****

เอกสารชุดข้อมูล
สำหรับบริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาต

(DATA FILE DOCUMENT)

**Document information**

**Revision history**

| **Version number** | **Date** | **Summary of changes** | **Revision marks** |
| --- | --- | --- | --- |
| **1.0** | **15 Aug 2018** | First version | **No** |

สารบัญ

 **หน้า**

[1. Document Overview 4](#_Toc519161894)

[2. Data File Summary 5](#_Toc519161895)

[3. Data File: Data Elements 6](#_Toc519161896)

[3.1 รายงานธุรกรรมการซื้อ-ขาย แลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ 6](#_Toc519161897)

[3.2 รายงานฐานะเงินตราต่างประเทศสุทธิ 9](#_Toc519161898)

[3.3 รายงานการเปิดบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศเพื่อการประกอบธุรกิจเงินตราต่างประเทศ 10](#_Toc519161899)

[4. Appendix A : Data Type 11](#_Toc519161900)

# Document Overview

This document provides information on the Data files to be submitted to the Bank of Thailand (BOT). This document is divided into 3 major sections:

**1. Data File Summary** section provides an overview of the new Data File, by listing all the Data sheets.

**2. Data File Data Element** section discusses in more details all the data elements within each of the defined Data File’s sheets. For each of the data elements, we have defined a valid data type. The list of all data types can be found in the Data Type Section.

**3. Data Type** section, which also provides the submission format for each of the data type, as well as some sample value. There is a special kind of data elements called ‘Classification’ data element, which is used to classify other data element, for example Currency Id, Country Id, Arrangement Type, etc. Classification data elements will contain a number of possible values, for example Currency Id can be ‘USD, ‘JPY’, or ‘THB’, etc. The list of all classifications can be found in the Classification Document for Data Management System Project.

**Vocabulary:**

* **Granularity** means granularity of data (how detailed the data is).
* **Frequency** means frequency of submission (how frequent each financial institution has to submit the data).

# Data File Summary

| **New Data File Subject Area** | **ABBR** | **Granularity** | **Frequency** | **Description** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | รายงานธุรกรรมการซื้อ-ขาย แลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ | **Table 1- FX transaction** | รายวัน รายธุรกรรม |  รายเดือน ภายใน 12.00 น. ของวันที่ 15 ของเดือนถัดจากเดือนที่ต้องรายงาน |  |
| 2 | รายงานฐานะเงินตราต่างประเทศสุทธิ | **Table 2-NET FX Position** | รายวัน | รายเดือน ภายใน 12.00 น. ของวันที่ 15 ของเดือนถัดจากเดือนที่ต้องรายงาน |   |
| 3 | รายงานการเปิดบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศเพื่อการประกอบธุรกิจเงินตราต่างประเทศ | **Table 3-FCD** | รายบัญฃี | รายเดือน ภายใน 12.00 น. ของวันที่ 15 ของเดือนถัดจากเดือนที่ต้องรายงาน |   |

# Data File: Data Elements

### 3.1 รายงานธุรกรรมการซื้อ-ขาย แลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ

**Sheet** : **Table 1- FX transaction**

**Granularity : รายวัน รายธุรกรรม**

**Frequency : รายเดือน ภายใน 12.00 น. ของวันที่ 15 ของเดือนถัดจากเดือนที่ต้องรายงาน**

| **Data Element (field)** | **Data Type** | **Description** | **M** | **O** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Organization Id | Provider Code | รหัสบริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาตผู้ส่งข้อมูล เช่น บริษัท หลักทรัพย์ AAA จำกัด รหัส A99  | X |  |
| Date Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล ให้ใช้วันสุดท้ายของเดือนตามปีปฏิทิน | X |  |
| FI Arrangement Number | Identification Number | เลขที่สัญญาธุรกรรมเงินตราต่างประเทศ | X |  |
| Previous FI Arrangement Number | Identification Number | เลขที่สัญญาอ้างอิงที่ทำกับคู่สัญญา หรือเลขที่สัญญาก่อนหน้า โดยรายงานเฉพาะในกรณีที่ทำสัญญาเพื่อ Rollover หรือ Unwind สัญญาเดิม**ตัวอย่าง**: บริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาตขายเงินตราต่างประเทศให้บริษัท ก. ตามสัญญา FI Arrangement Number 67890 เพื่อ Rollover สัญญาเดิมเลขที่ FI Arrangement Number 12345 ในกรณีนี้ Previous Arrangement Number คือ 12345 |  | X |
| Cancellation Flag | Flag | การยกเลิกสัญญาเดิม (cancel) โดย ระบุเป็น “1” เมื่อเป็นการรายงานเพื่อยกเลิกสัญญาเดิม (Cancel) | X |  |
| Set Up Reason Type | Classification | เหตุผลในการทำสัญญา ดังนี้1. ทำสัญญาใหม่ หรือ2.  ทำสัญญาเพื่อต่ออายุสัญญาเดิม (Rollover) หรือ3.  ทำสัญญาในทางตรงข้าม (Unwind) |  | X |
| FX Arrangement Type | Classification | ประเภทธุรกรรมการซื้อขายเงินตราต่างประเทศ ได้แก่ 1. ธุรกรรม Outright 1.1 Spot – Today: ธุรกรรม spot ที่ส่งมอบเงินในวันเดียวกัน 1.2 Spot – Tomorrow: ธุรกรรม spot ที่ส่งมอบเงินในทำการถัดไป นับแต่วันทำสัญญา 1.3 Spot – Next: ธุรกรรม spot ที่ส่งมอบเงินภายในสองวันทำการถัดไป นับแต่วันทำสัญญา 1.4 Forward2. ธุรกรรม Swap 2.1 Sell – Buy Swap: Buy Swap 2.2 Buy – Sell Swap: Sell Swap3. ธุรกรรม Option | X |  |
| Trade Date | Date | วันที่ทำสัญญาหรือวัน Trade Date | X |  |
|  Maturity Date | Date | วันที่สัญญาครบกำหนด/วันที่สัญญามีผลบังคับใช้ | X |  |
| Underlying Flag | Flag | ภาระผูกพันของธุรกรรมเงินตราต่างประเทศ | X |  |
| Transaction purpose | Classification | วัตุประสงค์การทำธุรกรรมเงินตราต่างประเทศ | X |  |
| Counterparty Unique ID Type | Classification | ประเภทของรหัสมาตรฐานของคู่สัญญา | X |  |
| Counterparty Unique ID | Identification Number | รหัสมาตรฐานของคู่สัญญา | X |  |
| Counterparty Name | Long Name | ชื่อของ NR ที่เป็นคู่สัญญา รูปแบบการรายงานชื่อ ให้รายงานชื่อเต็มภาษาอังกฤษ หากมี THE นำหน้าให้ตัดไปใส่ไว้ท้ายชื่อ เช่น XYZ BANK LTD., THE, LONDON และ ABC, MR. เป็นต้น | X |  |
| Counterparty Country Code  | Classification | รหัส (Code) ประเทศของคู่สัญญา | X |  |
| Buy Currency | Classification | สกุลเงินด้านที่บริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาตรับซื้อจากคู่สัญญา | X |  |
| Buy Amount | Amount | จำนวนเงินตราต่างประเทศที่บริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาตที่รับซื้อจากคู่สัญญา | X |  |
| Sell Currency | Classification | สกุลเงินด้านที่บริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาตขายให้คู่สัญญา | X |  |
| Sell Amount | Amount | จำนวนเงินตราต่างประเทศที่บริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาตขายให้คู่สัญญา | X |  |
| Exchange rate | Exchange Rate | อัตราแลกเปลี่ยนที่บริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาต รับซื้อ-ขาย แลกเปลี่ยน | X |  |
| Description  | Decription | รายละเอียดเพิ่มเติม  |  | X |

### 3.2 รายงานฐานะเงินตราต่างประเทศสุทธิ

**Sheet : Table 2-NET FX Position**

**Granularity : รายวัน**

**Frequency : รายเดือน ภายใน 12.00 น. ของวันที่ 15 ของเดือนถัดจากเดือนที่ต้องรายงาน**

| **Data Element (field)** | **Data Type** | **คำอธิบาย** | **M** | **O** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Data Set Date | Date | วันที่มีรายการธุรกรรมเงินตราต่างประเทศเกิดขึ้น  | X |  |
| Accumulated Net of the previous day | Amount | ฐานะเงินตราต่างประเทศสุทธิสะสมของวันทำการก่อนหน้า**ตัวอย่าง**: กรณีบริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาตรายงานข้อมูลของวันที่ 2 กรกฎาคม 2561 (Data Set Date) ให้ระบุฐานะเงินตราต่างประเทศสุทธิสะสมของ วันที่ 29 มิถุนายน 2561 | X |  |
| Total Buy Amount | Amount | * จำนวนเงินตราต่างประเทศรวม ที่ซื้อจากคู่สัญญา ระบุเป็นสกุล USD
* กรณีเป็นรายการยกเลิกสัญญาธุรกรรมเงินตราต่างประเทศ (ในรายงานธุรกรรมซื้อขาย แลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ ระบุ Cancellation Flag เป็น “1”) ให้นำมาลบหรือหักออก
 | X |  |
| Total Sell Amount | Amount | * จำนวนเงินตราต่างประเทศรวม ที่ขายให้คู่สัญญา ระบุเป็นสกุล USD
* กรณีเป็นรายการยกเลิกสัญญาธุรกรรมเงินตราต่างประเทศ (ในรายงานธุรกรรมซื้อขาย แลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ ระบุ Cancellation Flag เป็น “1”) ให้นำมาลบหรือหักออก
 | X |  |
| Accumulated Net at the end of the day | Amount | * ฐานะเงินตราต่างประเทศสุทธิสะสม ณ สิ้นวัน โดยระบุเป็นสกุล USD
 | X |  |

### 3.3 รายงานการเปิดบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศเพื่อการประกอบธุรกิจเงินตราต่างประเทศ

**Sheet : Table 3-FCD**

**Granularity: รายบัญฃี**

**Frequency : รายเดือน ภายใน 12.00 น. ของวันที่ 15 ของเดือนถัดจากเดือนที่ต้องรายงาน**

| **Data Element (field)** | **Data Type** | **คำอธิบาย** | **M** | **O** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Account Number/Swift Codes | Identification Number | เลขที่บัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ | X |  |
| Arrangement Contract Date | Date | วันที่เปิดบัญชี | X |  |
| FI Unique ID | Identification Number | รหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่เปิดบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ | X |  |
| FI Name | Long Name | ชื่อสถาบันการเงินที่เปิดบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ | X |  |
| Account Name | Long Name | ชื่อบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ | X |  |
| Currency | Classification | สกุลเงินตราต่างประเทศของบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ | X |  |
| Description | Description | รายละเอียดเพิ่มเติม |  | X |

# 4. Appendix A : Data Type

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Data Type Name** | **Data Type** | **Format** | **Remark** | **Sample** |
| Provider Code | Char(3) | AAA | No leading blanks | A22 |
| Date | Char(10) | YYYY-MM-DD | A.D. year | 2018-01-31 |
| Identification Number (ID) | VarChar(40) | AAAA | No leading blanks | 12345 |
| Classification | VarChar(10) | AAAA | No leading blanks | 0123456789 |
| Long Name | VarChar(200) | AAAA |  | XXX |
| Flag  | Char(1)  | '1' or '0' | Only two values | 1 |
| Exchange Rate | Number(20,7) | NNNNN.NNNNNNN |  | 32.223 |
| Amount | Number(20,2) | NNNNNNNNNN.NN | No leading zeroes | 102000020.20 |
| Description | VarChar(400) | AAAA |  | XXX111Description |