

RISK MANAGEMENT DATA SET DOCUMENT

(โครงสร้างชุดข้อมูลการบริหารความเสี่ยง

ของสถาบันการเงิน)

Document information

Revision history

| Version number | Released Date | Effective Date | Summary of changes | Revision marks |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.0 | 6 March 2019 | 1 April 2019 | First version | No |
| 1.1 | 22 March 2019 | 1 April 2019 | Reference to file “Summary of Change on Risk Management Data Set Document version 1.1 from version 1.0”  Remark: All changes from version 1.0 to version 1.1 are in blue font. | Yes |
| 1.2 | 13 June 2019 | 1 January 2019 | Reference to file “Summary of Change on Risk Management Data Set Document version 1.2 from version 1.1”  Remark: All changes from version 1.1 to version 1.2 are in red font. | Yes |
| 1.3 | 21 August 2019 | 1 September 2019 | Reference to file “Summary of Change on Risk Management Data Set Document version 1.3 from version 1.2”  Remark: All changes from version 1.2 to version 1.3 are in green font. | Yes |

**Table of Contents**

[1. Document Overview 4](#_Toc11138728)

[2. Data Set Summary 6](#_Toc11138729)

[3. Data Set Details 7](#_Toc11138730)

[1. Subject Area: Asset & Liability Management and Liquidity Risk 7](#_Toc11138731)

[**1.** **Data Set:** ข้อมูลวงเงินที่ได้รับจากคู่ค้า 7](#_Toc11138732)

[**2.** **Data Set:** ข้อมูล Risk Limit และ Trigger ที่สถาบันการเงินใช้บริหารสินทรัพย์และหนี้สิน 10](#_Toc11138733)

[**3.** **Data Set:** Net Stable Funding Ratio Consolidated Basis 13](#_Toc11138734)

[2. Subject Area: Strategic Risk 15](#_Toc11138735)

[**1.** **Data Set:** ข้อมูลเป้าหมายทางการเงินของสถาบันการเงิน 15](#_Toc11138736)

[3. Subject Area: Market Risk 17](#_Toc11138737)

[**1.** **Data Set:** Value at Risk 17](#_Toc11138738)

[**2.** **Data Set:** Greek 20](#_Toc11138739)

[**3.** **Data Set:** IR PV01 22](#_Toc11138740)

[**4.** **Data Set:** Credit Valuation Adjustment 24](#_Toc11138741)

[4. Appendix A. Data Type 25](#_Toc11138742)

# Document Overview

This document provides information on the Data Sets to be submitted to the Bank of Thailand (BOT) for the Data Management System project. Most of the existing data submissions to BOT will be replaced by these Data Sets. The Data Sets will be based on the industry open standard XML (Extensible Markup Language) format, and will be electronically submitted to BOT via the BOT Electronic Report Submission system (ERS).

This document is divided into 4 major sections:

**1. Data Set Summary** section provides an overview of the Data Set(s) and specify format (i.e. XML, XLSX) and description of each Data Set.

**2. Data Set Data Element** section discusses in more details all the data elements withineach of the defined Data Set(s). For each of the data elements, we have defined a valid data type. The list of all data types can be found in the **Data Type Section**.

**3. Data Type** section, which also provides the submission format for each of the data type, as well as some sample value. There is a special kind of data elements called **Classification** data element, which is used to classify other data elements i.e. Payment Instrument, Payment Channel. Each classification data element will contain a number of possible values. For example, the possible values of Currency Id classification data element are ‘USD’, ‘JPY’, ‘THB’, etc. The list of all classifications can be found in the **Classification Document**.

**4. Schema Type and Schema Group** section, which describes schema type of each data set and also identify schema group for each data set.

**Description:**

* **Granularity**: granularity of data (how detailed the data is).
* **Frequency**: frequency of data submission (how frequent each institution has to submit the data).
* **M**: mandatory field. This field cannot be blank.
* **O**: optional field. The field can contain value or blank depending on whether the institution has the data or not.
* **C**:mandatory with condition. These data are required under certain condition with other field(s).
* **Duplicate Record**: identify fields that BOT will check for duplicate records. If there are two records with identical value in these fields appeared in a data set, it will not pass basic validation.
* **Classification / View**: identify classification and view which is the possible value for each data element. **Classification** and **View** will be listed in **Classification Document.**
* **CB:** Commercial Bank includes Thai commercial banks, retail banks, foreign commercial bank’s subsidiary and foreign commercial bank’sbranch.
* **FC:** Finance Company**.**
* **CF:** Credit Foncier.
* **SFI:** Specialized Financial Institution includes Bank for Agriculture and Agricultural Cooperatives (BAAC), Government Saving Banks (GSB), Government Housing Banks (GHB), Islamic Bank of Thailand, Export-Import Bank of Thailand (EXIM), Small and Medium Enterprise Development Bank of Thailand (SME Bank), Thai Credit Guarantee ​Corporation, and Secondary Mortgage Corporation.
* **Non-FI:** Non-Financial Institution in this context means financial service provider under BOT supervision which is not classified as commercial bank, specialized financial institution, finance company and credit foncier. The example of Non-FI are credit card company, personal loan company under BOT supervision, nano finance provider under BOT supervision, e-payment service provider, money exchange agency, money transfer agency.

# Data Set Summary

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Subject Area** | **ABBR** | **Granularity** | **Frequency** | **Description** |
| * 1. Asset & Liability Managementand Liquidity Risk | | | | |
| 1. Committed Credit Line | DS\_CCL | Monthly | Monthly |  |
| 1. Risk Limit and Trigger | DS\_RLT | Monthly | Monthly |  |
| 1. Net Stable Funding Ratio Consolidated Basis | DF\_NSFC | Semi-annually | Semi-annually | Sheet “DF\_NSFC” |
| * 1. Strategic Risk | | | | |
| 1. Financial Target | DS\_FTG | Yearly | Yearly |  |
| * 1. Market Risk | | | | |
| 1. Value at Risk | DS\_VAR | Daily | Weekly |  |
| 1. Greek | DS\_GRK | Daily | Weekly |  |
| 1. IR PV01 | DS\_IRP | Daily | Weekly |  |
| 1. Credit Valuation Adjustment | DS\_CVA | Monthly | Monthly |  |

# Data Set Details

## **Subject Area: Asset & Liability Management and Liquidity Risk**

### **Data Set:** ข้อมูลวงเงินที่ได้รับจากคู่ค้า

**Frequency: Monthly**

| **No.** | **Group** | **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **ธพ.** | **บง.** | **บค.** | **SFI** | **Non-FI** | **Duplicated Record** | **Classification / View** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** |
| 1 |  | Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | M | M | M | - | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | M | M | M | - | - | Y |  |
| 3 | 1 | Creditor Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | Creditor Unique Id | Identification Number | รหัสของผู้ให้วงเงิน | M | M | M | - | - | Y |  |
| 5 | 1.2 | Creditor Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของผู้ให้วงเงิน | M | M | M | - | - | Y | Unique Id Type 1/ |
| 6 | 1.3 | Creditor Country Code | Classification | รหัสประเทศของผู้ให้วงเงิน | M | M | M | - | - | Y | Country Id 1/ |
| 7 | 1.4 | Creditor Name | Description | ชื่อนิติบุคคลของผู้ให้วงเงิน | M | M | M | - | - | Y |  |
| 8 | 1.5 | Creditor Involved Party Type ID | Classification | ประเภทของผู้ให้วงเงิน | M | M | M | - | - | Y | Involved Party Type 1/ |
| 9 | 1.6 | Credit Line Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 10 | 1.6.1 | Remaining Term Range | Classification | ระยะเวลาคงเหลือ | M | M | M | - | - | Y | Term Range: V\_SL 2/ |
| 11 | 1.6.2 | Credit Line Outstanding Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 12 | 1.6.2.1 | Currency | Classification | รหัสสกุลเงิน | M | M | M | - | - | Y | Currency Id 1/ |
| 13 | 1.6.2.2 | Credit Line Amount in Original Currency | Amount | วงเงิน (ตามสกุลเงิน) | M | M | M | - | - |  |  |
| 14 | 1.6.2.3 | Credit Line Amount in Baht | Amount | วงเงิน (สกุลเงินบาท) | M | M | M | - | - |  |  |
| 15 | 1.6.2.4 | Outstanding Amount in Original Currency | Amount | ยอดคงค้าง (ตามสกุลเงิน) | M | M | M | - | - |  |  |
| 16 | 1.6.2.5 | Outstanding Amount in Baht | Amount | ยอดคงค้าง (สกุลเงินบาท) | M | M | M | - | - |  |  |
| 17 | 1.6.2.6 | Remark | Description | หมายเหตุ | O | O | O | - | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification Document

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** ข้อมูล Risk Limit และ Trigger ที่สถาบันการเงินใช้บริหารสินทรัพย์และหนี้สิน

**Frequency: Monthly**

| **No.** | **Group** | **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **ธพ.** | **บง.** | **บค.** | **SFI** | **Non-FI** | **Duplicated Record** | **Classification / View** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** |
| 1 |  | Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | M | M | M | - | - |  |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | M | M | M | - | - |  |  |
| 3 | 1 | Indicator Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | Indicator | Classification Name | ประเภท Indicator | M | M | M | - | - |  | Indicator 2/ |
| 5 | 1.2 | Indicator Description | Description | รายละเอียดสูตรการคำนวณ Indicator | C | C | C | - | - |  |  |
| 6 | 1.3 | Outstanding Amount in Mil. Baht | Amount | จำนวนเงิน (ล้านบาท) | C | C | C | - | - |  |  |
| 7 | 1.4 | Outstanding Amount in % | Percentage | จำนวนเงิน (%) | C | C | C | - | - |  |  |
| 8 | 1.5 | Limit and Trigger Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 9 | 1.5.1 | Level of Limit | Number | ระดับของ Limit | C | C | C | - | - |  |  |
| 10 | 1.5.2 | Comparison operator of Limit in Mil. Baht | Classification Name | เครื่องหมายของ Limit in Million Baht | C | C | C | - | - |  | Comparison operator 2/ |
| 11 | 1.5.3 | Limit in Mil. Baht | Amount | ค่า Limit รายงานเป็นจำนวนเงิน (ล้านบาท) | C | C | C | - | - |  |  |
| 12 | 1.5.4 | Condition of Limit | Classification Name | เงื่อนไขระหว่าง Limit in Million Baht และ Limit in % | C | C | C | - | - |  | Condition 2/ |
| 13 | 1.5.5 | Comparison operator of Limit in % | Classification Name | เครื่องหมายของ Limit in % | C | C | C | - | - |  | Comparison operator 2/ |
| 14 | 1.5.6 | Limit in % | Percentage | ค่า Limit รายงานเป็น % | C | C | C | - | - |  |  |
| 15 | 1.5.7 | Trigger Detail  กรณีมีค่า มีได้มากกว่า 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 16 | 1.5.7.1 | Level of Trigger | Number | ระดับของ Trigger | C | C | C | - | - |  |  |
| 17 | 1.5.7.2 | Comparison operator of Trigger in Mil. Baht | Classification Name | เครื่องหมายของ Trigger in Million Baht | C | C | C | - | - |  | Comparison operator 2/ |
| 18 | 1.5.7.3 | Trigger in Mil. Baht | Amount | ค่า Trigger รายงานเป็นจำนวนเงิน (ล้านบาท) | C | C | C | - | - |  |  |
| 19 | 1.5.7.4 | Condition of Trigger | Classification Name | เงื่อนไขระหว่าง Trigger in Million Baht และ Trigger in % | C | C | C | - | - |  | Condition 2/ |
| 20 | 1.5.7.5 | Comparison operator of Trigger in % | Classification Name | เครื่องหมายของ Trigger in % | C | C | C | - | - |  | Comparison operator 2/ |
| 21 | 1.5.7.6 | Trigger in % | Percentage | ค่า Trigger รายงานเป็น % | C | C | C | - | - |  |  |
| 22 | 1.5.7.7 | Remark | Description | หมายเหตุ | O | O | O | - | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification Document

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** Net Stable Funding Ratio Consolidated Basis

อัตราส่วนแหล่งเงินที่มีความมั่นคงและความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคงของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (Consolidated Basis)

**Frequency: Semi-annually**

| **No.** | **Group** | **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **ธพ.** | **บง.** | **บค.** | **SFI** | **Non-FI** | **Duplicated Record** | **Classification / View** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** |
| 1 |  | Organization Id | FI Code | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | - | - | Y |  |
| 2 |  | Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | M | - | - | - | - | Y |  |
| 4 | 1 | FI Reporting Group Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 5 | 1.1 | FI Reporting Group Id | Classification | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน | M | - | - | - | - | Y | FI Reporting Group Id 1/ |
| 6 | 1.2 | Net Stable Funding Ratio Item | Classification | สินทรัพย์ หนี้สิน และภาระผูกพัน | M | - | - | - | - | Y | Net Stable Funding Ratio Item 1/ : V\_TCB, V\_FCB |
| 7 | 1.3 | Net Stable Funding Ratio Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 8 | 1.3.1 | NSFR Remaining Term Range | Classification | อายุคงเหลือ | M | - | - | - | - | Y | NSFR Remaining Term Range 1/ |
| 9 | 1.3.2 | NSFR Value | Amount | มูลค่าของสินทรัพย์ หนี้สิน และภาระผูกพัน ก่อนปรับ ASF factor และ RSF factor (บาท) | M | - | - | - | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification Document

## **Subject Area: Strategic Risk**

### **Data Set:** ข้อมูลเป้าหมายทางการเงินของสถาบันการเงิน

**Frequency: Yearly**

| **No.** | **Group** | **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **ธพ.** | **บง.** | **บค.** | **SFI** | **Non-FI** | **Duplicated Record** | **Classification / View** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** |
| 1 |  | Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | M | M | M | - | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | M | M | M | - | - | Y |  |
| 3 |  | FI Reporting Group | Classification | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน | M | M | M | - | - | Y | FI Reporting Group Id: FTG 1/ |
| 4 | 1 | Target Details  ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 5 | 1.1 | Target Type | Classification Name | เป้าหมายทางการเงิน | M | M | M | - | - | Y | Target Type 2/ |
| 6 | 1.2 | Description | Description | คำอธิบายเป้าหมายทางการเงิน | O | O | O | - | - |  |  |
| 7 | 1.3 | Definition of Target | Description | ความหมายของรายการตามคำจำกัดความของธนาคาร | C | C | C | - | - |  |  |
| 8 | 1.4 | Target Amount | Amount | เป้าหมาย (ล้านบาท) | C | C | C | - | - |  |  |
| 9 | 1.5 | Target Percentage | Percentage | เป้าหมาย (%) | C | C | C | - | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification Document

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

## **Subject Area: Market Risk**

### **Data Set:** Value at Risk

**Frequency: Weekly**

| **No.** | **Group** | **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **ธพ.** | **บง.** | **บค.** | **SFI** | **Non-FI** | **Duplicated Record** | **Classification / View** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** |
| 1 |  | Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | M | - | - | - | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | - | - | Y |  |
| 3 |  | FI Reporting Group Id | Classification | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน | M | - | - | - | - | Y | FI Reporting Group Id: NFR 1/ |
| 4 | 1 | Daily VaR Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 5 | 1.1 | Calculation Date | Date | วันที่คำนวณค่า Value at Risk | M | - | - | - | - | Y |  |
| 6 | 1.2 | Monitoring Currency | Classification | รหัสสกุลเงินที่สถาบันการเงินใช้ในการติดตามความเสี่ยง | M | - | - | - | - | Y | Currency Id 1/ |
| 7 | 1.3 | VaR Value Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 8 | 1.3.1 | VaR Value Type | Classification Name | ประเภทของค่า Value at Risk | M | - | - | - | - | Y | Risk Value Type 2/ |
| 9 | 1.3.2 | VaR Approach | Classification Name | วิธีที่ใช้ในการคำนวณค่า Value at Risk | M | - | - | - | - | Y | VaR Approach 2/ |
| 10 | 1.3.3 | VaR Holding Period | Number | ระยะเวลาถือครองที่กำหนดของแบบจำลอง Value at Risk (หน่วย: วัน) | M | - | - | - | - | Y |  |
| 11 | 1.3.4 | VaR Confidence Level | Percentage | ระดับความเชื่อมั่นที่กำหนดของแบบจำลอง Value at Risk  (หน่วย: ร้อยละ) | M | - | - | - | - | Y |  |
| 12 | 1.3.5 | VaR by VaR Type Detail  ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 13 | 1.3.5.1 | VaR Type | Classification Name | รูปแบบการคำนวณค่า VaR | M | - | - | - | - | Y | VaR Type 2/ |
| 14 | 1.3.5.2 | General Market Risk Factor Type | Classification Name | ประเภทของ Risk Factor ตามที่กำหนด | C | - | - | - | - | Y | Market Risk Factor Type: V\_VAR 2/ |
| 15 | 1.3.5.3 | Other Market Risk Factor Type Name | Long Name | ชื่อประเภทของ Risk Factor อื่น | C | - | - | - | - | Y |  |
| 16 | 1.3.5.4 | Other Market Risk Factor Type Description | Description | คำอธิบายประเภทของ Risk Factor อื่น | C | - | - | - | - |  |  |
| 17 | 1.3.5.5 | Trading Desk Name | Long Name | ชื่อของ Trading Desk | C | - | - | - | - | Y |  |
| 18 | 1.3.5.6 | Trading Desk Description | Description | คำอธิบาย Trading Desk | C | - | - | - | - |  |  |
| 19 | 1.3.5.7 | VaR Value | Amount | มูลค่า Value at Risk ของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า | M | - | - | - | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification Document

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** Greek

**Frequency: Weekly**

| **No.** | **Group** | **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **ธพ.** | **บง.** | **บค.** | **SFI** | **Non-FI** | **Duplicated Record** | **Classification / View** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** |
| 1 |  | Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | M | - | - | - | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | - | - | Y |  |
| 3 |  | FI Reporting Group Id | Classification | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน | M | - | - | - | - | Y | FI Reporting Group Id: NFR 1/ |
| 4 | 1 | Daily Greek Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 5 | 1.1 | Calculation Date | Date | วันที่คำนวณมูลค่า Greek | M | - | - | - | - | Y |  |
| 6 | 1.2 | Greek Value Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 7 | 1.2.1 | Monitoring Currency | Classification | รหัสสกุลเงินที่สถาบันการเงินใช้ในการติดตามความเสี่ยง | M | - | - | - | - | Y | Currency Id 1/ |
| 8 | 1.2.2 | Greek Type | Classification Name | ประเภทของ Greek | M | - | - | - | - | Y | Greek Type 2/ |
| 9 | 1.2.3 | Greek Value Type | Classification Name | ประเภทของค่า Greek | M | - | - | - | - | Y | Risk Value Type 2/ |
| 10 | 1.2.4 | General Market Risk Factor Type | Classification Name | ประเภทของ Risk Factor ตามที่กำหนด | M | - | - | - | - | Y | Market Risk Factor Type: V\_GRK 2/ |
| 11 | 1.2.5 | Other Market Risk Factor Type Name | Long Name | ชื่อประเภทของ Risk Factor อื่น | C | - | - | - | - | Y |  |
| 12 | 1.2.6 | Other Market Risk Factor Type Description | Description | คำอธิบายประเภทของ Risk Factor อื่น | C | - | - | - | - | - |  |
| 13 | 1.2.7 | FX Base Currency | Classification | รหัสสกุลเงินหลัก | C | - | - | - | - |  | Currency Id 1/ |
| 14 | 1.2.8 | FX Quote Currency | Classification | รหัสสกุลเงินอ้างอิง | C | - | - | - | - |  | Currency Id 1/ |
| 15 | 1.2.9 | Greek Value | Amount | มูลค่า Position ตาม Greek Type | M | - | - | - | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification Document

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** IR PV01

**Frequency: Weekly**

| **No.** | **Group** | **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **ธพ.** | **บง.** | **บค.** | **SFI** | **Non-FI** | **Duplicated Record** | **Classification / View** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** |
| 1 |  | Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | M | - | - | - | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | - | - | Y |  |
| 3 |  | FI Reporting Group Id | Classification | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน | M | - | - | - | - | Y | FI Reporting Group Id: NFR 1/ |
| 4 | 1 | Daily PV01 Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 5 | 1.1 | Calculation Date | Date | วันที่คำนวณค่า PV01 | M | - | - | - | - | Y |  |
| 6 | 1.2 | Monitoring Currency | Classification | รหัสสกุลเงินที่สถาบันการเงินใช้ในการติดตามความเสี่ยง | M | - | - | - | - | Y | Currency Id 1/ |
| 7 | 1.3 | Limit | Amount | มูลค่า Limit รวมของ PV01 Trading Book | O | - | - | - | - |  |  |
| 8 | 1.4 | Currency and IR Curve Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 9 | 1.4.1 | Curve Currency | Classification | รหัสสกุลเงินของผลิตภัณฑ์ | M | - | - | - | - | Y | Currency Id 1/ |
| 10 | 1.4.2 | IR Curve | Classification Name | Interest Rate Curve ที่ใช้ในการคำนวณค่า PV01 | M | - | - | - | - | Y | IR Curve 2/ |
| 11 | 1.4.3 | PV01 by Tenor Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 12 | 1.4.3.1 | Tenor | Short Name | ช่วงระยะเวลาของธุรกรรม | O | - | - | - | - | Y |  |
| 13 | 1.4.3.2 | Tenor Unit | Classification | หน่วยของช่วงระยะเวลาของธุรกรรม | C | - | - | - | - | Y | Term Unit 1/ |
| 14 | 1.4.3.3 | PV01 Value | Amount | มูลค่าของ PV01 | M | - | - | - | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification Document

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** Credit Valuation Adjustment

**Frequency: Monthly**

| **No.** | **Group** | **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **ธพ.** | **บง.** | **บค.** | **SFI** | **Non-FI** | **Duplicated Record** | **Classification / View** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** | **M/O/C** |
| 1 |  | Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | M | - | - | - | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | - | - | Y |  |
| 3 |  | FI Reporting Group Id | Classification | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน | M | - | - | - | - | Y | FI Reporting Group Id: NFR 1/ |
| 4 | 1 | CVA Detail  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 5 | 1.1 | CVA Counterparty Type | Classification Name | ประเภทของ Counterparty | M | - | - | - | - | Y | CVA Counterparty Type 2/ |
| 6 | 1.2 | CVA Value | Amount | มูลค่า Credit Valuation Adjustment (หน่วย: บาท) | M | - | - | - | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification Document

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

# Appendix A. Data Type

| **Data Type Name** | **Data Type** | **Format** | **Remark** | **Sample** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Date | Char(10) | YYYY-MM-DD | A.D. year | '2002-09-11' |
| Amount | Number(20,2) | NNNNNNNNNN.NN | No leading zeroes | '102000020.20' |
| Classification | VarChar(6) | AAAA | No leading zeroes/blanks | '12345' |
| Classification Name | VarChar(200) | AAAA | No leading zeroes/blanks |  |
| Number | Number(12) | N | No leading zeroes | '12' |
| Identification Number | VarChar(40) | AAAA | No leading zeroes/blanks | '12345' |
| Long Name | VarChar(200) | AAAA | No leading zeroes/blanks | 'XXX' |
| Short Name | VarChar(40) | AAAA | No leading zeroes/blanks | 'XXX111' |
| Description | VarChar(400) | AAAA | No leading zeroes/blanks | 'XXX111' |
| Flag | Char(1) | '1' or '0' | Only two values |  |
| Interest Rate | Number(8,5) | NNN.NNNNN | No leading zeroes | '12.50' |
| Exchange Rate | Number(12,7) | NNNNN.NNNNNNN |  |  |
| Price | Number(12,7) | NNNNN.NNNNNNN |  |  |
| FI Code | Char(3) |  | See Standard Code |  |
| Business Type | Char(7) |  | See Standard Code |  |
| Branch Code | Char(4) |  | See Standard Code |  |
| Tax Id | Number(13) |  |  |  |
| Personal Id | Number(13) |  |  |  |
| SWIFT Code | VarChar(12) |  |  |  |
| Passport Number | Char(20) |  |  |  |
| Gender Code | Char(1) | ‘M’ or ‘F’ |  |  |
| Juristic Code | VarChar(13) |  |  |  |
| Fee Rate | Number(12,5) | NNNNNNN.NNNNN |  |  |
| Conversion Rate | Number(8,5) | NNN.NNNNN | No leading zeroes |  |
| LongNameCRLF | VarChar(200) | AAAA | No leading zeroes/blanks | 'XXX' |
| Timestamp | Char(19) | YYYY-MM-DD HH:MM:SS | A.D. year and timestamp | ‘2019-01-03 15:00:00’ |
| Percentage | Number(9,5) | NNNN.NNNNN | No leading Zeroes | ‘2.45000’ |