

ธนาคารแห่งประเทศไทย BANK OF THAILAND

ชื้แจงการรายงานข้อมูล FX Broker



การรายงานประกอบไปด้วย 2 ชุดข้อมูล (Excel Templates) ดังนี้

	Data File subject	ABBR	Granularity	Frequency
1	รายงานภาพรวม ข้อมูลการจับคู่การซื้อ ขายเงินตราต่างประเทศรายวัน ในแต่ละ เดือน โดยแบ่งตามคู่สกุลเงิน ประเภท ธุรกรรมและกลุ่มคู่สัญญา	Monthly Report	รายวัน	ภายใน 10 วันทำการ ของเดือนถัดไป
2	รายงานรายละเอียดข้อมูลการจับคู่การซื้อ ขายเงินตราต่างประเทศรายวันตามคู่สกุล เงิน (FX Against THB) ของแต่ละคู่สัญญา โดยครอบคลุมธุรกรรมประเภทต่างๆ ประกอบด้วย SPOT, Forward, SWAP, Option และธุรกรรมอื่นๆ	Special Report	รายวัน	ไม่เกิน 1 วันนับจาก วันที่ร้องขอ



รายละเอียดชุดข้อมูล

ในแต่ละชุดข้อมูล (Excel Template) จะประกอบไปด้วย 3 ชีท

- 1. ชีท Read Me แนะนำวิธีการใช้งานไฟล์ชุดข้อมูล
- ชีท Information สำหรับกรอกเลขที่นิติบุคคลของ FX Broker ที่เป็นเจ้าของ ข้อมูลและวันที่ของชุดข้อมุล

Broker Information			
เลขทะเบียนนิติบุคคล			
เดือน	March		
ปี ค.ศ.	2017		

3. ชีทข้อมูล (DF_FBx) – สำหรับกรอกข้อมูลซื้อขายเงินตราต่างประเทศที่ผ่าน FX Broker



ชุดข้อมูล DF_FBM - Monthly Report (Daily Aggregate Volume Report)

 รายงานผลรวมจำนวนเงินที่ทำการซื้อขายเงินตราต่างประเทศรายวันในแต่ละเดือน ตามคู่สกุลเงิน โดยแบ่งตามประเภทธุรกรรมและกลุ่มคู่สัญญา คือ Authorized FI, Non-Resident ^{Appendix I} และ BOT

<u>Field ข้อมูลและตัวอย่างการกรอก</u>

Unit: Million of Base currency

Matched Date	Base	Base Term Currency Currency		Arrangement Type	Other	Buy Amount (Mil.)			Sell Amount (Mil.)			Remarks
Matched Date	Currency				Arrangement Type	Authorized FI	Non-resident	вот	Authorized FI	Non-resident	вот	Remarks
2016-03-08	USD	-	THB	018104 Forward	-	20.00	10.00	-	20.00	5.00	-	
2016-03-08	USD THB	•	THB	018104 Forward 018106 Buy FX Swap 018107 Sell FX Swap 018107 Centre Oremony Swap		30.00	15.00	-	20.00	5.00	-	
2016-03-08	GBP JPY EUR HKD SGD		USD	218004 Buy Call Option 218005 Sell Call Option 218005 Sell Call Option		30.00	15.00	-	20.00	5.00	-	
2016-03-08			JPY	218007 Sell Put Option UT&TU4 POTWard		30.00	15.00	-	20.00	5.00	-	
2016-03-10	CHF	Ŧ	тнв	018327 Others	Pro Rata Forward	1.00	-	-	0.50	-	-	



รายละเอียดชุดข้อมูล

ชุดข้อมูล DF_FBS - Special Report (Daily Transaction Report)

 รายงานจำนวนเงินที่ทำการซื้อขายเงินตราต่างประเทศตามคู่สกุลเงินเฉพาะ FX/THB (FX Against THB) ของแต่ละคู่สัญญา โดยแบ่งตามประเภทธุรกรรม ซึ่งการรายงาน ขึ้นอยู่กับทางธนาคารแห่งประเทศไทยจะร้องขอ

Field ข้อมูลและตัวอย่างการกรอก

Unit: Million of Base currency

			Other				-		Cust	omer		For Swap	/ Forward		Remark
Trade date	Timestamp	Arrangement Type	Arrangement	Value date	Maturity date	Base	Term	Buy	rer	Sel	ler	Spot Pata	Swap Doint	Amount (Million)	
			Туре					Buyer Code	Buyer Name	Seller Code	Seller Name	oportate	onap i onit		
2016-03-01	2016-03-01 09.:25:10	018102 Spot Tomorrow		2016-03-02	2016-03-02	USD	тнв	XXEDSGSG	BB Bank	002	Bangkok Bank	35.12300		10.00	
2016-03-01	2016-03-01 10.:32:05	018101 Spot Today		2016-03-01	2016-03-01	EUR	тнв	AAED33FF	AA Bank	004	Kasikorn Bank	1.07451		2.00	
2016-03-01	2016-03-01 13.:11:03	018106 Buy FX Swap		2016-03-01	2016-05-01	JPY	тнв	014	SCB Bank	MM145DDE	MM Bank	37.67700	0.08520	30.00	
	Dropdow List	'n		\langle	Dropdow List	n									





Data File Document : รายละเอียดของข้อมูลแต่ละ Data File

Data File : Trequency :	FX Broker Input Monthly	oker Input Template Monthly dy nation					
sranularity : Sheet :	Information						
Data Element	Data Type	Description	м				
Data Element ลงทะเบียนนิดิบุคคล	Data Type Tax ID	Description เลขทะเบียนนิติบุคคล ของ FX Broker ผู้รายงานข้อมูล	м х				

Data File Manual : รายละเอียดการตรวจสอบข้อมูล

<u>คำอซิบาย</u>

Template Sheet: DF FBM

1.2

Template Sheet: Monthly Report (DF_FBM) ใช้สำหรับรายงานรายละเอียดข้อมูลการจับคู่การซื้อขายเงินตราท่างประเทศรายเดือน แบ่งทามสกุลเงิน มีวิธีการกรอกข้อมูลดังนี้

Data Element	คำอชิบาย	Validation Rule
เลขทะเบียนนิติบุคคล	เลขทะเบียนนิดิบุลคลของ FX Broker	มีค่าตามเลขทะเบียนนิติบุคคลที่ลงทะเบียนไว้กับธนาคาร แห่งประเทศไทย และต้องเป็นบริษัทเดียวกับ Provider ID
เดือน	เดือนของข้อมูลที่รายงาน	มีค่าตั้งแต่ 1 ถึง 12
ปีค.ศ.	ปี ค.ศ. ของข้อมูลที่รายงาน	มีค่าตั้งแต่ปี ค.ศ. มีค่าตั้งแต่ 2015 เป็นต้นไป
North Contractory	and the second	and the state of t

Classification:

ข้อมูล Possible Value สำหรับแต่ละ Data Element

Classi	fication Name: 7. Currency II	D
Code	Value	Description
AED	UAE DIRHAM	ดีแรห์ม สหรัฐอาหรับเอมิเรตส์
AFN	AFGHANI	อัฟกานิ
ALL	LEK	เลค
AMD	ARMENIAN DRAM	ดีแรห์ม อาร์เมเนีย
ANG	NETHERLANDS ANTILLIAN GUILDER	กิลเดอร์ เนเธอร์แลนด์แอนทิลลิส 🚽 🚽
AOA	KWANZA	ควันชา
ARS	ARGENTINE PESO	เปโซ อาร์เจนตินา
AUD	AUSTRALIAN DOLLAR	ดอลลาร์ ออสเตรเลีย
AWG	ARUBAN GUILDER	กิลเดอร์ อารูบา
AZN	AZERBAIJANIAN MANAT (NEW)	มานาท อาเซอร์ไบจาน
10 A.M.	SOALLIP TE LANDONS	UIS UP TO TOS



การรับส่งข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ของ ธปท.

เอกสารคู่มือการรับส่งข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ของ ธปท.

<u>https://www.bot.or.th/Thai/Statistics/DataManagementSystem/Standard/DMSDA/Docum</u> <u>ents/คู่มือการใช้งาน%20DMS%20DA%202559%20V0605.pdf</u>







้ถ้ามีการ Submit ไฟล์เดิม งวดวันที่ข้อมูลเดิม และ Data File Subject เดิม ที่เคยส่งมาแล้ว ไฟล์เดิมก่อนหน้าจะถูกเปลี่ยนสถานะเป็น 'Cancelled'



Appendix I

<u>นิยามกลุ่มคู่สัญญา</u>

Authorized FI : สถาบันการเงินที่ได้รับ FX License

Non-Resident (NR) : นิติบุคคล - ให้ถือตาม Location ของถิ่นที่ตั้งของนิติบุคคลที่ทำ ธุรกรรม ที่ไม่ใช่ประเทศไทย

BOT : ธนาคารแห่งประเทศไทย



Thank You