



(๒๔๘๕-๒๕๖๐)

ธนาการแห่งประเทศไทย

การประชุมชี้แจงการปรับปรุง  
ชุดข้อมูล (Data Set)  
ในระบบ DMS ประจำปี 2560

ฝ่ายเทคโนโลยีสารสนเทศ

18 กรกฎาคม 2560

- ความเป็นมา
- ภาพรวมของการปรับปรุงชุดข้อมูล
- การรายงานข้อมูล

## ประกาศที่เกี่ยวข้อง

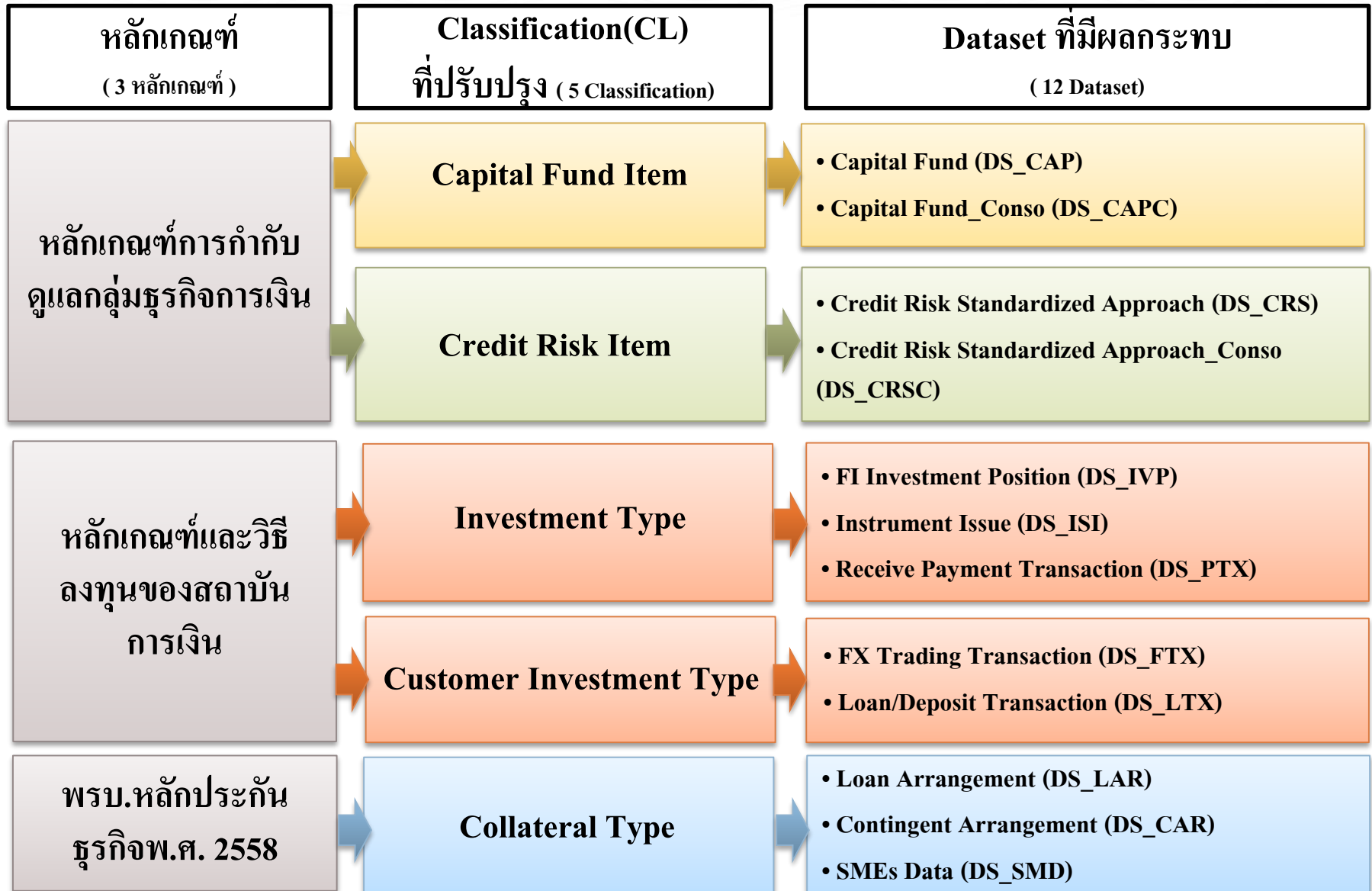
ประกาศ ธปท. เรื่อง หลักเกณฑ์การกำกับดูแลกลุ่มธุรกิจทางการเงิน จำนวน 5 ฉบับ ได้แก่

1. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สนส. 5/2560 เรื่อง หลักเกณฑ์การกำกับดูแลกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
2. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สนส. 6/2560 เรื่อง หลักเกณฑ์การกำกับดูแลโครงสร้างและขอบเขตธุรกิจของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
3. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สนส. 7/2560 เรื่อง หลักเกณฑ์การกำกับดูแลเงินกองทุนสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
4. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สนส. 8/2560 เรื่อง หลักเกณฑ์การกำกับดูแลความเสี่ยงของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
5. ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยที่ สนส. 9/2560 เรื่อง หลักเกณฑ์การจัดทำรายงานและการตรวจสอบกลุ่มธุรกิจทางการเงิน

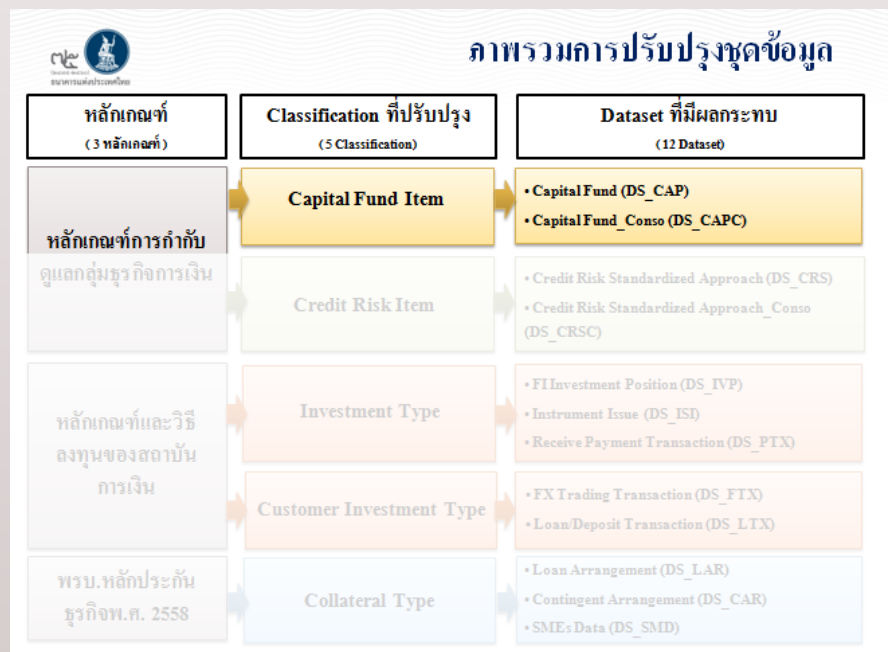
ประกาศ ธปท. ที่ สนส. 14/2559 เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีลงทุนของสถาบันการเงิน

พรบ.หลักประกันธุรกิจ พ.ศ. 2558

# ภาพรวมการปรับปรุงชุดข้อมูล



## การรายงาน Classification : Capital Fund Item



## เกณฑ์ใหม่

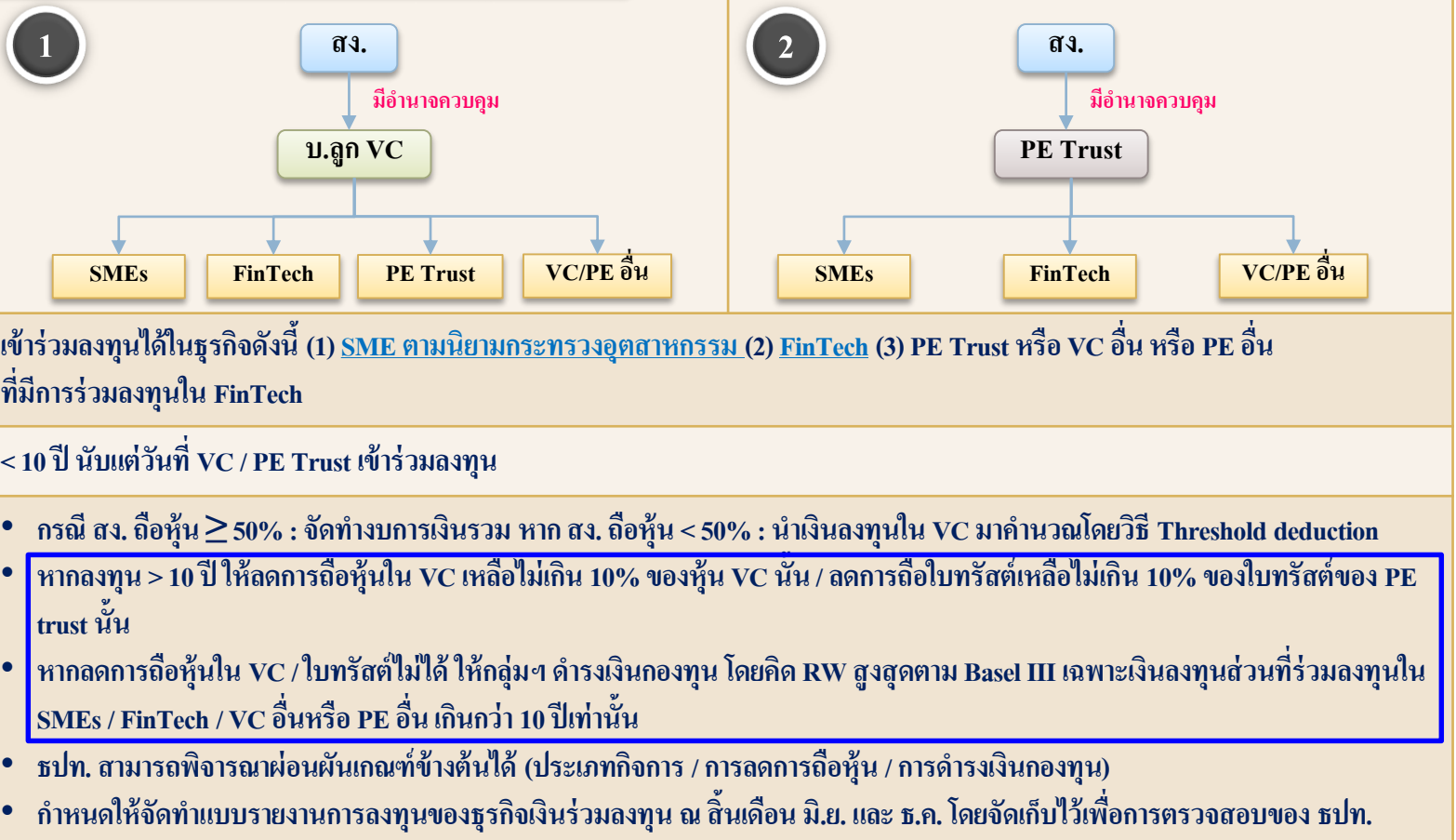
### หลักเกณฑ์การประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุน (VC และ PE Trust)

#### รูปแบบ การร่วมลงทุน

#### ประเภทธุรกิจ

#### ระยะเวลา

#### เกณฑ์การ กำกับดูแล



## DS\_CAP : Capital Fund

เงินกองทุน : ชุดสถาบันการเงิน

## DS\_CAPC : Capital Fund\_Conso

เงินกองทุน : ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

### โครงสร้างข้อมูล

Data Element	Data Type	Description
Organization Id	FI Code	รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล
FI Reporting Group Id	Classification	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน
Data Set Date	Date	วันที่ของชุดข้อมูล
Capital Fund Item	Classification	รายการเงินกองทุนโดยรายงานเฉพาะรายการย่อยที่สุด
Outstanding Amount per Book	Amount	ยอดคงค้างตามบัญชี (บาท)
Applicable Capital Fund Amount	Amount	ยอดคงค้างที่สามารถนับเข้าเป็นเงินกองทุนได้ (บาท)
Net Capital Fund Amount	Amount	ยอดคงค้างสุทธิที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนตามกฎหมายได้
Registered Capital Fund Value	Amount	มูลค่าที่จดแจ้งกับธนาคารแห่งประเทศไทยตามสินทรัพย์มาตรา 32
Applicable Capital Fund Value	Amount	มูลค่าตามมาตรฐานการบัญชี ณ สิ้นงวดการบัญชี 6 เดือน หรือเมื่อมีการเปลี่ยนแปลงสินทรัพย์ตามมาตรา 32 หรือเงินกองทุน

# Classification : Capital Fund Item

DS\_CAP : Capital Fund

DS\_CAPC : Capital Fund\_Conso

เงินกองทุน : ชุดสถาบันการเงิน

เงินกองทุน : ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

การรายงาน Capital Fund Item

- ปรับปรุงการรายงาน Classification 1 รายการ
- ปรับปรุงคำอธิบาย Classification 10 รายการ

1) ปรับปรุงการรายงาน Classification : เงินลงทุนในตราสารทุนรวมถึงเงินลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นของบริษัทที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าไปลงทุน (1 รายการ)

Code	Value
940103	เงินกองทุน (เฉพาะธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ บริษัทเงินทุน และกล
940104	เงินกองทุนชั้นที่ 1
940105	1. เงินกองทุนชั้นที่ 1 ที่เป็นส่วนของผู้ถือหุ้น
940106	1.1 หุ้นที่ออกและชำระแล้ว – หุ้นสามัญ
	...
940141	1.11 รายการหักจากเงินกองทุนชั้นที่ 1 ที่เป็นส่วนของผู้ถือหุ้น
940142	1.11.1 ขาดทุนสุทธิ
940143	1.11.2 ค่าความนิยม
	...
940233	1.11.11 เงินลงทุนในตราสารทุนรวมถึงเงินลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นของบริษัทที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าไปลงทุน
940153	1.11.12 เงินลงทุนในตราสารทุนรวมถึงเงินลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นของบริษัท โดยถือหุ้นไม่เกินร้อยละ 10 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของแต่ละบริษัทนั้น

ตั้งแต่ข้อมูลงวดเดือน ม.ค 61  
ให้รายงาน CL 940233 = 0

การรายงานปัจจุบัน -> เกณฑ์การกำกับดูแล (เดิม)

- หากลงทุน > 7 ปี ให้ลดการถือหุ้นใน VC เหลือไม่เกิน 10% ของหุ้น VC นั้น
- หากลดการถือหุ้นใน VC ไม่ได้ สง.หรือบริษัทแม่ต้องนำเงินลงทุนที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าไปลงทุนมาหักออกจากเงินกองทุนกลุ่มทั้งจำนวน

การรายงานที่ปรับปรุง -> เกณฑ์การกำกับดูแล (ใหม่)

- หากลงทุน > 10 ปี ให้ลดการถือหุ้นใน VC เหลือไม่เกิน 10% ของหุ้น VC นั้น
- หากลดการถือหุ้นใน VC ไม่ได้ สง.หรือบริษัทแม่ต้องดำรงเงินกองทุน โดยคิด RW สูงสุดตาม Basel III เฉพาะเงินลงทุนส่วนที่ร่วมลงทุนใน SMEs / FinTech / VC อื่นหรือ PE อื่น เกินกว่า 10 ปีเท่านั้น

# Classification : Capital Fund Item

DS\_CAP : Capital Fund

เงินกองทุน : ชุดสถาบันการเงิน

DS\_CAPC : Capital Fund\_Conso

เงินกองทุน : ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

การรายงาน Capital Fund Item

2) ปรับปรุงคำอธิบาย Classification ให้สอดคล้องกับประกาศเรื่องหลักเกณฑ์การกำกับดูแลกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ปรับปรุงใหม่ (10 รายการ)

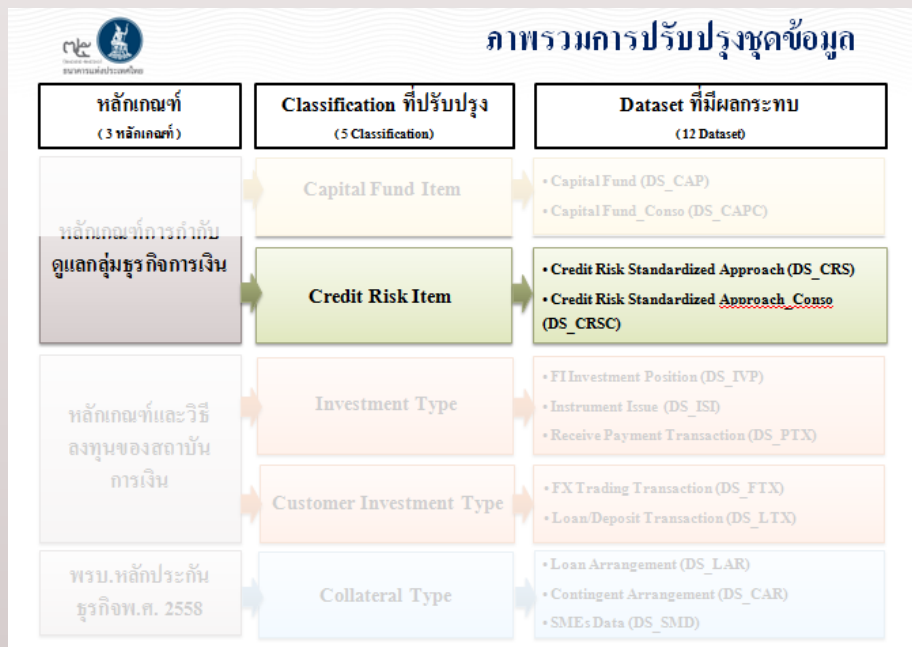
Code	Value	Description
940103	เงินกองทุน (เฉพาะธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ บริษัทเงินทุน และกลุ่มธุรกิจทางการเงิน)	
940104	เงินกองทุนชั้นที่ 1	เงินกองทุนชั้นที่ 1 ที่ต้องดำรงไว้ตามประกาศของธนาคารแห่งประเทศไทย
940105	1. เงินกองทุนชั้นที่ 1 ที่เป็นส่วนของเจ้าของ	รายการที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนชั้นที่ 1 ที่เป็นส่วนของเจ้าของ(Common Equity Tier 1) ได้ ภายหลังรายการปรับและรายการหักต่าง ๆ
940106	1.1 ทนที่ออกและชำระแล้ว - หุ้นสามัญ	ทุนจดทะเบียน - หุ้นสามัญที่เรียกชำระแล้ว
	...	
940228	1.8 รายการของบริษัทลูกที่ประกอบธุรกิจธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุน เฉพาะส่วนของผู้ถือหุ้นที่ไม่มีอำนาจควบคุมที่สามารถนับเป็นเงินกองทุนชั้นที่ 1 ที่เป็นส่วนของเจ้าของของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน	ส่วนได้เสียที่ไม่มีอำนาจควบคุม (Non-Controlling Interest: NCI) ที่สามารถนับเป็นองค์ประกอบเงินกองทุนในการคำนวณ CET1 ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด หลังพิจารณาการทยอยหักส่วนที่เกินกว่าจำนวนเงินกองทุนชั้นต่ำและเงินกองทุนส่วนเพิ่ม Conservation Buffer ในส่วนของผู้ถือหุ้นที่ไม่มีอำนาจควบคุม ตามที่กำหนดในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับ <b>แบบรวมกลุ่มดูแลเงินกองทุนสำหรับกลุ่มธุรกิจทางการเงิน</b>

	DS_CAP	DS_CAPC*
กลุ่มสถาบันการเงินที่เกี่ยวข้อง	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ธพ.จดทะเบียนในประเทศไทย (Schema = TCB)</li> <li>• บริษัทเงินทุน (Schema = FCS)</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ธพ.จดทะเบียนในประเทศไทย (Schema = TCB)</li> </ul>
ชุดของรายงาน (FI Reporting Group Id)	ชุดรวมทุกสำนักงาน (FI Reporting Group = 116002)	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ชุด Full Consolidated (FI Reporting Group = 116028)</li> <li>• ชุด Solo Consolidated (FI Reporting Group = 116030)</li> </ul>
ความถี่	รายเดือน (จัดส่งภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน)	รายไตรมาส (จัดส่งภายในไตรมาสถัดไป นับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน)
กำหนดเวลา	เริ่มรายงานข้อมูลงวดแรกเดือนมกราคม 2561	เริ่มรายงานข้อมูลงวดแรกเดือนมีนาคม 2561

หมายเหตุ :

DS\_CAPC\* : กรณีบริษัทเงินทุน หากมีการจัดตั้งกลุ่มธุรกิจทางการเงินให้รายงาน DS\_CAPC เช่นเดียวกับธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศไทย (ตามประกาศ ธพท. ที่ สนส. 9/2560 เรื่องหลักเกณฑ์การจัดทำรายงานและการตรวจสอบกลุ่มธุรกิจการเงิน)

## การรายงาน Classification : Credit Risk Item



## DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

สินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต ตามวิธี Standardized Approach  
: ชุดสถาบันการเงิน

## DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

สินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต ตามวิธี Standardized Approach  
: ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

### โครงสร้างข้อมูล

Data Element	Data Type	Description
Organization Id	FI Code	รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล
FI Reporting Group Id	Classification	ชุดข้อมูลของสถาบันการเงิน
Data Set Date	Date	วันที่ของชุดข้อมูล
Credit Risk Method	Classification	วิธีหลักที่ใช้คำนวณความเสี่ยงด้านเครดิต
CRM Method	Classification	วิธี CRM หลักประกันทางการเงิน
Credit Risk Type	Classification	ประเภทของกลุ่มลูกหนี้
Credit Risk Item	Classification	รายการความเสี่ยงด้านเครดิต
FTD Adjustment	Amount	จำนวนเงินของรายการปรับปรุงสินทรัพย์เสี่ยงของ ธุรกรรม First-to-default Credit Derivatives
CCF Rate	Conversion Rate	ระบุดำ Credit Conversion Factor (กรณี Credit Risk Item เป็นภาระผูกพัน)
RWA Rate	Conversion Rate	น้ำหนักความเสี่ยงของรายการใน Credit Risk Item (กรณีโอนพันธทางการเงินที่อยู่ในตลาด Exchange ให้รายงาน RWA = 0)

# Classification : Credit Risk Item

DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

ชุดสถาบันการเงิน

DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## การรายงาน Credit Risk Item

1) ส.ง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี SA

- เพิ่ม Classification ใหม่ 7 รายการ
- ปรับปรุงคำอธิบาย Classification 3 รายการ

2) ส.ง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี IRB (ใช้วิธี SA)

- เพิ่ม Classification ใหม่ 9 รายการ
- ปรับปรุงคำอธิบาย Classification 29 รายการ

DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## 1. การรายงาน Credit Risk Item ( สำหรับ สง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี SA )

1.1) เพิ่ม Classification ใหม่ : เงินลงทุนในกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด (1 รายการ)

Code	Value	Description
446001	รายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน (ไม่รวม Repo-style transaction)	
446002	วิธี Standardized Approach (SA) และ Simplified Standardized Approach (SSA)	
446003	1. ลูกหนี้ภาครัฐบาลและธนาคารกลาง	
446008	2. ลูกหนี้องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์การของรัฐ และรัฐวิสาหกิจ (PSEs)	
	...	
446028	9. สินทรัพย์อื่น	
446029	9.1 เงินสดที่เป็นเงินบาทและเงินตราต่างประเทศ	
	...	
446039	9.10 เงินลงทุนในตราสารทุน	
446166	9.10.1 สำหรับบริษัทที่ทำธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน Full Consolidation ที่ต้องจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน	
	...	
446172	9.10.7 สำหรับบริษัทกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด	
446286	9.10.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด	
446173	9.10.8 9.10.9 อื่น ๆ	

DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## 1. การรายงาน Credit Risk Item ( สำหรับ สง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี SA )

### 1.2) เพิ่ม Classification ใหม่ : ใบทรัสต์ในกองทรัสต์เพื่อประกอบกิจการเงินร่วมลงทุน (6 รายการ)

Code	Value
446001	รายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน (ไม่รวม Repo-style transaction)
446002	วิธี Standardized Approach (SA) และ Simplified Standardized Approach
446003	1. ลูกหนี้ภาครัฐบาลและธนาคารกลาง
	...
446028	9. สินทรัพย์อื่น
446029	9.1 เงินสดที่เป็นเงินบาทและเงินตราต่างประเทศ
	...
446287	9.12 ใบทรัสต์ในกองทรัสต์เพื่อประกอบกิจการเงินร่วมลงทุน
446288	9.12.1 สำหรับกองทรัสต์ที่ สง. ลงทุนตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท. กำหนด
446289	9.12.2 สำหรับกองทรัสต์ที่ สง. ลงทุนไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท. กำหนด
	...
446046	9.18 9.19 อื่น ๆ
446047	10. ลูกหนี้ด้วยคุณภาพ
446048	10.1 ลูกหนี้ภาครัฐบาล / MDBs / PSEs กลุ่มที่มีน้ำหนักความเสี่ยงเหมือนลูกหนี้ภาครัฐบาล
	...
446053	10.6 อื่น ๆ
446054	10.6.1 เงินสดที่เป็นเงินบาทและเงินตราต่างประเทศ
	...
446290	10.6.6 ใบทรัสต์ในกองทรัสต์เพื่อประกอบกิจการเงินร่วมลงทุน
446291	10.6.6.1 สำหรับกองทรัสต์ที่ สง. ลงทุนตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท. กำหนด
446292	10.6.6.2 สำหรับกองทรัสต์ที่ สง. ลงทุนไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่ ธปท. กำหนด
446061	10.6.7 10.6.7 อื่น ๆ

DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## 1. การรายงาน Credit Risk Item ( สำหรับ สง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี SA )

1.3) ปรับปรุงคำอธิบาย Classification ให้สอดคล้องกับประกาศเรื่องหลักเกณฑ์การกำกับดูแลกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ปรับปรุงใหม่ (3 รายการ)

Code	Value	Description
446001	รายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน (ไม่รวม Repo-style transaction)	
446002	วิธี Standardized Approach (SA) และ Simplified Standardized Approach (SSA)	
446003	1. ลูกหนี้ภาครัฐบาลและธนาคารกลาง	ลูกหนี้ภาครัฐบาลและธนาคารกลาง รวมทั้ง กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนา ระบบสถาบันการเงิน บรรษัทบริหารสินทรัพย์ไทย และบรรษัทบริหารสินทรัพย์กรุงเทพพาณิชย์ และสถาบันคุ้มครองเงินฝาก
	...	
446028	9. สินทรัพย์อื่น	สินทรัพย์อื่นตามที่ ธปท. กำหนด
446029	9.1 เงินสดที่เป็นเงินบาทและเงินตราต่างประเทศ	เงินสดที่เป็นเงินบาทและเงินตราต่างประเทศที่ สง. ถือไว้ เงินสดหรือเงินฝากที่ สง. ได้รับเป็นหลักประกันจากผู้กู้ ซึ่งเป็นสกุลเงินเดียวกับยอดหนี้ และเงินสดที่ สง. ได้รับเป็นหลักประกันหรือกู้ยืมมาจากคู่สัญญากรณีที่ทำธุรกรรม Repo-style transaction หรืออนุพันธ์ทางการเงินนอกตลาด (OTC derivatives)
	...	
446034	9.5 รายการสินทรัพย์ที่ ธปท. กำหนดให้หักออกจากเงินกองทุนแล้ว	สินทรัพย์ที่ ธปท. กำหนดให้หักออกจากเงินกองทุนแล้ว เช่น ค่าความนิยม ตราสาร First- to -default credit linked notes ที่ถูกกำหนดให้หักออกจากเงินกองทุน เงินลงทุนในตราสารทุนรวมถึงเงินลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นของบริษัทที่ประกอบธุรกิจทางการเงินและธุรกิจสนับสนุน เฉพาะส่วนที่เกินกว่าร้อยละ 10 ของ Net common equity tier 1 ที่ต้องนำไปหักออกจากเงินกองทุน เป็นต้น
446164	9.5.1 เงินลงทุนในตราสารส่วนที่หักออกจากเงินกองทุนแล้ว	สำหรับกรณีที่รายงานตามหลักเกณฑ์การกำกับ <b>แบบรวมกลุ่มดูแลเงินกองทุนของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน</b> ซึ่งคือ เงินลงทุนในบริษัทเฉพาะส่วนที่ธนาคารแห่งประเทศไทยได้กำหนดให้นำมาหักออกจากเงินกองทุนแล้ว ซึ่งรวมถึงเงินลงทุนที่ไม่ได้บันทึกอยู่ในงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน เช่น เงินลงทุนทางอ้อมที่ลงทุนโดยผู้ที่เกี่ยวข้องกับธนาคารพาณิชย์หรือบริษัทแม่ ที่อยู่นอกกลุ่มธุรกิจทางการเงิน หรือเงินลงทุนของกรรมการธนาคารพาณิชย์หรือบริษัทแม่รวมผู้ที่เกี่ยวข้อง เป็นต้น

DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

ชุดสถาบันการเงิน

DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## 2. การรายงาน Credit Risk Item ( สง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี IRB (ใช้วิธี SA) )

2.1) เพิ่ม Classification ใหม่ : เงินลงทุนในกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด (9 รายการ)

วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)

ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน

1) กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)

ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)

ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ

5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ropic. มีผลบังคับใช้

5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ropic. มีผลบังคับใช้

5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based

5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight

5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)

5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.3 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD

5.2.3.1 ตราสารทุนที่ถือไว้โดยไม่ได้รับ Capital Gain

Code	Value
446084	5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน
446085	5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)
446177	5.1.1 สำหรับบริษัทที่ประกอบธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน Full Consolidation ที่ต้องจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
	...
446183	5.1.7 สำหรับกิจการบริษัทที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446293	5.1.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446184	5.1.8 5.1.9 อื่น ๆ

## DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

ชุดสถาบันการเงิน

## DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## 2. การรายงาน Credit Risk Item ( สง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี IRB (ใช้วิธี SA) )

### 2.1) เพิ่ม Classification ใหม่ : เงินลงทุนในกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด (9 รายการ) (ต่อ)

#### วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)

##### ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน

##### ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)

##### ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ

##### 5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

##### 5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้

##### 5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้

##### 5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based

##### 5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight

##### 5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

##### 5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

##### 5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)

##### 5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

##### 5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

##### 5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

##### 5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

##### 5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

##### 5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น

##### 5.2.3 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD

##### 5.2.3.1 ตราสารทุนที่ถือไว้โดยไม่ได้รับ Capital Gain

2) กรณีมีนัยสำคัญ : ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

Code	Value
446084	5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน
	...
446086	5.2 กรณีมีนัยสำคัญ
446087	5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)
446088	5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้
446185	5.2.1.1.1 สำหรับบริษัทที่ประกอบธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน Full Consolidation ที่ต้องจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
	...
446191	5.2.1.1.7 สำหรับบริษัทที่ประกอบธุรกิจการเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446294	5.2.1.1.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจการเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446192	5.2.1.1.9 5.2.1.1.9 อื่น ๆ
446089	5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้
446193	5.2.1.2.1 สำหรับบริษัทที่ทำธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน Full Consolidation ที่ต้องจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
	...
446199	5.2.1.2.7 สำหรับบริษัทที่ประกอบธุรกิจการเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446295	5.2.1.2.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจการเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446200	5.2.1.2.9 5.2.1.2.9 อื่น ๆ

## DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

ชุดสถาบันการเงิน

## DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## 2. การรายงาน Credit Risk Item ( สง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี IRB (ใช้วิธี SA) )

### 2.1) เพิ่ม Classification ใหม่ : เงินลงทุนในกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด (9 รายการ) (ต่อ)

#### วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)

ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน

ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)

ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ

5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ropic. มีผลบังคับใช้

5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ropic. มีผลบังคับใช้

5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based

5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight

5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)

5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.3 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD

5.2.3.1 ตราสารทุนที่ถือไว้โดยไม่ได้รับ Capital Gain

2) กรณีมีนัยสำคัญ : ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

Code	Value
446084	5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน
	...
446086	5.2 กรณีมีนัยสำคัญ
	...
446090	5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based
446091	5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight
446138	5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ
446201	5.2.2.1.1.1 สำหรับบริษัทที่ทำธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน Full Consolidation ที่ต้องจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
	...
446207	5.2.2.1.1.7 สำหรับบริษัทกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446296	5.2.2.1.1.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446208	5.2.2.1.1.8 5.2.2.1.1.9 อื่น ๆ
446139	5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น
446209	5.2.2.1.2.1 สำหรับบริษัทที่ทำธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน Full Consolidation ที่ต้องจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
	...
446215	5.2.2.1.2.7 สำหรับบริษัทกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446297	5.2.2.1.2.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446216	5.2.2.1.2.8 5.2.2.1.2.9 อื่น ๆ

## DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

ชุดสถาบันการเงิน

## DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## 2. การรายงาน Credit Risk Item ( สง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี IRB (ใช้วิธี SA) )

### 2.1) เพิ่ม Classification ใหม่ : เงินลงทุนในกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด (9 รายการ) (ต่อ)

#### วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)

##### ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน

##### ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)

##### ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ

##### 5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

##### 5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้

##### 5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้

##### 5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณ โดยวิธี Market Based

##### 5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight

##### 5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

##### 5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

##### 5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)

##### 5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

##### 5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

##### 5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

##### 5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

##### 5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

##### 5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น

##### 5.2.3 ตราสารทุนที่คำนวณ โดยวิธี PD/LGD

##### 5.2.3.1 ตราสารทุนที่ถือไว้โดยไม่ได้รับ Capital Gain

2) กรณีมีนัยสำคัญ : ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

Code	Value
446084	5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน
	...
446086	5.2 กรณีมีนัยสำคัญ
	...
446090	5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based
	...
446092	5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)
446093	5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ
446094	5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ
446217	5.2.2.2.1.1.1 สำหรับบริษัทที่ทำธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ...
	...
446223	5.2.2.2.1.1.7 สำหรับบริษัทกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446298	5.2.2.2.1.1.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446224	5.2.2.2.1.1.8 5.2.2.2.1.1.9 อื่น ๆ
446095	5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น
446225	5.2.2.2.1.2.1 สำหรับบริษัทที่ทำธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ...
	...
446231	5.2.2.2.1.2.7 สำหรับบริษัทกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446299	5.2.2.2.1.2.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446232	5.2.2.2.1.2.8 5.2.2.2.1.2.9 อื่น ๆ

DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

ชุดสถาบันการเงิน

DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## 2. การรายงาน Credit Risk Item ( สง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี IRB (ใช้วิธี SA) )

### 2.1) เพิ่ม Classification ใหม่ : เงินลงทุนในกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด (9 รายการ) (ต่อ)

วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)

ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน

ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)

ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ

5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้

5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้

5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based

5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight

5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)

5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.3 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD

5.2.3.1 ตราสารทุนที่ถือไว้โดยไม่ได้รับ Capital Gain

2) กรณีมีนัยสำคัญ : ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

Code	Value
446084	5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน
...	...
446086	5.2 กรณีมีนัยสำคัญ
...	...
446090	5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based
...	...
446092	5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)
...	...
446096	5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ
446097	5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จัดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ
446233	5.2.2.2.2.1.1 สำหรับบริษัทที่ทำธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ....
...	...
446239	5.2.2.2.2.1.7 สำหรับบริษัทกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446300	5.2.2.2.2.1.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446240	5.2.2.2.2.1.9 5.2.2.2.2.1.9 อื่น ๆ
446098	5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น
446241	5.2.2.2.2.2.1 สำหรับบริษัทที่ทำธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน ....
...	...
446247	5.2.2.2.2.2.7 สำหรับบริษัทกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446301	5.2.2.2.2.2.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446248	5.2.2.2.2.2.9 5.2.2.2.2.2.9 อื่น ๆ

DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

ชุดสถาบันการเงิน

DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## 2. การรายงาน Credit Risk Item ( สง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี IRB (ใช้วิธี SA) )

2.2) การรายงาน Classification : เงินลงทุนในกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด สำหรับตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD

### วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)

#### ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน

ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)

ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ

5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้

5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้

5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based

5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight

...

5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)

...

5.2.3 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD

5.2.3.1 ตราสารทุนที่ถือไว้โดยไม่ได้รับ Capital Gain

5.2.3.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาด หลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.3.1.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.3.2 ตราสารทุนที่ถือไว้เพื่อหวัง Capital Gain (รวมฐานะ Short สุทธิ)

5.2.3.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาด หลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.3.2.2 ตราสารทุนอื่น

2) กรณีมีนัยสำคัญ :

ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี IRB

Code	Value
446084	5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน
446085	5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)
	...
446086	5.2 กรณีมีนัยสำคัญ
446087	5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)
446088	5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้
446185	5.2.1.1.1 สำหรับบริษัทที่ประกอบธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน Full Consolidation ที่ต้องจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
	...
446191	5.2.1.1.7 สำหรับบริษัทกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446294	5.2.1.1.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446192	5.2.1.1.9 อื่น ๆ
446089	5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้
446193	5.2.1.2.1 สำหรับบริษัทที่ทำธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน Full Consolidation ที่ต้องจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
	...
446199	5.2.1.2.7 สำหรับบริษัทกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446295	5.2.1.2.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446200	5.2.1.2.9 อื่น ๆ

## DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

ชุดสถาบันการเงิน

## DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## 2. การรายงาน Credit Risk Item ( สง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี IRB (ใช้วิธี SA) )

### 2.3) การรายงานข้อมูลใบรหัสต้นในกองทรัสต์เพื่อประกอบกิจการเงินร่วมลงทุนและกองทรัสต์ประเภทอื่นๆ

#### วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)

ข้อ 5. ฐานะที่เกี่ยวกับตราสารทุน

ข้อ 5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)

2) กรณีมีนัยสำคัญ : ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

ข้อ 5.2 กรณีมีนัยสำคัญ

5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)

5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้

5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้

5.2.2 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี Market Based

5.2.2.1 วิธี Simple Risk Weight

5.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.2.2 วิธี Internal Model (VaR)

5.2.2.2.1 ตราสารทุนที่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

5.2.2.2.1.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.2.1.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.2.2.2 ตราสารทุนที่ไม่เข้าข่ายต้องใช้น้ำหนักความเสี่ยงขั้นต่ำ

5.2.2.2.2.1 ตราสารทุนที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นที่ยอมรับ

5.2.2.2.2.2 ตราสารทุนอื่น

5.2.3 ตราสารทุนที่คำนวณโดยวิธี PD/LGD

5.2.3.1 ตราสารทุนที่ถือไว้โดยไม่ได้รับ Capital Gain

Code	Value
446084	5. ฐานะที่เกี่ยวกับตราสารทุน
446085	5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)
...	...
446086	5.2 กรณีมีนัยสำคัญ
446087	5.2.1 ตราสารทุนที่ได้รับการยกเว้นการคำนวณโดยวิธี IRB (ใช้วิธี SA)
446088	5.2.1.1 ตราสารทุน ณ วันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้
446185	5.2.1.1.1 สำหรับบริษัทที่ประกอบธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน Full Consolidation ที่ต้องจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
...	...
446191	5.2.1.1.7 สำหรับบริษัทที่ประกอบธุรกิจการเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446294	5.2.1.1.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจการเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446192	5.2.1.1.8 5.2.1.1.9 อื่น ๆ
446089	5.2.1.2 ตราสารทุนหลังวันที่ประกาศ ปรท. มีผลบังคับใช้
446193	5.2.1.2.1 สำหรับบริษัทที่ทำธุรกิจทางการเงินและสนับสนุนในกลุ่มธุรกิจทางการเงิน Full Consolidation ที่ต้องจัดทำงบการเงินรวมของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน
...	...
446199	5.2.1.2.7 สำหรับบริษัทที่ประกอบธุรกิจการเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด
446295	5.2.1.2.8 สำหรับกิจการที่บริษัทที่ประกอบธุรกิจการเงินร่วมลงทุนเข้าร่วมลงทุนไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนด
446200	5.2.1.2.8 5.2.1.2.9 อื่น ๆ

DS\_CRS : Credit Risk Standardized Approach

ชุดสถาบันการเงิน

DS\_CRSC : Credit Risk Standardized Approach\_Conso

ชุดสถาบันการเงิน + บริษัทลูกในกลุ่มฯ

## 2. การรายงาน Credit Risk Item ( สง. คำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิต วิธี IRB (ใช้วิธี SA) )

2.4) ปรับปรุงคำอธิบาย Classification ให้สอดคล้องกับประกาศเรื่องหลักเกณฑ์การกำกับดูแลกลุ่มธุรกิจทางการเงินที่ปรับปรุงใหม่ (29 รายการ)

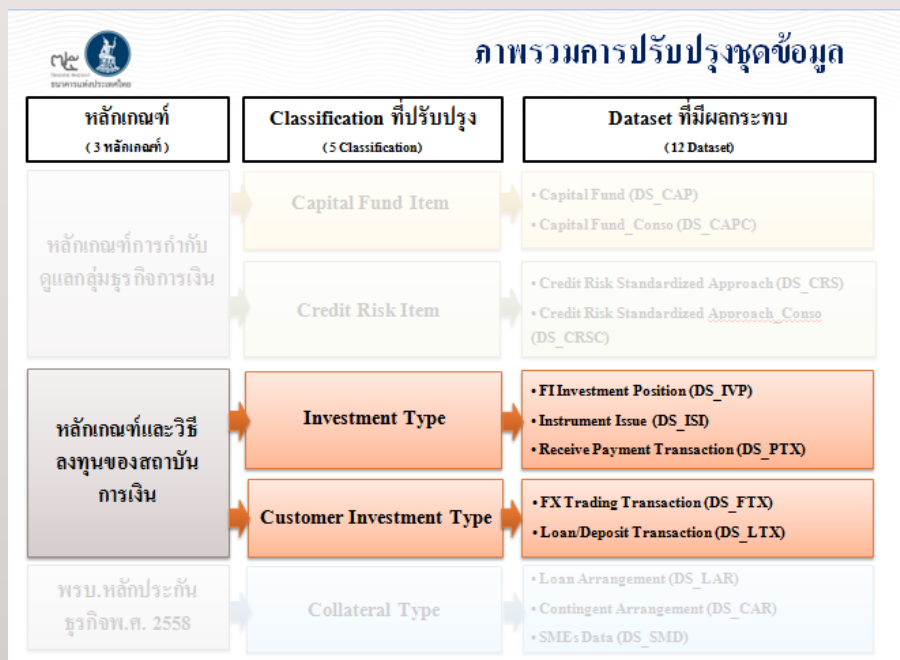
Code	Value	Description
446001	รายการสินทรัพย์ในงบแสดงฐานะการเงิน (ไม่รวม Repo-style transaction)	
446067	วิธี Internal Ratings-Based Approach (IRB)	
446068	1. ลูกหนี้ภาครัฐบาล	(1) ลูกหนี้ภาครัฐบาล และธนาคารกลางตามที่ ธปท. กำหนดในวิธี SA (2) ลูกหนี้องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่น องค์กรของรัฐ และรัฐวิสาหกิจ (Non-central government public sector entities: PSEs) ที่ ธปท. กำหนดน้ำหนักความเสี่ยงเหมือนลูกหนี้ภาครัฐบาลในวิธี SA (3) ลูกหนี้ธนาคารเพื่อการพัฒนาระหว่างประเทศ (Multilateral development banks: MDBs) ที่ ธปท. กำหนดน้ำหนักความเสี่ยงร้อยละ 0 ในวิธี SA
	...	
446084	5. ฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุน	(1) ตราสารที่มีลักษณะต่อไปนี้ทุกข้อ (ก) ไม่สามารถไถ่ถอนได้ ซึ่งผู้ลงทุนจะได้รับเงินที่ลงทุนไปคืนก็ต่อเมื่อมีการขายตราสารหรือขายสิทธิที่จะลงทุน หรือผู้ออกตราสารเลิกกิจการเท่านั้น ...
446085	5.1 กรณีไม่มีนัยสำคัญ (ใช้วิธี SA)	กรณี สง. หรือบริษัทในกลุ่มธุรกิจทางการเงินมีฐานะที่เกี่ยวข้องกับตราสารทุนทุกประเภทในระดับที่ไม่มีความสำคัญตามเกณฑ์ที่ ธปท. กำหนด ซึ่งสามารถใช้วิธี SA ในการคำนวณเงินกองทุนได้ สำหรับกรณีของหลักเกณฑ์การกำกับ <b>แบบรวมกลุ่มดูแลกลุ่มธุรกิจทางการเงิน</b> ให้นับการถือหุ้นทั้งทางตรงและทางอ้อมตามประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การกำกับ <b>แบบรวมกลุ่มดูแลโครงสร้างและขอบเขตธุรกิจของกลุ่มธุรกิจทางการเงิน</b> แม้ว่าเงินลงทุนทางอ้อมนั้นจะ ไม่แสดงอยู่ในงบการเงินรวมก็ตาม หลังหักส่วนที่ธนาคารแห่งประเทศไทยได้กำหนดให้นำมาหักออกจากเงินกองทุนแล้ว โดยกำหนดว่าแนกตามลักษณะบริษัทและสัดส่วนการถือหุ้น

	DS_CRS	DS_CRSC*
กลุ่มสถาบันการเงินที่เกี่ยวข้อง	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ธพ.จดทะเบียนในประเทศไทย (Schema = TCB)</li> <li>• สาขาธพ. ต่างประเทศ (Schema = FCB1)</li> <li>• บริษัทเงินทุน (Schema = FCS)</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ธพ.จดทะเบียนในประเทศไทย (Schema = TCB)</li> </ul>
ชุดของรายงาน (FI Reporting Group Id)	<p>ชุดรวมทุกสำนักงาน (FI Reporting Group = 116002) สำหรับ ธพ.จดทะเบียนในประเทศไทยและบริษัทเงินทุน</p> <p>ชุดรวมทุกสำนักงานในประเทศไทย (FI Reporting Group =116003) สำหรับ สาขาธพ. ต่างประเทศ</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ชุด Full Consolidated (FI Reporting Group = 116028)</li> <li>• ชุด Solo Consolidated (FI Reporting Group = 116030)</li> </ul>
ความถี่	รายเดือน (จัดส่งภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน )	รายไตรมาส (จัดส่งภายในไตรมาสถัดไป นับจากวันสิ้นไตรมาสที่รายงาน )
กำหนดเวลา	เริ่มรายงานข้อมูลงวดแรกเดือนมกราคม 2561	เริ่มรายงานข้อมูลงวดแรกเดือนมีนาคม 2561

หมายเหตุ :

DS\_CRSC\* : กรณีบริษัทเงินทุน หากมีการจัดตั้งกลุ่มธุรกิจทางการเงินให้รายงาน DS\_CRSC เช่นเดียวกับธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศไทย (ตามประกาศ ธปท. ที่ สนส. 9/2560 เรื่องหลักเกณฑ์การจัดทำรายงานและการตรวจสอบกลุ่มธุรกิจการเงิน)

# การรายงาน Classification : Investment Type และ Customer Investment Type



# Classification : Investment Type

DS\_IVP : FI Investment Position

DS\_ISI : Instrument Issue

DS\_PTX : Receive Payment Transaction

เงินลงทุน

รายการจัดการออกและจำหน่ายตราสาร

รายการรับและชำระเงิน

การรายงาน Investment Type

• ปรับปรุงคำอธิบาย Classification 1 รายการ

## 1) ปรับปรุงคำอธิบาย Classification : Unit Trust ให้ครอบคลุมการลงทุนในใบทรัสต์

Code	Value	Description
168001	เงินลงทุนในหลักทรัพย์	
168002	Equity Instrument	ตราสารทุน
168003	Common Stock	หุ้นสามัญ
168004	Preferred Stock	หุ้นบุริมสิทธิ
168005	Unit Trust	หน่วยลงทุน, ใบทรัสต์
168006	Warrant	ใบสำคัญแสดงสิทธิในการจองซื้อหุ้นสามัญ
168007	Derivative Warrant	ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
168008	Others	ตราสารทุนอื่นๆ
168009	Debt Instrument	ตราสารหนี้
168010	Bond	พันธบัตร
168011	Debenture	หุ้นกู้
168012	Straight Bond	หุ้นกู้ธรรมดา
168013	Convertible Debentures	หุ้นกู้แปลงสภาพ
168014	Subordinate Debentures	หุ้นกู้ด้อยสิทธิ
168015	Treasury Bill	ตั๋วเงินคลัง
168016	Bill of Exchange	ตั๋วแลกเงิน
168017	Floating Rate Note	ตั๋วเงินอัตราดอกเบี้ยลอยตัว
168018	Floating Rate Certificate of Deposit	บัตรเงินฝากอัตราดอกเบี้ยลอยตัว
168019	Credit Linked Note	การให้กู้ยืมหรือการรับซื้อตราสารโดยที่สัญญาจะให้ผู้ให้กู้หรือผู้ซื้อตราสารเป็นผู้รับโอนความเสี่ยงด้านเครดิตของตราสารแสดงสิทธิในหนี้หรือสินทรัพย์อ้างอิงที่ออกโดยบุคคลอื่นแทนผู้กู้หรือผู้ออกตราสาร โดยการนี้ผู้กู้หรือผู้ออกตราสารตกลงที่จะให้ดอกเบี้ยหรือผลตอบแทนเป็นอัตราอ้างอิงกับความเสี่ยงด้านเครดิตของตราสารแสดงสิทธิในหนี้หรือสินทรัพย์อ้างอิงนั้น
168020	Promissory Note (for Investment)	ตั๋วสัญญาใช้เงินที่จัดทะเบียนกับสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และทำการซื้อขายผ่านตลาดเงิน เช่น ตั๋วของ บมจ. การบินไทย, บมจ. ไทยออยล์
168022	Others	ตราสารหนี้อื่นๆ
168023	Hybrid Instrument	ตราสารหนี้ที่มีลักษณะคล้ายทุน
168024	เงินลงทุนในลูกหนี้	ลูกหนี้ที่สถาบันการเงินรับโอนมาที่เข้าข่ายเป็นการซื้อตามหลักการบัญชี
168025	อื่นๆ	หลักทรัพย์ประเภทอื่นๆ

# Classification : Customer Investment Type

DS\_FTX : FX Trading Transaction

รายการซื้อขายเงินตราต่างประเทศและตราสารอนุพันธ์

DS\_LTX : Loan/Deposit Transaction

รายการบัญชีเงินฝากและสินเชื่อ

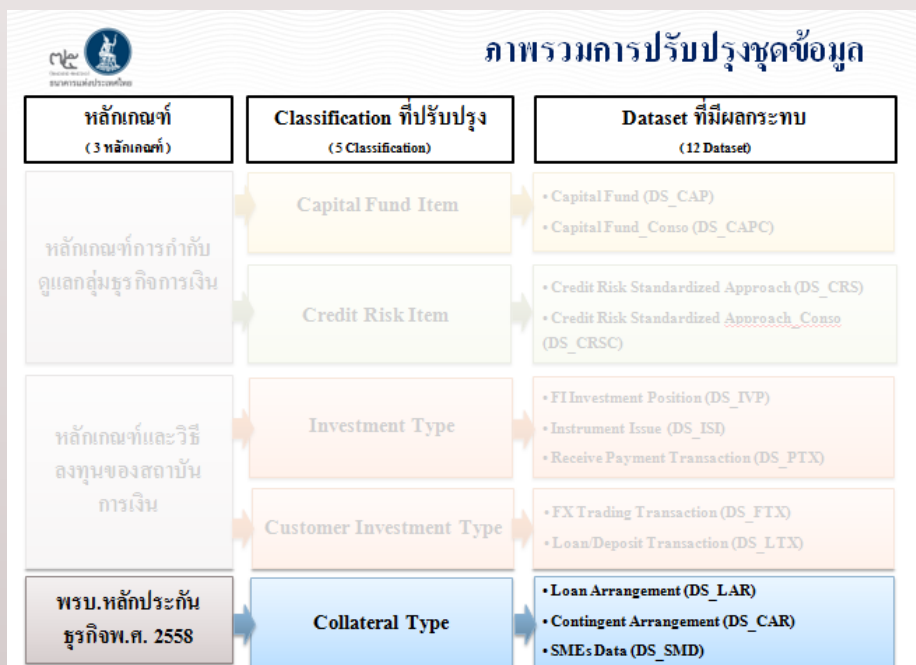
การรายงาน Customer Investment Type

• ปรับปรุงคำอธิบาย Classification 1 รายการ

## 1) ปรับปรุงคำอธิบาย Classification : Unit Trust ให้ครอบคลุมการลงทุนในโบทรัสต์

Code	Value	Description
168002	Equity Instrument	ตราสารทุน
168003	Common Stock	หุ้นสามัญ
168004	Preferred Stock	หุ้นบุริมสิทธิ
168005	Unit Trust	หน่วยลงทุน, โบทรัสต์
168006	Warrant	ใบสำคัญแสดงสิทธิในการจองซื้อหุ้นสามัญ
168007	Derivative Warrant	ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
168008	Others	ตราสารทุนอื่นๆ
168009	Debt Instrument	ตราสารหนี้
168010	Bond	พันธบัตร
168011	Debenture	หุ้นกู้
168012	Straight Bond	หุ้นกู้ธรรมดา
168013	Convertible Debentures	หุ้นกู้แปลงสภาพ
168014	Subordinate Debentures	หุ้นกู้ด้อยสิทธิ
168015	Treasury Bill	ตั๋วเงินคลัง
168016	Bill of Exchange	ตั๋วแลกเงิน
168017	Floating Rate Notes	ตั๋วเงินอัตราดอกเบี้ยลอยตัว
168018	Floating Rate Certificate of Deposit	บัตรเงินฝากอัตราดอกเบี้ยลอยตัว
168019	Credit Linked Note	การให้กู้ยืมหรือการรับซื้อตราสารโดยที่สัญญาระบุว่าผู้ให้กู้หรือผู้ซื้อตราสารเป็นผู้รับโอนความเสี่ยงด้านเครดิตของตราสารแสดงสิทธิในหนี้หรือสินทรัพย์อ้างอิงที่ออกโดยบุคคลอื่นแทนผู้กู้หรือผู้ออกตราสาร โดยการนี้ผู้กู้หรือผู้ออกตราสารตกลงที่จะให้ดอกเบี้ยหรือผลตอบแทนเป็นอัตราอ้างอิงกับความเสียด้านเครดิต ของตราสารแสดงสิทธิในหนี้หรือสินทรัพย์อ้างอิงนั้น
168020	Promissory Note (for Investment)	ตั๋วสัญญาใช้เงิน
168021	Negotiable Certificate of Deposit	บัตรเงินฝาก
168022	Others	ตราสารหนี้อื่นๆ

## การรายงาน Classification : Collateral Type



กฎหมายที่ออกมาเพื่อรองรับให้ผู้ประกอบการสามารถนำทรัพย์สินที่มีมูลค่าทางเศรษฐกิจแต่ไม่เป็นที่ยอมรับของสถาบันการเงินในการใช้เป็นหลักประกัน เช่น สินค้าคงคลัง วัตถุดิบที่ใช้ในการผลิตสินค้า ทรัพย์สินทางปัญญา เป็นต้น มาเป็นหลักประกันการกู้ยืมเงินได้

## ประโยชน์ของกฎหมาย

- ผู้ประกอบการเข้าถึงแหล่งเงินทุนได้ง่ายและสะดวกขึ้น
- ธนาคารกระจายสินเชื่อธุรกิจที่หลากหลายมากยิ่งขึ้น
- เพิ่มประเภททรัพย์สินที่ SMEs ใช้ในการประกอบธุรกิจมาเป็นหลักประกันได้
- ไม่ต้องส่งมอบทรัพย์สินให้กับเจ้าหนี้ ยังคงสามารถใช้ทรัพย์สินนั้นในการประกอบธุรกิจได้

## ทรัพย์สินที่ใช้เป็นหลักประกันได้

- กิจการ
- สิทธิเรียกร้อง\*
- สหกรณ์ทรัพย์ที่ผู้ให้หลักประกันใช้ในการประกอบธุรกิจ
- อสังหาริมทรัพย์ในกรณีที่ผู้ให้หลักประกันประกอบธุรกิจอสังหาริมทรัพย์โดยตรง
- ทรัพย์สินทางปัญญา
- ทรัพย์สินอื่นตามที่กำหนดในกฎกระทรวง

## DS\_LAR : Loan Arrangement

สินเชื่อรายตัว / รายสัญญา

### โครงสร้างข้อมูล

Data Element	Data Type	Description
Organization Id	FI Code	รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล
Branch Number	Branch Code	รหัสสาขาของผู้ส่งข้อมูล
IBF Indicator	Classification	ใช้ Classification ใน IBF Indicator
Data Set Date	Date	วันที่ของชุดข้อมูล
FI Arrangement Number	Identification Number	เลขที่สัญญาของสถาบันการเงิน
Loan Type	Classification	ใช้ ประเภทเงินให้สินเชื่อ ของ Classification ใน Arrangement Type
Credit Type	Classification	
Primary Involved Party Id	Identification Number	Unique Id of the primary involved party
Unique Id Type	Classification	Type of Unique Id being submitted
Country Id to Invest	Classification	รหัสประเทศที่นำไปทำธุรกรรม ใช้ classification ใน Country ID
Contract Amount	Amount	จำนวนเงินตามสัญญา
Collateral Type	Classification	ประเภทหลักประกัน
Collateral Value Amount	Amount	มูลค่าหลักประกันรวม (ราคาประเมิน) / วงเงินค่าประกัน
Collateral Pledged Amount	Amount	มูลค่าปัจจุบันของกระแสเงินสดที่คาดว่าจะได้รับจากการจำหน่ายหลักประกันเฉพาะส่วนที่นำมาหักได้
Cash Flow Value Amount	Amount	มูลค่าปัจจุบันของกระแสเงินสดที่คาดว่าจะได้รับจากลูกหนี้เฉพาะส่วนที่นำมาหักได้

## DS\_CAR : Contingent Arrangement

ภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

### โครงสร้างข้อมูล

Data Element	Data Type	Description
Organization Id	FI Code	รหัสสถาบันการเงินผู้ส่งข้อมูล
Branch Number	Branch Code	รหัสสาขาเจ้าของสัญญา
Data Set Date	Date	วันที่ของชุดข้อมูล
FI Arrangement Number	Identification Number	เลขที่สัญญาของสถาบันการเงิน
Currency ID	Classification	รหัสสกุลเงินของภาระผูกพัน ทั้งนี้ไม่รวมภาระผูกพันของตราสารอนุพันธ์
Contingent Type	Classification	ประเภทภาระผูกพัน ใช้ classification ของ Contingent ใน Arrangement Type
CCF Rate	Conversion Rate	รณาค่า Credit Conversion Factor
Notional Amount	Amount	ยอดภาระผูกพัน
Collateral Type*	Classification	ประเภทหลักประกัน ใช้ Classification ใน Collateral Type
Collateral Value Amount*	Amount	มูลค่าหลักประกันรวม (ราคาประเมิน) / วงเงินค้ำประกัน
Collateral Pledged Amount*	Amount	มูลค่าหลักประกันส่วนที่นำมาหักได้
Exposure Method	Classification	วิธีการคิด Exposure ใช้ Classification ใน Exposure Type (เฉพาะตราสารอนุพันธ์)

## DS\_SMD : SMEs Data

สินเชื่อและภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

### โครงสร้างข้อมูล

Data Element	Data Type	Description
Organization Id	FI Code	รหัสสถาบันผู้ส่งข้อมูล
Data Set Date	Date	วันที่ของชุดข้อมูล
Primary Involved Party Id	Identification Number	เลขที่แสดงตนของคู่สัญญา (เช่น เลขทะเบียนนิติบุคคล, เลขประจำตัวประชาชน, ....)
Primary Unique Id Type	Classification	ประเภทเลขที่แสดงตนของคู่สัญญา
Arrangement Contract Date	Date	วันที่ทำสัญญา
FI Arrangement Number	Identification Number	เลขที่สัญญาของสถาบันการเงิน
Arrangement Business Type	Business Type	รหัสประเภทธุรกิจที่ขอกู้เงินสินเชื่อ หรือภาระผูกพัน (ISIC-BOT Rev. 4.0) <a href="#">ให้ยกเว้น ISIC-BOT Rev. 4.0 ตาม Appendix A (กรณียกเว้น ISIC บางกลุ่ม เริ่มใช้ตั้งแต่การรายงานข้อมูลงวดเดือนมีนาคม 2558 เป็นต้นไป)</a>
Arrangement Type <sup>1/</sup>	Classification	ประเภทของสัญญาที่เป็นเงินให้สินเชื่อและภาระผูกพัน ทั้งนี้ ภาระผูกพันให้รายงานเฉพาะ "การรับอวัลต์เงิน (018056)", "การรับรองเงิน (018057)" และ "การค้ำประกันการกู้ยืมเงิน (018059)" เท่านั้น
Asset Classification Type <sup>1/</sup>	Classification	สถานะการจัดชั้นเงินให้สินเชื่อ (เช่น ปกติ, กล่าวถึงเป็นพิเศษ, ต่ำกว่ามาตรฐาน, ....)
Collateral Type <sup>2/</sup>	Classification	ประเภทหลักประกัน
Collateral Value Amount <sup>2/</sup>	Amount	มูลค่าหลักประกันรวม (ราคาประเมิน) หรือวงเงินค้ำประกัน

## Classification : Collateral Type

**DS\_LAR : Loan Arrangement**

สินเชื่อรายตัว / รายสัญญา

**DS\_CAR : Contingent Arrangement**

ภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

**DS\_SMD : SMEs Data**

สินเชื่อและภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

การรายงาน Collateral Type

- เพิ่ม Classification ใหม่ 14 รายการ
- ปรับปรุงนิยาม Classification 2 รายการ

# Classification : Collateral Type

DS\_LAR : Loan Arrangement

สินเชื่อรายตัว / รายสัญญา

DS\_CAR : Contingent Arrangement

ภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

DS\_SMD : SMEs Data

สินเชื่อและภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

## การรายงาน Collateral Type

### 1) เพิ่ม Classification ใหม่ : สิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสาร (9 รายการ)

Code	Value	Description
286055	นิติบุคคล และบุคคลธรรมดา	
286056	ธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุนและสถาบันการเงินอื่นๆ	การค้าประกัน การอวัล การรับรองจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน และสถาบันการเงินอื่น ๆ รวมถึงกรณีให้ลูกหนี้แห่งสิทธิตามสิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสารนั้นเป็นธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน และสถาบันการเงินอื่น ๆ ด้วย
286093	การค้าประกัน	
286057	ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ	
286061	...	
286062	ตัวเงินที่ธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุนและสถาบันการเงินอื่นอวัลหรือรับรอง	
286062	Standby L/C	
286094	สิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสาร	สิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสาร ตามกฎหมายว่าด้วยหลักประกันทางธุรกิจ พ.ศ. 2558 ซึ่งสามารถเปลี่ยนมือได้ตามกฎหมาย แต่ไม่รวมถึงสิทธิในบัญชีเงินฝากและสิทธิการเช่า
286095	ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ	
286096	สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศในประเทศไทย และธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ	
286097	บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์	
286098	สถาบันการเงินที่จัดตั้งขึ้นโดยกฎหมายเฉพาะ	
286099	สถาบันการเงินอื่นๆ	

# Classification : Collateral Type

DS\_LAR : Loan Arrangement

สินเชื่อรายตัว / รายสัญญา

DS\_CAR : Contingent Arrangement

ภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

DS\_SMD : SMEs Data

สินเชื่อและภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

## การรายงาน Collateral Type

### 1) เพิ่ม Classification ใหม่ : สิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสาร (9 รายการ) (ต่อ)

Code	Value	Description
286055	นิติบุคคล และบุคคลธรรมดา	
286056	ธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุนและสถาบันการเงินอื่นๆ	การค้าประกัน การอ่าวัว การรับรองจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน และสถาบันการเงินอื่น ๆ รวมถึงกรณีที่ถูกหนี้แห่งสิทธิตามสิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสารนั้นเป็นธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน และสถาบันการเงินอื่น ๆ ด้วย
	...	
286064	นิติบุคคล	
286065	การค้าประกัน	
286068	การอ่าวัว และการรับรอง	
286100	สิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสาร	สิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสาร ตามกฎหมายว่าด้วยหลักประกันทางธุรกิจ พ.ศ. 2558 ซึ่งสามารถเปลี่ยนมือได้ตามกฎหมาย แต่ไม่รวมถึงสิทธิการเช่า
286069	อื่นๆที่เกี่ยวข้องกับนิติบุคคล	
286070	บุคคลธรรมดา	
286071	การค้าประกัน	
286072	การอ่าวัว และการรับรอง	
286101	สิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสาร	สิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสาร ตามกฎหมายว่าด้วยหลักประกันทางธุรกิจ พ.ศ. 2558 ซึ่งสามารถเปลี่ยนมือได้ตามกฎหมาย แต่ไม่รวมถึงสิทธิการเช่า
286073	อื่นๆที่เกี่ยวข้องกับบุคคลธรรมดา	
286074	ภาครัฐบาล	
286075	การค้าประกัน	
286076	การอ่าวัว และการรับรอง	
286102	สิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสาร	สิทธิเรียกร้องที่ไม่มีตราสาร ตามกฎหมายว่าด้วยหลักประกันทางธุรกิจ พ.ศ. 2558 ซึ่งสามารถเปลี่ยนมือได้ตามกฎหมาย แต่ไม่รวมถึงสิทธิการเช่า
286077	อื่น ๆ ที่เกี่ยวกับภาครัฐบาล	

# Classification : Collateral Type

**DS\_LAR : Loan Arrangement**

สินเชื่อรายตัว / รายสัญญา

**DS\_CAR : Contingent Arrangement**

ภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

**DS\_SMD : SMEs Data**

สินเชื่อและภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

การรายงาน Collateral Type

2) เพิ่ม Classification ใหม่ : กิจการ และอื่นๆ (2 รายการ)

Code	Value	Description
286103	กิจการ	กิจการตามกฎหมายว่าด้วยหลักประกันทางธุรกิจ พ.ศ. 2558
286078	หลักประกันที่ไม่สามารถแยกประเภทได้	
286079	หลักประกันที่ไม่สามารถแยกประเภทได้	
286080	คณะกรรมการ กรรมการ ผู้ถือหุ้น	
286081	คณะกรรมการ กรรมการ ผู้ถือหุ้น	
286104	อื่นๆ	
286082	ไม่มีหลักประกัน	

# Classification : Collateral Type

DS\_LAR : Loan Arrangement

สินเชื่อรายตัว / รายสัญญา

DS\_CAR : Contingent Arrangement

ภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

DS\_SMD : SMEs Data

สินเชื่อและภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

## การรายงาน Collateral Type

3) เพิ่ม Classification ใหม่ และปรับนิยาม Classification : ใบฝากประจำ หรือบัญชีเงินฝากประจำ และ เงินฝากออมทรัพย์

(เพิ่ม : 2 รายการ, ปรับปรุง : 2 รายการ)

Code	Value
286001	สังหาริมทรัพย์และอสังหาริมทรัพย์
286002	ที่ดินพร้อมสิ่งปลูกสร้าง และอื่นๆ
286003	ที่ดิน
286004	อาคารสิ่งปลูกสร้าง
286066	อาคารชุด
286005	สิทธิการเช่าอาคารและที่ดิน
286006	ที่ดินพร้อมสิ่งปลูกสร้าง
286007	สิทธิเหนือที่ดินและสิทธิเก็บกิน
286008	อื่นๆที่เกี่ยวกับที่ดินและสิ่งปลูกสร้าง
286009	โรงงาน เครื่องจักร
286010	โรงงาน
286011	เครื่องจักร
286012	อื่นๆที่เกี่ยวกับโรงงาน เครื่องจักร
286013	สินค้า
286014	สินค้า
286015	ใบรับสินค้า ใบประทวนสินค้า
286016	อื่นๆที่เกี่ยวข้องกับสินค้า
286067	เงินสด
286083	ธนบัตรที่ระลึก
286017	ใบฝาก หรือบัญชีเงินฝาก
286018	ใบฝากประจำ หรือบัญชีเงินฝากประจำของสถาบันการเงินนั้น
286091	ใบฝากประจำ หรือบัญชีเงินฝากประจำของสถาบันการเงินอื่น
286019	เงินฝากออมทรัพย์ของสถาบันการเงินนั้น
286092	เงินฝากออมทรัพย์ของสถาบันการเงินอื่น

# Classification : Collateral Type

DS\_LAR : Loan Arrangement

สินเชื่อรายตัว / รายสัญญา

DS\_CAR : Contingent Arrangement

ภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

DS\_SMD : SMEs Data

สินเชื่อและภาระผูกพันรายตัว / รายสัญญา

การรายงาน Collateral Type

## 4) เพิ่ม Classification ใหม่ : การค้ำประกัน (1รายการ)

ปัจจุบัน

Code	Value
286001	สังหาริมทรัพย์และอสังหาริมทรัพย์
286002	ที่ดินพร้อมสิ่งปลูกสร้าง และอื่นๆ
286003	ที่ดิน
...	...
286009	โรงงาน เครื่องจักร
...	...
286050	ทรัพย์สินทางปัญญา
286087	สิทธิบัตร
286088	อนุสิทธิบัตร
...	...
286055	นิติบุคคล และบุคคลธรรมดา
286056	ธนาคาร บริษัทเงินทุนและสถาบันการเงินอื่นๆ
286057	ธนาคารจดทะเบียนในประเทศไทย
286058	สาขาธนาคารต่างประเทศในประเทศไทย และธนาคารต่างประเทศ
286059	บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์
286060	สถาบันการเงินที่จัดตั้งขึ้นโดยกฎหมายเฉพาะ
286061	ค้ำเงินที่ธนาคาร บริษัทเงินทุนและสถาบันการเงินอื่นอาจหรือรับรอง
286062	Standby L/C
286063	สถาบันการเงินอื่นๆ

ปรับปรุงใหม่

Code	Value
286001	สังหาริมทรัพย์และอสังหาริมทรัพย์
286002	ที่ดินพร้อมสิ่งปลูกสร้าง และอื่นๆ
286003	ที่ดิน
...	...
286009	โรงงาน เครื่องจักร
...	...
286050	ทรัพย์สินทางปัญญา
286087	สิทธิบัตร
286088	อนุสิทธิบัตร
...	...
286055	นิติบุคคล และบุคคลธรรมดา
286056	ธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุนและสถาบันการเงินอื่นๆ
286093	การค้ำประกัน
286057	ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศไทย
286058	สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศในประเทศไทย และธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ
286059	บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์
286060	สถาบันการเงินที่จัดตั้งขึ้นโดยกฎหมายเฉพาะ
286063	สถาบันการเงินอื่นๆ
286061	ค้ำเงินที่ธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุนและสถาบันการเงินอื่นอาจหรือรับรอง
286062	Standby L/C

# DS\_LAR, DS\_CAR & DS\_SMD

กลุ่มสถาบัน  
การเงิน  
ที่เกี่ยวข้อง

ความถี่

กำหนดเวลา

DS_LAR	DS_CAR	DS_SMD*
<ul style="list-style-type: none"> <li>• ธพ.จดทะเบียนในประเทศไทย (Schema = TCB)</li> <li>• สาขาธพ. ต่างประเทศ (Schema = FCB1)</li> <li>• บริษัทเงินทุน (Schema = FCS)</li> <li>• บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ (Schema = CCS)</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ธพ.จดทะเบียนในประเทศไทย (Schema = TCB)</li> <li>• สาขาธพ. ต่างประเทศ (Schema = FCB1)</li> <li>• บริษัทเงินทุน (Schema = FCS)</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ธพ.จดทะเบียนในประเทศไทย (Schema = TCB)</li> </ul>
รายเดือน (จัดส่งภายใน 21 วัน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน )		รายเดือน (จัดส่งภายใน 1 เดือน นับจากวันสิ้นเดือนที่รายงาน )
เริ่มรายงานข้อมูลงวดแรกเดือนมกราคม 2561		

หมายเหตุ :

DS\_SMD \* : ธพ.จดทะเบียนในประเทศไทย (เฉพาะ ธนาคารพาณิชย์ไทย และธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อรายย่อย)

# สรุปการปรับปรุงชุดข้อมูล

Classification (CL) ที่ปรับปรุง	Dataset ที่เกี่ยวข้อง	การปรับปรุง		กำหนดเวลาเริ่มใช้
		Classification (CL)	Schema	
Capital Fund Item	DS_CAP	1) ปรับการรายงาน CL	-	มกราคม 61
	DS_CAPC	2) ปรับคำอธิบาย CL		มีนาคม 61
Credit Risk Item	DS_CRS	1) เพิ่ม CL ใหม่	New Schema	มกราคม 61
	DS_CRSC	2) ปรับคำอธิบาย CL		มีนาคม 61
Investment Type	DS_IVP	1) ปรับคำอธิบาย CL	-	รายงานได้ทันที
	DS_ISI			
	DS_PTX			
Customer Investment Type	DS_FTX			
	DS_LTX			
Collateral Type	DS_LAR	1) เพิ่ม CL ใหม่ 2) ปรับนิยาม CL	New Schema	มกราคม 61
	DS_CAR			
	DS_SMD			

หมายเหตุ :

- 1) 1 ส.ค. 60 สปท. เผยแพร่เอกสาร Data Set Document & โครงสร้างชุดข้อมูล (Schema)
- 2) ไม่มีการทดสอบ IWT

## การจัดทำ / รายงานชุดข้อมูล (Data Set)

คุณวิเชียร เชิดวรพงศ์

โทร. 0-2283-5120

Email : WichianC@bot.or.th

คุณวันชัย ธนากรกิจกุล

โทร. 0-2283-5633

Email : WanchaiT@bot.or.th

คุณอรจิรา ไชยชนेत्रดี

โทร. 0-2283-6434

Email : OrnjiraC@bot.or.th