Summary of changes on “FI Data Set Manual”

Update on FI Data Set Manual Version 1.0

Remark: All changes are in blue font.

| Version number | Page No. | Data Set Name | Data Element | Summary of Changes |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.1 | 148 - 150 | NFR | NSFR Remaining Term Range | Change Classification ID  Modify 3 Classification ID as of follows:  from 310033 < 6 เดือน to 310039 < 6 เดือน  from 310034 >= 6 เดือน ถึง < 1 ปี to 310040 >= 6 เดือน ถึง < 1 ปี  from 310035 >= 1 ปี to 310041 >= 1 ปี  These results in changing validation rules as the following:   1. from “1.1 Net Stable Funding Ratio Item = 477053, 477061, 477254 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310033”   to “1.1 Net Stable Funding Ratio Item = 477053, 477061, 477254 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310039”   1. from “1.2 Net Stable Funding Ratio Item = 477003, 477004 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310035”   to “1.2 Net Stable Funding Ratio Item = 477003, 477004 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310041”   1. from “1.3 Net Stable Funding Ratio Item = 477197, 477199 - 477201ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310033 และ 310034”   to “1.3 Net Stable Funding Ratio Item = 477197, 477199 - 477201 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310039 และ 310040”   1. from “1.4 Net Stable Funding Ratio Item = 477005, 477006 477008 – 477010, 477012 – 477014, 477016 – 477018, 477020 – 477023, 477025 - 477029, 477046, 477051, 477052, 477054, 477055, 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, 477247, 477253, 477255, 477256 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310033, 310034 และ 310035”   to “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. from “ 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, 477249 - 477251, 477259 - 477265, 477268 - 477272 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้เท่ากับ 310029”   to “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” |
| 150 | NFR | NSFR Remaining Term Range | Add Validation Rule  “1.6 Net Stable Funding Ratio Item มีค่าเท่ากับ 477052 และ 477055 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310029, 310039, 310040 และ 310041” |
| 150 | NFR | NSFR Value | Change Description  from “(จำนวนเงินของรายการเป็นจำนวนเงินก่อนปรับค่า ASF factor และ RSF factor ยกเว้นรายการ 477069 ให้ใส่จำนวนเงินหลังคูณค่า RSF factor แล้ว)”  to “(จำนวนเงินของรายการเป็นจำนวนเงินก่อนปรับค่า ASF factor และ RSF factor ยกเว้นรายการ 477068 ให้ใส่จำนวนเงินหลังคูณค่า RSF factor แล้ว)” |
| 150-154 | NFR | NSFR Value | Change Validation Rule  from “2.1 ผลรวม Amount ของแต่ละ NSFR Remaining Term Range ที่มี Net Stable Funding Ratio Item ต้องมีค่า คือ 477255 = 477054  2.2 ผลรวม Amount ของ NSFR Remaining Term ตามที่กำหนด ที่มี Net Stable Funding Ratio Item ต้องมีค่าดังนี้  477046 (310033) + 477046 (310034) + 477046 (310035) = 477043 (310029) + 477044 (310029) + 477045 (310029)  477058 (310029) <= [ผลรวมของ (Amount \* ค่าแปลงสภาพ) ของรายการ 477061 - 477271] \*0.4  477246 (310033) + 477246 (310034) + 477246 (310035) = 477242 (310029) + 477243 (310029) + 477244 (310029)  \*\*477272 ต้อง validate ว่ามีค่าเท่ากับอัตราส่วน NSFR ที่คำนวณจากระบบที่ทศนิยม 2 ตำแหน่ง”  to **“**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)**”** |