

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 | 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](#_Toc11080975)

[2. Dataset Reporting Guideline: 5](#_Toc11080976)

[1. แนวทางการตั้งชื่อ Dataset ตามมาตรฐาน ธปท. : 5](#_Toc11080977)

[2. แนวทางการจัดทำชุดข้อมูล 5](#_Toc11080978)

[3. Data Set Details 6](#_Toc11080979)

[1. Subject Area: Asset & Liability Management and Liquidity Risk 6](#_Toc11080980)

[1. Data Set: ข้อมูลวงเงินที่ได้รับจากคู่ค้า 6](#_Toc11080981)

[2. Data Set: ข้อมูล Risk Limit และ Trigger ที่สถาบันการเงินใช้บริหารสินทรัพย์และหนี้สิน 9](#_Toc11080982)

[3. Data Set: Net Stable Funding Ratio Consolidated Basis 13](#_Toc11080983)

[2. Subject Area: Strategic Risk 21](#_Toc11080984)

[1. Data Set: ข้อมูลเป้าหมายทางการเงินของสถาบันการเงิน 21](#_Toc11080985)

[3. Subject Area: Market Risk 24](#_Toc11080986)

[1. Data Set: Value at Risk 24](#_Toc11080987)

[2. Data Set: Greek 28](#_Toc11080988)

[3. Data Set: IR PV01 31](#_Toc11080989)

[4. Data Set: Credit Valuation Adjustment 35](#_Toc11080990)

# 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 and Liquidity Risk

### 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)  กรณีที่ได้รับวงเงินแบบไม่จำกัดจำนวน ให้รายงานด้วยค่า 99999.99 | Data Set Validation:  มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์ |
| Credit Line Amount in Baht | วงเงิน (สกุลเงินบาท)  กรณีที่ได้รับวงเงินแบบไม่จำกัดจำนวน ให้รายงานด้วยค่า 99999.99 | 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 |
| Outstanding Amount in Mil. Baht | จำนวนเงิน (ล้านบาท) | Data Set Validation:  ต้องมีค่า เมื่อ Limit in Mil. Baht หรือ Trigger in Mil. Baht มีค่า |
| Outstanding Amount in % | จำนวนเงิน (%) | Data Set Validation:  ต้องมีค่า เมื่อ Limit in % หรือ Trigger in % มีค่า |
| Level of Limit | ระดับของ Limit  ให้รายงาน Limit ทุกระดับ เรียงตามลำดับความเข้ม โดยระดับ 1 คือ Limit ที่มีความเข้มสูงสุด | Data Set Validation:  ต้องมีค่ามากกว่าศูนย์ เมื่อ Limit in Mil. Baht หรือ Limit in % มีค่า |
| Comparison operator of Limit in Mil. Baht | เครื่องหมายของ Limit in Million Baht เช่น >, <=, =, <> | Data Set Validation:  ต้องมีค่า เมื่อ Limit in Mil. Baht มีค่า |
| Limit in Mil. Baht | ค่า Limit รายงานเป็นจำนวนเงิน (ล้านบาท) | Data Set Validation:  Limit in Mil. Baht, Limit in %, Trigger in Mil. Baht หรือ Trigger in % อย่างน้อยค่าใดค่าหนึ่งต้องมีค่า |
| Condition of Limit | เงื่อนไขระหว่าง Limit in Million Baht และ Limit in % | Data Set Validation:  ต้องมีค่า เมื่อ Limit in Mil. Baht และ Limit in % มีค่า |
| Comparison operator of Limit in % | เครื่องหมายของ Limit in % เช่น >, <=, =, <> | Data Set Validation:  ต้องมีค่า เมื่อ Limit in % มีค่า |
| Limit in % | ค่า Limit รายงานเป็น % | Data Set Validation:  Limit in Mil. Baht, Limit in %, Trigger in Mil. Baht หรือ Trigger in % อย่างน้อยค่าใดค่าหนึ่งต้องมีค่า |
| Level of Trigger | ระดับของ Trigger  ให้รายงาน Trigger ทุกระดับ เรียงตามลำดับความเข้ม โดยระดับ 1 คือ Trigger ที่มีความเข้มสูงสุด | Data Set Validation:  ต้องมีค่ามากกว่าศูนย์ เมื่อ Trigger in Mil. Baht หรือ Trigger in % มีค่า |
| Comparison operator of Trigger in Mil.Baht | เครื่องหมายของ Trigger in Million Baht เช่น >, <=, =, <> | Data Set Validation:  ต้องมีค่า เมื่อ Trigger in Mil. Baht มีค่า |
| Trigger in Mil.Baht | ค่า Trigger รายงานเป็นจำนวนเงิน (ล้านบาท) | Data Set Validation:  Limit in Mil. Baht, Limit in %, Trigger in Mil. Baht หรือ Trigger in % อย่างน้อยค่าใดค่าหนึ่งต้องมีค่า |
| Condition of Trigger | เงื่อนไขระหว่าง Trigger in Million Baht และ Trigger in % | Data Set Validation:  ต้องมีค่า เมื่อ Trigger in Mil. Baht และ Trigger in % มีค่า |
| Comparison operator of Trigger in % | เครื่องหมายของ Trigger in % เช่น >, <=, =, <> | Data Set Validation:  ต้องมีค่า เมื่อ Trigger in % มีค่า |
| Trigger in % | ค่า Trigger รายงานเป็น % | Data Set Validation:  Limit in Mil. Baht, Limit in %, Trigger in Mil. Baht หรือ Trigger in % อย่างน้อยค่าใดค่าหนึ่งต้องมีค่า |
| Remark | หมายเหตุ |  |

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

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Net Stable Funding Ratio Consolidated Basis ข้อมูลการดำรงอัตราส่วนแหล่งเงินที่มีความมั่นคงและความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคงของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (Consolidated basis) เป็นการรายงานโครงสร้างแหล่งเงินที่จะใช้ในการสนับสนุนกิจกรรมในระยะปานกลางและระยะยาวของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ตามหลักเกณฑ์ BASEL III ซึ่งเป็นการรายงานเพิ่มเติมจากการรายงานสินทรัพย์สภาพคล่องภายใต้สถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (Data Set ชุด Liquidity Coverage Ratio) โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อรวบรวมข้อมูลประกอบการวิเคราะห์ระดับและแนวโน้มความเสี่ยงด้านสภาพคล่องของ ธพ. กลุ่มธุรกิจทางการเงิน และระบบ ธพ. อย่างครบถ้วน และมีประสิทธิภาพ

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

**ลักษณะข้อมูล**

ราย 6 เดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกสิ้น 6 เดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายใน 3 เดือน นับจากวันสิ้นงวดที่รายงาน

**File Name**

HBASNn\_YYYYMMDD\_NSFC.xlsx

**Sheet Name**

DF\_NSFC

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Organization Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล รายงานตามรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงิน | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงินที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล | Data Set Validation:  วันที่ต้องเป็นวันสิ้นงวดครึ่งปีตามปีปฏิทิน |
| FI Reporting Group Id | รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล รายงานตามรหัสมาตรฐานของสถาบันการเงิน | Data Set Validation:  ตรวจสอบความสอดคล้องระหว่างชุดข้อมูล FI Reporting Group Id กับ กลุ่มสถาบันการเงิน |
| Net Stable Funding Ratio Item | รายการการดำรงอัตราส่วนแหล่งเงินที่มีความมั่นคงและความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง |  |
| NSFR Remaining Term Range | อายุคงเหลือ | Data Set Validation:  1. ค่าที่เป็นไปได้ของ Net Stable Funding Ratio Item ตาม NSFR Remaining Term Range  1.1 Net Stable Funding Ratio Item = 477053, 477061, 477254 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310039  1.2 Net Stable Funding Ratio Item = 477003, 477004 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310041  1.3 Net Stable Funding Ratio Item = 477197, 477199 - 477201 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310039 และ 310040  1.4 Net Stable Funding Ratio Item = 477005, 477006, 477008 - 477010, 477012 - 477014, 477016 - 477018, 477020 - 477023, 477025 - 477029, 477046, 477051, 477054, 477064, 477065, 477067 - 477069, 477072, 477074 - 477076, 477078, 477080 - 477082, 477087, 477089 - 477091, 477093, 477095 - 477097, 477099, 477101 - 477103, 477106, 477108 - 477110, 477112, 477114 - 477116, 477119, 477121 - 477123, 477125, 477127 - 477129, 477132, 477134 - 477136, 477138, 477140 - 477142, 477145, 477147 - 477149, 477152, 477154 - 477156, 477158, 477160 - 477162, 477165, 477167 - 477169, 477171, 477173 - 477176, 477179, 477181 - 477183, 477185, 477187 - 477189, 477191, 477193 - 477195, 477209, 477211 - 477214, 477246, 477253, 477255, 477256 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310039, 310040 และ 310041  1.5 Net Stable Funding Ratio Item มีค่าเท่ากับ 477032, 477034, 477035, 477037, 477039, 477040, 477043 - 477045, 477048, 477049, 477057, 477058, 477203, 477205 - 477207, 477223, 477225, 477226, 477229, 477231, 477232, 477234, 477236, 477237, 477242 - 477245, 477247, 477249 - 477251, 477259 - 477265, 477268 - 477272 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้เท่ากับ 310029  1.6 Net Stable Funding Ratio Item มีค่าเท่ากับ 477052 และ 477055 ค่า NSFR Remaining Term Range ที่เป็นไปได้มีค่าเท่ากับ 310029, 310039, 310040 และ 310041 |
| NSFR Value | จำนวนเงินของรายการ หน่วยจะเป็นบาท  (จำนวนเงินของรายการเป็นจำนวนเงินก่อนปรับค่า ASF factor และ RSF factor ยกเว้นรายการ 477068 ให้ใส่จำนวนเงินหลังคูณค่า RSF factor แล้ว)  Net Stable Funding Ratio Item ที่ 477272 Amount มีค่าเป็นร้อยละ และไม่ต้องใส่เครื่องหมาย % ตัวอย่างเช่น 114.35 เป็นต้น  Net Stable Funding Ratio Item 477058 กรณีที่มีค่าเท่ากับ Unlimited (วงเงินไม่จำกัด) ให้กรอก เป็นตัวเลข 9999999999999.99 | Data Set Validation:  1. ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับศูนย์  2. ผลรวมของ NSFR value ตาม Net Stable Funding Ratio Item และ NSFR Remaining Term Range ต้องมีค่าดังนี้  2.1 NSFR value ของ Net Stable Funding Ratio Item 477255 และ 477054 ในแต่ละ Remaining Term Range ต้องมีค่าเท่ากัน  2.2 ผลรวม NSFR value ของ Net Stable Funding Ratio Item และ NSFR Remaining Term Range ตามเงื่อนไขที่กำหนด ต้องมีค่าตรงตามที่ระบุดังนี้  2.2.1 ผลรวมของ NFSR Value ของ Net Stable Funding Ratio Item “11.5 หลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ทุกประเภทที่ได้รับจากคู่สัญญาทั้งสิ้น แยกตามอายุคงเหลือของธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกี่ยวข้อง” (477046) รวมทุก NSFR Remaining Term Range (310039, 310040, 310041) ต้องเท่ากับ ผลรวมของ Net Stable Funding Ratio Item หลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ที่ได้รับจากคู่สัญญาทั้งสิ้น “11.4.1 ส่วนที่ได้รับเป็นเงินสด” (477043) + “11.4.2 ส่วนที่ได้รับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1” (477044) และ “11.4.3 ส่วนที่ได้รับเป็นสินทรัพย์อื่นที่ไม่ใช่สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1” (477045) ทุก NFSR Remaining Term Range (310029)  2.2.2 ผลรวมของ NFSR Value ของ Net Stable Funding Ratio Item “13.1 วงเงิน Committed line ที่ได้รับจากสำนักงานใหญ่ หรือสำนักงานสาขาอื่นที่เป็นนิติบุคคลเดียวกันและเป็นศูนย์กลางการบริหารสาขาของธนาคารพาณิชย์ในภูมิภาค (Regional hub) ที่นับเป็น Available Stable Funding ตามหลักเกณฑ์ NSFR” (477057) ทุก NSFR Remaining Term Range (310029) <= 0.4 \* [ผลรวมของ (NSFR value \* ค่าแปลงสภาพ) ของรายการย่อย Net Stable Funding Ratio Item ทุกรายการ ตั้งแต่ 477061 ถึง 477220 และ 477253 ถึง 477271 บวกด้วย ผลรวมของ (NSFR Value ที่ได้จากการคำนวณ \* ค่าแปลงสภาพ) ของ Net Stable Funding Ratio Item 477238 477239 และ 477252]  **รายละเอียดการคำนวณ NSFR Value ของ Net Stable Funding Ratio Item 477238 477239 และ 477252 มีดังนี้**   1. Net Stable Funding Ratio Item 477238 สินทรัพย์จากธุรกรรมอนุพันธ์ คำนวณโดยนำสินทรัพย์จากธุรกรรมอนุพันธ์ (NFSR Item 477222) ลบด้วยหลักประกันผันแปรในรูปของเงินสด (Cash variation margin) ที่ได้รับจากคู่สัญญา (NFSR Item 477228) [477238 = 477222 - 477228] 2. Net Stable Funding Ratio Item 477239 ความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคงที่เกี่ยวข้องกับหนี้สินจากธุรกรรมอนุพันธ์ คำนวณจากร้อยละ 5 ของฐานะของหนี้สินจากธุรกรรมอนุพันธ์ (NFSR Item 477031) [477239 = 477031 \* 0.05] 3. Net Stable Funding Ratio Item 477252 ฐานะของความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคงจากหลักประกันขั้นต่ำที่วางไว้ และเงินสดหรือสินทรัพย์ที่วางไว้เป็นกองทุนทดแทนความเสียหายจากการผิดนัดชำระราคา (Default fund) ที่สำนักหักบัญชีกลาง (CCP) คำนวณโดยนำหลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ที่วางไว้กับคู่สัญญาทั้งสิ้น (NFSR Item 477240) ลบด้วยหลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ที่วางไว้ในนามของลูกค้า (NFSR Item 477245) และบวกด้วยเงินสดหรือสินทรัพย์อื่นที่วางไว้เป็นกองทุนทดแทนความเสียหายจากการผิดนัดชำระราคา (Default fund) ที่สำนักหักบัญชีกลาง (CCP) (NFSR Item 477251) [477252 = 477240 – 477245 + 477251]   2.2.3 ผลรวมของ NFSR Value ของ Net Stable Funding Ratio Item “12.5.3 หลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ที่วางไว้ในนามของธนาคารพาณิชย์เอง (รวมหลักประกันทุกประเภท) แยกตามอายุคงเหลือของธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกี่ยวข้อง” (477246) รวมทุก NSFR Remaining Term Range (310039, 310040, 310041) ต้องมีค่าเท่ากับ ผลรวมของ Net Stable Funding Ratio Item หลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ส่วนที่วางเพื่อธนาคารพาณิชย์เอง “12.5.1.1 ส่วนที่วางไว้เป็นเงินสด” (477242) + “12.5.1.2 ส่วนที่วางไว้เป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 (477243) + “12.5.1.3 ส่วนที่วางไว้เป็นสินทรัพย์อื่นที่ไม่ใช่สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1” (477244) ทุก NFSR Remaining Term Range (310029)  2.2.4 ผลรวมของ NFSR Value ของ Net Stable Funding Ratio Item “12.5.4 หลักประกันเริ่มต้น (Initial margin) ที่วางไว้ในนามของธนาคารพาณิชย์เองที่วางไว้กับคู่สัญญาที่ไม่ได้รับยกเว้นการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์การเรียกและวางหลักประกันสำหรับธุรกรรมอนุพันธ์ (BCBS-IOSCO: Margin requirements for non-centrally cleared derivatives)” (477247) + “12.5.5.1 ส่วนของนิติบุคคลอื่นที่ไม่ใช่นิติบุคคลที่ประกอบธุรกิจทางการเงินซึ่งไม่มีความสำคัญในเชิงระบบ” (477249) + “12.5.5.2 ส่วนของรัฐบาล ธนาคารกลาง ธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือธนาคารเพื่อการชำระเงินระหว่างประเทศ (BIS)” (477250) ทุก NFSR Remaining Term Range (310029) ต้องเท่ากับผลรวมของ Net Stable Funding Ratio Item “12.5.1.1 ส่วนที่วางไว้เป็นเงินสด” (477242) + “12.5.1.2 ส่วนที่วางไว้เป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1” (477243) + “12.5.1.3 ส่วนที่วางไว้เป็นสินทรัพย์อื่นที่ไม่ใช่สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1” (477244) ทุก NFSR Remaining Term Range (310029) |

## Subject Area: 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 รายการใดรายการหนึ่งมีค่า 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 รายการใดรายการหนึ่งมีค่า 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 |  |
| General Market Risk Factor Type | ประเภทของ Risk Factor ตามที่กำหนด  กรณีที่ Greek Type มีค่าเป็น Delta ไม่ต้องรายงาน General Market Risk Factor Type ที่มีค่าเป็น FX และ IR |  |
| Other Market Risk Factor Type Name | ชื่อประเภทของ Risk Factor อื่น | Data Set Validation:  ต้องมีค่า ในกรณีที่ General Market Risk Factor Type มีค่าเป็น Others |
| Other Market Risk Factor Type Description | คำอธิบายประเภทของ Risk Factor อื่น | Data Set Validation:  ต้องมีค่า ในกรณีที่ General Market Risk Factor Type มีค่าเป็น Others |
| 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 |  |
| 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 |