

คำถาม - คำตอบเกี่ยวกับแนวปฏิบัติธนาคารแห่งประเทศไทย
เรื่อง มาตรฐานการปฏิบัติงานสำหรับ Contributing Bank และ FX Broker
ที่นำส่งข้อมูลเพื่อการจัดทำอัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFI)
(แก้ไขเพิ่มเติมครั้งที่ 1 มีผลตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2563)

แก้ไข ข้อ 7.1

เพิ่มเติม ข้อ 3.17 3.18 และ 3.19

ประเด็นคำถาม	สรุปคำตอบ
3. การนำส่ง Submission	
3.17 Contributing Bank ต้องนำส่งข้อมูลธุรกรรมที่ซื้อขายผ่าน Single Bank Platform ซึ่งเป็นช่องทาง Electronic ที่พัฒนาขึ้นเองเข้าระบบ FXT เพื่อคำนวณอัตราอ้างอิง THBFI หรือไม่	ไม่ต้องนำส่งข้อมูลธุรกรรมดังกล่าว เนื่องจาก ธปท. เห็นว่าด้วยข้อจำกัดทางเทคนิคและปริมาณธุรกรรมที่เกิดขึ้นผ่านช่องทางดังกล่าวยังมีจำนวนน้อย และไม่ได้มีผลกระทบต่อความน่าเชื่อถือของการคำนวณ THBFI อย่างมีนัยสำคัญ อย่างไรก็ตาม ในอนาคตหากพบว่ามีธุรกรรมที่ทำผ่านช่องทางดังกล่าวเพิ่มขึ้นมาก ธปท. จะหาวิธีจัดเก็บข้อมูลต่อไป
3.18 การนำส่งข้อมูล Forward Points สำหรับธุรกรรม USDTHB FX Swap ในตลาดเงินตราต่างประเทศของไทย ควรใช้หน่วยเป็นอะไร	Contributing Bank และ FX Broker ต้องส่งข้อมูลราคา Forward Points สำหรับธุรกรรม USDTHB FX Swap โดยมีหน่วยเป็น สตางค์ เท่านั้น ดังนั้น Contributing bank และ FX Broker มีหน้าที่ตรวจสอบรายละเอียดของ Submission ทั้งหน่วยของ USDTHB Swap Points และอัตราแลกเปลี่ยน Near leg และ Far leg ให้ถูกต้องครบถ้วนก่อนนำส่งเข้าระบบ FXT
3.19 Contributing Bank สามารถใช้ Keyboard Shortcut Keys บนโปรแกรม FXT เช่น “End + Confirmed + End” หรือ “Confirmation” ได้หรือไม่	ธปท. ในฐานะ Administrator เข้าใจถึงประโยชน์และความจำเป็นของการใช้ Keyboard Shortcut Keys บนโปรแกรม FXT อย่างไรก็ตาม ธปท. ขอเน้นย้ำว่า ก่อนนำส่ง Submission เข้าระบบคำนวณอัตราอ้างอิง THBFI Contributing Bank มีหน้าที่ตรวจสอบรายละเอียดของ Submission ให้มีคุณสมบัติตรงตามที่กำหนดใน THBFI Methodology ไม่ว่า Contributing Bank จะใช้ Keyboard Shortcut Keys บนโปรแกรม FXT หรือไม่ นอกจากนี้ ธปท. ขอให้ Supervisor ของ Contributing Bank ดูแลการนำส่ง Submission ทุกรายการเพื่อป้องกันความผิดพลาดที่เกิดจากหรือเป็นผลสืบเนื่องจากการใช้ Keyboard Shortcut Keys

ประเด็นคำถาม	สรุปคำตอบ
7. การตรวจสอบโดย Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก	
7.1 ความถี่ที่เหมาะสมในการตรวจสอบควรอยู่ที่เท่าใด	<p>ความถี่ที่เหมาะสมขึ้นกับดุลยพินิจของ Contributing Bank และ FX Broker แต่ละราย อย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง โดยอาจพิจารณาจากปริมาณการทำธุรกรรมที่เป็น Submission ตลอดจนสถิติการนำส่งข้อมูลที่ผิดพลาดประกอบด้วย</p> <p>นอกจากนี้ สำคัญของการตรวจสอบโดย Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก (แนวปฏิบัติ ข้อ 8) ครอบคลุมทั้งการตรวจสอบข้อมูลการสื่อสารและการสอบทานการปฏิบัติตามแนวปฏิบัติ ดังนั้น แม้ Contributing Bank มีกระบวนการนำส่ง Submission ผ่านระบบ Trading ที่เป็น Straight Through Process (STP) และมีระบบ Communication Surveillance แต่ก็ยังต้องมีการสอบทานการปฏิบัติตามแนวปฏิบัติในประเด็นอื่น ๆ เช่น governance policy, conflicts of interest และการจัดเก็บข้อมูล ดังนั้น Contributing Bank ยังคงต้องตรวจสอบตามแนวปฏิบัติ ข้อ 8 อย่างน้อย 1 ครั้งในปีแรกของการเป็น Contributing Bank แต่ละรอบที่ต่อเนื่องกัน และหลังจากนั้นให้พิจารณาตรวจสอบตามความถี่ที่เหมาะสม โดยอาจพิจารณาจากปริมาณการทำธุรกรรมที่เป็น Submission ตลอดจนสถิติการนำส่งข้อมูลที่ผิดพลาดประกอบด้วย</p>