)	CAD	27.34	27.29
	EUR	-	-	-	-	-	-	-	-	EUR	41.26	39.44
	JPY	73,569.87	73,834.32	264.45	78.68	22,547.55	21,887.48	(660.07)	(581.39)	JPY	0.31	0.30
	USD	512.24	513.72	1.48	52.86	18,714.37	18,317.13	(397.24)	(344.38)	USD	36.53	35.76
หนี้ที่ได้รับการปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	JPY	38,282.52	37,269.37	(1,013.15)	(327.78)	-	-	-	(327.78)			
	USD	988.58	988.58	-	-	-	-	-	-			
รวม					(196.24)			(1,057.74)	(1,253.98)			

1 CAD = สกุลเงินเหรียญแคนาดา, EUR=สกุลเงินยูโร, JPY=สกุลเงินเยน, และ USD=สกุลเงินเหรียญสหรัฐ
 2 อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราแล้วเฉลี่ยราย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน

อย่างไรก็ดี หากพิจารณาในรูปเงินบาท หนี้ที่รัฐบาลกู้โดยตรงจำแนกเป็นสกุลเงินต่างๆ หลังจากทำการป้องกันความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนแล้วมีรายละเอียดปรากฏตามแผนภาพที่ 2

แผนภาพที่ 2 หนี้ต่างประเทศที่รัฐบาลกู้โดยตรงที่บริหารความเสี่ยงและจำแนกเป็นสกุลเงินต่างๆ

สกุลเงิน	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)		
		รวม	Hedged	Unhedged
เยน	111,103.69	34,167.25	12,201.10	21,966.15
เหรียญสหรัฐ	1,502.30	48,999.42	30,629.43	18,369.99
เหรียญแคนาดา	9.38	256.05	-	256.05
ยูโร	-	-	-	-
รวมหนี้ต่างประเทศของรัฐบาล (1)		83,422.72	42,830.53	40,592.19
หนี้ของรัฐบาลทั้งหมด (2)			4,255,904.86	
ร้อยละของหนี้ต่างประเทศต่อหนี้ทั้งหมดของรัฐบาล (%) = (1)/(2)		1.96	1.01	0.95



1.1.2 **หนี้ในประเทศ** เพิ่มขึ้นจากเดือนก่อนหน้า จำนวน 99,764.06 ล้านบาท โดยมีรายการสำคัญเกิดจาก

- การกู้เงินเพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณ และการบริหารหนี้ เพิ่มขึ้น 99,094.26 ล้านบาท รายละเอียด ดังนี้
 - การกู้เงินเพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณ จำนวน 72,777.26 ล้านบาท โดยการออกพันธบัตรรัฐบาล จำนวน 45,707 ล้านบาท และพันธบัตรออมทรัพย์ จำนวน 27,070.26 ล้านบาท
 - การเพิ่มขึ้นของตั๋วเงินคลังสุทธิ จำนวน 26,317 ล้านบาท เพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณ
- การเบิกจ่ายเงินกู้เพื่อวางระบบบริหารจัดการน้ำ ภายใต้ พ.ร.ก. บริหารจัดการน้ำและสร้างอนาคต ประเทศ จำนวน 140 ล้านบาท
 - เงินกู้ให้กู้ต่อ ลดลง 5,306.53 ล้านบาท โดยแบ่งเป็น
 - การรถไฟฟ้าขนส่งมวลชนแห่งประเทศไทยเบิกจ่ายเงินกู้ จำนวน 1,682.66 ล้านบาท เพื่อจัดทำโครงการรถไฟฟ้าสายสีม่วง จำนวน 638.77 ล้านบาท โครงการรถไฟฟ้าสายสีเขียว จำนวน 580.13 ล้านบาท โครงการรถไฟฟ้าสายสีน้ำเงิน จำนวน 463.76 ล้านบาท และชำระหนี้เงินกู้ที่รัฐบาลให้กู้ต่อ จำนวน 7,304.78 ล้านบาท
 - การรถไฟแห่งประเทศไทยเบิกจ่ายเงินกู้ จำนวน 315.59 ล้านบาท เพื่อจัดทำโครงการปรับปรุงทางรถไฟที่ไม่ปลอดภัย 8 สายทาง จำนวน 306.87 ล้านบาท และโครงการรถไฟฟ้าชานเมืองสายสีแดง ช่วงบางซื่อ-รังสิต จำนวน 8.72 ล้านบาท
 - เงินกู้เพื่อปรับโครงสร้างหนี้ต่างประเทศที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน ลดลง 516.67 ล้านบาท เนื่องจากการรถไฟแห่งประเทศไทยชำระคืนต้นเงินกู้ โดยใช้เงินงบประมาณทั้งจำนวน
- การกู้เงินบาททดแทนการกู้เงินตราต่างประเทศ เพิ่มขึ้น 6,353 ล้านบาท เนื่องจาก
 - การเบิกจ่ายเงินกู้เพื่อใช้ในโครงการเงินกู้เพื่อฟื้นฟูเศรษฐกิจและพัฒนาโครงสร้างพื้นฐาน (DPL) จำนวน 353 ล้านบาท
 - การเบิกจ่ายเงินกู้เพื่อใช้ในการดำเนินโครงการพัฒนาระบบบริหารจัดการทรัพยากรน้ำและระบบขนส่งทางถนนระยะเร่งด่วน:มาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจระยะที่ 2 จำนวน 6,000 ล้านบาท

1.2 **หนี้ที่รัฐบาลกู้เพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูฯ** ไม่มีการเปลี่ยนแปลงจากเดือนก่อนหน้า

1.3 **หนี้เงินกู้ล่วงหน้าเพื่อปรับโครงสร้างหนี้** ไม่มีการเปลี่ยนแปลงจากเดือนก่อนหน้า

2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน

2.1 หนี้ที่รัฐบาลค้ำประกัน

2.1.1 หนี้ต่างประเทศ ลดลงจากเดือนก่อนหน้า จำนวน 1,435.88 ล้านบาท โดยเป็นผลการชำระคืนหนี้เงินเยน 366.63 ล้านบาท ของการรถไฟฟ้ามหานครแห่งประเทศไทยและบริษัทท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) ประกอบกับผลจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนทำให้ยอดหนี้คงค้างในรูปเงินบาทลดลง 1,069.25 ล้านบาท ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 3

ตารางที่ 3 การเปลี่ยนแปลงของหนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)

สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ ก.ย. 58	หนี้คงค้าง ณ ค.ค. 58	ผลจากการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ค.ค. 58		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ค.ค. 58	อัตราแลกเปลี่ยน ²			
			ล้าน CAD/EUR/JPY/USD	ล้านบาท	หนี้สิ้นเดือน ก.ย. 58 (ล้านบาท)	หนี้สิ้นเดือน ค.ค. 58 (ล้านบาท)	เพิ่ม/(ลด)		สกุลเงิน	ก.ย. 58 (ก)	ค.ค. 58 (ข)	
	(1)	(2)	(3)	(4) = (3)×(ข)	(5) = (1)×(ก)	(6) = (1)×(ข)	(7) = (6) - (5)	(7) + (4)				
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	EUR	49.96	49.96	-	-	2,061.46	1,970.22	(91.24)	(91.24)	CAD	27.34	27.29
	JPY	90,905.14	90,857.04	(48.10)	(14.31)	27,860.43	27,044.83	(815.60)	(829.91)	EUR	41.26	39.44
	USD	-	-	-	-	-	-	-	-	JPY	0.31	0.30
หนี้ที่ได้รับการปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	JPY	223,847.90	222,748.35	(1,099.55)	(352.32)	8,034.89	7,872.48	(162.41)	(514.73)	USD	36.53	35.76
	USD	-	-	-	-	-	-	-	-			
รวม				(366.63)				(1,069.25)	(1,435.88)			

1 EUR=สกุลเงินยูโร JPY=สกุลเงินเยน, และ USD=สกุลเงินเหรียญสหรัฐ

2 อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราตัวเฉลี่ยขาย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน

3 หนี้ต่างประเทศที่มีการบริหารความเสี่ยงแล้ว ใช้อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่ทำการบริหารความเสี่ยง

4 หนี้คงค้างต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่ได้มีการบริหารความเสี่ยงเพียงบางส่วน (Partial Hedge)

2.1.2 หนี้ในประเทศ เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าเพิ่มขึ้น จำนวน 64.26 ล้านบาท เนื่องจากรัฐวิสาหกิจมีการเบิกจ่ายจากแหล่งเงินกู้มากกว่าการชำระคืนต้นเงินกู้ โดยเป็นการเบิกจ่ายเงินกู้ 789.50 ล้านบาท และชำระคืนต้นเงินกู้ 725.24 ล้านบาท

2.2 หนี้ที่รัฐบาลไม่ค้ำประกัน

2.2.1 หนี้ต่างประเทศ ลดลงจากเดือนก่อนหน้า จำนวน 4,867.41 ล้านบาท โดยเป็นผลจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนที่ทำให้ยอดหนี้คงค้างในรูปเงินบาทลดลง 5,180.58 ล้านบาท ประกอบกับการชำระคืนหนี้สกุลเงินต่างๆ ของบริษัท การบินไทย จำกัด (มหาชน) ทำให้ยอดหนี้คงค้างในรูปเงินบาทเพิ่มขึ้น 313.17 ล้านบาท ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 4

ตารางที่ 4 การเปลี่ยนแปลงของหนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลไม่ค้ำประกัน)

สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ ก.ย. 58	หนี้คงค้าง ณ ต.ค. 58	ผลการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 58		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 58	อัตราแลกเปลี่ยน ²			
			ล้าน EUR/JPY/USD	ล้านบาท	หนี้สิ้นเดือน ก.ย. 58 (ล้านบาท)	หนี้สิ้นเดือน ต.ค. 58 (ล้านบาท)	เพิ่ม/ลด		สกุลเงิน	ก.ย. 58 (ก)	ต.ค. 58 (ข)	
	(1)	(2)	(3)	(4) = (3)×(ข)	(5) = (1)×(ก)	(6) = (1)×(ข)	(7) = (6) - (5)	(7) + (4)				
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	EUR	1,453.47	1,437.67	(15.80)	(622.98)	59,973.78	57,319.45	(2,654.33)	(3,277.31)	EUR	41.26	39.44
	JPY	54,103.72	57,326.04	3,222.32	958.66	16,581.60	16,096.18	(485.42)	473.24	JPY	0.31	0.30
	USD	2631.63	2,631.00	(0.63)	(22.51)	96,145.01	94,104.18	(2,040.83)	(2,063.34)	USD	36.53	35.76
รวม				313.17			(5,180.58)	(4,867.41)				

1 EUR=สกุลเงินยูโร JPY=สกุลเงินเยน, และ USD=สกุลเงินเหรียญสหรัฐ

2 อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราถัวเฉลี่ยขาย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน

2.2.2 หนี้ในประเทศ เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าลดลง 4,072.47 ล้านบาท เนื่องจาก

- บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) ออกหุ้นกู้ 4,200 ล้านบาท และไถ่ถอนหุ้นกู้ที่ครบกำหนด 7,100.53 ล้านบาท
- การไฟฟ้าส่วนภูมิภาคไถ่ถอนพันธบัตรที่ครบกำหนด 93 ล้านบาท
- รัฐวิสาหกิจมีการเบิกจ่ายจากแหล่งเงินกู้ต่างๆ น้อยกว่าชำระคืนต้นเงินกู้ จำนวน 1,078.94 ล้านบาท

โดยเป็นการเบิกจ่ายเงินกู้ 245.47 ล้านบาท และชำระคืนต้นเงินกู้ 1,324.41 ล้านบาท

3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)

3.1 หนี้ต่างประเทศ ลดลงจากเดือนก่อนหน้า จำนวน 12.43 ล้านบาท โดยเป็นผลจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 5

ตารางที่ 5 การเปลี่ยนแปลงของหนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)

สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ ก.ย. 58	หนี้คงค้าง ณ ต.ค. 58	ผลการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 58		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 58	อัตราแลกเปลี่ยน ²			
			ล้าน EUR/JPY/USD	ล้านบาท	หนี้สิ้นเดือน ก.ย. 58 (ล้านบาท)	หนี้สิ้นเดือน ต.ค. 58 (ล้านบาท)	เพิ่ม/ลด		สกุลเงิน	ก.ย. 58 (ก)	ต.ค. 58 (ข)	
	(1)	(2)	(3)	(4) = (3)×(ข)	(5) = (1)×(ก)	(6) = (1)×(ข)	(7) = (6) - (5)	(7) + (4)				
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	EUR	3.76	3.76	-	-	155.23	148.36	(6.87)	(6.87)	EUR	41.26	39.44
	USD	7.17	7.17	-	-	261.83	256.27	(5.56)	(5.56)	USD	36.53	35.76
หนี้ที่ได้รับการปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	EUR	26.00	26.00	-	-	-	-	-	-			
	JPY	3,403.78	3,403.78	-	-	-	-	-	-			
รวม				-			(12.43)	(12.43)				

1 EUR=สกุลเงินยูโร JPY=สกุลเงินเยน, และ USD=สกุลเงินเหรียญสหรัฐ

2 อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราถัวเฉลี่ยขาย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน

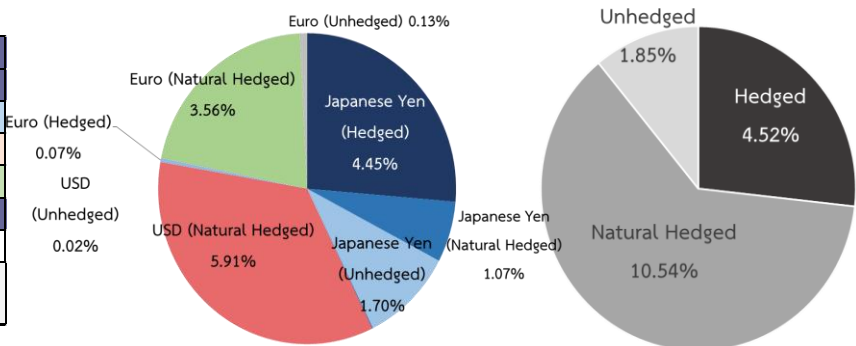
3 หนี้ต่างประเทศที่มีการบริหารความเสี่ยงแล้ว ใช้อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่ทำการบริหารความเสี่ยง

3.2 หนี้ในประเทศ เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าลดลง 4,082.80 ล้านบาท เนื่องจากธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตรชำระคืนต้นเงินตามสัญญาเงินกู้

ทั้งนี้ หากพิจารณาในรูปแบบเงินบาท หนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน และรัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน) หลังทำการป้องกันความเสี่ยงของอัตราแลกเปลี่ยน จำแนกเป็นสกุลเงินต่างๆ มีรายละเอียดปรากฏตามแผนภาพที่ 3

แผนภาพที่ 3 หนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน และรัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน) ที่บริหารความเสี่ยงและจำแนกเป็นสกุลเงินต่างๆ

สกุลเงิน	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)			
		รวม	Hedged	Natural Hedged	Unhedged
เมียน	374,335.21	115,033.96	70,948.60	17,054.84	27,030.52
เหรียญสหรัฐ	2,638.17	94,337.94	-	94,081.67	256.27
ยูโร	1,517.40	59,918.75	1,103.70	56,696.47	2,118.58
รวมหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจ (1)		269,290.65	72,052.30	167,832.98	29,405.37
หนี้รัฐวิสาหกิจทั้งหมด (2)		1,593,088.80			
ร้อยละของหนี้ต่างประเทศต่อหนี้ทั้งหมดของรัฐวิสาหกิจ (%) = (1)/(2)		16.90	4.52	10.54	1.85



4. หนี้หน่วยงานของรัฐ ลดลงจากเดือนก่อนหน้า 53.86 ล้านบาท เนื่องจากหน่วยงานของรัฐมีการเบิกจ่ายจากแหล่งเงินกู้ต่างๆ น้อยกว่าการชำระคืนต้นเงินกู้ โดยรายการที่สำคัญเกิดจากการชำระคืนต้นเงินกู้ของสำนักงานธนาคุณเคราะห์ จำนวน 58.05 ล้านบาท

รายงานสถานะหนี้สาธารณะคงค้างรายเดือน

หนี้สาธารณะคงค้าง ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2558 มีจำนวน 5,867,372.68 ล้านบาท ซึ่งหากแบ่งประเภทเป็นหนี้ต่างประเทศ-หนี้ในประเทศ และหนี้ระยะยาว-หนี้ระยะสั้น มีรายละเอียด ดังนี้

หนี้ต่างประเทศและหนี้ในประเทศ แบ่งออกเป็น หนี้ต่างประเทศ 352,713.37 ล้านบาท หรือร้อยละ 6.01 และหนี้ในประเทศ 5,514,659.31 ล้านบาท หรือร้อยละ 93.99 ของยอดหนี้สาธารณะคงค้าง รายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 6

ตารางที่ 6 สัดส่วนหนี้ต่างประเทศและหนี้ในประเทศ

	หนี้สาธารณะ	หนี้ต่างประเทศ		หนี้ในประเทศ	
	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)	%	(ล้านบาท)	%
1. หนี้ของรัฐบาล	4,255,904.86	83,422.72	1.96	4,172,482.14	98.04
2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน	1,054,887.68	266,948.94	25.31	787,938.74	74.69
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	538,201.12	2,341.71	0.44	535,859.41	99.56
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ	18,379.02	-	-	18,379.02	100.00
รวม	5,867,372.68	352,713.37	6.01	5,514,659.31	93.99

หนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น แบ่งออกเป็น 2 ประเภท ดังนี้

- หนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุของเครื่องมือการกู้เงิน) แบ่งออกเป็น หนี้ระยะยาว 5,628,574.27 ล้านบาท หรือร้อยละ 95.93 และหนี้ระยะสั้น 238,798.41 ล้านบาท หรือร้อยละ 4.07 ของยอดหนี้สาธารณะคงค้าง รายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 7

ตารางที่ 7 สัดส่วนหนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุของเครื่องมือการกู้เงิน)

	หนี้สาธารณะ	หนี้ระยะยาว		หนี้ระยะสั้น	
	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)	%	(ล้านบาท)	%
1. หนี้ของรัฐบาล	4,255,904.86	4,112,741.93	96.64	143,162.93	3.36
2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน	1,054,887.68	1,030,007.20	97.64	24,880.48	2.36
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	538,201.12	467,446.12	86.85	70,755.00	13.15
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ	18,379.02	18,379.02	100.00	-	-
รวม	5,867,372.68	5,628,574.27	95.93	238,798.41	4.07

● **หนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุคงเหลือ)** แบ่งออกเป็น หนี้ระยะยาว 5,098,127.65 ล้านบาท หรือร้อยละ 86.89 และหนี้ระยะสั้น 769,245.03 ล้านบาท หรือร้อยละ 13.11 ของยอดหนี้สาธารณะคงค้าง รายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 8

ตารางที่ 8 สัดส่วนหนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุคงเหลือ)

	หนี้สาธารณะ		หนี้ระยะยาว		หนี้ระยะสั้น	
	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)	%	(ล้านบาท)	%	
1. หนี้ของรัฐบาล	4,255,904.86	3,812,879.65	89.59	443,025.21	10.41	
2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน	1,054,887.68	888,518.07	84.23	166,369.61	15.77	
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	538,201.12	378,350.95	70.30	159,850.17	29.70	
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ	18,379.02	18,378.98	100.00	0.04	0.00	
รวม	5,867,372.68	5,098,127.65	86.89	769,245.03	13.11	

หมายเหตุ: การนำข้อมูลและ/หรือบทวิเคราะห์ของสำนักงานบริหารหนี้สาธารณะไปใช้และ/หรือเผยแพร่ต่อ ขอความร่วมมืออ้างแหล่งที่มาของข้อมูลด้วย
 ส่วนวิจัยนโยบายหนี้สาธารณะ สำนักนโยบายและแผน
 สำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ โทร. 0 2265 8050 ต่อ 5512,5520