

คำถาม-คำตอบ การรายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และ อนุพันธ์ (PIA)

ลำดับ	คำถาม	คำตอบ	วันที่ Update
1	ใครต้องรายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์บ้าง	1.1 กรณีที่มีการขอวงเงินจาก ก.ล.ต. ผ่าน FIA (Foreign Investment Allotment) ให้ผู้ขอวงเงินจาก ก.ล.ต. ผ่าน FIA เป็นผู้รายงานข้อมูล 1.2 กรณีที่ไม่ต้องขอวงเงินจาก ก.ล.ต. ผ่าน FIA ให้เจ้าของเงินลงทุนหรือ ผู้ลงทุนสถาบันอื่นที่ได้รับมอบหมายเป็นผู้รายงานข้อมูล 1.3 กรณีที่เป็นบุคคลลงทุนผ่าน brokers หรือลงทุนผ่าน private funds ให้ผู้ขอวงเงินจาก ก.ล.ต. ผ่าน FIA เป็นผู้รายงานข้อมูล 1.4 กรณีที่เป็นผู้ที่มีหน้าที่รายงานข้อมูลตามเงื่อนไขข้างต้น มีความประสงค์ให้ผู้ลงทุนสถาบันอื่นรายงานข้อมูลแทน จะต้องมียกข้อยกเว้นมอบหมาย แจ้งมายัง ธปท.	9-มี.ค.-58
2	หากต้องรายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์ โดยได้รับแจ้งว่าให้รายงานข้อมูลมายัง ธปท. สามารถหาข้อมูล และวิธีการรายงานจากที่ใดได้บ้าง	2.1 สามารถตรวจสอบเอกสารที่เกี่ยวข้อง ได้จาก http://www.bot.or.th เลือก "สถิติ" >> "การรับส่งข้อมูลกับ ธปท." >> "แบบรายงานและเอกสารชี้แจง ข้อมูลตลาดการเงิน" >> "ข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์" (https://www.bot.or.th/Thai/Statistics/DataManagementSystem/ReportDocFinMarket/PIA_Report/Pages/default.aspx) 2.2. ในการส่งข้อมูลมายัง ธปท. ผู้มีหน้าที่รายงานต้องขอใช้บริการการรับส่งข้อมูลกับ ธปท. ผ่านช่องทางการรับส่งข้อมูล (Data Acquisition-DA) โดยสามารถศึกษาวิธีการดำเนินการรับส่งข้อมูลกับ ธปท. จาก http://www.bot.or.th เลือก "สถิติ" >> "การรับส่งข้อมูลกับ ธปท." (https://www.bot.or.th/Thai/Statistics/DataManagementSystem/Pages/default.aspx)	9-มี.ค.-58
3	การมอบหมายให้ผู้ลงทุนสถาบันอื่นเป็นผู้รายงานแทน (Agent) สามารถทำอะไรได้บ้าง	ผู้มีหน้าที่รายงานข้อมูลต้องมีหนังสือมอบหมายผู้รายงานแทนพร้อมลงนามจากผู้มีอำนาจ แจ้งมายัง ธปท. โดยผู้มีหน้าที่รายงานแทนต้องแจ้งขอใช้บริการการรับส่งข้อมูลกับ ธปท. ผ่านช่องทางการรับส่งข้อมูล (Data Acquisition-DA) โดยสามารถศึกษาวิธีการรับส่งข้อมูลกับ ธปท. จาก Link ในข้อ 2.2 * ในการรายงานข้อมูลมายัง ธปท. นั้น เมื่อได้มอบหมายให้ Agent รายงานมาแล้ว ผู้มีหน้าที่รายงานไม่ต้องรายงานรายการนั้นซ้ำอีก เพื่อป้องกันการส่งข้อมูลซ้ำ	9-มี.ค.-58
4	ในการระบบบทบาทผู้รายงาน (Provider Role and Responsibility) นั้น ควรระบุอย่างไร	4.1 กรณีที่ผู้รายงานข้อมูลและเจ้าของเงินลงทุนเป็นรายเดียวกัน ให้รายงาน Provider Role and Responsibility เป็น “การลงทุนเพื่อตนเอง” โดยสามารถระบุได้ 3 Roles ต่อไปนี้ 0703600001 เพื่อตนเอง ลงทุนเอง (proprietary trade) 0703600002 เพื่อตนเอง ลงทุนผ่าน Broker 0703600003 เพื่อตนเอง บล./บลจ. บริหาร 4.2 กรณีผู้รายงานไม่ใช่เจ้าของเงินลงทุน รวมถึง บลจ. ที่รายงานการลงทุนโดยเจ้าของเงินเป็นกองทุนภายใต้ บลจ. นั้นๆ ให้รายงาน Provider Role and Responsibility เป็น “การลงทุนเพื่อลูกค้า” โดยสามารถระบุได้ 2 Roles ต่อไปนี้ 0703600004 เพื่อลูกค้า ในฐานะ broker 0703600005 เพื่อลูกค้า บล./บลจ. บริหาร 4.3 กรณีที่เจ้าของเงินลงทุนเป็นผู้ตัดสินใจเลือกการลงทุนเอง ให้รายงาน Provider Role and Responsibility เป็น “การลงทุนผ่าน Broker” โดยสามารถระบุได้ 2 Roles ต่อไปนี้ 0703600002 เพื่อตนเอง ลงทุนผ่าน Broker 0703600004 เพื่อลูกค้า ในฐานะ broker 4.4 กรณีที่ บล. /บลจ. เป็นผู้ตัดสินใจในการลงทุนแทนเจ้าของเงินลงทุน ให้รายงาน Provider Role and Responsibility เป็น “การลงทุนที่ บล./บลจ.บริหาร” โดยสามารถระบุได้ 2 Roles ต่อไปนี้ 0703600003 เพื่อตนเอง บล./บลจ. บริหาร 0703600005 เพื่อลูกค้า บล./บลจ. บริหาร	9-มี.ค.-58

ลำดับ	คำถาม	คำตอบ	วันที่ Update
5	ต้องการทราบว่า รพท. มีการตรวจสอบในเรื่องใดบ้าง	ในการตรวจสอบของ รพท. แบ่งเป็นการตรวจสอบ Basic Validation และ Complex Validation <u>5.1 ตรวจสอบ Basic Validation เพื่อเป็นการตรวจสอบคุณภาพข้อมูลเบื้องต้น มีการตรวจสอบดังต่อไปนี้</u> 5.1.1 ชื่อไฟล์ต้องเป็นไปตาม Format ที่ รพท. กำหนด ดังต่อไปนี้ MDMS_YYYYMMDD_XXX.xml โดยที่ XXX เป็นชื่อในแต่ละ Data File ตามเอกสาร "Data File Document" ตาม link ในข้อ 2.1 5.1.2 รูปแบบไฟล์ต้องเป็น XML 5.1.3 รหัสองค์กรของผู้ submit ข้อมูล ต้องตรงกับรหัสองค์กรในเนื้อข้อมูล 5.1.4 รูปแบบของข้อมูลต้องเป็นไปตามที่ระบุไว้ เช่น ข้อมูลวันที่ต้องมีรูปแบบเป็น YYYY-MM-DD (ตรวจสอบรูปแบบของข้อมูลการรายงานใน Appendix A: Data Type ในเอกสาร "Data File Document" ตาม link ในข้อ 2.1) 5.1.5 ตรวจสอบข้อมูลใน Mandatory Field และ Mandatory with Condition เนื่องจากเป็นช่องข้อมูลที่ รพท. ต้องนำไปใช้งานเป็นหลัก ดังนั้นจึงต้องให้ผู้รายงานรายงานมาให้ครบ และ ถูกต้อง 5.1.6 ตรวจสอบข้อมูลให้ตรงตามค่าที่ได้รับไว้ในเอกสาร Classification สำหรับช่องที่ได้รับไว้ 5.1.7 ตรวจสอบรายการซ้ำ เช่น ข้อมูลยอดคงค้างในแต่ละเดือนของแต่ละผู้ลงทุน ตามที่ได้รายงานมาต้องไม่เป็นข้อมูลซ้ำ เป็นต้น <u>5.2 การตรวจสอบ Complex Validation มีการตรวจสอบ ดังต่อไปนี้</u> 5.2.1 ตรวจสอบข้อมูลคุณสมบัติตราสารที่รายงานเข้ามา โดยตรวจสอบข้อมูลประเภทตราสารเทียบกับข้อมูล Data Feed โดย รพท. ใช้ข้อมูลจาก Reuters เป็นข้อมูลอ้างอิง ซึ่งให้แบ่งการรายงานมาในแต่ละ Data File ดังต่อไปนี้ - ข้อมูลคุณสมบัติตราสารหนี้ ให้รายงานมาใน Data File DSR - ข้อมูลคุณสมบัติตราสารทุน ให้รายงานมาใน Data File ESR - ข้อมูลคุณสมบัติกองทุน ให้รายงานมาใน Data File FFR 5.2.2 ตรวจสอบข้อมูลผู้ออกตราสาร โดยใช้ Issuer Id และ Issuer Unique Id Type เทียบกับคุณสมบัติตราสารใน Data File DSR และ ESR รวมทั้งตรวจสอบข้อมูล Asset Management Unique Id และ Asset Management Unique Id Type เทียบกับคุณสมบัติกองทุนใน Data File FFR ทั้งนี้ในกรณีที่ผู้ออกตราสารเป็นบุคคลหรือนิติบุคคลที่อยู่ต่างประเทศ และ ไม่สามารถหาข้อมูล Issuer Id และ Issuer Unique Id Type ได้ ขอให้รายงานข้อมูลมาตามมาตรฐานการตั้งรหัสบุคคลและนิติบุคคลต่างประเทศ ตามเอกสาร "Data File Manual" จาก Link ในข้อ 2.1 5.2.3 ผู้ออกตราสารทุกรายใน Data File DSR, ESR และ FFR ต้องพบข้อมูลใน Data File ISR 5.2.4 ข้อมูลยอดคงค้างของเงินลงทุนในหลักทรัพย์ในต่างประเทศ (Data File PIA) และ ข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์ในต่างประเทศ (Data File MPI) ต้องรายงานคุณสมบัติตราสารมาใน Data File DSR, ESR หรือ FFR 5.2.5 ตรวจสอบยอดคงค้างของเงินลงทุนในหลักทรัพย์ในต่างประเทศ (Data File PIA) งวดก่อนหน้า รวมกับยอดการซื้อขาย (Data File MPI) งวดปัจจุบัน เทียบกับยอดคงค้าง(Data File PIA) งวดปัจจุบัน ต้องไม่เกิน 100 USD ในแต่ละตราสาร 5.2.6 ตรวจสอบยอดคงค้างบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ (Data File FCD) งวดก่อนหน้า รวมกับยอดการเปลี่ยนแปลงในบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศงวดปัจจุบัน เทียบกับข้อมูลยอดคงค้างงวดปัจจุบัน ต้องไม่เกิน 100 USD ในแต่ละบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ 5.2.7 ตรวจสอบข้อมูลสถาบันผู้รับฝากเงินในรายงานบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ โดยกรณีที่สถาบันผู้รับฝากเงินตราต่างประเทศเป็นสถาบันที่อยู่ในประเทศไทย สถาบันผู้รับฝากเงินนั้นต้องได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจเงินตราต่างประเทศ (FX License) โดยใช้ข้อมูล Counter Party SWIFT Code ในการตรวจสอบร่วมกับข้อมูลการขออนุญาตประกอบธุรกิจเงินตราต่างประเทศ (FX License)	9-มี.ค.-58

ลำดับ	คำถาม	คำตอบ	วันที่ Update
6	รหัสตราสารที่ใช้ในการรายงาน หากมีหลายรหัสควรใช้รหัสใดในการรายงาน	6.1 การรายงานรหัสตราสารในข้อมูลคุณสมบัติตราสาร (Data File DSR, ESR, FFR) ขอให้รายงานประเภทตราสารทุกประเภทของรหัสตราสารนั้น (กรณีที่มีตราสารนั้นมีรหัสตราสารมากกว่า 1 ประเภท) หากตราสารนั้น ๆ ไม่มีประเภทรหัสตราสารตามที่กำหนด ให้รายงานรหัสตราสารที่ใช้ภายในองค์กรได้ และให้ระบุประเภทรหัสตราสารเป็น 0504100014 Other Code 6.2 การรายงานรหัสตราสารในข้อมูลธุรกรรม (Data File PIA, MPI) ให้ใช้ ISIN Code เป็นหลักในการรายงาน รวมทั้งเมื่อได้รายงานด้วยรหัสใดมายัง ธปท. และ ผ่านการตรวจสอบความถูกต้องในงวดข้อมูลนั้นแล้ว ในงวดถัดไปให้รายงานด้วยประเภทรหัสตราสารเดิม ยกเว้นได้รับแจ้งเปลี่ยนรหัสตราสารเป็นอย่างอื่น	9-มี.ค.-58
7	การจัดทำกรการรายงานข้อมูลผ่าน PIA Excel Input Template มีข้อควรระวังใดบ้าง	การจัดทำกรการรายงานข้อมูลผ่าน PIA Excel Input Template 7.1 ควรใช้โปรแกรม "PIA Excel Input Template" เวอร์ชันล่าสุดที่ได้เผยแพร่บนหน้า website ในการรายงานข้อมูลจาก Link ในข้อ 2.1 7.2 เมื่อเริ่มต้นเปิดโปรแกรมทุกครั้งควร update version ล่าสุด (เพื่อ update ข้อมูล Classification List) ก่อนการใช้งาน สามารถอ่านคู่มือการใช้งานจาก Link ในข้อ 2.1 และ เลือก "คู่มือการใช้งาน PIA Excel Input Template เบื้องต้น" และคู่มือประกอบอื่นๆ	9-มี.ค.-58
8	การรายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ และอนุพันธ์มายัง ธปท. มีข้อควรระวังใดบ้าง	การรายงานข้อมูลมายัง ธปท. 8.1 หากมีธุรกรรมเงินตราต่างประเทศ ไม่ว่าจะเกิดจากการซื้อขายหลักทรัพย์ หรือ การฝากเงินและอื่นๆ ต้องรายงานข้อมูลภาพรวมมาใน Data File OPI ด้วยทุกครั้ง 8.2 ในการส่งข้อมูลของเจ้าของเงินลงทุน หรือ ข้อมูลกองทุน ขอให้ระบุข้อมูลล่าสุดมายัง ธปท. รวมถึงรหัสของเจ้าของเงินลงทุน หรือ รหัสกองทุนล่าสุดด้วย 8.3 PIA Phase 2 เริ่มใช้งานในงวดข้อมูลเดือน ม.ค. 2558 หากต้องการส่งข้อมูลงวดก่อนหน้า หรือ ได้รับแจ้งให้แก้ไขข้อมูลงวดก่อนหน้า ให้ส่งมายังช่องทางเดิมและรูปแบบเดิม 8.4 อื่นๆ เพิ่มเติมตาม link ในข้อ 2.1	9-มี.ค.-58
9	การรายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารอนุพันธ์ ให้รายงานอย่างไร	ขอให้รายงานผ่านมาใน Excel file ซึ่งสามารถดาวน์โหลดรูปแบบได้ตาม Link ในข้อ 2.1 และเลือก "แบบฟอร์มรายงานธุรกรรม Derivatives และแบบฟอร์มรายงานธุรกรรม Securities Borrowing and Lending"	9-มี.ค.-58