



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

การประชุมนายทะเบียนตราสารหนี้
เพื่อชี้แจง
การจัดส่งข้อมูลการถือครองตราสารการเงิน
วันที่ 19 กรกฎาคม 2555



- 1 ระบบข้อมูลตราสารการเงิน
- 2 การประมวลผลข้อมูลการถือครองตราสารหนี้
- 3 ประเด็นพิจารณา : ร่างรูปแบบข้อมูล
- 4 กำหนดการและช่องทางส่งข้อมูล
- 5 การดำเนินการต่อไป



- 1 ระบบข้อมูลตราสารการเงิน
- 2 การประมวลผลข้อมูลการถือครองตราสารหนี้
- 3 ประเด็นพิจารณา : ร่างรูปแบบข้อมูล
- 4 กำหนดการและช่องทางส่งข้อมูล
- 5 การดำเนินการต่อไป



วัตถุประสงค์ของระบบข้อมูลตราสารการเงิน

- พัฒนาระบบเพื่อจัดเก็บข้อมูลตราสาร ให้รวมอยู่เป็นระบบงานเดียวกัน
- วิเคราะห์แนวทางการออก-การถือครองตราสารการเงินของภาคเศรษฐกิจ
- วิเคราะห์ความต้องการถือตราสารของนักลงทุนทั้งภาคสถาบันการเงิน ภาคครัวเรือน ภาคธุรกิจ และนักลงทุนต่างประเทศ
- วิเคราะห์และติดตามการเคลื่อนย้ายเงินทุนของนักลงทุนต่างประเทศในตลาดทุน
- วิเคราะห์โครงสร้างด้านตลาดเงินและตลาดทุน
- จัดทำสถิติตราสารการเงิน สถิติการดูแลการชำระเงิน/ดูแลบริการ สำหรับใช้งานภายใน ธปท. และเผยแพร่ผู้สนใจภายนอก

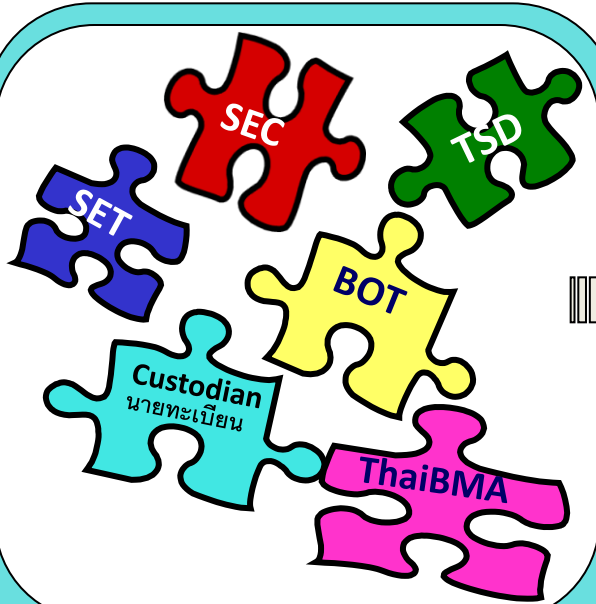


ที่มาของข้อมูลในระบบตราสารการเงิน



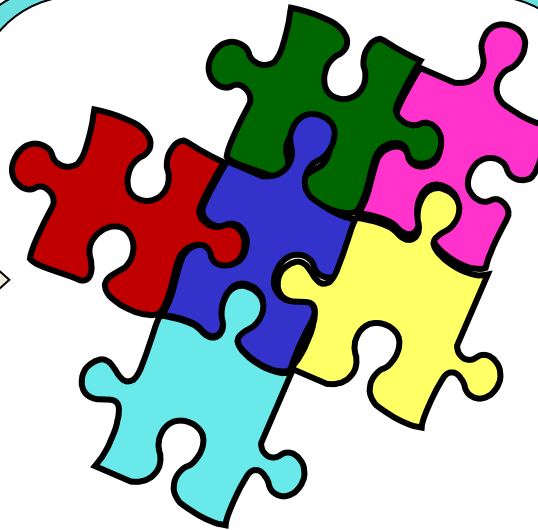


ปัจจุบัน



1. ทุกองค์กรมีพันธกิจของตนเอง
2. ข้อมูลกระจายอยู่หลายหน่วยงาน
3. มาตรฐานและนิยามต่างกัน
4. เชื่อมโยงข้อมูลทำได้ยาก

TFIIC



ส่งเสริมพันธกิจที่ 4
สร้างโครงสร้างพื้นฐานที่มีประสิทธิภาพ
ทั้งทางด้านกฎหมาย ระเบียบ บัญชี
ภาษี ข้อมูล เทคโนโลยี และการกำกับดูแล

การใช้งาน



1. กำหนดนโยบาย
2. พัฒนาลาดการเงิน
3. วิเคราะห์ ติดตาม กำกับ
ตรวจสอบ
4. จัดทำสถิติและ เผยแพร่



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

ประโยชน์ของศูนย์ข้อมูลตราสารการเงิน

สามารถเชื่อมโยงข้อมูลตลาดทุนไทย
กับตลาดทุนต่างประเทศ

ลดต้นทุนการบริหารจัดการและ
ลดความซ้ำซ้อนของข้อมูลตราสารการเงิน

สามารถวิเคราะห์ติดตามสภาพตลาด
และส่งเสริมการพัฒนากลตลาดทุน
อย่างมีประสิทธิภาพ

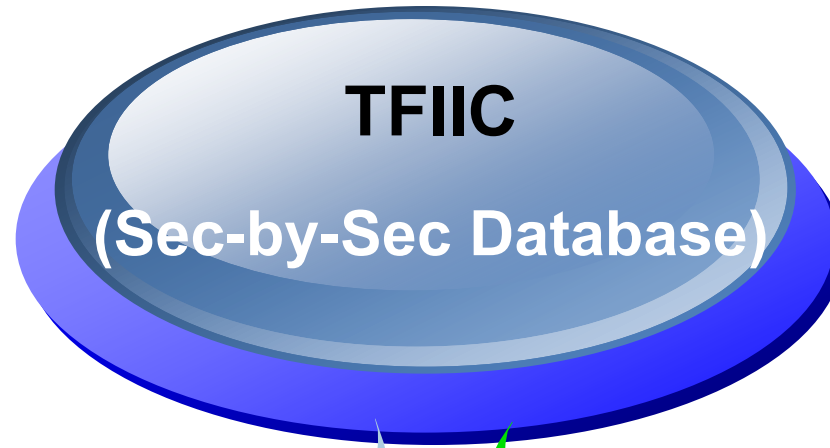
ผู้ระดมทุนและผู้ลงทุนสามารถใช้ข้อมูล
เพื่อการวิเคราะห์และตัดสินใจ

ศูนย์ข้อมูลตราสาร
การเงินแห่ง
ประเทศไทย
(TFIIC)



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

องค์ประกอบของศูนย์ข้อมูลตราสารการเงิน





- 1 ระบบข้อมูลตราสารการเงิน
- 2 การประมวลผลข้อมูลการถือครองตราสารหนี้
- 3 ประเด็นพิจารณา : ร่างรูปแบบข้อมูล
- 4 กำหนดการและช่องทางส่งข้อมูล
- 5 การดำเนินการต่อไป



การประมวลผลข้อมูลการถือครองตราสารหนี้

จัดเก็บข้อมูลการถือครองเป็นรายตราสาร (Securities-by-Securities)





ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

สถานะข้อมูลการถือครองตราสารหนี้ ณ พ.ค. 55



ตราสารหนี้
ที่ ธปท. เป็นนายทะเบียน

Outstanding Size

6.3 ล้านล้านบาท

Outstanding Size

จำแนกกลุ่มผู้ถือ
6.3 ล้านล้านบาท



ตราสารหนี้รัฐวิสาหกิจที่ ธปท. ไม่เป็นนายทะเบียน
& ตราสารภาคเอกชน

Outstanding Size

1.8 ล้านล้านบาท

Outstanding Size

จำแนกกลุ่มผู้ถือ
7.8 แสนล้านบาท
(43.81%)

การถือครองแบบ
Scrip
จากนายทะเบียน



- 1 ระบบข้อมูลตราสารการเงิน
- 2 การประมวลผลข้อมูลการถือครองตราสารหนี้
- 3 ประเด็นพิจารณา : ร่างรูปแบบข้อมูล
- 4 กำหนดการและช่องทางส่งข้อมูล
- 5 การดำเนินการต่อไป



ร่างรูปแบบข้อมูลตราสารที่เป็นนายทะเบียน

Date of Outstanding	Provider Name	ISIN Code	Corporation Type (Holder Type)	Total Unit	Total Amount (at face value)	Scrip Flag
ข้อมูลรายเดือน	รหัส	รหัส	<u>รหัส</u>	จำนวนหน่วย	มูลค่าตราสาร	กรณีถือครอง
วันที่สุดท้ายของเดือน	ผู้ส่งข้อมูล	ตราสาร	ประเภทบุคคล	ตราสารที่ถือ	ตามราคาตรา	แบบ Scrip =Y

- ตราสารที่เป็นนายทะเบียน รวมถึงตราสารที่นายทะเบียนเป็นผู้ออกด้วย
- จัดส่งเฉพาะข้อมูลการถือครองในรูปแบบใบตราสาร (Scrip)
- จัดส่งข้อมูลเป็นรายเดือน ตั้งแต่งวดข้อมูลเดือนส.ค. 55
- รหัสประเภทบุคคลจำแนกเป็น 24 กลุ่ม ตั้งแต่งวดเดือน ม.ค. 56



1. การจำแนกผู้ถือครองให้เป็นไปตามมาตรฐานการจัดทำสถิติ

Corporation Type Code	ประเภทสถาบัน (Corporation Type)
110	ธนาคารแห่งประเทศไทย
121	ธนาคารพาณิชย์ไทย
122	สาขาของธนาคารต่างประเทศ
123	สถาบันการเงินเฉพาะกิจที่รับฝากเงิน
124	บริษัทเงินทุน
125	สถาบันการเงินที่รับฝากเงินอื่นๆ
132	บริษัทหลักทรัพย์
133	กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ
134	กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
135	กองทุนรวม
136	บริษัทประกันภัย
137	สถาบันการเงินที่ไม่รับฝากเงินอื่นๆ

Corporation Type Code	ประเภทสถาบัน (Corporation Type)
138	บริษัทประกันชีวิต
141	ส่วนราชการสังกัดรัฐบาลกลาง
142	สำนักงานประกันสังคม
150	รัฐบาลท้องถิ่น
160	รัฐวิสาหกิจ
170	บริษัทและนิติบุคคล
180	บุคคลธรรมดา
190	สถาบันที่ไม่แสวงหากำไร
200	ผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศที่เป็นนิติบุคคล
201	ผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศที่เป็นบุคคลธรรมดา
202	ผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศที่เป็นสถาบันการเงิน
203	ผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศอื่นๆ



รูปแบบข้อมูลตราสารที่เป็นนายทะเบียน-ระยะที่ 1

Date of Outstanding	Provider Name	ISIN Code	Holder Type	Holder Career Type	Total Unit	Total Amount (at face value)	Scrip Flag
ข้อมูลรายเดือน วันที่สุดท้าย ของเดือน	รหัส ผู้ส่งข้อมูล	รหัส ตราสาร	<u>รหัส</u> ประเภทบุคคล	<u>รหัส</u> อาชีพ ผู้ถือตราสาร	จำนวนหน่วย ตราสารที่ถือ	มูลค่าตราสาร ตามราคาตรา	กรณีถือครอง แบบ Scrip =Y

- ตราสารที่เป็นนายทะเบียน รวมถึงตราสารที่นายทะเบียนเป็นผู้ออกด้วย
- จัดส่งเฉพาะข้อมูลการถือครองในรูปแบบใบตราสาร (Scrip)
- จัดส่งข้อมูลเป็นรายเดือน ตั้งแต่วัดเดือน ส.ค. 55 – ธ.ค. 55





รหัส	ความหมาย
0	นิติบุคคลในประเทศไทย
1	บุคคลธรรมดาในประเทศไทย
2	นิติบุคคลต่างประเทศ
3	บุคคลธรรมดาต่างประเทศ





Code	Description	Code	Description
000	บริษัทศูนย์รับฝากฯ เพื่อผู้ฝาก	500	มูลนิธิ (ประกาศกำหนดฯ)
001	บริษัทไทยเอ็นวีดีอาร์ จำกัด	501	มูลนิธิ
002	บริษัทสยามดีอาร์ จำกัด	502	สมาคม (ประกาศกำหนดฯ)
003	กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนซึ่งเป็นคนต่างด้าว	503	สมาคม
004	ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	504	องค์การ (ประกาศกำหนดฯ)
112	บริษัทเงินทุน (บริษัทสมาชิก)	505	สหกรณ์
113	บริษัทเงินทุน (ไม่ใช่บริษัทสมาชิก)	506	โครงการพระราชดำริ
121	บงล. (บริษัทสมาชิก)	507	วัดของไทย
122	บงล. (ไม่ใช่บริษัทสมาชิก)	508	สุเหร่า มัสยิด
131	บล. (บริษัทสมาชิก)	509	โบสถ์ คริสตจักร
132	บล. (ไม่ใช่บริษัทสมาชิก)	510	โรงเรียน (ของรัฐ)
142	บริษัทเครดิตฟองซิเอร์	511	โรงเรียน (ของเอกชนจัดตั้งโดย บริษัท หรือ หจก.)
152	ธนาคารพาณิชย์	512	โรงเรียน (ของเอกชนจัดตั้งโดย บุคคลธรรมดา)
153	ธนาคารของรัฐ	513	มหาวิทยาลัย (ของรัฐ)
210	บริษัทประกันภัย	514	มหาวิทยาลัย (ของเอกชนจัดตั้งโดย บริษัท หรือ หจก.)
220	บริษัทประกันชีวิต	515	มหาวิทยาลัย (ของเอกชนจัดตั้งโดย บุคคลธรรมดา)
311	กองทุนรวมในประเทศ (กองทุนเปิด)	610	บริษัท (ไม่รวม การเงิน/ธนาคาร/ประกันภัย)
312	กองทุนรวมในประเทศ (กองทุนปิด)	611	ห้างหุ้นส่วนจำกัด
321	กองทุนต่างประเทศ	612	ห้างหุ้นส่วนสามัญนิติบุคคล
330	กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ	613	นิติบุคคลอาคารชุด
341	กองทุนประกันสังคม	620	นิติบุคคลอื่นๆ
342	กองทุนบำเหน็จกลาง / บำนาญ	811	รพท. ฝ่ายการธนาคาร
343	หน่วยงานที่อยู่ภายใต้ ก.ม.เฉพาะ / บริษัท	812	รพท. ฝ่ายทรัพยากรบุคคล
344	กองทุนฯ (ไม่ได้จดทะเบียน)	813	รพท. ฝ่ายออกบัตรธนาคาร
400	หน่วยงานรัฐ	814	รพท. ฝ่ายธุรการ (เงินสวัสดิการ)
401	รัฐวิสาหกิจ	815	รพท. ทุนรักษาระดับอัตราแลกเปลี่ยนเงินตรา
816	กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน	990	บุคคล - บุคคลธรรมดาอื่นๆ
910	บุคคล - เจ้าของกิจการ / วิชาชีพอิสระ	991	คณะบุคคล
920	บุคคล - ลูกจ้าง/พนักงานเอกชน	992	ห้างหุ้นส่วนสามัญ
930	บุคคล - ข้าราชการ/พนักงานรัฐวิสาหกิจ		



- 1 ระบบข้อมูลตราสารการเงิน
- 2 การประมวลผลข้อมูลการถือครองตราสารหนี้
- 3 ประเด็นพิจารณา : ร่างรูปแบบข้อมูล
- 4 กำหนดการและช่องทางส่งข้อมูล
- 5 การดำเนินการต่อไป



ข้อมูลรายเดือน เพื่อสะดวกในการรองรับข้อมูลตราสารออกใหม่
ภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป เริ่มส่งข้อมูลงวดสิ้นเดือนสิงหาคม 2555

การส่งข้อมูลระยะที่หนึ่ง

- ช่องทาง : E-mail : Fin_Mkt_Stat@bot.or.th
- สำหรับข้อมูลย้อนหลัง ธปท. จะหารือเป็นรายกรณีกับนายทะเบียนแต่ละราย

การส่งข้อมูลงวดมกราคม 2556

- ช่องทาง DA Internet
- จัดส่งข้อมูลผู้ถือครองจำแนกเป็น 24 กลุ่ม



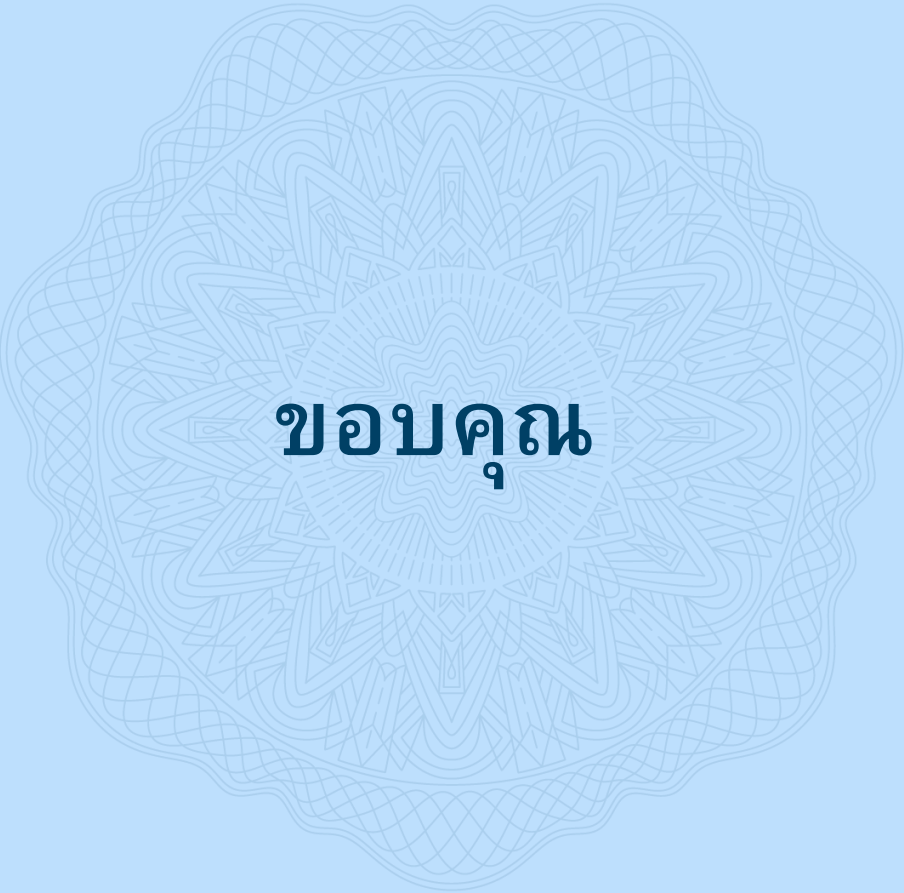
- 1 ระบบข้อมูลตราสารการเงิน
- 2 การประมวลผลข้อมูลการถือครองตราสารหนี้
- 3 ประเด็นพิจารณา : ร่างรูปแบบข้อมูล
- 4 กำหนดการและช่องทางส่งข้อมูล
- 5 การดำเนินการต่อไป



- ธปท. รวบรวมความคิดเห็นจากที่ประชุม และกำหนดแนวทางปฏิบัติในการจัดส่งข้อมูล
- ธปท. มีหนังสือแจ้งขอความอนุเคราะห์ให้จัดส่งข้อมูลอย่างเป็นทางการ และจัดส่ง Excel Template เพื่อใช้ในการส่งข้อมูล



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND



ขอบคุณ