

HighLights

- ในวันที่ 23 มีนาคม พ.ศ. 2566 ธนาคารกลางสหรัฐ (FED) มีมติเป็นเอกฉันท์ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยระยะสั้นร้อยละ 0.25 ผู้ระดับร้อยละ 4.75-5 ซึ่งเป็นระดับสูงสุดนับตั้งแต่เดือนตุลาคม พ.ศ. 2550 และเป็นการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยเป็นครั้งที่ 9 ติดต่อกันนับตั้งแต่ที่เฟดเริ่มวัฏจักรปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยในเดือนมีนาคม พ.ศ. 2565
- ในวันที่ 23 มีนาคม พ.ศ. 2566 ธนาคารกลางอังกฤษ (BoE) มีมติประกาศปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยร้อยละ 0.25 ผู้ระดับร้อยละ 4.25 ซึ่งเป็นระดับสูงสุดนับตั้งแต่ปี พ.ศ. 2551 ทั้งนี้ BoE ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยเป็นครั้งที่ 11 ติดต่อกันหลังจากเงินเฟ้อติดตัวขึ้นสู่ระดับ 10.4% ในเดือนกุมภาพันธ์ พ.ศ. 2566
- ในวันที่ 23 มีนาคม พ.ศ. 2566 ธนาคารกลางสวีเดน (SNB) ประกาศขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายร้อยละ 0.5 ผู้ระดับร้อยละ 1.5 โดยเป็นการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยติดต่อกันครั้งที่ 4 ในขณะที่อัตราเงินเฟ้อภายในประเทศยังคงเคลื่อนไหวเหนือกรอบเป้าหมายของ SNB ที่ระดับร้อยละ 0 - 2
- ในวันที่ 23 มีนาคม พ.ศ. 2566 ธนาคารกลางฮ่องกง (HKMA) ประกาศขึ้นอัตราดอกเบี้ยนโยบายร้อยละ 0.25 เป็นร้อยละ 5.25 ไม่มีข้อโต้แย้งจากธนาคารกลางสหรัฐ (FED) ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยในระดับเดียวกันเนื่องจากสกุลเงินดอลลาร์ฮ่องกงผูกติดกับสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐในกรอบแคบ ๆ ที่ 7.75-7.85 ดอลลาร์ฮ่องกง/ดอลลาร์สหรัฐ

March 27, 2023

Public

Macroeconomics Data

Inflation Rate		
Inflation Rate	YoY(%)	MoM(%)
Core Inflation	1.93	0.11
Headline Inflation	3.79	-0.12
Forecast	2.0-3.0	

Source: MOC As of Mar 2023

Policy Rate

American Interest Rate (Fed)	5.00%
British Interest Rate (BoE)	4.25%
European Interest Rate (ECB)	3.50%
Japanese Interest Rate (BoJ)	-0.10%

GDP Growth

	YoY(%)
2017	2.40
2018	-6.20
2019	1.50

Source: NESDB

Exchange Rate

Currency	Avg. Selling Rate (THB)	YTD
USD	34.46	14.49%
GBP	42.38	2.37%
EUR	37.24	0.53%
JPY	26.56	-9.83%
CNY	5.05	7.34%

Source : BOT As of Mar 27th, 2023

Thai Policy Interest Rate

1.50%

Next Meeting: 29 Mar 2023

GDP Forecast

	2019	2020
BOT	3.2	3.7
NESDB	2.6	2.7-3.7
FPO	3.0	3.8

Last Update: Mar 2023

INT'L RESERVE THAI (b USD)

244.63

Source : BOT As of Feb 2023

EQUITIES

Name	Index	Change(Wk)
SET	1,593.37	37.92
NIKKEI	27,485.00	539.33
DJIA	32,432.08	187.44
S&P500	3,977.53	25.96
DAX	15,127.68	194.30
HSI	19,652.00	452.50
FTSE100	7,471.00	67.15

OIL (USD/Barrel)

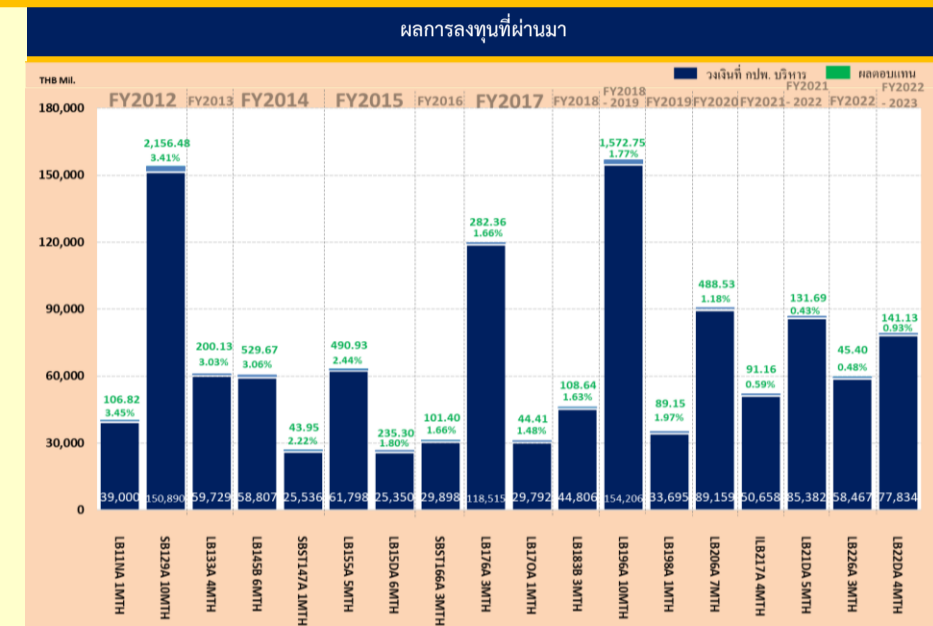
BRENT	77.49	3.68
WTI	72.78	5.14

PRECIOUS METALS (USD)

GOLD	1,979.45	-1.25
SILVER	23.25	0.61

Source : Bloomberg As of Mar 27th, 2023

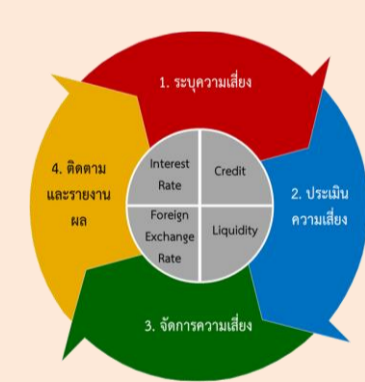
Investment Performance



สัดส่วนการลงทุนของเงิน Pre-funding พันธบัตรรัฐบาลรุ่น LB233A และ LB236A

วันที่เงินเข้า	ระยะเวลา	วงเงินตามแผน (ล้านบาท)	วงเงินที่ได้รับ (ล้านบาท)
20-ม.ค.-66	49 วัน	25,000	26,935.37
13-ม.ค.-66	153 วัน	36,000	34,643.43
3-ม.ค.-66	104 วัน	36,000	32,191.15
17-ม.ค.-66	90 วัน	30,000	30,578.83

กรอบแนวทางและเครื่องมือในการบริหารความเสี่ยง



- ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ย (Interest Rate Risk)**
 - Portfolio Duration เบี่ยงเบนจาก Duration ของพันธบัตรอ้างอิงไม่เกิน + 0.5 ปี
 - Absolute VaR Limit ไม่เกิน 0.5% ต่อปี (โดยวิธี Delta-normal method ที่ความเชื่อมั่น 99%)
 - Security Maturity ไม่เกิน 3 ปี
- ความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน (Foreign Exchange Rate Risk)**
 - ปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมด (Fully Hedged)
- ความเสี่ยงด้านเครดิต (Credit / Counterparty Risk)**
 - Issuer Limit ไม่เกินร้อยละ 30 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน (NAV)
 - Counterparty Limit ไม่เกินร้อยละ 30 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน
 - Country Limit ไม่เกินร้อยละ 30 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน (เฉพาะการลงทุนต่างประเทศ โดยไม่รวมกรณีที่มีปิดความเสี่ยงแบบ Fully Hedged แล้วสัดส่วนการลงทุนเกินร้อยละ 30 จากการ Mark to Market)
 - ยกเว้นตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยกระทรวงการคลัง หรือตราสารหนี้ที่ออกโดยธนาคารแห่งประเทศไทย
- ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง (Liquidity Risk)**
 - ลงทุนแบบ Maturity Matching เป็นหลัก
 - ลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีอายุมากกว่าวันครบกำหนดเงินจะตั้งเป็น LB หรือ BOT Bond ที่มีอายุคงเหลือไม่เกิน 3 ปี หรือ T-Bills, C-Bills เท่านั้น
 - ลงทุนในหลักทรัพย์ที่ขึ้นราคาหรือมีอายุจาก LB T-Bills BOT Bond และ C-Bill ให้ลงทุนแบบ Maturity Matching เท่านั้น ยกเว้นกรณีที่มีการจัดตั้งแผนบริหารสภาพคล่องเพื่อนำเงินคืนได้ กฟท.

ผลการกำกับการบริหารความเสี่ยงการลงทุนจากการ Pre - Funding

ประเภทความเสี่ยง	กรอบหลักเกณฑ์การบริหารความเสี่ยง	ผลการดำเนินงาน
1. Interest Rate Risk		
1.1 Portfolio Duration	เบี่ยงเบนจาก Benchmark (0.33) ไม่เกิน + 0.50 ปี เบี่ยงเบนไม่เกิน = 0.83 ปี	ระหว่าง 0.12 ถึง 0.28 ปี
1.2 Absolute VaR Limit	ไม่เกินร้อยละ 0.50 ต่อปี	ร้อยละ 0.00 ถึง 0.08 ต่อปี
2. Foreign Exchange Rate Risk	ปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมด (Fully Hedged)	การลงทุนในตราสารหนี้ต่างประเทศมีการปิดความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนทั้งหมด
3. Credit Risk	<ul style="list-style-type: none"> Issuer Limit ไม่เกินร้อยละ 30 ของ NAV (ยกเว้นตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยกระทรวงการคลัง) Counter Party Limit ไม่เกินร้อยละ 30 ของ NAV Country Limit ไม่เกินร้อยละ 30 ของ NAV 	ผู้บริหารสินทรัพย์บริหารจัดการการลงทุนเป็นไปตามที่ กฟท. กำหนด
4. Liquidity Risk	ลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอายุไม่เกินระยะเวลาการลงทุน	ตราสารหนี้ที่ลงทุน - ร้อยละ 68.94 ครบกำหนดภายในระยะเวลาการลงทุน - ร้อยละ 31.06 มีอายุคงเหลือเกินกว่าอายุการลงทุน คือตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยกระทรวงการคลัง ตราสารหนี้ที่ออกโดยธนาคารแห่งประเทศไทย รวมทั้งตราสารหนี้เอกชนที่มีสภาพคล่องสูง ซึ่งผู้บริหารสินทรัพย์ได้จัดดำเนินการเตรียมสภาพคล่องตามข้อกำหนดของกรมการคลังการลงทุนให้มีความเห็นชอบแล้ว
Investment Breach	สัดส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์ที่คงสูง : หลักทรัพย์อื่น = 60:40 (เกิดจากการลงทุน)	เป็นไปตามกรอบที่กำหนด (79.52 : 20.48)
Technical Breach	สัดส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์ที่คงสูง : หลักทรัพย์อื่น = 60:40 (เกิดจากการเปลี่ยนแปลงของตลาด)	เป็นไปตามกรอบที่ กฟท. กำหนด (79.50 : 20.50)
การบริหาร	เกณฑ์การให้บริหาร	ผลการดำเนินงาน
คุณภาพการบริการ	คุณภาพประสานงาน, ความรวดเร็วในการส่งรายงาน หรือให้ข้อมูล	ผู้บริหารสินทรัพย์ที่ 3 ราย มีการประสานงานกับ กฟท. เป็นไปอย่างเรียบร้อยและมีบริการให้ข้อมูลหรือส่งรายงานตามกำหนดเวลา

As end of Q2/FY2023

Investment Framework

กระบวนการบริหารจัดการลงทุน

กลยุทธ์การลงทุนสำหรับเงิน Pre-Funding

ตามดุลพินิจของ IC

วงเงินที่เหลือจากการฝากเงิน

- กฟท. ฝากเงินเอง
- ประเภทของธุรกรรม: ฝากเงินในสถาบันการเงินภาครัฐหรือธนาคารพาณิชย์ ที่คณะกรรมการกองทุน กำหนด
- วงเงิน: ≤100 ของมูลค่าเงินที่ได้รับจากกระทรวงการคลัง
- หมายเหตุ: การกำหนดสัดส่วนการฝากเงินจะพิจารณาจากปัจจัยต่างๆ เช่น วัตถุประสงค์ที่ กฟท. กำหนด, สภาพคล่อง, ความเสี่ยง, ระยะเวลา, อัตราดอกเบี้ย, ความเป็นไปได้ในการลดต้นทุน และผลของอัตราดอกเบี้ย
- Concentration Limit: สามารถฝากเงินได้ไม่เกินร้อยละ 10 ของมูลค่าเงินฝากของงบการเงิน

กฟท. มอบหมายให้ผู้บริหารสินทรัพย์บริหาร

- สินทรัพย์ที่ลงทุนได้:
 - ตัวบ่งชี้: พันธบัตรรัฐบาล, ตราสารหนี้ ธปท., พันธบัตรรัฐบาลค้ำประกัน, กระดาษชำระค้ำประกัน
- กรอบการลงทุน:
 - ตราสารหนี้ต่างประเทศที่ออกให้โดยรัฐบาล (Fully Hedge)
 - Reverse Repo
 - เงินฝากหรือตราสารหนี้ฝาก (≤10 ของ NAV)
- ตราสารหนี้อื่น: ≤40 ของ NAV หรือคิดเป็นค่าตอบแทน

ผลการดำเนินงาน:

- Enhance Yield**: ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล, ตราสารหนี้ ธปท. หรือพันธบัตรรัฐบาลที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน ไม่กำหนด (บน spot) ที่ยาวขึ้นกว่า Benchmark หรือสินทรัพย์ลงมือ
- Trading**: ลงทุนในพันธบัตรรัฐบาล, ตราสารหนี้ ธปท. หรือพันธบัตรรัฐบาลที่กระทรวงการคลังค้ำประกัน
- Enhance Yield**: ทรัพย์สินของหลักทรัพย์ที่ถือโดยกองทุนหรือบริษัทหลักทรัพย์ โดยลงทุนในตราสารหนี้ต่างประเทศที่มีผลตอบแทนสูงกว่าการลงทุนในประเทศ
- Enhance Yield**: ตราสารหนี้ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์หรือบริษัทหลักทรัพย์ที่ กฟท. กำหนด

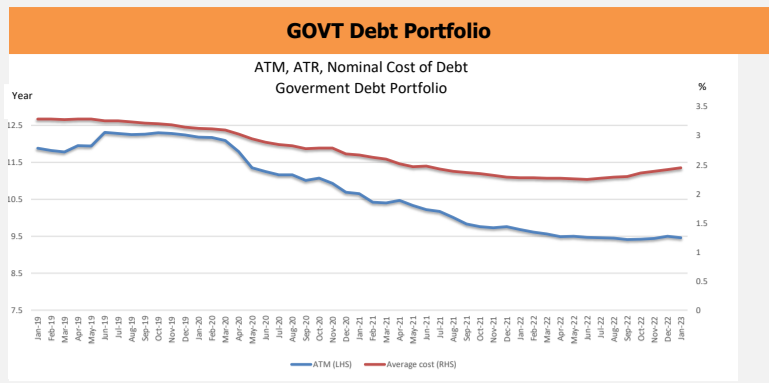
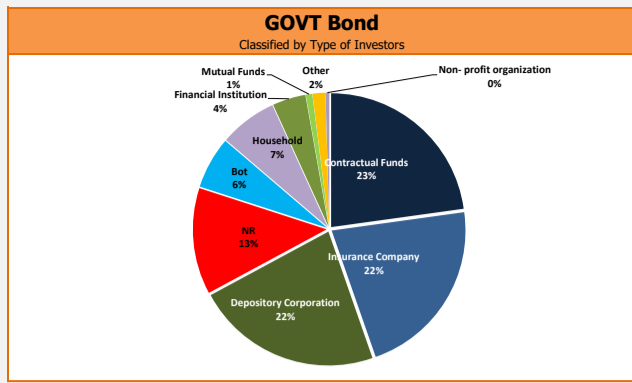
PUBLIC DEBT DATA

Public Debt

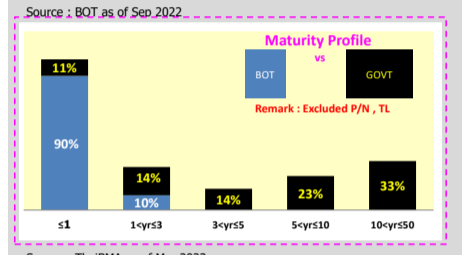
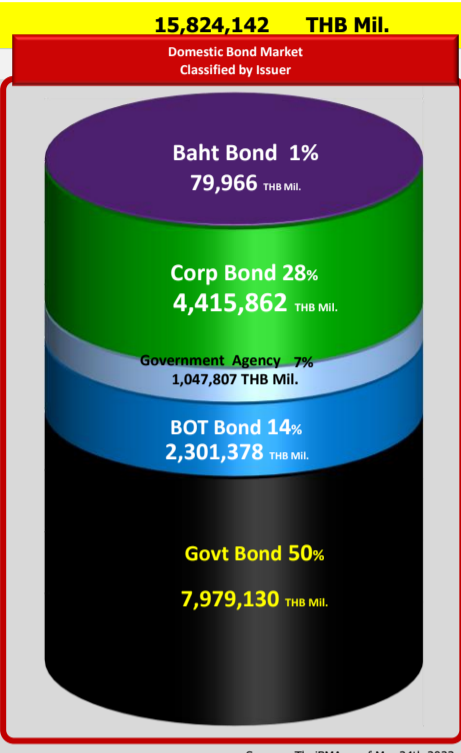
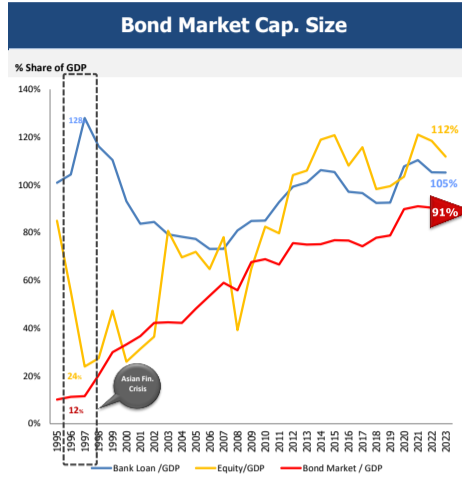
Debt to GDP = **61.26%**
10,692,883.04 THB Mil.

Oustanding Debt (THB Mil.)		%	Chg. from Sep-19 (THB Mil.)
GOVT	8,655,218.430	81%	2,663,374.88
- Domestic	8525128.53	80%	2,620,045.71
- Foreign	130089.9	1%	43,329.17
FIDF	670613.5	6%	-72,424.71
Debt Prefunding	58340	1%	58,340.00
SOE	1,045,872.610	10%	249,892.32
- G	492512.16	5%	91,472.93
- NG	553360.45	5%	158,419.39
SFIs	226573.85	2%	-82,898.51
Others	36,264.650	0%	28,443.18
Total	10,692,883.040	100%	2,844,727.16

Source : PDMO as of Jan 2023



Bond Market Data



T-bills and GOVT Bond Auction Schedule Q1/FY2023

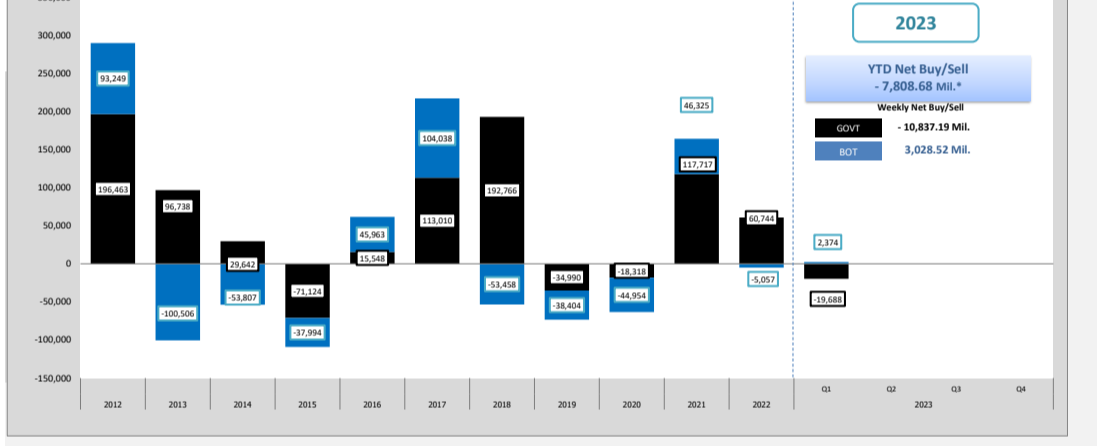
Date	Type	Tenor (Year)	Symbol	Auction Amount (THB MIL)	Total Allocated CB+NCB (THB MIL)	Allocated CB (THB MIL)	NCB (THB MIL)	BCR	G/O	AAV (%)	Spread (bps)	Min. (bps)	Max. (bps)
11-Jan-23	Bond	5	LB286A	30,000	30,000	30,000	-	1.93	-	1.93	2.10	0.87	3.17
11-Jan-23	Bond	30	LB526A	5,000	5,000	4,120	880	6.68	-	3.46	-19.43	-20.46	-16.66
16-Jan-23	bills	0.5	TB23719A	40,000	40,000	40,000	-	1.14	-	1.14	5.08	-5.98	13.42
18-Jan-23	Bond	3	LB266A	20,000	20,000	20,000	-	1.47	-	1.74	5.23	3.56	6.66
18-Jan-23	Bond	10	LB336A	25,000	25,000	24,950	50	1.66	-	2.50	3.96	2.69	5.19
25-Jan-23	Bond	15	ESGLB376A	20,000	20,000	19,280	720	2.88	-	2.76	-10.20	-11.37	-9.27
1-Feb-23	Bond	25	LB476A	7,000	7,000	6,250	750	3.27	-	3.18	-6.86	-14.57	-4.87
13-Feb-23	bills	0.5	TB23816A	40,000	40,000	40,000	-	2.25	-	1.68	6.35	-3.44	13.06
15-Feb-23	Bond	3	LB266A	30,000	30,000	30,000	-	1.21	-	1.96	8.28	6.03	12.03
15-Feb-23	Bond	50	LB726A	6,000	6,000	5,200	800	1.65	-	3.74	-3.58	-12.46	2.44
22-Feb-23	Bond	20	LB436A	16,000	16,000	15,950	50	1.44	-	3.16	5.88	3.92	7.92
27-Feb-23	bills	0.5	TB23830A	40,000	40,000	40,000	-	1.75	-	1.70	4.49	-2.38	7.82
1-Mar-23	Bond	5	LB286A	30,000	30,000	30,000	-	1.91	-	2.24	4.51	3.63	5.03
8-Mar-23	Bond	10	LB336A	27,000	27,000	27,000	-	1.99	-	2.58	3.97	2.78	4.38
13-Mar-23	bills	0.5	TB23913A	40,000	40,000	40,000	-	1.81	-	1.68	1.24	-5.87	6.13
15-Mar-23	Bond	3	LB266A	30,000	30,000	30,000	-	2.14	-	1.92	0.85	-0.19	1.61
15-Mar-23	Bond	30	LB526A	5,000	5,000	4,500	500	4.66	-	3.09	-19.68	-23.43	-18.43
27-Mar-23	bills	0.5	TB23927A	40,000	40,000	40,000	-	2.28	-	1.54	-10.01	-16.94	-4.44
29-Mar-23	Bond	15	ESGLB376A	20,000	20,000	19,700	300	2.03	-	2.64	-1.54	-2.56	-0.66

G : Greenshoe option O : Overallotment

Non-Residence Holding

NR Holding Weekly

Issuer	Non-Resident Holding (THB Million)	% Share of Thai Bond Market Cap.
GOVT Bond	979,153	6.188%
BOT Bond	72,357	0.457%
SOE Bond	743	0.005%
Foreign Bond	212	0.001%
Corp Bond	8,488	0.054%
TOTAL	1,060,953	6.705%



รายงานผลการดำเนินงานของกองทุนบริหารเงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้สาธารณะ และพัฒนาตลาดตราสารหนี้ในประเทศ

รายงานผลการดำเนินงาน

1. **รายงานผลการลงทุนเงิน Pre-Funding พันธบัตรรัฐบาล LB233A และ LB236A**
 ในไตรมาสที่ 2 ปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 (1 มกราคม - 31 มีนาคม 2566) กองทุนบริหารเงินเพื่อปรับโครงสร้างหนี้สาธารณะและพัฒนาตลาดตราสารหนี้ในประเทศ (กปท.) ได้รับเงินจากกระทรวงการคลัง (คค.) โดยสำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ (สบน.) ซึ่งเป็นเงินที่รัฐบาลเพื่อปรับโครงสร้างหนี้ (Pre-Funding) พันธบัตรรัฐบาล LB233A ครบกำหนดเมื่อวันที่ 13 มีนาคม 2566 วงเงิน 26,935,369,087.10 บาท และพันธบัตรรัฐบาล LB236A ครบกำหนดเมื่อวันที่ 16 มิถุนายน 2566 แล้วจำนวน 3 วัต รวมวงเงิน 97,413,419,985.17 บาท

1) **การบริหารจัดการการลงทุน และผลการดำเนินงาน**
 พันธบัตรรัฐบาล LB233A คณะกรรมการด้านการลงทุนมีมติเห็นชอบให้ขอเสนอให้ผู้บริหารสิทธิ์ทั้ง 3 ราย ได้แก่ บจก. กลีกริโย บจก. กรุ๊ป และ บจก. ไทยพาณิชย์ บริหารจัดการทั้งจำนวนในสัดส่วนที่เท่ากัน โดยเมื่อสิ้นสุดการลงทุน ณ วันที่ 10 มีนาคม 2566 กปท. ได้รับผลตอบแทนจากการบริหารเงินของผู้บริหารสิทธิ์รวมจำนวน 40,146,791.94 บาท คิดเป็นร้อยละ 1.11 ต่อปี ซึ่งสูงกว่าดัชนีบวที่ร้อยละ 0.88 ต่อปี จำนวน 23 Basis Points โดย บจก. กลีกริโย ได้รับผลตอบแทนสูงที่สุดที่ร้อยละ 1.28 ต่อปี และ บจก. กรุ๊ป ได้รับผลตอบแทนต่ำสุดที่ร้อยละ 0.85 ต่อปี ในส่วนพันธบัตรรัฐบาล LB236A คณะกรรมการด้านการลงทุนมีมติเห็นชอบให้ผู้บริหารสิทธิ์ทั้ง 3 รายข้างต้น บริหารจัดการในสัดส่วนที่เท่ากัน

2) **การกำกับติดตามผลการลงทุน**
 ผู้บริหารสิทธิ์ทั้ง 3 ราย มีผลการดำเนินงานเป็นไปตามเกณฑ์ กปท. กำหนด โดยเงินในหลักทรัพย์มีมูลค่ากว่าร้อยละ 60 ลงทุนในหลักทรัพย์อื่นน้อยกว่าร้อยละ 40 ของมูลค่าหลักทรัพย์ในลงทุน หากเงินไม่ครบร้อยละ 10 ของมูลค่าหลักทรัพย์ (Net Asset Value: NAV) และไม่มีเกิด Investment Breach และ Technical Breach รวมทั้งยังมีการประเมินราคาที่เป็นจริงตามเกณฑ์ กปท. ภายในไตรมาส

3) **การดำเนินงานและผลตอบแทน**
 กปท. ได้สังเกตเห็นให้กักการระดมทุนแล้ว จำนวน 26,935,369,087.10 บาท เมื่อวันที่ 13 มีนาคม 2566 สำหรับผลตอบแทนจำนวน 40,146,791.94 บาท และออกเรียกร้องการชำระของและยื่นฟ้องบังคับชำระหนี้ จาก (ชำระวันที่ 10 - 12 มีนาคม 2566) จำนวน 1,884,590.74 บาท อยู่ระหว่างรอชำระค่าธรรมเนียมการจัดการของเจ้าหนี้และผู้ถือหุ้นและผู้ถือหุ้นในการบริหารของผู้รับฝากทรัพย์สินในเดือนเมษายน 2566 และยังคงยื่นฟ้องบังคับชำระหนี้ให้แก่ สบน. เพื่อนำไปชำระดอกเบี้ยที่เกิดจากการปรับโครงสร้างหนี้ดังกล่าว

2. **รายงานผลการสอบบัญชี**
 สำนักการตรวจเงินแผ่นดิน (สตง.) ได้ตรวจสอบรายงานการเงินของ กปท. ประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2565 แล้ว และส่งรายงานข้อสอบบัญชีและรายงานการเงินของ กปท. ที่ได้ตรวจสอบความถูกต้องแล้ว ประกอบด้วย ย่อและฐานการเงิน ณ วันที่ 30 กันยายน 2565 และผลการดำเนินงานทางการเงินและงบการเงินเปลี่ยนแปลงสิทธิ์/ส่วนบุ สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 กันยายน 2565 โดย สตง. มีความเห็นว่า รายงานการเงินดังกล่าวมีความถูกต้องตามที่ควรในสาระสำคัญตามมาตรฐานการบัญชีภาครัฐและนโยบายการบัญชีที่กระทรวงการคลังกำหนด

3. **การบริหารความเสี่ยงและควบคุมภายใน**
 กปท. ได้เข้าประชุมคณะกรรมการตรวจสอบภายใน ประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 กับคณะกรรมการตรวจสอบและหน่วยงานตรวจสอบภายใน เพื่อพิจารณาผลการตรวจสอบการดำเนินงานด้านการเงินและบัญชี การประเมินระบบควบคุมภายใน และการบันทึกบัญชีและข้อมูลที่เกี่ยวข้องผ่านระบบการบริหารการหนี้ภาครัฐแบบอิเล็กทรอนิกส์ (Government Fiscal Management Information System : GFMS) และระบบบริหารจัดการการเงินแบบบูรณาการ (Non-Budgetary Management System : NBMS) โดยผลการทบทวนพบว่า รายงานการเงิน การปฏิบัติงานด้านการเงินและบัญชี และการบันทึกบัญชีข้อมูลระบบ GFMS ระบบ NBMS มีความถูกต้อง ครบถ้วน มีประสิทธิภาพสูง และมีความเสี่ยงต่ำ การใช้จ่ายเงินเป็นไปตามแผนการใช้จ่ายที่ได้รับอนุมัติประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2565 และระบบการควบคุมภายในเป็นไปตามหลักเกณฑ์กระทรวงการคลังว่าด้วยมาตรฐานและหลักเกณฑ์ปฏิบัติการควบคุมภายในสำหรับหน่วยงานของรัฐ พ.ศ. 2561 โดยมีความเสี่ยงเพียงเล็กน้อย

4. **การบริหารจัดการสารสนเทศ**
 กปท. ได้ทบทวนคู่มือการบริหารความเสี่ยงและจัดการด้านการบริหารความเสี่ยงและควบคุมภายในประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2567 ตามต้องการประเมินผลการดำเนินงานประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 ระหว่าง กปท. กับกรมบัญชีกลาง โดยยังยึดตามหลักปฏิบัติประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 ที่ความเชื่อมโยงในระดับปานกลาง 11 งาน มาจัดทำแผนบริหารความเสี่ยงและควบคุมภายในเพื่อติดตามและประเมินผลในปี 2567 พร้อมทั้งได้พิจารณาข้อเสนอแนะที่มีความเสี่ยงและจัดการด้านการบริหารความเสี่ยงและจัดการด้านการบริหารความเสี่ยง/ส่วนบุ สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 30 กันยายน 2565 โดย กปท. ครึ่งปี 1/2566 เมื่อวันที่ 10 มกราคม 2566 รายละเอียดปรากฏตามแผนก ข สำหรับการบริหารความเสี่ยงและควบคุมภายในปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 ได้จัดทำระบบการควบคุมภายใน เพื่อให้มีสภาพแวดล้อมการควบคุมภายในที่ครบถ้วนเพียงพอ ประกอบด้วย ระบบข้อมูลระบบ การสะท้อนความคืบหน้าและประเมินผล และการกำหนดขอบเขตระดับอำนาจในการอนุมัติต่างๆ โดยรายละเอียดการปฏิบัติงานควบคุมภายใน

5. **การตรวจสอบภายใน**
 กปท. ได้เข้าประชุมคณะกรรมการตรวจสอบภายใน ประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 กับคณะกรรมการตรวจสอบและหน่วยงานตรวจสอบภายใน เพื่อพิจารณาผลการตรวจสอบการใช้จ่ายผู้รับฝากทรัพย์สิน การจ้างผู้บริหารสิทธิ์ และการบริหารหนี้ โดยผลการทบทวนพบว่า การจ้างผู้รับฝากทรัพย์สิน การจ้างผู้บริหารสิทธิ์ และการบริหารหนี้ มีความถูกต้อง เป็นไปตามกฎหมาย ระเบียบ หรือหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง และระบบการควบคุมภายในเป็นไปตามหลักเกณฑ์กระทรวงการคลังว่าด้วยมาตรฐานและหลักเกณฑ์ปฏิบัติการควบคุมภายในสำหรับหน่วยงานของรัฐ พ.ศ. 2561 โดยมีความเสี่ยงเพียงเล็กน้อย

6. **การบริหารจัดการสารสนเทศ**
 กปท. ได้ดำเนินการตามแผนปฏิบัติการด้านสารสนเทศ ประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 โดยมีผลการดำเนินงานตามแผนปฏิบัติการของ 6 เดือน ประกอบด้วย

- 1) ระบบการคำนวณและรายงานมูลค่าส่วนบุของ กปท. : บันทึกข้อมูลการลงทุนและมูลค่าส่วนบุของเงิน Pre-Funding พันธบัตรรัฐบาล LB233A ตั้งแต่วันที่ 20 มี.ค. - 10 มี.ค. 66 และรับ LB236A ตั้งแต่วันที่ 13 มี.ค. - 31 มี.ค. 66 โดยคำนวณมูลค่าส่วนบุของเงินและจัดทำรายงานผล เพื่อติดตามสถานะการลงทุนรายเดือนและรายไตรมาส
- 2) ระบบการรับค่าเฉลี่ยของส่วนบุของ กปท. : พัฒนาระบบการรับค่าเฉลี่ยของส่วนบุของเงิน Pre-Funding พันธบัตรรัฐบาล LB233A ตั้งแต่วันที่ 20 มี.ค. - 10 มี.ค. 66 และรับ LB236A ตั้งแต่วันที่ 13 มี.ค. - 31 มี.ค. 66 โดยทำการรับค่าเฉลี่ยของส่วนบุของเงิน
- 3) ระบบการรายงานผลการดำเนินงานของ กปท. ในรูปแบบอิเล็กทรอนิกส์ รายไตรมาส : จัดทำเว็บไซต์เพื่อรายงานผลการดำเนินงานของ กปท. ประจำปีไตรมาส 4/2565 และ 1/2566 โดยเผยแพร่ผ่านเว็บไซต์ของ กปท. และจัดส่งอีเมลให้คณะกรรมการ กปท. แล้ว
- 4) ระบบการบริหารการนำส่งเงิน Pre-Funding ให้กระทรวงการคลัง : จัดทำแผนการลงทุนเพื่อรับเงิน Pre-Funding พันธบัตรรัฐบาล LB236A พร้อมทั้งได้ประกาศแผนการนำส่งเงินดังกล่าวให้กระทรวงการคลังแล้วเรียบร้อย กปท. แล้ว
- 5) ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศภายในเพื่อเพิ่มความปลอดภัยและลดการใช้กระดาษ : ดำเนินการจัดทำข้อมูลไว้ในโปรแกรมประมวลผลแบบคลาวด์ใช้เป็นฐานข้อมูลกลางเพื่อเพิ่มความปลอดภัยและลดการใช้กระดาษในการปฏิบัติงาน
- 6) โครงการข้อมูลบัญชีเชื่อมโยงของ กปท. : ดำเนินการจัดทำโครงการข้อมูลเชื่อมโยงของ กปท. ภายใต้ชื่อ www.pcfdf.or.th ระหว่างเวลาในการใช้งาน 3 ปี (26 พฤศจิกายน 2565 - 25 พฤศจิกายน 2568) แล้ว
- 7) การรักษาความมั่นคงปลอดภัยไซเบอร์ (Cyber Security) : อบรมเครือข่าย อุปกรณ์ โปรแกรมและข้อมูลที่มีความเสี่ยงจากการโจมตี ความเสียหายหรือการรั่วไหลของข้อมูลที่ไม่ได้รับอนุญาต และจัดทำแนวทาง Cyber Security ที่มีประสิทธิภาพ โดยครอบคลุมถึง Network Security Data Security และ Cloud Security
- 8) นโยบายการคุ้มครองข้อมูลส่วนบุคคล : ศึกษาพระราชบัญญัติคุ้มครองข้อมูลส่วนบุคคล พ.ศ. 2562 ระเบียบที่เกี่ยวข้อง และรวบรวมรายการข้อมูลส่วนบุคคลที่ กปท. ต้องขอความยินยอม

7. **การบริหารทรัพยากรบุคคล**
 กปท. ได้จัดทำรายงานประจำปีในการดำเนินการตามแผนการบริหารและพัฒนาทรัพยากรบุคคล ประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 รอบ 6 เดือน (1 ตุลาคม 2565 - 31 มีนาคม 2566) ตามคู่มือการประเมินคุณธรรมและความโปร่งใสในการดำเนินงานของหน่วยงานภาครัฐ ประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 เรื่อง การดำเนินการตามนโยบายหรือแผนการบริหารทรัพยากรบุคคล

Yield Curve (Domestic & International Comparison)

