

ธนาคารแห่งประเทศไทย

16 พฤศจิกายน 2550

เรียน ผู้จัดการ

ธนาคารพาณิชย์ทุกธนาคาร

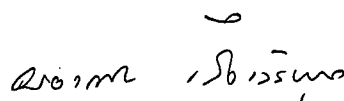
สถาบันการเงินเฉพาะกิจทุกสถาบัน

ที่ ผตง.(1ก.)ว. 11 /2550 เรื่อง การปรับปรุงรูปแบบรายงานและการส่งรายงาน

ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้มีหนังสือที่ 2759/2538, 29/2542 และ 08/2543 ลงวันที่ 21 ธ.ค. 2538, 30 ส.ค. 2542 และ 14 ก.พ. 2543 ตามลำดับ ขอให้สถาบันการเงินจัดส่งข้อมูลธุรกรรมเงินตราต่างประเทศ และได้จัดประชุมชี้แจงพร้อมทั้งขอให้สถาบันการเงินส่งข้อมูลเร็วในระหว่างวันตามรูปแบบใหม่ตั้งแต่วันที่ 3 กันยายน 2550 คู่ขนานกับตาราง 1, 3 - 6 ในรูปแบบเดิม นั้น

ธปท. พิจารณาแล้วเห็นว่าสถาบันการเงินสามารถจัดส่งรายงานข้อมูลตามรูปแบบใหม่ (XML File) ได้อย่างมีคุณภาพในระดับที่น่าพอใจ และเพื่อเป็นการลดภาระการรายงานของสถาบันการเงิน จึงขอให้สถาบันการเงินยุติการส่งตารางที่ 1, 3 - 6 ใน รูปแบบเดิม และจัดส่งรายงานธุรกรรมการซื้อขายเงินตราต่างประเทศในรูปแบบใหม่ (XML File) ตามแนบแทน ตั้งแต่วันที่ 19 พฤศจิกายน 2550 เป็นต้นไป และ ธปท. ขอขอบคุณในความร่วมมือมา ณ โอกาสนี้ด้วย

ขอแสดงความนับถือ



(นางฟองเพ็ญ เรืองวิรุทธ)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายตลาดการเงินและบริหารเงินสำรอง

ผู้ว่าการแทน

- สิ่งที่ส่งมาด้วย : 1. รายงานที่ยกเลิกการจัดส่งให้ ธปท. (ตารางที่ 1, 3 - 6)
2. รูปแบบรายงานมาตรฐานที่จะขอให้เริ่มจัดส่งแทนตารางที่ 1, 3 - 6 ตั้งแต่วันที่ 19 พฤศจิกายน 2550 เป็นต้นไป และคำอธิบายรายงาน

ทีมวิเคราะห์เงินตราต่างประเทศ

ฝ่ายตลาดการเงินและบริหารเงินสำรอง

โทรศัพท์ 0-2283-5425, 0-2283 5406

โทรสาร 0-2280-6059

เว็บไซต์ www.bot.or.th เป็นองค์กรที่มองการณ์ไกล พนักงานมีความสามารถสูงและอุทิศตนเพื่อดูแลเศรษฐกิจให้ผ่านพ้นความผันผวนได้อย่างราบรื่น

พจนาน. bot.or.th บริการข้อมูลอัตโนมัติ 24 ชั่วโมง โทร. 0 - 2283 - 6789

สงกจว90กต5200125501119

Table 1 Daily Foreign Currency Purchase/Sale Transactions Report

Code

Bank XXX

Date

(Million US Dollars equivalent)

Net Foreign Currency Position - Beginning of day _____ Mil USD

End of day _____ Mil USD

Type	Purchase				Sale				Net + Purchase - Sale
	Domestic Fin. Inst.	Foreign Fin. Inst.	Others	Total	Domestic Fin. Inst.	Foreign Fin. Inst.	Others	Total	
Spot (settle w/i 2 working days)									
Outright Forward									
2 days - 1 month									
1 month - 3 months									
3 months - 6 months									
6 months - 12 months									
Over 1 year									
Swap									
1 working day									
2 days - 1 month									
1 month - 3 months									
3 months - 6 months									
6 months - 12 months									
Over 1 year									

สกงจ90กต5200125501119

Table 3 Forward Contracts Balance

002

30/3/2006

(Million US Dollar Equivalent)

Remaining life	Purchase				Sale			
	Domestic Fin. Inst.	Foreign Fin. Inst.	Others	Total	Domestic Fin. Inst.	Foreign Fin. Inst.	Others	Total
1 working day								
2 days - 7 days								
7 days - 1 month								
1 month - 3 months								
3 months - 6 months								
6 months - 12 months								
Over 1 year								

Note: *Balance of Outright Forward and Swap transactions (count only forward position)

สกงว90กส5200125501119

Tab 4 Report of Foreign Exchange Transaction (With Non - Resident)

CODE

BANK XXX

DATE

Unit : Million

Non - Resident		Transaction.		Value Date		Exchange Rate		Foreign Currency	
Name	S.W.I.F.T. Code	Type	Buy/Sell	1 st leg	2 nd leg	1 st leg	2 nd leg	Currency	Amount

สกงจ90กต5200125501119

Tab 5 Report of Foreign Exchange Transaction (With Non - Bank Resident)

CODE

BANK XXX

DATE

Unit : Million

Non - Bank Resident		Transaction		Value Date		Exchange Rate		Foreign Currency		Underlying
Name	Tax id.	Type	Buy/Sell	1 st leg	2 nd leg	1 st leg	2 nd leg	Currency	Amount	

สงวนลิขสิทธิ์ 5200125501119

ข้อมูล FX Position

ธนาคาร	FI Name
001	Organization Id
2007-09-01	Dataset Date (yyyy-mm-dd)
Amount Type	Usd Equivalent Amount
Beginning Balance	
New Buy Contract Amount	+
New Sell Contract Amount	-
Net Change In Contract Amount	+/-
Error Transaction	+/-
Other Transaction	+/-
Option Notional Amount	+/-
Option Delta Amount	+/-
Cash Position Amount	

Purpose Remarks	Related Fi Arrangement Number	Arrangement Remarks

สกงว90กส5200125501119

ข้อมูล FX/THB Transaction ที่น้อยกว่า 1 ล้าน USD

ธนาคาร

001

Organization Id

2007-09-01

Dataset Date (yyyy-mm-dd)

Arrangement Type	Leg Type	Usd Equivalent Amount

*