

คู่มือการจัดทำชุดข้อมูลด้านสถาบันการเงิน

(FI DATA SET MANUAL)

Document information

Revision history

| **Version number** | **Date** | **Summary of changes** | **Revision marks** |
| --- | --- | --- | --- |
| **1.0** | **24 December 2018** | **First version** | **Yes** |

Table of Contents

[1. Data Set Details 6](#_Toc533410706)

[1. Subject Area: FI Financial Position 6](#_Toc533410707)

[1. Data Set : Balance Sheet (DS\_BLS) 6](#_Toc533410708)

[2. Data Set : Branch Summary (DS\_BSM) 12](#_Toc533410709)

[3. Data Set : Capital Fund (DS\_CAP) 15](#_Toc533410710)

[4. Data Set : Contingent Summary (DS\_COS) 22](#_Toc533410711)

[5. Data Set : Credit Risk Internal Ratings-Based Approach (DS\_CRI) 29](#_Toc533410712)

[6. Data Set : Credit Risk Standardized Approach (DS\_CRS) 41](#_Toc533410713)

[7. Data Set : Equity Position (DS\_EQP) 51](#_Toc533410714)

[8. Data Set : Items Between Organization Units (DS\_IBO) 56](#_Toc533410715)

[9. Data Set : Interest Rate Risk (DS\_IRR) 59](#_Toc533410716)

[10. Data Set : FI Investment Position (DS\_IVP) 63](#_Toc533410717)

[11. Data Set : Operational Risk (DS\_OPR) 76](#_Toc533410718)

[12. Data Set : Provision and Expected Loss (DS\_PEL) 80](#_Toc533410719)

[13. Data Set : Provision Summary (DS\_PVS) 84](#_Toc533410720)

[14. Data Set : Risk Weighted Assets (DS\_RWA) 87](#_Toc533410721)

[15. Data Set : Total Trading Book Position (DS\_TBP) 89](#_Toc533410722)

[2. Subject Area : Arrangement Summary 92](#_Toc533410723)

[16. Data Set : Arrangement Summary (ARS) 92](#_Toc533410724)

[17. Data Set : Arrangement Movement Summary (DS\_AMS) 99](#_Toc533410725)

[18. Data Set : Deposit Classified by Type of Depositor (DS\_DCD) 104](#_Toc533410726)

[19. Data Set : Lending Movement Summary (DS\_LMS) 109](#_Toc533410727)

[20. Data Set : Lending Operation Progress Outstanding (DS\_LOS) 113](#_Toc533410728)

[21. Data Set : Lending Purpose Summary (DS\_LPS) 116](#_Toc533410729)

[22. Data Set : Lending Summary classified by Business (DS\_LSB) 119](#_Toc533410730)

[23. Data Set : Total Classified Lending Summary (DS\_TCS) 123](#_Toc533410731)

[24. Data Set : Trouble Debts Restructuring Summary (DS\_TDR) 134](#_Toc533410732)

[3. Subject Area : FI Liquidity Status 138](#_Toc533410733)

[25. Data Set : Liquidity Coverage Ratio (DS\_LCR) 138](#_Toc533410734)

[26. Data Set : Liquidity Assessment 1 (DS\_LQ1) 143](#_Toc533410735)

[27. Data Set : Net Stable Funding Ratio (DS\_NFR) 146](#_Toc533410736)

[4. Subject Area : FI Financial Performance 153](#_Toc533410737)

[28. Data Set : Net Profit Distribution (DS\_PDS) 153](#_Toc533410738)

[29. Data Set : Profit and Loss (DS\_PNL) 155](#_Toc533410739)

[5. Subject Area : Key Customer Position 158](#_Toc533410740)

[30. Data Set : Contingent Arrangement (DS\_CAR) 158](#_Toc533410741)

[31. Data Set : Loan Arrangement (DS\_LAR) 167](#_Toc533410742)

[6. Subject Area : Other FI Summary 178](#_Toc533410743)

[32. Data Set : Credit Card Summary (DS\_CCS) 178](#_Toc533410744)

[33. Data Set : Income and Expense by Branch (DS\_IEB) 184](#_Toc533410745)

[34. Data Set : Interest Rate Outstanding (DS\_IRO) 187](#_Toc533410746)

[35. Data Set : Interest Rate Summary (DS\_IRS) 190](#_Toc533410747)

[7. Subject Area : FI Consolidation 194](#_Toc533410748)

[36. Data Set : Capital Fund\_Conso (DS\_CAPC) 194](#_Toc533410749)

[37. Data Set : Comprehensive Income Statement\_Conso (DS\_CISC) 199](#_Toc533410750)

[38. Data Set : Contingent Summary\_Conso (DS\_COSC) 205](#_Toc533410751)

[39. Data Set : Credit Risk Internal Ratings-Based Approach\_Conso (DS\_CRIC) 212](#_Toc533410752)

[40. Data Set : Credit Risk Standardized Approach\_Conso (DS\_CRSC) 224](#_Toc533410753)

[41. Data Set : Equity Position\_Conso (DS\_EQPC) 234](#_Toc533410754)

[42. Data Set : Financial Position Statement\_Conso (DS\_FPSC) 239](#_Toc533410755)

[43. Data Set : Investment by the Parent Company\_Conso (DS\_IPCC) 248](#_Toc533410756)

[44. Data Set : Interest Rate Risk\_Conso (DS\_IRRC) 253](#_Toc533410757)

[45. Data Set : Operational Risk\_Conso (DS\_OPRC) 257](#_Toc533410758)

[46. Data Set : Partial Comprehensive Income Statement\_Conso (DS\_PCSC) 261](#_Toc533410759)

[47. Data Set : Provision and Expected Loss\_Conso (DS\_PELC) 267](#_Toc533410760)

[48. Data Set : Partial Financial Position Statement\_Conso (DS\_PFSC) 270](#_Toc533410761)

[49. Data Set : Provision Summary\_Conso (DS\_PVSC) 274](#_Toc533410762)

[50. Data Set : Single Lending Limit \_Conso (DS\_SLLC) 278](#_Toc533410763)

[51. Data Set : Total Trading Book Position\_Conso (DS\_TBPC) 283](#_Toc533410764)

[8. Subject Area : FI Consolidation (Domestic systemically important bank: D-SIBs) 285](#_Toc533410765)

[52. Data Set : Capital Fund\_Full Conso (DS\_CAPF) 285](#_Toc533410766)

[53. Data Set : Capital Fund\_Solo Conso (DS\_CAPS) 290](#_Toc533410767)

[54. Data Set : Comprehensive Income Statement\_Full Conso (DS\_CISF) 295](#_Toc533410768)

[55. Data Set : Comprehensive Income Statement\_Solo Conso (DS\_CISS) 301](#_Toc533410769)

[56. Data Set : Contingent Summary\_Full Conso (DS\_COSF) 307](#_Toc533410770)

[57. Data Set : Contingent Summary\_Solo Conso (DS\_COSS) 313](#_Toc533410771)

[58. Data Set : Credit Risk Internal Ratings-Based Approach\_Full Conso (DS\_CRIF) 319](#_Toc533410772)

[59. Data Set : Credit Risk Internal Ratings-Based Approach\_Solo Conso (DS\_CRIS) 331](#_Toc533410773)

[60. Data Set : Credit Risk Standardized Approach\_Full Conso (DS\_CRSF) 343](#_Toc533410774)

[61. Data Set : Credit Risk Standardized Approach\_Solo Conso (DS\_CRSS) 354](#_Toc533410775)

[62. Data Set : Equity Position\_Full Conso (DS\_EQPF) 365](#_Toc533410776)

[63. Data Set : Equity Position\_Solo Conso (DS\_EQPS) 370](#_Toc533410777)

[64. Data Set : Financial Position Statement\_Full Conso (DS\_FPSF) 375](#_Toc533410778)

[65. Data Set : Financial Position Statement\_Solo Conso (DS\_FPSS) 382](#_Toc533410779)

[66. Data Set : Investment by the Parent Company\_Conso (DS\_IPCC) 389](#_Toc533410780)

[67. Data Set : Interest Rate Risk\_Full Conso (DS\_IRRF) 390](#_Toc533410781)

[68. Data Set : Interest Rate Risk\_Solo Conso (DS\_IRRS) 393](#_Toc533410782)

[69. Data Set : Operational Risk\_Full Conso (DS\_OPRF) 396](#_Toc533410783)

[70. Data Set : Operational Risk\_Solo Conso (DS\_OPRS) 400](#_Toc533410784)

[71. Data Set : Partial Comprehensive Income Statement\_Conso (DS\_PCSC) 404](#_Toc533410785)

[72. Data Set : Provision and Expected Loss\_Full Conso (DS\_PELF) 405](#_Toc533410786)

[73. Data Set : Provision and Expected Loss\_Solo Conso (DS\_PELS) 408](#_Toc533410787)

[74. Data Set : Partial Financial Position Statement\_Conso (DS\_PFSC) 411](#_Toc533410788)

[75. Data Set : Provision Summary\_Full Conso (DS\_PVSF) 412](#_Toc533410789)

[76. Data Set : Provision Summary\_Solo Conso (DS\_PVSS) 415](#_Toc533410790)

[77. Data Set : Single Lending Limit \_Conso (DS\_SLLC) 418](#_Toc533410791)

[78. Data Set : Total Trading Book Position\_Full Conso (DS\_TBPF) 419](#_Toc533410792)

[79. Data Set : Total Trading Book Position\_Solo Conso (DS\_TBPS) 421](#_Toc533410793)

# Data Set Details

## Subject Area: FI Financial Position

### Data Set : Balance Sheet (DS\_BLS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Balance Sheet เป็นข้อมูลเกี่ยวกับฐานะการเงิน ของสถาบันการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ  
 สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 บริษัทเงินทุน   
 บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ  
**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูลจะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ก็ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Branch Number | รหัสสาขาในกรณีที่เป็นชุดข้อมูลระดับสาขาใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงิน กรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์ จะเป็นรหัส 3 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 หลัก เช่น ธนาคารกรุงเทพสาขาฮ่องกง รหัสสาขา 801 จะเป็น 0801 | กรณีที่ FI Reporting Group Id ให้รายงานข้อมูลเป็นรายสาขา (สาขาธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศในต่างประเทศ) ให้ตรวจสอบรหัสสาขาของ Organization Id กับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงิน |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานตามประเภทสถาบันการเงินและธุรกรรม เช่น  -ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศเฉพาะที่มีสาขาต่างประเทศเท่านั้นที่ต้องรายงานชุดรายสาขาต่างประเทศตามจำนวนสาขาในต่างประเทศ และชุดรวมทุกสำนักงานต่างประเทศ  -บริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ รายงานเฉพาะชุดรวมทุกสำนักงาน (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Balance Sheet Item | รายการของฐานะการเงิน รายงานรายการตามที่กำหนดเป็น Mandatory /Optional ใน classification ชื่อ Balance Sheet Item  (Classification Name: Balance Sheet Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Balance Sheet Item |
| Balance Sheet Amount | จำนวนเงินของรายการใน Balance Sheet Item หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก และการแสดงค่าลบ ( - ) สำหรับจำนวนเงินที่เป็นค่าลบในรายการที่เป็นได้ทั้งค่าบวกและค่าลบ ค่าลบที่แสดงนั้นจะไม่นับอยู่ในจำนวนหลักข้างต้น หากเป็นรายการหักไม่ต้องแสดงค่าลบ  ( - )  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | สินทรัพย์ = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการด้านสินทรัพย์  หนี้สิน = ผลรวมของรายการย่อยทุกรายการของหนี้สิน  ส่วนของ**เจ้าของ** / ส่วนของสำนักงานใหญ่ = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของส่วนของ**เจ้าของ**/ส่วนของสำนักงานใหญ่  สินทรัพย์ = ผลรวมของรายการหนี้สินและส่วนของ**เจ้าของ**/ ส่วนของสำนักงานใหญ่  มูลค่าของทุนที่ออกและชำระแล้ว = จำนวนหุ้นของทุนที่ออกและชำระแล้ว X ราคาที่ตราไว้ (Par Value)  มูลค่าของทุนที่ออกและชำระแล้ว < = จำนวนหุ้นของทุนจดทะเบียน X ราคาที่ตราไว้ (Par Value)  สิทธิในการเรียกคืนหลักทรัพย์ < = ภาระในการส่งคืนหลักทรัพย์  ภาระของลูกค้าจากการรับรอง = ภาระของสถาบันการเงินจากการรับรอง  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศและบริษัทเงินทุน**  Data Set \_BLS : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002 และ  Data Set \_CAP : Outstanding Amount per Book ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002 โดยตรวจสอบที่   1. Balance Sheet Item Code 950404 <= Capital Fund Item Code 940143 (ค่าความนิยม) 2. Balance Sheet Item Code 950500 +950501 +950502 = Capital Fund Item Code 940179 +940159 +940107 (มูค่าตามบัญชีของหุ้นทุนที่ออกและชำระแล้ว) 3. Balance Sheet Item Code 950503 = Capital Fund Item Code 940109 +940161 +940181 (ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น) 4. Balance Sheet Item Code 950512 = Capital Fund Item Code 940122 (ส่วนเกินจากการตีราคาที่ดิน) 5. Balance Sheet Item Code 950513 = Capital Fund Item Code 940123 (ส่วนเกินทุนจากการตีราคาอาคารและห้องชุดในอาคารชุด) 6. Balance Sheet Item Code 950529 = Capital Fund Item Code 940118 (ทุนสำรองตามกฎหมาย) 7. Balance Sheet Item Code 950530 >= Capital Fund Item Code 940117 (เงินสำรองอื่น ๆ ที่จัดสรรแล้วไม่รวมทุนสำรองตามกฎหมาย)   **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ , บริษัทเงินทุน, บริษัทเครดิตฟองซิเอร์**  Data Set \_BLS : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002 และ CL\_Balance Sheet Item Code 950277, 950290, 950366, 950413, 950431, 950438, 950458, 950470, 950481, 950485 >= Data Set \_IRR : Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002 และ CL\_Banking Book Position Code 990002, 990006, 990009, 990014, 990018, 990021, 990044, 990025, 990049, 990026 ตามลำดับ  **กรณีสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ**  Data Set \_BLS : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 และ CL\_Balance Sheet Item Code 950277, 950290, [950366 + 950616], 950413, 950431, 950438, 950458, 950470, 950481, 950485 >= Data Set \_IRR : Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 และ CL\_Banking Book Position Code 990002, 990006, 990009, 990014, 990018, 990021, 990044, 990025, 990049, 990026 ตามลำดับ  **กรณีสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ**   1. Data Set \_BLS : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 และ CL\_Balance Sheet Item Code 950277, 950290, 950366, 950413, 950431, 950438, 950458, 950470, 950481, 950485 >= Data Set \_IRR : Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 และ CL\_Banking Book Position Code 990002, 990006, 990009, 990014, 990018, 990021, 990044, 990025, 990049, 990026 ตามลำดับ 2. Data Set\_BLS : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 และ CL\_Balance Sheet Item Code 950546 = Data Set\_IRR : Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 , CL\_Banking Book Position Code 990039 หัก 990036 |

### Data Set : Branch Summary (DS\_BSM)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Branch Summary เป็นข้อมูลเกี่ยวกับสรุปเงินฝาก เงินให้สินเชื่อ (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว) และสินทรัพย์รวม รายสาขา

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ (เฉพาะสถาบันการเงินที่มีสำนักงานสาขามากกว่า 1 แห่ง)

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ  
**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 1 เดือน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | -รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002  -สำหรับ Data set นี้ กิจการวิเทศธนกิจ ไม่ต้องส่งข้อมูล | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนดเฉพาะธนาคารพาณิชย์ |
| Branch Number | กรณีที่เป็นชุดข้อมูลระดับสาขาให้รายงานเป็นรายสาขาในประเทศและสาขาต่างประเทศ โดยใช้รหัสสาขาเดิมของสถาบันการเงิน ซึ่งเป็นรหัส 3 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 หลัก เช่น ธนาคารกรุงเทพ สาขาถนนรัชดาห้วยขวาง รหัสสาขา 055 จะเป็น 0055 | ตรวจสอบรหัสสาขาของ Organization Id กับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงิน |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Branch Summary Item | รายการสรุปของสาขา  (Classification Name: Branch Summary Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Branch Summary Item |
| Amount | จำนวนเงิน หน่วย จะเป็น บาท รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | เงินรับฝาก = เงินรับฝากกระแสรายวัน + เงินรับฝากออมทรัพย์ + เงินรับฝากจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลา + ตั๋วสัญญาใช้เงิน / ตั๋วแลกเงิน (เฉพาะ บง.) + บัตรเงินฝาก  เงินให้สินเชื่อ = เงินเบิกเกินบัญชี + เงินให้กู้ยืม + ตั๋วเงิน + อื่นๆ |

### Data Set : Capital Fund (DS\_CAP)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Capital Fund เป็นข้อมูลเกี่ยวกับเงินกองทุน ของสถาบันการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ  
 สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 บริษัทเงินทุน   
บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ก็ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม -สำหรับ Data set นี้ กิจการวิเทศธนกิจ ไม่ต้องส่งข้อมูล | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Capital Fund Item | รายการเงินกองทุน  (Classification Name: Capital Fund Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Capital Fund Item |
| Outstanding Amount per Book | ยอดคงค้างตามบัญชีของรายการ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท รูปแบบจะเป็น ตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | **กรณีบริษัทเครดิตฟองซิเอร์.**  เงินกองทุนทั้งสิ้น (ยอดคงค้างตามบัญชี) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนทั้งสิ้น (ยอดคงค้างตามบัญชี)  **กรณีเป็นธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศและบริษัทเงินทุน.**  1. เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  2. เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  3. เงินกองทุนทั้งสิ้นตามกฎหมาย (ยอดคงค้างตามบัญชี) = เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี) + เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  4.Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0  **กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ไม่รวมกิจการวิเทศธนกิจ(สินทรัพย์ตามมาตรา 32)**  1. การดำรงสินทรัพย์ตามมาตรา 32 = ผลรวมของรายการย่อยทุกรายการของการดำรงสินทรัพย์ตามมาตรา 32  2. เงินกองทุนทั้งสิ้นตามกฎหมาย = ผลรวมของรายการย่อยทุกรายการเงินกองทุนทั้งสิ้นตามกฎหมาย (940077 เงินกองทุนทั้งสิ้นก่อนรายการหักหัก940220 รายการหักจากเงินกองทุนทั้งสิ้น)  **Validation Data Set**  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศและบริษัทเงินทุน**  Data Set \_CAP : Outstanding Amount per Book ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002 และ  Data Set \_BLS : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002 โดยตรวจสอบที่   1. Capital Fund Item Code 940143 >= Balance Sheet Item Code 950404 (ค่าความนิยม) 2. Capital Fund Item Code 940179 +940159 + 940107 = Balance Sheet Item Code 950500 +950501 +950502 (มูค่าตามบัญชีของหุ้นทุนที่ออกและชำระแล้ว) 3. Capital Fund Item Code 940109 +940161 +940181 = Balance Sheet Item Code 950503 (ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น) 4. Capital Fund Item Code 940122 = Balance Sheet Item Code 950512 (ส่วนเกินจากการตีราคาที่ดิน) 5. Capital Fund Item Code 940123 = Balance Sheet Item Code 950513 (ส่วนเกินทุนจากการตีราคาอาคารและห้องชุดในอาคารชุด) 6. Capital Fund Item Code 940118 = Balance Sheet Item Code 950529 (ทุนสำรองตามกฎหมาย) 7. Capital Fund Item Code 940117 <= Balance Sheet Item Code 950530 (เงินสำรองอื่น ๆ ที่จัดสรรแล้วไม่รวมทุนสำรองตามกฎหมาย) |
| Applicable Capital Fund Amount | ยอดคงค้างของรายการเฉพาะที่สามารถนับเข้าเป็นเงินกองทุนได้ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | **กรณีเป็นธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศและบริษัทเงินทุน**  1. เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  2. เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  3. เงินกองทุนทั้งสิ้นตามกฎหมาย (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) + เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  4.Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0  **Validation Data Set *:*** *ที่ไม่ได้ตรวจสอบโดยระบบ*  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศและบริษัทเงินทุน**  สำรองสำหรับสินทรัพย์จัดชั้นปกติ (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) <= ร้อยละ 1.25 ของยอดสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตสำหรับ ธพ. ที่เลือกคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตวิธี SA และของยอดสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี SA ตามประกาศ ธปท. ว่าด้วย “หลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตสำหรับ ธพ. โดยวิธี IRB” สำหรับ สง. ที่เลือกคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตวิธี IRB |
| Net Capital Fund Amount | ยอดคงค้างสุทธิที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนตามกฎหมายได้ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | **กรณีเป็นธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศและบริษัทเงินทุน.**  - Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0 |
| Registered Capital Fund Value | สินทรัพย์ตามมาตรา 32 จำนวนที่ได้จดทะเบียนไว้กับธนาคารแห่งประเทศไทย จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก | ใช้เฉพาะสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ |
| Applicable Capital Fund Value | สินทรัพย์ตามมาตรา 32 มูลค่าตามมาตรฐานการบัญชี ณ สิ้นงวดการบัญชี 6 เดือน หรือเมื่อมีการเปลี่ยนแปลงสินทรัพย์ตามมาตรา 32 หรือ เงินกองทุน จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก | ใช้เฉพาะสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ |

### Data Set : Contingent Summary (DS\_COS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Contingent Summary เป็นข้อมูลแสดงจำนวนเงินตามสัญญาและมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะทางการเงินของรายการนอกงบแสดงฐานะทางการเงิน ทั้งนี้ให้ใช้ค่าแปลงสภาพ (Credit Conversion Factor) ตามที่กำหนดไว้ในหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III

ตราสารอนุพันธ์ ได้แก่ ตราสารอนุพันธ์ด้านอัตราแลกเปลี่ยน ตราสารอนุพันธ์ด้านอัตราดอกเบี้ย ตราสารอนุพันธ์ด้านตราสารหนี้ ตราสารอนุพันธ์ด้านตราสารทุน ตราสารอนุพันธ์ด้านสินค้าโภคภัณฑ์ และ ตราสารอนุพันธ์ด้านเครดิต

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

บริษัทเงินทุน

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด ธ.ค. 51)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานตามประเภทสถาบันการเงิน   * + ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ รายงานชุดรวมทุกสำนักงานและชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ   + สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ   + บริษัทเงินทุน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน   (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลใน Classification ชื่อ FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2551 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2008-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Customer Group | กลุ่มลูกหนี้ที่คำนวณความเสี่ยงด้านเครดิต  ค่า ‘0’ เท่ากับ Retail  ค่า ‘1’ เท่ากับ Non-retail | กรณีที่ Credit Risk Method มีรหัสเป็น 447001 หรือ 447002 Customer Group ต้องไม่มีค่า |
| Contingent Type | ประเภทภาระผูกพัน ใช้ classification ของภาระผูกพันใน Arrangement Type (ยกเว้นรายการ ภาระผูกพันอื่น ๆ ที่มีค่า CCF = 0.5 Cl\_code 018286)  (Classification Name: Arrangement Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent |
| Exposure Method | วิธีที่ใช้คำนวณ Exposure ของตราสารอนุพันธ์ ให้ใส่รหัสที่มีค่าเท่ากับ  รหัส ‘440001’ สำหรับวิธี Original  รหัส ‘440008’ สำหรับวิธี Current  (Classification Name: Exposure Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type ในส่วนของ Contingent เป็นตราสารอนุพันธ์ และค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 440001 และ 440008 ใน Exposure Type Classification และ 2. ถ้า Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440001 (วิธี Original) แลัว ค่าที่เป็นไปได้ของ Contingent Type คือ ค่าที่มีรหัสเป็นรหัสย่อย ภายใต้รหัส 018081 (อนุพันธ์ด้านอัตราแลกเปลี่ยน) หรือ รหัส 018087 (อนุพันธ์ด้านอัตราดอกเบี้ย )   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Booking Type | ประเภทบัญชีของตราสารอนุพันธ์  (Classification Name: Booking Type) | มีค่าเมื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์  และ ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Booking Type  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Netting Type | สถานะของการหักกลบลบหนี้ระหว่างกัน (Netting)  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่มี Netting  ค่า ‘1’ เท่ากับ มี Netting | มีค่าเมื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| CCF Rate | ระบุค่า Credit Conversion Factor ตามหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III เช่น  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 5 CCF Rate เท่ากับ 0.05  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 20 CCF Rate เท่ากับ 0.2  (กรณี สง. ที่ใช้วิธี IRB ให้รายงาน CCF ของอนุพันธ์ทางการเงิน = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| RWA Rate | ระบุน้ำหนักความเสี่ยงของรายการใน Arrangement Type เช่น  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 20 RWA Rate เท่ากับ 0.2  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 50 RWA Rate เท่ากับ 0.5  (กรณี สง. ที่ใช้วิธี IRB ให้รายงาน RWA = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Involved Party Type | ประเภทของผู้ทำสัญญา (Involved party)  (Classification Name: Involved Party Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Involved Party Type |
| Arrangement Currency Flag | ประเภทสกุลเงินของสัญญา  ค่า ‘0’ เท่ากับ เงินตราต่างประเทศ  ค่า ‘1’ เท่ากับ เงินบาท | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Notional Principal Amount | ยอดรวมของภาระผูกพันก่อนหัก Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Specific Provision | เงินสำรองส่วนที่นำมาหักก่อนคำนวณสินทรัพย์เสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของรายการนอกงบแสดงฐานะทางการเงิน และ Repo-style transaction  กรณีเป็นตราสารอนุพันธ์ที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current จะเป็นมูลค่าก่อนรวมผลกำไรจากวัดมูลค่ายุติธรรม  วิธี SA หลังหัก Specific Provision  วิธี IRB ก่อนหัก Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Add On or Potential Future Credit Exposure | ผลรวมของมูลค่าความเสี่ยงสุทธิที่คาดว่าจะเกิดขึ้นในอนาคต ของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์ ของคู่สัญญาทุกราย  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | ผลรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์ ของคู่สัญญาทุกราย  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Profit from Mark to Market | ผลกำไรทั้งสิ้นจากการวัดมูลค่ายุติธรรม กรณีคำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type อยู่ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และ 2. Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440008 (วิธี current)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Loss from Mark to Market | ผลขาดทุนทั้งสิ้นจากการวัดมูลค่ายุติธรรม กรณีคำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type อยู่ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และ 2. Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440008 (วิธี current)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Net Profit & Loss from Mark to Market | ผลรวมของคู่สัญญาทุกรายที่เกิดจากยอดรวมสุทธิของกำไรและขาดทุน เฉพาะยอดสุทธิที่เป็นบวก จากการวัดมูลค่ายุติธรรมของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่ทำกับคู่สัญญาแต่ละรายที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |

### Data Set : Credit Risk Internal Ratings-Based Approach (DS\_CRI)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Credit Risk Internal Ratings-Based Approach เป็นข้อมูลสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณจากข้อมูลสินทรัพย์และรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน ยกเว้น ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน สินทรัพย์อื่น และฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation โดยใช้ข้อมูลจากระบบ Internal Rating ของสถาบันการเงินเป็นหลักในการคำนวณหาค่าองค์ประกอบความเสี่ยงต่าง ๆ เพื่อนำมาแทนค่าในสูตรการคำนวณหาเงินกองทุนและสินทรัพย์เสี่ยงตามที่ ธปท. กำหนด และ มูลค่าความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น (Expected loss) ของสินทรัพย์แต่ละประเภท สำหรับสถาบันการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด ธ.ค. 52)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลใน Classification ชื่อ FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2551 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2008-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| CRM Method | วิธี CRM หลักประกันทางการเงิน  (Classification Name: Credit Risk Mitigation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Mitigation Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449014 ถึง 449017  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น)และ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 3. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Portfolio Type | ประเภทของ Portfolio  - กรณีที่ Credit Risk Item มี PD Range มากกว่า 1 กลุ่ม และ Credit Risk Item เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุล ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ดังกล่าวแล้วตามด้วยชื่อของประเภท Portfolio ใน Element ของ Portfolio Type ส่วนกรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ที่เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุลของ Credit Risk Typeของรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) นั้น แล้วตามด้วยชื่อของประเภท Portfolio ใน Element ของ Portfolio Type เช่น กรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุล รหัส 446081 (ข้อ4.2 วงเงินหมุนเวียนเพื่อรายย่อย) Portfolio Type จะเป็น446081CreditCard , 446081PersonalCredit เป็นต้น กรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) รหัส 446120 โดยรายการนอกงบดุลดังกล่าวเป็นของวงเงินหมุนเวียนเพื่อรายย่อย (รหัส 446081) และ Credit Risk Type รหัส 449017 Portfolio Type จะเป็น446081CreditCard , 446081PersonalCredit เป็นต้น  - กรณีที่ Credit Risk Item มี PD Range 1 กลุ่ม และ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุล และ ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) ของ Credit Risk Type ที่มีรหัสเป็น449016 (ข้อ 3.ลูกหนี้ธุรกิจเอกชน) และรหัส 449017 (ข้อ4. ลูกหนี้รายย่อย) ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ภายใต้รหัส 446070 (ข้อ 3.ลูกหนี้ธุรกิจเอกชน)และ รหัสย่อยภายใต้รหัส 446079(ข้อ4. ลูกหนี้รายย่อย) ใน Element ของ Portfolio Type เช่น กรณีรายงาน Credit Risk Type รหัส 449016และ Credit Risk Item รหัส 446120 โดยรายการนอกงบดุลดังกล่าวเป็นของสินเชื่อเพื่อสินค้าโภคภัณฑ์ Portfolio Type จะเป็น 446077 เป็นต้น |  |
| Asset Value Correlation | การปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ สำหรับลูกหนี้ที่เข้าข่ายเป็นบริษัทที่ประกอบธุรกิจทางการเงินที่ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ (Asset Value Correlation : AVC)  ‘0’ = ไม่ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์  ‘1’ = ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ |  |
| Double Default Method | วิธีปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  ‘0’ = ไม่ใช้วิธี Double Default  ‘1’ = ใช้วิธี Double Default | ค่าที่เป็นไปได้ สำหรับ Double Default Method ที่มีค่า ‘1’ คือ Credit Risk Item มีรหัสเป็น 446069, 446071, 446072, 446073, 446083, 446120, 446121, 446124, 446125, 446132, 446129, 446161, 446162 และ 446163 |
| Grade | เกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ และในกรณีของรายการที่เป็นรหัสย่อย ของลูกหนี้ธุรกิจเอกชน กลุ่มพิเศษที่ใช้วิธี Supervisory Slotting Criteria ในการคำนวณเงินกองทุน (รหัส446074) ให้แทนค่า Rating ที่ได้เทียบเคียงแล้วสำหรับ ค่า Internal Rating ของสง.กับ Rating ตามที่ธปท.กำหนด ดังนี้  ดีมาก ด้วย เกรด 1  ดีมาก\* ด้วย เกรด 2  ดี ด้วย เกรด 3  ดี\* ด้วย เกรด 4  พอใช้ ด้วย เกรด 5  อ่อน ด้วย เกรด 6  ผิดนัดชำระหนี้ ด้วย เกรด 7  โดยที่ \* คือ เกรดดีมากและดีที่มีน้ำหนักความเสี่ยงเที่เข้าเงื่อนไขตามที่ธปท.กำหนดสำหรับกรณีที่สินเชื่อกลุ่มพิเศษ ให้แสดงทุกเกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ |  |
| Lower Bound | ค่าความน่าจะเป็นต่ำสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Lower Bound ต้องมีค่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ ค่า Upper Bound |
| Upper Bound | ค่าความน่าจะเป็นสูงสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Upper Bound ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ ค่า Lower Bound |
| Estimated PD | ค่าประมาณการของความน่าจะเป็นที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ (PD) ที่ สง. ใช้เป็นตัวแทนของค่า PD ของแต่ละเกรด |  |
| Notional Principal Amount | ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement (Repo transaction และ Securities borrowing and lending) โดยสำหรับ OTC Derivatives ให้หมายถึง ยอดรวมจำนวนเงินตามสัญญาอนุพันธ์ทางการเงิน  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น    1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)    2. รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction ) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131)   แล้ว Notional Principal Amount ต้องมีค่า   1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) แล้ว Notional Principal Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า รวมทั้งกรณีที่ Double Default Method เป็น ‘1’ |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของมูลค่ารายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน ธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน (Reverse Repo) และลูกหนี้ที่เกิดจากการวางเงินสดเป็นหลักประกันในการยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing) ตามธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending (SBL) ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement และยอดรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินของรายการ OTC Derivatives  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น    1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) และ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)    2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446123 (ข้อ 2.1 อนุพันธ์ทางการเงินนอกตลาด (Over the Counter))    3. รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131)   แล้ว Gross Credit Equivalent Amount ต้องมีค่า   1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ Gross Credit Equivalent Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า รวมทั้งกรณีที่ Double Default Method เป็น ‘1’ |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount ของรายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน เช่น ส่วนที่ตีราคาเพิ่มของที่ดินและอาคาร ดอกผลเช่าซื้อรอการตัดบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าได้เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินและนอกงบแสดงฐานะการเงิน ที่หัก Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนหัก Specific provision และปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต ยกเว้น   * 1. กรณี Repo-style transaction ที่อยู่ภายใต้ Master netting agreement ให้รายงานด้วยยอดหลักการ netting ซึ่งมีค่าเท่ากับ E\* ตามสูตรที่ ธปท. กำหนด   2. กรณีธุรกิจการให้เช่าแบบลิสซิ่ง (Leasing) ที่มี Residual value risk ให้รายงานด้วยผลรวมของกระแสเงินค่าเช่าที่ผู้เช่าต้องจ่ายให้ สง. ผู้ให้เช่า คิดลดด้วยอัตราดอกเบี้ยที่เหมาะสม   กรณีลูกหนี้ที่รับซื้อมา ให้รายงานด้วยค่า EAD สำหรับ Default risk ก่อนปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต ซึ่งมีค่าเท่ากับมูลค่ายอดหนี้ที่รับซื้อมาหักด้วยเงินกองทุนสำหรับ Dilution risk ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ต้องมีค่า เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Decrease in EAD | EAD ที่ลดลงจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าได้เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Increase in EAD | EAD ที่เพิ่มขึ้นจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Collateral Type | ประเภทหลักประกัน ให้ สง. ที่ใช้วิธี AIRB ระบุประเภทหลักประกัน (กรณีค่าประมาณการ LGD ขึ้นอยู่กับประเภทหลักประกัน) |  |
| LGD Rate | ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ที่พิจารณาจากหลักประกันและการหักกลบหนี้ในงบแสดงฐานะการเงิน เช่น  ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ ร้อยละ 35 LGD Rate เท่ากับ 0.35  ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ ร้อยละ 75 LGD Rate เท่ากับ 0.75  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| EAD after CRM | ยอดรวมของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน และนอกงบแสดงฐานะการเงิน หลังปรับปรุงรายการที่เกี่ยวข้อง แยกตามค่า LGD  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ในแต่ละ Grade ของ Credit Risk Item, Credit Risk Type, Portfolio Type, Asset Value Correlation และ Double Default Method หนึ่งๆ ผลรวมของ EAD after CRM ต้องเท่ากับ Net Credit Equivalent Amount หัก Decrease in EAD บวก Increase in EAD |
| Protection Seller PD | ค่าเฉลี่ย PD ของ Protection seller สำหรับลูกหนี้ในแต่ละเกรด ถ่วงน้ำหนักด้วยยอดรวม EAD ส่วนที่มีการประกันความเสี่ยงด้านเครดิตจาก Protection seller สำหรับค่า PD ของ Protection seller ที่แตกต่างกันแต่ละค่า  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Double Default Method เป็น ‘1’ และไม่มีค่ากรณีที่ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Effective Maturity | ค่าเฉลี่ยของระยะเวลาครบกำหนดของหนี้ (ปี) สำหรับลูกหนี้ในแต่ละเกรด ถ่วงน้ำหนักด้วยยอดรวม EAD สำหรับค่า M ที่แตกต่างกันแต่ละค่า  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ค่า Effective Maturity ต้องมีค่าอยู่ในช่วงตั้งแต่ 0 ถึง 5 |
| Dilution risk | สินทรัพย์เสี่ยงที่เกิดจาก Dilution risk (ความเสี่ยงที่ยอดหนี้ที่ สง. รับซื้อมาอาจมีมูลค่าลดลงได้ เนื่องจากผู้ขายลูกหนี้มีข้อตกลงกับลูกหนี้) โดยการรายงานให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสถาบันการเงินที่ใช้วิธี IRB  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Residual value risk | สินทรัพย์เสี่ยงที่เกิดจาก Residual value risk (ความเสี่ยงที่เกิดจากความเสียหายจากการที่มูลค่ายุติธรรมของทรัพย์สินลดลงต่ำกว่ามูลค่าซาก ของธุรกรรมการให้เช่าแบบลิสซิ่ง)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้น ซึ่งเท่ากับผลรวมของมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงจาก Default risk, Dilution risk และ Residual value risk หลังคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสง.ที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Expected Loss | มูลค่าของความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Credit Risk Standardized Approach (DS\_CRS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Credit Risk Standardized Approach เป็นข้อมูลการคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณจากสินทรัพย์และรายการนอกงบแสดงฐานะการเงินถ่วงน้ำหนักความเสี่ยงตามที่ ธปท.กำหนด ของ

1. วิธี Simplified Standardized Approach (SSA)
2. วิธี Standardized Approach (SA)
3. วิธีInternal Ratings-Based Approach (IRB) สำหรับ
   1. สินทรัพย์เสี่ยงที่ไม่มีนัยสำคัญที่คำนวณด้วยวิธี SA
   2. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุนในกรณีที่มีนัยสำคัญ แต่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB
   3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุนในกรณีที่มีนัยสำคัญ ที่คำนวณโดยวิธี Market based
   4. สินทรัพย์อื่น
   5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

บริษัทเงินทุน

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด ธ.ค. 51)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ชื่อ FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2551 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2008-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| CRM Method | วิธี CRM หลักประกันทางการเงิน  (Classification Name: Credit Risk Mitigation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Mitigation Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449002 ถึง 449012 , 449018, 449019 และ 449020  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446002 (วิธี Standardized Approach (SA) และ Simplified Standardized Approach (SSA)) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน)    * ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)    * ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ   5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้ วิธี SA)  5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based  5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight  5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)  5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น  และรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) กับ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| FTD Adjustment | จำนวนเงินของรายการปรับปรุงสินทรัพย์เสี่ยงของงธุรกรรม First-to-default Credit Derivatives | มีค่าเมื่อ   1. Credit Risk Type มีรหัสเป็น 449012 (ข้อ 11. ผู้ขายประกันความเสี่ยงด้านเครดิตประเภท First-to-default Credit Derivatives และธุรกรรม Securitization) และ 2. Credit Risk Item มีรหัสเป็น 446063 (ข้อ 11.1 เงินลงทุนในตราสาร First-to-default Credit Linked Note ที่มี Rating)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| CCF Rate | ระบุค่า Credit Conversion Factor ตามหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III เช่น  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 5 CCF Rate เท่ากับ 0.05  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 20 CCF Rate เท่ากับ 0.2  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   * 1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น กรณี Credit Risk Item ที่มีรหัสเป็น 446125 กับ 446128 ของรายการที่ใช้วิธี Current Exposure Method และที่สามารถ Netting กันได้ตามเกณฑ์   2. รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction ) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ยกเว้น รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ค่า CCF Rate จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| RWA Rate | ระบุน้ำหนักความเสี่ยง เช่น  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 20 RWA Rate เท่ากับ 0.2  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 50 RWA Rate เท่ากับ 0.5  (กรณีอนุพันธ์ทางการเงินที่อยู่ในตลาด Exchange ให้รายงาน RWA = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของมูลค่ารายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน ธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน (Reverse Repo) และลูกหนี้ที่เกิดจากการวางเงินสดเป็นหลักประกันในการยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing) ตามธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending (SBL) ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement และยอดรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินของรายการ OTC Derivatives  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446002 (วิธี Standardized Approach (SA) และ Simplified Standardized Approach (SSA)) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน)    * ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)    * ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ   5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้ วิธี SA)  5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based  5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight  5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)  5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น  และรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) กับ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมSecuritisation)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446123 (ข้อ 2.1 อนุพันธ์ทางการเงินนอกตลาด (Over the Counter)) 2. รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ยกเว้น รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ Gross Credit Equivalent Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Specific Provision | เงินสำรองส่วนที่นำมาหักก่อนคำนวณสินทรัพย์เสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount เช่น ส่วนที่ตีราคาเพิ่มของที่ดินและอาคาร ดอกผลเช่าซื้อรอการตัดบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่หัก Specific Provision และ Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Decrease in CRM | มูลค่าของสินทรัพย์หรือมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ส่วนที่มีการนำ CRM มาปรับลดความเสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Increase in CRM | มูลค่าของสินทรัพย์หรือมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ส่วนที่นำไปปรับลดความเสี่ยงให้แก่ลูกหนี้อื่น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Potential Loss | มูลค่าผลขาดทุนสูงสุดที่คาดว่าจะเกิดขึ้นกับตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี VaR และไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Credit Risk Type มีรหัสเป็น 449018 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) และ 2. Credit Risk Item มีรหัสเป็น รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446097 (ข้อ 5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ) หรือ 446098 (5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้น  กรณีที่ Credit Risk Item มีรหัสเป็นรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446090 (ข้อ 5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based) ค่ามูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้นจะเป็นค่าก่อนคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสง.ที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Equity Position (DS\_EQP)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Equity Position เป็นข้อมูลความเสี่ยงด้านเครดิตและ มูลค่าความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น (Expected loss) สำหรับฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD สำหรับสถาบันการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด ธ.ค. 52)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลใน Classification ชื่อ FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2551 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2008-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Default Data | ความเพียงพอของข้อมูลที่ใช้ในการประมาณค่า Probability of Default (ค่า PD)  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่เพียงพอ  ค่า ‘1’ เท่ากับ เพียงพอ | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449018  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 446099 (ข้อ 5.2.3 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD)  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Grade | เกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ |  |
| Lower Bound | ค่าความน่าจะเป็นต่ำสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Lower Bound ต้องมีค่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ ค่า Upper Bound |
| Upper Bound | ค่าความน่าจะเป็นสูงสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Upper Bound ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ ค่า Lower Bound |
| Estimated PD | ค่าประมาณการของความน่าจะเป็นที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ (PD) ที่ สง. ใช้เป็นตัวแทนของค่า PD ของแต่ละเกรด |  |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount ของรายการฐานะที่เกี่ยวข้องกับ ตราสารทุน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Specific Provision | เงินสำรองที่เป็น Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ที่หัก Specific Provision และ Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Decrease in EAD | EAD ที่ลดลงจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Increase in EAD | EAD ที่เพิ่มขึ้นจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity exposure with sufficient information | ฐานะของตราสารทุนที่มีข้อมูลเพียงพอในการพิจารณาการผิดนัดชำระหนี้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity exposure without sufficient information | ฐานะของตราสารทุนที่มีข้อมูลไม่เพียงพอในการพิจารณาการผิดนัดชำระหนี้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Scaling Factor | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนที่ต้องใช้ scaling factor 1.5 ในการปรับค่าสินทรัพย์เสี่ยง และได้คูณค่าดังกล่าวแล้ว  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Minimum RW | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนในแต่ละเกรด เฉพาะตราสารทุนที่ต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ (Minimum risk weight)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Maximum RW | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนในแต่ละเกรด เฉพาะตราสารทุนที่ต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นสูง (Maximum risk weight)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของตราสารทุน หลังคูณ Scaling Factor ของการพิจารณาความเพียงพอของข้อมูลที่ใช้ในการประมาณค่า PD ตามคำจำกัดความของการผิดนัดชำระหนี้ แต่หลังคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสง.ที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Expected Loss | มูลค่าของความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Items Between Organization Units (DS\_IBO)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Items Between Organization Units เป็นข้อมูลเกี่ยวกับบัญชีระหว่างสำนักงานของสถาบันการเงิน เพื่อคำนวณยอดสุทธิที่มาจากยอดรวมรายการเจ้าหนี้หักด้วยยอดรวมรายการลูกหนี้

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศที่มีสาขาเปิดดำเนินการในต่างประเทศ  
 สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| From FI Reporting Group Id | ความหมายของ From และ To ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน  From หมายถึง รายการที่เกิดขึ้นระหว่างกันที่สำนักงานในประเทศมีต่อสำนักงานอื่นที่เป็นนิติบุคคลเดียวกัน เช่น รายการระหว่างกันที่สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศในประเทศไทย มีกับสำนักงานอื่นที่เป็นนิติบุคคลเดียวกันในต่างประเทศ เป็นต้น | ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศที่มีสาขาเปิดดำเนินการในต่างประเทศ และสาขาพาณิชย์ธนาคารต่างประเทศ มีชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ |
| To FI Interoffice Reporting Group Id | To หมายถึง รายการที่เกิดขึ้นระหว่างกันที่สำนักงานอื่นมีต่อสำนักงานในประเทศที่เป็นนิติบุคคลเดียวกัน เช่น รายการระหว่างกันที่สำนักงานอื่นที่เป็นนิติบุคคลเดียวกันในต่างประเทศ มีกับสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศในประเทศไทย เป็นต้น โดยมีความสัมพันธ์ของรายการระหว่างกันที่เกิดขึ้น ดังนี้   |  |  |  | | --- | --- | --- | | ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศที่มีสาขาเปิดดำเนินการในต่างประเทศและสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ | From | ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ | | To | ชุดรวมทุกสำนักงานในต่างประเทศ |   (Classification Name : FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบความสอดคล้องของชุดข้อมูล From FI Reporting Group Id (ต้นทาง) กับชุด To FI-Inter Office Reporting Group Id (ปลายทาง) ดังนี้   |  |  | | --- | --- | | From FI Reporting Group Id | To FI-Inter Office Reporting Group Id | | ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ | ชุดรวมทุกสำนักงานในต่างประเทศ | |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Items between Organization Units | รายการระหว่างกันด้านเจ้าหนี้และด้านลูกหนี้  (Classification Name: Items between Organization Units) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Items between Organization Units |
| Currency Flag | ประเภทสกุลเงินของรายการ  เงินบาท = ‘ 1 ’ เงินตราต่างประเทศ = ‘ 0 ’  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่า ‘ 0 ’ หรือ ‘ 1 ’ |
| Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | รายการเจ้าหนี้ = ผลรวมของรายการย่อยทุกรายการของรายการเจ้าหนี้  รายการลูกหนี้ = ผลรวมของรายการย่อยทุกรายการของรายการลูกหนี้ |

### Data Set : Interest Rate Risk (DS\_IRR)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Interest Rate Risk เป็นข้อมูลเกี่ยวกับความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยในบัญชีเพื่อการธนาคาร

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันวันสิ้นไตรมาส (เริ่มส่งข้อมูลงวดไตรมาสที่ 2/49)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์  ก็ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทย |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน กรณีเป็นสาขาธนาคารต่างประเทศ รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ  (Classification Name : FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น  yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาส (มี.ค., มิ.ย., ก.ย., ธ.ค.) ตามปีปฏิทิน |
| Banking Book Position | รายการของฐานะความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยให้ รายงานเฉพาะรายการที่อยู่ในบัญชีเพื่อการธนาคาร  (Classification Name: Banking Book Position) | *Validation Data Set:*  *-* ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน classification ชื่อ Banking Book Position  *-* ตรวจสอบว่าถ้าเป็นรายการที่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย และ  1. Amount มีค่า > 0 Repricing Term Range ต้องมีค่า หรือ  2. Amount มีค่า = 0 Repricing Term Range ต้องไม่มีค่า  *-* ตรวจสอบว่าถ้าเป็นรายการที่ไม่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย แล้ว Repricing Term Range ต้องไม่มีค่า |
| Repricing Term Range | ช่วงเวลาสำหรับรายการที่อ่อนไหวต่อการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ย  ช่วงเวลาของรายการที่มีอัตราดอกเบี้ยคงที่ หมายถึง ช่วงระยะเวลาตามอายุคงเหลือจนถึงวันที่ครบกำหนด  ช่วงเวลาของรายการที่มีอัตราดอกเบี้ยลอยตัว หมายถึง ช่วงระยะเวลาคงเหลือก่อนที่จะปรับอัตราดอกเบี้ยครั้งต่อไป  ช่วงเวลาของรายการที่ไม่มีอัตราดอกเบี้ยกำหนด หมายถึง ช่วงระยะเวลาตามอายุคงเหลือจนถึงวันที่ครบกำหนด | ตรวจสอบกับ Classification ใน Interest Rate Risk Term Range |
| Currency Id | รหัสสกุลเงิน  ...เฉพาะฐานะของสกุลเงินบาทและสกุลเงินต่างประเทศรายสกุลที่ สง. พิจารณาแล้วเห็นว่ามีนัยสำคัญให้ใส่รหัสสกุลเงินต่างประเทศ ใน Classification ชื่อ Currency Id  สำหรับฐานะเงินตราต่างประเทศสกุลอื่น ๆ ที่ สง. พิจารณาแล้วเห็นว่าไม่มีนัยสำคัญ ให้รายงานเป็นจำนวนเงินรวม โดยไม่ต้องใส่รหัสสกุลเงิน (Classification Name: Currency Id) | ตรวจสอบรหัสสกุลเงินต่างประเทศ Code ที่มีใน CL\_Currency Id |
| Amount | ยอดคงค้างตามบัญชีของรายการใน Banking Book Position หน่วยจะเป็นบาท  กรณีฐานะสกุลเงินต่างประเทศให้ใช้ยอดคงค้างสกุลเงินตราต่างประเทศคูณด้วยอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่รายงาน รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | *Validation Data Set:*  จำนวนเงิน (Amount) ของแต่ละรายการของชุดข้อมูล DS\_IRR (Classification : Banking Book Position) จะต้องมีค่า ≤ Balance Sheet Amount รายการเดียวกันในชุดข้อมูล DS\_BLS (Classification : Balance Sheet Item)  และ กรณีสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ DS\_IRR (Amount) : CL\_FI Reporting Group Id 116003 , CL\_Banking Book Position Code 990039 หัก 990036 = DS\_BLS (Balance Sheet Amount) : CL\_FI Reporting Group Id 116003 และ CL\_Balance Sheet Item Code 950546 |

### Data Set : FI Investment Position (DS\_IVP)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด FI Investment Position เป็นข้อมูลเกี่ยวกับเงินลงทุนในหลักทรัพย์ของสถาบันการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ  
 สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ก็ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Branch Number | รหัสสาขา (เฉพาะสาขาที่อยู่ในต่างประเทศของธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ตรวจสอบรหัสสาขาที่อยู่ในต่างประเทศของธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Investment Type | ประเภทเงินลงทุน  (Classification Name: Investment Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Investment Type |
| Returns Type | ประเภทของผลตอบแทนที่ได้รับจากการลงทุนในตราสารหนี้ (เฉพาะตราสารหนี้และตราสารหนี้ที่มีลักษณะคล้ายทุน)  (Classification Name: Returns Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Returns Type และตรวจสอบรหัส Classification ของ Investment Type = ตราสารหนี้และตราสารหนี้ที่มีลักษณะคล้ายทุน เท่านั้น |
| Coupon Rate | อัตราดอกเบี้ย หรือ ส่วนลด  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ตรวจสอบรหัส Classification ของ Returns Type = 437001(ดอกเบี้ย) และ 437002 (ส่วนลด) เท่านั้น |
| Maturity Date | วันครบกำหนดไถ่ถอน (เฉพาะตราสารหนี้ และตราสารหนี้ที่มีลักษณะคล้ายทุน)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Investment Country Id | ประเทศที่ผู้ออกตราสารนำตราสารออกจำหน่ายเป็นครั้งแรก (Initial Public Offering : IPO) (Classification Name: Country Id) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ในรหัสมาตรฐานของประเทศ (S.W.I.F.T. CODE) |
| Issuing Organization Id | เลขที่ประจำตัวผู้ออกตราสาร ให้ใช้เลขที่ประจำตัวที่สำคัญ และเปลี่ยนแปลงยาก เช่น นิติบุคคลเป็นผู้ออกตราสาร ซึ่งมีเลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลและเลขที่ประจำตัวผู้เสียภาษีอากร ก็ให้ใช้เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคล องค์กรที่ไม่มีเลขที่ประจำตัว ให้ใช้รหัสองค์กรที่ ธปท.กำหนด เป็นต้น (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ตรวจสอบขนาดความยาวของข้อมูลว่าต้องสอดคล้องกับ Unique Id Type |
| Unique Id Type | ประเภทของเลขที่ประจำตัวผู้ออกตราสาร  (Classification Name: Unique Id Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Unique Id Type |
| Investment Purpose Type | วัตถุประสงค์ในการลงทุน  (Classification Name: Investment Purpose Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Investment Purpose Type |
| Stock Acronym | ให้รายงานเฉพาะหลักทรัพย์ที่ซื้อขายใน SET, MAI และ ThaiBMA โดยให้รายงานชื่อย่อ ตามที่ใช้ในตลาดดังกล่าว เช่น “BBL” = ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Paid Up Share Unit | จำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของธุรกิจที่สถาบันการเงินถือหุ้นอยู่ เฉพาะที่เป็นตราสารทุนเท่านั้น |  |
| Investment Devalue Amount | ค่าเผื่อการด้อยค่าของเงินลงทุน จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | **Validation Data Set**   1. Data Set \_ BLS : กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ , บริษัทเงินทุน, บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002   กรณีสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  ตรวจสอบที่ Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item ( ข้อ 5.1.2.6 ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ + ข้อ 5.1.3.7 ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ + ข้อ 5.1.4.4 ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ + ข้อ 5.2.1.6 ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ + ข้อ 5.2.2.7 ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ + ข้อ 5.2.3.4 ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ + ข้อ 6.2 ค่าเผื่อการด้อยค่าของเงิน ลงทุน )  = Data set\_IVP : ผลรวม Investment Devalue Amount ที่ ยอดรวมของทุกสำนักงาน (ทั้งหมดที่ระบุและไม่ระบุใน Element : Branch Number )  2. Data Set \_ BLS : ตรวจสอบเฉพาะกรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ ตรวจสอบที่ Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group 116003 and CL\_Balance Sheet Item ( ข้อ 5.1.2.6 ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ + ข้อ 5.1.3.7 ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ + ข้อ 5.1.4.4 ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ + ข้อ 5.2.1.6 ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ + ข้อ 5.2.2.7 ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ + ข้อ 5.2.3.4 ค่าเผื่อการด้อยค่าของ หลักทรัพย์ + ข้อ 6.2 ค่าเผื่อการด้อยค่าของเงิน ลงทุน )  **=** Data set\_IVP : ผลรวม Investment Devalue Amount ที่ ยอดรวมของทุกสำนักงานในประเทศ (ที่ไม่ได้ระบุใน Element : Branch Number) |
| Total Increased Units | จำนวนหน่วยที่เปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นในงวดที่รายงานตัวเลขระหว่างเดือน (Flow) ที่เพิ่มขึ้นโดยแสดงตัวเลขจำนวนหน่วย  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Total Increased Value | มูลค่าที่เปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นในงวดที่รายงาน ตัวเลขระหว่างเดือนที่เพิ่มขึ้นโดยแสดงมูลค่าเป็นจำนวนเงิน (บาท) รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Total Decreased Units | จำนวนหน่วยที่เปลี่ยนแปลงลดลงในงวดที่รายงาน ตัวเลขระหว่างเดือน (Flow) ที่ลดลงโดยแสดงตัวเลขจำนวนหน่วย (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Total Decreased Value | มูลค่าที่เปลี่ยนแปลงลดลงในงวดที่รายงาน ตัวเลขระหว่างเดือนที่ลดลงโดยแสดงมูลค่าเป็นจำนวนเงิน (บาท) รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A[Data Set Document] : Data Type) |  |
| Price per Unit at Par | มูลค่าต่อหน่วยที่ตราไว้ ราคา Par ต่อ 1 หน่วย  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Investment Outstanding Unit Type | ประเภทของการถือครอง  (Classification Name: Investment Outstanding Unit Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Investment Outstanding Unit Type |
| Outstanding Units | จำนวนหน่วยที่ถือในแต่ละประเภทของการถือครอง แสดงเป็นจำนวนหน่วย (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Cost Value of Investment Outstanding Units | มูลค่าทุนที่ได้มาของเงินลงทุนในแต่ละประเภทของการถือครอง แสดงมูลค่าเป็นจำนวนเงิน (บาท) รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | **Validation Data Set**   1. Data Set \_ BLS : กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ , บริษัทเงินทุน, บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002   กรณีสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  Data set\_IVP : ยอดรวมของทุกสำนักงาน (ทั้งหมดที่ระบุและไม่ระบุใน Element : Branch Number )  ตรวจสอบที่เงื่อนไข   * 1. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนชั่วคราว หลักทรัพย์เพื่อค้า ข้อ 5.1.1.1 + ข้อ 5.1.1.2 + ข้อ 5.1.1.3+ ข้อ 5.1.1.4 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166002   2. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนชั่วคราว หลักทรัพย์เผื่อขายข้อ 5.1.2.1 + ข้อ 5.1.2.2 + ข้อ 5.1.2.3+ ข้อ 5.1.2.4 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166003   3. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนชั่วคราว ตราสารหนี้ที่จะถือจนครบกำหนด ข้อ 5.1.3.1 + ข้อ 5.1.3.2 + ข้อ 5.1.3.3 + ข้อ 5.1.3.4 + ข้อ 5.1.3.5+ ข้อ 5.1.3.6 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166004   4. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนชั่วคราว เงินลงทุนทั่วไป ข้อ 5.1.4.1 + ข้อ 5.1.4.2 + ข้อ 5.1.4.3 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166005   5. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนระยะยาว หลักทรัพย์เผื่อขาย ข้อ 5.2.1.1.1 + ข้อ 5.2.1.1.2 + ข้อ 5.2.1.1.3+ ข้อ 5.2.1.2.1 + ข้อ 5.2.1.2.2 + ข้อ 5.2.1.2.3 + ข้อ 5.2.1.2.4 + ข้อ 5.2.1.3 + ข้อ 5.2.1.4 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166007   6. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนระยะยาว ตราสารหนี้ที่จะถือจนครบกำหนด ข้อ 5.2.2.1 + ข้อ 5.2.2.2 + ข้อ 5.2.2.3+ ข้อ 5.2.2.4 + ข้อ 5.2.2.5+ ข้อ 5.2.2.6 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166008   7. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนระยะยาว เงินลงทุนทั่วไป ข้อ 5.2.3.1 + ข้อ 5.2.3.2 + ข้อ 5.2.3.3 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166009   8. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนในบริษัทย่อยและบริษัทร่วม ข้อ 6.1 + ข้อ 6.2 = (ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units หักด้วย Investment Devalue Amount) ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166010  1. Data Set \_ BLS : ตรวจสอบเฉพาะกรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003   Data set\_IVP : ยอดรวมของทุกสำนักงานในประเทศ (ที่ไม่ได้ระบุใน Element : Branch Number)  ตรวจสอบที่เงื่อนไข   * 1. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนชั่วคราว หลักทรัพย์เพื่อค้า ข้อ 5.1.1.1 + ข้อ 5.1.1.2 + ข้อ 5.1.1.3+ ข้อ 5.1.1.4 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166002   2. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนชั่วคราว หลักทรัพย์เผื่อขายข้อ 5.1.2.1 + ข้อ 5.1.2.2 + ข้อ 5.1.2.3+ ข้อ 5.1.2.4 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166003   3. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนชั่วคราว ตราสารหนี้ที่จะถือจนครบกำหนด ข้อ 5.1.3.1 + ข้อ 5.1.3.2 + ข้อ 5.1.3.3+ 5.1.3.4 + ข้อ 5.1.3.5+ ข้อ 5.1.3.6 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166004   4. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนชั่วคราว เงินลงทุนทั่วไป ข้อ 5.1.4.1 + ข้อ 5.1.4.2 + ข้อ 5.1.4.3 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166005   5. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนระยะยาว หลักทรัพย์เผื่อขาย ข้อ 5.2.1.1.1 + ข้อ 5.2.1.1.2 + ข้อ 5.2.1.1.3+ ข้อ 5.2.1.2.1 + ข้อ 5.2.1.2.2 + ข้อ 5.2.1.2.3 + ข้อ 5.2.1.2.4 + ข้อ 5.2.1.3 + ข้อ5.2.1.4 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166007   6. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนระยะยาว ตราสารหนี้ที่จะถือจนครบกำหนด ข้อ 5.2.2.1 + ข้อ 5.2.2.2 + ข้อ 5.2.2.3+ ข้อ 5.2.2.4 + ข้อ 5.2.2.5+ ข้อ 5.2.2.6 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166008   7. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนระยะยาว เงินลงทุนทั่วไป ข้อ 5.2.3.1 + ข้อ 5.2.3.2 + ข้อ 5.2.3.3 = ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166009   8. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item เงินลงทุนในบริษัทย่อยและบริษัทร่วม ข้อ 6.1 + ข้อ 6.2 = (ผลรวม Cost Value of Investment Outstanding Units หักด้วย Investment Devalue Amount) ที่ Cl\_Investment Purpose Type 166010 |
| Market or Fair or Equity Value of Investment Outstanding Units | มูลค่าตลาด/ราคายุติธรรม ณ วันสิ้นเดือนที่รายงานของเงินลงทุนในแต่ละประเภทของการถือครอง หัก ค่าเผื่อการด้อยค่า โดยแสดงมูลค่าเป็นจำนวนเงิน (บาท) รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  - กรณีเงินลงทุนในตราสารหนี้ที่จะถือจนครบกำหนด ให้รายงานช่องดังกล่าวด้วยมูลค่าตลาด/ราคายุติธรรม หัก ค่าเผื่อการด้อยค่า (ถ้ามี)  - กรณีเงินลงทุนในบริษัทย่อยและบริษัทร่วม ให้รายงานช่องดังกล่าวด้วยวิธีส่วนได้เสีย (Equity Method) หัก ค่าเผื่อการด้อยค่า (ถ้ามี) (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Operational Risk (DS\_OPR)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Operational Risk เป็นข้อมูลการดำรงฐานเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ ซึ่งมีวิธีการคำนวณ 3 วิธี คือ 1) Basic Indicator Approach (วิธี BIA) , 2) Standardized Approach (วิธี SA-OR) และ 3) Alternative Standardized Approach (วิธี ASA)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

**ลักษณะข้อมูล**

ราย 6 เดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้น 6 เดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด ธ.ค. 51 ส่วนสง.ที่มีรอบบัญชีสิ้นสุดเดือนมีนาคม และกันยายน เริ่มส่งข้อมูลงวด ก.ย. 51)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลใน Classification ชื่อ FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2551 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2008-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นงวดครึ่งปีตามปีบัญชีของสถาบันการเงินนั้น ๆ |
| Change Method | สถานะการเปลี่ยนแปลงวิธีคำนวณความเสี่ยงด้านปฏิบัติการจากงวดการบัญชีก่อน  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่เปลี่ยนแปลง  ค่า ‘1’ เท่ากับ เปลี่ยนแปลง หรือ รายงานข้อมูลครั้งแรก | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Operational Risk Method | วิธีที่ใช้คำนวณความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ  (Classification Name: Operational Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Operational Risk Method |
| Period Date | วันที่ของงวดการบัญชีที่รายงาน Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2551 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2008-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | - ถ้า Change Method มี Flag เป็น ‘0’ แล้ว Period Date ต้องเป็นวันเดียวกับ Data Set Date หรือ  - ถ้า Change Method มี Flag เป็น ‘1’ แล้ว Period Date มีรายการอย่างน้อย 1 งวดการบัญชี แต่ไม่เกิน 6 งวดการบัญชี โดย Period Date หนึ่งต้องเท่ากับ Data Set Date ส่วน Period Date ที่เหลือมีค่าเป็นไปได้ คืองวดการบัญชีย้อนหลัง 5 งวดการบัญชี นับจากวันที่ของของชุดข้อมูล |
| Operational Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ  (Classification Name: Operational Risk Item) | - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452001 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451001 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452003 หรือ 452007 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451004, 451005, 451007 ถึง 451012 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452004 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451003 และ 451006 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452005 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451003, 451007 ถึง 451012 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452006 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451004 ถึง 451006 |
| Amount | กรณีเป็นรายได้จากการดำเนินงานให้รายงานด้วยยอดสะสม 6 เดือน (ตามงวดการบัญชี) ก่อนคูณค่าคงที่ ( ß ) และกรณีของเงินให้สินเชื่อรวมดอกเบี้ยค้างรับ และเงินลงทุนในตราสารหนี้และตราสารทุน (ไม่รวมรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ก่อนหักเงินสำรองที่กันไว้ให้รายงานด้วยยอดคงค้าง ณ สิ้นงวดการบัญชีก่อนคูณค่าคงที่ m และค่าคงที่ ß จำนวนเงิน หน่วย จะเป็น บาท รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Provision and Expected Loss (DS\_PEL)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Provision and Expected Loss เป็นข้อมูลแสดงเงินสำรองที่ได้กันไว้ ทั้งที่เป็น General Provision และ Specific Provision สำหรับสถาบันการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด ธ.ค. 52)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลใน Classification ชื่อ FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2551 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2008-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| General Provision Allocation Method | วิธีการจัดสรร General Provision  (Classification Name: General Provision Allocation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ General Provision Allocation Method |
| General Provision SA | เงินสำรองที่เป็น General Provision สำหรับสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี SA  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| General Provision IRB | เงินสำรองที่เป็น General Provision สำหรับสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี IRB  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้ที่ใช้คำนวณหา Specific Provision  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449014 ถึง 449017  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) ,รหัส 446106(ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) และ 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 3. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Specific Provision | เงินสำรองที่เป็น Specific Provision และยอดหนี้ส่วนที่ได้ตัดออกจากบัญชีไปแล้วบางส่วน (Partial write-offs)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Provision Summary (DS\_PVS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Provision Summary เป็นข้อมูลเกี่ยวกับสรุปสินทรัพย์จัดชั้นและการกันเงินสำรองของสถาบันการเงิน (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ  
สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ก็ใช้รหัส 3 หลัก เหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน  กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงานชุดรวมทุกสำนักงานประเทศ ไม่รวม กิจการวิเทศธนกิจ  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาส (มี.ค., มิ.ย., ก.ย., ธ.ค.) ตามปีปฏิทิน |
| Provision Summary Item | รายการของสรุปสินทรัพย์จัดชั้นและเงินสำรอง รายงานเป็นยอดรวมคงค้าง ณ วันสิ้นไตรมาส ตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท. ประกาศกำหนด เรื่อง หลักเกณฑ์การจัดชั้นและการกันเงินสำรองของสถาบันการเงิน (Classification Name: Provision Summary Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Provision Summary Item |
| Asset Classification Type | ประเภทของสินทรัพย์จัดชั้น เช่น 020001 = ปกติ, 020002 = กล่าวถึงเป็นพิเศษ, 020003 = ต่ำกว่ามาตรฐาน เป็นต้น  (Classification Name : Asset Classification Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Asset Classification Type |
| Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. สินทรัพย์จัดชั้น สุทธิ = ผลรวมของลูกหนี้จัดชั้นส่วนที่ต้องกันสำรองตามเกณฑ์จัดชั้น, เงินลงทุนในหลักทรัพย์ และสินทรัพย์อื่น  2. สำรองส่วนเกิน (ขาด) = เงินสำรองที่มีอยู่ – เงินสำรองที่ต้องกันทั้งสิ้น  3. เงินสำรองที่ต้องกันทั้งสิ้น = ผลรวมของรายการย่อยของสำรองที่ต้องกัน ทั้งสิ้น  4. เงินสำรองที่มีอยู่ = ผลรวมของรายการย่อยของเงินสำรองที่มีอยู่ทั้งสิ้น |

### Data Set : Risk Weighted Assets (DS\_RWA)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Risk Weighted Assets เป็นข้อมูลเกี่ยวกับสินทรัพย์ถ่วงน้ำหนักตามความเสี่ยงของสถาบันการเงิน (สำหรับรายการจำนวนเทียบเท่าสินทรัพย์ของภาระผูกพัน คำนวณจากภาระผูกพันคูณด้วยค่าแปลงสภาพ ให้รายงานใน Data set ชุด Arrangement Summary)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ   
**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงิน คือ บริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002 -10-31 (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Risk Weighted Assets Item | รายการสินทรัพย์ถ่วงน้ำหนักตามความเสี่ยง  (Classification Name: Risk Weighted Asset Item) | กรณีที่เป็นบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Risk Weighted Assets Item |
| Asset Outstanding Amount | จำนวนเงินของยอดคงค้างของสินทรัพย์ หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็น ตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | รวมสินทรัพย์ = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยของสินทรัพย์ถ่วงน้ำหนักตามความเสี่ยง |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | จำนวนเงินของมูลค่าสินทรัพย์ถ่วงน้ำหนักตามอัตราความเสี่ยงที่กำหนด หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | รวมสินทรัพย์ถ่วงน้ำหนักตามความเสี่ยง = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยของสินทรัพย์ถ่วงน้ำหนักตามความเสี่ยง  Risk Weighted Asset Outstanding Amount = Asset Outstanding Amount คูณ Weight ของแต่ละรายการ |

### Data Set : Total Trading Book Position (DS\_TBP)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Total Trading Book Position เป็นข้อมูลสรุปปริมาณธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า (โดยให้รายงานด้วยมูลค่ายุติธรรมของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า ณ วันสิ้นเดือน)

การจัดทำข้อมูลส่ง ธปท. นั้น ให้สถาบันการเงินเริ่มจัดทำข้อมูลตั้งแต่เดือนที่สถาบันการเงินเริ่มประกอบธุรกรรมดังกล่าว หลังจากที่ได้เริ่มประกอบธุรกรรมแล้ว หากเดือนใดไม่มีข้อมูลการประกอบธุรกรรม ให้สถาบันการเงินรายงานข้อมูลของเดือนดังกล่าวใน Outstanding Amount ด้วยค่า 0

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้น 6 เดือน (สิ้นเดือน มิ.ย. และสิ้นเดือน ธ.ค.)

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วันนับจากวันสิ้นงวดที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด ธ.ค. 47)

| **Data Element (Field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนใช้รหัส 3 หลัก เหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ธนาคารพาณิชย์ไทยและบริษัทเงินทุนให้รายงาน เฉพาะชุด Solo (รวมทุกสำนักงาน) สำหรับสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศให้รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไม่รวมกิจการวิเทศธนกิจ และสถาบันการเงินพิเศษของรัฐให้รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char (10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นงวด 6 เดือนตามปีปฏิทิน |
| Month | เดือนของข้อมูล  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ถ้า Data Set Date คือ เดือน มิ.ย. แล้ว Month มีค่า 01 – 06  ถ้า Data Set Date คือ เดือน ธ.ค. แล้ว Month มีค่า 07 - 12 |
| Trading Book Position | ประเภทของธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้าแยกตามประเภทของฐานะและยอดรวมของปริมาณธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า  (Classification Name: Trading book Position ) |  |
| Outstanding Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

## Subject Area : Arrangement Summary

### Data Set : Arrangement Summary (ARS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Arrangement Summary เป็นข้อมูลเกี่ยวกับสรุปเงินฝาก เงินรับฝาก เงินให้สินเชื่อ (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว) เงินกู้ยืม และภาระผูกพัน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ  
 สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ใช้รหัส 3 หลัก เหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน และชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ  (Classification Name : FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Arrangement Type | ประเภทหรือรูปแบบของสัญญา (Arrangement type) ครอบคลุม เงินรับฝาก, เงินฝาก, เงินกู้ยืม, เงินให้สินเชื่อ, ภาระผูกพัน  (Classification Name : Arrangement Type) | ใช้ Classification เฉพาะส่วน Account Arrangement |
| CCF Rate | ระบุค่า Credit Conversion Factor ตามประกาศของ ธปท. ที่เกี่ยวข้อง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ระบุค่า Credit Conversion Factor (กรณี Arrangement Type เป็นภาระผูกพัน) ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขจะไม่มีค่า |
| RWA Rate | ระบุค่า Risk Weighted Asset ตามประกาศของ ธปท. ที่เกี่ยวข้อง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ระบุค่า Risk Weighted Assets (กรณี Arrangement Type เป็นภาระผูกพัน)  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขจะไม่มีค่า |
| Involved Party Type | ประเภทของผู้ทำสัญญา (Involved Party)  (Classification Name: Involved Party Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Involved Party Type |
| Arrangement Term Range | ช่วงระยะเวลาของสัญญา (Original Time) เช่น สัญญาเงินกู้ยืมมีกำหนดเวลา 4 ปี (ยกเว้นเรื่องภาระผูกพัน)  (Classification Name: Term Range) | ไม่รวม Classification Item ที่เป็น Short term, Long Term และ No age |
| Remaining Term Range | ช่วงระยะเวลาที่เหลือของสัญญานับจากวันที่รายงานถึงวันครบกำหนด เช่น สัญญาเงินกู้ 36 เดือน (เป็น Original Time) แต่ปัจจุบันอายุสัญญา ใช้ไปแล้ว 6 เดือน คงเหลือเป็น Remaining เป็นเวลา 30 เดือน (ยกเว้นเรื่องภาระผูกพัน)  (Classification Name: Term Range) | ไม่รวม Classification Item ที่เป็น Short term, Long Term และ No age |
| Repricing Term Range | ช่วงระยะเวลาที่จะปรับอัตราดอกเบี้ยครั้งต่อไปนับจากวันที่รายงาน (ยกเว้นเรื่องภาระผูกพัน)  (Classification Name: Term Range) | ไม่รวม Classification Item ที่เป็น Short term, Long Term และ No age |
| Arrangement Currency Flag | ประเภทสกุลเงินของสัญญา  เงินบาท - ‘ 1 ’ เงินตราต่างประเทศ - ‘ 0 ’ (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ค่าเป็น ‘ 0 ’ หรือ ‘ 1 ’ |
| Outstanding Amount Range | ช่วงยอดคงค้างของเงินรับฝาก  (Classification Name: Amount Range) | เฉพาะกรณีที่ Arrangement Type เป็นเงินรับฝาก |
| Number of Accounts | จำนวนบัญชี (ยกเว้นเรื่องภาระผูกพัน)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Total Outstanding Amount | ยอดเงินคงค้าง หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Validation Data Set:   1. Data Set \_ BLS : กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ , บริษัทเงินทุน, บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002   กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ, สาขาพาณิชย์ธนาคารต่างประเทศ, สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  Data set\_ARS : กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ , บริษัทเงินทุน, บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002  กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ, สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ, สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  ตรวจสอบที่เงื่อนไข   * 1. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item ข้อ 2.1.1 + ข้อ 2.2.1 = Total Outstanding Amount ที่ Cl\_ Arrangement Type เป็น FI Deposit (เงินฝาก)   2. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item ข้อ 2.1.2 + ข้อ 2.2.2 + ข้อ 7.1 + เงินให้สินเชื่อแก่ลูกหนี้ตามธุรกรรมนโยบายรัฐ [เฉพาะ SFIs] - ข้อ 2.5 - ข้อ 7.4 - หัก รายได้รอตัดบัญชีจากธุรกรรมนโยบายรัฐ [เฉพาะ SFIs] = Total Outstanding Amount ที่ Cl\_ Arrangement Type เป็น Lending (เงินให้สินเชื่อ)   3. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item ข้อ 14.1 + ข้อ 14.2 + ข้อ 14.3 + ข้อ 14.4 + ข้อ 14. 5 + ข้อ 15.1.1 + ข้อ 15.2.1 + ข้อ 18.1.1 + ข้อ 18.2.1 = Total Outstanding Amount ที่ Cl\_ Arrangement Type เป็น Deposit from Customer (เงินรับฝาก)   4. Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item ข้อ 15.1.2 + ข้อ 15.2.2 + ข้อ 18.1.2 + ข้อ 18.2.2 + ข้อ 20.1 + ข้อ 20.2 = Total Outstanding Amount ที่ Cl\_ Arrangement Type เป็น Borrowing   2. Data Set \_ARS : Total Outstanding Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 และ CL\_Arrangement Type Code 018003 ,018005 , 018011 , 018012, 018013 , 018015 , 018016 , 018017 , 018018 , 018019 , 018020, 018021 , 018022 , 018025 , 018026 , 018028 , 018029 , 018030 , 018031, 018007, 018008, 018009, 018010  = Data Set \_LPS : Total Outstanding Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 และ CL\_Arrangement Type Code 018003 ,018005 , 018011 , 018012, 018013 , 018015 , 018016 , 018017 , 018018 , 018019 , 018020 , 018021 , 018022 , 018025 , 018026 , 018028 , 018029 , 018030 , 018031, 018007, 018008, 018009, 018010 ตามลำดับ  3. ตรวจสอบเฉพาะกรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ และสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ Data Set \_ARS : Total Outstanding Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 และ CL\_Arrangement Type Code 018003 ,018004 , 018023 , 018114 , 018039 , 018040, 018042+018043, 018044 = Data Set \_IRO : Outstanding Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 และ CL\_Interest Rate Outstanding Type Code 162023, 162024, 162025, 162027, 162050, 162020, 162021, 162051 ตามลำดับ |

### Data Set : Arrangement Movement Summary (DS\_AMS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Arrangement Movement Summary เป็นข้อมูลสรุปการเปลี่ยนแปลงของเงินฝาก เงินรับฝาก เงินให้สินเชื่อ (โดยให้รายงานด้วยยอดเปลี่ยนแปลงสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว) และเงินกู้ยืม โดยให้รายงานจำนวนเงินที่เปลี่ยนแปลงที่เกิดจากการเปลี่ยนแปลงอัตราแลกเปลี่ยน, การเปลี่ยนแปลงอื่นๆ ได้แก่ การตัดหนี้สูญ รวมทั้งส่วนสูญเสียจากการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ โดยการเปลี่ยนแปลงสุทธิที่ทำให้สินทรัพย์และหนี้สินดังกล่าวข้างต้นลดลงจะต้องแสดงค่าเป็นลบ

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ  
 สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วันนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวดไตรมาสที่ 1/50)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนใช้รหัส 3 หลัก เหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ให้รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาส (มี.ค., มิ.ย., ก.ย., ธ.ค.) ตามปีปฏิทิน |
| Arrangement Type | ประเภทหรือรูปแบบของสัญญา (Arrangement type) ครอบคลุม เงินรับฝาก, เงินฝาก, เงินกู้ยืม, เงินให้สินเชื่อ  (Classification Name : Arrangement Type) | ใช้ Classification เฉพาะส่วน Account Arrangement ให้รายงานเฉพาะหัวข้อหลักเท่านั้น  เงินให้สินเชื่อ รายงานเฉพาะ เงินเบิกเกินบัญชี (018003) เงินให้กู้ยืม (018004) ตั๋วเงิน (018023) เงินให้กู้ยืมอื่น ๆ (018114)  เงินกู้ยืม รายงานเฉพาะ เงินกู้ยืมแบบมีระยะเวลา (018033) เงินเบิกเกินบัญชี (018034) ตั๋วเงิน (018035)  เงินรับฝาก รายงานเฉพาะ Demand Deposit (018038) Term Deposit (018041)  เงินฝาก รายงานเฉพาะ Demand Deposit (018046) Term Deposit (018049) |
| Involved Party Type | ประเภทของผู้ทำสัญญา (Involved Party)  (Classification Name: Involved Party Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Involved Party Type |
| Arrangement Term Range | ช่วงระยะเวลาของสัญญา (Original Time)  (Classification Name: Term Range) | ให้รายงานเฉพาะหัวข้อ Short term (310001) และ Long Term (310018) |
| Arrangement Currency Flag | ประเภทสกุลเงินของสัญญา  เงินบาท - ‘1’ เงินตราต่างประเทศ - ‘0’  กรณี Arrangement currency Flag มีค่าเท่ากับ 0 แล้ว Arrangement Type มีค่าที่เป็นไปได้เท่ากับ เงินเบิกเกินบัญชี (018003) เงินให้กู้ยืม (018004) ตั๋วเงิน (018023) เงินให้กู้ยืมอื่น ๆ (018114) เงินกู้ยืมแบบ มีระยะเวลา (018033) เงินเบิกเกินบัญชี (018034) ตั๋วเงิน (018035) Demand Deposit (018038) Term Deposit (018041) และ FI Deposit : Demand Deposit (018046) Term Deposit (018049)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. ค่าเป็น ‘0’ หรือ ‘1’  2. ถ้า Arrangement currency Flag มีค่าเท่ากับ 1 แล้ว Arrangement Type มีค่า ที่เป็นไปได้ เท่ากับ เงินเบิกเกินบัญชี (018003) เงินให้กู้ยืม (018004) ตั๋วเงิน (018023) และอื่นๆ (018114) |
| Movement Amount Type | ประเภทการเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นระหว่างงวด  (Classification Name: Balance Sheet Amount Type)  ถ้า Movement Amount Type = Exchange Rate Change (014031) แล้วArrangement Type เป็นไปได้เท่ากับ เงินเบิกเกินบัญชี (018003) เงินให้กู้ยืม (018004) ตั๋วเงิน (018023) เงินให้กู้ยืมอื่น ๆ (018114) เงินกู้ยืมแบบมีระยะเวลา (018033) เงินเบิกเกินบัญชี (018034) ตั๋วเงิน (018035) Demand Deposit (018038) Term Deposit (018041) และ FI Deposit : Demand Deposit (018046) Term Deposit (018049) และ Arrangement Currency Flag จะมีค่าเป็น ‘0’ (เงินตราต่างประเทศ) เท่านั้น  ถ้า Movement Amount Type = Other Change (014033) แล้ว Arrangement Type ที่เป็นไปได้เท่ากับ เงินเบิกเกินบัญชี (018003) เงินให้กู้ยืม (018004) ตั๋วเงิน (018023) เงินให้กู้ยืมอื่น ๆ (018114) และ Arrangement Currency Flag จะมีค่าที่เป็นไปได้ทั้ง ‘0’ (เงินตราต่างประเทศ) และ ‘1’ (เงินบาท) | 1. ให้รายงานเฉพาะหัวข้อ Exchange Rate Change และ Other Change  2. ถ้า Arrangement Type มีค่าเท่ากับ 018003, 018004, 018023, 018114 และ Movement Amount Type = 014031 (Exchange Rate Change) แล้ว Arrangement Currency Flag จะมีค่าเป็น ‘0’ (เงินตราต่างประเทศ) เท่านั้น  3. ถ้า Arrangement Type มีค่าเท่ากับ 018033, 018034, 018035, 018038, 018041, 018046 และ018049 แล้ว Movement Amount Type = 014031 (Exchange Rate Change) และ Arrangement Currency Flag จะมีค่าเป็น ‘0’ (เงินตราต่างประเทศ) เท่านั้น |
| Movement Amount | จำนวนเงินที่เปลี่ยนแปลง  1. Exchange Rate Change ให้แสดงเครื่องหมายลบหน้าจำนวนเงิน  กรณีเป็นการเปลี่ยนแปลงลดลงจากสิ้นไตรมาสก่อน  2. Other Change ให้แสดงเครื่องหมายลบหน้าจำนวนเงินที่เกิดจากการตัดหนี้สูญ และส่วนสูญเสียจากการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ ที่เกิดขึ้นในระหว่างงวดกรณีเป็นการเปลี่ยนแปลงลดลงจากสิ้นไตรมาสก่อน  หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Validation Data Set : ที่ไม่ได้ตรวจสอบโดยระบบ  ค่าสัมบูรณ์ของยอดรวม Movement Amount ที่มีค่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ 0 ของ DS\_AMS ที่ Balance Sheet Amount Type CL\_ID 014033 >= Movement Amount ของ DS\_LMS ที่ Movement Type CL\_ID 202005 + 202046 + 202047 |

### Data Set : Deposit Classified by Type of Depositor (DS\_DCD)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด **Deposit Classified by Type of Depositor** เป็นข้อมูลเงินรับฝากรายผู้ฝากแยกตามประเภทผู้ฝากและขนาดเงินฝาก

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน (เฉพาะสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ลักษณะข้อมูลรายไตรมาส)

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน (เฉพาะสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ความถี่ทุกสิ้นไตรมาส)

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน เฉพาะสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ กำหนดการส่งภายใน 21 วันนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวดไตรมาสที่ 1/49)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ใช้รหัส 3 หลัก เหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศClassification Name: FI Reporting Group Id | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char (10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือน ตามปีปฏิทิน  ยกเว้น สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาส (มี.ค., มิ.ย., ก.ย., ธ.ค.) ตามปีปฏิทิน |
| Involved Party Type | ประเภทของผู้ทำสัญญา (Involved Party)  (Classification Name: Involved Party Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification Name: Involved Party Type |
| Protection Flag | ความคุ้มครองตามกฎหมาย ที่กำหนดในพระราชบัญญัติสถาบันคุ้มครองเงินฝาก พ.ศ. 2551 และประกาศคณะกรรมการสถาบันคุ้มครองเงินฝาก  กรณีไม่คุ้มครอง ใส่ ‘0’  กรณีคุ้มครองใส่ ‘1’ |  |
| Outstanding Amount Range | ช่วงยอดคงค้างของเงินรับฝาก แยกตามช่วงเงินฝาก  (Classification Name: Amount Range) |  |
| Number of Customers | จำนวนรายผู้ฝาก  จำนวนรายผู้ฝาก หมายถึง จำนวนรายผู้ฝากผู้เป็นเจ้าของบัญชีแยกตามเลขที่ประจำตัวของผู้ฝาก เช่น เลขประจำตัวประชาชน เลขที่หนังสือเดินทาง เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคล หรือรหัสอื่น ๆ ที่ออกให้โดยหน่วยงานราชการ หรือองค์กรที่น่าเชื่อถือ ทั้งนี้ กรณีบัญชีเงินฝากที่มีชื่อบุคคลหลายคนร่วมกันเป็นเจ้าของบัญชี ต้องรายงานจำนวนรายผู้ฝากทุกรายที่มีสิทธิตามหลักฐานการฝากเงินที่สถาบันการเงินมีอยู่อย่างชัดแจ้ง  ยกตัวอย่าง เช่น กรณีสถาบันการเงินมีบัญชีเงินฝากออมทรัพย์ของนาย ก จำนวน 5 บัญชี ให้สถาบันการเงินรายงานจำนวนรายผู้ฝากจำนวน 1 ราย หรือกรณีมีบัญชีเงินฝากออมทรัพย์ของนาย ก จำนวน 5 บัญชี และมีบัญชีเงินฝากออมทรัพย์ร่วมระหว่างนาย ก และ นาย ข จำนวน 1 บัญชี  ให้สถาบันการเงินรายงานจำนวนรายผู้ฝากจำนวน 2 ราย เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Arrangement Type | ประเภทหรือรูปแบบของสัญญา (Arrangement type) ที่เป็นเงินรับฝาก (Classification Name : Arrangement Type) |  |
| Total Outstanding Amount | ยอดเงินคงค้างเฉพาะสกุลเงินบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก หน่วยจะเป็นบาท  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | *Validation Data Set:*  1. Total Outstanding Amount ของ DS\_DCD ที่ Arrangement Type CL\_ID 018039 = Total Outstanding Amount ของ DS\_ARS ที่ Arrangement Type CL\_ID 018039 เมื่อ Arrangement Currency Flag เป็น ‘1’  2. Total Outstanding Amount ของ DS\_DCD ที่ Arrangement Type CL\_ID 018040 = Total Outstanding Amount ของ DS\_ARS ที่ Arrangement Type CL\_ID 018040 เมื่อ Arrangement Currency Flag เป็น ‘1’  3. Total Outstanding Amount ของ DS\_DCD ที่ Arrangement Type CL\_ID 018042 = Total Outstanding Amount ของ DS\_ARS ที่ Arrangement Type CL\_ID 018042 เมื่อ Arrangement Currency Flag เป็น ‘1’  4. Total Outstanding Amount ของ DS\_DCD ที่ Arrangement Type CL\_ID 018043 = Total Outstanding Amount ของ DS\_ARS ที่ Arrangement Type CL\_ID 018043 เมื่อ Arrangement Currency Flag เป็น ‘1’  5. Total Outstanding Amount ของ DS\_DCD ที่ Arrangement Type CL\_ID 018044 = Total Outstanding Amount ของ DS\_ARS ที่ Arrangement Type CL\_ID 018044 เมื่อ Arrangement Currency Flag เป็น ‘1’ |

### Data Set : Lending Movement Summary (DS\_LMS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Lending Movement Summary เป็นข้อมูลสรุปการเปลี่ยนแปลงของเงินให้สินเชื่อ การเปลี่ยนแปลงสถานะการเป็น NPL (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว) และวงเงินให้สินเชื่อ

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวดไตรมาสที่ 1/48)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ใช้รหัส 3 หลัก เหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน ยกเว้น ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ รายงานชุดรวมทุกสำนักงานและชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ และสถาบันการเงินพิเศษของรัฐให้รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ  **(**Classification Name : FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาส (มี.ค., มิ.ย., ก.ย., ธ.ค.) ตามปีปฏิทิน |
| Arrangement Type | ประเภทการให้สินเชื่อ (เฉพาะเงินให้สินเชื่อ)  (Classification Name : Arrangement Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Arrangement Type |
| Lending Business type | ประเภทธุรกิจที่นำเงินไปใช้ซึ่งอาจจะต่างจากประเภทธุรกิจของผู้กู้ ใช้รหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ยกเว้นลูกหนี้ที่เป็นบุคคลธรรมดาและกู้เพื่อการอุปโภคส่วนบุคคลใช้ Classification ใน Personal Consumption) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ในรหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ISIC BOT Code Rev.4) ในระดับต่ำสุดของหมวดนั้น ๆ (รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS”) หรือหมวดย่อยสุดใน Classification ชื่อ Personal Consumption |
| NPL Flag | การเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นมีผลกระทบต่อจำนวน NPL ของสถาบันการเงินหรือไม่  ไม่กระทบ = ‘0’, กระทบ = ‘1’  ยกเว้น การรายงานการเปลี่ยนแปลงวงเงินให้รายงาน NPL Flag = ‘0’ | ค่าเป็น ‘0’ หรือ ‘1’ |
| Movement Type | ประเภทการเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นระหว่างงวด  (Classification Name : Movement Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Movement Type |
| Movement Amount | จำนวนเงินที่เปลี่ยนแปลง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type)  สำหรับลูกหนี้เงินเบิกเกินบัญชี ให้รายงาน Movement Type และ Movement Amount เป็นจำนวนเงินที่เปลี่ยนแปลงสุทธิ (ยอด Net) ที่เกิดขึ้นในงวดนั้น (ยอดคงค้างปลายงวด – ยอดคงค้างต้นงวด) เช่น ในงวด มี.ค. 48 มีการให้สินเชื่อเพิ่มและรับชำระหนี้คืน ทั้งสิ้น 5 รายการ จากลูกหนี้เงินเบิกเกินบัญชี 1 ราย (รายเก่า) โดยมียอดคงค้างปลายงวดเพิ่มขึ้น สุทธิ 100 บาท ให้ สง. รายงาน Movement Type ด้วย Code 202051 หรือ 202052 แล้วแต่กรณี (ให้สินเชื่อเพิ่ม รายเก่า) 100 บาท เป็นต้น | Validation Data Set : ที่ไม่ได้ตรวจสอบโดยระบบ  1. การเปลี่ยนแปลงจำนวนเงิน  ยอดคงค้างปลายงวดในรายงาน TCS (ณ สิ้นไตรมาสนี้) = ยอดคงค้างปลายงวดในรายงาน TCS ( ณ สิ้นไตรมาสที่แล้ว) - ยอดลดลง + ยอดเพิ่มขึ้น  2. การเปลี่ยนปลงของ NPL  ยอดคงค้างปลายงวดในรายงาน TCS ที่มี Asset Classification Type 020003, 020004, 020005, 020006 (ณ สิ้นไตรมาสนี้) = ยอดคงค้างปลายงวด ในรายงาน TCS ที่มี Asset Classification Type 020003, 020004, 020005, 020006 ( ณ สิ้นไตรมาสที่แล้ว) - ยอดลดลง ที่มี NPL Flag = ‘1’ + ยอดเพิ่มขึ้น ที่มี NPL Flag = ‘1’ - NPL ลดลง จำนวนเงินไม่เปลี่ยนแปลง (Movement Type 202058, 202059, 202060) + NPL เพิ่มขึ้น จำนวนเงินไม่เปลี่ยนแปลง (Movement Type 202055, 202056)  3. การเปลี่ยนแปลงวงเงิน  วงเงินปลายงวด( ณ สิ้นไตรมาสนี้) (Movement Type 202037) = วงเงินต้นงวด (ณ สิ้นไตรมาสนี้) (Movement Type 202032) +วงเงินเพิ่มใหม่(Movement Type 202034) +วงเงินเพิ่มรายเก่า (Movement Type 202035) - วงเงินลดรายเก่า (Movement Type 202036) |

### Data Set : Lending Operation Progress Outstanding (DS\_LOS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Lending Operation Progress Outstanding **เป็นข้อมูลสรุปสินเชื่อที่อยู่ระหว่างการดำเนินการทางศาล**

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ  
**สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ**

**บริษัทเงินทุน**

**บริษัทเครดิตฟองซิเอร์**

**ลักษณะข้อมูล**

**ราย**ไตร**มาส**

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

**ทุกสิ้นไตรมาส**

**กำหนดการส่ง**

**ภายใน 21 วันนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน**

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุน และบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ  **(**Classification Name : FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของข้อมูล ใช้ปี ค.ศ.โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  Data Type = Char(10) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาส (มี.ค., มิ.ย., ก.ย., ธ.ค.) ตามปีปฏิทิน |
| Court Case Item | กระบวนการทางศาล ตามคำสั่งผู้ตรวจการลงวันที่ 10 สิงหาคม 2543  (Classification Name : Court Case Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Court Case Item |
| Operation Progress Term Range | ระยะเวลาคงค้างในแต่ละสถานะการดำเนินการ  (Classification Name : Operation Progress Term Range) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Operation Progress Term Range |
| Number of Customers | ให้รายงานเป็นจำนวนลูกหนี้ เมื่อลูกหนี้ยังไม่ได้เข้าสู่การดำเนินการทางศาล หรือ รายงานเป็นจำนวนคดี เมื่อลูกหนี้อยู่ในระหว่างการดำเนินการทางศาล, ศาลพิพากษาแล้วแต่ยังไม่ได้บังคับคดี และอยู่ระหว่างบังคับคดี  Data type = Number (12) |  |
| Outstanding Amount | จำนวนยอดคงค้างตามบัญชี  Data Type = Number (20,2) จำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 ตำแหน่ง |  |
| Claim Outstanding Amount | จำนวนยอดคงค้างตามสิทธิเรียกร้อง  Data Type = Number (20,2) จำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 ตำแหน่ง |  |
| Collateral Amount | มูลค่าหลักประกัน  Data Type = Number (20,2) จำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 ตำแหน่ง |  |

### Data Set : Lending Purpose Summary (DS\_LPS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Lending Purpose Summary เป็นข้อมูลสรุปวัตถุประสงค์การให้สินเชื่อแยกตามประเภทลูกหนี้ (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ  
 สาขาธนาคาร**พาณิชย์**ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุน และบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ  (Classification Name : FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Lending Arrangement Type | เงินให้สินเชื่อแยกตามประเภทลูกหนี้  (Classification Name : Arrangement Type) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ชื่อ Arrangement Type เฉพาะส่วนของ Lending |
| Purpose Type | เงินให้สินเชื่อที่แยกตามวัตถุประสงค์การกู้ โดยแยกเป็น 3 หลักใหญ่ คือ เพื่ออุปโภคบริโภคส่วนบุคคล, เพื่อการพาณิชย์ และเพื่ออื่น ๆ  (Classification Name : Arrangement Purpose Code) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ชื่อ Arrangement Purpose Code |
| Number of Accounts | จำนวนบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Total Outstanding Amount | จำนวนยอดสินเชื่อคงค้างตามบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Validation Data Set:  Data Set \_BLS : กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ ,สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ, สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  กรณีบริษัทเงินทุน, บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002  Data Set \_LPS : กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ ,สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ, บริษัทเงินทุน, บริษัทเครดิตฟองซิเอร์, สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  ตรวจสอบที่ Balance Sheet Amount ที่ Balance Sheet Item ( 2.1.2 เงินให้สินเชื่อ + 2.2.2 เงินให้สินเชื่อ + 7.1 เงินให้สินเชื่อ + เงินให้สินเชื่อแก่ลูกหนี้ตามธุรกรรมนโยบายรัฐ [เฉพาะ SFIs] – 2.5 หัก รายได้รอตัดบัญชี - 7.4 หัก รายได้รอตัดบัญชี - หัก รายได้รอตัดบัญชีจากธุรกรรมนโยบายรัฐ [เฉพาะ SFIs]) = Data Set \_LPS ที่ Total Outstanding Amount |

### Data Set : Lending Summary classified by Business (DS\_LSB)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Lending Summary classified by Business เป็นข้อมูลสรุปเงินให้สินเชื่อแยกตามประเภทธุรกิจ (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวดไตรมาสที่ 1/48)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ใช้รหัส 3 หลัก เหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Branch Number | กรณีที่เป็นชุดข้อมูลระดับสาขาให้รายงานเป็นรายสาขาในประเทศและสาขาต่างประเทศ โดยใช้รหัสสาขาเดิมของสถาบันการเงิน ซึ่งเป็นรหัส 3 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 หลัก เช่น ธนาคารกรุงเทพ สาขาถนนรัชดาห้วยขวาง รหัสสาขา 055 จะเป็น 0055 | ให้ตรวจสอบรหัสสาขาของ Organization Id กับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงิน |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาส (มี.ค., มิ.ย., ก.ย., ธ.ค.) ตามปีปฏิทิน |
| Business Size | แยกขนาดธุรกิจออกเป็นขนาดย่อม, กลาง และใหญ่ **ยกเว้น**  - ข้อมูลของสาขาและสำนักงานตัวแทนที่อยู่ในต่างประเทศของธนาคารพาณิชย์ไทย  - ข้อมูลของลูกหนี้ที่เป็นบุคคลธรรมดาและกู้เพื่อการอุปโภคบริโภคส่วนบุคคล | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Business Size |
| Lending Business type | ประเภทธุรกิจที่นำเงินไปใช้ซึ่งอาจจะต่างจากประเภทธุรกิจของผู้กู้ ใช้รหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ยกเว้นลูกหนี้ที่เป็นบุคคลธรรมดาและกู้เพื่อการอุปโภคส่วนบุคคลใช้ Classification ใน Personal Consumption) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ในรหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ISIC BOT Code Rev.4) ในระดับต่ำสุดของหมวดนั้น ๆ (รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS”) หรือหมวดย่อยสุดใน Classification ชื่อ Personal Consumption |
| Number of Customers | จำนวนรายลูกหนี้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Total Outstanding Amount | ยอดคงค้างเงินให้สินเชื่อ  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Validation Data Set : *ที่ไม่ได้ตรวจสอบโดยระบบ*  1. Lending Summary classified by Business (Total Outstanding Amount) = Balance Sheet Item ชุดรวมทุกสำนักงาน ( 2.1.2 เงินให้สินเชื่อ + 2.2.2 เงินให้สินเชื่อ + 7.1 เงินให้สินเชื่อ + เงินให้สินเชื่อแก่ลูกหนี้ตามธุรกรรมนโยบายรัฐ [เฉพาะ SFIs] - 2.5 หัก รายได้รอตัดบัญชี - 7.4 หัก รายได้รอตัดบัญชี - หัก รายได้รอตัดบัญชีจากธุรกรรมนโยบายรัฐ [เฉพาะ SFIs] )  2. การตรวจสอบกับ ข้อมูล Provision Summary (DS\_PVS)  2.1 กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์  Lending Summary classified by Business(Total Outstanding Amount) = Provision Summary Item (1.1.1.1 สินเชื่อจัดชั้น )  2.2 กรณีสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ  Lending Summary classified by Business(Total Outstanding Amount) >= Provision Summary Item (1.1.1.1 สินเชื่อจัดชั้น ) |

### Data Set : Total Classified Lending Summary (DS\_TCS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Total Classified Lending Summary เป็นข้อมูลสรุปเงินให้สินเชื่อและสินทรัพย์อื่นที่เกี่ยวข้องจัดชั้นแยกตามประเภทธุรกิจ (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด ม.ค. 48)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ใช้รหัส 3 หลัก เหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน  **(**Classification Name : FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Arrangement Type | ประเภทการให้สินเชื่อ (เฉพาะเงินให้สินเชื่อ และสินทรัพย์อื่นที่เกี่ยวข้อง)  (Classification Name : Arrangement Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Arrangement Type |
| Business Size | แยกขนาดธุรกิจออกเป็นขนาดย่อม, ขนาดกลาง และขนาดใหญ่  (Classification Name : Business Size) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Business Size  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ**  สำหรับที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002 Business Size ต้องว่าง เมื่อ Arrangement Type เป็นสินทรัพย์อื่นที่เกี่ยวข้อง หรือ Lending Business Typeเป็นการกู้เพื่อการอุปโภคบริโภคส่วนบุคคล ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขจะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้ ( Business Size ไม่มีค่า กรณี Arrangement Type เป็นเงินให้สินเชื่อ และ Lending Business Type รหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ ในส่วนของข้อมูลที่มาจากสาขาธนาคารพาณิชย์ไทยในต่างประเทศ)  สำหรับที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 ระบุ Business Size กรณี Arrangement Type เป็นเงินให้สินเชื่อ และ Lending Business Type รหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขจะไม่มีค่า  **กรณีสาขาธนาคาร**พาณิชย์**ต่างประเทศ**  สำหรับที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003 ระบุ Business Size กรณี Arrangement Type เป็นเงินให้สินเชื่อ และ Lending Business Type รหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขจะไม่มีค่า  **บริษัทเงินทุน, บริษัทเครดิตฟองซิเอร์**  สำหรับที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002 ระบุ Business Size กรณี Arrangement Type เป็นเงินให้สินเชื่อ และ Lending Business Type รหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขจะไม่มีค่า |
| Lending Business type | ประเภทธุรกิจที่นำเงินไปใช้ซึ่งอาจจะต่างจากประเภทธุรกิจของผู้กู้ ใช้รหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ยกเว้นลูกหนี้ที่เป็นบุคคลธรรมดาและกู้เพื่อการอุปโภคส่วนบุคคลใช้ Classification ใน Personal Consumption) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ในรหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ISIC BOT Code Rev.4) ในระดับต่ำสุดของหมวดนั้น ๆ (รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS”) หรือหมวดย่อยสุดใน Classification ชื่อ Personal Consumption |
| Asset Classification Type | ประเภทการจัดชั้น  (Classification Name: Asset Classification Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Asset Classification Type |
| TDR Type | เกณฑ์การปรับโครงสร้างหนี้  (Classification Name : TDR Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ TDR Type |
| Operation Progress | สถานะการดำเนินการสุดท้าย ณ วันที่รายงาน  (Classification Name : Operation Progress) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Operation Progress |
| Total Outstanding Amount | ยอดเงินคงค้างก่อนหักค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญ  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Validation Data Set : ที่ไม่ได้ตรวจสอบโดยระบบ  1. เงินให้สินเชื่อ  1.1 Total Classified Lending Summary (Total Outstanding Amount) เฉพาะเงินให้สินเชื่อ = Balance Sheet (Balance Sheet Amount) ที่ Balance Sheet Item ชุดรวมทุกสำนักงาน ( 2.1.2 เงินให้สินเชื่อ + 2.2.2 เงินให้สินเชื่อ + 7.1 เงินให้สินเชื่อ + เงินให้สินเชื่อแก่ลูกหนี้ตามธุรกรรมนโยบายรัฐ [เฉพาะ SFIs] - 2.5 หัก รายได้รอตัดบัญชี - 7.4 หัก รายได้รอตัดบัญชี - หัก รายได้รอตัดบัญชีจากธุรกรรมนโยบายรัฐ [เฉพาะ SFIs] )  Validation Data Set: *ที่ตรวจสอบโดยระบบ*  1.2 การตรวจสอบกับ ข้อมูล Provision Summary (DS\_PVS)  1.2.1 กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ บริษัทเงินทุน บริษัท เครดิตฟองซิเอร์ Total Classified Lending Summary (Total Outstanding Amount) = Provision Summary (Amount ) ที่ Provision Summary Item (1.1.1.1 สินเชื่อจัดชั้น )  (Data Set\_TCS : CL\_FI Reporting Group Id 116002 = Data Set\_PVS : CL\_FI Reporting Group Id 116002)  1.2.2 กรณีสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ  Total Classified Lending Summary(Total Outstanding Amount) >= Provision Summary Item (1.1.1.1 สินเชื่อจัดชั้น )  (Data Set\_TCS : CL\_FI Reporting Group Id 116003 >= Data Set\_PVS (Amount ) : CL\_FI Reporting Group Id 116008)  2. เงินให้สินเชื่อจัดชั้นปกติ , กล่าวถึงเป็นพิเศษ, ต่ำกว่ามาตรฐาน สงสัย สงสัยจะสูญ สูญ  2.1 กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ บริษัทเงินทุน บริษัท เครดิตฟองซิเอร์  Total Classified Lending Summary (Total Outstanding Amount) เฉพาะเงินให้สินเชื่อ ที่มี Asset Classification Type 020001,020002,020003, 020004, 020005, 020006 = Provision Summary (Amount ) ที่ Provision Summary Item (1.1.1.1 สินเชื่อจัดชั้น ) ที่มี Asset Classification Type 020001,020002, 020003, 020004, 020005, 020006  (Data Set\_TCS : CL\_FI Reporting Group Id 116002 = Data Set\_PVS (Amount ) : CL\_FI Reporting Group Id 116002)  2.2 กรณีสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ  Total Classified Lending Summary (Total Outstanding Amount) เฉพาะเงินให้สินเชื่อ ที่มี Asset Classification Type 020001,020002,020003, 020004, 020005, 020006 >= Provision Summary (Amount ) ที่ Provision Summary Item (1.1.1.1 สินเชื่อจัดชั้น ) ที่มี Asset Classification Type 020001,020002,020003, 020004, 020005, 020006  (Data Set\_TCS : CL\_FI Reporting Group Id 116003 >= Data Set\_PVS (Amount ) : CL\_FI Reporting Group Id 116008)  3. Data Set \_TCS (Total Outstanding Amount)  กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ บริษัทเงินทุน และ บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002  กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ และ สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  และ CL\_Arrangement Type Code 018003 ,018005 , 018011 , 018012, 018013 , 018015 , 018016 , 018017 , 018018 , 018019 , 018020 , 018021 , 018022 , 018025 , 018026 , 018028 , 018029 , 018030 , 018031, 018007, 018008, 018009, 018010  = Data Set \_ARS (Total Outstanding Amount )  กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ บริษัทเงินทุน และ บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002  กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ และ สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  และ CL\_Arrangement Type Code 018003 ,018005 , 018011 , 018012, 018013 , 018015 , 018016 , 018017 , 018018 , 018019 , 018020 , 018021 , 018022 , 018025 , 018026 , 018028 , 018029 , 018030 , 018031, 018007, 018008, 018009, 018010 ตามลำดับ  4. Data Set \_TCS (Total Outstanding Amount) : เฉพาะกรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002 CL\_Arrangement Type ที่ไม่ใช่ Code 018051 ถึง 018054 และ CL\_Lending Business Type (ตรวจสอบ รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS”, Personal Consumption หมวดย่อยทุกตัว) = Total Outstanding Amount ของ Data Set \_LSB : CL\_Lending Business Type (ตรวจสอบ รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS” , Personal Consumption หมวดย่อยทุกตัว)  5. Data Set \_TCS (Total Outstanding Amount)  กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ และ สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  กรณีบริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002  ที่ CL\_Arrangement Type ที่ไม่ใช่ Code 018051 ถึง 018054 และ CL\_Lending Business Type (ตรวจสอบ รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS” , Personal Consumption หมวดย่อยทุกตัว) = Total Outstanding Amount ของ Data Set \_LSB : CL\_ Branch Number ที่เป็นสาขาในประเทศ และ CL\_Lending Business Type (ตรวจสอบ รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS”, Personal Consumption หมวดย่อยทุกตัว)  6. กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ  Data Set \_TCS (Total Outstanding Amount) : CL\_FI Reporting Group Id 116002 ที่ Business Size มีค่า CL\_Arrangement Type ที่ไม่ใช่ Code 018051 ถึง 018054 และ CL\_Lending Business Type ที่เป็นรหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ตรวจสอบ รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS”) = Data Set \_TCS (Total Outstanding Amount) : CL\_FI Reporting Group Id 116003 ที่ Business Size มีค่า CL\_Arrangement Type ที่ไม่ใช่ Code 018051 ถึง 018054 และ CL\_Lending Business Type ที่เป็นรหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ตรวจสอบ รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS” ) |
| Net Outstanding Amount | ยอดเงินคงค้างหลังหักค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญ  ให้รายงานยอดเงินคงค้างหลังหักค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญ เฉพาะเงินให้สินเชื่อด้อยคุณภาพ (Asset Classification Type = 020003, 020004, 020005, 020006)  สำหรับเงินให้สินเชื่อในชั้นปกติ, กล่าวถึงเป็นพิเศษ (Asset Classification Type = 020001, 020002) และสินทรัพย์อื่นที่เกี่ยวข้อง (Arrangement Type = 018051, 018052, 018053, 018054) ให้รายงานยอดเงินคงค้างหลังหักค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญ = 0  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Validation Data Set  1.1 Net Outstanding Amount < = Total Outstanding Amount  1.2 การตรวจสอบกับ ข้อมูล Balance Sheet (DS\_BLS)  Data Set \_TCS : กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002  กรณีสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ, สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  ที่ Total Classified Lending Summary (Total Outstanding Amount - Net Outstanding Amount) เฉพาะส่วนที่เป็นเงินให้สินเชื่อด้อยคุณภาพ < = Data Set \_BLS : กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002  กรณีสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ, สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  ที่ Balance Sheet Amount ของ Balance Sheet Item (2.6 ค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญ + 7.5.1 สินเชื่อปกติและกล่าวถึงเป็นพิเศษ + 7.5.2 สินเชื่อด้อยคุณภาพ + 7.6 ค่าเผื่อการปรับมูลค่าจากการปรับโครงสร้างหนี้ + หัก ค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญตามธุรกรรมนโยบายรัฐ [เฉพาะ SFIs] + หัก ค่าเผื่อการปรับมูลค่าจากการปรับโครงสร้างหนี้ตามธุรกรรมนโยบายรัฐ [เฉพาะ SFIs])  1.3. กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ  Data Set \_TCS (Total Outstanding Amount) : CL\_FI Reporting Group Id 116002 ที่ Business Size มีค่า CL\_Arrangement Type ที่ไม่ใช่ Code 018051 ถึง 018054 และ CL\_Lending Business Type ที่เป็นรหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ตรวจสอบ รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS”) = Data Set \_TCS (Total Outstanding Amount) : CL\_FI Reporting Group Id 116003 ที่ Business Size มีค่า CL\_Arrangement Type ที่ไม่ใช่ Code 018051 ถึง 018054 และ CL\_Lending Business Type ที่เป็นรหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS”) |

### Data Set : Trouble Debts Restructuring Summary (DS\_TDR)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Trouble Debts Restructuring Summary เป็นข้อมูลการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ของลูกหนี้ที่อยู่ระหว่างการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ที่มีอยู่ ณ วันสิ้นไตรมาสที่รายงาน และลูกหนี้ที่ปรับปรุงโครงสร้างหนี้เสร็จแล้วที่เพิ่มขึ้นในระหว่างไตรมาสที่รายงาน แยกตามประเภทธุรกิจ (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวดไตรมาสที่ 1/48)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ใช้รหัส 3 หลัก เหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Branch Number | กรณีที่เป็นชุดข้อมูลระดับสาขาให้รายงานเป็นรายสาขาในประเทศและสาขาต่างประเทศ โดยใช้รหัสสาขาเดิมของสถาบันการเงิน ซึ่งเป็นรหัส 3 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 หลัก เช่น ธนาคารกรุงเทพ สาขาถนนรัชดาห้วยขวาง รหัสสาขา 055 จะเป็น 0055 | ตรวจสอบรหัสสาขาของ Organization Id กับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงิน |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาส (มี.ค., มิ.ย., ก.ย., ธ.ค.) ตามปีปฏิทิน |
| Lending Business type | ประเภทธุรกิจที่นำเงินไปใช้ซึ่งอาจจะต่างจากประเภทธุรกิจของผู้กู้ ใช้รหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ยกเว้นลูกหนี้ที่เป็นบุคคลธรรมดาและกู้เพื่อการอุปโภคส่วนบุคคลใช้ Classification ใน Personal Consumption) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ในรหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ISIC BOT Code Rev.4) ในระดับต่ำสุดของหมวดนั้น ๆ (รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS”) หรือหมวดย่อยสุดใน Classification ชื่อ Personal Consumption |
| TDR Status | สถานะการปรับปรุงโครงสร้างหนี้  ‘1’= ลูกหนี้ที่อยู่ระหว่างการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ที่มีอยู่ ณ วันสิ้นไตรมาสที่รายงาน  ‘0’= ลูกหนี้ที่ปรับปรุงโครงสร้างหนี้เสร็จแล้วที่เพิ่มขึ้นในระหว่างไตรมาสที่รายงาน |  |
| Number of Customers | จำนวนรายลูกหนี้  กรณี TDR Status = ‘1’ หมายถึง จำนวนรายลูกหนี้ที่อยู่ระหว่างการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ที่มีอยู่ ณ วันสิ้นไตรมาสที่รายงาน  กรณี TDR Status = ‘0’ หมายถึง จำนวนรายลูกหนี้ที่ปรับปรุงโครงสร้างหนี้เสร็จแล้วที่เพิ่มขึ้นในระหว่างไตรมาสที่รายงาน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Outstanding or Movement Amount | ยอดคงค้างเงินให้สินเชื่อที่อยู่ระหว่างปรับปรุงโครงสร้างหนี้ หรือยอดคงค้างเงินให้สินเชื่อที่ปรับปรุงโครงสร้างหนี้เสร็จแล้วที่เพิ่มขึ้นในไตรมาสที่รายงาน  กรณี TDR Status = ‘1’ หมายถึง ยอดหนี้ตามบัญชี ณ วันสิ้นไตรมาสที่รายงานของลูกหนี้ที่สถาบันการเงินกำลังพิจารณาปรับปรุงโครงสร้างหนี้ แต่ยังไม่บรรลุข้อตกลงของเงื่อนไขในการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ เนื่องจากอยู่ระหว่างการวิเคราะห์ความสามารถในการชำระหนี้ หรือการแต่งตั้งที่ปรึกษาทางการเงิน เพื่อวิเคราะห์ข้อมูลประกอบการตัดสินใจว่าจะปรับปรุงโครงสร้างหนี้หรือไม่  กรณี TDR Status = ‘0’ หมายถึง ยอดหนี้ตามบัญชีก่อนการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ของลูกหนี้ที่สถาบันการเงินได้บรรลุถึงข้อตกลงในเงื่อนไขการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ที่เพิ่มขึ้นในระหว่างไตรมาสที่รายงาน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Accrued Interest Amount | ดอกเบี้ยค้างรับที่ได้บันทึกเป็นรายได้แล้ว  กรณี TDR Status = ‘1’ หมายถึง ยอดดอกเบี้ยค้างรับที่ได้บันทึกเป็นรายได้แล้วของลูกหนี้ที่อยู่ระหว่างการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ที่มีอยู่ ณ วันสิ้นไตรมาสที่รายงาน  กรณี TDR Status = ‘0’ หมายถึง ยอดดอกเบี้ยค้างรับที่ได้บันทึกเป็นรายได้แล้วของลูกหนี้ที่ปรับปรุงโครงสร้างหนี้เสร็จแล้วที่เพิ่มขึ้นในระหว่างไตรมาสที่รายงาน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

## Subject Area : FI Liquidity Status

### Data Set : Liquidity Coverage Ratio (DS\_LCR)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Liquidity Coverage Ratio ข้อมูลสินทรัพย์สภาพคล่อง เป็นการรายงานตามความเสี่ยงด้านสภาพคล่องภายใต้สถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง ตามเกณฑ์ BASEL III มีวัตถุประสงค์เพื่อรวบรวมข้อมูลประกอบการวิเคราะห์ระดับและแนวโน้มความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง ของ ธพ. และระบบ ธพ. โดยรวมอย่างมีประสิทธิภาพยิ่งขึ้น

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวดเดือน ม.ค. 59)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน และชุดรวม ทุกสำนักงานในต่างประเทศ กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ และกรณีเป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id และ  FI Reporting Group Id = 116002 (mandatory)  FI Reporting Group Id = 116005 (Optional)  FI Reporting Group Id = 116003 (mandatory) |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Liquidity Coverage Ratio Item | รายการการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่อง  (Classification Name: Liquidity Coverage Ratio Item) | ค่าที่เป็นไปได้ของ Liquidity Coverage Ratio Item ตาม Reporting Group Id   1. ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ    1. ชุดรวมทุกสำนักงาน (FI Reporting Group Id = 116002)   มีค่า Liquidity Coverage Ratio Item\* ทุกค่า ยกเว้น 469034 และ 469035   * 1. ชุดรวมทุกสำนักงานในต่างประเทศ (FI Reporting Group Id = 116005)   มีค่า Liquidity Coverage Ratio Item\* ระหว่าง 469001 - 469032  2. สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ (FI Reporting Group Id = 116003)  มีค่า Liquidity Coverage Ratio Item\* ระหว่าง 469001 – 469392  3. บริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์   * 1. ชุดรวมทุกสำนักงาน (FI Reporting Group Id = 116002)   มีค่า Liquidity Coverage Ratio Item\* ทุกค่า ยกเว้น 469034 และ 469035  \* Liquidity Coverage Ratio Item ระดับย่อยสุดที่รายงาน |
| Booking Type | รหัสประเภทบัญชี  (Classification Name: Booking Type) | ค่าที่เป็นไปได้ของ Liquidity Coverage Ratio Item ตาม Booking Type   1. Booking Type = 445002 ที่ Liquidity Coverage Ratio Item มีค่าเท่ากับ 469003, 469005 และ 469006 2. Booking Type = 445001 และ 445002 ที่ Liquidity Coverage Ratio Item มีค่าเท่ากับ 469008 – 469011, 469013 – 469014, 469017 – 4690024 และ 469027 – 469032 3. Booking Type = “ “ (Null) ที่ Liquidity Coverage Ratio Item นอกเหนือจาก 1 และ 2 ข้างต้น |
| Currency Id | รหัสสกุลเงิน สกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศที่มีนัยสำคัญ\*  ส่วนสกุลเงินตราต่างประเทศที่ไม่เข้าเกณฑ์สกุลนัยสำคัญ ให้รายงานเป็นจำนวนเงินรวม โดยไม่ต้องใส่รหัสสกุลเงิน  \*สกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญ หมายถึง สกุลเงินที่ผลรวมของหนี้สินในสกุลเงินนั้นและภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน (Off balance sheet) ประเภท Foreign exchange forward และ Cross currency swaps ที่จะทำให้เกิดกระแสเงินไหลออกในสกุลนั้นมากกว่าหรือเทียบเท่ากับร้อยละ 5 ของผลรวมของหนี้สินทั้งสิ้นและภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะทางการเงิน (Off balance sheet) ประเภท Foreign exchange forward และ Cross currency swaps  (Classification Name: Currency Id ) | 1. ค่าที่เป็นไปได้ของ Liquidity Coverage Ratio Item ตาม Currency Id มีค่าระหว่าง 469001 – 469260 2. ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Currency Id รวมทั้ง Code ที่มี Value เท่ากับ THB และ “ “ (Null) |
| Market Value | มูลค่าตลาดของรายการ หน่วย จะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลักทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลักทศนิยม 2 หลัก  (จำนวนเงินของรายการเป็นจำนวนเงินก่อนปรับค่า Haircut, Run-Off Rate และ Inflow Rate)  Liquidity Coverage Ratio Item ที่ 469392 Amount มีค่าเป็นร้อยละ และไม่ต้องใส่เครื่องหมาย % ตัวอย่างเช่น 114.35 เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |

### Data Set : Liquidity Assessment 1 (DS\_LQ1)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Liquidity Assessment 1 เป็นข้อมูลเกี่ยวกับการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่อง ของสถาบันการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

**ลักษณะข้อมูล**

รายวัน (เฉพาะสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ลักษณะข้อมูลรายเดือน)

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นปักษ์ (เฉพาะสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ความถี่ทุกสิ้นเดือน)

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 10 วัน นับจากวันสิ้นปักษ์ที่รายงาน เฉพาะสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ กำหนดการส่ง ภายใน 21 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลปักษ์วันที่ 14-27 มีนาคม 2550)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31 เริ่มต้นวันพุธและสิ้นสุดวันอังคารของอีกสองสัปดาห์ถัดมา (ปักษ์ละ 14 วัน)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสุดท้ายของแต่ละปักษ์ |
| Item Date | วันที่ของชุดรายการ Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31 การรายงานรวมวันหยุดทำการด้วย (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Item Date ต้องมีค่าอยู่ในช่วง 14 วัน ของปักษ์ที่รายงาน และวันที่ต้องไม่ซ้ำกัน |
| Liquidity Assessment Item | รายการสินทรัพย์สภาพคล่อง โดยรหัสย่อยภายใต้รหัสของรายการถอนเงินฝากระหว่างเดือนและรายละเอียดประกอบการประเมินฐานะสภาพคล่อง ณ วันสิ้นเดือน ให้รายงานเฉพาะวันสิ้นเดือน  (Classification Name: Liquidity Assessment Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Liquidity Assessment Item |
| Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วย จะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลักทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | สินทรัพย์สภาพคล่อง = ผลรวมของรายการย่อยของสินทรัพย์สภาพคล่อง  เงินรับฝาก = ผลรวมของรายการย่อยของเงินรับฝาก  เงินกู้ยืมจากต่างประเทศ = ผลรวมของรายการย่อยของเงินกู้ยืมจากต่างประเทศ  ตั๋วเงิน = ผลรวมของรายการย่อยของตั๋วเงิน |

### Data Set : Net Stable Funding Ratio (DS\_NFR)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Net Stable Funding Ratio ข้อมูลการดำรงอัตราส่วนแหล่งเงินที่มีความมั่นคงและความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง เป็นการรายงานโครงสร้างแหล่งเงินที่จะใช้ในการสนับสนุนกิจกรรมในระยะปานกลางและระยะยาวของธนาคารพาณิชย์ (ธพ.) ตามหลักเกณฑ์ BASEL III ซึ่งเป็นการรายงานเพิ่มเติมจากการรายงานสินทรัพย์สภาพคล่องภายใต้สถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (Data Set ชุด Liquidity Coverage Ratio) โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อรวบรวมข้อมูลประกอบการวิเคราะห์ระดับและแนวโน้มความเสี่ยงด้านสภาพคล่องของ ธพ. และระบบ ธพ. อย่างครบถ้วน และมีประสิทธิภาพ

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วันนับจากวันสิ้นไตรมาส (เริ่มส่งข้อมูลงวดไตรมาส 1/62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล รายงานตามรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงิน | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล | Data Set Validation:  วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| FI Reporting Group Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล รายงานตามรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงิน | Data Set Validation:  ตรวจสอบความสอดคล้องระหว่างชุดข้อมูล FI Reporting Group Id กับ กลุ่มสถาบันการเงิน |
| Net Stable Funding Ratio Item | รายการการดำรงอัตราส่วนแหล่งเงินที่มีความมั่นคงและความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Net Stable Funding Ratio Item  1. ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Net Stable Funding Ratio Item  2. ค่าที่เป็นไปได้ของ Net Stable Funding Ratio Item ตาม FI Reporting Group Id  2.1 ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ ชุดรวมทุกสำนักงาน (FI Reporting Group Id = 116002) มีรายการ Net Stable Funding Ratio Item ที่ไม่ต้องรายงาน ได้แก่ 477001, 477002, 477007, 477011, 477015, 477019, 477024, 477030, 477031, 477033, 477036, 477038, 477041, 477042, 477047, 477050, 477056, 477059, 477060, 477062, 477063, 477066, 477070, 477071, 477073, 477077, 477079, 477083 - 477086, 477088, 477092, 477094, 477098, 477100, 477104, 477105, 477107, 477111, 477113, 477117, 477118, 477120, 477124, 477126, 477130, 477131, 477133, 477137, 477139, 477143, 477144, 477146, 477150, 477151, 477153, 477157, 477159, 477163, 477164, 477166, 477170, 477172, 477177, 477178, 477180, 477184, 477186, 477190, 477192, 477196, 477198, 477202, 477204, 477208, 477210, 477215 - 477222, 477224, 477227, 477228, 477230, 477233, 477235, 477238 - 477241, 477248, 477252, 477257, 477258, 477266, 477267 และ 477057, 477058  2.2 สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ (FI Reporting Group Id = 116003) มีรายการ Net Stable Funding Ratio Item ที่ไม่ต้องรายงานเหมือนกับชุดรวมทุกสำนักงาน (FI Reporting Group Id = 116002) ทุกรายการ ยกเว้น 477057 และ 477058 ที่ต้องรายงานตามปกติ |
| NSFR Remaining Term Range | อายุคงเหลือ | Data Set Validation:  1. ค่าที่เป็นไปได้ของ Net Stable Funding Ratio Item ตาม NSFR Remaining Term Range  1.1 Net Stable Funding Ratio Item = 477053, 477061, 477254 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310039  1.2 Net Stable Funding Ratio Item = 477003, 477004 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310041  1.3 Net Stable Funding Ratio Item = 477197, 477199 - 477201 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310039 และ 310040  1.4 Net Stable Funding Ratio Item = 477005, 477006, 477008 - 477010, 477012 - 477014, 477016 - 477018, 477020 - 477023, 477025 - 477029, 477046, 477051, 477054, 477064, 477065, 477067 - 477069, 477072, 477074 - 477076, 477078, 477080 - 477082, 477087, 477089 - 477091, 477093, 477095 - 477097, 477099, 477101 - 477103, 477106, 477108 - 477110, 477112, 477114 - 477116, 477119, 477121 - 477123, 477125, 477127 - 477129, 477132, 477134 - 477136, 477138, 477140 - 477142, 477145, 477147 - 477149, 477152, 477154 - 477156, 477158, 477160 - 477162, 477165, 477167 - 477169, 477171, 477173 - 477176, 477179, 477181 - 477183, 477185, 477187 - 477189, 477191, 477193 - 477195, 477209, 477211 - 477214, 477246, 477253, 477255, 477256 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310039, 310040 และ 310041  1.5 Net Stable Funding Ratio Item มีค่าเท่ากับ 477032, 477034, 477035, 477037, 477039, 477040, 477043 - 477045, 477048, 477049, 477057, 477058, 477203, 477205 - 477207, 477223, 477225, 477226, 477229, 477231, 477232, 477234, 477236, 477237, 477242 - 477245, 477247, 477249 - 477251, 477259 - 477265, 477268 - 477272 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้เท่ากับ 310029  1.6 Net Stable Funding Ratio Item มีค่าเท่ากับ 477052 และ 477055 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310029, 310039, 310040 และ 310041 |
| NSFR Value | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (จำนวนเงินของรายการเป็นจำนวนเงินก่อนปรับค่า ASF factor และ RSF factor ยกเว้นรายการ 477068 ให้ใส่จำนวนเงินหลังคูณค่า RSF factor แล้ว)  Net Stable Funding Ratio Item ที่ 477272 Amount มีค่าเป็นร้อยละ และไม่ต้องใส่เครื่องหมาย % ตัวอย่างเช่น 114.35 เป็นต้น  Net Stable Funding Ratio Item 477058 กรณีที่มีค่าเท่ากับ Unlimited (วงเงินไม่จำกัด) ให้กรอก เป็นตัวเลข 999999999999999999.99 | Data Set Validation:  1. ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์  2. ผลรวมของ NSFR value ตาม Net Stable Funding Ratio Item และ NSFR Remaining Term Range ต้องมีค่าดังนี้  2.1 NSFR value ของ Net Stable Funding Ratio Item 477255 และ 477054 ในแต่ละ Remaining Term Range ต้องมีค่าเท่ากัน  2.2 ผลรวม NSFR value ของ Net Stable Funding Ratio Item และ NSFR Remaining Term Range ตามเงื่อนไขที่กำหนด ต้องมีค่าตรงตามที่ระบุดังนี้  2.2.1 ผลรวมของ NFSR Value ของ Net Stable Funding Ratio Item “11.5 หลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ทุกประเภทที่ได้รับจากคู่สัญญาทั้งสิ้น แยกตามอายุคงเหลือของธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกี่ยวข้อง” (477046) รวมทุก NSFR Remaining Term Range (310039, 310040, 310041) ต้องเท่ากับ ผลรวมของ Net Stable Funding Ratio Item หลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ที่ได้รับจากคู่สัญญาทั้งสิ้น “11.4.1 ส่วนที่ได้รับเป็นเงินสด” (477043) + “11.4.2 ส่วนที่ได้รับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1” (477044) และ “11.4.3 ส่วนที่ได้รับเป็นสินทรัพย์อื่นที่ไม่ใช่สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1” (477045) ทุก NFSR Remaining Term Range (310029)  2.2.2 ผลรวมของ NFSR Value ของ Net Stable Funding Ratio Item “13.1 วงเงิน Committed line ที่ได้รับจากสำนักงานใหญ่ หรือสำนักงานสาขาอื่นที่เป็นนิติบุคคลเดียวกันและเป็นศูนย์กลางการบริหารสาขาของธนาคารพาณิชย์ในภูมิภาค (Regional hub) ที่นับเป็น Available Stable Funding ตามหลักเกณฑ์ NSFR” (477057) ทุก NSFR Remaining Term Range (310029) <= 0.4 \* [ผลรวมของ (NSFR value \* ค่าแปลงสภาพ) ของรายการย่อย Net Stable Funding Ratio Item ทุกรายการ ตั้งแต่ 477061 ถึง 477220 และ 477253 ถึง 477271 บวกด้วย ผลรวมของ (NSFR Value ที่ได้จากการคำนวณ \* ค่าแปลงสภาพ) ของ Net Stable Funding Ratio Item 477238 477239 และ 477252]  **รายละเอียดการคำนวณ NSFR Value ของ Net Stable Funding Ratio Item 477238 477239 และ 477252 มีดังนี้**   1. Net Stable Funding Ratio Item 477238 สินทรัพย์จากธุรกรรมอนุพันธ์ คำนวณโดยนำสินทรัพย์จากธุรกรรมอนุพันธ์ (NFSR Item 477222) ลบด้วยหลักประกันผันแปรในรูปของเงินสด (Cash variation margin) ที่ได้รับจากคู่สัญญา (NFSR Item 477228) [477238 = 477222 - 477228] 2. Net Stable Funding Ratio Item 477239 ความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคงที่เกี่ยวข้องกับหนี้สินจากธุรกรรมอนุพันธ์ คำนวณจากร้อยละ 5 ของฐานะของหนี้สินจากธุรกรรมอนุพันธ์ (NFSR Item 477031) [477239 = 477031 \* 0.05] 3. Net Stable Funding Ratio Item 477252 ฐานะของความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคงจากหลักประกันขั้นต่ำที่วางไว้ และเงินสดหรือสินทรัพย์ที่วางไว้เป็นกองทุนทดแทนความเสียหายจากการผิดนัดชำระราคา (Default fund) ที่สำนักหักบัญชีกลาง (CCP) คำนวณโดยนำหลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ที่วางไว้กับคู่สัญญาทั้งสิ้น (NFSR Item 477240) ลบด้วยหลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ที่วางไว้ในนามของลูกค้า (NFSR Item 477245) และบวกด้วยเงินสดหรือสินทรัพย์อื่นที่วางไว้เป็นกองทุนทดแทนความเสียหายจากการผิดนัดชำระราคา (Default fund) ที่สำนักหักบัญชีกลาง (CCP) (NFSR Item 477251) [477252 = 477240 – 477245 + 477251]   2.2.3 ผลรวมของ NFSR Value ของ Net Stable Funding Ratio Item “12.5.3 หลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ที่วางไว้ในนามของธนาคารพาณิชย์เอง (รวมหลักประกันทุกประเภท) แยกตามอายุคงเหลือของธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกี่ยวข้อง” (477246) รวมทุก NSFR Remaining Term Range (310039, 310040, 310041) ต้องมีค่าเท่ากับ ผลรวมของ Net Stable Funding Ratio Item หลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ส่วนที่วางเพื่อธนาคารพาณิชย์เอง “12.5.1.1 ส่วนที่วางไว้เป็นเงินสด” (477242) + “12.5.1.2 ส่วนที่วางไว้เป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 (477243) + “12.5.1.3 ส่วนที่วางไว้เป็นสินทรัพย์อื่นที่ไม่ใช่สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1” (477244) ทุก NFSR Remaining Term Range (310029)  2.2.4 ผลรวมของ NFSR Value ของ Net Stable Funding Ratio Item “12.5.4 หลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ที่วางไว้ในนามของธนาคารพาณิชย์เองที่วางไว้กับคู่สัญญาที่ไม่ได้รับยกเว้นการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์การเรียกและวางหลักประกันสำหรับธุรกรรมอนุพันธ์ (BCBS-IOSCO: Margin requirements for non-centrally cleared derivatives)” (477247) + “12.5.5.1 ส่วนของนิติบุคคลอื่นที่ไม่ใช่นิติบุคคลที่ประกอบธุรกิจทางการเงินซึ่งไม่มีความสำคัญในเชิงระบบ” (477249) + “12.5.5.2 ส่วนของรัฐบาล ธนาคารกลาง ธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือธนาคารเพื่อการชำระเงินระหว่างประเทศ (BIS)” (477250) ทุก NFSR Remaining Term Range (310029) ต้องเท่ากับผลรวมของ Net Stable Funding Ratio Item “12.5.1.1 ส่วนที่วางไว้เป็นเงินสด” (477242) + “12.5.1.2 ส่วนที่วางไว้เป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1” (477243) + “12.5.1.3 ส่วนที่วางไว้เป็นสินทรัพย์อื่นที่ไม่ใช่สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1” (477244) ทุก NFSR Remaining Term Range (310029) |

## Subject Area : FI Financial Performance

### Data Set : Net Profit Distribution (DS\_PDS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Net Profit Distribution เป็นข้อมูลเกี่ยวกับการจัดสรรกำไรสุทธิ ของสถาบันการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 บริษัทเงินทุน  
 บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ  
**ลักษณะข้อมูล**

ราย 6 เดือน (เฉพาะสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ลักษณะข้อมูลรายปี)

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้น 6 เดือน (เฉพาะสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ความถี่ทุกสิ้นงวดการบัญชี)

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 4 เดือน นับจากวันสิ้น 6 เดือนที่รายงาน(เฉพาะสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ กำหนดการส่งภายใน 5 เดือน นับจากวันสิ้นงวดการบัญชีที่รายงาน)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงาน  และสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นงวดครึ่งปีตามปีบัญชีของสถาบันการเงินนั้น ๆ |
| Net Profit Distribution Item | รายการจัดสรรกำไรสุทธิ   (Classification Name: Net Profit Distribution Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Net Profit Distribution Item |
| Amount | จำนวนเงิน หน่วย จะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กำไรสุทธิคงเหลือหลังจากการจัดสรร = กำไร(ขาดทุน)สุทธิคงเหลือหลังจากการจัดสรรยกมา + กำไร(ขาดทุน) สุทธิงวดนี้ + เงินโอนจากสำรองส่วนทุน + เงินโอนจากสำนักงานใหญ่ในต่างประเทศ – ผลรวมของรายการย่อยของการจัดสรร |

### Data Set : Profit and Loss (DS\_PNL)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Profit and Loss เป็นข้อมูลเกี่ยวกับ รายได้ค่าใช้จ่าย ของสถาบันการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 บริษัทเงินทุน   
 บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วันนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน อนึ่ง ในกรณีที่ได้มีการแก้ไขงบการเงินตามคำแนะนำของผู้สอบบัญชี ให้สถาบันการเงินจัดส่งรายงานหลังปรับปรุงมาอีก 1 ชุด ภายใน 21 วัน นับแต่วันที่ผู้สอบบัญชีรับรอง

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์ จะเป็นรหัส 2 หลัก ให้ใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 หลัก เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ให้ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Branch Number | รหัสสาขา ในกรณีที่เป็นชุดข้อมูลระดับสาขา ใช้รหัสสาขาเดิมของสถาบันการเงิน ในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์ จะเป็นรหัส 3 หลักให้ใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 หลัก เช่น ธนาคารกรุงเทพสาขาฮ่องกง รหัสสาขา 801 จะเป็น 0801 | ตรวจสอบรหัสสาขาของ Organization Id กับรหัสมาตรฐานของสถาบัน การเงิน |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-03-31 (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ซึ่งต้องเป็นวันที่สิ้นไตรมาส 1, ครึ่งปีแรก, ไตรมาส 3, ครึ่งปีหลัง ตามปีบัญชีของสถาบันการเงินนั้น ๆ |
| Data Set Period Month | รอบระยะเวลาสะสมของข้อมูลแทนค่าด้วยตัวเลข 1 หลัก คือ 3 และ 6  3 ใช้แทนไตรมาส 1 และไตรมาส 3  6 ใช้แทนงวดครึ่งปีแรกและงวดครึ่งปีหลัง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นไตรมาส 1 แล้ว Data Set Period Month = 3  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นงวดครึ่งปีแรกแล้ว Data Set Period Month = 6  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นไตรมาส 3 แล้ว Data Set Period Month = 3  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นงวดครึ่งปีหลังแล้ว Data Set Period Month = 6 |
| Profit and Loss Item | รายการของรายได้และค่าใช้จ่าย  (Classification Name: Profit and Loss Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Profit and Loss Item |
| Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วย จะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กำไร (ขาดทุน)จากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้ = ผลต่างสุทธิของรายการรายได้และค่าใช้จ่ายทุกประเภท  กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม = กำไร (ขาดทุน) สุทธิ + กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น  รายการรายได้และค่าใช้จ่ายระหว่างกัน (ข้อ 22.) รายงานเฉพาะกรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศที่มีสาขาในต่างประเทศ และรายงานเฉพาะชุด FI Reporting Group Id = 116005 และ 116006 |

## Subject Area : Key Customer Position

### Data Set : Contingent Arrangement (DS\_CAR)

**คำอธิบาย**

Data Set **ชุด** Contingent Arrangement **เป็นข้อมูลเกี่ยวกับภาระผูกพันในภายหน้ารายสัญญาของลูกหนี้**แต่ละรายที่มียอดคงค้างของภาระผูกพัน รวมกันทุกสำนักงาน ตั้งแต่ 20 ล้านบาทขึ้นไปสำหรับธนาคารพาณิชย์ไทย ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ **สาขาธนาคาร**พาณิชย์**ต่างประเทศ** และ ตั้งแต่ 5 ล้านบาทขึ้นไปสำหรับ ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย และ บริษัทเงินทุน ยกเว้นการรายงานประเภทภาระผูกพันดังต่อไปนี้

1. ตั๋วเงินเพื่อเรียกเก็บ

2. วงเงินที่ลูกค้ายังไม่ได้ใช้

3. ภาระผูกพันที่สามารถบอกเลิกสัญญาได้

ทั้งนี้การนับมูลค่าของภาระผูกพันดังกล่าว กรณีที่เป็นภาระผูกพันที่ไม่ใช่ตราสารอนุพันธ์ให้ใช้ยอดคงค้างตามบัญชี (Notional Amount) ส่วนภาระผูกพันประเภทตราสารอนุพันธ์ให้ใช้ยอดคงค้าง (Outstanding Amount) ของ Notional Amount คูณด้วยค่าแปลงสภาพ (Credit Conversion Factor) ตามที่กำหนดไว้ในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่อง การกำหนดให้ธนาคารพาณิชย์ดำรงเงินกองทุน

ตราสารอนุพันธ์ ได้แก่ สัญญาเกี่ยวกับอัตราแลกเปลี่ยน สัญญาเกี่ยวกับอัตราดอกเบี้ย อนุพันธ์ด้านตราสารหนี้ อนุพันธ์ด้านตราสารทุน อนุพันธ์ด้าน Commodity และอนุพันธ์ด้านเครดิต

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

**สาขาธนาคาร**พาณิชย์**ต่างประเทศ**

**บริษัทเงินทุน**

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

**รายเดือน**

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

**ทุกสิ้นเดือน**

**กำหนดการส่ง**

**ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน**

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | **รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุน ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม** | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Branch Number | **รหัสสาขาเจ้าของสัญญา** | ตรวจสอบรหัสสาขาของ Organization Id กับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงิน |
| Data Set Date | **วันที่ของชุดข้อมูล ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น** yyyy-mm-dd **เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31**  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| FI Arrangement Number | เลขที่สัญญาของสถาบันการเงิน ไม่ระบุรูปแบบ (Free Format)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Currency Id | รหัสสกุลเงินของภาระผูกพันที่ไม่ใช่ตราสารอนุพันธ์ เช่น การรับรอง การรับอาวัล และการค้ำประกันการกู้ยืมเงิน ฯลฯ  (Classification Name : Currency Id) | จะมีค่า Contingent Type ไม่ใช่กลุ่มของตราสารอนุพันธ์ |
| Contingent Type | ประเภทภาระผูกพันทุกประเภทที่สถาบันการเงินมีภาระที่จะต้องชดใช้ให้แก่บุคคลที่ 3 หากลูกค้าไม่สามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขที่ให้ไว้แก่บุคคลที่ 3 ได้  ยกเว้น ประเภทภาระผูกพัน ดังต่อไปนี้  1. ตั๋วเงินเพื่อเรียกเก็บ (018074)  2. วงเงินที่ลูกค้ายังไม่ได้ใช้ (018075)  3. ภาระผูกพันที่สามารถบอกเลิกสัญญาได้ (018077)  (Classification Name : Arrangement Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent |
| CCF Rate | ระบุค่า Credit Conversion Factor ตามประกาศของ ธปท. ที่เกี่ยวข้อง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ตรวจสอบว่าเป็นค่า Credit Conversion Factor |
| Minimum Fee Rate | อัตราค่าธรรมเนียมต่ำสุด (ยกเว้นประเภทกลุ่มตราสารอนุพันธ์)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Minimum Fee Rate Unit | หน่วยของอัตราค่าธรรมเนียมต่ำสุด  (Classification Name : Fee Rate Unit) |  |
| Maximum Fee Rate | อัตราค่าธรรมเนียมสูงสุด (ยกเว้นประเภทกลุ่มตราสารอนุพันธ์)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Maximum Fee Rate Unit | หน่วยของอัตราค่าธรรมเนียมสูงสุด  (Classification Name : Fee Rate Unit) |  |
| Primary Involved Party Id | ระบุ Id ของคู่สัญญา ที่ให้กู้ยืม เช่น บุคคลธรรมดา ใช้เลขประจำตัวประชาชน (13 หลัก) นิติบุคคลใช้เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลที่จดทะเบียนกับกระทรวงพาณิชย์ เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ตรวจสอบขนาดความยาวของข้อมูลว่าต้องสอดคล้องกับ Unique Id Type |
| Unique Id Type | ระบุประเภทของ Primary Involved Party เช่น กรณีบุคคลธรรมดาที่รายงานด้วยเลข 13 หลัก ให้ระบุว่าเป็นประเภทเลขประจำตัวประชาชน = code 324001 (Personal Id)  (Classification Name : Unique Id Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Unique Id Type |
| Review Flag \*\* | สถานะการสอบทานภาระผูกพัน  ภาระผูกพันที่ยังไม่สอบทาน หรือ ภาระผูกพันที่ไม่เกี่ยวกับการให้สินเชื่อให้รายงาน Review Flag = ‘ 0 ’  ภาระผูกพันที่สอบทานแล้ว หรือ ภาระผูกพันที่ได้รับการยกเว้นไม่ต้องสอบทานให้รายงาน Review Flag = ‘ 1 ’ (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ตรวจสอบ  1. ภาระผูกพันที่ได้รับการยกเว้นไม่ต้องสอบทานให้รายงาน  Review Flag = ‘1’  2. รอบการสอบทานให้ถือตามปีปฏิทิน |
| Arrangement Contract Date | วันที่ทำสัญญา จำนวน 10 ตัว ใช้ปี ค.ศ.โดยมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Arrangement Contract Date <= Data Set Date |
| Arrangement Business Type | ประเภทธุรกิจที่ทำธุรกรรม ใช้รหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ยกเว้น ลูกค้าที่เป็นบุคคลธรรมดาและทำธุรกรรมเพื่อการอุปโภคบริโภคส่วนบุคคลใช้ classification ใน Personal Consumption) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ในรหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ISIC BOT Code Rev.4) ในระดับต่ำสุดของหมวดนั้น ๆ (รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS”) หรือหมวดย่อยสุดใน Classification ชื่อ Personal Consumption |
| Arrangement Term | อายุตามสัญญา  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Arrangement Term Unit | หน่วยของอายุสัญญา มี 3 แบบ คือ day, month, year  (Classification Name : Term Unit) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Term Unit |
| Effective Date | วันที่สัญญาเริ่มมีผลบังคับ (กรณีที่เป็นรายการอนุพันธ์ทางการเงินให้รายงานด้วย Trade Date) จำนวน 10 ตัว ใช้ปี ค.ศ. โดยมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Effective Date <= Data Set Date |
| Maturity Date | วันที่สัญญาครบกำหนด จำนวน 10 ตัว ใช้ปี ค.ศ. โดยมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Maturity Date >= Contract Date  Maturity Date >= Effective Date |
| Buy Currency Id | รหัสสกุลเงินของภาระผูกพันที่เป็นตราสารอนุพันธ์ โดยให้ระบุ Code ของสกุลเงินตราต่างประเทศ/หรือเงินบาทที่สถาบันการเงินซื้อ/ได้รับจากคู่ค้าตามที่ระบุในสัญญา เช่น บาทไทย ใช้ THB, ดอลลาร์สิงคโปร์ ใช้ SGD เป็นต้น ทั้งนี้ ในกรณีตราสารอนุพันธ์ที่มีความเกี่ยวข้องกับเงินสกุลเดียวให้ระบุเงินสกุลนั้นใน Buy Currency Id  (Classification Name : Currency Id) | จะมีค่าถ้า Contingent Type เป็นกลุ่มของตราสารอนุพันธ์ |
| Sell Currency Id | รหัสสกุลเงินของภาระผูกพันที่เป็นตราสารอนุพันธ์ โดยให้ระบุ Code ของสกุลเงินตราต่างประเทศ/หรือเงินบาทที่สถาบันการเงินขาย/จ่ายให้คู่ค้าตามที่ระบุในสัญญา เช่น บาทไทย ใช้ THB, ดอลลาร์สิงคโปร์ ใช้ SGD เป็นต้น  (Classification Name : Currency Id) | จะมีค่าถ้า Contingent Type เป็นกลุ่มของตราสารอนุพันธ์ |
| Notional Amount | กรณีตราสารอนุพันธ์  ให้รายงานด้วยจำนวนเงินตามสัญญา (Notional Amount) ของตราสารอนุพันธ์ โดยกรณีที่เป็นสัญญาเกี่ยวกับอัตราแลกเปลี่ยนให้รายงาน Notional Amount เป็นเงินสกุลบาท ดังนี้ :  (1) กรณีการแลกเปลี่ยนระหว่างเงินตราต่างประเทศกับเงินสกุลบาท (Foreign Currency against Baht) ให้ใช้จำนวนเงินตราต่างประเทศตามสัญญาคูณด้วยอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่รายงาน  (2) กรณีการแลกเปลี่ยนเงินข้ามสกุล (Cross currency) ให้ใช้จำนวนเงินตราต่างประเทศตามสัญญา (ด้านซื้อ) คูณด้วยอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่รายงาน  ส่วนตราสารอนุพันธ์อื่น ๆ ที่ไม่เกี่ยวกับอัตราแลกเปลี่ยน แต่ทำในรูปเงินตราต่างประเทศ ให้ใช้จำนวนเงินตราต่างประเทศตามสัญญาคูณด้วยอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่รายงาน  กรณีภาระผูกพันประเภทอื่น  ให้รายงานด้วยจำนวนเงินตามยอดภาระผูกพัน ในกรณีที่จำนวนเงินในสัญญาเป็นสกุลเงินตราต่างประเทศให้แสดงยอดเป็นเงินบาท โดยใช้จำนวนเงินตราต่างประเทศตามสัญญาคูณด้วยอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่รายงาน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Validation Data Set : ที่ไม่ได้ตรวจสอบโดยระบบ  Contingent Arrangement ( ผลรวมของ Notional Amount) <= Balance Sheet Item (26.1 การรับอาวัลตั๋วเงิน และการค้ำประกันการกู้ยืมเงิน + 26.2 ภาระตามตั๋วเงินค่าสินค้าเข้าที่ยังไม่ครบกำหนด + 26.3 การขายลูกหนี้ตั๋วเงินที่ผู้ซื้อมีสิทธิไล่เบี้ย (Commercial Papers Sold with Recourse) + 26.4 เล็ตเตอร์ออฟเครดิต + 26.5 ภาระผูกพันอื่น +27. ตราสารอนุพันธ์) |
| Collateral Type | ประเภทหลักประกัน เช่น ที่ดิน, โรงงาน, พันธบัตร เป็นต้น  (Classification Name : Collateral Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Collateral Type |
| Collateral Value Amount | มูลค่าหลักประกันรวม (ราคาประเมิน) / วงเงินค้ำประกัน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Collateral Pledged Amount | มูลค่าหลักประกันส่วนที่นำมาหักได้ ตามเกณฑ์ที่ ธปท. กำหนด  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Exposure Method | วิธีการคิด Exposure ตามประกาศของ ธปท. ที่เกี่ยวข้องกับการ Netting  (Classification Name : Exposure Type) | จะมีค่าถ้า Contingent Type เป็นกลุ่มของตราสารอนุพันธ์ **ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขจะไม่มีค่า** |
| Profit or Loss From Mark to Market | มูลค่ากำไร (ขาดทุน) ที่เกิดจากการ Mark to Market ตราสารอนุพันธ์ ทั้งนี้ไม่ว่าจะเลือกวิธี Original Exposure หรือ Current Exposure  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | จะมีค่าถ้า Contingent Type เป็นกลุ่มของตราสารอนุพันธ์ **ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขจะไม่มีค่า** |
| Related Involved Party Id | ระบุ Id ของคู่สัญญาที่เกี่ยวข้อง เช่น บุคคลธรรมดา ใช้เลขประจำตัวประชาชน (13 หลัก) นิติบุคคลใช้เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลที่จดทะเบียนกับกระทรวงพาณิชย์ เป็นต้น  (Classification Name : Involved Party Id) |  |
| Unique Id Type | ระบุประเภทของ Related Involved Party Id  (Classification Name : Unique Id Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Unique Id Type |
| IP AR Relationship Type | ให้ระบุเฉพาะในกรณี กู้ร่วม  (Classification Name : Involved Party Arrangement Relationship Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ IP AR Relationship Type |
| Outstanding Amount | Notional amount x Credit conversion factor  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

\*\* หมายเหตุ :-

นิยามของลูกค้ารายใหญ่ในการสอบทานภาระผูกพันในภายหน้า

- ธนาคารพาณิชย์ไทย ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ หมายถึง ภาระผูกพันในภายหน้าที่มียอดคงค้างรวมกันทุกสำนักงานตั้งแต่ 20 ล้านบาทขึ้นไป

- ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย หมายถึง ภาระผูกพันในภายหน้าที่มียอดคงค้างรวมกันทุกสำนักงานตั้งแต่ 5 ล้านบาทขึ้นไป

- สาขาธนาคารต่างพาณิชย์ประเทศ หมายถึง ภาระผูกพันในภายหน้าที่มียอดคงค้างตั้งแต่ 20 ล้านบาทขึ้นไป

- บริษัทเงินทุน หมายถึง ภาระผูกพันในภายหน้าที่มียอดคงค้างรวมกันทุกสำนักงานตั้งแต่ 5 ล้านบาทขึ้นไป

### Data Set : Loan Arrangement (DS\_LAR)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Loan Arrangement เป็นข้อมูลเกี่ยวกับสินเชื่อรายสัญญา รวมทั้งเงินบาทและเงินตราต่างประเทศ โดยให้รายงานการให้สินเชื่อเป็นเงินบาทแก่ลูกหนี้แต่ละรายที่มีวงเงินสินเชื่อหรือยอดคงค้างอย่างใดอย่างหนึ่ง รวมกันทุกสำนักงาน ตั้งแต่ 20 ล้านบาทขึ้นไปสำหรับธนาคารพาณิชย์ไทย ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ **สาขาธนาคาร**พาณิชย์**ต่างประเทศ** ตั้งแต่ 5 ล้านบาทขึ้นไปสำหรับธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย บริษัทเงินทุน และ ตั้งแต่ 1 ล้านบาทขึ้นไปสำหรับบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างก่อนหักรายได้รอตัดบัญชี)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

บริษัทเงินทุน

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุนและบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ก็ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Branch Number | รหัสสาขาเจ้าของสัญญา | ตรวจสอบรหัสสาขาของ Organization Id กับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงิน |
| IBF Indicator | กรณีสถาบันการเงินที่ส่งชุดข้อมูลเป็นกิจการวิเทศธนกิจให้ระบุรหัสประเภทธุรกิจของกิจการวิเทศธนกิจผู้ส่งชุดข้อมูล ได้แก่ Out-Out, Out-in, Out-in Baht (Classification Name : IBF Indicator) |  |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31 | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| FI Arrangement Number | เลขที่สัญญาของสถาบันการเงิน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Loan Type | ประเภทของ เงินให้สินเชื่อ  (Classification Name : Arrangement Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Arrangement Type ใช้เฉพาะเงินให้สินเชื่อ |
| Credit Type | รูปแบบของการให้สินเชื่อ มี 3 แบบ  (Classification Name : Credit Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Type |
| Primary Involved Party Id | ระบุ Id ของคู่สัญญาที่ให้กู้ยืม เช่น บุคคลธรรมดา ใช้เลขประจำตัวประชาชน (13 หลัก) นิติบุคคล ใช้เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลที่จดทะเบียนกับกระทรวงพาณิชย์ เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ตรวจสอบขนาดความยาวของข้อมูลว่าต้องสอดคล้องกับ Unique Id Type |
| Unique Id Type | ระบุประเภทของ Primary Involved Party Id เช่น กรณีบุคคลธรรมดาที่รายงานด้วยเลข 13 หลัก ให้ระบุว่าเป็นประเภทเลขประจำตัวประชาชน = code 324001 Personal Id  (Classification Name : Unique Id Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Unique Id Type |
| Risk and Reward Involved Party Id | รหัสมาตรฐานของผู้รับรอง อาวัล หรือ ผู้ที่รับความเสี่ยงแทน เช่น กรณีสถาบันการเงินในประเทศ ให้ระบุเลขของรหัสสถาบันการเงิน (FI Code) เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ตรวจสอบขนาดความยาวของข้อมูลว่าต้องสอดคล้องกับ Unique Id Type |
| Risk and Reward Unique Id Type | ระบุประเภทรหัสมาตรฐานของผู้รับรอง อาวัล หรือ ผู้ที่รับความเสี่ยงแทน เช่น ระบุว่าเป็นรหัสสถาบันการเงิน = code 324007 (FI Code)  (Classification Name : Unique Id Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Unique Id Type |
| Review Flag \*\* | สถานะการสอบทานเงินให้สินเชื่อ  ยังไม่สอบทาน = ‘0’  สอบทานแล้ว = ‘1’  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ตรวจสอบ  1. เงินให้สินเชื่อที่ได้รับการยกเว้นไม่ต้องสอบทานให้รายงาน  Review Flag = ‘1’  2. รอบการสอบทานให้ถือตามปีปฏิทิน |
| Arrangement Contract Date | วันที่ทำสัญญา จำนวน 10 ตัว ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. Date (YYYY-MM-DD ) ต้องมีการเช็คปี ค.ศ. มีค่าระหว่าง 1900–2050 เดือนมีค่าระหว่าง 01 – 12 วันที่มีค่าระหว่าง 01– 31  2. Arrangement Contract Date <= Data Set Date |
| Arrangement Purpose Code | วัตถุประสงค์ในการกู้ โดยแบ่งออกเป็นกลุ่มใหญ่ ๆ 3 กลุ่ม คือ เพื่อการอุปโภคบริโภคส่วนบุคคล, เพื่อการพาณิชย์ และเพื่อการอื่นๆ  (Classification Name : Arrangement Purpose Code) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Arrangement Purpose Code |
| Lending Business Type | ประเภทธุรกิจที่นำเงินไปใช้ซึ่งอาจจะต่างจากประเภทธุรกิจของผู้กู้ ใช้รหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ยกเว้น ลูกหนี้ที่เป็นบุคคลธรรมดาและกู้เพื่อการอุปโภคบริโภคส่วนบุคคลใช้ Classification ใน Personal Consumption) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ในรหัสมาตรฐานประเภทธุรกิจ (ISIC BOT Code Rev.4) ในระดับต่ำสุดของหมวดนั้น ๆ (รหัสที่มีใน ISIC BOT คอลัมน์ชื่อ“รายงานข้อมูล DMS”) หรือหมวดย่อยสุดใน Classification ชื่อ Personal Consumption |
| Effective Date | วันที่สัญญาเริ่มมีผลบังคับ |  |
| Maturity Date | วันที่สัญญาครบกำหนด |  |
| Description | รายละเอียดของสัญญา จำนวน 400 ตัว ไม่ระบุรูปแบบ (Free Format)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Movement Type | ประเภทการเปลี่ยนแปลงที่เกิดขึ้นระหว่างงวด ให้รายงานเฉพาะในส่วนที่เกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงยอดคงค้างที่เพิ่มขึ้นและลดลง  (Classification Name : Movement Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Movement Type และตรวจสอบ Code ว่าอยู่ในส่วนที่เกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงยอดคงค้างที่เพิ่มขึ้นและลดลง |
| Asset Classification Type | ประเภทการจัดชั้น มีทั้งหมด 6 ชั้น คือ ปกติ, กล่าวถึงเป็นพิเศษ, ต่ำกว่ามาตรฐาน, สงสัย, สงสัยจะสูญ และสูญ ทั้งนี้ตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท.ประกาศกำหนด เรื่อง สินทรัพย์ที่ไม่มีราคาหรือเรียกคืนไม่ได้ และสินทรัพย์ที่สงสัยว่าจะไม่มีราคาหรือเรียกคืนไม่ได้  (Classification Name : Asset Classification Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Asset Classification Type |
| Asset Classification Reason | เหตุผลการจัดชั้น ทั้งนี้ตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท.ประกาศกำหนด เรื่อง สินทรัพย์ที่ไม่มีราคาหรือเรียกคืนไม่ได้ และสินทรัพย์ที่สงสัยว่าจะไม่มีราคาหรือเรียกคืนไม่ได้  (Classification Name : Asset Classification Reason) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Asset Classification Reason |
| Operation Progress | สถานะการดำเนินการของลูกหนี้ เช่น ยังไม่ได้ดำเนินการ ,อยู่ระหว่างการเจรจาให้ชำระหนี้ ฯลฯ  (Classification Name : Operation Progress) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Operation Progress |
| Minimum Interest Rate | อัตราดอกเบี้ยต่ำสุด  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Maximum Interest Rate | อัตราดอกเบี้ยสูงสุด  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Contract Currency Id | รหัสสกุลเงินของสัญญา เช่น ADP, AED, GBP, EUR เป็นต้น  (Classification Name : Currency Id) | ตรวจสอบว่าอยู่ในรหัสมาตรฐานสกุลเงิน |
| Country Id to Invest | รหัสประเทศที่นำเงินไปทำธุรกรรม  (Classification Name : Country Id) | ตรวจสอบว่าอยู่ในรหัสมาตรฐานประเทศ |
| Contract Amount | จำนวนเงินตามสัญญา  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Collateral Type | ประเภทหลักประกัน เช่น ที่ดิน, โรงงาน, พันธบัตร เป็นต้น  (Classification Name : Collateral Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Collateral Type |
| Collateral Value Amount | มูลค่าหลักประกันรวม (ราคาประเมิน) / วงเงินค้ำประกัน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Collateral Pledged Amount | มูลค่าปัจจุบันของกระแสเงินสดที่คาดว่าจะได้รับจากการจำหน่ายหลักประกันเฉพาะส่วนที่นำมาหักได้ ตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท. ประกาศกำหนด  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Collateral Pledged Amount <= Collateral Value Amount |
| Cash Flow Value Amount | มูลค่าปัจจุบันของกระแสเงินสดที่คาดว่าจะได้รับจากลูกหนี้เฉพาะส่วนที่นำมาหักได้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| TDR Method Type | วิธีการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ เช่น ลดต้นเงินและ/หรือดอกเบี้ยค้างรับ, ขยายเวลาการชำระหนี้,รับโอนสินทรัพย์ที่เป็นหลักประกันหนี้ เป็นต้น ทั้งนี้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท. กำหนด เรื่อง หลักเกณฑ์การปรับปรุงโครงสร้างหนี้ของสถาบันการเงิน  (Classification Name : TDR Method Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ TDR Method Type |
| TDR Type | เกณฑ์ของการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ เช่น การปรับปรุงโครงสร้างหนี้ทั่วไป-ไม่มีส่วนสูญเสีย และการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ที่มีปัญญา-มีส่วนสูญเสีย  (Classification Name : TDR Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ TDR Type  TDR Type = CL\_Code 306007, 306014, 306015 และ 306016 TDR Method Type จะไม่มีค่า  TDR Type = CL\_Code 306012, 306013, 306018, 306019, 306020, 306022, 306024 และ 306025 TDR Method Type จะต้องมีค่า |
| Number of Re-entry | จำนวนครั้งของการ Re-entry |  |
| Principal Hair Cut Amount | จำนวนเงินของส่วนสูญเสียจากการปรับโครงสร้างที่เป็นเงินต้น คือมีการลดเงินต้นให้ลูกหนี้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Interest Hair Cut Amount | จำนวนเงินของส่วนสูญเสียจากการปรับโครงสร้างที่เป็นดอกเบี้ย คือมีการลดดอกเบี้ยให้ลูกหนี้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| VAT Waived Amount | จำนวนเงินภาษีมูลค่าเพิ่มที่ได้รับการยกเว้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Business Tax Waived Amount | จำนวนเงินภาษีธุรกิจเฉพาะที่ได้รับการยกเว้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Other Tax Waived Amount | จำนวนเงินภาษีอื่น ๆ ที่ได้รับการยกเว้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Other Arrangement Number | เลขที่สัญญาหรือเลขที่เอกสารอ้างอิงของสถาบันการเงินที่เกี่ยวข้องกัน เช่น กรณีมีการให้กู้ร่วม  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| AR AR Relationship Type | กรณีที่มีเลขที่สัญญาร่วมกับสถาบันการเงินที่เกี่ยวข้องกัน ให้ระบุประเภทของสัญญา  (Classification Name : Arrangement Arrangement Relationship Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Arrangement Arrangement Relationship Type |
| Related Involved Party Id | ระบุ Id ของคู่สัญญาที่เกี่ยวข้อง เช่น บุคคลธรรมดา ใช้เลขประจำตัวประชาชน (13 หลัก) นิติบุคคลใช้เลขที่จดทะบียนนิติบุคคลที่จดทะเบียนกับกระทรวงพาณิชย์ เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ตรวจสอบขนาดความยาวของข้อมูลว่าต้องสอดคล้องกับ Unique Id Type |
| Unique Id Type | ระบุประเภทของ Related Involved Party Id เช่น กรณีบุคคลธรรมดาที่รายงานด้วยเลข 13 หลัก ให้ระบุว่าเป็นประเภทเลขประจำตัวประชาชน = code 324001 Personal Id  (Classification Name : Unique Id Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Unique Id Type |
| IP AR Relationship Type | ให้ระบุเฉพาะในกรณีกู้ร่วม  (Classification Name : Involved Party Arrangement Relationship Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ IP AR Relationship Type |
| Outstanding Amount | ยอดเงินคงค้าง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Validation Data Set  Data Set \_ BLS : กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ , บริษัทเงินทุน, บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002  กรณีสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ, สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ ตรวจสอบที่ CL\_FI Reporting Group Id 116003  ตรวจสอบที่ Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item ( ข้อ 2.1.2 เงินให้สินเชื่อ + ข้อ 2.2.2 เงินให้สินเชื่อ+ ข้อ 7.1 เงินให้สินเชื่อ + เงินให้สินเชื่อแก่ลูกหนี้ตามธุรกรรมนโยบายรัฐ [เฉพาะ SFIs] ) > = Data set\_LAR : ผลรวม Outstanding Amount ของทุกสำนักงาน |
| Accrued Interest Amount | ดอกเบี้ยค้างรับตามบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Suspended Interest Amount | ดอกเบี้ยค้างรับนอกบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

\*\* หมายเหตุ :-

นิยามของลูกหนี้รายใหญ่ในการสอบทานเงินให้สินเชื่อ, เงินให้กู้ยืม และลูกหนี้

- ธนาคารพาณิชย์ไทย ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ หมายถึง เงินให้สินเชื่อที่มีวงเงินหรือยอดคงค้างรวมกันทุกสำนักงานตั้งแต่ 20 ล้านบาทขึ้นไป

- ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย หมายถึง เงินให้สินเชื่อที่มีวงเงินหรือยอดคงค้างรวมกันทุกสำนักงานตั้งแต่ 5 ล้านบาทขึ้นไป

- สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ หมายถึง เงินให้สินเชื่อที่มีวงเงินหรือยอดคงค้างตั้งแต่ 20 ล้านบาทขึ้นไป

- บริษัทเงินทุน หมายถึง เงินให้กู้ยืมและลูกหนี้ที่มีวงเงินหรือยอดคงค้างรวมกันทุกสำนักงานตั้งแต่ 5 ล้านบาทขึ้นไป

- บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หมายถึง เงินให้กู้ยืมและลูกหนี้ที่มีวงเงินหรือยอดคงค้างตั้งแต่ 1 ล้านบาทขึ้นไป

## Subject Area : Other FI Summary

### Data Set : Credit Card Summary (DS\_CCS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Credit Card Summary เป็นข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการให้บริการบัตรเครดิตของสถาบันการเงินและผู้ประกอบธุรกิจบัตรเครดิตที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน

**สถาบันที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

ผู้ประกอบธุรกิจบัตรเครดิตที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินหรือรหัสผู้ประกอบธุรกิจบัตรเครดิตที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน  กรณีผู้ส่งข้อมูลที่เป็นสถาบันการเงินจะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงิน ซึ่ง ธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002  กรณีที่เป็นผู้ประกอบธุรกิจบัตรเครดิตที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน  ใช้เลขรหัสมาตรฐานที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน รายงานชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char (10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น  yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2002-10-31 (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Card Type | ประเภทของบัตรเครดิต (เฉพาะรายการที่เกี่ยวข้องกับบัตรที่ผู้ประกอบธุรกิจบัตรเครดิตในประเทศเป็นเจ้าของ หรือเป็นตัวแทนออกบัตร) (Classification Name: Card Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Card Type |
| Cardholder Income Range | รายได้รวมต่อเดือนของผู้ถือบัตร (Classification Name: Income Range) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Income Range |
| Number of Accounts | จำนวนบัญชีหมายถึงจำนวนสะสมของบัตรที่ผู้ประกอบธุรกิจบัตรเครดิตในประเทศเป็นเจ้าของหรือเป็นตัวแทนออกบัตรออกให้ผู้บริโภคแล้ว ตามจำนวนบัญชีที่ผู้บริโภคขอมีบัตร โดย “บัญชี” หมายถึง ประเภทของบัตรชนิดใดชนิดหนึ่งที่ผู้ประกอบธุรกิจบัตรเครดิตออกให้กับผู้บริโภคแล้ว เช่น ผู้บริโภคมีบัตร VISA และ Mastercard ให้นับเป็น 2 บัญชี เป็นต้น และไม่ต้องนับจำนวนบัญชี  กรณีบัตรถูกยกเลิกไม่ให้ใช้ทั้งแบบ Cancel และ Write off ทั้งนี้กรณีบัตรถูกยกเลิกแบบ Cancel ยังคงต้องรายงานข้อมูลการใช้จ่าย และยอดคงค้างในงวดที่รายงาน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Total Outstanding Balance | ยอดสินเชื่อคงค้าง (Outstanding Balance) ของลูกหนี้บัตรเครดิตทั้งสิ้น ณ วัน สิ้นงวดที่รายงาน ที่เกิดจากการใช้จ่ายตามปกติ การเบิกเงินสดล่วงหน้า ค่าธรรมเนียมต่าง ๆ และดอกเบี้ยค้างจ่าย (ถ้ามี) (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Domestic Spending Volume | จำนวน Sales Slip ของการบริโภคในประเทศแต่ละรายสะสม ณ วันสิ้นงวดที่รายงาน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Domestic Spending Amount | ยอดเงินการใช้จ่าย สะสมที่เกิดขึ้นจากการใช้จ่ายภายในประเทศในงวดที่รายงาน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Oversea Spending Volume | จำนวน Sales Slip ของการบริโภคในต่างประเทศแต่ละรายสะสม ณ วันสิ้นงวดที่รายงาน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Oversea Spending Amount | ยอดเงินการใช้จ่าย สะสมที่เกิดขึ้นจากการใช้จ่ายในต่างประเทศในงวดที่รายงาน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Cash Advance Amount | จำนวนเงินที่มีการเบิกเงินสดล่วงหน้าสะสมของบัตรที่ออกโดยผู้ประกอบธุรกิจบัตรเครดิตในประเทศที่เป็นเจ้าของหรือเป็นตัวแทนออกบัตรในงวดที่รายงาน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Number of Accounts with more than 1 Month up to 3 Months Outstanding | จำนวนบัญชีของลูกค้าที่มียอดค้างชำระเกิน 1 เดือนถึง-3 เดือน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Total Outstanding Amount  with more than 1 Month up to 3 Months Outstanding | ยอดคงค้างของลูกค้าค้างชำระเกิน 1 เดือนถึง 3 เดือน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Number of Accounts with  more than 3 Months up to 6 Months Outstanding | จำนวนบัญชีของลูกค้าที่มียอดค้างชำระเกิน 3 เดือนถึง 6 เดือน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Total Outstanding Amount  with more than 3 Months up to 6 Months Outstanding | ยอดคงค้างของลูกค้าค้างชำระเกิน 3 เดือนถึง 6 เดือน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Number of Accounts with  more than 6 Months up to 12 Months Outstanding | จำนวนบัญชีของลูกค้าที่มียอดค้างชำระเกิน 6 เดือนถึง12 เดือน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Total Outstanding Amount with more than 6 Months up to 12 Months Outstanding | ยอดคงค้างของลูกค้าค้างชำระเกิน 6 เดือนถึง12 เดือน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Number of Accounts with more than 12 Months Outstanding | จำนวนบัญชีของลูกค้าที่มียอดค้างชำระเกิน12 เดือน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Total Outstanding Amount with more than 12 Months Outstanding | ยอดคงค้างของลูกค้าค้างชำระเกิน12 เดือน (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Income and Expense by Branch (DS\_IEB)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Income and Expense by Branch เป็นข้อมูลสรุปเกี่ยวกับรายได้และค่าใช้จ่ายจากการดำเนินงานรายสาขาของสถาบันการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ (เฉพาะสถาบันการเงินที่มีสำนักงานสาขามากกว่า 1 แห่ง)

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ  
**ลักษณะข้อมูล**

ราย 6 เดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้น 6 เดือน  
**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้น 6 เดือนที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Branch Number | กรณีที่เป็นชุดข้อมูลระดับสาขาให้รายงานเป็นรายสาขาในประเทศและสาขาต่างประเทศ โดยใช้รหัสสาขาเดิมของสถาบันการเงิน ซึ่งเป็นรหัส 3 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 หลัก เช่น ธนาคารกรุงเทพ สาขาถนนรัชดาห้วยขวาง รหัสสาขา 055 จะเป็น 0055 | ตรวจสอบรหัสสาขาของ Organization Id กับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงิน |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 30 มิถุนายน 2545 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2002-06-30 (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นงวดครี่งปีตามปีบัญชีของสถาบันการเงินนั้น ๆ |
| Income Amount | จำนวนเงินของรายได้จากการดำเนินงาน หน่วย จะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Expense Amount | จำนวนเงินของค่าใช้จ่ายจากการดำเนินงาน หน่วย จะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | **Validation Data Set:**  Data Set \_PNL : ตรวจสอบเฉพาะธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116002 และ Cl\_Profit and Loss Itemข้อ 12 กำไร(ขาดทุน)จากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้ (Profit (loss) from operating before income tax expense)  = Data Set \_IEB : ผลรวมยอดสุทธิของ (Income Amount หักด้วย Expense Amount ) ของทุกสำนักงาน |

### Data Set : Interest Rate Outstanding (DS\_IRO)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Interest Rate Outstanding เป็นข้อมูลเกี่ยวกับยอดคงเหลือแยกตามประเภทอัตราดอกเบี้ยเงินฝาก (โดยให้รายงานด้วยยอดสุทธิหลังจากหักส่วนลดจ่ายรอตัดบัญชีและดอกเบี้ยจ่ายล่วงหน้า) และยอดคงค้างแยกตามประเภทอัตราดอกเบี้ยเงินให้สินเชื่อ (โดยให้รายงานด้วยยอดสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว ทั้งนี้ ในกรณีที่เป็นเงินให้สินเชื่อด้อยคุณภาพ (NPL) ให้ระบุอัตราดอกเบี้ยเป็น 0%) โดยให้รายงานทั้งสกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศ กรณีที่เป็นสกุลเงินตราต่างประเทศให้แปลงเป็นเงินบาทโดยใช้อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันสิ้นไตรมาสที่รายงาน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ  
**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงินส่งชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล  Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นสุดไตรมาส (มี.ค.,มิ.ย., ก.ย., ธ.ค.) ตามปีปฏิทิน |
| Interest Rate Outstanding Type | ประเภทอัตราดอกเบี้ย แยกออกเป็นอัตราดอกเบี้ยเงินรับฝากและอัตราดอกเบี้ยเงินให้สินเชื่อ  (Classification Name: Interest Rate Outstanding Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Interest Rate Outstanding Type |
| Deposit Interest Term | ระยะเวลาดอกเบี้ยตามหน่วยที่ระบุ (เฉพาะกรณีอัตราดอกเบี้ยเงินรับฝากจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลา และอัตราดอกเบื้ยเงินรับฝากประเภทบัตรเงินฝาก) เช่นระยะเวลา 3 เดือน Data Type = Number(9) ใส่ค่า = 3 ในกรณีที่เป็นเงินรับฝากประเภท Demand Deposite Rate ให้รายงาน Deposit Interest Term เป็น 0 (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | จะมีค่าถ้า Interest Rate Outstanding Type = เงินรับฝากประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาและประเภทบัตรเงินฝาก |
| Deposit Interest Term Unit | หน่วยของช่วงเวลาดอกเบี้ย (เฉพาะกรณีอัตราดอกเบี้ยเงินรับฝากจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลา และอัตราดอกเบื้ยเงินรับฝากประเภทบัตรเงินฝาก)  ในกรณีที่เป็นเงินรับฝากประเภท Demand Deposit Rate ให้รายงาน Deposit Interest Term Unit เป็น day  (Classification Name: Term Unit) | จะมีค่าถ้า Interest Rate Outstanding Type = เงินรับฝากประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาและประเภทบัตรเงินฝาก |
| Remaining Term Range | ระยะเวลาของสัญญาคงเหลือ ให้รายงานในกรณีที่ Classification : Interest Rate Outstanding Type = 162024 (เงินให้กู้ยืม)  (Classification Name : Term Range) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Term Range และ  Classification ชื่อ Interest Rate Outstanding Type = 162024 (เงินให้กู้ยืม) |
| Interest Rate | อัตราดอกเบี้ย เช่น 12.50 Data Type = Number (8,5) สามารถมีทศนิยมได้ถึง 5 ตำแหน่ง (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Outstanding Amount | ยอดเงินต้นคงค้าง ณ สิ้นงวด ตามประเภทอัตราดอกเบี้ยที่ระบุ  Data Type = Number (20,2) สามารถมีทศนิยมได้ 2 ตำแหน่ง (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Interest Rate Summary (DS\_IRS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Interest Rate Summary เป็นข้อมูลสรุปเกี่ยวกับอัตราดอกเบี้ย สำหรับเงินฝาก หรือ เงินให้สินเชื่อ สำหรับบุคคลธรรมดา/ลูกค้าทั่วไป

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ  
 บริษัทเงินทุน   
 บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ

**ลักษณะข้อมูล**

รายวัน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ส่งข้อมูลเมื่อมีการเปลี่ยนแปลง โดยให้ส่งเฉพาะรายการที่เปลี่ยนแปลงเท่านั้น รวมถึงการเพิ่มหรือยกเลิกประเภทดอกเบี้ย

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 3 วันนับจากวันที่ประกาศเปลี่ยนแปลง

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 กรณีที่เป็นบริษัทเงินทุน และบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ใช้รหัส 3 หลักเหมือนเดิม | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงินส่งชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ประกาศเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ย Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ประกาศเปลี่ยนแปลงเป็น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2002-10-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ตรวจสอบให้ตรงกับวันที่ประกาศเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ย |
| Interest Rate Announcement Type | ประเภทอัตราดอกเบี้ยที่ประกาศ แยกออกเป็น  - ด้านเงินฝาก เช่น เงินฝากประเภทออมทรัพย์ และเงินฝากประจำต่าง ๆ  - ด้านสินเชื่อ เช่น MOR (Minimum Overdraft Rate) , MLR (Minimum Loan Rate) , MRR (Minimum Retail Rate) ฯลฯ  (Classification Name: Interest Rate Announcement Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Interest Rate Announcement Type  (Classification Code 162014 ให้รวมถึงอัตราดอกเบี้ยหรือส่วนลดสูงสุดรวมทั้งเงื่อนไขต่าง ๆ (ถ้ามี) ของสินเชื่อทุกประเภทที่สถาบันการเงินจะเรียกจากลูกค้า และ Classification Code 162015 ให้รวมถึงอัตราดอกเบี้ยหรือส่วนลดสูงสุดที่สถาบันการเงินจะเรียกจากลูกค้าสินเชื่อทุกประเภทที่ปฏิบัติผิดเงื่อนไข Classification Code 162016 และ 162017 สถาบันการเงินเรียกดอกเบี้ยได้ แต่ต้องไม่เกินเพดานอัตราดอกเบี้ยสินเชื่อบัตรเครดิตที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด) |
| Maximum Interest Rate | อัตราดอกเบี้ยสูงสุด Data Type = Number (8,5) สามารถมีทศนิยมได้ถึง 5 ตำแหน่ง (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Minimum Interest Rate | อัตราดอกเบี้ยต่ำสุด ในกรณีที่สถาบันการเงินประกาศอัตราดอกเบี้ยเพียง Rate เดียวให้รายงาน Maximum Interest Rate และ Minimum Interest Rate ด้วย Rate เดียวกัน Data Type = Number (8,5) สามารถมีทศนิยมได้ถึง 5 ตำแหน่ง (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Maximum Interest Rate >= Minimum Interest Rate |
| Effective Date | วันที่อัตราดอกเบี้ยเริ่มมีผลบังคับใช้  Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ตุลาคม 2545 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2002-10-31 (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | Effective Date >= Data Set Date |
| End Date | วันที่ยกเลิกการให้บริการ | End Date >= Data Set Date ระบุเมื่อสถาบันการเงินยกเลิกประเภทอัตราดอกเบี้ยนั้น ๆ และไม่ต้องระบุ Effective Date มา หากระบุ Effective Date จะต้อง < Data Set Date แต่จะต้องไม่เป็นวันที่เดียวกันกับ End Date |

หมายเหตุ :

1. กรณีที่สถาบันการเงินประกาศอัตราดอกเบี้ยเป็นช่วงวงเงิน เมื่อมีการเปลี่ยนแปลงช่วงวงเงินใหม่ แต่อัตราดอกเบี้ย Maximum และ Minimum ยังอยู่ในช่วงที่ไม่เกินจากค่า Maximum Interest Rate และ Minimum Interest Rate ก่อนการเปลี่ยนแปลง สถาบันการเงิน ไม่ต้องส่ง DS\_IRS

2. กรณี Adjustment Request เมื่อต้องการแก้ไขข้อมูล ให้สถาบันการเงินส่งแก้ไขข้อมูลของ Data Set Date นั้นมาทั้งไฟล์

## Subject Area : FI Consolidation

### Data Set : Capital Fund\_Conso (DS\_CAPC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Capital Fund\_Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับเงินกองทุนของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ตามเกณฑ์ Basel III

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ (เฉพาะบรรษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 57)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Capital Fund Item | รายการเงินกองทุน  (Classification Name: Capital Fund Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Capital Fund Item |
| Outstanding Amount per Book | ยอดคงค้างตามบัญชีของรายการ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท รูปแบบจะเป็น ตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  2. เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  3. เงินกองทุนทั้งสิ้นตามกฎหมาย (ยอดคงค้างตามบัญชี) = เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี) + เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  4. Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0  **Validation Data Set**  Data Set \_CAPC : Outstanding Amount per Book ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116028 และ 116030 และ  Data Set \_FPSC : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116028 และ 116030 โดยตรวจสอบที่   1. Capital Fund Item Code 940143 >= Balance Sheet Item Code 950404 (ค่าความนิยม) 2. Capital Fund Item Code 940179 +940159 + 940107 = Balance Sheet Item Code 950500 +950501 +950502 (มูค่าตามบัญชีของหุ้นทุนที่ออกและชำระแล้ว) 3. Capital Fund Item Code 940109 +940161 +940181 = Balance Sheet Item Code 950503 (ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น) 4. Capital Fund Item Code 940122 = Balance Sheet Item Code 950512 (ส่วนเกินจากการตีราคาที่ดิน) 5. Capital Fund Item Code 940123 = Balance Sheet Item Code 950513 (ส่วนเกินทุนจากการตีราคาอาคารและห้องชุดในอาคารชุด) 6. Capital Fund Item Code 940118 = Balance Sheet Item Code 950529 (ทุนสำรองตามกฎหมาย) 7. Capital Fund Item Code 940117 <= Balance Sheet Item Code 950530 (เงินสำรองอื่น ๆ ที่จัดสรรแล้วไม่รวมทุนสำรองตามกฎหมาย) |
| Applicable Capital Fund Amount | ยอดคงค้างของรายการเฉพาะที่สามารถนับเข้าเป็นเงินกองทุนได้ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  2. เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  3. เงินกองทุนทั้งสิ้นตามกฎหมาย (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) + เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  4. Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0  **Validation Data Set *:*** *ที่ไม่ได้ตรวจสอบโดยระบบ*  สำรองสำหรับสินทรัพย์จัดชั้นปกติ (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) <= ร้อยละ 1.25 ของยอดสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่เลือกคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตวิธี SA และของยอดสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี SA ตามประกาศ ธปท. ว่าด้วย “หลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตสำหรับ ธพ. โดยวิธี IRB” สำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ที่เลือกคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตวิธี IRB |
| Net Capital Fund Amount | ยอดคงค้างสุทธิที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนตามกฎหมายได้ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณี Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0 |

### Data Set : Comprehensive Income Statement\_Conso (DS\_CISC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Comprehensive Income Statement\_Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับ รายได้ค่าใช้จ่าย ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ (เฉพาะบรรษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส สำหรับข้อมูลไตรมาส 1 และไตรมาส 3, รายครึ่งปี สำหรับข้อมูลไตรมาส 2 และไตรมาส 4

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน อนึ่ง ในกรณีที่ได้มีการแก้ไขงบการเงินของแต่ละบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินตามคำแนะนำของผู้สอบบัญชี หลังจากที่ได้มีการจัดส่งข้อมูลดังกล่าวให้ ธปท. แล้ว ให้สถาบันการเงินจัดส่งรายงานหลังปรับปรุงมาอีก 1 ชุด ภายใน 21 วัน นับแต่วันที่ผู้สอบบัญชีรับรอง (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 56)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์ จะเป็นรหัส 2 หลัก ให้ใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 หลัก เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31 (Appendix A [Data Set Document] : Data Type)) | วันที่ซึ่งต้องเป็นวันที่สิ้นไตรมาส 1, ครึ่งปีแรก, ไตรมาส 3, ครึ่งปีหลัง ตามปีบัญชีของสถาบันการเงินนั้น ๆ |
| Data Set Period Month | รอบระยะเวลาสะสมของข้อมูล แทนค่าด้วยตัวเลข 1 หลัก คือ 3 และ 6  3 ใช้แทนไตรมาส 1 และไตรมาส 3  6 ใช้แทนงวดครึ่งปีแรกและงวดครึ่งปีหลัง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นไตรมาส 1 แล้ว Data Set Period Month = 3  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นงวดครึ่งปีแรก แล้ว Data Set Period Month = 6  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นไตรมาส 3 แล้ว Data Set Period Month = 3  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นงวดครึ่งปีหลัง แล้ว Data Set Period Month = 6 |
| Profit and Loss Item | รายการของรายได้และค่าใช้จ่าย  (Classification Name: Profit and Loss Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Profit and Loss Item  ค่าที่เป็นไปได้ คือ   1. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920251 (ข้อ 1. รายได้ดอกเบี้ย) ได้แก่ 920430 ถึง 920436, 920254, 920256 ถึง 920257, 920259 ถึง 920262, 920421 ถึง 920422 2. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920263 (ข้อ 2. ค่าใช้จ่ายดอกเบี้ย) ได้แก่ 920264, 920266 ถึง 920268, 920270 ถึง 920275 3. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920276 (ข้อ 3. รายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ) ได้แก่ 920277, 920279 ถึง 920282, 920284 ถึง 920286, 920288 ถึง 920289, 920437 ถึง 920438, 920291 ถึง 920297, 920439 ถึง 920445, 920299 4. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920300 (ข้อ 4. ค่าใช้จ่ายค่าธรรมเนียมและบริการ) ได้แก่ 920301 ถึง 920303 5. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920304 (ข้อ 5. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากธุรกรรมเพื่อค้าและการปริวรรตเงินตราต่างประเทศ) ได้แก่ 920306 ถึง 920311, 920313 ถึง 920317, 920319, 920320, 920322ถึง 920324 6. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920325 (ข้อ 6. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากหนี้สินทางการเงินที่กำหนดให้แสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม) ได้แก่ 920326 ถึง 920327 7. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920328 (ข้อ 7. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน) ได้แก่ 920331 ถึง 920334, 920336 ถึง 920339, 920341, 920342, 920344 ถึง 920346 8. ค่าที่มีรหัสเป็น 920347 (ข้อ 8. ส่วนแบ่งกำไร (ขาดทุน) จากเงินลงทุนตามวิธีส่วนได้เสีย[เฉพาะ Conso.]) 9. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920348 (ข้อ 9. รายได้จากการดำเนินงานอื่น) ได้แก่ 920349 ถึง 920352 10. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920353 (ข้อ 10. ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงานอื่น) ได้แก่ 920354 ถึง 920357, 920359 ถึง 920364 11. ค่าที่มีรหัสเป็น 920365 (ข้อ 11. หนี้สูญ หนี้สงสัยจะสูญ และขาดทุนจากการด้อยค่า) ได้แก่ 920367 ถึง 920370 12. ค่าที่มีรหัสเป็น 920371 (ข้อ 12. กำไร (ขาดทุน)จากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้) 13. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920372 (ข้อ 13. ภาษีเงินได้) ได้แก่ 920373, 920374 14. ค่าที่มีรหัสเป็น 920375 (ข้อ14. กำไร (ขาดทุน) สุทธิ) 15. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920376 (ข้อ 15. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น) ได้แก่ 920377 ถึง 920382 และ 920425 , 920426, 920428 , 920429 16. ค่าที่มีรหัสเป็น 920385 (ข้อ 16. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม) 17. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920386 (ข้อ 17. การแบ่งปันกำไร (ขาดทุน) สุทธิ [เฉพาะ Conso.])ได้แก่ 920387, 920388 18. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920389 (ข้อ 18. การแบ่งปันกำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม [เฉพาะ Conso.]) 920390, 920391 19. ค่าที่มีรหัสเป็น 920395 (ข้อ 20. จำนวนพนักงาน (คน)) 20. ค่าที่มีรหัสเป็น 920396 (ข้อ 21. จำนวนกรรมการ (คน)) |
| Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก และการแสดงค่าลบ ( - ) สำหรับจำนวนเงินที่เป็นค่าลบในรายการที่เป็นได้ทั้งค่าบวกและค่าลบ (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กำไร (ขาดทุน)จากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้ (920371) = ผลต่างสุทธิของรายการรายได้และค่าใช้จ่ายทุกประเภท  กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม (920385) = กำไร (ขาดทุน) สุทธิ (920375) + กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น (920376) ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920376 (ข้อ 15. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น) ซึ่งได้แก่ 920377 ถึง 920382 และ 920425, 920426, 920428, 920429 |

### Data Set : Contingent Summary\_Conso (DS\_COSC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Contingent Summary\_Conso เป็นข้อมูลแสดงจำนวนเงินตามสัญญาและมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะทางการเงินของรายการนอกงบแสดงฐานะทางการเงิน ทั้งนี้ให้ใช้ค่าแปลงสภาพ (Credit Conversion Factor) ตามที่กำหนดไว้ในหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III

ตราสารอนุพันธ์ ได้แก่ ตราสารอนุพันธ์ด้านอัตราแลกเปลี่ยน ตราสารอนุพันธ์ด้านอัตราดอกเบี้ย ตราสารอนุพันธ์ด้านตราสารหนี้ ตราสารอนุพันธ์ด้านตราสารทุน ตราสารอนุพันธ์ด้านสินค้าโภคภัณฑ์ และ ตราสารอนุพันธ์ด้านเครดิต

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 57)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Customer Group | กลุ่มลูกหนี้ที่คำนวณความเสี่ยงด้านเครดิต  ค่า ‘0’ เท่ากับ Retail  ค่า ‘1’ เท่ากับ Non-retail | กรณีที่ Credit Risk Method มีรหัสเป็น 447001 หรือ 447002 Customer Group ต้องไม่มีค่า |
| Contingent Type | ประเภทภาระผูกพัน ใช้ classification ของภาระผูกพันใน Arrangement Type (ยกเว้นรายการ ภาระผูกพันอื่น ๆ ที่มีค่า CCF = 0.5 Cl\_code 018286)  (Classification Name: Arrangement Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent |
| Exposure Method | วิธีที่ใช้คำนวณ Exposure ของตราสารอนุพันธ์ ให้ใส่รหัสที่มีค่าเท่ากับ  รหัส ‘440001’ สำหรับวิธี Original  รหัส ‘440008’ สำหรับวิธี Current  (Classification Name: Exposure Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type ในส่วนของ Contingent เป็นตราสารอนุพันธ์ และค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 440001 และ 440008 ใน Exposure Type Classification และ 2. ถ้า Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440001 (วิธี Original) แลัว ค่าที่เป็นไปได้ของ Contingent Type คือ ค่าที่มีรหัสเป็นรหัสย่อย ภายใต้รหัส 018081 (อนุพันธ์ด้านอัตราแลกเปลี่ยน) หรือ รหัส 018087 (อนุพันธ์ด้านอัตราดอกเบี้ย )   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Booking Type | ประเภทบัญชีของตราสารอนุพันธ์  (Classification Name: Booking Type) | มีค่าเมื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และ ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Booking Type  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Netting Type | สถานะของการหักกลบลบหนี้ระหว่างกัน (Netting)  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่มี Netting  ค่า ‘1’ เท่ากับ มี Netting | มีค่าเมื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| CCF Rate | ระบุค่า Credit Conversion Factor ตามหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III เช่น  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 5 CCF Rate เท่ากับ 0.05  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 20 CCF Rate เท่ากับ 0.2  (กรณี สง. ที่ใช้วิธี IRB ให้รายงาน CCF ของอนุพันธ์ทางการเงิน = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| RWA Rate | ระบุน้ำหนักความเสี่ยงของรายการใน Arrangement Type เช่น  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 20 RWA Rate เท่ากับ 0.2  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 50 RWA Rate เท่ากับ 0.5  (กรณี สง. ที่ใช้วิธี IRB ให้รายงาน RWA = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Involved Party Type | ประเภทของผู้ทำสัญญา (Involved party)  (Classification Name: Involved Party Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Involved Party Type |
| Arrangement Currency Flag | ประเภทสกุลเงินของสัญญา  ค่า ‘0’ เท่ากับ เงินตราต่างประเทศ  ค่า ‘1’ เท่ากับ เงินบาท | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Notional Principal Amount | ยอดรวมของภาระผูกพันก่อนหัก Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Specific Provision | เงินสำรองส่วนที่นำมาหักก่อนคำนวณสินทรัพย์เสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของรายการนอกงบแสดงฐานะทางการเงิน และ Repo-style transaction  กรณีเป็นตราสารอนุพันธ์ที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current จะเป็นมูลค่าก่อนรวมผลกำไรจากวัดมูลค่ายุติธรรม  วิธี SA หลังหัก Specific Provision  วิธี IRB ก่อนหัก Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Add On or Potential Future Credit Exposure | ผลรวมของมูลค่าความเสี่ยงสุทธิที่คาดว่าจะเกิดขึ้นในอนาคต ของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์ ของคู่สัญญาทุกราย  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | ผลรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์ของคู่สัญญาทุกราย  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Profit from Mark to Market | ผลกำไรทั้งสิ้นจากการวัดมูลค่ายุติธรรม กรณีคำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type อยู่ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และ 2. Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440008 (วิธี current)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Loss from Mark to Market | ผลขาดทุนทั้งสิ้นจากการวัดมูลค่ายุติธรรม กรณีคำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type อยู่ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และ 2. Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440008 (วิธี current)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Net Profit & Loss from Mark to Market | ผลรวมของคู่สัญญาทุกรายที่เกิดจากยอดรวมสุทธิของกำไรและขาดทุน เฉพาะยอดสุทธิที่เป็นบวก จากการวัดมูลค่ายุติธรรมของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่ทำกับคู่สัญญาแต่ละรายที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |

### Data Set : Credit Risk Internal Ratings-Based Approach\_Conso (DS\_CRIC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Credit Risk Internal Ratings-Based Approach\_Conso เป็นข้อมูลสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณจากข้อมูลสินทรัพย์และรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน ยกเว้น ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน สินทรัพย์อื่น และฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation โดยใช้ข้อมูลจากระบบ Internal Rating ของของกลุ่มธุรกิจทางการเงินเป็นหลักในการคำนวณหาค่าองค์ประกอบความเสี่ยงต่าง ๆ เพื่อนำมาแทนค่าในสูตรการคำนวณหาเงินกองทุนและสินทรัพย์เสี่ยงตามที่ ธปท. กำหนด และ มูลค่าความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น (Expected loss) ของสินทรัพย์แต่ละประเภท สำหรับของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 57)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| CRM Method | วิธี CRM หลักประกันทางการเงิน  (Classification Name: Credit Risk Mitigation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Mitigation Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449014 ถึง 449017  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น)และ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 3. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Portfolio Type | ประเภทของ Portfolio  - กรณีที่ Credit Risk Item มี PD Range มากกว่า 1 กลุ่ม และ Credit Risk Item เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุล ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ดังกล่าวแล้วตามด้วยชื่อของประเภท Portfolio ใน Element ของ Portfolio Type ส่วนกรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ที่เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุลของ Credit Risk Typeของรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) นั้น แล้วตามด้วยชื่อของประเภท Portfolio ใน Element ของ Portfolio Type เช่น กรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุล รหัส 446081 (ข้อ4.2 วงเงินหมุนเวียนเพื่อรายย่อย) Portfolio Type จะเป็น446081CreditCard , 446081PersonalCredit เป็นต้น กรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) รหัส 446120 โดยรายการนอกงบดุลดังกล่าวเป็นของวงเงินหมุนเวียนเพื่อรายย่อย (รหัส 446081) และ Credit Risk Type รหัส 449017 Portfolio Type จะเป็น446081CreditCard , 446081PersonalCredit เป็นต้น  - กรณีที่ Credit Risk Item มี PD Range 1 กลุ่ม และ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุล และ ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) ของ Credit Risk Type ที่มีรหัสเป็น449016 (ข้อ 3.ลูกหนี้ธุรกิจเอกชน) และรหัส 449017 (ข้อ4. ลูกหนี้รายย่อย) ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ภายใต้รหัส 446070 (ข้อ 3.ลูกหนี้ธุรกิจเอกชน)และ รหัสย่อยภายใต้รหัส 446079(ข้อ4. ลูกหนี้รายย่อย) ใน Element ของ Portfolio Type เช่น กรณีรายงาน Credit Risk Type รหัส 449016และ Credit Risk Item รหัส 446120 โดยรายการนอกงบดุลดังกล่าวเป็นของสินเชื่อเพื่อสินค้าโภคภัณฑ์ Portfolio Type จะเป็น 446077 เป็นต้น |  |
| Asset Value Correlation | การปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ สำหรับลูกหนี้ที่เข้าข่ายเป็นบริษัทที่ประกอบธุรกิจทางการเงินที่ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ (Asset Value Correlation : AVC)  ‘0’ = ไม่ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์  ‘1’ = ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ |  |
| Double Default Method | วิธีปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  ‘0’ = ไม่ใช้วิธี Double Default  ‘1’ = ใช้วิธี Double Default | ค่าที่เป็นไปได้ สำหรับ Double Default Method ที่มีค่า ‘1’ คือ Credit Risk Item มีรหัสเป็น 446069, 446071, 446072, 446073, 446083, 446120, 446121, 446124, 446125, 446132, 446129, 446161, 446162 และ 446163 |
| Grade | เกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ และในกรณีของรายการที่เป็นรหัสย่อย ของลูกหนี้ธุรกิจเอกชน กลุ่มพิเศษที่ใช้วิธี Supervisory Slotting Criteria ในการคำนวณเงินกองทุน (รหัส446074) ให้แทนค่า Rating ที่ได้เทียบเคียงแล้วสำหรับ ค่า Internal Rating ของสง.กับ Rating ตามที่ธปท.กำหนด ดังนี้  ดีมาก ด้วย เกรด 1  ดีมาก\* ด้วย เกรด 2  ดี ด้วย เกรด 3  ดี\* ด้วย เกรด 4  พอใช้ ด้วย เกรด 5  อ่อน ด้วย เกรด 6  ผิดนัดชำระหนี้ ด้วย เกรด 7  โดยที่ \* คือ เกรดดีมากและดีที่มีน้ำหนักความเสี่ยงเที่เข้าเงื่อนไขตามที่ธปท.กำหนดสำหรับกรณีที่สินเชื่อกลุ่มพิเศษ ให้แสดงทุกเกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ |  |
| Lower Bound | ค่าความน่าจะเป็นต่ำสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Lower Bound ต้องมีค่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ ค่า Upper Bound |
| Upper Bound | ค่าความน่าจะเป็นสูงสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Upper Bound ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ ค่า Lower Bound |
| Estimated PD | ค่าประมาณการของความน่าจะเป็นที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ (PD) ที่กลุ่มธุรกิจทางการเงินใช้เป็นตัวแทนของค่า PD ของแต่ละเกรด |  |
| Notional Principal Amount | ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement (Repo transaction และ Securities borrowing and lending) โดยสำหรับ OTC Derivatives ให้หมายถึง ยอดรวมจำนวนเงินตามสัญญาอนุพันธ์ทางการเงิน  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น    1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)    2. รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction ) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131)   แล้ว Notional Principal Amount ต้องมีค่า   1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) แล้ว Notional Principal Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า รวมทั้งกรณีที่ Double Default Method เป็น ‘1’ |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของมูลค่ารายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน ธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน (Reverse Repo) และลูกหนี้ที่เกิดจากการวางเงินสดเป็นหลักประกันในการยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing) ตามธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending (SBL) ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement และยอดรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินของรายการ OTC Derivatives  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น    1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) และ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)    2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446123 (ข้อ 2.1 อนุพันธ์ทางการเงินนอกตลาด (Over the Counter))    3. รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131)   แล้ว Gross Credit Equivalent Amount ต้องมีค่า   1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ Gross Credit Equivalent Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า รวมทั้งกรณีที่ Double Default Method เป็น ‘1’ |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount ของรายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน เช่น ส่วนที่ตีราคาเพิ่มของที่ดินและอาคาร ดอกผลเช่าซื้อรอการตัดบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าได้เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินและนอกงบแสดงฐานะการเงิน ที่หัก Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนหัก Specific provision และปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต ยกเว้น   1. กรณี Repo-style transaction ที่อยู่ภายใต้ Master netting agreement ให้รายงานด้วยยอดหลักการ netting ซึ่งมีค่าเท่ากับ E\* ตามสูตรที่ ธปท. กำหนด 2. กรณีธุรกิจการให้เช่าแบบลิสซิ่ง (Leasing) ที่มี Residual value risk ให้รายงานด้วยผลรวมของกระแสเงินค่าเช่าที่ผู้เช่าต้องจ่ายให้ ผู้ให้เช่า คิดลดด้วยอัตราดอกเบี้ยที่เหมาะสม   กรณีลูกหนี้ที่รับซื้อมา ให้รายงานด้วยค่า EAD สำหรับ Default risk ก่อนปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต ซึ่งมีค่าเท่ากับมูลค่ายอดหนี้ที่รับซื้อมาหักด้วยเงินกองทุนสำหรับ Dilution risk ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ต้องมีค่า เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Decrease in EAD | EAD ที่ลดลงจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าได้เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Increase in EAD | EAD ที่เพิ่มขึ้นจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Collateral Type | ประเภทหลักประกัน ให้ กลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ใช้วิธี AIRB ระบุประเภทหลักประกัน (กรณีค่าประมาณการ LGD ขึ้นอยู่กับประเภทหลักประกัน) |  |
| LGD Rate | ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ที่พิจารณาจากหลักประกันและการหักกลบหนี้ในงบแสดงฐานะการเงิน เช่น  ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ ร้อยละ 35 LGD Rate เท่ากับ 0.35  ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ ร้อยละ 75 LGD Rate เท่ากับ 0.75  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| EAD after CRM | ยอดรวมของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน และนอกงบแสดงฐานะการเงิน หลังปรับปรุงรายการที่เกี่ยวข้อง แยกตามค่า LGD  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ในแต่ละ Grade ของ Credit Risk Item, Credit Risk Type, Portfolio Type, Asset Value Correlation และ Double Default Method หนึ่งๆ ผลรวมของ EAD after CRM ต้องเท่ากับ Net Credit Equivalent Amount หัก Decrease in EAD บวก Increase in EAD |
| Protection Seller PD | ค่าเฉลี่ย PD ของ Protection seller สำหรับลูกหนี้ในแต่ละเกรด ถ่วงน้ำหนักด้วยยอดรวม EAD ส่วนที่มีการประกันความเสี่ยงด้านเครดิตจาก Protection seller สำหรับค่า PD ของ Protection seller ที่แตกต่างกันแต่ละค่า  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Double Default Method เป็น ‘1’ และไม่มีค่ากรณีที่ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Effective Maturity | ค่าเฉลี่ยของระยะเวลาครบกำหนดของหนี้ (ปี) สำหรับลูกหนี้ในแต่ละเกรด ถ่วงน้ำหนักด้วยยอดรวม EAD สำหรับค่า M ที่แตกต่างกันแต่ละค่า  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ค่า Effective Maturity ต้องมีค่าอยู่ในช่วงตั้งแต่ 0 ถึง 5 |
| Dilution risk | สินทรัพย์เสี่ยงที่เกิดจาก Dilution risk (ความเสี่ยงที่ยอดหนี้ที่ กลุ่มธุรกิจทางการเงิน รับซื้อมาอาจมีมูลค่าลดลงได้ เนื่องจากผู้ขายลูกหนี้มีข้อตกลงกับลูกหนี้) โดยการรายงานให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสถาบันการเงินที่ใช้วิธี IRB  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Residual value risk | สินทรัพย์เสี่ยงที่เกิดจาก Residual value risk (ความเสี่ยงที่เกิดจากความเสียหายจากการที่มูลค่ายุติธรรมของทรัพย์สินลดลงต่ำกว่ามูลค่าซาก ของธุรกรรมการให้เช่าแบบลิสซิ่ง)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้น ซึ่งเท่ากับผลรวมของมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงจาก Default risk, Dilution risk และ Residual value risk หลังคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Expected Loss | มูลค่าของความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Credit Risk Standardized Approach\_Conso (DS\_CRSC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Credit Risk Standardized Approach\_Conso เป็นข้อมูลการคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณจากสินทรัพย์และรายการนอกงบแสดงฐานะการเงินถ่วงน้ำหนักความเสี่ยงตามที่ ธปท.กำหนด ของ

1. วิธี Simplified Standardized Approach (SSA)
2. วิธี Standardized Approach (SA)
3. วิธีInternal Ratings-Based Approach (IRB) สำหรับ
   1. สินทรัพย์เสี่ยงที่ไม่มีนัยสำคัญที่คำนวณด้วยวิธี SA
   2. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุนในกรณีที่มีนัยสำคัญ แต่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB
   3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุนในกรณีที่มีนัยสำคัญ ที่คำนวณโดยวิธี Market based
   4. สินทรัพย์อื่น
   5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ (เฉพาะบรรษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 57)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| CRM Method | วิธี CRM หลักประกันทางการเงิน  (Classification Name: Credit Risk Mitigation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Mitigation Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449002 ถึง 449012 , 449018, 449019 และ 449020  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446002 (วิธี Standardized Approach (SA) และ Simplified Standardized Approach (SSA)) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน)  * ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA) * ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ   5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้ วิธี SA)  5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based  5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight  5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)  5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น  และรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) กับ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| FTD Adjustment | จำนวนเงินของรายการปรับปรุงสินทรัพย์เสี่ยงของงธุรกรรม First-to-default Credit Derivatives | มีค่าเมื่อ   1. Credit Risk Type มีรหัสเป็น 449012 (ข้อ 11. ผู้ขายประกันความเสี่ยงด้านเครดิตประเภท First-to-default Credit Derivatives และธุรกรรม Securitization) และ 2. Credit Risk Item มีรหัสเป็น 446063 (ข้อ 11.1 เงินลงทุนในตราสาร First-to-default Credit Linked Note ที่มี Rating)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| CCF Rate | ระบุค่า Credit Conversion Factor ตามหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III เช่น  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 5 CCF Rate เท่ากับ 0.05  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 20 CCF Rate เท่ากับ 0.2  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น กรณี Credit Risk Item ที่มีรหัสเป็น 446125 กับ 446128 ของรายการที่ใช้วิธี Current Exposure Method และที่สามารถ Netting กันได้ตามเกณฑ์ 2. รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction ) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ยกเว้น รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ค่า CCF Rate จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| RWA Rate | ระบุน้ำหนักความเสี่ยง เช่น  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 20 RWA Rate เท่ากับ 0.2  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 50 RWA Rate เท่ากับ 0.5  (กรณีอนุพันธ์ทางการเงินที่อยู่ในตลาด Exchange ให้รายงาน RWA = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Notional Principal Amount | ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement (Repo transaction และ Securities borrowing and lending) โดยสำหรับ OTC Derivatives ให้หมายถึง ยอดรวมจำนวนเงินตามสัญญาอนุพันธ์ทางการเงิน  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) 2. รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction ) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ยกเว้น รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ Notional Principal Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของมูลค่ารายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน ธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน (Reverse Repo) และลูกหนี้ที่เกิดจากการวางเงินสดเป็นหลักประกันในการยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing) ตามธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending (SBL) ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement และยอดรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินของรายการ OTC Derivatives  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446002 (วิธี Standardized Approach (SA) และ Simplified Standardized Approach (SSA)) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน)    * ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)    * ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ   5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้ วิธี SA)  5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based  5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight  5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)  5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น  และรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) กับ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446123 (ข้อ 2.1 อนุพันธ์ทางการเงินนอกตลาด (Over the Counter)) 2. รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ยกเว้น รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ Gross Credit Equivalent Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Specific Provision | เงินสำรองส่วนที่นำมาหักก่อนคำนวณสินทรัพย์เสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount เช่น ส่วนที่ตีราคาเพิ่มของที่ดินและอาคาร ดอกผลเช่าซื้อรอการตัดบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่หัก Specific Provision และ Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Decrease in CRM | มูลค่าของสินทรัพย์หรือมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ส่วนที่มีการนำ CRM มาปรับลดความเสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Increase in CRM | มูลค่าของสินทรัพย์หรือมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ส่วนที่นำไปปรับลดความเสี่ยงให้แก่ลูกหนี้อื่น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Potential Loss | มูลค่าผลขาดทุนสูงสุดที่คาดว่าจะเกิดขึ้นกับตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี VaR และไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Credit Risk Type มีรหัสเป็น 449018 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) และ 2. Credit Risk Item มีรหัสเป็น รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446097 (ข้อ 5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ) หรือ 446098 (5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้น  กรณีที่ Credit Risk Item มีรหัสเป็นรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446090 (ข้อ 5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based) ค่ามูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้นจะเป็นค่าก่อนคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสง.ที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Equity Position\_Conso (DS\_EQPC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Equity Position\_Conso เป็นข้อมูลความเสี่ยงด้านเครดิตและมูลค่าความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น (Expected loss) สำหรับฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD สำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 57)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Default Data | ความเพียงพอของข้อมูลที่ใช้ในการประมาณค่า Probability of Default (ค่า PD)  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่เพียงพอ  ค่า ‘1’ เท่ากับ เพียงพอ | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449018  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 446099 (ข้อ 5.2.3 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD)  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Grade | เกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ |  |
| Lower Bound | ค่าความน่าจะเป็นต่ำสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Lower Bound ต้องมีค่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ ค่า Upper Bound |
| Upper Bound | ค่าความน่าจะเป็นสูงสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Upper Bound ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ ค่า Lower Bound |
| Estimated PD | ค่าประมาณการของความน่าจะเป็นที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ (PD) ที่ สง. ใช้เป็นตัวแทนของค่า PD ของแต่ละเกรด |  |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount ของรายการฐานะที่เกี่ยวข้องกับ ตราสารทุน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Specific Provision | เงินสำรองที่เป็น Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ที่หัก Specific Provision และ Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Decrease in EAD | EAD ที่ลดลงจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Increase in EAD | EAD ที่เพิ่มขึ้นจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity exposure with sufficient information | ฐานะของตราสารทุนที่มีข้อมูลเพียงพอในการพิจารณาการผิดนัดชำระหนี้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity exposure without sufficient information | ฐานะของตราสารทุนที่มีข้อมูลไม่เพียงพอในการพิจารณาการผิดนัดชำระหนี้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Scaling Factor | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนที่ต้องใช้ scaling factor 1.5 ในการปรับค่าสินทรัพย์เสี่ยง และได้คูณค่าดังกล่าวแล้ว  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Minimum RW | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนในแต่ละเกรด เฉพาะตราสารทุนที่ต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ (Minimum risk weight)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Maximum RW | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนในแต่ละเกรด เฉพาะตราสารทุนที่ต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นสูง (Maximum risk weight)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของตราสารทุน หลังคูณ Scaling Factor ของการพิจารณาความเพียงพอของข้อมูลที่ใช้ในการประมาณค่า PD ตามคำจำกัดความของการผิดนัดชำระหนี้ แต่หลังคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Expected Loss | มูลค่าของความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Financial Position Statement\_Conso (DS\_FPSC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Financial Position Statement\_Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับฐานะการเงิน ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ (เฉพาะบรรษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 56)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูลจะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Balance Sheet Item | รายการของฐานะการเงินของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: Balance Sheet Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Balance Sheet Item  ค่าที่เป็นไปได้ คือ   1. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950271 (สินทรัพย์) 2. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950430 (หนี้สิน) 3. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950497 (ส่วนของเจ้าของ) ประกอบด้วย    1. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950498 (ข้อ 25.1 ทุนที่ออกและชำระแล้ว)    2. ค่าที่มีรหัสเป็น 950503 (ข้อ 25.2 ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น)    3. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950504 (ข้อ 25.3 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) มูลค่าหุ้น)    4. ค่าที่มีรหัสเป็น 950509 (ข้อ 25.4 ส่วนเกินทุนหุ้นบุริมสิทธิซื้อคืน)    5. ค่าที่มีรหัสเป็น 950510 (ข้อ 25.5 ส่วนเกินทุนหุ้นสามัญซื้อคืน)    6. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950511 (ข้อ 25.6 ส่วนเกินทุนจากการตีราคาสินทรัพย์)    7. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950515 (ข้อ 25.7 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) ทุนจากการเปลี่ยนแปลงมูลค่าเงินลงทุน)    8. ค่าที่มีรหัสเป็น 950522 (ข้อ 25.8 ผลต่างจากการแปลงค่างบการเงิน)    9. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950523 (ข้อ 25.9 องค์ประกอบอื่น ๆ ของส่วนของเจ้าของ )    10. ค่าที่มีรหัสเป็น 950524 (ข้อ 25.10 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) จากการประเมินมูลค่ายุติธรรมตราสารป้องกันความเสี่ยงสำหรับการป้องกันความเสี่ยงในกระแสเงินสด (ส่วนที่มีประสิทธิผล))    11. ค่าที่มีรหัสเป็น 950525 (ข้อ 25.11 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) จากการประเมินมูลค่ายุติธรรมตราสารป้องกันความเสี่ยงสำหรับการป้องกันความเสี่ยงในเงินลงทุนสุทธิในหน่วยงานต่างประเทศ (ส่วนที่มีประสิทธิผล))    12. ค่าที่มีรหัสเป็น 950526 (ข้อ 25.12 ส่วนแบ่งกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จอื่นในบริษัทร่วม [เฉพาะ Conso.])    13. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950527 (ข้อ 25.13 กำไร(ขาดทุน)สะสม)    14. ค่าที่มีรหัสเป็น 950536 (ข้อ 25.14 หัก หุ้นบุริมสิทธิซื้อคืน)    15. ค่าที่มีรหัสเป็น 950537 (ข้อ 25.15 หัก หุ้นสามัญซื้อคืน )    16. ค่าที่มีรหัสเป็น 950538(ข้อ 25.16 ส่วนได้เสียที่ไม่มีอำนาจควบคุม) 4. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950564 (ข้อ 26 หนี้สินที่จะเกิดในภายหน้า) 5. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950570 (ข้อ 27 ตราสารอนุพันธ์) |
| Balance Sheet Amount | จำนวนเงินของรายการใน Balance Sheet Item หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก และการแสดงค่าลบ ( - ) สำหรับจำนวนเงินที่เป็นค่าลบในรายการที่เป็นได้ทั้งค่าบวกและค่าลบ ค่าลบที่แสดงนั้นจะไม่นับอยู่ในจำนวนหลักข้างต้น หากเป็นรายการหักไม่ต้องแสดงค่าลบ ( - )  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | สินทรัพย์ = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการด้านสินทรัพย์  หนี้สิน = ผลรวมของรายการย่อยทุกรายการของหนี้สิน  ส่วนของเจ้าของ = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของส่วนของเจ้าของ  สินทรัพย์ = ผลรวมของรายการหนี้สินและส่วนของเจ้าของ  สิทธิในการเรียกคืนหลักทรัพย์ < = ภาระในการส่งคืนหลักทรัพย์  ภาระของลูกค้าจากการรับรอง = ภาระของสถาบันการเงินจากการรับรอง  *Validation Data Set*  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ**  **- ตรวจสอบระหว่าง Data Set \_FPSC กับ Data Set \_CAPC**  Data Set \_FPSC : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116028 และ 116030 และ  Data Set \_CAPC : Outstanding Amount per Book ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116028 และ 116030  โดยตรวจสอบที่  1. Balance Sheet Item Code 950404 <= Capital Fund Item Code 940143 (ค่าความนิยม)  2. Balance Sheet Item Code 950500 +950501 +950502 = Capital Fund Item Code 940179 +940159 +940107 (มูค่าตามบัญชีของหุ้นทุนที่ออกและชำระแล้ว)  3. Balance Sheet Item Code 950503 = Capital Fund Item Code 940109 +940161 +940181 (ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น)  4. Balance Sheet Item Code 950512 = Capital Fund Item Code 940122 (ส่วนเกินจากการตีราคาที่ดิน)  5. Balance Sheet Item Code 950513 = Capital Fund Item Code 940123 (ส่วนเกินทุนจากการตีราคาอาคารและห้องชุดในอาคารชุด)  6. Balance Sheet Item Code 950529 = Capital Fund Item Code 940118 (ทุนสำรองตามกฎหมาย)  7. Balance Sheet Item Code 950530 >= Capital Fund Item Code 940117 (เงินสำรองอื่น ๆ ที่จัดสรรแล้วไม่รวมทุนสำรองตามกฎหมาย)  **กรณีสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ**  **- ตรวจสอบระหว่าง Data Set \_FPSC กับ Data Set \_CAPC**  Data Set \_FPSC : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116028 และ  Data Set \_CAPC : Outstanding Amount per Book ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116028  โดยตรวจสอบที่  1. Balance Sheet Item Code 950404 <= Capital Fund Item Code 940143 (ค่าความนิยม)  2. Balance Sheet Item Code 950500 +950501 +950502 = Capital Fund Item Code 940179 +940159 +940107 (มูค่าตามบัญชีของหุ้นทุนที่ออกและชำระแล้ว)  3. Balance Sheet Item Code 950503 = Capital Fund Item Code 940109 +940161 +940181 (ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น)  4. Balance Sheet Item Code 950512 = Capital Fund Item Code 940122 (ส่วนเกินจากการตีราคาที่ดิน)  5. Balance Sheet Item Code 950513 = Capital Fund Item Code 940123 (ส่วนเกินทุนจากการตีราคาอาคารและห้องชุดในอาคารชุด)  6. Balance Sheet Item Code 950529 = Capital Fund Item Code 940118 (ทุนสำรองตามกฎหมาย)  7. Balance Sheet Item Code 950530 >= Capital Fund Item Code 940117 (เงินสำรองอื่น ๆ ที่จัดสรรแล้วไม่รวมทุนสำรองตามกฎหมาย)  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ**  **- ตรวจสอบระหว่าง Data Set \_FPSC กับ Data Set \_IRRC โดย**ตรวจสอบ สำหรับแต่ละ CL\_FI Reporting Group Id ที่ 116028 และ 116030  Data Set \_FPSC : Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item Code 950277, 950290, 950366, 950413, 950431, 950438, 950458, 950470, 950481, 950485 >= Data Set \_IRRC : Amount ที่ CL\_Banking Book Position Code 990002, 990006, 990009, 990014, 990018, 990021, 990044, 990025, 990049, 990026 ตามลำดับ  **กรณีสถาบันการเงินพิเศษของรัฐ**  **- ตรวจสอบระหว่าง Data Set \_FPSC กับ Data Set \_IRRC โดย**ตรวจสอบ สำหรับแต่ละ CL\_FI Reporting Group Id ที่ 116028 Data Set \_FPSC : Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item Code 950277, 950290, [950366 + 950616], 950413, 950431, 950438, 950458, 950470, 950481, 950485 >= Data Set \_IRRC : Amount ที่ CL\_Banking Book Position Code 990002, 990006, 990009, 990014, 990018, 990021, 990044, 990025, 990049, 990026 ตามลำดับ |

### Data Set : Investment by the Parent Company\_Conso (DS\_IPCC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Investment by the Parent Company\_Conso เป็นข้อมูลแสดงการลงทุนของบริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงินในบริษัทต่าง ๆ ทั้งที่เป็นการลงทุนทางตรงและการลงทุนทางอ้อม โดยแบ่งเป็นการลงทุนในบริษัทที่อยู่ในกลุ่มธุรกิจทางการเงินและบริษัทนอกกลุ่มธุรกิจทางการเงินซึ่งการลงทุนในบริษัทที่อยู่นอกกลุ่มธุรกิจทางการเงิน จะรายงานเฉพาะบริษัทที่บริษัทแม่ถือหุ้นทางตรงและทางอ้อมรวมกันเกินร้อยละ 10 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 56)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูลจะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Financial Group | ประเภทของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: Financial Group) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Financial Group  กรณีที่ Financial Group มีรหัสเป็น 457002 (กลุ่มธุรกิจทางการเงินที่บริษัทแม่ไม่ใช่สถาบันการเงิน) แล้ว Classification of Investment by the Parent Company ที่มีรหัสเป็น 458003 จะต้องมีค่า ถ้าไม่ใช่ต้อง ไม่มีค่า |
| Classification of Investment by the Parent Company | การจัดประเภทของการลงทุนในบริษัทต่าง ๆ ของบริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: Classification of Investment by the Parent Company) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Classification of Investment by the Parent Company |
| Primary Involved Party Id | ระบุ Id ของบริษัทที่บริษัทแม่ลงทุน เช่น เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลกับกระทรวงพาณิชย์ เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Unique Id Type | ระบุประเภทของรหัสมาตรฐานของ Primary Involved Party Id  (Classification Name : Unique Id Type) |  |
| Issued and Paid-up Share Capital | มูลค่าหุ้นทุนที่ออกและชำระแล้วของบริษัทที่บริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงินลงทุน หน่วยจะเป็น บาท  โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Descriptive Detail | ระบุรายละเอียดเพิ่มเติมของบริษัทที่บริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงินลงทุน เช่น หุ้นที่ถืออยู่ ณ วันที่รายงานมีการเรียกชำระค่าหุ้นตามมูลค่าเพียงบางส่วน หรือ ระบุวันสิ้นสุดการได้รับอนุญาตให้ถือหุ้นในบริษัทที่อยู่นอกกลุ่มธุรกิจทางการเงินเกินร้อยละ 10 เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Investment Type\* | ประเภทของหุ้นทุนที่ลงทุน  (Classification Name: Investment Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น 168003, 168004 |
| Holding Type\* | ลักษณะการถือหุ้นในบริษัทหนึ่ง ๆ ของบริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: Holding Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Holding Type  และ ถ้า Holding Type มีรหัสเป็น 459002 (Indirect holding) แล้วจะต้องรายงานข้อมูลใน  Related Involved Party Id \*  Related Unique Id Type\*  Relationship with the Parent Company\*  ถ้าไม่ใช่ Data Element ข้างต้นไม่ต้องรายงาน |
| Shareholders Rate\* | สัดส่วนของจำนวนหุ้นสามัญและหุ้นบุริมสิทธิของบริษัทที่บริษัทแม่ลงทุน เทียบกับจำนวนหุ้นสามัญและหุ้นบุริมสิทธิที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของบริษัทนั้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Investment Value\* | มูลค่าของเงินลงทุน โดยให้แสดงมูลค่าด้วยวิธีที่มาตราฐานการบัญชีกำหนดในการจัดทำงบการเงินรวม ทั้งนี้ เงินลงทุนในบริษัทย่อยให้ใช้ Equity Method หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Related Involved Party Id \* | ระบุ Id ของบุคคลหรือนิติบุคคลที่มีความสัมพันธ์กับบริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ที่ซึ่งบริษัทแม่ได้ลงทุนทางอ้อมในบริษัทที่รายงานใน Primary Involved Party Id ผ่านบุคคลหรือนิติบุคคลดังกล่าว  ลักษณะของความสัมพันธ์กับบริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน คือ   1. การเป็นผู้ที่เกี่ยวข้องกับบริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน 2. การเป็นกรรมการ ผู้ถือหุ้นรายใหญ่ และบุคคลที่ทำหน้าที่เยี่ยงกรรมการของบริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน รวมถึงผู้เกี่ยวข้องของบุคคลดังกล่าว   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Related Unique Id Type\* | ระบุประเภทของรหัสมาตรฐานของ Related Involved Party Id  (Classification Name : Unique Id Type) |  |
| Relationship with the Parent Company\* | ระบุความสัมพันธ์ของ Related Involved Party Id กับ บริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน |  |

### Data Set : Interest Rate Risk\_Conso (DS\_IRRC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Interest Rate Risk\_Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับการประเมินความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยในบัญชีเพื่อการธนาคารของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน โดยเป็นการประเมินผลกระทบต่อมูลค่าเศรษฐกิจจากการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยเพิ่มขึ้น 100 Basis Points

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ (เฉพาะบรรษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 56)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทย |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name : FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น  yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Banking Book Position | รายการของฐานะความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยให้ รายงานเฉพาะรายการที่อยู่ในบัญชีเพื่อการธนาคาร  (Classification Name: Banking Book Position) | *-* ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน classification ชื่อ Banking Book Position  *-* ตรวจสอบว่าถ้าเป็นรายการที่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย และ  1. Amount มีค่า > 0 Repricing Term Range ต้องมีค่า หรือ  2. Amount มีค่า = 0 Repricing Term Range ต้องไม่มีค่า  *-* ตรวจสอบว่าถ้าเป็นรายการที่ไม่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย แล้ว Repricing Term Range ต้องไม่มีค่า |
| Repricing Term Range\* | ช่วงเวลาสำหรับรายการที่อ่อนไหวต่อการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ย  ช่วงเวลาของรายการที่มีอัตราดอกเบี้ยคงที่ หมายถึง ช่วงระยะเวลาตามอายุคงเหลือจนถึงวันที่ครบกำหนด  ช่วงเวลาของรายการที่มีอัตราดอกเบี้ยลอยตัว หมายถึง ช่วงระยะเวลาคงเหลือก่อนที่จะปรับอัตราดอกเบี้ยครั้งต่อไป  ช่วงเวลาของรายการที่ไม่มีอัตราดอกเบี้ยกำหนด หมายถึง ช่วงระยะเวลาตามอายุคงเหลือจนถึงวันที่ครบกำหนด | * + ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน classification ชื่อ Interest Rate Risk Term Range   + มีค่าเมื่อ Banking Book Position มีรหัสอยู่ในกลุ่มของรายการที่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า |
| Currency Id\* | รหัสสกุลเงิน  ...เฉพาะฐานะของสกุลเงินบาทและสกุลเงินต่างประเทศรายสกุลที่ สง. พิจารณาแล้วเห็นว่ามีนัยสำคัญให้ใส่รหัสสกุลเงินต่างประเทศ ใน Classification ชื่อ Currency Id  สำหรับฐานะเงินตราต่างประเทศสกุลอื่น ๆ ที่ สง. พิจารณาแล้วเห็นว่าไม่มีนัยสำคัญ ให้รายงานเป็นจำนวนเงินรวม โดยไม่ต้องใส่รหัสสกุลเงิน (Classification Name: Currency Id) | ตรวจสอบรหัสสกุลเงินต่างประเทศว่ามี Code ใน classification ชื่อ Currency Id |
| Amount\* | ยอดคงค้างตามบัญชีของรายการใน Banking Book Position หน่วยจะเป็นบาท  กรณีฐานะสกุลเงินต่างประเทศให้ใช้ยอดคงค้างสกุลเงินตราต่างประเทศคูณด้วยอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่รายงาน รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | *Validation Data Set:*  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ**  ตรวจสอบ สำหรับแต่ละ CL\_FI Reporting Group Id ที่ 116028 และ 116030  Data Set \_IRRC : Amount ที่ CL\_Banking Book Position Code 990002, 990006, 990009, 990014, 990018, 990021, 990044, 990025, 990049, 990026 <= Data Set \_FPSC : Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item Code 950277, 950290, 950366, 950413, 950431, 950438, 950458, 950470, 950481, 950485 ที่รายการเดียวกันตามลำดับ |

\* These are repeating data elements, which may occur several times in a data set record. Please see the XML data set sample to see how these repeating data elements can be prepared

### Data Set : Operational Risk\_Conso (DS\_OPRC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Operational Risk\_Conso เป็นข้อมูลการดำรงฐานเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ ซึ่งมีวิธีการคำนวณ 3 วิธี คือ 1) Basic Indicator Approach (วิธี BIA), 2) Standardized Approach (วิธี SA-OR) และ 3) Alternative Standardized Approach (วิธี ASA)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ (เฉพาะบรรษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย)

**ลักษณะข้อมูล**

ราย 6 เดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้น 6 เดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน ( ยกเว้นข้อมูลงวดแรก (ธ.ค.56) ส่งภายใน มิ.ย. 57 )

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นงวดครึ่งปีตามปีบัญชีของสถาบันการเงินนั้น ๆ |
| Change Method | สถานะการเปลี่ยนแปลงวิธีคำนวณความเสี่ยงด้านปฏิบัติการจากงวดการบัญชีก่อน  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่เปลี่ยนแปลง  ค่า ‘1’ เท่ากับ เปลี่ยนแปลง หรือ รายงานข้อมูลครั้งแรก | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Operational Risk Method | วิธีที่ใช้คำนวณความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ  (Classification Name: Operational Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Operational Risk Method |
| Period Date | วันที่ของงวดการบัญชีที่รายงาน Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | - ถ้า Change Method มี Flag เป็น ‘0’ แล้ว Period Date ต้องเป็นวันเดียวกับ Data Set Date หรือ  - ถ้า Change Method มี Flag เป็น ‘1’ แล้ว Period Date มีรายการอย่างน้อย 1 งวดการบัญชี แต่ไม่เกิน 6 งวดการบัญชี โดย Period Date หนึ่งต้องเท่ากับ Data Set Date ส่วน Period Date ที่เหลือมีค่าเป็นไปได้ คืองวดการบัญชีย้อนหลัง 5 งวดการบัญชี นับจากวันที่ของของชุดข้อมูล |
| Operational Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ  (Classification Name: Operational Risk Item) | - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452001 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451001 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452003 หรือ 452007 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451004, 451005, 451007 ถึง 451012 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452004 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451003 และ 451006 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452005 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451003, 451007 ถึง 451012 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452006 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451004 ถึง 451006 |
| Amount | กรณีเป็นรายได้จากการดำเนินงานให้รายงานด้วยยอดสะสม 6 เดือน (ตามงวดการบัญชี) ก่อนคูณค่าคงที่ ( ß ) และกรณีของเงินให้สินเชื่อรวมดอกเบี้ยค้างรับ และเงินลงทุนในตราสารหนี้และตราสารทุน (ไม่รวมรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ก่อนหักเงินสำรองที่กันไว้ให้รายงานด้วยยอดคงค้าง ณ สิ้นงวดการบัญชีก่อนคูณค่าคงที่ m และค่าคงที่ ß จำนวนเงิน หน่วย จะเป็น บาท รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Partial Comprehensive Income Statement\_Conso (DS\_PCSC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Partial Comprehensive Income Statement\_Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับ รายได้และค่าใช้จ่าย บางรายการของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ของบริษัทแม่และบริษัทลูกของกลุ่มธุรกิจทางการเงินเป็นรายบริษัทที่ถูกนำมาจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่ม Full Consolidation ตามที่กำหนดในประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับแบบรวมกลุ่ม

ทั้งนี้ การรายงานไม่ต้องรายงานข้อมูลของบริษัทที่ถูกนำมาจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่ม Full Consolidation ที่เป็น

* + สถาบันการเงิน (ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ)
  + บริษัทลูกที่เป็นบริษัทบริหารสินทรัพย์ (AMC)
  + บริษัทลูกที่เป็นธนาคารพาณิชย์ในต่างประเทศที่เป็นบริษัทลูกของสถาบันการเงินที่จดทะเบียนในประเทศไทย ที่มีการจัดส่งงบการเงินในรูปแบบ Data Set (DS\_PNL) ให้ ธปท. แล้ว

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส สำหรับข้อมูลไตรมาส 1 และไตรมาส 3, รายครึ่งปี สำหรับข้อมูลไตรมาส 2 และไตรมาส 4

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน อนึ่ง ในกรณีที่ได้มีการแก้ไขงบการเงินของบริษัทที่อยู่ในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ตามคำแนะนำของผู้สอบบัญชี หลังจากที่ได้มีการจัดส่งข้อมูลดังกล่าวให้ ธปท. แล้ว โดยบริษัทดังกล่าวจะต้องรายงานข้อมูลใน Data Set นี้ด้วยนั้น ให้สถาบันการเงินจัดส่งรายงานหลังปรับปรุงมาอีก 1 ชุด ภายใน 21 วัน นับแต่วันที่ผู้สอบบัญชีรับรอง (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 56)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์ จะเป็นรหัส 2 หลัก ให้ใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 หลัก เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31 (Appendix A [Data Set Document] : Data Type)) | วันที่ซึ่งต้องเป็นวันที่สิ้นไตรมาส 1, ครึ่งปีแรก, ไตรมาส 3, ครึ่งปีหลัง ตามปีบัญชีของสถาบันการเงินนั้น ๆ |
| Financial Group | ประเภทของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: Financial Group) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Financial Group  กรณีที่ Financial Group มีรหัสเป็น 457002 (กลุ่มธุรกิจทางการเงินที่บริษัทแม่ไม่ใช่สถาบันการเงิน) แล้ว Status of Company ที่มี Flag เป็น ‘1’ จะต้องมีค่า ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Period Month | รอบระยะเวลาสะสมของข้อมูล แทนค่าด้วยตัวเลข 1 หลัก คือ 3 และ 6  3 ใช้แทนไตรมาส 1 และไตรมาส 3  6 ใช้แทนงวดครึ่งปีแรกและงวดครึ่งปีหลัง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นไตรมาส 1 แล้ว Data Set Period Month = 3  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นงวดครึ่งปีแรก แล้ว Data Set Period Month = 6  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นไตรมาส 3 แล้ว Data Set Period Month = 3  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นงวดครึ่งปีหลัง แล้ว Data Set Period Month = 6 |
| Status of Company | สถานะของบริษัทที่ถูกรายงาน  กรณีเป็นบริษัทแม่ = ‘1’ กรณีเป็นบริษัทลูก = ‘0’  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณีที่ Status of Company มี Flag เป็น ‘0’ แล้ว Classification of Investment by the Parent Company จะต้องมีค่า ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า |
| Classification of Investment by the Parent Company | ประเภทของการลงทุนในบริษัทลูกในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน โดยบริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: Classification of Investment by the Parent Company) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น 458004, 458005 |
| Primary Involved Party Id \* | ระบุ Id ของบริษัทแม่และบริษัทลูกของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่รายงานข้อมูล เช่น เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลกับกระทรวงพาณิชย์ เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Unique Id Type \* | ระบุประเภทของรหัสมาตรฐานของ Primary Involved Party Id  (Classification Name : Unique Id Type) |  |
| Comprehensive Income Item\* | รายการรายได้และค่าใช้จ่ายบางรายการ โดยรายงานเฉพาะรายการย่อยที่สุด  (Classification Name : Profit and Loss Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Profit and Loss Item  ค่าที่เป็นไปได้ คือ   1. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920251 (ข้อ 1. รายได้ดอกเบี้ย) ได้แก่ 920252, 920253, 920257, 920258, 920262 2. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920263 (ข้อ 2. ค่าใช้จ่ายดอกเบี้ย) ได้แก่ 920265, 920269, 920273, 920275 3. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920276 (ข้อ 3. รายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ) ได้แก่ 920278, 920292 ถึง 920295, 920444, 920299 4. ค่าที่มีรหัสเป็น 920300 (ข้อ 4. ค่าใช้จ่ายค่าธรรมเนียมและบริการ) 5. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920304 (ข้อ 5. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากธุรกรรมเพื่อค้าและการปริวรรตเงินตราต่างประเทศ) ได้แก่ 920305, 920311, 920312, 920318, 920321 6. ค่าที่มีรหัสเป็น 920325 (ข้อ 6. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากหนี้สินทางการเงินที่กำหนดให้แสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม) 7. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920328 (ข้อ 7. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน)ได้แก่ 920329, 920343 8. ค่าที่มีรหัสเป็น 920347 (ข้อ 8. ส่วนแบ่งกำไร (ขาดทุน) จากเงินลงทุนตามวิธีส่วนได้เสีย[เฉพาะ Conso.]) 9. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920348 (ข้อ 9. รายได้จากการดำเนินงานอื่น) ได้แก่ 920349 ถึง 920352 10. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920353 (ข้อ 10. ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงานอื่น) ได้แก่ 920354 ถึง 920358 11. ค่าที่มีรหัสเป็น 920365 (ข้อ 11. หนี้สูญ หนี้สงสัยจะสูญ และขาดทุนจากการด้อยค่า) 12. ค่าที่มีรหัสเป็น 920371 (ข้อ 12. กำไร (ขาดทุน)จากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้) 13. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920372 (ข้อ 13. ภาษีเงินได้) ได้แก่ 920373, 920374 14. ค่าที่มีรหัสเป็น 920375 (ข้อ14. กำไร (ขาดทุน) สุทธิ) 15. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920376 (ข้อ 15. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น) ได้แก่ 920377 ถึง 920382 และ 920425, 920426, 920428, 920429 16. ค่าที่มีรหัสเป็น 920385 (ข้อ 16. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม) 17. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920386 (ข้อ 17. การแบ่งปันกำไร (ขาดทุน) สุทธิ [เฉพาะ Conso.])ได้แก่ 920387, 920388 18. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920389 (ข้อ 18. การแบ่งปันกำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม [เฉพาะ Conso.]) 920390, 920391 19. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920392 (ข้อ 19. กำไร (ขาดทุน) ต่อหุ้น 920393, 920394 20. ค่าที่มีรหัสเป็น 920395 (ข้อ 20. จำนวนพนักงาน (คน)) 21. ค่าที่มีรหัสเป็น 920396 (ข้อ 21. จำนวนกรรมการ (คน)) |
| Comprehensive Income  Amount\* | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก และการแสดงค่าลบ ( - ) สำหรับจำนวนเงินที่เป็นค่าลบในรายการที่เป็นได้ทั้งค่าบวกและค่าลบ (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กำไร (ขาดทุน)จากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้ (920371) = ผลต่างสุทธิของรายการรายได้และค่าใช้จ่ายทุกประเภท  กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม (920385) = กำไร (ขาดทุน) สุทธิ (920375) + ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920376 (ข้อ 15. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น) ซึ่งได้แก่ 920377 ถึง 920382 และ 920425, 920426, 920428, 920429 |

\* These are repeating data elements, which may occur several times in a data set record. Please see the XML data set sample to see how these repeating data elements can be prepared.

### Data Set : Provision and Expected Loss\_Conso (DS\_PELC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Provision and Expected Loss\_Conso เป็นข้อมูลแสดงเงินสำรองที่ได้กันไว้ ทั้งที่เป็น General Provision และ Specific Provision สำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 57)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| General Provision Allocation Method | วิธีการจัดสรร General Provision  (Classification Name: General Provision Allocation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ General Provision Allocation Method |
| General Provision SA | เงินสำรองที่เป็น General Provision สำหรับสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี SA  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| General Provision IRB | เงินสำรองที่เป็น General Provision สำหรับสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี IRB  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้ที่ใช้คำนวณหา Specific Provision  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449014 ถึง 449017  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) ,รหัส 446106(ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) และ 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 3. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Specific Provision | เงินสำรองที่เป็น Specific Provision และยอดหนี้ส่วนที่ได้ตัดออกจากบัญชีไปแล้วบางส่วน (Partial write-offs)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Partial Financial Position Statement\_Conso (DS\_PFSC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Partial Financial Position Statement\_Conso เป็นข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการแสดงฐานะทางการเงินบางรายการ ของบริษัทแม่และบริษัทลูกของกลุ่มธุรกิจทางการเงินเป็นรายบริษัทที่ถูกนำมาจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่ม Full Consolidation ตามที่กำหนดในประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับแบบรวมกลุ่ม โดยแสดงรายการด้วยมูลค่าภายหลังที่บริษัทแม่ได้ปรับปรุงตามมาตรฐานการบัญชีกำหนดเพื่อใช้ในการจัดทำงบการเงินรวมแต่ไม่ต้องหักรายการระหว่างกัน

ทั้งนี้ การรายงานไม่ต้องรายงานข้อมูลของบริษัทที่ถูกนำมาจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่ม Full Consolidation ที่เป็น

* + สถาบันการเงิน (ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ)
  + บริษัทลูกที่เป็นบริษัทบริหารสินทรัพย์ (AMC)
  + บริษัทลูกที่เป็นธนาคารพาณิชย์ในต่างประเทศที่เป็นบริษัทลูกของสถาบันการเงินที่จดทะเบียนในประเทศไทย ที่มีการจัดส่งงบการเงินในรูปแบบ Data Set (DS\_BLS) ให้ ธปท. แล้ว

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 56)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูลจะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Financial Group | ประเภทของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: Financial Group) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Financial Group  กรณีที่ Financial Group มีรหัสเป็น 457002 (กลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ บริษัทแม่ไม่ใช่สถาบันการเงิน) แล้ว Status of Company ที่มี Flag เป็น ‘1’ จะต้องมีค่า ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Status of Company | สถานะของบริษัทที่ถูกรายงาน  กรณีเป็นบริษัทแม่ = ‘1’ กรณีเป็นบริษัทลูก = ‘0’  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณีที่ Status of Company มี Flag เป็น ‘0’ แล้ว Classification of Investment by the Parent Company จะต้องมีค่า ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า |
| Classification of Investment by the Parent Company | ประเภทของการลงทุนในบริษัทลูกในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน โดยบริษัทแม่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: Classification of Investment by the Parent Company) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น 458004, 458005 |
| Primary Involved Party Id \* | ระบุ Id ของบริษัทแม่และบริษัทลูกของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่รายงานข้อมูล เช่น เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลกับกระทรวงพาณิชย์ เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Unique Id Type \* | ระบุประเภทของรหัสมาตรฐานของ Primary Involved Party Id  (Classification Name : Unique Id Type) |  |
| Financial Position Summary Item\* | รายการข้อมูลบางรายการของฐานะการเงิน โดยรายงานเฉพาะรายการย่อยที่สุด (Classification Name : Financial Position Summary Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Financial Position Summary Item ค่าที่เป็นไปได้ คือ   1. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 460001 (เงินให้สินเชื่อแก่ลูกหนี้) ได้แก่ 460002 ถึง 460005 , 460007 ถึง 460015 2. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 460016 (เงินลงทุนสุทธิ) ได้แก่ 460017 ถึง 460020 3. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 460021 (ทรัพย์สินรอการขายสุทธิ) ได้แก่ 460022, 460023 4. ค่าที่มีรหัสเป็น 460024 ได้แก่ (สิทธิในการเรียกคืนหลักทรัพย์) 5. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 460025 (ลูกหนี้อื่น (ไม่ได้เกิดจากการให้สินเชื่อ)) ได้แก่ 460026 ถึง 460029 6. ค่าที่มีรหัสเป็น 460030 ได้แก่ (สินทรัพย์รวม) 7. ค่าที่มีรหัสเป็น 460031 ได้แก่ (หนี้สินรวม) 8. ค่าที่มีรหัสเป็น 460032 ได้แก่ (ส่วนของเจ้าของ) 9. ค่าที่มีรหัสเป็น 460033 ได้แก่ (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน (ภาระผูกพันทั้งสิ้น)) |
| Financial Position Amount \* | จำนวนเงินของรายการใน Financial Position Summary Item หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก และการแสดงค่าลบ ( - ) สำหรับจำนวนเงินที่เป็นค่าลบในรายการที่เป็นได้ทั้งค่าบวกและค่าลบ ค่าลบที่แสดงนั้นจะไม่นับอยู่ในจำนวนหลักข้างต้น หากเป็นรายการหักไม่ต้องแสดงค่าลบ ( - )  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | สินทรัพย์รวม (460030) = หนี้สินรวม (460031) + ส่วนของเจ้าของ (460032) |
| Unearned Revenue \* | มูลค่าของรายได้รอการตัดบัญชี หน่วยจะเป็นบาท  โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | รานงานเมื่อ Financial Position Summary Item มีรหัสเป็นรายการภายใต้หัวข้อ460001 (เงินให้สินเชื่อแก่ลูกหนี้) ดังนี้ 460002 ถึง 460005 , 460007 ถึง 460012 ถ้าไม่ใช่ไม่ต้องรายงาน |

\* These are repeating data elements, which may occur several times in a data set record. Please see the XML data set sample to see how these repeating data elements can be prepared.

### Data Set : Provision Summary\_Conso (DS\_PVSC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Provision Summary\_Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับสรุปสินทรัพย์จัดชั้นและการกันเงินสำรองของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

สถาบันการเงินพิเศษของรัฐ (เฉพาะบรรษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 56)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Solo Consolidated Company Id\* | รหัสมาตรฐานของบริษัทลูกในกลุ่ม Solo Consolidation  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116031 (ชุดรายบริษัทใน Solo Consolidated) ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า |
| Solo Consolidated Company Unique Id Type\* | ประเภทของรหัสมาตรฐานของ Solo Consolidated Company Id ที่ใช้ เช่น รหัสสถาบันการเงิน, เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลกับกระทรวงพาณิชย์ เป็นต้น (Classification Name: Unique Id Type) | * มีค่าเมื่อ FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116031 (ชุดรายบริษัทใน Solo Consolidated) ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า * ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น 324003, 324004, 324006 - 324008 , 324010 - 324013 |
| Provision Summary Item\* | รายการของสรุปสินทรัพย์จัดชั้นและเงินสำรอง รายงานเป็นยอดรวมคงค้าง ณ วันสิ้นไตรมาส ตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท.ประกาศกำหนด  (Classification Name: Provision Summary Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Provision Summary Item |
| Asset Classification Type\* | ประเภทของสินทรัพย์จัดชั้น เช่น 020001 = ปกติ, 020002 = กล่าวถึงเป็นพิเศษ, 020003 = ต่ำกว่ามาตรฐาน เป็นต้น  กรณีที่ FI Reporting Group Id ที่มีรหัสเป็น 116028 (ชุด Full Consolidated) ให้รวมข้อมูลของบริษัทที่ไม่ได้จัดชั้นกันสำรองตามเกณฑ์ ธปท. โดยให้จัดตามอายุที่ค้างชำระ  (Classification Name : Asset Classification Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Asset Classification Type |
| Amount\* | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  กรณีรายงานจำนวนเงินของรายการของสรุปสินทรัพย์จัดชั้นและเงินสำรอง สำหรับ FI Reporting Group Id ที่มีรหัสเป็น 116030 (ชุด Solo Consolidated )และ 116028 (ชุด Full Consolidated) จะเป็นข้อมูลของทุกบริษัทที่จัดทำงบการเงินรวมของกลุ่ม หลังหักรายการระหว่างกัน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. สินทรัพย์จัดชั้น สุทธิ = ผลรวมของลูกหนี้จัดชั้นส่วนที่ต้องกันสำรองตามเกณฑ์จัดชั้น, เงินลงทุนในหลักทรัพย์ และสินทรัพย์อื่น  2. สำรองส่วนเกิน (ขาด) = เงินสำรองที่มีอยู่ – เงินสำรองที่ต้องกันทั้งสิ้น  3. เงินสำรองที่ต้องกันทั้งสิ้น = ผลรวมของรายการย่อยของสำรองที่ต้องกัน ทั้งสิ้น  4. เงินสำรองที่มีอยู่ = ผลรวมของรายการย่อยของเงินสำรองที่มีอยู่ทั้งสิ้น |
| Remark | รายชื่อบริษัทลูกในกลุ่ม Full Consolidation ที่ไม่ได้จัดชั้นและกันสำรองตามเกณฑ์ ธปท. กรณีมีมากกว่า 1 บริษัทให้คั่นด้วย “,”  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 (ชุด Full Consolidated)  ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า |

\* These are repeating data elements, which may occur several times in a data set record. Please see the XML data set sample to see how these repeating data elements can be prepared.

### Data Set : Single Lending Limit \_Conso (DS\_SLLC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Single Lending Limit \_Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับการให้สินเชื่อ ลงทุน ก่อภาระผูกพันหรือทำธุรกรรมที่มีลักษณะคล้ายการให้สินเชื่อของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน โดยครอบคลุมทั้งในส่วนของการให้สินเชื่อ ลงทุน ก่อภาระผูกพัน หรือทำธุรกรรมที่มีลักษณะคล้ายการให้สินเชื่อแก่บริษัทนอกกลุ่ม Solo Consolidation และการให้สินเชื่อ ลงทุน ก่อภาระผูกพันหรือทำธุรกรรมที่มีลักษณะคล้ายการให้สินเชื่อแก่ลูกหนี้รายใหญ่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (ลูกหนี้รายใหญ่ หมายถึง ลูกหนี้และบุคคลที่เกี่ยวข้องกับลูกหนี้ ตามนิยาม “ผู้เกี่ยวข้อง” ในมาตรา 4 ของ พรบ. ธุรกิจสถาบันการเงิน พ.ศ. 2551 ซึ่งลูกหนี้หมายรวมถึงที่เป็นบุคคลหนึ่งบุคคลใด หรือแก่บุคคลหลายคนรวมกันในโครงการใดโครงการหนึ่ง หรือเพื่อใช้ในวัตถุประสงค์อย่างเดียวกัน)

สำหรับการรายงานการให้สินเชื่อ ลงทุน ก่อภาระผูกพัน หรือทำธุรกรรมที่มีลักษณะคล้ายการให้สินเชื่อแก่ลูกหนี้รายใหญ่ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ให้รายงานเฉพาะกลุ่มลูกหนี้รายใหญ่ที่มียอดสุทธิเกินกว่าร้อยละ 10 ของเงินกองทุนของกลุ่ม Full Consolidation และกรณีที่กลุ่มลูกหนี้รายใหญ่ที่มียอดสุทธิเกินกว่าร้อยละ 10 ของเงินกองทุนของกลุ่ม Full Consolidation มีน้อยกว่า 10 กลุ่ม ให้รายงานกลุ่มลูกหนี้รายใหญ่ที่มียอดสุทธิสูงสุด 10 อันดับแรก

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 56)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูลจะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Status of Lender | สถานะของผู้ให้สินเชื่อ ลงทุน และก่อภาระผูกพัน หรือทำธุรกรรมที่มีลักษณะคล้ายการให้สินเชื่อ  ถ้าเป็นบริษัทในกลุ่ม Solo Consolidation แล้ว Status of Lender = ‘1’ ถ้าเป็นบริษัทนอกกลุ่ม Solo Consolidation แล้ว Status of Lender = ‘0’  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณีที่ Status of Lender มี Status เป็น ‘1’ แล้ว Status of Borrower มี Status ได้ทั้ง ‘1’ และ ‘0’  กรณีที่ Status of Lender มี Status เป็น ‘0’ แล้ว Status of Borrower มี Status เป็น ‘1’ ได้เท่านั้น |
| Primary Involved Party Id of Lender | ระบุ Id ของบริษัทผู้ให้สินเชื่อ ลงทุน และก่อภาระผูกพัน หรือทำธุรกรรมที่มีลักษณะคล้ายการให้สินเชื่อ เช่น เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลกับกระทรวงพาณิชย์ เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Unique Id Type of Lender | ระบุประเภทของรหัสมาตรฐานของ Primary Involved Party Id of Lender  (Classification Name : Unique Id Type) |  |
| Status of Borrower | สถานะของผู้ได้รับสินเชื่อ ลงทุน และก่อภาระผูกพัน หรือทำธุรกรรมที่มีลักษณะคล้ายการให้สินเชื่อ  ถ้าอยู่ในกลุ่มลูกหนี้รายใหญ่ แล้ว Status of Borrower = ‘1’ ถ้าอยู่ในบริษัทนอกกลุ่ม Solo Consolidation แล้ว Status of Borrower = ‘0’  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Description Name Group | รายชื่อกลุ่มลูกหนี้รายใหญ่  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณีที่ Status of Borrower มี Status เป็น ‘1’ แล้ว ต้องระบุชื่อกลุ่มลูกหนี้รายใหญ่ ของ ผู้ได้รับสินเชื่อ ลงทุน และก่อภาระผูกพัน หรือทำธุรกรรมที่มีลักษณะคล้ายการให้สินเชื่อ (Primary Involved Party Id of Borrower) นั้น ใน Description Name Group ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า |
| Primary Involved Party Id of Borrower\* | ระบุ Id ของผู้ได้รับสินเชื่อ ลงทุน และก่อภาระผูกพัน หรือทำธุรกรรมที่มีลักษณะคล้ายการให้สินเชื่อ เช่น เลขประจำตัวประชาชน เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลกับกระทรวงพาณิชย์ เป็นต้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Unique Id Type of Borrower\* | ระบุประเภทของรหัสมาตรฐานของ Primary Involved Party Id of Borrower (Classification Name : Unique Id Type) |  |
| Lending Outstanding Amount\* | ยอดคงค้างเงินให้สินเชื่อ หรือธุรกรรมที่มีลักษณะคล้ายการให้สินเชื่อ หน่วย จะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Investment Value\* | มูลค่าของเงินลงทุน โดยให้แสดงมูลค่าด้วยวิธีที่มาตราฐานการบัญชีกำหนดในการจัดทำงบการเงินรวม หน่วย จะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Contingent Amount\* | มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของภาระผูกพัน หน่วย จะเป็น บาท  โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Deduct from Lending\* | รายการยอดคงค้างเงินให้สินเชื่อ หรือธุรกรรมที่มีลักษณะคล้ายการให้สินเชื่อที่ได้รับยกเว้นไม่นับในการคำนวณอัตราส่วนการกำกับลูกหนี้รายใหญ่ ทั้งที่กำหนดในประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับลูกหนี้รายใหญ่และหลักเกณฑ์การกำกับแบบรวมกลุ่ม หน่วย จะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Deduct from Investment\* | รายการมูลค่าของเงินลงทุน ที่ได้รับยกเว้นไม่นับในการคำนวณอัตราส่วนการกำกับลูกหนี้รายใหญ่ ทั้งที่กำหนดในประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับลูกหนี้รายใหญ่และหลักเกณฑ์การกำกับแบบรวมกลุ่ม หน่วย จะเป็น บาท  โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Deduct from Contingent \* | รายการมูลค่าเทียบเท่าสินทรพย์ของภาระผูกพัน ที่ได้รับยกเว้นไม่นับในการคำนวณอัตราส่วนการกำกับลูกหนี้รายใหญ่ ทั้งที่กำหนดในประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับลูกหนี้รายใหญ่และหลักเกณฑ์การกำกับแบบรวมกลุ่ม หน่วย จะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

\* These are repeating data elements, which may occur several times in a data set record. Please see the XML data set sample to see how these repeating data elements can be prepared.

### Data Set : Total Trading Book Position\_Conso (DS\_TBPC)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Total Trading Book Position**\_**Conso เป็นข้อมูลสรุปปริมาณธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้าสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน โดยรายงานปริมาณธุรกรรมเฉพาะของบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่นำมาจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (ไม่รวมรายการระหว่างกัน) และแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรมของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า ณ วันสิ้นไตรมาส

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 56)

| **Data Element (Field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Trading Book Position | ประเภทของธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้าแยกตามประเภทของฐานะและยอดรวมของปริมาณธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า  (Classification Name: Trading book Position ) |  |
| Outstanding Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

## Subject Area : FI Consolidation (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

### Data Set : Capital Fund\_Full Conso (DS\_CAPF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Capital Fund\_Full Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับเงินกองทุนของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ตามเกณฑ์ Basel III

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Capital Fund Item | รายการเงินกองทุน  (Classification Name: Capital Fund Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Capital Fund Item |
| Outstanding Amount per Book | ยอดคงค้างตามบัญชีของรายการ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท รูปแบบจะเป็น ตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  2. เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  3. เงินกองทุนทั้งสิ้นตามกฎหมาย (ยอดคงค้างตามบัญชี) = เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี) + เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  4. Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0  **Validation Data Set**  Data Set\_CAPF : Outstanding Amount per Book ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116028 และ  Data Set\_FPSF : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116028 โดยตรวจสอบที่   1. Capital Fund Item Code 940143 >= Balance Sheet Item Code 950404 (ค่าความนิยม) 2. Capital Fund Item Code 940179 +940159 + 940107 = Balance Sheet Item Code 950500 +950501 +950502 (มูลค่าตามบัญชีของหุ้นทุนที่ออกและชำระแล้ว) 3. Capital Fund Item Code 940109 +940161 +940181 = Balance Sheet Item Code 950503 (ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น) 4. Capital Fund Item Code 940122 = Balance Sheet Item Code 950512 (ส่วนเกินจากการตีราคาที่ดิน) 5. Capital Fund Item Code 940123 = Balance Sheet Item Code 950513 (ส่วนเกินทุนจากการตีราคาอาคารและห้องชุดในอาคารชุด) 6. Capital Fund Item Code 940118 = Balance Sheet Item Code 950529 (ทุนสำรองตามกฎหมาย) 7. Capital Fund Item Code 940117 <= Balance Sheet Item Code 950530 (เงินสำรองอื่น ๆ ที่จัดสรรแล้วไม่รวมทุนสำรองตามกฎหมาย) |
| Applicable Capital Fund Amount | ยอดคงค้างของรายการเฉพาะที่สามารถนับเข้าเป็นเงินกองทุนได้ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  2. เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  3. เงินกองทุนทั้งสิ้นตามกฎหมาย (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) + เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  4. Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0  **Validation Data Set *:*** *ที่ไม่ได้ตรวจสอบโดยระบบ*  สำรองสำหรับสินทรัพย์จัดชั้นปกติ (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) <= ร้อยละ 1.25 ของยอดสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่เลือกคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตวิธี SA และของยอดสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี SA ตามประกาศ ธปท. ว่าด้วย “หลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตสำหรับ ธพ. โดยวิธี IRB” สำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ที่เลือกคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตวิธี IRB |
| Net Capital Fund Amount | ยอดคงค้างสุทธิที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนตามกฎหมายได้ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณี Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0 |

### Data Set : Capital Fund\_Solo Conso (DS\_CAPS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Capital Fund\_SoloConso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับเงินกองทุนของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ตามเกณฑ์ Basel III

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 45 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 ม.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Capital Fund Item | รายการเงินกองทุน  (Classification Name: Capital Fund Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Capital Fund Item |
| Outstanding Amount per Book | ยอดคงค้างตามบัญชีของรายการ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท รูปแบบจะเป็น ตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  2. เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  3. เงินกองทุนทั้งสิ้นตามกฎหมาย (ยอดคงค้างตามบัญชี) = เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างตามบัญชี) + เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างตามบัญชี)  4. Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0  **Validation Data Set**  Data Set \_CAPS : Outstanding Amount per Book ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116030 และ  Data Set \_FPSS : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116030 โดยตรวจสอบที่   1. Capital Fund Item Code 940143 >= Balance Sheet Item Code 950404 (ค่าความนิยม) 2. Capital Fund Item Code 940179 +940159 + 940107 = Balance Sheet Item Code 950500 +950501 +950502 (มูค่าตามบัญชีของหุ้นทุนที่ออกและชำระแล้ว) 3. Capital Fund Item Code 940109 +940161 +940181 = Balance Sheet Item Code 950503 (ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น) 4. Capital Fund Item Code 940122 = Balance Sheet Item Code 950512 (ส่วนเกินจากการตีราคาที่ดิน) 5. Capital Fund Item Code 940123 = Balance Sheet Item Code 950513 (ส่วนเกินทุนจากการตีราคาอาคารและห้องชุดในอาคารชุด) 6. Capital Fund Item Code 940118 = Balance Sheet Item Code 950529 (ทุนสำรองตามกฎหมาย) 7. Capital Fund Item Code 940117 <= Balance Sheet Item Code 950530 (เงินสำรองอื่น ๆ ที่จัดสรรแล้วไม่รวมทุนสำรองตามกฎหมาย) |
| Applicable Capital Fund Amount | ยอดคงค้างของรายการเฉพาะที่สามารถนับเข้าเป็นเงินกองทุนได้ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  2. เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของเงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  3. เงินกองทุนทั้งสิ้นตามกฎหมาย (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) = เงินกองทุนชั้นที่ 1 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) + เงินกองทุนชั้นที่ 2 (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้)  4. Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0  **Validation Data Set *:*** *ที่ไม่ได้ตรวจสอบโดยระบบ*  สำรองสำหรับสินทรัพย์จัดชั้นปกติ (ยอดคงค้างที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนได้) <= ร้อยละ 1.25 ของยอดสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่เลือกคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตวิธี SA และของยอดสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี SA ตามประกาศ ธปท. ว่าด้วย “หลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตสำหรับ ธพ. โดยวิธี IRB” สำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ที่เลือกคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตวิธี IRB |
| Net Capital Fund Amount | ยอดคงค้างสุทธิที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนตามกฎหมายได้ จำนวนเงิน หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณี Capital Fund Item Code 940233 ต้องมีค่า เท่ากับ 0 |

### Data Set : Comprehensive Income Statement\_Full Conso (DS\_CISF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Comprehensive Income Statement\_Full Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับ รายได้ค่าใช้จ่าย ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส สำหรับข้อมูลไตรมาส 1 และไตรมาส 3, รายครึ่งปี สำหรับข้อมูลไตรมาส 2 และไตรมาส 4

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน อนึ่ง ในกรณีที่ได้มีการแก้ไขงบการเงินของแต่ละบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินตามคำแนะนำของผู้สอบบัญชี หลังจากที่ได้มีการจัดส่งข้อมูลดังกล่าวให้ ธปท. แล้ว ให้สถาบันการเงินจัดส่งรายงานหลังปรับปรุงมาอีก 1 ชุด ภายใน 21 วัน นับแต่วันที่ผู้สอบบัญชีรับรอง (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์ จะเป็นรหัส 2 หลัก ให้ใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 หลัก เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id  มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31 (Appendix A [Data Set Document] : Data Type)) | วันที่ซึ่งต้องเป็นวันที่สิ้นไตรมาส 1, ครึ่งปีแรก, ไตรมาส 3, ครึ่งปีหลัง ตามปีบัญชีของสถาบันการเงินนั้น ๆ |
| Data Set Period Month | รอบระยะเวลาสะสมของข้อมูล แทนค่าด้วยตัวเลข 1 หลัก คือ 3 และ 6  3 ใช้แทนไตรมาส 1 และไตรมาส 3  6 ใช้แทนงวดครึ่งปีแรกและงวดครึ่งปีหลัง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นไตรมาส 1 แล้ว Data Set Period Month = 3  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นงวดครึ่งปีแรก แล้ว Data Set Period Month = 6  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นไตรมาส 3 แล้ว Data Set Period Month = 3  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นงวดครึ่งปีหลัง แล้ว Data Set Period Month = 6 |
| Profit and Loss Item | รายการของรายได้และค่าใช้จ่าย  (Classification Name: Profit and Loss Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Profit and Loss Item  ค่าที่เป็นไปได้ คือ   1. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920251 (ข้อ 1. รายได้ดอกเบี้ย) ได้แก่ 920430 ถึง 920436, 920254, 920256 ถึง 920257, 920259 ถึง 920262, 920421 ถึง 920422 2. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920263 (ข้อ 2. ค่าใช้จ่ายดอกเบี้ย) ได้แก่ 920264, 920266 ถึง 920268, 920270 ถึง 920275 3. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920276 (ข้อ 3. รายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ) ได้แก่ 920277, 920279 ถึง 920282, 920284 ถึง 920286, 920288 ถึง 920289, 920437 ถึง 920438, 920291 ถึง 920297, 920439 ถึง 920445, 920299 4. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920300 (ข้อ 4. ค่าใช้จ่ายค่าธรรมเนียมและบริการ) ได้แก่ 920301 ถึง 920303 5. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920304 (ข้อ 5. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากธุรกรรมเพื่อค้าและการปริวรรตเงินตราต่างประเทศ) ได้แก่ 920306 ถึง 920311, 920313 ถึง 920317, 920319, 920320, 920322ถึง 920324 6. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920325 (ข้อ 6. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากหนี้สินทางการเงินที่กำหนดให้แสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม) ได้แก่ 920326 ถึง 920327 7. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920328 (ข้อ 7. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน) ได้แก่ 920331 ถึง 920334, 920336 ถึง 920339, 920341, 920342, 920344 ถึง 920346 8. ค่าที่มีรหัสเป็น 920347 (ข้อ 8. ส่วนแบ่งกำไร (ขาดทุน) จากเงินลงทุนตามวิธีส่วนได้เสีย[เฉพาะ Conso.]) 9. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920348 (ข้อ 9. รายได้จากการดำเนินงานอื่น) ได้แก่ 920349 ถึง 920352 10. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920353 (ข้อ 10. ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงานอื่น) ได้แก่ 920354 ถึง 920357, 920359 ถึง 920364 11. ค่าที่มีรหัสเป็น 920365 (ข้อ 11. หนี้สูญ หนี้สงสัยจะสูญ และขาดทุนจากการด้อยค่า) ได้แก่ 920367 ถึง 920370 12. ค่าที่มีรหัสเป็น 920371 (ข้อ 12. กำไร (ขาดทุน)จากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้) 13. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920372 (ข้อ 13. ภาษีเงินได้) ได้แก่ 920373, 920374 14. ค่าที่มีรหัสเป็น 920375 (ข้อ14. กำไร (ขาดทุน) สุทธิ) 15. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920376 (ข้อ 15. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น) ได้แก่ 920377 ถึง 920382 และ 920425 , 920426, 920428 , 920429 16. ค่าที่มีรหัสเป็น 920385 (ข้อ 16. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม) 17. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920386 (ข้อ 17. การแบ่งปันกำไร (ขาดทุน) สุทธิ [เฉพาะ Conso.])ได้แก่ 920387, 920388 18. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920389 (ข้อ 18. การแบ่งปันกำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม [เฉพาะ Conso.]) 920390, 920391 19. ค่าที่มีรหัสเป็น 920395 (ข้อ 20. จำนวนพนักงาน (คน)) 20. ค่าที่มีรหัสเป็น 920396 (ข้อ 21. จำนวนกรรมการ (คน)) |
| Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก และการแสดงค่าลบ ( - ) สำหรับจำนวนเงินที่เป็นค่าลบในรายการที่เป็นได้ทั้งค่าบวกและค่าลบ (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กำไร (ขาดทุน)จากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้ (920371) = ผลต่างสุทธิของรายการรายได้และค่าใช้จ่ายทุกประเภท  กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม (920385) = กำไร (ขาดทุน) สุทธิ (920375) + กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น (920376) ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920376 (ข้อ 15. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น) ซึ่งได้แก่ 920377 ถึง 920382 และ 920425, 920426, 920428, 920429 |

### Data Set : Comprehensive Income Statement\_Solo Conso (DS\_CISS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Comprehensive Income Statement\_Solo Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับ รายได้ค่าใช้จ่าย ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือนสะสม โดยสะสมจนครบ 6 เดือน ตามงวดการบัญชี

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 45 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน อนึ่ง ในกรณีที่ได้มีการแก้ไขงบการเงินของแต่ละบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินตามคำแนะนำของผู้สอบบัญชี หลังจากที่ได้มีการจัดส่งข้อมูลดังกล่าวให้ ธปท. แล้ว ให้สถาบันการเงินจัดส่งรายงานหลังปรับปรุงมาอีก 1 ชุด ภายใน 21 วัน นับแต่วันที่ผู้สอบบัญชีรับรอง (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 ม.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์ จะเป็นรหัส 2 หลัก ให้ใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 หลัก เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31 (Appendix A [Data Set Document] : Data Type)) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือน |
| Data Set Period Month | รอบระยะเวลาสะสมของข้อมูล แทนค่าด้วยตัวเลข 1 หลัก คือ 1 ถึง 6  1 แทนตัวเลข เดือน 1 และเดือน 7  2 แทนตัวเลข เดือน 2 และเดือน 8  3 แทนตัวเลข เดือน 3 และเดือน 9  4 แทนตัวเลข เดือน 4 และเดือน 10  5 แทนตัวเลข เดือน 5 และเดือน 11  6 แทนตัวเลข เดือน 6 และเดือน 12  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นเดือน 1 หรือวันที่สิ้นเดือน 7 แล้ว Data Set Period Month = 1  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นเดือน 2 หรือวันที่สิ้นเดือน 8 แล้ว Data Set Period Month = 2  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นเดือน 3 หรือวันที่สิ้นเดือน 9 แล้ว Data Set Period Month = 3  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นเดือน 4 หรือวันที่สิ้นเดือน 10 แล้ว Data Set Period Month = 4  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นเดือน 5 หรือวันที่สิ้นเดือน 11 แล้ว Data Set Period Month = 5  กรณี Data Set Date เป็น วันที่สิ้นเดือน 6 หรือวันที่สิ้นเดือน 12 แล้ว Data Set Period Month = 6 |
| Profit and Loss Item | รายการของรายได้และค่าใช้จ่าย  (Classification Name: Profit and Loss Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Profit and Loss Item  ค่าที่เป็นไปได้ คือ   1. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920251 (ข้อ 1. รายได้ดอกเบี้ย) ได้แก่ 920430 ถึง 920436, 920254, 920256 ถึง 920257, 920259 ถึง 920262, 920421 ถึง 920422 2. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920263 (ข้อ 2. ค่าใช้จ่ายดอกเบี้ย) ได้แก่ 920264, 920266 ถึง 920268, 920270 ถึง 920275 3. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920276 (ข้อ 3. รายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ) ได้แก่ 920277, 920279 ถึง 920282, 920284 ถึง 920286, 920288 ถึง 920289, 920437 ถึง 920438, 920291 ถึง 920297, 920439 ถึง 920445, 920299 4. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920300 (ข้อ 4. ค่าใช้จ่ายค่าธรรมเนียมและบริการ) ได้แก่ 920301 ถึง 920303 5. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920304 (ข้อ 5. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากธุรกรรมเพื่อค้าและการปริวรรตเงินตราต่างประเทศ) ได้แก่ 920306 ถึง 920311, 920313 ถึง 920317, 920319, 920320, 920322ถึง 920324 6. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920325 (ข้อ 6. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากหนี้สินทางการเงินที่กำหนดให้แสดงด้วยมูลค่ายุติธรรม) ได้แก่ 920326 ถึง 920327 7. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920328 (ข้อ 7. กำไร (ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน) ได้แก่ 920331 ถึง 920334, 920336 ถึง 920339, 920341, 920342, 920344 ถึง 920346 8. ค่าที่มีรหัสเป็น 920347 (ข้อ 8. ส่วนแบ่งกำไร (ขาดทุน) จากเงินลงทุนตามวิธีส่วนได้เสีย[เฉพาะ Conso.]) 9. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920348 (ข้อ 9. รายได้จากการดำเนินงานอื่น) ได้แก่ 920349 ถึง 920352 10. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920353 (ข้อ 10. ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงานอื่น) ได้แก่ 920354 ถึง 920357, 920359 ถึง 920364 11. ค่าที่มีรหัสเป็น 920365 (ข้อ 11. หนี้สูญ หนี้สงสัยจะสูญ และขาดทุนจากการด้อยค่า) ได้แก่ 920367 ถึง 920370 12. ค่าที่มีรหัสเป็น 920371 (ข้อ 12. กำไร (ขาดทุน)จากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้) 13. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920372 (ข้อ 13. ภาษีเงินได้) ได้แก่ 920373, 920374 14. ค่าที่มีรหัสเป็น 920375 (ข้อ14. กำไร (ขาดทุน) สุทธิ) 15. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920376 (ข้อ 15. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น) ได้แก่ 920377 ถึง 920382 และ 920425 , 920426, 920428 , 920429 16. ค่าที่มีรหัสเป็น 920385 (ข้อ 16. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม) 17. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920386 (ข้อ 17. การแบ่งปันกำไร (ขาดทุน) สุทธิ [เฉพาะ Conso.])ได้แก่ 920387, 920388 18. ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920389 (ข้อ 18. การแบ่งปันกำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม [เฉพาะ Conso.]) 920390, 920391 19. ค่าที่มีรหัสเป็น 920395 (ข้อ 20. จำนวนพนักงาน (คน)) 20. ค่าที่มีรหัสเป็น 920396 (ข้อ 21. จำนวนกรรมการ (คน)) |
| Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก และการแสดงค่าลบ ( - ) สำหรับจำนวนเงินที่เป็นค่าลบในรายการที่เป็นได้ทั้งค่าบวกและค่าลบ (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | กำไร (ขาดทุน)จากการดำเนินงานก่อนภาษีเงินได้ (920371) = ผลต่างสุทธิของรายการรายได้และค่าใช้จ่ายทุกประเภท  กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวม (920385) = กำไร (ขาดทุน) สุทธิ (920375) + กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น (920376) ค่าที่เป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 920376 (ข้อ 15. กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่น) ซึ่งได้แก่ 920377 ถึง 920382 และ 920425, 920426, 920428, 920429 |

### Data Set : Contingent Summary\_Full Conso (DS\_COSF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Contingent Summary\_Full Conso เป็นข้อมูลแสดงจำนวนเงินตามสัญญาและมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะทางการเงินของรายการนอกงบแสดงฐานะทางการเงิน ทั้งนี้ให้ใช้ค่าแปลงสภาพ (Credit Conversion Factor) ตามที่กำหนดไว้ในหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III

ตราสารอนุพันธ์ ได้แก่ ตราสารอนุพันธ์ด้านอัตราแลกเปลี่ยน ตราสารอนุพันธ์ด้านอัตราดอกเบี้ย ตราสารอนุพันธ์ด้านตราสารหนี้ ตราสารอนุพันธ์ด้านตราสารทุน ตราสารอนุพันธ์ด้านสินค้าโภคภัณฑ์ และ ตราสารอนุพันธ์ด้านเครดิต

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Customer Group | กลุ่มลูกหนี้ที่คำนวณความเสี่ยงด้านเครดิต  ค่า ‘0’ เท่ากับ Retail  ค่า ‘1’ เท่ากับ Non-retail | กรณีที่ Credit Risk Method มีรหัสเป็น 447001 หรือ 447002 Customer Group ต้องไม่มีค่า |
| Contingent Type | ประเภทภาระผูกพัน ใช้ classification ของภาระผูกพันใน Arrangement Type (ยกเว้นรายการ ภาระผูกพันอื่น ๆ ที่มีค่า CCF = 0.5 Cl\_code 018286)  (Classification Name: Arrangement Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent |
| Exposure Method | วิธีที่ใช้คำนวณ Exposure ของตราสารอนุพันธ์ ให้ใส่รหัสที่มีค่าเท่ากับ  รหัส ‘440001’ สำหรับวิธี Original  รหัส ‘440008’ สำหรับวิธี Current  (Classification Name: Exposure Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type ในส่วนของ Contingent เป็นตราสารอนุพันธ์   และค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 440001 และ 440008 ใน Exposure Type Classification และ   1. ถ้า Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440001 (วิธี Original) แลัว ค่าที่เป็นไปได้ของ Contingent Type คือ ค่าที่มีรหัสเป็นรหัสย่อย ภายใต้รหัส 018081 (อนุพันธ์ด้านอัตราแลกเปลี่ยน) หรือ รหัส 018087 (อนุพันธ์ด้านอัตราดอกเบี้ย )   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Booking Type | ประเภทบัญชีของตราสารอนุพันธ์  (Classification Name: Booking Type) | มีค่าเมื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และ ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Booking Type  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Netting Type | สถานะของการหักกลบลบหนี้ระหว่างกัน (Netting)  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่มี Netting  ค่า ‘1’ เท่ากับ มี Netting | มีค่าเมื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| CCF Rate | ระบุค่า Credit Conversion Factor ตามหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III เช่น  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 5 CCF Rate เท่ากับ 0.05  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 20 CCF Rate เท่ากับ 0.2  (กรณี สง. ที่ใช้วิธี IRB ให้รายงาน CCF ของอนุพันธ์ทางการเงิน = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| RWA Rate | ระบุน้ำหนักความเสี่ยงของรายการใน Arrangement Type เช่น  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 20 RWA Rate เท่ากับ 0.2  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 50 RWA Rate เท่ากับ 0.5  (กรณี สง. ที่ใช้วิธี IRB ให้รายงาน RWA = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Involved Party Type | ประเภทของผู้ทำสัญญา (Involved party)  (Classification Name: Involved Party Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Involved Party Type |
| Arrangement Currency Flag | ประเภทสกุลเงินของสัญญา  ค่า ‘0’ เท่ากับ เงินตราต่างประเทศ  ค่า ‘1’ เท่ากับ เงินบาท | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Notional Principal Amount | ยอดรวมของภาระผูกพันก่อนหัก Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Specific Provision | เงินสำรองส่วนที่นำมาหักก่อนคำนวณสินทรัพย์เสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของรายการนอกงบแสดงฐานะทางการเงิน และ Repo-style transaction  กรณีเป็นตราสารอนุพันธ์ที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current จะเป็นมูลค่าก่อนรวมผลกำไรจากวัดมูลค่ายุติธรรม  วิธี SA หลังหัก Specific Provision  วิธี IRB ก่อนหัก Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Add On or Potential Future Credit Exposure | ผลรวมของมูลค่าความเสี่ยงสุทธิที่คาดว่าจะเกิดขึ้นในอนาคต ของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์ ของคู่สัญญาทุกราย  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | ผลรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์ของคู่สัญญาทุกราย  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Profit from Mark to Market | ผลกำไรทั้งสิ้นจากการวัดมูลค่ายุติธรรม กรณีคำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type อยู่ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และ 2. Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440008 (วิธี current)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Loss from Mark to Market | ผลขาดทุนทั้งสิ้นจากการวัดมูลค่ายุติธรรม กรณีคำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type อยู่ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และ 2. Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440008 (วิธี current)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Net Profit & Loss from Mark to Market | ผลรวมของคู่สัญญาทุกรายที่เกิดจากยอดรวมสุทธิของกำไรและขาดทุน เฉพาะยอดสุทธิที่เป็นบวก จากการวัดมูลค่ายุติธรรมของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่ทำกับคู่สัญญาแต่ละรายที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |

### Data Set : Contingent Summary\_Solo Conso (DS\_COSS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Contingent Summary\_Solo Conso เป็นข้อมูลแสดงจำนวนเงินตามสัญญาและมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะทางการเงินของรายการนอกงบแสดงฐานะทางการเงิน ทั้งนี้ให้ใช้ค่าแปลงสภาพ (Credit Conversion Factor) ตามที่กำหนดไว้ในหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III

ตราสารอนุพันธ์ ได้แก่ ตราสารอนุพันธ์ด้านอัตราแลกเปลี่ยน ตราสารอนุพันธ์ด้านอัตราดอกเบี้ย ตราสารอนุพันธ์ด้านตราสารหนี้ ตราสารอนุพันธ์ด้านตราสารทุน ตราสารอนุพันธ์ด้านสินค้าโภคภัณฑ์ และ ตราสารอนุพันธ์ด้านเครดิต

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 45 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 ม.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Customer Group | กลุ่มลูกหนี้ที่คำนวณความเสี่ยงด้านเครดิต  ค่า ‘0’ เท่ากับ Retail  ค่า ‘1’ เท่ากับ Non-retail | กรณีที่ Credit Risk Method มีรหัสเป็น 447001 หรือ 447002 Customer Group ต้องไม่มีค่า |
| Contingent Type | ประเภทภาระผูกพัน ใช้ classification ของภาระผูกพันใน Arrangement Type (ยกเว้นรายการ ภาระผูกพันอื่น ๆ ที่มีค่า CCF = 0.5 Cl\_code 018286)  (Classification Name: Arrangement Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent |
| Exposure Method | วิธีที่ใช้คำนวณ Exposure ของตราสารอนุพันธ์ ให้ใส่รหัสที่มีค่าเท่ากับ  รหัส ‘440001’ สำหรับวิธี Original  รหัส ‘440008’ สำหรับวิธี Current  (Classification Name: Exposure Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type ในส่วนของ Contingent เป็นตราสารอนุพันธ์   และค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 440001 และ 440008 ใน Exposure Type Classification และ   1. ถ้า Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440001 (วิธี Original) แลัว ค่าที่เป็นไปได้ของ Contingent Type คือ ค่าที่มีรหัสเป็นรหัสย่อย ภายใต้รหัส 018081 (อนุพันธ์ด้านอัตราแลกเปลี่ยน) หรือ รหัส 018087 (อนุพันธ์ด้านอัตราดอกเบี้ย )   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Booking Type | ประเภทบัญชีของตราสารอนุพันธ์  (Classification Name: Booking Type) | มีค่าเมื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และ ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Booking Type  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Netting Type | สถานะของการหักกลบลบหนี้ระหว่างกัน (Netting)  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่มี Netting  ค่า ‘1’ เท่ากับ มี Netting | มีค่าเมื่อ Arrangement Type ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสารอนุพันธ์ และค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| CCF Rate | ระบุค่า Credit Conversion Factor ตามหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III เช่น  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 5 CCF Rate เท่ากับ 0.05  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 20 CCF Rate เท่ากับ 0.2  (กรณี สง. ที่ใช้วิธี IRB ให้รายงาน CCF ของอนุพันธ์ทางการเงิน = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| RWA Rate | ระบุน้ำหนักความเสี่ยงของรายการใน Arrangement Type เช่น  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 20 RWA Rate เท่ากับ 0.2  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 50 RWA Rate เท่ากับ 0.5  (กรณี สง. ที่ใช้วิธี IRB ให้รายงาน RWA = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Involved Party Type | ประเภทของผู้ทำสัญญา (Involved party)  (Classification Name: Involved Party Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Involved Party Type |
| Arrangement Currency Flag | ประเภทสกุลเงินของสัญญา  ค่า ‘0’ เท่ากับ เงินตราต่างประเทศ  ค่า ‘1’ เท่ากับ เงินบาท | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Notional Principal Amount | ยอดรวมของภาระผูกพันก่อนหัก Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Specific Provision | เงินสำรองส่วนที่นำมาหักก่อนคำนวณสินทรัพย์เสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของรายการนอกงบแสดงฐานะทางการเงิน และ Repo-style transaction  กรณีเป็นตราสารอนุพันธ์ที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current จะเป็นมูลค่าก่อนรวมผลกำไรจากวัดมูลค่ายุติธรรม  วิธี SA หลังหัก Specific Provision  วิธี IRB ก่อนหัก Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Add On or Potential Future Credit Exposure | ผลรวมของมูลค่าความเสี่ยงสุทธิที่คาดว่าจะเกิดขึ้นในอนาคต ของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์ ของคู่สัญญาทุกราย  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | ผลรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์ของคู่สัญญาทุกราย  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Profit from Mark to Market | ผลกำไรทั้งสิ้นจากการวัดมูลค่ายุติธรรม กรณีคำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type อยู่ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสาร   อนุพันธ์ และ   1. Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440008 (วิธี current)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Loss from Mark to Market | ผลขาดทุนทั้งสิ้นจากการวัดมูลค่ายุติธรรม กรณีคำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Arrangement Type อยู่ในส่วนของ Contingent ที่เป็นตราสาร   อนุพันธ์ และ   1. Exposure Type มีรหัสเท่ากับ 440008 (วิธี current)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Net Profit & Loss from Mark to Market | ผลรวมของคู่สัญญาทุกรายที่เกิดจากยอดรวมสุทธิของกำไรและขาดทุน เฉพาะยอดสุทธิที่เป็นบวก จากการวัดมูลค่ายุติธรรมของสัญญาอนุพันธ์ทางการเงินทุกสัญญาที่ทำกับคู่สัญญาแต่ละรายที่คำนวณ Exposure ด้วยวิธี Current และสามารถ Netting ได้ตามเกณฑ์  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |

### Data Set : Credit Risk Internal Ratings-Based Approach\_Full Conso (DS\_CRIF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Credit Risk Internal Ratings-Based Approach\_Full Conso เป็นข้อมูลสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณจากข้อมูลสินทรัพย์และรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน ยกเว้น ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน สินทรัพย์อื่น และฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation โดยใช้ข้อมูลจากระบบ Internal Rating ของของกลุ่มธุรกิจทางการเงินเป็นหลักในการคำนวณหาค่าองค์ประกอบความเสี่ยงต่าง ๆ เพื่อนำมาแทนค่าในสูตรการคำนวณหาเงินกองทุนและสินทรัพย์เสี่ยงตามที่ ธปท. กำหนด และ มูลค่าความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น (Expected loss) ของสินทรัพย์แต่ละประเภท สำหรับของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| CRM Method | วิธี CRM หลักประกันทางการเงิน  (Classification Name: Credit Risk Mitigation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Mitigation Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449014 ถึง 449017  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น)และ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 3. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Portfolio Type | ประเภทของ Portfolio  - กรณีที่ Credit Risk Item มี PD Range มากกว่า 1 กลุ่ม และ Credit Risk Item เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุล ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ดังกล่าวแล้วตามด้วยชื่อของประเภท Portfolio ใน Element ของ Portfolio Type ส่วนกรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ที่เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุลของ Credit Risk Typeของรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) นั้น แล้วตามด้วยชื่อของประเภท Portfolio ใน Element ของ Portfolio Type เช่น กรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุล รหัส 446081 (ข้อ4.2 วงเงินหมุนเวียนเพื่อรายย่อย) Portfolio Type จะเป็น446081CreditCard , 446081PersonalCredit เป็นต้น กรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) รหัส 446120 โดยรายการนอกงบดุลดังกล่าวเป็นของวงเงินหมุนเวียนเพื่อรายย่อย (รหัส 446081) และ Credit Risk Type รหัส 449017 Portfolio Type จะเป็น446081CreditCard , 446081PersonalCredit เป็นต้น  - กรณีที่ Credit Risk Item มี PD Range 1 กลุ่ม และ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุล และ ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) ของ Credit Risk Type ที่มีรหัสเป็น449016 (ข้อ 3.ลูกหนี้ธุรกิจเอกชน) และรหัส 449017 (ข้อ4. ลูกหนี้รายย่อย) ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ภายใต้รหัส 446070 (ข้อ 3.ลูกหนี้ธุรกิจเอกชน)และ รหัสย่อยภายใต้รหัส 446079(ข้อ4. ลูกหนี้รายย่อย) ใน Element ของ Portfolio Type เช่น กรณีรายงาน Credit Risk Type รหัส 449016และ Credit Risk Item รหัส 446120 โดยรายการนอกงบดุลดังกล่าวเป็นของสินเชื่อเพื่อสินค้าโภคภัณฑ์ Portfolio Type จะเป็น 446077 เป็นต้น |  |
| Asset Value Correlation | การปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ สำหรับลูกหนี้ที่เข้าข่ายเป็นบริษัทที่ประกอบธุรกิจทางการเงินที่ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ (Asset Value Correlation : AVC)  ‘0’ = ไม่ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์  ‘1’ = ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ |  |
| Double Default Method | วิธีปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  ‘0’ = ไม่ใช้วิธี Double Default  ‘1’ = ใช้วิธี Double Default | ค่าที่เป็นไปได้ สำหรับ Double Default Method ที่มีค่า ‘1’ คือ Credit Risk Item มีรหัสเป็น 446069, 446071, 446072, 446073, 446083, 446120, 446121, 446124, 446125, 446132, 446129, 446161, 446162 และ 446163 |
| Grade | เกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ และในกรณีของรายการที่เป็นรหัสย่อย ของลูกหนี้ธุรกิจเอกชน กลุ่มพิเศษที่ใช้วิธี Supervisory Slotting Criteria ในการคำนวณเงินกองทุน (รหัส446074) ให้แทนค่า Rating ที่ได้เทียบเคียงแล้วสำหรับ ค่า Internal Rating ของสง.กับ Rating ตามที่ธปท.กำหนด ดังนี้  ดีมาก ด้วย เกรด 1  ดีมาก\* ด้วย เกรด 2  ดี ด้วย เกรด 3  ดี\* ด้วย เกรด 4  พอใช้ ด้วย เกรด 5  อ่อน ด้วย เกรด 6  ผิดนัดชำระหนี้ ด้วย เกรด 7  โดยที่ \* คือ เกรดดีมากและดีที่มีน้ำหนักความเสี่ยงเที่เข้าเงื่อนไขตามที่ธปท.กำหนดสำหรับกรณีที่สินเชื่อกลุ่มพิเศษ ให้แสดงทุกเกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ |  |
| Lower Bound | ค่าความน่าจะเป็นต่ำสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Lower Bound ต้องมีค่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ ค่า Upper Bound |
| Upper Bound | ค่าความน่าจะเป็นสูงสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Upper Bound ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ ค่า Lower Bound |
| Estimated PD | ค่าประมาณการของความน่าจะเป็นที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ (PD) ที่กลุ่มธุรกิจทางการเงินใช้เป็นตัวแทนของค่า PD ของแต่ละเกรด |  |
| Notional Principal Amount | ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement (Repo transaction และ Securities borrowing and lending) โดยสำหรับ OTC Derivatives ให้หมายถึง ยอดรวมจำนวนเงินตามสัญญาอนุพันธ์ทางการเงิน  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น    1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)    2. รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction ) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131)   แล้ว Notional Principal Amount ต้องมีค่า   1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) แล้ว Notional Principal Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า รวมทั้งกรณีที่ Double Default Method เป็น ‘1’ |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของมูลค่ารายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน ธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน (Reverse Repo) และลูกหนี้ที่เกิดจากการวางเงินสดเป็นหลักประกันในการยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing) ตามธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending (SBL) ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement และยอดรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินของรายการ OTC Derivatives  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น    1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) และ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)    2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446123 (ข้อ 2.1 อนุพันธ์ทางการเงินนอกตลาด (Over the Counter))    3. รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131)   แล้ว Gross Credit Equivalent Amount ต้องมีค่า   1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ Gross Credit Equivalent Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า รวมทั้งกรณีที่ Double Default Method เป็น ‘1’ |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount ของรายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน เช่น ส่วนที่ตีราคาเพิ่มของที่ดินและอาคาร ดอกผลเช่าซื้อรอการตัดบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าได้เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินและนอกงบแสดงฐานะการเงิน ที่หัก Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนหัก Specific provision และปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต ยกเว้น   1. กรณี Repo-style transaction ที่อยู่ภายใต้ Master netting agreement ให้รายงานด้วยยอดหลักการ netting ซึ่งมีค่าเท่ากับ E\* ตามสูตรที่ ธปท. กำหนด 2. กรณีธุรกิจการให้เช่าแบบลิสซิ่ง (Leasing) ที่มี Residual value risk ให้รายงานด้วยผลรวมของกระแสเงินค่าเช่าที่ผู้เช่าต้องจ่ายให้ ผู้ให้เช่า คิดลดด้วยอัตราดอกเบี้ยที่เหมาะสม   กรณีลูกหนี้ที่รับซื้อมา ให้รายงานด้วยค่า EAD สำหรับ Default risk ก่อนปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต ซึ่งมีค่าเท่ากับมูลค่ายอดหนี้ที่รับซื้อมาหักด้วยเงินกองทุนสำหรับ Dilution risk ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ต้องมีค่า เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Decrease in EAD | EAD ที่ลดลงจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าได้เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Increase in EAD | EAD ที่เพิ่มขึ้นจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Collateral Type | ประเภทหลักประกัน ให้ กลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ใช้วิธี AIRB ระบุประเภทหลักประกัน (กรณีค่าประมาณการ LGD ขึ้นอยู่กับประเภทหลักประกัน) |  |
| LGD Rate | ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ที่พิจารณาจากหลักประกันและการหักกลบหนี้ในงบแสดงฐานะการเงิน เช่น  ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ ร้อยละ 35 LGD Rate เท่ากับ 0.35  ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ ร้อยละ 75 LGD Rate เท่ากับ 0.75  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| EAD after CRM | ยอดรวมของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน และนอกงบแสดงฐานะการเงิน หลังปรับปรุงรายการที่เกี่ยวข้อง แยกตามค่า LGD  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ในแต่ละ Grade ของ Credit Risk Item, Credit Risk Type, Portfolio Type, Asset Value Correlation และ Double Default Method หนึ่งๆ ผลรวมของ EAD after CRM ต้องเท่ากับ Net Credit Equivalent Amount หัก Decrease in EAD บวก Increase in EAD |
| Protection Seller PD | ค่าเฉลี่ย PD ของ Protection seller สำหรับลูกหนี้ในแต่ละเกรด ถ่วงน้ำหนักด้วยยอดรวม EAD ส่วนที่มีการประกันความเสี่ยงด้านเครดิตจาก Protection seller สำหรับค่า PD ของ Protection seller ที่แตกต่างกันแต่ละค่า  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Double Default Method เป็น ‘1’ และไม่มีค่ากรณีที่ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Effective Maturity | ค่าเฉลี่ยของระยะเวลาครบกำหนดของหนี้ (ปี) สำหรับลูกหนี้ในแต่ละเกรด ถ่วงน้ำหนักด้วยยอดรวม EAD สำหรับค่า M ที่แตกต่างกันแต่ละค่า  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ค่า Effective Maturity ต้องมีค่าอยู่ในช่วงตั้งแต่ 0 ถึง 5 |
| Dilution risk | สินทรัพย์เสี่ยงที่เกิดจาก Dilution risk (ความเสี่ยงที่ยอดหนี้ที่ กลุ่มธุรกิจทางการเงิน รับซื้อมาอาจมีมูลค่าลดลงได้ เนื่องจากผู้ขายลูกหนี้มีข้อตกลงกับลูกหนี้) โดยการรายงานให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสถาบันการเงินที่ใช้วิธี IRB  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Residual value risk | สินทรัพย์เสี่ยงที่เกิดจาก Residual value risk (ความเสี่ยงที่เกิดจากความเสียหายจากการที่มูลค่ายุติธรรมของทรัพย์สินลดลงต่ำกว่ามูลค่าซาก ของธุรกรรมการให้เช่าแบบลิสซิ่ง)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้น ซึ่งเท่ากับผลรวมของมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงจาก Default risk, Dilution risk และ Residual value risk หลังคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Expected Loss | มูลค่าของความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Credit Risk Internal Ratings-Based Approach\_Solo Conso (DS\_CRIS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Credit Risk Internal Ratings-Based Approach\_Solo Conso เป็นข้อมูลสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณจากข้อมูลสินทรัพย์และรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน ยกเว้น ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน สินทรัพย์อื่น และฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation โดยใช้ข้อมูลจากระบบ Internal Rating ของของกลุ่มธุรกิจทางการเงินเป็นหลักในการคำนวณหาค่าองค์ประกอบความเสี่ยงต่าง ๆ เพื่อนำมาแทนค่าในสูตรการคำนวณหาเงินกองทุนและสินทรัพย์เสี่ยงตามที่ ธปท. กำหนด และ มูลค่าความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น (Expected loss) ของสินทรัพย์แต่ละประเภท สำหรับของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 45 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 ม.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| CRM Method | วิธี CRM หลักประกันทางการเงิน  (Classification Name: Credit Risk Mitigation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Mitigation Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449014 ถึง 449017  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based   Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น)และ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Portfolio Type | ประเภทของ Portfolio  - กรณีที่ Credit Risk Item มี PD Range มากกว่า 1 กลุ่ม และ Credit Risk Item เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุล ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ดังกล่าวแล้วตามด้วยชื่อของประเภท Portfolio ใน Element ของ Portfolio Type ส่วนกรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ที่เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุลของ Credit Risk Typeของรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) นั้น แล้วตามด้วยชื่อของประเภท Portfolio ใน Element ของ Portfolio Type เช่น กรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการสินทรัพย์ในงบดุล รหัส 446081 (ข้อ4.2 วงเงินหมุนเวียนเพื่อรายย่อย) Portfolio Type จะเป็น446081CreditCard , 446081PersonalCredit เป็นต้น กรณีที่ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุลและธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) รหัส 446120 โดยรายการนอกงบดุลดังกล่าวเป็นของวงเงินหมุนเวียนเพื่อรายย่อย (รหัส 446081) และ Credit Risk Type รหัส 449017 Portfolio Type จะเป็น446081CreditCard , 446081PersonalCredit เป็นต้น  - กรณีที่ Credit Risk Item มี PD Range 1 กลุ่ม และ Credit Risk Item เป็นรายการนอกงบดุล และ ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction) ของ Credit Risk Type ที่มีรหัสเป็น449016 (ข้อ 3.ลูกหนี้ธุรกิจเอกชน) และรหัส 449017 (ข้อ4. ลูกหนี้รายย่อย) ให้ใส่รหัสย่อยของ Credit Risk Item ภายใต้รหัส 446070 (ข้อ 3.ลูกหนี้ธุรกิจเอกชน)และ รหัสย่อยภายใต้รหัส 446079(ข้อ4. ลูกหนี้รายย่อย) ใน Element ของ Portfolio Type เช่น กรณีรายงาน Credit Risk Type รหัส 449016และ Credit Risk Item รหัส 446120 โดยรายการนอกงบดุลดังกล่าวเป็นของสินเชื่อเพื่อสินค้าโภคภัณฑ์ Portfolio Type จะเป็น 446077 เป็นต้น |  |
| Asset Value Correlation | การปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ สำหรับลูกหนี้ที่เข้าข่ายเป็นบริษัทที่ประกอบธุรกิจทางการเงินที่ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ (Asset Value Correlation : AVC)  ‘0’ = ไม่ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์  ‘1’ = ต้องปรับเพิ่มค่าสหสัมพันธ์ |  |
| Double Default Method | วิธีปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  ‘0’ = ไม่ใช้วิธี Double Default  ‘1’ = ใช้วิธี Double Default | ค่าที่เป็นไปได้ สำหรับ Double Default Method ที่มีค่า ‘1’ คือ Credit Risk Item มีรหัสเป็น 446069, 446071, 446072, 446073, 446083, 446120, 446121, 446124, 446125, 446132, 446129, 446161, 446162 และ 446163 |
| Grade | เกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ และในกรณีของรายการที่เป็นรหัสย่อย ของลูกหนี้ธุรกิจเอกชน กลุ่มพิเศษที่ใช้วิธี Supervisory Slotting Criteria ในการคำนวณเงินกองทุน (รหัส446074) ให้แทนค่า Rating ที่ได้เทียบเคียงแล้วสำหรับ ค่า Internal Rating ของสง.กับ Rating ตามที่ธปท.กำหนด ดังนี้  ดีมาก ด้วย เกรด 1  ดีมาก\* ด้วย เกรด 2  ดี ด้วย เกรด 3  ดี\* ด้วย เกรด 4  พอใช้ ด้วย เกรด 5  อ่อน ด้วย เกรด 6  ผิดนัดชำระหนี้ ด้วย เกรด 7  โดยที่ \* คือ เกรดดีมากและดีที่มีน้ำหนักความเสี่ยงที่เข้าเงื่อนไขตามที่ธปท.กำหนดสำหรับกรณีที่สินเชื่อกลุ่มพิเศษ ให้แสดงทุกเกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ |  |
| Lower Bound | ค่าความน่าจะเป็นต่ำสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Lower Bound ต้องมีค่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ ค่า Upper Bound |
| Upper Bound | ค่าความน่าจะเป็นสูงสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Upper Bound ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ ค่า Lower Bound |
| Estimated PD | ค่าประมาณการของความน่าจะเป็นที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ (PD) ที่กลุ่มธุรกิจทางการเงินใช้เป็นตัวแทนของค่า PD ของแต่ละเกรด |  |
| Notional Principal Amount | ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement (Repo transaction และ Securities borrowing and lending) โดยสำหรับ OTC Derivatives ให้หมายถึง ยอดรวมจำนวนเงินตามสัญญาอนุพันธ์ทางการเงิน  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น    1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)    2. รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction ) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131)   แล้ว Notional Principal Amount ต้องมีค่า   1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) แล้ว Notional Principal Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า รวมทั้งกรณีที่ Double Default Method เป็น ‘1’ |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของมูลค่ารายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน ธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน (Reverse Repo) และลูกหนี้ที่เกิดจากการวางเงินสดเป็นหลักประกันในการยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing) ตามธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending (SBL) ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement และยอดรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินของรายการ OTC Derivatives  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น    1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) และ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)    2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446123 (ข้อ 2.1 อนุพันธ์ทางการเงินนอกตลาด (Over the Counter))    3. รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131)   แล้ว Gross Credit Equivalent Amount ต้องมีค่า   1. ถ้า Double Default Method เป็น ‘0’ และ Credit Risk Item มีรหัสเป็น รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ Gross Credit Equivalent Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า รวมทั้งกรณีที่ Double Default Method เป็น ‘1’ |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount ของรายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน เช่น ส่วนที่ตีราคาเพิ่มของที่ดินและอาคาร ดอกผลเช่าซื้อรอการตัดบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าได้เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินและนอกงบแสดงฐานะการเงิน ที่หัก Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนหัก Specific provision และปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต ยกเว้น   1. กรณี Repo-style transaction ที่อยู่ภายใต้ Master netting agreement ให้รายงานด้วยยอดหลักการ netting ซึ่งมีค่าเท่ากับ E\* ตามสูตรที่ ธปท. กำหนด 2. กรณีธุรกิจการให้เช่าแบบลิสซิ่ง (Leasing) ที่มี Residual value risk ให้รายงานด้วยผลรวมของกระแสเงินค่าเช่าที่ผู้เช่าต้องจ่ายให้ ผู้ให้เช่า คิดลดด้วยอัตราดอกเบี้ยที่เหมาะสม   กรณีลูกหนี้ที่รับซื้อมา ให้รายงานด้วยค่า EAD สำหรับ Default risk ก่อนปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต ซึ่งมีค่าเท่ากับมูลค่ายอดหนี้ที่รับซื้อมาหักด้วยเงินกองทุนสำหรับ Dilution risk ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ต้องมีค่า เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Decrease in EAD | EAD ที่ลดลงจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าได้เมื่อ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Increase in EAD | EAD ที่เพิ่มขึ้นจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Collateral Type | ประเภทหลักประกัน ให้ กลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ใช้วิธี AIRB ระบุประเภทหลักประกัน (กรณีค่าประมาณการ LGD ขึ้นอยู่กับประเภทหลักประกัน) |  |
| LGD Rate | ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ที่พิจารณาจากหลักประกันและการหักกลบหนี้ในงบแสดงฐานะการเงิน เช่น  ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ ร้อยละ 35 LGD Rate เท่ากับ 0.35  ค่าความเสียหายที่อาจจะเกิดขึ้นเมื่อลูกหนี้ผิดนัดชำระหนี้ ร้อยละ 75 LGD Rate เท่ากับ 0.75  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| EAD after CRM | ยอดรวมของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน และนอกงบแสดงฐานะการเงิน หลังปรับปรุงรายการที่เกี่ยวข้อง แยกตามค่า LGD  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ในแต่ละ Grade ของ Credit Risk Item, Credit Risk Type, Portfolio Type, Asset Value Correlation และ Double Default Method หนึ่งๆ ผลรวมของ EAD after CRM ต้องเท่ากับ Net Credit Equivalent Amount หัก Decrease in EAD บวก Increase in EAD |
| Protection Seller PD | ค่าเฉลี่ย PD ของ Protection seller สำหรับลูกหนี้ในแต่ละเกรด ถ่วงน้ำหนักด้วยยอดรวม EAD ส่วนที่มีการประกันความเสี่ยงด้านเครดิตจาก Protection seller สำหรับค่า PD ของ Protection seller ที่แตกต่างกันแต่ละค่า  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Double Default Method เป็น ‘1’ และไม่มีค่ากรณีที่ Double Default Method เป็น ‘0’ |
| Effective Maturity | ค่าเฉลี่ยของระยะเวลาครบกำหนดของหนี้ (ปี) สำหรับลูกหนี้ในแต่ละเกรด ถ่วงน้ำหนักด้วยยอดรวม EAD สำหรับค่า M ที่แตกต่างกันแต่ละค่า  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | ค่า Effective Maturity ต้องมีค่าอยู่ในช่วงตั้งแต่ 0 ถึง 5 |
| Dilution risk | สินทรัพย์เสี่ยงที่เกิดจาก Dilution risk (ความเสี่ยงที่ยอดหนี้ที่ กลุ่มธุรกิจทางการเงิน รับซื้อมาอาจมีมูลค่าลดลงได้ เนื่องจากผู้ขายลูกหนี้มีข้อตกลงกับลูกหนี้) โดยการรายงานให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสถาบันการเงินที่ใช้วิธี IRB  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Residual value risk | สินทรัพย์เสี่ยงที่เกิดจาก Residual value risk (ความเสี่ยงที่เกิดจากความเสียหายจากการที่มูลค่ายุติธรรมของทรัพย์สินลดลงต่ำกว่ามูลค่าซาก ของธุรกรรมการให้เช่าแบบลิสซิ่ง)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้น ซึ่งเท่ากับผลรวมของมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงจาก Default risk, Dilution risk และ Residual value risk หลังคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Expected Loss | มูลค่าของความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Credit Risk Standardized Approach\_Full Conso (DS\_CRSF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Credit Risk Standardized Approach\_Full Conso เป็นข้อมูลการคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณจากสินทรัพย์และรายการนอกงบแสดงฐานะการเงินถ่วงน้ำหนักความเสี่ยงตามที่ ธปท.กำหนด ของ

1. วิธี Simplified Standardized Approach (SSA)
2. วิธี Standardized Approach (SA)
3. วิธีInternal Ratings-Based Approach (IRB) สำหรับ
   1. สินทรัพย์เสี่ยงที่ไม่มีนัยสำคัญที่คำนวณด้วยวิธี SA
   2. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุนในกรณีที่มีนัยสำคัญ แต่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB
   3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุนในกรณีที่มีนัยสำคัญ ที่คำนวณโดยวิธี Market based
   4. สินทรัพย์อื่น
   5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| CRM Method | วิธี CRM หลักประกันทางการเงิน  (Classification Name: Credit Risk Mitigation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Mitigation Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449002 ถึง 449012 , 449018, 449019 และ 449020  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446002 (วิธี Standardized Approach (SA) และ Simplified Standardized Approach (SSA)) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน)  * ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA) * ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ   5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้ วิธี SA)  5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based  5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight  5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)  5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น  และรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) กับ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| FTD Adjustment | จำนวนเงินของรายการปรับปรุงสินทรัพย์เสี่ยงของงธุรกรรม First-to-default Credit Derivatives | มีค่าเมื่อ   1. Credit Risk Type มีรหัสเป็น 449012 (ข้อ 11. ผู้ขายประกันความเสี่ยงด้านเครดิตประเภท First-to-default Credit Derivatives และธุรกรรม Securitisation) และ 2. Credit Risk Item มีรหัสเป็น 446063 (ข้อ 11.1 เงินลงทุนในตราสาร First-to-default Credit Linked Note ที่มี Rating)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| CCF Rate | ระบุค่า Credit Conversion Factor ตามหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III เช่น  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 5 CCF Rate เท่ากับ 0.05  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 20 CCF Rate เท่ากับ 0.2  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน)ยกเว้น กรณี Credit Risk Item ที่มีรหัสเป็น 446125 กับ 446128 ของรายการที่ใช้วิธี Current Exposure Method และที่สามารถ Netting กันได้ตามเกณฑ์ 2. รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction ) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ยกเว้น รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ค่า CCF Rate จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| RWA Rate | ระบุน้ำหนักความเสี่ยง เช่น  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 20 RWA Rate เท่ากับ 0.2  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 50 RWA Rate เท่ากับ 0.5  (กรณีอนุพันธ์ทางการเงินที่อยู่ในตลาด Exchange ให้รายงาน RWA = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Notional Principal Amount | ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement (Repo transaction และ Securities borrowing and lending) โดยสำหรับ OTC Derivatives ให้หมายถึง ยอดรวมจำนวนเงินตามสัญญาอนุพันธ์ทางการเงิน  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน 2. รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction ) ภายใต้   Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ยกเว้น รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ Notional Principal Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของมูลค่ารายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน ธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน (Reverse Repo) และลูกหนี้ที่เกิดจากการวางเงินสดเป็นหลักประกันในการยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing) ตามธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending (SBL) ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement และยอดรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินของรายการ OTC Derivatives  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446002 (วิธี Standardized Approach (SA) และ Simplified Standardized Approach (SSA)) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน)    * ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)    * ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ   5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้ วิธี SA)  5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based  5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight  5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)  5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น  และรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) กับ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446123 (ข้อ 2.1 อนุพันธ์ทางการเงินนอกตลาด (Over the Counter)) 2. รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ยกเว้น รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ Gross Credit Equivalent Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Specific Provision | เงินสำรองส่วนที่นำมาหักก่อนคำนวณสินทรัพย์เสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount เช่น ส่วนที่ตีราคาเพิ่มของที่ดินและอาคาร ดอกผลเช่าซื้อรอการตัดบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่หัก Specific Provision และ Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Decrease in CRM | มูลค่าของสินทรัพย์หรือมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ส่วนที่มีการนำ CRM มาปรับลดความเสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Increase in CRM | มูลค่าของสินทรัพย์หรือมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ส่วนที่นำไปปรับลดความเสี่ยงให้แก่ลูกหนี้อื่น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Potential Loss | มูลค่าผลขาดทุนสูงสุดที่คาดว่าจะเกิดขึ้นกับตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี VaR และไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Credit Risk Type มีรหัสเป็น 449018 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) และ 2. Credit Risk Item มีรหัสเป็น รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446097 (ข้อ 5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ) หรือ 446098 (5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้น  กรณีที่ Credit Risk Item มีรหัสเป็นรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446090 (ข้อ 5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based) ค่ามูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้นจะเป็นค่าก่อนคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสง.ที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Credit Risk Standardized Approach\_Solo Conso (DS\_CRSS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Credit Risk Standardized Approach\_Solo Conso เป็นข้อมูลการคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณจากสินทรัพย์และรายการนอกงบแสดงฐานะการเงินถ่วงน้ำหนักความเสี่ยงตามที่ ธปท.กำหนด ของ

1. วิธี Simplified Standardized Approach (SSA)
2. วิธี Standardized Approach (SA)
3. วิธีInternal Ratings-Based Approach (IRB) สำหรับ
   1. สินทรัพย์เสี่ยงที่ไม่มีนัยสำคัญที่คำนวณด้วยวิธี SA
   2. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุนในกรณีที่มีนัยสำคัญ แต่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB
   3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุนในกรณีที่มีนัยสำคัญ ที่คำนวณโดยวิธี Market based
   4. สินทรัพย์อื่น
   5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 45 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 ม.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| CRM Method | วิธี CRM หลักประกันทางการเงิน  (Classification Name: Credit Risk Mitigation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Credit Risk Mitigation Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449002 ถึง 449012 , 449018, 449019 และ 449020  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446002 (วิธี Standardized Approach   (SA) และ Simplified Standardized Approach (SSA))   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based   Approach (IRB)) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน)   * ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA) * ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ   5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้ วิธี SA)  5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based  5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight  5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)  5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น  และรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) กับ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะ   การเงิน)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| FTD Adjustment | จำนวนเงินของรายการปรับปรุงสินทรัพย์เสี่ยงของงธุรกรรม First-to-default Credit Derivatives | มีค่าเมื่อ   1. Credit Risk Type มีรหัสเป็น 449012 (ข้อ 11. ผู้ขายประกันความเสี่ยงด้านเครดิตประเภท First-to-default Credit Derivatives และธุรกรรม Securitisation) และ 2. Credit Risk Item มีรหัสเป็น 446063 (ข้อ 11.1 เงินลงทุนในตราสาร First-to-default Credit Linked Note ที่มี Rating)   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| CCF Rate | ระบุค่า Credit Conversion Factor ตามหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนตาม Basel III เช่น  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 5 CCF Rate เท่ากับ 0.05  ค่า Credit Conversion Factor ร้อยละ 20 CCF Rate เท่ากับ 0.2  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน)   ยกเว้น กรณี Credit Risk Item ที่มีรหัสเป็น 446125 กับ 446128 ของรายการที่ใช้วิธี Current Exposure Method และที่สามารถ Netting กันได้ตามเกณฑ์   1. รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction ) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ยกเว้น รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ค่า CCF Rate จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้   ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| RWA Rate | ระบุน้ำหนักความเสี่ยง เช่น  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 20 RWA Rate เท่ากับ 0.2  น้ำหนักความเสี่ยง ร้อยละ 50 RWA Rate เท่ากับ 0.5  (กรณีอนุพันธ์ทางการเงินที่อยู่ในตลาด Exchange ให้รายงาน RWA = 0)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Notional Principal Amount | ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement (Repo transaction และ Securities borrowing and lending) โดยสำหรับ OTC Derivatives ให้หมายถึง ยอดรวมจำนวนเงินตามสัญญาอนุพันธ์ทางการเงิน  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Credit Risk Item มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานการเงิน 2. รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction ) ภายใต้   Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ยกเว้น รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ Notional Principal Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของมูลค่ารายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน ธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน (Reverse Repo) และลูกหนี้ที่เกิดจากการวางเงินสดเป็นหลักประกันในการยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing) ตามธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending (SBL) ที่ไม่อยู่ภายใต้ Master netting agreement และยอดรวมของมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินของรายการ OTC Derivatives  ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ Credit Risk Item มีรหัสเป็น  1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446002 (วิธี Standardized Approach (SA) และ Simplified Standardized Approach (SSA))  2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน)   * + ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)   + ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ   5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้ วิธี SA)  5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ธปท. มีผลบังคับใช้  5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based  5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight  5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)  5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น  5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ  5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น  และรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446106 (ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) กับ รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะ   การเงิน) เฉพาะในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446123 (ข้อ 2.1 อนุพันธ์ทางการเงินนอกตลาด (Over the Counter))   1. รหัสย่อย 446162 (ข้อ1.2 Reverse Repo transaction)   ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ยกเว้น รหัสย่อย 446161 (ข้อ 1.1 Repo-style transaction) กับ 446163 (ข้อ1.3 Securities borrowing and lending) ภายใต้ Repo-style transaction แบบไม่มี Netting Agreement (รหัส 446131) ที่ Gross Credit Equivalent Amount จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Specific Provision | เงินสำรองส่วนที่นำมาหักก่อนคำนวณสินทรัพย์เสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount เช่น ส่วนที่ตีราคาเพิ่มของที่ดินและอาคาร ดอกผลเช่าซื้อรอการตัดบัญชี  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน มูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ของรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน และ Repo-style transaction ที่หัก Specific Provision และ Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Decrease in CRM | มูลค่าของสินทรัพย์หรือมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ส่วนที่มีการนำ CRM มาปรับลดความเสี่ยง  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Increase in CRM | มูลค่าของสินทรัพย์หรือมูลค่าเทียบเท่าสินทรัพย์ส่วนที่นำไปปรับลดความเสี่ยงให้แก่ลูกหนี้อื่น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Potential Loss | มูลค่าผลขาดทุนสูงสุดที่คาดว่าจะเกิดขึ้นกับตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี VaR และไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ   1. Credit Risk Type มีรหัสเป็น 449018 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตรา   สารทุน) และ   1. Credit Risk Item มีรหัสเป็น รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446097 (ข้อ   5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ) หรือ 446098 (5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น)  ถ้าไม่เป็นไปตามเงื่อนไขต้องไม่มีค่า |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้น  กรณีที่ Credit Risk Item มีรหัสเป็นรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446090 (ข้อ 5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based) ค่ามูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตทั้งสิ้นจะเป็นค่าก่อนคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของสง.ที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Equity Position\_Full Conso (DS\_EQPF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Equity Position\_Full Conso เป็นข้อมูลความเสี่ยงด้านเครดิตและมูลค่าความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น (Expected loss) สำหรับฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD สำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Default Data | ความเพียงพอของข้อมูลที่ใช้ในการประมาณค่า Probability of Default (ค่า PD)  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่เพียงพอ  ค่า ‘1’ เท่ากับ เพียงพอ | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449018  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 446099 (ข้อ 5.2.3 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD)  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Grade | เกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ |  |
| Lower Bound | ค่าความน่าจะเป็นต่ำสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Lower Bound ต้องมีค่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ ค่า Upper Bound |
| Upper Bound | ค่าความน่าจะเป็นสูงสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Upper Bound ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ ค่า Lower Bound |
| Estimated PD | ค่าประมาณการของความน่าจะเป็นที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ (PD) ที่ สง. ใช้เป็นตัวแทนของค่า PD ของแต่ละเกรด |  |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount ของรายการฐานะที่เกี่ยวข้องกับ ตราสารทุน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Specific Provision | เงินสำรองที่เป็น Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ที่หัก Specific Provision และ Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Decrease in EAD | EAD ที่ลดลงจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Increase in EAD | EAD ที่เพิ่มขึ้นจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity exposure with sufficient information | ฐานะของตราสารทุนที่มีข้อมูลเพียงพอในการพิจารณาการผิดนัดชำระหนี้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity exposure without sufficient information | ฐานะของตราสารทุนที่มีข้อมูลไม่เพียงพอในการพิจารณาการผิดนัดชำระหนี้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Scaling Factor | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนที่ต้องใช้ scaling factor 1.5 ในการปรับค่าสินทรัพย์เสี่ยง และได้คูณค่าดังกล่าวแล้ว  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Minimum RW | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนในแต่ละเกรด เฉพาะตราสารทุนที่ต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ (Minimum risk weight)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Maximum RW | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนในแต่ละเกรด เฉพาะตราสารทุนที่ต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นสูง (Maximum risk weight)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของตราสารทุน หลังคูณ Scaling Factor ของการพิจารณาความเพียงพอของข้อมูลที่ใช้ในการประมาณค่า PD ตามคำจำกัดความของการผิดนัดชำระหนี้ แต่หลังคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Expected Loss | มูลค่าของความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Equity Position\_Solo Conso (DS\_EQPS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Equity Position\_Solo Conso เป็นข้อมูลความเสี่ยงด้านเครดิตและมูลค่าความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น (Expected loss) สำหรับฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD สำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 45 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 ม.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Default Data | ความเพียงพอของข้อมูลที่ใช้ในการประมาณค่า Probability of Default (ค่า PD)  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่เพียงพอ  ค่า ‘1’ เท่ากับ เพียงพอ | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449018  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็นรหัสย่อยภายใต้รหัส 446099 (ข้อ 5.2.3 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD)  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Grade | เกรดหรือลำดับชั้นของลูกหนี้ |  |
| Lower Bound | ค่าความน่าจะเป็นต่ำสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Lower Bound ต้องมีค่าน้อยกว่าหรือเท่ากับ ค่า Upper Bound |
| Upper Bound | ค่าความน่าจะเป็นสูงสุดที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ | ค่า Upper Bound ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ ค่า Lower Bound |
| Estimated PD | ค่าประมาณการของความน่าจะเป็นที่ลูกหนี้จะผิดนัดชำระหนี้ (PD) ที่ สง. ใช้เป็นตัวแทนของค่า PD ของแต่ละเกรด |  |
| Gross Credit Equivalent Amount | ยอดรวมของฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ก่อนรายการปรับเพิ่ม/ลด Specific provision และก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Adjustment Item | รายการปรับเพิ่ม / ลดเพื่อคำนวณหา Net Credit Equivalent Amount ของรายการฐานะที่เกี่ยวข้องกับ ตราสารทุน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Specific Provision | เงินสำรองที่เป็น Specific Provision  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Net Credit Equivalent Amount | ยอดสุทธิของฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน ที่หัก Specific Provision และ Adjustment Item แล้ว แต่ก่อนการปรับลดความเสี่ยงด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Decrease in EAD | EAD ที่ลดลงจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Increase in EAD | EAD ที่เพิ่มขึ้นจากการค้ำประกันและอนุพันธ์ด้านเครดิต  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity exposure with sufficient information | ฐานะของตราสารทุนที่มีข้อมูลเพียงพอในการพิจารณาการผิดนัดชำระหนี้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity exposure without sufficient information | ฐานะของตราสารทุนที่มีข้อมูลไม่เพียงพอในการพิจารณาการผิดนัดชำระหนี้  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Scaling Factor | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนที่ต้องใช้ scaling factor 1.5 ในการปรับค่าสินทรัพย์เสี่ยง และได้คูณค่าดังกล่าวแล้ว  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Minimum RW | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนในแต่ละเกรด เฉพาะตราสารทุนที่ต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ (Minimum risk weight)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Equity RWA using Maximum RW | ยอดรวมสินทรัพย์เสี่ยงของตราสารทุนในแต่ละเกรด เฉพาะตราสารทุนที่ต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นสูง (Maximum risk weight)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Risk Weighted Asset Outstanding Amount | มูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของตราสารทุน หลังคูณ Scaling Factor ของการพิจารณาความเพียงพอของข้อมูลที่ใช้ในการประมาณค่า PD ตามคำจำกัดความของการผิดนัดชำระหนี้ แต่หลังคูณ Scaling Factor (ค่าที่ใช้ในการปรับเพิ่มมูลค่าสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ใช้วิธี IRB)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Expected Loss | มูลค่าของความเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้น  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Financial Position Statement\_Full Conso (DS\_FPSF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Financial Position Statement\_Full Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับฐานะการเงิน ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูลจะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Balance Sheet Item | รายการของฐานะการเงินของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: Balance Sheet Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Balance Sheet Item  ค่าที่เป็นไปได้ คือ   1. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950271 (สินทรัพย์) 2. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950430 (หนี้สิน) 3. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950497 (ส่วนของเจ้าของ) ประกอบด้วย    1. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950498 (ข้อ 25.1 ทุนที่ออกและชำระแล้ว)    2. ค่าที่มีรหัสเป็น 950503 (ข้อ 25.2 ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น)    3. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950504 (ข้อ 25.3 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) มูลค่าหุ้น)    4. ค่าที่มีรหัสเป็น 950509 (ข้อ 25.4 ส่วนเกินทุนหุ้นบุริมสิทธิซื้อคืน)    5. ค่าที่มีรหัสเป็น 950510 (ข้อ 25.5 ส่วนเกินทุนหุ้นสามัญซื้อคืน)    6. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950511 (ข้อ 25.6 ส่วนเกินทุนจากการตีราคาสินทรัพย์)    7. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950515 (ข้อ 25.7 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) ทุนจากการเปลี่ยนแปลงมูลค่าเงินลงทุน)    8. ค่าที่มีรหัสเป็น 950522 (ข้อ 25.8 ผลต่างจากการแปลงค่างบการเงิน)    9. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950523 (ข้อ 25.9 องค์ประกอบอื่น ๆ ของส่วนของเจ้าของ )    10. ค่าที่มีรหัสเป็น 950524 (ข้อ 25.10 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) จากการประเมินมูลค่ายุติธรรมตราสารป้องกันความเสี่ยงสำหรับการป้องกันความเสี่ยงในกระแสเงินสด (ส่วนที่มีประสิทธิผล))    11. ค่าที่มีรหัสเป็น 950525 (ข้อ 25.11 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) จากการประเมินมูลค่ายุติธรรมตราสารป้องกันความเสี่ยงสำหรับการป้องกันความเสี่ยงในเงินลงทุนสุทธิในหน่วยงานต่างประเทศ (ส่วนที่มีประสิทธิผล))    12. ค่าที่มีรหัสเป็น 950526 (ข้อ 25.12 ส่วนแบ่งกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จอื่นในบริษัทร่วม [เฉพาะ Conso.])    13. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950527 (ข้อ 25.13 กำไร(ขาดทุน)สะสม)    14. ค่าที่มีรหัสเป็น 950536 (ข้อ 25.14 หัก หุ้นบุริมสิทธิซื้อคืน)    15. ค่าที่มีรหัสเป็น 950537 (ข้อ 25.15 หัก หุ้นสามัญซื้อคืน)    16. ค่าที่มีรหัสเป็น 950538(ข้อ 25.16 ส่วนได้เสียที่ไม่มีอำนาจควบคุม) 4. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950564 (ข้อ 26 หนี้สินที่จะเกิดในภายหน้า) 5. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950570 (ข้อ 27 ตราสารอนุพันธ์) |
| Balance Sheet Amount | จำนวนเงินของรายการใน Balance Sheet Item หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก และการแสดงค่าลบ ( - ) สำหรับจำนวนเงินที่เป็นค่าลบในรายการที่เป็นได้ทั้งค่าบวกและค่าลบ ค่าลบที่แสดงนั้นจะไม่นับอยู่ในจำนวนหลักข้างต้น หากเป็นรายการหักไม่ต้องแสดงค่าลบ ( - )  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | สินทรัพย์ = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการด้านสินทรัพย์  หนี้สิน = ผลรวมของรายการย่อยทุกรายการของหนี้สิน  ส่วนของเจ้าของ = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของส่วนของเจ้าของ  สินทรัพย์ = ผลรวมของรายการหนี้สินและส่วนของเจ้าของ  สิทธิในการเรียกคืนหลักทรัพย์ < = ภาระในการส่งคืนหลักทรัพย์  ภาระของลูกค้าจากการรับรอง = ภาระของสถาบันการเงินจากการรับรอง  *Validation Data Set*  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ**  **- ตรวจสอบระหว่าง Data Set \_FPSF กับ Data Set \_CAPF**  Data Set \_FPSF : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116028 และ  Data Set\_CAPF: Outstanding Amount per Book ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116028  โดยตรวจสอบที่  1. Balance Sheet Item Code 950404 <= Capital Fund Item Code 940143 (ค่าความนิยม)  2. Balance Sheet Item Code 950500 +950501 +950502 = Capital Fund Item Code 940179 +940159 +940107 (มูค่าตามบัญชีของหุ้นทุนที่ออกและชำระแล้ว)  3. Balance Sheet Item Code 950503 = Capital Fund Item Code 940109 +940161 +940181 (ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น)  4. Balance Sheet Item Code 950512 = Capital Fund Item Code 940122 (ส่วนเกินจากการตีราคาที่ดิน)  5. Balance Sheet Item Code 950513 = Capital Fund Item Code 940123 (ส่วนเกินทุนจากการตีราคาอาคารและห้องชุดในอาคารชุด)  6. Balance Sheet Item Code 950529 = Capital Fund Item Code 940118 (ทุนสำรองตามกฎหมาย)  7. Balance Sheet Item Code 950530 >= Capital Fund Item Code 940117 (เงินสำรองอื่น ๆ ที่จัดสรรแล้วไม่รวมทุนสำรองตามกฎหมาย)  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ**  **- ตรวจสอบระหว่าง Data Set\_FPSF กับ Data Set\_IRRF โดย**ตรวจสอบ สำหรับแต่ละ CL\_FI Reporting Group Id ที่ 116028  Data Set \_FPSF : Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item Code 950277, 950290, 950366, 950413, 950431, 950438, 950458, 950470, 950481, 950485 >= Data Set \_IRRF : Amount ที่ CL\_Banking Book Position Code 990002, 990006, 990009, 990014, 990018, 990021, 990044, 990025, 990049, 990026 ตามลำดับ |

### Data Set : Financial Position Statement\_Solo Conso (DS\_FPSS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Financial Position Statement\_Solo Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับฐานะการเงิน ของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 45 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 ม.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูลจะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Balance Sheet Item | รายการของฐานะการเงินของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: Balance Sheet Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Balance Sheet Item  ค่าที่เป็นไปได้ คือ   1. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950271 (สินทรัพย์) 2. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950430 (หนี้สิน) 3. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950497 (ส่วนของเจ้าของ) ประกอบด้วย    1. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950498 (ข้อ 25.1 ทุนที่ออกและชำระแล้ว)    2. ค่าที่มีรหัสเป็น 950503 (ข้อ 25.2 ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น)    3. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950504 (ข้อ 25.3 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) มูลค่าหุ้น)    4. ค่าที่มีรหัสเป็น 950509 (ข้อ 25.4 ส่วนเกินทุนหุ้นบุริมสิทธิซื้อคืน)    5. ค่าที่มีรหัสเป็น 950510 (ข้อ 25.5 ส่วนเกินทุนหุ้นสามัญซื้อคืน)    6. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950511 (ข้อ 25.6 ส่วนเกินทุนจากการตีราคาสินทรัพย์)    7. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950515 (ข้อ 25.7 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) ทุนจากการเปลี่ยนแปลงมูลค่าเงินลงทุน)    8. ค่าที่มีรหัสเป็น 950522 (ข้อ 25.8 ผลต่างจากการแปลงค่างบการเงิน)    9. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950523 (ข้อ 25.9 องค์ประกอบอื่น ๆ ของส่วนของเจ้าของ )    10. ค่าที่มีรหัสเป็น 950524 (ข้อ 25.10 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) จากการประเมินมูลค่ายุติธรรมตราสารป้องกันความเสี่ยงสำหรับการป้องกันความเสี่ยงในกระแสเงินสด (ส่วนที่มีประสิทธิผล))    11. ค่าที่มีรหัสเป็น 950525 (ข้อ 25.11 ส่วนเกิน (ต่ำกว่า) จากการประเมินมูลค่ายุติธรรมตราสารป้องกันความเสี่ยงสำหรับการป้องกันความเสี่ยงในเงินลงทุนสุทธิในหน่วยงานต่างประเทศ (ส่วนที่มีประสิทธิผล))    12. ค่าที่มีรหัสเป็น 950526 (ข้อ 25.12 ส่วนแบ่งกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จอื่นในบริษัทร่วม [เฉพาะ Conso.])    13. ค่าที่มีรหัสย่อยภายใต้รหัส 950527 (ข้อ 25.13 กำไร(ขาดทุน)สะสม)    14. ค่าที่มีรหัสเป็น 950536 (ข้อ 25.14 หัก หุ้นบุริมสิทธิซื้อคืน)    15. ค่าที่มีรหัสเป็น 950537 (ข้อ 25.15 หัก หุ้นสามัญซื้อคืน)    16. ค่าที่มีรหัสเป็น 950538(ข้อ 25.16 ส่วนได้เสียที่ไม่มีอำนาจควบคุม) 4. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950564 (ข้อ 26 หนี้สินที่จะเกิดในภายหน้า) 5. ค่าที่มีรหัสย่อย ภายใต้รหัส 950570 (ข้อ 27 ตราสารอนุพันธ์) |
| Balance Sheet Amount | จำนวนเงินของรายการใน Balance Sheet Item หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก และการแสดงค่าลบ ( - ) สำหรับจำนวนเงินที่เป็นค่าลบในรายการที่เป็นได้ทั้งค่าบวกและค่าลบ ค่าลบที่แสดงนั้นจะไม่นับอยู่ในจำนวนหลักข้างต้น หากเป็นรายการหักไม่ต้องแสดงค่าลบ ( - )  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | สินทรัพย์ = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการด้านสินทรัพย์  หนี้สิน = ผลรวมของรายการย่อยทุกรายการของหนี้สิน  ส่วนของเจ้าของ = ผลรวมสุทธิของรายการย่อยทุกรายการของส่วนของเจ้าของ  สินทรัพย์ = ผลรวมของรายการหนี้สินและส่วนของเจ้าของ  สิทธิในการเรียกคืนหลักทรัพย์ < = ภาระในการส่งคืนหลักทรัพย์  ภาระของลูกค้าจากการรับรอง = ภาระของสถาบันการเงินจากการรับรอง  *Validation Data Set*  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ**  **- ตรวจสอบระหว่าง Data Set\_FPSS กับ Data Set\_CAPS**  Data Set\_FPSS : Balance Sheet Amount ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116030 และ  Data Set \_CAPS: Outstanding Amount per Book ที่ CL\_FI Reporting Group Id 116030  โดยตรวจสอบที่  1. Balance Sheet Item Code 950404 <= Capital Fund Item Code 940143 (ค่าความนิยม)  2. Balance Sheet Item Code 950500 +950501 +950502 = Capital Fund Item Code 940179 +940159 +940107 (มูค่าตามบัญชีของหุ้นทุนที่ออกและชำระแล้ว)  3. Balance Sheet Item Code 950503 = Capital Fund Item Code 940109 +940161 +940181 (ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น)  4. Balance Sheet Item Code 950512 = Capital Fund Item Code 940122 (ส่วนเกินจากการตีราคาที่ดิน)  5. Balance Sheet Item Code 950513 = Capital Fund Item Code 940123 (ส่วนเกินทุนจากการตีราคาอาคารและห้องชุดในอาคารชุด)  6. Balance Sheet Item Code 950529 = Capital Fund Item Code 940118 (ทุนสำรองตามกฎหมาย)  7. Balance Sheet Item Code 950530 >= Capital Fund Item Code 940117 (เงินสำรองอื่น ๆ ที่จัดสรรแล้วไม่รวมทุนสำรองตามกฎหมาย)  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ**  **- ตรวจสอบระหว่าง Data Set\_FPSS กับ Data Set \_IRRS โดย**ตรวจสอบ สำหรับแต่ละ CL\_FI Reporting Group Id ที่ 116030  Data Set\_FPSS : Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item Code 950277, 950290, 950366, 950413, 950431, 950438, 950458, 950470, 950481, 950485 >= Data Set \_IRRS : Amount ที่ CL\_Banking Book Position Code 990002, 990006, 990009, 990014, 990018, 990021, 990044, 990025, 990049, 990026 ตามลำดับ |

### Data Set : Investment by the Parent Company\_Conso (DS\_IPCC)

ใช้ชุดข้อมูล [**43. Data Set : Investment by the Parent Company\_Conso**](#_Data_Set_)

### Data Set : Interest Rate Risk\_Full Conso (DS\_IRRF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Interest Rate Risk\_Full Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับการประเมินความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยในบัญชีเพื่อการธนาคารของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน โดยเป็นการประเมินผลกระทบต่อมูลค่าเศรษฐกิจจากการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยเพิ่มขึ้น 100 Basis Points

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทย |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name : FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น  yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Banking Book Position | รายการของฐานะความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยให้ รายงานเฉพาะรายการที่อยู่ในบัญชีเพื่อการธนาคาร  (Classification Name: Banking Book Position) | *-* ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน classification ชื่อ Banking Book Position  *-* ตรวจสอบว่าถ้าเป็นรายการที่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย และ  1. Amount มีค่า > 0 Repricing Term Range ต้องมีค่า หรือ  2. Amount มีค่า = 0 Repricing Term Range ต้องไม่มีค่า  *-* ตรวจสอบว่าถ้าเป็นรายการที่ไม่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย แล้ว Repricing Term Range ต้องไม่มีค่า |
| Repricing Term Range\* | ช่วงเวลาสำหรับรายการที่อ่อนไหวต่อการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ย  ช่วงเวลาของรายการที่มีอัตราดอกเบี้ยคงที่ หมายถึง ช่วงระยะเวลาตามอายุคงเหลือจนถึงวันที่ครบกำหนด  ช่วงเวลาของรายการที่มีอัตราดอกเบี้ยลอยตัว หมายถึง ช่วงระยะเวลาคงเหลือก่อนที่จะปรับอัตราดอกเบี้ยครั้งต่อไป  ช่วงเวลาของรายการที่ไม่มีอัตราดอกเบี้ยกำหนด หมายถึง ช่วงระยะเวลาตามอายุคงเหลือจนถึงวันที่ครบกำหนด | * + ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน classification ชื่อ Interest Rate Risk Term Range   + มีค่าเมื่อ Banking Book Position มีรหัสอยู่ในกลุ่มของรายการที่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า |
| Currency Id\* | รหัสสกุลเงิน  ...เฉพาะฐานะของสกุลเงินบาทและสกุลเงินต่างประเทศรายสกุลที่ สง. พิจารณาแล้วเห็นว่ามีนัยสำคัญให้ใส่รหัสสกุลเงินต่างประเทศ ใน Classification ชื่อ Currency Id  สำหรับฐานะเงินตราต่างประเทศสกุลอื่น ๆ ที่ สง. พิจารณาแล้วเห็นว่าไม่มีนัยสำคัญ ให้รายงานเป็นจำนวนเงินรวม โดยไม่ต้องใส่รหัสสกุลเงิน (Classification Name: Currency Id) | ตรวจสอบรหัสสกุลเงินต่างประเทศว่ามี Code ใน classification ชื่อ Currency Id |
| Amount\* | ยอดคงค้างตามบัญชีของรายการใน Banking Book Position หน่วยจะเป็นบาท  กรณีฐานะสกุลเงินต่างประเทศให้ใช้ยอดคงค้างสกุลเงินตราต่างประเทศคูณด้วยอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่รายงาน รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | *Validation Data Set:*  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ**  ตรวจสอบ สำหรับแต่ละ CL\_FI Reporting Group Id ที่ 116028  Data Set \_IRRF : Amount ที่ CL\_Banking Book Position Code 990002, 990006, 990009, 990014, 990018, 990021, 990044, 990025, 990049, 990026 <= Data Set \_FPSF : Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item Code 950277, 950290, 950366, 950413, 950431, 950438, 950458, 950470, 950481, 950485 ที่รายการเดียวกันตามลำดับ |

\* These are repeating data elements, which may occur several times in a data set record. Please see the XML data set sample to see how these repeating data elements can be prepared

### Data Set : Interest Rate Risk\_Solo Conso (DS\_IRRS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Interest Rate Risk\_Solo Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับการประเมินความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยในบัญชีเพื่อการธนาคารของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน โดยเป็นการประเมินผลกระทบต่อมูลค่าเศรษฐกิจจากการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยเพิ่มขึ้น 100 Basis Points

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลักและใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทย |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name : FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น  yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Banking Book Position | รายการของฐานะความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยให้ รายงานเฉพาะรายการที่อยู่ในบัญชีเพื่อการธนาคาร  (Classification Name: Banking Book Position) | *-* ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน classification ชื่อ Banking Book Position  *-* ตรวจสอบว่าถ้าเป็นรายการที่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย และ  1. Amount มีค่า > 0 Repricing Term Range ต้องมีค่า หรือ  2. Amount มีค่า = 0 Repricing Term Range ต้องไม่มีค่า  *-* ตรวจสอบว่าถ้าเป็นรายการที่ไม่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย แล้ว Repricing Term Range ต้องไม่มีค่า |
| Repricing Term Range\* | ช่วงเวลาสำหรับรายการที่อ่อนไหวต่อการเปลี่ยนแปลงของอัตราดอกเบี้ย  ช่วงเวลาของรายการที่มีอัตราดอกเบี้ยคงที่ หมายถึง ช่วงระยะเวลาตามอายุคงเหลือจนถึงวันที่ครบกำหนด  ช่วงเวลาของรายการที่มีอัตราดอกเบี้ยลอยตัว หมายถึง ช่วงระยะเวลาคงเหลือก่อนที่จะปรับอัตราดอกเบี้ยครั้งต่อไป  ช่วงเวลาของรายการที่ไม่มีอัตราดอกเบี้ยกำหนด หมายถึง ช่วงระยะเวลาตามอายุคงเหลือจนถึงวันที่ครบกำหนด | * + ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน classification ชื่อ Interest Rate Risk Term Range   + มีค่าเมื่อ Banking Book Position มีรหัสอยู่ในกลุ่มของรายการที่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า |
| Currency Id\* | รหัสสกุลเงิน  ...เฉพาะฐานะของสกุลเงินบาทและสกุลเงินต่างประเทศรายสกุลที่ สง. พิจารณาแล้วเห็นว่ามีนัยสำคัญให้ใส่รหัสสกุลเงินต่างประเทศ ใน Classification ชื่อ Currency Id  สำหรับฐานะเงินตราต่างประเทศสกุลอื่น ๆ ที่ สง. พิจารณาแล้วเห็นว่าไม่มีนัยสำคัญ ให้รายงานเป็นจำนวนเงินรวม โดยไม่ต้องใส่รหัสสกุลเงิน (Classification Name: Currency Id) | ตรวจสอบรหัสสกุลเงินต่างประเทศว่ามี Code ใน classification ชื่อ Currency Id |
| Amount\* | ยอดคงค้างตามบัญชีของรายการใน Banking Book Position หน่วยจะเป็นบาท  กรณีฐานะสกุลเงินต่างประเทศให้ใช้ยอดคงค้างสกุลเงินตราต่างประเทศคูณด้วยอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่รายงาน รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | *Validation Data Set:*  **กรณีธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ**  ตรวจสอบ สำหรับแต่ละ CL\_FI Reporting Group Id ที่ 116030  Data Set \_IRRS : Amount ที่ CL\_Banking Book Position Code 990002, 990006, 990009, 990014, 990018, 990021, 990044, 990025, 990049, 990026 <= Data Set \_FPSS : Balance Sheet Amount ที่ CL\_Balance Sheet Item Code 950277, 950290, 950366, 950413, 950431, 950438, 950458, 950470, 950481, 950485 ที่รายการเดียวกันตามลำดับ |

\* These are repeating data elements, which may occur several times in a data set record. Please see the XML data set sample to see how these repeating data elements can be prepared

### Data Set : Operational Risk\_Full Conso (DS\_OPRF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Operational Risk\_Full Conso เป็นข้อมูลการดำรงฐานเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ ซึ่งมีวิธีการคำนวณ 3 วิธี คือ 1) Basic Indicator Approach (วิธี BIA) , 2) Standardized Approach (วิธี SA-OR) และ 3) Alternative Standardized Approach (วิธี ASA)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

ราย 6 เดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้น 6 เดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นงวดที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 30 มิ.ย. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นงวดครึ่งปีตามปีบัญชีของสถาบันการเงินนั้น ๆ |
| Change Method | สถานะการเปลี่ยนแปลงวิธีคำนวณความเสี่ยงด้านปฏิบัติการจากงวดการบัญชีก่อน  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่เปลี่ยนแปลง  ค่า ‘1’ เท่ากับ เปลี่ยนแปลง หรือ รายงานข้อมูลครั้งแรก | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Operational Risk Method | วิธีที่ใช้คำนวณความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ  (Classification Name: Operational Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Operational Risk Method |
| Period Date | วันที่ของงวดการบัญชีที่รายงาน Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | - ถ้า Change Method มี Flag เป็น ‘0’ แล้ว Period Date ต้องเป็นวันเดียวกับ Data Set Date หรือ  - ถ้า Change Method มี Flag เป็น ‘1’ แล้ว Period Date มีรายการอย่างน้อย 1 งวดการบัญชี แต่ไม่เกิน 6 งวดการบัญชี โดย Period Date หนึ่งต้องเท่ากับ Data Set Date ส่วน Period Date ที่เหลือมีค่าเป็นไปได้ คืองวดการบัญชีย้อนหลัง 5 งวดการบัญชี นับจากวันที่ของของชุดข้อมูล |
| Operational Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ  (Classification Name: Operational Risk Item) | - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452001 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451001 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452003 หรือ 452007 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451004, 451005, 451007 ถึง 451012 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452004 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451003 และ 451006 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452005 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451003, 451007 ถึง 451012 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452006 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451004 ถึง 451006 |
| Amount | กรณีเป็นรายได้จากการดำเนินงานให้รายงานด้วยยอดสะสม 6 เดือน (ตามงวดการบัญชี) ก่อนคูณค่าคงที่ ( ß ) และกรณีของเงินให้สินเชื่อรวมดอกเบี้ยค้างรับ และเงินลงทุนในตราสารหนี้และตราสารทุน (ไม่รวมรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ก่อนหักเงินสำรองที่กันไว้ให้รายงานด้วยยอดคงค้าง ณ สิ้นงวดการบัญชีก่อนคูณค่าคงที่ m และค่าคงที่ ß จำนวนเงิน หน่วย จะเป็น บาท รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Operational Risk\_Solo Conso (DS\_OPRS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Operational Risk\_Solo Conso เป็นข้อมูลการดำรงฐานเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ ซึ่งมีวิธีการคำนวณ 3 วิธี คือ 1) Basic Indicator Approach (วิธี BIA) , 2) Standardized Approach (วิธี SA-OR) และ 3) Alternative Standardized Approach (วิธี ASA)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

ราย 6 เดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้น 6 เดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 45 วันนับจากวันสิ้นงวดที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 30 มิ.ย. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นงวดครึ่งปีตามปีบัญชีของสถาบันการเงินนั้น ๆ |
| Change Method | สถานะการเปลี่ยนแปลงวิธีคำนวณความเสี่ยงด้านปฏิบัติการจากงวดการบัญชีก่อน  ค่า ‘0’ เท่ากับ ไม่เปลี่ยนแปลง  ค่า ‘1’ เท่ากับ เปลี่ยนแปลง หรือ รายงานข้อมูลครั้งแรก | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ‘0’ กับ ‘1’ |
| Operational Risk Method | วิธีที่ใช้คำนวณความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ  (Classification Name: Operational Risk Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Operational Risk Method |
| Period Date | วันที่ของงวดการบัญชีที่รายงาน Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 ธันวาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-12-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | - ถ้า Change Method มี Flag เป็น ‘0’ แล้ว Period Date ต้องเป็นวันเดียวกับ Data Set Date หรือ  - ถ้า Change Method มี Flag เป็น ‘1’ แล้ว Period Date มีรายการอย่างน้อย 1 งวดการบัญชี แต่ไม่เกิน 6 งวดการบัญชี โดย Period Date หนึ่งต้องเท่ากับ Data Set Date ส่วน Period Date ที่เหลือมีค่าเป็นไปได้ คืองวดการบัญชีย้อนหลัง 5 งวดการบัญชี นับจากวันที่ของของชุดข้อมูล |
| Operational Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ  (Classification Name: Operational Risk Item) | - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452001 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451001 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452003 หรือ 452007 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451004, 451005, 451007 ถึง 451012 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452004 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451003 และ 451006 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452005 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451003, 451007 ถึง 451012 หรือ  - ถ้า Operational Risk Method มีรหัสเท่ากับ 452006 แล้ว ค่าที่เป็นไปได้ของ Operational Risk Item คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 451004 ถึง 451006 |
| Amount | กรณีเป็นรายได้จากการดำเนินงานให้รายงานด้วยยอดสะสม 6 เดือน (ตามงวดการบัญชี) ก่อนคูณค่าคงที่ ( ß ) และกรณีของเงินให้สินเชื่อรวมดอกเบี้ยค้างรับ และเงินลงทุนในตราสารหนี้และตราสารทุน (ไม่รวมรายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ก่อนหักเงินสำรองที่กันไว้ให้รายงานด้วยยอดคงค้าง ณ สิ้นงวดการบัญชีก่อนคูณค่าคงที่ m และค่าคงที่ ß จำนวนเงิน หน่วย จะเป็น บาท รูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก   (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Partial Comprehensive Income Statement\_Conso (DS\_PCSC)

ใช้ชุดข้อมูล [**46. Data Set : Partial Comprehensive Income Statement\_Conso (DS\_PCSC)**](#_Data_Set__1)

### Data Set : Provision and Expected Loss\_Full Conso (DS\_PELF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Provision and Expected Loss\_Full Conso เป็นข้อมูลแสดงเงินสำรองที่ได้กันไว้ ทั้งที่เป็น General Provision และ Specific Provision สำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| General Provision Allocation Method | วิธีการจัดสรร General Provision  (Classification Name: General Provision Allocation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ General Provision Allocation Method |
| General Provision SA | เงินสำรองที่เป็น General Provision สำหรับสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี SA  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| General Provision IRB | เงินสำรองที่เป็น General Provision สำหรับสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี IRB  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้ที่ใช้คำนวณหา Specific Provision  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449014 ถึง 449017  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based   Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) ,รหัส 446106(ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) และ 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Specific Provision | เงินสำรองที่เป็น Specific Provision และยอดหนี้ส่วนที่ได้ตัดออกจากบัญชีไปแล้วบางส่วน (Partial write-offs)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Provision and Expected Loss\_Solo Conso (DS\_PELS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Provision and Expected Loss\_Solo Conso เป็นข้อมูลแสดงเงินสำรองที่ได้กันไว้ ทั้งที่เป็น General Provision และ Specific Provision สำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่คำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำ ตามหลักเกณฑ์ Basel III วิธี IRB

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 45 วันนับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 ม.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| General Provision Allocation Method | วิธีการจัดสรร General Provision  (Classification Name: General Provision Allocation Method) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ General Provision Allocation Method |
| General Provision SA | เงินสำรองที่เป็น General Provision สำหรับสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี SA  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| General Provision IRB | เงินสำรองที่เป็น General Provision สำหรับสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตที่คำนวณโดยวิธี IRB  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |
| Credit Risk Method | วิธีที่ใช้ในการคำนวณเงินกองทุนขั้นต่ำสำหรับความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Method) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 447003 และ 447004  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Method |
| Credit Risk Type | ประเภทของกลุ่มลูกหนี้ที่ใช้คำนวณหา Specific Provision  (Classification Name: Credit Risk Type) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเท่ากับ 449014 ถึง 449017  ใน Classification ชื่อ Credit Risk Type |
| Credit Risk Item | รายการความเสี่ยงด้านเครดิต  (Classification Name: Credit Risk Item) | ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446067 (วิธี Internal Ratings-Based   Approach (IRB)) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446084 (ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน) ,รหัส 446106(ข้อ 6. สินทรัพย์อื่น) และ 446142 (ข้อ 7. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation)   1. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446118 (รายการนอกงบแสดงฐานะการเงิน) ยกเว้น ในส่วนของรหัสย่อย ภายใต้รหัส 446149 (ข้อ 3. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Securitisation) 2. รหัสย่อย ภายใต้รหัส 446130 (ธุรกรรมตลาดซื้อคืน (Repo-style transaction))   ใน Classification ชื่อ Credit Risk Item |
| Specific Provision | เงินสำรองที่เป็น Specific Provision และยอดหนี้ส่วนที่ได้ตัดออกจากบัญชีไปแล้วบางส่วน (Partial write-offs)  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Partial Financial Position Statement\_Conso (DS\_PFSC)

ใช้ชุดข้อมูล [**48. Data Set : Partial Financial Position Statement\_Conso (DS\_PFSC)**](#_Data_Set__2)

### Data Set : Provision Summary\_Full Conso (DS\_PVSF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Provision Summary\_FullConso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับสรุปสินทรัพย์จัดชั้นและการกันเงินสำรองของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Provision Summary Item | รายการของสรุปสินทรัพย์จัดชั้นและเงินสำรอง รายงานเป็นยอดรวมคงค้าง ณ วันสิ้นไตรมาส ตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท.ประกาศกำหนด  (Classification Name: Provision Summary Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Provision Summary Item |
| Asset Classification Type | ประเภทของสินทรัพย์จัดชั้น เช่น 020001 = ปกติ, 020002 = กล่าวถึงเป็นพิเศษ, 020003 = ต่ำกว่ามาตรฐาน เป็นต้น  กรณีที่ FI Reporting Group Id ที่มีรหัสเป็น 116028 (ชุด Full Consolidated) ให้รวมข้อมูลของบริษัทที่ไม่ได้จัดชั้นกันสำรองตามเกณฑ์ ธปท. โดยให้จัดตามอายุที่ค้างชำระ  (Classification Name : Asset Classification Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Asset Classification Type |
| Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  กรณีรายงานจำนวนเงินของรายการของสรุปสินทรัพย์จัดชั้นและเงินสำรอง สำหรับ FI Reporting Group Id ที่มีรหัสเป็น 116028 (ชุด Full Consolidated) จะเป็นข้อมูลของทุกบริษัทที่จัดทำงบการเงินรวมของกลุ่ม หลังหักรายการระหว่างกัน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. สินทรัพย์จัดชั้น สุทธิ = ผลรวมของลูกหนี้จัดชั้นส่วนที่ต้องกันสำรองตามเกณฑ์จัดชั้น, เงินลงทุนในหลักทรัพย์ และสินทรัพย์อื่น  2. สำรองส่วนเกิน (ขาด) = เงินสำรองที่มีอยู่ – เงินสำรองที่ต้องกันทั้งสิ้น  3. เงินสำรองที่ต้องกันทั้งสิ้น = ผลรวมของรายการย่อยของสำรองที่ต้องกัน ทั้งสิ้น  4. เงินสำรองที่มีอยู่ = ผลรวมของรายการย่อยของเงินสำรองที่มีอยู่ทั้งสิ้น |
| Remark | รายชื่อบริษัทลูกในกลุ่ม Full Consolidation ที่ไม่ได้จัดชั้นและกันสำรองตามเกณฑ์ ธปท. กรณีมีมากกว่า 1 บริษัทให้คั่นด้วย “,”  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116028 (ชุด Full Consolidated) |

### Data Set : Provision Summary\_Solo Conso (DS\_PVSS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Provision Summary\_Solo Conso เป็นข้อมูลเกี่ยวกับสรุปสินทรัพย์จัดชั้นและการกันเงินสำรองของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (โดยให้รายงานด้วยยอดคงค้างสุทธิหลังจากหักรายได้รอตัดบัญชีแล้ว)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 45 วันนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 , 116030 และ 116031 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงานคือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Solo Consolidated Company Id\* | รหัสมาตรฐานของบริษัทลูกในกลุ่ม Solo Consolidation  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | มีค่าเมื่อ FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116031 (ชุดรายบริษัทใน Solo Consolidated) ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า |
| Solo Consolidated Company Unique Id Type\* | ประเภทของรหัสมาตรฐานของ Solo Consolidated Company Id ที่ใช้ เช่น รหัสสถาบันการเงิน, เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคลกับกระทรวงพาณิชย์ เป็นต้น (Classification Name: Unique Id Type) | * มีค่าเมื่อ FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116031 (ชุดรายบริษัทใน Solo Consolidated) ถ้าไม่ใช่ต้องไม่มีค่า * ค่าที่เป็นไปได้ คือ ค่าที่มีรหัสเป็น 324003, 324004, 324006 - 324008 , 324010 - 324013 |
| Provision Summary Item\* | รายการของสรุปสินทรัพย์จัดชั้นและเงินสำรอง รายงานเป็นยอดรวมคงค้าง ณ วันสิ้นไตรมาส ตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท.ประกาศกำหนด  (Classification Name: Provision Summary Item) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Provision Summary Item |
| Asset Classification Type\* | ประเภทของสินทรัพย์จัดชั้น เช่น 020001 = ปกติ, 020002 = กล่าวถึงเป็นพิเศษ, 020003 = ต่ำกว่ามาตรฐาน เป็นต้น  (Classification Name : Asset Classification Type) | ตรวจสอบรหัสว่าอยู่ใน Classification ชื่อ Asset Classification Type |
| Amount\* | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็นบาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  กรณีรายงานจำนวนเงินของรายการของสรุปสินทรัพย์จัดชั้นและเงินสำรอง สำหรับ FI Reporting Group Id ที่มีรหัสเป็น 116030 (ชุด Solo Consolidated ) จะเป็นข้อมูลของทุกบริษัทที่จัดทำงบการเงินรวมของกลุ่ม หลังหักรายการระหว่างกัน  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | 1. สินทรัพย์จัดชั้น สุทธิ = ผลรวมของลูกหนี้จัดชั้นส่วนที่ต้องกันสำรองตามเกณฑ์จัดชั้น, เงินลงทุนในหลักทรัพย์ และสินทรัพย์อื่น  2. สำรองส่วนเกิน (ขาด) = เงินสำรองที่มีอยู่ – เงินสำรองที่ต้องกันทั้งสิ้น  3. เงินสำรองที่ต้องกันทั้งสิ้น = ผลรวมของรายการย่อยของสำรองที่ต้องกัน ทั้งสิ้น  4. เงินสำรองที่มีอยู่ = ผลรวมของรายการย่อยของเงินสำรองที่มีอยู่ทั้งสิ้น |

\* These are repeating data elements, which may occur several times in a data set record. Please see the XML data set sample to see how these repeating data elements can be prepared

### Data Set : Single Lending Limit \_Conso (DS\_SLLC)

ใช้ชุดข้อมูล [**50. Data Set : Single Lending Limit \_Conso (DS\_SLLC)**](#_Data_Set__3)

### Data Set : Total Trading Book Position\_Full Conso (DS\_TBPF)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Total Trading Book Position**\_**FullConso เป็นข้อมูลสรุปปริมาณธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้าสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน โดยรายงานปริมาณธุรกรรมเฉพาะของบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่นำมาจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (ไม่รวมรายการระหว่างกัน) และแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรมของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า ณ วันสิ้นไตรมาส

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายในไตรมาสถัดไปนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (Field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id  มีรหัสเป็น 116028 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Trading Book Position | ประเภทของธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้าแยกตามประเภทของฐานะและยอดรวมของปริมาณธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า  (Classification Name: Trading book Position ) |  |
| Outstanding Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |

### Data Set : Total Trading Book Position\_Solo Conso (DS\_TBPS)

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Total Trading Book Position**\_**SoloConso เป็นข้อมูลสรุปปริมาณธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้าสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน โดยรายงานปริมาณธุรกรรมเฉพาะของบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่นำมาจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (ไม่รวมรายการระหว่างกัน) และแสดงด้วยมูลค่ายุติธรรมของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า ณ วันสิ้นไตรมาส

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (Domestic systemically important bank: D-SIBs)

**ลักษณะข้อมูล**

รายไตรมาส

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นไตรมาส

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 45 วันนับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน (เริ่มส่งข้อมูลงวด 31 มี.ค. 62)

| **Data Element (Field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล จะใช้รหัสเดิมของสถาบันการเงินในกรณีที่เป็นธนาคารพาณิชย์จะเป็นรหัส 2 หลัก และใส่ 0 นำหน้ารหัสเดิม 1 ตัว เช่น ธนาคารกรุงเทพ รหัส 02 จะเป็น 002 | ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน  (Classification Name: FI Reporting Group Id) | ตรวจสอบชุดข้อมูลที่ Classification ใน FI Reporting Group Id มีรหัสเป็น 116030 |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล Data Type = Char(10) ใช้ปี ค.ศ. โดยจะมีรูปแบบเป็น yyyy-mm-dd เช่น วันที่ 31 มีนาคม 2556 รูปแบบที่ต้องรายงาน คือ 2013-03-31  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) | วันที่ต้องเป็นวันสิ้นไตรมาสตามปีปฏิทิน |
| Trading Book Position | ประเภทของธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้าแยกตามประเภทของฐานะและยอดรวมของปริมาณธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า  (Classification Name: Trading book Position ) |  |
| Outstanding Amount | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็น บาท โดยรูปแบบจะเป็นตัวเลข 20 หลัก ตัวเลขจำนวนเต็ม 18 หลัก ทศนิยม 2 หลัก  (Appendix A [Data Set Document] : Data Type) |  |