

รายงานสถานะการบริหารเงินลงทุนกองทุนประกันสังคม

ไตรมาสที่ 1 ณ 31 มีนาคม 2560

สำนักงานประกันสังคม ได้นำเงินกองทุนประกันสังคมไปลงทุนตามกรอบการลงทุนที่คณะกรรมการประกันสังคม และกระทรวงการคลังให้ความเห็นชอบ โดยแยกการลงทุนประกันสังคมเป็นเงินลงทุนของกองทุนประกันสังคมกรณีเจ็บป่วย คลอดบุตร ทูพพลภาพ และตาย (เงินลงทุน 4 กรณี) และเงินลงทุนประกันสังคม กรณีสงเคราะห์บุตรและกรณีชราภาพ (เงินลงทุน 2 กรณี) เงินลงทุนกรณีว่างงาน เงินลงทุนมาตรา 40



แยกตามประเภท
เงินลงทุน



หน่วย : ล้านบาท

แยกตามประเภท
หลักทรัพย์

- 6 (ก) (1) เงินฝากหรือบัตรเงินฝากของธนาคารที่มี
กฎหมายเฉพาะจัดตั้ง 0.70%
- 6 (ก) (2) เงินฝากหรือบัตรเงินฝากของธนาคาร
พาณิชย์ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน
หรือธนาคารที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศ ที่
ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับการลงทุน
2.79%
- 6 (ก) (3) ตราสารแห่งหนึ่งที่ออกโดยกระทรวงการคลัง
หรือธนาคารแห่งประเทศไทย 65.80%
- 6 (ก) (4) ตราสารแห่งหนึ่งที่รัฐวิสาหกิจไทยเป็นผู้ออก
โดยมีกระทรวงการคลังเป็นผู้รับรอง ฯลฯ ที่ได้รับการ
จัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับการลงทุน 6.59%
- 6 (ก) (9) ตราสารแห่งหนึ่งที่ธนาคารตามกฎหมายว่า
ด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะ
จัดตั้งขึ้นฯ หรือนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย
หรือต่างประเทศเป็นผู้ออก โดยตราสารหรือผู้ออก
ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับการลงทุน
3.68%
- 6 (ก) (11) ตราสารแห่งหนึ่งที่เกิดจากการแปลง
สิทธิเป็นหลักทรัพย์โดยตราสารหรือผู้ออกได้รับ
การจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับการลงทุน
0.31%
- 6 (ก) (12) ตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขาย
ล่วงหน้าและหุ้นกู้อนุพันธ์ที่กระทรวงการคลัง
หรือธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นผู้ออก 1.07%
- 6 (ก) (16) หน่วยลงทุนกองทุนรวมตลาดเงิน หรือ
หน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่มีนโยบายการลงทุนใน
หลักทรัพย์ตามข้อ 6(ก)(1)-(14) 0.19%



- 6 (จ) (2) ตราสารแห่งหนึ่งตามข้อ 6 (ก)(4) ที่
กระทรวงการคลังเป็นผู้รับรองฯ โดยตราสารหรือ
ผู้ออกไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ใน
ระดับการลงทุน 4.15%
- 6 (จ) (9) หุ้น โบลล์แคชแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น หรือ
โบลล์แคชแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้
ซึ่งออกโดยรัฐวิสาหกิจไทยฯ 10.66%
- 6 (จ) (10) หน่วยลงทุนของกองทุนที่มีนโยบาย
การลงทุนในหลักทรัพย์ตามข้อ 6(จ)(1)-(8) 2.61%
- 6 (จ) (11) หน่วยทรัสต์ของกองทุนเพื่อการลงทุน
ในอสังหาริมทรัพย์ (Real Estate Investment
Trusts: REITs) 0.25%
- 6 (จ) (12) หน่วยลงทุนของกองทุน หรือหน่วยทรัสต์
หรือโบลล์แคชของกองทุนที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อ
ลงทุนในโครงสร้างพื้นฐาน 0.13%
- 6 (จ) (13) อสังหาริมทรัพย์หรือหน่วยลงทุนของ
กองทุนที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนใน
อสังหาริมทรัพย์หรือหน่วยทรัสต์ หรือในทรัสต์ของ
กองทุนเพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ 0.81%
- 6 (จ) (14) สินค้าโภคภัณฑ์หรือหน่วยลงทุนของ
กองทุนที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในสินค้าโภค
ภัณฑ์ 0.24%

เงินลงทุน 2 กรณี ลงทุนในหลักทรัพย์

ลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความมั่นคงสูงไม่ต่ำกว่าร้อยละ 60 ของเงินกองทุน ได้แก่

- 6 (ก) (1) เงินฝากหรือบัตรเงินฝากของธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้ง
- 6 (ก) (2) เงินฝากหรือบัตรเงินฝากของธนาคารพาณิชย์ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน หรือธนาคารที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศ ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน
- 6 (ก) (3) ตราสารแห่งหนึ่งหรือมากกว่าที่ออกโดยกระทรวงการคลังหรือธนาคารแห่งประเทศไทย
- 6 (ก) (4) ตราสารแห่งหนึ่งหรือมากกว่าที่รัฐวิสาหกิจไทยเป็นผู้ออก โดยมีกระทรวงการคลังเป็นผู้รับรอง ฯลฯ ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน
- 6 (ก) (9) ตราสารแห่งหนึ่งหรือมากกว่าที่ธนาคารตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นฯ หรือนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยหรือต่างประเทศเป็นผู้ออก โดยตราสารหรือผู้ออกได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน
- 6 (ก) (11) ตราสารแห่งหนึ่งที่เกิดจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์โดยตราสารหรือผู้ออกได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับน่าลงทุน
- 6 (ก) (12) ตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝงและหุ้นกู้อนุพันธ์ที่กระทรวงการคลังหรือธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นผู้ออก
- 6 (ก) (16) หน่วยลงทุนกองทุนรวมตลาดเงิน หรือหน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่มีนโยบายการลงทุนในหลักทรัพย์ตามข้อ 6(ก)(1) - (14)

ลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความเสี่ยงไม่เกินร้อยละ 40 ของเงินกองทุน ได้แก่

- 6 (ข) (2) ตราสารแห่งหนึ่งตามข้อ 6 (ก)(4) ที่กระทรวงการคลังมิได้เป็นผู้รับรองฯ โดยตราสารหรือผู้ออกไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับน่าลงทุน
- 6 (ข) (8) หุ้น ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น หรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้ ซึ่งออกโดยรัฐวิสาหกิจไทยฯ
- 6 (ข) (10) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่มีนโยบายการลงทุนในหลักทรัพย์ตามข้อ 6(ข)(1) -(8)
- 6 (ข) (11) หน่วยทรัสต์ของกองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (Real Estate Investment Trusts: REITs)
- 6 (ข) (12) หน่วยลงทุนของกองทุน หรือหน่วยทรัสต์หรือใบทรัสต์ของกองทรัสต์ที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในโครงสร้างพื้นฐาน
- 6 (ข) (13) อสังหาริมทรัพย์หรือหน่วยลงทุนของกองทุนที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในอสังหาริมทรัพย์หรือหน่วยทรัสต์ หรือใบทรัสต์ของกองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาฯ
- 6 (ข) (14) สินค้าโภคภัณฑ์หรือหน่วยลงทุนของกองทุนที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในสินค้าโภคภัณฑ์

ลงทุน 4 กรณี ลงทุนในหลักทรัพย์

ลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความมั่นคงสูงไม่ต่ำกว่าร้อยละ 60 ของเงินกองทุน ได้แก่

- 6 (ก) (1) เงินฝากหรือบัตรเงินฝากของธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้ง
- 6 (ก) (2) เงินฝากหรือบัตรเงินฝากของธนาคารพาณิชย์ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน หรือธนาคารที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศ ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน
- 6 (ก) (3) ตราสารแห่งหนึ่งหรือมากกว่าที่ออกโดยกระทรวงการคลังหรือธนาคารแห่งประเทศไทย
- 6 (ก) (4) ตราสารแห่งหนึ่งหรือมากกว่าที่รัฐวิสาหกิจไทยเป็นผู้ออก โดยมีกระทรวงการคลังเป็นผู้รับรอง ฯลฯ ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน
- 6 (ก) (9) ตราสารแห่งหนึ่งหรือมากกว่าที่ธนาคารตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นฯ หรือนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยหรือต่างประเทศเป็นผู้ออก โดยตราสารหรือผู้ออกได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน

ลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความเสี่ยงไม่เกินร้อยละ 40 ของเงินกองทุน ได้แก่

- 6 (ข) (3) หุ้น ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น หรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้ ซึ่งออกโดยรัฐวิสาหกิจไทย

เงินลงทุน กรณีว่างงาน ลงทุนในหลักทรัพย์

ลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความมั่นคงสูงไม่ต่ำกว่าร้อยละ 60 ของเงินกองทุน ได้แก่

- 6 (ก) (1) เงินฝากหรือบัตรเงินฝากของธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้ง
- 6 (ก) (2) เงินฝากหรือบัตรเงินฝากของธนาคารพาณิชย์ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน หรือธนาคารที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศ ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน
- 6 (ก) (3) ตราสารแห่งหนี้ที่ออกโดยกระทรวงการคลังหรือธนาคารแห่งประเทศไทย
- 6 (ก) (4) ตราสารแห่งหนี้ที่รัฐวิสาหกิจไทยเป็นผู้ออก โดยมีกระทรวงการคลังเป็นผู้รับรอง ฯลฯ ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน
- 6 (ก) (9) ตราสารแห่งหนี้ที่ธนาคารตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นฯ หรือนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยหรือต่างประเทศเป็นผู้ออก โดยตราสารหรือผู้ออกได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับน่าลงทุน
- 6 (ก) (11) ตราสารแห่งหนี้ที่เกิดจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์โดยตราสารหรือผู้ออกได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับน่าลงทุน
- 6 (ก) (12) ตราสารที่มีลักษณะของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝงและหุ้นกู้อนุพันธ์ที่กระทรวงการคลังหรือธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นผู้ออก

ลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความเสี่ยงไม่เกินร้อยละ 40 ของเงินกองทุน ได้แก่

- 6 (ข) (2) ตราสารแห่งหนี้ตามข้อ 6 (ก)(4) ที่กระทรวงการคลังมิได้เป็นผู้รับรองฯ โดยตราสารหรือผู้ออกไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับน่าลงทุน
- 6 (ข) (8) หุ้น ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น หรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้ ซึ่งออกโดยรัฐวิสาหกิจไทยฯ
- 6 (ข) (11) หน่วยทรัสต์ของกองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (Real Estate Investment Trusts: REITs)
- 6 (ข) (12) หน่วยลงทุนของกองทุน หรือหน่วยทรัสต์หรือใบทรัสต์ของกองทรัสต์ที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในโครงสร้างพื้นฐาน
- 6 (ข) (13) อสังหาริมทรัพย์หรือหน่วยลงทุนของกองทุนที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในอสังหาริมทรัพย์หรือหน่วยทรัสต์ หรือใบทรัสต์ของกองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาฯ

เงินลงทุนมาตรา 40 ลงทุนในหลักทรัพย์

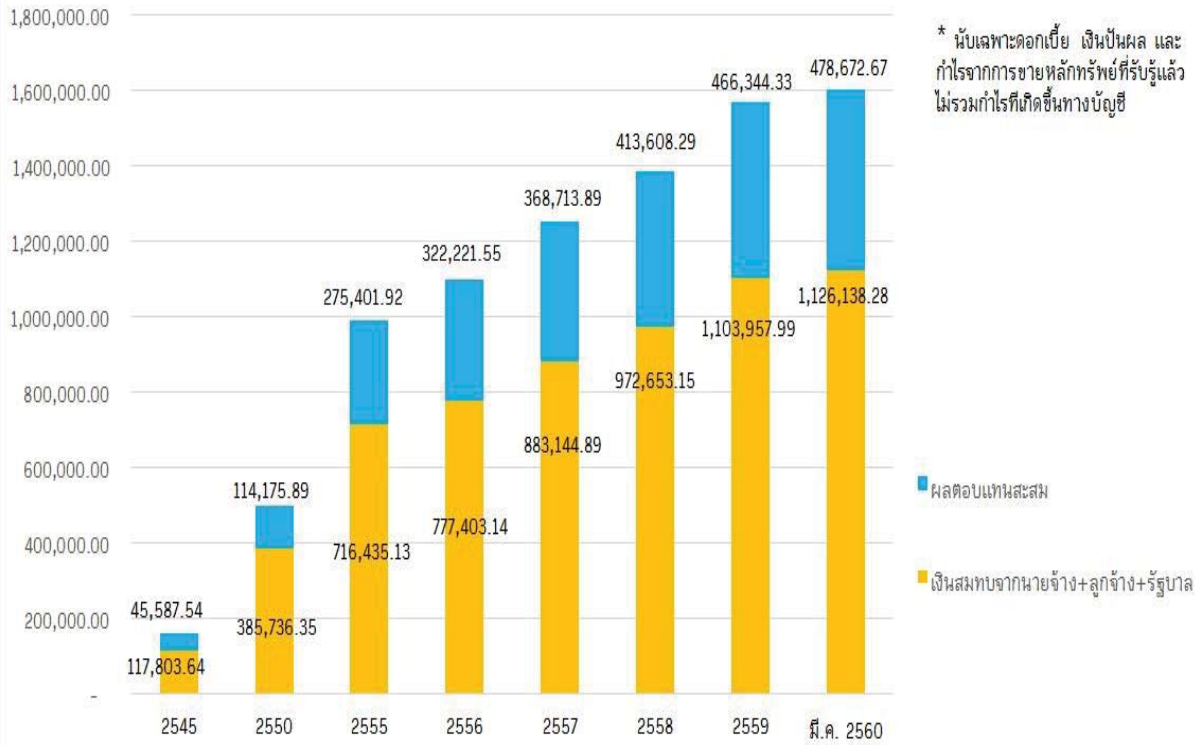
ลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความมั่นคงสูงไม่ต่ำกว่าร้อยละ60 ของเงินกองทุน ได้แก่

- 6 (ก) (2) เงินฝากหรือบัตรเงินฝากของธนาคารพาณิชย์ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน หรือธนาคารที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศ ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับนำลงทุน
- 6 (ก) (3) ตราสารแห่งหนึ่งหรือออกโดยกระทรวงการคลังหรือธนาคารแห่งประเทศไทย
- 6 (ก) (4) ตราสารแห่งหนึ่งที่รัฐวิสาหกิจไทยเป็นผู้ออก โดยมีกระทรวงการคลังเป็นผู้รับรอง ฯลฯ ที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับนำลงทุน
- 6 (ก) (9) ตราสารแห่งหนึ่งที่ธนาคารตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะ จัดตั้งขึ้นฯ หรือนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยหรือต่างประเทศเป็นผู้ออก โดยตราสารหรือผู้ออกได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับนำลงทุน
- 6 (ก) (11) ตราสารแห่งหนึ่งที่เกิดจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์โดยตราสารหรือผู้ออกได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับนำลงทุน

ลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความเสี่ยงไม่เกินร้อยละ40 ของเงินกองทุน ได้แก่

- 6 (ข) (2) ตราสารแห่งหนึ่งตามข้อ 6 (ก)(4) ที่กระทรวงการคลังมิได้เป็นผู้รับรองฯ โดยตราสารหรือผู้ออกไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในระดับนำลงทุน
- 6 (ข) (8) หุ้น ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น หรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้ ซึ่งออกโดยรัฐวิสาหกิจไทยฯ
- 6 (ข) (11) หน่วยทรัสต์ของกองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (Real Estate Investment Trusts: REITs)
- 6 (ข) (12) หน่วยลงทุนของกองทุน หรือหน่วยทรัสต์หรือใบทรัสต์ของกองทรัสต์ที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในโครงสร้างพื้นฐาน
- 6 (ข) (13) อสังหาริมทรัพย์หรือหน่วยลงทุนของกองทุนที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในอสังหาริมทรัพย์หรือหน่วยทรัสต์หรือใบทรัสต์ของกองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาฯ
- 6 (ข) (14) สินค้าโภคภัณฑ์หรือหน่วยลงทุนของกองทุนที่มีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในสินค้าโภคภัณฑ์

ผลตอบแทนจากการลงทุนกองทุนประกันสังคม



* นับเฉพาะดอกเบี้ย เงินปันผล และกำไรจากการขายหลักทรัพย์ที่รับรู้แล้ว ไม่รวมกำไรที่เกิดขึ้นทางบัญชี

ตั้งแต่ปี 2533-2560 เงินลงทุนสะสม 1,604,811 ประกอบด้วย

- เงินสมทบจากนายจ้าง + ลูกจ้าง + รัฐบาล: 1,126,138 ล้านบาท
- ดอกผลสะสมจากการลงทุน: 478,673 ล้านบาท

การลงทุนในโครงการเพื่อประโยชน์ทางอ้อมแก่ผู้ประกันตน

ณ 31 มีนาคม 2560 สำนักงานประกันสังคม มีการดำรงเงินฝากตามโครงการลงทุนทางสังคม จำนวน 2 โครงการ ดังนี้

โครงการสนับสนุนการจ้างงานในเขตพัฒนาพิเศษ 5 จังหวัดชายแดนภาคใต้

สำนักงานประกันสังคมได้ร่วมมือกับ ธนาคารออมสิน ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ธนาคารอิสลามแห่งประเทศไทย จำกัด (มหาชน) ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย โดยสนับสนุนเงินสำหรับสถานประกอบการวงเงินโครงการ 2,000 ล้านบาท อายุโครงการ 5 ปี วันเริ่มโครงการ 26 กันยายน 2557 ซึ่งสิ้นสุดการยื่นกู้ วันที่ 31 ธันวาคม 2558 และครบกำหนดไถ่ถอนเงินลงทุน วันที่ 31 ธันวาคม 2563 ขณะนี้ปล่อยสินเชื่อให้สถานประกอบการแล้ว จำนวน 69 ราย จำนวนเงิน 223.20 ล้านบาท

2. โครงการสินเชื่อเพื่อส่งเสริมการจ้างงาน

สำนักงานประกันสังคมได้ร่วมมือกับธนาคารอิสลามแห่งประเทศไทย ธนาคารแลนด์ แอนด์ เฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) และธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน) สนับสนุนเงินกู้ในวงเงิน 10 ,000 ล้านบาท อายุโครงการ 3 ปี วันเริ่มโครงการ 4 มกราคม 2555 โดยแบ่งเป็น

- วงเงิน 6,000 ล้านบาท สำหรับสถานประกอบการที่มีลูกจ้างไม่เกิน 50 คน วงเงินกู้ไม่เกิน 1 ล้านบาท ต่อราย
- วงเงิน 3,000 ล้านบาท สำหรับสถานประกอบการที่มีลูกจ้างไม่เกิน 50 – 200 คน วงเงินกู้ไม่เกิน 2 ล้านบาท ต่อราย
- วงเงิน 1,000 ล้านบาท สำหรับสถานประกอบการที่มีลูกจ้างไม่เกิน 200 คน วงเงินกู้ไม่เกิน 4 ล้านบาท ต่อราย

อัตราดอกเบี้ยกรณีการกู้มีหลักทรัพย์ค้ำประกัน ร้อยละ 3 ต่อปี คงที่ 3 ปี

อัตราดอกเบี้ยกรณีการกู้ไม่มีหลักทรัพย์ค้ำประกัน หรือใช้บุคคลค้ำประกัน ร้อยละ 5 ต่อปี คงที่ 3 ปี

ขณะนี้ปล่อยสินเชื่อให้สถานประกอบการ จำนวน 2 ,318 ราย จำนวนเงิน 4 ,455.69 ล้านบาท ซึ่งสิ้นสุดการยื่นกู้ วันที่ 31 ธันวาคม 2555 และครบกำหนดไถ่ถอนเงินลงทุน วันที่ 31 ธันวาคม 2563

หมายเหตุ :

โครงการตามข้อ 1 และ 2 สิ้นสุดระยะเวลาการยื่นคำขอกู้แล้ว แต่ยังไม่ครบกำหนดระยะเวลาการไถ่ถอนตามMOU