

DRT DATA SET MANUAL

คู่มือการจัดทำชุดข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์  
และยอดคงค้างธุรกรรมยืมและคืนตราสารหนี้/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**](#_Toc2080414)

[**2. Data Set Reporting Guideline 6**](#_Toc2080415)

[1. แนวทางการตั้งชื่อ Data Set ตามมาตรฐาน ธปท. 6](#_Toc2080416)

[2. แนวทางการจัดทำชุดข้อมูล 6](#_Toc2080417)

[**3. Data Set Details 8**](#_Toc2080418)

[1. Data Set: Derivatives Outstanding 8](#_Toc2080419)

[2. Data Set: Excess Cash and Margin Outstanding 15](#_Toc2080420)

[3. Data Set: Securities Borrowing and Lending/Repo Outstanding 19](#_Toc2080421)

# Document Overview

This document provides information on the Data Set(s) to be submitted to the Bank of Thailand (BOT). The Data Set(s) will be electronically submitted to BOT via DMS Data Acquisition (Extranet/Internet).

**Description:**

* **Schema Validation**: Check the XML file content against XML schema to verify whether it is conform to the defined structure. The Schema Validation rules are as follows: **XML Syntax, XML Structure, Data Type, Value List and Data Format**. The Data Element and Data Type are specified in the Data Set Document while the Data Format is defined in the Data Set Manual i.e. Date Format. The Value Lists of each Data Element are referred to in the Data Set Document by using classification name and view name while the complete list of classification and view are shown in the Classification Document.
* **File Validation:** Validate by using Excel validation rules or an application developed on BOT excel template. In the case where the file is in other formats such as text file, the file validation will be done by BOT internal system. The File Validation rules are as follows: **Data Element, Data Type, Value List and Data Format**. The Data Element, Data Type, Value List and Data Format for the file are specified in the same pattern as XML Data Set, in the Data Set Document, Data Set Manual and Classification Document.
* **Data Set Validation**: Validate the data set content by BOT internal system after schema validation or file validation is completed. (Specific validation rule will explain in each data set.)
* **Cross Validation:** Check data consistency between data sets. (Specific validation rule will explain in each data set.)

ผู้ที่ต้องรายงานยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ และยอดคงค้างธุรกรรมยืมและให้ยืมหลักทรัพย์/ ตลาดซื้อคืน มีดังนี้

1. ผู้ลงทุน ตามประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่องการกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ ยกเว้น นิติบุคคลที่จดทะเบียนตามกฎหมายไทยหรือบุคคลธรรมดาที่มีถิ่นที่อยู่ในประเทศไทยที่มีเงินลงทุนในตราสารหรืออนุพันธ์ หรือเงินฝาก ตั้งแต่ 50 ล้านบาทขึ้นไป

2. ตัวแทนการลงทุน ตามประกาศเจ้าพนักงานควบคุมการแลกเปลี่ยนเงิน เรื่องการกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศ   
และอนุพันธ์

# Data Set Reporting Guideline

## แนวทางการตั้งชื่อ Data Set ตามมาตรฐาน ธปท.

รูปแบบ FXXXNNN\_YYYYMMDD\_ZZZ.xlsx

F ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล

XXX Subject Area

Nn รหัสประจำตัวผู้ส่งข้อมูล เช่น 999

YYYY ปีของข้อมูลให้ใช้ปี ค.ศ. 4 หลัก เช่น 2019 เป็นต้น

MM เดือนของข้อมูล มีค่าระหว่าง 01-12

DD วันที่ของข้อมูล มีค่าระหว่าง 01-31

ZZZ ชื่อย่อชุดข้อมูล

.xlsx นามสกุลชุดข้อมูล

เช่น ต้องการส่งข้อมูลงวด เดือนมกราคม ปี 2562 ให้ตั้งชื่อ File ดังนี้ MXXX999\_20190131\_ZZZ.xlsx

## แนวทางการจัดทำชุดข้อมูล

* 1. ให้จัดทำข้อมูลโดยยึดตามนิยามในเอกสาร DRT Data Set Document, DRT Data Set Manual และ DRT Classification Document
  2. จัดทำชุดข้อมูลบน Excel File ตามรูปแบบที่กำหนดโดย Excel Template เผยแพร่บน BOT Website รองรับ Excel ตั้งแต่ Version 2007
  3. ห้ามแก้ไขรูปแบบและสูตรที่ปรากฏในแบบฟอร์มรายงาน
  4. กรอกข้อมูลเฉพาะ cell ที่มีพื้นหลังเป็นสีเหลือง ใน Sheet "Derivatives Outstanding", "Derivatives Excess Cash" และ "SBL and Repo"
  5. ป้อนข้อมูลชื่อผู้รายงาน รหัสประจำตัวผู้รายงาน ประเภทรหัสประจำตัวผู้รายงาน วันที่ของชุดข้อมูล ใน sheet "ผู้ส่งข้อมูล" และป้อนข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ใน sheet "Derivatives Outstanding", "Derivatives Excess Cash" และยอดคงค้างธุรกรรมยืมและคืนตราสารหนี้/ตลาดซื้อคืนใน sheet "SBL and Repo"
  6. หาก sheet ใด ไม่มีข้อมูล ไม่ต้องกรอกข้อมูลใดๆ

# 3. Data Set Details

## 1. Data Set: Derivatives Outstanding

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Derivatives Outstanding เป็นข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์

**สถาบันที่ต้องรายงาน**

ผู้ลงทุน

ตัวแทนการลงทุน

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป

**File Name**

MDRTNn\_YYYYMMDD\_DRT.xlsx

**Sheet Name**

Derivatives Outstanding

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล ใช้ปี ค.ศ. | Data Set Validation:  วันที่จะต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Provider Unique Id | รหัสผู้รายงาน | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของผู้รายงานข้อมูลที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Provider Unique Id Type | ประเภทรหัสผู้รายงาน |  |
| End Investor Id | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |
| End Investor Unique Id Type | ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |
| End Investor Name | ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |
| Objective Type | ประเภทธุรกรรม |  |
| Provider Role and Responsibility | บทบาทและความรับผิดชอบของผู้รายงาน | Data Set Validation:   1. กรณี Objective Type (ประเภทธุรกรรม) = “465001 เพื่อตนเอง” จะต้องระบุค่า Provider Role and Responsibility เป็นหนึ่งในตัวเลือกดังต่อไปนี้เท่านั้น - ลงทุนเอง  - ลงทุนผ่าน Broker  - บล./บลจ.บริหาร - ฐานะ Market Maker 2. กรณี Objective Type (ประเภทธุรกรรม) = “465003 เพื่อลูกค้า” จะต้องระบุค่า Provider Role and Responsibility เป็นหนึ่งในตัวเลือกดังต่อไปนี้เท่านั้น - บล./บลจ.บริหาร - ฐานะ Broker |
| End Investor Type | ประเภทสถาบันผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน | Data Set Validation:   1. กรณี Objective Type = “465001 เพื่อตนเอง” และ Provider Role and Responsibility = “บล./บลจ.บริหาร” จะต้องระบุค่า End Investor Type เป็นหนึ่งในตัวเลือกดังต่อไปนี้เท่านั้น - กองทุนรวม - กองทุนส่วนบุคคล 2. กรณี Objective Type = “465003 เพื่อลูกค้า” และ Provider Role and Responsibility = “บล./บลจ.บริหาร” จะต้องระบุค่า End Investor Type เป็นหนึ่งในตัวเลือกดังต่อไปนี้เท่านั้น - กองทุนรวม - กองทุนส่วนบุคคล - กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ 3. กรณีที่เงื่อนไขไม่ตรงกับข้อ 1 และ 2 End Investor Type จะต้องไม่มีค่า |
| Derivatives Type | ประเภทตราสารอนุพันธ์ที่ลงทุน |  |
| Underlying Asset Type | ประเภทสินทรัพย์อ้างอิง กรณีที่ Underlying Asset Name เป็น Index ให้ระบุประเภทสินทรัพย์อ้างอิงตามประเภทตราสารที่ใช้คำนวณใน Index เช่น MSCI Emerging Markets Index ให้ระบุเป็น Equity |  |
| Underlying Asset Name | ชื่อสินทรัพย์อ้างอิง |  |
| Maturity Date | วันครบกำหนดตามสัญญา ใช้ปี ค.ศ. | Data Set Validation:  จะต้องมีค่า หากประเภทตราสารอนุพันธ์ที่ลงทุน (Derivatives type) ไม่เท่ากับ “Others” |
| Exchange Name | ชื่อตลาดซื้อขายตราสารอนุพันธ์  กรณีที่เป็นการซื้อขายในตลาด Exchange ให้ระบุค่า Exchange Name หากเป็นกรณีที่ซื้อขายนอกตลาดหรือกับคู่สัญญาโดยตรง ให้ระบุค่า Exchange Name เป็น OTC (Over-The-Counter) |  |
| Counterparty/Broker Name | ชื่อของคู่สัญญาที่ซื้อขายตราสารหรือชื่อของ broker ที่ใช้บริการ  กรณีที่ซื้อขายในตลาด Exchange ไม่ต้องระบุชื่อคู่สัญญา กรณีที่ซื้อขายนอกตลาด (OTC) จะต้องระบุชื่อคู่สัญญาหรือ Broker | Data Set Validation:   1. กรณี Exchange Name มีค่าไม่เท่ากับ “OTC” Counterparty/Broker Name จะต้องไม่มีค่า 2. กรณี Exchange Name มีค่าเท่ากับ “OTC” Counterparty/Broker Name จะต้องไม่เป็นค่าว่าง |
| Country | ประเทศของผู้ออกตราสารอนุพันธ์  กรณีที่ซื้อขายในตลาด exchange ให้ระบุประเทศที่ตั้งของตลาด exchange และกรณีที่ซื้อขายนอกตลาด (OTC) ให้ระบุประเทศผู้ออกตราสารอนุพันธ์ |  |
| Currency | สกุลเงินของตราสารอนุพันธ์ |  |
| Position | สถานะซื้อ/ขาย | Data Set Validation:  จะต้องมีค่า หากประเภทตราสารอนุพันธ์ที่ลงทุน (Derivatives Type) ไม่เท่ากับ “Swap” |
| Notional Amount | มูลค่าของตราสารหรือจำนวนเงินตามสัญญา ต้องระบุตามสกุลเงินของตราสาร (Original Currency)  กรณี option หรืออนุพันธ์ที่มีลักษณะคล้าย option (เช่น derivative warrant) ค่า Notional Amount = จำนวนสัญญา \* ขนาดสัญญา (Multiplier) \* exercise price | Data Set Validation:  จะต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 |
| Cost Value | มูลค่าต้นทุนของตราสารอนุพันธ์ เป็นราคาที่ซื้อ/ได้มาซึ่งตราสาร รวมค่าใช้จ่ายในการได้มาซึ่งตราสาร ระบุตามสกุลเงินของตราสาร (Original Currency)  กรณี option หรืออนุพันธ์ที่มีลักษณะคล้าย option (เช่น derivative warrant) ค่า Cost Value = จำนวนสัญญา \* ขนาดสัญญา (Multiplier) \* premium | Data Set Validation:  จะต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 |
| Mark to Market Value | ยอดคงค้างตามราคาตลาดของตราสารอนุพันธ์ โดยคำนวณจากราคาตลาดของตราสาร ณ วันสิ้นงวด ระบุตามสกุลเงินของตราสาร (Original Currency)  กรณีเป็นตราสารอนุพันธ์ที่ไม่มีราคาตลาด ให้ใช้ราคาที่ตกลงซื้อขาย ณ วันที่ประเมิน | Data Set Validation:  จะต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 |
| Description | รายละเอียดเพิ่มเติม |  |

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

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Excess Cash and Margin Outstanding เป็นข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรม Excess Cash และ Margin เพื่อซื้อขายอนุพันธ์

**สถาบันที่ต้องรายงาน**

ผู้ลงทุน

ตัวแทนการลงทุน

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป

**File Name**

MDRTNn\_YYYYMMDD\_DRT.xlsx

**Sheet Name**

Derivatives Excess Cash

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล ใช้ปี ค.ศ. | Data Set Validation:  วันที่จะต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Provider Id | รหัสผู้รายงาน | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของผู้รายงานข้อมูลที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Provider Id Type | ประเภทรหัสผู้รายงาน |  |
| End Investor Id | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |
| End Investor Unique Id Type | ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |
| Objective Type | ประเภทธุรกรรม |  |
| Provider Role and Responsibility | บทบาทและความรับผิดชอบของผู้รายงาน | Data Set Validation:   1. กรณี Objective Type (ประเภทธุรกรรม) = “465001 เพื่อตนเอง” จะต้องระบุค่า Provider Role and Responsibility เป็นหนึ่งในตัวเลือกดังต่อไปนี้เท่านั้น - ลงทุนเอง  - ลงทุนผ่าน Broker  - บล./บลจ.บริหาร - ฐานะ Market Maker 2. กรณี Objective Type (ประเภทธุรกรรม) = “465003 เพื่อลูกค้า” จะต้องระบุค่า Provider Role and Responsibility เป็นหนึ่งในตัวเลือกดังต่อไปนี้เท่านั้น - บล./บลจ.บริหาร - ฐานะ Broker |
| End Investor Type | ประเภทสถาบันผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน | Data Set Validation:   1. กรณี Objective Type = “465001 เพื่อตนเอง” และ Provider Role and Responsibility = “บล./บลจ.บริหาร” จะต้องระบุค่า End Investor Type เป็นหนึ่งในตัวเลือกดังต่อไปนี้เท่านั้น - กองทุนรวม - กองทุนส่วนบุคคล 2. กรณี Objective Type = “465003 เพื่อลูกค้า” และ Provider Role and Responsibility = “บล./บลจ.บริหาร” จะต้องระบุค่า End Investor Type เป็นหนึ่งในตัวเลือกดังต่อไปนี้เท่านั้น - กองทุนรวม - กองทุนส่วนบุคคล - กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ 3. กรณีที่เงื่อนไขไม่ตรงกันกับข้อ 1 และ 2 End Investor Type ต้องไม่มีค่า |
| Currency | สกุลเงินของตราสารอนุพันธ์ |  |
| Excess Cash + Margin | ยอดคงค้างเงินส่วนเกินและเงินวางประกัน ณ วันสิ้นงวด ระบุตามสกุลเงินของตราสาร (Original Currency) | Data Set Validation:  จะต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 |
| Description | รายละเอียดเพิ่มเติม |  |

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

**คำอธิบาย**

Data Set ชุด Securities Borrowing and Lending/Repo Outstanding เป็นข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรม Securities Borrowing and Lending และธุรกรรม Repo/Reverse Repo เพื่อซื้อขายอนุพันธ์

**สถาบันการเงินที่ต้องรายงาน**

ผู้ลงทุน

ตัวแทนการลงทุน

**ลักษณะข้อมูล**

รายเดือน

**ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล**

ทุกเดือน

**กำหนดการส่ง**

ภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป

**File Name**

MDRTNn\_YYYYMMDD\_DRT.xlsx

**Sheet Name**

SBL and Repo

| **Data Element (field)** | **คำอธิบาย** | **Validation Rule** |
| --- | --- | --- |
| Data Set Date | วันที่ของชุดข้อมูล ใช้ปี ค.ศ. | Data Set Validation:  วันที่จะต้องเป็นวันสิ้นเดือนตามปีปฏิทิน |
| Provider Id | รหัสผู้รายงาน | Data Set Validation:  ตรวจสอบกับรหัสมาตรฐานของผู้รายงานข้อมูลที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด |
| Provider Id Type | ประเภทรหัสผู้รายงาน |  |
| End Investor Id | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |
| End Investor Unique Id Type | ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |
| End Investor Name | ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |
| Contract Type | ประเภทของสัญญาที่ผู้ลงทุนทำธุรกรรม |  |
| Contract - Maturity Date | วันครบกำหนดสัญญา SBL หรือ Repo ใช้ปี ค.ศ. |  |
| Contract - Securities Type | ประเภทหลักทรัพย์ |  |
| Contract-Securities Symbol/ISIN Code | รหัสหลักทรัพย์ โดยระบุเป็นเลขรหัสหลักทรัพย์สากล (ISIN Code: International Securities Identifying Number Code) หรือ ชื่อย่อหลักทรัพย์ (Security Symbol) |  |
| Contract - Issuer Name | ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ตามสัญญา SBL หรือ Repo |  |
| Contract - Currency | สกุลเงินของหลักทรัพย์ตามสัญญา SBL หรือ Repo |  |
| Contract - Market Value | มูลค่าของหลักทรัพย์ตามราคาตลาด หรือราคาที่ใช้ตกลงซื้อขาย กรณีเป็นหลักทรัพย์ที่มีราคาตลาด เช่น หุ้น ให้ใช้ราคาตลาด และกรณีเป็นหลักทรัพย์ที่ไม่มีราคาตลาด เช่น หุ้นกู้บางประเภท ให้ใช้ราคาที่ตกลงซื้อขาย ณ วันที่ประเมิน | Data Set Validation:  จะต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 |
| Collateral Type | ประเภทสินทรัพย์หลักประกัน |  |
| Collateral Symbol/ISIN Code | รหัสสินทรัพย์ที่ใช้เป็นหลักประกัน โดยระบุเป็น เลขรหัสหลักทรัพย์สากล (ISIN Code: International Securities Identifying Number Code) หรือ ชื่อย่อหลักทรัพย์ (Security Symbol) หรือชื่อสินทรัพย์ที่ใช้เป็นหลักประกัน | Data Set Validation:   1. กรณีที่ Collateral Type มีค่าเท่ากับ “Equity” หรือ “Debt Securities” ค่า Collateral Symbol/ISIN Code ต้องไม่เป็นค่าว่าง 2. กรณีที่ Collateral Type มีค่าเท่ากับ “Cash” ค่า Collateral Symbol/ISIN Code ต้องไม่มีค่า 3. กรณีที่ Collateral Type มีค่าเท่ากับ “Others” ค่า Collateral Symbol/ISIN Code จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้ |
| Collateral - Issuer Name | ชื่อผู้ออกสินทรัพย์ที่ใช้เป็นหลักประกัน | Data Set Validation:   1. กรณีที่ Collateral Type มีค่าเท่ากับ “Equity” หรือ “Debt Securities” ค่า Collateral - Issuer Name ต้องไม่เป็นค่าว่าง 2. กรณีที่ Collateral Type มีค่าเท่ากับ “Cash” ค่า Collateral - Issuer Name ต้องไม่มีค่า 3. กรณีที่ Collateral Type มีค่าเท่ากับ “Others” ค่า Collateral - Issuer Name จะมีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้ |
| Collateral Currency | สกุลเงินของสินทรัพย์ที่ใช้เป็นหลักประกัน |  |
| Collateral Market Value | มูลค่าของสินทรัพย์ที่เป็นหลักประกันตามราคาตลาด หรือราคาที่ใช้ตกลงซื้อขาย  กรณีเป็นหลักทรัพย์หรือสินทรัพย์ที่มีราคาตลาด เช่น หุ้น ให้ใช้ราคาตลาด  กรณีเป็นหลักทรัพย์หรือสินทรัพย์ที่ไม่มีราคาตลาด เช่น หุ้นกู้บางประเภท ให้ใช้ราคาที่ตกลงซื้อขาย ณ วันที่ประเมิน | Data Set Validation:  จะต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 |
| Description | รายละเอียดเพิ่มเติม |  |