

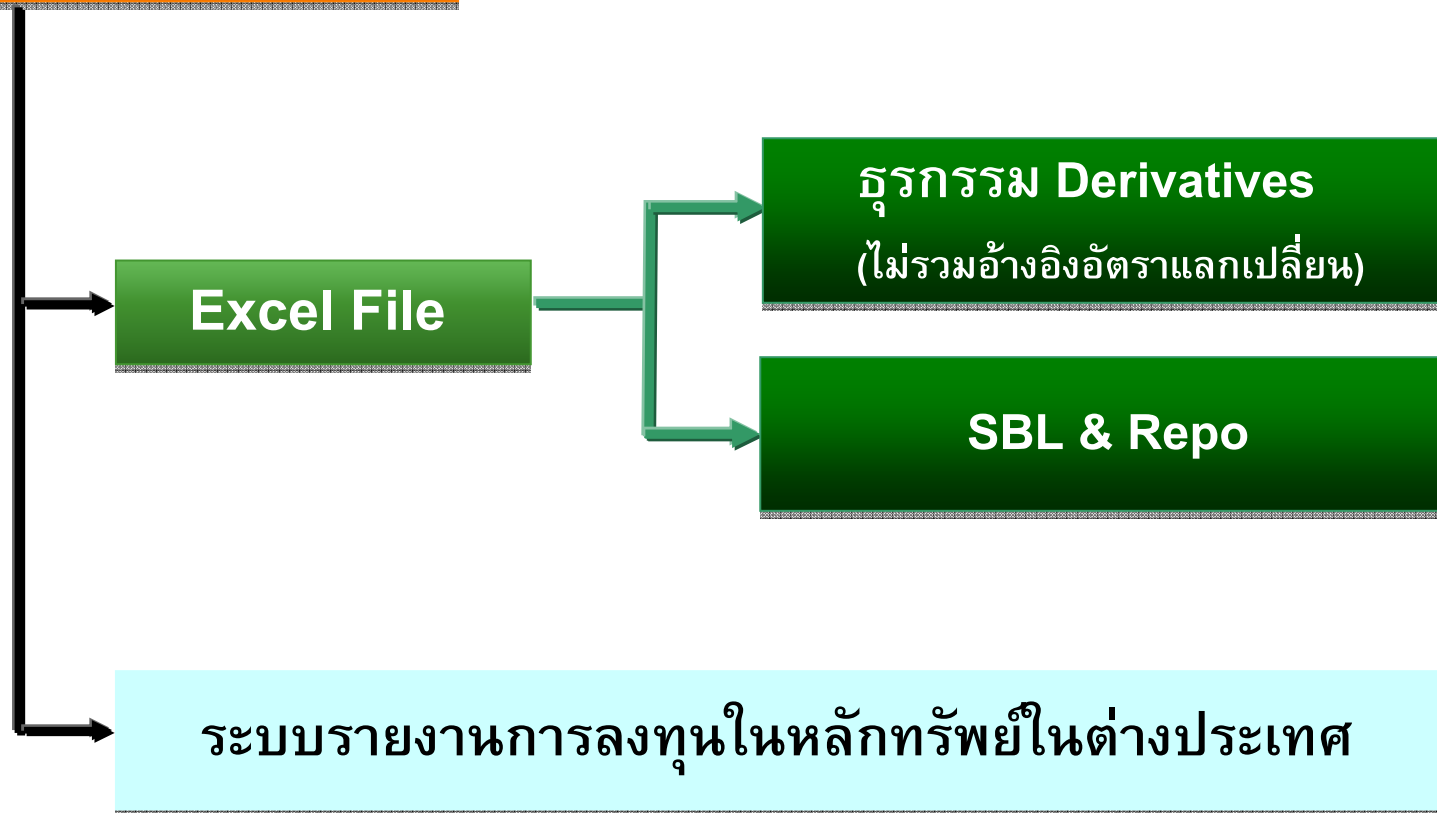


ธนาคารแห่งประเทศไทย
Bank of Thailand



การรายงานธุรกรรม Derivatives, SBL & Repo ในช่วง Stop Gap

ช่วง Stop Gap





รายงานธุรกรรม Derivatives (ไม่รวมอ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยน)

วิธีการคำนวณวงเงิน - ธุรกรรม Derivatives

سمมติ	หลักทรัพ์	FCD	Option		ผลประโยชน์สุทธิ (ขาดทุน)
			Notional Amount	Premium	
ยอดคงค้างเงินลงทุน	100	50	200	10	-20

รายการ	เดิม	ใหม่
ยอดคงค้างหลักทรัพ์	100	100
บวก FCD	50	50
บวก Option	200	
บวก ค่าใช้จ่าย (premium)		10
วงเงินลงทุน	350	160
ผลประโยชน์สุทธิ		
หัก กำไรสุทธิ		
บวก ขาดทุนสุทธิ	-20	-20
วงเงินลงทุน	370	180



รูปแบบรายงาน (Excel File)

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Derivatives (ไม่รวมอ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยน)

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Derivatives (ไม่รวมอ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยน)

บริษัท.....

เดือน.....พ.ศ.....

Unit : Unit

ที่	End Investor Name	ประเภทธุรกรรม	Underlying Assets	Maturity Date	Exchange / Counter Party Name (ระบุ)	ประเทศ	สกุลเงิน	short / long	No. of Contracts	Notional Amount	Cost Value		Mark to Market Value	Unrealized Gain or Loss (-) (เทียบเท่า USD)	Excess Cash + Margin		หมายเหตุ	
											สกุลเดิม	เทียบเท่า USD			สกุลเดิม	เทียบเท่า USD		
Total Outstanding											0		0		0			

หมายเหตุ ผลประโยชน์ (รายได้ / ค่าใช้จ่าย) ที่เกิดจากการทำธุรกรรมสุทธิ (Realized) ให้นำไปรายงานในรายงาน Return on Portfolio Investment Abroad (DF_RPI)

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Derivatives (ไม่รวมอ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยน)

ตัวอย่าง – กองทุนเอ็กซ์วาย ลงทุนใน Dow Jones Index Futures 10 สัญญา ราคาต้นทุน USD 90,000 Notional Amount

USD 100,000 Mark to Market USD 91,000 จ่ายค่าธรรมเนียม USD 2,000

- เปิดบัญชีเงินลงทุน USD 15,000 Initial Margin USD 10,000 (Excess Cash + Margin = USD 15,000)

- ณ สิ้นเดือนที่เปิด position มียอดคงค้าง Excess Cash + Margin รวม USD 14,000

เดือนที่เปิด Position

Excel File

ชื่อ Column	ข้อมูล
End Investor Name	กองทุนเอ็กซ์วาย
ประเภทธุรกรรม	Futures
Underlying Assets	Stock Index
Maturity Date	31/12/ 2009
Exchange / Counter Party Name	CBOT
ประเทศ	US
สกุลเงิน	USD
Short / Long	Long
No. of Contracts	10

ชื่อ Column	ข้อมูล
Notional Amount	100,000
Cost Value (สกุลเดิม)	90,000
(เทียบเท่า USD)	90,000
Mark to Market Value	91,000
Unrealized Gain or Loss(-) (เทียบเท่า USD)	1,000
Excess Cash + Margin (สกุลเดิม)	14,000
(เทียบเท่า USD)	14,000
หมายเหตุ	-

DF_RPI

บันทึกการจ่ายค่าธรรมเนียม

ระบบรายงานหลักทรัพย์ปัจจุบัน

Cumulative Interest Income Amount	Cumulative Dividend Amount	Cumulative Gain or Loss Amount	Cumulative Other Income Amount	Description
-	-	-	-2,000	

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Derivatives (ไม่รวมอ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยน)

ตัวอย่าง – กองทุนเอ็กซ์วาย ปิด Position ได้รับกำไรจากการขาย USD 12,000
- ยอดคงค้าง Excess Cash + Margin รวม USD 25,000

เดือนที่ปิด Position		Excel File		
ชื่อ Column	ข้อมูล	ชื่อ Column	ข้อมูล	
End Investor Name	กองทุนเอ็กซ์วาย	Notional Amount	-	
ประเภทธุรกรรม	-	Cost Value (สกุลเดิม)	-	
Underlying Assets	-	(เทียบเท่า USD)	-	
Maturity Date	-	Mark to Market Value	-	
Exchange / Counter Party Name	CBOT	Unrealized Gain or Loss (-) (เทียบเท่า USD)	-	
ประเทศ	US	Excess Cash + Margin (สกุลเดิม)	25,000	
สกุลเงิน	USD	(เทียบเท่า USD)	25,000	
Short / Long	-	หมายเหตุ	-	
No. of Contracts	-			

DF_RPI	บันทึกกำไร	ระบบรายงานหลักทรัพ์พย์ปัจจุบัน		
Cumulative Interest Income Amount	Cumulative Dividend Amount	Cumulative Gain or Loss Amount	Cumulative Other Income Amount	Description
-	-	-	10,000	

กำไร – ค่าธรรมเนียม (12,000 -2,000)

ฝ่ายกำกับกับการแลกเปลี่ยนเงินและสินเชื่อ

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Derivatives (ไม่รวมอ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยน)

การคำนวณวงเงิน	สถานะ	หุ้นสามัญ	Excess Cash + Margin	ค่าธรรมเนียม	Unrealized Gain	กำไรจาก Futures
	ยอดยกมา	100,000				
	วันที่เปิดบัญชีลงทุน	100,000	15,000			
	ณ สิ้นเดือนที่ open position	100,000	14,000	2,000	1,000	
	ณ สิ้นเดือนที่ close position	100,000	25,000			12,000

รายการ	ณ สิ้นเดือนที่ Open position	ณ สิ้นเดือนที่ Close position
ยอดคงค้างหลักทรัพย์	100,000	100,000
<u>บวก</u> ค่าใช้จ่าย	2,000	
<u>บวก</u> ยอดคงค้าง Excess Cash + Margin	14,000	25,000
<u>หัก</u> Unrealized Gain	-1,000	
<u>หัก</u> ผลประโยชน์สุทธิ		-10,000*
วงเงินลงทุน	115,000	115,000

* คำนวณจาก Realized Gain (12,000) – ค่าธรรมเนียม (2,000) = 10,000



รายงานธุรกรรม SBL

วิธีการคำนวณวงเงิน - ธุรกรรม SBL

สมมติ	หลักทรัพย์	FCD	ได้รับเงิน วางประกัน	ค่าใช้จ่าย
ยอดคงค้างเงินลงทุน	100	50		
ให้ยืม (Securities Lending : SL)	SL		100 (หลักประกัน) ฝาก FCD	10

รายการ	ปกติ	SL
ยอดคงค้างหลักทรัพย์	100	100
บวก FCD	50	150
หัก หลักประกัน		-100
บวก ค่าใช้จ่าย		10
วงเงินลงทุน	150	160



รูปแบบรายงาน (Excel File)

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending / Repurchase Market

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending / Repurchase Market

บริษัท.....

เดือน.....พ.ศ.....

Unit : Unit

ที่	End Investor Name	ประเภทสัญญา (ระบุตัวเลข)	รายละเอียดสัญญา								หลักประกัน							การลงทุนต่อ			หมายเหตุ					
			ประเภทหลักทรัพย์	ISIN CODE / Security symbol	ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์	วันครบกำหนดหลักทรัพย์	สกุลเงิน	Face Value	Market Value	วันครบกำหนดของสัญญา	ประเภท	ISIN CODE / Security symbol	ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์	วันครบกำหนดหลักทรัพย์	สกุลเงิน	Face Value	Market Value	ประเภทสัญญา	Face Value	Market Value						
		1 Securities Borrowing : SB									เงินสด												1 Securities Borrowing : SB			
		2 Securities Lending : SL									ตราสารหนี้	-ระบุเฉพาะหลักทรัพย์-													2 Securities Lending : SL	
		3 Repo									ตราสารทุน												3 Repo			
		4 Reverse Repo									อื่น ๆ (ระบุ)												4 Reverse Repo			
																							5 Short Selling			
																							6 ชื่อหลักทรัพย์			
																							7 Others (ระบุ)			

หมายเหตุ ผลประโยชน์ (รายได้ / ค่าใช้จ่าย) ที่ได้รับจากการทำธุรกรรมสุทธิ (Realized) ให้นำไปรายงานในรายงาน Return on Portfolio Investment Abroad (DF_RPI)

กรณีนำหลักทรัพย์หรือหลักประกันไปลงทุนต่อและเกิดผลประโยชน์ ก็ให้นำไปรายงานในรายงาน Return on Portfolio Investment Abroad (DF_RPI) ด้วย

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending / Repurchase Market

ตัวอย่าง – ธุรกรรมให้ยืม (Securities Lending : SL) – กองทุนเอ็กซ์วาย

Excel File

- หุ้น บริษัท Stars Co.,Ltd. Face Value USD 100,00 ราคาตลาด USD 80,000 วางหลักประกันเงินสด USD 100,000 (ฝาก FCD) ผลตอบแทนที่เหลือ (rebate) ที่จะต้องจ่าย USD 1,000 และมียอดคงค้าง FCD ยกมา USD 50,000

รายละเอียดสัญญา

ชื่อ Column	ข้อมูล
End Investor Name	กองทุนเอ็กซ์วาย
ประเภทสัญญา	2
ประเภทหลักทรัพย์	Common Stock
ISIN CODE/Security Symbol	C0111111111
ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์	Stars Co.,Ltd.
วันครบกำหนดหลักทรัพย์	-
สกุลเงิน	USD
Face Value	100,000
Market Value	80,000
วันครบกำหนดของสัญญา	31/10/2009

หลักประกัน

ชื่อ Column	ข้อมูล
ประเภท	เงินสด
ISIN CODE/Security symbol	-
ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์	-
วันครบกำหนดหลักทรัพย์	-
สกุลเงิน	USD
Face Value	100,000
Market Value	100,000

การลงทุนต่อ

ชื่อ Column	ข้อมูล
ประเภทสัญญา	6
Face Value	100,000
Market Value	100,000
หมายเหตุ	-

ฝ่ายกำกับดูแลการแลกเปลี่ยนเงินและสินเชื่อ

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending / Repurchase Market

ตัวอย่าง – ธุรกรรมให้ยืม (Securities Lending : SL) (ต่อ)

ระบบรายงานหลักทรัพย์ปัจจุบัน

- ให้ยืมหุ้น ราคาตลาด USD 80,000 ได้รับเงินสดเป็นหลักประกัน USD 100,000 นำฝาก FCD

DF_FCD

Account Number	Currency Id	Original Currency Deposit Amount	Original Currency Withdrawal Amount	Original Currency Outstanding Amount	Description
ยอดยกมา				50,000	
005EUR00000333	USD	100,000		150,000	หลักประกัน SL 100,000

DF_PIA

บันทึกจัดกลุ่มหลักทรัพย์ และบันทึกยอดคงค้าง P/N

ISIN Code	Security Type	Issuer Name	Currency Id	Original Currency Cost Value	Original Currency Market Value	Description
C01111111111	168003 (Common Stock)	Stars Co.,Ltd.	USD	100,000	80,000	SL

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending / Repurchase Market

ตัวอย่าง – ธุรกรรมให้ยืม (Securities Lending : SL) (ต่อ)

ระบบรายงานหลักทรัพย์ปัจจุบัน

-นำเงินสดไปซื้อ P/N ของบริษัท PPP.Ltd. USD 100,000

DF_FCD

Account Number	Currency Id	Original Currency Deposit Amount	Original Currency Withdrawal Amount	Original Currency Outstanding Amount	Description
005EUR00000333	USD	100,000	100,000	50,000	หลักประกัน SL 100,000

DF_MPI

บันทึกการซื้อ P/N

Security Type	Currency Id	Transaction Type	Trade Date	Value Date	Original Currency Cost Value	Description
168020 (Promissory Note)	USD	0290700002 (Buy)	2009/01/16	2009/01/18	100,000	

DF_PIA

บันทึกจัดกลุ่มหลักทรัพย์ และบันทึกยอดคงค้าง P/N

ISIN Code	Security Type	Issuer Name	Currency Id	Original Currency Cost Value	Original Currency Market Value	Description
C01111111111	168003 (Common Stock)	Stars Co.,Ltd.	USD	100,000	80,000	SL
P02222222222	168020 (Promissory Note)	PPP Ltd.	USD	100,000	100,000	

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending / Repurchase Market

ตัวอย่าง – ธุรกรรมให้ยืม (Securities Lending : SL) (ต่อ)

ระบบรายงานหลักทรัพย์ปัจจุบัน

-ขาย P/N USD 120,000 ได้กำไรจากการขาย USD 20,000 นำเงินฝาก FCD

DF_MPI		บันทึกการขาย P/N				
Security Type	Currency Id	Transaction Type	Trade Date	Value Date	Original Currency Cost Value	Description
168020 (Promissory Note)	USD	0290700003 (Sell)	2009/10/20	2009/10/22	100,000	

DF_PIA		บันทึกจัดกลุ่มหลักทรัพย์ และบันทึกยอดคงค้าง P/N				
ISIN Code	Security Type	Issuer Name	Currency Id	Original Currency Cost Value	Original Currency Market Value	Description
C01111111111	168003 (Common Stock)	Stars Co.,Ltd.	USD	100,000	80,000	
P02222222222	168020 (Promissory Note)	PPP Ltd.	USD	0	0	

รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending / Repurchase Market

ตัวอย่าง – ธุรกรรมให้ยืม (Securities Lending : SL) (ต่อ)

ระบบรายงานหลักทรัพย์ปัจจุบัน

- ขาย P/N USD 120,000 ได้กำไร USD 20,000 นำเงินฝาก FCD
- ส่งคืนหลักประกัน และผลตอบแทนที่เหลือ (rebate) USD 1,000

DF_FCD

Account Number	Currency Id	Original Currency Deposit Amount	Original Currency Withdrawal Amount	Original Currency Outstanding Amount	Description
ยอดยกมา				50,000	
005EUR00000333	USD	120,000	101,000	69,000	

หลักประกันเงินสด + rebate (100,000 + 1,000)

DF_RPI

Cumulative Interest Income Amount	Cumulative Dividend Amount	Cumulative Gain or Loss Amount	Cumulative Other Income Amount	Description
-	-	20,000	-1,000	

บันทึกกำไรจากการขาย P/N

บันทึกจ่าย rebate



รายงานยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending / Repurchase Market

การคำนวณวงเงิน

สถานะ	หุ้นสามัญ	FCD	P/N	จ่าย rebate	กำไรจาก P/N
ยอดยกมา	100,000	50,000			
ณ วันให้ยืม	(SL)	100,000 (หลักประกัน)			
เงินสดไปซื้อ P/N	(SL)	-100,000	100,000		
ขาย P/N ผาก FCD ได้กำไร	(SL)	120,000			20,000
ส่ง/รับคืนหลักประกัน/จ่าย rebate		-100,000		-1,000	

รายการ	กรณีปกติ	กรณีทำ SL
ยอดคงค้างหลักทรัพย์	100,000	100,000
บวก ยอดคงค้าง FCD	50,000	150,000
หัก หลักประกันเงินสด		-100,000
วงเงินลงทุน	150,000	150,000
บวก ซื้อ P/N		100,000
หัก หลักประกันเงินสด		-100,000
วงเงินลงทุน	150,000	150,000
บวก FCD (ขาย P/N) บันทึกกำไร 20,000		120,000
หัก FCD (คืนเงินสด /จ่าย rebate)		-101,000
หัก ผลประโยชน์สุทธิ		-19,000*
วงเงินลงทุน	150,000	150,000

* คำนวณจาก กำไรจากการขาย P/N (20,000) – rebate (1,000) = 19,000

ฝ่ายกำกับดูแลการแลกเปลี่ยนเงินและสินเชื่อ

การรายงานธุรกรรม Derivatives, SBL & Repo

Download แบบรายงาน

www.bot.or.th

- ➔ การรับส่งข้อมูลกับ ธปท.
- ➔ คำแนะนำการส่งข้อมูลการลงทุนในหลักทรัพย์ในต่างประเทศ
- ➔ รูปแบบข้อมูล / กลุ่ม :7

หรือ http://www.bot.or.th/Thai/DataManagementSystem/Portfolio_Investment_Abroad/Pages/data.aspx

การตั้งชื่อ Excel File

มาตรฐานการตั้งชื่อไฟล์ข้อมูล : MDSRXXX_YYYYMMDD_DSR.XLS

MDSR	เป็นค่าคงที่
XXX	รหัสประจำตัวผู้ส่งข้อมูล เช่น A99
YYYY	ปีของข้อมูลให้ใช้ปี ค.ศ. 4 หลัก เช่น 2009 เป็นต้น
MM	เดือนของข้อมูล มีค่าระหว่าง 01-12
DD	วันที่ของข้อมูลที่รายงาน (เป็นวันสุดท้ายของเดือน)
DSR.xls	เป็นค่าคงที่

ตัวอย่าง เช่น MDSRA99_20090831_DSR.XLS

การรายงานธุรกรรม Derivatives, SBL & Repo

การส่งข้อมูล

- 🕒 ความถี่ในการส่งข้อมูล : รายเดือน
- 🕒 กำหนดส่ง : ภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป
(วันที่ 10 เป็นวันหยุด ให้ส่งภายในวันทำการถัดไป)
- 🕒 รูปแบบ : Excel File / ระบบรายงานปัจจุบัน
- 🕒 ช่องทางการส่ง : DMS DA Extranet / DMS DA Internet
(ช่องทางจัดส่งในปัจจุบัน)

การดำเนินการก่อนส่งข้อมูล

- ① เป็นสมาชิกส่งรายงานปัจจุบัน : แจ้งชื่อองค์กรและช่องทางการส่งมาที่ SupportDMS@bot.or.th
ภายในวันสิ้นเดือนของข้อมูลงวดแรก
- ② ไม่เคยเป็นสมาชิก : ระเบียบการสมัคร www.bot.or.th
➔ การรับส่งข้อมูลกับ ธปท.
➔ ระเบียบการส่งข้อมูลทาง Internet
ส่งใบสมัครที่ คุณสมบัติ แสนบุตร หรือ คุณเอกชัย เลิศพนารักษ์
ทีมสนับสนุนระบบการบริหารข้อมูล ฝ่ายบริหารข้อมูล อาคาร 2 ชั้น 7
สอบถามรายละเอียดโทร. 0-2356-7422 และ 0-2283-5126



Q & A



สอบถามข้อมูลเพิ่มเติม

ทีมวิเคราะห์และพัฒนากำกับการแลกเปลี่ยนเงิน



023-567-814