

ชุดข้อมูลความเสี่ยงด้านตลาด

สารบัญ

Document Overview	2
1. VaR ของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า	3
2. Greek ของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า	6
3. PV01 ของความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า	9
4. จำนวนครั้งที่ผลขาดทุนที่เกิดขึ้นจริง เกินเพดานผลขาดทุนสูงสุดของธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า.....	13
5. ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม.....	15
6. ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา	19
7. ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต	26
8. ธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝง	33
9. เป้าหมาย และกำไร ขาดทุนที่เกิดขึ้นจริงของธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า แบ่งตามโต๊ะ.....	40
10. Credit Valuation Adjustment ของธุรกรรมอนุพันธ์ทางการเงิน	43
Appendix Data Type.....	45

Document Overview

Vocabulary:

- **Mandatory (M)** means data element is required in order to pass validation.
- **Condition (C)** means data element is required with only some specific condition related to this element or other element in order to pass validation.
- **Optional (O)** means data element is not required but is encouraged upon availability of data.

1. VaR ของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า

คำอธิบาย

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

สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

ลักษณะข้อมูล

รายวัน

ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

รายสัปดาห์

กำหนดการส่ง

ภายใน 3 วันทำการของสัปดาห์ถัดไป

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
1	Organization Id	FI Code	M	รหัสสถาบันการเงิน	
2	Data Set Date	Date	M	วันที่ชุดข้อมูล	วันที่ของวันศุกร์ในสัปดาห์
	1. Reporting Group Details		C		^{1/} 3 – 10 = Repeating Data Elements เงื่อนไข 1. ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
					2. ธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในประเทศไทย รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงาน (116002) - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003) - ชุดรวมทุกสำนักงานต่างประเทศ (116005) 3. กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003)
3	FI Reporting Group Id ^{1/}	Classification	M	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน (Classification Name: FI Reporting Group)	
	1.1 Calculation Date Details		M		^{2/} 4 – 10 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีจำนวนชุดเท่ากับวันทำการของสัปดาห์ที่ รายงาน
4	Calculation Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันที่คำนวณค่า VaR	ต้องเป็นวันทำการ
	1.1.1 Value Type Details		M		^{3/} 5 – 10 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
5	Value Type ^{1/ 2/ 3/}	Classification	M	ประเภทของข้อมูล (Classification Name: Value Type)	
6	VaR Approach ^{1/ 2/ 3/}	Classification	M	วิธีที่ใช้ในการคำนวณค่า VaR (Classification Name: VaR Assumption Approach)	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
7	Holding Period (Days) ^{1/ 2/ 3/}	Number	M	ระยะเวลาถือครองที่กำหนดของแบบจำลอง VaR (วัน)	
8	Confidence Level (%) ^{1/ 2/ 3/}	Percentage	M	ระดับความเชื่อมั่นที่กำหนดของแบบจำลอง VaR (%)	
	1.1.1.1 Risk Factor Details		M		^{4/} 9 – 10 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
9	Risk Factor Type ^{1/ 2/ 3/ 4/}	Classification	M	ประเภทของ Risk Factor Type ตามที่กำหนด (Aggregate, FX, IR, Commodity, Equity, Others) (Classification Name : Risk Factor Type)	
10	VaR Value ^{1/ 2/ 3/ 4/}	Amount	M	ค่า Value at Risk ของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า (บาท)	

2. Greek ของฐานะในบัญชีเพื่อการค้า

คำอธิบาย

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

สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

ลักษณะข้อมูล

รายวัน

ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

รายสัปดาห์

กำหนดการส่ง

ภายใน 3 วันทำการของสัปดาห์ถัดไป

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
1	Organization Id	FI Code	M	รหัสสถาบันการเงิน	
2	Data Set Date	Date	M	วันที่ชุดข้อมูล	วันที่ของวันศุกร์ในสัปดาห์

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
	1. Reporting Group Details		C		^{1/} 3 – 9 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> 1. ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด 2. ธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในประเทศ รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงาน (116002) - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ (116003) - ชุดรวมทุกสำนักงานต่างประเทศ (116005) 3. กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ (116003)
3	FI Reporting Group Id ^{1/}	Classification	M	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน (Classification Name: FI Reporting Group)	
	1.1 Calculation Date Details		M		^{2/} 4 – 9 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีจำนวนชุดเท่ากับวันทำการของสัปดาห์ที่ รายงาน
4	Calculation Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันที่คำนวณค่า Geek Value	ต้องเป็นวันทำการ
	1.1.1 Geek Type Details				^{3/} 5 – 9 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
5	Greek Type ^{1/ 2/ 3/}	Classification	M	ชื่อของ Limit (Classification Name: Greek Type)	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
	1.1.1.1 Value Type Details		M		^{4/} 6 – 9 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
6	Value Type ^{1/ 2/ 3/ 4/}	Classification	M	ประเภทของข้อมูล (Classification Name: Value Type)	
	1.1.1.1.1 Risk Factor Type Details		M		^{5/} 7 – 9 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
7	Risk Factor Type ^{1/ 2/ 3/ 4/ 5/}	Classification	C	ประเภทของ Risk Factor Type (Classification Name: Risk Factor Type)	<u>เงื่อนไข</u> ในกรณีที่ Greek Type เป็น Delta ต้องไม่มี Risk Factor Type ที่เป็น IR
8	Currency ^{1/ 2/ 3/ 4/ 5/}	Classification	C	สกุลเงินของ Geek Value (Classification Name: Currency Id)	<u>เงื่อนไข</u> ต้องมีค่าในกรณีที่ Risk Factor Type เป็น FX
9	Greek Value ^{1/ 2/ 3/ 4/ 5/}	Amount	M	มูลค่าของ Greek (บาท) เมื่อ Risk Factor เพิ่มขึ้น 1 basis point	

3. PV01 ของความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยของฐานะในบัญชีเพื่อค้า

คำอธิบาย

Data Set ข้อมูล PV01 ของความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ยของฐานะในบัญชีเพื่อค้า แบ่งตามสกุลเงิน และระยะเวลา (Tenor)

สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

ลักษณะข้อมูล

รายวัน

ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

รายสัปดาห์

กำหนดการส่ง

ภายใน 3 วันทำการของสัปดาห์ถัดไป

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
1	Organization Id	FI Code	M	รหัสสถาบันการเงิน	
2	Data Set Date	Date	M	วันที่ชุดข้อมูล	วันที่ของวันศุกร์ในสัปดาห์
	1. <u>Reporting Group Details</u>		C		^{1/} 3 – 12 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> 1. ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
					2. ธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในประเทศไทย รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงาน (116002) - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003) - ชุดรวมทุกสำนักงานต่างประเทศ (116005) 3. กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003)
3.	FI Reporting Group Id ^{1/}	Classification	M	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน (Classification Name: FI Reporting Group)	
	1.1 Calculation Date Details		M		^{2/} 4 – 12 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีจำนวนชุดเท่ากับวันทำการของสัปดาห์ที่ รายงาน
4	Calculation Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันที่คำนวณ PV01 Value	ต้องเป็นวันทำการ
	1.1.1 Currency Details		M		^{3/} 5 – 12 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
5	Currency ^{1/ 2/ 3/}	Classification	M	สกุลเงินของผลิตภัณฑ์ (Classification Name: Currency Id)	
	1.1.1.1 IR Curve Details		M		^{4/} 6 – 12 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u>

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
					ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
6	Product Group ^{1/ 2/ 3/ 4/}	Classification	M	กลุ่มผลิตภัณฑ์ (Classification Name: Product Group)	
7	IR Curve ^{1/ 2/ 3/ 4/}	Classification	M	Interest rate curve ที่ใช้ในการคำนวณค่า PV01 (Classification Name: IR Curve)	
	1.1.1.1.1 Value Type Details		M		^{5/} 8 – 12 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
8	Value Type ^{1/ 2/ 3/ 4/ 5/}	Classification	M	ประเภทของข้อมูล (Classification Name: Value Type)	
9	Tenor From ^{1/ 2/ 3/ 4/ 5/}	Number	M	ตั้งแต่ Tenor	เพื่อระบุช่วง Tenor ของ PV01 Value : <u>ตัวอย่างที่ 1</u> Tenor O/N ให้รายงานดังนี้ Tenor From : 1 Tenor To : 1 Tenor Unit : วัน <u>ตัวอย่างที่ 2</u> Tenor 3–6 เดือน ให้รายงานดังนี้ Tenor Form : 3 Tenor To : 6 Tenor Unit : เดือน <u>ตัวอย่างที่ 2</u>
10	Tenor To ^{1/ 2/ 3/ 4/ 5/}	Number	O	ถึง Tenor	
11	Tenor Unit ^{1/ 2/ 3/ 4/ 5/}	Classification	M	หน่วยของ Tenor (Classification Name : Term Unit)	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
					Tenor 30 ปีขึ้นไป ให้รายงานดังนี้ Tenor Form : 30 Tenor To : (ไม่มีค่า) Tenor Unit : ปี
12	PV01 Value ^{1/ 2/ 3/ 4/ 5/}	Amount	M	มูลค่าของ PV01	

4. จำนวนครั้งที่ผลขาดทุนที่เกิดขึ้นจริง เกินเพดานผลขาดทุนสูงสุดของธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า

คำอธิบาย

Data Set ข้อมูลจำนวนครั้งที่ผลขาดทุนที่เกิดขึ้นจริง (Actual Loss) เกินเพดานผลขาดทุนสูงสุด (Stop Loss Limit) ของธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า

สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

ลักษณะข้อมูล

รายเดือน

ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

ทุกสิ้นเดือน

กำหนดการส่ง

ภายใน 21 นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
1	Organization Id	FI Code	M	รหัสสถาบันการเงิน	
2	Data Set Date	Date	M	วันที่ชุดข้อมูล	
	1. Reporting Group Details		C		^{1/} 3 – 4 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> กรณีเป็นธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในประเทศไทย รายงาน

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
					<ul style="list-style-type: none"> - ชุดรวมทุกสำนักงาน (116002) - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ (116003) - ชุดรวมทุกสำนักงานต่างประเทศ (116005) <p>กรณีเป็นสาขานาการพาณิชย์ต่างประเทศ รายงาน</p> <ul style="list-style-type: none"> - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ (116003)
3	FI Reporting Group Id ^{1/}	Classification	M	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน (Classification Name: FI Reporting Group)	
4	Number of Breaching Stop Loss Limit ^{1/}	Number	O	จำนวนครั้งที่ผลขาดทุนที่เกิดขึ้นจริง (Actual Loss) เกินเพดานผลขาดทุนสูงสุด (Stop Loss Limit) ของธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า	กรณีไม่ทำมีธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า ให้รายงานเป็นค่าว่าง

5. ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม

คำอธิบาย

Data Set ข้อมูลธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม (Market Derivatives by Products)

สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

ลักษณะข้อมูล

รายเดือน

ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

ทุกสิ้นเดือน

กำหนดการส่ง

ภายใน 21 นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
1	Organization Id	FI Code	M	รหัสสถาบันการเงิน	
2	Data Set Date	Date	M	วันที่ชุดข้อมูล	
	1. <u>Reporting Group Details</u>		C		^{1/} 3 – 8 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> 1. ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
					2. ธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในประเทศไทย รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงาน (116002) - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003) - ชุดรวมทุกสำนักงานต่างประเทศ (116005) 3. กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003)
3	FI Reporting Group Id ^{1/}	Classification	M	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน (Classification Name: FI Reporting Group)	
	1.1 Product Type Details		M		^{2/} 4 – 8 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
4	Product Type ^{1/ 2/}	Classification	M	ประเภทธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ได้รับอนุญาต (Classification Name: Market Derivatives Type)	
	1.1.1 Reference Variable Details		M		^{3/} 5 – 8 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
5	Reference Variable ^{1/ 2/ 3/}	Classification	M	ตัวแปรอ้างอิงที่ได้รับอนุญาต	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
				(Classification Name: Reference Variable Type)	
6	Notional Amount Outstanding ^{1/ 2/ 3/}	Amount	M	จำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่	ในกรณีธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่มีขารับหรือขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน Outstanding currency และ Outstanding amount ของขาที่เป็นเงินตราต่างประเทศ หรือหากเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ทั้งขารับและขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน Outstanding currency และ Outstanding amount ของขารับ
7	Mark-to-Market ^{1/ 2/ 3/}	Amount	M	มูลค่าที่ได้จากการ Mark-to-market อนุพันธ์ย่อยทั้งหมด ณ วันที่รายงานเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท”	
8	Realized PnL ^{1/ 2/ 3/}	Amount	M	มูลค่ากำไร (ขาดทุน) จากที่เกิดจากการชำระราคา (settle) /การทำสัญญาใหม่ในทางตรงข้ามกับสัญญาเดิมโดยที่สัญญาทั้งสองยังมีผลบังคับจนสัญญาครบกำหนด (unwind) /การได้รับมอบหรือส่งมอบเงินตราต่างประเทศตามธุรกรรมอนุพันธ์ก่อนวันครบกำหนดชำระเงิน (early taken up) /ดอกเบี้ยรับ หรือ ดอกเบี้ยจ่ายสำหรับธุรกรรมที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ย รวมทั้งกำไรที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (Margin) และ	กรณี Desk Type = Sale จะใส่มูลค่าเท่ากับ กำไรที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (Margin) รวมค่าธรรมเนียมต่างๆ (fee) ทั้งนี้ ให้รายงานเฉพาะมูลค่า Realized PnL ที่เกิดขึ้นในเดือนนั้น

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
				ค่าธรรมเนียมที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (fee)	

ร่าง

6. ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา

คำอธิบาย

Data Set ข้อมูลธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา (Market derivatives by transactions)

สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

ลักษณะข้อมูล

รายเดือน

ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

ทุกสิ้นเดือน

กำหนดการส่ง

ภายใน 21 นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
1	Organization Id	FI Code	M	รหัสสถาบันการเงิน	
2	Data Set Date	Date	M	วันที่ชุดข้อมูล	
	1. <u>Reporting Group Details</u>		C		^{1/} 3 – 26 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> 1. ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
					2. ธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในประเทศไทย รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003) - ชุดรวมทุกสำนักงานต่างประเทศ (116005) 3. กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003)
3	FI Reporting Group Id ^{1/}	Classification	M	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน (Classification Name: FI Reporting Group)	
	1.1 Transaction Details		O		^{2/} 4 – 26 = Repeating Data Elements
4	Reference No. ^{1/ 2/}	Identification Number	M	เลขที่อ้างอิงของธุรกรรม เช่น เลขที่บัญชี เลขที่ Confirmation หรือเลขที่สัญญา	
5	New Product Flag ^{1/ 2/}	Flag	M	รายงานค่า “1” ในกรณีเป็นธุรกรรมที่ ธนาคารพาณิชย์ทำเป็นครั้งแรก โดย รายงานเฉพาะในงวดที่ทำสัญญาเท่านั้น นอกจากนั้นให้รายงาน “0”	
6	Trade Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันทำสัญญา	
7	Effective Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันที่กำหนดมูลค่า	
8	Maturity Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันครบกำหนดสัญญา	
9	Name of Product ^{1/ 2/}	Long Name	M	ชื่อเรียกธุรกรรมซึ่งเป็นที่รู้จักกันทั่วไปหรือ ชื่อทางการค้าของธุรกรรมอนุพันธ์นั้น	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
10	Group of Product ^{1/ 2/}	Classification	M	กลุ่มของประเภทผลิตภัณฑ์ (Classification Name: Group of Product Type)	
11	Counterparty type ^{1/ 2/}	Classification	M	ประเภทคู่สัญญา (Classification Name: Counterparty type)	
12	Counterparty Name ^{1/ 2/}	Long Name	M	ชื่อคู่สัญญา	
13	Notional Currency ^{1/ 2/}	Classification	M	สกุลเงินของ Notional Amount (Classification Name: Currency Id)	ในกรณีธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่มีขารับหรือขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงานสกุลเงินของขาที่เป็นเงินตราต่างประเทศ หรือหากเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ทั้งขารับและขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงานสกุลเงินของขา
14	Notional Amount Outstanding (Baht Equivalent) ^{1/ 2/}	Amount	M	จำนวนเงินบาทเทียบเท่า (Baht Equivalent) ในการทำธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับเงินตราต่างประเทศ โดยในการคำนวณมูลค่า Baht equivalent ให้ใช้อัตรากลาง (Mid rate) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศที่ประกาศทางเว็บไซต์ของธนาคารแห่งประเทศไทย ณ วันสิ้นงวดการรายงานซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยของอัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนและอัตราขายถัวเฉลี่ย	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
				(อัตราซื้อถัวเฉลี่ย + อัตราขายถัวเฉลี่ย) / 2) ทั้งนี้ กรณีเป็นธุรกรรมที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้ธนาคารพาณิชย์รายงาน Notional Amount ด้วยมูลค่า "0"	
15	Reference Variables ^{1/ 2/}	Classification	M	ประเภทของตัวแปรอ้างอิงในการทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด (Classification Name: Reference Variables Type)	
16	Reference Details ^{1/ 2/}	Long Name	M	ชนิดหรือรายละเอียดของตัวแปรอ้างอิง เช่น USD/THB กรณีที่ประเภทตัวแปรอ้างอิงเป็นอัตราแลกเปลี่ยน ทั้งนี้ กรณีเป็นธุรกรรมที่อ้างอิงตัวแปรที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทย กำหนด ให้ธนาคารพาณิชย์รายงานรายละเอียดหรือวิธีการคำนวณตัวแปรอ้างอิงโดยละเอียด	
17	Payout ^{1/ 2/}	Description	M	รายละเอียด (สูตร) ของการคำนวณในการรับ-จ่ายเงินในธุรกรรมดังกล่าวในมุมมองของธนาคารพาณิชย์	โปรดดูตัวอย่างในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วย หลักเกณฑ์การอนุญาตให้ธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด (Market Derivatives)
18	Derivative Components ^{1/ 2/}	Description	M	รายละเอียดธุรกรรมอนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบของธุรกรรมอนุพันธ์ด้าน	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
				ตลาดที่ทำ พร้อมทั้งระบุว่าธนาคารพาณิชย์ ทำธุรกรรมย่อยดังกล่าวในฐานะผู้ซื้อ หรือ ผู้ขาย หรือผู้รับ หรือผู้จ่าย ตามแต่ละ ธุรกรรมอนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบ ของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดดังกล่าว ทั้งนี้ ในกรณีที่ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด ดังกล่าวไม่สามารถแยกองค์ประกอบย่อย ได้ ให้อธิบายรายละเอียดของธุรกรรม	
19	Type of Delivery ^{1/ 2/}	Classification	M	รายงานธุรกรรมกำหนดเงื่อนไขการส่ง มอบและชำระราคาเป็นสินทรัพย์อ้างอิง (Physical settlement) หรือเงินสด (Cash settlement) (Classification Name: Type of Delivery)	
20	Purpose ^{1/ 2/}	Classification	M	วัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม (Classification Name: Purpose Type)	
21	Effective Notional Amount ^{1/ 2/}	Amount	M	จำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงของธุรกรรม อนุพันธ์ด้านตลาดเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้ หน่วย “บาท” หากเป็นธุรกรรมที่ทำและสิ้นสุดในระหว่าง งวด ให้ธนาคารพาณิชย์รายงานด้วยมูลค่า ศูนย์	ให้ธนาคารพาณิชย์อ้างอิงวิธีการหาจำนวนเงินตาม สัญญาที่แท้จริงตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดใน ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วย หลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต ของคู่สัญญาสำหรับธุรกรรมอนุพันธ์

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
22	Mark-to-Market ^{1/ 2/}	Amount	M	มูลค่าที่ได้จากการ Mark-to-market อนุพันธ์ย่อยทั้งหมด ณ วันที่รายงานเป็น สกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” หากเป็นธุรกรรมที่ทำและสิ้นสุดในระหว่าง งวด ให้ธนาคารพาณิชย์รายงานด้วยมูลค่า ยุติธรรม ณ วันที่ธุรกรรมสิ้นสุด	
23	Realized PnL ^{1/ 2/}	Amount	M	มูลค่ากำไร (ขาดทุน) จากที่เกิดจากการ ชำระราคา (settle) /การทำสัญญาใหม่ใน ทางตรงข้ามกับสัญญาเดิมโดยที่สัญญาทั้งสอง ยังมีผลบังคับจนสัญญาครบกำหนด (unwind) /การได้รับมอบหรือส่งมอบ เงินตราต่างประเทศตามธุรกรรมอนุพันธ์ ก่อนวันครบกำหนดชำระเงิน (early taken up) /ดอกเบี้ยรับ หรือ ดอกเบี้ยจ่ายสำหรับ ธุรกรรมที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ย รวมทั้งกำไร ที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (Margin) และ ค่าธรรมเนียมที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (fee)	กรณี Desk Type = Sale จะใส่มูลค่าเท่ากับ กำไร ที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (Margin) รวม ค่าธรรมเนียมต่างๆ (fee) ทั้งนี้ ให้รายงานเฉพาะมูลค่า Realized PnL ที่ เกิดขึ้นในเดือนนั้น
24	Gain or Loss ^{1/ 2/}	Amount	M	มูลค่ากำไรหรือขาดทุนจากการทำธุรกรรม ณ วันที่รายงานโดยเปรียบเทียบกับวันสิ้น เดือนก่อนหน้า เป็นสกุลเงินบาทโดยใช้ หน่วย “บาท”	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
25	Approval Letter No. ^{1/ 2/}	Long Name	O	เลขที่หนังสือให้ความเห็นชอบการทำ ธุรกรรมจากธนาคารแห่งประเทศไทยใน กรณีเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ต้อง ได้รับความเห็นชอบจากธนาคารแห่ง ประเทศไทย (ถ้ามี)	
26	Notes ^{1/ 2/}	Description	O	รายงานรายละเอียดเพิ่มเติมอื่น ๆ จากการ ทำธุรกรรม (ถ้ามี)	

7. ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต

คำอธิบาย

Data Set ข้อมูลธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต (Credit derivatives)

สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

ลักษณะข้อมูล

รายเดือน

ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

ทุกสิ้นเดือน

กำหนดการส่ง

ภายใน 21 นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
1	Organization Id	FI Code	M	รหัสสถาบันการเงิน	
2	Data Set Date	Date	M	วันที่ชุดข้อมูล	
	1. <u>Reporting Group Details</u>		C		^{1/} 4 – 30 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> 1. ต้องมีค่าน้อย 1 ชุด

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
					2. ธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในประเทศไทย รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003) - ชุดรวมทุกสำนักงานต่างประเทศ (116005) 3. กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003)
3	FI Reporting Group Id ^{1/}	Classification	M	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน (Classification Name: FI Reporting Group)	
	1.1 Transaction Details		O		^{2/} 3 – 30 = Repeating Data Elements
4	Reference No. ^{1/ 2/}	Identification Number	M	เลขที่อ้างอิงของธุรกรรม เช่น เลขที่บัญชี เลขที่ Confirmation หรือเลขที่สัญญา	
5	New Product Flag ^{1/ 2/}	Flag	M	รายงานค่า “1” ในกรณีเป็นธุรกรรมที่ธนาคารพาณิชย์ทำเป็นครั้งแรก โดยรายงานเฉพาะในงวดที่ทำสัญญาเท่านั้น นอกจากนั้นให้รายงาน “0”	
6	Trade Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันทำสัญญา	
7	Effective Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันที่กำหนดมูลค่า	
8	Maturity Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันครบกำหนดสัญญา	
9	Type of Product ^{1/ 2/}	Classification	M	ประเภทของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต (Classification Name: Type of Product)	
10	Counterparty Type ^{1/ 2/}	Classification	M	ประเภทคู่สัญญา	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
				(Classification Name : Counterparty Type)	
11	Counterparty Name ^{1/ 2/}	Long Name	M	ชื่อคู่สัญญา	
12	Notional Currency ^{1/ 2/}	Classification	M	สกุลเงินของ Notional Amount (Classification Name: Currency Id)	
14	Notional Amount Baht Equivalent ^{1/ 2/}	Amount	M	จำนวนเงินบาทเทียบเท่า (Baht Equivalent) ในการทำธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับเงินตราต่างประเทศ โดยในการคำนวณมูลค่า Baht equivalent ให้ใช้อัตรากลาง (Mid rate) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศที่ประกาศทางเว็บไซต์ของธนาคารแห่งประเทศไทย ณ วันสิ้นงวดการรายงานซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยของอัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนและอัตราขายถัวเฉลี่ย $(\text{อัตราซื้อถัวเฉลี่ย} + \text{อัตราขายถัวเฉลี่ย}) / 2$ ทั้งนี้ กรณีเป็นธุรกรรมที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้ธนาคารพาณิชย์รายงาน Notional Amount ด้วยมูลค่าศูนย์	
15	Reference Obligations Name ^{1/ 2/}	Long Name	M	ระบุชื่อ รุ่น ของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ใช้อ้างอิงสำหรับการจ่ายชำระเงินภายใต้สัญญาอนุพันธ์ด้านเครดิต	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
16	Reference Obligations Maturity ^{1/ 2/}	Date	M	วันครบกำหนดสัญญา ของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ใช้อ้างอิงสำหรับการจ่ายชำระเงินภายใต้สัญญาอนุพันธ์ด้านเครดิต	
17	Reference Obligations Currency ^{1/ 2/}	Classification	M	สกุลเงิน ของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ใช้อ้างอิงสำหรับการจ่ายชำระเงินภายใต้สัญญาอนุพันธ์ด้านเครดิต (Classification Name : Currency Id)	
18	Underlying Obligations Name ^{1/ 2/}	Long Name	O	ระบุชื่อ รุ่น ของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ธนาคารพาณิชย์มีฐานะอยู่และต้องการป้องกันความเสี่ยงโดยใช้ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต ซึ่งอาจเป็นสินทรัพย์หรือภาระผูกพันเดียวกับ Reference obligations (ถ้ามี)	
19	Underlying Obligations Maturity ^{1/ 2/}	Date	O	วันครบกำหนดสัญญา ของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ธนาคารพาณิชย์มีฐานะอยู่และต้องการป้องกันความเสี่ยงโดยใช้ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต ซึ่งอาจเป็นสินทรัพย์หรือภาระผูกพันเดียวกับ Reference obligations (ถ้ามี)	
20	Underlying Obligations Currency ^{1/ 2/}	Classification	O	สกุลเงิน ของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ธนาคารพาณิชย์มีฐานะอยู่และต้องการป้องกันความเสี่ยงโดยใช้ธุรกรรมอนุพันธ์	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
				ด้านเครดิต ซึ่งอาจเป็นสินทรัพย์หรือภาระผูกพันเดียวกับ Reference obligations (ถ้ามี) (Classification Name: Currency Id)	
21	Derivative Components ^{1/ 2/}	Description	M	รายละเอียดธุรกรรมอนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ทำ เฉพาะกรณีเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ความเห็นชอบ พร้อมทั้งระบุฐานะของธนาคารพาณิชย์ในการทำธุรกรรมย่อยดังกล่าว ทั้งนี้ ในกรณีที่ธุรกรรมดังกล่าวไม่สามารถแยกองค์ประกอบย่อยได้ให้อธิบายรายละเอียดของธุรกรรม	
22	Purpose ^{1/ 2/}	Classification	M	วัตถุประสงค์หลักของการทำธุรกรรม (Classification Name: Purpose Type)	
23	Effective Notional Amount ^{1/ 2/}	Amount	M	จำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท”	ให้ธนาคารพาณิชย์อ้างอิงวิธีการหาจำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของคู่สัญญาสำหรับธุรกรรมอนุพันธ์

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
24	Mark-to-Market ^{1/ 2/}	Amount	M	มูลค่าที่ได้จากการ Mark-to-market อนุพันธ์ย่อยทั้งหมด ณ วันที่รายงานเป็น สกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท”	
25	Realized PnL ^{1/ 2/}	Amount	M	มูลค่ากำไร (ขาดทุน) จากที่เกิดจากการ ชำระราคา (settle) / การทำสัญญาใหม่ใน ทางตรงข้ามกับสัญญาเดิมโดยที่สัญญาทั้ง สองยังมีผลบังคับจนสัญญาครบกำหนด (unwind) / การได้รับมอบหรือส่งมอบ เงินตราต่างประเทศตามธุรกรรมอนุพันธ์ ก่อนวันครบกำหนดชำระเงิน (early taken up) / ดอกเบี้ยรับ หรือ ดอกเบี้ยจ่ายสำหรับ ธุรกรรมที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ย รวมทั้งกำไร ที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (Margin) และ ค่าธรรมเนียมที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (fee)	กรณี Desk Type = Sale จะใส่มูลค่าเท่ากับ กำไร ที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (Margin) รวม ค่าธรรมเนียมต่าง ๆ (fee) ทั้งนี้ ให้รายงานเฉพาะมูลค่า Realized PnL ที่ เกิดขึ้นในเดือนนั้น
26	Gain or Loss ^{1/ 2/}	Amount	M	มูลค่ากำไรหรือขาดทุนจากการทำธุรกรรม ณ วันที่รายงานโดยเปรียบเทียบกับวันสิ้น เดือนก่อนหน้า เป็นสกุลเงินบาทโดยใช้ หน่วย “บาท”	
27	Protection Buyer or Seller ^{1/ 2/}	Classification	M	รายงานว่าธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรม อนุพันธ์ด้านเครดิตดังกล่าวในฐานะเป็นผู้ โอนความเสี่ยงด้านเครดิตให้รายงาน	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
				“Protection buyer” หรือผู้รับโอนความเสี่ยงด้านเครดิตให้รายงาน “Protection seller” (Classification Name: Protection Buyer or Seller Type)	
28	Rating ^{1/ 2/}	Short Name	O	อันดับความน่าเชื่อถือของตราสารในกรณีเป็นธุรกรรม Funded credit derivatives ที่ได้รับจากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือภายนอก (ถ้ามี)	
29	Approval Letter No. ^{1/ 2/}	Long Name	O	เลขที่หนังสือให้ความเห็นชอบการทำธุรกรรมจากธนาคารแห่งประเทศไทยในกรณีเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ต้องได้รับความเห็นชอบจากธนาคารแห่งประเทศไทย (ถ้ามี)	
30	Notes ^{1/ 2/}	Description	O	รายงานรายละเอียดเพิ่มเติมอื่น ๆ จากการทำธุรกรรม (ถ้ามี)	

8. ธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝง

คำอธิบาย

Data Set ข้อมูลธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝง (Structured Products)

สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

ลักษณะข้อมูล

รายเดือน

ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

ทุกสิ้นเดือน

กำหนดการส่ง

ภายใน 21 นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
1	Organization Id	FI Code	M	รหัสสถาบันการเงิน	
2	Data Set Date	Date	M	วันที่ชุดข้อมูล	
	1. <u>Reporting Group Details</u>		C		^{1/} 3 – 29 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> 1. ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
					2. ธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในประเทศ รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ (116003) - ชุดรวมทุกสำนักงานต่างประเทศ (116005) 3. กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศ (116003)
3	FI Reporting Group Id ^{1/}	Classification	M	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน (Classification Name: FI Reporting Group)	
	1.1 Transaction Details		O		^{2/} 4 – 29 = Repeating Data Elements
4	Reference No. ^{1/ 2/}	Identification Number	M	เลขที่อ้างอิงของธุรกรรม เช่น เลขที่บัญชี เลขที่ Confirmation หรือเลขที่สัญญา	
5	New Product Flag ^{1/ 2/}	Flag	M	รายงานค่า “1” ในกรณีเป็นธุรกรรมที่ ธนาคารพาณิชย์ทำเป็นครั้งแรก โดย รายงานเฉพาะในงวดที่ทำสัญญาเท่านั้น นอกจากนั้นให้รายงาน “0”	
6	Trade Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันทำสัญญา	
7	Effective Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันที่กำหนดมูลค่า	
8	Maturity Date ^{1/ 2/}	Date	M	วันครบกำหนดสัญญา	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
9	Name of Product ^{1/ 2/}	Long Name	M	ชื่อเรียกธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งเป็นที่รู้จักกันทั่วไปหรือชื่อทางการค้าของธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น	
10	Type of Product ^{1/ 2/}	Classification	M	ประเภทของธุรกรรมเงินกู้ยืม (Classification Name: Type of Product)	
11	Counterparty Type ^{1/ 2/}	Classification	M	ประเภทคู่สัญญา (Classification Name: Counterparty Type)	
12	Counterparty Name ^{1/ 2/}	Long Name	M	ชื่อคู่สัญญา	
13	Borrower or Lender ^{1/ 2/}	Classification	M	รายงานว่าธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวในฐานะเป็นผู้กู้ยืมหรือผู้ให้กู้ยืม (Classification Name: Borrower or Lender Type)	
14	Notional Currency ^{1/ 2/}	Classification	M	สกุลเงินของจำนวนเงินตามสัญญาของธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝง (Classification Name: Currency Id)	ในกรณีธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝงมีขารับหรือขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงานสกุลเงิน ของขาที่เป็นเงินตราต่างประเทศ หรือหากเป็นธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝงที่ทั้งขารับและขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงานสกุลเงิน ของขารับ
16	Notional Amount Baht Equivalent ^{1/ 2/}	Amount	M	จำนวนเงินในการทำธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับเงินตราต่างประเทศ โดยในการคำนวณ	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
				มูลค่า Baht equivalent ให้ใช้อัตรากลาง (Mid rate) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศที่ประกาศทางเว็บไซต์ของ ธนาคารแห่งประเทศไทย ณ วันสิ้นงวดการรายงานซึ่งคำนวณจาก ค่าเฉลี่ยของอัตราซื้อตั๋วเงินโอนและ อัตราขายตั๋วเงิน([อัตราซื้อตั๋วเงิน + อัตราขายตั๋วเงิน] / 2)	
17	Reference Variables ^{1/ 2/}	Classification	M	ประเภทของตัวแปรอ้างอิงในการทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด ได้แก่ อัตราดอกเบี้ย อัตราแลกเปลี่ยน ราคาตราสารหนี้ ราคาตราสารทุน ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ เครดิต ผลการดำเนินงานของกองทุน อัตราเงินเฟ้อ ดัชนีทางการเงิน และอื่นๆ	
18	Reference Variables Details ^{1/ 2/}	Long Name	M	ชนิดหรือรายละเอียดของตัวแปรอ้างอิง ทั้งนี้ กรณีเป็นธุรกรรมที่อ้างอิงตัวแปรที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด ให้ธนาคารพาณิชย์ รายงานรายละเอียดหรือวิธีการคำนวณตัวแปรอ้างอิงโดยละเอียด	
19	Payout ^{1/ 2/}	Description	M	รายละเอียด (สูตร) ของการคำนวณในการรับ-จ่ายเงินในธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์แฝงในมุมมองของธนาคารพาณิชย์	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
20	Delivery ^{1/ 2/}	Classification	O	เงื่อนไขการส่งมอบคืนหรือได้รับคืน (Classification Name: Type of Delivery)	
21	Purpose ^{1/ 2/}	Classification	M	วัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม (Classification Name: Purpose Type)	
22	Derivative Components ^{1/ 2/}	Description	M	รายละเอียดของอนุพันธ์ทั้งหมดที่แฝงอยู่ เช่น อนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบของ อนุพันธ์แฝง แต่ละอนุพันธ์ย่อยนั้นธนาคาร พาณิชย์ทำธุรกรรมในด้านใด (ซารับ/จ่าย) จำนวนเงินในอนุพันธ์ย่อย (ระบุ เฉพาะเจาะจงสำหรับแต่ละอนุพันธ์ย่อย) มี ตัวแปรอ้างอิงใดบ้าง ราคาใช้สิทธิ อายุหรือ วันสิ้นสุดของธุรกรรมย่อย เป็นต้น ทั้งนี้ ใน กรณีที่ธุรกรรมดังกล่าวไม่สามารถแยก องค์ประกอบย่อยได้ให้อธิบายรายละเอียด ของธุรกรรม	
23	Effective Notional Amount ^{1/ 2/}	Amount	M	จำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงของธุรกรรม อนุพันธ์ด้านตลาดเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้ หน่วย “บาท” พร้อมทศนิยม 2 ตำแหน่ง โดยให้ธนาคารพาณิชย์อ้างอิงวิธีการหา จำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงตาม หลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศธนาคาร แห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การ	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
				คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของ คู่สัญญาสำหรับธุรกรรมอนุพันธ์	
24	Mark-to-Market ^{1/ 2/}	Amount	M	มูลค่าที่ได้จากการ Mark-to-market อนุพันธ์ย่อยทั้งหมด ณ วันที่รายงานเป็น สกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท”	
25	Realized PnL ^{1/ 2/}	Amount	M	มูลค่ากำไร (ขาดทุน) จากที่เกิดจากการ ชำระราคา (settle) / การทำสัญญาใหม่ใน ทางตรงข้ามกับสัญญาเดิมโดยที่สัญญาทั้ง สองยังมีผลบังคับจนสัญญาครบกำหนด (unwind) / การได้รับมอบหรือส่งมอบ เงินตราต่างประเทศตามธุรกรรมอนุพันธ์ ก่อนวันครบกำหนดชำระเงิน (early taken up) / ดอกเบี้ยรับ หรือ ดอกเบี้ยจ่ายสำหรับ ธุรกรรมที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ย รวมทั้งกำไร ที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (Margin) และ ค่าธรรมเนียมที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (fee)	กรณี Desk Type = Sale จะใส่มูลค่าเท่ากับ กำไร ที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (Margin) รวม ค่าธรรมเนียมต่าง ๆ (fee) ทั้งนี้ ให้รายงานเฉพาะมูลค่า Realized PnL ที่ เกิดขึ้นในเดือนนั้น
26	Gain or Loss ^{1/ 2/}	Amount	M	มูลค่ากำไรหรือขาดทุนจากการทำธุรกรรม ณ วันที่รายงานโดยเปรียบเทียบกับวันสิ้น เดือนก่อนหน้า เป็นสกุลเงินบาทโดยใช้ หน่วย “บาท”	
27	Principal Protection (%) ^{1/ 2/}	Percentage	M	รายงานร้อยละของเงินต้นขั้นต่ำที่ผู้ให้กู้ยืม จะได้รับชำระคืนเมื่อสิ้นสุดสัญญา (ในกรณี	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
				ไม่มีการคุ้มครองเงินต้นให้รายงานด้วยค่า 0)	
28	Approval Letter No. ^{1/ 2/}	Long Name	O	ให้รายงานเลขที่หนังสือให้ความเห็นชอบ การทำธุรกรรมจากธนาคารแห่งประเทศไทย ในกรณีเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด ที่ต้องได้รับความเห็นชอบจากธนาคารแห่ง ประเทศไทย (ถ้ามี)	
29	Notes ^{1/ 2/}	Description	O	รายละเอียดเพิ่มเติมอื่น ๆ จากการทำ ธุรกรรม (ถ้ามี)	

9. เป้าหมาย และกำไร ขาดทุนที่เกิดขึ้นจริงของธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า แบ่งตามโต๊ะ

คำอธิบาย

Data Set ข้อมูลเป้าหมายและกำไร/ขาดทุนที่เกิดขึ้นจริงของธุรกรรมในบัญชีเพื่อการค้า แบ่งตามโต๊ะ

สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

ลักษณะข้อมูล

รายเดือน

ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

ทุกสิ้นเดือน

กำหนดการส่ง

ภายใน 21 นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
1	Organization Id	FI Code	M	รหัสสถาบันการเงิน	
2	Data Set Date	Date	M	วันที่ชุดข้อมูล	
	1. <u>Reporting Group Details</u>		C		^{1/} 3 – 8 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> 1. ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
					2. ธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในประเทศไทย รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงาน (116002) - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003) - ชุดรวมทุกสำนักงานต่างประเทศ (116005) 3. กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003)
3	FI Reporting Group Id ^{1/}	Classification	M	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน (Classification Name: FI Reporting Group)	
	1.1 PnL Type Details		M		^{2/} 4 – 8 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
4	PnL Type ^{1/ 2/}	Classification	M	ประเภทกำไรขาดทุน (Classification Name: PnL Type)	
	1.1.1 Desk Type Details		M		^{3/} 5 – 8 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด
5	Desk Type ^{1/ 2/ 3/}	Classification	M	โต๊ะในห้งค์ค้า (Classification Name: Desk Type)	

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
6	Desk Name ^{1/ 2/ 3/}	Long Name	M	ชื่อโต๊ะในห้องค้า (ภาษาอังกฤษ) ตามสถาบันการเงิน	
7	Customer Type ^{1/ 2/ 3/}	Classification	M	โต๊ะแยกตามประเภทของลูกค้า แบ่งออกเป็น 1. Bank 2.Non-Bank และ 3. All (Classification Name: Customer Type)	ในกรณีโต๊ะดังกล่าวทำธุรกรรมทั้งกับลูกค้าที่เป็น Bank และ Non-Bank ให้รายงาน All
8	Mark-to-Market ^{1/ 2/ 3/}	Amount	C	มูลค่ากำไร (ขาดทุน) จากการประเมินมูลค่ายุติธรรมในตราสารหนี้ ตราสารทุน รวมทั้งตราสารอนุพันธ์เพื่อการค้าแยกตามประเภท Product Type	จะมีค่าเฉพาะ Desk Type = Trading
9	Realized PnL ^{1/ 2/ 3/}	Amount	M	มูลค่ากำไร (ขาดทุน) จากที่เกิดจากการชำระราคา (settle) /การทำสัญญาใหม่ในทางตรงข้ามกับสัญญาเดิมโดยที่สัญญาทั้งสองยังมีผลบังคับจนสัญญาครบกำหนด (unwind) /การได้รับมอบหรือส่งมอบเงินตราต่างประเทศตามธุรกรรมอนุพันธ์ก่อนวันครบกำหนดชำระเงิน (early taken up) /ดอกเบี้ยรับ หรือ ดอกเบี้ยจ่ายสำหรับธุรกรรมที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ย รวมทั้งกำไรที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (Margin) และค่าธรรมเนียมที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (fee)	กรณี Desk Type = Sale จะใส่มูลค่าเท่ากับ กำไรที่ได้รับจากการทำธุรกรรม (Margin) รวมค่าธรรมเนียมต่าง ๆ (fee)

10. Credit Valuation Adjustment ของธุรกรรมอนุพันธ์ทางการเงิน

คำอธิบาย

Data Set ข้อมูล Credit Valuation Adjustment (CVA) ของธุรกรรมอนุพันธ์ทางการเงิน

สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน

ธนาคารพาณิชย์ไทย

ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ

สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

ลักษณะข้อมูล

รายเดือน

ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

ทุกสิ้นเดือน

กำหนดการส่ง

ภายใน 21 ของเดือนถัดไป

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
1	Organization Id	FI Code	M	รหัสสถาบันการเงิน	
2	Data Set Date	Date	M	วันที่ชุดข้อมูล	
	1. <u>Reporting Group Details</u>		C		^{1/} 3 – 8 = Repeating Data Elements <u>เงื่อนไข</u> 1. ต้องมีอย่างน้อย 1 ชุด

No.	Data Element	Data Type	M / O / C	Description	รายละเอียดเพิ่มเติม
					2. ธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในประเทศไทย รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงาน (116002) - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003) - ชุดรวมทุกสำนักงานต่างประเทศ (116005) 3. กรณีเป็นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ รายงาน - ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (116003)
3	FI Reporting Group Id ^{1/}	Classification	M	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน (Classification Name: FI Reporting Group)	
4	Sovereign CVA Value ^{1/}	Amount	M	CVA ของคู่สัญญาที่จัดเป็น “ลูกหนี้ภาครัฐบาล”	ให้อ้างอิงนิยามลูกหนี้ตามประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การคำนวณ สินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตสำหรับธนาคารพาณิชย์ โดย Internal Rating-Based Approach (วิธี IRB)
5	FI CVA Value ^{1/}	Amount	M	CVA ของคู่สัญญาที่จัดเป็น “ลูกหนี้สถาบันการเงิน”	
6	Corporate CVA Value ^{1/}	Amount	M	CVA ของคู่สัญญาที่จัดเป็น “ลูกหนี้ภาคธุรกิจ”	
7	Retail CVA Value ^{1/}	Amount	M	CVA ของคู่สัญญาที่จัดเป็น “ลูกหนี้รายย่อย”	
8	Others CVA Value ^{1/}	Amount	M	CVA ของคู่สัญญาที่จัดเป็น ลูกหนี้ประเภทอื่นๆ ที่ไม่เข้าข่ายข้างต้น	

Appendix Data Type

Data Type Name	Data Type	Format	Remark	Sample
Date	Char(10)	YYYY-MM-DD	A.D. year	'2002-09-11'
Amount	Number(20,2)	NNNNNNNNNN.NN	No leading zeroes	'102000020.20'
Classification	VarChar(6)	AAAA	No leading zeroes/blanks	'12345'
Number	Number(12)	N	No leading zeroes	'12'
Identification Number	VarChar(40)	AAAA	No leading zeroes/blanks	'12345'
Long Name	VarChar(200)	AAAA	No leading zeroes/blanks	'XXX'
Short Name	VarChar(40)	AAAA	No leading zeroes/blanks	'XXX111'
Description	VarChar(400)	AAAA	No leading zeroes/blanks	'XXX111'
Flag	Char(1)	'1' or '0'	Only two values	
Interest Rate	Number(8,5)	NNN.NNNNN	No leading zeroes	'12.50'
Exchange Rate	Number(12,7)	NNNNN.NNNNNNN		
Price	Number(12,7)	NNNNN.NNNNNNN		
FI Code	Char(3)		See Standard Code	
Business Type	Char(7)		See Standard Code	
Branch Code	Char(4)		See Standard Code	
Tax Id	Number(13)			
Personal Id	Number(13)			
SWIFT Code	VarChar(12)			
Passport Number	Char(20)			
Gender Code	Char(1)	'M' or 'F'		

Data Type Name	Data Type	Format	Remark	Sample
Juristic Code	VarChar(13)			
Fee Rate	Number(12,5)	NNNNNNN.NNNNN		
Conversion Rate	Number(8,5)	NNN.NNNNN	No leading zeroes	
LongNameCRLF	VarChar(200)	AAAA	No leading zeroes/blanks	'XXX'
Percentage	Number(9,4)	NNNNN.NNNN	No leading Zeroes	2.4500