

รายงานการเงินรวม

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2564

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

งบแสดงฐานะการเงินรวม

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2564

หน่วย : บาท

สินทรัพย์	2564	2563
	เงินสดและเงินฝาก	1,076,107,071,059
เงินสด	2,597,578	3,562,570
เงินฝากในประเทศ	670,410,079	750,244,401
เงินฝากต่างประเทศ	1,075,434,063,402	1,013,573,214,680
ทองคำ	479,145,697,011	281,673,676,601
สิทธิซื้อส่วนสำรองและสิทธิพิเศษถอนเงิน	231,477,480,510	80,887,520,182
เงินลงทุนในหลักทรัพย์	7,022,771,635,571	6,814,868,237,996
หลักทรัพย์ในประเทศ	438,446,699,184	425,990,591,181
หลักทรัพย์ต่างประเทศ	6,584,324,936,387	6,388,877,646,815
เงินให้กู้ยืม	283,280,775,819	118,759,624,055
เงินให้กู้ยืมแก่สถาบันการเงิน	282,903,182,601	118,127,178,907
เงินให้กู้ยืมตามภาระผูกพันกับกองทุนการเงินระหว่างประเทศ	377,593,218	632,445,148
สินค้าคงเหลือ	2,276,869,582	2,344,521,288
ที่ดิน อาคารและอุปกรณ์	8,934,923,936	9,354,619,921
ที่ดิน	3,412,066,482	3,412,066,482
อาคารและสิ่งปลูกสร้างสุทธิ	2,876,956,757	3,070,452,046
อุปกรณ์สุทธิ	2,491,346,977	2,663,005,478
สินทรัพย์ระหว่างทำ	154,553,720	209,095,915
สินทรัพย์อื่น	555,527,908,246	478,202,540,984
สินทรัพย์ตราสารอนุพันธ์	31,159,351,557	20,474,699,140
สินทรัพย์ไม่มีตัวตนสุทธิ	467,217,759	434,666,030
สินทรัพย์อื่น	523,901,338,930	457,293,175,814
<b>รวมสินทรัพย์</b>	<b>9,659,522,361,734</b>	<b>8,800,417,762,678</b>

## กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

งบแสดงฐานะการเงินรวม (ต่อ)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2564

	หน่วย : บาท	
	2564	2563
<b>หนี้สินและส่วนของผู้ถือหุ้น</b>		
เงินรับฝาก	541,403,178,418	692,567,965,172
เงินรับฝากจากรัฐบาล	352,463,344,510	499,360,446,825
เงินรับฝากจากสถาบันการเงิน	180,708,681,603	157,597,436,675
เงินรับฝากแบบมีดอกเบีย	-	28,600,000,000
เงินรับฝากอื่น	8,231,152,305	7,010,081,672
ธนบัตรออกใช้	2,319,377,368,660	2,094,451,984,850
สิทธิพิเศษถอนเงินที่ได้รับจัดสรร	189,487,758,211	42,038,542,806
หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาซื้อคืน	597,263,000,000	648,996,780,242
ตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย	4,756,469,675,685	5,216,468,486,098
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	2,865,969,675,685	3,342,568,486,098
ตราสารหนี้อื่น	1,890,500,000,000	1,873,900,000,000
เจ้าหนี้การค้า	41,737,934	20,588,462
หนี้สินอื่น	753,762,061,595	432,273,256,318
หนี้สินตราสารอนุพันธ์	24,276,882,078	18,569,757,118
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	3,861,182,835	5,891,552,783
หนี้สินอื่น	725,623,996,682	407,811,946,417
<b>รวมหนี้สิน</b>	<b>9,157,804,780,503</b>	<b>9,126,817,603,948</b>

## กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

งบแสดงฐานะการเงินรวม (ต่อ)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2564

	หน่วย : บาท	
	2564	2563
<b>หนี้สินและส่วนของทุน (ต่อ)</b>		
<b>ส่วนของทุน</b>		
ทุนประเดิม	9,958,461,543	9,958,461,543
เงินจัดสรรตามกฎหมาย	27,307,931,128	27,307,931,128
เงินสำรองเพื่อรักษาระดับกำไรนำส่งรัฐ	624,075,747	624,075,747
เงินสำรองทั่วไป	993,846,154	993,846,154
เงินสำรองอันเกิดจากการตีราคาสินทรัพย์และหนี้สิน	371,973,777,870	(136,977,579,442)
สำรองพิเศษ	837,907,171,449	644,601,583,761
ขาดทุนสะสม	(747,047,682,660)	(872,908,160,161)
<b>รวมส่วนของทุน</b>	<b>501,717,581,231</b>	<b>(326,399,841,270)</b>
<b>รวมหนี้สินและส่วนของทุน</b>	<b>9,659,522,361,734</b>	<b>8,800,417,762,678</b>

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย  
งบกำไรขาดทุนรวม  
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2564

	หน่วย : บาท	
	2564	2563
<b>รายได้</b>		
ดอกเบียรับ	96,871,828,804	112,308,289,394
กำไรจากการจำหน่ายเงินลงทุนสุทธิ	-	122,602,071,028
ค่าธรรมเนียม	553,104,849	492,133,533
กำไรจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศสุทธิ	286,130,871,221	88,310,262,891
รายได้อื่น	17,341,818,640	8,715,034,932
<b>รวมรายได้</b>	<b>400,897,623,514</b>	<b>332,427,791,778</b>
<b>ค่าใช้จ่าย</b>		
ดอกเบียจ่าย	35,512,381,458	55,312,430,830
ขาดทุนจากการจำหน่ายเงินลงทุนสุทธิ	7,122,930,847	-
ขาดทุนจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศสุทธิ	-	64,027,697,861
ต้นทุนขาย	1,946,767,506	2,026,423,585
ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับพนักงาน	6,069,940,460	6,362,150,931
ค่าใช้จ่ายอื่น	4,459,194,093	3,892,381,137
ค่าธรรมเนียมจ่าย	492,732,354	446,985,303
ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับกรรมการ	36,514,208	39,381,306
ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับอาคารสถานที่และอุปกรณ์	1,076,010,871	1,305,662,239
ค่าใช้จ่ายอื่น	2,853,936,660	2,100,352,289
<b>รวมค่าใช้จ่าย</b>	<b>55,111,214,364</b>	<b>131,621,084,344</b>
<b>กำไรสุทธิ</b>	<b>345,786,409,150</b>	<b>200,806,707,434</b>

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย  
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จรวม  
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2564

	2564	หน่วย : บาท 2563
กำไรสุทธิ	345,786,409,150	200,806,707,434
กำไรเบ็ดเสร็จอื่น		
รายการที่จัดประเภทรายการใหม่เข้าไปไว้ใน		
กำไรหรือขาดทุนในภายหลัง		
ส่วนเปลี่ยนแปลงในบัญชีเงินสำรองอันเกิดจาก		
การตีราคาสินทรัพย์และหนี้สิน	508,522,551,992	290,617,507,541
รายการที่ไม่จัดประเภทรายการใหม่เข้าไปไว้ใน		
กำไรหรือขาดทุนในภายหลัง		
ส่วนเปลี่ยนแปลงในบัญชีเงินสำรองอันเกิดจาก		
การตีราคาสินทรัพย์และหนี้สิน	428,805,320	2,265,384,181
กำไร (ขาดทุน) จากการประมาณการตาม		
หลักคณิตศาสตร์ประกันภัย	54,321,939	(5,461,274,673)
รวมกำไรเบ็ดเสร็จอื่นสุทธิ	509,005,679,251	287,421,617,049
กำไรเบ็ดเสร็จรวม	854,792,088,401	488,228,324,483

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

**กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย**  
**หมายเหตุประกอบงบการเงิน**  
**สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2564**

**ภาระผูกพัน**

ธปท. มีภาระผูกพัน ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2564 ดังนี้

**1. สัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า (Forward Contracts)**

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า เทียบเท่า 49,573 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2565

**2. สัญญาสวอปเงินตราต่างประเทศ (Foreign Exchange Swap Contracts)**

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาสวอปเงินตราต่างประเทศ เทียบเท่า 28,355 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2565

**3. สัญญาสิทธิที่จะซื้อหรือขายสินทรัพย์ทางการเงิน (Option Contracts)**

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาสิทธิที่จะซื้อหรือขายสินทรัพย์ทางการเงิน เทียบเท่า 8,431 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2565

**4. สัญญาซื้อขายในอนาคต (Futures Contracts)**

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาซื้อขายหลักทรัพย์หรือดัชนีราคาหลักทรัพย์ในอนาคตและสัญญาซื้อขายในอนาคตอื่นๆ เทียบเท่า 5,227 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2565 - 2566

**5. สัญญาซื้อขายล่วงหน้าของตราสารที่มีสินเชื่อนหนุนหลัง ที่จะประกาศสินเชื่อนหนุนหลังในภายหลัง (Mortgage-backed Securities To-be-announced)**

จำนวนเงินตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของตราสารที่มีสินเชื่อนหนุนหลัง ที่จะประกาศสินเชื่อนหนุนหลังในภายหลัง เทียบเท่า 361 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2565

**6. การยืมตราสารหนี้ (Securities Borrowing Facility)**

ธปท. มีภาระผูกพันที่จะต้องส่งคืนตราสารหนี้ที่ยืมและภาระจากการออกตราสารหนี้ ธปท. เพื่อเป็นหลักประกัน จำนวน 161,087 ล้านบาท ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2565 - 2582 ทั้งนี้ มูลค่ายุติธรรมของหลักทรัพย์ยืมที่นำไปทำธุรกรรมขายโดยมีสัญญาซื้อคืน ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2564 มีจำนวน 155,897 ล้านบาท