



เรียน เลขาธิการ กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ
ผู้อำนวยการ กองทุนประกันสังคม
ผู้จัดการ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
ผู้จัดการ บริษัทหลักทรัพย์
ผู้จัดการ บริษัทประกันชีวิตและบริษัทประกันวินาศภัย
ผู้จัดการ สถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้ง
ผู้จัดการ ผู้ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
ผู้จัดการ นิติบุคคลอื่นที่ เป็นผู้ลงทุนตามประกาศเจ้าพนักงาน*

ที่ ผกง.(25)ว. 22 /2562 เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานการลงทุนในอนุพันธ์ใน
ต่างประเทศ (Derivatives) และธุรกรรมยืมหรือให้ยืมตราสารในต่างประเทศ (Securities
Borrowing and Lending)

ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้ออกประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน
เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ ลงวันที่
24 มิถุนายน 2558 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ซึ่งเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน (เจ้าพนักงานฯ)
ได้กำหนดให้ผู้ลงทุนรายงานการลงทุนในตราสารในต่างประเทศตามแบบรายงาน Portfolio Investment
Abroad (PIA) และรายงานการลงทุนในอนุพันธ์ในต่างประเทศ (Derivatives) ธุรกรรมยืมหรือให้ยืมตราสาร
ในต่างประเทศ (Securities Borrowing and Lending: SBL) และธุรกรรมขายหรือซื้อตราสารในต่างประเทศ
โดยมีสัญญาซื้อคืนหรือขายคืน (Repo หรือ Reverse Repo: Repo) ตามแบบรายงาน “แบบฟอร์มรายงาน
ธุรกรรม Derivatives และแบบฟอร์มรายงานธุรกรรม Securities Borrowing and Lending” นั้น

ธปท. เห็นควรปรับปรุงแบบรายงานที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนใน Derivatives, SBL และ Repo
โดยยกเลิกแบบรายงานเดิมและให้ใช้แบบรายงานตามรูปแบบและวิธีการที่ ธปท. กำหนด ซึ่งประกอบไปด้วย
3 ตาราง ได้แก่ ตารางที่ 1: แบบรายงานยอดคงค้างธุรกรรม Derivatives ตารางที่ 2: แบบรายงานยอดคงค้าง
Excess cash + Margin เพื่อซื้อขาย Derivatives และ ตารางที่ 3: แบบรายงานยอดคงค้างธุรกรรม Securities
Borrowing and Lending / Repo โดยผู้ลงทุนสามารถเรียกแบบรายงานและคู่มือการกรอกรายงานที่
ปรับปรุงใหม่ได้ที่เว็บไซต์ของ ธปท. (www.bot.or.th) ภายใต้หัวข้อ สถิติ >> การรับส่งข้อมูลกับ ธปท. >>
แบบรายงานและเอกสารชี้แจงข้อมูลตลาดการเงิน >> ข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์
>> ภายใต้หัวข้อ “แบบฟอร์มรายงานธุรกรรม Derivatives และแบบฟอร์มรายงานธุรกรรม Securities
Borrowing and Lending/Repo”

* 1) นิติบุคคลที่มีสินทรัพย์ตามงบดุลตั้งแต่ 5,000 ล้านบาท ซึ่งมีธุรกิจหลักเป็นผู้ผลิตหรือประกอบกิจการค้าหรือบริการ
2) บริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ทั้งนี้ ให้ผู้ส่งรายงานจัดส่งรายงานตามแบบรายงานที่ปรับปรุงใหม่ตั้งแต่ข้อมูลงวดเดือน มิถุนายน 2562 (รายงานภายในวันที่ 10 กรกฎาคม 2562) เป็นต้นไป โดยจัดส่งเป็นรายเดือนภายใน วันที่ 10 ของเดือนถัดไปตามวิธีปฏิบัติเดิม

ขอแสดงความนับถือ



(นางสาวชिरา อารมย์ดี)

เจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน

- สิ่งที่ส่งมาด้วย: 1. แบบรายงานยอดคงค้างธุรกรรม Derivatives
2. แบบรายงานยอดคงค้าง Excess cash + Margin เพื่อซื้อขาย Derivatives
3. แบบรายงานยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending/Repo

ฝ่ายนโยบายและกำกับการแลกเปลี่ยนเงิน
โทรศัพท์ 0 2283 5162

