



เรียน ผู้จัดการ

ธนาคารพาณิชย์ทุกธนาคาร

ที่ ฝนส.(01) ว. 35 /2558 เรื่อง การรายงานข้อมูลตามแบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) ได้ออกหนังสือเวียน ที่ ธปท. ฝนส. (02) ว. 51/2556 เรื่อง การรายงานข้อมูลตามแบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง เมื่อวันที่ 11 กรกฎาคม 2556 เพื่อขอให้ธนาคารพาณิชย์ (ธพ.) จัดส่งข้อมูลการประเมินผลกระทบจากหลักเกณฑ์ด้านสภาพคล่องของ Basel Committee on Banking Supervision (BCBS) ได้แก่ Liquidity Coverage Ratio (LCR) และ Net Stable Funding Ratio (NSFR) เพื่อประโยชน์ในการพิจารณากำหนดหลักเกณฑ์ที่เหมาะสมกับประเทศไทย นั้น

สืบเนื่องจากที่ ธปท. ได้ออกประกาศ ธปท. ที่ สนส. 9/2558 เรื่อง หลักเกณฑ์การดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (LCR) เมื่อ 27 พฤษภาคม 2558 ดังนั้นเพื่อให้ ธพ. และ ธปท. สามารถติดตามการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ LCR ได้ชัดเจน และเป็นไปตามวิธีการที่กำหนดตามประกาศ จึงขอให้ ธพ. ดำเนินการจัดส่งข้อมูล ดังนี้

1) จัดส่งแบบรายงาน LCR ที่ ธปท. ได้ปรับให้สอดคล้องกับประกาศ ธปท. โดยให้รายงานเป็นรายไตรมาสเช่นเดิม และตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2559 ซึ่งหลักเกณฑ์ LCR มีผลบังคับใช้ ให้รายงานเป็นรายเดือน

2) จัดส่งแบบรายงาน NSFR ที่ ธปท. ได้ปรับให้สอดคล้องกับหลักเกณฑ์ BCBS ฉบับ Final ที่เผยแพร่เมื่อ 31 ตุลาคม 2557 เพื่อให้การประเมินผลกระทบประกอบการพิจารณากำหนดหลักเกณฑ์ที่เหมาะสมกับประเทศไทยมีความถูกต้องยิ่งขึ้น โดยให้รายงานเป็นรายครึ่งปีเช่นเดิม

3) เพื่อส่งเสริมให้การดูแลเสถียรภาพระบบการเงินและสถาบันการเงินมีประสิทธิภาพยิ่งขึ้น ธปท. จึงได้จัดทำแบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิ และแบบรายงานการกระจุกตัวของแหล่งเงิน เพื่อพัฒนาฐานข้อมูลให้มีความครอบคลุมเป็นมาตรฐาน โดยได้คำนึงถึงความเห็นของ ธพ. ในช่วงที่ผ่านมา และได้นำเสนอให้ ธพ. แล้วในเบื้องต้น เพื่อให้ ธพ. มีเวลาปรับระบบข้อมูล โดยแบบรายงานส่วนนี้ ให้เริ่มรายงานตั้งแต่งวดสิ้นเดือนกันยายน 2558 เป็นรายไตรมาส และตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2559 ให้รายงานเป็นรายเดือน

ทั้งนี้ ให้ ธพ. จัดทำรายงานข้อมูลโดยอ้างอิงรายละเอียดการรายงานตามคู่มือการจัดทำแบบรายงานที่แนบมาพร้อมนี้ ตั้งแต่งวดสิ้นเดือนมิถุนายน 2558 เป็นต้นไป

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

(นายสมบุรณ์ จิตเป็นธม)

ผู้อำนวยการอาวุโส ฝ่ายนโยบายการกำกับสถาบันการเงิน

ผู้ว่าการ^{แทน}

สิ่งที่ส่งมาด้วย คู่มือการจัดทำแบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง พร้อมทั้งแบบรายงานและคำอธิบายรายการสำหรับแบบรายงาน

ฝ่ายนโยบายการกำกับสถาบันการเงิน

โทรศัพท์ 0 2283 6876, 0 2356 7703

โทรสาร 0 2283 5983

หมายเหตุ [] มีการจัดประชุมชี้แจงวันที่..... ณ.....

[X] ไม่มีการจัดประชุมชี้แจง

ฝนสว10-คส30001-25580630

คส 300 วันที่ 30 มิ.ย. 2558

วิสัยทัศน์ เป็นองค์กรที่มองไกล มีหลักการ และร่วมมือ เพื่อความเป็นอยู่ที่ดีอย่างยั่งยืนของไทย

คู่มือการจัดทำแบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

I. รูปแบบการรายงานข้อมูล

การรายงานข้อมูลตามแบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง ประกอบด้วย การรายงานข้อมูล 2 ประเภท ได้แก่

1. แบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่องภายใต้สถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง: ให้ใช้นิยาม สมมติฐาน แนวทางการรายงาน และแบบรายงานตามที่ ธพท. กำหนด อันประกอบด้วย

1) แบบรายงานการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (Liquidity Coverage Ratio: LCR) หรือแบบรายงาน LCR ตามเอกสารแนบ 1 และ

2) แบบรายงานอัตราส่วนที่มาจากแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Net Stable Funding Ratio: NSFR) หรือแบบรายงาน NSFR ตามเอกสารแนบ 2

การกำหนดให้ ธพท. รายงานข้อมูลตามแบบรายงานข้างต้น มีวัตถุประสงค์เพื่อให้ ธพท. สามารถวิเคราะห์ฐานะสภาพคล่อง และประเมินผลกระทบจากหลักเกณฑ์ LCR¹ และ NSFR ต่อ ธพท. และระบบ ธพท. โดยรวม โดยเฉพาะหลักเกณฑ์ LCR ซึ่งจะมีผลบังคับใช้ตั้งแต่ต้นปี 2559 เป็นต้นไป รวมถึงเป็นข้อมูลเพื่อประกอบการพิจารณาความเหมาะสมของการนำหลักเกณฑ์ NSFR มาใช้ในประเทศไทย ทั้งนี้ การกำหนดค่าแปลงสภาพต่าง ๆ ของแบบรายงาน NSFR (available stable funding factor และ required stable funding factor) เป็นเพียงอัตราเบื้องต้นซึ่งอ้างอิงจากมาตรฐานสากล เพื่อใช้เป็นข้อมูลในการประเมินผลกระทบเบื้องต้น ซึ่งอัตราดังกล่าวอาจแตกต่างจากอัตราที่จะบังคับใช้จริงในอนาคต

2. แบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่องในภาวะปกติ (Normal Business Operations): ให้ใช้นิยาม แนวทางการรายงาน และแบบรายงานตามที่ ธพท. กำหนด อันประกอบด้วย

1) แบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิ หรือแบบรายงาน Liquidity Gap ตามเอกสารแนบ 3 และ

2) แบบรายงานการกระจุกตัวของแหล่งเงิน หรือแบบรายงาน Funding Concentration ตามเอกสารแนบ 4

การกำหนดให้ ธพท. รายงานข้อมูลตามแบบรายงานดังกล่าวมีวัตถุประสงค์เพื่อรวบรวมข้อมูลประกอบการวิเคราะห์ระดับและแนวโน้มความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง โดยเฉพาะการติดตามภาพรวมและการเปรียบเทียบระหว่าง ธพท. เพื่อให้สามารถกำกับดูแลการบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องของ ธพท. และระบบ ธพท. ได้อย่างมีประสิทธิภาพยิ่งขึ้น

แบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิที่จัดส่งภายใต้หนังสือเวียนฉบับนี้ สามารถนับเป็นส่วนหนึ่งของแนวนโยบายการบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องของสถาบันการเงิน และประกาศ ธพท. ว่าด้วยการบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องของสถาบันการเงิน เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับแบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิในภาวะปกติ ดังนั้น ธพท. ยังต้องจัดทำแบบรายงานอื่นตามที่หลักเกณฑ์กำหนดด้วย เช่น

¹ ประกาศ ธพท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (Liquidity Coverage Ratio: LCR)

การจัดทำแบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิภายใต้ภาวะวิกฤติ และแบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิแยกเป็นรายสกุลเงินที่มีนัยสำคัญ

II. ความถี่และการจัดส่งแบบรายงาน

สำหรับข้อมูลเฉพาะ ธพ. (solo basis) ให้ ธพ. จัดทำแบบรายงานทั้ง 4 ชุดข้างต้น โดยมีรายละเอียดความถี่ในการจัดทำและการจัดส่งแบบรายงาน ดังนี้

ข้อมูล	ความถี่ในการจัดทำ ²	ระยะเวลาในการจัดส่ง (นับจากวันสิ้นสุด)
แบบรายงาน LCR	รายไตรมาส ³	ภายใน 1 เดือน ³
แบบรายงาน NSFR	รายครึ่งปี	ภายใน 2 เดือน
แบบรายงาน Liquidity Gap	รายไตรมาส / รายเดือน ⁴	ภายใน 1 เดือน / 21 วัน ⁴
แบบรายงาน Funding Concentration	รายไตรมาส / รายเดือน ⁴	ภายใน 1 เดือน / 21 วัน ⁴

สำหรับข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (Consolidated basis) ให้จัดทำแบบรายงาน LCR และ NSFR โดยไม่ต้องนำข้อมูลบริษัทประกันมารวมคำนวณ ตามรายละเอียดความถี่ในการจัดทำและการจัดส่งแบบรายงาน ดังนี้

ข้อมูล	ความถี่ในการจัดทำ	ระยะเวลาในการจัดส่ง (นับจากวันสิ้นสุด)
แบบรายงาน LCR	รายครึ่งปี / รายไตรมาส ⁵	ภายใน 3 เดือน / 2 เดือน ⁵
แบบรายงาน NSFR	รายครึ่งปี	ภายใน 3 เดือน

โดยจัดส่งข้อมูลในรูปแบบของ excel file ผ่านทาง DMS Data Acquisition โดยใช้ช่องทาง extranet (<https://webserv>) หัวข้อ Submit File รายการ Basel III Liquidity

ทั้งนี้ ให้ ธพ. เริ่มจัดทำข้อมูลตามแบบรายงานนี้ตั้งแต่ 30 มิถุนายน 2558 โดย ธพ. สามารถ Download แบบรายงานที่ www.bot.or.th > สถิติ > การรับส่งข้อมูลกับ ธพท. > แบบรายงานและเอกสารชี้แจง ข้อมูลสถาบันการเงิน > ภายใต้หัวข้อ “รายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง”

² รายไตรมาส จัดทำข้อมูลทุกสิ้นเดือนมีนาคม มิถุนายน กันยายน และธันวาคม และรายครึ่งปี จัดทำข้อมูลทุกสิ้นเดือนมิถุนายน และธันวาคม

³ สำหรับแบบรายงาน LCR (solo basis) ในปี 2558 ให้รายงานเป็นรายไตรมาส โดยมีระยะเวลาในการจัดส่งภายใน 1 เดือน และตั้งแต่ปี 2559 เป็นต้นไป ให้อ้างอิงหลักเกณฑ์เกี่ยวกับระบบบริการการรับส่งข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ (DMS) ที่เกี่ยวข้อง

⁴ สำหรับแบบรายงาน Liquidity Gap และ Funding Concentration ให้เริ่มรายงานงวดแรกสำหรับข้อมูลสิ้นเดือนกันยายน 2558 ทั้งนี้ ในปี 2558 ให้รายงานเป็นรายไตรมาส โดยมีระยะเวลาในการจัดส่งภายใน 1 เดือน และตั้งแต่เดือนแรกของปี 2559 เป็นต้นไป ให้รายงานเป็นรายเดือน โดยมีระยะเวลาในการจัดส่งภายใน 21 วัน

⁵ สำหรับแบบรายงาน LCR (consolidated basis) ในปี 2558 ให้รายงานเป็นรายครึ่งปี โดยมีระยะเวลาในการจัดส่งภายใน 3 เดือน และตั้งแต่ไตรมาสแรกของปี 2559 เป็นต้นไป ให้รายงานเป็นรายไตรมาส โดยมีระยะเวลาในการจัดส่งภายใน 2 เดือน

สำหรับการกำหนดชื่อ File ให้ปฏิบัติดังนี้

PRPDXXX_YYYYMMDD_AAZZZZ_N.XLS

1 2 3 <---- 4 ----> 5 6 7 8

หมายเลขและอักษรย่อ	รายละเอียด
1. P	เป็นค่าถี่ในการจัดทำ โดยมีรายละเอียด ดังนี้ <ul style="list-style-type: none"> • กรณีเป็นรายครึ่งปี ให้ใช้ H • กรณีเป็นรายไตรมาส ให้ใช้ Q • กรณีเป็นรายเดือน ให้ใช้ M
2. RPD	เป็นค่าคงที่ หมายถึง Regulatory Policy Department
3. XXX	เป็นรหัสของสถาบันการเงิน (ผู้ส่งข้อมูล – Data Provider)
4. YYYYMMDD <ul style="list-style-type: none"> • YYYY • MM • DD 	เป็นงวดของข้อมูลที่ทำกรรายงาน โดยมีรายละเอียด ดังนี้ <ul style="list-style-type: none"> • ปีของข้อมูลที่รายงาน ให้ใช้ปี ค.ศ. 4 หลัก เช่น 2015 เป็นต้น • เดือนของข้อมูลที่รายงาน เช่น เดือนมกราคมให้ใช้ 01 และเดือนธันวาคมให้ใช้ 12 เป็นต้น • วันที่ของข้อมูลที่รายงาน (วันสุดท้ายของเดือน)
5. AAA	เป็นชื่อแบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง โดยมีรายละเอียด ดังนี้ <ul style="list-style-type: none"> • กรณีเป็นแบบรายงาน LCR ให้ใช้ LCR • กรณีเป็นแบบรายงาน NSFR ให้ใช้ NSF • กรณีเป็นแบบรายงาน Liquidity Gap ให้ใช้ GAP • กรณีเป็นแบบรายงาน Funding Concentration ให้ใช้ FCC
6. ZZZZ	เป็นลักษณะข้อมูลที่ ธพ. จัดทำ โดยมีรายละเอียด ดังนี้ <ul style="list-style-type: none"> • กรณีเป็นข้อมูลเฉพาะ ธพ. (solo basis) ให้ใช้ SOLO • กรณีเป็นข้อมูลของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (consolidated basis) ให้ใช้ CONS
7. N	เป็นจำนวนครั้งที่ส่งข้อมูล เช่น หากส่งข้อมูลเป็นครั้งแรกให้ใช้เลข 1 หากข้อมูลที่ส่งไปแล้วในครั้งแรกมีการแก้ไขและส่งใหม่เป็นครั้งที่สองให้ใช้เลข 2 หากข้อมูลที่ส่งไปแล้วในครั้งที่สองมีการแก้ไขและส่งใหม่เป็นครั้งที่สามให้ใช้เลข 3 เป็นต้น
8. XLS	เป็นค่าคงที่ หมายถึง นามสกุลของรูปแบบไฟล์ที่จัดส่งอยู่ในรูป excel File

III. การรายงานข้อมูลตามแบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่องภายใต้สถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง

แบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่องภายใต้สถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง ประกอบด้วย

1) แบบรายงานการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (Liquidity Coverage Ratio: LCR) หรือแบบรายงาน LCR ตามรายละเอียดในข้อ 1) และ

2) แบบรายงานอัตราส่วนที่มาและใช้ไปของแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Net Stable Funding Ratio: NSFR) หรือแบบรายงาน NSFR ตามรายละเอียดในข้อ 2)

ทั้งนี้ ให้ ธพ. รายงานข้อมูลเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “ล้านบาท” พร้อมทศนิยม 3 ตำแหน่ง และกรอกเลข “0” ในช่องที่ไม่มีรายการ สำหรับรายการที่เป็นสกุลเงินตราต่างประเทศ ให้แปลงค่าเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้อัตราเฉลี่ยระหว่างอัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนและอัตราขายถัวเฉลี่ยประจำวันล่าสุดซึ่งเผยแพร่ใน website ของ ธพท. ณ วันที่รายงาน

1) แบบรายงานการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (Liquidity Coverage Ratio: LCR)

เพื่อให้สามารถวิเคราะห์และติดตามความสามารถของ ธพ. ในการรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (Short-term severe liquidity stress) และประเมินผลกระทบจากหลักเกณฑ์ LCR ก่อนเริ่มบังคับใช้จริงในปี 2559

แบบรายงาน

แบบรายงานนี้กำหนดให้ ธพ. จัดทำอัตราส่วนการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (LCR) ซึ่งคำนวณจากข้อมูลสินทรัพย์สภาพคล่อง (High-quality liquid asset: HQLA) และประมาณการกระแสเงินสดไหลออกสุทธิใน 30 วัน ภายใต้สถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง

สินทรัพย์สภาพคล่อง <hr/> ประมาณการกระแสเงินสดไหลออกสุทธิใน 30 วัน ภายใต้สถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง	≥ 100%
--	---------------

แบบรายงาน LCR ประกอบด้วย 3 ส่วน ได้แก่

ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง

ส่วนที่ 2 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลออกสุทธิ (net cash outflow)

ส่วนที่ 3 : ธุรกิจการแลกเปลี่ยนสินทรัพย์ที่ไม่เกี่ยวข้องกับเงินสดสกุลใด ๆ (collateral swaps)

โดยรายละเอียดแบบรายงานและคำอธิบายรายการสำหรับแบบรายงาน อ้างอิงตามที่กำหนดในเอกสารแนบ 1

แนวทางการรายงาน

ให้ ธพ. รายงานข้อมูลในแบบรายงาน LCR โดยอ้างอิงหลักการตามประกาศ ธพท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง⁶

⁶ <https://www.bot.or.th/Thai/FIPCS/Documents/FPG/2558/ThaiPDF/25580129.pdf>

2) แบบรายงานอัตราส่วนที่มาจากและใช้ไปของแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Net Stable Funding Ratio: NSFR)

เพื่อให้สามารถวิเคราะห์และติดตามโครงสร้างแหล่งเงินที่จะใช้ในการสนับสนุนกิจกรรมระยะกลางและระยะยาวของสถาบันการเงิน

แบบรายงาน

แบบรายงานนี้กำหนดให้ ธพ. จัดทำอัตราส่วนที่มาจากและใช้ไปของแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (NSFR) ซึ่งคำนวณจากข้อมูลแหล่งเงินที่มีความมั่นคง ซึ่งจะคงอยู่กับ ธพ. ภายใต้สถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง และกิจกรรมการใช้ไปของแหล่งเงินซึ่งทำให้ ธพ. มีความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง

$\frac{\text{แหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Available Stable Funding)}}{\text{ความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Required Stable Funding)}} \geq 100\%$
--

แบบรายงาน NSFR ประกอบด้วย 2 ส่วน⁷ ได้แก่

ส่วนที่ 1 : แหล่งเงินที่มีความมั่นคง

ส่วนที่ 2 : ความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง

โดยรายละเอียดแบบรายงานและคำอธิบายรายการสำหรับแบบรายงาน อ้างอิงตามที่กำหนดในเอกสารแนบ 2

แนวทางการรายงาน

ให้ ธพ. รายงานข้อมูลในแบบรายงาน NSFR โดยอ้างอิงตามที่ Basel Committee on Banking Supervision (BCBS) กำหนดไว้ใน Basel III: the net stable funding ratio ลงวันที่ 31 ตุลาคม 2557⁸ และ Instructions for Basel III monitoring ลงวันที่ 13 ก.พ. 2558⁹ ทั้งนี้ สำหรับบางรายการที่ ธพ. มีรายละเอียดการรายงานเพิ่มเติม เพื่อให้การรายงานสอดคล้องกับหลักเกณฑ์ LCR ตามประกาศ ธพ. และเพื่อปรับให้เหมาะสมกับลักษณะธุรกรรมในประเทศไทย ให้อ้างอิงแนวทางการรายงานในเอกสารแนบ 2 โดยหลักการของการรายงาน สรุปได้ดังนี้

⁷ แบบรายงาน NSFR ของ BCBS กำหนดให้ ธพ. รายงานเพิ่มอีกหนึ่งส่วน ได้แก่ การรายงานสินทรัพย์ที่ติดภาระผูกพันสำหรับการดำเนินการด้านสภาพคล่องของธนาคารกลางที่เป็นกรณีพิเศษ (assets encumbered for exceptional central bank liquidity operations) ซึ่งจะต้องเป็นการดำเนินการด้านสภาพคล่องของธนาคารกลางที่ไม่ใช่การดำเนินการตามปกติ เกิดขึ้นชั่วคราว และเพื่อวัตถุประสงค์ทางด้านนโยบายการเงิน เช่น เกิดภาวะวิกฤตในระบบ (market-wide financial stress) และ/หรือมีความท้าทายทางด้านเศรษฐกิจมหภาค (exceptional macroeconomic challenges) และผู้กำกับดูแลได้กำหนดให้สินทรัพย์ที่ติดภาระผูกพันดังกล่าวได้รับค่าแปลงสภาพ (Required stable fund factor) ที่ต่ำกว่าที่หลักเกณฑ์กำหนด ทั้งนี้ เนื่องจากแบบรายงาน NSFR ในคู่มือฉบับนี้ มีจุดประสงค์เพื่อศึกษาผลกระทบของการนำหลักเกณฑ์มาใช้ จึงยังไม่ได้กำหนดให้ ธพ. รายงานข้อมูลส่วนนี้ในแบบรายงาน NSFR ตามเอกสารแนบ 2

⁸ <http://www.bis.org/bcbs/publ/d295.htm>

⁹ http://www.bis.org/bcbs/qis/biiimplmoninstr_feb15.pdf

■ **แหล่งเงินที่มีความมั่นคง** คำนวณจากหนี้สิน เช่น เงินฝากและเงินกู้ยืม และส่วนของเจ้าของในงบแสดงฐานะการเงิน โดยปริมาณแหล่งเงินที่มีความมั่นคงจะขึ้นอยู่กับความเหนียวแน่นของแหล่งเงินดังกล่าว พิจารณาได้จากประเภทของหนี้สิน/ส่วนของเจ้าของ คู่สัญญา และอายุคงเหลือ ซึ่งสะท้อนอยู่ในค่าแปลงสภาพที่กำหนด

สำหรับการรายงานข้อมูลดังกล่าวให้ ธพ. รายงานปริมาณหนี้สินและส่วนของเจ้าของในงบแสดงฐานะการเงินทั้งสิ้น ณ วันที่รายงานตามช่วงเวลาอายุคงเหลือ ดังนี้

- (1) อายุคงเหลือ < 6 เดือน
- (2) อายุคงเหลือ \geq 6 เดือนถึง < 1 ปี
- (3) อายุคงเหลือ \geq 1 ปี

ในการพิจารณาอายุคงเหลือของรายการดังกล่าว ให้คำนึงถึงสิทธิของผู้ฝากเงิน ผู้ให้กู้ยืมเงิน หรือผู้ลงทุนในการไถ่ถอนก่อนกำหนดประกอบด้วย โดยหากเป็นสิทธิของผู้ฝากเงิน ผู้ให้กู้ยืมเงิน หรือผู้ลงทุนในการไถ่ถอน ให้ถือว่าผู้ฝากเงิน ผู้ให้กู้ยืมเงิน หรือผู้ลงทุนจะขอไถ่ถอนเร็วที่สุดเท่าที่จะเป็นไปได้ และสำหรับกรณีที่สิทธิในการซื้อคืนเป็นของ ธพ. การพิจารณาอายุคงเหลือของรายการดังกล่าว ให้คำนึงถึงความเสี่ยงต่อชื่อเสียงของ ธพ. ในการไม่ซื้อคืน ในขณะที่ตลาดมีความคาดหวังให้ ธพ. ซื้อคืน ประกอบด้วย

ทั้งนี้ สำหรับเงินรับฝากหรือเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อทวงถาม และเงินรับฝากหรือเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่ลูกค้ามีสิทธิไถ่ถอนก่อนกำหนดได้โดยไม่เสียค่าปรับหรือเสียค่าปรับอย่างไม่มีนัยสำคัญ ให้รายงานในช่วงเวลาอายุคงเหลือ < 6 เดือน สำหรับเงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาอื่นให้รายงานตามช่วงเวลาอายุคงเหลือ และสำหรับเงินฝากหรือเงินให้กู้ยืมที่ติดภาระผูกพัน เช่น เงินรับฝากที่นำมาเป็นหลักประกันสินเชื่อ ให้รายงานส่วนที่ติดภาระผูกพัน ในช่วงเวลาที่ยาวกว่าระหว่าง อายุคงเหลือของเงินฝาก หรือระยะเวลาคงเหลือของการติดภาระผูกพันดังกล่าว

■ **ความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง** คำนวณจากรายการสินทรัพย์และภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน ทั้งที่มีสัญญาและไม่มีสัญญา โดยสำหรับรายการสินทรัพย์ ปริมาณความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคงจะขึ้นอยู่กับระยะเวลาการลงทุนและความรวดเร็วในการเปลี่ยนเป็นเงินสด พิจารณาได้จากประเภทของสินทรัพย์ คู่สัญญา อายุคงเหลือ และระยะเวลาคงเหลือของการติดภาระผูกพัน สำหรับภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน ปริมาณความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคงจะขึ้นอยู่กับโอกาสที่จะเกิดการเบิกถอนโดยไม่ได้กำหนดไว้ล่วงหน้า (potential calls) ซึ่งสะท้อนในค่าแปลงสภาพที่กำหนด

สำหรับการรายงานข้อมูลดังกล่าวให้ ธพ. รายงานปริมาณสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงินและภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงินทั้งสิ้นที่ ธพ. ถือครอง ครอบคลุมทุกสกุลเงิน โดยแบ่งตามประเภท อายุคงเหลือ และระยะเวลาคงเหลือของการติดภาระผูกพัน ตามที่ปรากฏในแบบรายงาน ดังนี้

(1) ให้รายงานปริมาณสินทรัพย์และภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงินแต่ละรายการตามอายุคงเหลือของรายการนั้น ๆ ณ วันที่รายงาน ใน column ที่เกี่ยวข้อง

สำหรับรายการสินทรัพย์ที่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง (High-quality liquid assets: HQLA) ให้นับรวมสินทรัพย์ทุกรายการที่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องตามหลักเกณฑ์ LCR ได้ โดยไม่ต้องคำนึงถึงมาตรฐานขั้นต่ำด้านปฏิบัติการและเพดานการถือครองสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2 และ

ชั้นที่ 2B ตามหลักเกณฑ์ LCR ทั้งนี้ สำหรับรายการที่เกี่ยวข้องกับเงินลงทุนในหลักทรัพย์ ให้ ธพ. ใช้ trade date accounting

ในการพิจารณาอายุคงเหลือ ให้คำนึงถึงความเป็นไปได้ที่คู่สัญญาอาจพิจารณาทางเลือกต่าง ๆ เพื่อขยายอายุสัญญานั้น และในกรณีที่สิทธิในการต่ออายุสัญญาเป็นของ ธพ. ให้คำนึงถึงความเสี่ยงต่อชื่อเสียงของ ธพ. ในการไม่ต่ออายุสัญญาดังกล่าวในขณะที่ตลาดคาดหวังให้ ธพ. ต่ออายุสัญญาประกอบด้วย สำหรับสินเชื่อที่มีกำหนดทยอยคืนเป็นงวด ๆ ให้ถือว่าส่วนที่จะครบกำหนดชำระในปี 1 มีอายุคงเหลือน้อยกว่า 1 ปี

(2) หลังจากนั้นให้พิจารณาว่า ณ วันที่รายงาน ปริมาณสินทรัพย์และภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงินสำหรับแต่ละช่วงอายุคงเหลือดังกล่าว ติดภาระผูกพัน (encumbered) หรือไม่ และมีระยะเวลาคงเหลือของการติดภาระผูกพันเท่าใด โดยให้รายงานปริมาณสินทรัพย์และภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงินตามระยะเวลาคงเหลือของการติดภาระผูกพันในแถวที่เกี่ยวข้อง

กรณีที่สินทรัพย์ติดภาระผูกพัน แต่ภาระผูกพันดังกล่าวไม่ได้ระบุเฉพาะเจาะจงประเภทสินทรัพย์ เช่น กรณีที่ภาระผูกพันดังกล่าวอ้างอิงกลุ่มของสินทรัพย์ ซึ่งมีค่าแปลงสภาพที่ต่างกัน ในการรายงานให้ถือว่าสินทรัพย์ที่มีค่าแปลงสภาพสูงที่สุดในกลุ่ม เป็นสินทรัพย์ที่ติดภาระผูกพันและไล่ลงมาเป็นลำดับตามค่าแปลงสภาพ

กรณีที่ ธพ. มีสินทรัพย์ประเภทเดียวกันที่ได้มาจากทั้งการซื้อหรือการยืม และ ธพ. ใช้สินทรัพย์ดังกล่าวเพื่อเป็นหลักประกันในการกู้ยืม ให้ถือว่าสินทรัพย์ที่กู้ยืมมาเป็นสินทรัพย์ที่ติดภาระก่อน

ยกตัวอย่างเช่น ธพ. A มีพันธบัตรรัฐบาลรวมทั้งสิ้นมูลค่า 50 ล้านบาท ซึ่งมีอายุคงเหลือ 10 เดือน โดยในจำนวน 50 ล้านบาทนี้ มีพันธบัตรจำนวน 20 ล้านบาท ติดภาระผูกพันเป็นระยะเวลา 2 เดือน และอีก 15 ล้านบาท ติดภาระผูกพันเป็นระยะเวลา 8 เดือน และคงเหลือส่วนที่ปราศจากภาระผูกพันจำนวน 15 ล้านบาท ดังนั้น การรายงานข้อมูลของ ธพ. A จะเป็นไปตามตัวอย่างด้านล่าง ดังนี้

ส่วนที่ 2 : ความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Required Stable Funding)			
หมวด (ก) รายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน			
	จำนวนที่รายงาน		
	อายุคงเหลือ < 6 เดือน	อายุคงเหลือ \geq 6 เดือน ถึง < 1 ปี	อายุคงเหลือ \geq 1 ปี
(4) คราสารหนี้ที่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์ชั้นที่ 1 ตาม LCR			
ปราศจากภาระผูกพัน	0	15	0
ติดภาระผูกพัน :			
ระยะเวลาคงเหลือของการติดภาระผูกพัน < 6 เดือน	0	20	0
ระยะเวลาคงเหลือของการติดภาระผูกพัน \geq 6 เดือน ถึง < 1 ปี	0	15	0
ระยะเวลาคงเหลือของการติดภาระผูกพัน \geq 1 ปี	0	0	0

IV. การรายงานข้อมูลตามแบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่องในภาวะปกติ (Normal Business Operations)

แบบรายงานความเสี่ยงด้านสภาพคล่องในภาวะปกติ (Normal Business Operations) ประกอบด้วย

1) แบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิ หรือแบบรายงาน Liquidity Gap ตามรายละเอียดในข้อ 1) และ

2) แบบรายงานการกระจุกตัวของแหล่งเงิน หรือแบบรายงาน Funding Concentration ตามรายละเอียดในข้อ 2)

ทั้งนี้ ให้ ธพ. รายงานข้อมูลเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “ล้านบาท” พร้อมทศนิยม 3 ตำแหน่ง และกรอกเลข “0” ในช่องที่ไม่มีรายการ สำหรับรายการที่เป็นสกุลเงินตราต่างประเทศ ให้แปลงค่าเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้อัตราเฉลี่ยระหว่างอัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนและอัตราขายถัวเฉลี่ยประจำวันล่าสุดซึ่งเผยแพร่ใน website ของ ธพ. ณ วันที่รายงาน

1) แบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิ (Liquidity Gap)

เพื่อให้สามารถวิเคราะห์และติดตามข้อมูลกระแสเงินสดที่จะเกิดขึ้นในแต่ละช่วงเวลา ทั้งกระแสเงินสดตามสัญญา (Contractual cashflow) และกระแสเงินสดตามพฤติกรรม (Behavioural cashflow)

แบบรายงาน

แบบรายงานนี้กำหนดให้ ธพ. จัดทำข้อมูลกระแสเงินสดไหลเข้าและไหลออกที่เกิดจากสินทรัพย์หนี้สิน และรายการนอกสมดุล รวมทั้งภาระต่าง ๆ ในแต่ละช่วงเวลา (Time bucket) ทั้งในลักษณะของ (1) กระแสเงินสดตามสัญญา (Contractual cashflow) และ (2) กระแสเงินสดตามพฤติกรรม (Behavioural cashflow) โดยให้ ธพ. รายงานข้อมูลทั้งหมด 4 ชุด ดังต่อไปนี้ โดยในแต่ละชุด ให้รายงานแยกสำหรับฐานะสกุลเงินบาท และฐานะรวมทุกสกุลเงินตราต่างประเทศด้วย

1. แบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิตามสัญญา (Contractual Liquidity Gap)

1.1 ชุด Solo¹⁰ (รวมทุกสำนักงาน) และรวมบริษัทลูก (Subsidiaries) ที่เป็น ธพ.

1.2 ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ¹¹

2. แบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิตามพฤติกรรม (Behavioural Liquidity Gap)

2.1 ชุด Solo¹⁰ (รวมทุกสำนักงาน) และรวมบริษัทลูก (Subsidiaries) ที่เป็น ธพ.

2.2 ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ¹¹

แบบรายงานประกอบด้วย 3 ส่วน ได้แก่

¹⁰ สำหรับ ธพ. ที่จดทะเบียนในประเทศ ให้รายงานชุดของข้อมูลสถาบันการเงินโดยเฉพาะ (Bank only) รวมทุกสำนักงาน (รวมสาขาต่างประเทศ) และกรณีที่ ธพ. มีบริษัทลูก (Subsidiaries) ที่เป็น ธพ. ต้องนำมารวมรายงานด้วย ทั้งนี้ หาก ธพ. ถือหุ้นในบริษัทดังกล่าวน้อยกว่าร้อยละ 100 และเห็นว่าธุรกรรมของบริษัทดังกล่าวยังไม่มีความสำคัญเชิงความเสี่ยงด้านสภาพคล่องต่อ ธพ. ให้ ธพ. ยื่นความประสงค์ที่จะยกเว้นการรายงานข้อมูลของบริษัทดังกล่าว ต่อฝ่ายกำกับสถาบันการเงิน ธพ. อย่างน้อย 60 วันก่อนวันสิ้นสุดงวดของการรายงานข้อมูล ทั้งนี้ ธพ. จะต้องพิจารณาทบทวนความสำคัญอย่างต่อเนื่อง และเมื่อพิจารณาแล้วเห็นควรให้รวมรายงานข้อมูลของบริษัทดังกล่าว ให้ ธพ. แจ้ง ธพ. เพื่อทราบก่อนวันจัดส่งข้อมูล

¹¹ สาขาของ ธพ. ต่างประเทศ ให้รายงานเฉพาะชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ

ส่วนที่ 1 : เงินสดและเงินลงทุน

ส่วนที่ 2 : กระแสเงินสดไหลเข้า

ส่วนที่ 3 : กระแสเงินสดไหลออก

โดยให้ ธพ. รายงานข้อมูลใน Liquidity Gap Sheet รายละเอียดแบบรายงาน ตามที่กำหนดในเอกสารแนบ 3

แนวทางการรายงาน

ให้ ธพ. รายงานกระแสเงินสด ในแบบรายงานฐานะสภาพคล่องตามสัญญา (Contractual Liquidity Gap) และแบบรายงานฐานะสภาพคล่องตามพฤติกรรม (Behavioural Liquidity Gap) โดยมีหลักการสำคัญดังนี้

- ให้รายงานด้วยกระแสเงินสดที่จะเกิดขึ้นจากธุรกรรม ดังนั้น บางรายการ เช่น กระแสเงินสดไหลเข้าและกระแสเงินสดไหลออกจากเงินลงทุนในหลักทรัพย์ ดอกเบี้ยค้างรับ¹² ดอกเบี้ยค้างจ่าย และธุรกรรมอนุพันธ์ เป็นต้น จึงอาจไม่สามารถนำไปกระทบยอดกับมูลค่าตามงบแสดงฐานะการเงิน หรือภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงินได้ อย่างไรก็ตาม การรายงานกระแสเงินสดดังกล่าวต้องครอบคลุมทุกรายการที่มีนัยสำคัญทั้งในแง่ขนาดและความเสี่ยง (Size and risk profile) เช่น ครอบคลุมรายการหลักต่าง ๆ ด้านสินทรัพย์ โดยรวมกันแล้วมากกว่าร้อยละ 90 ของยอดรวมสินทรัพย์ทั้งที่อยู่ในงบแสดงฐานะการเงินและนอกงบแสดงฐานะการเงิน และครอบคลุมรายการหลักต่าง ๆ ด้านหนี้สิน โดยรวมกันแล้วมากกว่าร้อยละ 90 ของยอดรวมหนี้สินทั้งที่อยู่ในงบแสดงฐานะการเงินและนอกงบแสดงฐานะการเงิน เช่นกัน
- ไม่รายงานกระแสเงินสดซ้ำ เช่น ในกรณีที่รายงานดอกเบี้ยรับที่จะเกิดขึ้น รวมอยู่ในกระแสเงินสดไหลเข้าจากสินเชื่อแล้ว ธพ. จะต้องไม่รายงานดอกเบี้ยรับในสินทรัพย์อื่นอีก
- สำหรับรายการเกี่ยวกับเงินลงทุนในหลักทรัพย์ ให้ ธพ. ใช้ trade date accounting เพื่อให้สะท้อนสิทธิทางกฎหมายในการเปลี่ยนเงินลงทุนเป็นกระแสเงินสด
- ให้รายงานประมาณการกระแสเงินสดของดอกเบี้ยรับ ดอกเบี้ยจ่าย ยอดมาร์จิ้น และกระแสเงินสดอื่นที่เกี่ยวข้องในช่วงเวลาต่างๆ ตามประเภทธุรกรรมที่เป็นที่มาของกระแสเงินสดดังกล่าว เช่น เงินให้สินเชื่อ เงินรับฝาก หรือธุรกรรมอนุพันธ์ ทั้งนี้ หากไม่สามารถแยกได้ ให้รายงานภายใต้หัวข้อสินทรัพย์อื่น หรือหนี้สินอื่นได้
- ในกรณีของสินทรัพย์หรือหนี้สินบางประเภทที่ไม่ก่อให้เกิดกระแสเงินสด เช่น เงินลงทุนในบริษัทย่อยและบริษัทร่วม ที่ดิน อาคาร หรือสินเชื่อต่อคุณภาพ ให้ ธพ. รายงานมูลค่าตามบัญชีในช่อง “Unallocated”
- สำหรับแบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิตามสัญญา (Contractual Liquidity Gap) ให้ ธพ. รายงานกระแสเงินสดตามสัญญา ในช่วงเวลาที่เกี่ยวข้อง โดยไม่คำนึงถึงการต่ออายุสัญญา (Rollover) หรือการทำสัญญาใหม่ โดยให้รายงานตามคำอธิบายรายการที่ ธพ. กำหนดในเอกสารแนบ 3

¹² เช่น ณ วันที่รายงาน มีรายการดอกเบี้ยค้างรับมูลค่า 150 บาท บันทึกในงบดุล ให้รายงานกระแสเงินสดไหลเข้าจากดอกเบี้ยสำหรับส่วนที่ครบกำหนดชำระแล้วในช่อง “ทันที” และสำหรับส่วนที่เหลือให้รายงานกระแสเงินสดไหลเข้าตามช่วงเวลาที่จะได้รับ

ซึ่งระบุรายละเอียดการรายงานเพิ่มเติมสำหรับสินทรัพย์ หนี้สิน และภาระผูกพันบางประเภท เช่น การรายงานกระแสเงินสดที่เกี่ยวกับเงินลงทุน ซึ่งต้องคำนึงถึงช่วงเวลาที่ ธพ. มีสิทธิเปลี่ยนหลักทรัพย์เป็นเงินสด ประกอบด้วย

- **สำหรับแบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิตามพฤติกรรม (Behavioural Liquidity Gap)** ให้ ธพ. รายงานกระแสเงินสดที่ได้ปรับให้เหมาะสมสอดคล้องกับพฤติกรรมที่คาดว่าจะเกิดขึ้นในภาวะปกติ โดยให้ ธพ. ระบุนิยามและสมมติฐานต่างๆ ในการปรับพฤติกรรม ใน Sheet “คำอธิบาย Behavioural Gap”

2) แบบรายงานการกระจุกตัวของแหล่งเงิน (Funding Concentration)

เพื่อให้สามารถวิเคราะห์และติดตามการกระจุกตัวของแหล่งเงินฝากและเงินกู้ยืมของ ธพ.

แบบรายงาน

แบบรายงานนี้ กำหนดให้ ธพ. จัดทำข้อมูลการกระจุกตัวของแหล่งเงินฝากและเงินกู้ยืม ซึ่งรวมถึงเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) และตราสารหนี้ (ตั๋วเงินและหุ้นกู้) เฉพาะกรณี Private placement ที่ได้รับจากผู้ฝาก เจ้าหนี้ หรือผู้ลงทุน โดยให้รายงานชุด Solo¹³ (รวมทุกสำนักงาน) และรวมบริษัทลูก (Subsidiaries) ที่เป็น ธพ.

แบบรายงานประกอบด้วย 2 ส่วน ได้แก่

ส่วนที่ 1 : ผู้ฝากเงิน เจ้าหนี้ หรือผู้ลงทุน 20 กลุ่มแรกของคู่สัญญาประเภท Non-interbank

ส่วนที่ 2 : ผู้ฝากเงิน เจ้าหนี้ หรือผู้ลงทุน 20 กลุ่มแรกของคู่สัญญาประเภท Interbank

โดยให้ ธพ. รายงานข้อมูลใน Funding Concentration Sheet รายละเอียดแบบรายงาน ตามที่กำหนดในเอกสารแนบ 4

แนวทางการรายงาน

สำหรับ**คู่สัญญาประเภท Non-interbank** ให้ ธพ. รายงานยอดรวมเงินฝากและเงินกู้ยืม ซึ่งรวมถึงเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) และตราสารหนี้ (ตั๋วเงินและหุ้นกู้) เฉพาะกรณี Private placement ของผู้ฝากเงิน เจ้าหนี้ หรือผู้ลงทุน 20 กลุ่มแรก พร้อมระบุความเกี่ยวข้องระหว่างกลุ่มคู่สัญญากับ ธพ. ประเภทคู่สัญญา (บุคคลธรรมดาหรือนิติบุคคล) และสัดส่วนต่อหนี้สินรวมทั้งสิ้น สำหรับ**คู่สัญญาประเภท Interbank** ให้ ธพ. รายงานยอดรวมเงินฝากและเงินกู้ยืม ซึ่งรวมถึงเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) และตราสารหนี้ (ตั๋วเงินและหุ้นกู้) เฉพาะกรณี Private placement ของผู้ฝากเงิน เจ้าหนี้ หรือผู้ลงทุน 20 กลุ่มแรก พร้อมระบุ ชื่อ จำนวนเงิน ซึ่งให้แบ่งตามลักษณะธุรกรรม (มีหรือไม่มีหลักประกัน) และสัดส่วนต่อหนี้สินรวมทั้งสิ้น โดยการรายงานให้อ้างอิงแนวทาง ดังนี้

¹³ สำหรับ ธพ. ที่จดทะเบียนในประเทศ ให้รายงานชุดของข้อมูลสถาบันการเงินโดยเฉพาะ (Bank only) รวมทุกสำนักงาน (รวมสาขาต่างประเทศ) และกรณีที่ ธพ. มีบริษัทลูก (Subsidiaries) ที่เป็น ธพ. ต้องนำมารวมรายงานด้วย ทั้งนี้ หาก ธพ. ถือหุ้นในบริษัทดังกล่าวน้อยกว่าร้อยละ 100 และเห็นว่าธุรกรรมของบริษัทดังกล่าวยังไม่มีความเสี่ยงด้านสภาพคล่องต่อ ธพ. ให้ ธพ. ยื่นความประสงค์ที่จะยกเว้นการรายงานข้อมูลของบริษัทดังกล่าว ต่อฝ่ายกำกับสถาบันการเงิน ธพ. อย่างน้อย 60 วันก่อนวันสิ้นสุดของการรายงานข้อมูล ทั้งนี้ ธพ. จะต้องพิจารณาทบทวนความมั่นคงสำคัญอย่างต่อเนื่อง และเมื่อพิจารณาแล้วเห็นควรให้รวมรายงานข้อมูลของบริษัทดังกล่าว ให้ ธพ. แจ้ง ธพ. เพื่อทราบก่อนวันจัดส่งข้อมูล

- “แหล่งเงิน” เงินฝากและเงินกู้ยืม¹⁴ ซึ่งรวมถึงเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) และตราสารหนี้ (ตั๋วเงินและหุ้นกู้) เฉพาะกรณี Private placement
- “กลุ่ม” หมายถึง กลุ่มของผู้ฝากเงิน เจ้าหนี้ หรือผู้ลงทุน กับผู้ที่เกี่ยวข้อง¹⁵ และกรณีนิติบุคคล ให้รวมถึงบริษัทแม่ บริษัทลูก และบริษัทร่วม ด้วย นอกจากนี้ บุคคลที่ ธพ. พิจารณาแล้วเห็นว่ามีความสัมพันธ์ของกระแสเงินเกี่ยวเนื่องกัน ให้รายงานเป็นกลุ่มเดียวกัน หรือให้ ธพ. อ้างอิงการจัดกลุ่มตามแนวทางภายในของ ธพ. หากพิจารณาแล้วเห็นว่าในภาพรวมมีแนวทางที่สอดคล้องกัน
- “Interbank” หมายถึง คู่สัญญาที่เป็นสถาบันการเงินภายใต้พระราชบัญญัติดอกเบี้ยเงินให้กู้ยืมของสถาบันการเงินที่ตั้งอยู่ในประเทศ ธนาคารอิสลามแห่งประเทศไทย และสถาบันการเงินที่อยู่ในต่างประเทศ เช่น ธนาคารกลาง ธนาคารพาณิชย์ (Bank & Investment Bank)
- “Non-interbank” หมายถึง คู่สัญญาอื่นนอกเหนือจากคู่สัญญาประเภท Interbank
- “ผู้มีความเกี่ยวข้องกับ ธพ.” หมายถึง กรรมการ ผู้มีอำนาจในการจัดการ ผู้ถือหุ้นรายใหญ่ของ สง. และผู้ที่เกี่ยวข้องกับบุคคลเหล่านี้ รวมถึง กิจกรรมที่มีผลประโยชน์เกี่ยวข้อง¹⁶ บริษัทแม่ บริษัทลูก บริษัทร่วม หรือให้ ธพ. อ้างอิงการจัดประเภทผู้มีความเกี่ยวข้องกับ ธพ. ตามแนวทางภายในของ ธพ. หากพิจารณาแล้วเห็นว่าในภาพรวมมีแนวทางที่สอดคล้องกัน ทั้งนี้ หากในกลุ่มหนึ่งๆ มีบุคคลธรรมดาหรือนิติบุคคลใดที่มีความเกี่ยวข้องกับ ธพ. ให้ถือว่าเป็นกลุ่มที่มีความเกี่ยวข้องทันที เว้นแต่ ธพ. สามารถอธิบายได้ว่ายอดเงินดังกล่าวไม่มีนัยสำคัญ
- “หนี้สินรวม¹⁷” หมายถึง ยอดหนี้สินรวมตามงบแสดงฐานะทางการเงิน ชุด Solo (รวมทุกสำนักงาน)¹⁸
- “รายชื่อ” เฉพาะกรณีของคู่สัญญา Interbank ทั้งนี้ หากในกลุ่มมีมากกว่า 1 ราย ให้ระบุชื่อทั้งหมด

¹⁴ กรณีสาขาของ ธพ. ต่างประเทศ แหล่งเงิน หมายรวมถึง ยอดสุทธิของบัญชีระหว่างกันที่สาขาเป็นลูกหนี้สำนักงานใหญ่และสาขาอื่นที่เป็นนิติบุคคลเดียวกัน บริษัทแม่และบริษัทลูกของสำนักงานใหญ่

¹⁵ ผู้ที่เกี่ยวข้อง บริษัทแม่ บริษัทลูก บริษัทร่วม ผู้ถือหุ้นรายใหญ่ และผู้มีอำนาจในการจัดการ อ้างอิงนิยามตามมาตรา 4 แห่งพระราชบัญญัติธุรกิจสถาบันการเงิน พ.ศ. 2551

¹⁶ กิจกรรมที่มีผลประโยชน์เกี่ยวข้อง อ้างอิงนิยามตามมาตรา 49 แห่งพระราชบัญญัติธุรกิจสถาบันการเงิน พ.ศ. 2551

¹⁷ กรณีสาขาของ ธพ. ต่างประเทศ หนี้สิน หมายรวมถึง ยอดสุทธิของบัญชีระหว่างกันที่สาขาเป็นลูกหนี้สำนักงานใหญ่และสาขาอื่นที่เป็นนิติบุคคลเดียวกัน บริษัทแม่และบริษัทลูกของสำนักงานใหญ่

¹⁸ กรณีที่ ธพ. มีบริษัทลูก (Subsidiaries) ที่เป็น ธพ. ให้รวมหนี้สินรวมในชุด Solo ของบริษัทลูกดังกล่าวด้วย ทั้งนี้ สำหรับสาขา ธพ. ต่างประเทศ ให้หมายถึงชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ

1	แบบรายงานการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (Liquidity Coverage Ratio - LCR)	(รายชื่อ ธพ.)				เอกสารแนบ 1 – LCR
2	ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง					-แบบรายงาน-ปรับปรุง มี.ย. 58
3	หมวด (ก) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1					
4		ปริมาณ		น้ำหนัก	ปริมาณสุทธิ	หมายเหตุ
5		บัญชีเพื่อการธนาคาร	บัญชีเพื่อการค้า			
6	(1) เงินสด			1.00		
7	(2) เงินฝากและเงินสำรองที่ธนาคารกลาง					
8	(2.1) เฉพาะส่วนที่สามารถไถ่ถอนได้ในภาวะวิกฤต			1.00		
9	(3) ตราสารหนี้ที่รับน้ำหนักความเสี่ยง 0%					
10	(3.1) ซ้ำออก หรือค้ำประกันโดยรัฐบาล			1.00		
11	(3.2) ซ้ำออก หรือค้ำประกันโดยธนาคารกลาง			1.00		
12	(3.3) ซ้ำออก หรือค้ำประกันโดยองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ			1.00		
13	(3.4) ซ้ำออก หรือค้ำประกันโดย BIS, IMF, ECB, EC หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)			1.00		
14	(4) ตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 0%					
15	(4.1) ตราสารหนี้สกุลเงินบาทที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลไทย ธปท. หรือ ตราสารหนี้ที่ออกเป็นสกุลเงินท้องถิ่นโดยรัฐบาล ธนาคารกลางของประเทศที่ ธพ. จัดทะเบียนในประเทศไทย ไปมีสาขาจัดตั้งอยู่			1.00		
16	(4.2) ตราสารหนี้สกุลเงินต่างประเทศที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลไทย ธปท. หรือ ออกโดยรัฐบาล ธนาคารกลางของประเทศที่ ธพ. จัดทะเบียนในประเทศไทยไปมีสาขาจัดตั้งอยู่ โดย จำกัดให้นับได้ไม่เกินกระแสเงินสดไหลออกสุทธิ (stressed net cash outflow) ไนสกุลเงินต่างประเทศดังกล่าวซึ่งเกิดจากการทำธุรกรรมของ ธพ. ในประเทศนั้น			1.00		
17	ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1					
18	การปรับมูลค่าสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1					
19	ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 หลังการปรับมูลค่า					
20	หมวด (ข) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A					
21		ปริมาณ		น้ำหนัก	ปริมาณสุทธิ	หมายเหตุ
22		บัญชีเพื่อการธนาคาร	บัญชีเพื่อการค้า			
23	(1) ตราสารหนี้ที่รับน้ำหนักความเสี่ยง 20%					
24	(1.1) ซ้ำออก หรือค้ำประกันโดยรัฐบาล			0.85		
25	(1.2) ซ้ำออก หรือค้ำประกันโดยธนาคารกลาง			0.85		
26	(1.3) ซ้ำออก หรือค้ำประกันโดยองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ			0.85		
27	(1.4) ซ้ำออก หรือค้ำประกันโดยธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)			0.85		
28	(2) ตราสารหนี้รัฐกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (non-financial corporates) ที่ได้รับอันดับเครดิตตั้งแต่ AA- ขึ้นไป			0.85		
29	(3) ตัวสัญญาใช้เงินซึ่งออกโดยกระทรวงการคลัง			0.85		
30	(4) ตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินเฉพาะกิจที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ย และตราสารหนี้ผู้ออกต้องได้รับอันดับเครดิตตั้งแต่ A ขึ้นไป กรณีไม่มี การจัดอันดับเครดิตต้องมีสถานะการดำเนินงานเป็น "ไม่มีปัญหา" ตามที่ สสร. กำหนด			0.85		
31	(5) หุ้นที่มีประกัน (covered bond) ที่ได้รับอันดับเครดิตตั้งแต่ AA- ขึ้นไป			0.85		
32	ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A					
33	การปรับมูลค่าสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A					
34	ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หลังการปรับมูลค่า			0.85		
35	ส่วนเกินพหุณสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2					
36						
37						
38						

39 หมวด (ค) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B

	ปริมาณ		น้ำหนัก	ปริมาณสุทธิ	หมายเหตุ
	บัญชีเพื่อการธนาคาร	บัญชีเพื่อการค้า			
(1) ตราสารหนี้ที่ได้รับน้ำหนักความเสียง 50%					
(1.1) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยรัฐบาล				0.50	
(1.2) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยธนาคารกลาง				0.50	
(1.3) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ				0.50	
(1.4) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)				0.50	
(2) ตราสารหนี้ธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (non-financial corporates) ที่ได้รับอันดับเครดิต A ถึง A+				0.50	
(3) ตัวแลกเปลี่ยนหรือสัญญาใช้เงินซึ่งออกโดยสถาบันการเงินเฉพาะกิจ				0.50	
ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B					
การปรับมูลค่าสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B					
ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B หลังการปรับมูลค่า				0.50	
ส่วนเกินตลาดสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B					

53 หมวด (ง) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (committed facilities) ที่สาขา ธพ. ต่างประเทศได้รับจากสำนักงานใหญ่เนื่องจากทำให้ความช่วยเหลือด้านสภาพคล่อง

	ปริมาณ	น้ำหนัก	ปริมาณสุทธิ	หมายเหตุ
(1) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (committed facilities) ที่สาขา ธพ. ต่างประเทศได้รับจากสำนักงานใหญ่				
(1.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้			1.00	

59 หมวด (จ) ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องทั้งสิ้น

ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องทั้งสิ้น	ปริมาณสุทธิ	หมายเหตุ

63 หมวด (ฉ) สินทรัพย์สภาพคล่องทั้งหมดของสาขาในต่างประเทศของ ธพ. จดทะเบียนในประเทศไทย

	ปริมาณ	หมายเหตุ
(1) ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องทั้งหมดของสาขาในต่างประเทศของ ธพ. จดทะเบียนในประเทศไทย ซึ่งได้รายงานในหมวด (ข) และ (ค)		

67 หมวด (ช) สินทรัพย์สภาพคล่องแบ่งตามสกุลเงินที่มีอยู่สำคัญ

	ปริมาณ	ปริมาณสุทธิ	หมายเหตุ
ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องที่ ธพ. ถือครอง แบ่งตามสกุลเงินที่มีอยู่สำคัญ			
(1) สกุลเงินบาท			
(2) สกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญ			
(2.1)			
(2.2)			
(2.3)			
(2.4)			
(2.5)			

77
78

79	ส่วนที่ 2 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลออกสุทธิ (net cash outflows)						
80	ส่วนที่ 2.1 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลออก (expected cash outflows)						
81	หมวด (ก) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายย่อย (retail deposits and borrowings)						
82		ปริมาณ		อัตราการไหลออก	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกใน 30 วัน	หมายเหตุ	
83	(1) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก						
84	(1.1) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก และเป็นบัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน (transactional accounts)			0.05			
85	(1.2) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน (non-transactional accounts) แต่เป็นบัญชีที่ลูกค้ามีความสัมพันธ์กับ ธพ. (relationship accounts) ซึ่งทำให้ความน่าจะเป็นในการถอนเงินออกเป็นไปได้อย่าง			0.05			
86	(1.3) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน (non-transactional accounts) และไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้ามีความสัมพันธ์กับ ธพ. (non-relationship accounts)			0.10			
87	(2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก			0.10			
88	(2.1) เฉพาะส่วนที่เป็นเงินรับฝากที่มีการใช้บริการธนาคารทางอินเทอร์เน็ต (internet banking)						
89	(3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมอื่น						
90	(3.1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดการชำระคืนมากกว่า 30 วัน ซึ่งผู้ฝากมีสิทธิไต่ถอนก่อนกำหนดแต่มีค่าปรับในจำนวนที่กระทบต่อดอกเบี้ยรับของลูกค้าในช่วงระหว่างวันที่ฝากจนถึงวันที่ถอนอย่างมีนัยสำคัญ			0.05			
91	(3.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีเงื่อนไขห้ามไต่ถอนก่อนกำหนด และไม่มีพฤติกรรมการไต่ถอนก่อนกำหนด			0.05			
92	(3.3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมซึ่งลูกค้าไม่มีสิทธิในการไต่ถอนภายในระยะเวลา 30 วัน หรือ เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีกำหนดการชำระคืนมากกว่า 30 วัน ซึ่งผู้ฝากมีสิทธิไต่ถอนก่อนกำหนดแต่มีค่าปรับในจำนวนที่กระทบต่อเงินต้นของลูกค้าอย่างมีนัยสำคัญ			0.00			
93	(4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายย่อยของสาขาหรือบริษัทลูก (subsidiaries) ของ ธพ. ที่จัดตั้งอยู่ในต่างประเทศซึ่งใช้ตราการไหลออกตามที่หน่วยงานกำกับดูแลในประเทศนั้นกำหนด			1.00			
94	กระแสเงินสดไหลออกทั้งสิ้นจากเงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายย่อย						
95							
96	หมวด (ข) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายใหญ่แบบไม่มีหลักประกัน (unsecured wholesale funding)						
97		ปริมาณ		อัตราการไหลออก	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกใน 30 วัน	หมายเหตุ	
98	(1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจขนาดเล็ก (small business customers)						
99	(1.1) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก						
100	(1.1.1) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก และเป็นบัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน (transactional accounts)			0.05			
101	(1.1.2) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน (non-transactional accounts) แต่เป็นบัญชีที่ลูกค้ามีความสัมพันธ์กับ ธพ. (relationship accounts) ซึ่งทำให้ความน่าจะเป็นในการถอนเงินออกเป็นไปได้อย่าง			0.05			
102	(1.1.3) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน (non-transactional accounts) และไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้ามีความสัมพันธ์กับ ธพ. (non-relationship accounts)			0.10			
103	(1.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก			0.10			
104	(1.2.1) เฉพาะส่วนที่เป็นเงินรับฝากที่มีการใช้บริการธนาคารทางอินเทอร์เน็ต (internet banking)						
105	(1.3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมอื่น						
106	(1.3.1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดการชำระคืนมากกว่า 30 วัน ซึ่งผู้ฝากมีสิทธิไต่ถอนก่อนกำหนดแต่มีค่าปรับในจำนวนที่กระทบต่อดอกเบี้ยรับของลูกค้าในช่วงระหว่างวันที่ฝากจนถึงวันที่ถอนอย่างมีนัยสำคัญ			0.05			
107	(1.3.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีเงื่อนไขห้ามไต่ถอนก่อนกำหนด และไม่มีพฤติกรรมการไต่ถอนก่อนกำหนด			0.05			
108	(1.3.3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมซึ่งลูกค้าไม่มีสิทธิในการไต่ถอนภายในระยะเวลา 30 วัน หรือ เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีกำหนดการชำระคืนมากกว่า 30 วัน ซึ่งผู้ฝากมีสิทธิไต่ถอนก่อนกำหนดแต่มีค่าปรับในจำนวนที่กระทบต่อเงินต้นของลูกค้าอย่างมีนัยสำคัญ			0.00			
109	(1.4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมธุรกิจขนาดเล็กของสาขาหรือบริษัทลูก (subsidiaries) ของ ธพ. ที่ตั้งอยู่ในต่างประเทศซึ่งใช้ตราการไหลออกตามที่หน่วยงานกำกับดูแลในประเทศนั้นกำหนด			1.00			

110	(2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากนิติบุคคลอื่นที่ไม่ใช่ธุรกิจขนาดเล็ก (wholesale customers)					
111	(2.1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (operational deposits)					
112	(2.1.1) จากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (non-financial corporates)					
113	(2.1.1.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก					0.05
114	(2.1.1.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก					0.25
115	(2.1.2) จากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)					
116	(2.1.2.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก					0.05
117	(2.1.2.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก					0.25
118	(2.1.3) จาก ธพ.					
119	(2.1.3.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก					0.05
120	(2.1.3.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก					0.25
121	(2.1.4) จากสถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น (ไม่รวม ธพ.)					
122	(2.1.4.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก					0.05
123	(2.1.4.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก					0.25
124	(2.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีง่เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (non-operational deposits)					
125	(2.2.1) จากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (non-financial corporates)					
126	(2.2.1.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน					0.20
127	(2.2.1.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน					0.40
128	(2.2.2) จากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)					
129	(2.2.2.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน					0.20
130	(2.2.2.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน					0.40
131	(2.2.3) จาก ธพ.					1.00
132	(2.2.4) จากสถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น (ไม่รวม ธพ.)					1.00
133	(2.2.5) จากบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกัน (intra-group transaction)					
134	(2.2.5.1) กระแสเงินสดไหลออกสุทธิจากธุรกรรมระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกัน (net intra-group outflow)		FALSE			1.00
135	(2.3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีง่เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการอื่น					
136	(2.3.1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีเงื่อนไขที่ได้ออกก่อนกำหนด และไม่มีการผิดนัดการไถ่ถอนก่อนกำหนด					
137	(2.3.1.1) จากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (non-financial corporates)					0.20
138	(2.3.1.2) จากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)					0.20
139	(2.3.1.3) จาก ธพ. สถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น					0.50
140	(2.3.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากลูกค้าที่เป็นนิติบุคคลซึ่งไม่มีสิทธิในการไถ่ถอนภายในระยะเวลา 30 วัน					
141	(2.3.2.1) จากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (non-financial corporates)					0.00
142	(2.3.2.2) จากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)					0.00
143	(2.3.2.3) จาก ธพ. สถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น					0.00
144	(3) กระแสเงินสดไหลออกอื่นที่ ธพ. กำหนดให้ได้รับอัตราดอกเบี้ย 100% ได้แก่ เงินรับฝากหรือเงินกู้ยืมอื่นที่ครบกำหนดใน 30 วัน เข้านี้ค้างง่ที่เกิดจากการซื้อหลักทรัพย์ซึ่งอยู่ระหว่างรอการส่งมอบ และรายการอื่นที่ ธพ. กำหนดเพิ่มเติม					1.00
145	(4) ตราสารหนี้ที่ไม่มีหลักประกัน (unsecured debt issuance)					1.00
146	(5) ปริมาณเงินสำรองที่ธนาคารกลางที่ ธพ. ต้องดำรงเพื่อปฏิบัติตามกฎหมายชั้นต่ำ					1.00
147	กระแสเงินสดไหลออกทั้งสิ้นจากเงินฝากและเงินกู้ยืมรายให่รูปแบบไม่มีหลักประกัน					
148						

149	(6) เงินรับฝากและเงินผู้ยืมที่มีลักษณะคล้ายเงินรับฝากและเงินผู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (operational deposits) แต่จัดประเภทเป็นเงินรับฝากและเงินผู้ยืมที่มีชื่อเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (non-operational deposits) ซึ่งได้รายงานในหัวข้อ (2.2)							หมายเหตุ
150	(6.1) บัญชี vostro							
151	Check: row 150 ≤ sum of rows 131 to 133	Pass						
152	(6.2) บัญชีที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการการลงทุนรายใหญ่ (prime brokerage services)							
153	Check: row 152 ≤ sum of rows 131 to 133	Pass						
154	(6.3) เงินฝากส่วนเกินกว่ายอดหมุนเวียนเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (excess balances)							
155	Check: row 154 ≤ sum of rows 126 to 127, 129 to 133	Pass						
156	หมวด (ก) กระแสเงินสดไหลออกจากเงินผู้ยืมที่มีหลักประกันซึ่งรวมถึง ธุรกรรมการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน (repo) ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ (securities lending) การให้ลูกค้ายืมหลักทรัพย์เพื่อไปเปิดฐานะชอร์ต (short position) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน							
158		จำนวนเงินที่ได้รับ	ราคาตลาดของ สินทรัพย์หลักประกัน		อัตราการทำลออก	ปริมาณกระแสเงินสด ไหลออกใน 30 วัน		หมายเหตุ
159	(1) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1							
160	(1.1) ผู้สัญญาเป็นธนาคารกลาง				0.00			
161	(1.2) ผู้สัญญาอื่น				0.00			
162	เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง							
163	Check: row 162 ≤ sum of rows 160 to 161	Pass	Pass					
164	(2) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A							
165	(2.1) ผู้สัญญาเป็นธนาคารกลาง				0.00			
166	(2.2) ผู้สัญญาอื่น				0.15			
167	เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง							
168	Check: row 167 ≤ sum of rows 165 to 166	Pass	Pass					
169	(3) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B							
170	(3.1) ผู้สัญญาเป็นธนาคารกลาง				0.00			
171	(3.2) ผู้สัญญาเป็นรัฐบาล ถูกหนีธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 20% หรือดีกว่า				0.25			
172	(3.3) ผู้สัญญาอื่น				0.50			
173	เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง							
174	Check: row 173 ≤ sum of rows 170 to 172	Pass	Pass					
175	(4) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์ชั้นอื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B							
176	(4.1) ผู้สัญญาเป็นธนาคารกลาง				0.00			
177	(4.2) ผู้สัญญาเป็นรัฐบาล ถูกหนีธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 20% หรือดีกว่า				0.25			
178	(4.3) ผู้สัญญาอื่น				1.00			
179	กระแสเงินสดไหลออกจากเงินผู้ยืมที่มีหลักประกันซึ่งรวมถึง ธุรกรรมการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน (repo) ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ (securities lending) การให้ลูกค้ายืมหลักทรัพย์เพื่อไปเปิดฐานะชอร์ต (short position) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน							
180								

181	หมวด (ง) การผูกพันที่มีสัญญา					
182		ปริมาณ			อัตราการไหลออก	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกใน 30 วัน
183	(1) กระแสเงินสดไหลออกจากธุรกรรมอนุพันธ์ (derivatives cash outflow)					1.00
184	(2) หลักประกันที่ต้องวางเพิ่มเติมและกระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากการถูกลดอันดับเครดิต					1.00
185	(3) หลักประกันที่ต้องวางเพิ่มเติมและกระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากการลดลงของมูลค่าหลักประกันที่วางไว้สำหรับการทำธุรกรรมอนุพันธ์และธุรกรรมอื่น					
186	(3.1) หลักประกันที่เป็นเงินสดและสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1					0.00
187	(3.2) หลักประกันประเภทอื่น					0.20
188	(4) หลักประกันส่วนเกินที่ผู้สัญญาวางไว้เพื่อธุรกรรมอนุพันธ์และธุรกรรมการกู้ยืมแบบมีหลักประกันอื่น ซึ่งผู้สัญญาไม่มีสิทธิเรียกคืนตามสัญญา					1.00
189	(5) หลักประกันที่ 3B. ต้องวางเพิ่มเติมสัญญาของธุรกรรมอนุพันธ์และธุรกรรมการกู้ยืมแบบมีหลักประกันอื่น แต่ผู้สัญญายังมีได้สิทธิในการเรียกหลักประกันดังกล่าว					1.00
190	(6) กระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากผู้สัญญาไม่มีสิทธิตามสัญญาในการแลกเปลี่ยนสินทรัพย์ที่ใช้เป็นหลักประกัน					1.00
191	(7) กระแสเงินสดไหลออกจากการเปลี่ยนแปลงมูลค่าของธุรกรรมอนุพันธ์หรือธุรกรรมอื่นภายในระยะเวลา 30 วัน					1.00
192	(8) กระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากการได้ออนตราสารจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (asset-backed securities) และตราสารการกู้ยืมที่ซับซ้อน (structured financing instrument) ที่ 3B. หรือบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินผู้ออก ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน					1.00
193	(9) กระแสเงินสดไหลออกที่เกี่ยวข้องกับตราสารระยะสั้นจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (asset-backed commercial paper) และนิติบุคคลเฉพาะกิจเพื่อการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (Special Purpose Vehicles/ conduits/ Securities Investment Vehicles) และธุรกรรมกู้ยืมต่าง ๆ					
194	(9.1) ส่วนที่ครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน					1.00
195	(9.2) ส่วนที่ครบกำหนดเกินกว่า 30 วัน แต่สิทธิซึ่งมีผลที่สามารถต่อระยะเวลาครบกำหนดให้เร็วขึ้นเป็นภายในระยะเวลา 30 วัน					1.00
196	(9.3) กระแสเงินสดไหลออกอื่น นอกเหนือจากรายงานในข้อ (9.1) และข้อ (9.2)					1.00
197	(10) กระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากการได้ออนตราสารที่มีประกัน (covered bond) ที่ 3B. เป็นผู้ออก ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน					1.00
198	(11) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (committed facilities) ที่ให้แก่ลูกค้ารายย่อย (retail) และธุรกิจขนาดเล็ก (small business customers) เพื่อวัตถุประสงค์ในการได้ออนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (liquidity facilities) และวัตถุประสงค์อื่น (credit facilities)					0.05
199	(12) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (committed facilities) ที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (credit facilities)					
200	(12.1) ลูกค้าเป็นธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (non-financial corporates)					0.10
201	(12.2) ลูกค้าเป็นรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)					0.10
202	(13) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (committed facilities) ที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์ในการได้ออนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (liquidity facilities)					
203	(13.1) ลูกค้าเป็นธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (non-financial corporates)					0.30
204	(13.2) ลูกค้าเป็นรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)					0.30
205	(14) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (committed facilities) ที่ให้แก่ 3B. เพื่อวัตถุประสงค์ในการได้ออนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (liquidity facilities) และวัตถุประสงค์อื่น (credit facilities)					
206	(14.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่					0.40
207	(14.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน					0.40
208	(14.3) ที่ให้แก่ 3B. อื่น					0.40
209	(15) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (committed facilities) ที่ให้แก่สถาบันการเงิน ซึ่งไม่รวม 3B. เพื่อวัตถุประสงค์อื่น (credit facilities)					
210	(15.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่					0.40
211	(15.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน					0.40
212	(15.3) ที่ให้แก่สถาบันการเงินอื่น					0.40
213	(16) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (committed facilities) ที่ให้แก่สถาบันการเงิน ซึ่งไม่รวม 3B. เพื่อวัตถุประสงค์ในการได้ออนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (liquidity facilities)					
214	(16.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่					1.00
215	(16.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน					1.00
216	(16.3) ที่ให้แก่สถาบันการเงินอื่น					1.00
217	(17) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (committed facilities) ที่ให้แก่นิติบุคคลอื่น เพื่อวัตถุประสงค์ในการได้ออนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (liquidity facilities) และวัตถุประสงค์อื่น (credit facilities)					
218	(17.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่					1.00
219	(17.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน					1.00
220	(17.3) ที่ให้แก่นิติบุคคลอื่น					1.00

221							
222	หมวด (ก) การผูกพันตามสัญญาซึ่ง ธพ. ให้สิทธิในการขายอายุสัญญาเงินเชื่อแก่ลูกค้า						
223		ปริมาณ	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกซึ่งคำนึงถึงการปล่อยสินเชื่อให้กับลูกค้า	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกส่วนที่มากกว่าปริมาณการปล่อยสินเชื่อให้กับลูกค้า	อัตราการไหลออก	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกใน 30 วัน	หมายเหตุ
224	(1) ผู้สัญญาเป็น ธพ. หรือสถาบันการเงินอื่น					1.00	
225	(2) ผู้สัญญาเป็นลูกค้ารายย่อย (retail)						
226	(3) ผู้สัญญาเป็นธุรกิจขนาดเล็ก (small business customers)						
227	(4) ผู้สัญญาเป็นธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (non-financial corporates)						
228	(5) ผู้สัญญาอื่น นอกเหนือจากข้อ (1) – (4)						
229	ผลรวมของกระแสผูกพันอื่นตามสัญญาอื่น ที่จะจ่ายเงินหรือให้กู้ยืมแก่ผู้สัญญาตามข้อ (2) ถึง (5)					1.00	
230	การผูกพันตามสัญญาอื่น ที่จะจ่ายเงินหรือให้กู้ยืมแก่ผู้สัญญา						
231							
232						ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกใน 30 วัน	หมายเหตุ
233	กระแสเงินสดไหลออกทั้งสิ้นจากการผูกพันที่มีสัญญา						
234							
235	หมวด (ก) การผูกพันอื่น ทั้งที่มีสัญญาและไม่มีสัญญา						
236		ปริมาณ			อัตราการไหลออก	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกใน 30 วัน	หมายเหตุ
237	(1) รายการการผูกพันที่เป็นสัญญา						
238	(1.1) เงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งสามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (unconditionally revocable uncommitted facilities)					0.00	
239	(1.2) ธุรกรรมที่เกี่ยวกับบริการทางการเงินเพื่อการค้า (trade finance-related obligations)					0.005	
240	(1.3) รายการค้ำประกัน รับรอง อวัล เล็ตเตอร์ออฟเครดิต ที่ไม่เกี่ยวข้องกับบริการทางการเงินเพื่อการค้า (Guarantees L/C unrelated to trade finance obligations)					0.01	
241	(1.4) การเปิดฐานะซอร์ต (short position) ของ ธพ. โดยใช้หลักทรัพย์ของลูกค้านำมาวางไว้เป็นหลักประกันกับ ธพ.					0.00	
242	(1.5) รายการการผูกพันตามสัญญาอื่น					1.00	
243	(2) การผูกพันที่ไม่มีสัญญาผูกมัด แต่อาจส่งผลให้ ธพ. มีกระแสเงินสดไหลออก						
244	(2.1) การรับซื้อคืนตราสารหนี้ (debt-buy back requests) และธุรกรรมซับซ้อน (structured products)						
245	(2.1.1) กรณี ธพ. หรือบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินไม่ได้ทำหน้าที่เป็นผู้ค้าตราสารหนี้ (dealer) หรือเป็นผู้สร้างสภาพคล่องในตลาด (market maker)					0.05	
246	(2.1.2) กรณี ธพ. หรือบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินทำหน้าที่เป็นผู้ค้าตราสารหนี้ (dealer) หรือเป็นผู้สร้างสภาพคล่องในตลาด (market maker)					0.10	
247	(2.2) การให้ความช่วยเหลือกองทุน (managed funds) ที่บริหารโดยบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน					0.05	
248	(2.3) การให้ความช่วยเหลือสภาพคล่องแก่ joint venture และ minority investment					1.00	
249	(2.4) การเปิดฐานะซอร์ต (short position) ของลูกค้าซึ่ง ธพ. ให้กู้ยืมหลักทรัพย์ที่นำมาจากบัญชีลูกค้าอื่น					0.50	
250	กระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากการการผูกพันอื่น ทั้งที่มีสัญญาและไม่มีสัญญา						
251							

252	หมวด (ข) กระแสเงินสดไหลออกทั้งสิ้น				
253				ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกใน 30 วัน	หมายเหตุ
254	กระแสเงินสดไหลออกทั้งสิ้น				

255	หมวด (ข) กระแสเงินสดไหลออกทั้งสิ้นแบ่งตามสกุลเงินที่มีนัยสำคัญ				
256		ปริมาณ		ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกใน 30 วัน	หมายเหตุ
257					
258	กระแสเงินสดไหลออกทั้งสิ้น แบ่งตามสกุลเงินที่มีนัยสำคัญ				
259	(1) สกุลเงินบาท				
260	(2) สกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญ				
261	(2.1)				
262	(2.2)				
263	(2.3)				
264	(2.4)				
265	(2.5)				

266 ส่วนที่ 2.2 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลเข้า (expected cash inflows)

267

268

269 หมวด (ก) กระแสเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน (reverse repo) และการกู้ยืมหลักทรัพย์ (securities borrowing) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน

270		จำนวนเงินที่กู้ยืม	ราคาตลาดของหลักทรัพย์หลักประกัน	อัตราการไหลเข้า	ปริมาณกระแสเงินสดไหลเข้าใน 30 วัน	หมายเหตุ
271	กระแสเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมซื้อขายหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน (reverse repo) และการกู้ยืมหลักทรัพย์ (securities borrowing) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน					
272	(1) กรณี ธพ. มีสินทรัพย์ประกันที่ได้ออกการให้กู้ยืมเงินไปใช้ต่อ (non-rehypothecation) เช่น เปิดฐานะซอร์ค (covered short position) หรือนำไปใช้ต่อซึ่งมีผลทำให้หลักประกันดังกล่าวคิดการผูกพันไม่เกิน 30 วัน					
273	(1.1) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1			0.00		
274	(1.1.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง					
275	Check: row 274 ≤ row 273	Pass	Pass			
276	(1.2) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A			0.15		
277	(1.2.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง					
278	Check: row 277 ≤ row 276	Pass	Pass			
279	(1.3) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B			0.50		
280	(1.3.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง					
281	Check: row 280 ≤ row 279	Pass	Pass			
282	(1.4) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์ชั้นอื่นที่ไม่ใช่ขายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B			1.00		
283	(1.5) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์ชั้นอื่นที่ไม่ใช่ขายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B ซึ่ง ธพ. ได้รับจากธุรกรรม margin lending			0.50		
284	(2) กรณี ธพ. นำหลักประกันที่ได้ออกการให้กู้ยืมเงินไปใช้ต่อ (rehypothecation) เช่น เปิดฐานะซอร์ค (covered short position) ซึ่งมิผลทำให้หลักประกันดังกล่าวคิดการผูกพันเกินกว่า 30 วัน					
285	(2.1) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1			0.00		
286	(2.2) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A			0.00		
287	(2.3) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B			0.00		
288	(2.4) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์ชั้นอื่นที่ไม่ใช่ขายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B			0.00		
289	(2.5) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์ชั้นอื่นที่ไม่ใช่ขายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B ซึ่ง ธพ. ได้รับจากธุรกรรม margin lending			0.00		
290	กระแสเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมซื้อขายหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน (reverse repo) และการกู้ยืมหลักทรัพย์ (securities borrowing) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน					

291

292	หมวด (ข) ภาระเงินสดไหลเข้าจากการรับชำระคืนเงินให้สินเชื่อจากลูกหนี้ที่มีคุณภาพดี (fully performing loans) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน						
293		ปริมาณ		อัตราการไหลเข้า	ปริมาณภาระเงินสดไหลเข้าใน 30 วัน	หมายเหตุ	
294	(1) การรับชำระคืนเงินให้สินเชื่อและเงินฝากจากผู้มีคุณภาพดี (fully performing loans) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน						
295	(1.1) ลูกหนี้รายย่อย (retail)				0.50		
296	(1.2) ลูกหนี้ธุรกิจขนาดเล็ก (small business customers)				0.50		
297	(1.3) ลูกหนี้ธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (non-financial corporates)				0.50		
298	(1.4) ลูกหนี้ธนาคารกลาง				1.00		
299	(1.5) ลูกหนี้ ธพ. และ สถาบันการเงินอื่น (financial institutions)						
300	(1.5.1) เงินฝากเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (operational deposits) ที่ฝากไว้ที่ ธพ. และสถาบันการเงินอื่น				0.00		
301	(1.5.2) กรณีเงินฝากหรือการชำระหนี้อื่นซึ่งครบกำหนดใน 30 วัน				1.00		
302	(1.6) ลูกหนี้ที่เป็นนิติบุคคลอื่น				0.50		
303	(1.7) เฉพาะส่วนที่เป็นเงินรับชำระคืนเงินให้สินเชื่อที่เป็น call loan ซึ่งได้รายงานไปข้อ (1.1) ถึง (1.6)						
304	(1.8) ลูกหนี้ที่เป็นบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกัน (intra-group transaction)						
305	(1.8.1) ภาระเงินสดไหลเข้าสุทธิจากธุรกรรมระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกัน (net intra-group inflow)		FALSE		1.00		
306	(2) การรับชำระคืนเงินให้สินเชื่ออื่นที่ ธปท. กำหนดที่ได้รับอัตราไหลเข้า 100% ได้แก่ เงินให้สินเชื่อ soft loan ลูกหนี้ค้างรับที่เกิดจากการขายหลักทรัพย์ซึ่งอยู่ระหว่างรอการส่งมอบรายการเงินสดระหว่างเรียกเก็บ และรายการอื่นที่ ธปท. กำหนดเพิ่มเติม				1.00		
307	(3) ภาระเงินสดไหลเข้าจากตราสารหนี้ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน				1.00		
308	ภาระเงินสดไหลเข้าจากการรับชำระคืนเงินให้สินเชื่อจากลูกหนี้ที่มีคุณภาพดี (fully performing loans) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน						
309	หมวด (ค) ภาวะผูกพันที่มีสัญญา						
310		ปริมาณ		อัตราการไหลเข้า	ปริมาณภาระเงินสดไหลเข้าใน 30 วัน	หมายเหตุ	
311	(1) ภาวะผูกพันที่มีสัญญา						
312	(1.1) ภาระเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมอนุพันธ์ (derivatives cash inflow)				1.00		
313	(1.2) ภาระเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมอื่น				1.00		
314	ภาระเงินสดไหลเข้าจากภาวะผูกพันที่มีสัญญา						
315	หมวด (ง) ภาระเงินสดไหลเข้าทั้งสิ้น						
316		ปริมาณ		อัตราการไหลเข้า	ปริมาณภาระเงินสดไหลเข้าใน 30 วัน	หมายเหตุ	
317	ภาระเงินสดไหลเข้าทั้งสิ้นก่อนการกำหนดผลของภาระเงินสดไหลเข้า						
318	ภาระเงินสดไหลเข้าที่ถูกลดไว้ในผลของภาระเงินสดไหลเข้า				0.75		
319	ภาระเงินสดไหลเข้าทั้งสิ้นหลังการกำหนดผลของภาระเงินสดไหลเข้า						
320	หมวด (จ) ภาระเงินสดไหลเข้าทั้งสิ้นแบ่งตามสกุลเงินที่มีนัยสำคัญ						
321		ปริมาณ		อัตราการไหลเข้า	ปริมาณภาระเงินสดไหลเข้าใน 30 วัน	หมายเหตุ	
322	ภาระเงินสดไหลเข้าทั้งสิ้นก่อนการกำหนดผลของภาระเงินสดไหลเข้า แบ่งตามสกุลเงินที่มีนัยสำคัญ						
323	(1) สกุลเงินบาท						
324	(2) สกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญ						
325	(2.1)						
326	(2.2)						
327	(2.3)						
328	(2.4)						
329	(2.5)						

334	ส่วนที่ 3 : ธุรกิจการแลกเปลี่ยนหลักประกัน (collateral swaps) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน						
335							
336							
337		ราคาลาดของ สินทรัพย์ที่ยืม	ราคาลาดของ สินทรัพย์ที่ยืม		อัตราการไหลออก	ปริมาณกระแสเงินสด ไหลออกใน 30 วัน	อัตราการไหลเข้า ไหลเข้าใน 30 วัน
338	ธุรกิจการแลกเปลี่ยนหลักประกัน (collateral swaps) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน						
339	(1) กรณีมีได้มาสินทรัพย์ที่ได้รับมาจากการทำธุรกรรมไปใช้ต่อ (non-rehypothecation) เช่น เปิดฐานะซอร์ต (covered short position) หรือนำไปใช้ต่อซึ่งมีผลทำให้หลักประกันดังกล่าวติด ภาระผูกพันแต่ไม่เกิน 30 วัน						
340	(1.1) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1						
341	(1.1.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
342	Check: row 341 ≤ row 340						
343	(1.2) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2A						
344	(1.2.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
345	Check: row 344 ≤ row 343						
346	(1.3) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2B						
347	(1.3.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
348	Check: row 347 ≤ row 346						
349	(1.4) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2A หรือ 2B						
350	(1.4.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
351	Check: row 350 ≤ row 349						
352	(1.5) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2A แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1						
353	(1.5.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
354	Check: row 353 ≤ row 352						
355	(1.6) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2A แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2A						
356	(1.6.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
357	Check: row 356 ≤ row 355						
358	(1.7) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2A แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2B						
359	(1.7.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
360	Check: row 359 ≤ row 358						
361	(1.8) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2A แลกกับการยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2A หรือ 2B						
362	(1.8.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
363	Check: row 362 ≤ row 361						
364	(1.9) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1						
365	(1.9.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
366	Check: row 365 ≤ row 364						
367	(1.10) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2A						
368	(1.10.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
369	Check: row 368 ≤ row 367						
370	(1.11) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2B						
371	(1.11.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
372	Check: row 371 ≤ row 370						
373	(1.12) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 2A หรือ 2B						
374	(1.12.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง						
375	Check: row 374 ≤ row 373						

คำอธิบายรายการสำหรับแบบรายงานการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (Liquidity Coverage Ratio - LCR)

ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
4	หมวด (ก) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1	
		ในการรายงานสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/3 ข้อ 1.1] กำหนดให้ ธพ. รายงานมูลค่าตามบัญชี สำหรับรายการเงินสดในข้อ (1) และเงินฝากและเงินสำรองที่ธนาคารกลางในข้อ (2) และให้รายงานราคาตลาดซึ่งเป็นราคาที่รวมดอกเบี้ยรับ (Gross price) สำหรับรายการตราสารหนี้ทุกประเภท โดยให้แบ่งตามประเภทบัญชี ได้แก่ บัญชีเพื่อการธนาคาร (Banking book account) ซึ่งรวมถึงสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ที่ได้รับมาจากธุรกรรมการซื้อหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน (Reverse repo) ธุรกรรมการยืมหลักทรัพย์ (Securities borrowing) และธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกัน (Collateral swaps) ใน Column D และบัญชีเพื่อการค้า (Trading book account) ใน Column E
7	(1) เงินสด	ปริมาณเงินสดที่ ธพ. ถือครองทั้งหมด [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/3 ข้อ 1.1.1] ทั้งนี้ ไม่รวมเงินสดที่ฝากไว้กับสถาบันการเงินอื่น และเงินสดระหว่างเรียกเก็บ ซึ่งให้รายงานใน ส่วนที่ 2.2 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลเข้า (Expected cash inflows) หมวด (ข) กระแสเงินสดไหลเข้าจากการรับชำระคืนเงินให้สินเชื่อจากลูกหนี้ที่มีคุณภาพดี (Fully performing loans) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ข้อ (1.5) ลูกหนี้ ธพ. และ สถาบันการเงินอื่น (Financial institutions) และ ข้อ (2) การรับชำระคืนเงินให้สินเชื่ออื่นที่ ธพท. กำหนดให้ได้รับอัตราการไหลเข้า 100% ได้แก่ เงินให้สินเชื่อ Soft loan ลูกหนี้ค้างรับที่เกิดจากการขายหลักทรัพย์ซึ่งอยู่ระหว่างรอการส่งมอบ รายการเงินสดระหว่างเรียกเก็บ และรายการอื่นที่ ธพท. กำหนดเพิ่มเติมตามลำดับ
8	(2) เงินฝากและเงินสำรองที่ธนาคารกลาง	ปริมาณเงินฝากและเงินสำรองที่ธนาคารกลางทั้งหมด ซึ่งรวมถึงเงินสำรองที่ต้องดำรงตามกฎหมายขั้นต่ำ [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/3 ข้อ 1.1.2]
9	(2.1) เฉพาะส่วนที่สามารถไถ่ถอนได้ในภาวะวิกฤต	ปริมาณเงินฝากและเงินสำรองที่ ธพท. ทั้งหมด และเงินฝากและเงินสำรองที่ธนาคารกลางของประเทศที่ ธพ. จัดทะเบียนในประเทศไทยไปมีสาขาจัดตั้งอยู่เฉพาะส่วนที่เกินจากส่วนที่ต้อง

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		<p>ดำรงขึ้นต่ำตามกฎหมายตามที่ผู้กำกับดูแลในแต่ละประเทศกำหนด ซึ่งได้รายงานใน ข้อ (2) เงินฝากและเงินสำรองที่ธนาคารกลาง</p> <p>ทั้งนี้ หากมีส่วนขาดให้ ธพ. รายงานส่วนขาดจากส่วนที่ต้องดำรงตามกฎหมายขั้นต่ำใน ส่วนที่ 2.1 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลออก (Expected cash outflows) หมวด (ข) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายใหญ่แบบไม่มีหลักประกัน (Unsecured wholesale funding) ข้อ (5) ปริมาณเงินสำรองที่ธนาคารกลางที่ ธพ. ต้องดำรงเพิ่มเพื่อปฏิบัติตามกฎหมายขั้นต่ำ</p>
10	<p>(3) ตราสารหนี้ที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 0%</p> <p>ตราสารหนี้ที่ปราศจากภาระผูกพัน ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ ธนาคารเพื่อการชำระหนี้ระหว่างประเทศ (Bank for International Settlement: BIS) กองทุนการเงินระหว่างประเทศ (International Monetary Fund: IMF) ธนาคารกลางสหภาพยุโรป (European Central Bank: ECB) สหภาพยุโรป (European Commission: EC) หรือธนาคารเพื่อการพัฒนา ระหว่างประเทศ (Multilateral Development Banks: MDBs) ที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 0 ตามหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตโดยวิธี SA [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/3 ข้อ 1.1.3]</p>	
11	(3.1) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยรัฐบาล	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 0
12	(3.2) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยธนาคารกลาง	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยธนาคารกลางที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 0
13	(3.3) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 0
14	(3.4) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดย BIS, IMF, ECB, EC หรือธนาคารเพื่อการพัฒนา ระหว่างประเทศ (MDBs)	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดย Bank for International Settlement (BIS), International Monetary Fund (IMF), European Central Bank (ECB), European Commission (EC) หรือธนาคารเพื่อการพัฒนา ระหว่างประเทศ (MDBs) ที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 0

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
15	(4) ตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 0% ตราสารหนี้ที่ปราศจากภาระผูกพัน ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลไทยหรือ ธพท. ซึ่งหมายรวมถึงคู่สัญญาที่ถูกจัดประเภทเป็นลูกหนี้รัฐบาลไทยและ ธพท. ได้แก่ กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาาระบบสถาบันการเงิน (FIDF) สถาบันคุ้มครองเงินฝาก (DPA) และบริษัทบริหารสินทรัพย์กรุงเทพพาณิชย์ จำกัด (BAM) หรือ ตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลหรือธนาคารกลางของประเทศที่ ธพท. จดทะเบียนในประเทศไทยไปมีสาขาจัดตั้งอยู่ ที่ไม่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 0 ตามหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตโดยวิธี SA [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/4 ข้อ 1.1.4]	
16	(4.1) ตราสารหนี้สกุลเงินบาทที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลไทย ธพท. หรือ ตราสารหนี้ที่ออกเป็นสกุลเงินท้องถิ่นโดยรัฐบาลธนาคารกลางของประเทศที่ ธพท. จดทะเบียนในประเทศไทยไปมีสาขาจัดตั้งอยู่	ปริมาณคงค้าง ตราสารหนี้สกุลเงินบาทที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลไทยหรือ ธพท. หรือ ตราสารหนี้สกุลเงินท้องถิ่นที่ออกโดยรัฐบาลหรือธนาคารกลางของประเทศที่ ธพท. จดทะเบียนในไทยไปมีสาขาจัดตั้งอยู่ และตราสารหนี้ดังกล่าวไม่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 0 [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/4 ข้อ 1.1.4.1]
17	(4.2) ตราสารหนี้สกุลเงินต่างประเทศที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลไทย ธพท. หรือ ออกโดยรัฐบาล ธนาคารกลางของประเทศที่ ธพท. จดทะเบียนในประเทศไทยไปมีสาขาจัดตั้งอยู่ โดยจำกัดให้นับได้ไม่เกินกระแสเงินสดไหลออกสุทธิ (Stressed net cash outflow) ในสกุลเงินต่างประเทศดังกล่าวซึ่งเกิดจากการทำธุรกรรมของ ธพท. ในประเทศนั้น	ปริมาณคงค้าง ตราสารหนี้สกุลเงินต่างประเทศที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลไทยหรือ ธพท. หรือ ตราสารหนี้สกุลเงินต่างประเทศที่ไม่ใช่สกุลเงินท้องถิ่นซึ่งออกโดยรัฐบาลหรือธนาคารกลางของประเทศที่ ธพท. จดทะเบียนในไทยไปมีสาขาจัดตั้งอยู่ และตราสารหนี้ดังกล่าวไม่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 0 [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/4 ข้อ 1.1.4.2]
22	หมวด (ข) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ในการรายงานสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/4 ข้อ 1.2.1] กำหนดให้ ธพท. รายงานราคาตลาดซึ่งเป็นราคาที่รวมดอกเบี้ยรับ (Gross price) สำหรับรายการตราสารหนี้ทุกประเภท โดยให้แบ่งตามประเภทบัญชี ได้แก่ บัญชีเพื่อการธนาคาร (Banking book	

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		account) ซึ่งรวมถึงสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ที่ได้รับมาจากธุรกรรมการซื้อหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน (Reverse repo) ธุรกรรมการยืมหลักทรัพย์ (Securities borrowing) และธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกัน (Collateral swaps) ใน Column D และบัญชีเพื่อการค้า (Trading book account) ใน Column E
25	(1) ทรสารหนี้ที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 20% ทรสารหนี้ที่ปราศจากภาวะผูกพัน ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) ที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 20 ตามหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตโดยวิธี SA [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/4 ข้อ 1.2.1.1]	
26	(1.1) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยรัฐบาล	ปริมาณคงค้างทรสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 20
27	(1.2) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยธนาคารกลาง	ปริมาณคงค้างทรสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยธนาคารกลางที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 20
28	(1.3) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ	ปริมาณคงค้างทรสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 20
29	(1.4) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)	ปริมาณคงค้างทรสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) ที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 20
30	(2) ทรสารหนี้ธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (Non-financial corporates) ที่ได้รับอันดับเครดิตตั้งแต่ AA- ขึ้นไป	ปริมาณคงค้างทรสารหนี้ธุรกิจเอกชนที่ปราศจากภาวะผูกพัน และทรสารดังกล่าวได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า AA- หรือเทียบเท่า [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/5 ข้อ 1.2.1.2]
31	(3) ตั๋วสัญญาใช้เงินซึ่งออกโดยกระทรวงการคลัง	ปริมาณคงค้างตั๋วสัญญาใช้เงินแบบมีใบหุ้นหรือหลักทรัพย์ (Scrip) ซึ่งออกโดยกระทรวงการคลังที่ปราศจากภาวะผูกพัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/5 ข้อ 1.2.1.3]

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
32	(4) ตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินเฉพาะกิจที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ย และตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับอันดับเครดิตตั้งแต่ A ขึ้นไป กรณีไม่มีการจัดอันดับเครดิตต้องมีสถานะการดำเนินงานเป็น "ไม่มีปัญหา" ตามที่ สคร. กำหนด	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ที่ออกโดยรัฐวิสาหกิจหรือสถาบันการเงินเฉพาะกิจที่กระทรวงการคลังไม่ค้ำประกันเงินต้นและดอกเบี้ยที่ปราศจากภาระผูกพัน และตราสารหรือผู้ออกต้องได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า A หรือเทียบเท่า ในกรณีไม่มีการจัดอันดับเครดิตต้องมีสถานะการดำเนินงานเป็น "ไม่มีปัญหา" ตามหลักเกณฑ์ที่สำนักคณะกรรมการนโยบายรัฐวิสาหกิจ (สคร.) กำหนด [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/5 ข้อ 1.2.1.4]
33	(5) หุ้นกู้มีประกัน (Covered bond) ที่ได้รับอันดับเครดิตตั้งแต่ AA- ขึ้นไป	ปริมาณคงค้างหุ้นกู้มีประกัน (Covered bond) ที่ปราศจากภาระผูกพัน และหุ้นกูดังกล่าวได้รับการจัดอันดับเครดิตไม่ต่ำกว่า AA- หรือเทียบเท่า [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/5 ข้อ 1.2.1.5]
39	<p>หมวด (ค) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B</p> <p>ในการรายงานสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/5 ข้อ 1.2.2] กำหนดให้ ธพ. รายงานราคาตลาดซึ่งเป็นราคาที่ยรวมดอกเบี้ยรับ (Gross price) สำหรับรายการตราสารหนี้ทุกประเภท โดยให้แบ่งตามประเภทบัญชี ได้แก่ บัญชีเพื่อการธนาคาร (Banking book account) ซึ่งรวมถึงสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B ที่ได้รับมาจากธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน (Reverse repo) ธุรกรรมการยืมหลักทรัพย์ (Securities borrowing) และธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกัน (Collateral swaps) ใน Column D และบัญชีเพื่อการค้า (Trading book account) ใน Column E</p>	
42	<p>(1) ตราสารหนี้ที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 50%</p> <p>ตราสารหนี้ที่ปราศจากภาระผูกพัน ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจหรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) ที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 50 ตามหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตโดยวิธี SA [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/5 ข้อ 1.2.2.1]</p>	
43	(1.1) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยรัฐบาล	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 50
44	(1.2) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยธนาคารกลาง	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยธนาคารกลางที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 50

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
45	(1.3) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 50
46	(1.4) ซึ่งออก หรือค้ำประกันโดยธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ซึ่งออกหรือค้ำประกันโดยธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) ที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 50
47	(2) ตราสารหนี้ธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (Non-financial corporates) ที่ได้รับอันดับเครดิต A ถึง A+	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ธุรกิจเอกชนที่ปราศจากภาระผูกพัน และตราสารดังกล่าวได้รับการจัดอันดับเครดิตตั้งแต่ A ถึง A+ หรือเทียบเท่า [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/6 ข้อ 1.2.2.2]
48	(3) ตัวแลกเงินหรือตัวสัญญาใช้เงินซึ่งออกโดยสถาบันการเงินเฉพาะกิจ	ปริมาณคงค้างตัวแลกเงิน และตัวสัญญาใช้เงินแบบมิใบหุ้นหรือหลักทรัพย์ (Scrip) ซึ่งออกโดยสถาบันการเงินเฉพาะกิจที่ปราศจากภาระผูกพัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/6 ข้อ 1.2.2.3]
54	หมวด (ง) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ที่สาขา ธพ. ต่างประเทศได้รับจากสำนักงานใหญ่เนื่องจากการให้ความช่วยเหลือด้านสภาพคล่อง	
56	(1) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ที่สาขา ธพ. ต่างประเทศได้รับจากสำนักงานใหญ่	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ซึ่งมีลักษณะเป็นสัญญาและมีผลผูกพันทางกฎหมาย เฉพาะส่วนที่ยังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่งสาขา ธพ. ต่างประเทศที่จัดตั้งอยู่ในประเทศไทยได้รับจากสำนักงานใหญ่ในต่างประเทศ [ประกาศ LCR หน้า 7]
63	หมวด (ฉ) สินทรัพย์สภาพคล่องทั้งหมดของสาขาในต่างประเทศของ ธพ. จดทะเบียนในประเทศไทย	
65	(1) ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องทั้งหมดของสาขาในต่างประเทศของ ธพ. จดทะเบียนในประเทศไทย ซึ่งได้รายงานในหมวด (ก) (ข) และ (ค)	ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องทั้งหมดของสาขาในต่างประเทศของ ธพ. จดทะเบียนในประเทศไทย ซึ่งได้รายงานใน หมวด (ก) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 หมวด (ข) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A และ หมวด (ค) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B [เพื่อประกอบการพิจารณาประเด็น Excess HQLA ในประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 1/8 ข้อ 6]

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
67	หมวด (ข) สินทรัพย์สภาพคล่องแบ่งตามสกุลเงินที่มีนัยสำคัญ ในการรายงานสินทรัพย์สภาพคล่องแบ่งตามสกุลเงินที่มีนัยสำคัญ กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องในรูปสกุลเงินบาท และสกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญทั้งสิ้นที่ ธพ. ได้รายงานไว้ใน หมวด (ก) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 หมวด (ข) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หมวด (ค) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B และ หมวด (ง) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ที่สาขา ธพ. ต่างประเทศได้รับจากสำนักงานใหญ่เนื่องจากการให้ความช่วยเหลือด้านสภาพคล่อง โดยให้ ธพ. ระบุสกุลเงินที่มีนัยสำคัญไว้ที่หัวข้อใน Column C และรายงานปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องในแต่ละสกุลเงินก่อนปรับด้วยอัตราส่วนลดใน Column D และปริมาณหลังปรับด้วยอัตราส่วนลดใน Column I	
70	(1) สกุลเงินบาท	ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องที่อยู่ในรูปสกุลเงินบาท
71	(2) สกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญ สกุลเงินที่มีนัยสำคัญ หมายถึง สกุลเงินที่ผลรวมของหนี้สินในสกุลเงินนั้นและภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน (Off balance sheet) ประเภท Foreign exchange forward และ Cross currency swaps ที่จะทำให้เกิดกระแสเงินไหลออกในสกุลนั้นมากกว่าหรือเท่ากับร้อยละ 5 ของผลรวมของหนี้สินทั้งสิ้นและภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน (Off balance sheet) ประเภท Foreign exchange forward และ Cross currency swaps	
72 - 76	(2.1) – (2.5)	ปริมาณสินทรัพย์สภาพคล่องที่อยู่ในรูปสกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญ

ส่วนที่ 2 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลออกสุทธิ (Net cash outflows)

ส่วนที่ 2.1 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลออก (Expected cash outflows)

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
81	หมวด (ก) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายย่อย (Retail deposits and borrowings) ในการรายงานเงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายย่อย [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/1 ข้อ 1] กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากคู่สัญญาที่เป็นบุคคลธรรมดา ใน Column D โดยให้แบ่งตามประเภทสัญญา การได้รับการคุ้มครองเงินฝาก และลักษณะของบัญชีเงินรับฝากและเงินกู้ยืม	
83	(1) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก เงินรับฝากจากบุคคลธรรมดาประเภท (1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อทวงถาม (2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาซึ่งมีกำหนดชำระคืนภายในระยะเวลา 30 วัน (3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ผู้ฝากเงินมีสิทธิในการไถ่ถอนก่อนกำหนดได้โดยไม่เสียค่าปรับหรือเสียค่าปรับอย่างไม่มีนัยสำคัญ และ (4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ ธพ. มีสิทธิจ่ายคืนก่อนครบกำหนดและหากไม่ใช้สิทธิอาจมีผลกระทบในทางลบต่อชื่อเสียงของ ธพ. [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 1-4] เฉพาะส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก	
84	(1.1) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากและเป็นบัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน (Transactional accounts)	ปริมาณเงินรับฝากจากบุคคลธรรมดาซึ่งเป็นบัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/1 ข้อ 1.1.1] เฉพาะส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก
85	(1.2) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน (Non-transactional accounts) แต่เป็นบัญชีที่ลูกค้ามีความสัมพันธ์กับ ธพ. (Relationship accounts) ซึ่งทำให้ความน่าจะเป็นในการถอนเงินออกเป็นไปได้ยาก	ปริมาณเงินรับฝากจากบุคคลธรรมดาซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน แต่เป็นบัญชีที่ลูกค้าผู้ฝากเงินมีความสัมพันธ์กับ ธพ. [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/1 ข้อ 1.1.2] เฉพาะส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก
86	(1.3) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทาง	ปริมาณเงินรับฝากจากบุคคลธรรมดาซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน และลูกค้าผู้ฝากเงินมิได้มีความสัมพันธ์กับ ธพ. [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 1.2] เฉพาะ

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
	การเงิน (Non-transactional accounts) และไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้ามีความสัมพันธ์กับ ธพ. (Non-relationship accounts)	<u>ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก</u>
87	(2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากบุคคลธรรมดาประเภท (1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อทวงถาม (2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาซึ่งมีกำหนดชำระคืนภายในระยะเวลา 30 วัน (3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ผู้ฝากเงินมีสิทธิในการไถ่ถอนก่อนกำหนดได้โดยไม่เสียค่าปรับหรือเสียค่าปรับอย่างไม่มีนัยสำคัญ และ (4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ ธพ. มีสิทธิจ่ายคืนก่อนครบกำหนดและหากไม่ใช่สิทธิอาจมีผลกระทบในทางลบต่อชื่อเสียงของ ธพ. [<i>ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 1-4</i>] <u>ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก</u>
88	(2.1) เฉพาะส่วนที่เป็นเงินรับฝากที่มีการใช้บริการธนาคารทางอินเทอร์เน็ต (Internet banking)	ปริมาณเงินรับฝากจากบุคคลธรรมดาที่ได้รายงานใน ข้อ (2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก เฉพาะส่วนที่เป็นบัญชีเงินรับฝากที่ลูกค้าผู้ฝากสามารถทำธุรกรรมที่ก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลออกผ่านการใช้บริการธนาคารทางอินเทอร์เน็ต (Internet banking)
89	(3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมอื่น เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากบุคคลธรรมดาประเภท (1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ผู้ฝากเงินมีสิทธิในการไถ่ถอนก่อนกำหนดได้แต่มีค่าปรับอย่างมีนัยสำคัญ (2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่มีเงื่อนไขห้ามไถ่ถอนก่อนครบกำหนด [<i>ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 5-6</i>] และเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่ไม่สามารถก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลออกได้ใน 30 วัน	
90	(3.1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดการชำระคืนมากกว่า 30 วัน ซึ่งผู้ฝากมีสิทธิไถ่ถอนก่อน	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากบุคคลธรรมดาประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ผู้ฝากเงินมีสิทธิในการไถ่ถอนก่อนกำหนดได้แต่มีค่าปรับอย่างมีนัยสำคัญ [<i>ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 5</i>]

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
	กำหนดแต่มีค่าปรับในจำนวนที่กระทบต่อดอกเบี้ยรับของลูกค้าในช่วงระหว่างวันที่ฝากจนถึงวันที่ถอนอย่างมีนัยสำคัญ	
91	(3.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีเงื่อนไขห้ามไถ่ถอนก่อนกำหนด และไม่มีพฤติกรรมการไถ่ถอนก่อนกำหนด	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืม เช่น บัตรเงินฝาก จากบุคคลธรรมดาประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่มีเงื่อนไขห้ามไถ่ถอนก่อนครบกำหนด <i>[ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 6]</i>
92	(3.3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมซึ่งลูกค้าไม่มีสิทธิในการไถ่ถอนภายในระยะเวลา 30 วัน หรือเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีกำหนดการชำระคืนมากกว่า 30 วัน ซึ่งผู้ฝากมีสิทธิไถ่ถอนก่อนกำหนดแต่มีค่าปรับในจำนวนที่กระทบต่อเงินต้นของลูกค้าอย่างมีนัยสำคัญ	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากบุคคลธรรมดาที่ไม่สามารถก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลออกได้ใน 30 วัน ซึ่งไม่ได้ถูกรายงานเป็นกระแสเงินสดไหลออกจากเงินรับฝากและเงินกู้ยืมในข้ออื่นของหมวด (ก) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายย่อย
93	(4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายย่อยของสาขาหรือบริษัทลูก (Subsidiaries) ของ ธพ. ที่จัดตั้งอยู่ในต่างประเทศซึ่งใช้อัตราการไหลออกตามที่หน่วยงานกำกับดูแลในประเทศนั้นกำหนด	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากบุคคลธรรมดาทั้งหมดของสาขาของ ธพ. ที่จัดตั้งอยู่ในต่างประเทศ ซึ่งเป็นปริมาณหลังจากปรับด้วยอัตราการไหลออกตามอัตราที่ผู้กำกับดูแลในประเทศกำหนดแล้ว <i>[ประกาศ LCR หน้า 5]</i> ทั้งนี้ เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายย่อยของบริษัทลูก สำหรับการรายงานข้อมูลกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (Consolidated basis)
96	หมวด (ข) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายใหญ่แบบไม่มีหลักประกัน (Unsecured wholesale funding) ในการรายงานเงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายใหญ่แบบไม่มีหลักประกัน <i>[ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/3 ข้อ 2]</i> กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่ไม่มีหลักประกันจากลูกค้าที่ไม่ใช่บุคคลธรรมดา ใน Column D โดยให้แบ่งตามประเภทสัญญา คู่สัญญา การได้รับการคุ้มครองเงินฝาก และลักษณะของบัญชีเงินรับฝากและเงินกู้ยืม	

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
98	<p>(1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจขนาดเล็ก (Small business customers)</p> <p>ในการรายงานเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจขนาดเล็ก [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/3 ข้อ 2.1] กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากคู่สัญญาที่เป็นธุรกิจขนาดเล็ก ใน Column D โดยให้แบ่งตามประเภทสัญญา การได้รับการคุ้มครองเงินฝาก และลักษณะของบัญชีเงินรับฝากและเงินกู้ยืม ทั้งนี้ ลูกค้ายุติขนาดเล็กจะต้องมีคุณสมบัติตามที่กำหนดในหลักเกณฑ์ LCR</p> <p>สำหรับเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจขนาดเล็กที่ไม่เข้าข่ายตามคุณสมบัติที่กำหนด ให้รายงานเงินรับฝากและเงินกู้ยืมดังกล่าวเป็นเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากนิติบุคคลใน ข้อ (2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากนิติบุคคลอื่นที่ไม่ใช่ธุรกิจขนาดเล็ก (Wholesale customers)</p>	
99	<p>(1.1) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก</p> <p>เงินรับฝากจากธุรกิจขนาดเล็กประเภท (1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อทวงถาม (2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาซึ่งมีกำหนดชำระคืนภายในระยะเวลา 30 วัน (3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ผู้ฝากเงินมีสิทธิในการไถ่ถอนก่อนกำหนดได้โดยไม่เสียค่าปรับหรือเสียค่าปรับอย่างไม่เป็นนัยสำคัญ และ (4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ ธพ. มีสิทธิจ่ายคืนก่อนครบกำหนดและหากไม่ใช่สิทธิอาจมีผลกระทบในทางลบต่อชื่อเสียงของ ธพ. [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 1-4] เฉพาะส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก</p>	
100	<p>(1.1.1) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก และเป็นบัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน (Transactional accounts)</p>	<p>ปริมาณเงินรับฝากจากธุรกิจขนาดเล็กซึ่งเป็นบัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/1 ข้อ 1.1.1] เฉพาะส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก</p>
101	<p>(1.1.2) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก ซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน (Non-transactional accounts) แต่เป็นบัญชีที่ลูกค้ามีความสัมพันธ์กับ ธพ. (Relationship accounts) ซึ่งทำให้ความน่าจะเป็นในการถอนเงินออกไปได้ยาก</p>	<p>ปริมาณเงินรับฝากจากธุรกิจขนาดเล็กซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน แต่เป็นบัญชีที่ลูกค้าผู้ฝากเงินมีความสัมพันธ์กับ ธพ. [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/1 ข้อ 1.1.2] เฉพาะส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก</p>

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
102	(1.1.3) เงินรับฝากที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน (Non-transactional accounts) และไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้ามีความสัมพันธ์กับ ธพ. (Non-relationship accounts)	ปริมาณเงินรับฝากจากธุรกิจขนาดเล็กซึ่งไม่ใช่บัญชีที่ลูกค้าใช้ในการทำธุรกรรมทางการเงิน และลูกค้าผู้ฝากเงินมิได้มีความสัมพันธ์กับ ธพ. [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 1.2] เฉพาะส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก
103	(1.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจขนาดเล็กประเภท (1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อทวงถาม (2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาซึ่งมีกำหนดชำระคืนภายในระยะเวลา 30 วัน (3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ผู้ฝากเงินมีสิทธิในการไถ่ถอนก่อนกำหนดได้โดยไม่เสียค่าปรับหรือเสียค่าปรับอย่างไม่มีนัยสำคัญ และ (4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ ธพ. มีสิทธิจ่ายคืนก่อนครบกำหนดและหากไม่ใช้สิทธิอาจมีผลกระทบในทางลบต่อชื่อเสียงของ ธพ. [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 1-4] ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก
104	(1.2.1) เฉพาะส่วนที่เป็นเงินรับฝากที่มีการใช้บริการธนาคารทางอินเทอร์เน็ต (Internet banking)	ปริมาณเงินรับฝากจากธุรกิจขนาดเล็กที่ได้รายงานใน ข้อ (1.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก เฉพาะส่วนที่เป็นบัญชีเงินรับฝากที่ลูกค้าผู้ฝากสามารถทำธุรกรรมที่ก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลออกผ่านการใช้บริการธนาคารทางอินเทอร์เน็ต (Internet banking)
105	(1.3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมอื่น	เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจขนาดเล็กประเภท (1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ผู้ฝากเงินมีสิทธิในการไถ่ถอนก่อนกำหนดได้แต่มีค่าปรับอย่างมีนัยสำคัญ (2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่มีเงื่อนไขห้ามไถ่ถอนก่อนครบกำหนด [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 5-6] และเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่ไม่สามารถก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลออกได้ใน 30 วัน

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
106	(1.3.1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดการชำระคืนมากกว่า 30 วัน ซึ่งผู้ฝากมีสิทธิไถ่ถอนก่อนกำหนดแต่มีค่าปรับในจำนวนที่กระทบต่อดอกเบี้ยรับของลูกค้าในช่วงระหว่างวันที่ฝากจนถึงวันที่ถอนอย่างมีนัยสำคัญ	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจขนาดเล็กประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ผู้ฝากเงินมีสิทธิในการไถ่ถอนก่อนกำหนดได้แต่มีค่าปรับอย่างมีนัยสำคัญ [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 5]
107	(1.3.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีเงื่อนไขห้ามไถ่ถอนก่อนกำหนด และไม่มีพฤติกรรมการไถ่ถอนก่อนกำหนด	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืม เช่น บัตรเงินฝาก จากธุรกิจขนาดเล็กประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่มีเงื่อนไขห้ามไถ่ถอนก่อนครบกำหนด [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/2 ข้อ 6]
108	(1.3.3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมซึ่งลูกค้าไม่มีสิทธิในการไถ่ถอนภายในระยะเวลา 30 วัน หรือ เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีกำหนดการชำระคืนมากกว่า 30 วัน ซึ่งผู้ฝากมีสิทธิไถ่ถอนก่อนกำหนดแต่มีค่าปรับในจำนวนที่กระทบต่อเงินต้นของลูกค้าอย่างมีนัยสำคัญ	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจขนาดเล็กที่ไม่สามารถก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลออกได้ใน 30 วัน ซึ่งไม่ได้ถูกรายงานเป็นกระแสเงินสดไหลออกจากเงินรับฝากและเงินกู้ยืมในข้ออื่นของหมวด (ข) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายใหญ่แบบไม่มีหลักประกัน (Unsecured wholesale funding) ข้อ (1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจขนาดเล็ก (Small business customers)
109	(1.4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมธุรกิจขนาดเล็กของสาขาหรือบริษัทลูก (Subsidiaries) ของ ธพ. ที่ตั้งอยู่ในต่างประเทศซึ่งใช้อัตราการไหลออกตามที่หน่วยงานกำกับดูแลในประเทศนั้นกำหนด	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจขนาดเล็กทั้งหมดของสาขาของ ธพ. ที่จัดตั้งอยู่ในต่างประเทศ ซึ่งเป็นปริมาณหลังจากปรับตัวด้วยอัตราการไหลออกตามอัตราที่ผู้กำกับดูแลในต่างประเทศกำหนดแล้ว [ประกาศ LCR หน้า 5] ทั้งนี้ เงินรับฝากและเงินกู้ยืมธุรกิจขนาดเล็กของบริษัทลูก สำหรับการรายงานข้อมูลกลุ่มธุรกิจทางการเงิน (Consolidated basis)
110	(2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากนิติบุคคลอื่นที่ไม่ใช่ธุรกิจขนาดเล็ก (Wholesale customers) ในการรายงานเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากนิติบุคคลอื่นที่ไม่ใช่ธุรกิจขนาดเล็ก [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/4 ข้อ 2.2] กำหนดให้ ธพ.	

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		รายงานปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืม ใน Column D โดยให้แบ่งตามประเภทสัญญา คู่สัญญา การได้รับการคุ้มครองเงินฝาก และลักษณะของบัญชีเงินรับฝากและเงินกู้ยืม
111	(2.1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (Operational deposits) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภท (1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อทวงถามทั้งหมด (2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาซึ่งมีกำหนดชำระคืนภายในระยะเวลา 30 วัน (3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลามีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ผู้ฝากเงินมีสิทธิไถ่ถอนก่อนกำหนดได้ (4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลามีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ ธพ. มีสิทธิจ่ายคืนก่อนครบกำหนดและหากไม่ใช่สิทธิอาจมีผลกระทบในทางลบต่อชื่อเสียงของ ธพ. [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/6 ข้อ 1-4] ซึ่งใช้เพื่อการทำธุรกรรมด้านปฏิบัติการ ได้แก่ การชำระเงิน (Clearing) การเก็บรักษาทรัพย์สิน (Custody) หรือการบริหารเงิน (Cash management) ตามที่หลักเกณฑ์กำหนด [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/4 ข้อ 2.2.1]	
112	(2.1.1) จากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (Non-financial corporates) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการจากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน	
113	(2.1.1.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก	ปริมาณเงินรับฝากจากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน เฉพาะส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก
114	(2.1.1.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก
115	(2.1.2) จากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการจากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) ทั้งนี้ ไม่นับรวมเงินรับฝากและเงินกู้ยืมดังกล่าวจากสถาบันการเงินเฉพาะกิจ ซึ่งให้รายงานในข้อ (2.1.4) จากสถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น (ไม่รวม ธพ.)	
116	(2.1.2.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก	ปริมาณเงินรับฝากจากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) เฉพาะส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
117	(2.1.2.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก
118	(2.1.3) จาก ธพ. เงินรับฝากและเงินกู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการจาก ธพ.	
119	(2.1.3.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก	ปริมาณเงินรับฝากจาก ธพ. เฉพาะส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก
120	(2.1.3.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจาก ธพ. ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก
121	(2.1.4) จากสถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น (ไม่รวม ธพ.) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการจากสถาบันการเงิน ซึ่งรวมถึงบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. เอง บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ บริษัทอื่นที่ประกอบธุรกิจทางการเงิน สถาบันการเงินเฉพาะกิจ และนิติบุคคลอื่น เช่น กองทุน นิติบุคคลเฉพาะกิจเพื่อการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ซึ่งครอบคลุม Special Purpose Vehicles (SPVs) Securities Investment Vehicles (SIVs) และ Conduits	
122	(2.1.4.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก	ปริมาณเงินรับฝากจากสถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น เฉพาะส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก
123	(2.1.4.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากสถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝาก
124	(2.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีใช้เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (Non-operational deposits) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภท (1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อทวงถามทั้งหมด (2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาซึ่งมีกำหนดชำระคืนภายในระยะเวลา 30 วัน (3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาซึ่งมีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ผู้ฝากเงินมีสิทธิไถ่ถอนก่อนกำหนดได้ (4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาซึ่งมีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่ ธพ. มีสิทธิจ่ายคืนก่อนครบกำหนดและหากไม่ใช้สิทธิอาจมีผลกระทบในทางลบต่อชื่อเสียงของ ธพ. [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/6 ข้อ 1-4] ที่ไม่เข้าข่ายการเป็นเงินรับฝากและเงินกู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/5 ข้อ 2.2.2]	
125	(2.2.1) จากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (Non-financial corporates) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีใช้เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการจากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน	

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
126	(2.2.1.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน	ปริมาณเงินรับฝากจากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน <u>โดยเป็นบัญชีที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน</u>
127	(2.2.1.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน <u>โดยเป็นบัญชีที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน</u>
128	(2.2.2) จากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีใช้เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการจากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) ทั้งนี้ ไม่นับรวมเงินรับฝากและเงินกู้ยืมดังกล่าวจากสถาบันการเงินเฉพาะกิจ ซึ่งให้รายงานใน ข้อ (2.2.4) จากสถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น (ไม่รวม ธพ.) และไม่นับรวมเงินกู้ยืมจากโครงการสินเชื่อ Soft loan ของ ธพท. เพื่อช่วยเหลือผู้ได้รับความเสียหายจากอุทกภัย ซึ่งให้รายงานใน ข้อ (3) กระแสเงินสดไหลออกอื่นที่ ธพท. กำหนดให้ได้รับอัตราดอกเบี้ย 100% ได้แก่ เงินรับฝากหรือเงินกู้ยืมอื่นที่จะครบกำหนดใน 30 วัน เจ้าหนี้ค้างจ่ายที่เกิดจากการซื้อหลักทรัพย์ซึ่งอยู่ระหว่างรอการส่งมอบ และรายการอื่นที่ ธพท. กำหนดเพิ่มเติม	
129	(2.2.2.1) ส่วนที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน	ปริมาณเงินรับฝากจากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) <u>โดยเป็นบัญชีที่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน</u>
130	(2.2.2.2) ส่วนที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) <u>โดยเป็นบัญชีที่ไม่ได้รับการคุ้มครองเงินฝากเต็มจำนวน</u>
131	(2.2.3) จาก ธพ.	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจาก ธพ. ทั้งนี้ ในกรณีที่ ธพ. มีรายการกระแสเงินสดไหลออกและกระแสเงินสดไหลเข้าที่เกิดขึ้นระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. ให้ ธพ. สามารถหักลบกระแสเงินสดดังกล่าวที่เกิดขึ้นภายในระยะเวลา 30 วันได้ [ประกาศ LCR หน้า 7] โดยให้รายงานปริมาณซึ่งเป็นยอดรวมของเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีใช้เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการจากบริษัทที่อยู่ในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกับ ธพ. ใน ข้อ (2.2.5) จากบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกัน (Intra-group transaction)

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
132	(2.2.4) จากสถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น (ไม่รวม ธพ.)	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากสถาบันการเงิน ซึ่งรวมถึงบริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ บริษัทอื่นที่ประกอบธุรกิจทางการเงิน สถาบันการเงินเฉพาะกิจ และนิติบุคคลอื่น เช่น กองทุน นิติบุคคลเฉพาะกิจเพื่อการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ซึ่งครอบคลุม Special Purpose Vehicles (SPVs) Securities Investment vehicles (SIVs) และ Conduits ทั้งนี้ ในกรณีที่ ธพ. มีรายการกระแสเงินสดไหลออกและกระแสเงินสดไหลเข้าที่เกิดขึ้นระหว่าง บริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. ให้ ธพ. สามารถหักลบกระแสเงินสดดังกล่าวที่เกิดขึ้น ภายในระยะเวลา 30 วันได้ [ประกาศ LCR หน้า 7] โดยให้รายงานปริมาณซึ่งเป็นยอดรวมของเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีใช้เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการจากบริษัทที่อยู่ในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกับ ธพ. ใน ข้อ (2.2.5) จากบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกัน (Intra-group transaction)
133	(2.2.5) จากบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน เดียวกัน (Intra-group transaction)	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ.
135	(2.3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีใช้เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการอื่น เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีใช้เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการอื่น ได้แก่ เงินรับฝากและเงินกู้ยืม เช่น บัตรเงินฝาก จากนิติบุคคลที่ไม่เข้าเงื่อนไขเป็นธุรกิจขนาดเล็กประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่มีเงื่อนไขห้ามไถ่ถอนก่อนครบกำหนด [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/6 ข้อ 5] และเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่ไม่สามารถก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลออกได้ใน 30 วัน	
136	(2.3.1) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีเงื่อนไขห้ามไถ่ถอนก่อนกำหนด และไม่มีพฤติกรรมการไถ่ถอนก่อนกำหนด เงินรับฝากและเงินกู้ยืม เช่น บัตรเงินฝาก จากนิติบุคคลที่ไม่เข้าเงื่อนไขเป็นธุรกิจขนาดเล็กประเภทจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่มีกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน ที่มีเงื่อนไขห้ามไถ่ถอนก่อนครบกำหนด [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/6 ข้อ 5] โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา	
137	(2.3.1.1) จากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (Non-financial corporates)	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน
138	(2.3.1.2) จากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและ	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs)

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
	รัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนา ระหว่างประเทศ (MDBs)	
139	(2.3.1.3) จาก ธพ. สถาบันการเงิน และ นิติบุคคลอื่น	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจาก ธพ. สถาบันการเงิน ซึ่งรวมถึงบริษัทเงินทุน บริษัท เครดิตฟองซิเอร์ บริษัทอื่นที่ประกอบธุรกิจทางการเงิน สถาบันการเงินเฉพาะกิจ และนิติบุคคลอื่น เช่น กองทุน นิติบุคคลเฉพาะกิจเพื่อการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ซึ่งครอบคลุม Special Purpose Vehicles (SPVs) Securities Investment Vehicles (SIVs) และ Conduits
140	(2.3.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากลูกค้าที่เป็นนิติบุคคลซึ่งไม่มีสิทธิในการไถ่ถอนภายในระยะเวลา 30 วัน เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากนิติบุคคลที่ไม่สามารถก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลออกได้ใน 30 วัน ซึ่งไม่ได้ถูกรายงานเป็นกระแสเงินสดไหลออก จากเงินรับฝากและเงินกู้ยืมในข้ออื่นของ หมวด (ข) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายใหญ่แบบไม่มีหลักประกัน (Unsecured wholesale funding) ข้อ (2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากนิติบุคคลอื่นที่ไม่ใช่ธุรกิจขนาดเล็ก (Wholesale customers)	
141	(2.3.2.1) จากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบัน การเงิน (Non-financial corporates)	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน
142	(2.3.2.2) จากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์กร ปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและ รัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนา ระหว่างประเทศ (MDBs)	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของ รัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนา ระหว่างประเทศ (MDBs)
143	(2.3.2.3) จาก ธพ. สถาบันการเงิน และ นิติบุคคลอื่น	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจาก ธพ. สถาบันการเงิน ซึ่งรวมถึงบริษัทเงินทุน บริษัท เครดิตฟองซิเอร์ บริษัทอื่นที่ประกอบธุรกิจทางการเงิน สถาบันการเงินเฉพาะกิจ และนิติบุคคลอื่น เช่น กองทุน นิติบุคคลเฉพาะกิจเพื่อการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ซึ่งครอบคลุม Special Purpose Vehicles (SPVs) Securities Investment Vehicles (SIVs) และ Conduits
144	(3) กระแสเงินสดไหลออกอื่นที่ ธพท. กำหนดให้ได้รับอัตราดอกเบี้ยไหลออก 100%	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกจากเงินรับฝากและเงินกู้ยืมอื่นๆ [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/6 ข้อ 2.4]

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
	ได้แก่ เงินรับฝากหรือเงินกู้ยืมอื่นที่จะครบกำหนดใน 30 วัน เจ้าหนี้ค้างจ่ายที่เกิดจากการซื้อหลักทรัพย์ซึ่งอยู่ระหว่างรอการส่งมอบและรายการอื่นที่ ธพท. กำหนดเพิ่มเติม	
145	(4) ตราสารหนี้ที่ไม่มีหลักประกัน (Unsecured debt issuance)	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ไม่มีหลักประกันทุกประเภทที่ ธพท. เป็นผู้ออกและจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/6 ข้อ 2.3]
146	(5) ปริมาณเงินสำรองที่ธนาคารกลางที่ ธพท. ต้องดำรงเพิ่มเพื่อปฏิบัติตามกฎหมายขั้นต่ำ	ปริมาณเงินสำรองส่วนที่ ธพท. ต้องดำรงเพิ่มเพื่อให้สามารถปฏิบัติตามกฎหมายขั้นต่ำตามที่ผู้กำกับดูแลในต่างประเทศกำหนด
149	(6) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีลักษณะคล้ายเงินรับฝากและเงินกู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (Operational deposits) แต่จัดประเภทเป็นเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีใช้เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (Non-operational deposits) ซึ่งได้รายงานในหัวข้อ (2.2)	เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีลักษณะคล้ายเงินรับฝากและเงินกู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ แต่จัดประเภทเป็นเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีใช้เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/5 ข้อ 2.2.2] เนื่องจากอาจมีลักษณะความเสี่ยงด้านสภาพคล่องที่แตกต่างจากเงินรับฝากและเงินกู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการโดยทั่วไป โดยให้รายงานรายการเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีลักษณะคล้ายเงินรับฝากและเงินกู้ยืมเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการในข้อนี้ และใน หัวข้อ (2.2) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีใช้เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (Non-operational deposits) ด้วย
150	(6.1) บัญชี Vostro	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจาก ธพท. สถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่นในต่างประเทศ เพื่อใช้ในการชำระเงิน (บัญชี Vostro) ซึ่งได้รายงานแล้วใน ข้อ (2.2.3) จาก ธพท. ข้อ (2.2.4) จากสถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น (ไม่รวม ธพท.) และ ข้อ (2.2.5) จากบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกัน (Intra-group transaction)
152	(6.2) บัญชีที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการการลงทุนรายใหญ่ (Prime brokerage services)	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมจาก ธพท. สถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น เพื่อการให้บริการเกี่ยวกับการลงทุนแก่ลูกค้ารายใหญ่ (บัญชี Prime brokerage) ซึ่งได้รายงานแล้วใน ข้อ (2.2.3) จาก ธพท. ข้อ (2.2.4) จากสถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น (ไม่รวม ธพท.) และ ข้อ (2.2.5) จากบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกัน (Intra-group transaction)

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
154	(6.3) เงินฝากส่วนที่เกินกว่ายอดหมุนเวียนเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (Excess balances)	ปริมาณเงินรับฝากและเงินกู้ยืมส่วนที่เกินกว่าที่ใช้เพื่อการทำธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (Excess balances) ซึ่งได้รายงานแล้วใน ข้อ (2.2.1) จากธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (Non-financial corporates) ข้อ (2.2.2) จากรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) ข้อ (2.2.3) จาก ธพ. ข้อ (2.2.4) จากสถาบันการเงิน และนิติบุคคลอื่น (ไม่รวม ธพ.) และ ข้อ (2.2.5) จากบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกัน (Intra-group transaction)
157	หมวด (ค) กระแสเงินสดไหลออกจากเงินกู้ยืมที่มีหลักประกันซึ่งรวมถึง ธุรกรรมการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน (Repo) ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities lending) การให้ลูกค้ายืมหลักทรัพย์เพื่อไปเปิดฐานะชอร์ต (Short position) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน	ในการรายงานเงินกู้ยืมที่มีหลักประกัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/8 ข้อ 3] กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณเงินกู้ยืมจากธุรกรรมการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน (Repo) ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities lending) ธุรกรรมการให้ลูกค้ายืมหลักทรัพย์เพื่อไปเปิดฐานะชอร์ตของลูกค้ายืมหลักทรัพย์ (Short position) และธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกัน (Collateral swaps) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน และยอดเงินที่ได้รับมาจากธุรกรรมการให้ลูกค้ายืมหลักทรัพย์เพื่อไปเปิดฐานะชอร์ตของลูกค้ายืมหลักทรัพย์ที่ไม่มีวันครบกำหนดชัดเจน ใน Column D และรายงานราคาตลาดของสินทรัพย์หลักประกันใน Column E โดยให้แบ่งตามประเภทหลักประกัน และคู่สัญญา ทั้งนี้ การรายงานในข้อนี้ไม่รวมถึงธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ไม่เกี่ยวข้องกับเงินสดสกุลใด ๆ (Collateral swaps) ซึ่งให้รายงานในส่วนที่ 3 : ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกัน (Collateral swaps) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน
159	(1) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 เป็นหลักประกัน ซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา
160	(1.1) คู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 เป็นหลักประกัน เฉพาะธุรกรรมที่มีคู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/8 Footnote 9]
161	(1.2) คู่สัญญาอื่น	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 เป็นหลักประกัน เฉพาะธุรกรรมที่ทำกับคู่สัญญาอื่น นอกเหนือจาก ข้อ (1.1) คู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
162	เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 เป็นหลักประกันตามที่ได้รายงานใน หัวข้อ (1) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการกู้ยืมเงินนี้ จะสามารถรายงานเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้
164	(2) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A เป็นหลักประกัน ซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา	
165	(2.1) คู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A เป็นหลักประกัน เฉพาะธุรกรรมที่มีคู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/8 Footnote 9]
166	(2.2) คู่สัญญาอื่น	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A เป็นหลักประกัน เฉพาะธุรกรรมที่ทำกับคู่สัญญาอื่น นอกเหนือจาก ข้อ (2.1) คู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง
167	เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A เป็นหลักประกันตามที่ได้รายงานใน หัวข้อ (2) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการกู้ยืมเงินนี้ จะสามารถรายงานเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้
169	(3) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B เป็นหลักประกัน ซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา	
170	(3.1) คู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B เป็นหลักประกัน เฉพาะธุรกรรมที่มีคู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/8 Footnote 9]
171	(3.2) คู่สัญญาเป็นรัฐบาล ลูกหนี้ธนาคาร เพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือ องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐ และรัฐวิสาหกิจที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 20% หรือดีกว่า	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B เป็นหลักประกัน เฉพาะธุรกรรมที่มีคู่สัญญาเป็นรัฐบาล ธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือองค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐ และรัฐวิสาหกิจที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 20 หรือดีกว่า [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/8 Footnote 10, 11]

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
172	(3.3) คู่สัญญาอื่น	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B เป็นหลักประกัน เฉพาะธุรกรรมที่ทำกับคู่สัญญาอื่น นอกเหนือจาก ข้อ (3.1) คู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง และ ข้อ (3.2) คู่สัญญาเป็นรัฐบาล ลูกหนี้ ธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐ และรัฐวิสาหกิจที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 20% หรือดีกว่า
173	เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B เป็นหลักประกันตามที่ได้รายงานใน หัวข้อ (3) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการกู้ยืมเงินนี้ จะสามารถรายงานเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้
175	(4) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์ชั้นอื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์อื่นที่มีใช้สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B เป็นหลักประกัน ซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา
176	(4.1) คู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์อื่นที่มีใช้สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B เป็นหลักประกัน เฉพาะธุรกรรมที่มีคู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/8 Footnote 9]
177	(4.2) คู่สัญญาเป็นรัฐบาล ลูกหนี้ธนาคาร เพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือ องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐ และรัฐวิสาหกิจที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 20% หรือดีกว่า	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์อื่นที่มีใช้สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B เป็นหลักประกัน เฉพาะธุรกรรมที่มีคู่สัญญาเป็นรัฐบาล ธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือ องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 20 หรือดีกว่า [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/8 Footnote 10, 11]
178	(4.3) คู่สัญญาอื่น	การกู้ยืมที่มีสินทรัพย์อื่นที่มีใช้สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B เป็นหลักประกัน ซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน เฉพาะธุรกรรมที่ทำกับคู่สัญญาอื่น นอกเหนือจาก ข้อ (4.1) คู่สัญญาเป็นธนาคารกลาง และ ข้อ (4.2) คู่สัญญาเป็นรัฐบาล ลูกหนี้

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		<u>ธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือองค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐ และรัฐวิสาหกิจที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 20% หรือดีกว่า</u>
181	หมวด (ง) ภาระผูกพันที่มีสัญญา ในการรายงานภาระผูกพันที่มีสัญญา ได้แก่ 1) อุดหนุนพันธบัตร ซึ่งรวมถึงกระแสเงินสดไหลออกจากอุดหนุนพันธบัตรและหลักประกันที่ต้องวางเพิ่มจากอุดหนุนพันธบัตรและอุดหนุนการกู้ยืมที่มีหลักประกันอื่น 2) การได้ถอนตราสารจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักประกัน (Asset-backed securities) อุดหนุนซับซ้อน (Structured financing instrument) และหุ้นกู้มีประกัน (Covered bond) 3) กระแสเงินสดไหลออกที่เกี่ยวกับตราสารระยะสั้นจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักประกัน (Asset-backed commercial paper) นิติบุคคลเฉพาะกิจเพื่อการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักประกัน และ อุดหนุนกู้ยืมต่างๆ จากการเป็นผู้รับได้ถอนตราสารหนี้หรือเป็นผู้สนับสนุนทางการเงิน และ 4) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/9 ข้อ 4.1 - 4.4, เอกสารแนบ หน้า 2/10 ข้อ 4.5] กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณกระแสเงินสดไหลออกที่ ธพ. อาจต้องจ่ายหรือให้กู้ยืมแก่คู่สัญญาภายในระยะเวลา 30 วัน ใน Column D	
183	(1) กระแสเงินสดไหลออกจากอุดหนุนพันธบัตร (Derivatives cash outflow)	ปริมาณกระแสเงินสดที่คาดว่าจะไหลออกสุทธิภายในระยะเวลา 30 วันจากอุดหนุนพันธบัตร [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/11 ข้อ 4.1] ทั้งนี้ หากผลลัพธ์สุทธิเป็นกระแสเงินสดไหลออก ให้รายงานในข้อนี้ แต่หากผลลัพธ์สุทธิเป็นกระแสเงินสดไหลเข้า ให้รายงานใน ส่วนที่ 2.2 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลเข้า (Expected cash inflows) หมวด (ค) ภาระผูกพันที่มีสัญญา ข้อ (1.1) กระแสเงินสดไหลเข้าจากอุดหนุนพันธบัตร (Derivatives cash inflow)
184	(2) หลักประกันที่ต้องวางเพิ่มและกระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากการถูกลดอันดับเครดิต	มูลค่าหลักประกันที่ต้องวางเพิ่มและกระแสเงินสดไหลออกตามสัญญาอันเนื่องมาจากการที่ ธพ. ถูกลดอันดับเครดิตลงไม่เกิน 3 อันดับ เช่น ผู้ให้กู้ยืมเรียกชำระหนี้คืนหรือการถูกปรับลดวงเงิน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/12 ข้อ 4.2.1]
185	(3) หลักประกันที่ต้องวางเพิ่มและกระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากการลดลงของมูลค่าหลักประกันที่วางไว้สำหรับการทำอุดหนุนพันธบัตรและอุดหนุนอื่น หลักประกันที่ต้องวางเพิ่มและกระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากการลดลงของมูลค่าหลักประกันที่ ธพ. วางไว้สำหรับการทำอุดหนุนพันธบัตรและ	

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		ธุรกรรมอื่น [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/12 ข้อ 4.2.2] โดยให้แบ่งตามประเภทหลักประกัน และให้รายงานมูลค่าตามบัญชีสำหรับหลักประกันที่เป็นเงินสด และให้รายงานราคาตลาดสำหรับหลักประกันที่เป็นตราสารทางการเงิน
186	(3.1) หลักประกันที่เป็นเงินสดและสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1	มูลค่าหลักประกันที่เป็นเงินสด และสินทรัพย์ที่หากปราศจากภาระผูกพันจะเข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 ซึ่ง ธพ. นำไปวางเป็นหลักประกันไว้กับคู่สัญญาในการทำธุรกรรมอนุพันธ์และธุรกรรมการกู้ยืมแบบมีหลักประกัน (เช่น การวาง Margin)
187	(3.2) หลักประกันประเภทอื่น	มูลค่าหลักประกันที่ไม่ใช่เงินสด และสินทรัพย์ที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 ซึ่ง ธพ. นำไปวางเป็นหลักประกันไว้กับคู่สัญญาในการทำธุรกรรมอนุพันธ์และธุรกรรมการกู้ยืมแบบมีหลักประกัน (เช่น การวาง Margin)
188	(4) หลักประกันส่วนเกินที่คู่สัญญาวางไว้เพื่อธุรกรรมอนุพันธ์และธุรกรรมการกู้ยืมแบบมีหลักประกันอื่น ซึ่งคู่สัญญามีสิทธิเรียกคืนตามสัญญา	มูลค่าหลักประกันส่วนเกินที่เกินกว่าอัตราขั้นต่ำที่ ธพ. กำหนดให้คู่สัญญานำมาวางเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมอนุพันธ์และธุรกรรมการกู้ยืมแบบมีหลักประกันอื่น [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/12 ข้อ 4.2.3]
189	(5) หลักประกันที่ ธพ. ต้องวางเพิ่มตามสัญญาของธุรกรรมอนุพันธ์และธุรกรรมการกู้ยืมแบบมีหลักประกันอื่น แต่คู่สัญญายังมิได้ใช้สิทธิในการเรียกหลักประกันดังกล่าว	มูลค่าหลักประกันที่ ธพ. จะต้องวางเพิ่มตามสัญญาสำหรับการทำธุรกรรมอนุพันธ์และธุรกรรมการกู้ยืมแบบมีหลักประกัน แต่คู่สัญญายังมิได้ใช้สิทธิในการเรียกวางหลักประกัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/12 ข้อ 4.2.4]
190	(6) กระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากคู่สัญญามีสิทธิตามสัญญาในการแลกเปลี่ยนสินทรัพย์ที่ใช้เป็นหลักประกัน	กระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากคู่สัญญามีสิทธิในการแลกเปลี่ยนสินทรัพย์ที่วางเป็นหลักประกันกับ ธพ. โดยการนำสินทรัพย์ในลำดับชั้นที่ต่ำกว่ามาวางเป็นหลักประกันแทน โดยให้รายงานผลต่างระหว่าง (1) มูลค่าหลักประกันที่เป็นสินทรัพย์สภาพคล่องที่คู่สัญญานำมาวางในการทำธุรกรรมอนุพันธ์และธุรกรรมอื่นกับ ธพ. และ (2) มูลค่าหลักประกันในลำดับชั้นที่ต่ำกว่าที่คู่สัญญานำมาวางเป็นหลักประกันแทน โดยใช้มูลค่าหลังจากหัก Haircut [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/12 ข้อ 4.2.5]
191	(7) กระแสเงินสดไหลออกจากการเปลี่ยนแปลงมูลค่าของธุรกรรมอนุพันธ์หรือธุรกรรมอื่น	มูลค่าหลักประกันที่ ธพ. จะต้องวางเพิ่มเนื่องจากการเปลี่ยนแปลงมูลค่าของธุรกรรมอนุพันธ์และธุรกรรมอื่นภายในระยะเวลา 30 วัน โดยให้รายงานมูลค่าซึ่งเป็นค่าสัมบูรณ์ที่มากที่สุดของฐานะสุทธิ

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
	ภายในระยะเวลา 30 วัน	ระหว่างหลักประกันที่ได้วางเพิ่ม และหลักประกันที่ได้รับมา (Net collateral flow) ในช่วง 30 วัน โดยใช้ข้อมูลย้อนหลัง 2 ปี [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/12 ข้อ 4.2.6]
192	(8) กระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากการไถ่ถอนตราสารจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (Asset-backed securities) และตราสารการกู้ยืมที่ซับซ้อน (Structured financing instrument) ที่ ธพ. หรือบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเป็นผู้ออก ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน	ปริมาณคงค้างตราสารจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (Asset-backed securities) และตราสารการกู้ยืมที่ซับซ้อน (Structured financing instrument) ที่ ธพ. หรือบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. เป็นผู้ออก ซึ่งจะครบกำหนดชำระภายในระยะเวลา 30 วัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 4.3] ทั้งนี้ ไม่นับรวมหุ้นกู้มีประกัน (Covered bond) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ซึ่งให้รายงานใน ข้อ (10) กระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากการไถ่ถอนหุ้นกู้มีประกัน (Covered bond) ที่ ธพ. เป็นผู้ออก ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน
193	(9) กระแสเงินสดไหลออกที่เกี่ยวข้องกับตราสารระยะสั้นจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (Asset-backed commercial paper) และนิติบุคคลเฉพาะกิจเพื่อการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (Special Purpose Vehicles/ Conduits/ Securities Investment Vehicles) และธุรกรรมกู้ยืมต่าง ๆ กระแสเงินสดไหลออกเนื่องจาก ธพ. มีความจำเป็นในการให้สภาพคล่องหรือซื้อคืนสินทรัพย์หรือไถ่ถอนตราสารระยะสั้นที่เกี่ยวข้องกับการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (Asset-backed commercial paper) นิติบุคคลเพื่อการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (Special Purpose Vehicles/ Conduits/ Securities Investment Vehicles) และธุรกรรมกู้ยืมต่างๆ เนื่องจากการเป็นผู้รับไถ่ถอนตราสารหนี้หรือเป็นผู้สนับสนุนทางการเงิน ซึ่งตราสารการกู้ยืมหรือสัญญาที่เกี่ยวข้องดังกล่าวจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน หรือครบกำหนดมากกว่า 30 วัน แต่ให้สิทธิในการเลื่อนระยะเวลาครบกำหนดให้เร็วขึ้นเป็นภายในระยะเวลา 30 วันได้ [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 4.4]	
194	(9.1) ส่วนที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน	ปริมาณคงค้างตราสารระยะสั้นที่เกี่ยวข้องกับการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (Asset-backed commercial paper) เฉพาะส่วนของตราสารที่จะครบกำหนดชำระคืนภายใน 30 วัน
195	(9.2) ส่วนที่ครบกำหนดเกินกว่า 30 วัน แต่ให้สิทธิซึ่งมีผลให้สามารถเลื่อนระยะเวลาครบกำหนดให้เร็วขึ้นเป็นภายในระยะเวลา 30 วัน	ปริมาณคงค้างตราสารระยะสั้นที่เกี่ยวข้องกับการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (Asset-backed commercial paper) เฉพาะส่วนของตราสารที่จะครบกำหนดชำระคืนมากกว่า 30 วัน แต่ให้สิทธิในการเลื่อนระยะเวลาครบกำหนดให้เร็วขึ้นเป็นภายในระยะเวลา 30 วันได้

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
196	(9.3) กระแสเงินสดไหลออกอื่น นอกเหนือจากที่รายงานในข้อ (9.1) และข้อ (9.2)	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกที่เกี่ยวกับการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (Asset-backed commercial paper) นิติบุคคลเพื่อการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ (Special Purpose Vehicles/ Conduits/ Securities Investment Vehicles) และธุรกรรมกู้ยืมต่างๆ ในฐานะที่ ธพ. เป็นผู้รับไถ่ถอนตราสารหนี้หรือเป็นผู้สนับสนุนทางการเงิน (Sponsor) <u>นอกเหนือจากที่รายงานในข้อ (9.1) ส่วนที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน และ ข้อ (9.2) ส่วนที่ครบกำหนดเกินกว่า 30 วัน แต่ให้สิทธิซึ่งมีผลให้สามารถเลื่อนระยะเวลาครบกำหนดให้เร็วขึ้นเป็นภายในระยะเวลา 30 วัน</u>
197	(10) กระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากการไถ่ถอนหุ้นกู้มีประกัน (Covered bond) ที่ ธพ. เป็นผู้ออก ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน	ปริมาณค่างหุ้นกู้มีประกัน (Covered bond) ที่ ธพ. หรือบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. เป็นผู้ออก ซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน <i>[ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 4.3]</i>
198	(11) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ที่ให้แก่ลูกค้ารายย่อย (Retail) และธุรกิจขนาดเล็ก (Small business customers) เพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (Liquidity facilities) และ วัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities)	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) <u>เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้</u> ทั้งกรณีที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (Liquidity facilities) และเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities) <i>[ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 1]</i> ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่บุคคลธรรมดาและธุรกิจขนาดเล็ก
199	(12) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities)	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) <u>เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้</u> ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่ลูกค้าเพื่อใช้ในวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities) <i>[ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 1.1]</i> ซึ่งให้รวมถึงวงเงินส่วนที่เหลือจากวงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities) ที่จะครบกำหนดแต่ยังไม่มีการจัดสรรให้รองรับการไถ่ถอนตราสารหนี้ใด โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
200	(12.1) ลูกค้านับธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (Non-financial corporates)	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ๗๗. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ๗๗. อนุมัติให้แก่ธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน
201	(12.2) ลูกค้านับรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนา ระหว่างประเทศ (MDBs)	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ๗๗. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ๗๗. อนุมัติให้แก่รัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนา ระหว่างประเทศ (MDBs)
202	(13) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (Liquidity facilities)	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ๗๗. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ๗๗. อนุมัติให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (Liquidity facilities) [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 1.2] โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา
203	(13.1) ลูกค้านับธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (Non-financial corporates)	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ๗๗. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ๗๗. อนุมัติให้แก่ธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน
204	(13.2) ลูกค้านับรัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนา ระหว่างประเทศ (MDBs)	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ๗๗. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ๗๗. อนุมัติให้แก่รัฐบาล ธนาคารกลาง องค์การปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐและรัฐวิสาหกิจ หรือธนาคารเพื่อการพัฒนา ระหว่างประเทศ (MDBs)
205	(14) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ที่ให้แก่ ๗๗. เพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (Liquidity facilities) และวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities)	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ๗๗. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่ ธพ. เพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (Liquidity facilities) และเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities) [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 1] โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา
206	(14.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่ ธพ. ที่เป็นบริษัทแม่ รวมถึงสำนักงานใหญ่กรณีสาขา ธพ. ต่างประเทศ
207	(14.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่ ธพ. ที่เป็นบริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ซึ่งไม่รวมส่วนที่ได้รายงานในข้อ (14.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่ ข้างต้น
208	(14.3) ที่ให้แก่ ธพ. อื่น	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่ ธพ. อื่น ซึ่งไม่รวมส่วนที่ได้รายงานใน ข้อ (14.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่ และ ข้อ (14.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ข้างต้น
209	(15) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ที่ให้แก่สถาบันการเงิน ซึ่งไม่รวม ธพ. เพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities)	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่สถาบันการเงิน ซึ่งรวมถึงบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. เอง บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ บริษัทอื่นที่ประกอบธุรกิจทางการเงิน สถาบันการเงินเฉพาะกิจ เพื่อใช้ในวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities) [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 1.1] ซึ่งให้รวมถึงวงเงินส่วนที่เหลือจากวงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities) ที่จะครบกำหนดแต่ยังไม่มีการจัดสรรให้รองรับการไถ่ถอนตราสารหนี้ใด โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
210	(15.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่สถาบันการเงินที่เป็นบริษัทแม่
211	(15.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่สถาบันการเงินที่เป็นบริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ซึ่งไม่รวมส่วนที่ได้รายงานใน ข้อ (15.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่ ข้างต้น
212	(15.3) ที่ให้แก่สถาบันการเงินอื่น	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่สถาบันการเงินอื่น ซึ่งไม่รวมส่วนที่ได้รายงานใน ข้อ (15.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่ และ ข้อ (15.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ข้างต้น
213	(16) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ที่ให้แก่สถาบันการเงิน ซึ่งไม่รวม ธพ. เพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (Liquidity facilities)	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่สถาบันการเงิน ซึ่งรวมถึงบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. เอง บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ บริษัทอื่นที่ประกอบธุรกิจทางการเงิน สถาบันการเงินเฉพาะกิจ เพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (Liquidity facilities) [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 1.2] โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา
214	(16.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่สถาบันการเงินที่เป็นบริษัทแม่
215	(16.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิก

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		ใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่สถาบันการเงินที่เป็นบริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ซึ่งไม่รวมส่วนที่ได้รายงานใน ข้อ (16.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่ ข้างต้น
216	(16.3) ที่ให้แก่สถาบันการเงินอื่น	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่สถาบันการเงินอื่น ซึ่งไม่รวมส่วนที่ได้รายงานใน ข้อ (16.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่ และ ข้อ (16.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ข้างต้น
217	(17) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ที่ให้แก่นิติบุคคลอื่น เพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (Liquidity facilities) และวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities) วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่นิติบุคคลอื่น เช่น กองทุน นิติบุคคลเฉพาะกิจเพื่อการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์ซึ่งครอบคลุม Special Purpose Vehicles (SPVs) Securities Investment Vehicles (SIVs) และ Conduits เพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (Liquidity facilities) และเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities) [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 1] โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา	
218	(17.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่นิติบุคคลอื่นที่เป็นบริษัทแม่
219	(17.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่นิติบุคคลอื่นที่เป็นบริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ซึ่งไม่รวมส่วนที่ได้รายงานใน ข้อ (17.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่ ข้างต้น
220	(17.3) ที่ให้แก่นิติบุคคลอื่น	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิก

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		ใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่นิติบุคคลอื่น ซึ่งไม่รวมส่วนที่ได้รายงานใน ข้อ (17.1) ที่ให้แก่บริษัทแม่ และ ข้อ (17.2) ที่ให้แก่บริษัทอื่นในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ข้างต้น
222	หมวด (จ) ภาระผูกพันตามสัญญาซึ่ง ธพ. ให้สิทธิในการขยายอายุสัญญาสินเชื่อแก่ลูกค้า ในการรายงานภาระผูกพันตามสัญญาซึ่ง ธพ. ให้สิทธิในการขยายอายุสัญญาสินเชื่อแก่ลูกค้า [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/15] กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณเงินให้สินเชื่อที่ ธพ. ให้สิทธิในการขยายอายุสัญญาสินเชื่อแก่ลูกค้าภายในระยะเวลา 30 วัน ใน Column D โดยให้แบ่งตามประเภทคู่สัญญา เพื่อนำมาคำนวณหาส่วนเกินเมื่อเทียบกับปริมาณการขยายอายุสัญญาสินเชื่อจากส่วนกระแสเงินสดไหลเข้า	
224	(1) คู่สัญญาเป็น ธพ. หรือสถาบันการเงินอื่น	ปริมาณเงินให้สินเชื่อที่ ธพ. ให้สิทธิในการขยายอายุสัญญาแก่คู่สัญญาที่เป็น ธพ. หรือสถาบันการเงิน ซึ่งรวมถึงบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. เอง บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเออร์ บริษัทอื่นที่ประกอบธุรกิจทางการเงิน และสถาบันการเงินเฉพาะกิจ
225	(2) คู่สัญญาเป็นลูกค้ารายย่อย (Retail)	ปริมาณเงินให้สินเชื่อที่ ธพ. ให้สิทธิในการขยายอายุสัญญาแก่คู่สัญญาที่เป็นลูกค้ารายย่อย (Retail)
226	(3) คู่สัญญาเป็นธุรกิจขนาดเล็ก (Small business customers)	ปริมาณเงินให้สินเชื่อที่ ธพ. ให้สิทธิในการขยายอายุสัญญาแก่คู่สัญญาที่เป็นธุรกิจขนาดเล็ก (Small business customers)
227	(4) คู่สัญญาเป็นธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (Non-financial corporates)	ปริมาณเงินให้สินเชื่อที่ ธพ. ให้สิทธิในการขยายอายุสัญญาแก่คู่สัญญาที่เป็นธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (Non-financial corporates)
228	(5) คู่สัญญาอื่น นอกเหนือจากข้อ (1) – (4)	ปริมาณเงินให้สินเชื่อที่ ธพ. ให้สิทธิในการขยายอายุสัญญาแก่คู่สัญญาอื่น นอกเหนือจาก ข้อ (1) – (4)
235	หมวด (ฉ) ภาระผูกพันอื่น ทั้งที่มีสัญญาและไม่มีสัญญา ในการรายงานภาระผูกพันอื่นทั้งที่มีสัญญาและไม่มีสัญญา กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณกระแสเงินสดไหลออกเนื่องจากรายการภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน (Off balance sheet) ซึ่งครอบคลุมทั้งภาระผูกพันที่มีสัญญา และภาระผูกพันที่ไม่มีสัญญา ใน Column D	
237	(1) รายการภาระผูกพันที่เป็นสัญญา	รายการภาระผูกพันที่มีสัญญา ได้แก่ วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่ง ธพ. สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Uncommitted facilities) การค้า

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		ประกัน รับรอง อาวัล เล็ตเตอร์ออฟเครดิต การเปิดฐานะซอร์ต (Short position) ของ ธพ. โดยใช้หลักทรัพย์ของลูกค่านำมาวางไว้เป็นหลักประกันกับ ธพ. และภาระผูกพันตามสัญญาอื่นที่จะจ่ายเงินหรือให้กู้ยืมแก่คู่สัญญา [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/10 ข้อ 4.6 - 4.8, เอกสารแนบ หน้า 2/11 ข้อ 4.9 - 4.10]
238	(1.1) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งสามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted facilities)	วงเงินที่ ธพ. อนุมัติให้แก่ลูกค้า และ ธพ. สามารถยกเลิกวงเงินดังกล่าวได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/14 ข้อ 4.6]
239	(1.2) ธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับบริการทางการเงินเพื่อการค้า (Trade finance-related obligations)	ยอดคงค้างสัญญาการค้าประกัน รับรอง และอาวัลทุกประเภทที่ ธพ. เป็นผู้ค้าประกัน รับรอง และอาวัล รวมถึงยอดคงค้างตามเล็ตเตอร์ออฟเครดิตที่ ธพ. เป็นผู้ออก ซึ่งเกี่ยวข้องกับบริการทางการเงินเพื่อการค้า [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/14 ข้อ 4.7]
240	(1.3) รายการค้าประกัน รับรอง อาวัล เล็ตเตอร์ออฟเครดิต ที่ไม่เกี่ยวข้องกับบริการทางการเงินเพื่อการค้า (Guarantees L/C unrelated to trade finance obligations)	ยอดคงค้างสัญญาการค้าประกัน รับรอง และอาวัลทุกประเภทที่ ธพ. เป็นผู้ค้าประกัน รับรอง และอาวัล รวมถึงยอดคงค้างตามเล็ตเตอร์ออฟเครดิตที่ ธพ. เป็นผู้ออก ซึ่งไม่เกี่ยวข้องกับบริการทางการเงินเพื่อการค้า [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/15 ข้อ 4.8]
241	(1.4) การเปิดฐานะซอร์ต (Short position) ของ ธพ. โดยใช้หลักทรัพย์ของลูกค่านำมาวางไว้เป็นหลักประกันกับ ธพ.	มูลค่าหลักทรัพย์ที่ ธพ. ได้รับจากลูกค้าจากธุรกรรม Reverse repo และ Securities borrowing และได้นำไปเปิดฐานะซอร์ต (Short position) [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 4.9]
242	(1.5) รายการภาระผูกพันตามสัญญาอื่น	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกอื่นตามสัญญาที่ ธพ. อาจจะต้องจ่ายหรือให้กู้ยืมแก่คู่สัญญาภายในระยะเวลา 30 วัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/13 ข้อ 4.10] ซึ่งไม่ได้ถูกรายงานเป็นกระแสเงินสดไหลออกในข้ออื่นตามแบบรายงานนี้
243	(2) ภาระผูกพันที่ไม่มีสัญญาผูกมัด แต่อาจส่งผลให้ ธพ. มีกระแสเงินสดไหลออก รายการภาระผูกพันที่ไม่มีสัญญาแต่อาจก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลออกเนื่องจาก ธพ. เข้าไปมีส่วนร่วมหรือเป็นผู้สนับสนุนการออกหรือขายผลิตภัณฑ์หรือการให้บริการ ทำให้ ธพ. อาจต้องเตรียมสภาพคล่องเพื่อรองรับผลกระทบต่อชื่อเสียงของ ธพ. ในสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มี	

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		<p>ความรุนแรง ได้แก่ การรับซื้อคืนตราสารหนี้ (Debt-buy back requests) และธุรกรรมซับซ้อน (Structured products) ที่มีอายุครบกำหนดชำระเกินกว่า 30 วัน การให้ความช่วยเหลือสภาพคล่องแก่กองทุน (Managed funds) ที่บริหารโดยบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน และการให้ความช่วยเหลือสภาพคล่องแก่บริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินและกิจการอื่นที่ ธพ. เป็นผู้ถือหุ้นส่วนน้อย (Minority investments in entities) [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/15 ข้อ 5]</p>
244	<p>(2.1) การรับซื้อคืนตราสารหนี้ (Debt-buy back requests) และธุรกรรมซับซ้อน (Structured products)</p>	<p>ตราสารหนี้และธุรกรรมซับซ้อนที่ ธพ. หรือบุคคลอื่น เช่น SPV ที่ ธพ. เป็นผู้ให้การสนับสนุนทางการเงินเป็นผู้ออก ซึ่งมีอายุครบกำหนดชำระเกินกว่า 30 วัน แต่ ธพ. อาจต้องจ่ายชำระเงินออกไปเพื่อการไถ่ถอนตราสารดังกล่าวเนื่องจากผู้ถือคาดหวังว่ามีตลาดรองรับ [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/16 ข้อ 5.1] โดยให้รายงานเฉพาะตราสารหนี้ที่ไม่ได้ถูกนับเป็นเงินกองทุน ณ วันที่รายงาน และให้เลือกรายงานในข้อใดข้อหนึ่ง ดังต่อไปนี้</p>
245	<p>(2.1.1) กรณี ธพ. หรือบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินไม่ได้ทำหน้าที่เป็นผู้ค้าตราสารหนี้ (Dealer) หรือเป็นผู้สร้างสภาพคล่องในตลาด (Market maker)</p>	<p>ปริมาณตราสารหนี้ และธุรกรรมซับซ้อนคงค้างที่ ธพ. หรือบุคคลอื่น เช่น SPV ที่ ธพ. เป็นผู้ให้การสนับสนุนทางการเงินเป็นผู้ออก และตราสารดังกล่าวมีอายุครบกำหนดเกินกว่า 30 วัน</p>
246	<p>(2.1.2) กรณี ธพ. หรือบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินทำหน้าที่เป็นผู้ค้าตราสารหนี้ (Dealer) หรือเป็นผู้สร้างสภาพคล่องในตลาด (Market maker)</p>	<p>ปริมาณตราสารหนี้ และธุรกรรมซับซ้อนคงค้างที่ ธพ. หรือบุคคลอื่น เช่น SPV ที่ ธพ. เป็นผู้ให้การสนับสนุนทางการเงินเป็นผู้ออก และตราสารดังกล่าวมีอายุครบกำหนดเกินกว่า 30 วัน</p>
247	<p>(2.2) การให้ความช่วยเหลือกองทุน (Managed funds) ที่บริหารโดยบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน</p>	<p>มูลค่า NAV ของกองทุนเปิดประเภทกองทุนรวมตราสารแห่งหนี้ (Fixed income fund) และกองทุนรวมตลาดเงิน (Money market fund) ที่อยู่ภายใต้การบริหารของบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. ยกเว้น กองทุนที่จดทะเบียนกับสำนักงาน ก.ล.ต. เป็นกองทุนเปิดแต่มีลักษณะคล้ายกองทุนปิด [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/16 ข้อ 5.2]</p> <p>ทั้งนี้ ในการรายงานในข้อนี้ให้ ธพ. พิจารณาปริมาณที่สูงกว่าซึ่งเป็นปริมาณหลังคุณอัตราการไหลออกระหว่าง 1) มูลค่า NAV และ 2) ปริมาณวงเงิน Committed facilities ที่ ธพ. ให้แก่กองทุน</p>

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		(หลังการหักลบหลักประกัน) โดย หาก (1) > (2) ให้รายงานปริมาณมูลค่า NAV ทั้งหมด ในข้อนี้ หาก (2) > (1) ให้รายงานปริมาณมูลค่า NAV ทั้งหมด ในข้อนี้ และให้รายงานปริมาณส่วนเกิน (ส่วนที่ (2) > (1)) ใน ส่วนที่ 2.1 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลออก (Expected cash outflows) หมวด (ง) ภาระผูกพันที่มีสัญญา ข้อ (17) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed facilities) ที่ให้แก่นิติบุคคลอื่น เพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน (Liquidity facilities) และวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities)
248	(2.3) การให้ความช่วยเหลือสภาพคล่องแก่ Joint venture และ Minority investment	ประมาณการกระแสเงินสดไหลออกที่ ธพ. อาจต้องให้ความช่วยเหลือแก่บริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินและกิจการอื่นที่ ธพ. เป็นผู้ถือหุ้นส่วนน้อยภายในระยะเวลา 30 วัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/16 ข้อ 5.3]
256	หมวด (ข) กระแสเงินสดไหลออกทั้งสิ้นแบ่งตามสกุลเงินที่มีนัยสำคัญ	ในการรายงานกระแสเงินสดไหลออกแบ่งตามสกุลเงินที่มีนัยสำคัญ กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณกระแสเงินสดไหลออกในรูปสกุลเงินบาท และสกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญทั้งสิ้นที่ ธพ. ได้รายงานไว้ใน หมวด (ก) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายย่อย (Retail deposits and borrowings) หมวด (ข) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมรายใหญ่แบบไม่มีหลักประกัน (Unsecured wholesale funding) หมวด (ค) กระแสเงินสดไหลออกจากเงินกู้ยืมที่มีหลักประกันซึ่งรวมถึง ธุรกิจการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน (Repo) ธุรกิจการให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities lending) การให้ลูกค้ายืมหลักทรัพย์เพื่อไปเปิดฐานะชอร์ต (Short position) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน หมวด (ง) ภาระผูกพันที่มีสัญญา หมวด (จ) ภาระผูกพันตามสัญญาซึ่ง ธพ. ให้สิทธิในการขยายอายุสัญญาสินเชื่อแก่ลูกค้า และ หมวด (ฉ) ภาระผูกพันอื่น ทั้งที่มีสัญญาและไม่มีสัญญา โดยให้ ธพ. ระบุสกุลเงินที่มีนัยสำคัญไว้ที่หัวข้อใน Column C และรายงานปริมาณกระแสเงินสดไหลออกในแต่ละสกุลเงินก่อนปรับด้วยอัตราการไหลออกใน Column D และปริมาณหลังปรับด้วยอัตราการไหลออกใน Column I
259	(1) สกุลเงินบาท	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกที่อยู่ในรูปสกุลเงินบาท

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
260	(2) สกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญ สกุลเงินที่มีนัยสำคัญ หมายถึง สกุลเงินที่ผลรวมของหนี้สินในสกุลเงินนั้นและภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน (Off balance sheet) ประเภท Foreign exchange forward และ Cross currency swaps ที่จะทำให้เกิดกระแสเงินสดไหลออกในสกุลนั้นมากกว่าหรือเท่ากับร้อยละ 5 ของผลรวมของหนี้สินทั้งสิ้นและภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน (Off balance sheet) ประเภท Foreign exchange forward และ Cross currency swaps	
261-265	(2.1) – (2.5).....	ปริมาณกระแสเงินสดไหลออกที่อยู่ในรูปสกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญ

ส่วนที่ 2.2 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลเข้า (Expected cash inflows)

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
269	<p>หมวด (ก) กระแสเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมการซื้อหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน (Reverse repo) และการกู้ยืมหลักทรัพย์ (Securities borrowing) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน</p> <p>ในการรายงานเงินให้กู้ยืมที่มีหลักประกัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/16 ข้อ 1] กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณเงินให้กู้ยืมจากธุรกรรม การซื้อหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน (Reverse repo) และธุรกรรมการกู้ยืมหลักทรัพย์ (Securities borrowing) ที่จะครบกำหนดภายใน ระยะเวลา 30 วัน ใน Column D และรายงานราคาตลาดของสินทรัพย์หลักประกันใน Column E โดยให้แบ่งตามประเภทหลักประกัน</p> <p>ทั้งนี้ การรายงานในข้อนี้ไม่รวมถึงธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ไม่เกี่ยวข้องกับเงินสดสกุลใด ๆ (Collateral swaps) ซึ่งให้รายงานใน ส่วนที่ 3 : ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกัน (Collateral swaps) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน</p>	
272	<p>(1) กรณี ธพ. มิได้นำหลักประกันที่ได้จากการให้กู้ยืมเงินไปใช้ต่อ (Non-rehypothecation) เช่น เปิดฐานะชอร์ต (Covered short position) หรือนำไปใช้ต่อซึ่งมีผลทำให้หลักประกันดังกล่าวติดภาวะผูกพันแต่ไม่เกิน 30 วัน</p> <p>การให้กู้ยืมที่มีหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน และ ธพ. มิได้นำสินทรัพย์หลักประกันที่ได้รับมาไปใช้ต่อ เช่น เพื่อเปิด ฐานะชอร์ตหรือใช้เป็นหลักประกันในการกู้ยืมเงินต่อ หรือนำไปใช้ต่อแต่มีผลให้หลักประกันนั้นติดภาวะผูกพันไม่เกิน 30 วัน [ประกาศ LCR เอกสาร แนบ หน้า 2/16 ข้อ 1.1]</p>	
273	(1.1) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์ สภาพคล่องชั้นที่ 1	การให้กู้ยืมซึ่ง ธพ. ได้รับหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1
274	(1.1.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์ สภาพคล่อง	การให้กู้ยืมซึ่ง ธพ. ได้รับหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.1) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 เฉพาะส่วนที่ ธพ. ได้รายงานสินทรัพย์ หลักประกันดังกล่าวใน ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ก) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1
276	(1.2) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์ สภาพคล่องชั้นที่ 2A	การให้กู้ยืมซึ่ง ธพ. ได้รับหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
277	(1.2.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	การให้กู้ยืมซึ่ง ธพ. ได้รับหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.2) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A เฉพาะส่วนที่ ธพ. ได้รายงานสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวใน ส่วนที่ 1 : <u>สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ข) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A</u>
279	(1.3) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B	การให้กู้ยืมซึ่ง ธพ. ได้รับหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B
280	(1.3.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	การให้กู้ยืมซึ่ง ธพ. ได้รับหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B ตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.3) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B เฉพาะส่วนที่ ธพ. ได้รายงานสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวใน ส่วนที่ 1 : <u>สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ค) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B</u>
282	(1.4) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์ชั้นอื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B	การให้กู้ยืมซึ่ง ธพ. ได้รับหลักประกันเป็นสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B
284	(2) กรณี ธพ. นำหลักประกันที่ได้จากการให้กู้ยืมเงินไปใช้ต่อ (Rehypothecation) เช่น เปิดฐานะชอร์ต (Covered short position) ซึ่งมีผลทำให้หลักประกันดังกล่าวติดภาระผูกพันเกินกว่า 30 วัน การให้กู้ยืมที่มีหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน และ ธพ. นำสินทรัพย์หลักประกันที่ได้รับมาไปใช้ต่อ เช่น เพื่อเปิดฐานะชอร์ตหรือใช้เป็นหลักประกันในการกู้ยืมเงินต่อ ซึ่งมีผลให้หลักประกันนั้นติดภาระผูกพันเกินกว่า 30 วัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/17 ข้อ 1.2]	
285	(2.1) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1	การให้กู้ยืมซึ่ง ธพ. ได้รับหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1
286	(2.2) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A	การให้กู้ยืมซึ่ง ธพ. ได้รับหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A
287	(2.3) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B	การให้กู้ยืมซึ่ง ธพ. ได้รับหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
288	(2.4) กรณีหลักประกันเป็นสินทรัพย์ชั้นอื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B	การให้กู้ยืมซึ่ง ธพ. ได้รับหลักประกันเป็นสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B
292	<p>หมวด (ข) กระแสเงินสดไหลเข้าจากการรับชำระคืนเงินให้สินเชื่อจากลูกหนี้ที่มีคุณภาพดี (Fully performing loans) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน</p> <p>ในการรายงานกระแสเงินสดไหลเข้าจากการรับชำระคืนเงินให้สินเชื่อจากลูกหนี้ที่มีคุณภาพดีที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/17 ข้อ 2] กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณกระแสเงินสดที่จะได้รับเข้ามาภายในระยะเวลา 30 วัน ตามสัญญาจาก เงินให้สินเชื่อและเงินฝากที่สถาบันการเงินอื่น เงินให้สินเชื่ออื่นที่ ธพท. กำหนดให้ได้รับอัตราการไหลเข้า 100% และตราสารหนี้ที่ ธพ. ถือครอง ใน Column D</p>	
294	<p>(1) การรับชำระคืนเงินให้สินเชื่อและเงินฝากจากคู่สัญญาที่มีคุณภาพดี (Fully performing loans) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน</p> <p>เงินให้สินเชื่อซึ่งรวมถึงเงินฝากที่สถาบันการเงินอื่น ที่ให้แก่คู่สัญญาที่มีคุณภาพดี [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/17 ข้อ 2.1] เฉพาะส่วนที่จะครบกำหนดชำระภายในระยะเวลา 30 วัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/18 ข้อ (1)] โดยให้แบ่งตามประเภทลูกหนี้</p> <p>ทั้งนี้ ไม่นับรวมเงินให้สินเชื่อตามโครงการ Soft loan ของ ธพท. เพื่อช่วยเหลือผู้ได้รับความเสียหายจากอุทกภัย ซึ่งให้รายงานใน ข้อ (2) การรับชำระคืนเงินให้สินเชื่ออื่นที่ ธพท. กำหนดให้ได้รับอัตราการไหลเข้า 100% ได้แก่ เงินให้สินเชื่อ Soft loan ลูกหนี้ค้างรับที่เกิดจากการขายหลักทรัพย์ซึ่งอยู่ระหว่างรอการส่งมอบ รายการเงินสดระหว่างเรียกเก็บ และรายการอื่นที่ ธพท. กำหนดเพิ่มเติม</p>	
295	(1.1) ลูกหนี้รายย่อย (Retail)	ปริมาณเงินให้สินเชื่อที่ให้แก่มูลุหนี้รายย่อย
296	(1.2) ลูกหนี้ธุรกิจขนาดเล็ก (Small business customers)	ปริมาณเงินให้สินเชื่อที่ให้แก่มูลุหนี้ธุรกิจขนาดเล็ก
297	(1.3) ลูกหนี้ธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน (Non-financial corporates)	ปริมาณเงินให้สินเชื่อที่ให้แก่มูลุหนี้ธุรกิจเอกชนที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน
298	(1.4) ลูกหนี้ธนาคารกลาง	<p>ปริมาณเงินฝากที่ธนาคารกลาง และเงินให้สินเชื่อที่ให้แก่มูลุหนี้ธนาคารกลาง</p> <p>ทั้งนี้ ไม่นับรวมเงินฝากที่ธนาคารกลางและเงินให้สินเชื่อซึ่งได้รายงานแล้วใน ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ก) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ข้อ (2) เงินฝากและเงินสำรองที่ธนาคารกลาง</p>

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
299	(1.5) ลูกหนี้ ธพ. และสถาบันการเงินอื่น (Financial institutions) เงินฝากและเงินให้สินเชื่อที่ให้แก่ ธพ. และสถาบันการเงินอื่น ซึ่งรวมถึงบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. เอง บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ บริษัทอื่นที่ประกอบธุรกิจทางการเงิน และสถาบันการเงินเฉพาะกิจ โดยให้แบ่งตามประเภทธุรกรรม	
300	(1.5.1) เงินฝากเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (Operational deposits) ที่ฝากไว้ที่ ธพ. และสถาบันการเงินอื่น	ปริมาณเงินฝากเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการที่ ธพ. ฝากไว้ที่ ธพ. และสถาบันการเงินอื่น ได้แก่ เงินฝากที่ใช้ในการชำระเงิน (Clearing) การเก็บรักษาทรัพย์สิน (Custody) และการบริหารเงิน (Cash management)
301	(1.5.2) กรณีเงินฝากหรือการชำระหนี้อื่นซึ่งครบกำหนดใน 30 วัน	ปริมาณเงินฝากที่ ธพ. และสถาบันการเงินอื่น และเงินให้สินเชื่อที่ให้แก่ ธพ. และสถาบันการเงินอื่น นอกเหนือจากที่ได้รายงานไว้ใน ข้อ (1.5.1) เงินฝากเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (Operational deposits) ที่ฝากไว้ที่ ธพ. และสถาบันการเงินอื่น ทั้งนี้ ในกรณีที่ ธพ. มีรายการกระแสเงินสดไหลเข้าและกระแสเงินสดไหลออกที่เกิดขึ้นระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. ให้ ธพ. สามารถหักกลบกระแสเงินสดดังกล่าวที่เกิดขึ้นภายในระยะเวลา 30 วันได้ [ประกาศ LCR หน้า 7] โดยให้รายงานปริมาณซึ่งเป็นยอดรวมของเงินฝากและเงินให้สินเชื่อที่ให้แก่บริษัทที่อยู่ในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกับ ธพ. ใน ข้อ (1.8) ลูกหนี้ที่เป็นบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกัน (Intra-group transaction)
302	(1.6) ลูกหนี้ที่เป็นนิติบุคคลอื่น	ปริมาณเงินให้สินเชื่อที่ให้แก่ลูกหนี้ที่เป็นนิติบุคคลอื่น นอกเหนือจากที่ได้รายงานใน ข้อ (1.1) – (1.5) ข้างต้น
303	(1.7) เฉพาะส่วนที่เป็นเงินรับชำระคืนเงินให้สินเชื่อที่เป็น Call loan ซึ่งได้รายงานในข้อ (1.1) ถึง (1.6)	ปริมาณเงินให้สินเชื่อเฉพาะส่วนที่เป็น Call loan ที่ ธพ. ให้แก่คู่สัญญาที่ได้รายงานใน ข้อ (1.1) – (1.6) ข้างต้น
304	(1.8) ลูกหนี้ที่เป็นบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินเดียวกัน (Intra-group transaction)	ปริมาณเงินให้สินเชื่อที่ให้แก่บริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ.

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
306	(2) การรับชำระคืนเงินให้สินเชื่ออื่นที่ ธปท. กำหนดให้ได้รับอัตราดอกเบี้ย 100% ได้แก่ เงินให้สินเชื่อ Soft loan ลูกหนี้ค้างรับที่เกิดจากการขายหลักทรัพย์ซึ่งอยู่ระหว่างรอการส่งมอบ รายการเงินสดระหว่างเรียกเก็บ และรายการอื่นที่ ธปท. กำหนดเพิ่มเติม	ปริมาณเงินให้สินเชื่ออื่นที่ ธปท. กำหนดให้ได้รับอัตราดอกเบี้ยร้อยละ 100 [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/17 ข้อ 2.2] เฉพาะส่วนที่จะครบกำหนดชำระภายในระยะเวลา 30 วัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/18 ข้อ (2)]
307	(3) กระแสเงินสดไหลเข้าจากตราสารหนี้ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน	ปริมาณคงค้างตราสารหนี้ที่ ธพ. ถือครอง และ ธพ. ไม่ได้รายงานตราสารหนี้ดังกล่าวใน ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/18 ข้อ 2.3] เฉพาะส่วนที่จะครบกำหนดตามสัญญาภายในระยะเวลา 30 วัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/18 ข้อ (3)]
310	หมวด (ค) ภาระผูกพันที่มีสัญญา ในการรายงานภาระผูกพันที่มีสัญญา [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/19 ข้อ 3] กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณกระแสเงินสดไหลเข้าอื่นที่จะครบกำหนดตามสัญญาภายในระยะเวลา 30 วัน ใน Column D	
312	(1) ภาระผูกพันที่มีสัญญา รายการภาระผูกพันที่มีสัญญา ได้แก่ กระแสเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมอนุพันธ์ (Derivatives cash inflow) [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/19 ข้อ 3.1] และกระแสเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมอื่นที่จะครบกำหนดตามสัญญาภายในระยะเวลา 30 วันตามที่ ธปท. กำหนด [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/19 ข้อ 3.2]	
313	(1.1) กระแสเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมอนุพันธ์ (Derivatives cash inflow)	ปริมาณกระแสเงินสดที่คาดว่าจะไหลเข้าสุทธิภายในระยะเวลา 30 วันจากธุรกรรมอนุพันธ์ [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/19 ข้อ 3.1] ทั้งนี้ หากผลลัพธ์สุทธิเป็นกระแสเงินสดไหลเข้า ให้รายงานในข้อนี้ แต่หากผลลัพธ์สุทธิเป็นกระแสเงินสดไหลออก ให้รายงานใน ส่วนที่ 2.1 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลออก (Expected cash outflows) หมวด (ง) ภาระผูกพันที่มีสัญญา ข้อ (1) กระแสเงินสดไหลออกจากธุรกรรมอนุพันธ์ (Derivatives cash outflow)

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
314	(1.2) กระแสเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมอื่น	ปริมาณกระแสเงินสดไหลเข้าอื่นตามสัญญาที่จะได้รับเข้ามาภายในระยะเวลา 30 วัน [ประกาศ LCR เอกสารแนบ หน้า 2/19 ข้อ 3.2] ซึ่งไม่ได้ถูกรายงานเป็นกระแสเงินสดไหลเข้าในข้ออื่นตามแบบรายงานนี้
324	หมวด (จ) กระแสเงินสดไหลเข้าทั้งสิ้นแบ่งตามสกุลเงินที่มีนัยสำคัญ ในการรายงานกระแสเงินสดไหลเข้าแบ่งตามสกุลเงินที่มีนัยสำคัญ กำหนดให้ ธพ. รายงานปริมาณกระแสเงินสดไหลเข้าในรูปสกุลเงินบาท และสกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญทั้งสิ้นที่ ธพ. ได้รายงานไว้ใน หมวด (ก) กระแสเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมการซื้อหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน (Reverse repo) และการกู้ยืมหลักทรัพย์ (Securities borrowing) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน หมวด (ข) กระแสเงินสดไหลเข้าจากการรับชำระคืนเงินให้สินเชื่อจากลูกหนี้ที่มีคุณภาพดี (Fully performing loans) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน และ หมวด (ค) ภาระผูกพันที่มีสัญญาโดยให้ ธพ. ระบุสกุลเงินที่มีนัยสำคัญไว้ที่หัวข้อใน Column C และรายงานปริมาณกระแสเงินสดไหลเข้าในแต่ละสกุลเงินก่อนปรับด้วยอัตราการไหลเข้าใน Column D และปริมาณหลังปรับด้วยอัตราการไหลเข้าใน Column I	
327	(1) สกุลเงินบาท	ปริมาณกระแสเงินสดไหลเข้าที่อยู่ในรูปสกุลเงินบาท
328	(2) สกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญ สกุลเงินที่มีนัยสำคัญ หมายถึง สกุลเงินที่ผลรวมของหนี้สินในสกุลเงินนั้นและภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน (Off balance sheet) ประเภท Foreign exchange forward และ Cross currency swaps ที่จะทำให้เกิดกระแสเงินสดออกในสกุลนั้นมากกว่าหรือเท่ากับร้อยละ 5 ของผลรวมของหนี้สินทั้งสิ้นและภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน (Off balance sheet) ประเภท Foreign exchange forward และ Cross currency swaps	
329-333	(2.1) – (2.5).....	ปริมาณกระแสเงินสดไหลเข้าที่อยู่ในรูปสกุลเงินอื่นที่มีนัยสำคัญ

ส่วนที่ 3 : ธุรกิจการแลกเปลี่ยนหลักประกัน (Collateral swaps) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
338	<p>ธุรกิจการแลกเปลี่ยนหลักประกัน (Collateral swaps) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน</p> <p>ในการรายงานธุรกิจการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน กำหนดให้ ธพ. รายงานราคาตลาดของสินทรัพย์หลักประกันที่ ธพ. ให้ค้ำสัญญาไว้ใน Column D และรายงานราคาตลาดของสินทรัพย์หลักประกันที่ ธพ. ยืมมาใน Column E โดยให้แบ่งตามประเภทหลักประกันที่ ธพ. ยืม และให้ยืมแก่ค้ำสัญญา</p> <p>ทั้งนี้ ธุรกิจการแลกเปลี่ยนหลักประกันเป็นการแลกเปลี่ยนสินทรัพย์ที่ไม่ใช่เงินสดประเภทหนึ่งกับสินทรัพย์ที่ไม่ใช่เงินสดอีกประเภทหนึ่ง จึงไม่รวมถึงธุรกรรมการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน (Repo) ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities lending) ธุรกรรมการให้ลูกค้ำยืมหลักทรัพย์เพื่อไปเปิดฐานะชอร์ต (Short position) ซึ่งให้รายงานใน ส่วนที่ 2.1 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลออก (Expected cash outflows) หมวด (ค) กระแสเงินสดไหลออกจากเงินกู้ยืมที่มีหลักประกันซึ่งรวมถึง ธุรกรรมการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน (Repo) ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities lending) การให้ลูกค้ำยืมหลักทรัพย์เพื่อไปเปิดฐานะชอร์ต (Short position) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน และไม่รวมถึงธุรกรรมการซื้อหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน (Reverse repo) การกู้ยืมหลักทรัพย์ (Securities borrowing) และการให้กู้ยืมโดยมีหลักประกัน (Secured lending) ซึ่งให้รายงานใน ส่วนที่ 2.2 : ประมาณการกระแสเงินสดไหลเข้า (Expected cash inflows) หมวด (ก) กระแสเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมการซื้อหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน (Reverse repo) และการกู้ยืมหลักทรัพย์ (Securities borrowing) ที่จะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน</p>	
339	<p>(1) กรณีมิได้นำสินทรัพย์ที่ได้รับมาจากการทำธุรกรรมไปใช้ต่อ (Non-rehypothecation) เช่น เปิดฐานะชอร์ต (Covered short position) หรือนำไปใช้ต่อซึ่งมีผลทำให้หลักประกันดังกล่าวติดภาระผูกพันแต่ไม่เกิน 30 วัน</p> <p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน และ ธพ. มิได้นำสินทรัพย์หลักประกันที่ได้รับมาไปใช้ต่อ เช่น เพื่อเปิดฐานะชอร์ตหรือใช้เป็นหลักประกันในการกู้ยืมเงินต่อ หรือนำไปใช้ต่อแต่มีผลให้หลักประกันนั้นติดภาระผูกพันไม่เกิน 30 วัน</p>	
340	(1.1) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1
341	(1.1.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.1) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1 โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยน

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		<p>หลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้</p> <p>1) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ที่ให้ยืมไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้</p> <p>2) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ที่ได้ยืมมา เฉพาะส่วนที่ ธพ. ได้รายงานสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวใน ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ก) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1</p>
343	(1.2) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A</p>
344	(1.2.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.2) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้</p> <p>1) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ที่ให้ยืมไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้</p> <p>2) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ที่ได้ยืมมา เฉพาะส่วนที่ ธพ. ได้รายงานสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวใน ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ข) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A</p>
346	(1.3) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B</p>
347	(1.3.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.3) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้</p> <p>1) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ที่ให้ยืมไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้</p>

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		2) สิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B ที่ได้ยื่นมา เฉพาะส่วนที่ จพ. ได้รายงานสิ้นทรัพย์หลักประกัน ดังกล่าวใน <u>ส่วนที่ 1 : สิ้นทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ค) สิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B</u>
349	(1.4) ให้ยื่นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยื่นสิ้นทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ จพ. ให้ยื่นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยื่นสิ้นทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B
350	(1.4.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสิ้นทรัพย์สภาพคล่อง	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.4) ให้ยื่นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยื่นสิ้นทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้ 1) สิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ที่ให้ยื่นไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องได้
352	(1.5) ให้ยื่นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A แลกกับการยื่นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ จพ. ให้ยื่นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A แลกกับการยื่นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1
353	(1.5.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสิ้นทรัพย์สภาพคล่อง	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.5) ให้ยื่นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A แลกกับการยื่นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้ 1) สิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ที่ให้ยื่นไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องได้ 2) สิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ที่ได้ยื่นมา เฉพาะส่วนที่ จพ. ได้รายงานสิ้นทรัพย์หลักประกัน ดังกล่าวใน <u>ส่วนที่ 1 : สิ้นทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ก) สิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1</u>
355	(1.6) ให้ยื่นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A แลก	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ จพ. ให้ยื่นสิ้นทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A แลกกับการยื่น

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
	กับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A	<u>สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A</u>
356	(1.6.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.6) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้</p> <p>1) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ที่ให้ยืมไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้</p> <p>2) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ที่ได้ยืมมา เฉพาะส่วนที่ จพ. ได้รายงานสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวใน <u>ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ข) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A</u></p>
358	(1.7) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ จพ. ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B</p>
359	(1.7.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.7) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้</p> <p>1) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ที่ให้ยืมไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้</p> <p>2) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B ที่ได้ยืมมา เฉพาะส่วนที่ จพ. ได้รายงานสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวใน <u>ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ค) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B</u></p>
361	(1.8) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A แลกกับการยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ จพ. ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A แลกกับการยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B</p>
362	(1.8.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.8) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่</p>

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
	สภาพคล่อง	2A แลกกับการยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้ 1) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ที่ให้ยืมไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้
364	(1.9) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1
365	(1.9.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.9) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้ 1) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B ที่ให้ยืมไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้ 2) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ที่ได้ยืมมา เฉพาะส่วนที่ ธพ. ได้รายงานสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวใน ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ก) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1
367	(1.10) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A
368	(1.10.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.10) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้ 1) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B ที่ให้ยืมไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องได้ 2) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ที่ได้ยืมมา เฉพาะส่วนที่ ธพ. ได้รายงานสินทรัพย์หลักประกัน

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		ดังกล่าวใน ส่วนที่ 1 : <u>สิทธิสภาพคล่อง หมวด (ข) สิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2A</u>
370	(1.11) ให้ยืมสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B
371	(1.11.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสิทธิสภาพคล่อง	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.11) ให้ยืมสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้</p> <p>1) สิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B ที่ให้ยืมไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสิทธิสภาพคล่องได้</p> <p>2) สิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B ที่ได้ยืมมา เฉพาะส่วนที่ ธพ. ได้รายงานสิทธิหลักประกันดังกล่าวใน ส่วนที่ 1 : <u>สิทธิสภาพคล่อง หมวด (ค) สิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B</u></p>
373	(1.12) ให้ยืมสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสิทธิอื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 1 สิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสิทธิอื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 1 สิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B
374	(1.12.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสิทธิสภาพคล่อง	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.12) ให้ยืมสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B แลกกับการยืมสิทธิอื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 1 สิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้</p> <p>1) สิทธิสภาพคล่องชั้นที่ 2B ที่ให้ยืมไป เฉพาะส่วนที่หากสินทรัพย์ดังกล่าวมิได้ถูกนำมาเป็นหลักประกันในการทำธุรกรรมจะสามารถรายงานเป็นสิทธิสภาพคล่องได้</p>
376	(1.13) ให้ยืมสิทธิอื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็น	ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสิทธิอื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสิทธิสภาพคล่อง

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
	<p>สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1</p>	<p><u>ชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1</u></p>
377	<p>(1.13.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง</p>	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.13) ให้ยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้</p> <p>1) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ที่ได้ยืมมา เฉพาะส่วนที่ ธพ. ได้รายงานสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวใน <u>ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ก) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1</u></p>
379	<p>(1.14) ให้ยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A</p>	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A</p>
380	<p>(1.14.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง</p>	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.14) ให้ยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้</p> <p>1) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ที่ได้ยืมมา เฉพาะส่วนที่ ธพ. ได้รายงานสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวใน <u>ส่วนที่ 1 : สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ข) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A</u></p>
382	<p>(1.15) ให้ยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B แลกกับการยืม</p>	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B</p>

บรรทัดที่ใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
	สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B	
383	(1.15.1) เฉพาะส่วนที่นับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่อง	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันตามที่ได้รายงานใน ข้อ (1.15) ให้ยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B โดยให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน ที่มีคุณสมบัติ ดังนี้</p> <p>1) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B ที่ได้ยืมมา เฉพาะส่วนที่ ธพ. ได้รายงานสินทรัพย์หลักประกันดังกล่าวใน ส่วนที่ 1 : <u>สินทรัพย์สภาพคล่อง หมวด (ค) สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B</u></p>
385	(1.16) ให้ยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B แลกกับการยืมสินทรัพย์อื่นที่ไม่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A หรือ 2B</p>
386	(2) กรณีนำสินทรัพย์ที่ได้รับมาจากการทำธุรกรรมไปใช้ต่อ (Rehypothecation) เช่น เปิดฐานะชอร์ต (Covered short position) ซึ่งมีผลทำให้หลักประกันดังกล่าวติดภาวะผูกพันเกินกว่า 30 วัน	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันซึ่งจะครบกำหนดภายในระยะเวลา 30 วัน และ ธพ. นำสินทรัพย์หลักประกันที่ได้รับมาไปใช้ต่อ เช่น เพื่อเปิดฐานะชอร์ตหรือใช้เป็นหลักประกันในการกู้ยืมเงินต่อ ซึ่งมีผลให้หลักประกันนั้นติดภาวะผูกพันเกินกว่า 30 วัน</p>
387	(2.1) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1</p>
388	(2.2) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A</p>
389	(2.3) ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลก	<p>ธุรกรรมการแลกเปลี่ยนหลักประกันที่ ธพ. ให้ยืมสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 แลกกับการยืม</p>

1	แบบรายงานอัตราส่วนที่มาและใช้ไปของแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Net Stable Funding Ratio - NSFR)	(รายชื่อ บพ.)							เอกสารแนบ 2 - NSFR			
2	ส่วนที่ 1 : แหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Available Stable Funding)								-แบบรายงาน-ปรับปรุง มิ.ย. 58			
3	หมวด (ก) รายการหนี้สิน และส่วนของเจ้าของในงบแสดงฐานะการเงิน											
4	รายการ	Paragraph nr in standards doc	จำนวนที่รายงาน			ค่าแปลงสภาพ (ASF Factor)			ปริมาณแหล่งเงินที่มีความมั่นคง			
5			อายุคงเหลือ < 6 เดือน	อายุคงเหลือ ≥ 6 เดือน < 1 ปี	อายุคงเหลือ ≥ 1 ปี	ส่วนที่ < 6 เดือน	ส่วนที่ ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี	ส่วนที่ ≥ 1 ปี	ส่วนที่ < 6 เดือน	ส่วนที่ ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี	ส่วนที่ ≥ 1 ปี	ทั้งสิ้น
6	(1) เงินกองทุนชั้นที่ 1 และเงินกองทุนชั้นที่ 2 ตามประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนสำหรับธนาคารพาณิชย์ ก่อนรายการหักทั้งสิ้นจากเงินกองทุน ทั้งนี้ ไม่รวมถึงเงินกองทุนชั้นที่ 2 ที่มีอายุคงเหลือ (residual maturity) ต่ำกว่า 1 ปี	21(a)						1.00				
7	(2) เงินกองทุนอื่นนอกเหนือจากรายการข้างต้นที่มีอายุคงเหลือ (effective residual maturity) ตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป	21(b)						1.00				
8	(3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากรายย่อย (retail) และธุรกิจขนาดเล็ก (small business customers) ที่เข้าข่ายเป็นเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีความมั่นคง (stable deposits)	21(c), 22				0.95	0.95	1.00				
9	(4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากรายย่อย (retail) และธุรกิจขนาดเล็ก (small business customers) ที่เข้าข่ายเป็นเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีความมั่นคงรองลงมา (less stable deposits)	21(c), 23				0.90	0.90	1.00				
10	(5) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมแบบไม่มีหลักประกันจากธุรกิจเอกชน (non-financial corporates)	21(c), 24(a)										
11	(5.1) เงินรับฝากเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (operational deposits) ตาม LCR					0.50	0.50	1.00				
12	(5.2) เงินรับฝากที่ไม่ใช่เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (non-operational deposits) ตาม LCR					0.50	0.50	1.00				
13	(5.3) เงินกู้ยืมแบบไม่มีหลักประกัน (non-deposit unsecured funding)					0.50	0.50	1.00				
14	Check: sum of rows 11 to row 13 = row 10 for each column		Pass	Pass	Pass							
15	(6) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมแบบไม่มีหลักประกันจากธนาคารกลาง	21(c), 24(b), 24(d), 25(a)										
16	(6.1) เงินรับฝากเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (operational deposits) ตาม LCR					0.50	0.50	1.00				
17	(6.2) เงินรับฝากที่ไม่ใช่เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (non-operational deposits) ตาม LCR					0.00	0.50	1.00				
18	(6.3) เงินกู้ยืมแบบไม่มีหลักประกัน (non-deposit unsecured funding)					0.00	0.50	1.00				
19	Check: sum of row 16 to row 18 = row 15 for each column		Pass	Pass	Pass							
20	(7) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมแบบไม่มีหลักประกันจากรัฐบาล องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ ธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาของแต่ละประเทศ (NDBs)	21(c), 24(c)										
21	(7.1) เงินรับฝากเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (operational deposits) ตาม LCR					0.50	0.50	1.00				
22	(7.2) เงินรับฝากที่ไม่ใช่เพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (non-operational deposits) ตาม LCR					0.50	0.50	1.00				
23	(7.3) เงินกู้ยืมแบบไม่มีหลักประกัน (non-deposit unsecured funding)					0.50	0.50	1.00				
24	Check: sum of row 21 to row 23 = row 20 for each column		Pass	Pass	Pass							

48	(11.2) หนี้สินสุทธิจากธุรกรรมอนุพันธ์ตาม NSFR (หนี้สินสุทธิจากธุรกรรมอนุพันธ์หลังหักหลักประกันทั้งสิ้นที่วางไว้กับผู้สัญญาเป็น variation margin)	19, 20, FN 6							0.00				
49	(11.3) Initial margin ที่ได้รับจากผู้สัญญาทั้งสิ้น (total initial margin received)												
50	(11.3.1) ส่วนที่ได้รับเป็นเงินสด												
51	(11.3.2) ส่วนที่ได้รับเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1												
52	(11.3.3) ส่วนที่ได้รับเป็นสินทรัพย์อื่นที่ไม่ใช่สินทรัพย์สภาพคล่องขั้นที่ 1												
53	Check: sum of row 50 to row 52 = row 49												Pass
54	(11.4) Initial margin ที่ได้รับทั้งสิ้น (รวมหลักประกันทุกประเภท) แยกตามอายุคงเหลือของธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกี่ยวข้อง												
55	Check: sum of row 54 = row 49												Pass
56	(11.5) Initial margin ที่ได้รับ (รวมหลักประกันทุกประเภท) จากผู้สัญญาที่ได้รับยกเว้นการปฏิบัติตามข้อกำหนดด้านหลักประกันของ BCBS-IOSCO												
57	(11.5.1) ส่วนของนิติบุคคลอื่นที่ไม่ใช่สถาบันการเงินซึ่งไม่มีความสำคัญในเชิงระบบ (non-financial entities that are not systemically important)												
58	(11.5.2) ส่วนของรัฐบาล ธนาคารกลาง ธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือธนาคารเพื่อการชำระเงินระหว่างประเทศ (BIS)												
59	Check: row 49 \geq sum of rows 57 to 58												Pass
60	(12) หนี้สินอื่นและส่วนของผู้ถือหุ้นอื่น												
61	(12.1) หนี้สินภาษีเงินได้รอตัดบัญชี	25(b)					0.00	0.50	1.00				
62	(12.2) ส่วนได้เสียที่ไม่มีอำนาจควบคุม (minority interest)	25(b)					0.00	0.50	1.00				
63	(12.3) หนี้ที่ค้างจ่ายจากการซื้อหลักทรัพย์ที่ต่อระหว่างรอการส่งมอบ (trade date payables)	25(d)					0.00						
64	(12.4) Interdependent liabilities	45					0.00	0.00	0.00				
65	(12.5) หนี้สินอื่นและส่วนของผู้ถือหุ้นอื่นนอกเหนือจากรายการข้างต้น	21(c), 24(d), 25(a), 25(b)					0.00	0.50	1.00				
66										Total ASF			

ส่วนที่ 2 : ความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Required Stable Funding)													
หมวด (ก) รายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน													
	Paragraph nr in standards doc	จำนวนที่รายงาน			ค่าแปลงสภาพ (RSF Factor)			ปริมาณความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง					
		อายุคงเหลือ < 6 เดือน	อายุคงเหลือ ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี	อายุคงเหลือ ≥ 1 ปี	ส่วนที่ < 6 เดือน	ส่วนที่ ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี	ส่วนที่ ≥ 1 ปี	ส่วนที่ < 6 เดือน	ส่วนที่ ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี	ส่วนที่ ≥ 1 ปี	ทั้งสิ้น		
72	(1) เงินสด	36(a)				0.00							
73	(2) เงินฝากและเงินสำรองที่ธนาคารกลาง	36(b)				0.00	0.00	0.00					
74	(1) - (2) ส่วนของเงินสำรองที่ธนาคารกลางที่ ๓๗. ต้องดำรงตามกฎหมาย	Sec FN 17				1.00	1.00	1.00					
75	(3) สินเชื่อที่ให้แก่สถาบันการเงิน												
76	(3.1) สินเชื่อที่ให้แก่สถาบันการเงิน ที่มีหลักประกันเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 และสามารถนำหลักประกันที่ได้จากการให้ผู้ยืมเงินไปใช้ต่อ (rehypothecate) ได้ตลอดอายุของสินเชื่อ	31, 38, 40(c), 43(a), 43(c)											
77	ปราศจากการผูกพัน					0.10	0.50	1.00					
78	ติดการผูกพัน :												
79	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน					0.10	0.50	1.00					
80	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี					0.50	0.50	1.00					
81	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี					1.00	1.00	1.00					
82	(3.2) สินเชื่อที่ให้แก่สถาบันการเงิน ที่มีหลักประกันเป็นสินทรัพย์อื่นที่ไม่เป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1	31, 39(b), 40(c), 43(a), 43(c)											
83	ปราศจากการผูกพัน					0.15	0.50	1.00					
84	ติดการผูกพัน :												
85	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน					0.15	0.50	1.00					
86	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี					0.50	0.50	1.00					
87	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี					1.00	1.00	1.00					
88	(3.3) สินเชื่อที่ให้แก่สถาบันการเงิน ที่ไม่มีหลักประกัน	31, 39(b), 40(c), 43(a), 43(c)											
89	ปราศจากการผูกพัน					0.15	0.50	1.00					
90	ติดการผูกพัน :												
91	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน					0.15	0.50	1.00					
92	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี					0.50	0.50	1.00					
93	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี					1.00	1.00	1.00					

94	(4) ธุรสารหนี้ที่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1 ตาม LCR	31, 37, 40(b), 43(a)												
95	ปราศจากการผูกพัน						0.05	0.05	0.05					
96	ติดการผูกพัน :													
97	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน						0.05	0.05	0.05					
98	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี						0.50	0.50	0.50					
99	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี						1.00	1.00	1.00					
100	(5) ธุรสารหนี้ที่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2A ตาม LCR	31, 39(a), 40(b), 43(a)												
101	ปราศจากการผูกพัน						0.15	0.15	0.15					
102	ติดการผูกพัน :													
103	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน						0.15	0.15	0.15					
104	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี						0.50	0.50	0.50					
105	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี						1.00	1.00	1.00					
106	(6) ธุรสารหนี้ที่เข้าข่ายเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 2B ตาม LCR	31, 40(a), 40(b), 43(a)												
107	ปราศจากการผูกพัน						0.50	0.50	0.50					
108	ติดการผูกพัน :													
109	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน						0.50	0.50	0.50					
110	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี						0.50	0.50	0.50					
111	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี						1.00	1.00	1.00					
112	(7) เงินฝากเพื่อธุรกรรมด้านปฏิบัติการ (operational deposits) ที่ฝากไว้ที่สถาบันการเงิน	31, 40(d), 43(a)												
113	ปราศจากการผูกพัน						0.50	0.50	1.00					
114	ติดการผูกพัน :													
115	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน						0.50	0.50	1.00					
116	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี						0.50	0.50	1.00					
117	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี						1.00	1.00	1.00					
118	(8) สินเชื่อที่ให้แก่ธุรกิจเอกชน (non-financial corporates) ซึ่งมีอายุคงเหลือ (residual maturity) ต่ำกว่า 1 ปี	31, 40(e), 43(a)												
119	ปราศจากการผูกพัน						0.50	0.50						
120	ติดการผูกพัน :													
121	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน						0.50	0.50						
122	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี						0.50	0.50						
123	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี						1.00	1.00						

124	(9) สินเชื่อที่ให้แก่นาคารกลาง ซึ่งมีอายุคงเหลือ (residual maturity) ต่ำกว่า 1 ปี	31, 36(c), 40(c), 43(a)											
125	ปราศจากการผูกพัน						0.00	0.50					
126	ติดการผูกพัน :												
127	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน						0.00	0.50					
128	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี						0.50	0.50					
129	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี						1.00	1.00					
130	(10) สินเชื่อที่ให้แก่รัฐบาล องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐและรัฐวิสาหกิจ ธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือธนาคารเพื่อการพัฒนาแห่งชาติ (NDBs) ซึ่งมีอายุคงเหลือ (residual maturity) ต่ำกว่า 1 ปี	31, 40(e), 41, 43(a)											
131	ปราศจากการผูกพัน						0.50	0.50					
132	ติดการผูกพัน :												
133	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน						0.50	0.50					
134	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี						0.50	0.50					
135	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี						1.00	1.00					
136	(11) สินเชื่อเพื่อที่อยู่อาศัยที่ได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 35% หรือต่ำกว่า ตาม Basel II - SA	31, 40(e), 41(a), 43(a)											
137	ปราศจากการผูกพัน						0.50	0.50	0.65				
138	ติดการผูกพัน :												
139	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน						0.50	0.50	0.65				
140	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี						0.50	0.50	0.65				
141	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี						1.00	1.00	1.00				
142	(12) สินเชื่ออื่น (ยกเว้นสินเชื่อที่ให้แก่สถาบันการเงิน) ที่มีอายุคงเหลือ (residual maturity) ตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป ซึ่งได้รับน้ำหนักความเสี่ยง 35% หรือต่ำกว่าตาม Basel II - SA	31, 41(b), 43(a)											
143	ปราศจากการผูกพัน								0.65				
144	ติดการผูกพัน :												
145	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน								0.65				
146	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี								0.65				
147	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี								1.00				
148	(13) สินเชื่อที่ให้แก่รายย่อย (retail) และธุรกิจขนาดเล็ก (small business customers) (ยกเว้นสินเชื่อเพื่อที่อยู่อาศัย ตามที่ได้อธิบายในข้อ 11) ที่มีอายุคงเหลือ (residual maturity) ต่ำกว่า 1 ปี	31, 40(e), 43(a)											
149	ปราศจากการผูกพัน						0.50	0.50					
150	ติดการผูกพัน :												
151	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน < 6 เดือน						0.50	0.50					
152	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 6 เดือน ถึง < 1 ปี						0.50	0.50					
153	ระยะเวลาคงเหลือของการติดการผูกพัน ≥ 1 ปี						1.00	1.00					

204	(20.5) Initial margin ที่วางไว้กับผู้สัญญาทั้งสิ้น																		
205	(20.5.1) ส่วนที่วางไว้สำหรับ position ของ ธพ. เอง (initial margin posted on bank's own positions)	42(a)																	
206	(20.5.1.1) ส่วนที่วางไว้เป็นเงินสด																		
207	(20.5.1.2) ส่วนที่วางไว้เป็นสินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1																		
208	(20.5.1.3) ส่วนที่วางไว้เป็นสินทรัพย์อื่นที่ไม่ใช่สินทรัพย์สภาพคล่องชั้นที่ 1																		
209	(20.5.2) ส่วนของ Initial margin ที่วางไว้ในนามของลูกค้า (initial margin posted on behalf of a customer)	See FN 18																	
210	Check: sum of row 206 to row 209 = row 204																		Pass
211	(20.5.3) Initial margin ที่วางไว้ในนามของ ธพ. เอง (รวมหลักประกันทุกประเภท) แยกตามอายุคงเหลือของธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกี่ยวข้อง																		
212	Check: sum of row 211 = sum of rows 206 to 208																		Pass
213	(20.5.4) Initial margin ที่วางไว้ในนามของ ธพ. เอง (รวมหลักประกันทุกประเภท) ที่วางไว้กับผู้สัญญาที่ได้รับขบวนการปฏิบัติตามข้อกำหนดด้านหลักประกันของ BCBS-IOSCO																		
214	(20.5.4.1) ส่วนของนิติบุคคลอื่นที่ไม่ใช่สถาบันการเงินซึ่งไม่มีความสำคัญในเชิงระบบ (non-financial entities that are not systemically important)																		
215	(20.5.4.2) ส่วนของรัฐบาล ธนาคารกลาง ธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (MDBs) หรือธนาคารเพื่อการชำระหนี้ระหว่างประเทศ (BIS)																		
216	Check: Sum of rows 206 to 208 \geq sum of rows 214 to 215																		Pass
217	(20.6) เงินสดหรือสินทรัพย์อื่นที่วางไว้สำหรับกองทุนคินด์ชำระราคา (default fund) ที่สำนักหักบัญชีกลาง (CCP)	42(a)																	
218	(20.7) ความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคงจากหลักประกันชั้นต้นที่วางไว้และเงินสดหรือสินทรัพย์อื่นที่วางไว้สำหรับกองทุนคินด์ชำระราคา (default fund) ที่สำนักหักบัญชีกลาง	42(a)																	0.85
219	(21) รายการหักจากเงินกองทุนตามประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์องค์ประกอบของเงินกองทุนสำหรับ ธพ.	43(c)								1.00		1.00							1.00
220	(22) ลูกหนี้ค้างรับจากการขายหลักทรัพย์ที่อยู่ระหว่างรอการส่งมอบ (Trade date receivables)	36(d)								0.00									
221	(23) Interdependent assets	45								0.00		0.00							0.00
222	Check: interdependent assets in row 221 = interdependent liabilities above in row 64																		Pass
223	(24) สินทรัพย์อื่น นอกเหนือจากรายการข้างต้น ที่ได้รับ RSF 100 %	43(c)								1.00		1.00							1.00

224

225

226

227 หมวด (ข) รายการภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน (off balance sheet)

	Paragraph nr in standards doc	จำนวนที่รายงาน
228		
229	(1) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ ที่ให้แก่อุปสงค์ในการถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ถือ (irrevocable or conditionally revocable liquidity facilities)	
230	(2) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ ที่ให้แก่อุปสงค์อื่น (irrevocable or conditionally revocable credit facilities)	
231	(3) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งสามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข ที่ให้แก่อุปสงค์ในการถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ถือ (unconditionally revocable liquidity facilities)	
232	(4) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งสามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข ที่ให้แก่อุปสงค์อื่น (unconditionally revocable credit facilities)	
233	(5) ธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับบริการทางการเงินเพื่อการค้า (trade finance-related obligations)	
234	(6) การค้ำประกัน รัฐบาล ออวัล และเช็คเตอร์ออฟเครดิตที่ไม่เกี่ยวข้องกับบริการทางการเงินเพื่อการค้า (guarantees and letters of credit unrelated to trade finance obligations)	
235	(7) ภาระผูกพันที่ไม่มีสัญญาผูกมัด	
236	(7.1) การรับซื้อคืนตราสารหนี้ (debt-buy back requests)	
237	(7.2) ธุรกรรมซับซ้อน (structured products) ที่ผู้ถือคาดหวังว่ามีตลาดรองรับ	
238	(7.3) การให้ความช่วยเหลือกองทุน (managed funds) ที่บริหารโดยบริษัทในกลุ่มธุรกิจการเงิน	
239	(7.4) ภาระผูกพันที่ไม่มีสัญญาอื่น	
240	(8) รายการนอกงบแสดงฐานะการเงินอื่นนอกเหนือจากข้อ (1) - (7)	

ค่าแปลงสภาพ (RSF Factor)
0.05
0.05
0.00
0.00
0.005
0.01
0.10
0.10
0.05
1.00
1.00

			ปริมาณความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง

Total RSF

Net stable funding ratio

242

243

คำอธิบายรายการสำหรับแบบรายงานอัตราส่วนที่มาและใช้ไปของแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Net Stable Funding Ratio – NSFR)

สำหรับบางรายการที่ ธปท. มีรายละเอียดการรายงานเพิ่มเติม

ส่วนที่ 1 : แหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Available Stable Funding)

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
	หมวด (ก) รายการหนี้สิน และส่วนของผู้ถือหุ้นในงบแสดงฐานะการเงิน	
7	(2) เงินกองทุนอื่นนอกเหนือจากรายการข้างต้นที่มีอายุคงเหลือ (Effective residual maturity) ตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป	เช่น เงินกองทุนที่มีคุณสมบัติไม่ครบตามหลักเกณฑ์ Basel III และต้องทยอยลดนับเป็นเงินกองทุน ซึ่งยังมีได้รายงานในข้อ (1) เงินกองทุนชั้นที่ 1 และเงินกองทุนชั้นที่ 2 ตามประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนสำหรับธนาคารพาณิชย์ ก่อนรายการหักทั้งสิ้นจากเงินกองทุน ทั้งนี้ ไม่รวมถึงเงินกองทุนชั้นที่ 2 ที่มีอายุคงเหลือ (Residual maturity) ต่ำกว่า 1 ปี
8	(3) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากรายย่อย (Retail) และธุรกิจขนาดเล็ก (Small business customers) ที่เข้าข่ายเป็นเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีความมั่นคง (Stable deposits)	เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากรายย่อย (Retail) และธุรกิจขนาดเล็ก (Small business customers) ซึ่งได้รับอัตราดอกเบี้ย 5% หรือต่ำกว่า ตามประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (Liquidity Coverage Ratio: LCR)
9	(4) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากรายย่อย (Retail) และธุรกิจขนาดเล็ก (Small business customers) ที่เข้าข่ายเป็นเงินรับฝากและเงินกู้ยืมที่มีความมั่นคงรองลงมา (Less stable deposits)	เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากรายย่อย (Retail) และธุรกิจขนาดเล็ก (Small business customers) ซึ่งได้รับอัตราดอกเบี้ยสูงกว่า 5% ตามประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อรองรับสถานการณ์ด้านสภาพคล่องที่มีความรุนแรง (Liquidity Coverage Ratio: LCR)

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
30	(9) ตราสารหนี้ที่ไม่มีหลักประกัน (Unsecured debt issuance)	แยกรายการตราสารหนี้ที่ไม่มีหลักประกันออกจากหนี้สินอื่นและส่วนของผู้ถือหุ้นอื่น เพื่อประโยชน์ในการวิเคราะห์ข้อมูล
60	(12) หนี้สินอื่นและส่วนของผู้ถือหุ้นอื่น	
64	(12.4) Interdependent liabilities	เช่น เงินกู้ยืมจากโครงการสินเชื่อ Soft loan ของธนาคารแห่งประเทศไทย เงินกู้ยืมเพื่อทำหน้าที่ส่งผ่านเงินระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจการเงินเดียวกัน ¹ หรือธุรกรรมอื่นที่เข้าเงื่อนไขที่กำหนด

ส่วนที่ 2 : ความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Required Stable Funding)

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
	หมวด (ก) รายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน	
74	(1) - (2) เฉพาะส่วนของเงินสำรองที่ธนาคารกลางที่ ธพ. ต้องดำรงตามกฎหมาย	กรณีประเทศไทย ให้รายงานเงินฝากกระแสรายวัน ตามที่ได้รายงานในข้อ (2) เงินฝากและเงินสำรองที่ธนาคารกลาง และ/หรือเงินสดที่ศูนย์เงินสดกลาง ตามที่ได้รายงานในข้อ (1) เงินสด เฉพาะส่วนที่ต้องดำรงตามกฎหมายสำหรับปัจจุบัน
118	(8) สินเชื่อที่ให้แก่ธุรกิจเอกชน (Non-financial corporates) ซึ่งมีอายุคงเหลือ (Residual maturity) ต่ำกว่า 1 ปี	ให้รวมถึง สินเชื่อที่ให้แก่คู่สัญญาที่เป็นนิติบุคคลอื่นด้วย ²

¹ บริษัทในกลุ่มธุรกิจการเงินเดียวกัน ให้รวมถึงสำนักงานใหญ่และสาขาอื่น บริษัทแม่ บริษัทร่วม และบริษัทลูก ทั้งที่อยู่ในประเทศไทยและต่างประเทศ

² สำหรับแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (ASF) เงินรับฝากและเงินกู้ยืมจากนิติบุคคลอื่น ให้รายงานรวมกับคู่สัญญาที่เป็นสถาบันการเงิน สำหรับความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (RSF) สินเชื่อที่ให้แก่นิติบุคคลอื่น ให้รายงานรวมกับคู่สัญญาที่เป็นธุรกิจเอกชน (Non-financial corporates)

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
221	(23) Interdependent assets	เช่น เงินให้สินเชื่อตามโครงการสินเชื่อ Soft loan ของธนาคารแห่งประเทศไทย เงินให้สินเชื่อเพื่อทำหน้าที่ส่งผ่านเงินระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจการเงินเดียวกัน หรือธุรกรรมอื่นที่เข้าเงื่อนไขที่กำหนด
หมวด (ข) รายการภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน (Off balance sheet)		
229	(1) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ ที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออก (Irrevocable or conditionally revocable liquidity facilities)	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Irrevocable facilities) หรือวงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities) ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายใน <u>ระยะเวลา 1 ปี</u>
231	(3) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งสามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข ที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออก (Unconditionally revocable liquidity facilities)	วงเงินที่ ธพ. อนุมัติให้แก่ลูกค้า และ ธพ. สามารถยกเลิกวงเงินดังกล่าวได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line) เฉพาะส่วนที่ลูกค้ายังไม่ได้เบิกใช้ ซึ่ง ธพ. อนุมัติให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities) ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนดภายใน <u>ระยะเวลา 1 ปี</u>
235	(7) ภาระผูกพันที่ไม่มีสัญญาผูกมัด	
236	(7.1) การรับซื้อคืนตราสารหนี้ (Debt-buy back requests)	ตราสารหนี้ที่ ธพ. หรือบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. เป็นผู้ออกซึ่งมีอายุครบกำหนดชำระเกินกว่า <u>1 ปี</u> แต่ ธพ. อาจต้องจ่ายชำระเงินออกไปเพื่อการไถ่ถอนตราสารดังกล่าวเนื่องจากผู้ถือคาดหวังว่ามีตลาดรองรับ หรือ ธพ. อาจถูกคาดหวังในการเป็นผู้ให้ความช่วยเหลือด้านสภาพคล่องแก่บริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่เป็นผู้ออกตราสาร ทั้งนี้ ให้รวมเฉพาะตราสารหนี้ที่ไม่ได้นับเป็นเงินกองทุน ณ วันที่รายงาน

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
237	(7.2) ธุรกรรมซับซ้อน (Structured products) ที่ผู้ถือคาดหวังว่ามีตลาดรองรับ	ธุรกรรมซับซ้อนที่ ธพ. หรือบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินของ ธพ. เป็นผู้ออกซึ่งมีอายุครบกำหนดชำระเกินกว่า 1 ปี แต่ ธพ. อาจต้องจ่ายชำระเงินออกไปเพื่อการไถ่ถอนตราสารดังกล่าวเนื่องจากผู้ถือคาดหวังว่ามีตลาดรองรับ หรือ ธพ. อาจถูกคาดหวังในการเป็นผู้ให้ความช่วยเหลือด้านสภาพคล่องแก่บริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่เป็นผู้ออกตราสาร
238	(7.3) การให้ความช่วยเหลือกองทุน (Managed funds) ที่บริหารโดยบริษัทในกลุ่มธุรกิจการเงิน	อ้างอิงแนวทางการรายงาน ตามแบบรายงาน LCR โดยให้ ธพ. พิจารณาปริมาณที่สูงกว่าซึ่งเป็นปริมาณหลังคูณค่าแปลงสภาพระหว่าง (1) มูลค่า NAV และ (2) ปริมาณวงเงิน Committed facilities ที่ ธพ. ให้แก่กองทุน (หลังการหักลบหลักประกัน) โดย หาก (1) > (2) ให้รายงานปริมาณมูลค่า NAV ทั้งหมด ในข้อนี้ หาก (2) > (1) ให้รายงานปริมาณมูลค่า NAV ทั้งหมด ในข้อนี้ และให้รายงานปริมาณส่วนเกิน (ส่วนที่ (2) > (1)) ใน ส่วนที่ 2 : ความต้องการแหล่งเงินที่มีความมั่นคง (Required Stable Funding) หมวด (ข) รายการภาระผูกพันนอกงบแสดงฐานะการเงิน (Off balance sheet) ข้อ (1) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ ที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออก (Irrevocable or conditionally revocable liquidity facilities) หรือ (2) วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ซึ่งไม่สามารถยกเลิกได้ ที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Irrevocable or conditionally revocable credit facilities) โดยให้รายงานด้วยปริมาณส่วนเกินหารด้วยค่าแปลงสภาพของรายการ Committed facilities

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
1		(รายชื่อ ธพ.)										
2		แบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิตามสัญญา (Contractual liquidity gap) ชุด Solo (รวมทุกสำนักงาน) และรวมบริษัทลูก (Subsidiaries) ที่เป็น ธพ.										
3		วันที่รายงาน (วัน/เดือน/ปี)										
4												
5		ฐานะสกุลเงินบาท										หน่วย : ล้านบาท
6			ทันที	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
7		ส่วนที่ 1 : เงินสดและเงินลงทุน										
8	1.1	เงินสด										-
9	1.2	เงินลงทุนในหลักทรัพย์										-
10	1.2.1	ตราสารหนี้:										-
11	1.2.1.1	ตราสารหนี้ที่ออกหรือกำกับประกันโดยรัฐบาลและธนาคารกลาง										-
12	1.2.1.1 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการอื่นและให้ชื่อหลักทรัพย์ (SBL)										-
13	1.2.1.2	ตราสารหนี้อื่น										-
14	1.2.1.2 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการอื่นและให้ชื่อหลักทรัพย์ (SBL)										-
15	1.2.2	ตราสารทุน และอื่นๆ										-
16	1.3	เงินลงทุนอื่น										-
17		เงินสดและเงินลงทุนทั้งสิ้น										-
18												
19		ส่วนที่ 2 : กระแสเงินสดไหลเข้า										
20	2.1	เงินฝาก เงินให้สินเชื่อ และเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
21	2.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
22	2.1.1.1	เงินฝาก										-
23	2.1.1.2	เงินให้สินเชื่อ										-
24	2.1.1.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
25	2.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
26	2.1.2.1	เงินฝาก										-
27	2.1.2.2	เงินให้สินเชื่อ										-
28	2.1.2.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
29	2.1.2.1 - 2.1.2.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
30	2.1.3	สัญญาอื่น:										-
31	2.1.3.1	เงินให้สินเชื่อ										-
32	2.1.3.1 (1)	สินเชื่อแบบหมุนเวียน										-
33	2.1.3.1 (2)	สินเชื่อแบบไม่หมุนเวียน:										-
34	2.1.3.1 (2) / 1	เฉพาะส่วนที่เป็นสัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง										-
35	2.1.3.2	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
36	2.1.1 - 2.1.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นผู้มีเงินที่ผูกประเทศ:										-
37	2.1.1 - 2.1.3 (1)	เงินฝาก										-
38	2.1.1 - 2.1.3 (2)	เงินให้สินเชื่อ										-
39	2.1.1 - 2.1.3 (3)	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
40	2.2	สินทรัพย์อื่น:										-
41	2.2.1	เฉพาะส่วนที่เป็นลูกหนี้มีารอื่น และลูกหนี้อื่น										-
42	2.3	ธุรกรรมอนุพันธ์										-
43	2.3.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
44	2.3.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
45	2.3.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
46	2.3.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
47	2.3.1 - 2.3.2	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นผู้มีเงินที่ผูกประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
48	2.3.1 - 2.3.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
49	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
50	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
51	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
52	2.3.1 - 2.3.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
53		ฐานะผูกเงินบาท (ต่อ)		ทันที	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
54	2.4	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้											-
55	2.4.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)											-
56	2.4.2	วงเงินที่หักถ่วงกันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):											-
57	2.4.2.1	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)											-
58	2.4.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)											-
59		กระแสเงินสดรับทั้งสิ้น											-
60													
61		ส่วนที่ 3: กระแสเงินสดไหลออก											
62	3.1	เงินรับฝาก เงินกู้ยืม และเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)											-
63	3.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:											-
64	3.1.1.1	เงินรับฝาก											-
65	3.1.1.2	เงินกู้ยืม											-
66	3.1.1.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)											-
67	3.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:											-
68	3.1.2.1	เงินรับฝาก											-
69	3.1.2.2	เงินกู้ยืม											-
70	3.1.2.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)											-
71	3.1.2.1 - 3.1.2.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย											-
72	3.1.3	ผู้สัญญาอื่น:											-
73	3.1.3.1	เงินรับฝาก											-
74	3.1.3.2	เงินกู้ยืม											-
75	3.1.3.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)											-
76	3.1.1 - 3.1.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ:											-
77	3.1.1 - 3.1.3 (1)	เงินรับฝาก											-
78	3.1.1 - 3.1.3 (2)	เงินกู้ยืม											-
79	3.1.1 - 3.1.3 (3)	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)											-
80	3.2	ตราสารหนี้ที่ออก:											-
81	3.2.1	เฉพาะส่วนที่เสนอขายในต่างประเทศ											-
82	3.3	หนี้สินอื่น:											-
83	3.3.1	เฉพาะส่วนที่เป็นเจ้าหนี้มาร์จิ้น และเจ้าหนี้อื่น											-
84	3.4	ธุรกรรมอนุพันธ์											-
85	3.4.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:											-
86	3.4.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ											-
87	3.4.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:											-
88	3.4.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ											-
89	3.4.1 - 3.4.2	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ											-
90	3.4.1 - 3.4.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:											-
91	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures											-
92	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 2	สัญญา Swap											-
93	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap											-
94	3.4.1 - 3.4.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น											-
95													
96	3.5	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้											-
97	3.5.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)											-
98	3.5.2	วงเงินที่หักถ่วงกันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):											-
99	3.5.2.1	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)											-
100	3.5.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)											-
101	3.6	ภาวะผูกพันอื่นๆ											-
102		กระแสเงินสดจ่ายทั้งสิ้น											-
103													
104		รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											-
105		รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สะสมสุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											fail
106		ฐานะสภาพคล่องสุทธิ											-
107		ฐานะสภาพคล่องสะสมสุทธิ											fail

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
108	ฐานะรวมทุกสกุลเงินตราต่างประเทศ											
109												หน่วย : ล้านบาท
110			ทันที	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
111	ส่วนที่ 1 : เงินสดและเงินลงทุน											
112	1.1	เงินสด										-
113	1.2	เงินลงทุนในหลักทรัพย์										-
114	1.2.1	ตราสารหนี้:										-
115	1.2.1.1	ตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลและธนาคารกลาง										-
116	1.2.1.1 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนค้ำประกันสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนค้ำประกันสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการขึ้นและให้อิมหลักทรัพย์ (SBL)										-
117	1.2.1.2	ตราสารหนี้อื่น										-
118	1.2.1.2 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนค้ำประกันสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนค้ำประกันสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการขึ้นและให้อิมหลักทรัพย์ (SBL)										-
119	1.2.2	ตราสารทุน และอื่นๆ										-
120	1.3	เงินลงทุนอื่น										-
121	เงินสดและเงินลงทุนทั้งสิ้น											-
122	ส่วนที่ 2 : กระแสเงินสดไหลเข้า											
123	2.1	เงินฝาก เงินให้สินเชื่อ และเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
124	2.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
125	2.1.1.1	เงินฝาก										-
126	2.1.1.2	เงินให้สินเชื่อ										-
127	2.1.1.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
128	2.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
129	2.1.2.1	เงินฝาก										-
130	2.1.2.2	เงินให้สินเชื่อ										-
131	2.1.2.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
132	2.1.2.1 - 2.1.2.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
133	2.1.3	สัญญาอื่น:										-
134	2.1.3.1	เงินให้สินเชื่อ										-
135	2.1.3.1 (1)	สินเชื่อแบบหมุนเวียน										-
136	2.1.3.1 (2)	สินเชื่อแบบไม่หมุนเวียน:										-
137	2.1.3.1 (2) / 1	เฉพาะส่วนที่เป็นสัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง										-
138	2.1.3.2	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
139	2.1.1 - 2.1.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นคู่สัญญาที่อยู่นอกประเทศ:										-
140	2.1.1 - 2.1.3 (1)	เงินฝาก										-
141	2.1.1 - 2.1.3 (2)	เงินให้สินเชื่อ										-
142	2.1.1 - 2.1.3 (3)	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
143	2.2	สินทรัพย์อื่น:										-
144	2.2.1	เฉพาะส่วนที่เป็นลูกหนี้มีประกัน และลูกหนี้อื่น										-
145	2.3	ธุรกรรมอนุพันธ์										-
146	2.3.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
147	2.3.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
148	2.3.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
149	2.3.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
150	2.3.1 - 2.3.2	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นคู่สัญญาที่อยู่นอกประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
151	2.3.1 - 2.3.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
152	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
153	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
154	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
155	2.3.1 - 2.3.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
			ทันที	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
157	ฐานะรวมทุกกลุ่มเงินตราต่างประเทศ (ต่อ)											
158	2.4	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
159	2.4.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
160	2.4.2	วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
161	2.4.2.1	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
162	2.4.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
163	กระแสเงินสดรับทั้งสิ้น											-
164												-
165	ส่วนที่ 3: กระแสเงินสดไหลออก											-
166	3.1	เงินรับฝาก เงินกู้ยืม และเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
167	3.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
168	3.1.1.1	เงินรับฝาก										-
169	3.1.1.2	เงินกู้ยืม										-
170	3.1.1.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
171	3.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
172	3.1.2.1	เงินรับฝาก										-
173	3.1.2.2	เงินกู้ยืม										-
174	3.1.2.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
175	3.1.2.1 - 3.1.2.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
176	3.1.3	ผู้สัญญาอื่น:										-
177	3.1.3.1	เงินรับฝาก										-
178	3.1.3.2	เงินกู้ยืม										-
179	3.1.3.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
180	3.1.1 - 3.1.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ:										-
181	3.1.1 - 3.1.3 (1)	เงินรับฝาก										-
182	3.1.1 - 3.1.3 (2)	เงินกู้ยืม										-
183	3.1.1 - 3.1.3 (3)	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
184	3.2	ตราสารหนี้ที่ออก:										-
185	3.2.1	เฉพาะส่วนที่เสนอขายในต่างประเทศ										-
186	3.3	หนี้สินอื่น:										-
187	3.3.1	เฉพาะส่วนที่เป็นเจ้าหนี้มาร์จิ้น และเจ้าหนี้อื่น										-
188	3.4	ธุรกรรมอนุพันธ์:										-
189	3.4.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
190	3.4.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
191	3.4.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
192	3.4.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
193	3.4.1 - 3.4.2	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
194	3.4.1 - 3.4.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
195	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
196	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
197	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
198	3.4.1 - 3.4.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-
199												-
200	3.5	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
201	3.5.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
202	3.5.2	วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
203	3.5.2.1	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
204	3.5.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
205	3.6	ภาระผูกพันอื่นๆ										-
206	กระแสเงินสดจ่ายทั้งสิ้น											-
207												-
208	รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											-
209	รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สะสมสุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											fail
210	ฐานะสภาพคล่องสุทธิ											-
211	ฐานะสภาพคล่องสะสมสุทธิ											fail

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
1	(รายชื่อ ธพ.)											
2	แบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิตามสัญญา (Contractual Liquidity Gap) ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ											
3	วันที่รายงาน (วัน/เดือน/ปี)											
4												หน่วย : ล้านบาท
5	ฐานะสกุลเงินบาท											
6												วันที่
7												วันที่ 2 - 7
8												8 วัน - 1 เดือน
9												> 1 - 3 เดือน
10												> 3 - 6 เดือน
11												> 6 เดือน - 1 ปี
12												> 1 - 5 ปี
13												มากกว่า 5 ปี
14												Unallocated
15												Total
16	ส่วนที่ 1 : เงินสดและเงินลงทุน											
17	1.1	เงินสด										-
18	1.2	เงินลงทุนในหลักทรัพย์										-
19	1.2.1	ตราสารหนี้:										-
20	1.2.1.1	ตราสารหนี้ที่ออกหรือกำกับโดยรัฐบาลและธนาคารกลาง										-
21	1.2.1.1 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการอื่นและให้ชื่อหลักทรัพย์ (SBL)										-
22	1.2.1.2	ตราสารหนี้อื่น										-
23	1.2.1.2 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการอื่นและให้ชื่อหลักทรัพย์ (SBL)										-
24	1.2.2	ตราสารทุน และอื่นๆ										-
25	1.3	เงินลงทุนอื่น										-
26	เงินสดและเงินลงทุนทั้งสิ้น											
27	ส่วนที่ 2 : กระแสเงินสดไหลเข้า											
28	2.1	เงินฝาก เงินให้สินเชื่อ และเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
29	2.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
30	2.1.1.1	เงินฝาก										-
31	2.1.1.2	เงินให้สินเชื่อ										-
32	2.1.1.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
33	2.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
34	2.1.2.1	เงินฝาก										-
35	2.1.2.2	เงินให้สินเชื่อ										-
36	2.1.2.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
37	2.1.2.1 - 2.1.2.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
38	2.1.3	สัญญาอื่น:										-
39	2.1.3.1	เงินให้สินเชื่อ										-
40	2.1.3.1 (1)	สินเชื่อแบบหมุนเวียน										-
41	2.1.3.1 (2)	สินเชื่อแบบไม่หมุนเวียน:										-
42	2.1.3.1 (2) / 1	เฉพาะส่วนที่เป็นสัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง										-
43	2.1.3.2	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
44	2.1.1 - 2.1.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นผู้มีเงินที่อยู่นอกประเทศ:										-
45	2.1.1 - 2.1.3 (1)	เงินฝาก										-
46	2.1.1 - 2.1.3 (2)	เงินให้สินเชื่อ										-
47	2.1.1 - 2.1.3 (3)	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
48	2.2	สินทรัพย์อื่น:										-
49	2.2.1	เฉพาะส่วนที่เป็นลูกหนี้มีารเงิน และลูกหนี้อื่น										-
50	2.3	ธุรกรรมอนุพันธ์										-
51	2.3.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
52	2.3.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
53	2.3.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
54	2.3.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
55	2.3.1 - 2.3.2	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นผู้มีเงินที่อยู่นอกประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
56	2.3.1 - 2.3.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
57	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
58	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
59	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
60	2.3.1 - 2.3.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
53	ฐานะสภาพคล่อง (ต่อ)		ทันที	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
54	2.4	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
55	2.4.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
56	2.4.2	วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
57	2.4.2.1	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
58	2.4.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
59	กระแสเงินสดทั้งสิ้น											-
60												
61	ส่วนที่ 3 : กระแสเงินสดไหลออก											
62	3.1	เงินรับฝาก เงินกู้ยืม และเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
63	3.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
64	3.1.1.1	เงินรับฝาก										-
65	3.1.1.2	เงินกู้ยืม										-
66	3.1.1.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
67	3.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
68	3.1.2.1	เงินรับฝาก										-
69	3.1.2.2	เงินกู้ยืม										-
70	3.1.2.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
71	3.1.2.1 - 3.1.2.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
72	3.1.3	ผู้สัญญาอื่น:										-
73	3.1.3.1	เงินรับฝาก										-
74	3.1.3.2	เงินกู้ยืม										-
75	3.1.3.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
76	3.1.1 - 3.1.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ:										-
77	3.1.1 - 3.1.3 (1)	เงินรับฝาก										-
78	3.1.1 - 3.1.3 (2)	เงินกู้ยืม										-
79	3.1.1 - 3.1.3 (3)	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
80	3.2	ตราสารหนี้ที่ออก:										-
81	3.2.1	เฉพาะส่วนที่เสนอขายในต่างประเทศ										-
82	3.3	หนี้สินอื่น:										-
83	3.3.1	เฉพาะส่วนที่เป็นเจ้าหนี้มาร์จิ้น และเจ้าหนี้อื่น										-
84	3.4	ธุรกรรมอนุพันธ์:										-
85	3.4.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
86	3.4.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
87	3.4.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
88	3.4.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
89	3.4.1 - 3.4.2	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
90	3.4.1 - 3.4.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
91	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
92	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
93	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
94	3.4.1 - 3.4.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-
95												
96	3.5	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
97	3.5.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
98	3.5.2	วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
99	3.5.2.1	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
100	3.5.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
101	3.6	ภาวะผูกพันอื่นๆ										-
102	กระแสเงินสดทั้งสิ้น											-
103												
104	รวมกระแสเงินสด (จ่าย) สุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											-
105	รวมกระแสเงินสด (จ่าย) สะสมสุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											fail
106	ฐานะสภาพคล่องสุทธิ											-
107	ฐานะสภาพคล่องสะสมสุทธิ											fail

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M									
108																					
109	ฐานะรวมทุกสกุลเงินตราต่างประเทศ											หน่วย : ล้านบาท									
110												วันที่	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
111	ส่วนที่ 1 : เงินสดและเงินลงทุน																				
112	1.1	เงินสด																			
113	1.2	เงินลงทุนในหลักทรัพย์																			
114	1.2.1	ตราสารหนี้:																			
115	1.2.1.1	ตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลและธนาคารกลาง																			
116	1.2.1.1 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการขึ้นและให้อิมหลักทรัพย์ (SBL)																			
117	1.2.1.2	ตราสารหนี้อื่น																			
118	1.2.1.2 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการขึ้นและให้อิมหลักทรัพย์ (SBL)																			
119	1.2.2	ตราสารทุน และอื่นๆ																			
120	1.3	เงินลงทุนอื่น																			
121	เงินสดและเงินลงทุนทั้งสิ้น																				
122	ส่วนที่ 2 : กระแสเงินสดไหลเข้า																				
123	2.1	เงินฝาก เงินให้สินเชื่อ และเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)																			
124	2.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:																			
125	2.1.1.1	เงินฝาก																			
126	2.1.1.2	เงินให้สินเชื่อ																			
127	2.1.1.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)																			
128	2.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:																			
129	2.1.2.1	เงินฝาก																			
130	2.1.2.2	เงินให้สินเชื่อ																			
131	2.1.2.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)																			
132	2.1.2.1 - 2.1.2.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย																			
133	2.1.3	สัญญาอื่น:																			
134	2.1.3.1	เงินให้สินเชื่อ																			
135	2.1.3.1 (1)	สินเชื่อแบบหมุนเวียน																			
136	2.1.3.1 (2)	สินเชื่อแบบไม่หมุนเวียน:																			
137	2.1.3.1 (2) / 1	เฉพาะส่วนที่เป็นสัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง																			
138	2.1.3.2	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)																			
139	2.1.1 - 2.1.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นคู่สัญญาที่อยู่นอกประเทศ:																			
140	2.1.1 - 2.1.3 (1)	เงินฝาก																			
141	2.1.1 - 2.1.3 (2)	เงินให้สินเชื่อ																			
142	2.1.1 - 2.1.3 (3)	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)																			
143	2.2	สินทรัพย์อื่น:																			
144	2.2.1	เฉพาะส่วนที่เป็นลูกหนี้มีประกัน และลูกหนี้อื่น																			
145	2.3	ธุรกรรมอนุพันธ์																			
146	2.3.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:																			
147	2.3.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ																			
148	2.3.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:																			
149	2.3.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ																			
150	2.3.1 - 2.3.2	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นคู่สัญญาที่อยู่นอกประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ																			
151	2.3.1 - 2.3.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:																			
152	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures																			
153	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 2	สัญญา Swap																			
154	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap																			
155	2.3.1 - 2.3.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น																			
156																					

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
			ทันที	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
157	ฐานะรวมทุกกลุ่มเงินตราต่างประเทศ (ต่อ)											
158	2.4	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
159	2.4.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
160	2.4.2	วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
161	2.4.2.1	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
162	2.4.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
163	กระแสเงินสดรับทั้งสิ้น											-
164												-
165	ส่วนที่ 3: กระแสเงินสดไหลออก											-
166	3.1	เงินรับฝาก เงินกู้ยืม และเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
167	3.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
168	3.1.1.1	เงินรับฝาก										-
169	3.1.1.2	เงินกู้ยืม										-
170	3.1.1.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
171	3.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
172	3.1.2.1	เงินรับฝาก										-
173	3.1.2.2	เงินกู้ยืม										-
174	3.1.2.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
175	3.1.2.1 - 3.1.2.3	เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
176	3.1.3	คู่สัญญาอื่น:										-
177	3.1.3.1	เงินรับฝาก										-
178	3.1.3.2	เงินกู้ยืม										-
179	3.1.3.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
180	3.1.1 - 3.1.3	เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ:										-
181	3.1.1 - 3.1.3 (1)	เงินรับฝาก										-
182	3.1.1 - 3.1.3 (2)	เงินกู้ยืม										-
183	3.1.1 - 3.1.3 (3)	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
184	3.2	ตราสารหนี้ที่ออก:										-
185	3.2.1	เฉพาะส่วนที่เสนอขายในต่างประเทศ										-
186	3.3	หนี้สินอื่น:										-
187	3.3.1	เฉพาะส่วนที่เป็นเจ้าหนี้มาร์จิ้น และเจ้าหนี้อื่น										-
188	3.4	ธุรกรรมอนุพันธ์:										-
189	3.4.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
190	3.4.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
191	3.4.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
192	3.4.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
193	3.4.1 - 3.4.2	เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
194	3.4.1 - 3.4.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
195	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
196	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
197	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
198	3.4.1 - 3.4.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-
199												-
200	3.5	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
201	3.5.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
202	3.5.2	วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
203	3.5.2.1	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
204	3.5.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
205	3.6	ภาระผูกพันอื่นๆ										-
206	กระแสเงินสดจ่ายทั้งสิ้น											-
207												-
208	รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											-
209	รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สะสมสุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											fail
210	ฐานะสภาพคล่องสุทธิ											-
211	ฐานะสภาพคล่องสะสมสุทธิ											fail

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
1		(รายชื่อ ธพ.)										
2		แบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิตามพฤติกรรม (Behavioural Liquidity Gap) ชุด Solo (รวมทุกสำนักงาน) และรวมบริษัทลูก (Subsidiaries) ที่เป็น ธพ.										
3		วันที่รายงาน (วัน/เดือน/ปี)										
4												
5		ฐานะสกุลเงินบาท										หน่วย : ล้านบาท
6												
7		ส่วนที่ 1 : เงินสดและเงินลงทุน										
8	1.1	เงินสด										-
9	1.2	เงินลงทุนในหลักทรัพย์										-
10	1.2.1	ตราสารหนี้:										-
11	1.2.1.1	ตราสารหนี้ที่ออกหรือกำกับโดยรัฐบาลและธนาคารกลาง										-
12	1.2.1.1 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการอื่นและให้ชื่อหลักทรัพย์ (SBL)										-
13	1.2.1.2	ตราสารหนี้อื่น										-
14	1.2.1.2 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการอื่นและให้ชื่อหลักทรัพย์ (SBL)										-
15	1.2.2	ตราสารทุน และอื่นๆ										-
16	1.3	เงินลงทุนอื่น										-
17		เงินสดและเงินลงทุนทั้งสิ้น										-
18												
19		ส่วนที่ 2 : กระแสเงินสดไหลเข้า										
20	2.1	เงินฝาก เงินให้สินเชื่อ และเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
21	2.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
22	2.1.1.1	เงินฝาก										-
23	2.1.1.2	เงินให้สินเชื่อ										-
24	2.1.1.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
25	2.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
26	2.1.2.1	เงินฝาก										-
27	2.1.2.2	เงินให้สินเชื่อ										-
28	2.1.2.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
29	2.1.2.1 - 2.1.2.3	เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
30	2.1.3	คู่สัญญาอื่น:										-
31	2.1.3.1	เงินให้สินเชื่อ										-
32	2.1.3.1 (1)	สินเชื่อแบบหมุนเวียน										-
33	2.1.3.1 (2)	สินเชื่อแบบไม่หมุนเวียน:										-
34	2.1.3.1 (2) / 1	เฉพาะส่วนที่เป็นคู่สัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง										-
35	2.1.3.2	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
36	2.1.1 - 2.1.3	เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ:										-
37	2.1.1 - 2.1.3 (1)	เงินฝาก										-
38	2.1.1 - 2.1.3 (2)	เงินให้สินเชื่อ										-
39	2.1.1 - 2.1.3 (3)	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
40	2.2	สินทรัพย์อื่น:										-
41	2.2.1	เฉพาะส่วนที่เป็นลูกหนี้มีารเงิน และลูกหนี้อื่น										-
42	2.3	ธุรกรรมอนุพันธ์										-
43	2.3.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
44	2.3.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
45	2.3.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
46	2.3.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
47	2.3.1 - 2.3.2	เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
48	2.3.1 - 2.3.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
49	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
50	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
51	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
52	2.3.1 - 2.3.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
53		ฐานะผูกเงินบาท (ต่อ)		ทันที	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
54	2.4	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้											-
55	2.4.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)											-
56	2.4.2	วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):											-
57	2.4.2.1	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)											-
58	2.4.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)											-
59	กระแสเงินสดทั้งสิ้น												-
60													
61	ส่วนที่ 3: กระแสเงินสดไหลออก												
62	3.1	เงินรับฝาก เงินกู้ยืม และเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)											-
63	3.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:											-
64	3.1.1.1	เงินรับฝาก											-
65	3.1.1.2	เงินกู้ยืม											-
66	3.1.1.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)											-
67	3.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:											-
68	3.1.2.1	เงินรับฝาก											-
69	3.1.2.2	เงินกู้ยืม											-
70	3.1.2.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)											-
71	3.1.2.1 - 3.1.2.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย											-
72	3.1.3	ผู้สัญญาอื่น:											-
73	3.1.3.1	เงินรับฝาก											-
74	3.1.3.2	เงินกู้ยืม											-
75	3.1.3.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)											-
76	3.1.1 - 3.1.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ:											-
77	3.1.1 - 3.1.3 (1)	เงินรับฝาก											-
78	3.1.1 - 3.1.3 (2)	เงินกู้ยืม											-
79	3.1.1 - 3.1.3 (3)	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)											-
80	3.2	ตราสารหนี้ที่ออก:											-
81	3.2.1	เฉพาะส่วนที่เสนอขายในต่างประเทศ											-
82	3.3	หนี้สินอื่น:											-
83	3.3.1	เฉพาะส่วนที่เป็นเจ้าหนี้มาร์จิ้น และเจ้าหนี้อื่น											-
84	3.4	ธุรกรรมอนุพันธ์:											-
85	3.4.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:											-
86	3.4.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ											-
87	3.4.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:											-
88	3.4.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ											-
89	3.4.1 - 3.4.2	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ											-
90	3.4.1 - 3.4.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:											-
91	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures											-
92	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 2	สัญญา Swap											-
93	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap											-
94	3.4.1 - 3.4.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น											-
95													
96	3.5	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้											-
97	3.5.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)											-
98	3.5.2	วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):											-
99	3.5.2.1	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)											-
100	3.5.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)											-
101	3.6	ภาวะผูกพันอื่นๆ											-
102	กระแสเงินสดทั้งสิ้น												-
103													
104	รวมกระแสเงินสด (จ่าย) สุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)												-
105	รวมกระแสเงินสด (จ่าย) สะสมสุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)												fail
106	ฐานะสภาพคล่องสุทธิ												-
107	ฐานะสภาพคล่องสะสมสุทธิ												fail

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
108												
109	ฐานะรวมทุกสกุลเงินตราต่างประเทศ											
110												หน่วย : ล้านบาท
111	ส่วนที่ 1 : เงินสดและเงินลงทุน											
112	1.1	เงินสด										-
113	1.2	เงินลงทุนในหลักทรัพย์										-
114	1.2.1	ตราสารหนี้:										-
115	1.2.1.1	ตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลและธนาคารกลาง										-
116	1.2.1.1 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนค้ำสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนค้ำสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการขึ้นและให้อิมหลักทรัพย์ (SBL)										-
117	1.2.1.2	ตราสารหนี้อื่น										-
118	1.2.1.2 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนค้ำสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนค้ำสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการขึ้นและให้อิมหลักทรัพย์ (SBL)										-
119	1.2.2	ตราสารทุน และอื่นๆ										-
120	1.3	เงินลงทุนอื่น										-
121	เงินสดและเงินลงทุนทั้งสิ้น											-
122												
123	ส่วนที่ 2 : กระแสเงินสดไหลเข้า											
124	2.1	เงินฝาก เงินให้สินเชื่อ และเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
125	2.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
126	2.1.1.1	เงินฝาก										-
127	2.1.1.2	เงินให้สินเชื่อ										-
128	2.1.1.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
129	2.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
130	2.1.2.1	เงินฝาก										-
131	2.1.2.2	เงินให้สินเชื่อ										-
132	2.1.2.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
133	2.1.2.1 - 2.1.2.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
134	2.1.3	สัญญาอื่น:										-
135	2.1.3.1	เงินให้สินเชื่อ										-
136	2.1.3.1 (1)	สินเชื่อแบบหมุนเวียน										-
137	2.1.3.1 (2)	สินเชื่อแบบไม่หมุนเวียน:										-
138	2.1.3.1 (2) / 1	เฉพาะส่วนที่เป็นสัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง										-
139	2.1.3.2	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
140	2.1.1 - 2.1.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นผู้ยื่นที่อยู่นอกประเทศ:										-
141	2.1.1 - 2.1.3 (1)	เงินฝาก										-
142	2.1.1 - 2.1.3 (2)	เงินให้สินเชื่อ										-
143	2.1.1 - 2.1.3 (3)	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
144	2.2	สินทรัพย์อื่น:										-
145	2.2.1	เฉพาะส่วนที่เป็นลูกหนี้มีประกัน และลูกหนี้อื่น										-
146	2.3	ธุรกรรมอนุพันธ์										-
147	2.3.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
148	2.3.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
149	2.3.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
150	2.3.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
151	2.3.1 - 2.3.2	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นผู้ยื่นที่อยู่นอกประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
152	2.3.1 - 2.3.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
153	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
154	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
155	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
156	2.3.1 - 2.3.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
			ทันที	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
157	ฐานะรวมทุกสกุลเงินตราต่างประเทศ (ต่อ)											
158	2.4	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
159	2.4.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
160	2.4.2	วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
161	2.4.2.1	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
162	2.4.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
163	กระแสเงินสดรับทั้งสิ้น											-
164												-
165	ส่วนที่ 3: กระแสเงินสดไหลออก											
166	3.1	เงินรับฝาก เงินกู้ยืม และเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
167	3.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
168	3.1.1.1	เงินรับฝาก										-
169	3.1.1.2	เงินกู้ยืม										-
170	3.1.1.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
171	3.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
172	3.1.2.1	เงินรับฝาก										-
173	3.1.2.2	เงินกู้ยืม										-
174	3.1.2.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
175	3.1.2.1 - 3.1.2.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
176	3.1.3	ผู้สัญญาอื่น:										-
177	3.1.3.1	เงินรับฝาก										-
178	3.1.3.2	เงินกู้ยืม										-
179	3.1.3.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
180	3.1.1 - 3.1.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ:										-
181	3.1.1 - 3.1.3 (1)	เงินรับฝาก										-
182	3.1.1 - 3.1.3 (2)	เงินกู้ยืม										-
183	3.1.1 - 3.1.3 (3)	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
184	3.2	ตราสารหนี้ที่ออก:										-
185	3.2.1	เฉพาะส่วนที่เสนอขายในต่างประเทศ										-
186	3.3	หนี้สินอื่น:										-
187	3.3.1	เฉพาะส่วนที่เป็นเจ้าหนี้มาร์จิ้น และเจ้าหนี้อื่น										-
188	3.4	ธุรกรรมอนุพันธ์:										-
189	3.4.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
190	3.4.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
191	3.4.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
192	3.4.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
193	3.4.1 - 3.4.2	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
194	3.4.1 - 3.4.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
195	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
196	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
197	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
198	3.4.1 - 3.4.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-
199												-
200	3.5	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
201	3.5.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
202	3.5.2	วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
203	3.5.2.1	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
204	3.5.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
205	3.6	ภาระผูกพันอื่นๆ										-
206	กระแสเงินสดจ่ายทั้งสิ้น											-
207												-
208	รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											-
209	รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สะสมสุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											fail
210	ฐานะสภาพคล่องสุทธิ											-
211	ฐานะสภาพคล่องสะสมสุทธิ											fail

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
1	(รายชื่อ ธพ.)											
2	แบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิตามพฤติกรรม (Behavioural Liquidity Gap) ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ											
3	วันที่รายงาน (วัน/เดือน/ปี)											
4												หน่วย : ล้านบาท
5	ฐานะสกุลเงินบาท											
6												วันที่
7												วันที่ 2 - 7
8												8 วัน - 1 เดือน
9												> 1 - 3 เดือน
10												> 3 - 6 เดือน
11												> 6 เดือน - 1 ปี
12												> 1 - 5 ปี
13												มากกว่า 5 ปี
14												Unallocated
15												Total
16	ส่วนที่ 1 : เงินสดและเงินลงทุน											
17	1.1	เงินสด										-
18	1.2	เงินลงทุนในหลักทรัพย์										-
19	1.2.1	ตราสารหนี้:										-
20	1.2.1.1	ตราสารหนี้ที่ออกหรือกำกับโดยรัฐบาลและธนาคารกลาง										-
21	1.2.1.1 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการอื่นและให้ชื่อหลักทรัพย์ (SBL)										-
22	1.2.1.2	ตราสารหนี้อื่น										-
23	1.2.1.2 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการอื่นและให้ชื่อหลักทรัพย์ (SBL)										-
24	1.2.2	ตราสารทุน และอื่นๆ										-
25	1.3	เงินลงทุนอื่น										-
26	เงินสดและเงินลงทุนทั้งสิ้น											
27	ส่วนที่ 2 : กระแสเงินสดไหลเข้า											
28	2.1	เงินฝาก เงินให้สินเชื่อ และเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
29	2.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
30	2.1.1.1	เงินฝาก										-
31	2.1.1.2	เงินให้สินเชื่อ										-
32	2.1.1.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
33	2.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
34	2.1.2.1	เงินฝาก										-
35	2.1.2.2	เงินให้สินเชื่อ										-
36	2.1.2.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
37	2.1.2.1 - 2.1.2.3	เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
38	2.1.3	คู่สัญญาอื่น:										-
39	2.1.3.1	เงินให้สินเชื่อ										-
40	2.1.3.1 (1)	สินเชื่อแบบหมุนเวียน										-
41	2.1.3.1 (2)	สินเชื่อแบบไม่หมุนเวียน:										-
42	2.1.3.1 (2) / 1	เฉพาะส่วนที่เป็นคู่สัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง										-
43	2.1.3.2	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
44	2.1.1 - 2.1.3	เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ:										-
45	2.1.1 - 2.1.3 (1)	เงินฝาก										-
46	2.1.1 - 2.1.3 (2)	เงินให้สินเชื่อ										-
47	2.1.1 - 2.1.3 (3)	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
48	2.2	สินทรัพย์อื่น:										-
49	2.2.1	เฉพาะส่วนที่เป็นลูกหนี้มีรายอื่น และลูกหนี้อื่น										-
50	2.3	ธุรกรรมอนุพันธ์										-
51	2.3.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
52	2.3.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
53	2.3.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
54	2.3.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
55	2.3.1 - 2.3.2	เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
56	2.3.1 - 2.3.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
57	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
58	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
59	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
60	2.3.1 - 2.3.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
			ทันที	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
53	ฐานะผูกเงินบาท (ต่อ)											
54	2.4	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
55	2.4.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
56	2.4.2	วงเงินที่หักถ่วงกันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
57	2.4.2.1	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
58	2.4.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
59	กระแสเงินสดรับทั้งสิ้น											-
60												
61	ส่วนที่ 3 : กระแสเงินสดไหลออก											
62	3.1	เงินรับฝาก เงินกู้ยืม และเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
63	3.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
64	3.1.1.1	เงินรับฝาก										-
65	3.1.1.2	เงินกู้ยืม										-
66	3.1.1.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
67	3.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
68	3.1.2.1	เงินรับฝาก										-
69	3.1.2.2	เงินกู้ยืม										-
70	3.1.2.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
71	3.1.2.1 - 3.1.2.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
72	3.1.3	ผู้สัญญาอื่น:										-
73	3.1.3.1	เงินรับฝาก										-
74	3.1.3.2	เงินกู้ยืม										-
75	3.1.3.3	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
76	3.1.1 - 3.1.3	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ:										-
77	3.1.1 - 3.1.3 (1)	เงินรับฝาก										-
78	3.1.1 - 3.1.3 (2)	เงินกู้ยืม										-
79	3.1.1 - 3.1.3 (3)	เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
80	3.2	ตราสารหนี้ที่ออก:										-
81	3.2.1	เฉพาะส่วนที่เสนอขายในต่างประเทศ										-
82	3.3	หนี้สินอื่น:										-
83	3.3.1	เฉพาะส่วนที่เป็นเจ้าหนี้มาร์จิ้น และเจ้าหนี้อื่น										-
84	3.4	ธุรกรรมอนุพันธ์:										-
85	3.4.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
86	3.4.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
87	3.4.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
88	3.4.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
89	3.4.1 - 3.4.2	เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
90	3.4.1 - 3.4.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
91	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
92	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
93	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
94	3.4.1 - 3.4.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-
95												
96	3.5	วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
97	3.5.1	วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
98	3.5.2	วงเงินที่หักถ่วงกันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
99	3.5.2.1	วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
100	3.5.2.2	วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
101	3.6	ภาวะผูกพันอื่นๆ										-
102	กระแสเงินสดจ่ายทั้งสิ้น											-
103												
104	รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											-
105	รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สะสมสุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)											fail
106	ฐานะสภาพคล่องสุทธิ											-
107	ฐานะสภาพคล่องสะสมสุทธิ											fail

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
108												
109	ฐานะรวมทุกสกุลเงินตราต่างประเทศ											
110												หน่วย : ล้านบาท
111			วันที่	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
112	ส่วนที่ 1 : เงินสดและเงินลงทุน											
112	1.1	เงินสด										-
113	1.2	เงินลงทุนในหลักทรัพย์										-
114	1.2.1	ตราสารหนี้:										-
115	1.2.1.1	ตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลและธนาคารกลาง										-
116	1.2.1.1 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนค้ำประกันสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนค้ำประกันสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการอื่นและให้อิมหลักทรัพย์ (SBL)										-
117	1.2.1.2	ตราสารหนี้อื่น										-
118	1.2.1.2 (1)	เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนค้ำประกันสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนค้ำประกันสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการอื่นและให้อิมหลักทรัพย์ (SBL)										-
119	1.2.2	ตราสารทุน และอื่นๆ										-
120	1.3	เงินลงทุนอื่น										-
121	เงินสดและเงินลงทุนทั้งสิ้น											
122												
123	ส่วนที่ 2 : กระแสเงินสดไหลเข้า											
124	2.1	เงินฝาก เงินให้สินเชื่อ และเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
125	2.1.1	รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
126	2.1.1.1	เงินฝาก										-
127	2.1.1.2	เงินให้สินเชื่อ										-
128	2.1.1.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
129	2.1.2	รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
130	2.1.2.1	เงินฝาก										-
131	2.1.2.2	เงินให้สินเชื่อ										-
132	2.1.2.3	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
133	2.1.2.1 - 2.1.2.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
134	2.1.3	สัญญาอื่น:										-
135	2.1.3.1	เงินให้สินเชื่อ										-
136	2.1.3.1 (1)	สินเชื่อแบบหมุนเวียน										-
137	2.1.3.1 (2)	สินเชื่อแบบไม่หมุนเวียน:										-
138	2.1.3.1 (2) / 1	เฉพาะส่วนที่เป็นสัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง										-
139	2.1.3.2	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
140	2.1.1 - 2.1.3	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นผู้ยื่นที่อยู่นอกประเทศ:										-
141	2.1.1 - 2.1.3 (1)	เงินฝาก										-
142	2.1.1 - 2.1.3 (2)	เงินให้สินเชื่อ										-
143	2.1.1 - 2.1.3 (3)	เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										-
144	2.2	สินทรัพย์อื่น:										-
145	2.2.1	เฉพาะส่วนที่เป็นลูกหนี้มีประกัน และลูกหนี้อื่น										-
146	2.3	ธุรกรรมอนุพันธ์										-
147	2.3.1	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
148	2.3.1.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
149	2.3.2	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
150	2.3.2.1	เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
151	2.3.1 - 2.3.2	เฉพาะส่วนที่สัญญาเป็นผู้ยื่นที่อยู่นอกประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
152	2.3.1 - 2.3.2 (1)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
153	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 1	สัญญา Forward และ Futures										-
154	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 2	สัญญา Swap										-
155	2.3.1 - 2.3.2 (1) / 3	สัญญา Cross currency swap										-
156	2.3.1 - 2.3.2 (2)	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M
157			ฐานะรวมทุกจุดเงินตราต่างประเทศ (ต่อ)	ทันที	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallocated	Total
158	2.4		วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
159	2.4.1		วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
160	2.4.2		วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
161	2.4.2.1		วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
162	2.4.2.2		วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
163			กระแสเงินสดรับทั้งสิ้น										-
164													
165			ส่วนที่ 3: กระแสเงินสดไหลออก										
166	3.1		เงินรับฝาก เงินกู้ยืม และเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
167	3.1.1		รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ:										-
168	3.1.1.1		เงินรับฝาก										-
169	3.1.1.2		เงินกู้ยืม										-
170	3.1.1.3		เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
171	3.1.2		รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน:										-
172	3.1.2.1		เงินรับฝาก										-
173	3.1.2.2		เงินกู้ยืม										-
174	3.1.2.3		เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
175	3.1.2.1 - 3.1.2.3		เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย										-
176	3.1.3		ผู้สัญญาอื่น:										-
177	3.1.3.1		เงินรับฝาก										-
178	3.1.3.2		เงินกู้ยืม										-
179	3.1.3.3		เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
180	3.1.1 - 3.1.3		เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ:										-
181	3.1.1 - 3.1.3 (1)		เงินรับฝาก										-
182	3.1.1 - 3.1.3 (2)		เงินกู้ยืม										-
183	3.1.1 - 3.1.3 (3)		เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)										-
184	3.2		ตราสารหนี้ที่ออก:										-
185	3.2.1		เฉพาะส่วนที่เสนอขายในต่างประเทศ										-
186	3.3		หนี้สินอื่น:										-
187	3.3.1		เฉพาะส่วนที่เป็นเจ้าหนี้มาร์จิ้น และเจ้าหนี้อื่น										-
188	3.4		ธุรกรรมอนุพันธ์:										-
189	3.4.1		ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
190	3.4.1.1		เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
191	3.4.2		ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น:										-
192	3.4.2.1		เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
193	3.4.1 - 3.4.2		เฉพาะส่วนที่ผู้สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ										-
194	3.4.1 - 3.4.2 (1)		ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน:										-
195	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 1		สัญญา Forward และ Futures										-
196	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 2		สัญญา Swap										-
197	3.4.1 - 3.4.2 (1) / 3		สัญญา Cross currency swap										-
198	3.4.1 - 3.4.2 (2)		ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น										-
199													
200	3.5		วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้										-
201	3.5.1		วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)										-
202	3.5.2		วงเงินที่หักคู่กันเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities):										-
203	3.5.2.1		วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line)										-
204	3.5.2.2		วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line)										-
205	3.6		ภาวะผูกพันอื่นๆ										-
206			กระแสเงินสดจ่ายทั้งสิ้น										-
207													
208			รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)										-
209			รวมกระแสเงินสดรับ (จ่าย) สะสมสุทธิ (ไม่รวมเงินสดและเงินลงทุน)										fail
210			ฐานะสภาพคล่องสุทธิ										-
211			ฐานะสภาพคล่องสะสมสุทธิ										fail

คำอธิบายรายการสำหรับแบบรายงานฐานะสภาพคล่องสุทธิตามสัญญา (Contractual liquidity gap)

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
7	ส่วนที่ 1 : เงินสดและเงินลงทุน	
8	1.1 เงินสด	<p>เงินสดในมือ ได้แก่ ธนบัตร และเหรียญกษาปณ์ รวมทั้งเงินสดย่อย และเงินสดระหว่างเรียกเก็บ ได้แก่ ตราสารที่ต้องจ่ายคืนเมื่อทวงถามที่อยู่ในระหว่างเรียกเก็บ และตราสารซึ่งจะต้องเรียกเก็บตามระเบียบการหักบัญชีระหว่างธนาคารซึ่งจะเรียกเก็บได้ภายในวันทำการถัดไป เช่น ดราฟท์ และเช็คธนาคารที่ยังไม่ได้นำไปหักบัญชีแต่ได้เครดิตบัญชีให้ลูกค้าแล้ว และเช็ครอส่งคืน</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานเงินสดในมือในช่วงเวลา (Time bucket) “ทันที” และรายงานเงินสดระหว่างเรียกเก็บ ในช่วงเวลาตามสัญญาที่จะได้รับเงินสด</p>
9	1.2 เงินลงทุนในหลักทรัพย์	<p>เงินลงทุนที่อาจเกิดจากการลงทุนตามนโยบายการบริหารเงิน หรือการลงทุนในตราสารหนี้ที่มีวันครบกำหนดที่แน่นอนและตั้งใจจะถือจนกว่าจะครบกำหนด ซึ่งครอบคลุมเงินลงทุนทุกประเภท เช่น เงินลงทุนเพื่อค้า (Trading) เงินลงทุนเพื่อขาย (Available for sale) ตราสารหนี้ที่จะถือจนครบกำหนด (Held to maturity) หรือเงินลงทุนทั่วไป (General investment) ตามที่มาตรฐานการบัญชีกำหนด</p> <p>ให้แยกรายงานตามประเภทตราสาร โดยแบ่งเป็นข้อ 1.2.1 ตราสารหนี้ และข้อ 1.2.2 ตราสารทุน และอื่นๆ ทั้งนี้ <u>ไม่รวมถึง</u>เงินลงทุนในลูกหนี้ที่รับโอนมาตามหลักการบัญชี และเงินลงทุนในธุรกรรมเงินฝากหรือเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝง และเงินลงทุนในบริษัทย่อยและบริษัทร่วมสุทธิ ซึ่งได้กำหนดให้รายงานใน ข้อ 1.3 เงินลงทุนอื่น</p> <p>วิธีการรายงาน : ให้รายงานดังนี้</p>

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		<p>มูลค่าที่รายงาน</p> <ul style="list-style-type: none"> ➢ ในกรณีของหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดที่เป็นที่ยอมรับ¹ ให้รายงานด้วยราคาตลาด ณ วันที่รายงาน (Mark to market) โดยคำนึงถึงดอกเบี้ยค้างรับประกอบด้วย (Dirty price) หรือรายงานด้วยราคาตลาด โดยไม่คำนึงถึงดอกเบี้ยค้างรับ (Clean price) และให้แสดงรายการดอกเบี้ยรับ ในข้อ 2.2 สิทธิประโยชน์อื่น ➢ ในกรณีของหลักทรัพย์ที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดที่เป็นที่ยอมรับ ให้รายงานด้วยกระแสเงินสดตามสัญญาในช่วงเวลาที่เกี่ยวข้อง ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานราคาหน้าตั๋ว (Par) <p>ช่วงเวลาที่ยรายงาน</p> <p>การรายงานหลักทรัพย์ให้คำนึงถึงเวลาที่ ธพ. มีสิทธิเปลี่ยนหลักทรัพย์เป็นเงินสด เช่น</p> <ul style="list-style-type: none"> ➢ รายงานหลักทรัพย์ที่ปราศจากภาระผูกพัน ณ วันที่รายงาน เป็นค่าบวก ในช่วงเวลา “ทันที” ซึ่งรวมถึงหลักทรัพย์ที่ ธพ. ได้รับจากธุรกรรม Reverse repo ที่ปราศจากภาระผูกพัน ณ วันที่รายงานด้วย <p>ทั้งนี้ กรณีของหลักทรัพย์ที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดที่เป็นที่ยอมรับ ให้รายงานด้วยกระแสเงินสดตามสัญญาในช่วงเวลาที่เกี่ยวข้อง เช่น รายงานราคาหน้าตั๋ว (Par) ในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือ</p> <ul style="list-style-type: none"> ➢ กรณีของหลักทรัพย์ที่ติดภาระผูกพัน ให้รายงานหลักทรัพย์ที่จะได้รับคืน หรือจะปลดภาระผูกพัน (ค่าบวก) ในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือตามสัญญาของการติดภาระผูกพัน ทั้งนี้ ในกรณีที่การติดภาระผูกพันไม่มีวันครบกำหนด เช่น หลักทรัพย์ที่สาขาของ ธพ. ต่างประเทศต้องดำรงตามมาตรา 32 หลักทรัพย์เพื่อค้ำประกันไฟฟ้า เป็นต้น ในช่อง “Unallocated”

¹ ให้พิจารณาจากการเป็นสินทรัพย์ที่มีคุณภาพดี มีสภาพคล่องสูง และสามารถเปลี่ยนเป็นเงินสดได้อย่างรวดเร็วโดยมูลค่าไม่เปลี่ยนแปลงอย่างมีนัยสำคัญ ทั้งนี้ ในกรณีประเทศไทย หมายถึง หลักทรัพย์ทุกตัวที่จดทะเบียนอยู่ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ตลาดหลักทรัพย์ MAI และตลาดตราสารหนี้ BEX ทั้งนี้ ให้รวมถึงตราสารหนี้ที่ขึ้นทะเบียนข้อมูลตราสารหนี้กับสมาคมตราสารหนี้ไทย ด้วย

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		<p>สำหรับหลักทรัพย์เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL) ให้รายงานในข้อ 1.2.1.1 (1) หรือ 1.2.1.2 (1) โดยกำหนดให้</p> <ul style="list-style-type: none"> ➢ รายงานหลักทรัพย์ที่จะต้องขายคืนตามสัญญา Reverse repo (ค่าลบ) ในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือตามสัญญา Reverse repo ➢ รายงานหลักทรัพย์ที่จะต้องซื้อคืนตามสัญญา Repo (ค่าบวก) ในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือตามสัญญา Repo <p>(ตัวอย่างการรายงานเงินลงทุนในหลักทรัพย์ ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo และธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ตามเอกสารแนบ 3.1)</p>
10	1.2.1 ตราสารหนี้	<p>เงินลงทุนในพันธบัตร หุ้นกู้ และตราสารแสดงสิทธิในหนี้ ทั้งนี้ รายงานเฉพาะเงินลงทุนในตราสารหนี้ที่ออกเพื่อการระดมทุนทั่วไป (Public offering)</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทผู้ออกหรือผู้ค้ำประกันตราสาร โดยแบ่งเป็นข้อ 1.2.1.1 ตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลและธนาคารกลาง และข้อ 1.2.1.2 ตราสารหนี้อื่น</p> <p>สำหรับหลักทรัพย์เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo และธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending: SBL) โดยให้รวมถึงหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับการชำระมาร์จิ้นเพื่อธุรกรรมดังกล่าว และการวางประกันตามสัญญา Credit Support Annex (CSA) ให้แยกรายงานในข้อ 1.2.1.1 (1) หรือ 1.2.1.2 (1) “เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL)” โดยไม่ต้องรายงานหลักทรัพย์เหล่านี้ในข้อ 1.2.1.1 ตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดยรัฐบาลและธนาคารกลาง และข้อ 1.2.1.2 ตราสารหนี้อื่น</p>

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
15	1.2.2 ตราสารทุน และอื่นๆ	เงินลงทุนในหลักทรัพย์ที่นอกเหนือจากพันธบัตร หุ้นกู้ และตราสารแสดงสิทธิในหนี้ ที่รายงานในข้อ 1.2.1 ตราสารหนี้ ยกตัวอย่างเช่น เงินลงทุนในตราสารทุน และกองทุน เป็นต้น
16	1.3 เงินลงทุนอื่น	<p>เงินลงทุนในลูกหนี้ที่รับโอนมาที่ตามหลักการบัญชี และเงินลงทุนในธุรกรรมเงินฝากหรือเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝง และเงินลงทุนในบริษัทย่อยและบริษัทร่วมสุทธิ</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ ทั้งนี้ ในกรณีที่ ธพ. คาดว่าจะไม่ถอนการลงทุน เช่น เงินลงทุนในบริษัทย่อยและบริษัทร่วมสุทธิ ให้รายงานมูลค่าตามบัญชีในช่อง “Unallocated”</p>
19	ส่วนที่ 2 : กระแสเงินสดไหลเข้า	
20	2.1 เงินฝาก เงินให้สินเชื่อ และเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)	<p>ให้รายงานเงินฝาก เงินให้สินเชื่อ และเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo) ตามประเภทคู่สัญญา โดยแบ่งเป็นข้อ 2.1.1 รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ ข้อ 2.1.2 รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน และข้อ 2.1.3 คู่สัญญาอื่น</p> <p>เงินฝาก เช่น เงินฝาก บัตรเงินฝากที่ ธพ. ฝากไว้สถาบันการเงินอื่น นอกจากนี้ สำหรับสาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ให้รวมถึงยอดบัญชีเงินฝากทุกประเภทที่ฝากไว้ที่สำนักงานใหญ่ หรือสาขาอื่นที่เป็นนิติบุคคลเดียวกัน หรือบริษัทแม่ หรือบริษัทลูกของสำนักงานใหญ่</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานยอดเงินฝากกระแสรายวัน ออมทรัพย์ และเงินฝากประเภทจ่ายคืนเมื่อทวงถาม ในช่วงเวลา “ทันที” และรายงานยอดเงินฝากประจำ (Term deposit) ในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือ ทั้งนี้ ให้คำนึงถึงดอกเบี้ยรับที่จะเกิดขึ้นด้วย โดยหากไม่สามารถรายงานดอกเบี้ยรับรวมกับเงินฝากได้ ให้แสดงรายการดอกเบี้ยรับ ในข้อ 2.2 สินทรัพย์อื่น</p> <p>เงินให้สินเชื่อ โดยรวมถึงเงินลงทุนในตราสารหนี้ ธพท. (e-P/N) และตัวสัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง ทั้งนี้ หมายรวมถึงการซื้อตราสารหนี้ (ตัวเงินและหุ้นกู้) ที่ออกเพื่อเสนอขายในวงจำกัด (แบบ Private placement) นอกจากนี้ สำหรับสาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ให้รวมถึงยอดเงินให้</p>

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		<p>กู้ยืมกับสำนักงานใหญ่ หรือสาขาอื่นที่เป็นนิติบุคคลเดียวกัน หรือบริษัทแม่ หรือบริษัทลูกของสำนักงานใหญ่</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานกระแสเงินสดเข้าของสินเชื่อและดอกเบี้ยรับตามสัญญาในช่วงเวลาที่เกี่ยวข้อง² โดยหากไม่สามารถรายงานดอกเบี้ยรับรวมกับเงินให้สินเชื่อได้ ให้แสดงรายการดอกเบี้ยรับในข้อ 2.2 สินทรัพย์อื่น อย่างไรก็ตามไม่ต้องคำนึงถึง ส่วนปรับมูลค่า รายได้รอดตัดบัญชี และค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญที่ไม่กระทบต่อกระแสเงินสดเข้า</p> <p>ทั้งนี้ การรายงานสินเชื่อมีรายละเอียดเพิ่มเติมดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ➢ สำหรับสินเชื่อที่ครบกำหนดชำระแล้วและยังจัดชั้นปกติ หรือกล่าวถึงเป็นพิเศษ (อ้างอิงการจัดชั้นตามประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การจัดชั้นและการกันเงินสำรองของสถาบันการเงิน) ให้รายงานในช่อง “ทันที” ➢ สำหรับสินเชื่อแบบมีกำหนดชำระคืนเมื่อทวงถาม (Call loan) ให้รายงานในช่อง “ทันที” ➢ สำหรับสินเชื่อ NPL ให้รายงานมูลค่าตามบัญชีในช่อง “Unallocated” ➢ สำหรับสินเชื่อหมุนเวียน หมายถึง สินเชื่อที่ไม่มีกำหนดระยะเวลาและจำนวนเงินที่จะได้รับชำระคืนได้อย่างแน่นอน เช่น สินเชื่อเงินเบิกเกินบัญชี สินเชื่อบัตรเครดิต ให้รายงานมูลค่าตามบัญชี ในช่อง “Unallocated” <p>เว้นแต่ กระแสเงินสดไหลเข้าที่เกิดจากมูลค่าขั้นต่ำที่ลูกค้าต้องชำระ เช่น ยอดชำระขั้นต่ำร้อยละ 10 ของสินเชื่อบัตรเครดิต หรือ สินเชื่อส่วนที่ครบกำหนดชำระแล้ว เนื่องจากลูกค้าเบิกใช้เกินกว่าวงเงินหรือวงเงินหมดอายุ ให้รายงานกระแสเงินสดเข้าของสินเชื่อและดอกเบี้ยรับตามสัญญาในช่วงเวลาที่เกี่ยวข้อง</p>

² เช่น ณ วันที่รายงาน มีรายการดอกเบี้ยค้างรับมูลค่า 150 บาท บันทึกในงบดุล ให้รายงานกระแสเงินสดไหลเข้าจากดอกเบี้ยสำหรับส่วนที่ครบกำหนดชำระแล้วในช่อง “ทันที” และสำหรับส่วนที่เหลือให้รายงานกระแสเงินสดไหลเข้าตามช่วงเวลาที่จะได้รับ

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		<p>เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo) เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืนทั้งที่คู่สัญญาเป็นเอกชน และ ธปท. (Bilateral repo)</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานยอดเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo) ในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือของสัญญา ทั้งนี้ ให้คำนึงถึงประมาณการกระแสเงินสดของดอกเบี้ยรับ ประกอบด้วย โดยหากไม่สามารถรายงานดอกเบี้ยรับรวมกับธุรกรรมได้ ให้แสดงรายการดอกเบี้ยรับ ในข้อ 2.2 สิทธิประโยชน์อื่น</p> <p>ทั้งนี้ ให้ ธพ. รายงานธุรกรรมเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo) ด้วยยอดกระแสเงินสดไหลเข้า ก่อนหักกลบหนี้ กล่าวคือ ไม่สามารถรายงานเป็นยอดสุทธิระหว่างเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo) และเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) ได้ (รายงานด้วยยอด Gross)</p> <p>ทั้งนี้ เมื่อรายงานกระแสเงินสดไหลเข้าจากธุรกรรมเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืนแล้ว ให้รายงานมูลค่า หลักทรัพย์ที่ต้องขายคืนให้แก่คู่สัญญา ในข้อ 1.2.1.1 (1) หรือ 1.2.1.2 (1) เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL) เป็นยอดลบ (-) ด้วย</p>
21-24	2.1.1 รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ	<p>รายงานกระแสเงินสด กรณีคู่สัญญาเป็นบริษัทในกลุ่มธุรกิจ โดยให้รวมถึง สำนักงานใหญ่และสาขาอื่น บริษัทแม่ บริษัทร่วม และบริษัทลูกที่อยู่ทั้งในและต่างประเทศ</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็นข้อ 2.1.1.1 เงินฝาก ข้อ 2.1.1.2 เงินให้สินเชื่อ และ ข้อ 2.1.1.3 เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)</p>
25-29	2.1.2 รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน	<p>รายงานกระแสเงินสด กรณีคู่สัญญาเป็นสถาบันการเงินภายใต้พระราชบัญญัติดอกเบี้ยเงินให้กู้ยืมของสถาบันการเงินที่ตั้งอยู่ในประเทศ ธนาคารอิสลามแห่งประเทศไทย และสถาบันการเงินที่อยู่ในต่างประเทศ เช่น ธนาคารกลาง และธนาคารพาณิชย์ (Bank & investment bank)</p>

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
		<p>อย่างไรก็ดี กรณีที่คู่สัญญาเป็นสถาบันการเงินที่อยู่ในกลุ่มธุรกิจ ให้รายงานในข้อ 2.1.1 รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็นข้อ 2.1.2.1 เงินฝาก ข้อ 2.1.2.2 เงินให้สินเชื่อ และข้อ 2.1.2.3 เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)</p> <p>นอกจากนี้ ให้รายงานกระแสเงินสดในข้อ 2.1.2.1 – 2.1.2.3 ข้างต้น ในส่วนที่คู่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย ในบรรทัด 29 “เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย” ด้วย</p>
30-35	2.1.3 คู่สัญญาอื่น	<p>รายงานกระแสเงินสด กรณีคู่สัญญามีใช้บริษัทในกลุ่มธุรกิจ และธนาคารและตลาดเงิน ที่อยู่ทั้งในและต่างประเทศ</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็นข้อ 2.1.3.1 เงินให้สินเชื่อ (ให้แยกรายงานตามประเภทสินเชื่อ โดยแบ่งเป็นข้อ 2.1.3.1 (1) สินเชื่อแบบหมุนเวียน ข้อ 2.1.3.1 (2) สินเชื่อแบบไม่หมุนเวียน) และข้อ 2.1.3.2 เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)</p> <p>นอกจากนี้ ให้รายงานกระแสเงินสดของสินเชื่อแบบไม่หมุนเวียนในข้อ 2.1.3.1 (2) ในส่วนที่เป็นการกู้ยืมในรูปของตัวสัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง ในบรรทัด 34 “เฉพาะส่วนที่เป็นตัวสัญญาใช้เงินที่ออกโดยกระทรวงการคลัง” ด้วย</p>
36-39	2.1.1 - 2.1.3 เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ	<p>รายงานกระแสเงินสดในข้อ 2.1.1 - 2.1.3 ในส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ ทั้งนี้ ให้อ้างอิงนิยามผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ (Non-residents) ตามหนังสือเวียน ธปท. ว่าด้วยเรื่อง ขอความร่วมมือปฏิบัติตามมาตรการป้องปรามการเก็งกำไรค่าเงินบาท</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็นข้อ 2.1.1 - 2.1.3 (1) เงินฝาก ข้อ 2.1.1 - 2.1.3 (2) เงินให้สินเชื่อ และข้อ 2.1.1 - 2.1.3 (3) เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)</p>

บรรทัดใน Excel file	หัวข้อ	คำอธิบาย
40	2.2 สินทรัพย์อื่น	สินทรัพย์ที่อาจก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลเข้า ซึ่งยังมิได้รายงานข้างต้น วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ
41	2.2.1 เฉพาะส่วนที่เป็นลูกหนี้มาร์จิ้น และลูกหนี้อื่น	รายงานกระแสเงินสดในข้อ 2.2 เฉพาะส่วนที่เป็นลูกหนี้มาร์จิ้น และลูกหนี้อื่น ซึ่งหมายความถึง ลูกหนี้ที่เกิดจากการชำระมาร์จิ้นตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) และธุรกรรมขายคืน (Reverse repo) ซึ่งรวมถึงธุรกรรมกับ ธพท. (Bilateral repo) และเงินสดที่ ธพ. วางเป็นประกันตามสัญญา Credit Support Annex (CSA) หรือเงินสดที่ ธพ. วางเป็นประกันตามธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending: SBL) ทั้งนี้ ในกรณีที่หลักประกันเป็นหลักทรัพย์ ให้รายงานมูลค่าหลักทรัพย์ดังกล่าว ในข้อ 1.2.1.1 (1) หรือ 1.2.1.2 (1) เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL) ด้วย วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานยอดลูกหนี้มาร์จิ้นและเงินสดที่ ธพ. วางเป็นประกัน ในช่วงเวลาตามระยะเวลาการ Re-margin ครึ่งถัดไป
42	2.3 ธุรกรรมอนุพันธ์	ธุรกรรมอนุพันธ์ที่ก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลเข้าทั้งสำหรับสัญญาที่เกิดขึ้นแน่นอน (Non-contingent) และสัญญาที่อาจเกิดขึ้น (Contingent) วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานกระแสเงินสดไหลเข้าของธุรกรรมอนุพันธ์ในช่วงเวลาที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ ➢ กรณีที่สัญญากำหนดให้ชำระราคาเป็นเงินสด (Cash settlement) ให้รายงานยอดกระแสเงินสดไหลเข้าสุทธิ ระหว่างกระแสเงินสดไหลเข้าและกระแสเงินสดไหลออกในช่วงเวลาเดียวกัน (รายงานด้วยกระแสเงินสด Net) ทั้งนี้ หากเป็นฝั่งจ่าย ให้รายงานยอดกระแสเงินสดไหลออกสุทธิ ในส่วนที่ 3 หัวข้อ 3.4 ธุรกรรมอนุพันธ์

		<p>➢ กรณีที่สัญญากำหนดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง (Physical settlement) ให้รายงานยอดกระแสเงินสดไหลเข้า <u>ก่อน</u> หักกระแสเงินสดไหลออก (รายงานด้วยกระแสเงินสด Gross) กล่าวคือ ไม่สามารถรายงานเป็นยอดสุทธิระหว่างกระแสเงินสดไหลเข้าและกระแสเงินสดไหลออกได้</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็นข้อ 2.3.1 ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน และ 2.3.2 ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น</p>
43-44	2.3.1 ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน	<p>รายงานกระแสเงินสดของธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน (Non-contingent) เช่น ธุรกรรมฟอร์เวิร์ด (Forward) ฟิวเจอร์ส (Futures) สวอป (Swap)</p> <p>ทั้งนี้ กรณีธุรกรรม Prorata Forward ซึ่งคู่สัญญาสามารถใช้สิทธิได้ล่วงหน้าก่อนกำหนด (Early taken up) ให้รายงานกระแสเงินสดรับโดยอ้างอิง Forward rate ณ วันสิ้นสุดสัญญา ในช่วงเวลาตามระยะเวลาคงเหลือถึงวันแรกที่คู่สัญญาสามารถใช้สิทธิได้</p> <p>ทั้งนี้ ให้รายงานกระแสเงินสดในส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying assets) เป็นเงินตราต่างประเทศ³ ในบรรทัด 44 “เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ” ด้วย</p>
45-46	2.3.2 ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น	<p>รายงานกระแสเงินสดของธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น (Contingent) เช่น ออปชัน (Options) สวอปชัน (Swaption)</p> <p>ทั้งนี้ ให้รายงานกระแสเงินสดในส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying assets) เป็นเงินตราต่างประเทศ ในบรรทัด 46 “เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ” ด้วย</p>
47-52	2.3.1 – 2.3.2 เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่นอกประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ	<p>รายงานกระแสเงินสดในข้อ 2.3.1 - 2.3.2 ในส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่นอกประเทศ (Non-residents) และมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ โดยให้อ้างอิงนิยามผู้มีถิ่นที่อยู่นอกประเทศ (Non-residents) ตามหนังสือเวียน ธปท. ว่าด้วยเรื่องขอความร่วมมือปฏิบัติตามมาตรการป้องปรามการเก็งกำไรค่าเงินบาท</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็น ข้อ 2.3.1 – 2.3.2 (1) ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน</p>

³ ธุรกรรมอนุพันธ์ที่มีสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying assets) เป็นเงินตราต่างประเทศ เช่น Foreign exchange forward, Currency futures, Foreign exchange swap และ Cross currency swap เป็นต้น

		(ให้แยกรายงานตามประเภทสัญญา โดยแบ่งเป็นข้อ 2.3.1 – 2.3.2 (1) / 1 สัญญา Forward และ Futures ข้อ 2.3.1 – 2.3.2 (1) / 2 สัญญา Swap และข้อ 2.3.1 – 2.3.2 (1) / 3 สัญญา Cross currency swap) และ ข้อ 2.3.1 – 2.3.2 (2) ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น
54	2.4 เงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้	<p>วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ที่ได้รับจากบริษัทแม่ และบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน รวมถึงคู่สัญญาอื่น ทั้งที่เป็นวงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line) ในทุกกรณี และวงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line) ทั้งที่มีเพื่อวัตถุประสงค์ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ ธพ. เป็นผู้ออก (Liquidity facilities) และวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities) ทั้งนี้ ไม่รวมวงเงินเพื่อวัตถุประสงค์ในการทำธุรกรรมอนุพันธ์ (Derivatives) และการก่อภาระผูกพันอื่นนอกงบแสดงฐานะการเงิน</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทวงเงิน โดยแบ่งเป็นข้อ 2.4.1 เงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities) และข้อ 2.4.2 เงินที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities)</p> <p>วิธีการรายงาน : ในกรณีที่สัญญาของวงเงินดังกล่าวกำหนดให้มีการวางหลักประกันด้วย ธพ. อจรายงานด้วยจำนวนสุทธิหลังหักหลักประกันที่ ธพ. ต้องวางเพื่อการประกันวงเงิน หรือที่จะให้ไปตามสัญญาเมื่อ ธพ. เบิกใช้ โดยจะต้องเป็นไปตามเงื่อนไขดังต่อไปนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) หลักประกันมีคุณสมบัติเข้าข่ายเป็นเงินลงทุนในหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดที่เป็นที่ยอมรับเฉพาะที่เป็นตราสารหนี้ และยังไม่ได้ถูกนับในข้อ 1.2 เงินลงทุนในหลักทรัพย์ (ไม่นับซ้ำ) 2) คู่สัญญาของ ธพ. มีสิทธิตามกฎหมายและมีความพร้อมในทางปฏิบัติ ที่จะใช้หลักประกันดังกล่าวในการหาสภาพคล่อง 3) มูลค่าหลักประกันดังกล่าวไม่มีความสัมพันธ์อย่างใกล้ชิดกับการเบิกใช้เงินของ ธพ.
55	2.4.1 เงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)	<p>รายงานวงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ ธพ. เป็นผู้ออก (Liquidity facilities)</p> <p>วิธีการรายงาน : ให้รายงานวงเงินในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือแต่ละตราสารหนี้</p>

56-58	2.4.2 วงเงินที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อ วัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities)	<p>รายงานวงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ที่มีวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities) นอกเหนือจากการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ ธพ. เป็นผู้ออก ทั้งนี้ ให้รวมถึงวงเงินส่วนที่เหลือจากวงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่จะครบกำหนด (Liquidity facilities) แต่ยังไม่มีการจัดสรรให้รองรับการไถ่ถอนตราสารหนี้ใด</p> <p>วิธีการรายงาน : ให้รายงานยอดรวมในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือตามสัญญา</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามเงื่อนไขของวงเงิน โดยแบ่งเป็นข้อ 2.4.2.1 วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line) และ 2.4.2.2 วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line) โดยอ้างอิงตามนิยาม ดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ➢ วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line) คือ วงเงินที่ ธพ. สามารถถูกยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities) ➢ วงเงินที่สามารถยกเลิกได้ทันทีโดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line) คือ วงเงินให้สินเชื่อที่ในสัญญาต้องมีการระบุข้อความที่ทำให้ ธพ. มีสิทธิถูกยกเลิกวงเงินได้ทันทีโดยไม่มีเงื่อนไข และสามารถถูกยกเลิกวงเงินดังกล่าวเมื่อใดก็ได้ ทั้งนี้ การระบุ Event of default หรือ Material adverse change clause เป็นเหตุผลในการยกเลิกสัญญานั้น ต้องไม่จำกัดสิทธิในการยกเลิกวงเงินเฉพาะกรณีที่ ธพ. มีคุณภาพเครดิตเสื่อมถอยหรือยกเลิกวงเงินเฉพาะกรณีใดกรณีหนึ่งเท่านั้น (อ้างอิงนิยามตามประกาศ ธพท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต สำหรับ ธพ. โดย Standardised Approach (วิธี SA))
ส่วนที่ 3 : กระแสเงินสดไหลออก		
62	3.1 เงินรับฝาก เงินกู้ยืม และ เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)	<p>ให้รายงานเงินรับฝาก เงินกู้ยืม และเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) ตามประเภทคู่สัญญา โดยแบ่งเป็นข้อ 3.1.1 รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ ข้อ 3.1.2 รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน และข้อ 3.1.3 คู่สัญญาอื่น</p> <p>เงินรับฝาก ได้แก่ เงินรับฝากทุกประเภท ซึ่ง ธพ. ต้องจ่ายดอกเบี้ยหรือไม่ต้องจ่ายดอกเบี้ยแก่ผู้ฝาก รวมทั้งเงินรับฝากที่บัญชีไม่เคลื่อนไหว นอกจากนี้ สำหรับสาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ให้รวมถึงยอดบัญชีเงินรับฝากทุกประเภท จากสำนักงานใหญ่ หรือสาขาอื่นที่เป็นนิติบุคคลเดียวกัน หรือบริษัทแม่ หรือบริษัทลูก</p>

		<p>ของสำนักงานใหญ่</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานยอดเงินรับฝากกระแสรายวัน ออมทรัพย์ และเงินรับฝากประเภทฝากคืนเมื่อทวงถาม ในช่วงเวลา “ทันที” และรายงานยอดเงินรับฝากประจำ (Term deposit) ในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือ ทั้งนี้ ให้รายงานโดยมิให้นำยอดเงินเบิกเกินบัญชีมาจากเงินรับฝาก และให้คำนึงถึงดอกเบี้ยจ่ายที่จะเกิดขึ้น ประกอบด้วย โดยหากไม่สามารถรายงานดอกเบี้ยจ่ายรวมกับเงินรับฝากได้ ให้แสดงรายการดอกเบี้ยจ่าย ในข้อ 3.3 หนี้สินอื่น</p> <p>เงินกู้ยืม รวมถึงตราสารหนี้ (ตัวเงินและหุ้นกู้) ที่ออกเพื่อเสนอขายในวงจำกัด (แบบ Private placement) ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และการขายลูกหนี้ที่ไม่เข้าข่ายเป็นการขายที่แท้จริงตามหลักการบัญชี (True sale) นอกจากนี้ สำหรับสาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ ให้รวมถึงยอดเงินกู้ยืมจากสำนักงานใหญ่ หรือสาขาอื่นที่เป็นนิติบุคคลเดียวกัน หรือบริษัทแม่ หรือบริษัทลูกของสำนักงานใหญ่ และเงินทุนสุทธิเพื่อดำรงสินทรัพย์ตามมาตรา 32</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานกระแสเงินสดไหลออกของเงินกู้ยืมและดอกเบี้ยจ่ายตามสัญญาในช่วงเวลาที่เกี่ยวข้อง โดยหากไม่สามารถรายงานดอกเบี้ยจ่ายรวมกับเงินกู้ยืมได้ ให้แสดงรายการดอกเบี้ยจ่าย ในข้อ 3.3 หนี้สินอื่น</p> <p>ทั้งนี้ ให้ ธพ. รายงานเงินทุนสุทธิเพื่อดำรงสินทรัพย์ตามมาตรา 32 ด้วยมูลค่าตามบัญชีในช่อง “Unallocated”</p> <p>เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืนทั้งที่คู่สัญญาเป็นเอกชนและ ธพ. (Bilateral repo) รวมถึงธุรกรรมด้านตลาดการเงินเกี่ยวกับการขายตราสารหนี้เพื่อบริหารสภาพคล่องโดยมีสัญญาจะซื้อคืน (บริการขายตราสารหนี้) และธุรกรรมอื่น ๆ ที่ ธพ. จะกำหนดต่อไป</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานยอดเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) ในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือของสัญญา ทั้งนี้ ให้คำนึงถึงประมาณการกระแสเงินสดของดอกเบี้ยจ่าย ประกอบด้วย โดยหากไม่สามารถรายงานดอกเบี้ยจ่ายรวมกับธุรกรรมได้ ให้แสดงรายการดอกเบี้ยจ่าย ในข้อ 3.3 หนี้สินอื่น</p>
--	--	--

		<p>ทั้งนี้ ให้ ธพ. รายงานธุรกรรมเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) ด้วยยอดกระแสเงินสดไหลออก <u>ก่อนหักกลบ</u> ลบหนี้ กล่าวคือ ไม่สามารถรายงานเป็นยอดสุทธิระหว่างเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) และเงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo) ได้ (รายงานด้วยยอด Gross)</p> <p>ทั้งนี้ เมื่อรายงานกระแสเงินสดไหลออกจากธุรกรรมเงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืนแล้ว ให้รายงานมูลค่าหลักทรัพย์ที่ต้องซื้อคืนจากคู่สัญญา ในข้อ 1.2.1.1 (1) หรือ 1.2.1.2 (1) เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL) เป็นยอดบวก (+) ด้วย</p>
63-66	3.1.1 รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ	<p>รายงานกระแสเงินสด กรณีคู่สัญญาเป็นบริษัทในกลุ่มธุรกิจ โดยให้รวมถึง สำนักงานใหญ่และสาขาอื่น บริษัทแม่ บริษัทร่วม และบริษัทลูกที่อยู่ทั้งในและต่างประเทศ</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็นข้อ 3.1.1.1 เงินรับฝาก ข้อ 3.1.1.2 เงินกู้ยืม และข้อ 3.1.1.3 เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)</p>
67-71	3.1.2 รายการระหว่างธนาคารและตลาดเงิน	<p>รายงานกระแสเงินสด กรณีคู่สัญญาเป็นสถาบันการเงินภายใต้พระราชบัญญัติดอกเบี้ยเงินกู้ยืมของสถาบันการเงินที่ตั้งอยู่ในประเทศ ธนาคารอิสลามแห่งประเทศไทย และสถาบันการเงินที่อยู่ในต่างประเทศ เช่น ธนาคารกลาง, ธนาคารพาณิชย์ (Bank & investment bank)</p> <p>อย่างไรก็ดี กรณีที่คู่สัญญาเป็นสถาบันการเงินที่อยู่ในกลุ่มธุรกิจ ให้รายงานในข้อ 3.1.1 รายการระหว่างบริษัทในกลุ่มธุรกิจ</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็นข้อ 3.1.2.1 เงินรับฝาก ข้อ 3.1.2.2 เงินกู้ยืม และข้อ 3.1.2.3 เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)</p> <p>นอกจากนี้ ให้รายงานกระแสเงินสดในข้อ 3.1.2.1 – 3.1.2.3 ข้างต้น ในส่วนที่คู่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย ในบรรทัด 71 “<u>เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นธนาคารแห่งประเทศไทย</u>” ด้วย</p>
72-75	3.1.3 คู่สัญญาอื่น	<p>รายงานกระแสเงินสด กรณีคู่สัญญาไม่ใช่บริษัทในกลุ่มธุรกิจ และธนาคารและตลาดเงิน ที่อยู่ทั้งในและต่างประเทศ</p>

		<p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็นข้อ 3.1.3.1 เงินรับฝาก ข้อ 3.1.3.2 เงินกู้ยืม และ ข้อ 3.1.3.3 เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)</p>
76-79	3.1.1 – 3.1.3 เฉพาะส่วนที่คู่สัญญา เป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ	<p>รายงานกระแสเงินสดในข้อ 3.1.1 – 3.1.3 ในส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ ทั้งนี้ ให้อ้างอิงนิยามผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ (Non-residents) ตามหนังสือเวียน ธปท. ว่าด้วยเรื่อง ขอความร่วมมือปฏิบัติตามมาตรการป้องปรามการเก็งกำไรค่าเงินบาท</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็นข้อ 3.1.1 - 3.1.3 (1) เงินรับฝาก ข้อ 3.1.1 - 3.1.3 (2) เงินกู้ยืม และข้อ 3.1.1 - 3.1.3 (3) เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)</p>
80	3.2 ตราสารหนี้ที่ออก	<p>ตราสารหนี้ (ตัวเงินและหุ้นกู้) ที่ออกเพื่อเสนอขายในกรณีทั่วไป (แบบ Public offering) ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ ทั้งนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ➢ กรณีของตราสารหนี้ที่ไม่มีวันหมดอายุ เช่น Perpetual bond ให้รายงานมูลค่าตามบัญชีในช่อง “Unallocated” ➢ กรณีที่ผู้ลงทุนมีสิทธิไถ่ถอนก่อนกำหนด ให้รายงานกระแสเงินสดที่เกี่ยวข้องในช่วงเวลาตามระยะเวลาคงเหลือถึงวันแรกที่คุณถือสามารถใช้สิทธิได้ ➢ กรณีที่ผู้ออก (ธพ.) มีสิทธิไถ่ถอนก่อนกำหนด ให้รายงานกระแสเงินสดที่เกี่ยวข้องในช่วงเวลาตามระยะเวลาคงเหลือถึงวันแรกที่คุณผู้ออกสามารถใช้สิทธิได้
81	3.2.1 เฉพาะส่วนที่เสนอขายในต่างประเทศ	รายงานกระแสเงินสดในข้อ 3.2 สำหรับส่วนที่มีการเสนอขายในต่างประเทศ
82	3.3 หนี้สินอื่น	<p>หนี้สินที่อาจก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลออก ซึ่งยังมีได้รายงานข้างต้น</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ</p>
83	3.3.1 เฉพาะส่วนที่เป็นเจ้าหนี้มาร์จิ้น และเจ้าหนี้อื่น	รายงานกระแสเงินสดในข้อ 3.3 เฉพาะส่วนที่เป็นเจ้าหนี้มาร์จิ้น และเจ้าหนี้อื่น กล่าวคือ เจ้าหนี้ที่เกิดจากการรับชำระมาร์จิ้นตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo) และธุรกรรมขายคืน (Reverse repo) ซึ่งรวมถึงธุรกรรมกับ ธปท.

		<p>(Bilateral repo) และเงินสดที่ ธพ. ได้รับเป็นประกันตามสัญญา Credit Support Annex (CSA) หรือเงินสดที่ ธพ. ได้รับเป็นประกันตามธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending: SBL) ทั้งนี้ ในกรณีที่หลักประกันเป็นหลักทรัพย์ ให้รายงานมูลค่าหลักทรัพย์ดังกล่าว ในข้อ 1.2.1.1 (1) หรือ 1.2.1.2 (1) เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL) ด้วย</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานยอดเจ้าหนี้มาร์จิ้นและเงินสดที่ ธพ. ได้รับเป็นประกัน ในช่วงเวลาตามระยะเวลาการ Re-margin ครั้งถัดไป</p>
84	3.4 ธุรกรรมอนุพันธ์	<p>ธุรกรรมอนุพันธ์ที่ก่อให้เกิดกระแสเงินสดไหลออกทั้งสำหรับสัญญาที่เกิดขึ้นแน่นอน (Non-contingent) และสัญญาที่อาจเกิดขึ้น (Contingent)</p> <p>วิธีการรายงาน : ตามที่กำหนดในคู่มือ เช่น รายงานกระแสเงินสดไหลออกของธุรกรรมอนุพันธ์ ในช่วงเวลาที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ➢ กรณีที่สัญญากำหนดให้ชำระราคาเป็นเงินสด (Cash settlement) ให้รายงานยอดกระแสเงินสดไหลออกสุทธิ ระหว่างกระแสเงินสดไหลออกและกระแสเงินสดไหลเข้าในช่วงเวลาเดียวกัน (รายงานด้วยกระแสเงินสด Net) ทั้งนี้ หากเป็นผู้รับ ให้รายงานยอดกระแสเงินสดไหลเข้าสุทธิ ในส่วนที่ 2 หัวข้อ 2.3 ธุรกรรมอนุพันธ์ ➢ กรณีที่สัญญากำหนดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง (Physical settlement) ให้รายงานยอดกระแสเงินสดไหลออก ก่อนหักกระแสเงินสดไหลเข้า (รายงานด้วยกระแสเงินสด Gross) กล่าวคือ ไม่สามารถรายงานเป็นยอดสุทธิระหว่างกระแสเงินสดไหลออกและกระแสเงินสดไหลเข้าได้ <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็นข้อ 3.4.1 ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน และ 3.4.2 ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น</p>
85-86	3.4.1 ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน	<p>รายงานกระแสเงินสดของธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน (Non-contingent) เช่น ธุรกรรมฟอร์เวิร์ด (Forward) ฟิวเจอร์ส (Futures) สวอป (Swap) เป็นต้น</p>

		<p>ทั้งนี้ กรณีธุรกรรม Prorata Forward ซึ่งคู่สัญญาสามารถใช้สิทธิได้ล่วงหน้าก่อนกำหนด (Early taken up) ให้รายงานกระแสเงินสดจ่ายโดยอ้างอิง Forward rate ณ วันสิ้นสุดสัญญา ในช่วงเวลาตามระยะเวลาคงเหลือถึงวันแรกคู่สัญญาสามารถใช้สิทธิได้</p> <p>ทั้งนี้ ให้รายงานกระแสเงินสดในส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying assets) เป็นเงินตราต่างประเทศ ในบรรทัด 86 “เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ” ด้วย</p>
87-88	3.4.2 ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น	<p>รายงานกระแสเงินสดของธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น (Contingent) เช่น ออปชัน (Options) สวอปชัน (Swaption)</p> <p>ทั้งนี้ ให้รายงานกระแสเงินสดในส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิง (Underlying assets) เป็นเงินตราต่างประเทศ ในบรรทัด 88 “เฉพาะส่วนที่มีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ” ด้วย</p>
89-94	3.4.1 – 3.4.2 เฉพาะส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศและมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ	<p>รายงานกระแสเงินสดในข้อ 3.4.1 - 3.4.2 ในส่วนที่คู่สัญญาเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ (Non-residents) และมีสินทรัพย์อ้างอิงเป็นเงินตราต่างประเทศ โดยให้อ้างอิงนิยามผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ ตามหนังสือเวียน ธปท. ว่าด้วยเรื่องขอความร่วมมือปฏิบัติตามมาตรการป้องปรามการเก็งกำไรค่าเงินบาท</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทธุรกรรม โดยแบ่งเป็น ข้อ 3.4.1 – 3.4.2 (1) ธุรกรรมอนุพันธ์ที่เกิดขึ้นแน่นอน (ให้แยกรายงานตามประเภทสัญญา โดยแบ่งเป็นข้อ 3.4.1 – 3.4.2 (1) / 1 สัญญา Forward และ Futures ข้อ 3.4.1 – 3.4.2 (1) / 2 สัญญา Swap และข้อ 3.4.1 – 3.4.2 (1) / 3 สัญญา Cross currency swap) และ ข้อ 3.4.1 – 3.4.2 (2) ธุรกรรมอนุพันธ์ที่อาจเกิดขึ้น</p>
96	3.5 วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้	<p>วงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ที่ ธพ. อนุมัติให้แก่บริษัทแม่ และบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน รวมถึงคู่สัญญาอื่น ทั้งที่เป็นวงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line) ในทุกกรณี และวงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line) ทั้งที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการได้ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออก (Liquidity facilities) และวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities) ทั้งนี้ ไม่รวมวงเงินเพื่อวัตถุประสงค์ในการทำธุรกรรมอนุพันธ์ (Derivatives) และการก่อภาระผูกพันอื่นนอกงบแสดงฐานะการเงิน</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามประเภทวงเงิน โดยแบ่งเป็นข้อ 3.5.1 วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการได้ถอนตรา</p>

		<p>สารหนี้ (Liquidity facilities) และข้อ 3.5.2 วงเงินที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities)</p> <p>วิธีการรายงาน : ในกรณีที่สัญญาของวงเงินดังกล่าวกำหนดให้มีการวางหลักประกันด้วย ธพ. อาจรายงานด้วยจำนวนสุทธิหลังหักหลักประกันที่ได้รับมาจากลูกค้าเพื่อการประกันวงเงิน หรือที่จะได้รับมาตามสัญญาเมื่อลูกค้าเบิกใช้ โดยจะต้องเป็นไปตามเงื่อนไขดังต่อไปนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) หลักประกันมีคุณสมบัติเข้าข่ายเป็นเงินลงทุนในหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดที่เป็นที่ยอมรับ เฉพาะที่เป็นตราสารหนี้ และยังไม่ได้ถูกนับในข้อ 1.2 เงินลงทุนในหลักทรัพย์ (ไม่นับซ้ำ) 2) ธพ. มีสิทธิตามกฎหมายและมีความพร้อมในทางปฏิบัติ ที่จะใช้หลักประกันดังกล่าวในการหาสภาพคล่อง 3) มูลค่าหลักประกันดังกล่าวไม่มีความสัมพันธ์อย่างใกล้ชิดกับการเบิกใช้เงินของลูกค้า
97	3.5.1 วงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ (Liquidity facilities)	<p>รายงานวงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ที่มีวัตถุประสงค์เพื่อการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออกที่จะครบกำหนด (Liquidity facilities)</p> <p>วิธีการรายงาน : ให้รายงานวงเงินในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือแต่ละตราสารหนี้</p>
98-100	3.5.2 วงเงินที่ให้แก่ลูกค้าเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities)	<p>รายงานวงเงินที่ยังไม่ได้เบิกใช้ที่มีวัตถุประสงค์อื่น (Credit facilities) นอกเหนือจากการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่ลูกค้าเป็นผู้ออก เช่น เป็นวงเงินเพื่อใช้เป็นเงินทุนหมุนเวียน (Working capital) ของลูกค้า และวงเงินส่วนที่เหลือจากวงเงินที่มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ในการไถ่ถอนตราสารหนี้ที่จะครบกำหนด (Liquidity facilities) แต่ยังไม่มีการจัดสรรให้รองรับการไถ่ถอนตราสารหนี้ได้</p> <p>วิธีการรายงาน : ให้รายงานยอดรวมในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือตามสัญญา</p> <p>ทั้งนี้ ให้แยกรายงานตามเงื่อนไขของวงเงิน โดยแบ่งเป็นข้อ 3.5.2.1 วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line) และ 3.5.2.2 วงเงินที่สามารถยกเลิกได้โดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line) โดยอ้างอิงตามนิยาม ดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ➢ วงเงินที่ไม่สามารถยกเลิกได้ (Committed line) คือ วงเงินที่ ธพ. สามารถยกเลิกได้ภายใต้เงื่อนไขที่

		<p>ตกลงไว้ล่วงหน้า (Conditionally revocable facilities)</p> <p>➢ วงเงินที่สามารถยกเลิกได้ทันทีโดยไม่มีเงื่อนไข (Unconditionally revocable uncommitted line) คือ วงเงินให้สินเชื่อที่ในสัญญาต้องมีการระบุข้อความที่ทำให้ธนาคารพาณิชย์มีสิทธิในการยกเลิกวงเงินได้ทันทีโดยไม่มีเงื่อนไขและสามารถยกเลิกวงเงินดังกล่าวเมื่อใดก็ได้ ทั้งนี้ การระบุ Event of default หรือ Material adverse change clause เป็นเหตุผลในการยกเลิกสัญญานั้น ต้องไม่จำกัดสิทธิของธนาคารพาณิชย์ในการยกเลิกวงเงินเฉพาะกรณีที่คุณภาพเครดิตเสื่อมถอยหรือยกเลิกวงเงินเฉพาะกรณีใดกรณีหนึ่งเท่านั้น (อ้างอิงนิยามตามประกาศ ธปท. ว่าด้วยหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต)</p>
101	3.6 ภาระผูกพันอื่นๆ	<p>หนี้สินที่จะเกิดในภายหลัง เช่น การรับอวัลต์ตัวเงิน และการค้าประกันการกู้ยืมเงิน ภาระตามตัวเงินค่าสินค้าเข้าที่ยังไม่ครบกำหนด การขายลูกหนี้ตัวเงินที่ผู้ซื้อไม่มีสิทธิไล่เบี้ย (Commercial papers sold with recourse) เล็ตเตอร์ออฟเครดิต ธุรกิจเกี่ยวกับบริการทางการเงินเพื่อการค้าอื่น (Other trade finance) เป็นต้น</p> <p>วิธีการรายงาน : ให้รายงานยอดภาระผูกพันในช่วงเวลาตามอายุคงเหลือตามสัญญา</p>

ตัวอย่างการรายงานเงินลงทุนในหลักทรัพย์ ธุรกิจขายคืนตามสัญญา Reverse repo และธุรกิจซื้อคืนตามสัญญา Repo

ตัวอย่างธุรกรรม		มูลค่า (ลบ.)	อายุคงเหลือตามสัญญา (เดือน)
A1	มีหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดที่เป็นที่ยอมรับ (อายุคงเหลือ 12 เดือน)	100	-
A2	มีหลักทรัพย์ที่ไม่ได้จดทะเบียนในตลาดที่เป็นที่ยอมรับ (อายุคงเหลือ 8 เดือน)	10	-
B	นำหลักทรัพย์ A1 ไปทำธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo	5	5
C	ได้รับหลักทรัพย์ A1 จากธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo	4	2
D	นำหลักทรัพย์ A1 จากธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo ไปทำธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo เพิ่ม	3	1

หมายเหตุ : กำหนดให้จำนวนเงินที่ได้รับจากธุรกรรมซื้อคืนตามสัญญา Repo / จำนวนเงินที่ให้กู้ยืมจากธุรกรรมขายคืนตามสัญญา Reverse repo เท่ากับมูลค่าหลักทรัพย์

ตัวอย่างการรายงานข้อมูล	ทันที	วันที่ 2 - 7	8 วัน - 1 เดือน	> 1 - 3 เดือน	> 3 - 6 เดือน	> 6 เดือน - 1 ปี	> 1 - 5 ปี	มากกว่า 5 ปี	Unallo- cated	Total
ส่วนที่ 1 : เงินสดและเงินลงทุน										
เงินลงทุนในหลักทรัพย์										
ตราสารหนี้:										
ตราสารหนี้ที่ออกหรือค้ำประกันโดย รัฐบาลและธนาคารกลาง	96					10 ^{A2}				106
	(100 ^{A1} - 5 ^B + 4 ^C - 3 ^D)									
เฉพาะส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม ซื้อคืนตามสัญญา Repo ธุรกรรมขายคืนตาม สัญญา Reverse repo หรือธุรกรรมการยืมและ ให้ยืมหลักทรัพย์ (SBL)			+ 3 ^D	- 4 ^C	+ 5 ^B					4
ส่วนที่ 2 : กระแสเงินสดไหลเข้า										
เงินฝาก เงินให้สินเชื่อ และเงินให้สินเชื่อตาม ธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)										
เงินให้สินเชื่อตามธุรกรรมซื้อคืน (Reverse repo)				+ 4 ^C						4
ส่วนที่ 3 : กระแสเงินสดไหลออก										
เงินรับฝาก เงินกู้ยืม และเงินกู้ยืมตามธุรกรรม ซื้อคืน (Repo)										
เงินกู้ยืมตามธุรกรรมซื้อคืน (Repo)			- 3 ^D		- 5 ^B					- 8

แบบรายงานการกระจุกตัวของแหล่งเงิน**ส่วนที่ 1****คู่สัญญา Non-interbank**

(รายชื่อ ธพ.)

วันที่รายงาน (วัน/เดือน/ปี)

ลำดับ	เป็นผู้มีความเกี่ยวข้องกับ ธพ. (ใช่/ ไม่ใช่)	ประเภทคู่สัญญา		จำนวนเงิน	สัดส่วนต่อหนี้สิน รวม
		บุคคลธรรมดา (ใช่/ ไม่ใช่)	นิติบุคคล (ใช่/ไม่ใช่)		
1					
2					
3					
4					
5					
6					
7					
8					
9					
10					
11					
12					
13					
14					
15					
16					
17					
18					
19					
20					

แบบรายงานการกระจุกตัวของแหล่งเงิน (ต่อ)**ส่วนที่ 2**

คู่สัญญา Interbank
(รายชื่อ ธพ.)
วันที่รายงาน (วัน/เดือน/ปี)

ลำดับ	รายชื่อ	จำนวนเงิน			สัดส่วนต่อหนี้สิน
		ส่วนที่มีหลักประกัน	ส่วนที่ไม่มีหลักประกัน	รวม	รวม
1					
2					
3					
4					
5					
6					
7					
8					
9					
10					
11					
12					
13					
14					
15					
16					
17					
18					
19					
20					