Summary of changes on “FI Data Set Document”

Update on FI Data Set Document version 2023.02

Remark: All changes from version 2023.01 to version 2023.02 are in red font.

| Version Number | Page No. | Data Set Name | Data Element | Summary of Changes |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2023.02 | 34 | COS | Notional Principal Amount | Description  Revise description  “ยอดรวมของภาระผูกพัน  1. กรณีภาระผูกพันที่ไม่ใช่ตราสารอนุพันธ์ รายงาน ยอดรวมของภาระผูกพันก่อนหัก Specific Provision  2. กรณีตราสารอนุพันธ์ รายงาน ยอดรวมของภาระผูกพันก่อนหัก Incurred CVA และ Specific Provision” |
| 134, 192, 199 | COSC, COSF, COSS | Notional Principal Amount | Description  Revise description  “ยอดรวมของภาระผูกพัน~~ก่อนหัก Specific Provision~~  1. กรณีภาระผูกพันที่ไม่ใช่ตราสารอนุพันธ์ รายงาน ยอดรวมของภาระผูกพันก่อนหัก Specific Provision  2. กรณีตราสารอนุพันธ์ รายงาน ยอดรวมของภาระผูกพันก่อนหัก Incurred CVA และ Specific Provision” |
| 35 | COS | Net Credit Equivalent Amount | **Description**  Revise description  “มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของรายการนอกงบแสดงฐานะทางการเงิน และ Repo-style transaction  1.กรณีเป็นภาระผูกพันที่ไม่ใช่ตราสารอนุพันธ์  วิธี SA หลังหัก Specific Provision  วิธี IRB ก่อนหัก Specific Provision  2. กรณีเป็นตราสารอนุพันธ์ที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current จะเป็นมูลค่าก่อน  รวมผลกำไรจากการวัดมูลค่ายุติธรรม  วิธี SA หลังหัก Incurred CVA และ Specific Provision  วิธี IRB หลังหัก Incurred CVA แต่ก่อนหัก Specific Provision” |
| 134, 193, 199 | COSC, COSF, COSS | Net Credit Equivalent Amount | **Description**  Revise description  “มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของรายการนอกงบแสดงฐานะทางการเงิน และ Repo-style transaction  1.กรณีเป็นภาระผูกพันที่ไม่ใช่ตราสารอนุพันธ์  วิธี SA หลังหัก Specific Provision  วิธี IRB ก่อนหัก Specific Provision  2. กรณีเป็นตราสารอนุพันธ์ที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current จะเป็นมูลค่าก่อน  รวมผลกำไรจากการวัดมูลค่ายุติธรรม  วิธี SA หลังหัก Incurred CVA และ Specific Provision  วิธี IRB หลังหัก Incurred CVA แต่ก่อนหัก Specific Provision” |
| 39, 139, 204, 212 | CRI, CRIC,  CRIF, CRIS | Notional Principal Amount | **Description**  Revise description  “ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement (Repo transaction และ Securities borrowing and lending) โดยสำหรับ OTC Derivatives ให้หมายถึง ยอดรวมจำนวนเงินตามสัญญาอนุพันธ์ทางการเงิน  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Incurred CVA/ Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต” |
| 41, 141, 206, 214 | CRI, CRIC,  CRIF, CRIS | Net Credit Equivalent Amount | **Description**  Revise description  “ยอดสุทธิของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน และนอกงบแสดงฐานะการเงินที่หัก Incurred CVA และ Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนหัก Specific provision และปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต” |
| 40, 140, 205, 213 | CRI, CRIC,  CRIF, CRIS | Gross Credit Equivalent Amount | **Description**  Revise description  “ยอดรวมของมูลค่ารายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน ธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน (Reverse Repo) และลูกหนี้ที่เกิดจากการวางเงินสดเป็นหลักประกันในการยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing) ตามธุรกรรมการยืมและ  ให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending (SBL) ที่ไม่อยู่ภายใต้Master netting agreement และยอดรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในแสดงฐานะการเงินของรายการ OTC Derivatives  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Incurred CVA/Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต” |
| 47, 147, 221, 227 | CRS, CRSC,  CRSF, CRSS | Notional Principal Amount | **Description**  Revise Description  “ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement (Repo transaction และ Securities borrowing and lending) โดยสำหรับ OTC Derivatives และ Exchange Traded Derivatives ให้หมายถึง ยอดรวมจำนวนเงินตามสัญญาอนุพันธ์ทางการเงิน  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Incurred CVA / Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต” |
| 49, 149, 223, 229 | CRS, CRSC, CRSF, CRSS | Net Credit Equivalent Amount | **Description**  Revise description  “ยอดสุทธิของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่หัก Incurred CVA / Specific Provision และ Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต” |
| 47, 147, 221, 227 | CRS, CRSC,  CRSF, CRSS | Gross Credit Equivalent Amount | **Description**  Revise description  “ยอดรวมของมูลค่ารายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน ธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน (Reverse Repo) และลูกหนี้ที่เกิดจากการวางเงินสดเป็นหลักประกันในการยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing) ตามธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending (SBL) ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement และยอดรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินของรายการ OTC Derivatives และ Exchange Traded Derivatives  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Incurred CVA / Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต” |
| 31, 50,  131, 150,  189, 196,  224, 230 | COS, CRS,  COSC, CRSC,  COSF, COSS,  CRSF, CRSS | Risk Weighted Asset Default Fund | **Add new element**  เพิ่ม การรายงาน Data Element “Risk Weighted Asset Default Fund” |
| 32, 43,  50, 131,  143, 150,  190, 196,  209, 217,  224, 230 | COS, CRI,  CRS, COSC,  CRIC, CRSC,  COSF, COSS,  CRIF, CRIS,  CRSF, CRSS | Risk Weighted Asset CVA | **Add new element**  เพิ่ม การรายงาน Data Element “Risk Weighted Asset CVA” |
| 34, 41,  48, 134,  141, 148,  192, 199,  206, 214,  222, 228 | COS, CRI,  CRS, COSC,  CRIC, CRSC,  COSF, COSS,  CRIF, CRIS,  CRSF, CRSS | Incurred CVA | **Add new element**  เพิ่ม การรายงาน Data Element “Incurred CVA” |
| 36, 136, 194, 201 | COS, COSC, COSF, COSS | Central Counterparty Clearing Type | **Add new element**  เพิ่ม การรายงาน Data Element “Central Counterparty Clearing Type” |
|  | 46, 147, 221, 226 | CRS, CRSC, CRSF, CRSS | RWA Rate | **Description**  Revise description  “น้ำหนักความเสี่ยงของรายการใน Credit Risk Item ~~(กรณีอนุพันธ์ทางการเงินที่อยู่ในตลาด Exchange ให้รายงาน RWA = 0)~~” |
|  | 47 | CRS | Notional Principal Amount | **M/O/C**  แก้ไขของ ธพ. บง. และ SFI เปลี่ยนจาก O เป็น C |