

คู่มือการจัดทำชุดข้อมูลเร็วเงินตราต่างประเทศ

(DATA FILE MANUAL)

**Document information**

**Revision history**

| **Version number** | **Date** | **Summary of changes** | **Revision marks** |
| --- | --- | --- | --- |
| **1.0** | **18 June 2007** | **First version** | **No** |
| **1.1** | **3 August 2007** | Reference to file “Summary of Changes from Version 1.0”  Remark: All changes from version 1.0 to version 1.1 are in blue font. | **YES** |
| **2.0** | **18 November 2010** | **Second version**  Reference to file “Summary of Changes from Version 1.0”  Remark: All changes from version 1.0 to version 1.1 are in blue font.  Reference to file “Summary of Changes from Version 1.1”  Remark: All changes from version 1.1 to version 2.0 are in red font. | **YES** |
| **3.0** | **23 July 2018** | **Third version**  Reference to file “Summary of Changes from Version 2.0”  Remark: All changes from version 2.0 to version 3.0 are in blue font. | **Yes** |

สารบัญ

**หน้า**

[1. Data File : FX Position 1-1](#_Toc169943550)

[2. Data File : FX Trading Transaction >= 1,000,000 USD 2-1](#_Toc169943551)

[3. Data File : FX Trading Transaction Under 1,000,000 USD Summary 3-1](#_Toc169943552)

[4. Appendix A: รายละเอียดการรายงานรหัสมาตรฐานของผู้ทำธุรกรรม (Counter Party Id) 4-1](#_Toc169943553)

# Data File : FX Position

**คำอธิบาย**

Data File ชุด FXP (FX Position ) เป็นข้อมูลเกี่ยวกับฐานะเงินตราต่างประเทศสุทธิ (เริ่มต้นรายงานโดยใช้ Position ทั้งธุรกิจทันทีและล่วงหน้าของ DS\_FTS) โดยแสดงยอดคงค้าง ณ ต้นวันเป็นค่าเทียบเท่าสกุลดอลลาร์สรอ. อัตราแลกเปลี่ยนที่ใช้ในการแปลงค่าฐานะเงินสกุลอื่น ๆเป็นดอลลาร์สรอ. ให้ใช้อัตราแลกเปลี่ยนจากแหล่งข้อมูลที่ใช้กันโดยทั่วไปหรือใช้อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศแต่ละสกุลเทียบเท่าเงินดอลลาร์สรอ. ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยเผยแพร่ โดยต้องใช้อัตราแลกเปลี่ยนจากแหล่งข้อมูลเดิมอย่างสม่ำเสมอ และต้องเป็นอัตราแลกเปลี่ยนเดียวกับที่ใช้ในคำนวณ DF\_FXM และ DF\_FXU

**รายละเอียดการรายงาน**

รายละเอียดการรายงาน FX Position

**+ Beginning Balance** XXX (เป็นยอดคงค้างของ DS\_FTS ของ ธุรกิจทันทีและล่วงหน้าสุทธิ ณ ต้นวัน)

**+ New Buy Contract Amount** XX (รายการNew+Rollover+Unwind+Cancel by Replacing with New Contract แลกกับบาทเฉพาะด้านซื้อ)

**- New Sell Contract Amount** X (รายการNew+Rollover+Unwind+Cancel by Replacing with New Contract แลกกับบาทเฉพาะด้านขาย)

**+ Net Change in Contract Amount** XX (เป็นยอด Net ของรายการ No delivery+Cancel+Rollover+Cancel by Replacing with New Contract ของสัญญาแลกกับบาท)

**+ Error Transaction X** (กรณีสถาบันการเงินรายงานผิดพลาดเกิน 1 วันหรือธปท.ตรวจสอบพบข้อผิดพลาด)

**+ Other transaction** X (เป็นยอด Net ของรายการอื่นๆ เช่น P/L + Conversion +Adjust Rate+อื่นๆ)

+ ฐานะเงินตราต่างประเทศ ตาม DS\_FTS XXX (เป็นยอดคงค้างของ DS\_FTS ของ ธุรกิจทันทีและล่วงหน้าสุทธิ ณ สิ้นวัน)

**+ Option Notional Amount** XX (กรณียอดคงค้างฐานะเงินตราต่างประเทศมีสัญญา Currency Option ซึ่งเท่ากับแบบรายงานฐานะรวมหัวข้อ 7)

+ **Option Delta Amount**  X (กรณีมีการปรับฐานะเงินตราต่างประเทศด้วยค่าเดลต้า ซึ่งเท่ากับแบบรายงานฐานะรวมหัวข้อ 8)

+ Ending Balance XXX (ฐานะเงินตราต่างประเทศที่ปรับด้วยค่าเดลต้า)

+ **Cash Position Amount** XXX (ถ้า Hedge Position ด้วยค่า NPV Cash Position Amount เท่ากับค่าเดลต้ารวมกับค่าNPV แต่ถ้าไม่ได้ Hedge Position

ด้วยค่า NPV Cash Position = Ending Balance)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

นิติบุคคลรับอนุญาต ซึ่งหมายถึง ตัวแทนรับอนุญาตตามประกาศกระทรวงการคลัง เรื่อง คำสั่งรัฐมนตรีให้ไว้แก่ตัวแทนรับอนุญาต ลงวันที่ 31 มีนาคม 2547 และนิติบุคคลที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น และได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจเกี่ยวกับปัจจัยชำระเงินต่างประเทศ ได้แก่

ธนาคารพาณิชย์

ตัวแทนรับอนุญาตอื่น

**ลักษณะข้อมูล**

รายวัน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกต้นวัน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 8.30 น. ของวันทำการถัดจากวันที่เกิดธุรกรรม

**การตรวจสอบความถูกต้องของข้อมูล (Validation Rule)**

ระบบจะแจ้งข้อความเตือน (Warning Message) ในกรณีที่สถาบันการเงินจัดส่งข้อมูลไม่เป็นไปตามเงื่อนไขที่กำหนดใน Validation Rule

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูลจะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล โดย Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) |  |
| Beginning Balance | จำนวนเงินเทียบเท่า USD รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก ถ้าฐานะเงินตราต่างประเทศเกินดุลให้ใส่ค่า + แต่ถ้าฐานะเงินตราต่างประเทศขาดดุลให้ใส่เครื่องหมาย -  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) |  |
| New Buy Contract Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD ที่เกิดจากการทำสัญญาใหม่ ต่ออายุสัญญา Unwind และ Cancel by Replacing with New Contract ด้านซื้อ โดยให้ใส่ค่าเป็น + เสมอ | 1. 1. มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 2. 2. มีค่าเท่ากับยอดรวม USD Equivalent Amount ของ DF\_FXM และ DF\_FXU ถ้า Leg Type ของ DF\_FXM และ DF\_FXU =182001 (Buy Foreign Currency) |
| New Sell Contract Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD ที่เกิดจากการทำสัญญาใหม่ ต่ออายุสัญญา Unwind และ Cancel by Replacing with New Contract ด้านขาย โดยให้ใส่ค่าเป็น – เสมอ | 1. 1. มีค่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ 0 2. 2. ค่าสัมบูรณ์ของ New Sell Contract Amount มีค่าเท่ากับยอดรวม USD Equivalent Amount ของ DF\_FXM และ DF\_FXU ถ้า Leg Type ของ DF\_FXM และ DF\_FXU =182002 (Sell Foreign Currency) |
| Net Change in Contract Amount | จำนวนเงินสุทธิเทียบเท่า USD ที่เกิดจาก No Delivery Cancel Rollover และ Cancel by Replacing with New Contract ถ้าทำให้ฐานะเกินดุลให้ใส่เครื่องหมาย + แต่ถ้าทำให้ฐานะขาดดุลให้ใส่เครื่องหมาย - |  |
| Error Transaction | จำนวนเงินเทียบเท่า USD ที่เกิดจากสถาบันการเงินรายงานผิดพลาดเกิน 1 วัน หรือ ธปท. ตรวจสอบพบข้อผิดพลาด ถ้าข้อผิดพลาดทำให้ฐานะเกินดุลให้ใส่เครื่องหมาย + แต่ถ้าทำให้ฐานะขาดดุลให้ใส่เครื่องหมาย - |  |
| Other Transaction | ยอดสุทธิเทียบเท่า USD ของรายการอื่นเช่น  1. จำนวนเงินสุทธิเทียบเท่า USD ของรายการรับจ่าย DS\_PTX  2. จำนวนเงินสุทธิเทียบเท่า USD ของการแลกเงินต่างสกุล   1. 3. การปรับปรุงอัตราแลกเปลี่ยนของฐานะเงินตราต่างประเทศยกไปและยกมา 2. 4. อื่น ๆ เช่น FX swap ที่ Fixed Baht 3. ถ้าทำให้ฐานะเกินดุลให้ใส่เครื่องหมาย + แต่ถ้าทำให้ฐานะขาดดุลให้ใส่ เครื่องหมาย - |  |
| Option Notional Amount | จำนวน Notional Amount สุทธิเทียบเท่า USD ของสัญญา Option ในฐานะเกินดุลสุทธิใน DS\_FTS ให้นำยอดดังกล่าวบันทึกใส่เครื่องหมาย – ส่วนกรณีขาดดุลสุทธิให้นำยอดดังกล่าวบันทึกโดยใส่เครื่องหมาย + |  |
| Option Delta Amount | จำนวนเทียบเท่า USD ยอดรวมสุทธิของการนำวงเงินตามสัญญา (Notional amount) แต่ละสัญญาไปคูณกับค่าเดลต้าของแต่ละสัญญาในกรณีที่ยอดรวมสุทธิเกินดุลให้ใส่เครื่องหมาย + และถ้ายอดรวมสุทธิขาดดุลให้ใส่เครื่องหมาย –  ทั้งนี้ ค่าเดลต้าแต่ละสัญญาคือ อัตราส่วนการเปลี่ยนแปลงมูลค่า Currency Options ทั้งสิ้นต่อการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนของเงินสกุลต่างประเทศในสกุลนั้น |  |
| Cash Position Amount | ฐานะเงินตราต่างประเทศที่ปรับค่าจาก Notional Amount เป็น Cash Position เกิดจาก   1. Notional Amount เป็น Net Present Value 2. Currency Option เป็นค่า Delta Amount |  |

# Data File : FX Trading Transaction >= 1,000,000 USD

**คำอธิบาย**

Data File ชุด FXM (FX Trading Transaction >= 1,000,000 USD) เป็นข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายเงินตราต่างประเทศทุกสกุลเงินแลกกับบาท (ไม่รวมการแลกเงินต่างสกุล) กับทุกประเภทคู่สัญญา และทุกประเภทธุรกรรมเป็นรายสัญญาที่มีจำนวนเทียบเท่าตั้งแต่ 1,000,000 ดอลลาร์สรอ. ขึ้นไป ใช้รายงานเฉพาะการทำสัญญาใหม่ ส่วนอัตราแลกเปลี่ยนที่ใช้ในการแปลงค่า  
ธุรกรรมเงินสกุลอื่น ๆเป็นดอลลาร์สรอ. ให้ใช้อัตราแลกเปลี่ยนจากแหล่งข้อมูลที่ใช้กันโดยทั่วไปหรือใช้อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศแต่ละสกุลเทียบเท่าเงินดอลลาร์สรอ. ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยเผยแพร่ โดยต้องใช้อัตราแลกเปลี่ยนจากแหล่งข้อมูลเดิมอย่างสม่ำเสมอ และต้องเป็นอัตราแลกเปลี่ยนเดียวกับที่ใช้ในคำนวณ DF\_FXP และ DF\_FXU

* Spot ที่มีระยะเวลาการส่งมอบเงินในวันเดียวกันกับวันที่ทำสัญญา (Today) วันทำการถัดไป (Tomorrow) หรือสองวันทำการถัดไป (Next)
* Outright Forward
* Swap

Buy Swap (Sell - Buy Swap )

Sell Swap (Buy - Sell Swap )

* Option

Buy Call

Sell Call

Buy Put

Sell Put

* Futures
* Cross Currency Swap

**รายละเอียดการรายงาน**

1. การรายงานวันที่ทำธุรกรรม วันเริ่มต้นสัญญาและวันครบกำหนด

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Arrangement Type** | **Trade Date** | **Start Date** | **Maturity Date** | **Exchange Rate1** | **Exchange Rate2** | **Leg Type** |
| Spot | T=0 | T=0 | T=0/T+1/T+2 | XX |  | Buy/Sell |
| Forward | T=0 | T+2 | ตามจริง | Base Rate | XX | Buy/Sell |
| Buy or Sell Swap | T=0 | Maturity ขาแรก | Maturity ขาหลัง | XX= ขาแรก | XX= ขาหลัง | Null |
| Cross Currency Swap | T=0 | Maturity ขาแรก | Maturity ขาแรก | XX= ขาแรก |  | Buy/Sell |
|  | T=0 | Maturity ขาแรก | Maturity ขาหลัง |  | XX= ขาหลัง | Buy/Sell |
| Buy Call | T=0 | ตามจริง | ตามจริง |  | XX | Buy |
| Sell Call | T=0 | ตามจริง | ตามจริง |  | XX | Sell |
| Buy Put | T=0 | ตามจริง | ตามจริง |  | XX | Sell |
| Sell Put | T=0 | ตามจริง | ตามจริง |  | XX | Buy |
| Futures | T=0 | ตามจริง | ตามจริง |  | XX | Buy/Sell |

2. กรณีธุรกรรมเป็นสัญญา Cross Currency Swap ให้รายงาน Leg Type ดังนี้

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Cross Currency Swap** | **การส่งมอบ** | **ตัวอย่าง** | **หมายเหตุ** | **การส่งมอบ** | **ตัวอย่าง** | **หมายเหตุ** | **การส่งมอบ** | **ตัวอย่าง** | **หมายเหตุ** |
| Initial Buy Currency Id | 🗴 | USD | ไม่รายงาน | 🗸 | USD | Leg Type= Buy | 🗸 | USD | Leg Type= Buy |
| Initial Sell Currency Id | 🗴 | THB | 🗸 | THB | 🗸 | THB |
| Final Buy Currency Id | 🗸 | THB | Leg Type=  Sell | 🗴 | THB | ไม่รายงาน | 🗸 | THB | Leg Type= Sell |
| Final Sell Currency Id | 🗸 | USD | 🗴 | USD | 🗸 | USD |

**หมายเหตุ** กรณี Cross Currency Swap ให้รายงานไม่เกิน 2 Records และสามารถใช้ FI Arrangement Number เลขเดียวกันได้

3. กรณีเป็นการต่ออายุสัญญา (Rollover) การยกเลิกโดยมีสัญญาใหม่ทดแทน (Cancel by Replacing with New Contract) และ Unwind ให้รายงาน เช่น

3.1 กรณีการต่ออายุสัญญาเมื่อสัญญาตั้งต้นสิ้นสุด (กรณีนี้คือสัญญา FWD001) และต้องการต่ออายุสัญญา จะทำให้เกิดการยกเลิกสัญญาตั้งต้น และมีสัญญาใหม่เกิดขึ้น (กรณีนี้คือสัญญา FWD002) พร้อมกัน การรายงานต่ออายุสัญญานั้นให้รายงานเฉพาะสัญญาใหม่คือ FWD002 ที่ต่ออายุสัญญาตั้งต้นโดยใน Data Element : Related FI Arrangement Number ให้อ้างอิงสัญญาตั้งต้น และData Element : Arrangement Remarks ให้รายงานระบุว่า Rollover ทั้งนี้ไม่ต้องรายงานการยกเลิกสัญญาตั้งต้น

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **FI Arrangement No** | **Trade Date** | **Start Date** | **Maturity Date** | **Exchange Rate1** | **Exchange Rate2** | **Related FI Ar No** | **AR Remarks** |
| FWD001 | 2007-04-17 | 2007-04-19 | 2007-05-19 | 35.00 | 35.50 |  |  |
| FWD002 | 2007-05-21 | 2007-05-23 | 2007-06-23 | 35.10 | 35.70 | FWD001 | Rollover |

3.2 กรณีการยกเลิกโดยมีสัญญาใหม่ทดแทน (Cancel by Replacing with New Contract) ให้ระบุใน Data Element : Related FI Arrangement Number ให้อ้างอิงสัญญาตั้งต้น และData Element : Arrangement Remarks ให้รายงานระบุว่า Cancel by Replacing with New Contract

3.3 กรณี Unwind สัญญานั้นมีสัญญาใหม่เกิดขึ้นนั้นให้ระบุใน ใน Data Element : Related FI Arrangement Number ให้อ้างอิงสัญญาตั้งต้น ที่ถูก Unwind และData Element : Arrangement Remarks ให้รายงานระบุว่า Unwind ในสัญญาใหม่ที่เกิดขึ้น

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

นิติบุคคลรับอนุญาต ซึ่งหมายถึง ตัวแทนรับอนุญาตตามประกาศกระทรวงการคลัง เรื่อง คำสั่งรัฐมนตรีให้ไว้แก่ตัวแทนรับอนุญาต ลงวันที่ 31 มีนาคม 2547 และนิติบุคคลที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น และได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจเกี่ยวกับปัจจัยชำระเงินต่างประเทศ ได้แก่

ธนาคารพาณิชย์

ตัวแทนรับอนุญาตอื่น

**ลักษณะข้อมูล**

รายธุรกรรม

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ธุรกรรมที่เกิดขึ้นภายในครึ่งวันเช้าให้ส่งภายใน 12.00 น.

ธุรกรรมที่เกิดขึ้นช่วงบ่ายส่งภายใน 15.30 น.

และที่เหลือส่งภายใน 16.30 น.

ธุรกรรมหลังจากนี้สามารถจัดส่งได้ทุกช่วงเวลา

และสุดท้ายก่อน 8.30 น. ของวันทำการถัดไป ต้องจัดส่งให้ครบถ้วน

**ทั้งนี้ การส่งข้อมูลในแต่ละรอบจะต้องจัดส่งข้อมูลตั้งแต่รอบแรกรวมมาด้วย**

**กำหนดการส่ง**

ภายในกำหนดการจัดส่งข้อมูลในแต่ละรอบ

**การตรวจสอบความถูกต้องของข้อมูล (Validation Rule)**

ระบบจะแจ้งข้อความเตือน (Warning Message) ในกรณีที่สถาบันการเงินจัดส่งข้อมูลไม่เป็นไปตามเงื่อนไขที่กำหนดใน Validation Rule

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล โดยมี Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) |  |
| Trade Date | วันเวลาที่ตกลงซื้อขาย โดยมี Data Type = Varchar(19) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น YYYY-MM-DD HH:MM:SS เช่น ทำธุรกรรม วันที่ 31 ตุลาคม 2561 เวลา 15:35 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ  2018-10-31 15:35:00  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) | วันเดือนปีที่ทำธุรกรรมต้อง มีค่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ Data Set Date |
| Key In Timestamp | วันเวลาที่นำข้อมูลเข้าระบบ โดยมี Data Type = Varchar(19) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น YYYY-MM-DD HH:MM:SS เช่น ทำธุรกรรม วันที่ 31 ตุลาคม 2561 เวลา 16:00 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2018-10-31 16:00:00  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) | วันเดือนปีที่นำข้อมูลเข้าระบบต้อง มีค่ามากกว่า หรือเท่ากับ วันเดือนปีที่ทำธุรกรรม |
| Counter Party Name | ชื่อผู้ทำธุรกรรม  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) |  |
| Counter Party Id | รหัสมาตรฐานของผู้ทำธุรกรรม  กรณีที่เป็นการซื้อขายเงินตราต่างประเทศกับสถาบันการเงินในประเทศให้ระบุรหัสสถาบันการเงิน (FI CODE) สำหรับผู้ทำธุรกรรมประเภทอื่น ให้รายงานรหัสมาตรฐานตามวิธีที่ปรากฏใน Appendix A ของ Data File Manual |  |
| Counter Party Unique Id Type | ประเภทรหัสมาตรฐานของคู่สัญญา  ตัวอย่าง 324001 คือ Personal Id (Classification Name: Unique Id Type) | ค่าที่เป็นไปได้ตาม Classification Unique Id Type |
| Counter Party Type | ประเภทของผู้ทำธุรกรรม  (Classification Name: Involved Party Type) | ค่าที่เป็นไปได้ตาม Classification Involved Party Type |
| Country of Non-Resident | กรณีที่ผู้ทำธุรกรรมเป็น Counter Party Type ที่มีค่าภายใต้ 176066 บุคคลผู้มีถิ่น ที่อยู่ในต่างประเทศให้ระบุรหัสประเทศ  (Classification Name: Country Id) | ค่าที่เป็นไปได้ตาม Classification Country Id |
| FI Arrangement Number | เลขที่สัญญาของสถาบันการเงิน  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) |  |
| Arrangement Type | ค่าที่เป็นไปได้ใน Arrangement Type คือ  018101 Today  018102 Tomorrow  018103 Next  018104 Forward  018106 Buy Swap (Sell-Buy Swap)  018107 Sell Swap (Buy -Sell Swap)  018109 Future  018110 Cross Currency Swap  และ Option Right Type คือ  218004 Buy Call  218005 Sell Call  218006 Buy Put  218007 Sell Put  (Classification Name: Arrangement Type และ Option Right Type) | ค่าที่เป็นไปได้ใน Arrangement Type คือ  018101 Today  018102 Tomorrow  018103 Next  018104 Forward  018106 Buy Swap (Sell-Buy Swap)  018107 Sell Swap (Buy -Sell Swap)  018109 Future  018110 Cross Currency Swap  และ Option Right Type คือ  218004 Buy Call  218005 Sell Call  218006 Buy Put  218007 Sell Put |
| Leg Type | 1. ค่าที่เป็นไปได้คือ 182001 Buy Foreign Currency และ 182002 Sell Foreign Currency  2. กรณีที่เป็นธุรกรรมที่เป็นสัญญา FX Swap ไม่ต้องระบุค่า  (Classification Name: Leg Type) | 1. ค่าที่เป็นไปได้คือ 182001 Buy Foreign Currency และ 182002 Sell Foreign Currency  2. ถ้า Arrangement Type มีค่าเท่ากับ 018106 ( Buy Swap) หรือ 018107 (Sell Swap) Leg Type ต้องไม่มีค่า  ถ้า Arrangement Type มีค่าไม่เท่ากับ 018106 (Buy Swap) หรือ 018107 (Sell Swap) Leg Type ต้องมีค่า |
| Currency Code | รหัสสกุลเงิน  (Classification Name: Currency Id) | ค่าที่เป็นไปได้ตาม Classification Currency Id |
| Start Date | วันที่สัญญามีผลบังคับใช้ เช่น สัญญา Forward ให้รายงาน 2 วันทำการถัดไปนับจากวันที่ Trade Date หรือกรณี Swap เป็นวันที่ส่งมอบธุรกรรมขาแรก  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) | มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ Trade Date |
| Maturity Date | วันที่สัญญาครบกำหนด หรือกรณี Swap เป็นวันที่ส่งมอบธุรกรรมขาหลัง  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) | มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ Trade Date และ Start Date |
| Exchange Rate 1 | 1. อัตราแลกเปลี่ยนที่ตกลงกันสำหรับธุรกรรม Spot  2. กรณีเป็น Swap ให้รายงานอัตราแลกเปลี่ยน FX/THB ของขาแรก  3. กรณีเป็น Forward ให้รายงานอัตราแลกเปลี่ยนที่เป็น Base Rate (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) | 1. ถ้า Arrangement type = 218004, 218005, 218006 or 218007 แล้ว   Exchange Rate1 ต้องไม่มีค่า  2. ถ้า Arrangement type = 018101, 018102, 018103 or 018104   Exchange Rate 1 ต้องมีค่า  3. ถ้า Exchange Rate 1 มีค่า จะมีค่ามากกว่า 0 |
| Exchange Rate 2 | 1. กรณีเป็น Swap ให้รายงานอัตราแลกเปลี่ยน FX/THB ของขาหลัง  2. กรณีเป็น Forward Future หรือ Option ให้รายงานอัตราแลกเปลี่ยนตามสัญญาหรือที่ตกลงกัน  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) | 1. ถ้า Arrangement type = 018101, 018102 or 018103 แล้ว  Exchange Rate 2 ต้องไม่มีค่า  2. ถ้า Arrangement type = 018104 แล้ว  Exchange Rate 2 ต้องมีค่า  3. ถ้า Exchange Rate 2 มีค่า จะมีค่ามากกว่า 0 |
| USD Equivalent Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD | 1. มีค่ามากกว่า 0 |
| Option Delta USD Equivalent Amount | กรณีที่ Arrangement Type เป็นประเภท Option เช่น Buy Call Sell Call Buy Put Sell Put ให้รายงานจำนวนเงินเทียบเท่า USD ของการนำวงเงินตามสัญญา Notional Amount คูณกับค่าเดลต้าของสัญญานั้น ค่าเดลต้าคือ อัตราส่วนการเปลี่ยนแปลงมูลค่าทั้งสิ้นต่อการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยนของเงินสกุล ต่างประเทศนั้น ๆ | มีค่ามากกว่า 0 |
| Transaction Purpose Code | วัตถุประสงค์ในการทำสัญญาให้รายงานเฉพาะธุรกรรมที่ทำกับลูกค้า  (Classification Name: Transaction Purpose Code) | 1. กรณีวัตถุประสงค์เป็นค่าสินค้าให้ใช้วัตถุประสงค์ระดับหมวด นอกจากนั้นให้ใช้วัตถุประสงค์ระดับหมวดย่อย 2.Transaction Purpose Code ไม่มีค่า เมื่อ Counter Party Type เป็นนิติบุคคลรับอนุญาต |
| Purpose Remarks | ค่าบริการอื่นๆ และเงินลงทุนอื่นๆ เช่นกรณีลงทุนใน Financial Derivatives Warrants Futures Swaps Interest Rate Derivatives หรือ เงินลงทุนใน หน่วยลงทุน เป็นต้น  จำนวน 400 ตัว ไม่ระบุรูปแบบ (Free Format)  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) |  |
| Related FI Arrangement Number | 1. กรณีเป็นสัญญาประเภท Exotic ให้ระบุรหัสเลขที่สัญญาที่เกี่ยวข้อง 2. กรณีต่ออายุสัญญา (Rollover) ให้ระบุเลขที่สัญญาก่อนหน้า 3. กรณีที่เป็นสัญญา Cross Currency Swap ให้รายงานเลขที่สัญญาของคู่ Cross Currency Swap |  |
| Set up Reason Type | ใช้รายงานในกรณีที่เป็นการทำสัญญาใหม่ เพื่อต่ออายุสัญญาเดิม (Rollover from Another Arrangement) หรือทำสัญญาตรงข้ามกับสัญญาเดิม (Unwind Another Arrangement) หรือเพื่อทดแทนสัญญาเดิม (Replace a Cancelled Arrangement) ทั้งนี้สามารถรายงานเลขที่สัญญา หรือ Descripton อื่นๆที่เกี่ยวข้องได้ใน Arrangement Remarks  (Classification Name : Set Up Reason Type) |  |
| Arrangement Remarks | หมายเหตุของการทำสัญญา โดยระบุชื่อธุรกรรม Derivative ซ้ำซ้อน หรือเลขที่สัญญาก่อนหน้ากรณี Rollover, Cancel by Replacing with New Contract หรือ Unwind  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) |  |

# 

# Data File : FX Trading Transaction Under 1,000,000 USD Summary

**คำอธิบาย**

Data File ชุด FXU (FX Trading Transaction Under 1,000,000 USD Summary) เป็นข้อมูลสรุปเกี่ยวกับ การซื้อขายเงินตราต่างประเทศทุกสกุลเงินแลกกับบาท (ไม่รวมการแลกเงินต่างสกุล) กับทุกประเภทคู่สัญญา และทุกประเภทธุรกรรมเป็นที่มีจำนวนต่ำกว่า 1,000,000 ดอลลาร์สรอ. โดยรายงานเป็นยอดรวมจำแนกตามด้านซื้อขาย และประเภทธุรกรรม ใช้รายงานเฉพาะการทำสัญญาใหม่ ส่วนอัตราแลกเปลี่ยนที่ใช้ในการแปลงค่าธุรกรรมเงินสกุลอื่น ๆเป็นดอลลาร์สรอ. ให้ใช้อัตราแลกเปลี่ยนจากแหล่งข้อมูลที่ใช้กันโดยทั่วไปหรือใช้อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศแต่ละสกุลเทียบเท่าเงินดอลลาร์สรอ. ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยเผยแพร่ โดยต้องใช้อัตราแลกเปลี่ยนจากแหล่งข้อมูลเดิมอย่างสม่ำเสมอ และต้องเป็นอัตราแลกเปลี่ยนเดียวกับที่ใช้ในคำนวณ DF\_FXP และ DF\_FXM

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

นิติบุคคลรับอนุญาต ซึ่งหมายถึง ตัวแทนรับอนุญาตตามประกาศกระทรวงการคลัง เรื่อง คำสั่งรัฐมนตรีให้ไว้แก่ตัวแทนรับอนุญาต ลงวันที่ 31 มีนาคม 2547 และนิติบุคคลที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น และได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจเกี่ยวกับปัจจัยชำระเงินต่างประเทศ ได้แก่

ธนาคารพาณิชย์

ตัวแทนรับอนุญาตอื่น

**ลักษณะข้อมูล**

รายวัน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกต้นวัน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 8.30 น. ของวันทำการถัดจากวันที่เกิดธุรกรรม

**การตรวจสอบความถูกต้องของข้อมูล (Validation Rule)**

ระบบจะแจ้งข้อความเตือน (Warning Message) ในกรณีที่สถาบันการเงินจัดส่งข้อมูลไม่เป็นไปตามเงื่อนไขที่กำหนดใน Validation Rule

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล โดยมี Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A ของ Data File Document : Data Type) |  |
| Arrangement Type | ประเภทธุรกรรม  (Classification Name: Arrangement Type และ Option Right Type) | ค่าที่เป็นไปได้ใน Arrangement Type คือ  018101 Today  018102 Tomorrow  018103 Next  018104 Forward  018106 Buy Swap (Sell-Buy Swap)  018107 Sell Swap (Buy -Sell Swap)  018109 Future  018110 Cross Currency Swap  และ Option Right Type คือ  218004 Buy Call  218005 Sell Call  218006 Buy Put  218007 Sell Put |
| Leg Type | 1. ค่าที่เป็นไปได้คือ 182001 Buy Foreign Currency และ 182002 Sell Foreign Currency  2. กรณีที่เป็นธุรกรรมที่เป็นสัญญา FX Swap ไม่ต้องระบุค่า  (Classification Name: Leg Type) | 1. ค่าที่เป็นไปได้คือ 182001 Buy Foreign Currency และ 182002 Sell Foreign Currency  2. ถ้า Arrangement Type มีค่าเท่ากับ 018106 ( Buy Swap) หรือ 018107 (Sell Swap) Leg Type ต้องไม่มีค่า  ถ้า Arrangement Type มีค่าไม่เท่ากับ 018106 (Buy Swap) หรือ 018107 (Sell Swap) Leg Type ต้องมีค่า |
| USD Equivalent Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD | 1. มีค่ามากกว่า 0 |

# Appendix A: รายละเอียดการรายงานรหัสมาตรฐานของผู้ทำธุรกรรม (Counter Party Id)

วิธีรายงาน Counter Party Id ให้ปฏิบัติเช่นเดียวกับการรายงาน Data Set ชุดข้อมูลเกี่ยวกับลูกค้าสถาบันการเงิน (Data Set ชุด Involved Party) ประกอบด้วย

**1. ลูกค้าในประเทศ** ได้แก่

* บุคคลธรรมดา ใช้เลขประจำตัวประชาชน (13 หลัก)
* ธุรกิจ
  + กรณีจดทะเบียนกับกระทรวงพาณิชย์ ใช้เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลที่จดทะเบียนกับกระทรวงพาณิชย์
  + กรณีจดทะเบียนกับหน่วยงานอื่น เช่น กระทรวงเกษตรและสหกรณ์ ใช้รหัสที่ออกโดยหน่วยงานผู้รับจดทะเบียน
  + กรณีไม่ได้จดทะเบียนนิติบุคคลให้ใช้เลขประจำตัวผู้เสียภาษีอากร (10 หลัก) เช่น กิจการร่วมค้า สมาคม มูลนิธิ สำนักงานตัวแทนและสาขาบริษัทต่างประเทศ  
    ที่ไม่ได้จดทะเบียนนิติบุคคลในประเทศ เป็นต้น
* กองทุน ใช้รหัสที่ออกโดย กลต. หรือเลขประจำตัวผู้เสียภาษีอากร
* องค์กรภาคทางการไทยหรือหน่วยงานของรัฐ ใช้รหัสองค์กรหรือหน่วยงานราชการ
* รัฐบาลท้องถิ่น ใช้เลขประจำตัวผู้เสียภาษีอากร
* สถาบันที่ไม่มีวัตถุประสงค์เพื่อหากำไร ใช้เลขประจำตัวผู้เสียภาษีอากร

**2. สถาบันการเงินในประเทศ** ได้แก่

* ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ สาขาธนาคารต่างประเทศ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ผู้ประกอบธุรกิจบัตรเครดิตที่มิใช่  
  สถาบันการเงิน บริษัทบริหารสินทรัพย์ ใช้รหัสสถาบันการเงิน (FI Code)
* กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน สถาบันประกันเงินฝาก ใช้เลขประจำตัวผู้เสียภาษีอากร
* บริษัทหลักทรัพย์ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม บริษัทประกันชีวิต โรงรับจำนำ และสถาบันการเงินอื่น ใช้เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลที่จดทะเบียนกับกระทรวงพาณิชย์
* สหกรณ์ออมทรัพย์, ชุมนุมสหกรณ์ออมทรัพย์ ใช้รหัสที่ออกโดยกระทรวงเกษตรและสหกรณ์ หรือ เลขที่ประจำตัวผู้เสียภาษีอากร

**3. ลูกค้าในต่างประเทศ** ได้แก่

* บุคคลธรรมดา
  + กรณีมีเลขหนังสือเดินทาง ใช้รหัสประเทศ+เลขที่หนังสือเดินทาง
  + กรณีไม่มีเลขหนังสือเดินทาง ใช้รหัสประเทศ+รหัสบุคคลธรรมดาในประเทศนั้น
* ธนาคาร สถาบันการเงิน และนิติบุคคล (รวมสาขาธนาคารพาณิชย์ไทยในต่างประเทศ)
  + กรณีเป็นสมาชิก Swift ใช้รหัสมาตรฐาน Swift Code
  + กรณีไม่ได้เป็นสมาชิก Swift ใช้รหัสประเทศ+รหัสนิติบุคคล หรือรหัสองค์กรหรือหน่วยงานราชการที่จดทะเบียนในประเทศนั้น