



ธนาคารแห่งประเทศไทย  
BANK OF THAILAND

การประชุมชี้แจง  
การปรับปรุงชุดข้อมูลด้านตลาดการเงิน (DMS FM)  
ประจำปี 2562

21 มิถุนายน 2562



เวลา	หัวข้อบรรยาย
13.15 - 13.45 น.	ลงทะเบียนและรับประทานอาหารว่าง
13.45 - 14.00 น.	ประธานกล่าวเปิดงาน
14.00 - 15.00 น.	การปรับปรุงชุดข้อมูลธุรกิจเงินตราต่างประเทศ <ul style="list-style-type: none"><li>▪ ขอบเขตและภาพรวมการปรับชุดข้อมูล</li><li>▪ รายละเอียดการปรับชุดข้อมูล</li><li>▪ กรอบเวลาการดำเนินการ</li></ul>
15.00 - 15.30 น.	ซักซ้อมการรายงานข้อมูล
15.30 – 16.00 น.	ถาม-ตอบ



1. ปรับวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ **monitor** ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ
2. เพิ่มการรายงาน **Unwind / Cancel / Rollover** ธุรกรรม **Spot Today**
3. ปรับเพิ่มการรายงานเหตุผลในการยกเลิกธุรกรรม
4. ยกเลิกการรายงานข้อมูลประกอบการทำธุรกรรม **FX** เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์และเงินกู้ยืม/เงินให้กู้
5. ยกเลิกการรายงาน **Element** ที่เกี่ยวข้องกับกิจการวิเทศธนกิจ



## ชุดข้อมูล DMS FM

### Foreign Currency Position and Arrangement

- FXA
- SWA
- OPA
- FRA
- FLA
- DAR
- FTA
- DIP
- FCP

### Foreign Currency Transaction

- FTU
- FTX
- LTX
- FTS
- PTX

### Other

- EPE
- ISI

## ชุดข้อมูลเร็ว

### FX Trading (FOX I)

- FXM
- FXU
- FXP

### NRLB

- OLB
- SLB
- BDA
- DWT

## Classification

- Transaction Purpose
- Cancellation Reason Type

## สรุปการปรับปรุง

- 12 Data Sets
- 2 Classifications



1. ปรับวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ **monitor** ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ
2. เพิ่มการรายงาน **Unwind / Cancel / Rollover** ธุรกรรม **Spot Today**
3. ปรับเพิ่มการรายงานเหตุผลในการยกเลิกธุรกรรม
4. ยกเลิกการรายงานข้อมูลประกอบการทำธุรกรรม **FX** เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์และเงินกู้ยืม/เงินให้กู้
5. ยกเลิกการรายงาน **Element** ที่เกี่ยวข้องกับกิจการวิเทศธนกิจ



## ปรับวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ monitor ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ

- **Dataset :**
  - **FM : FXA , SWA , OPA , FRA , FTU , FTX , EPE**
  - **FX Trading (FOX I) : FXM**
  - **NRLB : OLB**
- **Classification : Transaction Purpose Code**

ปรับรายละเอียด 3 หมวด

- หมวดบริการ
- หมวดค่าสินค้า
- หมวดอื่น ๆ



## ประวัติวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ monitor ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ

### หมวดบริการ

#### 1. เพิ่มวัตถุประสงค์ธุรกรรมในฐานะ Market Maker ภายใต้หมวดย่อย:บริการ / หมู่:ธุรกรรมของ Non Bank

Code	Value
318001	บริการ รายได้ และเงินโอนและบริจาค
318002	บริการ
318214	ธุรกรรมของ Non Bank
318165	บุคคลรับอนุญาต
318166	บริษัทรับอนุญาต
318167	ตัวแทนโอนเงินระหว่างประเทศ
318215	บริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาต
New	ธุรกรรมในฐานะ Market Maker เพื่อบริหารความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยน
New	ธุรกรรม market maker เพื่ออนุพันธ์อ้างอิงราคาทองคำ
New	ธุรกรรม market maker เพื่ออนุพันธ์อ้างอิงตัวแปรอื่น

เพิ่ม 3 รายการใหม่

- หมู่ย่อย 1 รายการ
- กิจกรรม 2 รายการ



## ปรับวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ monitor ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ

### หมวดบริการ

#### 2. เพิ่มวัตถุประสงค์ ค่าบริการซ่อมบำรุงเครื่องจักรและอุปกรณ์

เพิ่ม 1 รายการใหม่  
ปรับแก้คำจำกัดความ 1 รายการ

Code	Value	Description
318001	บริการ รายได้ และเงินโอนและบริจาค	
318002	บริการ	
318022	ค่าบริการอื่นๆ ภาคเอกชน	
318028	ค่าที่ปรึกษา	ได้แก่ ค่าที่ปรึกษาด้านกฎหมาย บัญชี การจัดการหรือประชาสัมพันธ์ ค่าตอบแทนผู้เชี่ยวชาญและ กรรมการบริษัท ค่าความช่วยเหลือทางเทคนิค ค่าความรู้วิชาการ ค่าบริการช่วยเหลือในการติดตั้ง เครื่องจักรและระบบไฟฟ้าในโรงงาน ค่าบริการทางการจัดการและดำเนินการทางเทคโนโลยี เป็นต้น
New	ค่าบริการซ่อมบำรุงเครื่องจักร และอุปกรณ์	ค่าบริการซ่อมหรือค่าบำรุงรักษาเครื่องจักรและอุปกรณ์ เครื่องบิน เรือ หรือยานพาหนะอื่นๆ
...	.....	.....
318036	ค่าบริการอื่นๆ (โปรดระบุรายละเอียด)	ค่าบริการอื่นๆ ที่ไม่เข้าข่ายข้างต้น เช่น การบริการส่วนบุคคล การบริการทางวัฒนธรรม การกีฬา และสันทนาการอื่นๆ เป็นต้น





## ปรับวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ monitor ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ

### หมวดค่าสินค้า (Goods)

1.ปรับแก้ ค่าทองคำ (318233) จากเดิมอยู่ระดับ หมวดย่อย มาอยู่ระดับ หมวด

Code	Value	หมวด	หมวดย่อย
318132	ค่าสินค้า (Goods)	3	
318231	ค่าสินค้าเข้าและสินค้าออก		31
318232	ส่วนลด เงินมัดจำ เงินที่ชำระไว้เกิน และอื่นๆของค่าสินค้า		32
318233	ค่าทองคำ		33

Code	Value	หมวด	หมวดย่อย
318132	ค่าสินค้า (Goods)	3	
318231	ค่าสินค้าเข้าและสินค้าออก		31
318232	ส่วนลด เงินมัดจำ เงินที่ชำระไว้เกิน และอื่นๆของค่าสินค้า		32
318233	ค่าทองคำ	4	

ปรับระดับจากหมวดย่อย เป็น  
หมวด 1 รายการ

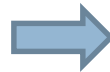


## ปรับตัวอุปสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ monitor ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ

### หมวดอื่น ๆ

#### 1. การโอนเงินในบัญชี FCD ระหว่างกัน

Code	Value
318141	อื่น ๆ
318142	ธนบัตรเงินบาทและบัญชีเงินฝาก
318217	บัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ (FCD)
318143	ถอนจากบัญชี FCD เพื่อขายรับบาท
318144	โอนเงินในบัญชี FCD ของตนเอง
318145	โอนเงินในบัญชี FCD ของธุรกิจในเครือ
318210	โอนเงินในบัญชี FCD ระหว่างบุคคลอื่น
318218	ซื้อและฝากเงินตราต่างประเทศที่ซื้อจากในประเทศเข้าบัญชี
318211	ฝากเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินในต่างประเทศ



Code	Value
318145	โอนเงินในบัญชี FCD ของธุรกิจในเครือ
New	โอนเงินในบัญชี FCD ของศูนย์บริหารเงินกับกลุ่มบริษัท
New	โอนเงินในบัญชี FCD ของศูนย์บริหารเงินกับกลุ่มบริษัทเพื่อการกู้ยืม
New	โอนเงินในบัญชี FCD ของศูนย์บริหารเงินกับกลุ่มบริษัทเพื่อค่าสินค้าและบริการ
New	โอนเงินในบัญชี FCD ของศูนย์บริหารเงินกับกลุ่มบริษัทเพื่อการซื้อขาย FX
New	โอนเงินในบัญชี FCD ของศูนย์บริหารเงินกับกลุ่มบริษัทเพื่อวัตถุประสงค์อื่น
318210	โอนเงินในบัญชี FCD ระหว่างบุคคลอื่น
New	โอนเงินในบัญชี FCD ระหว่างบุคคลอื่นเพื่อค่าสินค้าและบริการ
New	โอนเงินในบัญชี FCD ระหว่างบุคคลอื่นเพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์
New	โอนเงินในบัญชี FCD ระหว่างบุคคลอื่นเพื่อวัตถุประสงค์อื่น

#### เพิ่ม 8 รายการใหม่

- ระดับหมู่ย่อย 1 รายการ
- กิจกรรม 7 รายการ

ยกเลิก 1 รายการ



## ประวัติวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ monitor ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ

หมวดอื่น ๆ

ปรับแก้คำจำกัดความ 1 รายการ

### 2. ปรับแก้คำจำกัดความ

Code	Value	Description
318211	ฝากเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินในต่างประเทศ	ฝากเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินในต่างประเทศเพื่อเก็บไว้ชำระภาระผูกพันในต่างประเทศในอนาคต หรืออื่น ๆ ตามที่เจ้าพนักงานอนุญาต
318224	เพื่อการลงทุนในตราสาร	ผู้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศฝากเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินในต่างประเทศ เพื่อการลงทุนในตราสารต่างประเทศ
318225	เพื่อวัตถุประสงค์อื่น	ผู้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศฝากเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินในต่างประเทศ เพื่อวัตถุประสงค์อื่น ๆ

Code	Value	Description
318211	ฝากเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินในต่างประเทศ	ฝากเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินในต่างประเทศเพื่อเก็บไว้ชำระภาระผูกพันในต่างประเทศในอนาคต หรืออื่น ๆ ตามที่เจ้าพนักงานอนุญาต
318224	เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์หรือเงินฝากเพื่อหาผลตอบแทน	ผู้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศฝากเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินในต่างประเทศ เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศในอนาคต หรือลงทุนในเงินฝากเพื่อหาผลตอบแทน
318225	เพื่อวัตถุประสงค์อื่น	ผู้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศฝากเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินในต่างประเทศ เพื่อวัตถุประสงค์อื่น ๆ



## ประวัติการประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ monitor ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ

### หมวดอื่น ๆ

#### 1. เพิ่มรายการอื่น ๆ

เพิ่ม 1 รายการใหม่

Code	Value	หมวด	หมวดย่อย
318001	บริการ รายได้ และเงินโอนและบริจาค	1	
318002	บริการ		11
318039	รายได้		12
318051	เงินโอนและบริจาค		13
318060	<b>เงินลงทุน (Investment)</b>	2	
318061	เงินลงทุนในธุรกิจในเครือ/สาขา		21
318075	เงินลงทุนในหลักทรัพย์		22
318082	เงินกู้ (Borrowing)		23
318089	เงินให้กู้ยืม (Lending)		24
318096	ปรับฐานะเงินตราต่างประเทศ		25
318111	เงินทุนอื่น ๆ		26
318212	เงินส่วนต่างตามธุรกรรมอนุพันธ์		27
318132	<b>ค่าสินค้า (Goods)</b>	3	
318231	ค่าสินค้าเข้าและสินค้าออก		31
318232	ส่วนลด เงินมัดจำ เงินที่ชำระไว้เกิน และอื่นๆของค่าสินค้า		32
318233	<b>ค่าทองคำ</b>	4	
318141	<b>อื่น ๆ</b>	5	
318142	ธนบัตรเงินบาทและบัญชีเงินฝาก		51
318229	บัญชีเงินบาทของผู้มีถิ่นที่อยู่นอกประเทศ		52
New	อื่นๆ (โปรดระบุรายละเอียด)		53



1. ปรับวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ monitor ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ
2. เพิ่มการรายงาน Unwind / Cancel / Rollover ธุรกรรม Spot Today
3. ปรับเพิ่มการรายงานเหตุผลในการยกเลิกธุรกรรม
4. ยกเลิกการรายงานข้อมูลประกอบการทำธุรกรรม FX เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์และเงินกู้ยืม/เงินให้กู้
5. ยกเลิกการรายงาน Element ที่เกี่ยวข้องกับกิจการวิเทศธนกิจ



## เพิ่มการรายงาน Unwind / Cancel / Rollover ธุรกรรม Spot Today

- **Dataset : FTX**

รองรับการรายงานธุรกรรม **Spot Today** ทั้งการส่งมอบ **Delivery** / การ **Unwind** / การ **Rollover** / การ **Cancel**

โดยมีการเพิ่ม 3 Elements

- **Set Up Reason Type**
- **Previous Arrangement Number**
- **Previous Arrangement FI Code**



## เพิ่มการรายงาน Unwind / Cancel / Rollover ชุกรกรม Spot Today

### เพิ่ม 3 Elements ที่ Dataset FTX เพื่อรองรับการ Unwind / Cancel / Rollover ชุกรกรม Spot Today

<u>New</u> Data Element	Description	เงื่อนไขการตรวจสอบ
Set Up Reason Type (Data Type : Classification)	ใช้รายงานในกรณีที่เป็นการทำสัญญาใหม่ เพื่อต่ออายุสัญญาเดิม (Rollover from Another Arrangement) หรือทำสัญญาตรงข้ามกับสัญญาเดิม (Unwind Another Arrangement) หรือเพื่อทดแทนสัญญาเดิม (Replace a Cancelled Arrangement) (Classification Name: Set Up Reason Type)	รายงานเฉพาะชุกรกรม Spot Today ค่าที่เป็นไปได้คือ 1. Unwind Another Arrangement 2. Rollover from Another Arrangement 3. Replace a Cancelled Arrangement
Previous Arrangement Number (Data Type : Identification Number)	เลขที่สัญญาก่อนหน้า ใช้ในกรณีที่เป็นการทำสัญญาใหม่เพื่อ Rollover, Unwind, Replace a Cancelled Arrangement (ทดแทนสัญญาเดิม) ของชุกรกรม Spot Today	กรณีเป็นการ Settle ชุกรกรม Spot Today แบบ Unwind หรือ Rollover หรือ Cancel สัญญาที่มีการทำสัญญาใหม่ มาทดแทน ให้ระบุเลขที่สัญญาก่อนหน้ามาด้วย
Previous Arrangement FI Code (Data Type : FI Code)	รหัสสถาบันการเงินของสัญญาก่อนหน้า	จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้ กรณี Unwind ถ้ามีค่า ต้องมีค่าเท่ากับ Organization Id เท่านั้น



## เพิ่มการรายงาน Unwind / Cancel / Rollover ธุรกิจ Spot Today

ตัวอย่างการรายงาน

**FTX**

การรายงานธุรกรรม Unwind Spot Today ที่มีการส่งมอบส่วนต่าง (No-Delivery) กรณีวัตถุประสงค์ด้านการลงทุนในหลักทรัพย์

Organization Id	Arrangement Number	Previous Arrangement Number	Previous Arrangement FI Code	FX Arrangement Type	Set Up Reason Type	FX Trading TXN Type	Transaction Purpose	Other Transaction Purpose	Element ประกอบหลักทรัพย์/ เงินกู้
ธนาคาร A	SPT001	-	-	Spot Today	-	No-Delivery	-	-	-
ธนาคาร A	SPT002	SPT001	ธนาคาร A	Spot Today	Unwind	No-Delivery	-	-	-





## เพิ่มการรายงาน Unwind / Cancel / Rollover ธุรกิจ Spot Today

ตัวอย่างการรายงาน

**FTX**

การรายงานกรณี ยกเลิกการทำธุรกรรม Spot Today

Organization Id	Arrangement Number	Previous Arrangement Number	Previous Arrangement FI Code	FX Arrangement Type	Set Up Reason Type	FX Trading TXN Type	Transaction Purpose	Other Transaction Purpose	Element ประกอบหลักทรัพย์/ เงินกู้
ธนาคาร A	SPT003	-	-	Spot Today	-	Cancel	-	-	-



1. ปรับวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ monitor ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ
2. เพิ่มการรายงาน Unwind / Cancel / Rollover ธุรกรรม Spot Today
3. ปรับเพิ่มการรายงานเหตุผลในการยกเลิกธุรกรรม
4. ยกเลิกการรายงานข้อมูลประกอบการทำธุรกรรม FX เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์และเงินกู้ยืม/เงินให้กู้
5. ยกเลิกการรายงาน Element ที่เกี่ยวข้องกับกิจการวิเทศธนกิจ



## ปรับเพิ่มการรายงานเหตุผลในการยกเลิกธุรกรรม

- **Dataset : FTX**

เพิ่ม 1 Element

➤ **Cancellation Reason Type**

- **Classification : Cancellation Reason Type**



## ปรับเปลี่ยนการรายงานเหตุผลในการยกเลิกธุรกรรม

เพิ่มการรายงานเหตุผลการไม่ส่งมอบธุรกรรม กรณีการยกเลิก (Cancel) หรือ การ Unwind ธุรกรรม โดยรายงานเฉพาะธุรกรรมการซื้อขายเงินตรา ตปท. แลกบาทของลูกค้ำไทย (ไม่รวมลูกค้ำ NR ตปท. และธุรกรรม Interbank ) ที่ชุดข้อมูล FTX

New Data Element	Description
Cancellation Reason Type (Data Type : Classification)	ระบุเหตุการณ์ ยกเลิก หรือ Unwind ธุรกรรมการซื้อขายเงินตราต่างประเทศ (ไม่รวมการแลกเปลี่ยนสกุล) ของคู่สัญญาที่เป็นลูกค้ำในประเทศที่ไม่ใช่นิติบุคคลรับอนุญาตและธนาคารแห่งประเทศไทย รายงานเฉพาะสัญญาที่มีการ Unwind หรือ Cencel เท่านั้น (Classification Name: Cancellation Reason Type)

### New Classification : Cancellation Reason Type

Code	Value	Description
New	เปลี่ยนแปลง Underlying	ลูกค้ำมีการเปลี่ยนแปลงเงื่อนไขการส่งมอบ FX ตามสัญญา/เอกสารแสดงภาระที่มีกับค้ำในต่างประเทศ
New	เปลี่ยนแปลง/แก้ไข ธุรกรรม FX	การจองซื้อหรือขายเงินตราต่างประเทศผิดสกุลหรือ ผิดด้าน หรือ เกินวงเงิน ซึ่งไม่สอดคล้องกับสัญญา/เอกสาร
New	ไม่สามารถส่งมอบ/รับมอบ FX	ในวันส่งมอบ/รับมอบเงิน ลูกค้ำมีเงินบาทในบัญชีไม่พอ หรือ ยังไม่อนุมัติ วงเงิน LC,TR หรือติดเงื่อนไขการโอนต่างๆ
New	อื่นๆ	



1. ปรับวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ **monitor** ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ
2. เพิ่มการรายงาน **Unwind / Cancel / Rollover** ธุรกรรม **Spot Today**
3. ปรับเพิ่มการรายงานเหตุผลในการยกเลิกธุรกรรม
4. ยกเลิกการรายงานข้อมูลประกอบการทำธุรกรรม **FX** เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์และเงินกู้ยืม/เงินให้กู้
5. ยกเลิกการรายงาน **Element** ที่เกี่ยวข้องกับกิจการวิเทศธนกิจ



## ยกเลิกการรายงานข้อมูลประกอบการทำธุรกรรม FX เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์และเงินกู้ยืม/เงินให้กู้

- **Dataset : FTX , LTX**

**ยกเลิกการรายงาน 13 Elements**



## ยกเลิกการรายงานข้อมูลประกอบการทำธุรกรรม FX เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์และเงินกู้ยืม/เงินให้กู้

### ยกเลิกการรายงาน 13 Elements ดังนี้

กลุ่มข้อมูล	รายละเอียด	Description
เงินลงทุน	Number of Shares	จำนวนหุ้นที่ลงทุน
	Par value per Share	ราคาต่อหุ้นที่ตราไว้
	YTD Accumulated Amount	จำนวนเงินที่ส่งออกไปลงทุนหรือให้กู้ยืมแล้วในปีนี้ (ไม่รวมครั้งนี้)
	Listed in Market Flag	การแจ้งการจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์
	Investment Repatriated Reason	เหตุผลในการนำเงินลงทุนกลับ
เงินกู้ยืม / เงินให้กู้	Term	อายุจริงของสัญญาเงินกู้หรือตราสารหนี้
	Term Unit	หน่วยของอายุเงินกู้หรือตราสารหนี้
	Installment Term	ระยะเวลาระหว่างงวดการชำระคืนเงินต้น
	Installment Term Unit	หน่วยของอายุเงินกู้
	Number of Installments	จำนวนงวดการชำระคืนเงินต้น
	Debt Instrument Issued Date	วันที่ออกตราสารหนี้
	Debt Instrument Issued Amount	จำนวนเงินของตราสารหนี้ที่ออก
	Whole Partial Repayment Flag	การไถ่ถอนตราสารหนี้ เป็นการไถ่ถอนทั้งจำนวน หรือ บางส่วน





## ยกเลิกการรายงานข้อมูลประกอบการทำธุรกรรม FX เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์และเงินกู้ยืม/เงินให้กู้

### วัตถุประสงค์เรื่องเงินลงทุน (Investment)

318061	เงินลงทุนในธุรกิจในเครือ/สาขา
318062	เงินลงทุนในธุรกิจในเครือ/สาขาจากต่างประเทศ (Foreign Direct Investment)
318065	เงินลงทุนในธุรกิจในเครือ/สาขาในต่างประเทศ (Thai Direct Investment)
318075	เงินลงทุนในหลักทรัพย์
318076	เงินลงทุนในหลัก จาก ต่างประเทศ (Foreign Portfolio Investment)
318079	เงินลงทุนหลักทรัพย์ ใน ต่างประเทศ (Thai Portfolio Investment in Foreign Market)
318213	เงินลงทุนในหลักทรัพย์ <b>ตปท.</b> ใน ตปท.
318216	เงินลงทุนในหลักทรัพย์ <b>ไทย</b> ใน ตปท.
318171	เงินลงทุนในตราสารหนี้ของ ตปท. ที่ออกในประเทศ (Thai Portfolio Investment in Domestic market)

### วัตถุประสงค์เรื่องเงินกู้ (Borrowing)

318083	เงินกู้ยืม (Foreign Loan)
318086	เงินกู้ยืมที่เป็นตราสารหนี้ (Foreign Debt Instrument)

### วัตถุประสงค์เรื่องเงินให้กู้ (Lending)

318090	เงินให้กู้ยืม (Thai Loan)
318093	เงินให้กู้ที่เป็นตราสารหนี้ (Thai Debt Instrument)





## ยกเลิกการรายงานข้อมูลประกอบการทำธุรกรรม FX เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์และเงินกู้ยืม/เงินให้กู้

ตัวอย่างการรายงานข้อมูลประกอบ กรณีธุรกรรมที่มีวัตถุประสงค์เป็นเงินให้กู้ยืม (318090)

รายงาน 14 Elements ที่เกี่ยวข้อง

เดิม

TXN Purpose Code	TXN Purpose Name	Related Involved Party Business Type	Relationship with Related Involved Party	Term Range	Term	Term Unit	Maturity Date	Number of Installments	Installment Term	Installment Term Unit	First Installment Date	Interest Rate Type	Interest Rate	Interest Rate Margin	YTD Accumulated Amount
318090	เงินให้กู้ยืม	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓

ใหม่

รายงาน 6 Elements ที่เกี่ยวข้อง

TXN Purpose Code	TXN Purpose Name	Related Involved Party Business Type	Relationship with Related Involved Party	Term Range	Term	Term Unit	Maturity Date	Number of Installments	Installment Term	Installment Term Unit	First Installment Date	Interest Rate Type	Interest Rate	Interest Rate Margin	YTD Accumulated Amount
318090	เงินให้กู้ยืม			✓			✓				✓	✓	✓	✓	



1. ปรับวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมเพื่อให้สามารถ monitor ข้อมูลรองรับการผ่อนคลายระเบียบ
2. เพิ่มการรายงาน Unwind / Cancel / Rollover ธุรกรรม Spot Today
3. ปรับเพิ่มการรายงานเหตุผลในการยกเลิกธุรกรรม
4. ยกเลิกการรายงานข้อมูลประกอบการทำธุรกรรม FX เพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์และเงินกู้ยืม/เงินให้กู้
5. ยกเลิกการรายงาน Element ที่เกี่ยวข้องกับกิจการวิเทศธนกิจ



## ยกเลิกการรายงาน Element ที่เกี่ยวข้องกับกิจการวิเทศนกิจ

- Dataset : FXA , SWA , OPA , FRA , FLA , DAR

### ยกเลิกการรายงาน 1 Element

#### ➤ Element Primary Involved Party IBF Indicator

Data Element	Description
Primary Involved Party IBF Indicator (Classification Name: IBF Indicator)	<p>ในกรณีที่ผู้ฝากเป็นกิจการวิเทศนกิจใช้ประเภทธุรกิจของกิจการวิเทศนกิจ ได้แก่</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><b>Out-out</b> : กิจการวิเทศนกิจขออนุญาตให้ประกอบกิจการวิเทศนกิจเพื่อการให้กู้ยืมในต่างประเทศ</li> <li><b>Out-in</b> : กิจการวิเทศนกิจขออนุญาตให้ประกอบกิจการวิเทศนกิจเพื่อการให้กู้ยืมในประเทศ</li> <li><b>Out-in Baht</b> : กิจการวิเทศนกิจขออนุญาตให้ประกอบกิจการวิเทศนกิจเพื่อการรับฝากหรือการกู้ยืมจากต่างประเทศโดยมีวัตถุประสงค์เพื่อการให้กู้ยืมเป็นเงินบาทในต่างจังหวัด</li> </ul>





Data Set	Modified Element
FXA	<ul style="list-style-type: none"> <li>FX Arrangement Purpose</li> </ul>
	Deleted Element
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Primary Involved Party IBF Indicator</li> </ul>

Data Set	Modified Element
SWA	<ul style="list-style-type: none"> <li>CCIRS Arrangement Purpose</li> </ul>
	Deleted Element
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Primary Involved Party IBF Indicator</li> </ul>

Data Set	Modified Element
FTU	<ul style="list-style-type: none"> <li>Inflow Transaction Purpose</li> <li>Outflow Transaction Purpose</li> </ul>

Data Set	Modified Element
OPA	<ul style="list-style-type: none"> <li>Options Purpose Code</li> </ul>
	Deleted Element
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Primary Involved Party IBF Indicator</li> </ul>

Data Set	Modified Element
FRA	<ul style="list-style-type: none"> <li>FRA Arrangement Purpose Code</li> </ul>
	Deleted Element
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Primary Involved Party IBF Indicator</li> </ul>

Data Set	Modified Element
EPE	<ul style="list-style-type: none"> <li>Source Transaction Purpose Code</li> <li>Used Transaction Purpose Code</li> </ul>

Data Set	Deleted Element
FLA, DAR	<ul style="list-style-type: none"> <li>Primary Involved Party IBF Indicator</li> </ul>



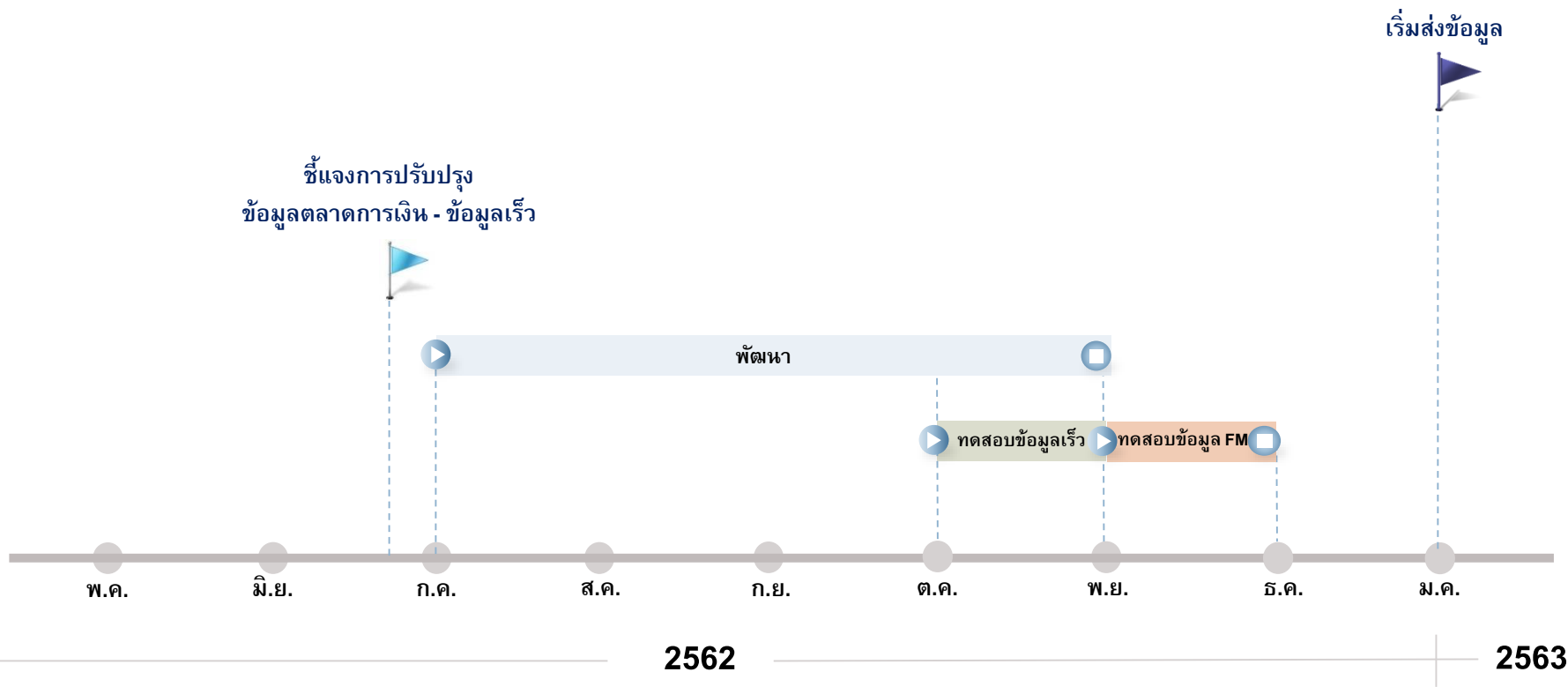
Data Set	Modified Element
LTX	<ul style="list-style-type: none"> <li>Inflow Transaction Purpose</li> <li>Outflow Transaction Purpose</li> </ul>
	<b>Deleted Element</b>
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Listed in Market Flag</li> <li>Investment Repatriated Reason</li> <li>Number of Shares</li> <li>Par value per Share</li> <li>YTD Accumulated Amount</li> <li>Term</li> <li>Term Unit</li> <li>Number of Installments</li> <li>Installments Term</li> <li>Installments Term Unit</li> <li>Whole Partial Repayment Flag</li> <li>Debt Instrument Issued Date</li> <li>Debt Instrument Issued Amount</li> </ul>

Data Set	New Element
FTX	<ul style="list-style-type: none"> <li>Cancellation Reason Type</li> <li>Set Up Reason Type</li> <li>Previous Arrangement Number</li> <li>Previous Arrangement FI Code</li> </ul>
	<b>Modified Element</b>
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Inflow Transaction Purpose</li> <li>Outflow Transaction Purpose</li> </ul>
	<b>Deleted Element</b>
	<ul style="list-style-type: none"> <li>Listed in Market Flag</li> <li>Investment Repatriated Reason</li> <li>Number of Shares</li> <li>Par value per Share</li> <li>YTD Accumulated Amount</li> <li>Term</li> <li>Term Unit</li> <li>Number of Installments</li> <li>Installments Term</li> <li>Installments Term Unit</li> <li>Whole Partial Repayment Flag</li> <li>Debt Instrument Issued Date</li> <li>Debt Instrument Issued Amount</li> </ul>

Data Set	Modified Element
FXM	<ul style="list-style-type: none"> <li>Transaction Purpose</li> </ul>

Data Set	Modified Element
OLB	<ul style="list-style-type: none"> <li>Underlying Purpose Type</li> </ul>





## ประเด็นหารือ

1. การรายงานวัตถุประสงค์ให้สอดคล้องกับ Underlying
2. ธุรกรรมที่ขออนุญาต และได้รับเลขที่หนังสืออนุญาต
3. การรายงานข้อมูลผู้รับเงิน หรือ ผู้ส่งเงิน
4. การรายงานข้อมูล Objective Type
5. การโอนย้ายเงินจากบัญชี FCD
6. การรายงานข้อมูลบัญชี FCD
7. การรายงานธุรกรรม Unwind หรือ Rollover



## การรายงานวัตถุประสงค์ให้สอดคล้องกับ Underlying



### ประเด็นที่พบ

1. รายงานวัตถุประสงค์ในวันทำสัญญาและวันส่งมอบคนละหมวด เช่น
  - วันทำสัญญารายงานเรื่อง “ค่าสินค้า” แต่วันส่งมอบรายงานเป็น “การลงทุนในหลักทรัพย์”
2. รายงานไม่สอดคล้องกับ Underlying ที่ใช้ เช่น
  - รายงาน “คืนเงินกู้ยืม” แต่ Underlying คือ “ชำระคืนเงินกู้ที่เป็นตราสารหนี้ ไม่ใช่เงินกู้ปกติ”
  - รายงาน “รายได้ส่งกลับของแรงงาน” แต่ Underlying คือ “ค่าบริการภาครัฐบาล”
3. รายงานไม่ถูกต้องอันเนื่องจากความเข้าใจที่คลาดเคลื่อน เช่น
  - รายงาน “เงินทุนอื่น ๆ” (การโอนเงินไปยังบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ) แต่ Underlying คือ “ฝากเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินในต่างประเทศ”





## ธุรกรรมที่ขออนุญาต และได้รับเลขที่หนังสืออนุญาต

กรณีธุรกรรมนั้นมีการขอเลขที่หนังสืออนุญาต ให้รายงานเลขที่หนังสืออนุญาตพร้อมวันที่ มากับ Transaction ด้วย

**Dataset : FXA , OPA , SWA , FTX , LTX , EPE**

Data Element	Description	การตรวจสอบข้อมูล
Approval Document Number	เลขที่หนังสืออนุญาตเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน (อาจมีได้มากกว่า 1 ต่อรายการ) โดยระบุเฉพาะกรณีที่ได้รับอนุญาตจากเจ้าพนักงานแลกเปลี่ยนเงินเป็นการเฉพาะราย	
Approval Document Date	วันที่หนังสืออนุญาตเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน ใ้ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2550 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2007-10-31	กรณี Approval Document Number มีค่าแล้ว Approval Document Date ต้องมีค่า



### ประเด็นที่พบ

1. ไม่รายงานเลขที่หนังสืออนุญาตในธุรกรรมที่ได้รับอนุญาต
2. รายงานเลขที่หนังสืออนุญาตไม่ถูกต้อง
3. รายงานเลขที่หนังสืออนุญาต ในธุรกรรมที่ไม่ต้องขออนุญาต



## การรายงานข้อมูลผู้รับเงิน หรือ ผู้ส่งเงิน

กรณีลูกค้าทำธุรกรรมแล้วมีการส่งเงินไปให้บุคคลอื่น หรือ รับเงินจากบุคคลอื่นเพื่อมาทำธุรกรรม ให้รายงานรายละเอียดของบุคคลนั้น

**Dataset : FTX , LTX**

Data Element	Description
Beneficiary or Sender Name	ชื่อผู้รับเงินตราต่างประเทศ ( <i>Beneficiary Name</i> ) หรือผู้ส่งเงินตราต่างประเทศ ( <i>Sender Name</i> ) เฉพาะธุรกรรมที่ไม่ใช่ <i>interbank</i>
Country Id of Beneficiary or Sender	รหัสประเทศของผู้รับเงิน ( <i>Beneficiary Country</i> ) หรือ รหัสประเทศของผู้ส่งเงิน ( <i>Sender Country</i> ) ( <i>Classification Name: Country Id</i> )
Relationship with Beneficiary or Sender	รหัสแสดงประเภทความสัมพันธ์ของ <b>Primary Involved Party</b> หรือ <b>Exercising Involved Party</b> กับ <b>Beneficiary or Sender</b> แล้วแต่กรณี มีค่าได้ดังนี้ 1) ธุรกิจในเครือ/สาขา : สัดส่วนการลงทุนตั้งแต่ร้อยละ 10 ขึ้นไป <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>Parent</b> : บริษัทแม่ ที่มีสัดส่วนการลงทุนในบริษัทลูกตั้งแต่ร้อยละ 10 ขึ้นไป</li> <li>• <b>Child</b> : บริษัทลูก ที่มีสัดส่วนการลงทุนจากบริษัทแม่ตั้งแต่ร้อยละ 10 ขึ้นไป</li> </ul> 2) อื่น ๆ : มีสัดส่วนการลงทุนน้อยกว่าร้อยละ 10 ( <i>Classification Name: Involved Party Involved Party Relationship Type</i> )



## การรายงานข้อมูลผู้รับเงิน หรือ ผู้ส่งเงิน

กรณีลูกค้าทำธุรกรรมแล้วมีการส่งเงินไปให้บุคคลอื่น หรือ รับเงินจากบุคคลอื่นเพื่อมาทำธุรกรรม ให้รายงานรายละเอียดของบุคคลนั้น

**Dataset : FTX , LTX**



### ประเด็นที่พบ

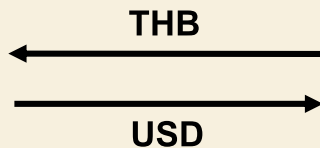
1. รายงาน ชื่อ ประเทศ หรือ เลขที่บัญชี ผู้รับ/ส่งเงินไม่ถูกต้อง เช่นการซื้อ FX เพื่อส่งไปวาง margin ในต่างประเทศ ต้องการให้รายงานข้อมูลผู้รับเงินปลายทางที่ส่งเงินไป
2. รายงานชื่อ สง. (Provider) หรือ ผู้ที่ได้รับมอบอำนาจมาทำการแทน ซึ่งไม่ถูกต้อง ควรรายงานชื่อผู้รับ/ส่งเงิน



## การรายงานข้อมูลผู้รับเงิน หรือ ผู้ส่งเงิน

ตัวอย่างการรายงาน

**กรณีที่ 1 :** ลูกค้านไทยซื้อ USD เพื่อชำระค่าทองคำนำเข้าจากต่างประเทศ (Bank Sell USD)



### แนวทางการรายงานธุรกรรมซื้อขายเงินตราต่างประเทศที่ Dataset FTX

Element ที่เกี่ยวข้อง	แนวทางการรายงาน
Primary Involve Party	ลูกค้านไทย นาย ก
Beneficiary or Sender Name	บริษัท A
Country Id of Beneficiary or Sender	สิงคโปร์ (SG)
Relationship with Beneficiary or Sender	อื่นๆ



## การรายงานข้อมูลผู้รับเงิน หรือ ผู้ส่งเงิน

## ตัวอย่างการรายงาน

**กรณีที่ 2 :** บริษัทแม่ (Company A) ในต่างประเทศโอนเงินมาลงทุนในบริษัทลูกที่ตั้งอยู่ในไทย (บริษัท ก) ผ่านบัญชี FCD



### แนวทางการรายงานการเปิดบัญชีที่ Dataset DAR

Element ที่เกี่ยวข้อง	แนวทางการรายงาน
FI Arrangement Number	เลขที่บัญชี FCD ของ บริษัท ก
Deposit Account Type	SFCD
Primary Involved Party	บริษัท ก

### แนวทางการรายงานธุรกรรมฝากเงินที่ Dataset LTX

Element ที่เกี่ยวข้อง	แนวทางการรายงาน
FI Arrangement Number	เลขที่บัญชี FCD ของ บริษัท ก
Loan Deposit Transaction Type	Deposit (Principle)
Beneficiary or Sender Name	Company A
Country Id of Beneficiary or Sender	สหรัฐอเมริกา (US)
Relationship with Beneficiary or Sender	Child



## การรายงานข้อมูลบัญชี FCD

กรณีมีการปิดบัญชีให้รายงานแจ้งการปิดบัญชี

**Dataset : LTX**

Data Element	Description
<b>Loan Deposit Transaction Type</b>	<p>ให้ใส่รหัสประเภทรายการ ได้แก่</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1) กรณีที่สถาบันการเงินกู้ยืม หรือให้กู้ยืม ให้ใช้รหัส <b>Disbursement</b></li> <li>2) กรณีที่สถาบันการเงินชำระคืนเงินกู้ยืม หรือรับชำระคืนเงินให้กู้ยืม ให้ใช้รหัสย่อยซึ่งอยู่ภายใต้ <b>Repayment</b> ระบุว่าเป็น Principal (เงินต้น) หรือ Interest (ดอกเบี้ย) หรือ Fee (ค่าธรรมเนียม) แล้วแต่กรณี</li> <li>3) กรณีที่สถาบันการเงินรับฝากเงิน ให้ใช้รหัสย่อยซึ่งอยู่ภายใต้ <b>Deposit</b> ระบุว่าเป็น Principal หรือ Interest แล้วแต่กรณี</li> <li>4) กรณีที่ผู้ฝากเงินถอนเงินจากบัญชีรับเงินฝาก ให้ใช้รหัส <b>Withdraw</b></li> <li>5) กรณีที่สัญญาเงินกู้ หรือเงินให้กู้ยืม หรือบัญชีเงินรับฝาก มีรายการเคลื่อนไหว ให้รายงานยอดคงเหลือยกไป ณ สิ้นวันทำการของวันที่เกิดธุรกรรมของแต่ละสัญญาหรือบัญชีเงินรับฝาก แล้วแต่กรณี โดยใช้รหัส <b>Balance This Period</b></li> <li>6) กรณีที่ผู้ฝากเงินปิดบัญชีเงินรับฝาก ให้ใช้รหัส <b>Close Account</b> ในกรณีนี้จำนวนเงินของรายการ (Transaction Amount) ต้องมีค่าเท่ากับ 0 เท่านั้น</li> </ol> <p><i>Classification Name : Loan Deposit Transaction Type</i></p>



### ประเด็นที่พบ

1. จำนวนบัญชี FCD ที่เปิดไว้และมียอดคงค้างเป็นศูนย์ มีจำนวนมาก ขอให้ สง. ตรวจสอบสถานะของบัญชี FCD เพิ่มเติม
2. รายงานประเภทบัญชีที่ Dataset DAR ไม่ถูกต้อง



## การรายงาน Objective Type

การรายงานธุรกรรมกรณีทำเพื่อตนเอง / เพื่อธุรกิจในเครือ / เพื่อลูกค้า หรือ เพื่อศูนย์บริหารเงิน

**Dataset : FTX , FXA , OPA , SWA , FRA , DAR**

Data Element	Description
Objective Type	<p>ประเภทการทำธุรกรรมของคู่สัญญาของสถาบันการเงิน ได้แก่  <b>ธุรกรรมเพื่อธุรกิจในเครือ, ธุรกรรมเพื่อตนเอง, ธุรกรรมเพื่อลูกค้า หรือ ธุรกรรมเพื่อศูนย์บริหารเงิน</b>                      รายงานกรณีลูกค้าผู้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศที่ไม่ใช่นิติบุคคลรับอนุญาต หรือรพท.  <i>Classification Name : Objective Type</i></p>



### ประเด็นที่พบ

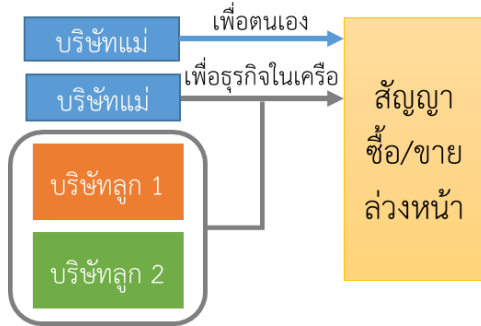
ทำธุรกรรมแทนธุรกิจในเครือ แต่รายงาน Objective Type เป็น “เพื่อตนเอง” ไม่รายงานเป็น “เพื่อธุรกิจในเครือ”



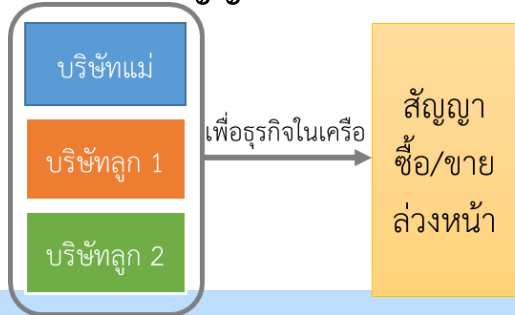
## การทำธุรกรรมป้องกันความเสี่ยงแทนเครีอ

### Trade Date

บริษัทแม่ทำสัญญาของตนเอง และแทนเครีอ

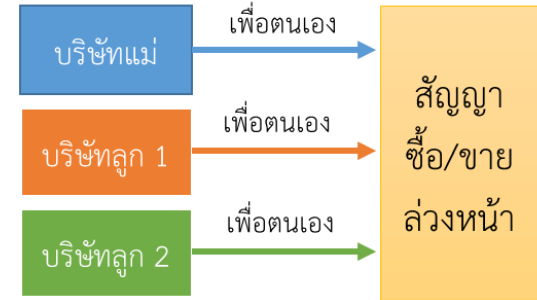


บริษัทแม่ทำสัญญารวมของตนเองและเครีอ



### Settlement Date

ส่งมอบโดยใช้ Underlying ตนเอง







## การรายงาน Objective Type

การรายงานธุรกรรมกรณีป้องกันความเสี่ยงแทนเครือข่าย

บริษัท ก เป็นผู้ขอทำธุรกรรมป้องกันความเสี่ยง FX แทนบริษัทในเครือ (credit line บริษัท ก) ซึ่งประกอบด้วย บริษัท ข และ บริษัท ค ณ วันทำสัญญา

FI Arrangement Number	Primary Involved Party	FX Arrangement Type	FX Arrangement Purpose Code	Objective Type	Buy CCY	Buy Amount	Sell CCY	Sell Amount
X001	บริษัท ก	Forward	ค่าสินค้า	เพื่อธุรกิจในเครือ	THB	330,000	USD	10,000

ณ วันส่งมอบ บริษัท ก บริษัท ข และบริษัท ค Exercise สัญญาด้วยตนเอง

FI Arrangement Number	FX Arrangement Type	FX Arrangement Purpose Code	Objective Type	Exercising Involved Party	Buy CCY	Buy Amount	Sell CCY	Sell Amount
X001	Forward	ค่าสินค้า	เพื่อตนเอง	บริษัท ก	THB	132,000	USD	4,000
X001	Forward	ค่าสินค้า	เพื่อตนเอง	บริษัท ข	THB	66,000	USD	2,000
X001	Forward	ค่าบริการ	เพื่อตนเอง	บริษัท ค	THB	132,000	USD	4,000



## การรายงานการโอนเงินไปฝากในต่างประเทศเพื่อผลตอบแทน

ประเภทบัญชีที่โอน	แนวทางการรายงาน
1. กรณี บล. ในฐานะตัวแทนการลงทุนพนาย ก ไปลงทุนฝากเงินเพื่อการลงทุนในต่างประเทศ โดย <u>บล. ซื้อเงินแทน เพื่อโอนไปฝากเข้าบัญชี FCD ในต่างประเทศ ของ บล. ที่เปิดเพื่อลูกค้า (Omnibus Account)</u>	Objective Type: เพื่อลูกค้า Beneficiary: บล. Country of Beneficiary: ประเทศที่ไปเปิดบัญชี (ต่างประเทศ)
2. กรณี บล. ในฐานะตัวแทนการลงทุนพนาย ก ไปลงทุนฝากเงินเพื่อการลงทุนในต่างประเทศ โดย <u>นาย ก ถอนเงินจาก DSFCD ของตนเองเพื่อโอนไปฝากเข้าบัญชี FCD ในต่างประเทศ ของ บล. ที่เปิดเพื่อลูกค้า (Omnibus Account)</u>	Objective Type: เพื่อตนเอง Beneficiary: บล. Country of Beneficiary: ประเทศที่ไปเปิดบัญชี (ต่างประเทศ)
3. กรณี บล. ในฐานะตัวแทนการลงทุนพนาย ก ไปลงทุนฝากเงินเพื่อการลงทุนในต่างประเทศ โดย <u>บล. ซื้อเงินแทน เพื่อโอนไปฝากเข้าบัญชี นาย ก ซึ่งได้รับอนุญาตเป็นรายกรณี (Segregate Account)</u>	Objective Type: เพื่อลูกค้า Beneficiary: นาย ก Country of Beneficiary: ประเทศที่ไปเปิดบัญชี (ต่างประเทศ)
4. กรณี <u>นาย ก เป็น Qualified Investor (QI) ต้องการไปลงทุนฝากเงินเพื่อการลงทุนในต่างประเทศ โดยซื้อเงินเพื่อโอนไปฝากเข้าบัญชี FCD ในต่างประเทศของตนเอง</u>	Objective Type: เพื่อตนเอง Beneficiary: นาย ก Country of Beneficiary: ประเทศที่ไปเปิดบัญชี (ต่างประเทศ)



## การรายงานการโอนเงินเพื่อวาง margin

ประเภทบัญชีที่โอน	แนวทางการรายงาน
กรณี บริษัท ก โอนเงินไปจ่าย Margin ให้กับ Supplier ในต่างประเทศ (โอนเข้าบัญชี Supplier)	Objective Type: เพื่อตนเอง Beneficiary: Supplier ในต่างประเทศ Country of Beneficiary: ประเทศที่เปิดบัญชี (ต่างประเทศ) ของ Supplier



## การรายงานธุรกรรม Unwind หรือ Rollover

กรณี Unwind หรือ Rollover ธุรกรรม Forward , FX Swap , Spot Next และ Spot Tomorrow ต้องระบุว่าธุรกรรมดังกล่าวเป็นการ Unwind หรือ Rollover มาจากสัญญาใดให้ถูกต้อง ห้ามรายงานสัญญาที่ 2 ว่าเป็น New Contract

Dataset : FXA , FTX

### FXA

Element	Description
FI Arrangement Number	เลขที่สัญญา
Previous Arrangement Number	เลขที่สัญญาก่อนหน้า
Previous Arrangement FI Code	รหัสสถาบันการเงินของสัญญาก่อนหน้า
Set Up Reason Type	Rollover / Unwind / Cancel with replacing

### FTX

Element	Description
FI Arrangement Number	เลขที่สัญญา
FX Trading Transaction Type	ประเภทการส่งมอบ เช่น Delivery , No Delivery , Cancel , Rollover เป็นต้น
Cancellation Reason Type	เหตุผลการยกเลิกสัญญา



### ประเด็นที่พบ

1. กรณีที่มีทำสัญญาเพื่อ Unwind หรือ Rollover สัญญาก่อนหน้า แต่รายงานสัญญาใหม่มาเป็น New Contract
2. กรณี Rollover ต่างธนาคาร รายงานเลขที่สัญญาก่อนหน้า (Previous Arrangement Number) ของธนาคารอื่นไม่สอดคล้องกับสัญญาที่อีกธนาคารรายงานมา



## ตัวอย่างการรายงานการรายงานธุรกรรม Rollover / Unwind ภายในธนาคารเดียวกัน

การรายงานธุรกรรม Unwind โดยสัญญาที่ 2 ทำขึ้นเพื่อ Unwind สัญญาที่ 1

### FXA

การรายงาน ณ วันที่ทำสัญญาที่ Dataset FXA

Organization ID	FI Arrangent Number	Previous Arrangement Number	Previous Arrangement FI Code	Set Up Reason Type	FX Arrangement Type
ธนาคาร A	FWD001	-	-	-	Forward
ธนาคาร A	FWD002	FWD001	ธนาคาร A	Unwind	Forward

สัญญาที่ 1

สัญญาที่ 2

### FTX

การรายงาน ณ วันที่ส่งมอบที่ Dataset FTX

Organization ID	FI Arrangent Number	FX Trading Transaction Type	Cancellation Reason Type
ธนาคาร A	FWD001	No Delivery	เปลี่ยนแปลง Underlying
ธนาคาร A	FWD002	No Delivery	เปลี่ยนแปลง Underlying

สัญญาที่ 1

สัญญาที่ 2



## ตัวอย่างการรายงานธุรกรรม Rollover ต่างธนาคาร

การรายงานธุรกรรม Rollover ต่างธนาคาร สัญญาที่ 4 ทำขึ้นเพื่อ Rollover สัญญาที่ 3

### FXA

การรายงาน FXA และ FTX ของธนาคาร A



Organization ID	FI Arragent Number	Previous Arrangement Number	Previous Arrangement FI Code	Set Up Reason Type	FX Arrangement Type
ธนาคาร A	FWD003	-	-	-	Forward

### FTX

Organization ID	FI Arragent Number	FX Trading Transaction Type
ธนาคาร A	FWD003	Delivery

### FXA

การรายงาน FXA และ FTX ของธนาคาร B



Organization ID	FI Arragent Number	Previous Arrangement Number	Previous Arrangement FI Code	Set Up Reason Type	FX Arrangement Type
ธนาคาร B	SWP004	FWD003	ธนาคาร A	Rollover	Swap

### FTX

Organization ID	FI Arragent Number	FX Trading Transaction Type
ธนาคาร B	FWD004	Delivery



ผู้ประสานงาน	ช่องทางการติดต่อ
กิตติพงษ์ สุขสม	โทร : 0-2283-5119 Email : KittipoS@bot.or.th
นันทนา มัคพันธ์	โทร : 0-2283-5175 Email : NuntanaM@bot.or.th
กิงนภา แสงสุวรรณ	โทร : 0-2356-7328 Email : KingnapS@bot.or.th
ดวงฤดี เหมทานนท์	โทร : 0-2356-7411 Email : DoungruT@bot.or.th
ปิยาภา มีประมุข	โทร : 0-2356-7724 Email : PiyaphaM@bot.or.th
ศิวพร สุขสถาพร	โทร : 0-2283-5150 Email : SiwaporS@bot.or.th
ดลยา สีมานนทปริญา	โทร : 0-2283-6498 Email : DonlayaS@bot.or.th



ธนาคารแห่งประเทศไทย  
BANK OF THAILAND



# Q & A