

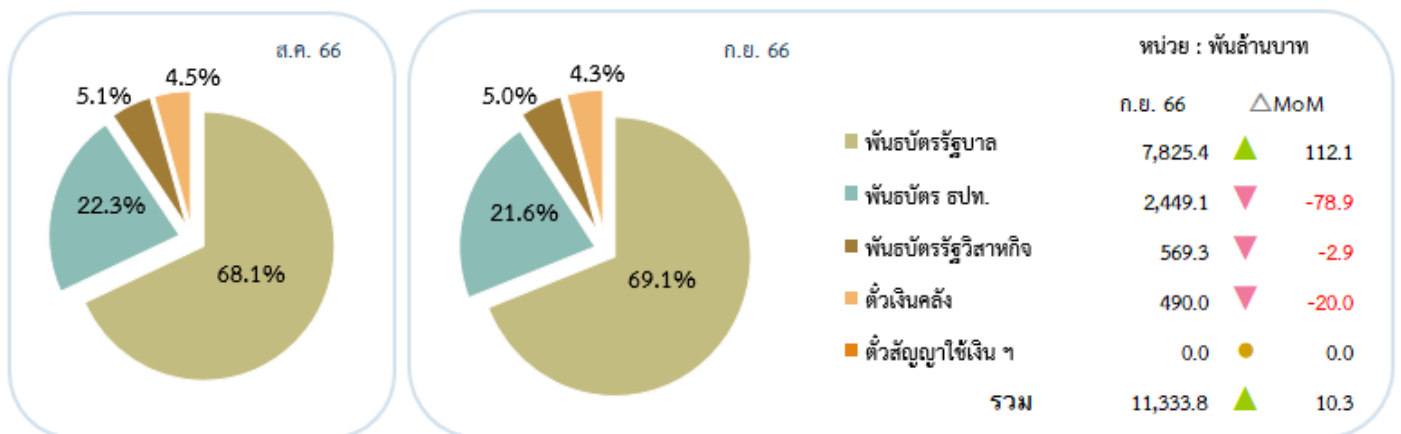


ยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อนหน้า ตามการเพิ่มขึ้นของพันธบัตรรัฐบาลเป็นสำคัญ ส่วนอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุไม่เกิน 6 เดือน อยู่ที่ร้อยละ 2.11 – 2.39 เปลี่ยนแปลงจากเดือนก่อนหน้า 15 ถึง 36 bps สำหรับอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุเกิน 6 เดือนของพันธบัตร ธปท. อยู่ที่ร้อยละ 2.27 – 2.63 และพันธบัตรรัฐบาลอยู่ที่ร้อยละ 2.66 – 3.51

1. ยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐ

ณ สิ้นเดือนกันยายน 2566 ยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐ มีจำนวน 297 รุ่น ลดลงจากเดือนก่อนหน้า 5 รุ่น โดยมีมูลค่า 11,333.8 พันล้านบาท เพิ่มขึ้น 10.3 พันล้านบาท ตามการเพิ่มขึ้นของพันธบัตรรัฐบาลที่เพิ่มขึ้น 112.1 พันล้านบาท ซึ่งหากพิจารณาตามประเภทตราสารหนี้ พบว่า ยอดคงค้างพันธบัตรรัฐบาลยังคงมีสัดส่วนสูงสุดเช่นเดียวกับเดือนก่อนในสัดส่วนร้อยละ 69.1 รองลงมาเป็นพันธบัตร ธปท. ร้อยละ 21.6 พันธบัตรรัฐวิสาหกิจร้อยละ 5.0 และตั๋วเงินคลังร้อยละ 4.3

ยอดคงค้าง	ส.ค. 66	ก.ย. 66	Δ MoM	% Δ MoM
จำนวนรุ่น	302	297	↓	-5
วงเงิน (พันล้านบาท)	11,323.5	11,333.8	↑	10.3



2. การจำหน่ายตราสารหนี้ภาครัฐ

การจำหน่ายตราสารหนี้ภาครัฐที่ ธปท. เป็นนายทะเบียนมีจำนวน 16 รุ่น โดยจำหน่ายผ่านการประมูลทั้งหมด 15 รุ่น มูลค่ารวม 514.1 พันล้านบาท ทั้งนี้ รุ่นที่นักลงทุนให้ความสนใจมากที่สุด คือ ตั๋วเงินคลัง อายุ 6 เดือน Bid Coverage Ratio 3.52 และมีการจำหน่ายผ่านตัวแทน 1 รุ่น ได้แก่ พันธบัตรการประปาส่วนภูมิภาค พ.ศ. 2566 ครั้งที่ 3 มูลค่า 0.65 พันล้านบาท

2.1 การประมูลตราสารหนี้ภาครัฐ (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

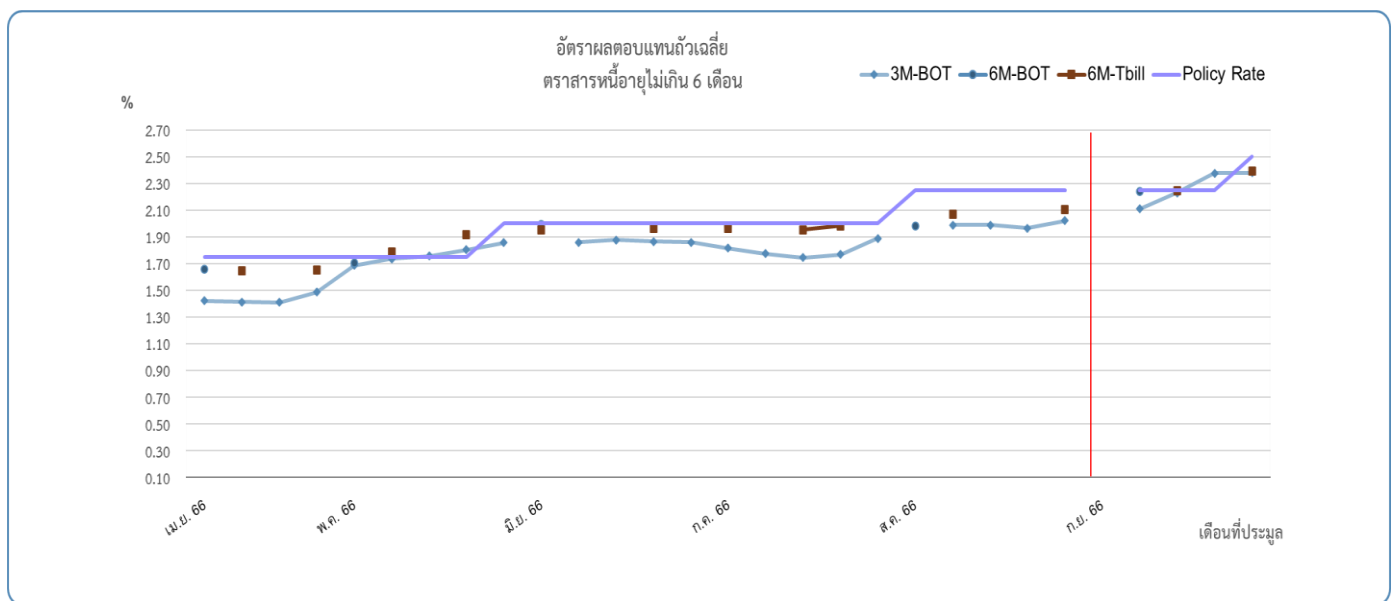
การประมูลตราสารหนี้ภาครัฐมีจำนวน 15 รุ่น วงเงินตามประกาศ 527.0 พันล้านบาท และได้รับการจัดสรรทั้งสิ้น 514.1 พันล้านบาท จำแนกเป็น

- พันธบัตร ธปท. 8 รุ่น วงเงินรวมตามประกาศ 375.0 พันล้านบาท โดยรุ่นอายุต่ำกว่า 1 ปี ประกอบด้วย รุ่นอายุ 3 เดือน จำนวน 4 รุ่น วงเงิน 240.0 พันล้านบาท ได้รับจัดสรรเต็มวงเงิน รุ่นอายุ 6 เดือน จำนวน 1 รุ่น วงเงิน 40.0 พันล้านบาท ได้รับจัดสรรเต็มวงเงิน ส่วนรุ่นอายุตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป จำนวน 3 รุ่น วงเงิน 95.0 พันล้านบาท มีการลดวงเงินจัดสรร 1 รุ่น รวมวงเงินจัดสรร 82.1 พันล้านบาท ทำให้มีวงเงินจัดสรรรวมทั้งสิ้น 362.1 พันล้านบาท

- พันธบัตรรัฐบาล 5 รุ่น วงเงินรวมตามประกาศ 92.0 พันล้านบาท โดยเป็นพันธบัตรรุ่นอายุคงเหลือ 3.5 ปี 5.53 ปี 9.74 ปี 23.79 ปี และ 28.78 ปี วงเงิน 25.0 พันล้านบาท 30.0 พันล้านบาท 23.0 พันล้านบาท 7.0 พันล้านบาท และ 7.0 พันล้านบาท ตามลำดับ ได้รับการจัดสรรเต็มวงเงินทุกรุ่น

- ตัวเงินคลัง 2 รุ่น วงเงินรวมตามประกาศ 60.0 พันล้านบาท ได้รับจัดสรรเต็มวงเงินทุกรุ่น
- พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ ไม่มีการประมูลในเดือนนี้
- ตัวสัญญาใช้เงินเพื่อการปรับโครงสร้างหนี้ ไม่มีการประมูลในเดือนนี้

อัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุไม่เกิน 6 เดือน อยู่ที่ร้อยละ 2.11 – 2.39 เปลี่ยนแปลงจากเดือนก่อนหน้า 15 ถึง 36 bps สำหรับอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุเกิน 6 เดือนของพันธบัตร ธปท. อยู่ที่ร้อยละ 2.27 – 2.63 และพันธบัตรรัฐบาลอยู่ที่ร้อยละ 2.66 – 3.51



2.2 การจำหน่ายพันธบัตรออมทรัพย์

ไม่มีการจำหน่ายในเดือนนี้

2.3 การจำหน่ายพันธบัตรรัฐบาลผ่านตัวแทนจำหน่าย

ไม่มีการจำหน่ายในเดือนนี้

2.4 การจำหน่ายพันธบัตรรัฐวิสาหกิจผ่านตัวแทนจำหน่าย (เฉพาะที่ ธปท. รับเป็นนายทะเบียน)

การจำหน่ายพันธบัตรรัฐวิสาหกิจมีจำนวน 1 รุ่น ได้แก่ พันธบัตรการประปาส่วนภูมิภาค พ.ศ. 2566 ครั้งที่ 3 ครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. 2571 อายุ 5 ปี อัตราดอกเบี้ยร้อยละ 2.60 โดยมีมูลค่าการจำหน่าย 0.65 พันล้านบาท และเป็นการจำหน่ายผ่านธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)

2.5 ธุรกรรมแลกเปลี่ยนพันธบัตร (Bond Switching)

ไม่มีการแลกเปลี่ยนพันธบัตรในเดือนนี้

3. ตราสารหนี้ที่ครบกำหนดไถ่ถอน

ตราสารหนี้ที่ครบกำหนดไถ่ถอนมีจำนวน 15 รุ่น มูลค่ารวม 512.6 พันล้านบาท ได้แก่ พันธบัตร ฐปท. 8 รุ่น มูลค่า 429.0 พันล้านบาท ตั๋วเงินคลัง 2 รุ่น มูลค่า 80.0 พันล้านบาท และพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ 5 รุ่น มูลค่า 3.6 พันล้านบาท

ตราสารหนี้ที่ครบกำหนดไถ่ถอน

ประเภทตราสารหนี้	จำนวนรุ่น	มูลค่า (พันล้านบาท)
พันธบัตร ฐปท.	8	429.0
ตั๋วเงินคลัง	2	80.0
รัฐวิสาหกิจ	5	3.6
รวม	15	512.6

ภาคผนวก

1. ตารางสรุปยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐ เดือน ก.ย. 65 – ก.ย. 66

ประเภทตราสารหนี้	2565				2566								
	ก.ย.	ต.ค.	พ.ย.	ธ.ค.	ม.ค.	ก.พ.	มี.ค.	เม.ย.	พ.ค.	มิ.ย.	ก.ค.	ส.ค.	ก.ย.
พันธบัตรรัฐบาล	7,062,568	7,162,962	7,202,962	7,235,440	7,339,780	7,400,180	7,463,854	7,577,974	7,642,867	7,560,759	7,641,355	7,713,355	7,825,355
พันธบัตร อปท.	2,521,930	2,540,910	2,390,662	2,403,266	2,435,432	2,388,425	2,331,683	2,386,282	2,270,877	2,374,634	2,439,468	2,528,025	2,449,059
พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ	581,370	581,370	586,370	588,870	586,870	593,930	597,930	600,460	582,615	582,615	582,215	572,215	569,262
ตั๋วเงินคลัง	540,000	540,000	535,276	535,276	535,276	535,276	535,276	535,276	540,000	540,000	540,000	510,000	490,000
ตั๋วสัญญาใช้เงิน	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ยอดรวมจำนวนเงิน	10,705,868	10,825,242	10,715,270	10,762,851	10,897,357	10,917,810	10,928,742	11,099,991	11,036,358	11,058,007	11,203,037	11,323,594	11,333,675
ยอดรวมจำนวนรุ่น	299	301	301	305	305	305	303	303	304	303	304	302	297

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > ข้อมูลตราสารหนี้ > ตราสารหนี้คงค้าง จำหน่าย ไถ่ถอน

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2566

2. ตารางสรุปการจำหน่ายตราสารหนี้ภาครัฐ เดือน ก.ย. 65 – ก.ย. 66 (ข้อมูลตามวันที่ชำระเงิน)

ประเภทตราสารหนี้	2565				2566								
	ก.ย.	ต.ค.	พ.ย.	ธ.ค.	ม.ค.	ก.พ.	มี.ค.	เม.ย.	พ.ค.	มิ.ย.	ก.ค.	ส.ค.	ก.ย.
พันธบัตรรัฐบาล	80,646	100,394	83,173	170,712	104,340	80,400	114,374	114,120	129,002	87,880	80,596	92,000	112,000
พันธบัตร อปท.	418,937	355,000	339,418	394,373	357,065	370,908	432,385	376,262	398,201	460,357	381,674	475,084	350,000
พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ	-	-	5,000	4,500	4,000	12,260	5,000	3,730	10,355	2,000	2,600	2,000	650
ตั๋วเงินคลัง	80,000	80,000	75,276	80,000	80,000	80,000	120,000	100,000	80,000	80,000	80,000	90,000	60,000
ตั๋วสัญญาใช้เงิน	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ยอดรวมจำนวนเงิน	579,583	535,394	502,867	649,585	545,405	543,568	671,759	594,112	617,558	630,237	544,870	659,084	522,650
ยอดรวมจำนวนรุ่น	15	16	20	23	16	20	18	18	26	18	17	21	16

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > ข้อมูลตราสารหนี้ > ตราสารหนี้คงค้าง จำหน่าย ไถ่ถอน

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2566

3. ตารางสรุปอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุไม่เกิน 6 เดือน เดือน ส.ค. – ก.ย. 66 (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

ประเภทตราสารหนี้	2566					2566				
	2 - 4 ส.ค.	7 - 11 ส.ค.	15 - 18 ส.ค.	21 - 25 ส.ค.	28 - 31 ส.ค.	1 ก.ย.	4 - 8 ก.ย.	11 - 15 ก.ย.	18 - 22 ก.ย.	25 - 29 ก.ย.
อปท. 3 เดือน		1.98998	1.98781	1.96435	2.02116		2.10991	2.23030	2.37507	2.38065
อปท. 6 เดือน	1.98149	-	-	-	-		2.24164			
ตั๋วเงินคลัง 3 เดือน	-	-	-	-	-					
ตั๋วเงินคลัง 6 เดือน	-	2.07082	-	-	2.10691			2.24339		2.39141
อัตราดอกเบี้ยนโยบาย ^{1/}	2.25000	2.25000	2.25000	2.25000	2.25000	2.25000	2.25000	2.25000	2.25000	2.50000

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล

ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2566

4. ตารางสรุปผลการประมูลพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย เดือน ก.ย. 66 (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

ช่วงอายุ	วันที่ประมูล	วันที่ชำระเงิน	รุ่น	อายุคงเหลือ	วงเงินประกาศ (ล้านบาท)	วงเงินจัดสรร (ล้านบาท)	อัตราต่ำสุด (%)	อัตราสูงสุด (%)	อัตราถัวเฉลี่ย (%)	เพิ่มขึ้น/ (ลดลง)จาก สัปดาห์ก่อน (bps)	BCR
3 เดือน	05 ก.ย. 2566	07 ก.ย. 2566	CB23D07A	91 วัน	60,000	60,000	2.0770	2.1930	2.10991	9	1.22
	12 ก.ย. 2566	14 ก.ย. 2566	CB23D14B	91 วัน	60,000	60,000	2.1500	2.2800	2.23030	12	1.33
	19 ก.ย. 2566	21 ก.ย. 2566	CB23D21A	91 วัน	60,000	60,000	2.2700	2.4980	2.37507	15	1.14
	26 ก.ย. 2566	28 ก.ย. 2566	CB23D28A	91 วัน	60,000	60,000	2.3050	2.4280	2.38065	0	2.11
		รวม		4 รุ่น	240,000	240,000					
6 เดือน	07 ก.ย. 2566	11 ก.ย. 2566	CBF24311B	182 วัน	40,000	40,000	2.22185	2.26185	2.24164	n.a	1.77
		รวม		1 รุ่น	40,000	40,000					
มากกว่า 6 เดือน	05 ก.ย. 2566	07 ก.ย. 2566	CB24905A	364 วัน	30,000	30,000	2.2000	2.3500	2.27082	n.a	1.23
	14 ก.ย. 2566	18 ก.ย. 2566	CBF24916A	364 วัน	40,000	40,000	2.25318	2.33318	2.28885	n.a	1.06
	28 ก.ย. 2566	02 ต.ค. 2566	BOT255A	1.66 ปี	25,000	12,143	2.577	2.670	2.6325	n.a	0.62
		รวม		3 รุ่น	95,000	82,143					
		รวมทั้งหมด		8 รุ่น	375,000	362,143					

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2566

5. ตารางสรุปผลการประมูลพันธบัตรรัฐบาล เดือน ก.ย. 66 (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

วันที่ประมูล	วันที่ชำระเงิน	รุ่น	อายุคงเหลือ	อัตราดอกเบี้ย (ร้อยละต่อปี)	วงเงินประกาศ NCB+CB (ล้านบาท)	วงเงินจัดสรร NCB+CB (ล้านบาท)	Greenshoe Option (ล้านบาท)	Over AllotMent (ล้านบาท)	วงเงิน จัดสรรรวม (ล้านบาท)	อัตราต่ำสุด (%)	อัตรา สูงสุด (%)	อัตราถัวเฉลี่ย (%)	BCR
06 ก.ย. 2566	08 ก.ย. 2566	LB293A	5.53 ปี	2.40	30,000	30,000	-	-	30,000	2.680	2.700	2.6924	1.58
06 ก.ย. 2566	08 ก.ย. 2566	LBA476A	23.79 ปี	3.14	7,000	7,000	-	-	7,000	3.297	3.333	3.3099	1.27
13 ก.ย. 2566	15 ก.ย. 2566	LB273A	3.5 ปี	2.25	25,000	25,000	-	-	25,000	2.640	2.700	2.6624	1.13
13 ก.ย. 2566	15 ก.ย. 2566	LB526A	28.78 ปี	2.75	7,000	7,000	-	-	7,000	3.444	3.600	3.5071	1.04
20 ก.ย. 2566	22 ก.ย. 2566	LB336A	9.74 ปี	3.35	23,000	23,000	-	-	23,000	3.195	3.257	3.2337	1.81
		รวม	5 รุ่น		92,000	92,000	-	-	92,000				

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2566

6. ตารางสรุปผลการประมูลตั๋วเงินคลัง เดือน ก.ย. 66 (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

วันที่ประมูล	วันที่ชำระเงิน	รุ่น	อายุคงเหลือ	วงเงินประกาศ (ล้านบาท)	วงเงินจัดสรร (ล้านบาท)	อัตราต่ำสุด (%)	อัตราสูงสุด (%)	อัตราถัวเฉลี่ย (%)	BCR
11 ก.ย. 2566	13 ก.ย. 2566	TB24313A	182 วัน	30,000	30,000	2.1990	2.2980	2.24339	1.84
25 ก.ย. 2566	27 ก.ย. 2566	TB24327A	182 วัน	30,000	30,000	2.3800	2.4000	2.39141	3.52
		รวม	2 รุ่น	60,000	60,000				

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2566

7. ตารางสรุปการจำหน่ายพันธบัตรรัฐวิสาหกิจผ่านตัวแทน เดือน ก.ย. 66 (เฉพาะที่ ropic รับเป็นนายทะเบียน)

วันที่ชำระเงิน	ชื่อตราสารหนี้	อายุ	อัตราดอกเบี้ย (%)	วงเงิน (ล้านบาท)
25 ก.ย. 2566	พันธบัตรการประปาส่วนภูมิภาค พ.ศ. 2566 ครั้งที่ 3	5 ปี	2.6	650
	รวม	1 รุ่น		650

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > ข้อมูลตราสารหนี้ > ตราสารหนี้คงค้าง จำหน่าย ไถ่ถอน ข้อมูล ณ วันที่ 30 กันยายน 2566