

DRT DATA SET DOCUMENT

ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์และยอดคงค้าง  
ธุรกรรมยืมและคืนตราสารหนี้/ตลาดซื้อคืน

**Document information**

Revision history

| Version number | Released Date | Effective Date | Summary of changes | Revision marks |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.0 | 2 May 2019 | 1 June 2019 | First version | No |

**Table of Contents**

[**1. Document Overview 4**](#_Toc2089970)

[**2. Data Set Summary 7**](#_Toc2089971)

[**3. Data Set Details 8**](#_Toc2089972)

[1. Data Set: Derivatives Outstanding 8](#_Toc2089973)

[2. Data Set: Excess Cash and Margin Outstanding 12](#_Toc2089974)

[3. Data Set: Securities Borrowing and Lending/Repo Outstanding 14](#_Toc2089975)

[**4. Appendix A. Data Type 18**](#_Toc2089976)

# 1. Document Overview

This document provides information on the Data Sets to be submitted to the Bank of Thailand (BOT) for the Data Management System project. Most of the existing data submissions to BOT will be replaced by these Data Sets. The Data Sets will be based on the industry open standard XML (Extensible Markup Language) format, and will be electronically submitted to BOT via the BOT Electronic Report Submission system (ERS).

This document is divided into 4 major sections:

**1. Data Set Summary** section provides an overview of the Data Set(s) and specify format (i.e. XML, XLSX) and description of each Data Set.

**2. Data Set Data Element** section discusses in more details all the data elements withineach of the defined Data Set(s). For each of the data elements, we have defined a valid data type. The list of all data types can be found in the **Data Type Section**.

**3. Data Type** section, which also provides the submission format for each of the data type, as well as some sample value. There is a special kind of data elements called **Classification** data element, which is used to classify other data elements i.e. Payment Instrument, Payment Channel. Each classification data element will contain a number of possible values. For example, the possible values of Currency Id classification data element are ‘USD’, ‘JPY’, ‘THB’, etc. The list of all classifications can be found in the **Classification Document**.

**4. Schema Type and Schema Group** section, which describes schema type of each data set and also identify schema group for each data set.This sectionwill be available only when the Data Sets presented in this document are in XML format.

**Description:**

* **Granularity**: granularity of data (how detailed the data is).
* **Frequency**: frequency of data submission (how frequent each institution has to submit the data).
* **M**: mandatory field. This field cannot be blank.
* **O**: optional field. The field can contain value or blank depending on whether the institution has the data or not.
* **C**:mandatory with condition. These data are required under certain condition with other field(s).
* **Duplicated Record**: identify fields that BOT will check for duplicate records. If there are two records with identical value in these fields appeared in a data set, it will not pass basic validation.
* **Classification / View**: identify classification and view which is the possible value for each data element. **Classification** and **View** will be listed in **Classification Document.**
* **CB:** Commercial Bank includes Thai commercial banks, retail banks, foreign commercial bank’s subsidiary and foreign commercial bank’sbranch.
* **FC:** Finance Company**.**
* **CF:** Credit Foncier.
* **SFI:** Specialized Financial Institution includes Bank for Agriculture and Agricultural Cooperatives (BAAC), Government Saving Banks (GSB), Government Housing Banks (GHB), Islamic Bank of Thailand, Export-Import Bank of Thailand (EXIM), Small and Medium Enterprise Development Bank of Thailand (SME Bank), Thai Credit Guarantee ​Corporation, and Secondary Mortgage Corporation.
* **Non-FI:** Non-Financial Institution in this context means financial service provider under BOT supervision which is not classified as commercial bank, specialized financial institution, finance company and credit foncier. The example of Non-FI are credit card company, personal loan company under BOT supervision, nano finance provider under BOT supervision, e-payment service provider, money exchange agency, money transfer agency.

# 2. Data Set Summary

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **Data Set** | **ABBR** | **Granularity** | **Frequency** | **Description** |
|  | 1. **New Portfolio Investment Abroad** |  |  |  |  |
| 1 | Derivatives Outstanding  (ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์) | DS\_DRT | Monthly | Monthly | Sheet “Derivatives Outstanding” |
| 2 | Excess Cash and Margin Outstanding  (ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรม Excess Cash และ Margin เพื่อซื้อขายอนุพันธ์) | DS\_DRT | Monthly | Monthly | Sheet “Derivatives Excess Cash” |
| 3 | Securities Borrowing and Lending/Repo Outstanding  (ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending/Repurchase Market เพื่อซื้อขายอนุพันธ์) | DS\_DRT | Monthly | Monthly | Sheet “SBL and Repo” |

# 3. Data Set Details

## 1. Data Set: Derivatives Outstanding

ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์

**Frequency: Monthly**

| **No.** | | **Group** | **Data Element** | | **Data Type** | **Description** | **ผู้ลงทุน/ผู้แทนการลงทุน** | **Duplicated Record** | | **Classification / View** | |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M/O/C** |
| 1 | |  | | Data Set Date | Date | | วันที่ของชุดข้อมูล | M | Y |  | |
| 2 | |  | | Provider Unique Id | Identification Number | | รหัสผู้รายงาน | M | Y |  | |
| 3 | |  | | Provider Unique Id Type | Classification | | ประเภทรหัสผู้รายงาน | M | Y | Unique Id Type 1/ | |
| 4 | |  | | End Investor Id | Identification Number | | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน | M | Y |  | |
| 5 | |  | | End Investor Unique Id Type | Classification | | ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน | M | Y | Unique Id Type 1/ | |
| 6 | |  | | End Investor Name | Long Name | | ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน | M |  |  | |
| 7 | |  | | Objective Type | Classification | | ประเภทธุรกรรม | M | Y | Objective Type 1/ | |
| 8 | |  | | Provider Role and Responsibility | Classification Name | | บทบาทและความรับผิดชอบของผู้รายงาน | M | Y | Provider Role and Responsibility 2/ | |
| 9 | |  | | End Investor Type | Classification Name | | ประเภทสถาบันผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน | C | Y | End Investor Type 2/ | |
| 10 | |  | | Derivatives Type | Classification Name | | ประเภทตราสารอนุพันธ์ที่ลงทุน | M | Y | Derivatives Type 2/ | |
| 11 | |  | | Underlying Asset Type | Classification Name | | ประเภทสินทรัพย์อ้างอิง | M | Y | Underlying Asset Type 2/ | |
| 12 | |  | | Underlying Asset Name | Long Name | | ชื่อสินทรัพย์อ้างอิง | M | Y |  | |
| 13 | |  | | Maturity Date | Date | | วันครบกำหนดตามสัญญา | C |  |  | |
| 14 | |  | | Exchange Name | Classification Name | | ชื่อตลาดซื้อขายตราสารอนุพันธ์ | M | Y | Exchange Name 2/ | |
| 15 | |  | | Counterparty/Broker Name | Long Name | | ชื่อของคู่สัญญาที่ซื้อขายตราสารหรือชื่อของ broker ที่ใช้บริการ | C | Y |  | |
| 16 | |  | | Country | Classification | | ประเทศของผู้ออกตราสารอนุพันธ์ | M | Y | Country Id 1/ | |
| 17 | |  | | Currency | Classification | | สกุลเงินของตราสารอนุพันธ์ | M | Y | Currency Id 1/ | |
| 18 | |  | | Position | Classification Name | | สถานะซื้อ/ขาย | C | Y | Position 2/ | |
| 19 | |  | | Notional Amount | Amount | | มูลค่าของตราสารหรือจำนวนเงินตามสัญญา ตามสกุลเงินของตราสาร (Original Currency) | M |  |  | |
| 20 | |  | | Cost Value | Amount | | มูลค่าต้นทุนของตราสารอนุพันธ์ เป็นราคาที่ซื้อ/ได้มาซึ่งตราสาร รวมค่าใช้จ่ายในการได้มาซึ่งตราสาร ระบุตามสกุลเงินของตราสาร (Original Currency) | M |  |  | |
| 21 | |  | | Mark to Market Value | Amount | | ยอดคงค้างตามราคาตลาดของตราสารอนุพันธ์ โดยคำนวณจากราคาตลาดของตราสาร ณ วันสิ้นงวด ระบุตามสกุลเงินของตราสาร (Original Currency) | M |  |  | |
| 22 | |  | | Description | Description | | รายละเอียดเพิ่มเติม | O |  |  | |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification Document

2/ อ้างอิงจากเอกสาร DRT Classification Document

## 2. Data Set: Excess Cash and Margin Outstanding

ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรม Excess Cash และ Margin เพื่อซื้อขายอนุพันธ์

**Frequency: Monthly**

| **No.** | | **Group** | **Data Element** | | **Data Type** | | **Description** | **ผู้ลงทุน/ผู้แทนการลงทุน** | **Duplicated Record** | | **Classification / View** | |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M/O/C** |
| 1 | |  | | Data Set Date | Date | | วันที่ของชุดข้อมูล | | M | Y |  | |
| 2 | |  | | Provider Unique Id | Identification Number | | รหัสผู้รายงาน | | M | Y |  | |
| 3 | |  | | Provider Unique Id Type | Classification | | ประเภทรหัสผู้รายงาน | | M | Y | Unique Id Type 1/ | |
| 4 | |  | | End Investor Id | Identification Number | | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน | | M | Y |  | |
| 5 | |  | | End Investor Unique Id Type | Classification | | ประเภทรหัสของผู้เป็นเข้าของเงินลงทุน | | M | Y | Unique Id Type 1/ | |
| 6 | |  | | Objective Type | Classification | | ประเภทธุรกรรม | | M | Y | Objective Type 1/ | |
| 7 | |  | | Provider Role and Responsibility | Classification Name | | บทบาทและความรับผิดชอบของผู้รายงาน | | M | Y | Provider Role and Responsibility 2/ | |
| 8 | |  | | End Investor Type | Classification Name | | ประเภทสถาบันผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน | | C | Y | End Investor Type 2/ | |
| 9 | |  | | Currency | Classification | | สกุลเงินของตราสารอนุพันธ์ | | M | Y | Currency Id 1/ | |
| 10 | |  | | Excess Cash + Margin | Amount | | ยอดคงค้างเงินส่วนเกินและเงินวางประกัน ณ วันสิ้นงวด ระบุตามสกุลเงินของตราสาร (Original Currency) | | M |  |  | |
| 11 | |  | | Description | Description | | รายละเอียดเพิ่มเติม | | O |  |  | |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification Document

2/ อ้างอิงจากเอกสาร DRT Classification Document

## 3. Data Set: Securities Borrowing and Lending/Repo Outstanding

ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending และธุรกรรม Repo/Reverse Repo เพื่อซื้อขายอนุพันธ์

**Frequency: Monthly**

| **No.** | | **Group** | **Data Element** | | **Data Type** | | **Description** | **ผู้ลงทุน/ผู้แทนการลงทุน** | **Duplicated Record** | | **Classification / View** | |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **M/O/C** |
| 1 | |  | | Data Set Date | Date | | วันที่ของชุดข้อมูล | | M | Y |  | |
| 2 | |  | | Provider Unique Id | Identification Number | | รหัสผู้รายงาน | | M | Y |  | |
| 3 | |  | | Provider Unique Id Type | Classification | | ประเภทรหัสผู้รายงาน | | M | Y | Unique Id Type 1/ | |
| 4 | |  | | End Investor Id | Identification Number | | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน | | M | Y |  | |
| 5 | |  | | End Investor Unique Id Type | Classification | | ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน | | M | Y | Unique Id Type 1/ | |
| 6 | |  | | End Investor Name | Long Name | | ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน | | M |  |  | |
| 7 | |  | | Contract Type | Classification Name | | ประเภทของสัญญาที่ผู้ลงทุนทำธุรกรรม | | M | Y | Contract Type 2/ | |
| 8 | |  | | Contract - Maturity Date | Date | | วันครบกำหนดสัญญา SBL หรือ Repo | | M | Y |  | |
| 9 | |  | | Contract - Securities Type | Classification Name | | ประเภทหลักทรัพย์ | | M | Y | Securities Type/Collateral Type 2/ | |
| 10 | |  | | Contract - Securities Symbol/ISIN Code | Identification Number | | รหัสหลักทรัพย์ โดยระบุเป็นเลขรหัสหลักทรัพย์สากล (ISIN Code: International Securities Identifying Number Code) หรือ ชื่อย่อหลักทรัพย์ (Security Symbol) | | M | Y |  | |
| 11 | |  | | Contract - Issuer Name | Long Name | | ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ตามสัญญา SBL หรือ Repo | | M |  |  | |
| 12 | |  | | Contract - Currency | Classification | | สกุลเงินของหลักทรัพย์ตามสัญญา SBL หรือ Repo | | M | Y | Currency Id 1/ | |
| 13 | |  | | Contract - Market Value | Amount | | มูลค่าของหลักทรัพย์ตามราคาตลาด หรือราคาที่ใช้ตกลงซื้อขาย โดย   * กรณีเป็นหลักทรัพย์ที่มีราคาตลาด เช่น หุ้น ให้ใช้ราคาตลาด * กรณีเป็นหลักทรัพย์ที่ไม่มีราคาตลาด เช่น หุ้นกู้บางประเภท ให้ใช้ราคาที่ตกลงซื้อขาย ณ วันที่ประเมิน | | M |  |  | |
| 14 | |  | | Collateral Type | Classification Name | | ประเภทสินทรัพย์หลักประกัน | | M | Y | Securities Type/Collateral Type 2/ | |
| 15 | |  | | Collateral Symbol/ISIN Code | Identification Number | | รหัสสินทรัพย์ที่ใช้เป็นหลักประกัน โดยระบุเป็นเลขรหัสหลักทรัพย์สากล (ISIN Code: International Securities Identifying Number Code), ชื่อย่อหลักทรัพย์ (Security Symbol) หรือชื่อสินทรัพย์ที่ใช้เป็นหลักประกัน | | C | Y |  | |
| 16 | |  | | Collateral - Issuer Name | Long Name | | ชื่อผู้ออกสินทรัพย์ที่ใช้เป็นหลักประกัน | | C |  |  | |
| 17 | |  | | Collateral Currency | Classification | | สกุลเงินของสินทรัพย์ที่ใช้เป็นหลักประกัน | | M | Y | Currency Id 1/ | |
| 18 | |  | | Collateral Market Value | Amount | | มูลค่าของสินทรัพย์ที่เป็นหลักประกันตามราคาตลาด หรือราคาที่ใช้ตกลงซื้อขาย โดย   * กรณีเป็นหลักทรัพย์หรือสินทรัพย์ที่มีราคาตลาด เช่น หุ้น ให้ใช้ราคาตลาด * กรณีเป็นหลักทรัพย์หรือสินทรัพย์ที่ไม่มีราคาตลาด เช่น หุ้นกู้บางประเภท ให้ใช้ราคาที่ตกลงซื้อขาย ณ วันที่ประเมิน | | M |  |  | |
| 19 | |  | | Description | Description | | รายละเอียดเพิ่มเติม | | O |  |  | |

หมายเหตุ:

1/ อ้างอิงจากเอกสาร DMS Classification Document

2/ อ้างอิงจากเอกสาร DRT Classification Document

# 4. Appendix A. 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' |
| Classification Name | VarChar(200) | AAAA | No leading zeroes/blanks |  |
| 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’ |  |  |
| 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' |
| Timestamp | Char(19) | YYYY-MM-DD HH:MM:SS | A.D. year and timestamp | ‘2019-01-03 15:00:00’ |