



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

แนวทางการเผยแพร่ข้อมูล forward points บน BOT website

วันที่ 24 พฤษภาคม 2561

ณ ธนาคารแห่งประเทศไทย



- รูปแบบการเผยแพร่ข้อมูล forward points บน BOT website
- การรับส่งข้อมูล forward points
- การดำเนินการระยะต่อไป



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

รูปแบบการเผยแพร่ข้อมูล forward points บน BOT website



วัตถุประสงค์

เพื่อช่วยให้ SMEs เข้าถึงข้อมูลราคาธุรกรรม FX forward เพื่อประกอบการตัดสินใจทำธุรกรรม

รูปแบบ

ขอความร่วมมือ ธพ. ที่ให้บริการธุรกรรม forward แก่ลูกค้า SMEs ส่งข้อมูลราคา forward points ที่เป็น indicative price ในช่วงเวลา 9.00 – 9.15 น. ของทุกวันทำการ มายัง ธพท. ผ่านระบบ DMS

Indicative price อาจเป็นราคาที่เกิดจากการทำธุรกรรมจริง หรือราคาที่ quote ภายในช่วงเวลาดังกล่าว สำหรับลูกค้าตาม/ใกล้เคียงกับลักษณะที่กำหนด

1. Tenor: 1, 3, 6 เดือน แยกเป็น points สำหรับผู้ส่งออกและผู้นำเข้า
2. คู่สกุล: THB/USD
3. ประเภท forward: outright/fixed
4. คุณลักษณะของลูกค้า: เป็นลูกค้า SMEs (มียอดขายไม่เกิน 400 ล้านบาท) ชั้นดี ไม่มีประวัติ default และมีวงเงิน forward กับธนาคารอยู่แล้ว รวมถึงเป็นลูกค้าที่ใช้บริการนี้กับธนาคารเพียงไม่กี่แห่ง
5. ช่องทางเผยแพร่: Website ของ ธพท. (และมีข้อมูลติดต่อของแต่ละ ธพ.)
6. Timeline ในการเผยแพร่: ภายในไตรมาส 3 ของปีนี้



การเผยแพร่ forward points แบบ quoted บนหน้า website

เผยแพร่ข้อมูลเป็นค่าเฉลี่ย ค่าสูงสุด ค่าต่ำสุด

ทั้งนี้ หากได้รับผลตอบแทนดี อาจพิจารณาการเผยแพร่ forward point รายธนาคารในลำดับถัดไป

ข้อมูลอัตรา forward points แบบ outright คู่สกุล THB/USD สำหรับผู้ประกอบการรายย่อย (หน่วย:สตางค์)

เวลาเผยแพร่: 10.00 น. ของทุกวันทำการ

Forward points	ผู้ส่งออก (ขาย forward)			ผู้นำเข้า (ซื้อ forward)		
	1 เดือน	3 เดือน	6 เดือน	1 เดือน	3 เดือน	6 เดือน
ค่าสูงสุด						
ค่าเฉลี่ย						
ค่าต่ำสุด						

หมายเหตุ:

1. ค่าเฉลี่ยของ forward points เป็นการคำนวณค่าเฉลี่ยจากข้อมูลของธนาคาร 10 แห่ง ได้แก่

(คลิกที่ชื่อธนาคารเพื่อไปที่หน้าให้บริการธุรกรรม forward)

ธนาคารกรุงเทพ โทรศัพท

ธนาคารกรุงไทย โทรศัพท

ธนาคารกรุงศรีอยุธยา โทรศัพท

ธนาคารกสิกรไทย โทรศัพท

ธนาคารซีไอเอ็มบี ไทย โทรศัพท

ธนาคารทหารไทย โทรศัพท

ธนาคารไทยพาณิชย์ โทรศัพท

ธนาคารธนชาต โทรศัพท

ธนาคารยูโอบี โทรศัพท

ธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย โทรศัพท

2. ค่าสูงสุด คือ forward points ที่ดีสำหรับผู้ส่งออก แต่ไม่ดีสำหรับผู้นำเข้า

ค่าต่ำสุด คือ forward points ที่ไม่ดีสำหรับผู้ส่งออก แต่ดีสำหรับผู้นำเข้า

3. forward points ที่ประกาศ เป็น indicative rate สำหรับลูกค้าผู้ประกอบการที่มีรายได้ต่อปีไม่เกิน 400 ล้านบาทต่อปี

และได้รับวงเงินสินเชื่อจากธนาคารอยู่แล้ว ดังนั้น forward points สำหรับการทำธุรกรรมจริงของผู้ประกอบการแต่ละราย

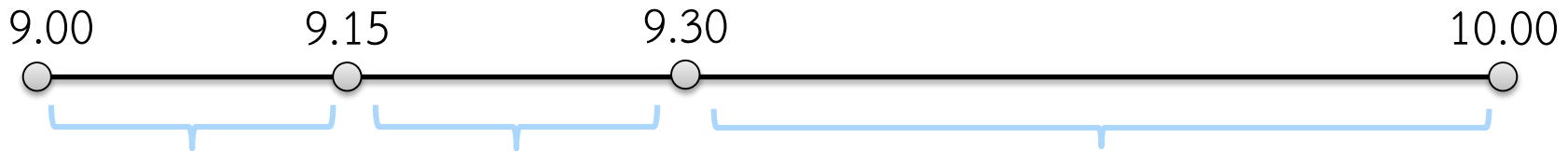
ขึ้นอยู่กับหลายปัจจัย เช่น ขนาดของธุรกรรม เครดิตของผู้ประกอบการ ความถี่ในการทำธุรกรรมของผู้ประกอบการ และอื่นๆ



การรายงานและการส่งข้อมูล forward points



เผยแพร่บน
website



ธนาคาร observe ราคา forward points ในตลาด หรือธุรกรรม forward กับลูกค้าที่มีลักษณะตามคุณสมบัติที่กำหนด

ธนาคารส่งราคา forward points ในช่วงเวลา 9.00 – 9.15 ในระบบ DMS ให้ ธปท.

- ระบบจะประมวลผลและเผยแพร่บน website ภายในเวลาที่กำหนด
- กรณีมีธนาคารที่ไม่ส่งข้อมูลเข้ามาในระบบ ธปท. จะติดตามเพื่อให้ข้อมูลครบตามจำนวนธนาคารที่ตกลงให้ความร่วมมือในการส่งราคา



กระบวนการตรวจสอบข้อมูล

1. ในช่อง forward points สำหรับทุก tenor ต้องมีการใส่ค่าเป็นตัวเลข ครบทุกช่อง (ห้ามมีช่องที่ว่างไว้หรือใส่ตัวหนังสือ เช่น n.a. มิเช่นนั้นระบบจะไม่รับข้อมูล)
2. ราคาด้านผู้นำเข้าต้องมากกว่าด้านผู้ส่งออก หากไม่เป็นดังกล่าว ระบบไม่รับข้อมูล
3. ราคาในแต่ละ tenor ไม่เกินจาก threshold ที่กำหนด หากเกิน threshold
 - ธนาคารต้องยืนยันราคาที่จะส่ง โดยระบุ YES ในช่องยืนยัน
 - หากไม่ยืนยัน ระบบจะไม่รับข้อมูล



ช่องทางการส่งข้อมูล: ระบบ DMS

ตัวอย่าง template ที่จะให้ธนาคารกรอกข้อมูล

ข้อมูล Forward Point

ธนาคาร (FI Code) :	025									
วันที่ (YYYY-MM-DD) :	2018-09-17									
									หมายเหตุ :	ข้อนี้ไม่ต้องกรอก
**** ราคา Forward Point แบบ outright สำหรับผู้ประกอบการรายย่อย (ตามเงื่อนไขที่กำหนด) ในช่วงเวลา 9:00 - 9:15 น. (หน่วย : สตางค์)										
Bid (ผู้ส่งออก)						Offer (ผู้นำเข้า)				ตรวจสอบ
สกุลเงิน	อายุสัญญา (เดือน)	Forward Point วันก่อนหน้า (สตางค์)	Forward Point (สตางค์)	ตรวจสอบ Threshold	ยืนยันราคากฎ เกิน Threshold (กรอก YES กรณี ยืนยัน)	Forward Point วันก่อนหน้า (สตางค์)	Forward Point (สตางค์)	ตรวจสอบ Threshold	ยืนยันราคากฎ เกิน Threshold (กรอก YES กรณี ยืนยัน)	Bid น้อยกว่า Offer
Dropdown List	Dropdown List	Numeric(12,2)	Numeric(12,2)		Text	Numeric(12,2)	Numeric(12,2)		Text	
USD - US DOLLAR	1	-3.22	-7.75	เกิน threshold	YES	-3.00	-2.80	Pass		Valid
USD - US DOLLAR	3	-10.00	-9.75	Pass		-9.80	-9.40	Pass		Valid
USD - US DOLLAR	6	-20.25	-20.20	Pass		-20.00	-20.20	Pass		Bid มากกว่า Offer



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

การดำเนินการระยะต่อไป



- ช่วงต้นเดือนมิถุนายน ธปท. ส่งหนังสือขอความร่วมมือไปยังธนาคาร
 - ขอให้ธนาคารส่งแบบตอบรับกลับมาให้ ธปท. ภายในวันที่ 21 มิถุนายน 2561 โดยระบุ contact person ทั้งผู้ที่ quote ราคา และผู้นำส่งข้อมูล
- ภายในเดือนสิงหาคม เริ่มส่งข้อมูล forward points ให้ ธปท. (การส่งข้อมูลในช่วง 2 สัปดาห์แรกเป็นการทดสอบระบบ จะไม่ยังเผยแพร่ข้อมูลที่ส่งมา)
- เผยแพร่ข้อมูล forward points ใน BOT website ในไตรมาส 3



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

Q&A