

เอกสารชุดข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์

(DATA FILE DOCUMENT)

Document information

Revision history

| Version number | Released Date | Effective  Date | Summary of changes | Revision marks |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **1.0** | **20 May 2008** | **31 August 2008** | **First version** | **No** |
| **2.0** | **31 July 2014** | **31 July 2014** | **Second version**  Reference to File “Summary of Changes on Version 2.0”  Remark: All changes from version 1.0 to version 2.0 are in blue font. | **Yes** |

**Table of Contents**

*Page*

[Document Overview 4](#_Toc394922843)

[Data File Summary 5](#_Toc394922844)

[Data File: Data Elements 6](#_Toc394922845)

[2.1 Overview of Portfolio and Derivative Investment Abroad (DF\_OPI) 6](#_Toc394922846)

[2.2 Movement of Portfolio Investment Abroad (DF\_MPI) 8](#_Toc394922847)

[2.3 Outstanding of Portfolio Investment Abroad (DF\_PIA) 9](#_Toc394922848)

[2.4 Foreign Currency Deposit (DF\_FCD) 10](#_Toc394922849)

[2.5 Return on Portfolio and Derivative Investment Abroad (DF\_RPI) 12](#_Toc394922850)

[2.6 Hedging of Portfolio and Derivative Investment Abroad (DF\_HPI) 13](#_Toc394922851)

[2.7 Debt Securities Registry (DF\_DSR) 15](#_Toc394922852)

[2.8 Equity Securities Registry (DF\_ESR) 17](#_Toc394922853)

[2.9 Foreign Fund Registry (DF\_FFR) 18](#_Toc394922854)

[2.10 Issuer Registry (DF\_ISR) 19](#_Toc394922855)

[Appendix A: Data Type 20](#_Toc394922856)

# Document Overview

This document provides information on the Data files to be submitted to the Bank of Thailand (BOT). The Data Files will be based on the industry open standard XML (Extensible Markup Language) format, and will be electronically submitted to BOT via Data Acquisition (Extranet/Internet).

This document is divided into 3 major sections:

**1. Data File Summary** section provides an overview of the new Data File, by listing all the

Data Files in the new system, and how they are related to the existing reports.

**2. Data File Data Element** section discusses in more details all the data elements within

each of the defined Data Files. 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 element, for example

Currency Id, Country Id, Arrangement Type, etc. Classification data elements will contain a  
 number of possible values, for example Currency Id can be ‘USD, ‘JPY’, or ‘THB’, etc. The

list of all classifications can be found in the Classification Document.

**Vocabulary:**

* **Granularity** means granularity of data (how detailed the data is).
* **Frequency** means frequency of submission (how frequent each institution has to submit the data).

# Data File Summary

| **Data File Subject Area** | | **ABBR** | **Granularity** | **Frequency** | **Description** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | รายงานภาพรวมการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ (Overview of Portfolio and Derivative Investment Abroad) | DF\_OPI | รายเดือน | ส่งภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป |  |
| 2 | รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์ในต่างประเทศ (Movement of Portfolio Investment Abroad) | DF\_MPI | รายเดือน | ส่งภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป |  |
| 3 | รายงานยอดคงค้างการลงทุนในหลักทรัพย์ในต่างประเทศ (Outstanding of Portfolio Investment Abroad) | DF\_PIA | รายเดือน | ส่งภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป |  |
| 4 | รายงานบัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ  (Foreign Currency Deposit) | DF\_FCD | รายเดือน | ส่งภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป |  |
| 5 | รายงานผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์  (Return on Portfolio and Derivative Investment Abroad) | DF\_RPI | รายเดือน | ส่งภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป |  |
| 6 | รายงานยอดคงค้างธุรกรรมเงินตราต่างประเทศล่วงหน้าเกี่ยวกับการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ (Hedging of Portfolio and Derivative Investment Abroad) | DF\_HPI | รายเดือน | ส่งภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป |  |
| 7 | รายงานคุณสมบัติตราสารหนี้  (Debt Securities Registry) | DF\_DSR | รายเดือน | ส่งภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป |  |
| 8 | รายงานคุณสมบัติตราสารทุน  (Equity Securities Registry) | DF\_ESR | รายเดือน | ส่งภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป |  |
| 9 | รายงานคุณสมบัติกองทุนต่างประเทศ  (Foreign Fund Registry) | DF\_FFR | รายเดือน | ส่งภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป |  |
| 10 | รายงานคุณสมบัติผู้ออกตราสาร  (Issuer Registry) | DF\_ISR | รายเดือน | ส่งภายในวันที่ 10 ของเดือนถัดไป |  |

# Data File: Data Elements

|  |  |
| --- | --- |
| **Data File:** | 2.1 Overview of Portfolio and Derivative Investment Abroad (DF\_OPI) |
| **Frequency:** | **Monthly** |

| **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **M** | **O** | **C** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Organization Id | Provider Code | รหัสสถาบันผู้รายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ | X |  |  |
| Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | X |  |  |
| Provider Role and Responsibility | Classification | บทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล | X |  |  |
| End Investor Id | Identification Number | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน โดยใช้เลขที่แสดงตนของบุคคล/นิติบุคคล/องค์กร |  |  | X |
| End Investor Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |  | X |
| End Investor Name | Long Name | ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (ชื่อเต็ม ภาษาไทย) |  |  | X |
| End Investor Type | Classification | ประเภทของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน  ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูลเป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร และเพื่อลูกค้า บล./บลจ.  บริหาร ให้ระบุ End Investor Type |  |  | X |
| Fund Id | Identification Number | รหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Unique Id Type | Classification | ประเภทของรหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Name | Long Name | ชื่อกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ |  |  | X |
| Fund Management Company/ Broker Company | Long Name | บริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ หรือ บริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker   * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ (Fund Management Company) * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง ลงทุนผ่าน Broker (ตัดสินใจเอง) ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker (Broker Company) |  |  | X |
| Fund Type | Classification | ประเภทของกองทุนรวม  เฉพาะ End Investor Type ประเภท Mutual Fund ให้ระบุว่าเป็น Term Fund หรือ No-Term Fund |  |  | X |
| Term of Mutual Fund | Number | อายุโครงการของกองทุนตามหนังสือชี้ชวน (จำนวนหน่วยเป็นวัน) เฉพาะกองทุนประเภท Term Fund |  |  | X |
| Net Asset Value | Amount | มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (บาท) กรณีเป็นสกุลเงินที่มิใช่สกุลเงินบาท ให้ใช้อัตราแลกเปลี่ยนตามที่กำหนดไว้ในโครงการในการคำนวณ แบ่งตามประเภทผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน ดังนี้   * กองทุนรวม และกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ : มูลค่าสินทรัพย์สุทธิรวมของกองทุน * กองทุนส่วนบุคคล, บุคคลลงทุนผ่าน Broker และบริษัทหลักทรัพย์/บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม (เฉพาะการลงทุนเพื่อตนเอง): วงเงินลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ที่ได้รับอนุมัติจาก ก.ล.ต. * กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ กองทุนประกันสังคม บริษัทประกันชีวิต บริษัทประกันวินาศภัย : วงเงินลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ ที่ได้รับอนุมัติจากหน่วยงานที่กำกับดูแลของแต่ละผู้ลงทุน * นิติบุคคลที่ได้รับอนุญาตให้ลงทุนในหลักทรัพย์ตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ (ไม่รวมการลงทุนผ่านกองทุนส่วนบุคคล และการลงทุนผ่าน Broker) : วงเงินลงทุนในตราสารในต่างประเทศที่ได้รับอนุมัติจากคณะกรรมการบริษัท/ผู้มีอำนาจของบริษัท | X |  |  |
| Percentage of NAV of Foreign Investment | Amount | อัตราร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ หรือมูลค่ารวมเงินลงทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ เทียบกับ Net Asset Value กรณีเป็นสกุลเงินที่มิใช่สกุลเงินบาท ให้ใช้อัตราแลกเปลี่ยนตามที่กำหนดไว้ในโครงการในการคำนวณ | X |  |  |
| Percentage of NAV of Foreign Investment Policy | Amount | อัตราร้อยละของนโยบายการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ เทียบกับ Net Asset Value | X |  |  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  |  |  |
| **Data File:** |  | 2.2 Movement of Portfolio Investment Abroad (DF\_MPI) |
| **Frequency:** |  | **Monthly** |

| **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **M** | **O** | **C** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Organization Id | Provider Code | รหัสสถาบันผู้รายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ | X |  |  |
| Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | X |  |  |
| Provider Role and Responsibility | Classification | บทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล | X |  |  |
| End Investor Id | Identification Number | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน โดยใช้เลขที่แสดงตนของบุคคล/นิติบุคคล/องค์กร |  |  | X |
| End Investor Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |  | X |
| End Investor Name | Long Name | ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (ชื่อเต็ม ภาษาไทย) |  |  | X |
| End Investor Type | Classification | ประเภทของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน  ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูลเป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร และเพื่อลูกค้า บล./บลจ.  บริหาร ให้ระบุ End Investor Type |  |  | X |
| Fund Id | Identification Number | รหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Unique Id Type | Classification | ประเภทของรหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Name | Long Name | ชื่อกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ |  |  | X |
| Fund Management Company/ Broker Company | Long Name | บริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสาร  ในต่างประเทศและอนุพันธ์ หรือ บริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker   * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ (Fund Management Company) * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง ลงทุนผ่าน Broker (ตัดสินใจเอง) ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker (Broker Company) |  |  | X |
| Asset Type | Classification | ประเภทสินทรัพย์ | X |  |  |
| Securities Code | Identification Number | รหัสตราสารการเงิน |  |  | X |
| Securities Identification Type | Classification | ประเภทรหัสตราสารการเงิน เช่น ISIN, SEDOL |  |  | X |
| Currency Id | Classification | รหัสสกุลเงินที่ใช้ในการชำระราคาหลักทรัพย์ | X |  |  |
| Transaction Type | Classification | ประเภทรายการซื้อ หรือ ขาย หรือ เพิ่มขึ้นด้วยเหตุผลอื่น หรือ ลดลงด้วยเหตุผลอื่น | X |  |  |
| Trade Date | Date | วันที่ตกลงซื้อ หรือ ขายหลักทรัพย์ หรือ เพิ่มขึ้นด้วยเหตุผลอื่น หรือ ลดลงด้วยเหตุผลอื่น | X |  |  |
| Value Date | Date | วันที่ชำระราคา และส่งมอบหลักทรัพย์ | X |  |  |
| Yield to Maturity | Amount | อัตราผลตอบแทนถึงวันครบกำหนดไถ่ถอน ณ วันที่ซื้อ กรณีที่มีการซื้อตราสารหนี้เพิ่ม ให้ใช้อัตราผลตอบแทนเฉลี่ย จากการซื้อตราสารหนี้ในแต่ละครั้ง  (เฉพาะ Financial Market Instrument Type ประเภทตราสารหนี้) |  | X |  |
| Original Currency Cost Value | Amount | จำนวนเงินตามสกุลเงินเดิม | X |  |  |
| Description | Description | ระบุรายละเอียดเพิ่มเติม |  | X |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Data File:** | 2.3 Outstanding of Portfolio Investment Abroad (DF\_PIA) |
| **Frequency:** | **Monthly** |

| **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **M** | **O** | **C** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Organization Id | Provider Code | รหัสสถาบันผู้รายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ | X |  |  |
| Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | X |  |  |
| Provider Role and Responsibility | Classification | บทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล | X |  |  |
| End Investor Id | Identification Number | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน โดยใช้เลขที่แสดงตนของบุคคล/นิติบุคคล/องค์กร |  |  | X |
| End Investor Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |  | X |
| End Investor Name | Long Name | ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (ชื่อเต็ม ภาษาไทย) |  |  | X |
| End Investor Type | Classification | ประเภทของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน  ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูลเป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร และเพื่อลูกค้า บล./บลจ.  บริหาร ให้ระบุ End Investor Type |  |  | X |
| Fund Id | Identification Number | รหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Unique Id Type | Classification | ประเภทของรหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Name | Long Name | ชื่อกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ |  |  | X |
| Fund Management Company/ Broker Company | Long Name | บริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ หรือ บริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker   * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ (Fund Management Company) * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง ลงทุนผ่าน Broker (ตัดสินใจเอง) ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker (Broker Company) |  |  | X |
| Asset Type | Classification | ประเภทสินทรัพย์ | X |  |  |
| Securities Code | Identification Number | รหัสตราสารการเงิน |  |  | X |
| Securities Identification Type | Classification | ประเภทรหัสตราสารการเงิน เช่น ISIN, SEDOL |  |  | X |
| Currency Id | Classification | รหัสสกุลเงินที่ใช้ในการชำระราคาหลักทรัพย์ | X |  |  |
| Securities Obligation | Classification | หลักทรัพย์ที่ไปลงทุนเป็นหลักทรัพย์ที่ได้จากธุรกรรม Securities Borrowing and Lending หรือ Repurchase Market Agreement (Repo/Reverse Repo) |  | X |  |
| Original Currency Cost Value | Amount | จำนวนเงินตามสกุลเงินเดิม | X |  |  |
| USD Equivalent Cost Value | Amount | จำนวนเงินเทียบเท่า USD | X |  |  |
| Original Currency Market Value | Amount | จำนวนเงินตามสกุลเงินเดิม โดยแสดงจำนวนเงินตามราคา Mark to Market | X |  |  |
| Description | Description | ระบุรายละเอียดเพิ่มเติม |  | X |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Data File:** | 2.4 Foreign Currency Deposit (DF\_FCD) |
| **Frequency:** | **Monthly** |

| **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **M** | **O** | **C** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Organization Id | Provider Code | รหัสสถาบันผู้รายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ | X |  |  |
| Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | X |  |  |
| Provider Role and Responsibility | Classification | บทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล | X |  |  |
| End Investor Id | Identification Number | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน โดยใช้เลขที่แสดงตนของบุคคล/นิติบุคคล/องค์กร |  |  | X |
| End Investor Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |  | X |
| End Investor Name | Long Name | ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (ชื่อเต็ม ภาษาไทย) |  |  | X |
| End Investor Type | Classification | ประเภทของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน  ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูลเป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร และเพื่อลูกค้า บล./บลจ.  บริหาร ให้ระบุ End Investor Type |  |  | X |
| Fund Id | Identification Number | รหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Unique Id Type | Classification | ประเภทของรหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Name | Long Name | ชื่อกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ |  |  | X |
| Fund Management Company/ Broker Company | Long Name | บริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ หรือ บริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker   * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ (Fund Management Company) * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง ลงทุนผ่าน Broker (ตัดสินใจเอง) ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker (Broker Company) |  |  | X |
| Counter Party SWIFT Code | SWIFT Code | รหัสสถาบันที่รับฝากเงินตราต่างประเทศ หรือ บริษัทหลักทรัพย์ที่ผู้ลงทุนเปิดบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ ที่กำหนดตามมาตรฐาน SWIFT | X |  |  |
| Counter Party Name | Long Name | ชื่อสถาบันที่รับฝากเงินตราต่างประเทศ | X |  |  |
| Country Id | Classification | รหัสประเทศที่ตั้งของสถาบันที่รับฝากเงินตราต่างประเทศ | X |  |  |
| Account Number | Identification Number | เลขที่บัญชีเงินฝากเงินตราต่างประเทศ | X |  |  |
| Deposit Account Type | Classification | ประเภทของบัญชีเงินฝาก ใช้ classification ใน Arrangement type | X |  |  |
| Account Type | Classification | ประเภทบัญชีเพื่อการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ | X |  |  |
| Term | Number | อายุของเงินฝากประจำ (ตามหน่วยที่ระบุ) |  |  | X |
| Term Unit | Classification | หน่วยของอายุของเงินฝากประจำ (day, month, year) |  |  | X |
| Deposit Maturity Date | Date | วันที่ครบกำหนดของเงินฝาก (เฉพาะ Fixed Deposit / Contractual Saving Deposit) |  |  | X |
| Interest Rate Type | Classification | ประเภทอัตราดอกเบี้ย | X |  |  |
| Interest Rate | Interest Rate | อัตราดอกเบี้ยของเงินฝาก เฉพาะกรณีเงินฝากมีการกำหนดอัตราดอกเบี้ยคงที่ |  |  | X |
| Interest Rate Margin | Interest Rate | ส่วนเพิ่ม/ลดอัตราดอกเบี้ยจากอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง เฉพาะกรณีเงินฝากมีการกำหนดอัตราดอกเบี้ยลอยตัว |  |  | X |
| Currency Id | Classification | รหัสสกุลเงิน | X |  |  |
| Original Currency Deposit Amount | Amount | จำนวนเงินฝาก |  | X |  |
| Original Currency Withdrawal Amount | Amount | จำนวนเงินถอน |  | X |  |
| Original Currency Outstanding Amount | Amount | ยอดคงค้าง | X |  |  |
| USD Equivalent Outstanding Amount | Amount | ยอดคงค้างเทียบเท่าสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. | X |  |  |
| Description | Description | ระบุรายละเอียดเพิ่มเติม เช่น ระบุเงื่อนไขหรือรายละเอียดของเงินฝาก |  |  | X |

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |
|  |  |
|  | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Data File:** | | 2.5 Return on Portfolio and Derivative Investment Abroad (DF\_RPI) | | | | | | |
| **Frequency:** | | **Monthly** | | | | | | |
| **Data Element** | | | **Data Type** | **Description** | **M** | **O** | **C** |
| Organization Id | | | Provider Code | รหัสสถาบันผู้รายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ | X |  |  |
| Data Set Date | | | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | X |  |  |
| Provider Role and Responsibility | | | Classification | บทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล | X |  |  |
| End Investor Id | | | Identification Number | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน โดยใช้เลขที่แสดงตนของบุคคล/นิติบุคคล/องค์กร |  |  | X |
| End Investor Unique Id Type | | | Classification | ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |  | X |
| End Investor Name | | | Long Name | ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (ชื่อเต็ม ภาษาไทย) |  |  | X |
| End Investor Type | | | Classification | ประเภทของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน  ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูลเป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร และเพื่อลูกค้า บล./บลจ.  บริหาร ให้ระบุ End Investor Type |  |  | X |
| Fund Id | | | Identification Number | รหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Unique Id Type | | | Classification | ประเภทของรหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Name | | | Long Name | ชื่อกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ |  |  | X |
| Fund Management Company/ Broker Company | | | Long Name | บริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ หรือ บริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker   * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ (Fund Management Company) * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง ลงทุนผ่าน Broker (ตัดสินใจเอง) ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker (Broker Company) |  |  | X |
| Country Id | | | Classification | รหัสประเทศผู้ออกตราสาร หรือรหัสประเทศของสถาบันที่เป็นผู้รับฝากเงิน หรือรหัสประเทศผู้ทำธุรกรรมอื่น ๆ ที่เกี่ยวข้อง | X |  |  |
| Currency Id | | | Classification | รหัสสกุลเงิน | X |  |  |
| Cumulative Interest Income Amount | | | Amount | จำนวนเงินสะสมของดอกเบี้ยรับเทียบเท่าสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. |  | X |  |
| Cumulative Dividend Amount | | | Amount | จำนวนเงินสะสมของเงินปันผลรับเทียบเท่าสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. |  | X |  |
| Cumulative Gain or Loss Amount | | | Amount | จำนวนเงินสะสมของกำไรขาดทุนจากการขายตราสาร (ไม่รวมธุรกรรม Derivative)  เทียบเท่าสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. (หากจำนวนเงินสะสมเป็นขาดทุน ให้แสดงด้วยเครื่องหมายลบ (-)) |  | X |  |
| Cumulative Derivative’s Income or Expense Amount | | | Amount | จำนวนเงินสะสมของรายรับ/รายจ่าย (รวมกำไร/ขาดทุน)ที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรม Derivative  เทียบเท่าสกุลเงินดอลลาร์ สรอ.เช่น ค่าธรรมเนียม,  ค่า Premium, เงิน margin (หากจำนวนเงินสะสมเป็นรายจ่าย/ขาดทุน ให้แสดงด้วยเครื่องหมายลบ (-)) |  | X |  |
| Cumulative Other Income or Expense Amount | | | Amount | จำนวนเงินสะสมของรายได้/ค่าใช้จ่ายอื่นๆ เทียบเท่าสกุลเงินดอลลาร์ สรอ. (หากจำนวนเงินสะสมเป็นรายจ่าย ให้แสดงด้วยเครื่องหมายลบ (-)) |  | X |  |
| Description | | | Description | ระบุรายละเอียดเพิ่มเติม |  | X |  |
|  | | | | | |

|  |  |
| --- | --- |
| **Data File:** | 2.6 Hedging of Portfolio and Derivative Investment Abroad (DF\_HPI) |
| **Frequency:** | **Monthly** |

| **Data Element** | **Data Type** | **Description** | **M** | **O** | **C** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Organization Id | Provider Code | รหัสสถาบันผู้รายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ | X |  |  |
| Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | X |  |  |
| Provider Role and Responsibility | Classification | บทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล | X |  |  |
| End Investor Id | Identification Number | รหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน โดยใช้เลขที่แสดงตนของบุคคล/นิติบุคคล/องค์กร |  |  | X |
| End Investor Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน |  |  | X |
| End Investor Name | Long Name | ชื่อผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน (ชื่อเต็ม ภาษาไทย) |  |  | X |
| End Investor Type | Classification | ประเภทของผู้เป็นเจ้าของเงินลงทุน  ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูลเป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร และเพื่อลูกค้า บล./บลจ.  บริหาร ให้ระบุ End Investor Type |  |  | X |
| Fund Id | Identification Number | รหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Unique Id Type | Classification | ประเภทของรหัสกองทุน |  |  | X |
| Fund Name | Long Name | ชื่อกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ |  |  | X |
| Fund Management Company/ Broker Company | Long Name | บริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ หรือ บริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker   * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง บล./บลจ.บริหาร ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่บริหารกองทุนที่ลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ (Fund Management Company) * ในกรณีบทบาทหน้าที่ของผู้รายงานข้อมูล เป็นเพื่อตนเอง ลงทุนผ่าน Broker (ตัดสินใจเอง) ให้ระบุชื่อบริษัทที่ทำหน้าที่เป็น Broker (Broker Company) |  |  | X |
| Counter Party Id | Identification Number | รหัสสถาบันที่ผู้ลงทุนทำธุรกรรมซื้อ / ขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า | X |  |  |
| Counter Party Unique Id Type | Classification | ประเภทของรหัสสถาบันที่ผู้ลงทุนทำธุรกรรมซื้อ / ขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า | X |  |  |
| Counter Party Name | Long Name | ชื่อของสถาบันที่ผู้ลงทุนทำธุรกรรมซื้อ / ขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า | X |  |  |
| Country Id | Classification | รหัสประเทศที่ตั้งของสถาบันที่ผู้ลงทุนทำธุรกรรมซื้อ / ขายเงินตราต่างประเทศล่วงหน้า | X |  |  |
| FI Arrangement Number | Identification Number | เลขที่สัญญา | X |  |  |
| Related FI Arrangement Number | Identification Number | เลขที่สัญญาคู่ตรงข้าม |  | X |  |
| Trade Date | Date | วันที่ตกลงทำธุรกรรม | X |  |  |
| Effective Date | Date | วันที่สัญญามีผลใช้บังคับ | X |  |  |
| Maturity Date | Date | วันที่ครบกำหนดสัญญา | X |  |  |
| Arrangement Type | Classification | ประเภทธุรกรรม ใช้ CL Financial Market Instrument Type | X |  |  |
| Buy Currency Id | Classification | รหัสสกุลเงินที่ซื้อ | X |  |  |
| Buy Amount | Amount | จำนวนเงินที่ซื้อ | X |  |  |
| Sell Currency Id | Classification | รหัสสกุลเงินที่ขาย | X |  |  |
| Sell Amount | Amount | จำนวนเงินที่ขาย | X |  |  |
| Exchange Rate | Exchange Rate | อัตราแลกเปลี่ยนที่ตกลงซื้อขาย | X |  |  |
| Description | Description | ระบุรายละเอียดเพิ่มเติม เช่น กรณีประเภทธุรกรรมเป็น Other Derivatives ให้ระบุประเภทของ Derivatives |  |  | X |

|  |  |
| --- | --- |
| **Data File:** | 2.7 Debt Securities Registry (DF\_DSR) |
| **Frequency:** | **Monthly** |

| Data Element | Data Type | Description | M | O | C |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Organization Id | Provider Code | รหัสสถาบันผู้รายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ | X |  |  |
| Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | X |  |  |
| Securities Code\* | Identification Number | รหัสตราสารการเงิน | X |  |  |
| Securities Identification Type\* | Classification | ประเภทรหัสตราสารการเงิน เช่น ISIN Code, CUSIP, SEDOL เป็นต้น | X |  |  |
| Financial Market Instrument Type | Classification | ประเภทตราสารการเงิน | X |  |  |
| Debt Securities Name | Long Name | ชื่อตราสารหนี้ (ภาษาอังกฤษ) | X |  |  |
| Issuer Id | Identification Number | รหัสของผู้ออกตราสาร โดยใช้เลขที่แสดงตนของบุคคล/นิติบุคคล/องค์กร | X |  |  |
| Issuer Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของผู้ออกตราสาร | X |  |  |
| Currency Id | Classification | รหัสสกุลเงิน | X |  |  |
| Country Id of Registration | Classification | รหัสประเทศที่จดทะเบียนหลักทรัพย์ | X |  |  |
| Issue Date | Date | วันที่ออกตราสารหนี้ | X |  |  |
| Perpetual Bond Flag | Flag | ตราสารหนี้ไม่กำหนดวันครบอายุตราสาร โดยจะไม่มีการไถ่ถอนคืนจนกว่าบริษัทจะเลิกกิจการ   และจะมีการจ่ายดอกเบี้ยอย่างต่อเนื่องไปเรื่อยๆ ตามที่กำหนดไว้  มีคุณสมบัติเป็น Perpetual Bond = ‘1’  ไม่มีคุณสมบัติเป็น Perpetual Bond = ‘0’ | X |  |  |
| Maturity Date | Date | วันที่หมดอายุ (วันที่ครบกำหนดไถ่ถอน) |  |  | X |
| Coupon Rate Type\* | Classification | ประเภทอัตราผลตอบแทน (จัดเก็บ CL ย่อยสุดของแต่ละประเภท เช่น ประเภท Float รหัสย่อยสุดคือ BIBOR, ประเภท Fix ย่อยสุด คือ Fix) | X |  |  |
| Coupon Currency Id\* | Classification | รหัสสกุลเงินสำหรับการจ่ายดอกเบี้ย | X |  |  |
| Coupon Rate\* | Interest Rate | อัตราดอกเบี้ย เฉพาะกรณีประเภทของอัตราดอกเบี้ยคงที่ เท่านั้น |  |  | X |
| Coupon Rate Margin\* | Interest Rate | ส่วนเพิ่ม/ลดอัตราดอกเบี้ยจากอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง (เฉพาะกรณีประเภทของอัตราดอกเบี้ยลอยตัวเท่านั้น) |  |  | X |
| Guarantor Name\* | Long Name | ชื่อของบริษัทที่นำหลักทรัพย์มาค้ำประกัน |  | X |  |
| Guarantor Country Id\* | Classification | รหัสประเทศที่อยู่ของบริษัทที่นำหลักทรัพย์มาค้ำประกัน |  | X |  |
| Business Sector of Guarantor\* | Classification | ประเภทธุรกิจหลักของบริษัทที่นำหลักทรัพย์มาค้ำประกัน |  | X |  |
| Guarantee Currency Id\* | Classification | รหัสสกุลเงินของสินทรัพย์/หลักทรัพย์ที่ใช้ค้ำประกัน |  | X |  |
| Guarantee Amount \* | Amount | มูลค่าสินทรัพย์/หลักทรัพย์ที่ใช้ค้ำประกัน |  | X |  |
| Underlying Type\* | Classification | ประเภทปัจจัยอ้างอิง เช่น ตราสารทุน ดัชนี |  | X |  |
| Underlying Name\* | Long Name | ชื่อปัจจัยอ้างอิง |  | X |  |
| Underlying Owner Name\* | Long Name | ชื่อเจ้าของปัจจัยอ้างอิง |  | X |  |
| Underlying Country Id\* | Classification | รหัสประเทศที่อยู่ของเจ้าของปัจจัยอ้างอิง |  | X |  |
| Convertible Bond Flag | Flag | ตราสารหนี้ที่สามารถแปลงสภาพไปเป็นตราสารประเภทอื่นได้  มีคุณสมบัติเป็น Convertible Bond = ‘1’  ไม่มีคุณสมบัติเป็น Convertible Bond = ‘0’ | X |  |  |
| Structured Bond Flag | Flag | ตราสารหนี้ที่มีคุณสมบัติซับซ้อน  มีคุณสมบัติเป็น Structured Bond = ‘1’  ไม่มีคุณสมบัติเป็น Structured Bond = ‘0’ | X |  |  |
| Securitization Bond Flag | Flag | ตราสารหนี้ที่เกิดจากการแปลงสินทรัพย์เป็นหลักทรัพย์  มีคุณสมบัติเป็น Securitization Bond = ‘1’  ไม่มีคุณสมบัติเป็น Securitization Bond = ‘0’ | X |  |  |
| Description | Description | ระบุรายละเอียดเพิ่มเติม |  |  | X |
| Previous Securities Code | Identification Number | รหัสตราสารการเงินก่อนการเปลี่ยนแปลง |  | X |  |
| Previous Securities Identification Type | Classification | ประเภทรหัสตราสารการเงิน ก่อนการเปลี่ยนแปลง เช่น ISIN Code, CUSIP, SEDOL เป็นต้น |  |  | X |

\* These are repeating data elements, which may occur several times in a data file record

|  |  |
| --- | --- |
| **Data File:** | 2.8 Equity Securities Registry (DF\_ESR) |
| **Frequency:** | **Monthly** |

| Data Element | Data Type | Description | M | O | C |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Organization Id | Provider Code | รหัสสถาบันผู้รายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ | X |  |  |
| Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | X |  |  |
| Securities Code\* | Identification Number | รหัสตราสารการเงิน | X |  |  |
| Securities Identification Type\* | Classification | ประเภทรหัสตราสารการเงิน เช่น ISIN Code, CUSIP, SEDOL เป็นต้น | X |  |  |
| Financial Market Instrument Type | Classification | ประเภทตราสารการเงิน | X |  |  |
| Equity Securities Name | Long Name | ชื่อตราสารทุน (อังกฤษ) | X |  |  |
| Issuer Id | Identification Number | รหัสของผู้ออกตราสาร โดยใช้เลขที่แสดงตนของบุคคล/นิติบุคคล/องค์กร | X |  |  |
| Issuer Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของผู้ออกตราสาร | X |  |  |
| Currency Id | Classification | รหัสอ้างอิงสกุลเงิน | X |  |  |
| Country Id of Registration | Classification | รหัสประเทศที่จดทะเบียนหลักทรัพย์ | X |  |  |
| Description | Description | ระบุรายละเอียดเพิ่มเติม |  | X |  |
| Previous Securities Code | Identification Number | รหัสตราสารการเงินก่อนการเปลี่ยนแปลง |  | X |  |
| Previous Securities Identification Type | Classification | ประเภทรหัสตราสารการเงิน ก่อนการเปลี่ยนแปลง เช่น ISIN Code, CUSIP, SEDOL เป็นต้น |  |  | X |

\* These are repeating data elements, which may occur several times in a data file record

|  |  |
| --- | --- |
| **Data File:** | 2.9 Foreign Fund Registry (DF\_FFR) |
| **Frequency:** | **Monthly** |

| Data Element | Data Type | Description | M | O | C |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Organization Id | Provider Code | รหัสสถาบันผู้รายงานข้อมูลการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ | X |  |  |
| Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | X |  |  |
| Securities Code\* | Identification Number | รหัสตราสารการเงิน | X |  |  |
| Securities Identification Type\* | Classification | ประเภทรหัสตราสารการเงิน เช่น ISIN Code, CUSIP, SEDOL เป็นต้น | X |  |  |
| Financial Market Instrument Type | Classification | ประเภทตราสาร | X |  |  |
| Fund Name | Long Name | ชื่อกองทุน (ภาษาอังกฤษ) | X |  |  |
| Asset Management Unique Id | Identification Number | รหัสของบริษัทจัดการกองทุน โดยใช้เลขที่แสดงตนของบุคคล/นิติบุคคล/องค์กร | X |  |  |
| Asset Management Unique Id Type | Classification | ประเภทรหัสของบริษัทจัดการกองทุน | X |  |  |
| Currency Id | Classification | รหัสอ้างอิงสกุลเงิน | X |  |  |
| Country Id of Registration | Classification | รหัสประเทศที่จดทะเบียนหลักทรัพย์ |  |  |  |
| Investment Policy | Classification | นโยบายการลงทุนของกองทุนรวมที่จัดตั้งในต่างประเทศ เช่น กองทุนตราสารหนี้ กองทุนรวมผสม | X |  |  |
| Description | Description | ระบุรายละเอียดเพิ่มเติม |  | X |  |
| Previous Securities Code | Identification Number | รหัสตราสารการเงินก่อนการเปลี่ยนแปลง |  | X |  |
| Previous Securities Identification Type | Classification | ประเภทรหัสตราสารการเงิน ก่อนการเปลี่ยนแปลง เช่น ISIN Code, CUSIP, SEDOL เป็นต้น |  |  | X |

\* These are repeating data elements, which may occur several times in a data file record

|  |  |
| --- | --- |
| **Data File:** | 2.10 Issuer Registry (DF\_ISR) |
| **Frequency:** | **Monthly** |

| Data Element | Data Type | Description | M | O | C |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Organization Id | Provider Code | รหัสสถาบันผู้รายงานข้อมูลการลงทุนในตราสาร  ในต่างประเทศและอนุพันธ์ | X |  |  |
| Data Set Date | Date | วันที่ของชุดข้อมูล | X |  |  |
| Issuer Unique Id/Asset Management Unique Id | Identification Number | รหัสมาตรฐาน ประจำตัวนิติบุคคล/บุคคลธรรมดา ของผู้ออกตราสาร หรือบริษัทจัดการกองทุน | X |  |  |
| Issuer Unique Id Type/Asset Management Unique Id Type | Classification | ประเภทของรหัสมาตรฐานที่ใช้ เช่น Swift Code, Oversea Juristic Id เป็นต้น | X |  |  |
| Name | Long Name | ชื่อบริษัทผู้ออกตราสาร | X |  |  |
| Country Id of Issuer | Classification | รหัสประเทศของผู้ออกตราสาร | X |  |  |
| Business Sector of Issuer | Classification | ประเภทธุรกิจของผู้ออกตราสาร | X |  |  |

หมายเหตุ Optional มี 2 ประเภทคือ

1) Mandatory with Condition (C) นั่นคือ ต้องมีการ Validation กับ Data element อื่น

2) Optional (O) ที่มีค่าหรือไม่มีค่าก็ได้

Appendix A: Data Type

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Data Type Name** | **Data Type** | **Format** | **Remark** | **Sample** |
| Provider Code | Char(3) | AAA | No leading blanks | ‘A40’ |
| Date | Char(10) | YYYY-MM-DD | A.D. year | '2014-10-11' |
| Classification | VarChar(10) | AAAA | No leading blanks | '0123456789' |
| Identification Number | VarChar(40) | AAAA | No leading blanks | '12345' |
| Short Name | VarChar(40) | AAAA |  | 'XXX111' |
| Long Name | VarChar(200) | AAAA |  | 'XXX' |
| SWIFT Code | VarChar(11) | AAAA | No leading blanks | ‘XXXXTHBK’ |
| Amount | Number(20,2) | NNNNNNNNNN.NN | No leading zeroes | '102000020.20' |
| Number | Number(12) | N | No leading zeroes | '12' |
| Interest Rate | Number(8,5) | NNN.NNNNN | No leading zeroes | '12.50' |
| Flag | Char(1) | '1' or '0' | Only '1' or '0' | '1' |
| Exchange Rate | Number(12,7) | NNNNN.NNNNNNN |  | '32.223' |
| Description | VarChar(400) | AAAA |  | 'XXX111' |