

**Thai Debt Securities Held by Non-Residents**

Data Entities, Data Elements, Data Validation and Classification

**March 2022**

**Document Information**

**Revision History**

| Version number | Released Date | Effective Date | Summary of changes | Revision marks |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| V 1.0 | 21 March 2022 | 1 April 2022 |  |  |

**Table of Contents**

[**Table of Contents** 3](#_Toc98245254)

[Document Overview 4](#_Toc98245255)

[I. Data Entity Summary 6](#_Toc98245256)

[II. Data Entity Detail 7](#_Toc98245257)

[1. Thai Debt Securities Held by Non-Residents 7](#_Toc98245258)

[1.1 Thai Debt Securities Holdings by Non-resident Ultimate Beneficiary Owner (NR-UBO) Level 7](#_Toc98245259)

[1.2 Thai Debt Securities Settlement Flows by Non-resident Ultimate Beneficiary Owner Level 8](#_Toc98245260)

[III. Reporting Institutions Summary 10](#_Toc98245261)

[IV. Data Type 11](#_Toc98245262)

[V. Classification Summary 11](#_Toc98245263)

[VI. Classification Detail 11](#_Toc98245264)

[1. Currency Code 11](#_Toc98245265)

[VII. Submission Format 11](#_Toc98245266)

[1. File Format for Submission 11](#_Toc98245267)

[2. Submission File Sample 12](#_Toc98245268)

[3. Naming Convention 12](#_Toc98245269)

[4. Submission Channel 13](#_Toc98245270)

# Document Overview

This document provides information on the Data Entities and Elements to be submitted to the Bank of Thailand (BOT) for the Thai Debt Securities Held by Non-Residents. Data Entities will be electronically submitted to BOT via the BOT Data Acquisition System.

This document is divided into 7 major sections:

1. Data Entity Summary section provides an overview of the Data Entities and data submission frequency for each data entity.

2. Data Entity Details discusses in more detail all the data elements within each of the defined Data Entities. For each of the data elements, a valid data type was defined. The list of all data types can be found in the Data Type Section.

3. Reporting Institutions section indicates an overview of the required institution types to submit each Data Entities.

4. Data Type section, which provides the submission format for each of the data type, as well as some sample value. The list of all classifications can be found in the Classification Document.

5. Classification Summary section shows an overview of the Classification and the related Data Entities as well as the data elements.

6. Classification Detail presents higher level of detail of all the Classifications which includes Classification Code, Classification Values, Classification Description and Classification View as specified.

7. Submission Format provides guidelines, including file format and naming convention, example of submission files and submission channel.

**Description:**

**Frequency:** frequency of data submission (how frequent each institution has to submit the data).

**Granularity:** granularity of data (how detailed the data is).

**M:** Mandatory data elements. This data element cannot be blank.

**C:** Mandatory with condition. These data are required under certain condition with other data element(s). The condition of which to report in outlined in the data element description section.

**O:** Optional data element. The data element can contain value or blank depending on whether the institution has the data or not.

**Classification / View:** identify classification and view which is the possible value for each data element. Classification and View will be listed in Classification Document.

# Data Entity Summary

| Data Entity Group | Data Entity Name | ABBR | Frequency | Granularity | Submission Date |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1. Thai Debt Securities Held by Non-Residents | 1.1 Thai Debt Securities Holdings by Non-resident Ultimate Beneficiary Owner (NR-UBO) Level | DS\_NRUBO | Daily | Daily | Before noon (12.00 PM) on the next business day |
| 1.2 Thai Debt Securities Settlement Flows by Non-resident Ultimate Beneficiary Owner Level | DS\_NRSFW | Daily | Daily | Before noon (12.00 PM) on the next business day |

# Data Entity Detail

## Thai Debt Securities Held by Non-Residents

### Thai Debt Securities Holdings by Non-resident Ultimate Beneficiary Owner (NR-UBO) Level

**Data Entity Description**

ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้ที่ออกในประเทศไทยรายวันของผู้มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศที่เป็นผู้ได้รับผลประโยชน์ที่แท้จริง (NR-UBO) โดยตราสารหนี้ หมายถึง ตราสารหนี้ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ทั้งที่เป็นสกุลเงินบาทและสกุลเงินตราต่างประเทศที่ออกในประเทศไทยซึ่งศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ให้บริการรับฝากและถอนตราสารหนี้

**Data Entity Overview**

| No | Data Element | Key | Req. | Data Type | Format | Classification |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | Date of Outstanding | PK | M | Date | Char(10) |  |
| 2 | LEI Number | PK | M | String | VarChar(40) |  |
| 3 | ISIN Code | PK | M | String | VarChar(40) |  |
| 4 | Total Unit |  | C | Numeric | Number(20) |  |
| 5 | Face Amount |  | C | Numeric | Number(25,7) |  |
| 6 | Currency |  | M | Classification | Char(3) | Currency Code |

**Data Element Description**

1. **Date of Outstanding**

Date of the outstanding dataset in the form of "YYYY-MM-DD"

1. **LEI Number**

Ultimate Beneficiary Owner's Legal Entity Identifier

1. **ISIN Code**

International Securities Identification Number (ISIN) which is used to identify the issue of debt securities deposited in the Thailand Securities Depository Co., Ltd. (TSD)

1. **Total Unit**

Total unit holdings of specific debt securities

In case of **Face Amount** is filled, this could leave blank

1. **Face Amount**

Total amount of debt securities holdings, in terms of face value

In case of **Total Unit** is filled, this could leave blank

1. **Currency**

Denominated currency of specific debt securities

### Thai Debt Securities Settlement Flows by Non-resident Ultimate Beneficiary Owner Level

**Data Entity Description**

ข้อมูลธุรกรรมการชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้รายธุรกรรม NR-SFW

**Data Entity Overview**

| No | Data Element | Key | Req. | Data Type | Format | Classification |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | Report date |  | M | Date | Char(10) |  |
| 2 | Settlement Date |  | M | Date | Char(10) |  |
| 3 | Trade Date |  | M | Date | Char(10) |  |
| 4 | Payment Type |  | M | String | VarChar(3) |  |
| 5 | Settlement Instruction Type |  | M | String | Char(8) |  |
| 6 | Matching ID |  | C | String | VarChar(40) |  |
| 7 | Settlement Currency |  | C | Classification | Char(3) | Currency Code |
| 8 | Transaction Type |  | O | String | VarChar(8) |  |
| 9 | ISIN Code |  | M | String | VarChar(40) |  |
| 10 | Yield |  | C | Numeric | Number(12,6) |  |
| 11 | Price |  | C | Numeric | Number(12,6) |  |
| 12 | Amount per unit |  | C | Numeric | Number(25,7) |  |
| 13 | Total Unit |  | C | Numeric | Number(20) |  |
| 14 | Face Amount |  | C | Numeric | Number(25,7) |  |
| 15 | Settlement Amount |  | C | Numeric | Number(25,7) |  |
| 16 | LEI Number |  | M | String | VarChar(40) |  |
| 17 | Counterparty's LEI Number |  | C | String | VarChar(40) |  |
| 18 | Counterparty's SSA number |  | C | String | VarChar(40) |  |

**Data Element Description**

1. **Report date**

Date of the reporting dataset in the form of "YYYY-MM-DD"

1. **Settlement Date**

Date of the transaction settled in the form of "YYYY-MM-DD"

1. **Trade Date**

Date of the transaction agreed or confirmed in the form of "YYYY-MM-DD"

1. **Payment Type**

Types of settlement are exclusively categorized into four types as follows:

**RVP** for Receive versus Payment

**DVP** for Delivery versus Payment

**RF** for Receive Free of Payment

**DF** for Delivery Free of Payment

1. **Settlement Instruction Type**

Specify whether settlement occurs within or between entity(ies) as follows:

**Internal** for internal settlement

**External** for external settlement

1. **Matching ID**

An identifier that is generated for matching the two legs of an internal settlement instruction in the case that settlement instruction type is Internal

1. **Settlement Currency**

Currency which is used to settle cash for the securities transactions

1. **Transaction Type**

Exclusively specify the purpose of debt securities receive or delivery as three categories follows:

**Outright** for outright purchase or sale of bonds

**Repo** for repurchase agreement

**Others** for other type of transaction e.g. securities borrowing and lending

In the case the purpose is unknown, please leave blank

1. **ISIN Code**

International Securities Identification Number (ISIN) which is used to identify the issue of debt securities depositedin the Thailand Securities Depository Co., Ltd. (TSD)

1. **Yield**

Yield which is agreed upon trading. ("YIEL" Code in field 90A of MT54X)

In case **Payment Type** is **RVP** or **DVP**, and **Price** and **Amount per unit** are both blank. **Yield** is required.

1. **Price**

Price, per one-hundred of denominated currency unit, which is agreed upon trading.

("PRCT" Code in field 90A of MT54X)

In case **Payment Type** is **RVP** or **DVP**, and **Yield** and **Amount per unit** are both blank. **Price** is required.

1. **Amount per unit**

Price, as an amount of currency per unit, which is agreed upon trading. ("ACTU" Code in field 90B of MT54X)

In case **Payment Type** is **RVP** or **DVP**, and **Yield** and **Price** are both blank. **Amount per unit** is required.

1. **Total Unit**

Total unit of settled debt securities

In case of **Face Amount** is filled, this could leave blank

1. **Face Amount**

Total amount of settled debt securities in terms of face value

In case of **Total Unit** is filled, this could leave blank

1. **Settlement Amount**

Total amount of settled debt securities in terms of market value

In case **Payment Type** is **RVP** or **DVP**, **Settlement Amount** is required

1. **LEI Number**

Legal Entity Identifier of Ultimate Beneficiary Owner who submits the settlement instruction

1. **Counterparty's LEI Number**

Legal Entity Identifier of the counterparty in the settlement instruction

In case of **Counterparty’s SSA number** is filled, this could leave blank

1. **Counterparty's SSA number**

Segregated Securities Account (SSA) number of the counterparty in the settlement instruction

In case of **Counterparty’s LEI number** is filled, this could leave blank

# Reporting Institutions Summary

- ผู้ที่ต้องจัดส่งข้อมูล คือ ผู้รับฝากทรัพย์สินในต่างประเทศ (Global Custodian) ตัวแทนการฝากทรัพย์สิน (International Broker) หรือผู้ที่มีถิ่นฐานในต่างประเทศ ที่ได้รับการผ่อนผันการดำเนินการตามประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การอนุญาตให้ธนาคารพาณิชย์ประกอบธุรกิจให้บริการอื่นที่เกี่ยวข้องกับบริการทางการเงินประเภทการดูแลและเก็บรักษาตราสารหนี้ (custodian service) และประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการให้บริการเกี่ยวกับตราสารหนี้แก่ลูกค้าของบริษัทหลักทรัพย์ เป็นรายกรณี โดยให้จัดส่งข้อมูลผ่านธนาคารพาณิชย์และบริษัทหลักทรัพย์ที่ทำหน้าที่เป็นผู้รับฝากทรัพย์สินในประเทศที่เป็นผู้ให้บริการ

# Data Type

| Data Type | Format | Sample Data Element | Sample Value |
| --- | --- | --- | --- |
| Classification | Char(3) | Currency | THB |
| Date | Char(10) | Date of Outstanding | 2020-06-30  รายงานเป็น ปี ค.ศ. เดือน วัน |
| Numeric | Number(20) | Total Unit | 12345 |
|  | Number(12,6) | Yield | 10000.123456 |
|  | Number(20,2) | Amount | 5500000.00 |
|  | Number(25,7) | Face Amount | 5500000.0000000 |
| String | Char(8) | Settlement Instruction Type | Internal |
|  | Varchar(3) | Payment Type | RVP |
|  | Varchar(8) | Transaction Type | Outright |
|  | Varchar(40) | LEI Number | 540000HJD00HOXYCA000 |

# Classification Summary

| No. | Classification | Data Entity : Data Element |
| --- | --- | --- |
|  |
| 1 | Currency Code | DS\_NRUBO และ DS\_NRSFW : Currency |

# Classification Detail

## Currency Code

สกุลเงิน โดยรายงานตามรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่ที่ [WWW.BOT.OR.TH](https://www.bot.or.th/Thai/Statistics/DataManagementSystem/Standard/StandardCode/Pages/default.aspx)

# Submission Format

## File Format for Submission

| หัวข้อ | ข้อกำหนด |
| --- | --- |
| Format Type | CSV |
| Delimiter | | (Pipe) |
| Header | **ระบุในบรรทัดแรกเสมอ** |
| Encode | Utf-8 |
| Encryption | **ตามระดับ** Security **ที่จัดส่งผ่านช่องทาง DMSDA**   * **ให้จัดส่งผ่าน User Password : แต่ต้องทำการเข้ารหัสข้อมูล โดยเลือกประเภทการเข้ารหัสเป็นแบบ Encrypt Without Sign ผ่าน โปรแกรม (DMS) DA Preparation Application เวอร์ชันล่าสุด สามารถ download ได้ที่ https://www.bot.or.th/Thai/Statistics/DataManagementSystem/Standard/DMSDA/Pages/DMSDA.aspx** |

ตัวอย่างการนำส่งข้อมูลแต่ละ Data Type

| Data Type | ตัวอย่างการรายงาน |
| --- | --- |
| Classification | 2000100001 |
| Date | 2021-07-01 |
| Flag | 1 |
| Numeric | 123456.00000 ห้ามมี comma |
| String | Sample |

หมายเหตุ : กรณี Data Element ใดไม่มีข้อมูลให้เว้นว่าง

## Submission File Sample

ตัวอย่างไฟล์ว่าง ให้นำส่งไฟล์ที่ไม่มีข้อมูล (0 Byte)

|  |
| --- |
|  |

ตัวอย่างไฟล์ข้อมูล DS\_NRUBO

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| |  | | --- | | Date of Outstanding|LEI Number|ISIN Code|Total Unit|Face Amount|Currency | | 2021-03-16|549XXXHJD00HOXYCA262|TH0655555XXX|10000|1000000|THB | |

ตัวอย่างไฟล์ข้อมูล DS\_NRSFW

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| |  |  |  | | --- | --- | --- | | |  | | --- | | Report date|Settlement Date|Trade Date|Payment Type|Settlement Instruction Type|Matching ID|Settlement Currency|Transaction Type |ISIN Code|Yield|Price|Amount per unit|Total Unit|Face Amount|Settlement Amount|LEI Number|Counterparty's LEI Number|Counterparty's SSA number | | 2021-03-16|2021-03-16|2021-03-16|RVP|Internal|A001|THB|Outright|TH0655555XXX|2.114112|102.554557|24840.0000000|10000|10000000.00|10009889.00|5493XXHJD00HOXYCA261|5493XXHJD00HOXYCA263|ABC01112XX | | |

## Naming Convention

เพื่อลดกระบวนการกำหนดค่าต่าง ๆ ในการนำส่งไฟล์จำนวนมาก ระบบจะอ่านชื่อไฟล์เพื่อระบุข้อมูลประกอบการนำส่ง โดยมีการกำหนดมาตรฐานชื่อไฟล์ ดังนี้

**FXXXNn\_YYYYMMDD\_Zz.csv**

| สัญลักษณ์ | ความหมายและข้อกำหนด |
| --- | --- |
| F | ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล (D: Daily, M: Monthly, Q: Quarterly, H: Half Yearly, Y: Yearly, A: As occur) |
| XXX | ชื่อย่อ Subject Area ของข้อมูล โดยข้อมูล ICSD Data คือ   * CST |
| Nn | รหัสประจำตัวผู้ส่งข้อมูล เช่น FI Code หรือ รหัสนิติบุคคล |
| YYYYMMDD | ปีเดือนวันของข้อมูล (ค.ศ.) |
| Zz | ชื่อย่อ Data Entity (Zz ชื่อย่อของ NRUBO หรือ NRSFW) |
| .csv | นามสกุลชุดข้อมูล |

ตัวอย่าง: ส่งไฟล์ข้อมูล Data Entity ICSD Data (DS\_NRUBO) งวดเดือน 15 มีนาคม ปี พ.ศ. 2565 ของสถาบันการเงินที่มี FI Code 002 ให้ตั้งชื่อไฟล์ ดังนี้ DCST002\_20220315\_NRUBO.csv

ตัวอย่าง: ส่งไฟล์ข้อมูล Data Entity ICSD Data (DS\_NRSFW) งวดเดือน 15 มีนาคม ปี พ.ศ. 2565 ของสถาบันการเงินที่มี FI Code 002 ให้ตั้งชื่อไฟล์ ดังนี้ DCST002\_20220315\_NRSFW.csv

## Submission Channel

ธปท. มีช่องทางมาตรฐาน (Data Acquisition) เพื่อการนำส่งข้อมูลสำหรับข้อมูล คือ

1. ช่องทาง Web Submission (Web based) รองรับการนำส่งข้อมูลผ่าน BOT Website