



20 มีนาคม 2562

เรียน ผู้จัดการ

สถาบันการเงินที่เป็น THBFIX Contributing Bank และ FX Broker

ที่ ผตง.(41) ว. 8 /2562 เรื่อง นำส่งแนวปฏิบัติธนาคารแห่งประเทศไทย  
เรื่อง มาตรฐานการปฏิบัติงานสำหรับ Contributing Bank และ FX Broker ที่นำส่งข้อมูล  
เพื่อการจัดทำอัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX)

เพื่อสร้างความน่าเชื่อถือและความโปร่งใสให้กับอัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX) รวมทั้งเพื่อประโยชน์ต่อเสถียรภาพในระบบการเงินและเป็นการคุ้มครองผู้บริโภค ธนาคารแห่งประเทศไทยในฐานะผู้บริหารจัดการการจัดทำอัตราอ้างอิง THBFIX (THBFIX Administrator) จึงได้จัดทำมาตรฐานการปฏิบัติงานที่สอดคล้องกับหลักการของ IOSCO Principles for Financial Benchmarks ซึ่งเป็นมาตรฐานที่ยอมรับของสากล เพื่อให้สถาบันการเงินและนายหน้าซื้อขายเงินตราต่างประเทศที่เป็นผู้นำส่งข้อมูลสำหรับจัดทำอัตราอ้างอิง THBFIX ใช้เป็นแนวทางในการปฏิบัติงาน

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

(นางสาวชญาวดี ชัยอนันต์)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายตลาดการเงิน

ผู้ว่าการแทน

- สิ่งที่ส่งมาด้วย
1. แนวปฏิบัติธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรฐานการปฏิบัติงานสำหรับ Contributing Bank และ FX Broker ที่นำส่งข้อมูลเพื่อการจัดทำอัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX)
  2. คำถาม – คำตอบเกี่ยวกับแนวปฏิบัติธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่อง มาตรฐานการปฏิบัติงานสำหรับ Contributing Bank และ FX Broker ที่นำส่งข้อมูลเพื่อการจัดทำอัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX)

ทีมมาตรฐานตลาดการเงิน

ส่วนพัฒนาตลาดการเงิน

ฝ่ายตลาดการเงิน

โทรศัพท์ 0 2283 6321, 0 2283 5476

โทรสาร 0 2356 7455

**แนวปฏิบัติธนาคารแห่งประเทศไทย**  
**เรื่อง มาตรฐานการปฏิบัติงานสำหรับ Contributing Bank และ FX Broker**  
**ที่นำส่งข้อมูลเพื่อการจัดทำอัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX)**

---

**1. เหตุผลในการออกแนวปฏิบัติ**

ปัจจุบันอัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX) ถือเป็นอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงที่มีการใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงินในตลาดการเงินไทยอย่างแพร่หลาย ทั้งในการทำธุรกรรมทางการเงินระหว่างสถาบันการเงินกับสถาบันการเงิน และระหว่างสถาบันการเงินกับลูกค้า ดังนั้น การพัฒนาอัตราอ้างอิง THBFIX ให้มีความโปร่งใสสอดคล้องกับมาตรฐานสากลจึงมีความสำคัญและจำเป็นอย่างยิ่งต่อการเสริมสร้างความเชื่อมั่นให้แก่ผู้ร่วมตลาดและป้องกันความเสียหายที่อาจเกิดจากสาเหตุต่าง ๆ โดยเฉพาะการบิดเบือนอัตราอ้างอิง หรือการจัดทำอัตราอ้างอิงที่ไม่สามารถสะท้อนสภาพตลาดจริงในตลาดการเงิน ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อเสถียรภาพของระบบการเงินได้ในที่สุด

เพื่อยกระดับมาตรฐานของกระบวนการจัดทำอัตราอ้างอิง THBFIX ดังกล่าว ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) และผู้ร่วมตลาด จึงเห็นควรร่วมกันให้ปรับเปลี่ยนวิธีการคำนวณอัตราอ้างอิง THBFIX จากการใช้ข้อมูลจากการสำรวจ (Survey-based) เป็นการใช้ข้อมูลธุรกรรมที่เกิดขึ้นจริง (Transactions-based) โดยในการจัดทำอัตราอ้างอิง THBFIX รูปแบบ Transactions-based ดังกล่าว ธปท. จะทำหน้าที่เป็นผู้บริหารจัดการ (Administrator) เพื่อดูแลให้การจัดทำอัตราอ้างอิง THBFIX เป็นไปอย่างถูกต้องเหมาะสม ซึ่งครอบคลุมถึงการกำหนดมาตรฐานการปฏิบัติงานของหน่วยงานที่นำส่งข้อมูลธุรกรรมเพื่อใช้ในการคำนวณอัตราอ้างอิงดังกล่าว ดังนั้น ธปท. จึงได้กำหนดแนวปฏิบัตินี้ เพื่อให้กระบวนการนำส่งข้อมูลสำหรับจัดทำอัตราอ้างอิง THBFIX มีความโปร่งใสน่าเชื่อถือและเป็นมาตรฐานเดียวกัน

**2. ขอบเขตของการบังคับใช้**

แนวปฏิบัตินี้ให้ใช้กับ Contributing Bank และ FX Broker ที่นำส่งข้อมูลธุรกรรมสำหรับจัดทำอัตราอ้างอิง THBFIX

**3. คำจำกัดความในแนวปฏิบัตินี้**

“อัตราอ้างอิง” หมายถึง อัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX) ซึ่งเป็นอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงในการกู้ยืมเงินบาทระยะต่าง ๆ ที่คำนวณมาจากการกู้ยืมเงินดอลลาร์ สรอ. ในระยะเดียวกันและแลกเปลี่ยนเป็นเงินบาทด้วยการทำธุรกรรม FX swap

“Administrator” หมายถึง ธปท. ซึ่งทำหน้าที่เป็นผู้บริหารจัดการการจัดทำอัตราอ้างอิง

“Calculation Agent” หมายถึง Thomson Reuters Asia Pte. Ltd. หรือบุคคลอื่นที่ได้รับกรมอบหมายจาก Administrator ให้ทำหน้าที่เป็นผู้คำนวณอัตราอ้างอิง

“Contributing Bank” หมายถึง สถาบันการเงินที่เป็นผู้นำส่งข้อมูลสำหรับจัดทำอัตราอ้างอิง

“FX Broker” หมายถึง บุคคลที่เป็นผู้นำส่งข้อมูลสำหรับจัดทำอัตราอ้างอิงและได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจเป็นนายหน้าซื้อขายเงินตราต่างประเทศ ตามประกาศกระทรวงการคลัง เรื่อง คำสั่งรัฐมนตรีให้ไว้แก่นายหน้าซื้อขายเงินตราต่างประเทศ

“THBFX Methodology” หมายถึง เอกสารว่าด้วยวิธีการคำนวณอัตราอ้างอิง THBFX ในรูปแบบ Transactions-based ตามภาคผนวก 1 แนบท้ายแนวปฏิบัตินี้

“Submission” หมายถึง ข้อมูลธุรกรรม USDTHB FX spot และ USDTHB FX swap ที่นับเป็นธุรกรรมที่เข้าข่ายเป็น Qualified Transaction ตามที่ระบุใน THBFX Methodology

“ระบบ FXT” หมายถึง ระบบ FX Trading ของ Thomson Reuters ที่ Contributing Bank และ FX Broker ใช้ในการนำส่ง Submission

“กระบวนการ Submission” หมายถึง กระบวนการภายในของ Contributing Bank และ FX Broker ที่เกี่ยวข้องกับการนำส่ง Submission

“คู่มือการนำส่ง Submission ผ่านระบบ FXT” หมายถึง คู่มือการปฏิบัติงานที่เกี่ยวข้องกับการนำส่ง Submission ผ่านระบบ FXT ตามภาคผนวก 2 แนบท้ายแนวปฏิบัตินี้ ซึ่งกำหนดรายละเอียดขั้นตอนการเข้าระบบ FXT การนำส่งข้อมูล การยืนยันความถูกต้องของข้อมูล (Confirmation) การแก้ไขหรือยกเลิก Submission (Contra Deal) และการตรวจสอบสถานะของการนำส่ง Submission เพื่อให้ Contributing Bank และ FX Broker ปฏิบัติตาม

“เจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission” หมายถึง เจ้าหน้าที่ของ Contributing Bank และ FX Broker ที่มีหน้าที่นำส่ง Submission ให้ Calculation Agent รวมถึงเจ้าหน้าที่ของ Contributing Bank ที่มีหน้าที่ทำธุรกรรมที่เป็น Submission และเจ้าหน้าที่ของ FX Broker ที่มีหน้าที่ให้บริการจับคู่ธุรกรรมที่เป็น Submission

“Supervisor” หมายถึง เจ้าหน้าที่ของ Contributing Bank และ FX Broker ที่มีหน้าที่ดูแลการปฏิบัติหน้าที่ของเจ้าหน้าที่ที่มีหน้าที่นำส่ง Submission

“ผู้มีอำนาจ” หมายถึง เจ้าหน้าที่ของหน่วยงานที่รับผิดชอบกระบวนการ Submission ของ Contributing Bank และ FX Broker ที่มีอำนาจหน้าที่ในการอนุมัติกระบวนการปฏิบัติงานภายในที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission กระบวนการในการรายงานข้อมูลหากพบพฤติกรรมที่ต้องสงสัย และแนวทางการจัดการกับความขัดแย้งทางผลประโยชน์

“Control Function” หมายถึง หน่วยงานของ Contributing Bank และ FX Broker ที่มีความเป็นอิสระ ซึ่งไม่ใช่หน่วยงานที่รับผิดชอบกระบวนการ Submission โดย Contributing Bank และ FX Broker พิจารณาแล้วว่ามีเหมาะสมในการทำหน้าที่ที่เกี่ยวข้องตามที่กำหนดในแนวปฏิบัตินี้

#### 4. การนำส่ง Submission

- (1) Contributing Bank และ FX Broker มีหน้าที่นำส่ง Submission ผ่านระบบ FXT ตามรายละเอียดที่กำหนดใน THBFIX Methodology ให้กับ Calculation Agent โดยปฏิบัติตามขั้นตอนที่ระบุไว้ในคู่มือการนำส่ง Submission ผ่านระบบ FXT
- (2) Contributing Bank และ FX Broker ต้องดำเนินการเพื่อให้มั่นใจได้ว่า Submission ที่นำส่งให้ Calculation Agent มีความถูกต้อง ครบถ้วน และมีคุณสมบัติตรงตามที่กำหนดใน THBFIX Methodology
- (3) ในกรณีที่พบความผิดพลาดของ Submission ให้ Contributing Bank และ FX Broker ที่เกี่ยวข้องกับการ Submission ดังกล่าวดำเนินการยกเลิกหรือแก้ไข Submission ตามขั้นตอนที่ระบุไว้ในคู่มือการนำส่ง Submission ผ่านระบบ FXT โดยเร็ว
- (4) Contributing Bank และ FX Broker ต้องจัดให้มีแผนรองรับกรณีเกิดเหตุขัดข้อง เพื่อให้มั่นใจว่าสามารถนำส่ง Submission ตามรายละเอียดที่กำหนดใน THBFIX Methodology ให้กับ Calculation Agent ได้ และในกรณีที่เกิดเหตุขัดข้องดังกล่าว Contributing Bank และ FX Broker จะต้องแจ้งให้ Administrator ทราบทันที

#### 5. นโยบายการกำกับดูแล (Governance policy)

Contributing Bank และ FX Broker ต้องจัดให้มีการกำกับดูแลที่เหมาะสม ดังนี้

- (1) แต่งตั้งผู้มีอำนาจเป็นลายลักษณ์อักษร โดยผู้มีอำนาจมีหน้าที่ในการอนุมัติ กระบวนการปฏิบัติงานภายในที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ตามที่ระบุในข้อ 5 (4) กระบวนการในการรายงานข้อมูลหากพบพฤติกรรมที่ต้องสงสัยตามที่ระบุในข้อ 5 (7) และแนวทางการจัดการกับความขัดแย้งทางผลประโยชน์ตามที่ระบุในข้อ 6 (1)
- (2) แต่งตั้ง Supervisor เป็นลายลักษณ์อักษร โดย Supervisor มีหน้าที่ความรับผิดชอบตามที่ระบุในข้อ 5 (6)
- (3) แต่งตั้งและกำหนดหน้าที่ของเจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission เป็นลายลักษณ์อักษร โดยต้องเป็นผู้มีความรู้ความสามารถและมีประสบการณ์ที่เหมาะสม
- (4) กำหนดกระบวนการปฏิบัติงานภายในที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ที่ชัดเจน โดยต้องผ่านการอนุมัติจากผู้มีอำนาจ รวมถึงต้องสื่อสารให้เจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission และ Supervisor รับทราบอย่างทั่วถึง ทั้งนี้ กระบวนการปฏิบัติงานภายในอย่างน้อยควรครอบคลุมในเรื่องดังต่อไปนี้
  - (4.1) การดำเนินการเพื่อให้มั่นใจได้ว่าเจ้าหน้าที่ที่มีหน้าที่นำส่ง Submission เป็นเจ้าหน้าที่ที่ได้รับมอบหมายให้ปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าว เช่น การกำหนดสิทธิการเข้าถึงระบบ FXT
  - (4.2) การนำส่ง Submission ตามที่ระบุในข้อ 4
  - (4.3) การจัดเก็บหรือเข้าถึงข้อมูลตามที่ระบุในข้อ 7

(4.4) การดูแลการนำส่ง Submission โดย Supervisor และการตรวจสอบโดย Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก

(5) ดำเนินการเพื่อให้มั่นใจได้ว่าเจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission และ Supervisor มีความเข้าใจในเรื่องดังต่อไปนี้

(5.1) แนวปฏิบัตินี้ และ THBFIX Methodology

(5.2) กระบวนการปฏิบัติงานภายในที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ตามที่ระบุในข้อ 5 (4) กระบวนการในการรายงานข้อมูลหากพบพฤติกรรมที่ต้องสงสัยตามที่ระบุในข้อ 5 (7) และแนวทางการจัดการกับความขัดแย้งทางผลประโยชน์ตามที่ระบุในข้อ 6 (1)

(5.3) คู่มือการนำส่ง Submission ผ่านระบบ FXT

(5.4) สถานการณ์หรือพฤติกรรมที่ถือเป็นการบิดเบือนอัตราอ้างอิง เช่น การทำ Wash Trading ในช่วง Qualifying Window การทำธุรกรรมในช่วง Qualifying Window โดยมีเจตนาจะยกเลิกธุรกรรมในภายหลัง หรือการหลีกเลี่ยงไม่ทำธุรกรรมที่สมควรจะเกิดขึ้นภายในช่วง Qualifying Window

(6) ให้ Supervisor ดูแลการนำส่ง Submission เช่น การกำชับ การควบคุม หรือการร่วมตรวจสอบการปฏิบัติงานของเจ้าหน้าที่ที่มีหน้าที่นำส่ง Submission ให้เป็นไปตาม THBFIX Methodology และคู่มือการนำส่ง Submission ผ่านระบบ FXT

(7) กำหนดกระบวนการในการรายงานข้อมูลหากพบพฤติกรรมที่ต้องสงสัย (Whistleblower policy) โดยต้องผ่านการอนุมัติจากผู้มีอำนาจ และต้องสื่อสารให้เจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission และ Supervisor รับทราบอย่างทั่วถึง ทั้งนี้ กระบวนการดังกล่าวอย่างน้อยควรครอบคลุมในเรื่องดังต่อไปนี้

(7.1) การสืบหาข้อเท็จจริงและหลักฐานที่เพียงพอ เมื่อได้รับแจ้งเบาะแสเกี่ยวกับพฤติกรรมที่สงสัยว่าฝ่าฝืนแนวปฏิบัติหรือฝ่าฝืนกระบวนการปฏิบัติงานภายในที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ขององค์กร รวมทั้งพฤติกรรมที่สงสัยว่าเกี่ยวข้องกับการบิดเบือนอัตราอ้างอิง เพื่อสรุปผลและหาแนวทางแก้ไขโดยเร็ว โดยจะต้องจัดทำรายงานผลการตรวจสอบเพื่อบันทึกกระบวนการดังกล่าวไว้เป็นลายลักษณ์อักษร

(7.2) การรายงานต่อ Administrator เมื่อมีการตรวจสอบแล้วพบว่าเป็นกรณีที่เกี่ยวข้องกับการบิดเบือนอัตราอ้างอิงจริง โดยจะต้องรายงานภายใน 15 วันทำการนับตั้งแต่วันที่ดำเนินการตรวจสอบเสร็จสิ้น

## 6. การจัดการกับความขัดแย้งทางผลประโยชน์ (Conflicts of interest)

(1) Contributing Bank และ FX Broker ต้องจัดให้มีแนวทางการจัดการกับความขัดแย้งทางผลประโยชน์ที่อาจเกิดขึ้นในกระบวนการ Submission โดยต้องผ่านการอนุมัติจากผู้มีอำนาจ และสื่อสารแนวทางการจัดการดังกล่าวให้เจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission และ Supervisor รับทราบอย่างทั่วถึง ทั้งนี้ แนวทางการจัดการดังกล่าวอย่างน้อยควรครอบคลุมถึงการดำเนินการเพื่อป้องกันไม่ให้เจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ทำธุรกรรม นำส่ง Submission จับคู่ธุรกรรม สื่อสารหรือเปิดเผยข้อมูลที่สามารถนำไปสู่การบิดเบือนหรือการร่วมกันบิดเบือนอัตราอ้างอิง

หาก Contributing Bank และ FX Broker ตรวจสอบจนพบหลักฐานที่ยืนยันได้ว่า เจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission มีพฤติกรรมที่เกี่ยวข้องกับความขัดแย้งทางผลประโยชน์และนำไปสู่การบิดเบือนอัตราอ้างอิง ให้ Contributing Bank และ FX Broker รายงานให้ Administrator ทราบภายใน 15 วันทำการนับตั้งแต่วันที่ดำเนินการตรวจสอบเสร็จสิ้น

(2) Contributing Bank และ FX Broker ต้องมีบทลงโทษที่เหมาะสมตามระเบียบวินัยขององค์กรสำหรับพฤติกรรมที่ฝ่าฝืนแนวปฏิบัติหรือกระบวนการปฏิบัติงานภายในที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ขององค์กร และพฤติกรรมที่เกี่ยวข้องกับการบิดเบือนอัตราอ้างอิง

## 7. การจัดเก็บหรือเข้าถึงข้อมูล

Contributing Bank และ FX Broker ต้องมีกระบวนการที่เหมาะสมในการจัดเก็บหรือเข้าถึงข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission โดยข้อมูลดังกล่าวต้องอยู่ในลักษณะพร้อมใช้งานเมื่อมีการตรวจสอบจาก Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก รวมทั้งต้องนำเสนอข้อมูลดังกล่าวให้แก่ Administrator ภายใน 15 วันทำการนับตั้งแต่วันที่มีการร้องขอ ทั้งนี้ Contributing Bank และ FX Broker ต้องจัดเก็บหรือสามารถเข้าถึงข้อมูลได้ตามกรอบระยะเวลา ดังนี้

(1) ข้อมูลที่ Contributing Bank และ FX Broker ต้องจัดเก็บหรือสามารถเข้าถึงได้เป็นเวลาอย่างน้อย 5 ปี ได้แก่

(1.1) Submission

(1.2) กระบวนการปฏิบัติงานภายในที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ตามที่ระบุในข้อ 5 (4) กระบวนการในการรายงานข้อมูลหากพบพฤติกรรมที่ต้องสงสัยตามที่ระบุในข้อ 5 (7) และแนวทางการจัดการกับความขัดแย้งทางผลประโยชน์ตามที่ระบุในข้อ 6 (1) ที่ Contributing Bank และ FX Broker จัดทำขึ้น

(1.3) รายชื่อและความรับผิดชอบของเจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission รายชื่อของผู้มีอำนาจและ Supervisor ตลอดจนรายงานผลการตรวจสอบของ Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก และรายงานผลการตรวจสอบสถานการณ์หรือพฤติกรรมที่เกี่ยวข้องกับการบิดเบือนอัตราอ้างอิง (ถ้ามี)

(1.4) การสื่อสารผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ เช่น Email หรือ Chat log ของเจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ทั้งระหว่างภายในและกับภายนอกองค์กร เช่น Contributing Bank อื่น FX Broker อื่น ลูกค้า หรือ Administrator

(2) ข้อมูลที่ Contributing Bank และ FX Broker ต้องจัดเก็บหรือสามารถเข้าถึงได้ เป็นเวลาอย่างน้อย 2 ปี ได้แก่ ข้อมูลบันทึกเสียงการสื่อสารผ่านโทรศัพท์ของเจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ทั้งระหว่างภายในและกับภายนอกองค์กร เช่น Contributing Bank อื่น FX Broker อื่น ลูกค้า หรือ Administrator

## 8. การตรวจสอบโดย Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก

Contributing Bank และ FX Broker ต้องจัดให้มีการตรวจสอบโดย Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก ตามความถี่ที่เหมาะสม เช่น การสุ่มตรวจข้อมูลการสื่อสาร หรือการสอบทานการปฏิบัติตามแนวปฏิบัตินี้ เพื่อให้มั่นใจได้ว่ากระบวนการ Submission และกระบวนการปฏิบัติงานภายในอื่น ๆ ของ Contributing Bank และ FX Broker มีความเหมาะสมและสอดคล้องกับแนวปฏิบัตินี้ และต้องรายงานผลการตรวจสอบต่อผู้มีอำนาจ

## 9. วันที่เริ่มต้นบังคับใช้

แนวปฏิบัตินี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 2 พฤษภาคม 2562 เป็นต้นไป โดยหาก Contributing Bank และ FX Broker ไม่สามารถดำเนินการตามที่กำหนดในแนวปฏิบัตินี้ ให้ Contributing Bank หรือ FX Broker นั้นแจ้งให้ Administrator ทราบก่อนวันที่เริ่มต้นบังคับใช้อย่างน้อย 10 วัน เพื่อหาแนวทางปฏิบัติที่เหมาะสมต่อไป

## ภาคผนวก 1

### วิธีการคำนวณอัตราอ้างอิง THBFX ในรูปแบบ Transactions-based (THBFX Methodology)

ชื่อ (Rate)	อัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFX)
คำจำกัดความ (Rate description)	อัตราดอกเบี้ยอ้างอิงในการกู้ยืมเงินบาทระยะต่าง ๆ ที่คำนวณมาจากการกู้ยืมเงินดอลลาร์ สรอ. ในระยะเดียวกัน และแลกเปลี่ยนเป็นเงินบาทด้วยการทำธุรกรรม FX swap
การคำนวณอัตราอ้างอิง THBFX (Rate setting)	<p>Calculation Agent จะคำนวณอัตราอ้างอิง THBFX แต่ละระยะ (Tenor) ในแต่ละวันทำการ ตามสูตรการคำนวณ ดังนี้</p> $\text{THBFX} = \left\{ \left[ \left( \frac{\text{Spot Rate} + \text{Forward Points}}{\text{Spot Rate}} \right) \times \left( 1 + \frac{\text{USD Rate} \times \# \text{days}}{360} \right) \right] - 1 \right\} \times \frac{365}{\# \text{days}} \times 100$ <p>โดย:</p> <p>“USD Rate” หมายถึง อัตราดอกเบี้ยสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. ของแต่ละ Tenor ที่ประกาศบน Thomson Reuters screen LIBOR01 (หรือหน้าอื่น ๆ ที่แสดง USD LIBOR) ณ เวลา 11.55 น. ตามเวลาสหราชอาณาจักร ในวันทำการนั้น</p> <p>“#days” หมายถึง จำนวนวันของแต่ละ Tenor ในวันทำการนั้น</p> <p>“Spot Rate” หมายถึง USDTHB spot rate ที่คำนวณด้วยวิธีถ่วงน้ำหนักด้วยปริมาณธุรกรรม (Volume weighted average) โดยคำนวณจากธุรกรรม USDTHB FX spot ที่เป็น Qualified Transaction (ไม่รวมธุรกรรมที่มีปริมาณสูงผิดปกติ หรือมีค่า Spot rate สูงหรือต่ำผิดปกติ) ในวันทำการนั้น ตามสูตรการคำนวณ ดังนี้</p> $\text{Spot Rate} = \sum (\text{THB Principal}_i \times \text{Spot Rate}_i) / \text{THB Aggregate Principal}$ <p>โดย:</p> <p>“THB Principal<sub>i</sub>” หมายถึง ปริมาณธุรกรรม USDTHB FX spot ในรูปสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. ของแต่ละธุรกรรมที่เป็น Qualified Transaction</p> <p>“THB Aggregate Principal” หมายถึง ปริมาณธุรกรรม USDTHB FX spot รวมในรูปสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. ของธุรกรรมที่เป็น Qualified Transaction</p> <p>“Spot Rate<sub>i</sub>” หมายถึง อัตราแลกเปลี่ยนสำหรับการซื้อขาย USDTHB FX spot ของแต่ละธุรกรรมที่เป็น Qualified Transaction</p> <p>“Forward Points” หมายถึง Forward points ที่คำนวณด้วยวิธีถ่วงน้ำหนักด้วยปริมาณธุรกรรม (Volume weighted average) โดยคำนวณจากธุรกรรม USDTHB FX swap ที่เป็น Qualified Transaction (ไม่รวมธุรกรรมที่มีปริมาณสูงผิดปกติ หรือมีค่า Forward point สูงหรือต่ำผิดปกติ) ของแต่ละ Tenor ในวันทำการนั้น ตามสูตรการคำนวณ ดังนี้</p> $\text{Forward Points} = \sum (\text{THB Principal}_i \times \text{Forward Points}_i) / \text{THB Aggregate Principal}$ <p>โดย:</p> <p>“THB Principal<sub>i</sub>” หมายถึง ปริมาณธุรกรรม USDTHB FX swap ในรูปสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. ของแต่ละธุรกรรมที่เป็น Qualified Transaction ของแต่ละ Tenor ในวันทำการนั้น</p>



	<p>“THB Aggregate Principal” หมายถึง ปริมาณธุรกรรม USDTHB FX swap รวมในรูปสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. ของธุรกรรมที่เป็น Qualified Transaction ของแต่ละ Tenor ในวันทำการนั้น</p> <p>“Forward Points” หมายถึง ส่วนต่างระหว่างอัตราแลกเปลี่ยนสำหรับการซื้อขาย USDTHB ขาแรก (Near leg) และอัตราแลกเปลี่ยนสำหรับการซื้อขาย USDTHB ขาหลัง (Far leg) ของแต่ละธุรกรรมที่เป็น Qualified Transaction ของแต่ละ Tenor ในวันทำการนั้น</p>
ประเภทธุรกรรม (Types of trades)	ธุรกรรม USDTHB FX spot และธุรกรรม USDTHB FX swap
ธุรกรรมที่เข้าข่ายเป็น Qualified Transaction	<p>ธุรกรรมที่นับเป็น Qualified Transaction จะต้องเข้าเงื่อนไขทั้งหมดดังต่อไปนี้</p> <p>(ก) มีปริมาณธุรกรรมเท่ากับหรือมากกว่าปริมาณธุรกรรมขั้นต่ำ</p> <p>(ข) USDTHB FX swap: คู่ค้าทั้งสองฝ่ายเป็น Contributing Bank USDTHB FX spot: คู่ค้าทั้งสองฝ่ายเป็น Contributing Bank <b>หรือ</b> คู่ค้าอย่างน้อย 1 ฝ่ายเป็น Contributing Bank สำหรับธุรกรรมที่ได้รับการจับคู่และดำเนินการด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์จาก FX Broker</p> <p>(ค) เป็นธุรกรรมที่เกิดขึ้นในช่วงเวลาที่กำหนด (Qualifying Window)</p> <p>(ง) Tenor ตรงกับที่กำหนด</p>
ช่วงเวลาที่กำหนดของ ธุรกรรม (Qualifying Window)	<p>USDTHB FX spot: 14.30 – 15.00 น. ตามเวลาประเทศไทย</p> <p>USDTHB FX swap: 07.30 – 16.30 น. ตามเวลาประเทศไทย</p>
ช่วงเวลาในการส่งข้อมูล (Submission Window)	<p>USDTHB FX spot: 14.30 – 15.25 น. ตามเวลาประเทศไทย</p> <p>USDTHB FX swap: 07.30 – 16.55 น. ตามเวลาประเทศไทย</p>
ปริมาณธุรกรรมขั้นต่ำ (Minimum notional)	<p>USDTHB FX spot: 1,000,000 ดอลลาร์ สรอ.</p> <p>USDTHB FX swap: 1,000,000 ดอลลาร์ สรอ.</p>
ระยะ (Tenor)	<p>USDTHB FX spot: T+2</p> <p>USDTHB FX swap: O/N, SW, 1M, 3M, 6M และ 1Y</p>
การนับวัน (Day count)	<p>THB – Actual/365</p> <p>USD – Actual/360</p>
การกำหนดจุดทศนิยม (No. of decimal places)	<p>THBFX: ทศนิยม 5 ตำแหน่ง ปิดเศษทางด้านที่ใกล้ที่สุด</p> <p>USDTHB Spot Rate: ทศนิยม 4 ตำแหน่ง ปิดเศษทางด้านที่ใกล้ที่สุด</p> <p>USDTHB Forward Points: ทศนิยม 4 ตำแหน่ง ปิดเศษทางด้านที่ใกล้ที่สุด</p>

<p>ช่องทางการเผยแพร่ (Publication page)</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Thomson Reuters screen</li> </ul> <p>Main page:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• THBFIX</li> </ul> <p>USDTHB Spot Rate:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• THBTRDF=BKTH</li> </ul> <p>USDTHB Forward Points:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• THBTRDONSO=BKTH</li> <li>• THBTRDSWSO=BKTH</li> <li>• THBTRD1MSO=BKTH</li> <li>• THBTRD3MSO=BKTH</li> <li>• THBTRD6MSO=BKTH</li> <li>• THBTRD1YSO=BKTH</li> </ul> <p>THBFIX:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• THBTRDONF=BKTH</li> <li>• THBTRDSWF=BKTH</li> <li>• THBTRD1MF=BKTH</li> <li>• THBTRD3MF=BKTH</li> <li>• THBTRD6MF=BKTH</li> <li>• THBTRD1YF=BKTH</li> </ul> <ul style="list-style-type: none"> <li>- เว็บไซต์ ธปท.</li> </ul>
<p>เวลาเผยแพร่ (Time of publication)</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Thomson Reuters screen             <ul style="list-style-type: none"> <li>• USDTHB Spot Rate: 15.30 น. ตามเวลาประเทศไทย</li> <li>• USDTHB Forward Points: 17.00 น. ตามเวลาประเทศไทย</li> <li>• THBFIX: 17.55 น. หรือ 18.55 น. ตามเวลาประเทศไทย (ขึ้นกับเวลาเผยแพร่ USD Rate)</li> </ul> </li> <li>- เว็บไซต์ ธปท.             <ul style="list-style-type: none"> <li>• USDTHB Spot Rate และ THBFIX: 19.00 น. หรือ 20.00 น. ตามเวลาประเทศไทย (ขึ้นกับเวลาเผยแพร่ USD Rate)</li> <li>• USDTHB Forward Points: 9.30 น. ของวันทำการถัดไป ตามเวลาประเทศไทย</li> </ul> </li> </ul>
<p>วันเผยแพร่ข้อมูล (Publication day)</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>- USDTHB Spot Rate: วันทำการของประเทศไทย</li> <li>- USDTHB Forward Points: วันทำการของประเทศไทย (หากเป็นวันหยุดทำการของสหรัฐฯ จะไม่มีการเผยแพร่ระยะ O/N)</li> <li>- THBFIX: วันทำการของประเทศไทย (หากเป็นวันหยุดทำการของสหรัฐฯ จะไม่มีการเผยแพร่ระยะ O/N)</li> </ul>
<p>การแก้ไขบน Thomson Reuters screen (Correction to rate)</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>- หากความผิดพลาดเกิดขึ้นจาก Thomson Reuters การแก้ไขจะทำภายใน 30 นาทีจากเวลาเผยแพร่</li> <li>- หากความผิดพลาดเกิดขึ้นจากการเผยแพร่ USD Rate การแก้ไขจะทำภายในเวลา 22.00 น. หรือ 23.00 น. ตามเวลาประเทศไทย (ขึ้นกับเวลาการแก้ไข USD Rate)</li> </ul>

<p>มาตรการสำรอง (Fallback)</p>	<p><b>USDTHB Spot Rate</b></p> <p>เงื่อนไขการใช้มาตรการสำรอง: มาตรการสำรองจะถูกนำมาใช้เมื่อไม่มีธุรกรรมที่เป็น Qualified Transaction เกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window</p> <p><b>ขั้นตอนการปฏิบัติ:</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. ขยายช่วง Qualifying Window อีก 25 นาที จาก 14.30 – 15.00 น. เป็น 14.30 – 15.25 น. ตามเวลาประเทศไทย ผ่านช่องทางซื้อขายด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์จาก FX Broker โดยหากมี Qualified Transaction ของ USDTHB Spot Rate ในช่วงเวลาดังกล่าว ธปท. จะเผยแพร่ USDTHB Spot Rate บน Thomson Reuters screen ณ เวลา 15.30 น. ตามเวลาประเทศไทย</li> <li>2. หากขยายช่วง Qualifying Window ตามขั้นที่ 1 แล้ว ไม่มีธุรกรรมที่เป็น Qualified Transaction เกิดขึ้นในช่วงเวลาดังกล่าว การเผยแพร่ USDTHB Spot Rate จะใช้อัตราแลกเปลี่ยนถัวเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักระหว่างธนาคาร (ที่ประกาศโดย ธปท.) ของวันทำการปัจจุบัน ซึ่ง USDTHB Spot Rate จะเผยแพร่บน Thomson Reuters screen ณ เวลา 18.00 น. ตามเวลาประเทศไทย</li> </ol> <p><b>USDTHB Forward Points</b></p> <p>เงื่อนไขการใช้มาตรการสำรอง: มาตรการสำรองจะถูกนำมาใช้เมื่อไม่มีธุรกรรมที่เป็น Qualified Transaction ใน Tenor นั้น เกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window</p> <p><b>ขั้นตอนการปฏิบัติ:</b></p> <p>การเผยแพร่ USDTHB Forward Point ใน Tenor ดังกล่าว จะใช้ USDTHB Forward Point ใน Tenor นั้นของวันทำการล่าสุดที่มีธุรกรรม Qualified Transaction โดยปรับด้วย Day count ของวันทำการปัจจุบัน ตามสูตรการคำนวณ ดังนี้</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin: 10px 0;"> <math display="block">\text{Adjusted forward points} = \left( \frac{\text{Forward Points}}{\text{Day count of the latest business day}} \right) \times (\text{Day count of the relevant day})</math> </div> <p><b>THBFX</b></p> <p>เงื่อนไขการใช้มาตรการสำรอง: มาตรการสำรองจะถูกนำมาใช้เมื่อไม่มีการเผยแพร่ USD Rate ใน Tenor นั้น</p> <p><b>ขั้นตอนการปฏิบัติ:</b></p> <p>หากไม่มีการเผยแพร่ USD Rate ใน Tenor ใด การคำนวณอัตราอ้างอิง THBFX ใน Tenor ดังกล่าวจะใช้ USD Rate ของวันทำการก่อนหน้า อย่างไรก็ตาม การปฏิบัติดังกล่าวจะใช้ได้ติดต่อกันเพียง 3 วันทำการเท่านั้น หากไม่มีการเผยแพร่ USD Rate ใน Tenor ดังกล่าวติดต่อกันเป็นวันทำการที่ 4 การเผยแพร่อัตราอ้างอิง THBFX สำหรับ Tenor นั้น จะเป็น “No Fix”</p> <p>หมายเหตุ: มาตรการสำรองข้างต้นมีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2563</p>
------------------------------------	--

## ภาคผนวก 2

### คู่มือการนำส่ง Submission ผ่านระบบ FXT

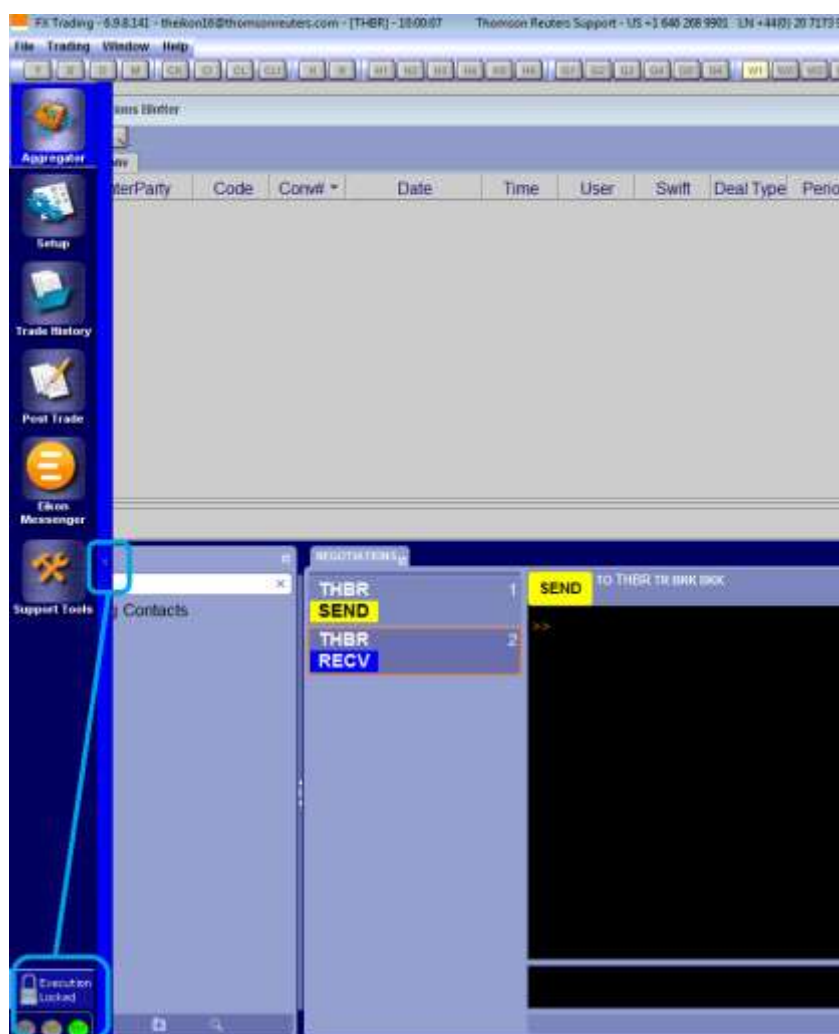
#### Table of Content

	Page
การลงชื่อเข้าใช้งานและการตรวจสอบสถานะการเข้าใช้งาน (Log in and Status Checking)	2
การทำธุรกรรมผ่าน FX Broker (Transactions Via Voice Brokers)	3
หน้าที่ความรับผิดชอบของ FX Broker (Mandatory for Brokers)	4
หน้าที่ความรับผิดชอบของ Contributing Bank (Mandatory for Banks)	8
การดำเนินการกรณีพบความผิดพลาดของธุรกรรมและจำเป็นต้องแก้ไข (Incorrect Transaction – needed to change)	14
การดำเนินการกรณีพบความผิดพลาดของธุรกรรมและจำเป็นต้องยกเลิกธุรกรรมเดิม (Cancel Transaction)	14
การระบุว่า CONTRA deal เป็นของธุรกรรมใด (How to identify CONTRA deal referred to which original deal?)	15
การอ้างอิงถึงธุรกรรมที่ต้องการ CONTRA หรือตรวจสอบข้อมูลของธุรกรรมเดียวกัน (How to identify which deal to CONTRA or how to reconcile deal?)	17
สถานะของธุรกรรมบนระบบ FXT (Types of Status on Blotter)	18
การทำธุรกรรมโดยตรงระหว่างธนาคาร (Transactions Via Dealing on FXT)	20
Conversation Convention ของการทำธุรกรรมโดยตรงระหว่างธนาคาร (Interbank Dealing Transaction Conversation Convention)	21
Contacts	28

## การลงชื่อเข้าใช้งานและการตรวจสอบสถานะการเข้าใช้งาน (Log in and Status Checking)

- All users (banks and brokers) must log in and be online during the qualified window period to be able to receive calls from counter parties
- On line status can be checked by clicking on the left frame of the screen, to open menu tab on left side
  - Green light = Online
  - Yellow or Red light = Might be a problem of connection

If user couldn't be online or if user is facing connection problem, please inform your IT to check network connection or contact Refinitiv team. (Contact details are in the last page)



### การทำธุรกรรมผ่าน FX Broker (Transactions Via Voice Brokers)

- Brokers send only qualified transactions

Types of transaction

- USD/THB spot from both onshore entities
- USD/THB FX swaps from both onshore entities

Overnight

Spot-week

1-month

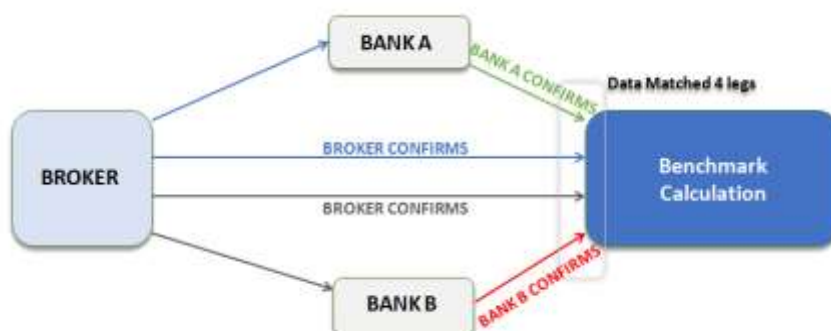
3-month

6-month

1-year

- Broker sends confirmation transactions via FXT within qualified window times
  - Trades within qualified window period
    - Thai Baht spot 14:30 – 15:00 BKK time
    - Thai Baht swap 07:30 – 16:30 BKK time
  - Submission window period
    - Thai Baht spot 14:30 – 15:25 BKK time
    - Thai Baht/USD swap 07:30 – 16:55 BKK time
- Timestamp on FXT program is GMT, Bangkok time is GMT+7

Remarks: Deal or CONTRA deal will be matched for benchmark calculation only when data was sent from all counter parties. (4 legs)



## หน้าที่ความรับผิดชอบของ FX Broker (Mandatory for Brokers)

### Send details of confirmation

1. Deal Type, Currency, tenor (FX swap)

2. Codes of 2 banks

Identify desk or trader name to reduce error

3. Codes of counter parties, 2 times in 2 fields

4. Transaction details, amount can be typed as “M” for Million

\*Other information can be added to Note field

The screenshot shows the 'Deal Affirmation' window with the following fields and annotations:

- Deal Details:** Deal Type: FX SWAP, Currency Pair: USD / THB, Period: 1M. (Annotated with 1.)
- Bank 1:** Dealing Code: XBHB, Interest: SPOT DESK. (Annotated with 2.)
- Bank 2 Enable:** Checked, Dealing Code: XBLC, Interest: (Empty). (Annotated with 2.)
- Counterparty:** Bank 1: XBLC, Bank 2: XBHB. (Annotated with 3.)
- Transaction Details:** Direction: BUY+SELL, Near Amount: 30000000, Far Amount: 30000000, Points: -2.4, Near Rate: 32.76, Far Rate: 32.736, Near Value Date: 24DEC2018, Far Value Date: 24JAN2019. (Annotated with 4.)
- Payment Instructions:** Near Payment Instructions, Near BIC, Far Payment Instructions, Far BIC, Clearing House, Clearing Member. (Annotated with 4.)
- Note:** (Annotated with \*).

Buttons at the bottom: Transmit, Dismiss after Transmit, Exit.

All information will be sent to 2 banks and auto-generated as correct sentences with all information.

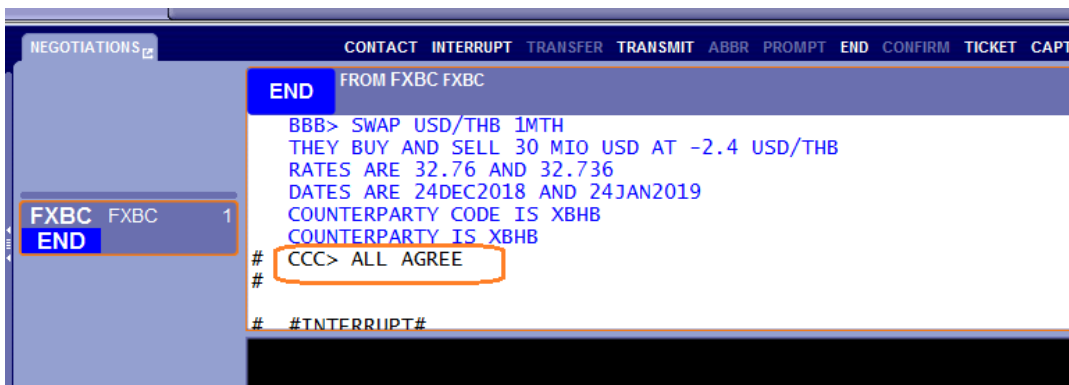
### Confirmation

1. Wait for both banks to confirm/acknowledge transactions first
2. END 2 conversation windows
3. Check 2 Ticket editors (pop-up window)
4. Press CONFIRM + END for 2 tickets (to send confirmation to calculation system)

Wait for BANK XBHB to confirm



Wait for BANK XBLC to confirm





Broker confirms 2 tickets from both banks

Direction	Curr	Status	Rate	Volume	Near Date	Far Date	TXN ID	Maker
JY&SELL	USD	CONFIRMED	-2.4	30 MIO	24-Dec-2...	24-Jan-20...	FXBC079993XBLC1812200935	XBLC
ELL&BUY	USD	CONFIRMED	-2.4	30 MIO	24-Dec-2...	24-Jan-20...	FXBC079983XBHB1812200935	XBHB

Ticket Editor (TXN ID: FXBC079983XBHB1812200935)
09:35GMT 20DEC2018
XBHB
XBHB
c11371
<TUAS>
CONFIRMED: TUAS

Deal
SWAP
1M
USD
THB
SELL+BUY
AT
32.76
-2.4
32.736
THB
982,800,000.00
USD
30,000,000.00
Deliverable
USD
10,000,000.00
THB
982,080,000.00
TUAS
MON 24DEC2018
THU 24JAN2019
<our pay - near>
<our pay code - near>
CONFIRMED
<their pay code - near>
<our pay - far>
<our pay code - far>
<their pay - far>
<their pay code - far>
<clearing house>
<our clearing member>
<their clearing member>
<reporting party>
<comment-1>
<comment-2>
Use Data
User Info #1
<user info>
Counterparty / Broker
Counterparty
XBHB
On behalf of
XBLC
OBO code: XBLC
<our LEI>
<their LEI>
Counterparty code: <cp code>
<clearing account>
<issuer namespace>
<trade repository>
FXBC079993XBLC1812200935
<transaction id 2>
<brokerage amount>
<ccy>
FX/Base Rates
Bank Base Rates
<currency>
<rate>
<currency>
<rate>
<currency>
<rate>
FX Market Rates
USD/THB 32.70
USD 1.0000
Best Price
<best bid>
<best offer>
Mid Price
<mid price>

Create Ticket
New
Contra
Ticket Chain
Back
Fwd
Tickets
Prev
Next

End
Quit
Print
Confirm
Cancel Ticket
Wrong

### If another trader picks up call wrongly

If trader from other desk in the bank picks up call from broker wrongly, the right trader can open ticket editor from blotter to CONFIRM. This is not necessary for broker to call again.

Example: Broker calls to user A, but another user (TUAS) accidentally picks up call.

User A can also see from blotter that deal shows as user TUAS name.

User TUAS can inform user A, then END the call.

Then user A can open Ticket Editor window from the blotter to review deal information.

Then user A press CONFIRM to send to calculation again.

**Negotiations Blotter**

Cou	Code	Conv#	Date	Time	User	Swift	Deal Type	Period	Direction	Curr	Status	Rate	Volume
XB	XBNC	11423	25-Jan-2019	06:19:06	TUAS	USD/THB	SPOT	SPOT	SELL	USD	EXTRACTED	31.69	1 MIO
XB	XBMC	11422	25-Jan-2019	06:18:54	TUAS	USD/THB	SPOT	SPOT	BUY	USD	EXTRACTED	31.69	1 MIO
XB	XBNC	11421	24-Jan-2019	12:51:2									
FX	FXBC	11419	23-Jan-2019	09:14:4									
FX	FXBC	11420	23-Jan-2019	09:14:4									
FX	FXBC	11417	23-Jan-2019	09:06:4									
FX	FXBC	11418	23-Jan-2019	09:06:4									
FX	FXBC	11416	23-Jan-2019	09:03:1									
FX	FXBC	11415	23-Jan-2019	09:03:2									
FX	FXBC	11413	22-Jan-2019	12:22:1									
FX	FXBC	11414	22-Jan-2019	12:22:1									
FX	FXBC	11412	22-Jan-2019	12:19:4									
FX	FXBC	11411	22-Jan-2019	12:19:4									
FX	FXBC	11409	22-Jan-2019	11:12:2									

**Ticket Editor (TDI ID: FXBC092623XBNC1901250618)**

Deal: SPOT USD / THB SELL AT 31.69  
 THB 51,000,000.00 USD 1,000,000.00  
 TUE 29JAN2019 TUE 29JAN2019  
 Our Payment Instruction: TUAS  
 Create Ticket: New Confirm  
 Ticket Chain: Back Forward  
 Tickets: Prev Next

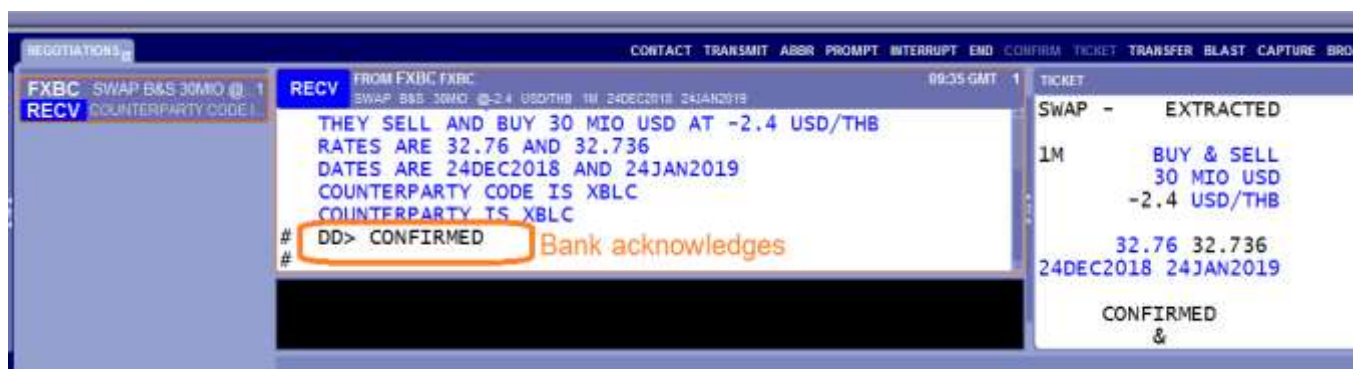
User Data:  
 User info #1: <user info> Counterparty / Broker: On behalf of: XBMC  
 User info #2: <user info> Counterparty: Counterparty code: <cp code>  
 User info #3: <user info> Counterparty: Counterparty code: <cp code>  
 <our LE> <their LE> Counterparty code: <cp code>  
 <clearing account> <clearing member> <their clearing member>  
 <trade repository> <comment-1> <comment-2>  
 FXBC092623XBNC1901250618 <transaction id 2>  
 <brokerage amount> <ccy>

FXBase Rates: End Quit Print **Confirm** Cancel Ticket Wrong

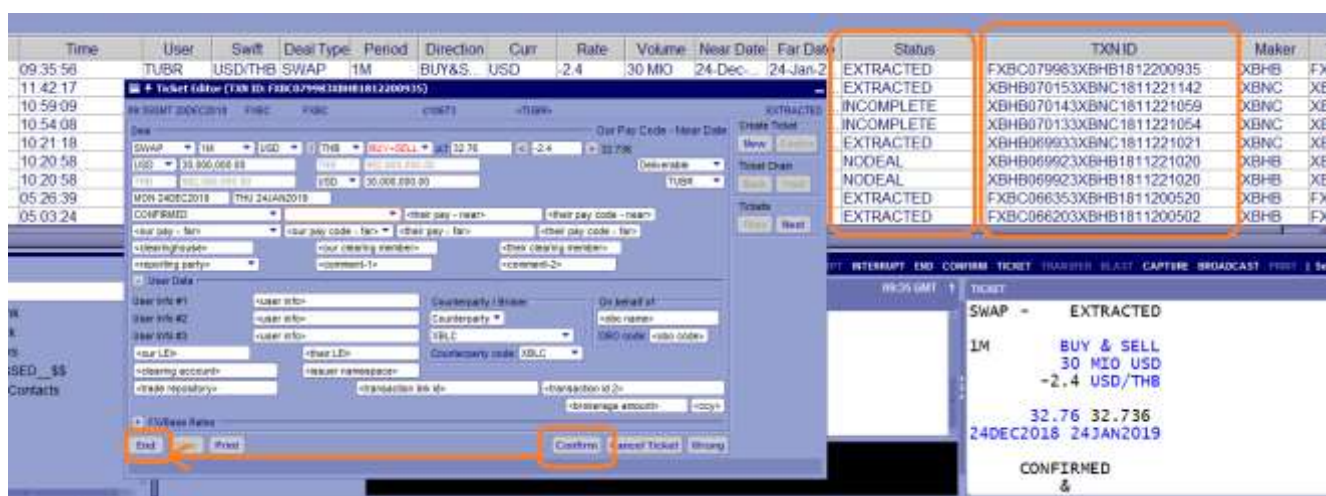
## หน้าที่ความรับผิดชอบของ Contributing Bank (Mandatory for Banks)

1. Online during the qualified window (trading & submission)
2. Accept calls
3. Review information
4. Confirm or acknowledge transactions - Bank could confirm in full sentences or acknowledge (CONFIRMED, CONFIRM, CFM, ALL AGREED, etc.)

Remarks: Information sent from broker shows as another counter party's direction (THEY)



5. End conversation window
6. Check Ticket editor (pop-up window)
7. Press CONFIRM + END (to send confirmation to calculation system)



After press CONFIRM, status of deal will change to CONFIRMING (waiting to send to calculation)

Time	User	Swift	Deal Type	Period	Direction	Curr	Rate	Volume	Near Date	Far Date	Status	TXN ID	Maker
09:35:56	TUBR	USD/THB	SWAP	1M	BUY&S	USD	-2.4	30 MIO	24-Dec-	24-Jan-2	CONFIRMING	FXBC079983XBHB1812200935	XBHB
11:42:17	TUBR	USD/THB	SWAP	1M	SELL&	USD	+0	50 MIO	23-Nov-2	26-Nov-2	EXTRACTED	XBHB070153XBNC1811221142	XBNC
10:59:09	TUBR	USD/THB	SWAP	ON	SELL&	USD	+33.01%	50 MIO	23-Nov-2	26-Nov-2	INCOMPLETE	XBHB070143XBNC1811221059	XBNC
10:54:08	TUBR	USD/THB	SWAP	ON	SELL&	USD	??????	50 MIO	21-Nov-2	23-Nov-2	INCOMPLETE	XBHB070133XBNC1811221054	XBNC
10:21:18	TUBR	USD/THB	SWAP	ON	SELL&	USD	+0	50 MIO	23-Nov-2	26-Nov-2	EXTRACTED	XBHB069933XBNC1811221021	XBNC
10:20:58	TUBR	??????	SPOT	SPOT			??????				NODEAL	XBHB069923XBHB1811221020	XBHB
10:20:58	TUBR	??????	SPOT	SPOT			??????				NODEAL	XBHB069923XBHB1811221020	XBHB
05:26:39	TUBR	USD/THB	SPOT	SPOT	SELL	USD	33.00	1 MIO	23-Nov-2		EXTRACTED	FXBC066353XBHB1811200520	XBHB
05:03:24	TUBR	USD/THB	SPOT	SPOT	SELL	USD	33.00	1 MIO	23-Nov-2		EXTRACTED	FXBC066203XBHB1811200502	XBHB

Press END again to send information, status will change to CONFIRMED

Time	User	Swift	Deal Type	Period	Direction	Curr	Rate	Volume	Near Date	Far Date	Status	TXN ID	Maker
09:35:56	TUBR	USD/THB	SWAP	1M	BUY&S	USD	-2.4	30 MIO	24-Dec-	24-Jan-2	CONFIRMED	FXBC079983XBHB1812200935	XBHB
11:42:17	TUBR	USD/THB	SWAP	1M	SELL&	USD	+0	50 MIO	23-Nov-2	26-Nov-2	EXTRACTED	XBHB070153XBNC1811221142	XBNC
10:59:09	TUBR	USD/THB	SWAP	ON	SELL&	USD	+33.01%	50 MIO	23-Nov-2	26-Nov-2	INCOMPLETE	XBHB070143XBNC1811221059	XBNC
10:54:08	TUBR	USD/THB	SWAP	ON	SELL&	USD	??????	50 MIO	21-Nov-2	23-Nov-2	INCOMPLETE	XBHB070133XBNC1811221054	XBNC
10:21:18	TUBR	USD/THB	SWAP	ON	SELL&	USD	+0	50 MIO	23-Nov-2	26-Nov-2	EXTRACTED	XBHB069933XBNC1811221021	XBNC
10:20:58	TUBR	??????	SPOT	SPOT			??????				NODEAL	XBHB069923XBHB1811221020	XBHB
10:20:58	TUBR	??????	SPOT	SPOT			??????				NODEAL	XBHB069923XBHB1811221020	XBHB
05:26:39	TUBR	USD/THB	SPOT	SPOT	SELL	USD	33.00	1 MIO	23-Nov-2		EXTRACTED	FXBC066353XBHB1811200520	XBHB
05:03:24	TUBR	USD/THB	SPOT	SPOT	SELL	USD	33.00	1 MIO	23-Nov-2		EXTRACTED	FXBC066203XBHB1811200502	XBHB



### If another trader picks up call wrongly

If trader from other desk in the bank picks up call from broker wrongly, the right trader can open ticket editor from blotter to CONFIRM. This is not necessary for broker to call again.

This is not recommended trader to use transfer function on FXT. As FXT will generate another ticket automatically.

Example: Broker calls to user A, but another user (TUAS) accidentally picks up call.

User A can also see from blotter that deal shows as user TUAS name.

User TUAS can inform user A, then END the call.

Then user A can open Ticket Editor window from the blotter to review deal information.

Then user A press CONFIRM to send to calculation again.

The screenshot displays the 'Negotiations Blotter' window with a table of deals. The 'User' column is highlighted with an orange box. Two deals are visible, both assigned to 'TUAS'. The first deal is a SELL order for USD/THB SPOT at a rate of 31.69. The second deal is a BUY order for USD/THB SPOT at a rate of 31.69. Below the blotter, the 'Ticket Editor' window is open for the selected deal. It contains various fields for deal details, payment instructions, and user data. The 'Confirm' button at the bottom right of the ticket editor is highlighted with an orange box.

Cou	Code	Conv#	Date	Time	User	Swift	Deal Type	Period	Direction	Curr	Status	Rate	Volume
XB	XBNC	11423	25-Jan-2019	06:19:06	TUAS	USD/THB	SPOT	SPOT	SELL	USD	EXTRACTED	31.69	1 MIO
XB	XBMC	11422	25-Jan-2019	06:18:54	TUAS	USD/THB	SPOT	SPOT	BUY	USD	EXTRACTED	31.69	1 MIO

## การทำธุรกรรมผ่าน FX Broker โดยระบุจำนวนเงินเป็นสกุลเงินบาท (Specified THB amount)

Broker sends details of confirmation

1. Deal Type, Currency (USD/THB), Tenor (FX swap)
2. Code of 2 banks  
Identify desk or trader name
3. Codes of counter parties, 2 fields
4. Transaction details
5. Select currency pair as USD/THB
6. Input Near amount then “space” and “THB” e.g. 700M THB

System will detect amount as THB, but rates are still quoting in USD/THB

**Deal Affirmation**

Deal Details  
 Deal Type: FX SWAP    Currency Pair: USD / THB    Period: 1M

Bank 1	Bank 2 Enable
Dealing Code: XBLC	Dealing Code: XBHB
Interest Message: SWAP DESK	Interest Message: SWAP DESK
Counterparty/Code: XBHB XBHB	Counterparty/Code: XBLC XBLC
Direction: BUY+SELL	Direction: SELL+BUY
Near Amount: 700M THB	Near Amount: 700M THB
Far Amount: 700M THB	Far Amount: 700M THB
Points: -2.20	Points: -2.20
Near Rate: 31.70	Near Rate: 31.70
Far Rate: 31.6780	Far Rate: 31.6780
Near Value Date: 05MAR2019	Near Value Date: 05MAR2019
Far Value Date: 05APR2019	Far Value Date: 05APR2019
Near Payment Instructions:	Near Payment Instructions:
Near BIC:	Near BIC:
Far Payment Instructions:	Far Payment Instructions:
Far BIC:	Far BIC:
Clearing House:	Clearing House:
Clearing Member:	Clearing Member:
Note:	Note:

Transmit    ☐ Dismiss after Transmit    Exit

This transaction Bank XBLC does BUY/SELL THB/USD amount in THB 700 million  
Swap point at -2.20 USD/THB, Spot at 31.70, Forward at 31.6780

The conversation will show as THEY (Bank XBHB) SELL AND BUY 700 M THB at rate -2.20 USD/THB

SEND	FROM FXBC FXBC	13:14 GMT 1	TICKET
SWAP B&S 700MIO @-2.20 USD/THB 1M 05MAR2019 05APR2019			SWAP - EXTRACTED
SWAP DESK			1M BUY & SELL
#			700 MIO THB
#INTERRUPT#			-2.20 USD/THB
SWAP USD/THB 1MTH			31.70 31.678
THEY SELL AND BUY 700M THB USD AT -2.20 USD/THB			05MAR2019 05APR2019
RATES ARE 31.70 AND 31.6780			???
DATES ARE 05MAR2019 AND 05APR2019			&
COUNTERPARTY CODE IS XBHB			???
COUNTERPARTY IS XBHB			???
# CCC>			
>> █			

System will detect as BUY/SELL action on THB currency

Ticket will show as: Bank XBLC BUY THB near leg (SELL USD)

SELL THB far leg (BUY USD)

Bank XBLC and Bank XBHB needed to review details and acknowledge.

Then CONFIRM.

Ticket: Bank XBLC's ticket shows as BUY/SELL THB

**BUY THB NEAR**

**SELL THB FAR**

**Ticket Editor (TXN ID: FXBC119213XBLC1903011314)**

13:14GMT 01MAR2019 FXBC FXBC c11006 <TUCX> EXTRACTED

Deal: THB 700,000,000.00 USD 22,082,018.93 Deliverable TUCX

USD 22,097,354.63 THB 700,000,000.00

TUE 05MAR2019 FRI 05APR2019

<our pay code - near> <their pay - near> <their pay code - near>

<our pay - far> <our pay code - far> <their pay - far> <their pay code - far>

<clearinghouse> <our clearing member> <their clearing member>

<reporting party> <comment-1> <comment-2>

User Data

User Info #1 <user info> Counterparty / Broker Counterparty XBHB On behalf of <obo name>

User Info #2 <user info> Counterparty code: XBHB OBO code: <obo code>

User Info #3 <user info>

<our LEI> <their LEI>

<clearing account> <issuer namespace>

<trade repository> <transaction link id> <transaction id 2>

<brokerage amount> <ccy>

+ FX/Base Rates

End Quit Print Confirm Cancel Ticket Wrong

Broker waits for acknowledgement/confirmation from both banks, then CONFIRM.

Broker's ticket which sent to Bank XBLC (Broker acts on behalf of Bank XBHB) will see direction as SELL/BUY on THB.

**BUY THB FAR**

**Ticket Editor (TXN ID: FXBC119213XBLC1903011314)**

13:14GMT 01MAR2019 XBLC XBLC c11600 <TUAS> EXTRACTED

Deal

SWAP 1M USD / THB SELL+BUY AT 31.70 <-2.20> 31.678

USD 22,082,018.93 THB 700,000,000.00 SELL THB NEAR Deliverable

THB 700,000,000.00 USD 22,097,354.63 TUAS

TUE 05MAR2019 FRI 05APR2019

<our pay - near> <our pay code - near> <their pay - near> <their pay code - near>

<our pay - far> <our pay code - far> <their pay - far> <their pay code - far>

<clearinghouse> <our clearing member> <their clearing member>

<reporting party> <comment-1> <comment-2>

User Data

User Info #1

User Info #2 <user info>

User Info #3 <user info>

<our LEI> <their LEI>

<clearing account> <issuer namespace>

<trade repository> <transaction link id> <transaction id 2>

<brokerage amount> <ccy>

+ FX/Base Rates

End Quit Print Confirm Cancel Ticket Wrong

On behalf of XBHB OBO code: XBHB



การดำเนินการกรณีพบความผิดพลาดของธุรกรรมและจำเป็นต้องแก้ไข (Incorrect Transaction – needed to change)

- Broker or bank inform all counter parties
- CONTRA the original deal (If broker/bank already CONFIRMED the transaction)
- Broker send new (correct) information to both banks
- Broker and both banks CONFIRM again

การดำเนินการกรณีพบความผิดพลาดของธุรกรรมและจำเป็นต้องยกเลิกธุรกรรมเดิม (Cancel Transaction)

- Broker or bank inform all counter parties
- CONTRA the original deal (If broker/bank already CONFIRMED the transaction)

## การระบุ CONTRA deal เป็นของธุรกรรมใด (How to identify CONTRA deal referred to which original deal?)

After CONTRA the original deal, new CONTRA deal will be generated with

1. New TXN ID (display only code of who click CONTRA)

Example: FXBC00000341461812200941

2. New Conversation number
3. New Ticket will have number referring to original ticket number

The screenshot displays a financial trading system interface. At the top, a table lists deals with columns: Code, Conv#, Date, Time, User, Swift, Deal Type, Period, Direction, Curr, Status, Rate, Volume, Near Date, Far Date, and TXN ID. The table contains three rows of data. Below the table, a 'Ticket Editor' window is open, showing fields for Deal, User Date, Counterparty, and various rates. The window has a 'Create Ticket' button with 'New' and 'Confirm' options. Annotations with numbers 1, 2, and 3 point to specific fields: 1 points to the TXN ID field in the table, 2 points to the Conv# field, and 3 points to the 'New' button in the ticket editor.

Code	Conv#	Date	Time	User	Swift	Deal Type	Period	Direction	Curr	Status	Rate	Volume	Near Date	Far Date	TXN ID
XBLC	11373	20-Dec-2018	09:41:53	TUAS	USD/THB	SWAP	1M	SELL&BUY	USD	CONFIRMED	-2.4	30 MIO	24-Dec-2	24-Jan-20	FXBC00000341461812200941
XBLC	11372	20-Dec-2018	09:41:53	TUAS	USD/THB	SWAP	1M	BUY&SELL	USD	CONFIRMED	-2.4	30 MIO	24-Dec-2	24-Jan-20	FXBC079993XBLC1812200935
XBHB	11371	20-Dec-2018	09:35:57	TUAS	USD/THB	SWAP	1M	SELL&BUY	USD	CONFIRMED	-2.4	30 MIO	24-Dec-2	24-Jan-20	FXBC079983XBHB1812200935

- Timestamp on Negotiation blotter of CONTRA deal and original deal will change to be the same time (time when the bank picked-up call)

Changed to call pick-up time:

Code	Conv#	Date	Time	User	Swift	Deal Type	Period	Direction	Curr	Status	Rate	Volume	Near Date	Far Date	TXN ID	Maker
LC	11373	20-Dec-2018	09:41:53	TUAS	USD/THB SWAP	1M	SELL&BUY	USD	CONFIRMED	-2.4	30 MKD	24-Dec-2	24-Jan-20	FXBC00000341461812200941	XBLC	F
LC	11372	20-Dec-2018	09:41:53	TUAS	USD/THB SWAP	1M	BUY&SELL	USD	CONFIRMED	-2.4	30 MKD	24-Dec-2	24-Jan-20	FXBC079993XBLC1812200935	XBLC	F
HB	11371	20-Dec-2018	09:35:57	TUAS	USD/THB SWAP	1M	SELL&BUY	USD	CONFIRMED	-2.4	30 MKD	24-Dec-2	24-Jan-20	FXBC079983XBHB1812200935	XBHB	F

Deal hasn't been CONTRA, time still be sending out time

User can click head of column in the blotter to sort sequence by date, time, or any column.

Negotiations Blotter

Filter:

Ticket/Conv

Cou...	Code	Conv#	Date	Time	User	S
XBLC	XBLC	11373	20-Dec-2018	09:41:53	TUAS	USC
XBLC	XBLC	11372	20-Dec-2018	09:41:53	TUAS	USC
XB...	XBHB	11371	20-Dec-2018	09:35:57	TUAS	USC

การอ้างอิงถึงธุรกรรมที่ต้องการ CONTRA หรือตรวจสอบข้อมูลของธุรกรรมเดียวกัน  
(How to identify which deal to CONTRA or how to reconcile deal?)

- Please refer to deal information with time (GMT), or use TXN ID (Transaction ID)
- TXN ID contains both counter parties codes (sender and receiver) and 10 digits of timestamp (broker's sending time)

Time	User	Swift	Deal Type	Period	Direction	Curr	Rate	Volume	Near Date	Far Date	Status	TXN ID	Maker
09:35:56	TUBR	USD/THB	SWAP	1M	BUY&S...	USD	-2.4	30 MIO	24-Dec-	24-Jan-2	CONFIRMED	FXBC079983XBHB1812200935	XBHB
11:42:17	TUBR	USD/THB	SWAP	Q/N	SELL&...	USD	+0	50 MIO	23-Nov-2	26-Nov-2	EXTRACTED	XBHB070153XBNC1811221142	XBNC
10:59:09	TUBR	USD/THB	SWAP	Q/N	SELL&...	USD	+33.01/	50 MIO	23-Nov-2	26-Nov-2	INCOMPLETE	XBHB070143XBNC1811221059	XBNC
10:54:08	TUBR	USD/THB	SWAP	Q/N	SELL&...	USD	??????	50 MIO	21-Nov-2	23-Nov-2	INCOMPLETE	XBHB070133XBNC1811221054	XBNC
10:21:16	TUBR	USD/THB	SWAP	Q/N	SELL&...	USD	+0	50 MIO	23-Nov-2	26-Nov-2	EXTRACTED	XBHB069933XBNC1811221021	XBNC
10:20:58	TUBR	??????	SPOT	SPOT			??????				NODEAL	XBHB069923XBHB1811221020	XBHB
10:20:58	TUBR	??????	SPOT	SPOT			??????				NODEAL	XBHB069923XBHB1811221020	XBHB
05:26:39	TUBR	USD/THB	SPOT	SPOT	SELL	USD	33.00	1 MIO	23-Nov-2		EXTRACTED	FXBC068353XBHB1811200520	XBHB
05:03:24	TUBR	USD/THB	SPOT	SPOT	SELL	USD	33.00	1 MIO	23-Nov-2		EXTRACTED	FXBC068203XBHB1811200502	XBHB

Explanation logic of TXN ID

- Last ten digits is date and time when broker send out a call
- TXN ID will always be the same between sender (Broker FXBC) and first receiver (BANK XBHB)

TXN ID  
 FXBC079983XBHB1812200935  
 Sender Receiver YMMDDHHMM

- TXIN ID will always be the same between sender (Broker FXBC) and Second receiver (BANK XBLC) , but will be different from first receiver (BANK XBHB)

TXN ID  
 FXBC079993XBLC1812200935  
 Second Receiver

### สถานะของธุรกรรมบนระบบ FXT (Types of Status on Blotter)

EXTRACTED – all necessary information are available: rate, amount, direction, tenor, and value date

INCOMPLETE – missing some necessary information

NO DEAL – No direction (Buy, Sell), No transaction occurred

FROZEN – Problem with information (wrong convention, etc.)

CONFIRMING – still in the process of confirming

CONFIRMED – complete deal and sent

### ตัวอย่างการดำเนินการ กรณีธุรกรรมมีสถานะเป็น “INCOMPLETE” บนระบบ FXT

INCOMPLETE status: If deal was done and conversation was END, yet status was

INCOMPLETE, please open ticket editor to see any missing information.

Then agree with counter party and make the same amendment manually on ticket editor.

Example: Deal status showed as INCOMPLETE

Ticket showed as this swap deal didn't have “Far rate” on the ticket, “THB amount” also missing.

System couldn't capture this deal as no far rate, 32.6460, was mentioned in the conversation.

The screenshot displays the FXT Ticket Editor interface. At the top, a table lists deals with columns: Date, Time, User, Swift, Deal Type, Period, Direction, Curr, Rate, Volume, Near Date, Far Date, Status, and TXN ID. One deal is highlighted with a red box around its status 'INCOMPLETE'.

Below the table, the 'Ticket Editor (TXN ID: XBHB080103XBLC1812201238)' window is open. It shows a swap deal with the following details:

- Deal: SWAP, BROKEN, USD, THB, BUY<SELL, AT 32.67, -2.4
- USD 1,000,000.00, THB amount
- THB amount, USD 1,000,000.00
- THU 27DEC2018, THU 24JAN2019

The 'Far rate' field is highlighted with a red box, indicating it is missing. The 'THB amount' field is also highlighted with a red box, indicating it is missing. The 'Status' field is set to 'INCOMPLETE'.

The left pane shows the conversation history:

```

END FROM XBHB XBHB
SWAP_BAS 1MIO @-2.4 USD/THB 27DEC2018 24JAN2019
DD> THB SWP
# CCC> HIHI
WE S/B USD 1MIO AG THB VAL 27DEC18 TO 24 JAN19
# #INTERUPT#
# #INTERUPT#
# -2.4
TO CONFIRM AT -2.4 I SELL AND BUY 1 MIO USD
RATES ARE 32.67
VAL 27DEC2018 AND 24JAN2019
# TO CONFIRM 1 MIO AGREED AT -2.4 I BUY AND SELL
AND 32.646
VAL 27DEC2018 AND 24JAN2019
# #END REMOTE#
  
```

The right pane shows the 'Create Ticket' button and other options like 'Show', 'Print', 'Cancel Ticket', and 'Wrong'.

Solution: After the conversation is end, needed to manually edit ticket by inputting swap point on the ticket again, -2.40.

Ticket will recalculate and then THB amount and CONFIRM button become available.

The screenshot displays the 'Ticket Editor' window for transaction ID XBHB080103XBLC1812201238. The interface is divided into several sections:

- Deal Section:** Contains fields for SWAP (set to BROKEN), USD, THB, BUY+SELL, and AT (set to 32.67). A swap point of -2.40 is entered in a field, highlighted with a green box. Other fields include THB 32,670,000.00, USD 1,000,000.00, and a Deliverable field set to TUCX.
- Payment and Clearing Section:** Includes fields for <our pay - near>, <our pay code - near>, <their pay - near>, <their pay code - near>, <our pay - far>, <our pay code - far>, <their pay - far>, <their pay code - far>, <clearinghouse>, <our clearing member>, <their clearing member>, <reporting party>, <comment-1>, and <comment-2>.
- User Data Section:** Includes fields for User Info #1, #2, and #3, <our LEI>, <their LEI>, <clearing account>, <issuer namespace>, <trade repository>, <transaction link id>, <transaction id 2>, <brokerage amount>, and <ccy>.
- FX/Base Rates Section:** A section for entering FX and base rates.
- Buttons:** At the bottom, there are buttons for End, Quit, Print, Confirm (highlighted with a green box), Cancel Ticket, and Wrong. A green line connects the swap point field to the Confirm button.

### การทำธุรกรรมโดยตรงระหว่างธนาคาร (Transactions Via Dealing on FXT)

- 2 Banks confirm only qualified transactions

Types of transaction

- USD/THB spot from both onshore entities
- USD/THB FX swaps from both onshore entities

Overnight

Spot-week

1-month

3-month

6-month

1-year

- Transactions via Dealing FXT within qualified window times

- Trades within qualified window period

- Thai Baht spot 14:30 – 15:00 BKK time

- Thai Baht swap 07:30 – 16:30 BKK time

- Submission window period

- Thai Baht spot 14:30 – 15:25 BKK time

- Thai Baht/USD swap 07:30 – 16:55 BKK time

- Timestamp on FXT program is GMT, Bangkok time is GMT+7

Remarks: Deal or CONTRA deal will be matched for benchmark calculation only when data was sent from 2 counter parties.

## Conversation Convention ของการทำธุรกรรมโดยตรงระหว่างธนาคาร (Interbank Dealing Transaction Conversation Convention)

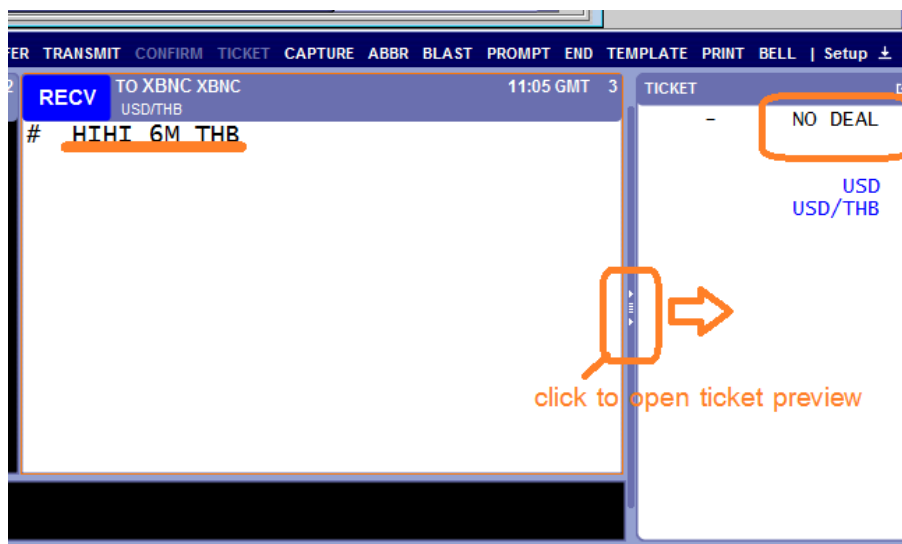
Best solution: Please use ticket editor to manually amend incorrect information before CONFIRM

For FXT system to capture information correctly, please refer to below convention

- Quantity format      Million: MILLION, MIL, MIO, MILL, MLN, MLO, or MM  
Billion: BILLION, BIO, BILL, BLN, YARD, YRD, YDS, or YD
- Swap deal              SW, SWP, SWAP
- Value date              VAL, VL, VD, AM, MAT, V
- Value date format      VAL DDMMYY  
VAL DDMMYYYY  
VAL DDMMYY and DDMMYY (swap)
- Quote price              using space or "/". For example: -0.35 -0.32

Example: FXT might not be able to capture missing information correctly.

(An ideal deal should include Tenor, Currency, Deal type, and amount)



\*However, trader can review ticket editor and manually amend after the end of transaction.



Example: During the conversation, deal is captured wrongly from Swap to Depo

The screenshot shows a trading interface with a conversation window on the left and a ticket summary window on the right. The conversation window has a 'SEND' button and a text area containing the following text:

```

FROM XBMC XBMC
DEPO GIVE 50MIO @-16.9 THB 6M 06FEB2019 06AUG2019
HIHI 6M THB
#
#INTERRUPT#
CAN OFFER AT -16.9 FOR USD 50MIO
OK CONFIRM I B/S USD 50MIO AG THB AT-16.9
RATES R 31.33/31.161
VAL 6FEB TO 6AUG2019
USD TO BANKX ACC NO 9999999
>>
  
```

The ticket summary window on the right shows the following information:

```

TICKET
DEPO - FROZEN
6M LEND
50 MIO THB
-16.9
06FEB2019 06AUG2019
???
&
???
  
```

After conversation is END, trader can open ticket from the blotter and review first.

Trader can manually amend all information.

Deal type, Tenor, Currency, Direction, Rates, and amounts

The screenshot shows a 'Ticket Editor' window with the following details:

- Deal Type:** DEPOSIT
- Tenor:** 6M
- Currency:** THB
- Direction:** LEND
- Rate:** AT -16.9 %
- Amount:** 50,000,000.00
- Start Date:** WED 06FEB2019
- End Date:** 06AUG2019
- FX/Basic Rates:** Bank Base Rates, FX Market Rates, Best Price, Mid Price
- Buttons:** End, Print, Confirm, Cancel Ticket, Wrong

Then information will be correct and can CONFIRM to send for calculation.

### Conversation Convention ของการทำธุรกรรมโดยตรงระหว่างธนาคาร (Interbank Dealing Transaction Conversation Convention) – ข้อควรระวังของการทำธุรกรรม Swap

If SW word isn't included, system couldn't detect as Swap transaction

### Best Solutions (To help system captures information and reduces time to edit the ticket)

1. Type SW, SWP, SWAP while asking for price

Use M for month

Avoid using S for month

Use MIO for unit of amount

Example: Swap USD/THB, 3 month, 50 million USD

<b>RCV</b>	FROM FXBC FXBC	12:30 GMT 4	<b>TICKET</b>
SWAP 50MIO USD/THB 3M 05MAR2019 05JUN...			SWAP - NO DEAL
SW THB 3M 50			3M
			50 MIO USD USD/THB
			05MAR2019 05JUN2019

2. Make a correction by typing word "SWAP DEAL" in the conversation before confirm details of transaction

System will be able to detect transaction as Swap type.

<b>SEND</b>	FROM FXBC FXBC	11:55 GMT 2	<b>TICKET</b>
SWAP B&S 50MIO @+6.60 brkn 03MAR2019			SWAP - INCOMPLETE
3S 50			BROKEN BUY & SELL
# -7.10 / 6.60			50 MIO USD
#			+6.60
MINE			03MAR2019
# SWAP DEAL			???
>>			

3. Type confirm sentence with all necessary information

Direction/ Currency/ Amount and unit/ Swap point

<b>SEND</b>	FROM FXBC FXBC	12:35 GMT 2	<b>TICKET</b>
SWAP B&S 50MIO @+6.60 USD/THB 3M 05MAR2019 05JUN2019			SWAP - EXTRACTED
3S 50			3M BUY & SELL
# -7.10 / 6.60			50 MIO USD
# MINE			+6.60 USD/THB
# OK			31.70 31.766
# TO CFM I B/S USD 50 MIO AG THB AT 6.60			05MAR2019 05JUN2019
# RATES ARE 31.70 AND 31.766			???
# VAL 5MAR2019 AND 5JUN2019			&
>>			???

During the confirmation process, adding near & far leg rates and settlement date, system will also capture information into the ticket correctly

If ticket still couldn't capture data correctly, please review ticket editor and edit information before CONFIRM.

**SEND** FROM FXBC FXBC 12:48 GMT 2 TICKET

THB 3M 40  
 # -7.0 / 6.1  
 MINE  
 # OK  
 # TO CFM WE S/B USD 40 MIO AGA THB AT 6.1  
 >>

TICKET: - NO DEAL

Review and edit ticket by using drop down menu and input numbers and information in the available fields

**Ticket Editor (TXN ID: FXBC119203FXBC1903011248)**

12:48GMT 01MAR2019 FXBC FXBC c11599 <TUAS> NO\_DEAL

Deal: SPOT ??? / ??? <direction> AT <rate>  
 ??? <amount> ??? <amount>  
 <buy date> <sell date> TUAS

<our pay> <our pay code> <their pay> <their pay code>  
 <clearinghouse> <our clearing member> <their clearing member>  
 <reporting party> <comment-1> <comment-2>

+ User Data  
 + FX/Base Rates

Buttons: End, Quit, Print, Confirm, Cancel Ticket, Wrong

Right Panel: Create Ticket (New, Contra), Ticket Chain (Back, Fwd), Tickets (Prev, Next)

การทำธุรกรรมโดยตรงระหว่างธนาคาร โดยระบุจำนวนเงินเป็นสกุลเงินบาท (Specified THB amount)

- Type SW/ Tenor/ amount/ **THB**
- By the following sequences with **THB**, FXT system will detect as THB amount

```
# SW 1M 800MIO THB
# -1.9 -1.5
# I BUY AND SELL
# TO CONFIRM AT -1.9 I BUY AND SELL 800 MIO THB
# RATES ARE 31.33 AND 31.311
# VAL 25FEB2019 AND 26MAR2019
# MY THB TO AA1111
# MY USD TO AA0000
# THANKS AND BYE
```

Bank A asked for Swap 1 month, amount of 800 million THB

Bank B quoted prices as -1.9/ -1.5

Bank A confirmed BUY/SELL swap THB at -1.9 USD/THB

System will detect as BUY/SELL action on THB currency

Ticket will show as:

BUY THB near leg (SELL USD)

SELL THB far leg (BUY USD)

FX Swap point still shows as USD/THB -1.9

Ticket: First row of ticket indicates near leg

Second row is far leg

Deal

SWAP 1M USD / THB BUY+SELL AT 31.33 < -1.9 > 31.311 Swap Points

NEAR THB 800,000,000.00 USD 25,534,631.34 Deliverable

FAR USD 25,550,126.15 THB 800,000,000.00 TUAS

TUE 26FEB2019 TUE 26MAR2019

AA1111 <our pay code - near> <their pay - near> <their pay code - near>

AA0000 <our pay code - far> <their pay - far> <their pay code - far>

Ticket: Left side of ticket indicates BUY

Right side of ticket is SELL

Deal

SWAP 1M USD / THB BUY+SELL AT 31.33 < -1.9 > 31.311 Swap Points

THB 800,000,000.00 USD 25,534,631.34 Deliverable

USD 25,550,126.15 THB 800,000,000.00 TUAS

TUE 26FEB2019 TUE 26MAR2019

AA1111 <our pay code - near> <their pay - near> <their pay code - near>

AA0000 <our pay code - far> <their pay - far> <their pay code - far>

BUY SELL

In this case, ticket shows BUY 800,000,000 THB (near leg) and SELL 800,000,000 THB at -1.9 points (far leg)

Deal

SWAP 1M USD / THB BUY+SELL AT 31.33 < -1.9 > 31.311 Swap Points

THB 800,000,000.00 USD 25,534,631.34 Deliverable

USD 25,550,126.15 THB 800,000,000.00 SELL THB FAR

TUE 26FEB2019 TUE 26MAR2019

AA1111 <our pay code - near> <their pay - near> <their pay code - near>

AA0000 <our pay code - far> <their pay - far> <their pay code - far>

BUY THB NEAR

Trader reviews ticket and CONFIRM.

Caution: To be more precise, trader could specify FX swap points as USD/THB quotation in the confirmation sentence

```
# SW 1M 800MIO THB
# -1.9 -1.5
# I BUY AND SELL
# TO CONFIRM AT -1.9 USD/THB I BUY AND SELL 800 MIO THB
# RATES ARE 31.33 AND 31.311
# VAL 25FEB2019 AND 26MAR2019
# MY THB TO AA1111
# MY USD TO AA0000
# THANKS AND BYE
```

**Contacts (Training)**

Mongkol Poonlapmongkol (02) 648-9623 Mongkol.Poonlapmongkol@refinitiv.com

Pongsakorn (02) 648-8718 Pongsakorn.Lertkiatmongkol@refinitiv.com

Lertkiatmongkol

Prapaploy Tannithat (02) 648-9383 Prapaploy.Tannithat@refinitiv.com

**Contacts (Technical)**

Nopporn Maneewong (02) 648-9639 Nopporn.Maneewong@refinitiv.com

**Contacts (Bank of Thailand)**

ทีมมาตรฐานตลาดการเงิน (02) 283-6321 [FMD-standards@bot.or.th](mailto:FMD-standards@bot.or.th)

คำถาม - คำตอบเกี่ยวกับแนวปฏิบัติธนาคารแห่งประเทศไทย  
เรื่อง มาตรฐานการปฏิบัติงานสำหรับ Contributing Bank และ FX Broker  
ที่นำส่งข้อมูลเพื่อการจัดทำอัตราอ้างอิง Thai Baht Interest Rate Fixing (THBFIX)

ประเด็นคำถาม	สรุปคำตอบ
<b>1. ขอบเขตของการบังคับใช้</b>	
1.1 จะมีการปรับเปลี่ยนจำนวน Contributing Bank หรือ FX Broker ในอนาคตหรือไม่	<ul style="list-style-type: none"> <li>- กรณี Contributing Bank: ธปท. ในฐานะ Administrator จะทบทวนรายชื่อสถาบันการเงินที่เป็น Contributing Bank เป็นประจำทุกปีหรือตามความถี่ที่เหมาะสม โดยจะพิจารณาจากปริมาณการทำธุรกรรม FX swap ในตลาด Interbank ของแต่ละ สง. เพื่อให้ครอบคลุมปริมาณธุรกรรมที่มากเพียงพอที่จะสะท้อนภาวะตลาดที่แท้จริงได้</li> <li>- กรณี FX Broker: FX Broker ทุกรายที่ได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจตามประกาศกระทรวงการคลัง มีหน้าที่นำส่งข้อมูลเพื่อการจัดทำอัตราอ้างอิง THBFIX ดังนั้นหากมี FX Broker รายใหม่ในอนาคต FX Broker รายดังกล่าวจะต้องนำส่งข้อมูลเพื่อการจัดทำอัตราอ้างอิง THBFIX ด้วย</li> </ul>
<b>2. คำจำกัดความ</b>	
2.1 เจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission หมายถึงใครบ้าง	<ul style="list-style-type: none"> <li>- กรณี Contributing Bank: Trader ที่ทำธุรกรรมที่เป็น Submission และ/หรือนำส่ง Submission ให้แก่ Calculation Agent และเจ้าหน้าที่อื่นที่นำส่ง Submission ให้แก่ Calculation Agent</li> <li>- กรณี FX Broker: เจ้าหน้าที่ที่ให้บริการจับคู่ธุรกรรมที่เป็น Submission และ/หรือนำส่ง Submission ให้แก่ Calculation Agent และเจ้าหน้าที่อื่นที่นำส่ง Submission ให้แก่ Calculation Agent</li> </ul> <p>ทั้งนี้ กรณีเจ้าหน้าที่อื่นเป็นผู้นำส่ง Submission Contributing Bank และ FX Broker ต้องมั่นใจว่าเจ้าหน้าที่ดังกล่าวมีความรู้ความสามารถและมีประสบการณ์ที่เหมาะสมตามที่ระบุไว้ในข้อ 5 (3) นอกจากนี้ เจ้าหน้าที่ดังกล่าวต้องรับผิดชอบความถูกต้อง ความครบถ้วน และคุณสมบัติของ Submission ที่นำส่งให้แก่ Calculation Agent ร่วมกับ Trader ที่ทำธุรกรรมหรือเจ้าหน้าที่ที่ให้บริการจับคู่ธุรกรรมด้วย</p>



ประเด็นคำถาม	สรุปคำตอบ
2.2 Trader สามารถนำส่ง Submission ได้หรือไม่	ได้  ทั้งนี้ เจ้าหน้าที่อื่นสามารถนำส่ง Submission ได้เช่นกัน แต่ต้องมีความรู้ความสามารถและมีประสบการณ์ที่เหมาะสมตามที่ระบุไว้ในข้อ 5 (3) นอกจากนี้ ยังต้องรับผิดชอบความถูกต้อง ความครบถ้วน และคุณสมบัติของ Submission ที่นำส่งให้แก่ Calculation Agent ร่วมกับ Trader ที่ทำธุรกรรมหรือเจ้าหน้าที่ที่ให้บริการจับคู่ธุรกรรมด้วย
2.3 Supervisor ควรเป็นเจ้าหน้าที่ระดับใด และสามารถอยู่ภายใต้หน่วยงานที่รับผิดชอบกระบวนการ Submission ได้หรือไม่	<ul style="list-style-type: none"> <li>- หาก Supervisor อยู่ภายใต้หน่วยงานที่มีความเป็นอิสระจากหน่วยงานที่รับผิดชอบกระบวนการ Submission สามารถเป็นเจ้าหน้าที่ระดับใดก็ได้</li> <li>- หาก Supervisor อยู่ภายใต้หน่วยงานที่รับผิดชอบกระบวนการ Submission ต้องเป็นเจ้าหน้าที่อาวุโส เช่น หัวหน้า Trader เพื่อให้สามารถดูแลการปฏิบัติงานของเจ้าหน้าที่ที่มีหน้าที่นำส่ง Submission ได้</li> </ul>
2.4 ผู้มีอำนาจควรเป็นผู้บริหารระดับใด	ขึ้นกับดุลยพินิจของ Contributing Bank และ FX Broker แต่ละราย
2.5 Supervisor และผู้มีอำนาจสามารถเป็นบุคคลเดียวกันได้หรือไม่	Supervisor และผู้มีอำนาจสามารถเป็นบุคคลเดียวกันได้
2.6 หน่วยงานใดควรทำหน้าที่เป็น Control Function	<p>ขึ้นอยู่กับโครงสร้างของ Contributing Bank และ FX Broker แต่ละราย ตัวอย่างหน่วยงานที่สามารถทำหน้าที่เป็น Control Function ได้แก่ Compliance และ Risk management</p> <p>ทั้งนี้ นอกจาก Control Function แล้ว หน่วยงานที่สามารถทำหน้าที่ตรวจสอบตามที่ระบุไว้ในข้อ 8 ยังรวมถึงผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอกด้วย</p>
<b>3. การนำส่ง Submission</b>	
3.1 ตัวอย่างการดำเนินการเพื่อให้มั่นใจได้ว่า Submission ที่นำส่งให้ Calculation Agent มีความถูกต้อง ครบถ้วน และมีคุณสมบัติตรงตามที่กำหนดใน THBFIX Methodology	เช่น การดูแลให้เจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission เข้าใจ THBFIX Methodology และคู่มือการนำส่ง Submission ผ่านระบบ FXT รวมทั้งปฏิบัติหน้าที่ด้วยความรอบคอบ ตรวจสอบข้อมูลก่อนนำส่งทุกครั้ง

ประเด็นคำถาม	สรุปคำตอบ
<p>3.2 ในกรณีที่ Contributing Bank ใช้ระบบ Straight Through Processing (STP) เพื่อจัดเก็บข้อมูลธุรกรรมเข้าระบบงานภายใน หาก Contributing Bank ทำธุรกรรมหลังช่วง Qualifying Window แต่ยังคงอยู่ในช่วง Submission Window (เช่น ทำธุรกรรม USDT HB FX swap เวลา 16.40 น.) ข้อมูลธุรกรรมดังกล่าวจะไหลเข้าระบบคำนวณอัตราอ้างอิง THBFX ด้วย เหตุการณ์นี้ถือว่า Contributing Bank ไม่ปฏิบัติตามแนวปฏิบัติหรือไม่</p>	<p>ตามแนวปฏิบัตินี้ Contributing Bank และ FX Broker ต้องนำส่ง Submission ที่มีคุณสมบัติตรงตามที่กำหนดใน THBFX Methodology ซึ่งรวมถึงต้องเป็นธุรกรรมที่เกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window ด้วย</p> <p>อย่างไรก็ตาม จากการหารือร่วมกันระหว่าง ธปท. กับผู้ร่วมตลาดเห็นว่า เหตุการณ์ดังกล่าว <u>ไม่ถือว่าเป็นการฝ่าฝืน</u> แนวปฏิบัตินี้ เนื่องจากเป็นข้อจำกัดที่เกิดจากระบบ</p>
<p>3.3 ในกรณีที่ Contributing Bank ทำธุรกรรมนอกช่วง Qualifying Window แต่ยืนยันข้อมูลเข้าระบบ FXT ในช่วง Submission Window เช่น ทำธุรกรรม USDT HB FX swap เวลา 07.20 น. แต่ยืนยันเข้าระบบ FXT เวลา 07.35 น. หรือทำธุรกรรม USDT HB FX swap เวลา 16.40 น. แต่ยืนยันเข้าระบบ FXT เวลา 16.45 น. เหตุการณ์นี้ถือว่า Contributing Bank ไม่ปฏิบัติตามแนวปฏิบัติหรือไม่</p>	<p>ธปท. ในฐานะ Administrator ไม่สนับสนุนการนำส่งข้อมูลธุรกรรมในลักษณะดังกล่าว เนื่องจากตามแนวปฏิบัตินี้ Contributing Bank และ FX Broker ต้องนำส่ง Submission ที่มีคุณสมบัติตรงตามที่กำหนดใน THBFX Methodology ซึ่งควรเป็นธุรกรรมที่เกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window เท่านั้น</p> <p>อย่างไรก็ตาม จากการหารือกับผู้ร่วมตลาด ธปท. ตระหนักว่า เหตุการณ์ดังกล่าวอาจเกิดขึ้นได้ อีกทั้งการตรวจสอบข้อมูลอาจมีความยุ่งยาก เพราะไม่มีการบันทึกเวลาทำธุรกรรมในระบบ FXT ดังนั้น หากเหตุการณ์ดังกล่าวเกิดขึ้น ธปท. จะไม่ถือว่า Contributing Bank ฝ่าฝืนแนวปฏิบัตินี้ อย่างไรก็ดี ธปท. ขอให้ Supervisor ของ Contributing Bank และ FX Broker สอดส่องดูแลการนำส่งธุรกรรมในลักษณะดังกล่าวว่า ไม่ได้มีเจตนาที่จะบิดเบือน แต่เป็นไปโดยความสุจริต</p>
<p>3.4 Contributing Bank และ FX Broker ต้องนำส่งข้อมูลธุรกรรม USDT HB FX spot ที่ทำโดยมีวัตถุประสงค์เพื่อโอนเงิน USDT HB ต่างธนาคาร หรือไม่</p>	<p><u>ไม่ต้อง</u> นำส่งข้อมูลธุรกรรมดังกล่าว</p> <p>ทั้งนี้ ธปท. ไม่สนับสนุนการทำธุรกรรมในลักษณะดังกล่าว</p>
<p>3.5 Contributing Bank และ FX Broker ต้องนำส่งข้อมูลธุรกรรม USDT HB FX swap ระยะ O/N ที่ทำเพื่อบริหารสภาพคล่องจากการทำธุรกรรม USDT HB FX spot ที่ส่งมอบภายในวันเดียวกัน (Same day) กับลูกค้าหรือไม่</p>	<p><u>ต้อง</u> นำส่งข้อมูลธุรกรรมดังกล่าว</p>

ประเด็นคำถาม	สรุปคำตอบ
<p>3.6 แนวทางการนำส่งข้อมูลธุรกรรม USDTHB FX spot และ USDTHB FX swap ที่มีการเปลี่ยนคู่ค้า (Switching) เนื่องจากติด Credit line</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>- กรณีธุรกรรมที่ต้องการทำจริงและธุรกรรม Switching เกิดขึ้นนอกช่วง Qualifying Window: ไม่ต้องนำส่งข้อมูล ทั้ง 2 ธุรกรรม</li> <li>- กรณีธุรกรรมที่ต้องการทำจริงและธุรกรรม Switching เกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window: ต้องนำส่งข้อมูลทั้ง 2 ธุรกรรม</li> <li>- กรณีธุรกรรมที่ต้องการทำจริงเกิดขึ้นในช่วง Qualifying Window แต่ธุรกรรม Switching เกิดขึ้นนอกช่วง Qualifying Window: ไม่ต้องนำส่งข้อมูลทั้ง 2 ธุรกรรม</li> </ul>
<p>3.7 ในกรณีที่ Contributing Bank ทำธุรกรรม USDTHB FX spot และ USDTHB FX swap ที่เข้าข่ายเป็น Qualified Transaction ตามที่ระบุใน THBFX Methodology แต่มีราคาเป็น Off-market rate ธุรกรรมดังกล่าวถือเป็น Qualified Transaction ที่ต้องนำส่งข้อมูลด้วยหรือไม่</p>	<p>เนื่องจาก Qualified Transaction จะพิจารณาจากปริมาณธุรกรรม ประเภทคู่ค้าช่วงเวลาในการทำธุรกรรม และ Tenor เท่านั้น ดังนั้น แม้เป็น off-market rate แต่หากเข้าข่าย Qualified Transaction ก็ต้องนำส่งด้วย อย่างไรก็ตาม ในการคำนวณ ธปท. ได้กำหนดเกณฑ์เพื่อตัดธุรกรรมที่มีปริมาณสูงผิดปกติ หรือ rate สูงหรือต่ำผิดปกติออก (Outlier) แล้ว จึงน่าจะเป็นการป้องกันปัญหาได้ในระดับหนึ่ง</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- อนึ่ง สง. ควรหลีกเลี่ยงการทำธุรกรรมที่ใช้ราคา Off-market rate ยกเว้นมีเหตุผลที่ดีพอ เนื่องจากอาจขัดกับ Best practice และ Thailand Code of Conduct นอกจากนี้ หากมีการนำส่งธุรกรรมดังกล่าวเข้าระบบ FXT บ่อยครั้ง ธปท. ในฐานะ Administrator อาจดำเนินการตรวจสอบ</li> </ul>
<p>3.8 ในกรณีที่พบความผิดพลาดของ Submission Contributing Bank และ FX Broker สามารถยกเลิกหรือแก้ไข Submission เฉพาะในส่วนของตนเองใช่หรือไม่</p>	<p>Contributing Bank และ FX Broker ต้องยกเลิกหรือแก้ไขในส่วนข้อมูลของตนเอง และแจ้งทุกฝ่ายที่เกี่ยวข้องกับ Submission ที่ผิดพลาด ให้ดำเนินการยกเลิกหรือแก้ไข Submission ดังกล่าวด้วย และควรดำเนินการให้เสร็จสิ้นภายในช่วง Submission Window</p>
<p>3.9 FX Broker มีหน้าที่แจ้ง Contributing Bank ให้ยกเลิกหรือแก้ไข Submission ที่ผิดพลาดใช่หรือไม่</p>	<p>ทั้ง FX Broker และ Contributing Bank มีหน้าที่แจ้งทุกฝ่ายที่เกี่ยวข้องกับ Submission ที่ผิดพลาดให้ดำเนินการยกเลิกหรือแก้ไข Submission ดังกล่าว</p>
<p>3.10 ในกรณีที่พบความผิดพลาดของ Submission หลังช่วง Qualifying Window แต่ยังอยู่ในช่วง Submission Window Contributing Bank และ FX Broker ต้องดำเนินการยกเลิกหรือแก้ไข Submission ที่ผิดพลาดหรือไม่</p>	<p>ต้องดำเนินการยกเลิกหรือแก้ไข เพื่อไม่ให้ข้อมูล Submission ที่ผิดพลาดถูกรวมเข้าไปในการคำนวณอัตราอ้างอิง THBFX</p>

ประเด็นคำถาม	สรุปคำตอบ
3.11 ดำเนินการยกเลิกหรือแก้ไข Submission โดยเร็ว หมายความว่าอย่างไร	ดำเนินการยกเลิกหรือแก้ไขทันทีหรืออยู่ในวิสัยที่เป็นไปได้ หลังพบความผิดพลาดของ Submission
3.12 Administrator จะดำเนินการอย่างไร กับ Contributing Bank หรือ FX Broker ที่นำส่ง Submission ไม่ครบถ้วนหรือล่าช้า หรือนำส่ง Submission ที่ไม่ถูกต้อง	ธปท. ในฐานะ Administrator จะพิจารณาถึงสาเหตุและดำเนินการตามความเหมาะสมเพื่อให้ Contributing Bank หรือ FX Broker รายดังกล่าวสามารถนำส่ง Submission ได้ถูกต้อง ครบถ้วน และไม่ล่าช้า ซึ่งรวมถึงการส่งหนังสือแจ้งผู้มีอำนาจหรือผู้บริหารระดับสูงของ Contributing Bank หรือ FX Broker เพื่อตักเตือนกดดันให้ปฏิบัติตามแนวปฏิบัตินี้และคู่มือการนำส่ง Submission ผ่านระบบ FXT ทั้งนี้ หากพบหลักฐานที่สื่อเจตนาว่าต้องการบิดเบือนอัตราอ้างอิง THBFX ธปท. จะพิจารณาใช้มาตรการที่รุนแรงขึ้น
3.13 Administrator จะดำเนินการอย่างไร กับ Contributing Bank หรือ FX Broker กรณีที่ความผิดพลาดของการนำส่ง Submission เกิดจาก Human error	ธปท. ในฐานะ Administrator ตระหนักว่าความผิดพลาดที่เกิดจาก Human error สามารถเกิดขึ้นได้และไม่ได้ถือเป็นความผิดเฉพาะบุคคล อย่างไรก็ตาม หากเกิดความผิดพลาดในลักษณะเดิมซ้ำหลายครั้งก็จะสะท้อนว่า Contributing Bank หรือ FX Broker รายดังกล่าวควบคุมกระบวนการนำส่ง Submission และนโยบายการกำกับดูแล (Governance policy) ไม่รัดกุมเพียงพอ ดังนั้น ธปท. จะแจ้งให้ดำเนินการปรับปรุง
3.14 ตัวอย่างแผนรองรับกรณีเกิดเหตุขัดข้อง	เช่น การมี Internet line backup หรือ Server สำรอง หรือการให้ Thomson Reuters เข้าไปติดตั้งโปรแกรมสำรองเพื่อรองรับกรณีที่โปรแกรมหลักขัดข้อง หรือมีแผนสำรองอื่น ๆ เพื่อให้สามารถนำส่ง Submission ให้แก่ Calculation Agent ได้ นอกจากนี้ ควรจัดให้มี Backup site เพื่อรองรับกรณีเกิดเหตุฉุกเฉินด้วย ซึ่งสอดคล้องกับแผนรองรับความเสี่ยงจากการดำเนินธุรกิจ (Business Continuity Plan)
3.15 Administrator จะดำเนินการอย่างไร เมื่อได้รับแจ้งเหตุขัดข้องจาก Contributing Bank และ FX Broker	Administrator จะแจ้งให้ Calculation Agent ทราบเพื่อพิจารณาหาวิธีดำเนินการแก้ไข และจะเก็บข้อมูลดังกล่าวไว้สำหรับประเมินผลกระทบที่มีต่อการเผยแพร่อัตราอ้างอิง THBFX ในวันดังกล่าวและติดตามพฤติกรรมของ Contributing Bank และ FX Broker หากพบว่ารายใดเกิดเหตุขัดข้องบ่อยครั้ง ก็จะแจ้งให้ดำเนินการปรับปรุง
3.16 กรณีระบบ FXT หรือระบบภายในของ Contributing Bank หรือ FX Broker ขัดข้อง Contributing Bank และ FX Broker ต้องนำส่ง Submission ที่เกิดขึ้นในช่วงที่ระบบ FXT ขัดข้องหรือไม่	หากระบบ FXT กลับมาใช้งานได้ภายในช่วง Submission Window ต้องนำส่ง Submission ที่เกิดขึ้นในช่วงที่ระบบ FXT ขัดข้อง

ประเด็นคำถาม	สรุปคำตอบ
<b>4. นโยบายการกำกับดูแล (Governance policy)</b>	
4.1 ใครมีหน้าที่แต่งตั้งผู้มีอำนาจและ Supervisor และแต่งตั้งและกำหนดหน้าที่ของเจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission	ขึ้นกับดุลยพินิจของ Contributing Bank และ FX Broker แต่ละราย
4.2 ตัวอย่างการสื่อสารให้เจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission และ Supervisor รับทราบกระบวนการปฏิบัติงานภายในที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission	เช่น การส่ง email หรือการส่งเอกสารเวียนให้ศึกษา พร้อมกับให้ลงชื่อรับทราบ หรือการจัดอบรมหรือการส่งเจ้าหน้าที่เข้ารับการอบรมจากหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง
4.3 ใครมีหน้าที่ดำเนินการเพื่อให้มั่นใจได้ว่าเจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission และ Supervisor มีความเข้าใจในเรื่องที่ระบุไว้ในข้อ 5 (5)	ขึ้นกับดุลยพินิจของ Contributing Bank และ FX Broker แต่ละราย
4.4 ตัวอย่างการดำเนินการเพื่อให้มั่นใจได้ว่าเจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission และ Supervisor มีความเข้าใจในเรื่องที่ระบุไว้ในข้อ 5 (5)	เช่น การส่ง email หรือการส่งเอกสารเวียนให้ศึกษา พร้อมกับให้ลงชื่อรับรองว่าเข้าใจ หรือการจัดอบรมหรือการส่งเจ้าหน้าที่เข้ารับการอบรมจากหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง
4.5 ต้องจัดส่งรายชื่อผู้มีอำนาจ Supervisor และเจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ให้แก่ Administrator หรือไม่	ไม่จำเป็นต้องส่งรายชื่อให้ Administrator แต่เมื่อ Administrator ร้องขอต้องสามารถนำส่งให้ได้ภายใน 15 วันทำการนับตั้งแต่วันที่มีการร้องขอ นอกจากนี้ ยังควรให้มีพร้อมใช้งานเมื่อมีการตรวจสอบจาก Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก
4.6 การสุ่มตรวจสอบการปฏิบัติงานของเจ้าหน้าที่ที่มีหน้าที่นำส่ง Submission โดย Supervisor ตามที่ระบุไว้ในข้อ 5 (6) หมายความว่าอย่างไร	Supervisor ควรสุ่มตรวจสอบการนำส่งข้อมูลธุรกรรมให้แก่ Calculation Agent ของเจ้าหน้าที่ที่มีหน้าที่นำส่ง Submission ว่าได้ปฏิบัติตาม THBFIX Methodology และคู่มือการนำส่ง Submission ผ่านระบบ FXT หรือไม่ เช่น ยืนยันธุรกรรมหรือนำส่งข้อมูลได้ภายในเวลาที่กำหนด มีการแก้ไขเมื่อตรวจพบความผิดพลาด เป็นต้น ซึ่ง Supervisor สามารถใช้ดุลยพินิจในการเลือกจำนวนธุรกรรมหรือความถี่ในการสุ่มตรวจสอบได้ตามความเหมาะสม ทั้งนี้ การตรวจสอบข้างต้นไม่ได้มุ่งเน้นรายละเอียดของธุรกรรม (เช่น ปริมาณ หรือราคา) เพราะเป็นข้อมูลธุรกรรมที่เกิดขึ้นจริงแล้ว

ประเด็นคำถาม	สรุปคำตอบ
<b>5. การจัดการกับความขัดแย้งทางผลประโยชน์ (Conflict of interest)</b>	
5.1 Contributing Bank และ FX Broker สามารถใช้แนวทางการจัดการ Conflict of Interest ที่มีอยู่แล้วได้หรือไม่	หากแนวทางการจัดการ Conflict of Interest ที่มีอยู่แล้ว ครอบคลุมการดำเนินการที่กำหนดไว้ในแนวปฏิบัตินี้ก็สามารถใช้ได้ แต่ควรแยกให้ชัดเจนว่ารายละเอียดในส่วนใดบ้างที่เกี่ยวข้องกับเรื่องของอัตราอ้างอิง THBFX เพื่อความสะดวกในการใช้อ้างอิงของผู้เกี่ยวข้อง
5.2 Contributing Bank หรือ FX Broker แต่ละรายสามารถมีบทลงโทษภายในที่หนักเบาแตกต่างกันได้หรือไม่	บทลงโทษขึ้นกับระเบียบวินัยของ Contributing Bank หรือ FX Broker แต่ละราย ดังนั้นบทลงโทษจึงมีความหนักเบาแตกต่างกันได้ขึ้นกับดุลยพินิจ
<b>6. การจัดเก็บหรือเข้าถึงข้อมูล</b>	
6.1 Contributing Bank และ FX Broker จำเป็นต้องจัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ในรูปแบบกระดาษหรือไม่ และจำเป็นต้องอยู่ในรูปแบบเดียวกับ Ticket จากระบบ FXT หรือไม่	Contributing Bank และ FX Broker สามารถจัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ในรูปแบบใดก็ได้ แต่ต้องพร้อมใช้งานเมื่อมีการตรวจสอบจาก Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก และต้องสามารถนำส่งให้แก่ Administrator ภายใน 15 วันทำการ นับตั้งแต่วันที่มีการร้องขอ
6.2 หากปัจจุบัน Contributing Bank หรือ FX Broker จัดเก็บข้อมูลธุรกรรมอยู่แล้ว ถือเป็นการปฏิบัติตามแนวปฏิบัตินี้หรือไม่	หากข้อมูลธุรกรรมที่จัดเก็บเป็น Submission อยู่แล้ว และข้อมูลอยู่ในลักษณะพร้อมใช้งานเมื่อมีการตรวจสอบจาก Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก และสามารถนำส่งให้แก่ Administrator ภายใน 15 วันทำการ นับตั้งแต่วันที่มีการร้องขอ รวมทั้งมีการจัดเก็บข้อมูลตามกรอบระยะเวลาที่กำหนดไว้ในแนวปฏิบัตินี้ ก็ถือว่าเป็นการปฏิบัติตามแนวปฏิบัตินี้แล้ว
6.3 ใครมีหน้าที่ตรวจสอบการจัดเก็บข้อมูล	Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก เนื่องจาก Contributing Bank และ FX Broker ต้องจัดให้มีการตรวจสอบโดย Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก เพื่อให้มั่นใจได้ว่ากระบวนการ Submission และกระบวนการปฏิบัติงานภายในอื่น ๆ มีความเหมาะสมและสอดคล้องกับแนวปฏิบัตินี้ ซึ่งกระบวนการปฏิบัติงานภายในอื่น ๆ ครอบคลุมถึงการจัดเก็บข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับกระบวนการ Submission ด้วย
<b>7. การตรวจสอบโดย Control Function หรือผู้ตรวจสอบภายใน หรือผู้ตรวจสอบภายนอก</b>	
7.1 ความถี่ที่เหมาะสมในการตรวจสอบควรอยู่ที่เท่าใด	ความถี่ที่เหมาะสมขึ้นกับดุลยพินิจของ Contributing Bank และ FX Broker แต่ละราย อย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง โดยอาจพิจารณาจากปริมาณการทำธุรกรรมที่เป็น Submission ประกอบด้วย

ประเด็นคำถาม	สรุปคำตอบ
<b>8. วันที่เริ่มต้นบังคับใช้</b>	
8.1 Contributing Bank และ FX Broker ต้องดำเนินการตามที่กำหนดในแนวปฏิบัตินี้ให้แล้วเสร็จภายในวันที่ 2 พฤษภาคม 2562 ใช่หรือไม่	ใช่ อย่างไรก็ตาม หาก Contributing Bank และ FX Broker ไม่สามารถดำเนินการได้ ให้แจ้ง Administrator ทราบอย่างน้อย 10 วัน ก่อนวันที่ 2 พฤษภาคม 2562 เพื่อขอผ่อนผันและหาแนวทางปฏิบัติที่เหมาะสมต่อไป
<b>9. อื่น ๆ</b>	
9.1 ทำไมต้องมีแนวปฏิบัตินี้ ทั้งๆ ที่อัตราอ้างอิง THBFIX รูปแบบใหม่คำนวณจากธุรกรรมที่เกิดขึ้นจริงอยู่แล้ว	แม้อัตราอ้างอิง THBFIX รูปแบบใหม่จะคำนวณจากธุรกรรมที่เกิดขึ้นจริง แต่ก็มีโอกาสที่จะเกิดความผิดพลาดจากความไม่เข้าใจ (Lack of knowledge) ถึงขั้นตอนการนำส่งข้อมูลให้แก่ Calculation Agent นอกจากนี้ ยังมีความเสี่ยงที่จะเกิดการบิดเบือนอัตราอ้างอิง เช่น การทำ Wash Trading หรือการทำธุรกรรมในช่วง Qualifying Window โดยมีเจตนาจะยกเลิกภายหลัง ดังนั้น จึงจำเป็นต้องจัดทำแนวปฏิบัตินี้ เพื่อให้ Contributing Bank และ FX Broker ใช้เป็นแนวทางในการปฏิบัติงาน เพื่อให้กระบวนการจัดทำอัตราอ้างอิง THBFIX เป็นไปอย่างเหมาะสม และรัดกุม ซึ่งจะช่วยลดความเสี่ยงข้างต้นได้
9.2 ธปท. มีมาตรการรองรับอย่างไรในกรณีที่อัตราอ้างอิง THBFIX โดยเฉพาะ Tenor 6 เดือน เผยแพร่เป็น “No Fix” ติดต่อกันหลายวัน	จากการหารือกับผู้ร่วมตลาด ธปท. และผู้ร่วมตลาด เห็นร่วมกันว่ายังไม่มีความจำเป็นที่จะต้องมีการรองรับในกรณีที่เกิดเหตุการณ์ดังกล่าว อย่างไรก็ตาม ธปท. อาจพิจารณาทบทวนในอนาคต โดยจะขอความเห็นจากผู้ร่วมตลาดต่อไป
9.3 จะมีการแก้ไขอัตราอ้างอิง THBFIX หลังการเผยแพร่หรือไม่ และสามารถเกิดเหตุการณ์ที่อัตราอ้างอิง THBFIX เผยแพร่ล่าช้ากว่ากำหนดหรือไม่	<ul style="list-style-type: none"> <li>- การแก้ไขอัตราอ้างอิง THBFIX หลังการเผยแพร่จะเกิดขึ้นได้เพียง 2 กรณีเท่านั้น คือ <ol style="list-style-type: none"> <li>1. กรณีที่เกิดความผิดพลาดจาก Thomson Reuters โดยจะมีการแก้ไขภายใน 30 นาทีหลังจากเผยแพร่</li> <li>2. กรณีที่เกิดความผิดพลาดจากการเผยแพร่ USD Rate จะมีการแก้ไขภายในเวลา 22.00 น. หรือ 23.00 น. ตามเวลาประเทศไทย (ขึ้นกับเวลาการแก้ไข USD Rate)</li> </ol> </li> <li>- การเผยแพร่อัตราอ้างอิง THBFIX อาจล่าช้าได้ หากการเผยแพร่ USD Rate เกิดความล่าช้า</li> </ul>



ประเด็นคำถาม	สรุปคำตอบ
9.4 ทำไมอัตราอ้างอิง THBFX รูปแบบ Survey-based และรูปแบบ Transactions-based จึงแตกต่างกันค่อนข้างมาก	ความแตกต่างเกิดขึ้นจากหลายสาเหตุ เช่น จำนวนผู้นำส่ง Submission ซึ่งรูปแบบ Transactions-based มีมากกว่ารูปแบบ Survey-based หลายเท่า และจำนวนข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณรูปแบบ Transactions-based ครอบคลุมจำนวนธุรกรรม USDTHB FX swap เกือบทั้งวัน ขณะที่รูปแบบ Survey-based ครอบคลุมเฉพาะช่วงเวลาสั้น ๆ ที่ใกล้เวลา Fixing เท่านั้น
9.5 กรณีที่ ธปท. ประกาศวันหยุดพิเศษ จะมีการเผยแพร่อัตราอ้างอิง THBFX หรือไม่	ไม่มี
9.6 ในอนาคต ธปท. จะเปลี่ยนแปลง Methodology ของอัตราอ้างอิง THBFX หรือไม่	หากมีการเปลี่ยนแปลงสาระสำคัญของ Methodology เช่น USD Rate ที่ใช้ในการคำนวณ ธปท. จะหารือกับผู้ร่วมตลาดและแจ้งการเปลี่ยนแปลงวิธีการคำนวณให้ผู้ร่วมตลาดทราบต่อไป
9.7 ในฐานะที่ ธปท. ทำหน้าที่เป็นทั้ง Administrator และ Contributing Bank ธปท. มีแนวทางการดำเนินการอย่างไร เพื่อป้องกันไม่ให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ (Conflict of Interest)	ธปท. แยกหน้าที่ระหว่าง Administrator และ Contributing Bank อย่างชัดเจน โดยสำนักวิเคราะห์และพัฒนาตลาดการเงิน จะทำหน้าที่เป็น Administrator ส่วนสำนักธุรกิจตลาดการเงิน จะทำหน้าที่เป็น Contributing Bank นอกจากนี้ ธปท. ได้กำหนดเป็นเกณฑ์ภายในให้เจ้าหน้าที่ในสำนักธุรกิจตลาดการเงิน ต้องปฏิบัติตามแนวปฏิบัตินี้อย่างเคร่งครัดด้วย
9.8 หากต้องการสอบถามเกี่ยวกับอัตราอ้างอิง THBFX หรือแจ้งเรื่องต่าง ๆ ตามที่กำหนดในแนวปฏิบัตินี้ให้ Administrator ทราบ ต้องติดต่อผ่านช่องทางใด	ส่ง email มายัง <a href="mailto:FMD-standards@bot.or.th">FMD-standards@bot.or.th</a>