



เรียน กรรมการผู้จัดการ

ผู้ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์

ผู้ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

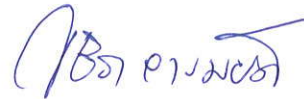
ที่ ผกง.(25)ว. 23 /2562 เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานการลงทุนในอนุพันธ์ในต่างประเทศ (Derivatives) และธุรกรรมยืมหรือให้ยืมตราสารในต่างประเทศ (Securities Borrowing and Lending)

ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้ออกประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่อง การกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ของบุคคลรายย่อย ลงวันที่ 24 มิถุนายน 2558 และที่แก้ไขเพิ่มเติม ซึ่งเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงินได้กำหนดให้ตัวแทนการลงทุนรายงานการลงทุนในตราสารในต่างประเทศของบุคคลรายย่อยตามแบบรายงาน Portfolio Investment Abroad (PIA) หรือแบบรายงานการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ของผู้ลงทุนรายย่อย (PIA-แบบย่อ) และรายงานการลงทุนในอนุพันธ์ในต่างประเทศ (Derivatives) ธุรกรรมยืมหรือให้ยืมตราสารในต่างประเทศ (Securities Borrowing and Lending: SBL) และธุรกรรมขายหรือซื้อตราสารในต่างประเทศโดยมีสัญญาซื้อคืนหรือขายคืน (Repo หรือ Reverse Repo: Repo) ตามแบบรายงาน “แบบฟอร์มรายงานธุรกรรม 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 โดยตัวแทนการลงทุนสามารถเรียกแบบรายงานและคู่มือการกรอกรายงานที่ปรับปรุงใหม่ได้ที่เว็บไซต์ของ ธปท. ([www.bot.or.th](http://www.bot.or.th)) ภายใต้หัวข้อสถิติ >> การรับส่งข้อมูลกับ ธปท. >> แบบรายงานและเอกสารชี้แจงข้อมูลตลาดการเงิน >> ข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ >> ภายใต้หัวข้อ “แบบฟอร์มรายงานธุรกรรม Derivatives และแบบฟอร์มรายงานธุรกรรม Securities Borrowing and Lending/Repo”

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

ฝ่ายนโยบายและกำกับการณ์การแลกเปลี่ยนเงิน

โทรศัพท์ 0 2283 5162





