



ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

การรายงานข้อมูลสำหรับบริษัทหลักทรัพย์

งานวิเคราะห์และติดตาม ฝกง.

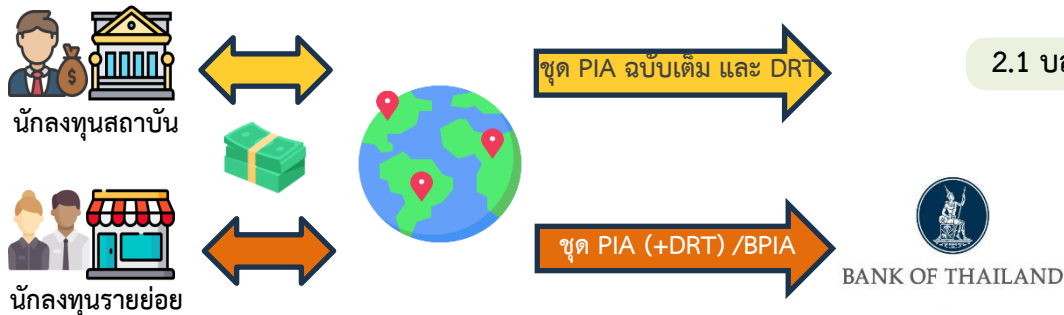


ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

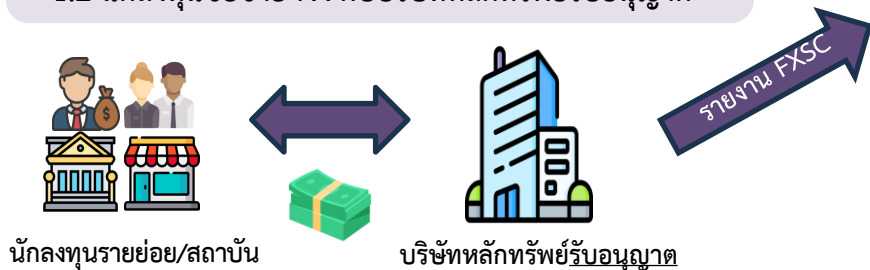
ประเภทธุรกรรมของบริษัทหลักทรัพย์ที่ต้องรายงานข้อมูลมายัง ธปท.

1. กฎหมายควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน

1.1 นักลงทุนซื้อขายหลักทรัพย์และอนุพันธ์ต่างประเทศผ่านบริษัทหลักทรัพย์



1.2 นักลงทุนซื้อขาย FX กับบริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาต^{1/}



2. มาตรการป้องปรามการเก็งกำไรค่าเงินบาท

2.1 บล. กู้ยืมหรือเสมือนกู้ยืมเงินบาทจาก Non-resident (NR)



2.2 ทรัพย์สินประเภทเงินบาทของ NR ที่อยู่กับ บล.

^{1/} บริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาต คือ บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับอนุญาตจาก ธปท. ให้ประกอบธุรกิจซื้อ ขาย หรือแลกเปลี่ยน FX ที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนในหลักทรัพย์



ประเภทของรายงานที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมตามกฎหมายควบคุมฯ

Portfolio Investment Aboard (PIA)

รายงานที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนในหลักทรัพย์
ในต่างประเทศของผู้ลงทุน/ลูกค้า

ตัวอย่าง มุมของข้อมูลที่รายงาน

- รายละเอียดของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน เช่น
 - ชื่อหลักทรัพย์
 - ประเภทของหลักทรัพย์ เช่น หุ้น กองทุน ตราสารหนี้ FCD
- ยอดคงค้างที่ไปลงทุน เช่น
 - Cost value
 - Market value

Derivative (DRT)

รายงานที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนในอนุพันธ์
ต่างประเทศของผู้ลงทุน/ลูกค้า

ตัวอย่าง มุมของข้อมูลที่รายงาน

- รายละเอียดของอนุพันธ์ที่ไปลงทุน เช่น
 - ประเภทของอนุพันธ์ เช่น Option และ Future
 - Position (i.e. Short, Long)
- ยอดคงค้างที่ไปลงทุน เช่น
 - Cost value
 - Market value

บริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาต (FXSC)

รายงานที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายเงินตรา
ต่างประเทศของบริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาต

ตัวอย่าง มุมของข้อมูลที่รายงาน

- รายละเอียดของธุรกรรมซื้อขาย เช่น
 - เลขที่สัญญา
 - วันที่ทำธุรกรรม
 - สกุลเงินในธุรกรรม
- ยอดการทำธุรกรรม



นักลงทุนสถาบัน

มีทั้งหมด **10 ประเภท** ได้แก่

1. กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ
2. สำนักงานประกันสังคม
3. บริษัทประกัน
4. สถาบันการเงินเฉพาะ
5. นิติบุคคลที่มีงบดุลเกิน 5 พันล้านบาท
6. บริษัทในตลาดหลักทรัพย์
7. กองทุนรวม
8. กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
9. บล. บลจ. บลน.
10. ผู้ประกอบการสัญญาซื้อขายล่วงหน้า



ประเภทของนักลงทุนตามเกณฑ์ของ ธปท.

นักลงทุนรายย่อย

กลุ่มที่นอกเหนือจากนักลงทุนสถาบันทั้ง

1. บุคคลธรรมดา
2. นิติบุคคล ที่ไม่เข้าเกณฑ์ผู้ลงทุนสถาบัน





1. รายงาน Portfolio Investment Abroad (PIA)

Portfolio Investment Aboard (PIA)

PIA คือ ชุดรายงานข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนในหลักทรัพย์ในต่างประเทศ

จำนวน Dataset : 10 ชุดข้อมูล

ใครเป็นคนรายงาน : 1) นักลงทุนสถาบัน 10 ประเภท (เพื่อตนเอง) 2) บริษัทหลักทรัพย์ (เพื่อลูกค้า)

Platform ที่ใช้กรอกข้อมูล : ต้องดาวน์โหลด Program

ความถี่ในการรายงาน : รายเดือน

กำหนดส่ง : ก่อนวันที่ 10 ของเดือนถัดไป

ช่องทางการลงรายงาน : ระบบบริการรับ-ส่งข้อมูล DAP

รายงาน PIA มี 2 ประเภท



รายงาน PIA
(รายงานฉบับเต็ม)

- รายงาน PIA ประกอบด้วย 10 Data sets
- สำหรับผู้ลงทุนสถาบัน 10 ประเภท และลูกค้าของตัวแทนที่จัดเป็นนักลงทุนสถาบัน



รายงาน BPIA
(รายงานฉบับย่อ)

- รายงาน BPIA เป็นรายงานที่ย่อรายงาน PIA กับ DRT เป็นชุดเดียว
- สำหรับบริษัทหลักทรัพย์เพื่อรายงานให้ลูกค้ารายย่อย (เท่านั้น)





1. Overview of Portfolio and Derivatives

Investment Aboard (DF_OPI)

ข้อมูลภาพรวมของ Portfolio

2. Movement of Portfolio Investment Aboard (DF_MPI)

ข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์ของ Portfolio

3. Outstanding of Portfolio Investment Aboard (DF_PIA)

ข้อมูลยอดคงค้างของเงินลงทุนใน Portfolio

4. Foreign Currency Deposit (DF_FCD)

ข้อมูลเกี่ยวกับการลงทุนในบัญชีเงินฝากของ Portfolio

5. Return on Portfolio and Derivative

Investment Aboard (DF_RPI)

ข้อมูลเกี่ยวกับผลประโยชน์ที่ได้รับ/จ่ายจากการลงทุน

6. Hedging of Portfolio and Derivative

Investment Aboard (DF_HPI)

ข้อมูลการทำสัญญาธุรกรรมเงินตราต่างประเทศเพื่อป้องกันความเสี่ยง

7. Debt Securities Registry (DF_DSR)

ข้อมูลคุณสมบัติของตราสารหนี้

8. Equity Securities Registry (DF_ESR)

ข้อมูลคุณสมบัติของตราสารทุน

9. Foreign Fund Registry (DF_FFR)

ข้อมูลคุณสมบัติของกองทุนในต่างประเทศ

10. Issuer Registry (DF_ISR)

ข้อมูลคุณสมบัติของผู้ออกตราสาร



PIAExcelTemplate1 - Microsoft Excel

Home Insert Page Layout Formulas Data Review View Developer BOT Addins Meridio Data Mining PIA

Open MPF PIA FCD RPI NPI DSR ESR FFR ISR

Data File Template

Open Save Validate Create XML Data File

Data Management

Update XML Schemas

XML Schema Management

Document Action (Hide) View

BOT PIA Excel Template Version 1.0.0 About

A8 0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)

1	Name	Movement of Portfolio Investment Abroad				
2	Type	No Fixed CL with sub-repeating				
3	Schema version	ALL 1.0				
4	Organization Id	A99				
5	Data Set Date	2015-01-31				
6						
7	Provider Role and Responsibility	End Investor Id	End Investor Unique Id Type	End Investor Name	End Investor Type	Fund Id
8	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000001	324001: (Personal Id)	นายสุข สุขใจ		
9	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000002	324001: (Personal Id)	นายมา มาชนะ		
10	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000003	324001: (Personal Id)	นายอลอ อลอสดี		
11	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000003	324001: (Personal Id)	นายอลอ อลอสดี		
12	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000004	324001: (Personal Id)	นายชนะ ชนะใจ		
13	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000004	324001: (Personal Id)	นายชนะ ชนะใจ		
14	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000004	324001: (Personal Id)	นายชนะ ชนะใจ		
15	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000004	324001: (Personal Id)	นายชนะ ชนะใจ		
16	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000005	324001: (Personal Id)	นายปา จังใจ		
17	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000005	324001: (Personal Id)	นายปา จังใจ		
18	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000005	324001: (Personal Id)	นายปา จังใจ		
19	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000006	324001: (Personal Id)	นายสิทธิ์ สิทธิฤทธิ์		
20	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000007	324001: (Personal Id)	นายบุญ ใจดี		
21	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000008	324001: (Personal Id)	นายมน รัชสี		
22	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000008	324001: (Personal Id)	นายมน รัชสี		
23	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000009	324001: (Personal Id)	นายพร สุขใจ		
24	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000009	324001: (Personal Id)	นายพร สุขใจ		
25	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000009	324001: (Personal Id)	นายพร สุขใจ		
26	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000009	324001: (Personal Id)	นายพร สุขใจ		
27	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000009	324001: (Personal Id)	นายพร สุขใจ		
28	0703600004: (Investment by Customer - Via Broker)	30000000000010	324001: (Personal Id)	นายเอก รักจิระ		
29						
30						
31						
32						
33						
34						
35						
36						
37						
38						
39						
40						
41						
42						
43						

Document Actions

Organization Id: Organization Id

Data Set Date: Data Set Date

Errors

Schema Errors Custom Errors



รายงานการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ของบุคคลรายย่อย ผ่านตัวแทนการลงทุน (Broker / Management Company for Customers Portfolio and Derivative Investment Abroad)									
			ผลการตรวจสอบ						
รหัสผู้รายงาน (Provider Unique ID)					ตรวจสอบข้อมูล				
ประเภทรหัสผู้รายงาน (Provider Unique ID Type)									
ชื่อผู้รายงาน (Provider Name)									
วันที่ของชุดข้อมูล (Data Set Date) [yyyy-mm-dd (ค.ศ.) เช่น 2018-01-31]									
(หน่วย: หน่วย)									
ที่ (No.)	รหัสของผู้เป็นเจ้าของ เงินลงทุน (End Investor Id)	ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของ เงินลงทุน (End Investor Unique Id Type)	ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (End Investor Name)	กลุ่มประเภทตราสาร และอื่น ๆ (Financial Market Instrument Type and Others)	ชื่อของผู้ออกตราสาร/ สถาบันผู้รับฝากเงิน/คู่สัญญา (Issuer Name / Exchange Market Name / Counter Party Name)	ประเทศที่ออกไปลงทุน / ฝากเงิน (Country of Registration / Investment)	สกุลเงินของตราสาร และอนุพันธ์ที่ลงทุน (Original Currency)	ยอดคงค้างการลงทุน (ไม่รวมตราสารอนุพันธ์) (Securities Investment)	
								ราคาทุน (Cost Value)	ราคาตลาด (Market Value)
								Original Currency	Original Currency
1									
2									



BPIA

LINK ข้อมูลเกี่ยวกับ BPIA : [ข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์](#) ตรงหัวข้อ XML Schema และ Excel Input Template

-> แบบรายงานการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ของผู้ลงทุนรายย่อย



Derivative (DRT)

DRT คือ ชุดรายงานข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์และยอดคงค้างธุรกรรมยืมและคืนตราสารหนี้/ตลาดซื้อคืน

จำนวน Dataset : 3 ชุดข้อมูล

ใครเป็นคนรายงาน : 1) นักลงทุนสถาบัน 10 ประเภท (เพื่อตนเอง) 2) บริษัทหลักทรัพย์ (เพื่อลูกค้า)

Platform ที่ใช้กรอกข้อมูล : Excel File

ลักษณะข้อมูล : รายเดือน

ความถี่ในการรายงาน : รายเดือน

กำหนดส่ง : ก่อนวันที่ 10 ของเดือนถัดไป

ช่องทางการลงรายงาน : ระบบบริการรับ-ส่งข้อมูล DAP

ชุดข้อมูล Dataset ใน DRT

1. Derivatives Outstanding

ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์

~~2. Excess Cash and Margin Outstanding~~

~~ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรม Excess Cash และ Margin เพื่อซื้อขายอนุพันธ์~~

~~3. Securities Borrowing and Lending/Repo Outstanding~~

~~ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรม SBL และธุรกรรม Repo/Reverse~~



ตัวอย่างและ
emplate รายงาน DR

ตัวอย่าง 1: การรายงานยอดคงค้างธุรกรรม futures และการรายงานยอดคงค้างส่วนเกินและเงินวางประกัน (Excess cash + Margin)

ณ สิ้นเดือนตุลาคม 2561 บริษัทหลักทรัพย์ AAA จำกัด มียอดคงค้างธุรกรรม Derivatives ของตนเองและลูกค้า ดังนี้

1. ยอดคงค้างฯ ของตนเอง (proprietary trading): Long MSCI Emerging Market Index Futures ในตลาด SGX จำนวน 1,000,000 SGD โดยมี maturity date คือวันที่ 31/12/2018 และมียอดคงค้างส่วนเกินและเงินวางประกันคงเหลือ ณ สิ้น ค.ค. 61 จำนวน 100,000 SGD
2. ยอดคงค้างฯ ของลูกค้า นาย ก ซึ่งจัดตั้งเป็นกองทุนส่วนบุคคล ดังนี้
 - 2.1 Long WTI Crude Oil Futures ในตลาด NYMEX เป็นสกุล USD จำนวน 50,000 USD โดยมี maturity date วันที่ 31/3/2019
 - 2.2 Short Silver ในตลาด COMEX เป็นสกุล USD จำนวน 30,000 USD โดยมี maturity date วันที่ 31/3/2019
 - 2.3 Long Gold (standard) ในตลาด TOCOM เป็นสกุล JPY จำนวน 1,000,000 JPY โดยมี maturity date วันที่ 31/3/2019

โดย นาย ก มียอดคงค้างส่วนเกินและเงินวางประกันคงเหลือ ณ สิ้น ค.ค. 61 สำหรับธุรกรรมในข้อ 2.1 และ 2.2 รวมอยู่ในบัญชีเดียวกันจำนวน 9,500 USD และสำหรับธุรกรรมในข้อ 2.3 จำนวน 150,000 JPY

3. ยอดคงค้างฯ ของลูกค้า นาง ส โดย Long Bitcoin Futures ในตลาด CME เป็นสกุล USD จำนวน 60,000 USD และมี Maturity date วันที่ 31/3/2019 และมียอดคงค้างส่วนเกินและเงินวางประกันคงเหลือ ณ สิ้น ค.ค. 61 เท่ากับ 27,500 USD

รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (End Investor Id)	ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (End Investor Unique Id Type)	ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (End Investor Name)	ประเภทธุรกรรม (Objective Type)	บทบาทและความรับผิดชอบของคู่ค้า (Provider Role and Responsibility)	ประเภทสถาบันผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (End Investor Type)	ประเภทธุรกรรม (Derivatives Type)	ประเภทสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying Asset Type)	ชื่อสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying Asset Name)	วันที่ครบกำหนดสัญญา (Maturity Date)	ชื่อตลาดซื้อขายตราสาร (Exchange Name)	ชื่อคู่สัญญา (Counterparty/Broker Name)	ประเทศ (Country)	สกุลเงิน (Currency)	สถานะซื้อ/ขาย (Position)	มูลค่าของสัญญา (Notional Amount)	ยอดคงค้างของสัญญา ค่าบวก/ลบ เมื่อใช้ราคา ณ วันที่ปิดมาซึ่งตรา	ยอดคงค้างของสัญญา ค่าบวก/ลบ เมื่อใช้ราคาตลาดของตรา	รายละเอียดเพิ่มเติม (Description)
A99	324005: รหัสกำกับตราโดยรัฐบาล	บริษัทหลักทรัพย์ AAA จำกัด	465001: เพื่อตนเอง	ลงทุนเอง		Futures	Equity	MSCI Emerging Markets Index	2018-09-30	SGX		SG	SGD	Long	1,000,000.00	1,000,000.00	1,050,948.00	
11000000000001	324001: เลขประจำตัว	นาย ค	465003: เพื่อลูกค้า	บส./บลจ.บริหาร	กองทุนส่วนบุคคล	Futures	Commodity - Others	WTI Crude Oil	2019-09-30	NYMEX		US	USD	Long	50,000.00	50,000.00	49,332.00	
11000000000001	324001: เลขประจำตัว	นาย ค	465003: เพื่อลูกค้า	บส./บลจ.บริหาร	กองทุนส่วนบุคคล	Futures	Commodity - Others	Silver	2019-09-30	COMEX		US	USD	Short	30,000.00	30,000.00	36,334.00	
11000000000001	324001: เลขประจำตัว	นาย ค	465003: เพื่อลูกค้า	บส./บลจ.บริหาร	กองทุนส่วนบุคคล	Futures	Commodity - Gold	Gold Standard	2019-09-30	TOCOM		JP	JPY	Long	1,000,000.00	1,000,000.00	1,044,522.00	
11000000000002	324001: เลขประจำตัว	นาง ส	465003: เพื่อลูกค้า	ฐานะ Broker		Futures	Others	Bitcoin	2019-09-30	CME		US	USD	Long	60,000.00	60,000.00	58,977.00	

รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (End Investor Id)	ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (End Investor Unique Id Type)	ประเภทธุรกรรม (Objective Type)	บทบาทและความรับผิดชอบของคู่ค้า ผู้รายงาน (Provider Role)	ประเภทสถาบันผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (End Investor Type)	สกุลเงิน (Currency)	ยอดคงค้างเงินส่วนเกินและเงินวางประกัน ณ วันสิ้นเดือน (Excess Cash +	รายละเอียดเพิ่มเติม (Description)
A99	324005: รหัสกำกับตราโดย	465001: เพื่อตนเอง	ลงทุนเอง		SGD	100,000.00	
11000000000001	324001: เลขประจำตัว	465003: เพื่อลูกค้า	บส./บลจ.บริหาร	กองทุนส่วนบุคคล	USD	9,500.00	
11000000000001	324001: เลขประจำตัว	465003: เพื่อลูกค้า	บส./บลจ.บริหาร	กองทุนส่วนบุคคล	JPY	150,000.00	
11000000000002	324001: เลขประจำตัว	465003: เพื่อลูกค้า	ฐานะ Broker		USD	27,500.00	



3. แบบรายงานสำหรับบริษัทหลักทรัพย์อนุญาต (FXSC)

บริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาต (FXSC)

FXSC คือ ชุดรายงานข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการทำธุรกรรมสำหรับบริษัทหลักทรัพย์อนุญาต ซึ่งประกอบไปด้วย 1) ธุรกรรมซื้อ-ขายแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ

2) ฐานะเงินตราต่างประเทศสุทธิ และ 3) รายงานการเปิดบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ

จำนวน Dataset : 3 ชุดข้อมูล

ใครต้องเป็นคนรายงาน : บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับอนุญาต

Platform ที่ใช้กรอกข้อมูล : Excel File

ลักษณะข้อมูล : รายวัน รายธุรกรรม รายบัญชี

ความถี่ในการรายงาน : รายเดือน

กำหนดส่ง : ภายใน 12.00 ของวันที่ 15 ของเดือนถัดไป ช่องทางการลงรายงาน : ระบบบริการรับ-ส่งข้อมูล DAP

ชุดข้อมูล Dataset ใน FXSC

1. รายงานธุรกรรมซื้อ-ขายแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ

ข้อมูลการทำธุรกรรมเงินตราต่างประเทศทั้งหมด
ของบริษัทหลักทรัพย์รับอนุญาต

2. รายงานฐานะเงินตราต่างประเทศสุทธิ

ข้อมูลฐานะเงินตราต่างประเทศสุทธิ ณ สิ้นวัน

3. รายงานการเปิดบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศเพื่อการประกอบธุรกิจเงินตราต่างประเทศ

รายงานการเปิดบัญชีเพื่อประกอบธุรกิจเงินตราต่างประเทศ



		แบบรายงานธุรกรรมซื้อ ขาย แลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ								
		Organization ID:	A99							
		วันที่ Data Set Date (YYYY-MM-DD) :	2018-05-31							
ตัวอย่าง	ธุรกรรมที่	FI Arrangement Number	Previous FI Arrangement Number	Cancellation Flag	Set Up Reason Type	FX Arrangement Type	Trade Date	Maturity Date	Underlying Flag	Transaction Purpose
ตัวอย่าง 1	1-1	1001		0	New Contract	Spot-today	2018-05-10	2018-05-10	1	318075 เงินลงทุนในหลักทรัพย์
	1-2	1002		0	New Contract	Spot-today	2018-05-10	2018-05-10	1	318075 เงินลงทุนในหลักทรัพย์
	1-3	1003		0	New Contract	Spot-today	2018-05-10	2018-05-10	1	318096 บริหารฐานะเงินตราต่างประเทศ
ตัวอย่าง 2	2-1	2001		0	New Contract	Spot-today	2018-05-11	2018-05-11	0	318075 เงินลงทุนในหลักทรัพย์
	2-2	2002		0	New Contract	Spot-tomorrow	2018-05-11	2018-05-14	1	318075 เงินลงทุนในหลักทรัพย์
	2-3	2003		0	New Contract	Spot-tomorrow	2018-05-11	2018-05-14	1	318075 เงินลงทุนในหลักทรัพย์



แบบรายงานและตัวอย่าง
าง FXSC



1. ข้อมูล Portfolio Investment Abroad (PIA) / Derivative (DRT)
 - คุณรัฐวิชญ์ วัฒนะชัยวัฒน์ โทร. 023567331 Email: RatthawW@bot.or.th
2. ข้อมูลแบบรายงานสำหรับบริษัทหลักทรัพย์อนุญาต (FXSC)
 - คุณพิชญานิษฐ์ เสนาะเสียง โทร. 022835635 Email: pichaysa@bot.or.th