

**การประชุมชี้แจง
การปรับปรุงชุดข้อมูลด้านตลาดการเงิน (DMS FM)
ประจำปี 2561**

29 มิถุนายน 2561

เวลา	หัวข้อบรรยาย
8.30-9.25	ลงทะเบียน / รับประทานอาหารว่าง
9.30-9.40	ประธานกล่าวเปิดงาน
9.40-12.00	<p>การปรับปรุงชุดข้อมูลเร็ว</p> <ul style="list-style-type: none"> ■ การปรับชุดข้อมูลเร็วเงินตราต่างประเทศ (FOX I) ■ การปรับชุดข้อมูลมาตรการป้องปรามการแก๊งค์กำไร (NRLB)
	<p>การปรับปรุง Data Set : FM</p> <ul style="list-style-type: none"> ■ การปรับชุดข้อมูล FM Data Set ■ การปรับชุดข้อมูลอัตราดอกเบี้ยและค่าธรรมเนียม FCD ■ กรอบเวลาการดำเนินการ ■ ถาม-ตอบ

ขอบเขตการปรับปรุงชุดข้อมูลด้านตลาดการเงิน

ข้อมูลซื้อขายเงินตราต่างประเทศระหว่างวัน (FOXI)

ติดตามแรงกดดันค่าเงินบาท

- ข้อมูลธุรกรรมซื้อขายเงินตรา ตปท. (FXM)
- เพิ่ม Key In timestamp และ trade time
- **ปรับลด**วัตถุประสงค์การทำธุรกรรมให้สอดคล้องกับ DMS

ข้อมูลการกู้หรือให้กู้แก่ NR (NRLB)

ปรับเพื่อสอดคล้องกับ DMS

- ข้อมูลการกู้/ให้กู้แก่ผู้มีถิ่นอยู่นอกประเทศ
- **ปรับลด**วัตถุประสงค์การทำธุรกรรมให้สอดคล้องกับ DMS

ข้อมูลธุรกรรมเงินตรา ตปท. (DMS FM)

ปฏิรูปกฎเกณฑ์การควบคุมการแลกเปลี่ยน

- **ปรับลด**เหตุผลในการยกเลิกการ unwind Hedging (FTX)
- ปรับให้รองรับธุรกรรม Rollover และ Unwind ต่างธนาคาร (FXA)

ลดภาระของสง.และผู้ประกอบการ

- **ปรับลด**จำนวนวัตถุประสงค์การทำธุรกรรม (8 Data Sets)
- ปรับการรายงานวัตถุประสงค์ของ ศูนย์บริหารเงิน (8 Data Sets)
- ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรม ผ่านสกุลเงินท้องถิ่น (ACCD – Local Currency) (5 Data Sets)

ความต้องการใหม่

- เพิ่ม Key In timestamp
- ปรับเพิ่ม Involved Party Type สำหรับข้อมูลยอดคงค้างของ สินทรัพย์และหนี้สิน (DIP)
- ปรับเพิ่มประเภทบัญชี SNA เพื่อรองรับมาตรการป้องปรามฯ (DAR)

ข้อมูลอัตราดอกเบี้ยและค่าธรรมเนียม FCD (DMS FM)

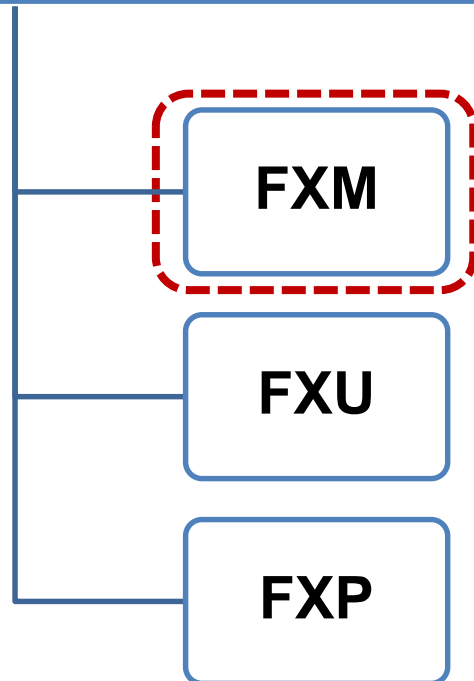
เพื่อให้สามารถเปรียบเทียบ

อัตราดอกเบี้ยและค่าธรรมเนียมระหว่างธนาคาร

- ปรับการรายงานรายการสกุลเงินและแยก element ให้ชัดเจน (4 Data Sets)

- การปรับชุดข้อมูลเร็วเงินตราต่างประเทศ (FOXI)
- การปรับชุดข้อมูลมาตรการป้องปรามการเก็งกำไร (NRLB)
- การปรับชุดข้อมูล FM Data Set
- การปรับชุดข้อมูลอัตราดอกเบี้ยและค่าธรรมเนียม FCD
- กรอบเวลาดำเนินการ

FX Trading (FOX I)



สรุปการปรับชุดข้อมูล

1. **Transaction purpose** : ปรับ Classification
2. **Trade Date** : ปรับเพิ่มเวลา
3. **Key in timestamp** : New Element
4. **Set up Reason Type** : New Element

รายละเอียดการรับชุดข้อมูลเงินตราต่างประเทศ (FOX I)

Data File กลุ่ม FX Trading : FX Trading Transaction $\geq 1,000,000$ USD (FXM)

New Data Element	Description	เงื่อนไขการรายงาน
Key In Timestamp (Data Type : Timestamp)	วันเวลาที่นำข้อมูลเข้าระบบ รูปแบบเป็น YYYY-MM-DD HH:MM:SS เช่น ทำธุรกรรม วันที่ 1 พฤศจิกายน 2561 เวลา 10.35 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2018-11-01 10:35:00	ระบุวันเวลาที่นำข้อมูลเข้าระบบ (First Key in time)
Set up Reason Type (Data Type : Classification)	ใช้รายงานในกรณีที่เป็นการทำสัญญาใหม่เพื่อ <ul style="list-style-type: none"> ต่ออายุสัญญาเดิม (Rollover from Another Arrangement) ทำสัญญาตรงข้ามกับสัญญาเดิม (Unwind Another Arrangement) หรือ ทดแทนสัญญาเดิม (Replace a Cancelled Arrangement) 	รายงานระบุประเภทสัญญาเกิดใหม่ที่เกิดจาก Rollover Unwind และ Replace a Cancelled Arrangement จากเดิมที่รายงานใน Arrangement Remarks

รายละเอียดการปรับชุดข้อมูลเงินตราต่างประเทศ (FOX I)

Data File กลุ่ม FX Trading : FX Trading Transaction $\geq 1,000,000$ USD (FXM)

Modified Data Element	Description	สรุปการเปลี่ยนแปลง
Trade Date (Data Type : Timestamp)	วันเวลาที่ตกลงซื้อ รูปแบบเป็น YYYY-MM-DD HH:MM:SS เช่น ทำธุรกรรมวันที่ 1 พฤศจิกายน 2561 เวลา 10:15 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2018-11-01 10:15:00	เปลี่ยน Data Type Format Date --> Timestamp เพื่อให้ ส. รายงานวันและเวลาที่ทำธุรกรรมการซื้อขาย (Deal Done)
Transaction Purpose (Data Type : Classification)	วัตถุประสงค์ในการทำสัญญาให้รายงานเฉพาะธุรกรรมที่ทำกับลูกค้า (Classification Name: Transaction Purpose Code)	ให้รายงาน Transaction Purpose Code ที่ปรับปรุงใหม่ (อ้างอิงเอกสาร Data File Manual , Classification และ Validation Worksheet)

(1) รอบการส่งและการ cut-off ข้อมูลในแต่ละรอบ

รอบการส่งข้อมูล

คงรอบการส่งข้อมูล 4 เวลา (12:00 น., 15:30 น., 16:30 น. และ 8:30 น.)

Cut-off time
สำหรับข้อมูล

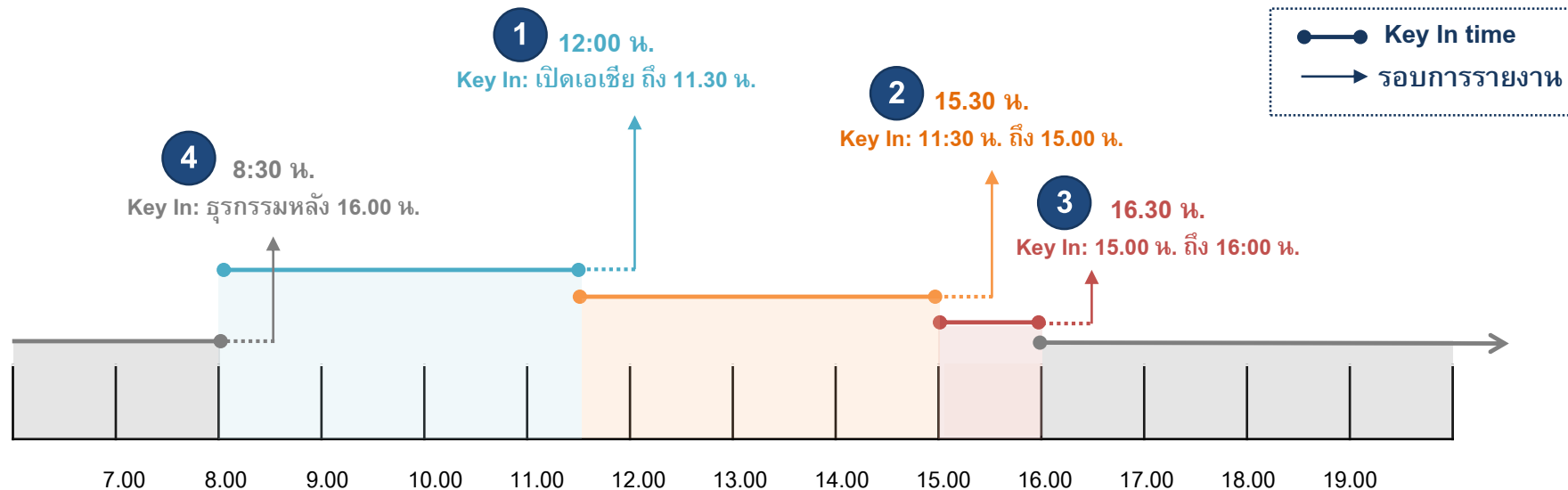
ครอบคลุมธุรกรรมที่ Key In ก่อนรอบการส่งครึ่งชั่วโมง

เช่น รอบการรายงาน 12.00 น. ให้รายงานธุรกรรมที่ Key In ตั้งแต่ช่วงเปิดเอเชียถึง 11.30 น.
(สามารถรายงานธุรกรรมที่เกิดหลัง 11:30 น. ในรอบการรายงาน 12:00 น. ได้)

ธุรกรรม O/N

ธุรกรรมหลัง 16:00 น. ถึง O/N รายงานก่อนเวลา 8.30 น. ในวันทำการถัดไป (t+1)

การรายงานธุรกรรม FOX I ตามรอบเวลาที่มีการ Key In



หมายเหตุ : การส่งข้อมูลในแต่ละรอบจะต้องจัดส่งข้อมูลตั้งแต่รอบแรกรวมมาด้วย

- การรายงานประเภทธุรกรรมให้ถูกต้อง
เช่น ไม่ให้รายงานธุรกรรม FX swap แยกขาเป็นธุรกรรม Spot + Forward ,
Forward + Forward
- การรายงานปริมาณธุรกรรมกรณี **Non-USD** ให้ถูกต้อง
โดยเฉพาะ Element มูลค่า USD equivalent Amount ต้องมีการแปลงสกุลเงินเป็น
USD ก่อนการรายงาน

- การปรับชุดข้อมูลเร็วเงินตราต่างประเทศ (FOXI)
- การปรับชุดข้อมูลมาตรการป้องปรามการเก็งกำไร (NRLB)
- การปรับชุดข้อมูล FM Data Set
- การปรับชุดข้อมูลอัตราดอกเบี้ยและค่าธรรมเนียม FCD
- กรอบเวลาดำเนินการ

การปรับชุดข้อมูลมาตรการป้องปรามการเก็งกำไร (NRLB)

Non-resident Lending and Borrowing (NRLB)

OLB

SLB

BDA

DWT

สรุปการปรับชุดข้อมูล

1. **Underlying Purpose Type** : ปรับ Classification
2. **Underlying Customer Investment Type** : ปรับ Validation

รายละเอียดการปรับชุดข้อมูลมาตรการป้องปรามการเก็งกำไร (NRLB)

Data File กลุ่ม Non-resident Lending and Borrowing

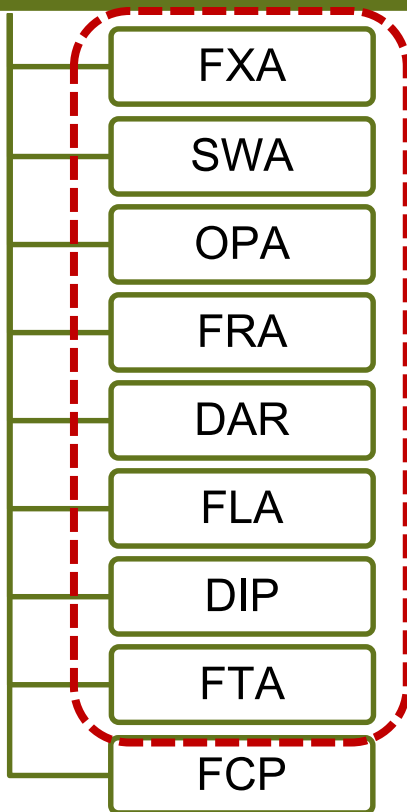
: Outstanding Lending and Borrowing

OLB : Outstanding Lending and Borrowing (การกู้/ให้กู้แก่ผู้มีถิ่นอยู่นอกประเทศ)

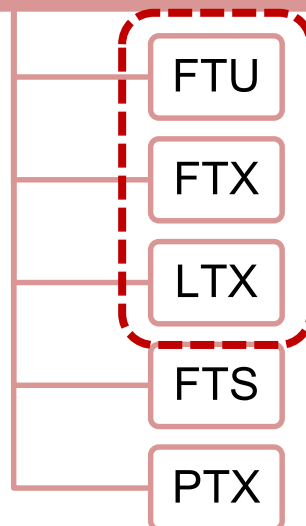
Modified Data Element	Description	สรุปการเปลี่ยนแปลง
Underlying Purpose Type (Data Type : Classification)	(Classification Name: Transaction Purpose Code)	ปรับ Transaction Purpose Code ที่ ปรับปรุงใหม่ (อ้างอิงเอกสาร Data File Manual , Classification และ Validation Worksheet)
Underlying Customer Investment Type (Data Type : Classification)	ระบุประเภทของการลงทุนใน หลักทรัพย์ (Classification Name: Customer Investment Type)	ปรับ Validation ที่อ้างอิงกับ Underlying Purpose Type

- การปรับชุดข้อมูลเร็วเงินตราต่างประเทศ (FOXI)
- การปรับชุดข้อมูลมาตรการป้องปรามการเก็งกำไร (NRLB)
- การปรับชุดข้อมูล FM Data Set
- การปรับชุดข้อมูลอัตราดอกเบี้ยและค่าธรรมเนียม FCD
- กรอบเวลาดำเนินการ

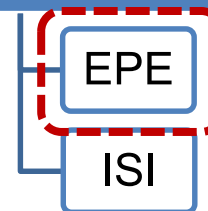
Foreign Currency Position and Arrangement



Foreign Currency Transaction



Other



สรุปการปรับปรุง

- 12 Data Sets
- 6 Classifications

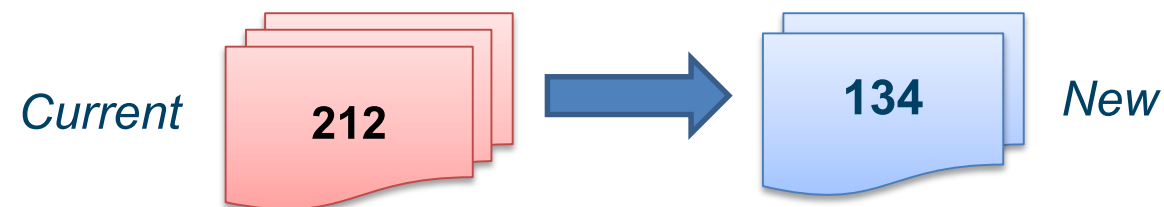
กลุ่มชุดข้อมูล FM

1. ปรับลดวัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม
2. ปรับเพื่อรองรับการ Rollover และ Unwind ต่างธนาคาร
3. ยกเลิกการรายงาน Cancellation Reason Type
4. เพิ่ม Key In Timestamp สำหรับชุดข้อมูลซื้อขายเงินตราต่างประเทศ
5. เพิ่มรายละเอียดประเภทบัญชี SNA (DAR)
6. ปรับชุดข้อมูลยอดคงค้างของสินทรัพย์และหนี้สิน (DIP)
7. ปรับปรุงการรายงานธุรกรรมกับศูนย์บริหารเงิน (TC)
8. ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น
(Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

ปรับ CL : วัตถุประสงค์

Data Set : **FXA, SWA, OPA, FRA, FTU, FTX, LTX, EPE**

สิ่งที่ปรับ	จำนวน
เพิ่มตามความต้องการใหม่ (New)	21
ปรับปรุงคำนิยามข้อมูล (Adjust)	13
ยกเลิกโดยยุบรวม Inflow/Outflow (Cancelled)	73
ยกเลิกวัตถุประสงค์ย่อย (Cancelled)	26



ปรับการรายงานวัตถุประสงค์

ปรับการรายงานวัตถุประสงค์ – เพิ่ม (New)

Case 1

เพิ่มรายละเอียดใหม่

318132	ค่าสินค้า (Goods)
318233	ค่าทองคำ

ปรับการรายงานวัตถุประสงค์ – ปรับปรุงคำนิยามข้อมูล (Adjust)

Case 2 ปรับแก้รายละเอียดให้ชัดเจนขึ้น

318017	ค่าใช้จ่ายตามบัตรสินเชื่อ	ได้แก่ ค่าสมาชิกแรกเข้า ค่าธรรมเนียมรายปี และค่าใช้จ่ายผ่านบัตรสินเชื่อ
↓		
318017	ค่าใช้จ่ายตามบัตรสินเชื่อหรือบัตรเดบิต	ได้แก่ ค่าสมาชิกแรกเข้า ค่าธรรมเนียมรายปี และค่าใช้จ่ายผ่านบัตรสินเชื่อหรือบัตรเดบิต

ปรับการรายงานวัตถุประสงค์

ปรับการรายงานวัตถุประสงค์ – ยกเลิก (Cancelled)

Case 3 ยกเลิกการรายงาน Inflow/Outflow โดยให้รายงานที่หัวหมวด

318089	เงินให้กู้ยืม (Lending)
318090	เงินให้กู้ยืม (Thai Loan)
318091	ให้กู้ยืม
318092	รับคืนเงินให้กู้ยืม

Case 4

ยกเลิกการรายงานรายละเอียด โดยให้รายงานในหัวหมวด

318046	เงินผลประโยชน์จากการลงทุนและการให้กู้ยืมจากต่างประเทศภาครัฐบาล
318047	ค่าไร (ภาครัฐบาล)
318048	ปันผล (ภาครัฐบาล)
318049	ดอกเบี้ยเงินกู้ (ภาครัฐบาล)
318050	ดอกเบี้ยอื่นๆ (ภาครัฐบาล)

กลุ่มชุดข้อมูล FM

1. ปรับลดวัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม
2. ปรับเพื่อรองรับการ Rollover และ Unwind ต่างธนาคาร
3. ยกเลิกการรายงาน Cancellation Reason Type
4. เพิ่ม Key In Timestamp สำหรับชุดข้อมูลซื้อขายเงินตราต่างประเทศ
5. เพิ่มรายละเอียดประเภทบัญชี SNA (DAR)
6. ปรับชุดข้อมูลยอดคงค้างของสินทรัพย์และหนี้สิน (DIP)
7. ปรับปรุงการรายงานธุรกรรมกับศูนย์บริหารเงิน (TC)
8. ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น
(Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

ปรับเพื่อรองรับการ Rollover และ Unwind ต่างธนาคาร

ตัวอย่างการรายงาน

สัญญาเดิม

FI Arrangement Number	Organization Id
A12005	001

สัญญาใหม่

FI Arrangement Number	Organization Id	Previous Arrangement Number	Previous Arrangement FI Code
B12345	088	A12005	001

ปรับเพื่อรองรับการ Rollover และ Unwind ต่างธนาคาร

Data Set : **FXA**

<u>New</u> Data Element	Description	เงื่อนไขการรายงาน
Previous Arrangement FI Code (Data Type : FI Code)	รหัสสถาบันการเงิน ของ Previous Arrangement Number โดยต้องเป็นรหัสที่สัมพันธ์กัน	<ul style="list-style-type: none"> - ค่าที่เป็นไปได้คือ Organization Id ที่มี FX License - ระบุกรณีเป็นการ Rollover หรือ Unwind ต่างธนาคาร

กลุ่มชุดข้อมูล FM

1. ปรับลดวัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม
2. ปรับเพื่อรองรับการ Rollover และ Unwind ต่างธนาคาร
3. ยกเลิกการรายงาน Cancellation Reason Type
4. เพิ่ม Key In Timestamp สำหรับชุดข้อมูลซื้อขายเงินตราต่างประเทศ
5. เพิ่มรายละเอียดประเภทบัญชี SNA (DAR)
6. ปรับชุดข้อมูลยอดคงค้างของสินทรัพย์และหนี้สิน (DIP)
7. ปรับปรุงการรายงานธุรกรรมกับศูนย์บริหารเงิน (TC)
8. ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น
(Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

ยกเลิกการรายงาน Cancellation Reason Type

Data Set : **FTX**

Deleted Data Element	Description	เงื่อนไขการรายงาน
Cancellation Reason Type (Data Type : Classification)	ระบุเหตุผลการยกเลิกธุรกรรมการซื้อขาย หรือขายเงินตราต่างประเทศที่ใช้ ธุรกรรม Spot (ไม่รวมการ ต่างสกุล) ของคู่สัญญาที่เป็นลูกค้า ประเทศที่ไม่ใช่นิติบุคคลรัฐ และธนาคารแห่งประเทศไทย รายงานเฉพาะกรณีที่ระบุ FX Trading Transaction Type เป็น 128003 No delivery หรือ ...	มีค่าเมื่อ Validation Data Set : FX Trading Transaction Type ที่ code มี value เท่ากับ No delivery (128003) หรือ Cancel (128006) หรือ Cancel by Replacing with New Contract (128007) และ FI Arrangement Number ของ DS_ FX Trading Transaction มีค่าเท่ากับ FI Arrangement Number ของ DS_Foreign Exchange Arrangement (DS_FXA) ...

กลุ่มชุดข้อมูล FM

1. ปรับลดวัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม
2. ปรับเพื่อรองรับการ Rollover และ Unwind ต่างธนาคาร
3. ยกเลิกการรายงาน Cancellation Reason Type
4. เพิ่ม Key In Timestamp สำหรับชุดข้อมูลซื้อขายเงินตราต่างประเทศ
5. เพิ่มรายละเอียดประเภทบัญชี SNA (DAR)
6. ปรับชุดข้อมูลยอดคงค้างของสินทรัพย์และหนี้สิน (DIP)
7. ปรับปรุงการรายงานธุรกรรมกับศูนย์บริหารเงิน (TC)
8. ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น
(Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

ปรับเพิ่ม Key In Timestamp สำหรับชุดข้อมูลซื้อขายเงินตราต่างประเทศ วันทำสัญญา

Data Set : **FXA, SWA, OPA, FRA, FTA, FTX**

Data Set	Key In Timestamp	เงื่อนไข
FXA, SWA, OPA, FRA, FTA	X	
FTX	X	เฉพาะสัญญา Spot today

New Element	Description	เงื่อนไขการรายงาน
Key In Timestamp (Data Type : Timestamp)	วันเวลาที่นำข้อมูลเข้าระบบ รูปแบบเป็น YYYY-MM-DD HH:MM:SS เช่น ทำธุรกรรม วันที่ 3 มกราคม 2562 เวลา 10.35 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2019-01-03 10:35:00	ระบุวันเวลาที่นำข้อมูลเข้าระบบ (First Key in time)

กลุ่มชุดข้อมูล FM

1. ปรับลดวัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม
2. ปรับเพื่อรองรับการ Rollover และ Unwind ต่างธนาคาร
3. ยกเลิกการรายงาน Cancellation Reason Type
4. เพิ่ม Key In Timestamp สำหรับชุดข้อมูลซื้อขายเงินตราต่างประเทศ
5. เพิ่มรายละเอียดประเภทบัญชี SNA (DAR)
6. ปรับชุดข้อมูลยอดคงค้างของสินทรัพย์และหนี้สิน (DIP)
7. ปรับปรุงการรายงานธุรกรรมกับศูนย์บริหารเงิน (TC)
8. ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น
(Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

CL : Deposit Account Type

ปรับเพื่อรองรับประเภทบัญชีเพื่อวัตถุประสงค์เฉพาะ

Data Set : **DAR**

Code	Value	Description
464006	NRB	Non-resident Baht Deposit
464007	NRBA	บัญชีเงินบาทของผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศเพื่อวัตถุประสงค์ทั่วไป (Non-resident Baht Account : NRBA)
464008	SNRBA	บัญชีเงินบาทของผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศเพื่อการค้าการลงทุนกับประเทศเพื่อนบ้าน (Special Non-resident Baht Account : SNRBA)
464009	NRBS	บัญชีเงินบาทของผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศเพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์และตราสารทางการเงินอื่น (Non-resident Baht Account for Securities : NRBS)
464010	SNA	บัญชีเงินบาทของผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศที่มีวัตถุประสงค์เฉพาะ (Special Purpose Non-resident Baht Account : SNA)
464012	DSNA	SNA เพื่อการปล่อยกู้เงินบาทโดยตรงแก่ NR เพื่อการค้าการลงทุนในประเทศไทย
464013	NSNA	SNA เพื่อการปล่อยกู้บาทโดยตรงแก่ NR ในประเทศเพื่อนบ้าน
464014	BSNA	SNA เพื่อ NR ที่ได้รับอนุญาตให้ออก Bath Bond
464015	LSNA	SNA เพื่อการส่งเสริมการใช้เงินสกุลท้องถิ่น

กลุ่มชุดข้อมูล FM

1. ปรับลดวัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม
2. ปรับเพื่อรองรับการ Rollover และ Unwind ต่างธนาคาร
3. ยกเลิกการรายงาน Cancellation Reason Type
4. เพิ่ม Key In Timestamp สำหรับชุดข้อมูลซื้อขายเงินตราต่างประเทศ
5. เพิ่มรายละเอียดประเภทบัญชี SNA (DAR)
6. ปรับชุดข้อมูลยอดคงค้างของสินทรัพย์และหนี้สิน (DIP)
7. ปรับปรุงการรายงานธุรกรรมกับศูนย์บริหารเงิน (TC)
8. ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น
(Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

ข้อมูลยอดคงค้างของสินทรัพย์และหนี้สิน

Data Set : DIP

<u>New</u> Data Element	Description	เงื่อนไขการรายงาน
Involved Party Type (Data Type : Classification)	ให้ระบุประเภทของ Counter Party (Involved Party Type) ในกรณีที่เป็นสินทรัพย์และหนี้สินดังนี้ <ul style="list-style-type: none"> • Due from Bank Abroad • Foreign Investment • Overdraft • Capital Funds • Trade Refinancing (Classification Name : Involved Party Type)	จะต้องระบุเมื่อ Foreign Currency Deposit and Investment Item Type ไม่ใช่ Other Asset และ Other Liabilities

<u>Modified</u> Data Element	Description	เงื่อนไขการรายงาน
Country Id (Data Type : Classification)	รหัสประเทศของ Involved Party เช่น ประเทศแคนาดา ใช้รหัส CA (Classification Name: Country Id)	เพิ่ม Validation ต้องมีค่าหาก Foreign Currency Deposit and Investment Item Type ไม่ใช่ Other Asset และ Other Liabilities

กลุ่มชุดข้อมูล FM

1. ปรับลดวัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม
2. ปรับเพื่อรองรับการ Rollover และ Unwind ต่างธนาคาร
3. ยกเลิกการรายงาน Cancellation Reason Type
4. เพิ่ม Key In Timestamp สำหรับชุดข้อมูลซื้อขายเงินตราต่างประเทศ
5. เพิ่มรายละเอียดประเภทบัญชี SNA (DAR)
6. ปรับชุดข้อมูลยอดคงค้างของสินทรัพย์และหนี้สิน (DIP)
7. ปรับปรุงการรายงานธุรกรรมกับศูนย์บริหารเงิน (TC)
8. ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น
(Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

การรายงานธุรกรรมกับศูนย์บริหารเงิน (TC)

Data Set : **FXA, SWA, OPA, FRA, FTU, FTX, LTX**

ปัจจุบัน	สิ่งที่ปรับ
<p>รพ. รายงานวัตถุประสงค์การทำธุรกรรมกับ TC ด้วยวัตถุประสงค์</p> <p>“เพื่อศูนย์บริหารเงิน (318168)”</p>	<ol style="list-style-type: none"> ยกเลิกวัตถุประสงค์ “เพื่อศูนย์บริหารเงิน (318168)” ให้รายงานวัตถุประสงค์ตามธุรกรรมจริง ของ TC เพิ่มการรายงาน “เพื่อศูนย์บริหารเงิน” ใน Objective Type

Objective Type

Code	Value	Description
465001	เพื่อตนเอง	การทำธุรกรรมเพื่อตนเอง
465002	เพื่อธุรกิจส่วนตัว	การทำธุรกรรมในเครือ
465003	เพื่อลูกค้า	การทำธุรกรรมเพื่อลูกค้า
465004	เพื่อศูนย์บริหารเงิน	การทำธุรกรรมเพื่อศูนย์บริหารเงิน

กลุ่มชุดข้อมูล FM

1. ปรับลดวัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม
2. ปรับเพื่อรองรับการ Rollover และ Unwind ต่างธนาคาร
3. ยกเลิกการรายงาน Cancellation Reason Type
4. เพิ่ม Key In Timestamp สำหรับชุดข้อมูลซื้อขายเงินตราต่างประเทศ
5. เพิ่มรายละเอียดประเภทบัญชี SNA (DAR)
6. ปรับชุดข้อมูลยอดคงค้างของสินทรัพย์และหนี้สิน (DIP)
7. ปรับปรุงการรายงานธุรกรรมกับศูนย์บริหารเงิน (TC)
8. ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น
(Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น

Appointed Cross Currency Dealer : ACCD

เพื่อลดต้นทุนทางการเงินของภาคเอกชนในการทำธุรกิจ ธปท. ได้ส่งเสริมให้มีการใช้เงินบาทและเงินสกุลท้องถิ่นอื่นๆ ในระยะแรกได้ร่วมดำเนินการกับ ธนาคารกลางมาเลเซีย และ อินโดนีเซีย ผ่อนคลายระเบียบที่เกี่ยวข้องกับการทำธุรกรรมเงินบาท ริงกิต (MYR) และรูเปีย (IDR) โดยทำธุรกรรมกับ ธพ. ไทยที่ได้รับอนุญาตให้เป็น ACCD



สรุปการปรับชุดข้อมูล FM

1. ปรับ 5 Data Sets
2. เพิ่ม 2 Classifications



รายงาน
เฉพาะธนาคาร
ที่เป็น ACCD

ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น (Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

CL : ACCD License Scheme

Code	Value	Description
475001	ACCD-MYR	การทำธุรกรรมภายใต้ Appointed Cross-Currency Dealers (ริงกิตมาเลเซีย : MYR)
475002	ACCD-IDR	การทำธุรกรรมภายใต้ Appointed Cross-Currency Dealers (รูเปียอินโดนีเซีย : IDR)

CL : ACCD Counterparty Type

Code	Value	Description
476001	Entities in Thailand	บุคคลธรรมดาที่มีสัญชาติไทยหรือนิติบุคคลที่จดทะเบียนในประเทศไทย
476002	Offshore ACCDs	ธนาคารในต่างประเทศที่ได้รับแต่งตั้งให้เป็น Appointed Cross Currency Dealer
476003	Thai ACCDs	ธนาคารในประเทศไทยที่ได้รับแต่งตั้งให้เป็น Appointed Cross Currency Dealer
476004	Non-ACCDs	ธนาคารในประเทศไทยอื่น ๆ ที่ไม่ได้รับแต่งตั้งให้เป็น Appointed Cross Currency Dealer

ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น (Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

Data Set : **FXA, SWA, FTX, DAR, FLA**

<u>New</u> Data Element	Description	เงื่อนไขการรายงาน
ACCD License Scheme (Data Type : Classification)	ประเภทของสัญญาที่ทำภายใต้ Appointed Cross Currency Dealer (ACCD) 1. ACCD-MYR (ริงกิตมาเลเซีย : MYR) 2. ACCD-IDR (รูเปียอินโดนีเซีย : IDR) (Classification Name : ACCD License Scheme)	
ACCD Counterparty Type (Data Type : Classification)	ประเภทของ Counterparty ที่ทำภายใต้ Appointed Cross Currency Dealer (ACCD) 1. Entities in Thailand 2. Offshore ACCDs 3. Thai ACCDs 4. Non-ACCDs (Classification Name : ACCD Counterparty Type)	ต้องระบุค่าต่อเมื่อ ACCD License Scheme มีค่า ถ้าไม่ตรงตามเงื่อนไขต้องไม่ระบุ

ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น (Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

Data Set : **FXA, SWA, FTX, DAR, FLA**

<u>New</u> Element	ACCD License Scheme	ACCD Counterparty Type	เงื่อนไข
FXA, DAR, FLA	X	X	
SWA	X	X	กรณีทำธุรกรรมภายใต้ ACCD License Scheme รายงานเฉพาะที่ Principal Exchange Indicator เป็น - Principal and Interest Exchange - Principal Exchange Only
FTX (Spot Today)	X	X	กรณีทำธุรกรรมภายใต้ ACCD License Scheme ต้องระบุค่าเมื่อประเภทสัญญาเป็น Spot Today

ขอบเขตการรายงานธุรกรรมการซื้อขายแลกเปลี่ยน FX ภายใต้ ACCD

License Scheme

การรายงาน	FM (ปัจจุบัน)	ธุรกรรม ภายใต้ ACCD License Scheme
วันทำสัญญา (Trade Date)	ทุกสัญญา	ทุกสัญญา (ยกเว้น OPA, FRA, FTA)
วันส่งมอบ (Settlement Date)	$\geq 50,000$ USD รายงานที่ FTX $< 50,000$ USD รายงานที่ FTU	รายงานทุกธุรกรรมที่ FTX
ธุรกรรม Spot today	$\geq 50,000$ USD รายงานที่ FTX $< 50,000$ USD รายงานที่ FTU	รายงานทุกธุรกรรมที่ FTX และ IPI
- วัตถุประสงค์ - Beneficiary or Sender Name	ธุรกรรมที่ทำกับลูกค้าแลกเปลี่ยน	ทุกธุรกรรม ทุกคู่สัญญา

ปรับเพื่อรองรับการรายงานธุรกรรมผ่านสกุลเงินท้องถิ่น (Appointed Cross Currency Dealer – Local Currency)

สรุปการรายงาน ACCD ในปัจจุบัน

รายงาน	สถานะรายงาน	หมายเหตุ
Table 01 Provider Info	คงเดิม	
Table 02 Daily FX Transactions	<u>ยกเลิก</u>	รายงานที่ DMS
Table 03 Net FX Position	<u>ยกเลิก</u>	รายงานที่ DMS
Table 04 Outstanding of ACCD SNA	คงเดิม	
Table 05 Deposit and withdrawal of ACCD SNA	คงเดิม	
Table 06 Trade Finance	คงเดิม	

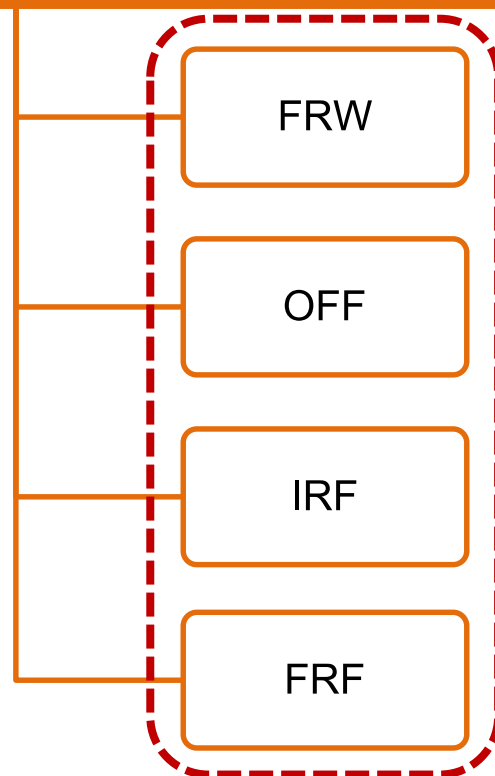
ปรับ Validation Rules เพื่อคุณภาพข้อมูลให้ดีขึ้น

~28 rules

มุมมองการตรวจ	หลักการ Validation	ตัวอย่าง
Purpose Code	วัตถุประสงค์ต้องมีความสอดคล้องกับ การทำธุรกรรม ประเภทธุรกรรม ผู้ทำธุรกรรม (~13 rules)	<ul style="list-style-type: none"> - FTX, FTU : ห้ามรายงาน วัตถุประสงค์การย้ายบัญชี FCD ของตนเอง - LTX : ห้ามรายงานวัตถุประสงค์ปรับฐานะฯ - FTX, FTU : ลูกค้าไทย ห้ามรายงานวัตถุประสงค์ ปรับฐานะฯ - LTX : ถ้าวัตถุประสงค์ค่าของเงินตราต่างประเทศที่นำมาขาย การรายงาน From Transaction Type ต้องมีค่าเป็น FX Trading
From / To Transaction Type	การรายงาน Form/To FI Code , Form/To A/C No. , Form/To Date ต้องสอดคล้องกับ From / To Transaction Type (~12 rules)	<ul style="list-style-type: none"> - FTX : From Transaction Type หรือ To Transaction Type มีค่าเท่ากับ 121004-FCD แล้ว From or To FI Code, From or To Account No. และ From or To Related Transaction Date ต้องมีค่า - LTX : กรณี ฝาก-ถอน NRB : From Transaction Type หรือ To Transaction Type ต้องไม่มีค่าเป็น 121004-FCD
Loan Deposit Transaction Type	การรายงาน Loan Deposit Transaction Type ใน LTX ต้องสอดคล้องประเภทสัญญาเงินฝาก (DAR) หรือ เงินกู้/ให้กู้(FLA) (~1 rule)	<ul style="list-style-type: none"> - ถ้ารายการของ LTX อ้างอิงเลขที่สัญญาของ DAR แล้ว Loan Deposit Transaction Type มีค่าที่เป็นไปได้คือ 184008, 184009, 184010, 184011, 184012 - ถ้ารายการของ LTX อ้างอิงเลขที่สัญญาของ FLA แล้ว Loan Deposit Transaction Type มีค่าที่เป็นไปได้คือ 184002, 184004, 184005, 184006, 184011
FX Arrangement Type	ตรวจสอบการรายงาน ธุรกรรม Spot Today เพิ่ม (~2 rules)	<ul style="list-style-type: none"> - FTX : ถ้า FX Arrangement Type มีค่าเท่ากับ Spot today แล้ว Exercising Involved Party Id ต้องมีค่า - FTX : ถ้า FX Arrangement Type มีค่าเท่ากับ Spot today แล้ว FX Trading Transaction Type ต้องมีค่าเป็น 128002 (Delivery)

- การปรับชุดข้อมูลเร็วเงินตราต่างประเทศ (FOXI)
- การปรับชุดข้อมูลมาตรการป้องปรามการเก็งกำไร (NRLB)
- การปรับชุดข้อมูล FM Data Set
- การปรับชุดข้อมูลอัตราดอกเบี้ยและค่าธรรมเนียม FCD
- กรอบเวลาดำเนินการ

Interest and Fee of Foreign Currency Deposit



สรุปการปรับ

- 4 Data Sets

Data Set กลุ่ม Interest and Fee of Foreign Currency Deposit : อัตราดอกเบี้ย และ ค่าธรรมเนียมของบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ

FRW : Fee Rate of SWIFT (ค่าธรรมเนียมในการฝากถอนโดยผ่านการโอนเงิน SWIFT หรือ Telex)

สิ่งที่ปรับ	Data Element
	Organization Id
	Data Set Date
ปรับชื่อ	FCD Currency Id
เพิ่ม	Currency of fee
ปรับ Data Type	Commission in lieu rate for Deposit
	Min Commission in lieu for Deposit
	Max Commission in lieu for Deposit
	Inwards Transfer Fee for Deposit
	Min Inwards Transfer Fee for Deposit
	Max Inwards Transfer Fee for Deposit
ปรับชื่อ	Other Fee Description for Deposit

สิ่งที่ปรับ	Data Element
เพิ่ม	Remarks of Fee for Deposit
ปรับ Data Type	Commission in lieu rate for Withdrawal
	Min Commission in lieu for Withdrawal
	Max Commission in lieu for Withdrawal
ยกเลิก	Withdrawal Fee for Other Transfer
เพิ่ม	Currency of transfer fee for withdrawal
เพิ่ม	Transfer Fee for withdrawal
เพิ่ม	Remark of fee for withdrawal
	Effective Date
	End Date
เพิ่ม	Website link for Deposit
เพิ่ม	Website link for withdrawal

Data Set กลุ่ม Interest and Fee of Foreign Currency Deposit : อัตราดอกเบี้ย และค่าธรรมเนียมของบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ

OFF : Other Fee Rate of Foreign Currency Deposit (เงื่อนไขการรักษา และการมีบัญชี)

สิ่งที่ปรับ	Data Element
	Organization Id
	Data Set Date
	Arrangement Type
ปรับชื่อ	FCD Currency Id
ยกเลิก	Minimum Open Account Amount
เพิ่ม	Minimum Open Account Amount for Retail Customer
เพิ่ม	Minimum Open Account Amount for Wholesale Customer
ยกเลิก	Minimum Balance for Maintenance Fee
เพิ่ม	Minimum Balance for Maintenance Fee for Retail Customer
เพิ่ม	Minimum Balance for Maintenance Fee for Wholesale Customer

สิ่งที่ปรับ	Data Element
เพิ่ม	Currency of Maintenance Fee
ปรับ Data Type	Maintenance Fee
ปรับนิยาม	Inactive Term
ยกเลิก	Inactive Term Unit
เพิ่ม	Currency of inactive fee
ปรับ Data Type	Inactive Fee
เพิ่ม	Remarks
	Effective Date
	End Date
เพิ่ม	Website link

Data Set กลุ่ม Interest and Fee of Foreign Currency Deposit : อัตราดอกเบี้ย และค่าธรรมเนียมของบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ

IRF : Interest Rate of Foreign Currency Deposit (อัตราดอกเบี้ยของบัญชี)

สิ่งที่ปรับ	Data Element
	Organization Id
	Data Set Date
	Arrangement Type
	Involved Party Type
ปรับชื่อ	FCD Currency Id
	Deposit Term

สิ่งที่ปรับ	Data Element
	Deposit Term Unit
	Balance Tier Amount
	Interest Rate
	Effective Date
	End Date
เพิ่ม	Website link for rate

Data Set กลุ่ม Interest and Fee of Foreign Currency Deposit : อัตราดอกเบี้ย และค่าธรรมเนียมของบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ

FRF : Fee Rate of Foreign Currency Deposit (ค่าธรรมเนียมในการฝากถอนโดยผ่าน
การโอนเงิน Draft, Cheque, Note and Coin)

สิ่งที่ปรับ	Data Element
	Organization Id
	Data Set Date
	Loan Deposit Transaction Type
ปรับชื่อ	FCD Currency Id
	Payment Method
	BR or BC Flag
เพิ่ม	Currency of Commission in lieu
ปรับ Data Type	Commission in lieu Rate

สิ่งที่ปรับ	Data Element
ปรับ Data Type	Min Commission in lieu
ยกเลิก	Max Commission in lieu
เพิ่ม	Currency of Other fee
เพิ่ม	Other Fee amount
ปรับชื่อ	Other Remark of Fee Description
	Effective Date
	End Date
เพิ่ม	Website link

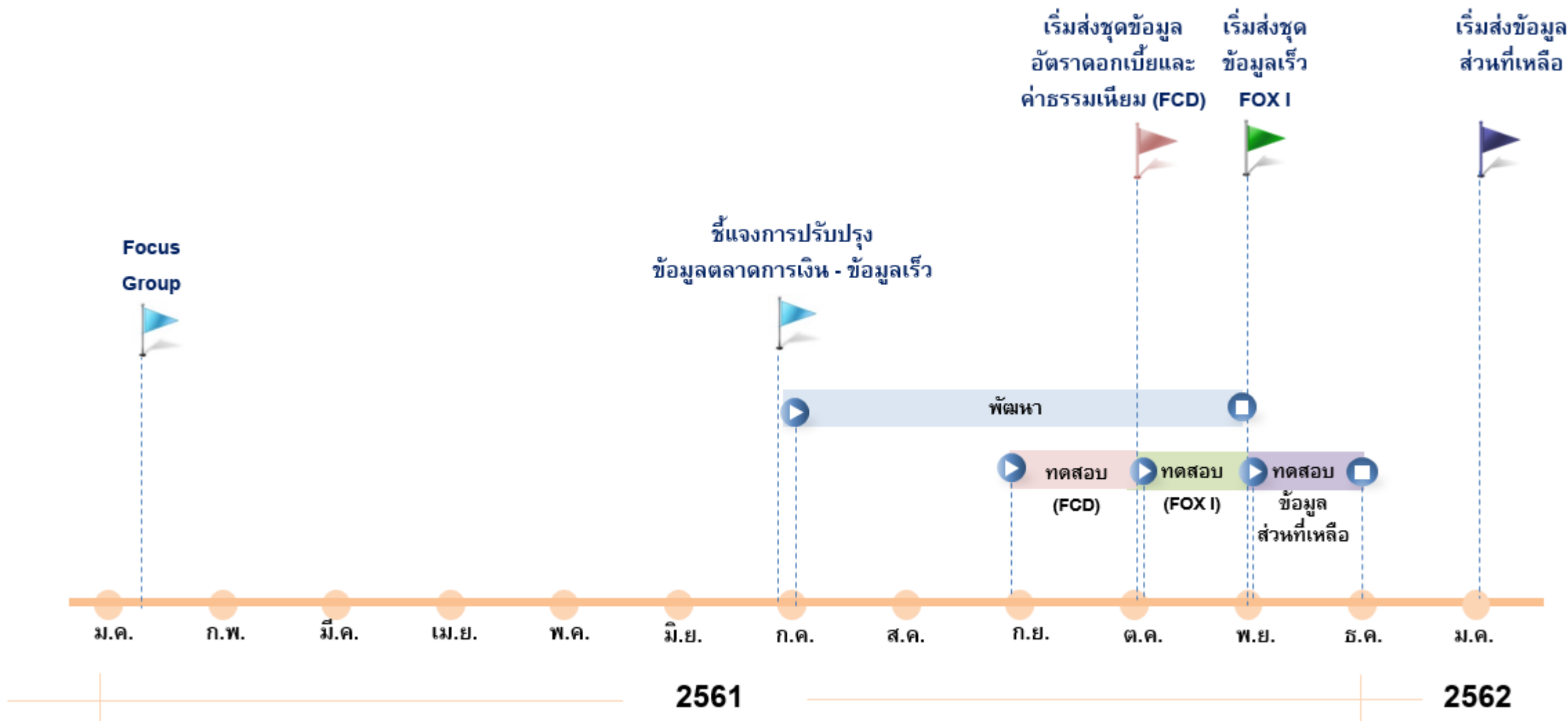
สรุปการปรับปรุง FM Data Set ประจำปี 2561

Data Set	New Element	Data Set	New Element	Data Set	New Element
FXA	<ul style="list-style-type: none"> ACCD License Scheme ACCD Counterparty Type Previous Arrangement FI Code Key In Timestamp 	SWA	<ul style="list-style-type: none"> ACCD License Scheme ACCD Counterparty Type Key In Timestamp 	DAR	<ul style="list-style-type: none"> ACCD License Scheme ACCD Counterparty Type
	Modified Element		Modified Element		Modified Element
	<ul style="list-style-type: none"> FX Arrangement Purpose Objective Type 		<ul style="list-style-type: none"> CCIRS Arrangement Purpose Code Objective Type 		<ul style="list-style-type: none"> Deposit Account Type Objective Type
Data Set	New Element	Data Set	New Element	Data Set	New Element
FTA	Key In Timestamp	OPA	Key In Timestamp	FLA	<ul style="list-style-type: none"> ACCD License Scheme ACCD Counterparty Type
			Modified Element		Modified Element
			Options Purpose Code	LTX	<ul style="list-style-type: none"> Inflow Transaction Purpose Outflow Transaction Purpose
			Objective Type		
Data Set	New Element	Data Set	New Element	Data Set	New Element
FRA	Key In Timestamp	FTX	<ul style="list-style-type: none"> ACCD License Scheme ACCD Counterparty Type Key In Timestamp 	DIP	Involved Party Type
	Modified Element		Modified Element		Modified Element
	FRA Arrangement Purpose Code		Inflow Transaction Purpose		Country Id
			Outflow Transaction Purpose	EPE	Source Transaction Purpose
			Objective Type		Used Transaction Purpose
Data Set	Modified Element		Deleted Element		
FTU	<ul style="list-style-type: none"> Inflow Transaction Purpose Outflow Transaction Purpose 		Cancellation Reason Type		

สรุปการปรับปรุงชุดข้อมูล FCD ประจำปี 2561

Data Set	New Element	Data Set	New Element	Data Set	New Element
IRF	<ul style="list-style-type: none"> Website Link for Rate 	OFF	<ul style="list-style-type: none"> Minimum Open Account Amount for Retail Customer Minimum Open Account Amount for Wholesale Customer Minimum Balance for Maintenance Fee for Retail Customer Minimum Balance for Maintenance Fee for Wholesale Customer Currency of Maintenance Fee Currency of Inactive Fee Remarks Website link 	FRW	<ul style="list-style-type: none"> Currency of Fee Remarks of Fee for Deposit Currency of Transfer Fee for Withdrawal Transfer Fee for withdrawal Remark of Fee for Withdrawal Website Link for Deposit Website Link for Withdrawal
	Modified Element				
FRF	<ul style="list-style-type: none"> FCD Currency Id 		Modified Element		Modified Element
	<ul style="list-style-type: none"> Currency of Commission in lieu Currency of Other Fee Other Fee Amount Website link 				
	Modified Element		Deleted Element		Deleted Element
	<ul style="list-style-type: none"> FCD Currency Id Commission in lieu Rate Min Commission in lieu Remark of Fee 				
	Deleted Element		Deleted Element		Deleted Element
	<ul style="list-style-type: none"> Max Commission in lieu 		<ul style="list-style-type: none"> Minimum Open Account Amount Minimum Balance for Maintenance Fee Inactive Term Unit 		<ul style="list-style-type: none"> Withdrawal Fee for Other Transfer

- การปรับชุดข้อมูลเร็วเงินตราต่างประเทศ (FOXI)
- การปรับชุดข้อมูลมาตรการป้องปรามการเก็งกำไร (NRLB)
- การปรับชุดข้อมูล FM Data Set
- การปรับชุดข้อมูลอัตราดอกเบี้ยและค่าธรรมเนียม FCD
- กรอบเวลาดำเนินการ



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 มีประมูล	โทร : 0-2356-7724 Email : PiyaphaM@bot.or.th
ธกสนันท์ ชันธิกุล	โทร : 0-2283-5634 Email : WannipaK@bot.or.th
ลาวัณย์ เดชะพหล	โทร : 0-2283-5138 Email : LawanD@bot.or.th
ดลยา สีมานนทปริญญา	โทร : 0-2283-6498 Email : DonlayaS@bot.or.th

Q & A