Summary of changes on “FI Data Set Manual”

Update on FI Data Set Manual Version 2024.01

Remark: All changes from version 2023.02 to version 2024.01 are in red font.

| Version number | Page No. | Data Set Name | Data Element | Summary of Changes |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2024.01 | 25, 186, 275, 285 | COS, COSC, COSF, COSS | Risk Weighted Asset Outstanding Amount | **คำอธิบาย**  ผลรวมของสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของคู่สัญญาสําหรับธุรกรรมอนุพันธ์ เฉพาะ  - สินทรัพย์เสี่ยงจาก Default Risk สำหรับฐานะที่เกิดจากธุรกรรมอนุพันธ์ทุกสัญญาที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์  - สินทรัพย์เสี่ยงจาก Default Risk สำหรับฐานะในกองทุนทดแทนความเสียหายจากการผิดนัดชำระราคา (Default Fund)  - สินทรัพย์เสี่ยงจาก CVA Risk  ~~ผลรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์ ของคู่สัญญาทุกราย (ซึ่งจะประกอบด้วยสินทรัพย์เสี่ยงจาก Default Risk สำหรับฐานะที่เกิดจากธุรกรรมอนุพันธ์และฐานะในกองทุนทดแทนความเสียหายจากการผิดนัดชำระราคา (Default Fund) และ สินทรัพย์เสี่ยงจาก CVA risk)~~ |
| 26, 187, 276, 286 | COS, COSC, COSF, COSS | Risk Weighted Asset CVA | **Validation Rule**  ~~Schema Validation~~ Complex Validation  Risk Weighted Asset CVA ต้องมีค่ากรณีมีข้อมูลอย่างน้อย 1 รายการที่เข้าเงื่อนไขทั้ง 3 ข้อดังนี้  1. Contingent Type มีค่าเป็นรหัสย่อย ภายใต้ ตราสารอนุพันธ์ (018080)  และ  2. Involved Party Type มีค่าเป็นรหัสตามรายการดังนี้  - 176039 (ธนาคารพาณิชย์ไทย)  - 176004 (ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย)  - 176005 (ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ)  - 176040 (สาขาธนาคารต่างประเทศ)  - 176057 (บริษัทเงินทุน / บริษัทเงินทุนหลักทรัพย์)  - 176060 (บริษัทเครดิตฟองซิเอร์)  - 176069 (สถาบันการเงินที่อยู่ในต่างประเทศ)  และ  3. Central Counter Party Clearing Type มีค่าเป็นรหัสตามรายการดังนี้  - 487002 (การชำระราคาผ่าน Non-QCCP)  - 487003 (การไม่ชำระราคาผ่าน CCP) |
| 43, 204, 302, 313 | CRI, CRIC, CRIF, CRIS | Risk Weighted Asset Outstanding Amount | **คำอธิบาย**  มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้น ซึ่งเท่ากับผลรวมของมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงจาก Default risk, Dilution risk และ Residual value risk หลังคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสง.ที่ใช้วิธี IRB) รวมถึงรายการตราสารอนุพันธ์ (ทั้ง OTC และ Exchanged Traded Derivative) แต่ไม่รวมมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตจาก CVA risk ~~สำหรับรายการ OTC Derivatives มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตจะมีส่วนที่เป็นสินทรัพย์เสี่ยงจาก CVA risk ด้วย~~ |
| 55, 216, 325, 336 | CRS, CRSC, CRSF, CRSS | Risk Weighted Asset Outstanding Amount | **คำอธิบาย**  มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้น  กรณีที่ Credit Risk Item มีรหัสเป็นรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446090 (ข้อ 5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based) ค่ามูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้นจะเป็นค่าก่อนคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสง.ที่ใช้วิธี IRB) รวมถึงรายการตราสารอนุพันธ์ (ทั้ง OTC และ Exchanged Traded Derivative) แต่ไม่รวมมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่เป็นสินทรัพย์เสี่ยงจาก Default Risk ฐานะในกองทุนทดแทนความเสียหายจากการผิดนัดชำระราคา (Default Fund) และ สินทรัพย์เสี่ยงจาก CVA risk  ~~สำหรับรายการตราสารอนุพันธ์ (ทั้ง OTC และ Exchanged Traded Derivative) มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตจะมีส่วนที่เป็นสินทรัพย์เสี่ยงจาก Default Risk สาหรับฐานะที่เกิดจากธุรกรรมอนุพันธ์และฐานะในกองทุนทดแทนความเสียหายจากการผิดนัดชำระราคา (Default Fund) และ สินทรัพย์เสี่ยงจาก CVA risk~~ |
| 37, 198, 297, 308 | CRI, CRIC, CRIF, CRIS | Double Default Method | **Validation Rule**  Schema Validation:  ค่าที่เป็นไปได้ สำหรับ Double Default Method ที่มีค่า ‘1’  คือ Credit Risk Item มีรหัสเป็น 446069, 446071, 446072, 446073, 446083, 446120, 446121, 446124, 446125, 446127, 446128, 446132, 446129, 446161, 446162 และ 446163 |