

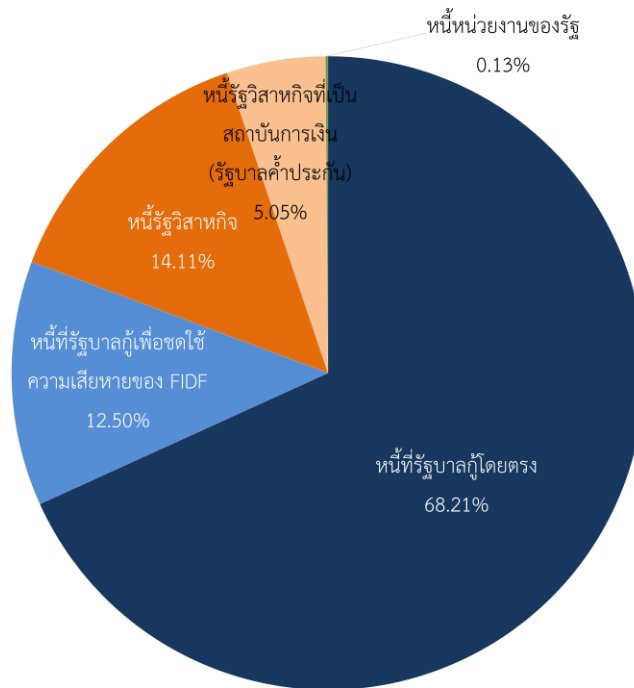
สำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ (สบน.) ขอรายงานสถานะหนี้สาธารณะคงค้าง ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2561 ดังนี้

ยอดหนี้สาธารณะคงค้าง ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2561 มีจำนวน 6,762,750.43 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 41.72 ของ GDP เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้า หนี้สาธารณะคงค้างลดลงสุทธิ 18,202.79 ล้านบาท โดยมีรายละเอียด ดังนี้

1. หนี้รัฐบาล 5,458,056.42 ล้านบาท เพิ่มขึ้นสุทธิ 7,836.41 ล้านบาท
2. หนี้รัฐวิสาหกิจ 954,436.55 ล้านบาท เพิ่มขึ้นสุทธิ 306.81 ล้านบาท
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน* (รัฐบาลค้ำประกัน) 341,751.97 ล้านบาท
ลดลงสุทธิ 25,882.96 ล้านบาท
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ 8,505.49 ล้านบาท ลดลงสุทธิ 463.05 ล้านบาท

ทั้งนี้ สัดส่วนและรายละเอียดของหนี้สาธารณะ ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2561 ปรากฏตามแผนภาพที่ 1 และตารางที่ 1 ตามลำดับ

แผนภาพที่ 1 สัดส่วนหนี้สาธารณะจำแนกตามประเภท



*หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน หมายถึง หนี้ของรัฐวิสาหกิจที่ทำธุรกิจให้กู้ยืมเงิน ธุรกิจบริหารสินทรัพย์ และธุรกิจประกันสินเชื่อ

ตารางที่ 1 รายงานหนี้สาธารณะคงค้าง ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2561¹

	ณ 30 ก.ย. 61	^{2,3} % GDP	ณ 31 ต.ค. 61	^{2,3} % GDP	หน่วย: ล้านบาท เพิ่ม/(ลด)
	(1)	(2)	(3)	(4)	(3)-(1)
1. หนี้รัฐบาล (1.1+1.2+1.3)	5,450,220.01	33.77	5,458,056.42	33.67	7,836.41
1.1 หนี้ที่รัฐบาลกู้โดยตรง	4,500,182.80	27.88	4,508,019.21	27.81	7,836.41
- หนี้ต่างประเทศ	83,593.71		85,464.90		1,871.19
- เงินกู้เพื่อใช้ในแผนงาน/โครงการของรัฐบาล	36,851.04		36,523.26		(327.78)
- เงินกู้ให้กู้ต่อ ⁴	46,742.67		48,941.64		2,198.97
- หนี้ในประเทศ	4,416,589.09		4,422,554.31		5,965.22
- เงินกู้เพื่อชดเชยการขาดดุลเงินงบประมาณและการบริหารหนี้ ⁵	3,863,476.72		3,867,176.72		3,700.00
- ระยะสั้น (ตัวเงินคลังและเงินกู้อื่น)	24,788.00		20,788.00		(4,000.00)
- ระยะยาว (พันธบัตรและเงินกู้อื่น)	3,838,688.72		3,846,388.72		7,700.00
- เงินกู้เพื่อฟื้นฟูและเสริมสร้างความมั่นคงทางเศรษฐกิจ	355,472.00		355,472.00		-
- เงินกู้ให้กู้ต่อ ⁴	138,118.04		145,777.92		7,659.88
- เงินกู้เพื่อปรับโครงสร้างหนี้ต่างประเทศที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน ⁶	4,133.33		3,616.67		(516.66)
- เงินกู้บาททดแทนการกู้เงินตราต่างประเทศ	55,389.00		50,511.00		(4,878.00)
- เพื่อใช้ในโครงการเงินกู้เพื่อฟื้นฟูเศรษฐกิจและพัฒนาโครงสร้างพื้นฐาน (DPL)	99.00		11.00		(88.00)
- เพื่อการพัฒนาบริหารจัดการทรัพยากรน้ำและระบบขนส่งทางถนนระยะเร่งด่วน	55,290.00		50,500.00		(4,790.00)
1.2 หนี้ที่รัฐบาลกู้เพื่อชดเชยความเสียหายให้แก่กองทุนเพื่อการฟื้นฟู⁷	845,037.21	5.24	845,037.21	5.21	-
- FIDF 1	333,739.21		333,739.21		-
- FIDF 3	511,298.00		511,298.00		-
1.3 หนี้เงินกู้ล่วงหน้าเพื่อปรับโครงสร้างหนี้⁸	105,000.00	0.65	105,000.00	0.65	-
- หนี้เงินกู้เพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณและการบริหารหนี้	105,000.00		105,000.00		-
2. หนี้รัฐวิสาหกิจ (2.1 + 2.2)	954,129.74	5.91	954,436.55	5.89	306.81
2.1 หนี้ที่รัฐบาลค้ำประกัน	413,584.37	2.57	414,177.69	2.56	593.32
- หนี้ต่างประเทศ	72,127.07		72,409.95		282.88
- หนี้ในประเทศ	341,457.30		341,767.74		310.44
2.2 หนี้ที่รัฐบาลไม่ค้ำประกัน	540,545.37	3.15	540,258.86	3.33	(286.51)
- หนี้ต่างประเทศ	106,028.67		105,500.99		(527.68)
- หนี้ในประเทศ	434,516.70		434,757.87		241.17
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	367,634.93	2.28	341,751.97	2.11	(25,882.96)
- หนี้ต่างประเทศ	172.15		172.19		0.04
- หนี้ในประเทศ	367,462.78		341,579.78		(25,883.00)
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ (4.1+4.2)	8,968.54	0.05	8,505.49	0.05	(463.05)
4.1 หนี้ที่รัฐบาลค้ำประกัน	-		-		-
4.2 หนี้ที่รัฐบาลไม่ค้ำประกัน	8,968.54		8,505.49		(463.05)
รวม (1+2+3+4)	6,780,953.22	42.01	6,762,750.43	41.72	(18,202.79)

หมายเหตุ:

1. ตัวเลขในตารางเป็นตัวเลขเบื้องต้น (Preliminary) และไม่รวมหนี้ของนิติบุคคลเฉพาะกิจ (Special Purpose Vehicle : SPV) ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2561 จำนวน 20,499.90 ล้านบาท ที่รัฐบาลมีภาระผูกพันต้องจ่ายภายใต้สัญญาเช่าพื้นที่อาคาร สัญญาบริการจัดหาเฟอร์นิเจอร์ และสัญญาโอนสิทธิเรียกร้องของโครงการศูนย์ราชการกรุงเทพมหานคร ถ. แจ้งวัฒนะ
2. GDP ปี 2560 เท่ากับ 15,452.90 พันล้านบาท และประมาณการ GDP ปี 2561 เท่ากับ 16,349.10 พันล้านบาท (สำนักงานคณะกรรมการพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ ณ 19 พฤศจิกายน 2561) ทั้งนี้ จากการประกาศตัวเลข GDP จริงของไตรมาส 3 ปี 2561 เมื่อวันที่ 19 พฤศจิกายน 2561 ทำให้ตัวเลขหนี้สาธารณะคงค้างต่อ GDP ณ สิ้นเดือนกันยายน 2561 มีการเปลี่ยนแปลงจากร้อยละ 41.70 เป็นร้อยละ 42.01 ของ GDP
3. สบณ. ได้ปรับวิธีการคำนวณ GDP ในแต่ละเดือน เพื่อให้สัดส่วนหนี้สาธารณะต่อ GDP สะท้อนค่าที่ใกล้เคียงความเป็นจริง โดย GDP ในรอบ 12 เดือนที่ผ่านมาสิ้นสุด ณ เดือนกันยายน 2561 ดังนี้ GDP ไตรมาส 4 ปี 60 + GDP ไตรมาส 1-3 ปี 61 เท่ากับ 16,139.43 พันล้านบาท และในรอบ 12 เดือนที่ผ่านมาสิ้นสุด ณ เดือนตุลาคม 2561 ดังนี้ (GDP ไตรมาส 4 ปี 60/3)*2 + GDP ไตรมาส 1-3 ปี 61 + (((ประมาณการ GDP ปี 61) - (GDP ไตรมาส 1-3 ปี 61))/3) เท่ากับ 16,209.32 พันล้านบาท
4. เงินกู้ให้กู้ต่อเป็นหนี้ที่กระทรวงการคลังกู้เงินให้แก่หน่วยงานของรัฐ หรือรัฐวิสาหกิจกู้ต่อเพื่อพัฒนาเศรษฐกิจและสังคมตามมติของ คณะรัฐมนตรี ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2561 หนี้เงินกู้ให้กู้ต่อมีจำนวนทั้งสิ้น 194,719.56 ล้านบาท เป็นการให้กู้ต่อแก่การรถไฟฟ้านครหลวงแห่งประเทศไทย 94,500.44 ล้านบาท การรถไฟแห่งประเทศไทย 83,973.86 ล้านบาท บริษัท การบินไทย จำกัด (มหาชน) 15,677.65 ล้านบาท การเคหะแห่งชาติ 379.02 ล้านบาท และการไฟฟ้าส่วนภูมิภาค 188.59 ล้านบาท ซึ่งหนี้ดังกล่าวไม่ปรากฏรายการในตารางส่วนของหนี้รัฐวิสาหกิจ เพื่อป้องกันการรายงานข้อมูลหนี้คงค้างที่ซ้ำซ้อน
5. 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 14,480 ล้านบาท และในปี 2571 จำนวน 29,200 ล้านบาท ภายใต้ข้อสมมติว่าอัตราเงินเฟ้อทั่วไป (Headline Inflation) เท่ากับ 2.0% (ประมาณการ ณ วันที่ 23 พฤศจิกายน 2561)
6. มาตรา 24 (2) ตามพระราชบัญญัติการบริหารหนี้สาธารณะ พ.ศ. 2548 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ได้ให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้สาธารณะ เพื่อเป็นการประหยัด ลดความเสี่ยงในอัตราแลกเปลี่ยน หรือกระจายภาระการชำระหนี้ โดยที่ผ่านมากระทรวงการคลังได้มีการกู้เงินในประเทศเพื่อชำระหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่กระทรวงการคลังค้ำประกันไม่เกินจำนวนเงินที่ยังมีภาระค้ำประกันอยู่ ทำให้หนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่กระทรวงการคลังค้ำประกันลดลงและหนี้ในประเทศของรัฐบาลเพิ่มขึ้น
7. เงินกู้ที่ออกภายใต้พระราชกำหนดให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินและจัดการเงินกู้เพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาสถาบันการเงิน พ.ศ. 2541 (FIDF1) และพระราชกำหนดให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินและจัดการเงินกู้เพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาสถาบันการเงิน ระยะที่สอง พ.ศ. 2545 (FIDF3) นั้น ต่อมาได้มีการตราพระราชกำหนดปรับปรุงการบริหารหนี้ที่กระทรวงการคลังเพื่อช่วยเหลือกองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาสถาบันการเงิน (กองทุนฯ) พ.ศ. 2555 มาตรา 4 ให้กองทุนฯ มีหน้าที่รับผิดชอบเกี่ยวกับการชำระคืนต้นเงินกู้ และการชำระดอกเบี้ยเงินกู้
8. มาตรา 24/1 ตามพระราชบัญญัติการบริหารหนี้สาธารณะ พ.ศ. 2548 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ได้ให้อำนาจกระทรวงการคลังกู้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ที่มีจำนวนมากและเห็นว่าไม่สมควรกู้เงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ดังกล่าวในคราวเดียวกัน โดยให้สามารถทยอยกู้เงินล่วงหน้าได้ไม่เกิน 12 เดือนก่อนวันที่หนี้ครบกำหนดชำระ และให้นำเงินกู้ดังกล่าวส่งเข้ากองทุนบริหารเงินกู้เพื่อการปรับโครงสร้างหนี้สาธารณะและพัฒนาตลาดตราสารหนี้ในประเทศให้เป็นผู้บริหารเงิน โดยจะนำไปลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความมั่นคงสูง เช่น ตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยกระทรวงการคลัง ตราสารหนี้ที่ออกเป็นเงินตราสกุลหลักและออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลต่างประเทศ การทำธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืนซึ่งตราสารหนี้ที่ออกโดยกระทรวงการคลัง หรือลงทุนในตราสารหนี้อื่นที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือจากบริษัทจัดอันดับความน่าเชื่อถือ เพื่อให้เกิดผลตอบแทนและเป็นการลดต้นทุนของการกู้เงิน

1.1 หนี้ที่รัฐบาลกู้โดยตรง เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าเพิ่มขึ้นสุทธิ 7,836.41 ล้านบาท เนื่องจาก

1.1.1 หนี้ต่างประเทศ เพิ่มขึ้นสุทธิ 1,871.19 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า โดยเป็นผลจากการเบิกจ่ายและชำระคืนหนี้เงินกู้สกุลเงินต่างๆ และการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน โดยการเปลี่ยนแปลงที่สำคัญเกิดจากการเบิกจ่ายเงินกู้เพื่อให้กู้ต่อโครงการระบบรถไฟฟ้าขนส่งมวลชน (สายสีแดง) ของการรถไฟแห่งประเทศไทย จำนวน 1,637.25 ล้านบาท ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 2

ตารางที่ 2 การเปลี่ยนแปลงของหนี้ต่างประเทศที่รัฐบาลกู้โดยตรง

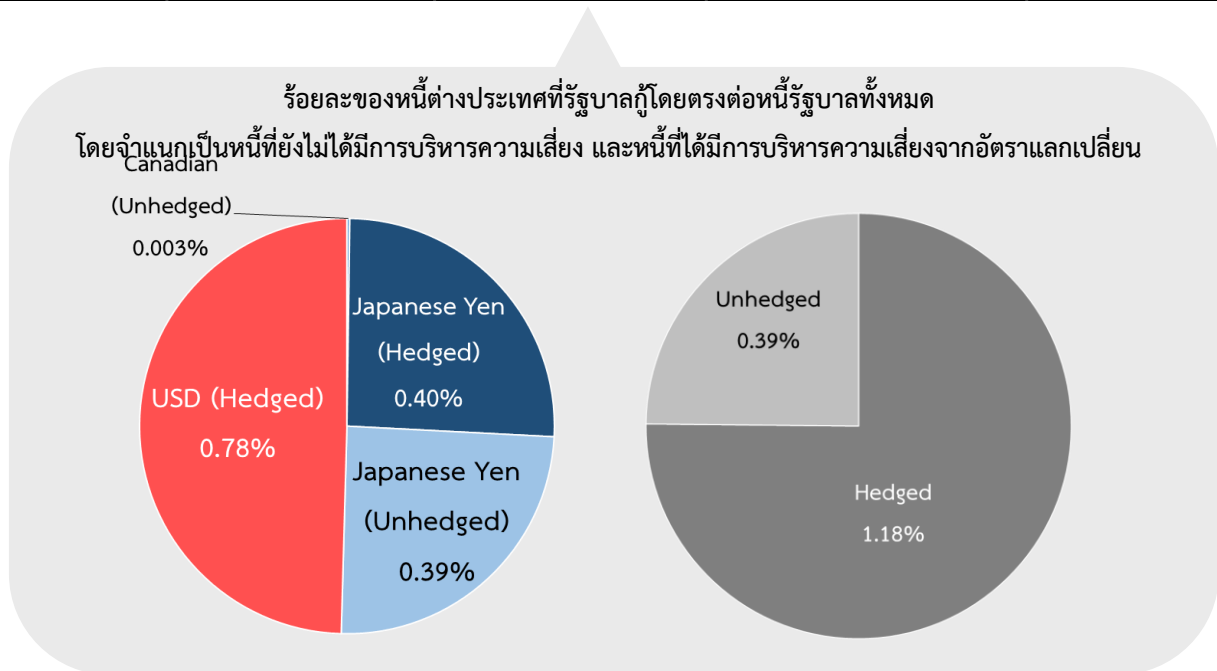
สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ		ผลจากการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 61		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 61		อัตราแลกเปลี่ยน ²		
	ก.ย. 61 (1)	ต.ค. 61 (2)	ล้าน CAD/EUR/JPY/USD (3)	ล้านบาท (4) = (3)×(ข)	ณ สิ้นเดือน ก.ย. 61 (ล้านบาท) (5) = (1)×(ก)	ณ สิ้นเดือน ต.ค. 61 (ล้านบาท) (6) = (1)×(ข)	เพิ่ม/ลด (7) = (6) - (5)	ณ ต.ค. 61 (7) + (4)	สกุลเงิน	ก.ย. 61 (ก)	ต.ค. 61 (ข)	
เงินกู้เพื่อใช้ในแผนงาน/โครงการของรัฐบาล												
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	CAD	25.11	25.63
	EUR	-	-	-	-	-	-	-	-	EUR	38.09	38.11
	JPY	-	-	-	-	-	-	-	-	JPY	0.29	0.30
	USD	-	-	-	-	-	-	-	-	USD	32.58	33.44
หนี้ที่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	JPY	31,762.19	30,749.04	(1,013.15)	(327.78)	-	-	-	(327.78)			
	USD	829.20	829.20	-	-	-	-	-	-			
เงินกู้ให้กู้ยืม												
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	CAD	7.36	7.36	-	-	184.74	188.59	3.85	3.85			
	EUR	-	-	-	-	-	-	-	-			
	JPY	65,163.24	70,661.15	5,497.91	1,637.25	18,847.42	19,405.29	557.87	2,195.12			
	USD	-	-	-	-	-	-	-	-			
หนี้ที่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	JPY	40,834.18	40,834.18	-	-	-	-	-	-			
	USD	500.00	500.00	-	-	-	-	-	-			
รวม					1,309.47			561.72	1,871.19			

- 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	101,410.18	42,921.02	21,878.48	21,042.54
เหรียญสหรัฐ	1,329.20	42,355.29	42,355.29	-
เหรียญแคนาดา	7.36	188.59	-	188.59
ยูโร	-	-	-	-
รวมหนี้ต่างประเทศของรัฐบาล (1)		85,464.90	64,233.77	21,231.13
หนี้ของรัฐบาลทั้งหมด (2)		5,458,056.42		
ร้อยละของหนี้ต่างประเทศต่อหนี้ทั้งหมด ของรัฐบาล (%) = (1)/(2)		1.57	1.18	0.39



1.1.2 หนี้ในประเทศ เพิ่มขึ้นสุทธิ 5,965.22 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า เนื่องจาก

- เงินกู้เพื่อชดเชยการขาดดุลงบประมาณและการบริหารหนี้สาธารณะเพิ่มขึ้นสุทธิ 3,700 ล้านบาท โดยเป็นผลมาจากการออกพันธบัตรรัฐบาลและพันธบัตรออมทรัพย์ จำนวน 33,700 ล้านบาท รวมถึงการไถ่ถอนพันธบัตรออมทรัพย์ จำนวน 30,000 ล้านบาท

- เงินกู้ให้กู้ต่อเพิ่มขึ้น 7,659.88 ล้านบาท เนื่องจาก

- การรถไฟฯขนส่งมวลชนแห่งประเทศไทยเบิกจ่ายเงินกู้จำนวน 5,849.79 ล้านบาท เพื่อจัดทำโครงการรถไฟฟ้าสายสีส้ม ช่วงศูนย์วัฒนธรรมแห่งประเทศไทย - มินบุรี จำนวน 3,777.18 ล้านบาท สายสีเขียว จำนวน 1,568.39 ล้านบาท และสายสีน้ำเงินจำนวน 504.22 ล้านบาท

- การรถไฟแห่งประเทศไทยเบิกจ่ายเงินกู้จำนวน 1,766.38 ล้านบาท เพื่อจัดทำโครงการก่อสร้างรถไฟทางคู่ ช่วงชุมทางถนนจิระ - ขอนแก่น จำนวน 1,057.64 ล้านบาท โครงการก่อสร้างทางคู่ ช่วงนครปฐม - ชุมพร จำนวน 463.47 ล้านบาท โครงการก่อสร้างทางคู่ในเส้นทางรถไฟสายชายฝั่งทะเลตะวันออก ช่วงฉะเชิงเทรา - คลองสิบเก้า - แก่งคอย จำนวน 121.14 ล้านบาท โครงการก่อสร้างทางคู่ ช่วงมาบตาพาด - ชุมทางถนนจิระ จำนวน 70.54 ล้านบาท และโครงการก่อสร้างทางคู่ ช่วงลพบุรี - ปากน้ำโพ จำนวน 53.59 ล้านบาท

- การเคหะแห่งชาติเบิกจ่ายเงินกู้จำนวน 43.71 ล้านบาท เพื่อจัดทำโครงการพักอาศัยแปลง G ตามแผนแม่บทโครงการฟื้นฟูเมืองชุมชนดินแดง

- เงินกู้เพื่อปรับโครงสร้างหนี้ต่างประเทศที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน ลดลง 516.66 ล้านบาท จากการชำระคืนหนี้

- เงินกู้บาททดแทนการกู้เงินตราต่างประเทศ ลดลงสุทธิจำนวน 4,878 ล้านบาท เนื่องจากการชำระคืนหนี้เงินกู้ในโครงการเงินกู้เพื่อฟื้นฟูเศรษฐกิจและพัฒนาโครงสร้างพื้นฐาน (DPL) จำนวน 99 ล้านบาท และการชำระหนี้เงินกู้โครงการพัฒนาระบบบริหารจัดการทรัพยากรน้ำและระบบขนส่งทางถนนระยะเร่งด่วน จำนวน 4,790 ล้านบาท เป็นสำคัญ

1.2 หนี้ที่รัฐบาลกู้เพื่อชดใช้ความเสียหายให้แก่กองทุนเพื่อการฟื้นฟูฯ ไม่มีการเปลี่ยนแปลงจากเดือนก่อนหน้า

1.3 หนี้เงินกู้ล่วงหน้าเพื่อการปรับโครงสร้างหนี้ ไม่มีการเปลี่ยนแปลงจากเดือนก่อนหน้า

2. หนี้รัฐวิสาหกิจ

2.1 หนี้ที่รัฐบาลค้ำประกัน

2.1.1 หนี้ต่างประเทศ เพิ่มขึ้นสุทธิ 282.88 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า โดยเป็นผลจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนเป็นสำคัญ รวมทั้งมีการชำระคืนหนี้สกุลเงินเยนของการรถไฟฟ้ายานขนส่งมวลชนแห่งประเทศไทยและ บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 3

ตารางที่ 3 การเปลี่ยนแปลงของหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจ (รัฐบาลค้ำประกัน)

สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ ก.ย. 61 (1)	หนี้คงค้าง ณ ต.ค. 61 (2)	ผลจากการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 61		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 61 (7) + (4)	อัตราแลกเปลี่ยน ²		
			ล้าน CAD/EUR/JPY/USD (3)	ล้านบาท (4) = (3)x(ข)	ณ สิ้นเดือน ก.ย. 61 (ล้านบาท) (5) = (1)x(ก)	ณ สิ้นเดือน ต.ค. 61 (ล้านบาท) (6) = (1)x(ข)	เพิ่ม/ลด (7) = (6) - (5)		สกุลเงิน	ก.ย. 61 (ก) (ก)	ต.ค. 61 (ข) (ข)
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	EUR 17.99	17.99	-	-	685.09	685.44	0.35	0.35	EUR	38.09	38.11
ความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	JPY 63,581.95	63,581.95	0.00	0.00	18,390.06	18,934.39	544.33	544.33	JPY	0.29	0.30
หนี้ที่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ³	USD -	-	-	-	-	-	-	-	USD	32.58	33.44
	JPY 171,405.06	170,305.51	(1,099.55)	(352.32)	4,709.51	4,800.03	90.52	(261.80)		-	-
	USD -	-	-	-	-	-	-	-		-	-
รวม				(352.32)			635.20	282.88			

- EUR=สกุลเงินยูโร JPY=สกุลเงินเยน และ USD=สกุลเงินเหรียญสหรัฐ
- อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศของธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นอัตราถัวเฉลี่ยราย ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน
- หนี้คงค้างต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจบางส่วนได้มีการบริหารจัดการความเสี่ยงแล้ว (Partial Hedge)

2.1.2 หนี้ในประเทศ เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าเพิ่มขึ้นสุทธิ 310.44 ล้านบาท โดยการเปลี่ยนแปลงเกิดจากหนี้ที่เพิ่มขึ้นสุทธิขององค์การขนส่งมวลชนกรุงเทพ 873.58 ล้านบาท หนี้ที่ลดลงสุทธิของการรถไฟแห่งประเทศไทย 489 ล้านบาท และการชำระคืนหนี้เงินกู้ของการยางแห่งประเทศไทย 74.14 ล้านบาท

2.2 หนี้ที่รัฐบาลไม่ค้ำประกัน

2.2.1 หนี้ต่างประเทศ ลดลงสุทธิ 527.68 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า เนื่องจากการชำระคืนหนี้สกุลเงินต่างๆ ของบริษัท PTT International Trading Singapore และ บริษัท การบินไทย จำกัด (มหาชน) เป็นสำคัญ ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 4

ตารางที่ 4 การเปลี่ยนแปลงของหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจ (รัฐบาลไม่ค้ำประกัน)

สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ ก.ย. 61 (1)	หนี้คงค้าง ณ ต.ค. 61 (2)	ผลจากการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 61		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 61 (7) + (4)	อัตราแลกเปลี่ยน ²		
			ล้าน CAD/EUR/JPY/USD (3)	ล้านบาท (4) = (3)x(ข)	ณ สิ้นเดือน ก.ย. 61 (ล้านบาท) (5) = (1)x(ก)	ณ สิ้นเดือน ต.ค. 61 (ล้านบาท) (6) = (1)x(ข)	เพิ่ม/ลด (7) = (6) - (5)		สกุลเงิน	ก.ย. 61 (ก) (ก)	ต.ค. 61 (ข) (ข)
หนี้ที่ยังไม่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ³	EUR 808.42	795.21	(13.21)	(503.37)	30,793.23	30,809.08	15.85	(487.52)	EUR	38.09	38.11
หนี้ที่ได้รับการบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	JPY 50,091.69	49,721.02	(370.67)	(110.39)	14,488.22	14,917.05	428.83	318.44	JPY	0.29	0.30
	USD 1,667.80	1,608.71	(59.09)	(1,976.27)	54,331.46	55,778.28	1,446.82	(529.45)	USD	32.58	33.44
	JPY 23,000.00	23,000.00	-	-	6,415.76	6,586.60	170.84	170.84			
รวม				(2,590.03)			2,062.34	(527.69)			

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

2.2.2 หนี้ในประเทศ เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าเพิ่มขึ้นสุทธิ 241.17 ล้านบาท โดยการเปลี่ยนแปลงที่สำคัญเกิดจากหนี้ที่เพิ่มขึ้นสุทธิของการไฟฟ้าฝ่ายผลิตแห่งประเทศไทย 2,700 ล้านบาท รวมทั้งมีการชำระคืนหนี้เงินกู้ของบริษัท การบินไทย จำกัด (มหาชน) 1,054.78 ล้านบาท การไถ่ถอนพันธบัตรของการไฟฟ้านครหลวง 1,000 ล้านบาท และการชำระคืนหนี้เงินกู้ของการทางพิเศษแห่งประเทศไทย 300 ล้านบาท

3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)

3.1 หนี้ต่างประเทศ เพิ่มขึ้น 0.04 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า โดยเป็นผลจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยน ดังรายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 5

ตารางที่ 5 การเปลี่ยนแปลงของหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)

สกุลเงิน ¹	หนี้คงค้าง ณ ก.ย. 61 (1)	หนี้คงค้าง ณ ต.ค. 61 (2)	ผลจากการบริหารหนี้ (การเบิกจ่าย/ การชำระคืน/การบริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน) ณ ต.ค. 61		ผลของอัตราแลกเปลี่ยนต่อหนี้คงค้าง			การเปลี่ยนแปลงของหนี้สาธารณะ ณ ต.ค. 61 (7) + (4)	อัตราแลกเปลี่ยน ²			
			ล้าน CAD/EUR/JPY/USD (3)	ล้านบาท (4) = (3)×(ข)	ณ สิ้นเดือน ก.ย. 61 (ล้านบาท) (5) = (1)×(ก)	ณ สิ้นเดือน ต.ค. 61 (ล้านบาท) (6) = (1)×(ข)	เพิ่ม/(ลด) (7) = (6) - (5)		สกุลเงิน	ก.ย. 61 (ก)	ต.ค. 61 (ข)	
หนี้ที่ยังไม่ได้มีการบริหาร	EUR	2.26	2.26	-	-	86.24	86.28	0.04	0.04	EUR	38.09	38.11
ความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน	USD	-	-	-	-	-	-	-	-	USD	32.58	33.44
หนี้ที่ได้มีการบริหารความเสี่ยง	EUR	-	-	-	-	-	-	-	-			
จากอัตราแลกเปลี่ยน	JPY	365.85	365.85	-	-	-	-	-	-			
รวม								0.04	0.04			

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

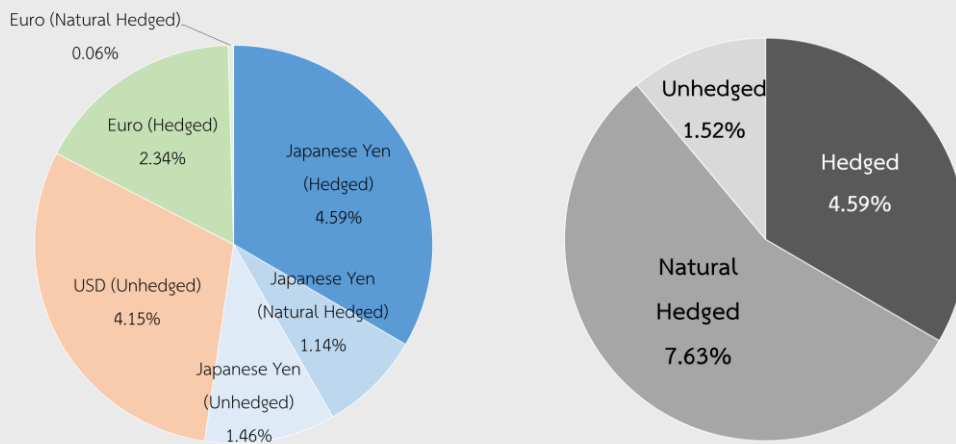
3.2 หนี้ในประเทศ เมื่อเปรียบเทียบกับเดือนก่อนหน้าลดลง 25,883 ล้านบาท โดยการเปลี่ยนแปลงเกิดจากการชำระคืนหนี้เงินกู้ของธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร (ธกส.) 30,883 ล้านบาท และการออกพันธบัตรของ ธกส. จำนวน 5,000 ล้านบาท

หากพิจารณาในรูปเงินบาท หนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจ และรัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน) หลังจากได้บริหารความเสี่ยงของอัตราแลกเปลี่ยนแล้ว มีรายละเอียดปรากฏตามแผนภาพที่ 3

แผนภาพที่ 3 หนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจ และรัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน) ที่บริหารความเสี่ยงและจำแนกเป็นสกุลเงินต่างๆ

สกุลเงิน	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)			
		รวม	Hedged	Natural Hedged	Unhedged
เยน	306,974.33	93,203.69	59,462.63	14,806.67	18,934.39
เหรียญสหรัฐ	1,608.71	53,802.01	-	53,802.01	-
ยูโร	815.46	31,077.43	-	30,305.70	771.73
รวมหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจ (1)		178,083.13	59,462.63	98,914.38	19,706.12
หนี้รัฐวิสาหกิจทั้งหมด (2)		1,296,188.52			
ร้อยละของหนี้ต่างประเทศต่อหนี้ทั้งหมดของรัฐวิสาหกิจ (%) = (1)/(2)		13.74	4.59	7.63	1.52

ร้อยละของหนี้ต่างประเทศของรัฐวิสาหกิจต่อหนี้ทั้งหมดของรัฐวิสาหกิจ โดยจำแนกเป็นหนี้ที่ยังไม่ได้มีการบริหารความเสี่ยง หนี้ที่ได้มีการบริหารความเสี่ยง และหนี้ที่บริหารความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนโดยวิธี Natural Hedged



4. หนี้หน่วยงานของรัฐ ลดลงสุทธิ 463.05 ล้านบาท จากเดือนก่อนหน้า โดยการเปลี่ยนแปลงที่สำคัญเกิดจากการชำระคืนหนี้เงินกู้ของสำนักงานกองทุนอ้อยและน้ำตาลทราย จำนวน 550 ล้านบาท

หนี้สาธารณะคงค้าง ณ วันที่ 31 ตุลาคม 2561 จำนวน 6,762,750.43 ล้านบาท สามารถแบ่งประเภทเป็น หนี้ต่างประเทศ-หนี้ในประเทศ และหนี้ระยะยาว-หนี้ระยะสั้นได้ ดังนี้

หนี้ต่างประเทศและหนี้ในประเทศ แบ่งออกเป็น หนี้ต่างประเทศ 263,548.03 ล้านบาท หรือร้อยละ 3.90 และหนี้ในประเทศ 6,499,202.40 ล้านบาท หรือร้อยละ 96.10 ของยอดหนี้สาธารณะคงค้าง รายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 6

ตารางที่ 6 สัดส่วนหนี้ต่างประเทศและหนี้ในประเทศ

	หนี้สาธารณะ	หนี้ต่างประเทศ		หนี้ในประเทศ	
	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)	%	(ล้านบาท)	%
1. หนี้รัฐบาล	5,458,056.42	85,464.90	1.57	5,372,591.52	98.43
2. หนี้รัฐวิสาหกิจ	954,436.55	177,910.94	18.64	776,525.61	81.36
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	341,751.97	172.19	0.05	341,579.78	99.95
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ	8,505.49	-	-	8,505.49	100.00
รวม	6,762,750.43	263,548.03	3.90	6,499,202.40	96.10

หนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น แบ่งออกเป็น 2 ประเภท ดังนี้

- หนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุของเครื่องมือการกู้เงิน) แบ่งออกเป็น หนี้ระยะยาว 6,580,502.43 ล้านบาท หรือร้อยละ 97.31 และหนี้ระยะสั้น 182,248 ล้านบาท หรือร้อยละ 2.69 ของยอดหนี้สาธารณะคงค้าง รายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 7

ตารางที่ 7 สัดส่วนหนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุของเครื่องมือการกู้เงิน)

	หนี้สาธารณะ	หนี้ระยะยาว		หนี้ระยะสั้น	
	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)	%	(ล้านบาท)	%
1. หนี้รัฐบาล	5,458,056.42	5,301,389.16	97.13	156,667.26	2.87
2. หนี้รัฐวิสาหกิจ	954,436.55	947,855.81	99.31	6,580.74	0.69
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	341,751.97	322,751.97	94.44	19,000.00	5.56
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ	8,505.49	8,505.49	100.00	-	-
รวม	6,762,750.43	6,580,502.43	97.31	182,248.00	2.69

● **หนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุคงเหลือ)** แบ่งออกเป็น หนี้ระยะยาว 5,925,466.55 ล้านบาท หรือร้อยละ 87.62 และหนี้ระยะสั้น 837,283.88 ล้านบาท หรือร้อยละ 12.38 ของยอดหนี้สาธารณะคงค้าง รายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 8

ตารางที่ 8 สัดส่วนหนี้ระยะยาวและหนี้ระยะสั้น (แบ่งตามอายุคงเหลือ)

	หนี้สาธารณะ		หนี้ระยะยาว		หนี้ระยะสั้น	
	(ล้านบาท)	(ล้านบาท)	%	(ล้านบาท)	%	
1. หนี้รัฐบาล	5,458,056.42	4,852,394.23	88.90	605,662.19	11.10	
2. หนี้รัฐวิสาหกิจ	954,436.55	809,555.96	84.82	144,880.59	15.18	
3. หนี้รัฐวิสาหกิจที่เป็นสถาบันการเงิน (รัฐบาลค้ำประกัน)	341,751.97	258,951.97	75.77	82,800.00	24.23	
4. หนี้หน่วยงานของรัฐ	8,505.49	4,564.39	53.66	3,941.10	46.34	
รวม	6,762,750.43	5,925,466.55	87.62	837,283.88	12.38	

พระราชบัญญัติวินัยการเงินการคลังของรัฐ พ.ศ. 2561 ได้กำหนดสัดส่วนเพื่อใช้เป็นกรอบในการบริหารหนี้สาธารณะไว้ โดยผลจากการบริหารหนี้สาธารณะ ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2561 สัดส่วนต่างๆ อยู่ภายใต้กรอบวินัยในการบริหารหนี้สาธารณะดังกล่าว รายละเอียดปรากฏตามตารางที่ 9

ตารางที่ 9 กรอบการบริหารหนี้สาธารณะภายใต้ พ.ร.บ. วินัยการเงินการคลังของรัฐ พ.ศ. 2561

กรอบการบริหารหนี้สาธารณะ	สถานะ ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2561
1. สัดส่วนหนี้สาธารณะคงค้างต่อ GDP	ไม่เกินร้อยละ 60 41.72%
2. สัดส่วนภาระหนี้รัฐบาลต่อประมาณการรายได้ประจำปี	ไม่เกินร้อยละ 35 23.50%
3. สัดส่วนหนี้สาธารณะคงค้างที่เป็นเงินตราต่างประเทศ ต่อหนี้สาธารณะทั้งหมด	ไม่เกินร้อยละ 10 3.90%
4. สัดส่วนภาระหนี้สาธารณะที่เป็นเงินตราต่างประเทศ ต่อรายได้จากการส่งออกสินค้าและบริการ	ไม่เกินร้อยละ 5 0.22%

1. สัดส่วนตามประกาศ คณะกรรมการนโยบายการเงินการคลังของรัฐ เรื่อง กำหนดกรอบในการบริหารหนี้สาธารณะพ.ศ. 2561 เมื่อวันที่ 7 มิถุนายน 2561
2. สัดส่วนที่ 2. และ 4. เป็นข้อมูลประมาณการรายปีของปีงบประมาณ 2562 ตามแผนการบริหารหนี้สาธารณะ ประจำปีงบประมาณ 2562 ที่คณะรัฐมนตรีมีมติเห็นชอบ เมื่อวันที่ 25 กันยายน 2561