

RISK MANAGEMENT DATA SET MANUAL

(คู่มือการจัดทำชุดข้อมูลการบริหารความเสี่ยง

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 | Second version | Yes |

**Table of Contents**

[1. Document Overview 4](#_Toc4146819)

[2. Dataset Reporting Guideline: 5](#_Toc4146820)

[1. แนวทางการตั้งชื่อ Dataset ตามมาตรฐาน ธปท. : 5](#_Toc4146821)

[2. แนวทางการจัดทำชุดข้อมูล 5](#_Toc4146822)

[3. Data Set Details 6](#_Toc4146823)

[1. Subject Area: Asset & Liability Management 6](#_Toc4146824)

[1. Data Set: ข้อมูลวงเงินที่ได้รับจากคู่ค้า 6](#_Toc4146825)

[2. Data Set: ข้อมูล Risk Limit และ Trigger ที่สถาบันการเงินใช้บริหารสินทรัพย์และหนี้สิน 9](#_Toc4146826)

[2. Subject Area: Strategic Risk 12](#_Toc4146827)

[1. Data Set: ข้อมูลเป้าหมายทางการเงินของสถาบันการเงิน 12](#_Toc4146828)

[3. Subject Area: Market Risk 15](#_Toc4146829)

[1. Data Set: Value at Risk 15](#_Toc4146830)

[2. Data Set: Greek 19](#_Toc4146831)

[3. Data Set: IR PV01 22](#_Toc4146832)

[4. Data Set: Credit Valuation Adjustment 26](#_Toc4146833)

# Document Overview

This document provides information on the Data Set(s) to be submitted to the Bank of Thailand (BOT). The Data Set(s) will be electronically submitted to BOT via DMS Data Acquisition (Extranet/Internet).

**Description:**

* **Schema Validation**: Check the XML file content against XML schema to verify whether it is conform to the defined structure. The Schema Validation rules are as follows: **XML Syntax, XML Structure, Data Type, Value List and Data Format**. The Data Element and Data Type are specified in the Data Set Document while the Data Format is defined in the Data Set Manual i.e. Date Format. The Value Lists of each Data Element are referred to in the Data Set Document by using classification name and view name while the complete list of classification and view are shown in the Classification Document.
* **File Validation:** Validate by using Excel validation rules or an application developed on BOT excel template. In the case where the file is in other formats such as text file, the file validation will be done by BOT internal system. The File Validation rules are as follows: **Data Element, Data Type, Value List and Data Format**. The Data Element, Data Type, Value List and Data Format for the file are specified in the same pattern as XML Data Set, in the Data Set Document, Data Set Manual and Classification Document.
* **Data Set Validation**: Validate the data set content by BOT internal system after schema validation or file validation is completed. (Specific validation rule will explain in each data set.)
* **Cross Validation:** Check data consistency between data sets. (Specific validation rule will explain in each data set.)

# Dataset Reporting Guideline:

## แนวทางการตั้งชื่อ Dataset ตามมาตรฐาน ธปท. :

รูปแบบ FXXXNn\_YYYYMMDD\_ZZZ.xlsx

F ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

XXX Subject Area

Nn รหัสประจำตัวผู้ส่งข้อมูล เช่น 999

YYYY ปีของข้อมูลให้ใช้ปี ค.ศ. 4 หลัก เช่น 2019 เป็นต้น

MM เดือนของข้อมูล มีค่าระหว่าง 01-12

DD วันที่ในเดือน มีค่าระหว่าง 01 - 31

ZZZ ชื่อย่อชุดข้อมูล

.xlsx นามสกุลชุดข้อมูล

เช่น ต้องการส่งข้อมูลงวด เดือนมกราคม ปี 2562 ให้ตั้งชื่อ File ดังนี้ MXXX999\_20190131\_ZZZ.xlsx

## แนวทางการจัดทำชุดข้อมูล

1. ให้จัดทำข้อมูลโดยยึดตามนิยามในเอกสาร Risk Management Data Set Document, Risk Management Data Set Manual และ Risk Management Classification Document
2. จัดทำชุดข้อมูลบน Excel File ตามรูปแบบที่กำหนดโดย Excel Template เผยแพร่บน BOT Website รองรับ Excel ตั้งแต่ Version 2007
3. ห้ามแก้ไขรูปแบบและสูตรที่ปรากฏในแบบฟอร์มรายงาน

# Data Set Details

## Subject Area: Asset & Liability Management

### Data Set: ข้อมูลวงเงินที่ได้รับจากคู่ค้า

**คำอธิบาย**

Data Set ชุดข้อมูลวงเงินที่ได้รับจากคู่ค้า เป็นการรายงานข้อมูลวงเงินกู้ยืมที่สถาบันการเงินได้รับจากคู่ค้า (Committed Credit Line) ทั้งที่เป็นเงินสกุลบาท และเงินสกุลต่างประเทศ กรณีสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ให้รายงานวงเงินกู้ยืม และยอดคงค้างที่ได้รับจากสำนักงานใหญ่ และสาขาอื่นด้วย

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ในต่างประเทศที่เป็นบริษัทลูกของสถาบันการเงินไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 สาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ  
 บริษัทเงินทุน  
 บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

**Data Set Name**

MALMNn\_YYYYMMDD\_CCL.xlsx

**Data Sheet Name**

Committed Credit Line

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล | Data Set Validation:  วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Creditor Unique Id | รหัสของผู้ให้วงเงิน |  |
| Creditor Unique Id Type | ประเภทรหัสของผู้ให้วงเงิน |  |
| Creditor Country Code | รหัสประเทศตามถิ่นที่อยู่ของผู้ให้วงเงิน |  |
| Creditor Name | ชื่อนิติบุคคลของผู้ให้วงเงิน |  |
| Creditor Involved Party Type ID | ประเภทของผู้ให้วงเงิน |  |
| Remaining Term Range | ระยะเวลาคงเหลือ |  |
| Currency | รหัสสกุลเงิน |  |
| Credit Line Amount in Original Currency | วงเงิน (ตามสกุลเงิน) | Data Set Validation:  มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |
| Credit Line Amount in Baht | วงเงิน (สกุลเงินบาท) | Data Set Validation:  มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |
| Outstanding Amount in Original Currency | ยอดคงค้าง (ตามสกุลเงิน) |  |
| Outstanding Amount in Baht | ยอดคงค้าง (สกุลเงินบาท) |  |
| Remark | หมายเหตุ |  |

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

**คำอธิบาย**

Data Set ชุดข้อมูล Risk Limit และ Trigger ที่สถาบันการเงินใช้บริหารสินทรัพย์และหนี้สิน เป็น ข้อมูล Indicator ต่าง ๆ ที่สถาบันการเงิน ใช้ในการบริหารสินทรัพย์และหนี้สินในปัจจุบัน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 สาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ  
 บริษัทเงินทุน   
 บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

**Data Set Name**

MALMNn\_YYYYMMDD\_RLT.xlsx

**Data Sheet Name**

Risk Limit Trigger

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล | Data Set Validation:  วันที่ต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Indicator | ประเภท Indicator |  |
| Indicator Description | รายละเอียดสูตรการคำนวณ Indicator | Data Set Validation:  ต้องรายงานเมื่อ Indicator มีค่าดังนี้   1. L/D Ratio (%) 2. L/D +BE (%) 3. Top 20 Funding / Total Funding |
| Level of Limit & Trigger | ระดับของ Limit และ Trigger  ถ้าสถาบันการเงินกำหนด Limit และ Trigger ไว้มากกว่า 1 ระดับ ให้รายงาน Limit และ Trigger ทุกระดับ | Data Set Validation:  มีค่ามากกว่าศูนย์ |
| Limit in Baht | ค่า Limit รายงานเป็นจำนวนเงิน (ล้านบาท) | Data Set Validation:  Limit in Baht หรือ Limit in % ค่าใดค่าหนึ่ง ต้องมีค่า หรือมีค่าทั้งสองค่าได้ กรณีมีค่า ต้องมากกว่าศูนย์ |
| Limit in % | ค่า Limit รายงานเป็น % | Data Set Validation:  Limit in Baht หรือ Limit in % ค่าใดค่าหนึ่ง ต้องมีค่า หรือมีค่าทั้งสองค่าได้ กรณีมีค่า ต้องมากกว่าศูนย์ |
| Trigger in Baht | ค่า Trigger รายงานเป็นจำนวนเงิน (ล้านบาท) | Data Set Validation:  Trigger in Baht หรือ Trigger in % ค่าใดค่าหนึ่ง ต้องมีค่า หรือมีค่าทั้งสองค่าได้ กรณีมีค่า ต้องมากกว่าศูนย์ |
| Trigger in % | ค่า Trigger รายงานเป็น % | Data Set Validation:  Trigger in Baht หรือ Trigger in % ค่าใดค่าหนึ่ง ต้องมีค่า หรือมีค่าทั้งสองค่าได้ กรณีมีค่า ต้องมากกว่าศูนย์ |
| Outstanding Amount in Baht | จำนวนเงิน (ล้านบาท) | Data Set Validation:  Outstanding Amount in Baht หรือ Outstanding Amount in % ค่าใดค่าหนึ่ง ต้องมีค่า หรือมีค่าทั้งสองค่าได้ กรณีมีค่า ต้องมากกว่าศูนย์ |
| Outstanding Amount in % | จำนวนเงิน (%) | Data Set Validation:  Outstanding Amount in Baht หรือ Outstanding Amount in % ค่าใดค่าหนึ่ง ต้องมีค่า หรือมีค่าทั้งสองค่าได้ กรณีมีค่า ต้องมากกว่าศูนย์ |
| Remark | หมายเหตุ |  |

## Subject Area: Strategic Risk

### Data Set: ข้อมูลเป้าหมายทางการเงินของสถาบันการเงิน

**คำอธิบาย**

Data Set ชุดข้อมูลเป้าหมายทางการเงินของสถาบันการเงิน เป็นข้อมูลเป้าหมายการดำเนินธุรกิจประจำปีของสถาบันการเงินตามที่ได้รับอนุมัติจากคณะกรรมการธนาคาร หรือคณะกรรมการบริหาร หรือสำนักงานใหญ่ ของสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ แล้วแต่กรณี ได้แก่ เป้าหมายการเงินให้สินเชื่อ แบ่งเป็น เงินให้สินเชื่อรวม เงินให้สินเชื่อแยกตามขนาดธุรกิจ เช่น สินเชื่อ Corporate สินเชื่อ SMEs สินเชื่อที่อยู่อาศัย สินเชื่อเช่าซื้อ สินเชื่อบัตรเครดิต และสินเชื่อส่วนบุคคล เป็นต้น เป้าหมายเงินรับฝาก เป้าหมายเงินกู้ยืม เป้าหมายกำไรสุทธิ เป้าหมายเงินกองทุน เป้าหมายอัตราส่วนที่สำคัญ ได้แก่ NPL ROA ROE และ BIS Ratio เป็นต้น

ทั้งนี้ การจัดประเภทเงินให้สินเชื่อแยกตามขนาดธุรกิจ (สินเชื่อ Corporate สินเชื่อ SMEs และ สินเชื่อ Retail) ให้ใช้ตามคำจำกัดความที่สถาบันการเงินใช้ภายใน พร้อมทั้งให้รายงานคำอธิบายความหมายของสินเชื่อแต่ละประเภทด้วย

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 สาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ  
 บริษัทเงินทุน   
 บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

**ลักษณะข้อมูล**

รายปี

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นปีบัญชี และ/หรือเมื่อมีการเปลี่ยนแปลง

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 3 เดือนนับจากวันสิ้นปีบัญชี กรณีที่มีการทบทวนเป้าหมายและมีการเปลี่ยนแปลง ให้รายงานภายใน 1 เดือน นับจากวันที่ได้รับอนุมัติ

**Data Set Name**

YSTGNn\_YYYYMMDD\_FTG.xlsx

**Data Sheet Name**

Financial Targets

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล | Data Set Validation:  วันที่ต้องเป็นวันที่ตามปีปฏิทิน |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน | Data Set Validation:  ตรวจสอบความสอดคล้องระหว่างชุดข้อมูล FI Reporting Group Id กับ กลุ่มสถาบันการเงิน |
| Target Type | เป้าหมายทางการเงิน |  |
| Description | คำอธิบายเป้าหมายทางการเงิน |  |
| Definition of Target | ความหมายของรายการตามคำจำกัดความของธนาคาร | Data Set Validation:  ต้องมีค่า เมื่อ Target Type มีค่าดังนี้   1. Growth Corporate loans (excluded Interbank) 2. Growth SMEs loans (excluded Interbank) 3. Growth Retail loans 4. Non interest income |
| Target Amount | เป้าหมาย (ล้านบาท) | Data Set Validation:  กรณีที่ Target Amount ของ Target Type ดังต่อไปนี้  Hire purchase loans, Growth Housing loans, Growth Credit card, Growth Personal loans รายการใดรายการหนึ่งมีค่ามากกว่าศูนย์ Target Amount ของ Target Type เท่ากับ Growth Retail loans ต้องมีค่าเสมอ |
| Target Percentage | เป้าหมาย (%) | Data Set Validation:  กรณีที่ Target Percentage ของ Target Type ดังต่อไปนี้  Hire purchase loans, Growth Housing loans, Growth Credit card, Growth Personal loans รายการใดรายการหนึ่งมีค่ามากกว่าศูนย์ Target Percentage ของ Target Type เท่ากับ Growth Retail loans ต้องมีค่าเสมอ |

## Subject Area: Market Risk

### Data Set: Value at Risk

**คำอธิบาย**

Data Set ข้อมูล Value at Risk ของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า แบ่งตามประเภทของ Risk Factor หรือ Trading Desk

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 สาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ  
**ลักษณะข้อมูล**

รายวัน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นสัปดาห์

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 5 วันทำการ นับจากวันสิ้นสัปดาห์ที่รายงาน

**Data Set Name**

WMKTNn\_YYYYMMDD\_VAR.xlsx

**Data Sheet Name**

VaR

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล | Data Set Validation:  วันที่ของชุดข้อมูลเป็นวันศุกร์ของสัปดาห์ หากตรงกับวันหยุดให้รายงานวันศุกร์ของสัปดาห์ |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน | Data Set Validation:  ตรวจสอบความสอดคล้องระหว่างชุดข้อมูล FI Reporting Group Id กับ กลุ่มสถาบันการเงิน |
| Calculation Date | วันที่คำนวณค่า Value at Risk | Data Set Validation:  ต้องเป็นวันทำการ และต้องมีวันที่ครบทุกวันทำการของสัปดาห์ที่รายงาน |
| Monitoring Currency | รหัสสกุลเงินที่สถาบันการเงินใช้ในการติดตามความเสี่ยง | Data Set Validation:  ต้องเป็นสกุลเดียวกันในวันที่คำนวณค่า Value at Risk วันเดียวกัน |
| VaR Value Type | ประเภทของค่า Value at Risk |  |
| VaR Approach | วิธีที่ใช้ในการคำนวณค่า Value at Risk |  |
| VaR Holding Period | ระยะเวลาถือครองที่กำหนดของแบบจำลอง Value at Risk (หน่วย: วัน) | Data Set Validation:  ต้องมีค่ามากกว่าศูนย์ |
| VaR Confidence Level | ระดับความเชื่อมั่นที่กำหนดของแบบจำลอง Value at Risk (หน่วย: ร้อยละ) | Data Set Validation:  ต้องมีค่ามากกว่า 0 และน้อยกว่า 100 |
| VaR Type | รูปแบบการคำนวณค่า VaR |  |
| General Market Risk Factor Type | ประเภทของ Risk Factor ตามที่กำหนด | Data Set Validation:  การรายงานต้องเป็นไปตามรูปแบบ ดังนี้   1. กรณี VaR Type มีค่าเป็น General Market Risk Factor ต้องรายงาน General Market Risk Factor Type และไม่ต้องรายงาน Other Market Risk Factor Type Name, Other Market Risk Factor Type Description, Trading Desk Name และ Trading Desk Description ใน row เดียวกัน 2. กรณี VaR Type มีค่าเป็น Other Market Risk Factor ต้องรายงาน Other Market Risk Factor Type Name, Other Market Risk Factor Risk Type Description และไม่ต้องรายงาน General Market Risk Factor Type, Trading Desk Name และ Trading Desk Description ใน row เดียวกัน 3. กรณี VaR Type มีค่าเป็น Trading Desk ต้องรายงาน Trading Desk Name และ Trading Desk Description และไม่ต้องรายงาน General Market Risk Factor Type, Other Market Risk Factor Type Name และ Other Market Risk Factor Type Description ใน row เดียวกัน |
| Other Market Risk Factor Type Name | ชื่อประเภทของ Risk Factor อื่น |
| Other Market Risk Factor Type Description | คำอธิบายประเภทของ Risk Factor อื่น |
| Trading Desk Name | ชื่อของ Trading Desk |
| Trading Desk Description | คำอธิบาย Trading Desk |
| VaR Value | มูลค่า Value at Risk ของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า | Data Set Validation:  มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |

### Data Set: Greek

**คำอธิบาย**

Data Set ข้อมูล Greek Limit และค่า Actual Greek ของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า แบ่งตามประเภทของ Risk Factor

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 สาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ  
**ลักษณะข้อมูล**

รายวัน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นสัปดาห์

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 5 วันทำการ นับจากวันสิ้นสัปดาห์ที่รายงาน

**Data Set Name**

WMKTNn\_YYYYMMDD\_GRK.xlsx

**Data Sheet Name**

Greek

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล | Data Set Validation:  วันที่ของชุดข้อมูลเป็นวันศุกร์ของสัปดาห์ หากตรงกับวันหยุดให้รายงานวันศุกร์ของสัปดาห์ |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน | Data Set Validation:  ตรวจสอบความสอดคล้องระหว่างชุดข้อมูล FI Reporting Group Id กับ กลุ่มสถาบันการเงิน |
| Calculation Date | วันที่คำนวณค่า Greek | Data Set Validation:  ต้องเป็นวันทำการ และต้องมีวันที่ครบทุกวันทำการของสัปดาห์ที่รายงาน |
| Monitoring Currency | รหัสสกุลเงินที่สถาบันการเงินใช้ในการติดตามความเสี่ยง |  |
| Greek Type | ประเภทของ Greek |  |
| Greek Value Type | ประเภทของค่า Greek |  |
| Market Risk Factor Type | ประเภทของ Risk Factor  กรณีที่ Greek Type มีค่าเป็น Delta ไม่ต้องรายงาน Market Risk Factor Type ที่มีค่าเป็น FX และ IR |  |
| FX Base Currency | รหัสสกุลเงินหลัก | Data Set Validation:  การรายงานต้องเป็นไปตามรูปแบบ ดังนี้   1. กรณีที่ Market Risk Factor Type มีค่าเป็น FX   ค่า FX Base Currency และ FX Quote Currency จะมีค่าหรือเป็นค่าว่างก็ได้ กรณีที่มีค่า ต้องมีค่าทั้งสองค่า   1. กรณีที่ Market Risk Factor Type มีค่าอื่น ๆ ที่ไม่ใช่ FX   ค่า FX Base Currency และ FX Quote Currency ต้องเป็นค่าว่าง |
| FX Quote Currency | รหัสสกุลเงินอ้างอิง |
| Greek Value | มูลค่า Position ตาม Greek Type  กรณี Greek Type มีค่าเป็น Delta  Greek Value คือ มูลค่าของ Position Delta เมื่อ Underlying Risk Factor เปลี่ยนแปลงไป (ตามสมมติฐานที่ ธพ. กำหนด)  กรณี Greek Type มีค่าเป็น Vega  Greek Value คือ มูลค่าของ Position Vega เมื่อ implied volatility ของ underlying เปลี่ยนแปลงไป (ตามสมมติฐานที่ ธพ. กำหนด) |  |

### Data Set: IR PV01

**คำอธิบาย**

Data Set ข้อมูล PV01 ของความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยของฐานะในบัญชีเพื่อค้า แบ่งตามสกุลเงิน และระยะเวลา (Tenor)

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 สาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

**ลักษณะข้อมูล**

รายวัน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นสัปดาห์

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 5 วันทำการ นับจากวันสิ้นสัปดาห์ที่รายงาน

**Data Set Name**

WMKTNn\_YYYYMMDD\_IRP.xlsx

**Data Sheet Name**

IR\_PV01

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล | Data Set Validation:  วันที่ของชุดข้อมูลเป็นวันศุกร์ของสัปดาห์ หากตรงกับวันหยุดให้รายงานวันศุกร์ของสัปดาห์ |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน | Data Set Validation:  ตรวจสอบความสอดคล้องระหว่างชุดข้อมูล FI Reporting Group Id กับ กลุ่มสถาบันการเงิน |
| Calculation Date | วันที่คำนวณค่า PV01 | Data Set Validation:  ต้องเป็นวันทำการ และต้องมีวันที่ครบทุกวันทำการของสัปดาห์ที่รายงาน |
| Monitoring Currency | รหัสสกุลเงินที่สถาบันการเงินใช้ในการติดตามความเสี่ยง | Data Set Validation:  ต้องเป็นสกุลเดียวกันในวันที่คำนวณค่า PV01 วันเดียวกัน |
| Limit | มูลค่า Limit รวมของ PV01 Trading Book | Data Set Validation:  การรายงานต้องเป็นไปตามรูปแบบ ดังนี้   1. มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ หรือเป็นค่าว่าง 2. ต้องเป็นค่าเดียวกันสำหรับวันที่คำนวณค่า PV01 วันเดียวกัน ทุก IR Curve และทุก Tenor สำหรับวันที่คำนวณ PV01 วันเดียวกัน |
| Curve Currency | รหัสสกุลเงินของผลิตภัณฑ์  กรณีคำนวณ PV01 รวมจากหลายสกุลเงิน ให้รายงานเป็น “XXX”  กรณีที่ IR Curve มีค่าเป็น Cross Currency Basis Curve ไม่ต้องรายงาน Curve Currency ที่เป็น USD | Data Set Validation:  กรณีที่ IR Curve มีค่าเป็น Cross Currency Basis Curve  ค่า Curve Currency ต้องไม่เท่ากับ USD |
| IR Curve | Interest Rate Curve ที่ใช้ในการคำนวณค่า PV01 |  |
| Tenor | ช่วงระยะเวลาของธุรกรรม เป็นระยะเวลาคงเหลือตามที่ธนาคารใช้ในการบริหารความเสี่ยง เช่น   * ข้อมูลมี Tenor เป็น 1 วัน ให้รายงานค่า Tenor เป็น “1” และรายงาน Tenor Unit เป็น “D” * ข้อมูลมีระยะเวลาคงเหลือ 4 ปี 4 เดือน โดยในการบริหารความเสี่ยงภายใน หากธนาคารแยกปันส่วน (Pro-rate) ข้อมูลจากธุรกรรมดังกล่าวลงในช่อง 4 ปี และ 5 ปี ให้รายงานค่า Tenor เป็น “4” และ “5” และรายงาน Tenor Unit เป็น “M” * ข้อมูลรวมทุก Tenor ที่มากกว่า Tenor สุดท้าย (เช่น มากกว่า 30 ปี) ให้รายงาน Tenor เป็น “>30” และ Tenor Unit เป็น “Y” * กรณี ธพ. ไม่ได้ติดตามความเสี่ยงโดยแบ่งตาม Tenor ไม่ต้องรายงานข้อมูล Tenor |  |
| Tenor Unit | หน่วยของช่วงระยะเวลาของธุรกรรม | Data Set Validation:  การรายงานต้องเป็นไปตามรูปแบบ ดังนี้   1. กรณีที่ Tenor มีค่า Tenor Unit ต้องไม่เป็นค่าว่าง 2. กรณีที่ Tenor เป็นค่าว่าง Tenor Unit ต้องเป็นค่าว่าง |
| PV01 Value | มูลค่าของ PV01 เมื่อ Underlying Factor เพิ่มขึ้น 1 basis point |  |

### Data Set: Credit Valuation Adjustment

**คำอธิบาย**

Data Set ข้อมูล Credit Valuation Adjustment (CVA) ของธุรกรรมอนุพันธ์ทางการเงิน

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ   
 สาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้นเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

**Data Set Name**

MMKTNn\_YYYYMMDD\_CVA.xlsx

**Data Sheet Name**

CVA

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล | Data Set Validation:  วันที่ของชุดข้อมูลเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน หากตรงกับวันหยุดให้รายงานวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| FI Reporting Group Id | ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน | Data Set Validation:  ตรวจสอบความสอดคล้องระหว่างชุดข้อมูล FI Reporting Group Id กับ กลุ่มสถาบันการเงิน |
| CVA Counterparty Type | ประเภทของ Counterparty |  |
| CVA Value | มูลค่า Credit Valuation Adjustment (หน่วย: บาท) | Data Set Validation:  มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |