



# คู่มือการจัดทำชุดข้อมูลมาตรการป้องปรามการเก็งกำไรค่าเงินบาท

สำหรับบริษัทหลักทรัพย์

(DATA FILE MANUAL)



**Document information**

**Revision history**

Version number	Date	Summary of changes	Revision marks
1.0	1 October 2018	First version	No



สารบัญ

	หน้า
1. รายงานธุรกรรมที่บริษัทหลักทรัพย์กู้ยืมเงินบาท หรือเสมือนการกู้ยืมเงินบาทจาก NR แบบมีและไม่มี Underlying รองรับ .....	1-1
2. รายงานยอดคงค้างทรัพย์สินประเภทเงินของลูกค้ำ NR ที่มีอยู่กับบริษัทหลักทรัพย์ .....	2-1
Appendix A. Data Type .....	2-1
Appendix B. รายละเอียดการรายงานรหัสมาตรฐาน .....	4-1

# ธนาคารแห่งประเทศไทย

## 1. รายงานธุรกรรมที่บริษัทหลักทรัพย์กู้ยืมเงินบาท หรือเสมือนการกู้ยืมเงินบาทจาก NR แบบมีและไม่มี Underlying รองรับ

### คำอธิบาย

ข้อมูลยอดคงค้างของธุรกรรมที่บริษัทหลักทรัพย์กู้ยืมเงินบาท หรือเสมือนการกู้ยืมเงินบาทจาก Non-Resident : NR ตามนิยามภายใต้มาตรการป้องปรามการเก็งกำไรค่าเงินบาท

1. แบบไม่มี Underlying ธุรกรรมการค้า หรือการลงทุนของ NR ที่เกิดขึ้นในประเทศไทยรองรับ รายงานธุรกรรม
2. แบบที่มี Underlying ธุรกรรมการค้า หรือการลงทุนของ NR ที่เกิดขึ้นในประเทศไทยรองรับ รายงานธุรกรรม

ทั้งนี้ หากยอดคงค้างลดลงเป็น 0 ให้รายงานเฉพาะวันแรกที่ยอดคงค้างเป็น 0 เท่านั้น

### สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

บริษัทหลักทรัพย์ทุกบริษัท

### ลักษณะข้อมูล

รายงานธุรกรรม, รายงาน

### กำหนดการส่ง

รายงานภายใน 12.00 น. ของวันที่ 15 ของเดือนถัดจากเดือนที่ต้องรายงาน

Data Element (field)	คำอธิบาย	Validation Rule
Organization Id	รหัสบริษัทหลักทรัพย์ผู้ส่งข้อมูล เช่น บริษัท หลักทรัพย์ กสิกรไทย จำกัด รหัส A22	Format Char(3) เช่น A22 ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

# ธนาคารแห่งประเทศไทย

Data Element (field)	คำอธิบาย	Validation Rule
Data Set Date	วันที่ของชุดข้อมูล ให้ใช้วันสุดท้ายของเดือนตามปีปฏิทิน	Format YYYY-MM-DD ปี ค.ศ. เช่น 2018-01-31
Date of Outstanding Balance	วันที่ของยอดคงค้าง ณ สิ้นวันทำการ ของสัญญาใหม่ และสัญญาเดิมที่ยอดคงค้างเปลี่ยนแปลง	Format YYYY-MM-DD ปี ค.ศ. เช่น 2018-01-03 ต้องมีย่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ Data Set Date
Contract Number	เลขที่สัญญาอ้างอิงที่ทำกับคู่สัญญา NR หรือเลขที่อ้างอิงภายในของบริษัทหลักทรัพย์	Format VarChar(40)
Contract Date	วันที่ทำสัญญาหรือวัน Trade Date	Format YYYY-MM-DD ปี ค.ศ. ต้องมีย่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ Date of Outstanding Balance
Effective Date	วันที่สัญญาเริ่มมีผลบังคับใช้	Format YYYY-MM-DD ปี ค.ศ. ต้องมีย่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ Contract Date
Maturity Date	วันที่สัญญาครบกำหนด	Format YYYY-MM-DD ปี ค.ศ. ต้องมีย่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ Effective Date
Primary Involved Party Id	รหัสอ้างอิงของ NR ที่ เป็นคู่สัญญา ให้รายงานรหัสอ้างอิงตามมาตรฐานที่กำหนดตาม Appendix B เช่น รหัส swift code (แหล่งสืบค้นข้อมูล <a href="http://www.swift.com">www.swift.com</a> )	VarChar(40) ให้ระบุรหัสอ้างอิง เช่น MGXX1234XYZ
Primary Involved Party Unique Id Type	ประเภทของรหัสมาตรฐาน ให้รายงานประเภทของรหัสมาตรฐาน (Unique Id Type) ที่กำหนดตาม Appendix B เช่น 324008	Format Char(6) ให้ระบุรหัส เช่น 324008 ค่าที่เป็นไปได้ คือ 324002 Passport Number 324008 Swift Code 324009 Oversea Individual Id 324010 Oversea Juristic Id

# ธนาคารแห่งประเทศไทย

Data Element (field)	คำอธิบาย	Validation Rule
		324011 International Organization and Oversea Government Id 324012 Others
Primary Involved Party Name	ชื่อของ NR ที่เป็นผู้สัญญา รูปแบบการรายงานชื่อ ให้รายงานชื่อเต็ม ภาษาอังกฤษ หากมี THE นำหน้าให้ตัดไปใส่ไว้ท้ายชื่อ เช่น XYZ BANK LTD., THE, LONDON และ ABC, MR. เป็นต้น	VarChar(200)
Primary Involved Party Type	ประเภทของ NR ที่เป็นผู้สัญญา	Format Char(6) ให้ระบุรหัส เช่น 176068 ค่าที่เป็นไปได้ คือ 176067 บุคคลธรรมดา 176068 นิติบุคคล 176069 สถาบันการเงิน 176070 อื่น ๆ
Country of Non-Resident	รหัสประเทศของ NR ที่เป็นผู้สัญญา (แหล่งสืบค้นข้อมูล <a href="#">Classification: Country Id</a> )	Format Var(2) ให้ระบุรหัส เช่น SG และต้องมีค่าไม่เท่ากับ TH
Financial Transaction Type	ประเภทธุรกรรมทางการเงินที่บริษัทหลักทรัพย์ทำกับ NR	Format Var(2) ให้ระบุค่า เช่น DI ค่าที่เป็นไปได้ คือ DI การกู้ยืมเงินบาทโดยตรงจาก NR BO การออกตราสารหนี้เงินบาททุกระยะขายให้กับ NR OT ธุรกรรมอื่นๆ (โปรดระบุรายละเอียดในช่อง Financial Transaction Description)
Financial Transaction Description	รายละเอียดเพิ่มเติม กรณีรายงานประเภทธุรกรรมทางการเงินเป็น OT (ธุรกรรมอื่นๆ)	Format VarChar(400) ต้องมีค่า เมื่อ Financial Transaction Type เท่ากับ OT

# ธนาคารแห่งประเทศไทย

Data Element (field)	คำอธิบาย	Validation Rule
Currency Id	รหัสสกุลเงิน (แหล่งสืบค้นข้อมูล <a href="#">Classification: Currency Id</a> )	Format Var(3) ให้ระบุรหัส เช่น THB กรณี Financial Transaction Type เท่ากับ DI หรือ BO ดังนั้น Currency Id ต้องเท่ากับ THB เท่านั้น
Contract Amount	จำนวนเงินบาท ณ วันทำสัญญา (หน่วยเป็นบาท ทศนิยม 2 ตำแหน่ง)	Format Number(20,2) ต้องมียกค่ามากกว่า 0
Outstanding Balance	ยอดคงค้างธุรกรรมทางการเงินที่บริษัทหลักทรัพย์ทำกับ NR (หน่วยเป็นบาท ทศนิยม 2 ตำแหน่ง)	Format Number(20,2)
Underlying code	ให้ระบุการใช้เงินบาท (underlying) ที่บริษัทหลักทรัพย์กู้เงินบาทจาก NR 1. เพื่อ บล. ให้กู้ยืมแก่ลูกค้า ซึ่งเป็นบุคคลไทย ( Resident ) ที่ไม่ใช่สถาบันการเงินในประเทศเพื่อการซื้อขายหรือแลกเปลี่ยนหลักทรัพย์ 2. อื่น ๆ	Format Char(2) ให้ระบุค่า เช่น LO ค่าที่เป็นไปได้ LO เงินกู้ (Loan) OT อื่น ๆ (Other Underlying) (โปรดระบุรายละเอียดใน Description)
Description	รายละเอียดเพิ่มเติม	Format VarChar(400) Underlying code เท่ากับ OT อื่น ๆ

# ธนาคารแห่งประเทศไทย

## 2. รายงานยอดคงค้างทรัพย์สินประเภทเงินของลูกค้ำ NR ที่มีอยู่กับบริษัทหลักทรัพย์

### คำอธิบาย

ยอดคงค้างทรัพย์สินประเภทเงินของลูกค้ำ NR แต่ละราย ณ สิ้นวัน รวมถึงกรณีที่ยอดคงค้างไม่เปลี่ยนแปลง หรือหากยอดคงค้างลดลงเป็น 0 ให้รายงานเฉพาะวันแรกที่ยอดคงค้างเป็น 0 เท่านั้น ได้แก่ เงินสด ภายใต้ประเภท (1) ทรัพย์สินลูกค้ำบัญชีเงินสด (2) ทรัพย์สินลูกค้ำระบบบัญชีมาร์จิน และ (3) ทรัพย์สินลูกค้ำบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตามความหมายในประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

### สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

บริษัทหลักทรัพย์ทุกบริษัท

### ลักษณะข้อมูล

รายการธุรกรรม, รายวัน

### กำหนดการส่ง

ภายใน 12.00 น. ของวันทำการถัดจากวันที่เกิดธุรกรรม

Data Element (field)	คำอธิบาย	Validation Rule
Organization Id	รหัสบริษัทหลักทรัพย์ผู้ส่งข้อมูล เช่น บริษัท หลักทรัพย์ กสิกรไทย จำกัด รหัส A22	Format Char(3) เช่น A22 ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด
Data Set Date	วันที่มียอดคงค้างทรัพย์สินประเภทเงิน หรือ Date of Balance	Format YYYY-MM-DD ปี ค.ศ. เช่น 2018-01-03



# ธนาคารแห่งประเทศไทย

Data Element (field)	คำอธิบาย	Validation Rule
Primary Involved Party Id	รหัสอ้างอิงของ NR แต่ละราย ที่มียอดคงค้างทรัพย์สินประเภทเงินกับบริษัท หลักทรัพย์ ให้รายงานรหัสอ้างอิง (Unique Id) ที่กำหนดตาม Appendix B เช่น รหัส swift code ของ NR (แหล่งสืบค้นข้อมูล <a href="http://www.swift.com">www.swift.com</a> )	VarChar(40) ให้ระบุรหัสอ้างอิง เช่น MGXX1234XYZ
Primary Involved Party Unique Id Type	ประเภทของรหัสมาตรฐาน (Unique Id Type) ให้รายงานประเภทของรหัส มาตรฐาน (Unique Id Type) ที่กำหนดตาม Appendix B เช่น 324008	Format Char(6) ให้ระบุตัวเลข เช่น 324008 ค่าที่เป็นไปได้คือ 324002 Passport Number 324008 Swift Code 324009 Oversea Individual Id 324010 Oversea Juristic Id 324011 International Organization and Oversea Government Id 324012 Others
Primary Involved Party Name	ชื่อของลูกค้า NR รูปแบบการรายงานชื่อ ให้รายงานชื่อเต็มภาษาอังกฤษ หากมี THE นำหน้าให้ตัดไปใส่ไว้ท้ายชื่อ เช่น XYZ BANK LTD., THE, LONDON และ ABC, MR. เป็นต้น	VarChar(200)
Primary Involved Party Type	ประเภทของ NR	Format Char(6) ให้ระบุตัวเลข เช่น 176068 ค่าที่เป็นไปได้คือ 176067 บุคคลธรรมดา 176068 นิติบุคคล 176069 สถาบันการเงิน 176070 อื่น ๆ
Country of Non-Resident	รหัสประเทศของ NR (แหล่งสืบค้นข้อมูล <a href="#">Classification: Country Id</a> )	Format Var(2) ให้ระบุรหัส Country Id เช่น SG

# ธนาคารแห่งประเทศไทย

Data Element (field)	คำอธิบาย	Validation Rule
ยอดคงค้าง บัญชีเงินสด	จำนวนเงินสดในบัญชีเงินสดของลูกค้า NR ที่ บล.รับฝากไว้ (หลักการตามข้อ 1.1 ภายใต้แบบ บ.ล.8 ของสำนักงาน กตต. เฉพาะลูกค้า NR) กรณีไม่มียอดคงค้าง ณ สิ้นวัน ให้ใส่จำนวนยอดคงค้างเท่ากับ “0”	Format Number(20,2)
ยอดคงค้าง บัญชีมาร์จิน	จำนวนเงินสดในระบบบัญชีมาร์จินของ NR ที่ บล.รับฝากไว้ (หลักการตามข้อ 2.1 ภายใต้แบบ บ.ล.8 ของสำนักงาน กตต. เฉพาะลูกค้า NR) กรณีไม่มียอดคงค้าง ณ สิ้นวัน ให้ใส่จำนวนยอดคงค้างเท่ากับ “0”	Format Number(20,2)
ยอดคงค้าง บัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	จำนวนเงินสดคงเหลือในบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ NR ที่ บล.รับฝากไว้ (หลักการตามข้อ 3.1 ภายใต้แบบ บ.ล.8 ของสำนักงาน กตต. เฉพาะลูกค้า NR) กรณีไม่มียอดคงค้าง ณ สิ้นวัน ให้ใส่จำนวนยอดคงค้างเท่ากับ “0”	Format Number(20,2)
ยอดคงค้างเงินวางประกันในบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	เฉพาะจำนวนเงินสดที่เป็นหลักประกันในบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ NR ที่ บล.เรียกไว้	Format Number(20,2)
Description	รายละเอียดเพิ่มเติม	Format VarChar(400)

**Appendix A. Data Type**

Data Type Name	Data Type	Format	Remark	Sample
Provider Code	Char(3)	AAA	No leading blanks	'A22'
Date	Char(10)	YYYY-MM-DD	A.D. year	'2018-01-31'
Identification Number	VarChar(40)	AAAA	No leading blanks	'12345'
Classification	VarChar(10)	AAAA	No leading blanks	'0123456789'
Long Name	VarChar(200)	AAAA		'XXX'
SWIFT Code	VarChar(12)	AAAA	No leading blanks	'XXXXXXXXJPJK'
Amount	Number(20,2)	NNNNNNNNNN.NN	No leading zeroes	'102000020.20'
Description	VarChar(400)	AAAA		'XXX111'

# ธนาคารแห่งประเทศไทย

## Appendix B. รายละเอียดการรายงานรหัสมาตรฐาน

วิธีรายงานรหัสลูกค้า NR ของบริษัทหลักทรัพย์ ขอให้ปฏิบัติดังนี้

ประเภทบุคคล/นิติบุคคล		รหัสอ้างอิง (Unique Id)	ประเภทของ รหัสมาตรฐาน (Unique Id Type)	แหล่งสืบค้น ข้อมูล
1. บุคคลธรรมดา	1.1 บุคคลธรรมดาที่มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ (รวมคนไทยโอนสัญชาติถาวร)	- รหัสประเทศ + เลขหนังสือเดินทาง	324002	
		- รหัสประเทศ + รหัสบุคคลธรรมดาในประเทศอื่น (กรณีไม่มีเลขที่หนังสือเดินทาง)	324009	
2. นิติบุคคล	2.1 นิติบุคคลที่มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ			
	2.1.1 นิติบุคคลตามกฎหมายในต่างประเทศ และมี สำนักงานในต่างประเทศ เช่น	รหัสประเทศ + เลขแสดงตนในต่างประเทศ ดังนี้		
	2.1.1.1 หน่วยงานของรัฐ, สหกรณ์, บริษัทจำกัด	- รหัสประเทศ + รหัสอ้างอิงที่ออกโดยองค์กร หรือ หน่วยงานราชการ (รัฐ) ในประเทศอื่น	324011	
		- รหัสประเทศ + รหัสนิติบุคคลในประเทศอื่น	324010	
	2.1.1.2 รัฐบาลต่างประเทศ	- รหัสประเทศ + GOVERNMENT	324012	
	2.1.1.3 สถานทูต ได้แก่ - สถานทูตต่างประเทศในไทย - สถานทูตต่างประเทศในต่างประเทศ <u>ยกเว้น</u> สถานทูตไทยในต่างประเทศเป็น Resident	- รหัสประเทศ + EMBASSY + รหัสประเทศที่ตั้ง เช่น - USEMBASSYTH - JPEMBASSYLA - THEMBASSYJP	324012	

## ธนาคารแห่งประเทศไทย

ประเภทบุคคล/นิติบุคคล		รหัสอ้างอิง (Unique Id)	ประเภทของ รหัสมาตรฐาน (Unique Id Type)	แหล่งสืบค้น ข้อมูล
	2.1.1.4 องค์กรหรือนิติบุคคลในต่างประเทศ ที่ไม่มี รหัสอ้างอิง	- รหัสประเทศ + คำแยกประเภท + ชื่อย่อ คำแยกประเภทเป็น 3 หลัก COM=COMMERCIAL SOC=SOCIAL GOV=GOVERNMENT ARM=ARMY INT=INTERNATIONAL OTH=OTHERS	324012	
	2.1.2 สถาบันการเงินที่อยู่ในต่างประเทศ	- รหัส SWIFT CODE	324008	<a href="http://www.swift.com">www.swift.com</a>
		- รหัสประเทศ+เลขที่แสดงตนในต่างประเทศ (กรณีสถาบันการเงินในตปท.ไม่มี SWIFT Code หรือมีแต่ ใช้ SWIFT Code ร่วมกับบริษัทแม่ ให้ใช้รหัสนิติบุคคลใน ประเทศอื่น)	324010	
	2.1.3 อื่น ๆ	รหัสประเทศ+เลขแสดงตนในต่างประเทศ ดังนี้		
		- รหัสประเทศ + รหัสอ้างอิงที่ออกโดยองค์กร หรือ หน่วยงานราชการ (รัฐ)ในประเทศอื่น	324011	
		- รหัสประเทศ + รหัสนิติบุคคลในประเทศอื่น	324010	
		- รหัสประเทศ + คำแยกประเภท + ชื่อย่อ	324012	