31 ตุลาคม 2565

เรียน ผู้จัดการ

ธนาคารพาณิชย์ทุกแห่ง ยกเว้นธนาคารพาณิชย์เพื่อรายย่อย

ที่ ฝขอ.ว. 103/2565 เรื่อง การส่งรายงานข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ต่อธนาคารแห่งประเทศไทย

ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้ออกประกาศ ธปท. ที่ สนส. 7/2565 เรื่อง หลักเกณฑ์การอนุญาตและกำกับดูแลการทำธุรกรรมอนุพันธ์ของธนาคารพาณิชย์ ลงวันที่ 6 ตุลาคม 2565 โดยกำหนดหน้าที่ให้ธนาคารพาณิชย์ที่ทำธุรกรรมอนุพันธ์ต้องจัดทำและจัดส่งแบบรายงานยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ ตามรูปแบบและระยะเวลาที่ ธปท. กำหนด นั้น

ธปท. จึงกำหนดให้ธนาคารพาณิชย์ที่ทำธุรกรรมอนุพันธ์จัดทำและจัดส่งแบบรายงานยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์แต่ละประเภทต่อ ธปท. ตามรูปแบบ ช่องทางการรายงาน ความถี่ (งวดการรายงาน) งวดแรกที่ต้องรายงาน และกำหนดระยะเวลาการส่งรายงาน ดังนี้

1. รูปแบบและช่องทางการรายงาน
   1.1 กำหนดรูปแบบรายงานเป็น Excel file
   1.2 กำหนดช่องทางการจัดส่งผ่านระบบ DMS Data Acquisition
2. แบบรายงาน ความถี่ ข้อมูลงวดแรกที่ต้องรายงาน และกำหนดระยะเวลาการส่งรายงาน

แบบรายงาน	**ความถี่ (งวดการรายงาน)**	**งวดแรกที่ต้องรายงาน**	**กำหนดระยะเวลาการส่งรายงาน***
1) ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด (DS_SDV) 1.1) ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม (SDVP) 1.2) ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา (SDVT)	รายเดือน	งวดเดือนธันวาคม 2565	ภายใน 1 เดือนนับแต่วันสิ้นงวด

แบบรายงาน	ความถี่ (งวดการรายงาน)	งวดแรกที่ต้องรายงาน	กำหนดระยะเวลาการส่งรายงาน*
2) ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง (DS_MLN)	รายเดือน	งวดเดือนธันวาคม 2565	ภายใน 1 เดือน นับแต่วันสิ้นงวด
3) ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต (DS_CDD)	รายเดือน	งวดเดือนธันวาคม 2565	ภายใน 1 เดือน นับแต่วันสิ้นงวด

* หากวันครบกำหนดระยะเวลาการส่งรายงานตรงกับวันหยุดทำการ ให้ส่งรายงานภายในวันทำการแรกถัดจากวันหยุดทำการดังกล่าว

อนึ่ง ท่านสามารถศึกษารายละเอียดการรายงานข้อมูลดังกล่าวได้จากคู่มือการจัดทำแบบรายงานยอดคงค้างตราสารอนุพันธ์และธุรกรรมที่เกี่ยวข้องและสามารถดาวน์โหลดรูปแบบรายงาน Excel file ข้างต้น ได้ที่ www.bot.or.th ภายใต้หัวข้อ สถิติ > การรับส่งข้อมูลกับ ธปท. > แบบรายงานและเอกสารชี้แจง ข้อมูลสถาบันการเงิน > รายงานตราสารอนุพันธ์และธุรกรรมที่เกี่ยวข้อง

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

(นายวันประชา เชาวลิตวงศ์)
ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายบริหารข้อมูลและดาต้าอนาไลติกส์
ผู้ว่าการแทน

ฝ่ายบริหารข้อมูลและดาต้าอนาไลติกส์
โทรศัพท์ 0 2283 5196, 0 2283 5197
โทรสาร 0 2283 5111