

เอกสารชุดข้อมูลเร็วเงินตราต่างประเทศ

(DATA FILE DOCUMENT)

Document information

Revision history

| Version number | Released  Date | Effective  Date | Summary of changes | Revision marks |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.0 | 18 June 2007 | 3 September 2007 | First version | NO |
| 2.0 | 18 November 2013 | 31 August 2010 | **Second version**  Remark: All changes from version 1.1 to version 2.0 are in red font. | Yes |
| 3.0 | 23 July 2018 | 1 November 2018 | **Third version**  Remark: All changes from version 2.0 to version 3.0 are in blue font. | Yes |

**Table of Contents**

*Page*

[Document Overview 4](#_Toc169943974)

[Data File Summary 5](#_Toc169943975)

[Data File: Data Elements 6](#_Toc169943976)

[3.1 FX Position (DF\_FXP) 6](#_Toc169943977)

[3.2 FX Trading Transaction >= 1,000,000 USD (DF\_FXM) 7](#_Toc169943978)

[3.3 FX Trading Transaction Under 1,000,000 USD Summary (DF\_FXU) 9](#_Toc169943979)

[Appendix A: Data Type 10](#_Toc169943980)

# Document Overview

This document provides information on the Data files to be submitted to the Bank of Thailand (BOT). The Data Files will be based on the industry open standard XML (Extensible Markup Language) format, and will be electronically submitted to BOT via Data Acquisition (Extranet/Internet).

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 Files in the new system, and how they are related to the existing reports.

**2. Data File Data Element** section discusses in more details all the data elements within

each of the defined Data Files. 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 | ฐานะเงินตราต่างประเทศสุทธิ (FX Position) | DF\_FXP | รายวัน | ภายใน 8.30 น. ของวันทำการถัดจากวันที่เกิดธุรกรรม | **ตารางที่จัดส่งเดิม** ตาราง 1 รายงานธุรกรรมการซื้อขายเงินตราต่างประเทศประจำวัน  (Daily Foreign Currency Purchase/ Sale Transactions Report) |
| 2 | การซื้อขายเงินตราต่างประเทศที่มีมูลค่าเทียบเท่าตั้งแต่ 1,000,000 ดอลลาร์ สรอ.  ขึ้นไป  (FX Trading transaction >=1,000,000 USD) | DF\_FXM | รายธุรกรรม | - ธุรกรรมที่เกิดขึ้นภายใน  ครึ่งวันเช้าจัดส่งภายใน   12.00น.  - ธุรกรรมที่เกิดขึ้นช่วงบ่าย  จัดส่งภายใน 15.30 น.  - ธุรกรรมที่เหลือจัดส่งภายใน   16.30 น.  - ธุรกรรมหลังจากนี้สามารถ  จัดส่งได้ตลอดเวลา และ  สุดท้ายก่อน 8.30 น. ของ  วันทำการถัดไปจะต้อง  จัดส่งให้ครบถ้วน | ตาราง 3 สัญญาคงค้างธุรกรรม Forward (Forward Contracts Balance) ตาราง 4 รายงานธุรกรรมเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินต่างประเทศ (Foreign Exchange Transaction with Non-Resident)  ตาราง 5 รายงานธุรกรรมเงินตรา ต่างประเทศกับลูกค้า (Foreign Exchange Transaction with Non-Bank Resident)  ตาราง 6 รายงานธุรกรรมเงินตรา ต่างประเทศกับธนาคารในประเทศ (Foreign Exchange Transaction with Resident Bank) |
| 3 | การซื้อขายเงินตราต่างประเทศที่มีมูลค่าเทียบเท่าต่ำกว่า 1,000,000 ดอลลาร์ สรอ.  (FX Trading Transaction Under 1,000,000 USD Summary) | DF\_FXU | รายวัน | ภายใน 8.30 น. ของวันทำการถัดจากวันที่เกิดธุรกรรม | - |

# Data File: Data Elements

|  |  |
| --- | --- |
| **Data File:** | 3.1 FX Position (DF\_FXP) |
| **Frequency:** | **Daily** |
| **Input Form:** | **Table 1** |
|  | |

| **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **ธพ.** | | **SFI** | |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M** | **O** | **M** | **O** |
| Organization Id | FI Code | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | X |  | X |  |
| Data Set Date | Date | วันที่ชุดของข้อมูล | X |  | X |  |
| Beginning Balance | Amount | ฐานะเงินตราต่างประเทศ ณ ต้นวัน เทียบเท่า USD | X |  | X |  |
| New Buy Contract Amount | Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD ของสัญญาซื้อ | X |  | X |  |
| New Sell Contract Amount | Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD ของสัญญาขาย | X |  | X |  |
| Net Change in Contract Amount | Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD สุทธิของการเปลี่ยนแปลงฐานะเงินตราต่างประเทศ | X |  | X |  |
| Error Transaction | Amount | จำนวนเทียบเท่า USD ที่เกิดจากสถาบันการเงินรายงานผิดเกินกว่า 1 วัน หรือ ธปท. ตรวจพบข้อผิดพลาด | X |  | X |  |
| Other Transaction | Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD สุทธิของ รายการอื่น ๆ | X |  | X |  |
| Option Notional Amount | Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD ของ Currency Option | X |  | X |  |
| Option Delta Amount | Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD ของ Cash Position ของ Currency Option | X |  | X |  |
| Cash Position Amount | Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD ของมูลค่าปัจจุบันรวมกับ Cash Position ของ Currency Option | X |  | X |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Data File:** | 3.2 FX Trading Transaction >= 1,000,000 USD (DF\_FXM) | | | | | | | |
| **Frequency:** | **Intra-day** | | | | | | | |
| **Input Form:** | **Table 3-6** | | | | | | | |
|  | | | | | | | | |
| **Data Element** | | **Data Type** | **Description** | **ธพ.** | | **SFI** | |
| **M** | **O** | **M** | **O** |
| Organization Id | | FI Code | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | X |  | X |  |
| Data Set Date | | Date | วันที่ชุดของข้อมูล |  |  |  |  |
| Trade Date | | TimeStamp | วันเวลาที่ตกลงซื้อขาย | X |  | X |  |
| Key In Timestamp | | TimeStamp | วันเวลาที่นำข้อมูลเข้าระบบ | X |  | X |  |
| Counter Party Name | | Long Name | ชื่อผู้ทำธุรกรรม | X |  | X |  |
| Counter Party Id | | Identification Number | รหัสมาตรฐานของผู้ทำธุรกรรม  กรณีที่เป็นสถาบันการเงินในประเทศ ให้ระบุ FI CODE | X |  | X |  |
| Counter Party Unique Id Type | | Classification | ประเภทของรหัสมาตรฐานที่ใช้ เช่น เลขประจำตัวประชาชนสำหรับบุคคลธรรมดาใช้ Classification: Unique Id Type | X |  | X |  |
| Counter Party Type | | Classification | ประเภทของผู้ทำธรุกรรม  ใช้ Classification: Involved Party Type | X |  | X |  |
| Country of Non-Resident | | Classification | รหัสประเทศ  ใช้ Classification: Country Id |  | X |  | X |
| FI Arrangement Number | | Identification Number | เลขที่สัญญาของสถาบันการเงิน | X |  | X |  |
| Arrangement Type | | Classification | ประเภทธุรกรรม  ใช้ Classification: Arrangement Type และ Option Right Type | X |  | X |  |
| Leg Type | | Classification | Buy/Sell  ใช้ Classification: Leg Type |  | X |  | X |
| Currency Code | | Classification | รหัสสกุลเงิน  ใช้ Classification: Currency Id | X |  | X |  |
| Start Date | | Date | วันที่สัญญามีผลบังคับใช้ | X |  | X |  |
| Maturity Date | | Date | วันที่ส่งมอบธุรกรรมตามสัญญา Forward และ Derivatives หรือส่งมอบธุรกรรมตามขาหลัง | X |  | X |  |
| Exchange Rate 1 | | Exchange Rate | อัตราแลกเปลี่ยน Spot, Base Rate  หรือFX/THB ของขาแรก |  | X |  | X |
| Exchange Rate 2 | | Exchange Rate | อัตราแลกเปลี่ยน FX/THB ของขาหลังหรือ Forward |  | X |  | X |
| USD Equivalent Amount | | Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD ของ Notional Amount | X |  | X |  |
| Option Delta USD Equivalent Amount | | Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD ของมูลค่า เดลต้า |  | X |  | X |
| Transaction Purpose Code | | Classification | วัตถุประสงค์  ใช้ Classification: Transaction Purpose Code |  | X |  | X |
| Purpose Remarks | | Description | ระบุชื่อเงินลงทุนหรือค่าบริการ กรณี purpose เป็นเงินลงทุนอื่นๆ หรือ ค่าบริการอื่นๆ |  | X |  | X |
| Related FI Arrangement Number \* | | Identification Number | ให้ระบุรหัสเลขที่สัญญาที่อ้างอิง หรือเกี่ยวข้อง |  | X |  | X |
| Set up Reason Type | | Classification | ใช้รายงานในกรณีที่เป็นการทำสัญญาใหม่ เพื่อต่ออายุสัญญาเดิม หรือทำสัญญาตรงข้ามกับสัญญาเดิม หรือเพื่อทดแทนสัญญาเดิม |  | X |  | X |
| Arrangement Remarks | | Description | ระบุชื่อธุรกรรม Derivative ซ้ำซ้อน หรือเลขที่สัญญาก่อนหน้ากรณี Rollover, Cancel by Replacing with New Contract หรือ Unwind |  | X |  | X |

**\* These are repeating data elements, which may occur several times in a record.**

|  |  |
| --- | --- |
| **Data File:** | 3.3 FX Trading Transaction Under 1,000,000 USD Summary (DF\_FXU) |
| **Frequency:** | **Daily** |
| **Input Form:** | **No Input Form** |
|  | |

| **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **ธพ.** | | **SFI** | |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M** | **O** | **M** | **O** |
| Organization Id | FI Code | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | X |  | X |  |
| Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | X |  | X |  |
| Arrangement Type | Classification | ประเภทธุรกรรม  ใช้ Classification: Arrangement Type และ Option Right Type | X |  | X |  |
| Leg Type | Classification | Buy/Sell  ใช้ Classification: Leg Type |  | X |  | X |
| USD Equivalent Amount | Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD | X |  | X |  |

Appendix A: Data Type

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Data Type Name** | **Data Type** | **Format** | **Remark** | **Sample** |
| Date | Char(10) | YYYY-MM-DD | A.D. year | '2002-09-11' |
| Amount | Number(20,2) | NNNNNNNNNN.NN | No leading zeroes | '102000020.20' |
| Classification | VarChar(6) | AAAA | No leading zeroes/blanks | '12345' |
| Identification Number | VarChar(40) | AAAA | No leading zeroes/blanks | '12345' |
| Long Name | VarChar(200) | AAAA | No leading zeroes/blanks | 'XXX' |
| Description | VarChar(400) | AAAA | No leading zeroes/blanks | 'XXX111' |
| Exchange Rate | Number(12,7) | NNNNN.NNNNNNN |  |  |
| FI Code | Char(3) |  | See Standard Code |  |
| Timestamp | VarChar(19) | YYYY-MM-DD HH:MM:SS |  | ‘2016-03-23 16:35:00’ |