

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 |
| 1.4 | 12 September 2019 | 1 January 2020 | Reference to file “Summary of Change on Risk Management Data Set Document version 1.4 from version 1.3” Remark: All changes from version 1.3 to version 1.4 are in purple font.  This document, “Risk Management Data Set Document version 1.4”, is designed to be used with “Risk Management Data Set Manual version 1.4” and “Risk Management Classification Document version 1.3”. In addition, other supporting documents is “DMS Classification version 19.1”. | Yes |
| 1.5 | 27 September 2019 | 1 September 2019 | Reference to file “Summary of Change on Risk Management Data Set Document version 1.5 from version 1.4” Remark: All changes from version 1.4 to version 1.5 are in pink font.  This document, “Risk Management Data Set Document version 1.5”, is designed to be used with “Risk Management Data Set Manual version 1.5” and “Risk Management Classification Document version 1.3”. In addition, other supporting documents is “DMS Classification version 19.1”. | Yes |
| 2.0 | 26 February 2020 | 1 April 2020 | Reference to file “Summary of Change on Risk Management Data Set Document version 2.0 from version 1.5” Remark: All changes from version 1.5 to version 2.0 are in Blue font.  This document, “Risk Management Data Set Document version 2.0”, is designed to be used with “Risk Management Data Set Manual version 2.0” and “Risk Management Classification Document version 2.0”. In addition, other supporting documents are “DMS Classification version 19.4” and “รหัสที่ตั้ง (Location Code)”. | Yes |

**Table of Contents**

[1. Document Overview 6](#_Toc32913199)

[2. Data Set Summary 8](#_Toc32913200)

[3. Data Set Details 11](#_Toc32913201)

[1. Subject Area: Asset & Liability Management and Liquidity Risk 11](#_Toc32913202)

[**1.** **Data Set:** ข้อมูลวงเงินที่ได้รับจากคู่ค้า 11](#_Toc32913203)

[**2.** **Data Set:** ข้อมูล Risk Limit และ Trigger ที่สถาบันการเงินใช้บริหารสินทรัพย์และหนี้สิน 14](#_Toc32913204)

[**3.** **Data Set:** Net Stable Funding Ratio Consolidated Basis 17](#_Toc32913205)

[2. Subject Area: Strategic Risk 19](#_Toc32913206)

[**1.** **Data Set:** ข้อมูลเป้าหมายทางการเงินของสถาบันการเงิน 19](#_Toc32913207)

[3. Subject Area: Market Risk 21](#_Toc32913208)

[**1.** **Data Set:** Value at Risk 21](#_Toc32913209)

[**2.** **Data Set:** Greek 24](#_Toc32913210)

[**3.** **Data Set:** IR PV01 26](#_Toc32913211)

[**4.** **Data Set:** Credit Valuation Adjustment 28](#_Toc32913212)

[**5.** **Data Set:** Profit and Loss of Financial Instruments Held at Fair Value through Profit and Loss 29](#_Toc32913213)

[4. Subject Area: Information Technology Risk Management 30](#_Toc32913214)

[**1.** **Data Set:** IT Audit 30](#_Toc32913215)

[**2.** **Data Set:** IT Capacity 33](#_Toc32913216)

[**3.** **Data Set:** IT DC-DR 36](#_Toc32913217)

[**4.** **Data Set:** IT Infrastructure 39](#_Toc32913218)

[**5.** **Data Set:** IT Project 41](#_Toc32913219)

[**6.** **Data Set:** IT Staff 44](#_Toc32913220)

[**7.** **Data Set:** IT System Profile 46](#_Toc32913221)

[**8.** **Data Set:** Technology Implementation 48](#_Toc32913222)

[**9.** **Data Set:** Third Party 50](#_Toc32913223)

[4. Appendix A. Data Type 53](#_Toc32913224)

# 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** | **Format** | **Description** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| * 1. Asset & Liability Managementand Liquidity Risk | | | | | |
| 1. Committed Credit Line | DS\_CCL | Monthly | Monthly |  | Filename: MALMNn\_YYYYMMDD\_CCL.xlsx Sheet “Committed Credit Line” |
| 1. Risk Limit and Trigger | DS\_RLT | Monthly | Monthly |  | Filename: MALMNn\_YYYYMMDD\_RLT.xlsx Sheet “Risk Limit Trigger” |
| 1. Net Stable Funding Ratio Consolidated Basis | DF\_NSFC | Semi-annually | Semi-annually |  | Filename: HBASNn\_YYYYMMDD\_NSFC.xlsx Sheet “DF\_NSFC” |
| * 1. Strategic Risk | | | | | |
| 1. Financial Target | DS\_FTG | Yearly | Yearly |  | Filename: YSTGNn\_YYYYMMDD\_FTG.xlsx Sheet “Financial Targets” |
| * 1. Market Risk | | | | | |
| 1. Value at Risk | DS\_VAR | Daily | Weekly |  | Filename: WMKTNn\_YYYYMMDD\_VAR.xlsx Sheet “VaR” |
| 1. Greek | DS\_GRK | Daily | Weekly |  | Filename: WMKTNn\_YYYYMMDD\_GRK.xlsx Sheet “Greek” |
| 1. IR PV01 | DS\_IRP | Daily | Weekly |  | Filename: WMKTNn\_YYYYMMDD\_IRP.xlsx Sheet “IR\_PV01” |
| 1. Credit Valuation Adjustment | DS\_CVA | Monthly | Monthly |  | Filename: MMKTNn\_YYYYMMDD\_CVA.xlsx Sheet “CVA” |
| 1. Profit and Loss of Financial Instruments Held at Fair Value through Profit and Loss | DS\_PLF | Monthly | Monthly |  | Filename: MMKTNn\_YYYYMMDD\_PLF.xlsx Sheet “DS\_PLF” |
| 4. Information Technology Risk Management | | | | | |
| 1. IT Audit (ข้อมูลการตรวจสอบด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ) | DS\_ITA | Quarterly | Quarterly | Excel | Filename: QIRMNn\_YYYYMMDD\_ITA.xlsx Sheet “ITA” |
| 1. IT Capacity (ข้อมูลความสามารถระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ) | DS\_ITC | Monthly | Monthly | Excel | Filename: MIRMNn\_YYYYMMDD\_ITC.xlsx Sheet “ITC” |
| 1. IT DC-DR (ข้อมูลศูนย์คอมพิวเตอร์หลักและคอมพิวเตอร์สำรอง) | DS\_IDD | Semi-Annually | Semi-Annually | Excel | Filename: HIRMNn\_YYYYMMDD\_IDD.xlsx  Sheet “IDD” |
| 1. IT Infrastructure (ข้อมูลโครงสร้างพื้นฐานด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ) | DS\_ITI | Monthly | Monthly | Excel | Filename: MIRMNn\_YYYYMMDD\_ITI.xlsx Sheet “ITI” |
| 1. IT Project (ข้อมูลโครงการด้านเทคโนโลยีสารสนเทศที่มีนัยสำคัญ) | DS\_ITP | Quarterly | Quarterly | Excel | Filename: QIRMNn\_YYYYMMDD\_ITP.xlsx Sheet “ITP” |
| 1. IT Staff (ข้อมูลบุคลากรด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ) | DS\_ITS | Quarterly | Quarterly | Excel | Filename: QIRMNn\_YYYYMMDD\_ITS.xlsx Sheet “ITS” |
| 1. IT System Profile (ข้อมูลภาพรวมระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ) | DS\_ISP | Semi-Annually | Semi-Annually | Excel | Filename: HIRMNn\_YYYYMMDD\_ISP.xlsx Sheet “ISP” |
| 1. Technology Implementation (ข้อมูลการนำเทคโนโลยีมาใช้งาน) | DS\_TGI | Quarterly | Quarterly | Excel | Filename: QIRMNn\_YYYYMMDD\_TGI.xlsx Sheet “TGI” |
| 1. Third Party (ข้อมูลการใช้บริการ การเชื่อมต่อระบบ และการเข้าถึงข้อมูลจากบุคคลภายนอก) | DS\_TPT | Quarterly | Quarterly | Excel | Filename: QIRMNn\_YYYYMMDD\_TPT.xlsx Sheet “TPT” |

# 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: COS 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: COS 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 | - | - | - | - | Y | Currency Id 1/ |
| 14 | 1.2.8 | FX Quote Currency | Classification | รหัสสกุลเงินอ้างอิง | C | - | - | - | - | Y | 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: COS 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

### **Data Set:** Profit and Loss of Financial Instruments Held at Fair Value through Profit and Loss

**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 | 1 | Profit and Loss Detail ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | Trading Book Profit and Loss Item | Classification | รายการงบกำไรขาดทุนจากการทำธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า | M | - | - | - | - | Y | Profit and Loss Item: V\_PLF 2/ |
| 5 | 1.2 | Profit and Loss Value | Amount | มูลค่า Profit and Loss (หน่วย: บาท) | M | - | - | - | - |  |  |

หมายเหตุ:

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

## **Subject Area: Information Technology Risk Management**

### **Data Set:** IT Audit

**Frequency: Quarterly**

| **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 | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | M | - | Y |  |
| 3 | 1 | Audit Details  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | Audit Type | Classification Name | ประเภทการตรวจสอบ | M | - | - | M | - |  | Audit Type 2/ |
| 5 | 1.2 | Audit Reference Id | Identification Number | รหัสอ้างอิงการตรวจสอบ ของสถาบันการเงิน | M | - | - | M | - | Y |  |
| 6 | 1.3 | Audit Subject | Long Name | เรื่องที่เข้าตรวจสอบ | M | - | - | M | - |  |  |
| 7 | 1.4 | Audit Start Date | Date | วันที่เริ่มเข้าตรวจสอบ | M | - | - | M | - |  |  |
| 8 | 1.5 | Audit End Date | Date | วันที่เสร็จสิ้นการตรวจสอบ | M | - | - | M | - |  |  |
| 9 | 1.6 | Audit Result Details  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 10 | 1.6.1 | Audit Finding Reference Id | Identification Number | รหัสอ้างอิงข้อสังเกต ของสถาบันการเงิน | M | - | - | M | - | Y |  |
| 11 | 1.6.2 | Audit Finding | Description | ข้อสังเกตที่ตรวจพบ ที่มีระดับความเสี่ยงตั้งแต่ระดับปานกลางขึ้นไป | M | - | - | M | - |  |  |
| 12 | 1.6.3 | Audit Finding Type | Classification Name | ประเภทของข้อสังเกตที่ตรวจพบ | M | - | - | M | - |  | IT Risk Management Type 2/ |
| 13 | 1.6.4 | Audit Recommendation | Text | ข้อสังเกตจากการตรวจสอบ | M | - | - | M | - |  |  |
| 14 | 1.6.5 | Remediation Plan | Text | แนวทาง/แผนการแก้ไขข้อสังเกต | M | - | - | M | - |  |  |
| 15 | 1.6.6 | Audit Rating | Classification Name | ระดับความเสี่ยงของข้อสังเกตตามแนวทางที่สถาบันการเงินกำหนด | M | - | - | M | - |  | Risk Level 2/: V\_Audit\_Rating |
| 16 | 1.6.7 | Initial Target Close Date | Date | วันที่กำหนดแล้วเสร็จในการวางแผนครั้งแรก | M | - | - | M | - |  |  |
| 17 | 1.6.8 | Audit Follow-up Date | Date | วันที่ติดตามความคืบหน้าการแก้ไขข้อสังเกตครั้งถัดไป | C | - | - | C | - |  |  |
| 18 | 1.6.9 | Remediation Action | Text | สรุปการแก้ไขข้อสังเกต | O | - | - | O | - |  |  |
| 19 | 1.6.10 | Audit Status | Classification Name | สถานะของข้อสังเกต | M | - | - | M | - |  | Audit Status 2/ |
| 20 | 1.6.11 | Close Date / Target Close Date | Date | วันที่แก้ไขข้อสังเกตแล้วเสร็จ/คาดว่าจะแล้วเสร็จ | M | - | - | M | - |  |  |

หมายเหตุ:

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** IT Capacity

**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 | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | M | - | Y |  |
| 3 | 1 | System Details  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | System Type | Classification | ประเภทของระบบงาน | M | - | - | M | - | Y | System Channel Type 2/ |
| 5 | 1.2 | System Name | Long Name | ชื่อระบบ | M | - | - | M | - | Y |  |
| 6 | 1.3 | Product Name | Long Name | ชื่อผลิตภัณฑ์ | O | - | - | O | - |  |  |
| 7 | 1.4 | Customer Type | Classification Name | กลุ่มลูกค้า | M | - | - | M | - | Y | Customer Type 2/ |
| 8 | 1.5 | Number of Active Customers | Number | จำนวนลูกค้าผู้เข้าใช้งานอย่างน้อย 1 ครั้งต่อเดือน | C | - | - | C | - |  |  |
| 9 | 1.6 | Target SLA% | Percentage | ระดับความพร้อม (Availability) ในการให้บริการอย่างต่อเนื่องตามข้อตกลง หรือ Service Level Agreement (SLA) | M | - | - | M | - |  |  |
| 10 | 1.7 | Actual SLA% | Percentage | ระดับความพร้อม (Availability) ในการให้บริการอย่างต่อเนื่องตามจริง | M | - | - | M | - |  |  |
| 11 | 1.8 | Capacity Details  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 12 | 1.8.1 | Capacity Type | Classification Name | ประเภทการวัดความสามารถของระบบงาน | M | - | - | M | - | Y | Capacity Type 2/ |
| 13 | 1.8.2 | Max | Number | ค่าความสามารถสูงสุดที่ระบบรองรับได้ ตาม แต่ละ Capacity Type ภายในงวดข้อมูล | C | - | - | C | - |  |  |
| 14 | 1.8.3 | Peak | Number | ค่าความสามารถระบบงานสูงสุดที่เกิดขึ้นจริง ตามแต่ละ Capacity Type ภายในงวดข้อมูล | C | - | - | C | - |  |  |
| 15 | 1.8.4 | Forecast Peak | Number | ค่าความสามารถของระบบงานสูงสุดที่คาดว่าจะเกิดขึ้น ตามแต่ละ Capacity Type ในช่วงเวลา 6 เดือนนับจากงวดข้อมูล | C | - | - | C | - |  |  |
| 16 | 1.8.5 | Daily Average | Number | ค่าความสามารถของระบบงานเฉลี่ยตามแต่ละ Capacity Type ที่เกิดขึ้นในช่วงเวลา 06.00 น. ถึง 22.00 น. ของวันที่มีธุรกรรมสูงสุดในงวดข้อมูล | C | - | - | C | - |  |  |
| 17 | 1.8.6 | Monthly Average | Number | ค่าความสามารถของระบบงานเฉลี่ยตามแต่ละ Capacity Type ที่เกิดขึ้นในช่วงเวลา 06.00 น. ถึง 22.00 น. ในงวดข้อมูล | C | - | - | C | - |  |  |
| 18 | 1.8.7 | %Trigger | Percentage | ค่าระดับการแจ้งเตือนที่มีนัยสำคัญ เพื่อใช้ในการบริหารจัดการความสามารถระบบงานให้สามารถรองรับบริการได้อย่างต่อเนื่อง (คำนวณเป็น % เทียบกับ Max) | C | - | - | C | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** IT DC-DR

**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 |  | Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | M | - | - | M | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | M | - | Y |  |
| 3 | 1 | Site Details  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | Site Type | Classification Name | ประเภทศูนย์คอมพิวเตอร์ | M | - | - | M | - | Y | Site Type 2/: V\_DCDR |
| 5 | 1.2 | Tier Level | Classification Name | ระดับมาตรฐานของศูนย์คอมพิวเตอร์ (อ้างอิงตามมาตรฐาน Uptime Institute และ TIA-942) | M | - | - | M | - | Y | Tier Level 2/ |
| 6 | 1.3 | Standard | Description | มาตรฐานการออกแบบศูนย์คอมพิวเตอร์ ที่ผ่านการรับรองและตรวจสอบตามมาตรฐานอุตสาหกรรม | M | - | - | M | - |  |  |
| 7 | 1.4 | Year of start date | Date | ปีที่เริ่มใช้งานศูนย์คอมพิวเตอร์ โดยระบุเป็นวันสิ้นปีตามปฏิทิน | M | - | - | M | - |  |  |
| 8 | 1.5 | Number of Facility Failure (Impacted) | Number | จำนวนครั้งที่สาธารณูปโภคพื้นฐานภายในศูนย์คอมพิวเตอร์ หรือปัจจัยภายนอก ที่ส่งผลกระทบให้ศูนย์คอมพิวเตอร์ขัดข้อง และส่งผลต่อการให้บริการลูกค้าของสถาบันการเงิน | M | - | - | M | - |  |  |
| 9 | 1.6 | Number of Facility Failure (Non-Impacted) | Number | จำนวนครั้งที่สาธารณูปโภคพื้นฐานภายในศูนย์คอมพิวเตอร์ แต่ไม่ส่งผลต่อการให้บริการลูกค้าของสถาบันการเงิน | M | - | - | M | - |  |  |
| 10 | 1.7 | Data Center Operation Type | Classification Name | ประเภทการบริหารจัดการศูนย์คอมพิวเตอร์ | M | - | - | M | - | Y | Data Center Operation Type 2/ |
| 11 | 1.8 | Vendor Unique Id | Identification Number | รหัสของผู้ให้บริการศูนย์คอมพิวเตอร์ | C | - | - | C | - | Y |  |
| 12 | 1.9 | Vendor Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของผู้ให้บริการศูนย์คอมพิวเตอร์ | C | - | - | C | - | Y | Unique Id Type 1/ |
| 13 | 1.10 | Vendor Name | Long Name | ผู้ให้บริการศูนย์คอมพิวเตอร์ | C | - | - | C | - |  |  |
| 14 | 1.11 | Country | Classification | ประเทศที่ตั้งของศูนย์คอมพิวเตอร์ | M | - | - | M | - | Y | Country ID 1/ |
| 15 | 1.12 | Location | Description | รายละเอียดที่อยู่ของศูนย์คอมพิวเตอร์ | M | - | - | M | - |  |  |
| 16 | 1.13 | Location Code | Classification Name | รหัสตำบล อำเภอ จังหวัดที่ตั้งศูนย์คอมพิวเตอร์ | C | - | - | C | - | Y | Location Code 3/ |
| 17 | 1.14 | State/City/Province | Long Name | รัฐหรือเมืองที่ตั้งของศูนย์คอมพิวเตอร์ | C | - | - | C | - | Y |  |
| 18 | 1.15 | Distance Between DC & DR | Amount | ระยะห่างระหว่างศูนย์คอมพิวเตอร์หลักที่ประมวลผลระบบงานหลัก (Core Banking System) และศูนย์คอมพิวเตอร์สำรอง (หน่วย: กิโลเมตร) | O | - | - | O | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

3/ อ้างอิงจากเอกสาร รหัสที่ตั้ง (Location Code) บน BOT Website ภายใต้หัวข้อ รหัสมาตรฐาน

### **Data Set:** IT Infrastructure

**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 | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | M | - | Y |  |
| 3 | 1 | Site Details  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | Site Type | Classification Name | ประเภทศูนย์คอมพิวเตอร์ | M | - | - | M | - | Y | Site Type 2/ : V\_Infra |
| 5 | 1.2 | Operating System Type | Classification Name | ประเภทของระบบปฏิบัติการ | M | - | - | M | - | Y | Operating System Type 2/ |
| 6 | 1.3 | Total Server | Number | จำนวน Logical Server ที่ตั้งอยู่บนศูนย์คอมพิวเตอร์ | M | - | - | M | - |  |  |
| 7 | 1.4 | Number of End-of-Support Server | Number | จำนวน Logical Server ที่ End-of-Support ที่ตั้งอยู่บนศูนย์คอมพิวเตอร์ | M | - | - | M | - |  |  |
| 8 | 1.5 | Number of Unpatched Server | Number | จำนวน Logical Server ที่ติดตั้ง Security Patch ล่าช้ากว่ากำหนด โดยพิจารณาตามนโยบายการบริหารจัดการ Patch ของสถาบันการเงิน | M | - | - | M | - |  |  |

หมายเหตุ:

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** IT Project

**Frequency: Quarterly**

| **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 | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | M | - | Y |  |
| 3 | 1 | Project Details  กรณีมีค่า มีได้มากกว่า 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | Project Reference Id | Identification Number | รหัสอ้างอิงโครงการ ของสถาบันการเงิน | M | - | - | M | - | Y |  |
| 5 | 1.2 | Project Name | Long Name | ชื่อโครงการ | M | - | - | M | - |  |  |
| 6 | 1.3 | Description | Description | ลักษณะและขอบเขตของโครงการ | M | - | - | M | - |  |  |
| 7 | 1.4 | Project Type | Classification Name | ประเภทโครงการ | M | - | - | M | - |  | Project Type 2/ |
| 8 | 1.5 | Project Sandbox Type | Classification Name | ประเภท Sandbox ที่เข้ารับการทดสอบ | M | - | - | M | - |  | Project Sandbox Type 2/ |
| 9 | 1.6 | Budget (Millions Baht) | Amount | งบประมาณของทั้งโครงการตามที่ได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการที่เกี่ยวข้อง โดยไม่รวมค่าบริการดูแลและบำรุงรักษา (Maintenance Service Agreement) (หน่วย: ล้านบาท) | M | - | - | M | - |  |  |
| 10 | 1.7 | Technology | Description | เทคโนโลยีที่ใช้ในโครงการ | O | - | - | O | - |  |  |
| 11 | 1.8 | Project Status | Classification Name | สถานะของโครงการ | M | - | - | M | - |  | Status 2/: V\_Project |
| 12 | 1.9 | Project Start Date | Date | วันที่เริ่มต้นโครงการ | M | - | - | M | - |  |  |
| 13 | 1.10 | Project Service Date | Date | วันที่เริ่มให้บริการหรือวันที่ใช้งาน | M | - | - | M | - |  |  |
| 14 | 1.11 | Third Party  กรณีมีค่า มีได้มากกว่า 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 15 | 1.11.1 | Third Party Unique Id | Identification Number | รหัสของบุคคลภายนอกที่เป็นผู้ให้บริการ | M | - | - | M | - | Y |  |
| 16 | 1.11.2 | Third Party Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของบุคคลภายนอกที่เป็นผู้ให้บริการ | M | - | - | M | - | Y | Unique Id Type 1/ |
| 17 | 1.11.3 | Third Party Name | Long Name | ชื่อจดทะเบียนของบุคคลภายนอกที่เป็นผู้ให้บริการ | M | - | - | M | - |  |  |
| 18 | 1.11.4 | Scope of Work | Description | ขอบเขตงานที่บุคคลภายนอกเป็นผู้ให้บริการ | M | - | - | M | - |  |  |
| 19 | 1.11.5 | Relationship | Classification Name | ความเกี่ยวข้องของสถาบันการเงินกับบุคคลภายนอกที่เป็นผู้ให้บริการ | M | - | - | M | - |  | Relationship 2/ |
| 20 | 1.11.6 | Registered Country | Classification Name | ประเทศที่ตั้งตามที่จดทะเบียนของบุคคลภายนอกที่เป็นผู้ให้บริการ | M | - | - | M | - |  | Country ID 1/ |
| 21 | 1.11.7 | DC Country | Classification | ประเทศที่ตั้งของศูนย์คอมพิวเตอร์หลักเฉพาะการให้บริการทางด้าน IT ของบุคคลภายนอก | O | - | - | O | - |  | Country ID 1/ |
| 22 | 1.11.8 | DR Country | Classification | ประเทศที่ตั้งของศูนย์คอมพิวเตอร์สำรองเฉพาะการให้บริการทางด้าน IT ของบุคคลภายนอก | O | - | - | O | - |  | Country ID 1/ |
| 23 | 1.11.9 | Certificate | Description | เอกสารการรับรองมาตรฐานสากลเฉพาะการให้บริการด้าน IT ของบุคคลภายนอก | O | - | - | O | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** IT Staff

**Frequency: Quarterly**

| **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 | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | M | - | Y |  |
| 3 | 1 | Job Function Details  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | IT Job Function | Classification Name | ประเภทหน้าที่งานด้าน IT | M | - | - | M | - | Y | IT Job Function 2/ |
| 5 | 1.2 | IT Resource Details  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 6 | 1.2.1 | Resource Type | Classification Name | ประเภทของบุคลากร | M | - | - | M | - | Y | Resource Type 2/ |
| 7 | 1.2.2 | Department Name / Outsource Company Name | Long Name | ชื่อฝ่ายงานของสถาบันการเงินหรือชื่อผู้ให้บริการภายนอกที่เกี่ยวข้องตาม IT Job Function | M | - | - | M | - | Y |  |
| 8 | 1.2.3 | Number of Employees (Manpower) | Number | อัตรากำลังตาม IT Job Function | M | - | - | M | - |  |  |
| 9 | 1.2.4 | Number of Employees (Actual) | Number | จำนวนพนักงานจริงในปัจจุบันตาม IT Job Function | M | - | - | M | - |  |  |
| 10 | 1.2.5 | Number of Employees with Certificate | Number | จำนวนพนักงานที่ได้รับการรับรองมาตรฐานสากลเฉพาะที่เกี่ยวข้องกับงาน IT ตาม IT Job Function | M | - | - | M | - |  |  |
| 11 | 1.2.6 | Number of Resigned Employees | Number | จำนวนพนักงานที่ลาออกสะสมในงวดที่รายงานตาม IT Job Function | M | - | - | M | - |  |  |
| 12 | 1.2.7 | Number of Transferred-out Employees | Number | จำนวนพนักงานที่ย้ายออกสะสมในงวดที่รายงานตาม IT Job Function | M | - | - | M | - |  |  |

หมายเหตุ:

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** IT System Profile

**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 |  | Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | M | - | - | M | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | M | - | Y |  |
| 3 | 1 | System Details  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | System | Classification Name | กลุ่มระบบงานสำคัญ | M | - | - | M | - | Y | System 2/ |
| 5 | 1.2 | System Name | Long Name | ชื่อระบบงาน | M | - | - | M | - | Y |  |
| 6 | 1.3 | Scope of Service | Description | ขอบเขตการทำงานและการให้บริการของระบบงาน | M | - | - | M | - |  |  |
| 7 | 1.4 | Recovery Time Objective | Number | ระยะเวลาในการกู้คืนระบบตามที่สถาบันการเงินกำหนด (หน่วย: นาที) | M | - | - | M | - |  |  |
| 8 | 1.5 | Server Details  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 9 | 1.5.1 | Server Tier | Classification Name | ประเภทชุดของ Server | M | - | - | M | - | Y | Server Tier 2/ |
| 10 | 1.5.2 | Operating System | Description | ชื่อระบบปฏิบัติการของชุด Server ที่ใช้ในระบบงาน | M | - | - | M | - |  |  |
| 11 | 1.5.3 | Software | Description | ชื่อซอฟต์แวร์หรือแอพพลิเคชั่นที่ใช้ในระบบงาน | M | - | - | M | - |  |  |
| 12 | 1.5.4 | Number of Logical Server | Number | จำนวน Logical Server ที่ใช้ในการทำงานของระบบงาน | M | - | - | M | - |  |  |
| 13 | 1.5.5 | Same-Site Clustering | Classification Name | รูปแบบการทำงานร่วมกันของชุด Server ในศูนย์คอมพิวเตอร์หลัก | M | - | - | M | - |  | Clustering Type 2/: V\_Same\_Site |
| 14 | 1.5.6 | Multi-Site Clustering | Classification Name | รูปแบบการทำงานร่วมกันของชุด Server ที่อยู่ในศูนย์คอมพิวเตอร์หลักและศูนย์คอมพิวเตอร์สำรอง | M | - | - | M | - |  | Clustering Type 2/: V\_Multi\_Site |

หมายเหตุ:

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** Technology Implementation

**Frequency: Quarterly**

| **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 | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | M | - | Y |  |
| 3 | 1 | Technology Details  กรณีมีค่า มีได้มากกว่า 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | Technology Category | Classification Name | ประเภทเทคโนโลยีที่นำมาใช้ | M | - | - | M | - | Y | Technology Category 2/ |
| 5 | 1.2 | Technology Type | Classification Name | รูปแบบของเทคโนโลยีที่นำมาใช้ | C | - | - | C | - | Y | Technology Type2/ |
| 6 | 1.3 | Business Case | Classification Name | รูปแบบทางธุรกิจที่นำเทคโนโลยีมาใช้ | M | - | - | M | - | Y | Business Case 2/ |
| 7 | 1.4 | System Reference Id | Identification Number | รหัสอ้างอิงระบบงาน ของสถาบันการเงิน ที่นำเทคโนโลยีมาใช้ | M | - | - | M | - | Y |  |
| 8 | 1.5 | System Name | Long Name | ชื่อระบบงานที่นำเทคโนโลยีมาใช้ | M | - | - | M | - |  |  |
| 9 | 1.6 | Description | Description | รายละเอียดของการนำเทคโนโลยีใหม่มาใช้ | M | - | - | M | - |  |  |
| 10 | 1.7 | Start Date | Date | วันที่เริ่มโครงการ/วันที่เริ่ม POC | M | - | - | M | - |  |  |
| 11 | 1.8 | Planned Release Date | Date | วันที่เริ่มใช้ระบบงานตามแผนงาน | M | - | - | M | - |  |  |
| 12 | 1.9 | Technology Status | Classification Name | สถานะระบบงานที่นำเทคโนโลยีใหม่มาใช้ | M | - | - | M | - |  | Status 2/: V\_Technology |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Risk Management Classification Document

### **Data Set:** Third Party

**Frequency: Quarterly**

| **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 | - | Y |  |
| 2 |  | Organization Id | FI Code | รหัสผู้ส่งข้อมูล | M | - | - | M | - | Y |  |
| 3 | 1 | Third Party Details  กรณีมีค่า มีได้มากกว่า 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 | 1.1 | Third Party Unique Id | Identification Number | รหัสของบุคคลภายนอก | M | - | - | M | - | Y |  |
| 5 | 1.2 | Third Party Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของบุคคลภายนอก | M | - | - | M | - | Y | Unique Id Type 1/ |
| 6 | 1.3 | Third Party Name | Long Name | ชื่อจดทะเบียนของบุคคลภายนอก | M | - | - | M | - |  |  |
| 7 | 1.4 | Relationship | Classification Name | ความเกี่ยวข้องของสถาบันการเงินกับบุคคลภายนอก | M | - | - | M | - |  | Relationship 2/ |
| 8 | 1.5 | Registered Country | Classification | ประเทศที่ตั้งตามที่จดทะเบียนของบุคคลภายนอก | M | - | - | M | - |  | Country ID 1/ |
| 9 | 1.6 | Third Party Type Details  ต้องมีค่าอย่างน้อย 1 ชุด |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 10 | 1.6.1 | Third Party Type | Classification Name | ประเภทการให้บริการและการเชื่อมต่อระบบจากบุคคลภายนอก | M | - | - | M | - | Y | Third Party Type 2/ |
| 11 | 1.6.2 | Work Type | Classification Name | ประเภทงานที่ให้บริการโดยผู้ให้บริการภายนอก | C | - | - | C | - | Y | Work Type 2/ |
| 12 | 1.6.3 | Integration Type | Classification Name | ประเภทการเชื่อมต่อระบบกับบุคคลภายนอก | M | - | - | M | - | Y | Integration Type 2/ |
| 13 | 1.6.4 | Scope of work Description | Description | คำอธิบายเพิ่มเติมถึงขอบเขตของการให้บริการและการเชื่อมต่อระบบจากบุคคลภายนอก | M | - | - | M | - |  |  |
| 14 | 1.6.5 | Service Start Date | Date | วันทีเริ่มใช้บริการ | M | - | - | M | - |  |  |
| 15 | 1.6.6 | Service End Date | Date | วันที่สิ้นสุดการใช้บริการ | C | - | - | C | - |  |  |
| 16 | 1.6.7 | Service Risk Level | Classification Name | ระดับความเสี่ยง จากการใช้บริการการเชื่อมต่อระบบจากบุคคลภายนอก | M | - | - | M | - |  | Risk Level 2/ |
| 17 | 1.6.8 | Service SLA | Classification Name | ผลการปฏิบัติงานตามข้อตกลง (SLA) ที่กำหนดในสัญญาที่ทำกับบุคคลภายนอก | M | - | - | M | - |  | SLA Performance 2/ |
| 18 | 1.6.9 | Cloud Type | Classification Name | รูปแบบการใช้บริการของ Cloud | M | - | - | M | - |  | Cloud Type 2/ |
| 19 | 1.6.10 | Data Center Country | Description | รหัสประเทศที่ตั้ง (อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification) ของศูนย์คอมพิวเตอร์หลัก และศูนย์คอมพิวเตอร์สำรองของบุคคลภายนอก | C | - | - | C | - |  |  |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification

2/ อ้างอิงจากเอกสาร Draft TRM 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' |
| Text | VarChar(4000) | AAAA | No leading zeroes/blanks | 'XXX111' |
| Long Text | VarChar(8000) | 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’ |