

รายงานการเงินรวม

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2565

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

งบแสดงฐานะการเงินรวม

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565

	หน่วย : บาท	
	2565	2564
สินทรัพย์		
เงินสดและเงินฝาก	1,159,089,594,027	1,076,107,071,059
เงินสด	2,277,677	2,597,578
เงินฝากในประเทศ	284,746,802	670,410,079
เงินฝากต่างประเทศ	1,158,802,569,548	1,075,434,063,402
ทองคำ	494,783,402,839	479,145,697,011
สิทธิซื้อส่วนสำรองและสิทธิพิเศษถอนเงิน	232,248,118,925	231,477,480,510
เงินลงทุนในหลักทรัพย์	6,028,677,842,206	7,022,771,635,571
หลักทรัพย์ในประเทศ	442,426,532,109	438,446,699,184
หลักทรัพย์ต่างประเทศ	5,586,251,310,097	6,584,324,936,387
เงินให้กู้ยืม	260,412,233,675	283,280,775,819
เงินให้กู้ยืมแก่สถาบันการเงิน	260,260,105,114	282,903,182,601
เงินให้กู้ยืมตามภาระผูกพันกับกองทุนการเงินระหว่างประเทศ	152,128,561	377,593,218
สินค้าคงเหลือ	2,141,026,282	2,276,869,582
ที่ดิน อาคารและอุปกรณ์	8,249,167,030	8,867,612,811
ที่ดิน	3,412,066,483	3,412,066,482
อาคารและสิ่งปลูกสร้างสุทธิ	2,465,019,233	2,876,956,757
อุปกรณ์สุทธิ	2,263,008,950	2,491,346,977
สินทรัพย์ระหว่างทำ	109,072,364	87,242,595
สินทรัพย์อื่น	403,650,359,354	555,595,219,371
สินทรัพย์ตราสารอนุพันธ์	43,590,394,805	31,159,351,557
สินทรัพย์ไม่มีตัวตนสุทธิ	526,102,978	534,528,884
สินทรัพย์อื่น	359,533,861,571	523,901,338,930
รวมสินทรัพย์	8,589,251,744,338	9,659,522,361,734

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

งบแสดงฐานะการเงินรวม (ต่อ)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565

	หน่วย : บาท	
	2565	2564
หนี้สินและส่วนของผู้ถือหุ้น		
เงินรับฝาก	526,625,963,359	540,826,025,262
เงินรับฝากจากรัฐบาล	364,957,431,751	351,904,453,392
เงินรับฝากจากสถาบันการเงิน	140,930,933,506	180,708,681,603
เงินรับฝากแบบมีดอกเบีย	16,500,000,000	-
เงินรับฝากอื่น	4,237,598,102	8,212,890,267
ธนบัตรออกใช้	2,323,500,455,590	2,319,377,368,660
สิทธิพิเศษถอนเงินที่ได้รับจัดสรร	187,139,612,123	189,487,758,211
หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาซื้อคืน	581,605,000,000	597,263,000,000
ตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย	4,324,249,213,252	4,756,469,675,685
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	2,379,949,213,252	2,865,969,675,685
ตราสารหนี้อื่น	1,944,300,000,000	1,890,500,000,000
หนี้สินอื่น	456,384,220,424	754,380,952,685
หนี้สินตราสารอนุพันธ์	63,191,762,353	24,276,882,078
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	5,501,095,777	3,861,182,835
หนี้สินอื่น	387,691,362,294	726,242,887,772
รวมหนี้สิน	8,399,504,464,748	9,157,804,780,503

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

งบแสดงฐานะการเงินรวม (ต่อ)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565

	หน่วย : บาท	
	2565	2564
หนี้สินและส่วนของทุน (ต่อ)		
ส่วนของทุน		
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	42,750,753,219	371,973,777,870
สำรองพิเศษ	1,048,377,081,166	837,907,171,449
ขาดทุนสะสม	(940,264,869,367)	(747,047,682,660)
รวมส่วนของทุน	189,747,279,590	501,717,581,231
รวมหนี้สินและส่วนของทุน	8,589,251,744,338	9,659,522,361,734

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย
งบกำไรขาดทุนรวม
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2565

	หน่วย : บาท	
	2565	2564
รายได้		
ดอกเบี๋ยรับ	127,058,340,601	96,871,828,804
กำไรจากการจำหน่ายเงินลงทุนสุทธิ	-	4,187,572,144
ค่าธรรมเนียม	539,746,359	553,104,849
กำไรจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศสุทธิ	68,268,553,524	286,174,792,526
รายได้อื่น	13,183,499,509	17,297,897,335
รวมรายได้	209,050,139,993	405,085,195,658
ค่าใช้จ่าย		
ดอกเบี๋ยจ่าย	37,687,696,847	35,512,381,458
ขาดทุนจากการจำหน่ายเงินลงทุนสุทธิ	140,667,209,275	-
ต้นทุนขาย	1,983,129,405	1,945,898,530
ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับพนักงาน	6,073,994,797	6,069,940,460
ค่าใช้จ่ายอื่น	5,454,034,249	15,770,566,060
ค่าธรรมเนียมจ่าย	746,198,402	492,732,354
ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับกรรมการ	35,619,809	36,514,208
ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับอาคารสถานที่และอุปกรณ์	1,280,253,474	1,076,010,871
ค่าใช้จ่ายอื่น	3,391,962,564	14,165,308,627
รวมค่าใช้จ่าย	191,866,064,573	59,298,786,508
กำไรสุทธิ	17,184,075,420	345,786,409,150

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จรวม
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2565

	หน่วย : บาท	
	2565	2564
กำไรสุทธิ	17,184,075,420	345,786,409,150
กำไรเบ็ดเสร็จอื่น		
รายการที่จัดประเภทรายการใหม่เข้าไปไว้ใน		
กำไรหรือขาดทุนในภายหลัง		
ส่วนเปลี่ยนแปลงในบัญชีเงินสำรองอันเกิดจาก		
การตีราคาสินทรัพย์และหนี้สิน	(329,318,078,131)	508,522,551,992
รายการที่ไม่จัดประเภทรายการใหม่เข้าไปไว้ใน		
กำไรหรือขาดทุนในภายหลัง		
ส่วนเปลี่ยนแปลงในบัญชีเงินสำรองอันเกิดจาก		
การตีราคาสินทรัพย์และหนี้สิน	95,053,480	428,805,320
กำไรจากการประมาณการตาม		
หลักคณิตศาสตร์ประกันภัย	2,249,753	54,321,939
รวมกำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่นสุทธิ	<u>(329,220,774,898)</u>	<u>509,005,679,251</u>
กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม	<u><u>(312,036,699,478)</u></u>	<u><u>854,792,088,401</u></u>

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย
หมายเหตุประกอบงบการเงิน
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2565

จำนวนเงินตามสัญญาของอนุพันธ์และภาระผูกพัน

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565 มีดังนี้

1. สัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า (Forward Contracts)

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า เทียบเท่า 44,023 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2566

2. สัญญาสวอปเงินตราต่างประเทศ (Foreign Exchange Swap Contracts)

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาสวอปเงินตราต่างประเทศ เทียบเท่า 34,923 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2566

3. สัญญาแลกเปลี่ยนอัตราดอกเบี้ย (Interest Rate Swap Contracts)

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาแลกเปลี่ยนอัตราดอกเบี้ย เทียบเท่า 357 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2566 – 2575

4. สัญญาสิทธิที่จะซื้อหรือขายสินทรัพย์ทางการเงิน (Options Contracts)

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาสิทธิที่จะซื้อหรือขายสินทรัพย์ทางการเงิน เทียบเท่า 8,834 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2566

5. สัญญาซื้อขายในอนาคต (Futures Contracts)

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาซื้อขายหลักทรัพย์หรือดัชนีราคาหลักทรัพย์ในอนาคตและสัญญาซื้อขายในอนาคตอื่นๆ เทียบเท่า 5,116 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2566

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

จำนวนเงินตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของตราสารที่มีสินเชื่อนหนุนหลัง ที่จะประกาศสินเชื่อนหนุนหลังในภายหลัง เทียบเท่า 298 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2566

7. การยืมตราสารหนี้ (Securities Borrowing Facility)

ภาระผูกพันที่จะต้องส่งคืนตราสารหนี้ที่ยืมและภาระจากการออกตราสารหนี้ ธปท. เพื่อเป็นหลักประกัน มีจำนวน 151,566 ล้านบาท ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2566 – 2582 โดยมีมูลค่ายุติธรรมของหลักทรัพย์ยืมที่นำไปทำธุรกรรมขายโดยมีสัญญาซื้อคืน จำนวน 141,156 ล้านบาท