

รายงานสถานะหนี้สาธารณะคงค้างรายเดือน

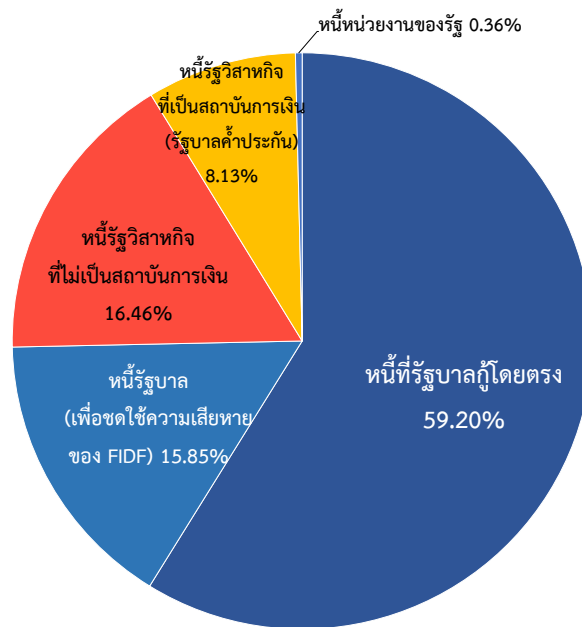
สำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ (สบน.) ขอรายงานสถานะหนี้สาธารณะคงค้าง ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2559 ดังนี้

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



ตารางที่ 1 รายงานหนี้สาธารณะคงค้าง ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2559¹

	ณ 30 ก.ย. ^{2,3}		ณ 31 ต.ค. ^{2,3}		หน่วย: ล้านบาท
	(1)	(2)	(3)	(4)	เพิ่ม/(ลด) (3)-(1)
1. หนี้รัฐบาล (1.1+1.2+1.3)	4,471,220.22	31.93	4,491,860.05	32.06	20,639.83
1.1 หนี้รัฐบาลกู้โดยตรง	3,522,121.28	25.15	3,543,221.21	25.29	21,099.93
- หนี้ต่างประเทศ	98,735.91		97,669.12		(1,066.79)
- เงินกู้เพื่อใช้ในแผนงาน/โครงการของรัฐบาล	39,732.93		39,515.80		(217.13)
- เงินกู้ให้กู้ต่อ	59,002.98		58,153.32		(849.66)
- หนี้ในประเทศ	3,423,385.37		3,445,552.09		22,166.72
- เงินกู้เพื่อชดเชยการขาดดุลเงินงบประมาณและการบริหารหนี้ ⁴	2,935,321.26		2,958,035.26		22,714.00
- ระยะสั้น (ตั๋วเงินคลังและเงินกู้อื่น)	80,000.00		50,000.00		(30,000.00)
- ระยะยาว (พันธบัตรและเงินกู้อื่น)	2,855,321.26		2,908,035.26		52,714.00
- เงินกู้เพื่อฟื้นฟูและเสริมสร้างความมั่นคงทางเศรษฐกิจ	359,853.00		359,853.00		-
- เงินกู้เพื่อนำเข้ากองทุนส่งเสริมการประกันภัยพิบัติ	-		-		-
- เงินกู้เพื่อวางระบบบริหารจัดการน้ำ	9,000.00		9,000.00		-
- เงินกู้ให้กู้ต่อ	58,794.51		58,763.90		(30.61)
- เงินกู้เพื่อปรับโครงสร้างหนี้ต่างประเทศที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน ⁵	6,200.00		5,683.33		(516.67)
- เงินกู้บาททดแทนการกู้เงินตราต่างประเทศ	54,216.60		54,216.60		-
- เพื่อใช้ในโครงการ DPL	4,216.60		4,216.60		-
- เพื่อการพัฒนาาระบบบริหารจัดการทรัพยากรน้ำและระบบขนส่งทางถนนระยะเร่งด่วน	50,000.00		50,000.00		-
1.2 หนี้รัฐบาลกู้เพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่กองทุนเพื่อการฟื้นฟู⁶	949,098.94	6.78	948,638.84	6.77	(460.10)
- FIDF 1	372,119.04		372,119.04		-
- FIDF 3	576,979.90		576,519.80		(460.10)
1.3 หนี้เงินกู้ล่วงหน้าเพื่อปรับโครงสร้างหนี้⁷	-	-	-	-	-
- หนี้เงินกู้เพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณ	-		-		-
- หนี้เงินกู้เพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่กองทุนเพื่อการฟื้นฟู	-		-		-
- หนี้เงินกู้เพื่อฟื้นฟูและเสริมสร้างความมั่นคงทางเศรษฐกิจ	-		-		-
2. หนี้รัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน (2.1 + 2.2)	994,794.29	7.10	984,958.41	7.03	(9,835.88)
2.1 หนี้รัฐบาลค้ำประกัน	423,593.78	3.03	423,034.10	3.02	(559.68)
- หนี้ต่างประเทศ	95,812.28		94,497.05		(1,315.23)
- หนี้ในประเทศ	327,781.50		328,537.05		755.55
2.2 หนี้รัฐบาลไม่ค้ำประกัน	571,200.51	4.08	561,924.31	4.01	(9,276.20)
- หนี้ต่างประเทศ	151,124.09		150,266.59		(857.50)
- หนี้ในประเทศ	420,076.42		411,657.72		(8,418.70)
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	500,054.33	3.57	487,049.87	3.48	(13,004.46)
- หนี้ต่างประเทศ	765.92		765.46		(0.46)
- หนี้ในประเทศ	499,288.41		486,284.41		(13,004.00)
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ (4.1+4.2)⁸	22,317.69	0.16	21,306.68	0.15	(1,011.01)
4.1 หนี้รัฐบาลค้ำประกัน	-		-		-
4.2 หนี้รัฐบาลไม่ค้ำประกัน	22,317.69		21,306.68		(1,011.01)
รวม (1+2+3+4)	5,988,386.53	42.77	5,985,175.01	42.71	(3,211.52)

หมายเหตุ:

1. ตัวเลขในตารางเป็นตัวเลขเบื้องต้น (Preliminary) และไม่รวมหนี้ของนิติบุคคลเฉพาะกิจ (Special Purpose Vehicle : SPV) จำนวน 20,499.90 ล้านบาท ที่รัฐบาลมีภาระผูกพันต้องจ่ายภายใต้สัญญาเช่าพื้นที่อาคาร สัญญาบริการจัดหาเฟอร์นิเจอร์ และสัญญาโอนสิทธิเรียกร้องของโครงการศูนย์ราชการกรุงเทพมหานคร ถ. แจ้งวัฒนะ
2. GDP ปี 2558 เท่ากับ 13,533.60 พันล้านบาท และประมาณการ GDP ปี 2559 เท่ากับ 14,034.30 พันล้านบาท (สำนักงานคณะกรรมการพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ ณ 21 พฤศจิกายน 2559)
3. สบพ. ได้ปรับวิธีการคำนวณ GDP ในแต่ละเดือน เพื่อให้สัดส่วนหนี้สาธารณะต่อ GDP สะท้อนค่าที่ใกล้เคียงความเป็นจริง โดย GDP ในรอบ 12 เดือนที่ผ่านมา สิ้นสุด ณ เดือนกันยายน 2559 เท่ากับ 14,002.04 พันล้านบาท ซึ่ง สบพ. ได้ปรับตัวเลขยอดหนี้สาธารณะคงค้างต่อ GDP ณ สิ้นเดือนกันยายน 2559 จากร้อยละ 42.73 เป็นร้อยละ 42.77 เนื่องจากสำนักงานคณะกรรมการพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติได้ประกาศตัวเลข GDP ไตรมาสที่ 3 ของปี 2559 เมื่อวันที่ 21 พฤศจิกายน 2559 ในขณะที่ GDP ในรอบ 12 เดือนที่ผ่านมา สิ้นสุด ณ เดือนตุลาคม 2559 $[(GDP \text{ ไตรมาส } 4 \text{ ปี } 58)/3]*2 + (GDP \text{ ไตรมาส } 1 - 3 \text{ ปี } 59) + (\text{ประมาณการ GDP ปี } 59 - GDP \text{ ไตรมาส } 1 - 3 \text{ ปี } 59)/3$ เท่ากับ 14,012.79 พันล้านบาท
4. รัฐบาลมีหนี้อัตราดอกเบี้ยแปรผันตามเงินเฟ้อ จำนวน 207,940 ล้านบาท ประกอบไปด้วย พันธบัตรระยะเงินเฟ้อ (Inflation-Linked Bond) รุ่น ILB217A จำนวน 100,872 ล้านบาท และ รุ่น ILB283A จำนวน 107,068 ล้านบาท โดยตามประมาณการภาระหนี้ที่จะครบกำหนดชำระในอนาคต รัฐบาลจะมีภาระหนี้ส่วนชดเชยเงินเฟ้อเพิ่มเติมจากเงินต้นที่จะครบกำหนดในปี 2564 จำนวน 17,546 ล้านบาท และในปี 2571 จำนวน 31,445 ล้านบาท ภายใต้ข้อสมมติว่าอัตราเงินเฟ้อทั่วไป (Headline Inflation) ในปี 2559 เท่ากับ -0.1% และเท่ากับ 2.0% ตั้งแต่ปี 2560 เป็นต้นไป
5. มาตรา 24 (2) ตามพระราชบัญญัติการบริหารหนี้สาธารณะ พ.ศ. 2548 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ได้ให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้สาธารณะ เพื่อเป็นการประหยัด ลดความเสี่ยงในอัตราแลกเปลี่ยน หรือกระจายภาระการชำระหนี้ โดยที่ผ่านมาระทรวงการคลังได้มีการกู้เงินในประเทศเพื่อชำระหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่กระทรวงการคลังค้ำประกันไม่เกินจำนวนเงินที่ยังมีภาระค้ำประกันอยู่ ทำให้หนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่กระทรวงการคลังค้ำประกันลดลงและหนี้ในประเทศของรัฐบาลเพิ่มขึ้น
6. เงินกู้ที่ออกภายใต้พระราชกำหนดให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินและจัดการเงินกู้เพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน พ.ศ. 2541 (FIDF1) และพระราชกำหนดให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินและจัดการเงินกู้เพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน ระยะที่สอง พ.ศ. 2545 (FIDF3) นั้น ต่อมาได้มีการตราพระราชกำหนดปรับปรุงการบริหารหนี้ที่กระทรวงการคลังกู้เพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน (กองทุนฯ) พ.ศ. 2555 มาตรา 4 ให้กองทุนฯ มีหน้าที่รับผิดชอบเกี่ยวกับการชำระคืนเงินกู้ และการชำระดอกเบี้ยเงินกู้
7. มาตรา 24/1 ตามพระราชบัญญัติการบริหารหนี้สาธารณะ พ.ศ. 2548 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ได้ให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ที่มีจำนวนมากและเห็นว่าไม่สมควรกู้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ดังกล่าวในคราวเดียวกัน โดยให้สามารถทยอยกู้เงินล่วงหน้าได้ไม่เกิน 12 เดือน ก่อนวันที่หนี้ครบกำหนดชำระ และให้นำเงินกู้ดังกล่าวส่งเข้ากองทุนบริหารเงินกู้เพื่อการปรับโครงสร้างหนี้สาธารณะและพัฒนาตลาดตราสารหนี้ในประเทศให้เป็นผู้บริหารเงิน โดยจะนำไปลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความมั่นคงสูง เช่น ตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยกระทรวงการคลัง ตราสารหนี้ที่ออกเป็นเงินตราสกุลหลักและออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลต่างประเทศ การทำธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืนซึ่งตราสารหนี้ที่ออกโดยกระทรวงการคลัง หรือลงทุนในตราสารหนี้อื่นที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือจากบริษัทจัดอันดับความน่าเชื่อถือ เพื่อให้เกิดผลตอบแทนและเป็นการลดต้นทุนของการกู้เงิน
8. ตัวเลขในตารางไม่รวมหนี้ของธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) เนื่องจากเดิม ธปท. ถือเป็นรัฐวิสาหกิจที่ประกอบธุรกิจให้กู้ยืมเงินตามพระราชกฤษฎีกากำหนดกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย พ.ศ. 2485 ซึ่งหนี้ของ ธปท. ไม่นับเป็นหนี้สาธารณะ เว้นแต่กระทรวงการคลังจะค้ำประกันหนี้นั้น ต่อมาพระราชบัญญัติธนาคารแห่งประเทศไทย (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 ได้บัญญัติให้ ธปท. เป็นหน่วยงานของรัฐที่ไม่เป็นส่วนราชการหรือรัฐวิสาหกิจ ตามกฎหมายว่าด้วยวิธีการงบประมาณและกฎหมายอื่น ทำให้หนี้ของ ธปท. นับรวมเป็นหนี้สาธารณะ อย่างไรก็ดี เพื่อให้สอดคล้องกับแนวทางปฏิบัติของนานาประเทศและเจตนารมณ์ดั้งเดิมของพระราชบัญญัติการบริหารหนี้สาธารณะ พ.ศ. 2548 สบพ. อยู่ในระหว่างการดำเนินการปรับปรุงนิยามและขอบเขตของหนี้สาธารณะภายใต้พระราชบัญญัติการบริหารหนี้สาธารณะ พ.ศ. 2548 อย่างไรก็ดี ณ สิ้นเดือนกันยายน พ.ศ. 2559 หนี้ของ ธปท. มีจำนวน 4,038,606 ล้านบาท (ที่มา: ธนาคารแห่งประเทศไทย)

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

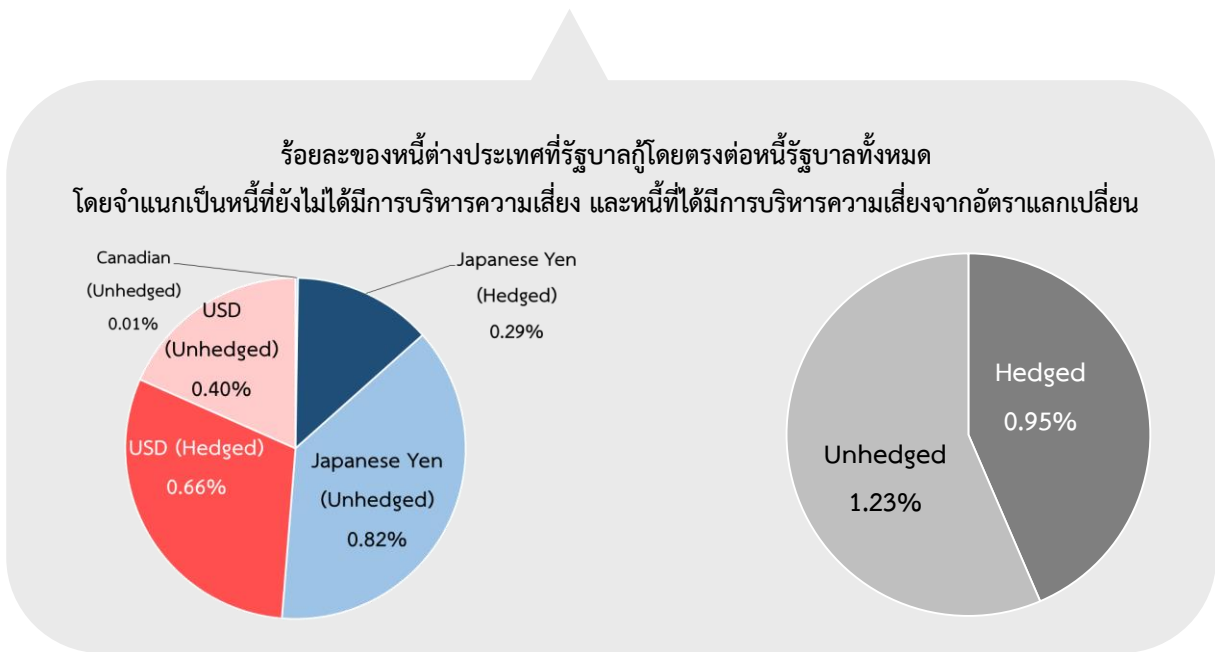
สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ		ผลจากการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 59		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 59	
	ก.ย. 59 (1)	ต.ค. 59 (2)	ล้าน CAD/EUR/JPY/USD (3)	ล้านบาท (4) = (3)×(ข)	หนี้สิ้นเดือน ก.ย. 59 (ล้านบาท) (5) = (1)×(ก)	หนี้สิ้นเดือน ต.ค. 59 (ล้านบาท) (6) = (1)×(ข)	เพิ่ม/(ลด) (7) = (6) - (5)	(7) + (4)	
เงินกู้เพื่อใช้ในแผนงาน/โครงการของรัฐบาล									
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	CAD	-	-	-	-	-	-	-	-
	EUR	-	-	-	-	-	-	-	-
	JPY	-	-	-	-	-	-	-	-
	USD	359.94	359.94	-	-	12,553.16	12,663.80	110.65	110.65
หนี้ที่ได้มีการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ³	JPY	41,148.35	40,135.20	(1,013.15)	(327.78)	-	-	-	(327.78)
	USD	456.57	456.57	-	-	-	-	-	-
เงินกู้ให้กู้ต่อ									
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	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
- อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราถัวเฉลี่ยขาย 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



1.1.2 หนี้ในประเทศ เพิ่มขึ้นสุทธิ 22,166.72 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า เนื่องจาก

- การกู้เงินเพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณและการบริหารหนี้สาธารณะ เพิ่มขึ้น 22,714 ล้านบาท โดยมีรายละเอียด ดังนี้

- การกู้เงินเพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณ จำนวน 52,714 ล้านบาท โดยการออกพันธบัตรรัฐบาลทั้งจำนวน
- การลดลงของตัวเงินคลัง 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 โครงการปรับปรุงทางรถไฟที่ไม่ปลอดภัยต่อการเดินทาง จำนวน 117.16 ล้านบาท
 - การรถไฟฟ้ามหานครแห่งประเทศไทยเบิกจ่ายเงินกู้จำนวน 1,028.86 ล้านบาท เพื่อจัดทำโครงการรถไฟฟ้ามหานครสายสีชมพู จำนวน 619.18 ล้านบาท สายสีน้ำเงิน จำนวน 391.62 ล้านบาท และสายสีม่วง จำนวน 18.06 ล้านบาท
- เงินกู้เพื่อปรับโครงสร้างหนี้ต่างประเทศที่กระทรวงการคลังค้ำประกันลดลง 516.67 ล้านบาท โดยการไถ่ถอนตัวสัญญาใช้เงินทั้งจำนวน ซึ่งหนี้ที่ชำระคืนดังกล่าวเป็นหนี้ที่กระทรวงการคลังได้ปรับโครงสร้างหนี้แทนการรถไฟฟ้ามหานครแห่งประเทศไทย

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

รายงานสถานะหนี้สาธารณะคงค้างรายเดือน

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)
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการบริหาร	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
หนี้ที่ได้รับการบริหารความเสี่ยง	JPY 205,190.26	204,090.71	(1,099.55)	(352.32)	4,606.56	4,482.92	(123.64)	(475.96)			
จากอัตราแลกเปลี่ยน ³	USD -	-	-	-	-	-	-	-			
รวม				(368.56)			(946.67)	(1,315.23)			

- EUR=สกุลเงินยูโร JPY=สกุลเงินเยน และ USD=สกุลเงินเหรียญสหรัฐ
- อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราถัวเฉลี่ยขาย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน
- 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 การเปลี่ยนแปลงของหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลไม่ค้ำประกัน)

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)
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
หนี้ที่ได้รับการบริหารความเสี่ยง	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
- อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราถัวเฉลี่ยขาย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน
- หนี้ที่ยังไม่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน เนื่องจากรัฐวิสาหกิจมีรายรับและรายจ่ายหนี้ต่างประเทศเป็นสกุลเงินตราต่างประเทศ (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
- การไฟฟ้าส่วนภูมิภาคไถ่ถอนพันธบัตรที่ครบกำหนด จำนวน 93 ล้านบาท
- รัฐวิสาหกิจมีการเบิกจ่ายจากแหล่งเงินกู้ต่างๆ น้อยกว่าชำระคืนต้นเงินกู้ จำนวน 325.70 ล้านบาท

โดยเป็นการเบิกจ่ายเงินกู้ 1,959.66 ล้านบาท และชำระคืนต้นเงินกู้ 2,285.36 ล้านบาท

3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)

3.1 หนี้ต่างประเทศ ลดลงสุทธิ 0.46 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า โดยเป็นผลจากผลการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 5

ตารางที่ 5 การเปลี่ยนแปลงของหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (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
หนี้ที่ได้รับการบริหารความเสี่ยง	EUR -	-	-	-	-	-	-	-			
จากอัตราแลกเปลี่ยน	JPY 2,120.25	2,120.25	-	-	-	-	-	-			
รวม							(0.46)	(0.46)			

1. EUR=สกุลเงินยูโร JPY=สกุลเงินเยน และ USD=สกุลเงินเหรียญสหรัฐ
2. อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราถัวเฉลี่ยขาย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน

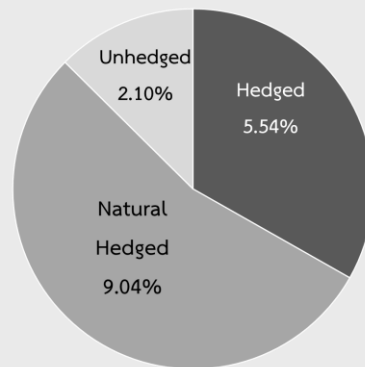
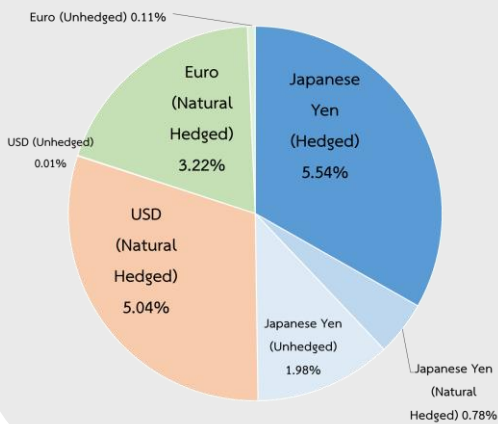
3.2 หนี้ในประเทศ เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าลดลง 13,004 ล้านบาท เนื่องจากธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตรชำระคืนต้นเงินกู้ จำนวน 11,004 ล้านบาท และไถ่ถอนพันธบัตร จำนวน 2,000 ล้านบาท

ทั้งนี้ หากพิจารณาในรูปเงินบาท หนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่ไม่เป็นสถาบันการเงิน และรัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน) หลังจากได้บริหารความเสี่ยงของอัตราแลกเปลี่ยนแล้ว มีรายละเอียดปรากฏตามแผนภาพที่ 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

รายงานสถานะหนี้สาธารณะคงค้างรายเดือน

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