

**ยอดคงค้างตราสารอนุพันธ์และธุรกรรมที่เกี่ยวข้อง**

Data Set,

Data Validation and Classification

**November 2022**

**Document Information**

**Revision History**

| Version number | Released Date | Effective Date | Summary of changes | Revision marks |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Draft | 16 September 2022 |  |  |  |
| V 1.0 | 3 November 2022 | 1 December 2022 | 3. Data Validation   * SDVT: New validation rules. (CNSDVT009 and CNSDVT010) * DS\_MLN: New validation rules. (CNMLN008 and CNMLN009) * DS\_CDD: New validation rules. (CNCDD009 and CNCDD010) |  |
| V 1.1 | 11 November 2022 | 1 December 2022 | 3. Data Validation   * SDVP: Revised validation rules. (CNSDVP001, CMSDVP001, CMSDVP003, CMSDVP005, CMSDVP007, CMSDVP009, CMSDVP011 and CMSDVP013) | Change from V 1.0  in Red |

**Table of Contents**

[Document Overview 4](#_Toc112401686)

[I. Data Set Summary 5](#_Toc112401687)

[II. Reporting Institutions Summary 5](#_Toc112401688)

[III. Data Set Detail 6](#_Toc112401689)

[1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด (DS\_SDV) 6](#_Toc112401690)

[1.1 ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม (SDVP) 6](#_Toc112401691)

[1.2 ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา (SDVT) 10](#_Toc112401692)

[2. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง (DS\_MLN) 15](#_Toc112401693)

[3. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต (DS\_CDD) 19](#_Toc112401694)

[IV. Data Type 23](#_Toc112401695)

[V. Data Validation Overview 24](#_Toc112401696)

[VI. Data Validation Detail 25](#_Toc112401697)

[1. File Validation 25](#_Toc112401698)

[2. All Entities Validation 26](#_Toc112401699)

[3. Data Validation 27](#_Toc112401700)

[VII. Classification Summary 40](#_Toc112401705)

[VIII. Classification Detail 41](#_Toc112401706)

[1. Currency Code 41](#_Toc112401707)

[2. Derivatives Counterparty Type Code 41](#_Toc112401708)

[3. Derivatives Product Group Code 42](#_Toc112401709)

[4. Derivatives Reference Variables Code 42](#_Toc112401710)

[5. Derivatives Transaction Purpose Code 43](#_Toc112401711)

[6. Structured Product Borrowing Type Code 43](#_Toc112401712)

[7. Derivatives Delivery Code 43](#_Toc112401713)

[IX. Submission Format 44](#_Toc112401714)

[1. File Format for Submission 44](#_Toc112401715)

[2. Naming Convention 44](#_Toc112401716)

[3. Submission Channel 44](#_Toc112401717)

# Document Overview

This document provides information on the Data Set and Elements to be submitted to the Bank of Thailand (BOT) for the Derivatives Reports. Data Set will be electronically submitted to BOT via the BOT Data Acquisition System.

This document is divided into 9 major sections:

1. Data Set Summary section provides an overview of the Data Set and data submission frequency for each Data Set.
2. Reporting Institutions Summary section indicates an overview of the required institution types to submit each Data Set.
3. Data Set Details section discusses in more detail all the data elements within each of the defined Data Set. For each of the data elements, a valid data type was defined. The list of all data types can be found in the Data Type Section.
4. Data Type section, which provides the submission format for each of the data type, as well as some sample value. The list of all classifications can be found in the Classification Section.
5. Data Validation Overview shows an overview of the validation, including the definition of each validation types: Consistency (CN), Completeness (CM) and Referential Integrity (RI) in the related Data Set.
6. Data Validation Detail section discusses all the required validation in every level, starting from File level, all Data Entities level and each Data Entities level.
7. Classification Summary section shows an overview of the Classification and the related Data Set as well as the data elements.
8. Classification Detail section presents higher level of detail of all the Classifications which includes Classification Code, Classification Values, Classification Description and Classification View as specified.
9. Submission Format section provides guidelines, including file format and naming convention, example of submission files and submission channel.

**Description:**

**Frequency:** frequency of data submission (how frequent each institution has to submit the data).

**M:** Mandatory data elements. This data element cannot be blank.

**C:** Mandatory with condition. These data are required under certain condition with other data element(s). The condition of which to report in outlined in the data element description section.

**O:** Optional data element. The data element can contain value or blank depending on whether the institution has the data or not.

**Classification / View:** identify classification and view which is the possible value for each data element. Classification and View will be listed in Classification Document.

# Data Set Summary

| Data Set Name | ABBR | Frequency | Submission Date |
| --- | --- | --- | --- |
| 1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด  1.1 ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม (SDVP)  1.2 ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา (SDVT) | DS\_SDV | Monthly | Data Date + 1 Month |
| 2. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง | DS\_MLN | Monthly | Data Date + 1 Month |
| 3. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต | DS\_CDD | Monthly | Data Date + 1 Month |

# Reporting Institutions Summary

| Data Set Name | ABBR | Reporting Institutions | | | | | Remarks |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Commercial Bank[[1]](#footnote-2) | Finance Company | Credit Foncier Company | Specialized Financial Institutions | Non-Financial Institution |
| 1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด | DS\_SDV | X |  |  |  |  |  |
| 2. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง | DS\_MLN | X |  |  |  |  |  |
| 3. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต | DS\_CDD | X |  |  |  |  |  |

**Description**

**Commercial Bank** includesCommercial Bank, Subsidiary (foreign commercial bank’s subsidiary), and Foreign Bank Branch(except Retail Bank)**.**

**Finance Company** is a business that raises funds from the public in the form of promissory notes (P/N)

and employing such funds in several forms of investment including commerce, development, purchases and

consumption, and housing.

**Credit Foncier Company** is a business of accepting money from public in the form of promissory notes

(P/N) and employing such accepted money in one or several ways such as granting credits by mortgaging

immovable property, accepting immovable property on consignment etc.

**Specialized Financial Institutions (SFIs)** are state-owned financial institutions established with each Specialized Financial Institutions’ establishment Act.

**Non-Financial Institution** in this context means financial service provider under BOT supervision which is not classified as Commercial Bank, Specialized Financial Institution, Finance Company and Credit Foncier.

# Data Set Detail

## ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด (DS\_SDV)

### 1.1 ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม (SDVP)

**Data Set Description**

ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม

Reporting Scope : รายงานยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดทุกธุรกรรม ณ วันสิ้นงวดการรายงาน โดยใช้หน่วย “บาท” และจำแนกตามประเภทของธุรกรรมที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

**Data Set Overview**

| No | Data Element | Key | Req. | Data Type | Format | Validation | Classification |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | รหัสสถาบัน | PK | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 2 | งวดข้อมูล | PK | M | Date | Char(10) |  |  |
| 3 | ชื่อผู้จัดทำ |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 4 | โทรศัพท์ |  | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 5 | อีเมล |  | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 6 | Group of Product |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 7 | Derivatives | PK | M | Classification | VarChar(200) |  | Derivatives Product Group Code (V\_SDVP) |
| 8 | อัตราดอกเบี้ย - Notional Amount |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP001 |  |
| 9 | อัตราดอกเบี้ย - MTM |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP002 |  |
| 10 | อัตราแลกเปลี่ยน - Notional Amount |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNSDVP001 |  |
| 11 | อัตราแลกเปลี่ยน - MTM |  | M | Numeric | Number(20,2) |  |  |
| 12 | ราคาตราสารหนี้ - Notional Amount |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP003 |  |
| 13 | ราคาตราสารหนี้ - MTM |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP004 |  |
| 14 | ราคาตราสารทุน - Notional Amount |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP005 |  |
| 15 | ราคาตราสารทุน - MTM |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP006 |  |
| 16 | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - Notional Amount |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP007 |  |
| 17 | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - MTM |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP008 |  |
| 18 | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - Notional Amount |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP009 |  |
| 19 | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - MTM |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP010 |  |
| 20 | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - Notional Amount |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP011 |  |
| 21 | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - MTM |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP012 |  |
| 22 | ดัชนีทางการเงิน - Notional Amount |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP013 |  |
| 23 | ดัชนีทางการเงิน - MTM |  | C | Numeric | Number(20,2) | CMSDVP014 |  |
| 24 | Total Notional Amount |  | M | Numeric | Number(20,2) |  |  |
| 25 | Total MTM |  | M | Numeric | Number(20,2) |  |  |

**Data Element Description**

1. **รหัสสถาบัน**

รหัสประจำตัวผู้รายงานข้อมูล หากเป็นธุรกิจสถาบันการเงินและธุรกิจการเงินอื่นที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) หรือจัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติ (พรบ.) พระราชกำหนด (พรก.) หรือกฎหมายอื่นที่เกี่ยวข้อง ให้รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสถาบันการเงิน” ที่เผยแพร่ที่ www.bot.or.th (FI Code 3 หลัก) ผู้รายงานข้อมูลที่นอกจากข้างต้นให้รายงานด้วยเลขจดทะเบียนที่ออกโดยทางการ เช่น เลขทะเบียนนิติบุคคล 13 หลัก

1. **งวดข้อมูล**

วันที่ ณ สิ้นเดือนของงวดการรายงาน ระบุเป็น ปี ค.ศ. (YYYY-MM-DD)

1. **ชื่อผู้จัดทำ**

ชื่อผู้จัดทำรายงาน

1. **โทรศัพท์**

เบอร์โทรศัพท์ผู้จัดทำรายงาน

1. **อีเมล**

อีเมลผู้จัดทำรายงาน

1. **Group of Product**

กลุ่มของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด

เงื่อนไข กำหนดโดย ธปท. ไม่ต้องรายงานข้อมูล

1. **Derivatives**

ประเภทของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด

เงื่อนไข กำหนดโดย ธปท. ไม่ต้องรายงานข้อมูล

1. **อัตราดอกเบี้ย - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ย ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **อัตราดอกเบี้ย – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ย ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **อัตราแลกเปลี่ยน - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยน ตาม Group of Product และ Derivatives

1. **อัตราแลกเปลี่ยน – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยน ตาม Group of Product และ Derivatives

1. **ราคาตราสารหนี้ - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงราคาตราสารหนี้ ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **ราคาตราสารหนี้ – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงราคาตราสารหนี้ ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **ราคาตราสารทุน - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงราคาตราสารทุน ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **ราคาตราสารทุน – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงราคาตราสารทุน ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงราคาโลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงราคาโลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงราคาทองคำ ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงราคาทองคำ ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงราคาสินค้าโภคภัณฑ์อื่นๆ นอกเหนือจากโลหะมีค่าและทองคำ ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงราคาสินค้าโภคภัณฑ์อื่นๆ นอกเหนือจากโลหะมีค่าและทองคำ ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **ดัชนีทางการเงิน - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงดัชนีทางการเงิน ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **ดัชนีทางการเงิน – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงดัชนีทางการเงิน ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Derivatives” ไม่ได้มีค่าเป็น 0793700010 FX pro-rata และ flexible derivatives

1. **Total Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญา ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข คำนวณโดย ธปท. ไม่ต้องรายงานข้อมูล

1. **Total MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรม ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข คำนวณโดย ธปท. ไม่ต้องรายงานข้อมูล

### 1.2 ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา (SDVT)

**Data Set Description**

ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา

Reporting Scope : รายงานรายละเอียดของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดประเภทต่อไปนี้ ที่มียอดคงค้างเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน (รวมถึงธุรกรรมใหม่ที่ทำเป็นครั้งแรกและสิ้นสุดในระหว่างงวดรายงาน) โดยรายงานเป็นรายสัญญาเรียงลำดับตามวันทำสัญญา (Trade Date)

1. ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดขั้นพื้นฐาน และธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ไม่ใช่ขั้นพื้นฐานทุกประเภท ยกเว้นประเภท “อื่นๆ” (เฉพาะในกรณีที่ธนาคารพาณิชย์อ้างอิงตัวแปรประเภทหนึ่ง ๆ หรือดัชนีทางการเงินหรือผลดำเนินงานของกองทุนหรือกองทรัสต์หนึ่ง ๆ เป็นครั้งแรก โดยรายงานเฉพาะในงวดที่ทำธุรกรรมเท่านั้น)
2. ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ไม่ใช่ขั้นพื้นฐานประเภท “อื่นๆ” (ทั้งที่เป็นธุรกรรมใหม่และไม่ใช่ธุรกรรมใหม่)
3. ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ได้รับความเห็นชอบเป็นรายกรณีหรือได้รับอนุญาตตามบทเฉพาะกาล (ทั้งที่เป็นธุรกรรมใหม่และไม่ใช่ธุรกรรมใหม่)
4. ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ทำเพื่อบริหารความเสี่ยงของธนาคารพาณิชย์เองซึ่งไม่ได้อยู่ภายใต้หลักเกณฑ์ที่ประกาศกำหนดเป็นการทั่วไป (ทั้งที่เป็นธุรกรรมใหม่และไม่ใช่ธุรกรรมใหม่)

**Data Set Overview**

| No | Data Element | Key | Req. | Data Type | Format | Validation | Classification |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | รหัสสถาบัน | PK | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 2 | งวดข้อมูล | PK | M | Date | Char(10) |  |  |
| 3 | ชื่อผู้จัดทำ |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 4 | โทรศัพท์ |  | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 5 | อีเมล |  | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 6 | Ref No. | PK | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 7 | New Product |  | M | String | Char(1) | CNSDVT001 |  |
| 8 | Trade Date |  | M | Date | Char(10) |  |  |
| 9 | Value Date |  | M | Date | Char(10) | CNSDVT002 |  |
| 10 | Maturity Date |  | M | Date | Char(10) | CNSDVT003 |  |
| 11 | Name of Product |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 12 | Group of Product |  | M | Classification | VarChar(200) |  | Derivatives Product Group Code (V\_SDVT) |
| 13 | Derivatives Counterparty Type |  | M | Classification | VarChar(200) |  | Derivatives Counterparty Type Code |
| 14 | Counterparty Name |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 15 | Notional Outstanding Currency |  | M | Classification | Char(3) |  | Currency Code |
| 16 | Notional Outstanding Amount |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNSDVT005 |  |
| 17 | Notional Baht Equivalent |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNSDVT006  CNSDVT010 |  |
| 18 | Reference Variables |  | M | Classification | VarChar(200) |  | Derivatives Reference Variables Code |
| 19 | Reference Variables Details |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 20 | Payout |  | O | String | VarChar(128) |  |  |
| 21 | Derivatives Component |  | O | String | VarChar(128) |  |  |
| 22 | Type of Delivery |  | M | String | VarChar(10) | CNSDVT004CNSDVT007 |  |
| 23 | Transaction Purpose |  | M | Classification | VarChar(200) |  | Derivatives Transaction Purpose Code |
| 24 | Effective Notional Amount |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNSDVT008 |  |
| 25 | Mark-to-Market |  | M | Numeric | Number(20,2) |  |  |
| 26 | Gain or Loss |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNSDVT009 |  |
| 27 | หนังสือให้ความเห็นชอบ |  | C | String | VarChar(128) | CMSDVT002 |  |
| 28 | Notes |  | C | String | VarChar(400) | CMSDVT001 |  |

**Data Element Description**

1. **รหัสสถาบัน**

รหัสประจำตัวผู้รายงานข้อมูล หากเป็นธุรกิจสถาบันการเงินและธุรกิจการเงินอื่นที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) หรือจัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติ (พรบ.) พระราชกำหนด (พรก.) หรือกฎหมายอื่นที่เกี่ยวข้อง ให้รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสถาบันการเงิน” ที่เผยแพร่ที่ www.bot.or.th (FI Code 3 หลัก) ผู้รายงานข้อมูลที่นอกจากข้างต้นให้รายงานด้วยเลขจดทะเบียนที่ออกโดยทางการ เช่น เลขทะเบียนนิติบุคคล 13 หลัก

1. **งวดข้อมูล**

วันที่ ณ สิ้นเดือนของงวดการรายงาน ระบุเป็น ปี ค.ศ. (YYYY-MM-DD)

1. **ชื่อผู้จัดทำ**

ชื่อผู้จัดทำรายงาน

1. **โทรศัพท์**

เบอร์โทรศัพท์ผู้จัดทำรายงาน

1. **อีเมล**

อีเมลผู้จัดทำรายงาน

1. **Ref No.**

เลขที่อ้างอิงของธุรกรรม เช่น เลขที่บัญชี เลขที่ confirmation หรือเลขที่สัญญา

1. **New Product**

ธุรกรรมใหม่

Y = การทำธุรกรรมในกรณีต่อไปนี้

1. การทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ไม่ใช่ขั้นพื้นฐานประเภท “อื่น ๆ” ที่ ธพ. ทำเป็นครั้งแรก
2. การอ้างอิงตัวแปรประเภทหนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
3. การอ้างอิงดัชนีทางการเงินหรือผลดำเนินงานของกองทุนหรือกองทรัสต์หนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
4. กรณีอื่น ๆ ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

N = ไม่เข้าเงื่อนไขข้างต้น

1. **Trade Date**

วันทำสัญญา

1. **Value Date**

วันที่กำหนดมูลค่า

1. **Maturity Date**

วันครบกำหนดสัญญา

1. **Name of Product**

ชื่อเรียกธุรกรรมซึ่งเป็นที่รู้จักกันทั่วไปหรือชื่อทางการค้าของธุรกรรมนั้น

1. **Group of Product**

กลุ่มของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด

1. **Derivatives Counterparty Type**

ประเภทคู่สัญญา

1. **Counterparty Name**

ชื่อคู่สัญญาที่ทำธุรกรรมกับธนาคารพาณิชย์

1. **Notional Outstanding Currency**

สกุลเงินของจำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่ที่ WWW.BOT.OR.TH

1. **Notional Outstanding Amount**

จำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ ทั้งนี้ในกรณีธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่มีขารับหรือขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขาที่เป็นเงินตราต่างประเทศ หรือหากเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ทั้งขารับและขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขารับ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Notional Outstanding Amount เป็น 0

1. **Notional Baht Equivalent**

จำนวนเงินเทียบเท่าสกุลเงินบาทของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่เกี่ยวข้องกับเงินตราต่างประเทศ โดยในการคำนวณมูลค่า baht equivalent ให้ใช้อัตรากลาง (mid rate) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศที่ประกาศทางเว็บไซต์ของธนาคารแห่งประเทศไทย ณ วันสิ้นงวดการรายงานซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยของอัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนและอัตราขายถัวเฉลี่ย ([อัตราซื้อถัวเฉลี่ย + อัตราขายถัวเฉลี่ย] / 2)

1. **Reference Variables**

ประเภทของตัวแปรอ้างอิงตามประเภทที่กำหนด รวมถึงตัวแปรอ้างอิงอื่น ๆ ที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

1. **Reference Variables Details**

ชนิดของตัวแปรอ้างอิง ทั้งนี้ กรณีเป็นธุรกรรมที่อ้างอิงตัวแปรที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด ให้ธนาคารพาณิชย์รายงานรายละเอียดหรือวิธีการคำนวณตัวแปรอ้างอิงโดยละเอียด

1. **Payout**

รายละเอียด (สูตร) การคำนวณในการรับ-จ่ายเงินในธุรกรรมดังกล่าวในมุมมองของธนาคารพาณิชย์ ทั้งนี้ ธนาคารพาณิชย์สามารถเลือกไม่รายงานรายการนี้ได้ แต่ต้องจัดเตรียมเอกสารรายละเอียดดังกล่าวไว้ที่สถานที่ทำการ เพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยตรวจสอบ หรือจัดส่งให้แก่ธนาคารแห่งประเทศไทยเมื่อมีการร้องขอ

|  |  |
| --- | --- |
| **ตัวอย่าง** ธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรม seagull options เพื่อขายเงินสกุลดอลลาร์สหรัฐอเมริกา (USD) มูลค่า USD 1 ล้าน โดยมีองค์ประกอบย่อยเป็นธุรกรรม options 3 ธุรกรรม และจำนวนเงินตามสัญญาธุรกรรมละ USD 1 ล้าน ดังนี้  **(1) ขาย put options @ K1 (2) ซื้อ put options @ K2 และ (3) ขาย call options @ K3**  ราคาตลาด (ST)  K1  กำไร / ขาดทุน    K3  K2 | |
| **การรายงาน Payout ของธุรกรรม** | |
| ST < K1 | ธนาคารพาณิชย์ซื้อ USD มูลค่า USD 1 ล้าน @ K1 ตามธุรกรรม (1) และ  ขาย USD มูลค่า USD 1 ล้าน @ K2 ตามธุรกรรม (2) |
| K1 < ST < K2 | ธนาคารพาณิชย์ขาย USD มูลค่า USD 1 ล้าน @ K2 ตามธุรกรรม (2) |
| K2 < ST < K3 | ธนาคารพาณิชย์ขาย USD มูลค่า USD 1 ล้าน @ ST |
| ST > K3 | ธนาคารพาณิชย์ขาย USD มูลค่า USD 1 ล้าน @ K3 ตามธุรกรรม (3) |

1. **Derivatives Component**

รายละเอียดธุรกรรมอนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ทำ พร้อมทั้งระบุว่าธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมย่อยดังกล่าวในฐานะผู้ซื้อ หรือผู้ขาย หรือผู้รับ หรือผู้จ่าย ตามแต่ละธุรกรรมอนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดดังกล่าว ทั้งนี้ ในกรณีที่ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดดังกล่าวไม่สามารถแยกองค์ประกอบย่อยได้ ให้อธิบายรายละเอียดของธุรกรรม สำหรับธุรกรรมเงินให้สินเชื่อที่ธนาคารพาณิชย์ทำพร้อมธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด ให้ธนาคารพาณิชย์ชี้แจงรายละเอียดของทั้งธุรกรรมเงินให้สินเชื่อและธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดในรายการนี้

ทั้งนี้ ธนาคารพาณิชย์สามารถเลือกไม่รายงานรายการนี้ได้ แต่ต้องจัดเตรียมเอกสารรายละเอียดดังกล่าวไว้ที่สถานที่ทำการ เพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยตรวจสอบ หรือจัดส่งให้แก่ธนาคารแห่งประเทศไทยเมื่อมีการร้องขอ

1. **Type of Delivery**

ธุรกรรมกำหนดเงื่อนไขการส่งมอบและชำระราคาเป็นสินทรัพย์อ้างอิง (physical settlement) หรือเงินสด (cash settlement)

1. **Transaction Purpose**

วัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม

1. **Effective Notional Amount**

จำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” โดยให้ธนาคารพาณิชย์อ้างอิงวิธีการหาจำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของคู่สัญญาสำหรับธุรกรรมอนุพันธ์ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Effective Notional Amount เป็น 0

1. **Mark-to-Market**

มูลค่าที่ได้จากการ mark-to-market ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด ณ วันที่รายงานเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Mark-to-Market ด้วยมูลค่ายุติธรรม ณ วันที่ธุรกรรมสิ้นสุด

1. **Gain or Loss**

มูลค่ากำไรหรือขาดทุนจากการทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด ณ วันที่รายงานโดยเปรียบเทียบกับวันสิ้นเดือนก่อนหน้า เป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” ทั้งนี้ ให้ใส่เครื่องหมายติดลบ (-) ในกรณีเป็นผลขาดทุน

1. **หนังสือให้ความเห็นชอบ**

เลขที่หนังสือให้ความเห็นชอบการทำธุรกรรมจากสายกำกับสถาบันการเงิน ในกรณีเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ต้องได้รับความเห็นชอบจากธนาคารแห่งประเทศไทย

1. **Notes**

รายงานรายละเอียดเพิ่มเติมอื่น ๆ จากการทำธุรกรรม นอกจากนี้ หากเป็นธุรกรรม Back-to-back ให้กรอก “BTB” และตามด้วย Ref.no. ของธุรกรรมที่เกี่ยวข้อง เช่น “BTB ABC-1234”

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Transaction Purpose” มีค่าเป็น 0794000999 Others

## ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง (DS\_MLN)

**Data Set Description**

ข้อมูลธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง

Reporting Scope : รายงานธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝงทุกประเภทที่มียอดคงค้างเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน(รวมถึงธุรกรรมใหม่ที่ทำเป็นครั้งแรกและสิ้นสุดในระหว่างงวดรายงาน) โดยรายงานเป็นรายสัญญาเรียงลำดับตามวันทำสัญญา (Trade Date)

**Data Set Overview**

| No | Data Element | Key | Req. | Data Type | Format | Validation | Classification |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | รหัสสถาบัน | PK | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 2 | งวดข้อมูล | PK | M | Date | Char(10) |  |  |
| 3 | ชื่อผู้จัดทำ |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 4 | โทรศัพท์ |  | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 5 | อีเมล |  | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 6 | Ref No. | PK | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 7 | New Product |  | M | String | Char(1) | CNMLN001 |  |
| 8 | Trade Date |  | M | Date | Char(10) |  |  |
| 9 | Value Date |  | M | Date | Char(10) | CNMLN002 |  |
| 10 | Maturity Date |  | M | Date | Char(10) | CNMLN003 |  |
| 11 | Name of Product |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 12 | Type of Product |  | M | Classification | VarChar(200) |  | Structured Product Borrowing Type Code |
| 13 | Derivatives Counterparty Type |  | M | Classification | VarChar(200) |  | Derivatives Counterparty Type Code |
| 14 | Counterparty Name |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 15 | Borrower or Lender |  | M | String | VarChar(10) | CNMLN004 |  |
| 16 | Notional Outstanding Currency |  | M | Classification | Char(3) |  | Currency Code |
| 17 | Notional Outstanding Amount |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNMLN005 |  |
| 18 | Notional Baht Equivalent |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNMLN006  CNMLN009 |  |
| 19 | Reference Variables |  | M | Classification | VarChar(200) |  | Derivatives Reference Variables Code |
| 20 | Reference Variables Details |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 21 | Payout |  | O | String | VarChar(128) |  |  |
| 22 | Delivery |  | M | Classification | VarChar(200) |  | Derivatives Delivery Code |
| 23 | Transaction Purpose |  | M | Classification | VarChar(200) |  | Derivatives Transaction Purpose Code |
| 24 | Embedded Derivatives – Derivatives Components |  | O | String | VarChar(128) |  |  |
| 25 | Embedded Derivatives - Effective Notional Amount |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNMLN007 |  |
| 26 | Embedded Derivatives - Mark-to-Market |  | M | Numeric | Number(20,2) |  |  |
| 27 | Gain or Loss |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNMLN008 |  |
| 28 | Principal Protection (%) |  | O | Numeric | Number(20,2) |  |  |
| 29 | หนังสือให้ความเห็นชอบ |  | O | String | VarChar(128) |  |  |
| 30 | Notes |  | C | String | VarChar(400) | CMMLN001 |  |

**Data Element Description**

1. **รหัสสถาบัน**

รหัสประจำตัวผู้รายงานข้อมูล หากเป็นธุรกิจสถาบันการเงินและธุรกิจการเงินอื่นที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) หรือจัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติ (พรบ.) พระราชกำหนด (พรก.) หรือกฎหมายอื่นที่เกี่ยวข้อง ให้รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสถาบันการเงิน” ที่เผยแพร่ที่ www.bot.or.th (FI Code 3 หลัก) ผู้รายงานข้อมูลที่นอกจากข้างต้นให้รายงานด้วยเลขจดทะเบียนที่ออกโดยทางการ เช่น เลขทะเบียนนิติบุคคล 13 หลัก

1. **งวดข้อมูล**

วันที่ ณ สิ้นเดือนของงวดการรายงาน ระบุเป็น ปี ค.ศ. (YYYY-MM-DD)

1. **ชื่อผู้จัดทำ**

ชื่อผู้จัดทำรายงาน

1. **โทรศัพท์**

เบอร์โทรศัพท์ผู้จัดทำรายงาน

1. **อีเมล**

อีเมลผู้จัดทำรายงาน

1. **Ref No.**

เลขที่อ้างอิงของธุรกรรม เช่น เลขที่บัญชี เลขที่ confirmation หรือเลขที่สัญญา

1. **New Product**

ธุรกรรมใหม่

Y = การทำธุรกรรมในกรณีต่อไปนี้

1. การทำธุรกรรมประเภทใหม่ที่ทำเป็นครั้งแรก
2. การอ้างอิงตัวแปรประเภทหนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
3. การอ้างอิงดัชนีทางการเงินหรือผลดำเนินงานของกองทุนหรือกองทรัสต์หนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
4. กรณีอื่น ๆ ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

N = ไม่เข้าเงื่อนไขข้างต้น

1. **Trade Date**

วันทำสัญญา

1. **Value Date**

วันที่กำหนดมูลค่า

1. **Maturity Date**

วันครบกำหนดสัญญา

1. **Name of Product**

ชื่อเรียกธุรกรรมซึ่งเป็นที่รู้จักกันทั่วไปหรือชื่อทางการค้าของธุรกรรมนั้น

1. **Type of Product**

ประเภทของธุรกรรมเงินกู้ยืม เช่น พันธบัตร หุ้นกู้ ตั๋วสัญญาใช้เงิน และตั๋วแลกเงิน

1. **Counterparty Type**

ประเภทคู่สัญญา

1. **Counterparty Name**

ชื่อคู่สัญญาที่ทำธุรกรรมกับธนาคารพาณิชย์

1. **Borrower or Lender**

ธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมดังกล่าวในฐานะเป็นผู้กู้ยืมหรือผู้ให้กู้ยืม

1. **Notional Outstanding Currency**

สกุลเงินของจำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่ที่ www.bot.or.th

1. **Notional Outstanding Amount**

จำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ ทั้งนี้ในกรณีธุรกรรมที่มีขารับหรือขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขาที่เป็นเงินตราต่างประเทศ หรือหากเป็นธุรกรรมที่ทั้งขารับและขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขารับ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Notional Outstanding Amount เป็น 0

1. **Notional Baht Equivalent**

จำนวนเงินเทียบเท่าสกุลเงินบาทของธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับเงินตราต่างประเทศ โดยในการคำนวณมูลค่า baht equivalent ให้ใช้อัตรากลาง (mid rate) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศที่ประกาศทางเว็บไซต์ของธนาคารแห่งประเทศไทย ณ วันสิ้นงวดการรายงานซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยของอัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนและอัตราขายถัวเฉลี่ย ([อัตราซื้อถัวเฉลี่ย + อัตราขายถัวเฉลี่ย] / 2)

1. **Reference Variables**

ประเภทของตัวแปรอ้างอิงตามประเภทที่กำหนด รวมถึงตัวแปรอ้างอิงอื่น ๆ ที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

1. **Reference Variables Details**

ชนิดของตัวแปรอ้างอิง ทั้งนี้ กรณีเป็นธุรกรรมที่อ้างอิงตัวแปรที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด ให้ธนาคารพาณิชย์รายงานรายละเอียดหรือวิธีการคำนวณตัวแปรอ้างอิงโดยละเอียด

1. **Payout**

รายละเอียด (สูตร) การคำนวณในการรับ-จ่ายเงินในธุรกรรมดังกล่าวในมุมมองของธนาคารพาณิชย์

ทั้งนี้ ธนาคารพาณิชย์สามารถเลือกไม่รายงานรายการนี้ได้ แต่ต้องจัดเตรียมเอกสารรายละเอียดดังกล่าวไว้ที่สถานที่ทำการ เพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยตรวจสอบ หรือจัดส่งให้แก่ธนาคารแห่งประเทศไทยเมื่อมีการร้องขอ

1. **Delivery**

เงื่อนไขการส่งมอบคืนหรือได้รับคืนในรูปตราสารหนี้ ตราสารทุน หรือเงินตราต่างประเทศในมุมมองของธนาคารพาณิชย์ กรณีธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมเงินกู้ยืมที่ให้สิทธิผู้กู้ยืมในการชำระคืน หรือให้สิทธิผู้ให้กู้ยืมในการรับชำระคืนเงินต้นหรือผลตอบแทนเป็นตราสารหนี้ ตราสารทุน หรือให้สิทธิผู้กู้ยืมหรือผู้ให้กู้ยืมในการซื้อขายหรือแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ

1. **Transaction Purpose**

วัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม

1. **Embedded Derivatives - Derivatives Components**

รายละเอียดของอนุพันธ์ด้านตลาดทั้งหมดที่แฝงอยู่ เช่น อนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบของอนุพันธ์แฝง แต่ละอนุพันธ์ย่อยนั้นธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมในด้านใด (ขารับ/จ่าย) จำนวนเงินในอนุพันธ์ย่อย (ระบุเฉพาะเจาะจงสำหรับแต่ละอนุพันธ์ย่อย) มีตัวแปรอ้างอิงใดบ้าง ราคาใช้สิทธิ อายุหรือวันสิ้นสุดของธุรกรรมย่อย เป็นต้น ในกรณีที่ธุรกรรมดังกล่าวไม่สามารถแยกองค์ประกอบย่อยได้ให้อธิบายรายละเอียดของธุรกรรม

ทั้งนี้ ธนาคารพาณิชย์สามารถเลือกไม่รายงานรายการนี้ได้ แต่ต้องจัดเตรียมเอกสารรายละเอียดดังกล่าวไว้ที่สถานที่ทำการ เพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยตรวจสอบ หรือจัดส่งให้แก่ธนาคารแห่งประเทศไทยเมื่อมีการร้องขอ

1. **Embedded Derivatives - Effective Notional Amount**

จำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงของอนุพันธ์ด้านตลาดทั้งหมดที่แฝงอยู่ เป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” โดยให้ธนาคารพาณิชย์อ้างอิงวิธีการหาจำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของคู่สัญญาสำหรับธุรกรรมอนุพันธ์ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Effective Notional Amount เป็น 0

1. **Embedded Derivatives - Mark-to-Market**

มูลค่าที่ได้จากการ mark-to-market อนุพันธ์ด้านตลาดทั้งหมดที่แฝงอยู่ ณ วันที่รายงานเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Mark-to-Market ด้วยมูลค่ายุติธรรม ณ วันที่ธุรกรรมสิ้นสุด

1. **Gain or Loss**

มูลค่ากำไรหรือขาดทุนจากการทำธุรกรรม ณ วันที่รายงานโดยเปรียบเทียบกับวันสิ้นเดือนก่อนหน้า เป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” ทั้งนี้ ให้ใส่เครื่องหมายติดลบ (-) ในกรณีเป็นผลขาดทุน

1. **Principal Protection (%)**

ร้อยละของเงินต้นขั้นต่ำที่ผู้ให้กู้ยืมจะได้รับชำระคืนเมื่อสิ้นสุดสัญญา

1. **หนังสือให้ความเห็นชอบ**

เลขที่หนังสือให้ความเห็นชอบการทำธุรกรรมจากสายกำกับสถาบันการเงิน ในกรณีเป็นธุรกรรมที่ต้องได้รับความเห็นชอบจากธนาคารแห่งประเทศไทย

1. **Notes**

รายละเอียดเพิ่มเติมอื่น ๆ จากการทำธุรกรรม นอกจากนี้ หากเป็นธุรกรรม Back-to-back ให้กรอก “BTB” และตามด้วยRef.no. ของธุรกรรมที่เกี่ยวข้อง เช่น “BTB ABC-1234”

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Type of Product” มีค่าเป็น 0794100999 เงินกู้ยืมอื่น ๆ หรือ “Transaction Purpose” มีค่าเป็น 0794000999 Others

## ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต (DS\_CDD)

**Data Set Description**

ข้อมูลธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต

Reporting Scope : รายงานธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตทุกประเภทที่มียอดคงค้างเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน (รวมถึงธุรกรรมใหม่ที่ทำเป็นครั้งแรกและสิ้นสุดในระหว่างงวดรายงาน) โดยรายงานเป็นรายสัญญาเรียงลำดับตามวันทำสัญญา (Trade Date)

**Data Set Overview**

| No | Data Element | Key | Req. | Data Type | Format | Validation | Classification |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | รหัสสถาบัน | PK | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 2 | งวดข้อมูล | PK | M | Date | Char(10) |  |  |
| 3 | ชื่อผู้จัดทำ |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 4 | โทรศัพท์ |  | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 5 | อีเมล |  | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 6 | Ref No. | PK | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 7 | New Product |  | M | String | Char(1) | CNCDD001 |  |
| 8 | Trade Date |  | M | Date | Char(10) |  |  |
| 9 | Value Date |  | M | Date | Char(10) | CNCDD002 |  |
| 10 | Maturity Date |  | M | Date | Char(10) | CNCDD003 |  |
| 11 | Name of Product |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 12 | Derivatives Counterparty Type |  | M | Classification | VarChar(200) |  | Derivatives Counterparty Type Code |
| 13 | Counterparty Name |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 14 | Notional Outstanding Currency |  | M | Classification | Char(3) |  | Currency Code |
| 15 | Notional Outstanding Amount |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNCDD006 |  |
| 16 | Notional Baht Equivalent |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNCDD007  CNCDD010 |  |
| 17 | Reference Obligations Name / Series |  | M | String | VarChar(128) |  |  |
| 18 | Reference Obligations Maturity |  | O | Date | Char(10) |  |  |
| 19 | Reference Obligations Currency |  | M | Classification | Char(3) |  | Currency Code |
| 20 | Underlying Obligations Name / Series |  | O | String | VarChar(128) |  |  |
| 21 | Underlying Obligations Maturity |  | C | Date | Char(10) | CMCDD001 |  |
| 22 | Underlying Obligations Currency |  | C | Classification | Char(3) | CMCDD002 | Currency Code |
| 23 | Derivatives Components |  | O | String | VarChar(128) |  |  |
| 24 | Transaction Purpose |  | M | Classification | VarChar(200) |  | Derivatives Transaction Purpose Code |
| 25 | Effective Notional Amount |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNCDD008 |  |
| 26 | Mark-to-Market |  | M | Numeric | Number(20,2) |  |  |
| 27 | Gain or Loss |  | M | Numeric | Number(20,2) | CNCDD009 |  |
| 28 | Protection Buyer or Seller |  | M | String | VarChar(20) | CNCDD005 |  |
| 29 | Rating |  | O | String | VarChar(20) |  |  |
| 30 | Type of Delivery |  | M | String | VarChar(10) | CNCDD004 |  |
| 31 | หนังสือให้ความเห็นชอบ |  | O | String | VarChar(128) |  |  |
| 32 | Notes |  | C | String | VarChar(400) | CMCDD003 |  |

**Data Element Description**

1. **รหัสสถาบัน**

รหัสประจำตัวผู้รายงานข้อมูล หากเป็นธุรกิจสถาบันการเงินและธุรกิจการเงินอื่นที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) หรือจัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติ (พรบ.) พระราชกำหนด (พรก.) หรือกฎหมายอื่นที่เกี่ยวข้อง ให้รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสถาบันการเงิน” ที่เผยแพร่ที่ www.bot.or.th (FI Code 3 หลัก) ผู้รายงานข้อมูลที่นอกจากข้างต้นให้รายงานด้วยเลขจดทะเบียนที่ออกโดยทางการ เช่น เลขทะเบียนนิติบุคคล 13 หลัก

1. **งวดข้อมูล**

วันที่ ณ สิ้นเดือนของงวดการรายงาน ระบุเป็น ปี ค.ศ. (YYYY-MM-DD)

1. **ชื่อผู้จัดทำ**

ชื่อผู้จัดทำรายงาน

1. **โทรศัพท์**

เบอร์โทรศัพท์ผู้จัดทำรายงาน

1. **อีเมล**

อีเมลผู้จัดทำรายงาน

1. **Ref No.**

เลขที่อ้างอิงของธุรกรรม เช่น เลขที่บัญชี เลขที่ confirmation หรือเลขที่สัญญา

1. **New Product**

ธุรกรรมใหม่

Y = การทำธุรกรรมในกรณีต่อไปนี้

1. การทำธุรกรรมประเภทใหม่ที่ทำเป็นครั้งแรก
2. การอ้างอิงตัวแปรประเภทหนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
3. การอ้างอิงดัชนีทางการเงินหรือผลดำเนินงานของกองทุนหรือกองทรัสต์หนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
4. กรณีอื่น ๆ ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

N = ไม่เข้าเงื่อนไขข้างต้น

1. **Trade date**

วันทำสัญญา

1. **Value date**

วันที่กำหนดมูลค่า

1. **Maturity Date**

วันครบกำหนดสัญญา

1. **Name of product**

ชื่อเรียกธุรกรรมซึ่งเป็นที่รู้จักกันทั่วไปหรือชื่อทางการค้าของธุรกรรมนั้น

1. **Derivatives Counterparty Type**

ประเภทคู่สัญญา

1. **Counterparty Name**

ชื่อคู่สัญญาที่ทำธุรกรรมกับธนาคารพาณิชย์

1. **Notional Outstanding Currency**

สกุลเงินของจำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่ที่ www.bot.or.th

1. **Notional Outstanding Amount**

จำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ ทั้งนี้ในกรณีธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่มีขารับหรือขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขาที่เป็นเงินตราต่างประเทศ หรือหากเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ทั้งขารับและขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขารับ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Notional Outstanding Amount เป็น 0

1. **Notional Baht Equivalent**

จำนวนเงินเทียบเท่าสกุลเงินบาทของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่เกี่ยวข้องกับเงินตราต่างประเทศ โดยในการคำนวณมูลค่า baht equivalent ให้ใช้อัตรากลาง (mid rate) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศที่ประกาศทางเว็บไซต์ของธนาคารแห่งประเทศไทย ณ วันสิ้นงวดการรายงานซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยของอัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนและอัตราขายถัวเฉลี่ย ([อัตราซื้อถัวเฉลี่ย + อัตราขายถัวเฉลี่ย] / 2)

1. **Reference Obligations Name / Series**

ชื่อ รุ่น ของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ใช้อ้างอิงสำหรับการจ่ายชำระเงินภายใต้สัญญาอนุพันธ์ด้านเครดิต

1. **Reference Obligations Maturity**

วันครบกำหนดสัญญาของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ใช้อ้างอิง

1. **Reference Obligations Currency**

สกุลเงินของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ใช้อ้างอิง รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่ที่ www.bot.or.th

1. **Underlying Obligations Name / Series**

ชื่อ รุ่น ของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ธนาคารพาณิชย์มีฐานะอยู่และต้องการป้องกันความเสี่ยงโดยใช้ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต ซึ่งอาจเป็นสินทรัพย์หรือภาระผูกพันเดียวกับ reference obligations ได้

1. **Underlying Obligations Maturity**

วันครบกำหนดสัญญาของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันของธนาคารพาณิชย์

1. **Underlying Obligations Currency**

สกุลเงินของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันของธนาคารพาณิชย์ รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่ที่ [WWW.bOT.OR.TH](http://WWW.bOT.OR.TH)

1. **Derivatives Component**

รายละเอียดธุรกรรมอนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ทำ เฉพาะกรณีเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ความเห็นชอบ พร้อมทั้งระบุฐานะของธนาคารพาณิชย์ในการทำธุรกรรมย่อยดังกล่าว ทั้งนี้ ในกรณีที่ธุรกรรมดังกล่าวไม่สามารถแยกองค์ประกอบย่อยได้ให้อธิบายรายละเอียดของธุรกรรม ทั้งนี้ ธนาคารพาณิชย์สามารถเลือกไม่รายงานรายการนี้ได้ แต่ต้องจัดเตรียมเอกสารรายละเอียดดังกล่าวไว้ที่สถานที่ทำการ เพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยตรวจสอบ หรือจัดส่งให้แก่ธนาคารแห่งประเทศไทยเมื่อมีการร้องขอ

1. **Transaction Purpose**

วัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม

1. **Effective Notional Amount**

จำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” โดยให้ธนาคารพาณิชย์อ้างอิงวิธีการหาจำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของคู่สัญญาสำหรับธุรกรรมอนุพันธ์ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Effective Notional Amount เป็น 0

1. **Mark-to-Market**

มูลค่าที่ได้จากการ mark-to-market ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต ณ วันที่รายงานเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Mark-to-Market ด้วยมูลค่ายุติธรรม ณ วันที่ธุรกรรมสิ้นสุด

1. **Gain or Loss**

มูลค่ากำไรหรือขาดทุนจากการทำธุรกรรม ณ วันที่รายงานโดยเปรียบเทียบกับวันสิ้นเดือนก่อนหน้า เป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” ทั้งนี้ ให้ใส่เครื่องหมายติดลบ (-) ในกรณีเป็นผลขาดทุน

1. **Protection Buyer or Seller**

ธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตดังกล่าวในฐานะเป็นผู้โอนความเสี่ยงด้านเครดิตให้รายงาน “Protection Buyer” หรือผู้รับโอนความเสี่ยงด้านเครดิตให้รายงาน “Protection Seller”

1. **Rating**

อันดับความน่าเชื่อถือของตราสารในกรณีเป็นธุรกรรม Funded Credit Derivatives ที่ได้รับจากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือภายนอก

1. **Type of Delivery**

ธุรกรรมกำหนดเงื่อนไขการส่งมอบและชำระราคาเป็นสินทรัพย์อ้างอิงให้รายงาน “Physical” หรือเงินสดให้รายงาน “Cash”

1. **หนังสือให้ความเห็นชอบ**

เลขที่หนังสือให้ความเห็นชอบการทำธุรกรรมจากสายกำกับสถาบันการเงิน ในกรณีเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ต้องได้รับความเห็นชอบจากธนาคารแห่งประเทศไทย

1. **Notes**

รายงานรายละเอียดเพิ่มเติมอื่น ๆ จากการทำธุรกรรมนอกจากนี้ หากเป็นธุรกรรม Back-to-back ให้กรอก “BTB” และตามด้วย Ref.no. ของธุรกรรมที่เกี่ยวข้อง เช่น “BTB ABC-1234”

เงื่อนไข ต้องรายงาน กรณี “Transaction Purpose” มีค่าเป็น 0794000999 Others

# Data Type

| Data Type | Format | Sample Data Set : Data Element | Sample Value |
| --- | --- | --- | --- |
| Classification | Char(3) | DS\_SDV : Notional Outstanding Currency | USD |
|  | VarChar(200) | DS\_MLN : Delivery | 0794200003 - เงินตราต่างประเทศ |
|  | VarChar(200) | DS\_MLN : Reference Variables | 0793800003 - ราคาตราสารหนี้ |
| Date | Char(10) | DS\_MLN : Maturity Date | 2022-07-31  รายงานเป็น ปี ค.ศ. เดือน วัน |
| Numeric | Number(20,2) | DS\_SDV : Mark-to-Market | 123456789.00 |
| String | Char(10) | DS\_CDD : โทรศัพท์ | 022836163 |
| VarChar(10) | DS\_MLN : Borrower or Lender | Borrower |
| VarChar(20) | DS\_CDD : Rating  DS\_CDD : Protection Buyer or Seller | BBB  Protection Seller |
| VarChar(40) | DS\_SDV : รหัสสถาบัน | 001 |
| VarChar(128) | DS\_MLN : Counterparty Name | บริษัท คล่องค้า จำกัด |
|  | VarChar(400) | DS\_SDV : Notes | BTB ABC-1234 |
|  | Char(1) | DS\_CDD : New Product | Y |

# Data Validation Overview

การตรวจสอบความถูกต้องและความสอดคล้องของข้อมูล ได้แก่ File Validation, All Entities Validation และ Data Validation ซึ่งประกอบด้วย 2 เรื่อง ได้แก่

1. **Consistency (CN)** เพื่อตรวจสอบความสอดคล้องของข้อมูลตามธุรกิจ เช่น วันที่สัญญาครบกำหนด (Maturity Date) ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับวันที่สัญญามีผล (Effective Date) รวมทั้งการรายงานข้อมูลให้สอดคล้องกับขอบเขตการรายงานที่ ธปท. กำหนด
2. **Completeness (CM)** เพื่อตรวจสอบความครบถ้วนของข้อมูลให้เป็นไปตามเงื่อนไขทางธุรกิจ กรณีที่ Data Element นั้นมีค่าแล้ว Data Element ที่เกี่ยวข้องกัน ต้องมีการรายงานข้อมูลเข้ามาให้ครบถ้วนและถูกต้องด้วย เช่น กรณีที่ Transaction Purpose มีค่าเป็น “0794000999 - Others” แล้ว Notes ต้องมีค่า

**สรุปการตรวจสอบความถูกต้องของข้อมูล**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Data Set Group | Data Set Name | ABBR | Consistency | Completeness |
| รายงานยอดคงค้างตราสารอนุพันธ์และธุรกรรมที่เกี่ยวข้อง | 1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด | DS\_SDV |  |  |
| 1.1 ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภท ธุรกรรม (SDVP) |  | X | X |
| 1.2. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา (SDVT) |  | X | X |
| 2. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง | DS\_MLN | X | X |
| 3. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต | DS\_CDD | X | X |

# 

# Data Validation Detail

## File Validation

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Validation Id | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| FV001 | จำนวน Data Element ต้องครบตามที่กำหนดในเอกสาร Data Set and Data Elements | The number of Data Element must match as specified in the Data Set and Data Elements Document. | Basic |
| FV002 | รูปแบบไฟล์ต้องเป็นไฟล์นามสกุลตามที่กำหนดเท่านั้น | The file extension or file type must be as specified. | Basic |
| FV003/1 | ข้อมูลต้องใช้ character encoding ในรูปแบบ UTF-8 เท่านั้น | The data must encoded as UTF-8. | Basic |
| FV004/1 | กรณีไม่ใช่ไฟล์ว่าง ไฟล์ต้องประกอบด้วยข้อมูล 2 ส่วน ได้แก่  Header และเนื้อหาข้อมูลอย่างน้อย 1 บรรทัด | Apart from a blank file, the data file must consist of a ‘header part’ and a ‘content part’, both of which contains at least one data record. | Basic |
| FV005/1 | กรณีข้อมูลถูกกำหนดให้ไม่สามารถส่งไฟล์ว่างได้ ข้อมูลที่นำส่งต้องมีขนาดไฟล์มากกว่า 0 bytes | If data submission is required, the file size must be greater than 0 bytes. | Basic |
| FV006/2 | กรณีไฟล์นามสกุล .xlsx ชื่อ sheet ต้องตรงตามที่กำหนดไว้ใน template | For .xlsx file type, the sheet name must be as pre-filled within the template. | Basic |

1/ สำหรับ File Format Type: CSV  
2/ สำหรับ File Format Type: xlsx

## All Entities Validation

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Validation Id | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| CN001 | ข้อมูลต้องตรงกับ Data Type และ Format ตามที่ระบุในเอกสาร Data Set and Data Elements | Data type and data format must be the same as specified in Data Set and Data Elements Document. | Basic |
| CN002 | Data Element ที่มีค่า Key เป็น PK ตามที่ระบุในเอกสาร Data Set and Data Elements จะต้องมีค่าไม่ซ้ำกัน | A primary key must uniquely identify each record. | Complex |
| CN003 | Data Element ที่มีค่า Req. เป็น M ต้องมีค่าเสมอ | A mandatory data element cannot be blank. | Complex |
| CN004 | ข้อมูลต้องตรงกับ possible value ของ Classification และ View (ถ้ามี) ที่ระบุในเอกสาร Data Set | Classification code must be in the code list of classification or view as specified in Classification Document. | Complex |
| CN005 | Data Date ต้องตรงกับวันที่ของงวดข้อมูลที่เลือกบนช่องทางการรับส่งข้อมูล (Data Acquisition) | Data date must be consistent with the frequency of data reporting requirement. | Complex |
| CN006 | รหัสประจำตัวผู้รายงานข้อมูลต้องตรงตามที่กำหนด หากเป็นธุรกิจสถาบันการเงินและธุรกิจการเงินอื่นที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของ ธปท. หรือจัดตั้งขึ้นตาม พรบ. พรก. หรือกฎหมายอื่นที่เกี่ยวข้อง ให้รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสถาบันการเงิน” ที่เผยแพร่ที่ WWW.BOT.OR.TH (FI Code 3 หลัก) ผู้รายงานข้อมูลที่นอกจากข้างต้นให้รายงานด้วยเลขจดทะเบียนที่ออกโดยทางการ เช่น เลขทะเบียนนิติบุคคล 13 หลัก | Organization ID must be identified by financial Institution code (FI Code), or juristic identification number as specified by the BOT standard. | Complex |
| CN007 | ข้อมูลต้องตรงกับ possible value ของ Data Type | Data must correspond with Data Type. | Complex |
| CN008 | ข้อมูลที่มี Data Type เป็น Date (YYYY-MM-DD) จะต้องรายงานเป็น ปี ค.ศ. เท่านั้น และต้องต่างไม่เกิน 200 ปี นับจากปี ค.ศ. ของวันที่ของงวดข้อมูล (Data Date) | The date (YYYY-MM-DD) must be A.D. and valid date value range must not exceed 200 years from Data date. | Complex |
| CN999 | ไม่สามารถส่งข้อมูลได้ เนื่องจากความผิดพลาดของระบบหรือความผิดพลาดอื่น ๆ สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้ที่ฟิลด์ Information | Data cannot be submitted because of system error or others, please see more detail at the information field. | Basic |

## 

## Data Validation

### 1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด (DS\_SDV)

#### **1.1 ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม (SDVP)**

**Consistency**

| Validation Id | Validation Rule | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| CNSDVP001 | [SDVP.อัตราแลกเปลี่ยน - Notional Amount] >= 0 | อัตราแลกเปลี่ยน - Notional Amount ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 | [อัตราแลกเปลี่ยน - Notional Amount] must be greater than or equal to zero. | Complex |

**Completeness**

| Validation Id | Validation Rule | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| CMSDVP001 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.อัตราดอกเบี้ย - Notional Amount] IS NULL  ELSE  [SDVP.อัตราดอกเบี้ย - Notional Amount] >= 0  END IF | อัตราดอกเบี้ย - Notional Amount ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” อัตราดอกเบี้ย - Notional Amount ต้องมีค่าเป็น Null | [อัตราดอกเบี้ย - Notional Amount] must be greater than or equal to zero, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [อัตราดอกเบี้ย - Notional Amount] must be Null. | Complex |
| CMSDVP002 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.อัตราดอกเบี้ย - MTM] IS NULL  ELSE  [SDVP.อัตราดอกเบี้ย - MTM] IS NOT NULL  END IF | อัตราดอกเบี้ย – MTM ต้องมีค่าเสมอ ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” อัตราดอกเบี้ย – MTM ต้องมีค่าเป็น Null | [อัตราดอกเบี้ย – MTM] must contain a value, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [อัตราดอกเบี้ย – MTM] must be Null. | Complex |
| CMSDVP003 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.ราคาตราสารหนี้ - Notional Amount] IS NULL  ELSE  [SDVP.ราคาตราสารหนี้ - Notional Amount] >= 0  END IF | ราคาตราสารหนี้ - Notional Amount ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” ราคาตราสารหนี้ - Notional Amount ต้องมีค่าเป็น Null | [ราคาตราสารหนี้ - Notional Amount] must be greater than or equal to zero, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ราคาตราสารหนี้ - Notional Amount]  must be Null. | Complex |
| CMSDVP004 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.ราคาตราสารหนี้ - MTM] IS NULL  ELSE  [SDVP.ราคาตราสารหนี้ - MTM] IS NOT NULL  END IF | ราคาตราสารหนี้ – MTM ต้องมีค่าเสมอ ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” ราคาตราสารหนี้ – MTM ต้องมีค่าเป็น Null | [ราคาตราสารหนี้ – MTM] must contain a value, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ราคาตราสารหนี้ – MTM] must be Null. | Complex |
| CMSDVP005 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.ราคาตราสารทุน - Notional Amount] IS NULL  ELSE  [SDVP.ราคาตราสารทุน - Notional Amount] >= 0  END IF | ราคาตราสารทุน - Notional Amount ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” ราคาตราสารทุน - Notional Amount  ต้องมีค่าเป็น Null | [ราคาตราสารทุน - Notional Amount] must be greater than or equal to zero, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ราคาตราสารทุน - Notional Amount] must be Null. | Complex |
| CMSDVP006 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’ THEN  [SDVP.ราคาตราสารทุน - MTM] IS NULL  ELSE  [SDVP.ราคาตราสารทุน - MTM] IS NOT NULL  END IF | ราคาตราสารทุน – MTM ต้องมีค่าเสมอ ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” ราคาตราสารทุน – MTM ต้องมีค่าเป็น Null | [ราคาตราสารทุน – MTM] must contain a value, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ราคาตราสารทุน - MTM] must be Null. | Complex |
| CMSDVP007 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - Notional Amount] IS NULL  ELSE  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - Notional Amount] >= 0  END IF | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - Notional Amount ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rate และ flexible derivatives” ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - Notional Amount  ต้องมีค่าเป็น Null | [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - Notional Amount] must be greater than or equal to zero, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - Notional Amount] must be Null. | Complex |
| CMSDVP008 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - MTM] IS NULL  ELSE  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - MTM] IS NOT NULL  END IF | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) – MTM ต้องมีค่าเสมอ ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) – MTM ต้องมีค่าเป็น Null | [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) – MTM] must contain a value, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - MTM] must be Null. | Complex |
| CMSDVP009 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - Notional Amount] IS NULL  ELSE  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - Notional Amount] >= 0  END IF | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - Notional Amount ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - Notional Amount ต้องมีค่าเป็น Null | [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - Notional Amount] must be greater than or equal to zero, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - Notional Amount] must be Null. | Complex |
| CMSDVP010 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ – MTM] IS NULL  ELSE  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ – MTM] IS NOT NULL  END IF | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ – MTM ต้องมีค่าเสมอ ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ – MTM ต้องมีค่าเป็น Null | [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ – MTM] must contain a value, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - MTM] must be Null. | Complex |
| CMSDVP011 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - Notional Amount] IS NULL  ELSE  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - Notional Amount] >= 0  END IF | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - Notional Amount ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - Notional Amount ต้องมีค่าเป็น Null | [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - Notional Amount] must be greater than or equal to zero, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - Notional Amount] must be Null. | Complex |
| CMSDVP012 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ – MTM] IS NULL  ELSE  [SDVP.ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ – MTM] IS NOT NULL  END IF | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ – MTM ต้องมีค่าเสมอ ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ – MTM ต้องมีค่าเป็น Null | [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ – MTM] must contain a value, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - MTM] must be Null. | Complex |
| CMSDVP013 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.ดัชนีทางการเงิน - Notional Amount] IS NULL  ELSE  [SDVP.ดัชนีทางการเงิน - Notional Amount] >= 0  END IF | ดัชนีทางการเงิน - Notional Amount ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” ดัชนีทางการเงิน - Notional Amount ต้องมีค่าเป็น Null | [ดัชนีทางการเงิน - Notional Amount] must be greater than or equal to zero, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ดัชนีทางการเงิน - Notional Amount]  must be Null. | Complex |
| CMSDVP014 | IF LEFT([SDVP.Derivatives], 10) = ‘0793700010’  THEN  [SDVP.ดัชนีทางการเงิน – MTM] IS NULL  ELSE  [SDVP.ดัชนีทางการเงิน – MTM] IS NOT NULL  END IF | ดัชนีทางการเงิน – MTM ต้องมีค่าเสมอ ยกเว้น กรณี Derivatives มีค่าเป็น “0793700010 - FX pro-rata และ flexible derivatives” ดัชนีทางการเงิน – MTM ต้องมีค่าเป็น Null | [ดัชนีทางการเงิน – MTM] must contain a value, unless the value of [Derivatives] is “0793700010 - FX pro-rata and flexible derivatives”, then [ดัชนีทางการเงิน - MTM] must be Null. | Complex |

#### **1.2 ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา (SDVT)**

**Consistency**

| Validation Id | Validation Rule | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| CNSDVT001 | [SDVT.New Product] IN (‘Y’,’N’) | New Product ต้องมีค่าเท่ากับ Y หรือ N | [New Product] must be ‘Y’ or ‘N’ | Complex |
| CNSDVT002 | [SDVT.Value Date] >= [SDVT.Trade Date] | Value Date ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ Trade Date | [Value Date] must be greater than or equal to [Trade Date]. | Complex |
| CNSDVT003 | [SDVT.Maturity Date] > [SDVT.Value Date] | Maturity Date ต้องมีค่ามากกว่า Value Date | [Maturity Date] must be greater than [Value Date]. | Complex |
| CNSDVT004 | [SDVT.Type of Delivery] IN (“Cash”, “Physical”) | Type of Delivery ต้องมีค่าเท่ากับ “Cash” หรือ “Physical” | [Type of Delivery] must either be specified as “Cash” or “Physical”. | Complex |
| CNSDVT005 | IF [SDVT.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([SDVT.Maturity Date]) =  MONTH([SDVT.งวดข้อมูล])  AND YEAR([SDVT.Maturity Date]) =  YEAR([SDVT.งวดข้อมูล])  THEN [SDVT.Notional Outstanding Amount] = 0  ELSE [SDVT.Notional Outstanding Amount] > 0  END IF | Notional Outstanding Amount ต้องมีค่าเท่ากับ 0 กรณีที่ New Product มีค่าเป็น “Y” และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date นอกนั้น Notional Outstanding Amount ต้องมีค่ามากกว่า 0 | [Notional Outstanding Amount] must be equal to zero if [New Product] is ‘Y’ and the month and year of both [Maturity Date] and [Data Date] are equal, otherwise [Notional Outstanding Amount] must be greater than zero. | Complex |
| CNSDVT006 | IF [SDVT.Notional Outstanding Currency] = “THB”  THEN  [SDVT.Notional Baht Equivalent] = [SDVT.Notional Outstanding Amount]END IF | Notional Baht Equivalent ต้องมีค่าเท่ากับ Notional Outstanding Amount ถ้า Notional Outstanding Currency = THB | If [Notional Outstanding Currency] is “THB”, then [Notional Baht Equivalent] must equal to [Notional Outstanding Amount]. | Complex |
| CNSDVT007 | IF LEFT([SDVT.Reference Variables], 10) = ‘0793800005’  THEN [SDVT.Type of Delivery] = “Cash”  END IF | Type of Delivery ต้องมีค่าเป็น “Cash” ถ้า Reference Variables เท่ากับ 0793800005 ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ (commodities) | If [Reference Variables] is “0793800005 commodity price. (commodities)”, then the value of [Type of Delivery] must be “Cash”. | Complex |
| CNSDVT008 | IF [SDVT.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([SDVT.Maturity Date]) =  MONTH([SDVT.งวดข้อมูล])  AND YEAR([SDVT.Maturity Date]) =  YEAR([SDVT.งวดข้อมูล])  THEN [SDVT.Effective Notional Amount] = 0  ELSE [SDVT.Effective Notional Amount] > 0  END IF | Effective Notional Amount ต้องมีค่าเท่ากับ 0 กรณีที่ New Product มีค่าเป็น “Y” และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date นอกนั้น Effective Notional Amount ต้องมีค่ามากกว่า 0 | [Effective Notional Amount] must be equal to zero if [New Product] is ‘Y’ and the month and year of both [Maturity Date] and [Data Date] are equal, otherwise [Effective Notional Amount] must be greater than zero. | Complex |
| CNSDVT009 | IF [SDVT.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([SDVT.Maturity Date]) =  MONTH([SDVT.งวดข้อมูล])  AND YEAR([SDVT.Maturity Date]) =  YEAR([SDVT.งวดข้อมูล])  THEN [SDVT.Gain or Loss] = 0  END IF | Gain or Loss ต้องมีค่าเท่ากับ 0 กรณีที่ New Product มีค่าเป็น “Y” และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date | [Gain or Loss] must be equal to zero if [New Product] is ‘Y’ and the month and year of both [Maturity Date] and [Data Date] are equal. | Complex |
| CNSDVT010 | IF [SDVT.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([SDVT.Maturity Date]) =  MONTH([SDVT.งวดข้อมูล])  AND YEAR([SDVT.Maturity Date]) =  YEAR([SDVT.งวดข้อมูล])  THEN [SDVT.Notional Baht Equivalent] = 0  ELSE [SDVT.Notional Baht Equivalent] > 0  END IF | Notional Baht Equivalent ต้องมีค่าเท่ากับ 0 กรณีที่ New Product มีค่าเป็น “Y” และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date นอกนั้น Notional Baht Equivalent ต้องมีค่ามากกว่า 0 | [Notional Baht Equivalent] must be equal to zero if [New Product] is ‘Y’ and the month and year of both [Maturity Date] and [Data Date] are equal, otherwise [Notional Baht Equivalent] must be greater than zero. | Complex |

**Completeness**

| Validation Id | Validation Rule | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| CMSDVT001 | IF LEFT([SDVT.Transaction Purpose], 10) = ‘0794000999’  THEN  [SDVT.Notes] IS NOT NULL  END IF | Notes ต้องมีค่า ถ้า Transaction Purpose มีค่าเท่ากับ “0794000999 Others” | [Notes] must have a value if the [Transaction Purpose] is equal to “0794000999 Others”. | Complex |
| CMSDVT002 | IF LEFT([SDVT.Group of Product], 10) IN (‘0793700013’, ‘0793700014’)  THEN  [SDVT.หนังสือให้ความเห็นชอบ] IS NOT NULL  END IF | หนังสือให้ความเห็นชอบ ต้องมีค่า กรณีที่ Group of Product มีค่าเป็น “0793700013 ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ความเห็นชอบเป็นรายกรณี” หรือ “0793700014 ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ธนาคารแห่งประเทศไทยอนุญาตให้ทำได้ตามบทเฉพาะกาลของประกาศฉบับนี้” | [หนังสือให้ความเห็นชอบ] must have a value if the [Group of Product] is equal to “0793700013 ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ความเห็นชอบเป็นรายกรณี” or “0793700014 ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ธนาคารแห่งประเทศไทยอนุญาตให้ทำได้ตามบทเฉพาะกาลของประกาศฉบับนี้” | Complex |

### 2. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง (DS\_MLN)

**Consistency**

| Validation Id | Validation Rule | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| CNMLN001 | [MLN.New Product] IN (‘Y’, ‘N’) | New Product ต้องมีค่าเท่ากับ Y หรือ N | [New Product] must be ‘Y’ or ‘N’. | Complex |
| CNMLN002 | [MLN.Value Date] >= [MLN.Trade Date] | Value Date ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ Trade Date | [Value Date] must be greater than or equal to [Trade Date]. | Complex |
| CNMLN003 | [MLN.Maturity Date] > [MLN.Value Date] | Maturity Date ต้องมีค่ามากกว่า Value Date | [Maturity Date] must be greater than [Value Date]. | Complex |
| CNMLN004 | [MLN.Borrower or Lender] IN (“Borrower”, “Lender”) | Borrower or Lender ต้องมีค่าเท่ากับ “Borrower” หรือ “Lender” | [Borrower or Lender] must either be ‘Borrower’ or ‘Lender’. | Complex |
| CNMLN005 | IF [MLN.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([MLN.Maturity Date]) =  MONTH([MLN.งวดข้อมูล])  AND YEAR([MLN.Maturity Date]) =  YEAR([MLN.งวดข้อมูล])  THEN  [MLN.Notional Outstanding Amount] = 0  ELSE  [MLN.Notional Outstanding Amount] > 0  END IF | Notional Outstanding Amount ต้องมีค่าเท่ากับ 0 กรณีที่ New Product มีค่าเป็น “Y” และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date นอกนั้น Notional Outstanding Amount ต้องมีค่ามากกว่า 0 | [Notional Outstanding Amount] must be equal to zero if [New Product] is ‘Y’ and the month and year of both [Maturity Date] and [Data Date] are equal, otherwise [Notional Outstanding Amount] must be greater than zero. | Complex |
| CNMLN006 | IF [MLN.Notional Outstanding Currency] = “THB”  THEN  [MLN.Notional Baht Equivalent] =  [MLN.Notional Outstanding Amount]END IF | Notional Baht Equivalent ต้องเท่ากับ Notional Outstanding Amount ถ้า Notional Outstanding Currency = THB | If [Notional Outstanding Currency] is “THB”, then [Notional Baht Equivalent] must equal to [Notional Outstanding Amount]. | Complex |
| CNMLN007 | IF [MLN.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([MLN.Maturity Date] =  MONTH([MLN.งวดข้อมูล])  AND YEAR([MLN.Maturity Date]) =  YEAR([MLN.งวดข้อมูล])  THEN  [MLN.Embedded Derivatives - Effective Notional Amount] = 0  ELSE  [MLN.Embedded Derivatives - Effective Notional Amount] > 0  END IF | Embedded Derivatives - Effective Notional Amount ต้องมีค่าเท่ากับ 0 ถ้า New Product มีค่าเป็น “Y” และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date นอกนั้น Effective Notional Amount ต้องมีค่ามากกว่า 0 | [Embedded Derivatives - Effective Notional Amount] must be equal to zero if [New Product] is ‘Y’ and the month and year of both [Maturity Date] and [Data Date] are equal, otherwise [Derivatives Effective Notional Amount] must be greater than zero. | Complex |
| CNMLN008 | IF [MLN.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([MLN.Maturity Date]) =  MONTH([MLN.งวดข้อมูล])  AND YEAR([MLN.Maturity Date]) =  YEAR([MLN.งวดข้อมูล])  THEN [MLN.Gain or Loss] = 0  END IF | Gain or Loss ต้องมีค่าเท่ากับ 0 กรณีที่ New Product มีค่าเป็น “Y” และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date | [Gain or Loss] must be equal to zero if [New Product] is ‘Y’ and the month and year of both [Maturity Date] and [Data Date] are equal. | Complex |
| CNMLN009 | IF [MLN.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([MLN.Maturity Date]) =  MONTH([MLN.งวดข้อมูล])  AND YEAR([MLN.Maturity Date]) =  YEAR([MLN.งวดข้อมูล])  THEN [MLN.Notional Baht Equivalent] = 0  ELSE [MLN.Notional Baht Equivalent] > 0  END IF | Notional Baht Equivalent ต้องมีค่าเท่ากับ 0 กรณีที่ New Product มีค่าเป็น “Y” และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date นอกนั้น Notional Baht Equivalent ต้องมีค่ามากกว่า 0 | [Notional Baht Equivalent] must be equal to zero if [New Product] is ‘Y’ and the month and year of both [Maturity Date] and [Data Date] are equal, otherwise [Notional Baht Equivalent] must be greater than zero. | Complex |

**Completeness**

| Validation Id | Validation Rule | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| CMMLN001 | IF LEFT([MLN.Transaction Purpose], 10) = ‘0794000999’  OR (LEFT([MLN.Type of Product], 10) = ‘0794100999’  THEN  [MLN.Notes] IS NOT NULL  END IF | Notes ต้องมีค่า ถ้า Type of Product เท่ากับ “0794100999 เงินกู้ยืมอื่นๆ” หรือ Transaction Purpose เท่ากับ “0794000999 อื่นๆ” | If [Type of Product] is “0794100999 Other Borrowing” or [Transaction Purpose] is “0794000999 Other” then, [Notes] may not be left blank”. | Complex |

### 3. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต (DS\_CDD)

**Consistency**

| Validation Id | Validation Rule | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| CNCDD001 | [CDD.New Product] IN (‘Y’, ‘N’) | New Product ต้องมีค่าเท่ากับ Y หรือ N | [New Product] must be ‘Y’ or ‘N’. | Complex |
| CNCDD002 | [CDD.Value Date] >= [CDD.Trade Date] | Value Date ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ Trade Date | [Value Date] must be greater than or equal to [Trade Date]. | Complex |
| CNCDD003 | [CDD.Maturity Date] > [CDD.Value Date] | Maturity Date ต้องมีค่ามากกว่า Value Date | [Maturity Date] must be greater than [Value Date]. | Complex |
| CNCDD004 | [CDD.Type of Delivery] IN (“Physical”, “Cash”) | Type of Delivery ต้องมีค่าเท่ากับ “Physical” หรือ “Cash” | [Type of Delivery] must either be ‘Physical’ or ‘Cash’. | Complex |
| CNCDD005 | [CDD.Protection Buyer or Seller] IN  (“Protection Buyer”, “Protection Seller”) | Protection Buyer or Seller ต้องมีค่าเท่ากับ “Protection Buyer” หรือ “Protection Seller” | [Protection Buyer or Seller] must be “Protection Buyer” or “Protection Seller”. | Complex |
| CNCDD006 | IF [CDD.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([CDD.Maturity Date]) =  MONTH([CDD.งวดข้อมูล])  AND YEAR([CDD.Maturity Date]) =  YEAR([CDD.งวดข้อมูล])  THEN [CDD.Notional Outstanding Amount] = 0  ELSE [CDD.Notional Outstanding Amount] > 0  END IF | Notional Outstanding Amount ต้องมีค่าเท่ากับ 0 กรณีที่ New Product มีค่าเป็น 'Y' และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date นอกนั้น Notional Outstanding Amount ต้องมีค่ามากกว่า 0 | [Notional Outstanding Amount] must be equal to zero if [New Product] is 'Y' and the month and year of [Maturity Date] and [Data Date] are both equal, otherwise [Notional Outstanding Amount] must be greater than zero. | Complex |
| CNCDD007 | IF [CDD.Notional Outstanding Currency] = “THB”  THEN  [CDD.Notional Baht Equivalent] =  [CDD.Notional Outstanding Amount]  END IF | Notional Baht Equivalent ต้องเท่ากับ Notional Outstanding Amount ถ้า Notional Outstanding Currency = THB | If [Notional Outstanding Currency] is “THB”, then [Notional Baht Equivalent] must equal to [Notional Outstanding Amount]. | Complex |
| CNCDD008 | IF [CDD.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([CDD.Maturity Date]) =  MONTH([CDD.งวดข้อมูล])  AND YEAR([CDD.Maturity Date]) =  YEAR([CDD.งวดข้อมูล])  THEN  [CDD.Effective Notional Amount] = 0  ELSE  [CDD.Effective Notional Amount] > 0  END IF | Effective Notional Amount ต้องมีค่า = 0 กรณีที่ New Product มีค่าเป็น 'Y' และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date นอกนั้น Effective Notional Amount ต้องมีค่ามากกว่า 0 | [Effective Notional Amount] must be equal to if [New Product] is ‘Y’ and the month and year of both [Maturity Date] and [Data Date] are equal, otherwise [Effective  Notional Amount] must be greater than zero. | Complex |
| CNCDD009 | IF [CDD.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([CDD.Maturity Date]) =  MONTH([CDD.งวดข้อมูล])  AND YEAR([CDD.Maturity Date]) =  YEAR([CDD.งวดข้อมูล])  THEN [CDD.Gain or Loss] = 0  END IF | Gain or Loss ต้องมีค่าเท่ากับ 0 กรณีที่ New Product มีค่าเป็น “Y” และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date | [Gain or Loss] must be equal to zero if [New Product] is ‘Y’ and the month and year of both [Maturity Date] and [Data Date] are equal. | Complex |
| CNCDD010 | IF [CDD.New Product] = ‘Y’  AND MONTH([CDD.Maturity Date]) =  MONTH([CDD.งวดข้อมูล])  AND YEAR([CDD.Maturity Date]) =  YEAR([CDD.งวดข้อมูล])  THEN [CDD.Notional Baht Equivalent] = 0  ELSE [CDD.Notional Baht Equivalent] > 0  END IF | Notional Baht Equivalent ต้องมีค่าเท่ากับ 0 กรณีที่ New Product มีค่าเป็น “Y” และ เดือนปีของ Maturity Date มีค่าเท่ากับ เดือนปีของ Data Date นอกนั้น Notional Baht Equivalent ต้องมีค่ามากกว่า 0 | [Notional Baht Equivalent] must be equal to zero if [New Product] is ‘Y’ and the month and year of both [Maturity Date] and [Data Date] are equal, otherwise [Notional Baht Equivalent] must be greater than zero. | Complex |

**Completeness**

| Validation Id | Validation Rule | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| CMCDD001 | IF [CDD.Underlying Obligations Name / Series] IS NOT NULL  THEN  [CDD.Underlying Obligations Maturity] IS NOT NULL  END IF | Underlying Obligations Maturity ต้องมีค่า ถ้า Underlying Obligations Name / Series มีค่า | If [Underlying Obligations Name / Series] contains a value, then [Underlying Obligations Maturity] must contain a value. | Complex |
| CMCDD002 | IF [CDD.Underlying Obligations Name / Series] IS NOT NULL  THEN  [CDD.Underlying Obligations Currency] IS NOT NULL  END IF | Underlying Obligations Currency ต้องมีค่า ถ้า Underlying Obligations Name / Series มีค่า | If [Underlying Obligations Name / Series] contains a value, then [Underlying Obligations Currency] must contain a value. | Complex |
| CMCDD003 | IF LEFT([CDD.Transaction Purpose], 10) = ‘0794000999’  THEN  [CDD.Notes] IS NOT NULL  END IF | Notes ต้องมีค่า ถ้า Transaction Purpose เท่ากับ “0794000999 Others” | If [Transaction Purpose] is “0794000999 Others”, then [Notes] must not be blank. | Complex |

# Classification Summary

| No. | Classification | DS\_SDV (SDVP) | DS\_SDV (SDVT) | DS\_MLN (MLN) | DS\_CDD (CDD) | Data Set : Data Element |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | Currency Code |  | X | X | X | DS\_SDV : Notional Outstanding Currency (V\_SDVT)  DS\_MLN : Notional Outstanding Currency  DS\_CDD : Notional Outstanding Currency, Reference Obligations Currency, Underlying Obligations Currency |
| 2 | Derivatives Counterparty Type Code |  | X | X | X | DS\_SDV : Derivatives Counterparty Type (V\_SDVT)  DS\_MLN : Derivatives Counterparty Type  DS\_CDD : Derivatives Counterparty Type |
| 3 | Derivatives Product Group Code | X | X |  |  | DS\_SDV : Derivatives (V\_SDVP),  Group of Product (V\_SDVT) |
| 4 | Derivatives Reference Variables Code |  | X | X |  | DS\_SDV : Reference Variables (V\_SDVT)  DS\_MLN : Reference Variables |
| 5 | Derivatives Transaction Purpose Code |  | X | X | X | DS\_SDV : Transaction Purpose (V\_SDVT)  DS\_MLN : Transaction Purpose  DS\_CDD : Transaction Purpose |
| 6 | Structured Product Borrowing Type Code |  |  | X |  | DS\_MLN : Type of Product |
| 7 | Derivatives Delivery Code |  |  | X |  | DS\_MLN : Delivery |

# Classification Detail

## Currency Code

รหัสสกุลเงิน โดยรายงานตามรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่บน WWW.BOT.OR.TH

## Derivatives Counterparty Type Code

ประเภทคู่สัญญา

| Code | Value | Description |
| --- | --- | --- |
| 0793600001 | ธนาคารพาณิชย์ไทย ซึ่งรวมถึง  ธนาคารพาณิชย์เพื่อรายย่อย |  |
| 0793600002 | สาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ  (ในประเทศไทย) |  |
| 0793600003 | สาขาอื่นของธนาคารพาณิชย์ | เช่น กรณีสาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศที่เปิดดำเนินการในประเทศไทยทำธุรกรรมกับสำนักงานใหญ่หรือสาขาอื่นของธนารคารพาณิชย์ในต่างประเทศ |
| 0793600004 | ธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ | เช่น กรณีทำธุรกรรมกับธนาคารพาณิชย์อื่นในต่างประเทศที่ไม่ใช่นิติบุคคลเดียวกันกับธนาคารพาณิชย์ผู้จัดทำแบบรายงาน |
| 0793600005 | สถาบันการเงินเฉพาะกิจ (ในประเทศไทย) |  |
| 0793600006 | บริษัทหลักทรัพย์ |  |
| 0793600007 | บริษัทประกันชีวิตและบริษัทประกันวินาศภัย |  |
| 0793600008 | หน่วยงานราชการ หน่วยงานของรัฐ รัฐวิสาหกิจ และธนาคารกลาง |  |
| 0793600009 | ผู้ลงทุนสถาบันอื่น ๆ |  |
| 0793600010 | ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษและผู้ลงทุนรายใหญ่ประเภทนิติบุคคลอื่น ๆ |  |
| 0793600011 | ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษและผู้ลงทุนรายใหญ่ประเภทบุคคลธรรมดา |  |
| 0793600012 | ผู้ลงทุนรายย่อยประเภทนิติบุคคล |  |
| 0793600013 | ผู้ลงทุนรายย่อยประเภทบุคคลธรรมดา |  |

## Derivatives Product Group Code

ประเภทของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด

| Code | Value | V\_SDVT | V\_SDVP |
| --- | --- | --- | --- |
| 0793700001 | ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดขั้นพื้นฐาน | X |  |
| 0793700002 | ธุรกรรม futures |  | X |
| 0793700003 | ธุรกรรม forwards |  | X |
| 0793700004 | ธุรกรรม swaps |  | X |
| 0793700005 | ธุรกรรม options |  | X |
| 0793700006 | ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ไม่ใช่ขั้นพื้นฐาน | X |  |
| 0793700007 | ธุรกรรม Barrier derivatives |  | X |
| 0793700008 | ธุรกรรม Average derivatives |  | X |
| 0793700009 | ธุรกรรม Option on derivatives |  | X |
| 0793700010 | ธุรกรรม FX pro-rata และ flexible derivatives |  | X |
| 0793700011 | ธุรกรรม Forward-start derivatives |  | X |
| 0793700012 | ธุรกรรมอื่น ๆ |  | X |
| 0793700013 | ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ความเห็นชอบเป็นรายกรณี | X |  |
| 0793700014 | ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ธนาคารแห่งประเทศไทยอนุญาตให้ทำได้ตามบทเฉพาะกาลของประกาศฉบับนี้ | X |  |
| 0793700015 | ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ธนาคารพาณิชย์ทำเพื่อบริหารความเสี่ยงของธนาคารพาณิชย์เอง ซึ่งไม่ได้อยู่ภายใต้หลักเกณฑ์ที่ประกาศกำหนดเป็นการทั่วไป | X |  |

## Derivatives Reference Variables Code

ประเภทของตัวแปรอ้างอิงตามประเภทที่กำหนด รวมถึงตัวแปรอ้างอิงอื่น ๆ ที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

| Code | Value | Description |
| --- | --- | --- |
| 0793800001 | อัตราดอกเบี้ย |  |
| 0793800002 | อัตราแลกเปลี่ยน |  |
| 0793800003 | ราคาตราสารหนี้ |  |
| 0793800004 | ราคาตราสารทุน |  |
| 0793800005 | ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ (commodities) |  |
| 0793800006 | เครดิต |  |
| 0793800007 | ผลดำเนินงานกองทุนหรือกองทรัสต์ |  |
| 0793800008 | ดัชนีทางการเงิน |  |
| 0793800999 | อื่น ๆ |  |

## Derivatives Transaction Purpose Code

วัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม

| Code | Value | Description |
| --- | --- | --- |
| 0794000001 | Bank’s Funding | เพื่อจัดหาแหล่งเงินทุนหรือบริหารสภาพคล่องของธนาคารพาณิชย์ |
| 0794000002 | Bank’s Hedging | เพื่อป้องกันความเสี่ยงของธนาคารพาณิชย์ |
| 0794000003 | Bank’s Trading | เพื่อการค้าหรือเก็งกำไรของธนาคารพาณิชย์ |
| 0794000004 | Counterparty’s Hedging | เพื่อป้องกันความเสี่ยงของคู่สัญญา |
| 0794000005 | Counterparty’s Trading | เพื่อการค้าหรือเก็งกำไรของคู่สัญญา |
| 0794000999 | Others | อื่น ๆ |

## Structured Product Borrowing Type Code

| Code | Value | Description | V\_MLN |
| --- | --- | --- | --- |
| 0794100001 | ตราสารหนี้ |  |  |
| 0794100002 | พันธบัตร |  | X |
| 0794100003 | หุ้นกู้ |  | X |
| 0794100004 | ตั๋วแลกเงิน |  | X |
| 0794100005 | ตั๋วเงินอัตราดอกเบี้ยลอยตัว |  | X |
| 0794100006 | บัตรเงินฝากอัตราดอกเบี้ยลอยตัว |  | X |
| 0794100007 | ตั๋วสัญญาใช้เงิน |  | X |
| 0794100008 | บัตรเงินฝาก |  | X |
| 0794100009 | ตราสารหนี้อื่น ๆ |  | X |
| 0794100010 | เงินฝาก |  | X |
| 0794100999 | เงินกู้ยืมอื่น ๆ |  | X |

ประเภทของธุรกรรมเงินกู้ยืม

## Derivatives Delivery Code

เงื่อนไขการส่งมอบคืนหรือได้รับคืนในรูปตราสารหนี้ ตราสารทุน หรือเงินตราต่างประเทศในมุมมองของธนาคารพาณิชย์

| Code | Value | Description |
| --- | --- | --- |
| 0794200001 | ตราสารหนี้ |  |
| 0794200002 | ตราสารทุน |  |
| 0794200003 | เงินตราต่างประเทศ |  |
| 0794200004 | ไม่มี |  |

# Submission Format

## File Format for Submission

| Data Set Name | ABBR | Format | Description |
| --- | --- | --- | --- |
| 1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด  1.1 ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม (SDVP)  1.2 ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา (SDVT) | DS\_SDV | Excel | Filename : MDRVNn\_YYYYMMDD\_SDV.xlsx 1.1) Sheet “SDVP”  1.2) Sheet “SDVT” |
| 2. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง | DS\_MLN | Excel | Filename : MDRVNn\_YYYYMMDD\_MLN.xlsx  Sheet “MLN” |
| 3. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต | DS\_CDD | Excel | Filename : MDRVNn\_YYYYMMDD\_CDD.xlsx  Sheet “CDD” |

## Naming Convention

เพื่อลดกระบวนการกำหนดค่าต่าง ๆ ในการนำส่งไฟล์จำนวนมาก ระบบจะอ่านชื่อไฟล์เพื่อระบุข้อมูลประกอบการนำส่ง โดยมีการกำหนดมาตรฐานชื่อไฟล์ ดังนี้

**FXXXNn\_YYYYMMDD\_Zz.xlsx**

| สัญลักษณ์ | ความหมายและข้อกำหนด |
| --- | --- |
| F | ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล (D: Daily, M: Monthly, Q: Quarterly, H: Half Yearly, Y: Yearly, A: As occur) |
| XXX | ชื่อย่อ Subject Area ของข้อมูล (ลำหรับข้อมูล Derivatives คือ DRV) |
| Nn | รหัสประจำตัวผู้ส่งข้อมูล เช่น FI Code หรือ รหัสนิติบุคคล |
| YYYYMMDD | ปีเดือนวันของข้อมูล (ค.ศ.) |
| Zz | ชื่อย่อ Data Set |
| .xlsx | นามสกุลชุดข้อมูล |

ตัวอย่าง: ส่งไฟล์ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม งวดวันที่ 31 มกราคม ปี พ.ศ. 2565 ของสถาบันการเงินที่มี Fi Code 001 ให้ตั้งชื่อไฟล์ ดังนี้ MDRV001\_20220131\_SDV.xlsx

## Submission Channel

ธปท. มีช่องทางมาตรฐาน (DMS-DA) เพื่อการนำส่งข้อมูล คือ ช่องทาง Web Submission (Web based) รองรับการนำส่งข้อมูลผ่าน BOT Website

1. สาขาในต่างประเทศของธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในไทย ให้รวบรวมส่งโดยธนาคารพาณิชย์ [↑](#footnote-ref-2)