

รายงานการเงินรวม

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2566

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

งบแสดงฐานะการเงินรวม

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2566

หน่วย : บาท

	2566	2565
<b>สินทรัพย์</b>		
เงินสดและเงินฝาก	878,827,548,404	1,159,089,594,027
เงินสด	1,746,578	2,277,677
เงินฝากในประเทศ	98,170,578	284,746,802
เงินฝากต่างประเทศ	878,727,631,248	1,158,802,569,548
ทองคำ	553,780,512,692	494,783,402,839
สิทธิซื้อส่วนสำรองและสิทธิพิเศษถอนเงิน	230,298,003,075	232,248,118,925
เงินลงทุนในหลักทรัพย์	6,464,942,560,263	6,028,677,842,206
หลักทรัพย์ในประเทศ	439,567,894,329	442,426,532,109
หลักทรัพย์ต่างประเทศ	6,025,374,665,934	5,586,251,310,097
เงินให้กู้ยืม	305,716,855,171	260,412,233,675
เงินให้กู้ยืมแก่สถาบันการเงิน	305,686,463,784	260,260,105,114
เงินให้กู้ยืมตามภาระผูกพันกับกองทุนการเงินระหว่างประเทศ	30,391,387	152,128,561
สินค้ำคงเหลือ	2,429,507,255	2,141,026,282
ที่ดิน อาคารและอุปกรณ์	7,851,659,948	8,249,167,030
ที่ดิน	3,412,066,482	3,412,066,482
อาคารและสิ่งปลูกสร้างสุทธิ	2,121,469,490	2,465,019,233
อุปกรณ์สุทธิ	2,114,936,103	2,263,008,951
สินทรัพย์ระหว่างทำ	203,187,873	109,072,364
สินทรัพย์อื่น	460,045,608,544	403,650,359,354
สินทรัพย์ตราสารอนุพันธ์	26,142,656,197	43,590,394,805
สินทรัพย์ไม่มีตัวตนสุทธิ	451,537,955	526,102,978
สินทรัพย์อื่น	433,451,414,392	359,533,861,571
<b>รวมสินทรัพย์</b>	<b>8,903,892,255,352</b>	<b>8,589,251,744,338</b>

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

## กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

งบแสดงฐานะการเงินรวม (ต่อ)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2566

	หน่วย : บาท	
	2566	2565
<b>หนี้สินและส่วนของผู้ถือหุ้น</b>		
เงินรับฝาก	355,666,747,919	526,625,963,359
เงินรับฝากจากรัฐบาล	209,821,623,080	364,957,431,751
เงินรับฝากจากสถาบันการเงิน	130,866,372,990	140,930,933,506
เงินรับฝากแบบมีดอกเบี้ย	11,010,000,000	16,500,000,000
เงินรับฝากอื่น	3,968,751,849	4,237,598,102
ธนาบัตรออกใช้หมุนเวียน	2,422,420,056,975	2,323,500,455,590
สิทธิพิเศษถอนเงินที่ได้รับจัดสรร	186,075,698,290	187,139,612,123
หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาซื้อคืน	547,107,000,000	581,605,000,000
ตราสารหนี้ธนาคารแห่งประเทศไทย	4,429,646,105,753	4,324,249,213,252
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	2,224,946,105,753	2,379,949,213,252
ตราสารหนี้อื่น	2,204,700,000,000	1,944,300,000,000
หนี้สินอื่น	496,504,757,803	456,384,220,424
หนี้สินตราสารอนุพันธ์	37,710,122,545	63,191,762,353
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	11,697,586,050	5,501,095,777
หนี้สินอื่น	447,097,049,208	387,691,362,294
<b>รวมหนี้สิน</b>	<b>8,437,420,366,740</b>	<b>8,399,504,464,748</b>

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย

งบแสดงฐานะการเงินรวม (ต่อ)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2566

	หน่วย : บาท	
	2566	2565
<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	109,896,991,767	42,750,753,219
สำรองพิเศษ	874,696,010,893	1,048,377,081,166
ขาดทุนสะสม	(557,005,428,620)	(940,264,869,367)
<b>รวมส่วนของทุน</b>	<b>466,471,888,612</b>	<b>189,747,279,590</b>
<b>รวมหนี้สินและส่วนของทุน</b>	<b>8,903,892,255,352</b>	<b>8,589,251,744,338</b>

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย  
งบกำไรขาดทุนรวม  
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2566

	หน่วย : บาท	
	2566	2565
<b>รายได้</b>		
ดอกเบี้ยรับ	219,247,449,675	127,058,340,601
กำไรจากเงินลงทุนสุทธิ	39,544,662,351	-
ค่าธรรมเนียม	531,446,755	539,746,359
กำไรจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศสุทธิ	8,864,879,089	68,268,553,524
รายได้อื่น	54,309,848,111	13,183,499,509
<b>รวมรายได้</b>	<b>322,498,285,981</b>	<b>209,050,139,993</b>
<b>ค่าใช้จ่าย</b>		
ดอกเบี้ยจ่าย	100,420,527,950	37,687,696,847
ขาดทุนจากเงินลงทุนสุทธิ	-	140,667,209,275
ต้นทุนขาย	1,908,900,570	1,983,129,405
ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับพนักงาน	6,171,762,694	6,073,994,797
ค่าใช้จ่ายอื่น	4,619,856,419	5,454,034,249
ค่าธรรมเนียมจ่าย	687,497,287	746,198,402
ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับกรรมการ	34,485,552	35,619,809
ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับอาคารสถานที่และอุปกรณ์	1,240,942,447	1,280,253,474
ค่าใช้จ่ายอื่น	2,656,931,133	3,391,962,564
<b>รวมค่าใช้จ่าย</b>	<b>113,121,047,633</b>	<b>191,866,064,573</b>
<b>กำไรสุทธิ</b>	<b>209,377,238,348</b>	<b>17,184,075,420</b>

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย  
งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จรวม  
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2566

	2566	หน่วย : บาท 2565
กำไรสุทธิ	209,377,238,348	17,184,075,420
กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น		
รายการที่จัดประเภทรายการใหม่เข้าไปไว้ใน		
กำไรหรือขาดทุนในภายหลัง		
ส่วนเปลี่ยนแปลงในบัญชีเงินสำรองอันเกิดจาก		
การตีราคาสินทรัพย์และหนี้สิน	67,134,324,488	(329,318,078,131)
รายการที่ไม่จัดประเภทรายการใหม่เข้าไปไว้ใน		
กำไรหรือขาดทุนในภายหลัง		
ส่วนเปลี่ยนแปลงในบัญชีเงินสำรองอันเกิดจาก		
การตีราคาสินทรัพย์และหนี้สิน	11,914,060	95,053,480
กำไรจากการประมาณการตาม		
หลักคณิตศาสตร์ประกันภัย	169,123,232	2,249,753
รวมกำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่นสุทธิ	67,315,361,780	(329,220,774,898)
กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม	276,692,600,128	(312,036,699,478)

หมายเหตุประกอบงบการเงินเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

**กลุ่มกิจการธนาคารแห่งประเทศไทย**  
**หมายเหตุประกอบงบการเงิน**  
**สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2566**

**จำนวนเงินตามสัญญาของอนุพันธ์และภาระผูกพัน**

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2566 มีดังนี้

**1. สัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า (Forward Contracts)**

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาซื้อขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า เทียบเท่า 34,554 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2567

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

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาสวอปเงินตราต่างประเทศ เทียบเท่า 36,409 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2567

**3. สัญญาแลกเปลี่ยนอัตราดอกเบี้ย (Interest Rate Swap Contracts)**

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาแลกเปลี่ยนอัตราดอกเบี้ย เทียบเท่า 2,304 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2567 – 2576

**4. สัญญาสิทธิที่จะซื้อหรือขายสินทรัพย์ทางการเงิน (Options Contracts)**

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาสิทธิที่จะซื้อหรือขายสินทรัพย์ทางการเงิน เทียบเท่า 16,339 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2567

**5. สัญญาซื้อขายในอนาคต (Futures Contracts)**

จำนวนเงินตามสัญญาของสัญญาซื้อขายหลักทรัพย์หรือดัชนีราคาหลักทรัพย์ในอนาคตและสัญญาซื้อขายในอนาคตอื่น ๆ เทียบเท่า 6,769 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2567

**6. สัญญาซื้อขายล่วงหน้าของตราสารที่มีสินเชื่อบนหลัง ที่จะประกาศสินเชื่อบนหลังในภายหลัง (Mortgage-backed Securities To-be-announced)**

จำนวนเงินตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของตราสารที่มีสินเชื่อบนหลัง ที่จะประกาศสินเชื่อบนหลังในภายหลัง เทียบเท่า 1,095 ล้านดอลลาร์ สรอ. ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2567

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

ภาระผูกพันที่จะต้องส่งคืนตราสารหนี้ที่ยืมและภาระจากการออกตราสารหนี้ ธปท. เพื่อเป็นหลักประกันจำนวน 159,169 ล้านบาท ซึ่งจะครบกำหนดในปี 2567 - 2582 ทั้งนี้ หลักทรัพย์ที่ยืมและนำไปทำธุรกรรมขายโดยมีสัญญาซื้อคืนมีมูลค่ายุติธรรม จำนวน 143,618 ล้านบาท