

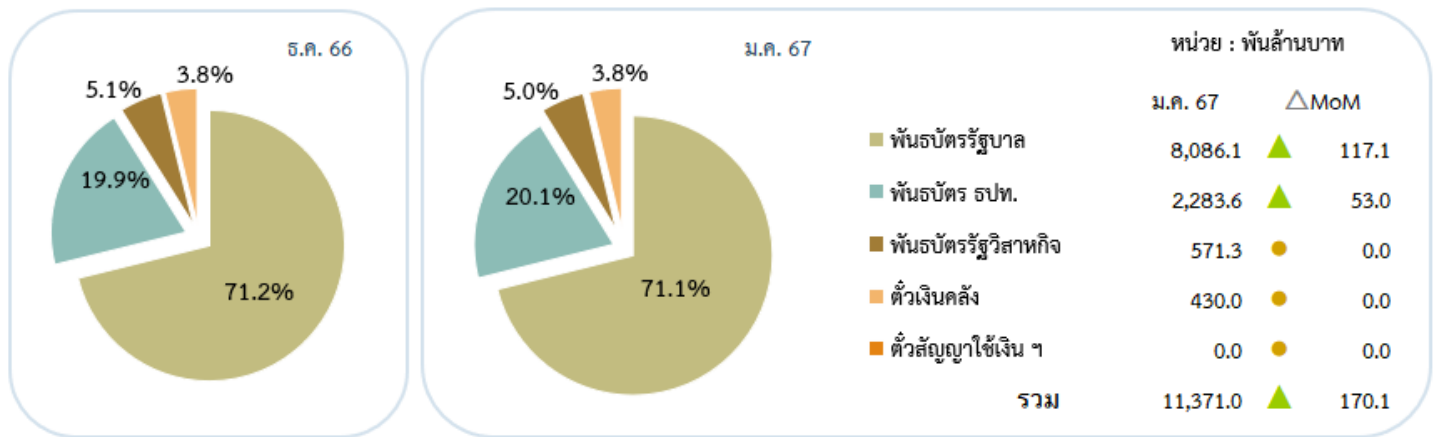


ยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐเพิ่มขึ้นจากเดือนก่อนหน้า ตามการเพิ่มขึ้นของพันธบัตรรัฐบาล และพันธบัตร ธพท. เป็นสำคัญ ส่วนอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุไม่เกิน 6 เดือน อยู่ที่ร้อยละ 2.18 – 2.45 เปลี่ยนแปลงจากเดือนก่อนหน้า -3 ถึง 16 bps สำหรับอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุเกิน 6 เดือนของพันธบัตร ธพท. อยู่ที่ร้อยละ 2.34 – 2.44 และพันธบัตรรัฐบาลอยู่ที่ร้อยละ 2.31 – 3.73

1. ยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐ

ณ สิ้นเดือนมกราคม 2567 ยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐ มีจำนวน 295 รุ่น โดยมีมูลค่า 11,371.0 พันล้านบาท เพิ่มขึ้น 170.1 พันล้านบาท ตามการเพิ่มขึ้นของพันธบัตรรัฐบาล และพันธบัตร ธพท. ที่เพิ่มขึ้น 117.1 และ 53.0 พันล้านบาท ตามลำดับ ซึ่งหากพิจารณาตามประเภทตราสารหนี้ พบว่า ยอดคงค้างพันธบัตรรัฐบาลยังคงมีสัดส่วนสูงสุดเช่นเดียวกับเดือนก่อนในสัดส่วนร้อยละ 71.1 รองลงมาเป็นพันธบัตร ธพท. ร้อยละ 20.1 พันธบัตรรัฐวิสาหกิจร้อยละ 5.0 และตั๋วเงินคลังร้อยละ 3.8

ยอดคงค้าง	ธ.ค. 66	ม.ค. 67	ΔMoM	% ΔMoM
จำนวนรุ่น	294	295	↑ 1	0.34%
วงเงิน (พันล้านบาท)	11,200.9	11,371.0	↑ 170.1	1.52%



2. การจำหน่ายตราสารหนี้ภาครัฐ

การจำหน่ายตราสารหนี้ภาครัฐที่ ธพท. เป็นนายทะเบียนมีจำนวน 18 รุ่น โดยจำหน่ายผ่านการประมูลทั้งหมด 17 รุ่น มูลค่ารวม 607.2 พันล้านบาท ทั้งนี้ รุ่นที่นักลงทุนให้ความสนใจมากที่สุด คือ พันธบัตร ธพท. อายุ 1 ปี Bid Coverage Ratio 3.66 นอกจากนี้ มีการจำหน่ายผ่านตัวแทน 1 รุ่น ได้แก่ พันธบัตรรองการค้าขนส่งมวลชนกรุงเทพ พ.ศ. 2567 ครั้งที่ 1 มูลค่า 1.3 พันล้านบาท

2.1 การประมูลตราสารหนี้ภาครัฐ (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

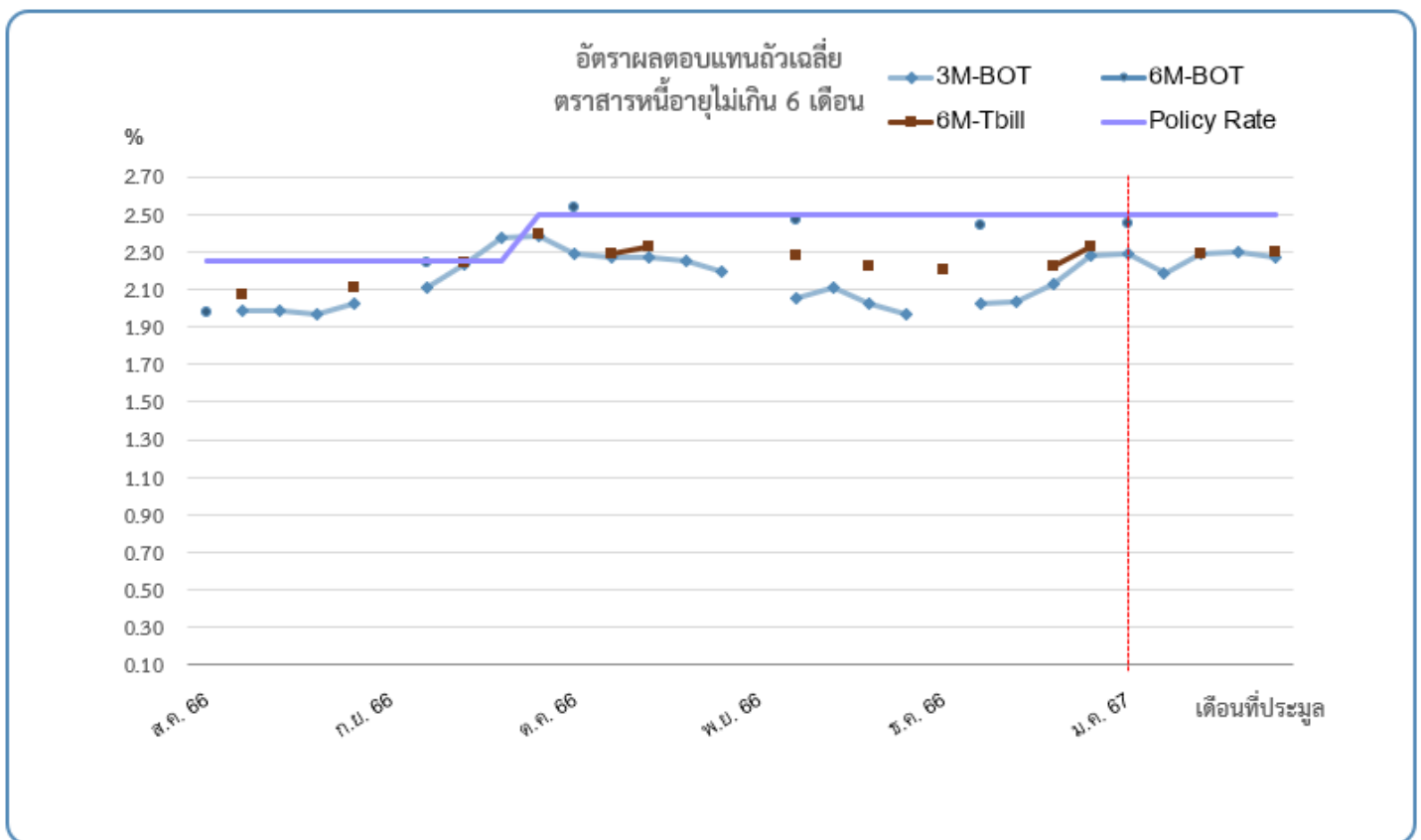
การประมูลตราสารหนี้ภาครัฐมีจำนวน 17 รุ่น วงเงินตามประกาศ 593.0 พันล้านบาท และได้รับการจัดสรรทั้งสิ้น 607.2 พันล้านบาท จำแนกเป็น

- พันธบัตร ธพท. 9 รุ่น วงเงินรวมตามประกาศ 410.0 พันล้านบาท โดยรุ่นอายุต่ำกว่า 1 ปี ประกอบด้วย รุ่นอายุ 3 เดือน จำนวน 5 รุ่น วงเงิน 300.0 พันล้านบาท ได้รับจัดสรรเต็มวงเงิน รุ่นอายุ 6 เดือน จำนวน 1 รุ่น วงเงิน 30.0 พันล้านบาท ได้รับจัดสรรเต็มวงเงิน ส่วนรุ่นอายุตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป จำนวน 3 รุ่น วงเงิน 80.0 พันล้านบาท มีการเปิดประมูลเพิ่มเติม 10.0 พันล้านบาท รวมวงเงินจัดสรร 90.0 พันล้านบาท ทำให้มีวงเงินจัดสรรรวมทั้งสิ้น 420.0 พันล้านบาท

- พันธบัตรรัฐบาล 6 รุ่น วงเงินรวมตามประกาศ 113.0 พันล้านบาท โดยเป็นพันธบัตรรุ่นอายุคงเหลือ 3.16 ปี 10.4 ปี 23.42 ปี 31.45 ปี และ 48.42 ปี วงเงิน 30.0 พันล้านบาท 28.0 พันล้านบาท 9.0 พันล้านบาท 8.0 พันล้านบาท และ 8.0 พันล้านบาท ตามลำดับ ได้รับการจัดสรรเต็มวงเงินทุกรุ่น และพันธบัตรรุ่นอายุคงเหลือ 5.18 ปี วงเงิน 30.0 พันล้านบาท ได้รับจัดสรรเพิ่มเติม (Greenshoe Option) 4.2 พันล้านบาท รวมเป็น 34.2 พันล้านบาท ทำให้มีวงเงินจัดสรรรวมทั้งสิ้น 117.2 พันล้านบาท

- ตั๋วเงินคลัง 2 รุ่น วงเงินรวมตามประกาศ 70.0 พันล้านบาท ได้รับการจัดสรรเต็มวงเงินทุกรุ่น
- พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ ไม่มีการประมูลในเดือนนี้
- ตั๋วสัญญาใช้เงินเพื่อการปรับโครงสร้างหนี้ ไม่มีการประมูลในเดือนนี้

อัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุไม่เกิน 6 เดือน อยู่ที่ร้อยละ 2.18 – 2.45 เปลี่ยนแปลงจากเดือนก่อนหน้า -3 ถึง 16 bps สำหรับอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุเกิน 6 เดือนของพันธบัตร รมท. อยู่ที่ร้อยละ 2.34 – 2.44 และพันธบัตรรัฐบาลอยู่ที่ร้อยละ 2.31 – 3.73



2.2 การจำหน่ายพันธบัตรออมทรัพย์

ไม่มีการจำหน่ายในเดือนนี้

2.3 การจำหน่ายพันธบัตรรัฐบาลผ่านตัวแทนจำหน่าย

ไม่มีการจำหน่ายในเดือนนี้

2.4 การจำหน่ายพันธบัตรรัฐวิสาหกิจผ่านตัวแทนจำหน่าย (เฉพาะที่ รมท. รับเป็นนายทะเบียน)

การจำหน่ายพันธบัตรรัฐวิสาหกิจมีจำนวน 1 รุ่น ได้แก่ พันธบัตรรองคําราชการขนส่งมวลชนกรุงเทพ พ.ศ. 2567 ครั้งที่ 1 ครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. 2577 อายุ 10 ปี อัตราดอกเบี้ยร้อยละ 2.799 มูลค่า 1.3 พันล้านบาท โดยจำหน่ายผ่านธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)

2.5 ธุรกรรมแลกเปลี่ยนพันธบัตร (Bond Switching)

ไม่มีการแลกเปลี่ยนพันธบัตรในเดือนนี้

3. ตราสารหนี้ที่ครบกำหนดไถ่ถอน

ตราสารหนี้ที่ครบกำหนดไถ่ถอนมีจำนวน 11 รุ่น มูลค่ารวม 418.4 พันล้านบาท ได้แก่ พันธบัตร ธปท. 7 รุ่น มูลค่า 307.1 พันล้านบาท ตั๋วเงินคลัง 3 รุ่น มูลค่า 110.0 พันล้านบาท และพันธบัตรรัฐวิสาหกิจ 1 รุ่น มูลค่า 1.3 พันล้านบาท

ตราสารหนี้ที่ครบกำหนดไถ่ถอน

ประเภทตราสารหนี้	จำนวนรุ่น	มูลค่า (พันล้านบาท)
พันธบัตร ธปท.	7	307.1
ตั๋วเงินคลัง	3	110.0
รัฐวิสาหกิจ	1	1.3
รวม	11	418.4

ภาคผนวก

1. ตารางสรุปยอดคงค้างตราสารหนี้ภาครัฐ เดือน ม.ค. 66 – ม.ค. 67

ประเภทตราสารหนี้	2566												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	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	7,930,329	8,000,329	7,968,956	8,086,121
พันธบัตร ธพท.	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	2,427,192	2,225,131	2,230,610	2,283,578
พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ	586,870	593,930	597,930	600,460	582,615	582,615	582,215	572,215	569,262	568,262	567,262	571,262	571,262
ตั๋วเงินคลัง	535,276	535,276	535,276	535,276	540,000	540,000	540,000	510,000	490,000	470,000	450,000	430,000	430,000
ตั๋วสัญญาใช้เงิน	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ยอดรวมจำนวนเงิน	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	11,395,782	11,242,721	11,200,828	11,370,961
ยอดรวมจำนวนรุ่น	305	305	303	303	304	303	304	302	297	296	296	294	295

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > ข้อมูลตราสารหนี้ > ตราสารหนี้คงค้าง จำหน่าย โฉดลอน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

2. ตารางสรุปการจำหน่ายตราสารหนี้ภาครัฐ เดือน ม.ค. 66 – ม.ค. 67 (ข้อมูลตามวันที่ชำระเงิน)

ประเภทตราสารหนี้	2566												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	104,340	80,400	114,374	114,120	129,002	87,880	80,596	92,000	112,000	104,974	90,000	100,000	117,165
พันธบัตร ธพท.	357,065	370,908	432,385	376,262	398,201	460,357	381,674	475,084	350,000	318,133	374,593	341,853	360,033
พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ	4,000	12,260	5,000	3,730	10,355	2,000	2,600	2,000	650	-	3,370	5,000	1,300
ตั๋วเงินคลัง	80,000	80,000	120,000	100,000	80,000	80,000	80,000	90,000	60,000	60,000	60,000	60,000	110,000
ตั๋วสัญญาใช้เงิน	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ยอดรวมจำนวนเงิน	545,405	543,568	671,759	594,112	617,558	630,237	544,870	659,084	522,650	483,107	527,963	506,853	588,498
ยอดรวมจำนวนรุ่น	16	20	18	18	26	18	17	21	16	17	20	17	18

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > ข้อมูลตราสารหนี้ > ตราสารหนี้คงค้าง จำหน่าย โฉดลอน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

3. ตารางสรุปอัตราผลตอบแทนถัวเฉลี่ยจากการประมูลตราสารหนี้อายุไม่เกิน 6 เดือน เดือน ธ.ค. 66 - ม.ค. 67

(ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

ประเภทตราสารหนี้	2566					2567					หน่วย : ร้อยละ
	1 ธ.ค.	4 - 8 ธ.ค.	12 - 15 ธ.ค.	18 - 22 ธ.ค.	25 - 28 ธ.ค.	3 - 5 ม.ค.	8 - 12 ม.ค.	15 - 19 ม.ค.	22 - 26 ม.ค.	29 - 31 ม.ค.	
ธพท. 3 เดือน		2.02219	2.03530	2.12747	2.27664	2.28514	2.18440	2.28592	2.29697	2.26806	
ธพท. 6 เดือน		2.44358				2.44881					
ตั๋วเงินคลัง 3 เดือน											
ตั๋วเงินคลัง 6 เดือน	2.20606			2.22284	2.32348			2.28969		2.29448	
อัตราดอกเบี้ยนโยบาย ^{1/}	2.50000	2.50000	2.50000	2.50000	2.50000	2.50000	2.50000	2.50000	2.50000	2.50000	

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

4. ตารางสรุปผลการประมูลพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย เดือน ม.ค. 67 (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

ช่วงอายุ	วันที่ประมูล	วันที่ชำระเงิน	รุ่น	อายุคงเหลือ	วงเงินประกาศ (ล้านบาท)	วงเงินจัดสรร (ล้านบาท)	อัตราต่ำสุด (%)	อัตราสูงสุด (%)	อัตราถัวเฉลี่ย (%)	เพิ่มขึ้น/ (ลดลง)จาก สัปดาห์ก่อน (bps)	BCR
3 เดือน	02 ม.ค. 2567	04 ม.ค. 2567	CB24404B	91 วัน	60,000	60,000	2.2350	2.3340	2.28514	1	1.65
	09 ม.ค. 2567	11 ม.ค. 2567	CB24411A	91 วัน	60,000	60,000	2.1700	2.2030	2.18440	(11)	1.44
	16 ม.ค. 2567	18 ม.ค. 2567	CB24418A	91 วัน	60,000	60,000	2.2000	2.3450	2.28592	11	1.53
	23 ม.ค. 2567	25 ม.ค. 2567	CB24425A	91 วัน	60,000	60,000	2.2700	2.3180	2.29697	1	1.79
	30 ม.ค. 2567	01 ก.พ. 2567	CB24502A	91 วัน	60,000	60,000	2.2300	2.2780	2.26806	(3)	1.91
		รวม		5 รุ่น	300,000	300,000					
6 เดือน	04 ม.ค. 2567	08 ม.ค. 2567	CBF24708A	182 วัน	30,000	30,000	2.44004	2.45504	2.44881	n.a.	3.03
		รวม		1 รุ่น	30,000	30,000					
มากกว่า 6 เดือน	02 ม.ค. 2567	04 ม.ค. 2567	CB25102A	364 วัน	35,000	41,675	2.3540	2.4500	2.41889	n.a.	2.93
	11 ม.ค. 2567	15 ม.ค. 2567	CBF25113A	364 วัน	25,000	26,180	2.4263	2.4543	2.44096	n.a.	3.66
	25 ม.ค. 2567	29 ม.ค. 2567	BOT25NA	1.77 ปี	20,000	22,178	2.305	2.355	2.3377	n.a.	3.64
		รวม		3 รุ่น	80,000	90,033					
		รวมทั้งหมด		9 รุ่น	410,000	420,033					

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

5. ตารางสรุปผลการประมูลพันธบัตรรัฐบาล เดือน ม.ค. 67 (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

วันที่ประมูล	วันที่ชำระเงิน	รุ่น	อายุคงเหลือ	อัตรา ดอกเบี้ย (ร้อยละต่อปี)	วงเงิน ประกาศ NCB+CB (ล้านบาท)	วงเงินจัดสรร NCB+CB (ล้านบาท)	Greenshoe Option (ล้านบาท)	Over AllotMent (ล้านบาท)	วงเงิน จัดสรรรวม (ล้านบาท)	อัตราต่ำสุด (%)	อัตรา สูงสุด (%)	อัตราถัวเฉลี่ย (%)	BCR
10 ม.ค. 2567	12 ม.ค. 2567	LB293A	5.18 ปี	2.40	30,000	30,000	4,165	-	34,165	2.394	2.414	2.4029	3.00
10 ม.ค. 2567	12 ม.ค. 2567	LB556A	31.45 ปี	4.00	8,000	8,000	-	-	8,000	3.488	3.535	3.5225	3.56
17 ม.ค. 2567	19 ม.ค. 2567	LB273A	3.16 ปี	2.25	30,000	30,000	-	-	30,000	2.299	2.317	2.3122	2.17
17 ม.ค. 2567	19 ม.ค. 2567	LBA476A	23.42 ปี	3.14	9,000	9,000	-	-	9,000	3.334	3.378	3.3540	2.42
24 ม.ค. 2567	26 ม.ค. 2567	LB346A	10.4 ปี	2.80	28,000	28,000	-	-	28,000	2.696	2.714	2.7037	2.93
24 ม.ค. 2567	26 ม.ค. 2567	LB726A	48.42 ปี	4.00	8,000	8,000	-	-	8,000	3.708	3.745	3.7317	2.70
		รวม	6 รุ่น		113,000	113,000	4,165	-	117,165				

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

6. ตารางสรุปผลการประมูลตั๋วเงินคลัง เดือน ม.ค. 67 (ข้อมูลตามวันที่ประมูล)

วันที่ประมูล	วันที่ชำระเงิน	รุ่น	อายุ คงเหลือ	วงเงิน ประกาศ (ล้านบาท)	วงเงินจัดสรร (ล้านบาท)	อัตราต่ำสุด (%)	อัตรา สูงสุด (%)	อัตราถัวเฉลี่ย (%)	BCR
15 ม.ค. 2567	17 ม.ค. 2567	TB24717A	182 วัน	40,000	40,000	2.2600	2.3030	2.28969	2.02
29 ม.ค. 2567	31 ม.ค. 2567	TB24731A	182 วัน	30,000	30,000	2.2750	2.3120	2.29448	3.65
		รวม	2 รุ่น	70,000	70,000				

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > การประมูลตราสารหนี้ > ผลการประมูล

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2567

7. ตารางสรุปการจำหน่ายพันธบัตรรัฐวิสาหกิจผ่านตัวแทน เดือน ม.ค. 67 (เฉพาะที่ ระบุรับเป็นนายทะเบียน)

วันที่ชำระเงิน	ชื่อตราสารหนี้	อายุ	อัตราดอกเบี้ย (%)	วงเงิน (ล้านบาท)
24 ม.ค. 2567	พันธบัตรรองค้ำประกันขนส่งมวลชนกรุงเทพ พ.ศ. 2567 ครั้งที่ 1	10 ปี	2.799	1,300
	รวม	1 รุ่น		1,300

ที่มา : BOT Website หัวข้อพันธบัตรและตราสารหนี้ > ข้อมูลตราสารหนี้ > ตราสารหนี้ค้ำประกันจำหน่าย ใต้ถอน

ข้อมูล ณ วันที่ 31 มกราคม 2567