

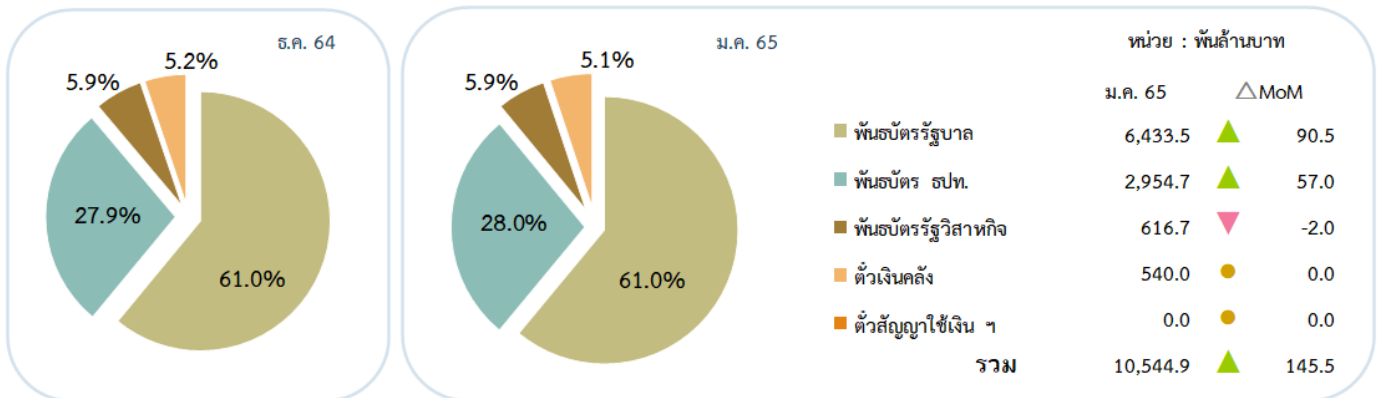


ยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อนหน้า ตามการเพิ่มขึ้นของพันธบัตรรัฐบาล และพันธบัตร ธปท. เป็นสำคัญ ส่วนอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุไม่เกิน 6 เดือน อยู่ที่ร้อยละ 0.36 – 0.50 ลดลงจากเดือนก่อนหน้า 1 ถึง 3 bps

1. ยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐ

ณ สิ้นเดือนมกราคม 2565 ยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐ มีจำนวน 304 รุ่น เท่ากับเดือนก่อน โดยมีมูลค่า 10,544.9 พันล้านบาท เพิ่มขึ้น 145.5 พันล้านบาท ตามการเพิ่มขึ้นของพันธบัตรรัฐบาล และพันธบัตร ธปท. มูลค่า 90.5 และ 57.0 พันล้านบาท ตามลำดับ ในขณะที่พันธบัตรรัฐวิสาหกิจมียอดคงค้างลดลง 2.0 พันล้านบาท โดยหากพิจารณาตามประเภทตราสารหนี้ พบว่ายอดคงค้างพันธบัตรรัฐบาลยังคงมีสัดส่วนสูงสุดร้อยละ 61 รองลงมาเป็นพันธบัตร ธปท. ร้อยละ 28.0 พันบัตรรัฐวิสาหกิจร้อยละ 5.9 และตั๋วเงินคลังร้อยละ 5.1

ยอดคงค้าง	ธ.ค. 64	ม.ค. 65	ΔMoM	%ΔMoM
จำนวนรุ่น	304	304	➡ 0	➡ 0.00%
วงเงิน (พันล้านบาท)	10,399.4	10,544.9	⬆ 145.5	⬆ 1.40%



2. การจำหน่ายตราสารหนี้ภาครัฐ

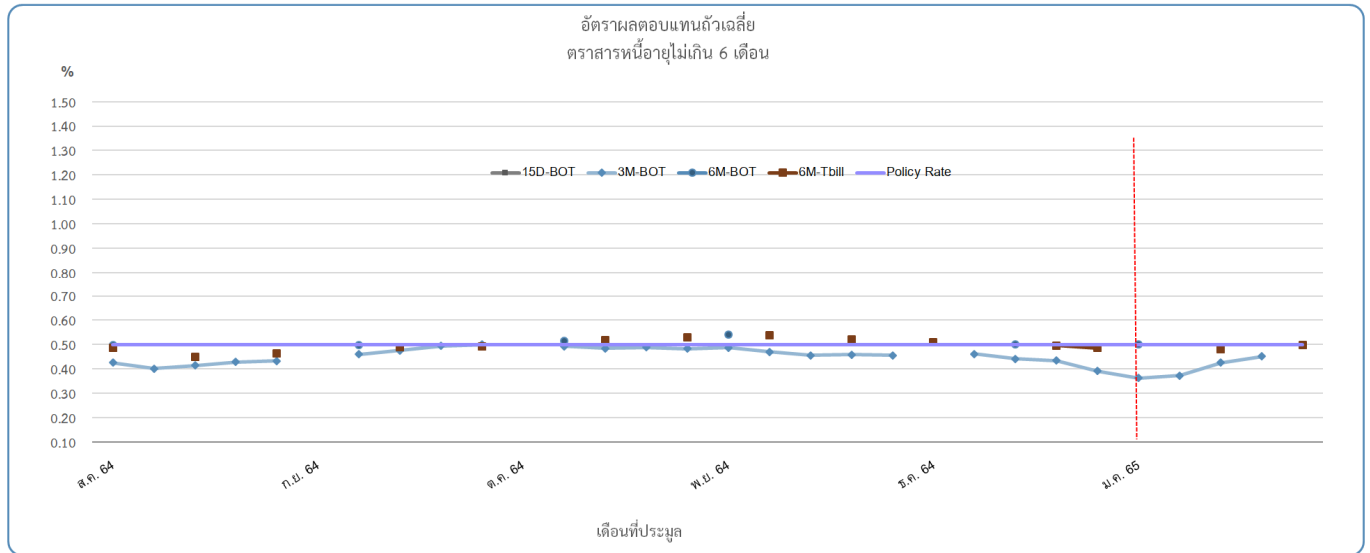
การจำหน่ายตราสารหนี้ภาครัฐที่ ธปท. เป็นนายทะเบียนมีจำนวน 16 รุ่น มูลค่ารวมทั้งสิ้น 507.5 พันล้านบาท เป็นการจำหน่ายผ่านการประมูลและผ่านตัวแทนจำหน่าย ซึ่งรุ่นที่นักลงทุนให้ความสนใจมากที่สุด ได้แก่ พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย รุ่นอายุ 364 วัน มี Bid Coverage Ratio 2.55

2.1 การประมูลตราสารหนี้ภาครัฐ (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

การประมูลตราสารหนี้ภาครัฐมีจำนวน 13 รุ่น วงเงินตามประกาศ 467.0 พันล้านบาท และได้รับการจัดสรรทั้งสิ้น 477.4 พันล้านบาท จำแนกเป็น

- พันธบัตร ธปท. 8 รุ่น วงเงินตามประกาศ 330 พันล้านบาท โดยรุ่นอายุต่ำกว่า 1 ปี มีจำนวน 5 รุ่น วงเงินตามประกาศ 230 พันล้านบาท ได้รับการจัดสรรเต็มวงเงินทุกรุ่น ส่วนรุ่นอายุตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป มีจำนวน 3 รุ่น วงเงินตามประกาศ 100 พันล้านบาท มีการเปิดประมูลเพิ่มเติม 7.0 พันล้านบาท รวมวงเงินจัดสรร 107.0 พันล้านบาท ทำให้มีวงเงินจัดสรรรวมทั้งสิ้น 337.0 พันล้านบาท
- พันธบัตรรัฐบาล 3 รุ่น วงเงินตามประกาศ 57.0 พันล้านบาท มีการเปิดประมูลเพิ่มเติม 3.4 พันล้านบาท ทำให้มีวงเงินจัดสรรรวมทั้งสิ้น 60.4 พันล้านบาท
- ตั๋วเงินคลัง 2 รุ่น วงเงินตามประกาศ 80 พันล้านบาท ได้รับการจัดสรรเต็มวงเงินทุกรุ่น
- พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ ไม่มีการประมูลในเดือนนี้
- ตั๋วสัญญาใช้เงินฯ ไม่มีการประมูลในเดือนนี้

ส่วนอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุไม่เกิน 6 เดือน อยู่ที่ร้อยละ 0.36 – 0.50 ลดลงจากเดือนก่อนหน้า 1 ถึง 3 bps



2.2 การจำหน่ายพันธบัตรออมทรัพย์

การจำหน่ายพันธบัตรออมทรัพย์พิเศษรุ่นส่งเสริมความสุขของกระทรวงการคลัง ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2565 อายุ 3 ปี อัตราดอกเบี้ยแบบขั้นบันได เฉลี่ยร้อยละ 1.90 ต่อปี วงเงินจำหน่าย 30,000 ล้านบาท กำหนดเวลาจำหน่ายตั้งแต่วันที่ 17 -31 มกราคม 2565 โดยจำหน่ายเต็มวงเงินเมื่อวันที่ 19 มกราคม 2565

2.3 การจำหน่ายพันธบัตรรัฐบาลผ่านตัวแทนจำหน่าย

ไม่มีการจำหน่ายในเดือนนี้

2.4 การจำหน่ายพันธบัตรรัฐวิสาหกิจผ่านตัวแทนจำหน่าย (เฉพาะที่ ธปท. รับเป็นนายทะเบียน)

ไม่มีการจำหน่ายในเดือนนี้

3. ตราสารหนี้ที่ครบกำหนดไถ่ถอน

ตราสารหนี้ที่ครบกำหนดไถ่ถอนมีจำนวน 10 รุ่น มูลค่ารวม 362 พันล้านบาท ได้แก่ พันธบัตร ธปท. 6 รุ่น มูลค่า 280 พันล้านบาท ตั๋วเงินคลัง 2 รุ่น มูลค่า 80 พันล้านบาท และพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ 2 รุ่น มูลค่า 2 พันล้านบาท

ตราสารหนี้ที่ครบกำหนดไถ่ถอน

ประเภทตราสารหนี้	จำนวนรุ่น	มูลค่า (พันล้านบาท)
พันธบัตรรัฐบาล	-	-
พันธบัตร ธปท.	6	280.0
รัฐวิสาหกิจ	2	2.0
ตั๋วเงินคลัง	2	80.0
รวม	10	362.0

ภาคผนวก

1. ตารางสรุปยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐ เดือน ม.ค. 64 – ม.ค. 65

ประเภทตราสารหนี้	2564												หน่วย : ล้านบาท
	ม.ค.	ก.พ.	มี.ค.	เม.ย.	พ.ค.	มิ.ย.	ก.ค.	ส.ค.	ก.ย.	ต.ค.	พ.ย.	ธ.ค.	ม.ค.
พันธบัตรรัฐบาล	5,650,552	5,797,552	5,820,157	5,845,157	5,886,908	5,945,283	5,976,056	6,063,456	6,143,456	6,240,456	6,403,635	6,343,024	6,433,469
พันธบัตร รพท.	3,238,846	3,079,823	2,911,028	2,904,141	2,871,458	2,917,241	2,975,188	2,958,499	2,925,768	2,960,110	2,871,553	2,897,665	2,954,710
พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ	572,425	585,875	611,045	620,045	628,045	640,915	640,715	639,715	647,545	647,703	610,703	618,703	616,703
ตั๋วเงินคลัง	458,958	498,958	528,958	540,000	540,000	540,000	540,000	540,000	540,000	540,000	540,000	540,000	540,000
ตั๋วสัญญาใช้เงิน	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ยอดรวมจำนวนเงิน	9,920,781	9,962,208	9,871,188	9,909,343	9,926,411	10,043,439	10,131,960	10,201,671	10,256,770	10,388,270	10,425,891	10,399,393	10,544,882
ยอดรวมจำนวนรุ่น	301	302	301	300	297	297	297	297	299	301	303	304	304

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > ข้อมูลตราสารหนี้ > ตราสารหนี้คงค้าง จำหน่าย ไถ่ถอน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2565

2. ตารางสรุปการจำหน่ายตราสารหนี้ภาครัฐ เดือน ม.ค. 64 – ม.ค. 65 (ข้อมูลตามวันที่ชำระเงิน)

ประเภทตราสารหนี้	2564												หน่วย : ล้านบาท
	ม.ค.	ก.พ.	มี.ค.	เม.ย.	พ.ค.	มิ.ย.	ก.ค.	ส.ค.	ก.ย.	ต.ค.	พ.ย.	ธ.ค.	ม.ค.
พันธบัตรรัฐบาล	69,523	147,000	91,605	194,000	53,453	59,000	123,000	87,400	80,000	97,000	177,915	80,105	90,445
พันธบัตร รพท.	406,160	308,330	337,484	396,612	371,178	357,647	424,466	393,908	428,700	340,720	323,121	376,112	337,045
พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ	10,000	14,300	28,170	9,000	13,000	18,250	3,800	-	11,830	2,158	-	9,000	-
ตั๋วเงินคลัง	80,000	80,000	120,000	100,000	80,000	80,000	80,000	80,000	120,000	80,000	80,000	80,000	80,000
ตั๋วสัญญาใช้เงิน	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ยอดรวมจำนวนเงิน	565,683	549,630	577,259	699,612	517,631	514,897	631,266	561,308	640,530	519,878	581,036	545,217	507,490
ยอดรวมจำนวนรุ่น	16	19	21	16	14	17	19	16	20	16	20	17	16

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > ข้อมูลตราสารหนี้ > ตราสารหนี้คงค้าง จำหน่าย ไถ่ถอน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2565

3. ตารางสรุปอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุไม่เกิน 6 เดือน เดือน ธ.ค. 64 – ม.ค. 65 (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

ประเภทตราสารหนี้	หน่วย : ร้อยละ					หน่วย : ร้อยละ				
	2564					2565				
	1 - 3 ธ.ค.	7 - 9 ธ.ค.	13 - 17 ธ.ค.	20 - 24 ธ.ค.	27 - 30 ธ.ค.	3 - 7 ม.ค.	10 - 14 ม.ค.	17 - 21 ม.ค.	24 - 28 ม.ค.	31 ม.ค.
รพท. 3 เดือน		0.46152	0.44065	0.43376	0.39060	0.36237	0.37256	0.42513	0.45140	
รพท. 6 เดือน			0.50006			0.49969				
ตั๋วเงินคลัง 3 เดือน										
ตั๋วเงินคลัง 6 เดือน	0.50866			0.49552	0.48588			0.47956		0.49801
อัตราดอกเบี้ยนโยบาย ^{1/}	0.50000	0.50000	0.50000	0.50000	0.50000	0.50000	0.50000	0.50000	0.50000	0.50000

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล

0.00

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2565

4. ตารางสรุปผลการประมูลพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย เดือน ม.ค. 65 (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

ช่วงอายุ	วันที่ประมูล	วันที่ชำระเงิน	รุ่น	อายุ คงเหลือ	วงเงินประกาศ (ล้านบาท)	วงเงินจัดสรร (ล้านบาท)	อัตราต่ำสุด (%)	อัตราสูงสุด (%)	อัตราเฉลี่ย (%)	เพิ่มขึ้น/ (ลดลง)จาก สัปดาห์ก่อน (bps)	BCR
3 เดือน	04 ม.ค. 2565	06 ม.ค. 2565	CB22407B	91 Days	50,000	50,000	0.3540	0.3700	0.36237	(3)	1.48
	11 ม.ค. 2565	13 ม.ค. 2565	CB22418A	95 Days	50,000	50,000	0.3500	0.3770	0.37256	1	1.36
	18 ม.ค. 2565	20 ม.ค. 2565	CB22421A	91 Days	50,000	50,000	0.3550	0.4530	0.42513	6	1.65
	25 ม.ค. 2565	27 ม.ค. 2565	CB22428A	91 Days	50,000	50,000	0.4000	0.4580	0.45140	2	1.72
		รวม		4 รุ่น	200,000	200,000					
6 เดือน	06 ม.ค. 2565	10 ม.ค. 2565	CBF22711A	182 วัน	30,000	30,000	0.48433	0.50533	0.49969	0	2.43
		รวม		1 รุ่น	30,000	30,000					
มากกว่า 6 เดือน	04 ม.ค. 2565	06 ม.ค. 2565	CB23105A	364 Days	45,000	45,000	0.4650	0.5100	0.50034	n.a.	1.94
	13 ม.ค. 2565	17 ม.ค. 2565	BOT23NA	1.85 Yrs	25,000	27,146	0.618	0.643	0.6334	n.a.	2.07
	20 ม.ค. 2565	24 ม.ค. 2565	CBF23123A	364 Days	30,000	34,899	0.50084	0.52300	0.51251	1	2.55
		รวม		3 รุ่น	100,000	107,045					
		รวมทั้งหมด		8 รุ่น	330,000	337,045					

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2565

5. ตารางสรุปผลการประมูลพันธบัตรรัฐบาล เดือน ม.ค. 65 (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

วันที่ประมูล	วันที่ชำระเงิน	รุ่น	อายุ คงเหลือ	อัตราดอกเบี้ย (ร้อยละต่อปี)	วงเงิน ประกาศ NCB+CB (ล้านบาท)	วงเงินจัดสรร NCB+CB (ล้านบาท)	Greenshoe Option (ล้านบาท)	Over Allotment (ล้านบาท)	วงเงินจัดสรร รวม (ล้านบาท)	อัตราต่ำสุด (%)	อัตรา สูงสุด (%)	อัตราเฉลี่ย (%)	BCR
12 ม.ค. 2565	14 ม.ค. 2565	ESGLB35DA	13.93 ปี	1.585	20,000	20,000	-	-	20,000	2.434	2.467	2.4531	1.68
19 ม.ค. 2565	21 ม.ค. 2565	LB276A	5.41 ปี	1.0	30,000	30,000	3,445	-	33,445	1.599	1.618	1.6091	2.00
26 ม.ค. 2565	28 ม.ค. 2565	LB526A	30.41 ปี	2.75	7,000	7,000	-	-	7,000	3.068	3.120	3.0924	1.75
		รวม	3 รุ่น		57,000	57,000	3,445	-	60,445				

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2565

6. ตารางสรุปผลการประมูลตั๋วเงินคลัง เดือน ม.ค. 65 (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

วันที่ประมูล	วันที่ชำระเงิน	รุ่น	อายุ คงเหลือ	วงเงิน ประกาศ (ล้านบาท)	วงเงินจัดสรร (ล้านบาท)	อัตราต่ำสุด (%)	อัตรา สูงสุด (%)	อัตราเฉลี่ย (%)	BCR
17 ม.ค. 2565	19 ม.ค. 2565	TB22720A	182 วัน	40,000	40,000	0.4450	0.5000	0.47956	1.65
31 ม.ค. 2565	02 ก.พ. 2565	TB22803A	182 วัน	40,000	40,000	0.4650	0.5030	0.49801	2.08
		รวม	2 รุ่น	80,000	80,000				

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2565

7. ตารางสรุปการจำหน่ายพันธบัตรออมทรัพย์ เดือน ม.ค. 65

ระยะเวลาเปิดจำหน่าย	ชื่อตราสารหนี้	อายุ	อัตราดอกเบี้ย (%)	วงเงิน (ล้านบาท)	จำหน่ายเดือนนี้ (ล้านบาท)	จำหน่ายสะสมถึง เดือนนี้ (ล้านบาท)
17 ม.ค. - 31 ม.ค. 64	พันธบัตรออมทรัพย์พิเศษรุ่นส่งเสริมความสุขของกระทรวงการคลัง ในปีงบประมาณ พ.ศ. 2565	3	แบบขั้นบันได ^{1/}	30,000.0	30,000.0	-
	รวม	1 รุ่น		30,000.0	30,000.0	-

^{1/} อัตราดอกเบี้ย ปีที่ 1 = 1.6%, ปีที่ 2 = 1.8%, ปีที่ 3 = 2.3% เฉลี่ย 1.9%

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2565

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > ข้อมูลตราสารหนี้ > ตราสารหนี้คงค้าง จำหน่าย ใดก่อน