



ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

ที่ สรข. 3/2566

เรื่อง การส่งรายงานข้อมูลระบบบริหารข้อมูล (Data Management System : DMS)

1. เหตุผลในการออกประกาศ

ด้วยธนาคารแห่งประเทศไทยมีการปรับปรุงแบบการรายงานข้อมูลด้านสินเชื่อและภาระผูกพันที่เกี่ยวข้องกับสินเชื่อเพื่อใช้ในการกำกับตรวจสอบสถาบันการเงิน การวิเคราะห์เชิงลึกในการติดตามความเสี่ยงและดูแลเสถียรภาพระบบสถาบันการเงิน โดยกำหนดให้ธนาคารพาณิชย์จัดทำและส่งรายงานข้อมูลสินเชื่อเพื่อการกำกับดูแลสถาบันการเงิน (Regulatory Data Transformation : RDT Credit) ในรูปแบบชุดข้อมูลสินเชื่อเพื่อการกำกับดูแล (RDT Credit Data Entity) ซึ่งเป็นการรายงานรูปแบบใหม่ที่มีรายละเอียดเป็นรายสัญญาหรือรายการธุรกรรมในรูปแบบมาตรฐานกลางที่เป็นมาตรฐานสากลและใกล้เคียงกับการจัดเก็บข้อมูลของธนาคารพาณิชย์ ตามประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยการส่งรายงานข้อมูลสินเชื่อเพื่อการกำกับดูแลสถาบันการเงิน (Regulatory Data Transformation : RDT Credit) ดังนั้น ธนาคารแห่งประเทศไทยจึงได้ทบทวนการรายงานข้อมูลในปัจจุบันให้มีความเหมาะสมและชัดเจนยิ่งขึ้น และปรับปรุงการรายงานข้อมูลในระบบบริหารข้อมูล (Data Management System : DMS) เพื่อลดการรายงานข้อมูลที่ซ้ำซ้อนกันกับการส่งรายงานตามประกาศข้างต้น

2. อำนาจตามกฎหมาย

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 71 แห่งพระราชบัญญัติธุรกิจสถาบันการเงิน พ.ศ. 2551

3. ประกาศที่ยกเลิก

ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สรข. 2/2566 เรื่อง การส่งรายงานข้อมูลต่อธนาคารแห่งประเทศไทย ลงวันที่ 15 มีนาคม 2566

4. ขอบเขตการบังคับใช้

ประกาศฉบับนี้ให้ใช้บังคับกับสถาบันการเงินตามกฎหมาย ว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงินทุกแห่ง

5. เนื้อหา

5.1 ให้สถาบันการเงินจัดทำและส่งรายงานข้อมูลระบบบริหารข้อมูล (Data Management System : DMS) ในรูปแบบชุดข้อมูล (XML Data Set) ตามรายละเอียดชุดข้อมูลและระยะเวลาในเอกสารแนบท้ายประกาศนี้ และคู่มือการจัดทำชุดข้อมูล (XML Data Set Manual) ซึ่งเผยแพร่

บน BOT Website www.bot.or.th โดยให้จัดส่งข้อมูลให้ธนาคารแห่งประเทศไทยด้วยวิธีการทางอิเล็กทรอนิกส์ตามวิธีการและหลักเกณฑ์ตามที่กำหนดในระเบียบธนาคารแห่งประเทศไทย ว่าด้วยบริการด้านการรับส่งข้อมูลด้วยวิธีอิเล็กทรอนิกส์เกี่ยวกับระบบบริหารข้อมูลของธนาคารแห่งประเทศไทย

5.2 ให้ถือว่าธนาคารแห่งประเทศไทย ได้รับรายงานข้อมูลตามชุดข้อมูล (XML Data Set) ในวันที่สถาบันการเงินส่งข้อมูลผ่านระบบสื่อสารอิเล็กทรอนิกส์ และข้อมูลที่ส่งมานั้น มีความถูกต้อง โดยผ่านหลักเกณฑ์การตรวจสอบเบื้องต้น (Basic Validation) ของธนาคารแห่งประเทศไทยแล้ว

6. บทเฉพาะกาล

ให้ธนาคารพาณิชย์ยังคงจัดทำและส่งรายงานข้อมูลสำหรับชุดข้อมูลดังต่อไปนี้ ตามประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย ที่ สรข. 2/2566 เรื่อง การส่งรายงานข้อมูลต่อธนาคารแห่งประเทศไทย ต่อไป จนกว่าธนาคารพาณิชย์จะสามารถจัดทำและส่งรายงานข้อมูลสินเชื่อเพื่อการกำกับดูแลสถาบันการเงิน (Regulatory Data Transformation : RDT Credit) ได้ครบถ้วน ถูกต้อง และได้รับแจ้งจากธนาคารแห่งประเทศไทยให้สามารถยกเลิกการจัดทำและส่งรายงานข้อมูลข้างต้นได้

6.1 ข้อมูลที่ให้รายงานทั้งชุดรายงาน

- (1) Arrangement Movement Summary (DS_AMS)
- (2) Credit Card Summary (DS_CCS)
- (3) Lending Purpose Summary (DS_LPS)
- (4) Lending Summary Classified by Business (DS_LSB)
- (5) Lending Movement Summary (DS_LMS)
- (6) Loan Arrangement (DS_LAR)
- (7) Total Classified Lending Summary (DS_TCS)
- (8) Trouble Debts Restructuring Summary (DS_TDR)
- (9) Involved Party (DS_IPI)

6.2 ข้อมูลที่ให้รายงานเฉพาะข้อมูลด้านสินเชื่อและภาระผูกพันในส่วนที่เกี่ยวข้องกับสินเชื่อ

- (1) Arrangement Summary (DS_ARS)
- (2) Branch Summary (DS_BSM)
- (3) Contingent Arrangement (DS_CAR)
- (4) Contingent Summary (DS_COS)

(5) Foreign Currency Loan Arrangement (DS_FLA)

(6) Loan / Deposit Arrangement Transaction (DS_LTX)

7. วันเริ่มต้นบังคับใช้

ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันถัดจากวันประกาศในราชกิจจานุเบกษาเป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566



(นายเศรษฐพุฒิ สุทธิวาทนฤพุฒิ)

ผู้ว่าการ

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ส่วนจัดการข้อมูลภาคการเงิน

ฝ่ายบริหารข้อมูลและดาต้าอานาไลติกส์

โทรศัพท์ 0 2283 5993

รายชื่อชุดข้อมูล (XML Data Set) ที่กำหนดให้สถาบันการเงินรายงาน

ชื่อชุดข้อมูล	ชื่อย่อ	ความถี่	กลุ่มสถาบันการเงินที่รายงาน			กำหนดส่งรายงาน*
			ธพ.	บง.	บค.	
ชุดข้อมูลฐานะการดำเนินงาน (ด้าน FI)						
กลุ่มข้อมูล - FI Financial Position						
Balance Sheet	DS_BLS	รายเดือน	✓	✓	✓	21 วัน
Branch Summary ^{1/5/}	DS_BSM	รายเดือน	✓			1 เดือน
Capital Fund	DS_CAP	รายเดือน	✓	✓	✓	21 วัน
Items Between Organization Units	DS_IBO	รายเดือน	✓			21 วัน
FI Investment Position	DS_IVP	รายเดือน	✓	✓	✓	21 วัน
Provision Summary	DS_PVS	รายไตรมาส	✓	✓	✓	21 วัน
Risk Weighted Assets	DS_RWA	รายเดือน			✓	21 วัน
Total Trading Book Position	DS_TBP	ราย 6 เดือน	✓	✓		21 วัน
Interest Rate Risk	DS_IRR	รายไตรมาส	✓	✓	✓	21 วัน
Credit Risk Standardized Approach	DS_CRS	รายเดือน	✓	✓		21 วัน
Credit Risk Internal Ratings-Based Approach	DS_CRI	รายเดือน	✓			21 วัน
Equity Position	DS_EQP	รายเดือน	✓			21 วัน
Provision and Expected Loss	DS_PEL	รายเดือน	✓			21 วัน
Contingent Summary ^{5/}	DS_COS	รายเดือน	✓	✓		21 วัน
Operational Risk	DS_OPR	ราย 6 เดือน	✓	✓	✓	21 วัน

ชื่อชุดข้อมูล	ชื่อย่อ	ความถี่	กลุ่มสถาบันการเงินที่รายงาน			กำหนดส่งรายงาน*
			ธพ.	บง.	บค.	
กลุ่มข้อมูล - Arrangement Summary						
Arrangement Summary ^{5/}	DS_ARS	รายเดือน	✓	✓	✓	21 วัน
Lending Purpose Summary	DS_LPS	รายเดือน		✓	✓	21 วัน
Lending Summary Classified by Business	DS_LSB	รายไตรมาส		✓	✓	21 วัน
Total Classified Lending Summary	DS_TCS	รายเดือน		✓	✓	21 วัน
Lending Movement Summary	DS_LMS	รายไตรมาส		✓	✓	21 วัน
Deposit Classified by Type of Depositor	DS_DCD	รายเดือน	✓	✓	✓	21 วัน
กลุ่มข้อมูล - FI Liquidity Status						
Liquidity Assessment 1	DS_LQ1	รายปักษ์	✓	✓	✓	10 วัน
Liquidity Coverage Ratio	DS_LCR	รายเดือน	✓	✓	✓	21 วัน
Net Stable Funding Ratio	DS_NFR	รายไตรมาส	✓			21 วัน
กลุ่มข้อมูล - FI Financial Performance						
Net Profit Distribution	DS_PDS	ราย 6 เดือน	✓	✓	✓	4 เดือน
Profit and Loss	DS_PNL	รายไตรมาส	✓	✓	✓	21 วัน
กลุ่มข้อมูล - Key Customer Position						
Contingent Arrangement ^{5/}	DS_CAR	รายเดือน	✓	✓		21 วัน
Loan Arrangement	DS_LAR	รายเดือน		✓	✓	21 วัน
กลุ่มข้อมูล - Other FI Summary						
Interest Rate Outstanding	DS_IRO	รายไตรมาส	✓			21 วัน
Interest Rate Summary	DS_IRS	เมื่อเปลี่ยนแปลง	✓	✓	✓	3 วัน
กลุ่มข้อมูล - FI Consolidation ^{2/}						

ชื่อชุดข้อมูล	ชื่อย่อ	ความถี่	กลุ่มสถาบันการเงินที่รายงาน			กำหนดส่งรายงาน*
			ธพ.	บง.	บค.	
Investment by the Parent Company_Conso	DS_IPCC	รายไตรมาส	✓		✓	3 เดือน
Financial Position Statement_Conso	DS_FPSC	รายไตรมาส	✓		✓	3 เดือน
Comprehensive Income Statement_Conso	DS_CISC	รายไตรมาส	✓		✓	3 เดือน
Partial Financial Position Statement_Conso	DS_PFSC	รายไตรมาส	✓		✓	3 เดือน
Partial Comprehensive Income Statement_Conso	DS_PCSC	รายไตรมาส	✓		✓	3 เดือน
Single Lending Limit_Conso	DS_SLLC	รายไตรมาส	✓		✓	3 เดือน
Provision Summary_Conso	DS_PVSC	รายไตรมาส	✓		✓	3 เดือน
Risk Weighted Assets_Conso	DS_RWAC	รายไตรมาส			✓	3 เดือน
Total Trading Book Position_Conso	DS_TBPC	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Interest Rate Risk_Conso	DS_IRRC	รายไตรมาส	✓		✓	3 เดือน
Capital Fund_Conso	DS_CAPC	รายไตรมาส	✓		✓	3 เดือน
Credit Risk Standardized Approach_Conso	DS_CRSC	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Credit Risk Internal Ratings-Based Approach_Conso	DS_CRIC	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Equity Position_Conso	DS_EQPC	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Provision and Expected Loss_Conso	DS_PELC	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Contingent Summary_Conso	DS_COSC	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Operational Risk_Conso	DS_OPRC	ราย 6 เดือน	✓		✓	3 เดือน
กลุ่มข้อมูล - FI Consolidation (D-SIBs) ^{3/}						
Financial Position Statement_Solo Conso	DS_FPSS	รายเดือน	✓			45 วัน
Financial Position Statement_Full Conso	DS_FPSF	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Comprehensive Income Statement_Solo Conso	DS_CISS	รายเดือน	✓			45 วัน

ชื่อชุดข้อมูล	ชื่อย่อ	ความถี่	กลุ่มสถาบันการเงินที่รายงาน			กำหนดส่งรายงาน*
			ธพ.	บง.	บค.	
Comprehensive Income Statement_Full Conso	DS_CISF	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Provision Summary_Solo Conso	DS_PVSS	รายไตรมาส	✓			45 วัน
Provision Summary_Full Conso	DS_PVSF	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Total Trading Book Position_Solo Conso	DS_TBPS	รายไตรมาส	✓			45 วัน
Total Trading Book Position_Full Conso	DS_TBPF	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Interest Rate Risk_Solo Conso	DS_IRRS	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Interest Rate Risk_Full Conso	DS_IRRF	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Capital Fund_Solo Conso	DS_CAPS	รายเดือน	✓			45 วัน
Capital Fund_Full Conso	DS_CAPF	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Credit Risk Standardized Approach_Solo Conso	DS_CRSS	รายเดือน	✓			45 วัน
Credit Risk Standardized Approach_Full Conso	DS_CRSF	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Credit Risk Internal Ratings-Based Approach_Solo Conso	DS_CRIS	รายเดือน	✓			45 วัน
Credit Risk Internal Ratings-Based Approach_Full Conso	DS_CRIF	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Equity Position_Solo Conso	DS_EQPS	รายเดือน	✓			45 วัน
Equity Position_Full Conso	DS_EQPF	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Provision and Expected Loss_Solo Conso	DS_PELS	รายเดือน	✓			45 วัน
Provision and Expected Loss_Full Conso	DS_PELF	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Contingent Summary_Solo Conso	DS_COSS	รายเดือน	✓			45 วัน
Contingent Summary_Full Conso	DS_COSF	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Operational Risk_Solo Conso	DS_OPRS	ราย 6 เดือน	✓			45 วัน
Operational Risk_Full Conso	DS_OPRF	ราย 6 เดือน	✓			3 เดือน

ชื่อชุดข้อมูล	ชื่อย่อ	ความถี่	กลุ่มสถาบันการเงินที่รายงาน			กำหนดส่งรายงาน*
			ธพ.	บง.	บค.	
Investment by the Parent Company_Conso	DS_IPCC	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Partial Financial Position Statement_Conso	DS_PFSC	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Partial Comprehensive Income Statement_Conso	DS_PCSC	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
Single Lending Limit_Conso	DS_SLLC	รายไตรมาส	✓			3 เดือน
ชุดข้อมูลธุรกรรมเงินตราต่างประเทศ (ด้าน FM)						
กลุ่มข้อมูล - Foreign Currency Position						
Foreign Currency Position	DS_FCP	รายวัน	✓			7 วัน
Foreign Currency Deposit and Investment Position	DS_DIP	รายเดือน	✓			10 วัน
Foreign Currency Loan Arrangement ^{5/}	DS_FLA	รายวัน	✓			7 วัน
Deposit Arrangement	DS_DAR	รายวัน	✓			7 วัน
Foreign Exchange Arrangement	DS_FXA	รายวัน	✓			7 วัน
Forward Rate Agreement Arrangement	DS_FRA	รายวัน	✓			7 วัน
Futures Arrangement	DS_FTA	รายวัน	✓			7 วัน
Options Arrangement	DS_OPA	รายวัน	✓			7 วัน
Cross Currency and Interest Rate Swap Arrangement	DS_SWA	รายวัน	✓			7 วัน
กลุ่มข้อมูล - Foreign Currency Transactions						
FX Trading Transaction	DS_FTX	รายวัน	✓			7 วัน
Loan / Deposit Arrangement Transaction ^{5/}	DS_LTX	รายวัน	✓			7 วัน
Receive Payment Transaction	DS_PTX	รายวัน	✓			7 วัน
FX Trading Transaction Under 20,000 USD Summary	DS_FTU	รายวัน	✓			7 วัน
Foreign Currency Transaction Summary	DS_FTS	รายวัน	✓			7 วัน

ชื่อชุดข้อมูล	ชื่อย่อ	ความถี่	กลุ่มสถาบันการเงินที่รายงาน			กำหนดส่งรายงาน*
			ธพ.	บง.	บค.	
กลุ่มข้อมูล - Other FM Summary						
Export Payment Exemption	DS_EPE	เมื่อเกิดธุรกรรม	✓			7 วัน
Instrument Issue	DS_ISI	รายวัน	✓			7 วัน
Interest Rate of Foreign Currency Deposit ^{4/}	DS_IRF	เมื่อเปลี่ยนแปลง	✓			3 วันทำการ
Fee Rate of Foreign Currency Deposit ^{4/}	DS_FRF	เมื่อเปลี่ยนแปลง	✓			3 วันทำการ
Fee Rate of SWIFT ^{4/}	DS_FRW	เมื่อเปลี่ยนแปลง	✓			3 วันทำการ
Other Fee Rate of Foreign Currency Deposit ^{4/}	DS_OFF	เมื่อเปลี่ยนแปลง	✓			3 วันทำการ
ชุดข้อมูลรวม (ด้าน FI/FM)						
กลุ่มข้อมูล - Key Customer Position						
Involved Party	DS_IPI	รายวัน/รายเดือน		✓	✓	เมื่อเปลี่ยนแปลง

* ครบกำหนดส่งภายในเวลา 16.30 น. และหากวันที่ครบกำหนดส่งตรงกับวันหยุดให้ส่งข้อมูลในวันทำการถัดไป

หมายเหตุ

^{1/} ยกเว้นสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศที่มีสาขาในประเทศไทยไม่เกิน 1 สาขา

^{2/} ยกเว้นธนาคารพาณิชย์ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (D-SIBs) และสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

^{3/} ธนาคารพาณิชย์ที่มีนัยต่อความเสี่ยงเชิงระบบในประเทศ (D-SIBs)

^{4/} ยกเว้นธนาคารพาณิชย์เพื่อรายย่อย

^{5/} กรณีธนาคารพาณิชย์สามารถจัดทำและส่งรายงานข้อมูล RDT Credit ได้ถูกต้องผ่านตามเงื่อนไขที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนดแล้ว และได้รับแจ้ง

จากธนาคารแห่งประเทศไทยให้ยกเลิกการรายงานข้อมูลด้านสินเชื่อและภาระผูกพันในส่วนที่เกี่ยวข้องกับสินเชื่อใน DMS ได้ ธนาคารพาณิชย์ดังกล่าว ไม่ต้องรายงานข้อมูลด้านสินเชื่อและภาระผูกพันในส่วนที่เกี่ยวข้องกับสินเชื่อ