

**ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ**

**จากนายทะเบียนหลักทรัพย์**

Data Set, Data Elements, Data Validation and Classification

**January 2025**

**Document Information**

**Revision History**

| Version number | Released Date | Effective Date | Summary of changes | Revision marks |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| V2024.01 | 1 October 2024 | 1 January 2025 |  |  |

**Table of Contents**

[**Table of Contents** 3](#_Toc182509534)

[Document Overview 4](#_Toc182509535)

[I. Data Set Summary 6](#_Toc182509536)

[II. Data Set Detail 7](#_Toc182509537)

[ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ จากนายทะเบียนหลักทรัพย์ (DS\_OBR) 7](#_Toc182509538)

[III. Reporting Institutions Summary 9](#_Toc182509539)

[IV. Data Type 10](#_Toc182509540)

[V. Data Validation Overview 11](#_Toc182509541)

[VI. Data Validation Detail 12](#_Toc182509542)

[A. File Validation 12](#_Toc182509543)

[B. All Entities Validation 13](#_Toc182509544)

[C. Validation 14](#_Toc182509545)

[ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ จากนายทะเบียนหลักทรัพย์ (DS\_OBR) 14](#_Toc182509546)

[VII. Classification Summary 15](#_Toc182509547)

[VIII. Classification Detail 16](#_Toc182509548)

[Corporation Type 27 กลุ่ม 16](#_Toc182509549)

[IX. Submission Format 17](#_Toc182509550)

[1. File Format for Submission 17](#_Toc182509551)

[2. Submission File Sample 17](#_Toc182509552)

[3. Naming Convention 18](#_Toc182509553)

[4. Submission Channel 18](#_Toc182509554)

# Document Overview

This document provides information on the Data Set and Elements to be submitted to the Bank of Thailand (BOT) for the Outstanding Amount of Debt Securities from Registrar. Data Set will be electronically submitted to BOT via the BOT Data Acquisition System.

This document is divided into 9 major sections:

1. Data Set Summary section provides an overview of the Data Set and data submission frequency for each data set.

2. Data Set Details discusses in more detail all the data elements within each of the defined Data Set. 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 Set.

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. Data Validation Overview shows an overview of the validation, including the definition of each validation types: Consistency (CN), Completeness (CM) and Referential Integrity (RI) in the related Data Set.

6. Data Validation Detail discusses all the required validation in every level, starting from File level, all Data Set level, and each Data Set level.

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

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

9. 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 Set Summary

| Data Set Group | Data Set Name | ABBR | Frequency | Granularity | Submission Date |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| DMS-FM | **ข้อมูลยอดคงค้างการถือครอง ตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ จากนายทะเบียนหลักทรัพย์** | DS\_OBR | Monthly | Monthly | 7 days after data date |

# Data Set Detail

## ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ จากนายทะเบียนหลักทรัพย์ (DS\_OBR)

**Data Set Description**

ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ

Reporting Scope : รายงานข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือจากนายทะเบียนหลักทรัพย์ เป็นข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้เป็นรายตราสารตามกลุ่มผู้ถือ ณ สิ้นเดือน ทั้งตราสารที่ทำหน้าที่เป็นนายทะเบียนให้ลูกค้า และเป็นผู้ออกตราสารของตนเอง เฉพาะการถือครองตราสารในรูปแบบใบตราสาร (Scrip) ขอบเขตของประเภทตราสารหนี้ให้เป็นไปตามประกาศ ธปท. ว่าด้วยการจัดส่งข้อมูลผู้ได้รับผลประโยชน์ที่แท้จริงจากการลงทุนในตราสารหนี้ โดยกำหนดส่งภายใน 7 วัน นับจากวันสิ้นเดือน

**Data Set Overview**

| No | Data Element | Key | Req. | Data Type | Format | Validation | Classification |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | Date of Outstanding | PK | M | Date | Char(10) |  |  |
| 2 | Provider Code | PK | M | String | VarChar(3) |  |  |
| 3 | Securities Code | PK | M | String | VarChar(40) |  |  |
| 4 | Corporation Type Code  (Holder Type Code) | PK | M | Classification | Char(3) |  | Corporation Type 27 กลุ่ม |
| 5 | Total Unit |  | M | Numeric | Number(25,7) | CNOBR001 |  |
| 6 | Total Amount (Face Value in Baht) |  | M | Numeric | Number(25,7) | CNOBR002 |  |
| 7 | Scrip Flag |  | M | String | Char(1) | CNOBR003 |  |

**Data Element Description**

1. **Date of Outstanding**

วันที่ของข้อมูล (งวดของข้อมูล) โดยงวดของข้อมูล ใช้วันสุดท้ายของเดือน (ซึ่งอาจตรงกับวันหยุดได้)

1. **Provider Code**

รหัสสถาบันที่ให้ข้อมูล (FI-Code)

1. **Securities Code**

รหัสตราสาร โดยให้กรอกรหัสใดรหัสหนึ่ง (เรียงลำดับ) ดังนี้

1. รหัสสากลของตราสาร (ISIN code)

2. รหัสตราสารหนี้ที่ขึ้นทะเบียนกับสมาคมตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA code)

3. รหัสตราสารที่ กลต. ออกให้ (SEC code)

4. รหัสอื่น ๆ (Other code) กรณีตราสารไม่มีรหัสทั้ง 3 รูปแบบข้างต้น

1. **Corporation Type Code (Holder Type Code)**

รหัสกลุ่มผู้ถือ 3 หลัก

1. **Total Unit**

จำนวนหน่วยตราสาร

1. **Total Amount (Face Value in Baht)**

ยอดคงค้างตราสารหนี้ตามราคาตรา (Face Value) หน่วยเป็นบาท ยึดตามกรรมสิทธิ์ตามกฎหมาย ตัวอย่างเช่น กรณีตราสารที่นำไปวางเป็นหลักประกันหรือจำนำ ตราสารยังคงเป็นกรรมสิทธิ์ของเจ้าของเดิม เป็นต้น

1. **Scrip Flag**

Flag รูปแบบของตราสาร ('Y' = Scrip)

# Reporting Institutions Summary

| Data Set Group | Data Set Name | ABBR | Reporting Institutions | | | | | Remarks |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Commercial Bank | Finance Company | Credit Foncier Company | Specialized Financial Institutions | Non-Financial Institution |
| DMS-FM | **ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ จากนายทะเบียนหลักทรัพย์** | DS\_OBR | x |  |  |  |  | 1/ |

1/ เฉพาะรายที่ ธปท. ได้ประสานขอความร่วมมือในการส่งข้อมูล

**Description**

**Commercial Bank** includesCommercial Bank, Retail Bank, Subsidiary (foreign commercial bank’s subsidiary), and Foreign Bank Branch.

**Solo Consolidation** consists of a financial institution and all subsidiaries within the Solo Consolidation refer to that as specified in the Bank of Thailand Notification Re: Regulations on Structure and Scope of Business of Financial Business Groups.

**Specialized Financial Institutions (SFIs)** are state-owned financial institutions established with each Specialized Financial Institutions’ establishment Act.

**Non-Bank** 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.

# Data Type

| Data Type | Format | Sample Data Element | Sample Value |
| --- | --- | --- | --- |
| Classification | Char(3) | Corporation Type Code (Holder Type Code) | 180 |
| Date | Char(10) | Date | 2025-01-31  รายงานเป็น ปี ค.ศ. เดือน วัน |
| Numeric | Number(25,7) | Total Unit | 1000 |
|  | Number(25,7) | Total Amount (Current Face Value in Baht) | 5500000.00 |
| String | Char(1) | Scrip Flag | Y |
|  | VarChar(3) | Provider Code | 002 |
|  | VarChar(40) | Securities Code | TH0647032505 |

# Data Validation Overview

การตรวจสอบความถูกต้องของข้อมูล ประกอบด้วย 3 เรื่อง คือ

1. Consistency (CN) เพื่อตรวจสอบความสอดคล้องของข้อมูลตามธุรกิจ เช่น วันที่สัญญาครบกำหนด (Maturity Date) ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับวันที่สัญญามีผล (Effective Date) รวมทั้งการรายงานข้อมูลให้สอดคล้องกับขอบเขตการรายงานที่ ธปท. กำหนด
2. Completeness (CM) เพื่อตรวจสอบความครบถ้วนของข้อมูลให้เป็นไปตามเงื่อนไขทางธุรกิจ กรณีที่ Data Element นั้นมีค่าแล้ว Data Element ที่เกี่ยวข้องกัน ต้องมีการรายงานข้อมูลเข้ามาให้ครบถ้วนและถูกต้องด้วย เช่น กรณีที่ Employment Status เป็นผู้มีงานทำ แล้ว Occupation ต้องมีค่า
3. Referential Integrity (RI) เพื่อตรวจสอบว่าทุกรายการข้อมูล (record) ที่มีการอ้างความสัมพันธ์จะต้องมีการรายงานข้อมูลนั้นใน Data Entity ที่อยู่ลำดับก่อนหน้าเข้ามาด้วย เช่น เมื่อรายงานข้อมูล Credit Line Id ของ Data Entity Account ค่าของ Credit Line Id จะต้องมีอยู่ใน Credit Line Id ของ Data Entity Credit Line ด้วย

สรุปการตรวจสอบความถูกต้องของข้อมูล**เพิ่มเติม**จาก All Set Validation

| Data Set Group | Data Set Name | ABBR | Consistency | Completeness | Referential Integrity |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| DMS-FM | **ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ จากนายทะเบียนหลักทรัพย์** | DS\_OBR | X |  |  |

# Data Validation Detail

## File Validation

| Validation Id | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| --- | --- | --- | --- |
| FV001 | จำนวน Data Element ต้องครบตามที่กำหนดในเอกสาร Data Entities and Data Elements | The number of Data Element must be the same as specified in Data Entities and Data Elements Document. | Basic |
| FV002 | รูปแบบไฟล์ต้องเป็นไฟล์นามสกุล ตามที่กำหนดเท่านั้น | A file extension or file type must be the specific type. | Basic |
| FV003/1 | ข้อมูลต้องใช้ character encoding ในรูปแบบ UTF-8 เท่านั้น | The data must be saved with UTF-8 character encoding. | Basic |
| FV004/1 | กรณีไม่ใช่ไฟล์ว่าง ไฟล์ต้องประกอบด้วยข้อมูล 2 ส่วน ได้แก่  Header และเนื้อหาข้อมูลอย่างน้อย 1 บรรทัด | The data file must consist of a header part and a content part which has at least one record of data except for blank file. | Basic |
| FV005/1 | กรณีข้อมูลถูกกำหนดให้ไม่สามารถส่งไฟล์ว่างได้ ข้อมูลที่นำส่งต้องมีขนาดไฟล์มากกว่า 0 Byte | If it is required to submit data then the file size must be greater than 0 byte. | Basic |
| FV006/2 | กรณีไฟล์นามสกุล xlsx หรือ xls จะต้องนำส่งด้วยชื่อ sheet ที่ตรงตาม template ที่กำหนด | .xlsx or .xls file must use the same sheet name as specified template. | Basic |

1/ สำหรับ File Format Type: CSV

2/ สำหรับ File Format Type: xlsx, xls

## All Entities Validation

| Validation Id | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| --- | --- | --- | --- |
| CN001 | ข้อมูลต้องตรงกับ Data Type และ Format ตามที่ระบุในเอกสาร Data Entities and Data Elements | Data type and data format must be the same as specified in Data Entities and Data Elements Document. | Basic |
| CN002 | Data Element ที่มีค่า Key เป็น PK ตามที่ระบุในเอกสาร Data Entities and Data Elements จะต้องมีค่าไม่ซ้ำกัน | A primary key must uniquely identify each record. | Complex |
| CN003 | Data Element ที่มีค่า Req. เป็น M ต้องมีค่าเสมอ | A mandatory data element cannot be blank. | Complex |
| CN004 | ข้อมูลต้องตรงกับ possible value ของ Classification และ View (ถ้ามี) ที่ระบุในเอกสาร Data Entities | Classification code must be in the code list of classification or view as specified in Classification Document. | Complex |
| CN005 | Data Date ต้องตรงกับวันที่ของงวดข้อมูลที่เลือกบนช่องทางการรับส่งข้อมูล (Data Acquisition) | Data date must be consistent with the frequency of data reporting requirement. | Complex |
| CN006 | รหัสประจำตัวผู้รายงานข้อมูลต้องตรงตามที่กำหนด หากเป็นธุรกิจสถาบันการเงินและธุรกิจการเงินอื่นที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของ ธปท. หรือจัดตั้งขึ้นตาม พรบ. พรก. หรือกฎหมายอื่นที่เกี่ยวข้อง ให้รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสถาบันการเงิน” ที่เผยแพร่ที่ WWW.BOT.OR.TH (FI Code 3 หลัก) ผู้รายงานข้อมูลที่นอกจากข้างต้นให้รายงานด้วยเลขจดทะเบียนที่ออกโดยทางการ เช่น เลขทะเบียนนิติบุคคล 13 หลัก | Organization Id must be identified by financial Institution code (FI Code) or juristic identification number as specified by the BOT standard. | Complex |
| CN007 | ข้อมูลต้องตรงกับ possible value ของ Data Type | Data must correspond with Data Type. | Complex |
| CN008 | ข้อมูลที่มี Data Type เป็น Date (YYYY-MM-DD) จะต้องรายงานเป็น ปี ค.ศ. เท่านั้น และต้องต่างไม่เกิน 200 ปี นับจากปี ค.ศ. ของวันที่ของงวดข้อมูล (Data Date) | The date (YYYY-MM-DD) must be A.D. and valid date value range must not exceed 200 years from Data date. | Complex |
| CN999 | ไม่สามารถส่งข้อมูลได้ เนื่องจากความผิดพลาดของระบบหรือความผิดพลาดอื่น ๆ สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้ที่ฟิลด์ Information | Data cannot be submitted because of system error or others, please see more detail at the information field. | Basic |

## Validation

### ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ จากนายทะเบียนหลักทรัพย์ (DS\_OBR)

**Consistency**

| Validation Id | Validation Rule | Description (TH) | Description (EN) | Validation Step |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| CNOBR001 | [DS\_OBR.Total Unit] >= 0 | Total Unit ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 | Total Unit must be greater than or equal to 0 | Complex |
| CNOBR002 | [DS\_OBR.Total Amount (Current Face Value in Baht)] >= 0 | Total Amount (Current Face Value in Baht) ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0 | Total Amount (Current Face Value in Baht) must be greater than or equal to 0 | Complex |
| CNOBR003 | [DS\_OBR.Scrip Flag] = ‘Y’ | Scrip Flag ต้องมีค่าเป็น ‘Y’ | Scrip Flag must be ‘Y’ Value | Complex |

# Classification Summary

| No. | Classification | Data Set Group : DMS-FM | Data Set : Data Element |
| --- | --- | --- | --- |
| ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ จากนายทะเบียนหลักทรัพย์ (DS\_OBR) |  |
| 1 | Corporation Type 27 กลุ่ม | X | DS\_OBR : Corporation Type Code (Holder Type Code) |

# Classification Detail

## Corporation Type 27 กลุ่ม

รหัสกลุ่มผู้ถือ โดยรายงานตามค่าที่เป็นไปได้ของ Corporation Type 27 กลุ่ม อ้างอิงเอกสาร Corporation Type 27 กลุ่ม ซึ่งเผยแพร่ที่หน้า BOT Website อยู่ภายใต้ บริการจาก ธปท. > บริการรับ-ส่งข้อมูล > แบบรายงานและเอกสารชี้แจง ข้อมูลตลาดการเงิน > ข้อมูลตราสารการเงิน > แบบรายงาน > ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้ และตราสารทุน > Corporation Type 27 กลุ่ม

# Submission Format

## File Format for Submission

| หัวข้อ | ข้อกำหนด |
| --- | --- |
| Format Type | xlsx, xls |
| Encryption | **ตามระดับ** Security **ที่จัดส่งผ่านช่องทาง** DMSDA   * **กรณี จัดส่งผ่าน** Certificate **: ต้องทำการ** Encrypt **ทั้งไฟล์ก่อนนำส่ง** **โดยใช้** Program **ที่สามารถ** download **ได้ที่** [www.bot.or.th](https://www.bot.or.th/Thai/Statistics/DataManagementSystem/Standard/DMSDA/Pages/DMSDA.aspx) * **กรณี จัดส่งผ่าน** Username Password : **ไม่มีข้อกำหนดในการ** Encrypt **ไฟล์** |

ตัวอย่างการนำส่งข้อมูลแต่ละ Data Type

| Data Type | ตัวอย่างการรายงาน |
| --- | --- |
| Classification | 180 |
| Date | 2025-01-31 |
| Numeric | 123456.00 |
| String | Sample |

## Submission File Sample

ตัวอย่างไฟล์ว่าง ให้นำส่งไฟล์ที่ไม่มีข้อมูล (0 Byte)

A screenshot of a computer

Description automatically generated

ตัวอย่างไฟล์ข้อมูล

A screenshot of a computer

Description automatically generated

## Naming Convention

เพื่อลดกระบวนการกำหนดค่าต่าง ๆ ในการนำส่งไฟล์จำนวนมาก ระบบจะอ่านชื่อไฟล์เพื่อระบุข้อมูลประกอบการนำส่ง โดยมีการกำหนดมาตรฐานชื่อไฟล์ ดังนี้

**FXXXNn\_Zz\_YYYYMMDD.xlsx หรือ FXXXNn\_Zz\_YYYYMMDD.xls**

| สัญลักษณ์ | ความหมายและข้อกำหนด |
| --- | --- |
| F | ความถี่ในการส่งชุดข้อมูล (M: Monthly) |
| XXX | ชื่อย่อ Subject Area ของข้อมูล โดยข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ จากนายทะเบียนหลักทรัพย์ คือ   * RGST |
| Nn | รหัสประจำตัวผู้ส่งข้อมูล ตาม FI Code |
| Zz | ชื่อย่อ Data Set เช่น ข้อมูล DS\_OBR : Zz คือ OBR |
| YYYYMMDD | ปีเดือนวันของข้อมูล (ค.ศ.) |
| .xlsx หรือ .xls | นามสกุลชุดข้อมูล |

ตัวอย่าง: ส่งไฟล์ข้อมูลยอดคงค้างการถือครองตราสารหนี้จำแนกตามกลุ่มผู้ถือ จากนายทะเบียนหลักทรัพย์ (DS\_OBR) งวดข้อมูลเดือนมกราคม ปี พ.ศ. 2568 ของสถาบันการเงินที่มี FI Code 001 ให้ตั้งชื่อไฟล์ ดังนี้ MRGST001\_OBR\_20250131.xlsx

## Submission Channel

ธปท. มีช่องทางมาตรฐาน (Data Acquisition) เพื่อการนำส่งข้อมูลสำหรับข้อมูล คือ ช่องทาง Web Submission (Web based) รองรับการนำส่งข้อมูลผ่าน BOT Website