



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

ชี้แจงการปรับปรุงรายงานของ ศูนย์บริหารเงิน (TC)

วันที่ 28 พฤศจิกายน 2561



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

Agenda

- การปรับปรุงรายงานของศูนย์บริหารเงิน (TC)
- ประเด็นแจ้งเพื่อทราบอื่นๆ



จำนวนรายงาน

การรายงาน ณ ปัจจุบัน



1. ธุรกิจ FX Hedging (TFH)
2. ธุรกิจ Spot ซื้อ/ขาย/ไม่ขาย-ไม่ฝาก (TFX)
3. ธุรกิจการฝาก/ถอนบัญชี FCD ตปท. (TDT)
4. ธุรกิจการฝาก/ถอนบัญชี NRBA (TBA)
5. ธุรกิจระหว่าง TC กับกลุ่ม (TGC)
6. การกู้/ให้กู้ระหว่าง TC กับกลุ่ม และระหว่าง TC กับ ธพ. (TLB)
7. รายละเอียดบัญชี FCD ในประเทศ และ ตปท. (TDA)
8. รายละเอียดการลงทุนในตราสารหนี้ระยะสั้นในต่างประเทศ (TDS)
9. Cash Pooling (รายงานตามเงื่อนไขที่ระบุใน นส. อนุญาต)



จำนวนรายงานคงเหลือ



1. ธุรกิจการฝาก/ถอนบัญชี FCD ตปท. (TDT)
2. ธุรกิจระหว่าง TC กับกลุ่ม (TGC)
3. การกู้/ให้กู้ระหว่าง TC กับกลุ่ม และระหว่าง TC กับ ธพ. (TLB)
4. รายละเอียดบัญชี FCD ในประเทศ และ ตปท. (TDA)
5. รายละเอียดการลงทุนในตราสารหนี้ระยะสั้นในต่างประเทศ (TDS)



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

รายละเอียดการปรับปรุงการรายงานของ TC

--เริ่มรายงานตามรูปแบบใหม่ตั้งแต่วันที่ 1 ก.พ. 2562 --

ข้อมูลที่ TC ส่งให้ ธพท. ปัจจุบัน		สิ่งที่เปลี่ยนแปลง
Type of Data	TC Data File	
1. ธุรกิจ FX Hedging	TFH	ยกเลิกการรายงาน โดยให้แจ้งวัตถุประสงค์การทำธุรกรรม และข้อมูลที่เกี่ยวข้อง กับ ธพท. ที่รับทำธุรกรรม โดยยึดวัตถุประสงค์ที่มีสัดส่วนสูงสุดในธุรกรรมนั้นเป็นหลัก
2. ธุรกิจ Spot ซื้อ/ขาย/ไม่ขาย-ไม่ฝาก	TFX	
3. ธุรกิจการฝาก/ถอนบัญชี NRBA	TBA	
4. ธุรกิจการฝาก/ถอนบัญชี FCD ในประเทศ และ ตปท.	TDT	รายงานเฉพาะบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศในต่างประเทศ (OFCD) เท่านั้น
5. ธุรกิจระหว่าง TC กับกลุ่ม	TGC	กำหนดให้รายงานธุรกรรมเป็น Gross basis
6. การกู้/ให้กู้ระหว่าง TC กับกลุ่ม และระหว่าง TC กับ ธพท.	TLB	คงเดิม
7. รายละเอียดบัญชี FCD ใน และ ตปท.	TDA	รายงานเฉพาะบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศในต่างประเทศ (OFCD) เท่านั้น
8. รายละเอียดการลงทุนในตราสารหนี้ระยะสั้นในต่างประเทศ	TDS	คงเดิม
9. Cash Pooling (รายงานตามเงื่อนไขที่ระบุใน นส. อนุญาต)	-	ยกเลิกการรายงาน

TGC, TDT : มีการปรับเปลี่ยน Transaction Purpose Code ซึ่งสามารถดูจากเอกสาร Classification Document V3.0



Datafile TGC : ข้อมูลธุรกรรมระหว่าง TC ทำกับกลุ่ม

ขอบเขต	เดิม	ใหม่
(1) ข้อมูลธุรกรรม สินค้าและบริการ และธุรกรรมอื่นๆ ที่ TC รับหรือจ่ายเงินแทนกลุ่มบริษัททั้งในและต่างประเทศ	Gross basis หรือ Net Basis	Gross basis รายบริษัทในกลุ่ม/รายวัตถุประสงค์/รายวัน/รายสกุลเงิน
(2) การทำธุรกรรมของ TC เพื่อตนเอง	Gross basis หรือ Net Basis	ไม่ต้องรายงานใน TGC แต่ต้องแจ้งข้อมูลกับนิติบุคคลรับอนุญาต
(3) ธุรกรรมเงินตราต่างประเทศที่ TC ทำกับกลุ่มบริษัท	Gross Basis	Gross basis รายบริษัทในกลุ่ม/รายวัตถุประสงค์/รายวัน/รายสกุลเงิน



ตัวอย่างการรายงานธุรกรรมที่ TC ทำกับบริษัทในกลุ่ม (Data File: TGC)

Settlement Flows ของ บริษัท A ณ วันที่ 30 พ.ย. 61

Settlement Flows ของ บริษัท B ณ วันที่ 30 พ.ย. 61 : MUSD

วัตถุประสงค์	ได้รับ FX	จ่าย FX	วัตถุประสงค์	ได้รับ FX	จ่าย FX
ค่าสินค้าออก	100		ค่าสินค้าออก	200	
ค่าสินค้าเข้า		30	ค่าสินค้าเข้า		50
ให้กู้ในต่างประเทศ		5	ส่งคืนเงินลงทุน		50
รับคืนเงินกู้	1		ส่งคืนกำไร		5
รับเงินลงทุน	50		ค่าบริการ	20	
ส่งคืนกำไร		5	ลงทุนในต่างประเทศ		500
Flows สุทธิของ A	111		Flows สุทธิของ B		385
TC ไปซื้อ FX จาก ธพ. เพื่อปิด Positionตามยอด Net ของทั้งกลุ่ม					274

TC ต้องรายงาน Flows ของบริษัท A และ B ทุกรายการใน Data File TGC มาที่ ธพท.



- TC ไม่ต้องแสดง Underlying กับ ธพ.
- TC ต้องให้รายละเอียดข้อมูลเพียงพอกับ ธพ. เพื่อให้ ธพ. นำมารายงาน ธปท.

ตัวอย่างเช่น

กรณีทำธุรกรรม ซื้อ ขาย ฝาก ถอน เงินตราต่างประเทศ
ที่มีวัตถุประสงค์ ดังต่อไปนี้ TC ต้องแจ้งรายละเอียดเพิ่มเติมให้กับ ธพ. ดังนี้

เงินลงทุนโดยตรงในธุรกิจในเครือ / สาขา

1. บริษัทที่ลงทุน
2. ประเภทธุรกิจ (ISIC)
3. ความสัมพันธ์กับ TC
4. Listed ในตลาดหุ้นหรือไม่
5. จำนวนหุ้น ราคาหุ้น มูลค่าหุ้นสะสม
6. เหตุผลกรณีนำเงินทุนกลับ

เงินลงทุนในหลักทรัพย์

1. ประเภทตราสารที่ลงทุน (หนี้ หรือตราสารทุน)
2. ชื่อผู้ออกตราสาร
3. ประเภทธุรกิจ ISIC ของผู้ออกตราสาร
4. อายุหลักทรัพย์
5. กรณีหุ้น Listed ในตลาดหรือไม่

เงินกู้ยืม หรือให้กู้ยืม กู้/ให้กู้โดยการออกตราสารหนี้

1. อายุ วันครบกำหนด
2. รายละเอียดการชำระคืนต้นเงินกู้ (จำนวนงวด ความถี่ งวดแรกการชำระ ...)
3. รายละเอียดอัตราดอกเบี้ย (ประเภทอัตราดอกเบี้ย อัตราดอกเบี้ย ส่วนเพิ่มเติม..)
4. วันที่เบิกเงินกู้งวดแรก
5. กรณีการชำระเงินกู้ ชำระตามกำหนด หรือก่อนกำหนด
6. Loan Declaration Type เช่น เงินกู้ที่เคยนำเข้า หรือไม่นำเข้า
7. กรณีตราสารหนี้

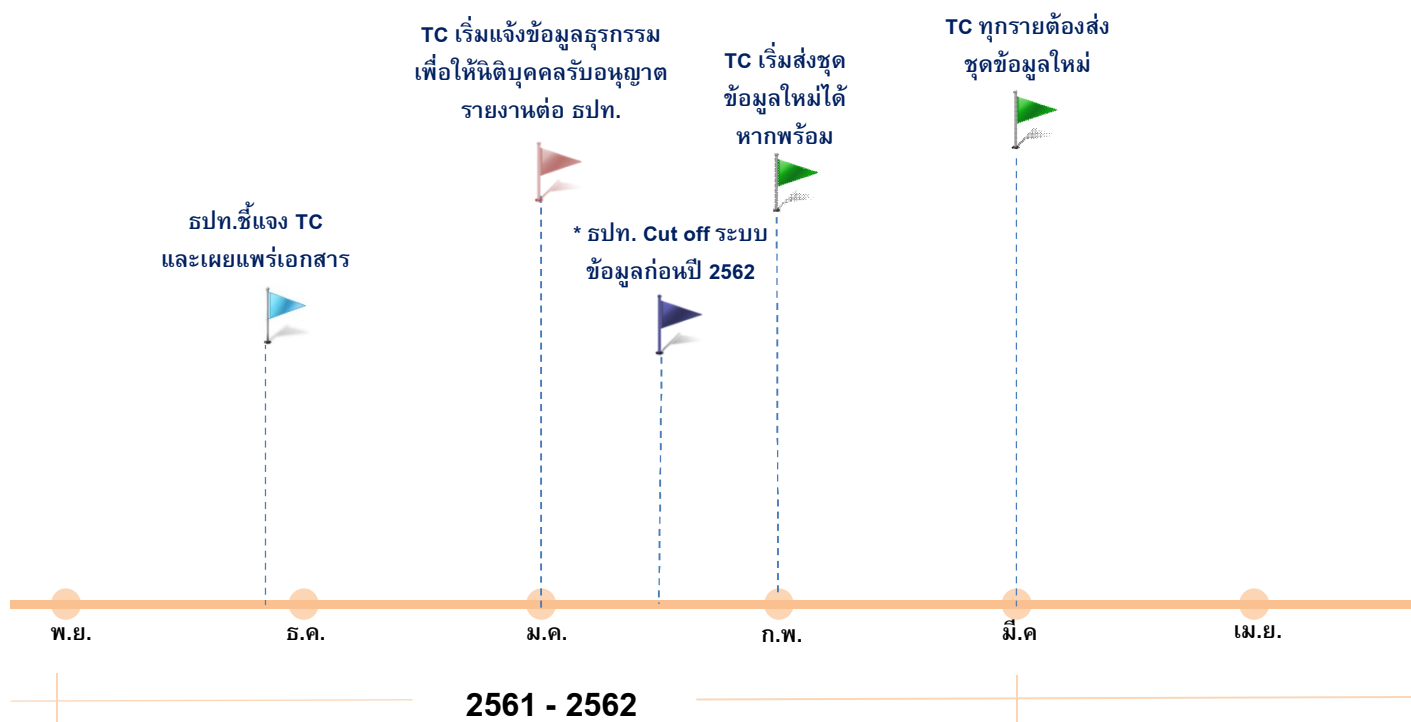
Issued Date Issued Amount

กรณี ไม่ถอน เป็นการไถ่ถอนตราสารหนี้ทั้งจำนวน หรือบางส่วน



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

กรอบเวลาดำเนินการ



* การส่งและแก้ไขข้อมูลธุรกรรมที่ทำก่อนปี 2562 TC ต้องดำเนินการให้แล้วเสร็จภายในวันที่ 15 มกราคม 2562



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

ประเด็นแจ้งเพื่อทราบอื่นๆ

คุณภาพการรายงานข้อมูล

- ความครบถ้วน และถูกต้อง
- การทำธุรกรรมเพื่อตนเอง/และเพื่อกลุ่มบริษัท ควรแยกธุรกรรมให้ชัดเจน



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

Q & A



สรุปคำถามคำตอบจากการประชุม

คำถาม	คำตอบ
1. กรณี TC ทำธุรกรรมเงินตราต่างประเทศ กับ ธพ. เพื่อวัตถุประสงค์ “เพื่อให้กู้ยืม” ซึ่ง TC ไม่สามารถแจ้งข้อมูล “YTD Accumulated Amount” ของเงินกู้ นั้นได้จะต้องทำอย่างไร	หากเป็นการทำธุรกรรมเพื่อวัตถุประสงค์ “ให้กู้ยืม / เงินให้กู้ที่เป็นตราสารหนี้ / เงินลงทุนในธุรกิจในเครือ/สาขาในต่างประเทศ” TC ต้องแจ้งรายละเอียดเพิ่มเติมให้ ธพ. สำหรับข้อมูล “YTD Accumulated Amount” หาก TC ไม่สามารถหาค่าได้ ให้ใส่ค่าเท่ากับ “0” และ กรณีที่เป็น revolving ให้ระบุ วันที่เบิกเงินกู้งวดแรก เป็นวันที่ให้กู้เงินในงวดปัจจุบัน โดยไม่ต้องคำนึงถึงวันที่ให้กู้ในงวดที่ผ่านมา
2. ธพ. และ TC ขอให้ ธปท. พิจารณาแนวทางการรายงานธุรกรรม cash pooling ให้มีความสะดวก เนื่องจากเป็นธุรกรรมที่เกิดขึ้นทุกวัน	ธปท. ขอแจ้งแนวทางการรายงานธุรกรรม cash pooling ดังนี้ (1) การรายงานธุรกรรม ตามขั้นตอนที่ TC รวบรวมเงินจากกลุ่มบริษัทในประเทศ โดยการโอนเงินจากบัญชี FCD ของกลุ่มบริษัทมายังบัญชี FCD ของ TC (cash pooling) ให้แจ้งวัตถุประสงค์ “318145 ย้ายเงินในบัญชี FCD ของธุรกิจเครือ” กับ ธพ. ที่รับทำธุรกรรม และให้ ธพ. รายงานข้อมูลเพิ่มเติมใน Element “Other Transaction Purpose Description” ว่า “Cash pooling” (2) การรายงานธุรกรรม ตามขั้นตอนที่ TC โอนเงินที่รวบรวมจากกลุ่ม ไปชำระภาระในต่างประเทศให้รายงานวัตถุประสงค์ตามจริง เช่น เพื่อวัตถุประสงค์ “ให้กู้ยืม / เงินให้กู้ที่เป็นตราสารหนี้ / เงินลงทุนในธุรกิจเครือ/สาขาในต่างประเทศ” และแจ้งข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับ ธพ. ด้วย
<u>แจ้งเพิ่ม</u> แนวทางการรายงานข้างต้นให้นำมาใช้กับธุรกรรมฝาก-ถอน บัญชี FCD ในประเทศ ระหว่าง TC กับ บริษัทในกลุ่ม และระหว่างบัญชี FCD ของ TC เอง ในกรณีอื่นที่ไม่ใช่ cash pooling ดังนี้ (1) การโอนเงินระหว่างบัญชี FCD ในประเทศของ TC กับ กลุ่มบริษัท ให้แจ้งวัตถุประสงค์ “318145 ย้ายเงินในบัญชี FCD ของธุรกิจเครือ” กับ ธพ. ที่รับทำธุรกรรม (2) การโอนเงินระหว่างบัญชี FCD ในประเทศของ TC เอง ให้แจ้งวัตถุประสงค์ “318144 ย้ายเงินในบัญชี FCD ของตนเอง” กับ ธพ. ที่รับทำธุรกรรม (3) นอกเหนือจาก (1) และ (2) ให้รายงานวัตถุประสงค์ตามจริง	