



ธนาคารแห่งประเทศไทย  
BANK OF THAILAND

ยอดคงค้างตราสารอนุพันธ์และธุรกรรมที่เกี่ยวข้อง

Data Set,  
Data Validation and Classification

July 2022

หมายเหตุ: ธปท. อยู่ระหว่างปรับปรุง validation part (ตัวอักษรสีแดง)

**Document Information**

**Revision History**

<b>Version number</b>	<b>Released Date</b>	<b>Effective Date</b>	<b>Summary of changes</b>	<b>Revision marks</b>
V 1.0	XX	XX		

## Table of Contents

Document Overview .....	4
I. Data Set Summary .....	5
II. Reporting Institutions Summary .....	5
III. Data Set Detail.....	7
1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม (DS_SDV) .....	7
2. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา (DS_SDV).....	10
3. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง (DS_MLN).....	15
4. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต (DS_CDD).....	20
IV. Data Type.....	24
V. Data Validation Overview .....	25
VI. Data Validation Detail .....	25
1. File Validation .....	25
2. All Entities Validation.....	26
3. Data Validation .....	27
VII. Classification Summary .....	28
VIII. Classification Detail.....	29
1. Currency Code .....	29
2. Derivatives Counterparty Type Code.....	29
3. Derivatives Product Group Code .....	30
4. Derivatives Reference Variables.....	30
5. Derivatives Transaction Purpose .....	31
6. Customer Investment Type .....	<b>Error! Bookmark not defined.</b>
7. Derivatives Delivery.....	31
IX. Submission Format.....	32
1. File Format for Submission .....	32
2. Naming Convention.....	32
3. Submission Channel.....	32

## Document Overview

This document provides information on the Data Set and Elements to be submitted to the Bank of Thailand (BOT) for the Derivatives Reports. 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. Reporting Institutions Summary section indicates an overview of the required institution types to submit each Data Set.
3. Data Set Details section 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.
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 Section.
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 section discusses all the required validation in every level, starting from File level, all Data Entities level and each Data Entities level.
7. Classification Summary section shows an overview of the Classification and the related Data Entities as well as the data elements.
8. Classification Detail section 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 section 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).

**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.

## I. Data Set Summary

Data Set Name	ABBR	Frequency	Submission Date
1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม	DS_SDV	Monthly	Data Date + 1 Month
2. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา	DS_SDV	Monthly	Data Date + 1 Month
3. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง	DS_MLN	Monthly	Data Date + 1 Month
4. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต	DS_CDD	Monthly	Data Date + 1 Month

## II. Reporting Institutions Summary

Data Set Name	ABBR	Reporting Institutions					Remarks
		Commercial Bank <sup>1</sup>	Finance Company	Credit Foncier Company	Specialized Financial Institutions	Non-Financial Institution	
1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม	DS_SDV	X					
2. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา	DS_SDV	X					
3. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง	DS_MLN	X					
4. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต	DS_CDD	X					

### Description

**Commercial Bank** includes Commercial Bank, Subsidiary (foreign commercial bank's subsidiary), and Foreign Bank Branch.

**Finance Company** is a business that raises funds from the public in the form of promissory notes (P/N) and employing such funds in several forms of investment including commerce, development, purchases and consumption, and housing.

**Credit Foncier Company** is a business of accepting money from public in the form of promissory notes (P/N) and employing such accepted money in one or several ways such as granting credits by mortgaging immovable property, accepting immovable property on consignment etc.

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

<sup>1</sup> สาขาในต่างประเทศของธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในไทย นำส่งผ่านธนาคารพาณิชย์

**Non-Financial Institution** 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.

### III. Data Set Detail

#### 1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม (DS\_SDV)

##### Data Set Description

ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม

Reporting Scope : รายงานยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดทุกธุรกรรม ณ วันสิ้นงวดการรายงาน โดยใช้หน่วย “บาท” พร้อมทศนิยม 2 ตำแหน่ง และจำแนกตามประเภทของธุรกรรมที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

##### Data Set Overview

No	Data Element	Key	Req.	Data Type	Format	Validation	Classification
1	รหัสสถาบัน	PK	M	String	VarChar(40)		
2	งวดข้อมูล	PK	M	Date	Char(10)		
3	ชื่อผู้จัดทำ		M	String	VarChar(128)		
4	โทรศัพท์		M	String	Char(10)		
5	อีเมล		M	String	VarChar(40)		
6	Group of Product		-	String	VarChar(128)		
7	Derivatives	PK	-	Classification	VarChar(128)		Derivatives Product Group Code (V_SDVP)
8	อัตราดอกเบี้ย - Notional Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
9	อัตราดอกเบี้ย - MTM		M	Numeric	Number(20,2)		
10	อัตราแลกเปลี่ยน - Notional Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
11	อัตราแลกเปลี่ยน - MTM		M	Numeric	Number(20,2)		
12	ราคาตราสารหนี้ - Notional Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
13	ราคาตราสารหนี้ - MTM		M	Numeric	Number(20,2)		
14	ราคาตราสารทุน - Notional Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
15	ราคาตราสารทุน - MTM		M	Numeric	Number(20,2)		
16	ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - Notional Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
17	ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - MTM		M	Numeric	Number(20,2)		
18	ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - Notional Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
19	ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - MTM		M	Numeric	Number(20,2)		
20	ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - Notional Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
21	ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่นๆ - MTM		M	Numeric	Number(20,2)		
22	ดัชนีทางการเงิน - Notional Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
23	ดัชนีทางการเงิน - MTM		M	Numeric	Number(20,2)		

No	Data Element	Key	Req.	Data Type	Format	Validation	Classification
24	Total Notional Amount		-	Numeric	Number(20,2)		
25	Total MTM		-	Numeric	Number(20,2)		

## Data Element Description

### 1. รหัสสถาบัน

รหัสประจำตัวผู้รายงานข้อมูล หากเป็นธุรกิจสถาบันการเงินและธุรกิจการเงินอื่นที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของธนาคารแห่งประเทศไทย (ชปท.) หรือจัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติ (พรบ.) พระราชกำหนด (พรก.) หรือกฎหมายอื่นที่เกี่ยวข้อง ให้รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสถาบันการเงิน” ที่เผยแพร่ที่ WWW.BOT.OR.TH (FI Code 3 หลัก) ผู้รายงานข้อมูลที่นอกจากข้างต้นให้รายงานด้วยเลขจดทะเบียนที่ออกโดยทางการ เช่น เลขทะเบียนนิติบุคคล 13 หลัก

### 2. งวดข้อมูล

วันที่ ณ สิ้นเดือนของงวดการรายงาน ระบุเป็น ปี ค.ศ. (YYYY-MM-DD)

### 3. ชื่อผู้จัดทำ

ชื่อผู้จัดทำรายงาน

### 4. โทรศัพท์

เบอร์โทรศัพท์ผู้จัดทำรายงาน

### 5. อีเมล

อีเมลผู้จัดทำรายงาน

### 6. Group of Product

กลุ่มของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด

เงื่อนไข กำหนดโดย ชปท. ไม่ต้องรายงานข้อมูล

### 7. Derivatives

ประเภทของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด

เงื่อนไข กำหนดโดย ชปท. ไม่ต้องรายงานข้อมูล

### 8. อัตราดอกเบี้ย - Notional Amount

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ย ตาม Group of Product และ Derivatives

### 9. อัตราดอกเบี้ย - MTM

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ย ตาม Group of Product และ Derivatives

### 10. อัตราแลกเปลี่ยน - Notional Amount

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยน ตาม Group of Product และ Derivatives

### 11. อัตราแลกเปลี่ยน - MTM

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงอัตราแลกเปลี่ยน ตาม Group of Product และ Derivatives

### 12. ราคาตราสารหนี้ - Notional Amount

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงราคาตราสารหนี้ ตาม Group of Product และ Derivatives



**13. ราคาตราสารหนี้ – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงราคาตราสารหนี้ ตาม Group of Product และ Derivatives

**14. ราคาตราสารทุน - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงราคาตราสารทุน ตาม Group of Product และ Derivatives

**15. ราคาตราสารทุน – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงราคาตราสารทุน ตาม Group of Product และ Derivatives

**16. ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาที่อ้างอิงราคาสินค้าโภคภัณฑ์ ได้แก่ โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) ตาม Group of Product และ Derivatives

**17. ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมที่อ้างอิงราคาสินค้าโภคภัณฑ์ ได้แก่ โลหะมีค่า (ยกเว้นทองคำ) ตาม Group of Product และ Derivatives

**18. ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาอ้างอิงราคาทองคำ ตาม Group of Product และ Derivatives

**19. ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - ทองคำ – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมอ้างอิงราคาทองคำ ตาม Group of Product และ Derivatives

**20. ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่น ๆ - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาอ้างอิงราคาสินค้าโภคภัณฑ์อื่นๆ ตาม Group of Product และ Derivatives

**21. ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ - อื่น ๆ – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมอ้างอิงราคาสินค้าโภคภัณฑ์อื่นๆ ตาม Group of Product และ Derivatives

**22. ดัชนีทางการเงิน - Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญาอ้างอิงดัชนีทางการเงิน ตาม Group of Product และ Derivatives

**23. ดัชนีทางการเงิน – MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรมอ้างอิงดัชนีทางการเงิน ตาม Group of Product และ Derivatives

**24. Total Notional Amount**

ยอดรวมของจำนวนเงินตามสัญญา ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข คำนวณโดย ธปท. ไม่ต้องรายงานข้อมูล

**25. Total MTM**

ยอดรวมของมูลค่ายุติธรรม ตาม Group of Product และ Derivatives

เงื่อนไข คำนวณโดย ธปท. ไม่ต้องรายงานข้อมูล

## 2. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา (DS\_SDV)

### Data Set Description

ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา

Reporting Scope : รายงานรายละเอียดของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ไม่ใช่ชั้นพื้นฐานประเภท “อื่น ๆ” โดยรายงานเป็นรายสัญญาเรียงลำดับตามวันที่ทำสัญญา (Trade Date)

### Data Set Overview

No	Data Element	Key	Req.	Data Type	Format	Validation	Classification
1	รหัสสถาบัน	PK	M	String	VarChar(40)		
2	งวดข้อมูล	PK	M	Date	Char(10)		
3	ชื่อผู้จัดทำ		M	String	VarChar(128)		
4	โทรศัพท์		M	String	Char(10)		
5	อีเมล		M	String	VarChar(40)		
6	Ref No.	PK	M	String	VarChar(128)		
7	New Product		M	Flag	Char(1)		
8	Trade Date		M	Date	Char(10)		
9	Value Date		M	Date	Char(10)		
10	Maturity Date		M	Date	Char(10)		
11	Name of Product		M	String	VarChar(128)		
12	Group of Product		M	Classification	VarChar(128)		Derivatives Product Group Code (V_SDVT)
13	Derivatives Counterparty Type		M	Classification	VarChar(128)		Derivatives Counterparty Type Code
14	Counterparty Name		M	String	VarChar(128)		
15	Notional Outstanding Currency		M	Classification	Char(3)		Currency Code
16	Notional Outstanding Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
17	Notional Baht Equivalent		M	Numeric	Number(20,2)		
18	Reference Variables		M	Classification	VarChar(128)		Derivatives Reference Variables Code
19	Reference Variables Details		M	String	VarChar(128)		
20	Payout		O	String	VarChar(128)		
21	Derivatives Component		O	String	VarChar(128)		
22	Type of Delivery		M	Flag	VarChar(10)		
23	Transaction Purpose		M	Classification	VarChar(128)		Derivatives Transaction Purpose Code

No	Data Element	Key	Req.	Data Type	Format	Validation	Classification
24	Effective Notional Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
25	Mark-to-Market		M	Numeric	Number(20,2)		
26	Gain or Loss		M	Numeric	Number(20,2)		
27	หนังสือให้ความเห็นชอบ		O	String	VarChar(128)		
28	Notes		C	String	VarChar(400)	Purpose อื่นๆ	

## Data Element Description

### 1. รหัสสถาบัน

รหัสประจำตัวผู้รายงานข้อมูล หากเป็นธุรกิจสถาบันการเงินและธุรกิจการเงินอื่นที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) หรือจัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติ (พรบ.) พระราชกำหนด (พรก.) หรือกฎหมายอื่นที่เกี่ยวข้อง ให้รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสถาบันการเงิน” ที่เผยแพร่ที่ WWW.BOT.OR.TH (FI Code 3 หลัก) ผู้รายงานข้อมูลที่นอกจากข้างต้นให้รายงานด้วยเลขจดทะเบียนที่ออกโดยทางการ เช่น เลขทะเบียนนิติบุคคล 13 หลัก

### 2. งวดข้อมูล

วันที่ ณ สิ้นเดือนของงวดการรายงาน ระบุเป็น ปี ค.ศ. (YYYY-MM-DD)

### 3. ชื่อผู้จัดทำ

ชื่อผู้จัดทำรายงาน

### 4. โทรศัพท์

เบอร์โทรศัพท์ผู้จัดทำรายงาน

### 5. อีเมล

อีเมลผู้จัดทำรายงาน

### 6. Ref No.

เลขที่อ้างอิงของธุรกรรม เช่น เลขที่บัญชี เลขที่ confirmation หรือเลขที่สัญญา

### 7. New Product

ธุรกรรมใหม่

Y = ธุรกรรมในกรณีต่อไปนี้

- 1) เป็นธุรกรรมประเภทใหม่ที่ทำเป็นครั้งแรก
- 2) เป็นธุรกรรมประเภทเดิมที่เคยทำ แต่อ้างอิงตัวแปรประเภทหนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
- 3) เป็นธุรกรรมอนุพันธ์ที่อ้างอิง ดัชนีทางการเงินหรือกองทุนหนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
- 4) เป็นกรณีอื่น ๆ ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

N = ไม่เข้าเงื่อนไขข้างต้น

### 8. Trade Date

วันที่ทำสัญญา

### 9. Value Date

วันที่กำหนดมูลค่า

### 10. Maturity Date

วันครบกำหนดสัญญา

**11. Name of Product**

ชื่อเรียกธุรกรรมซึ่งเป็นที่รู้จักกันทั่วไปหรือชื่อทางการค้าของธุรกรรมนั้น

**12. Group of Product**

กลุ่มของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด (ที่ไม่ใช่ชั้นพื้นฐาน)

**13. Derivatives Counterparty Type**

ประเภทคู่สัญญา

**14. Counterparty Name**

ชื่อคู่สัญญาที่ทำธุรกรรมกับธนาคารพาณิชย์

**15. Notional Outstanding Currency**

สกุลเงินของจำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่ที่ WWW.BOT.OR.TH

**16. Notional Outstanding Amount**

จำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ ทั้งนี้ในกรณีธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่มีขารับหรือขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขาที่เป็นเงินตราต่างประเทศ หรือหากเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ทั้งขารับและขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขารับ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Notional Outstanding Amount เป็น 0

**17. Notional Baht Equivalent**

จำนวนเงินในการทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่เกี่ยวข้องกับเงินตราต่างประเทศ โดยในการคำนวณมูลค่า baht equivalent ให้ใช้อัตรากลาง (mid rate) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศที่ประกาศทางเว็บไซต์ของธนาคารแห่งประเทศไทย ณ วันสิ้นงวดการรายงานซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยของอัตราซื้อตั๋วเฉลี่ยเงินโอนและอัตราขายตั๋วเฉลี่ย ([(อัตราซื้อตั๋วเฉลี่ย + อัตราขายตั๋วเฉลี่ย) / 2])

**18. Reference Variables**

ประเภทของตัวแปรอ้างอิงตามประเภทที่กำหนด รวมถึงตัวแปรอ้างอิงอื่น ๆ ที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

**19. Reference Variables Details**

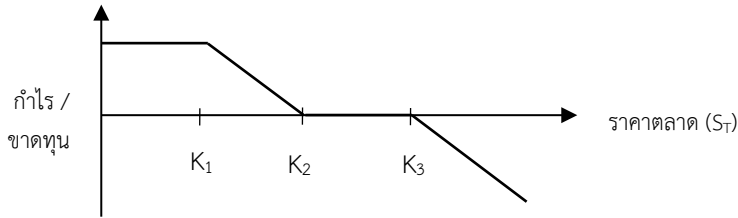
ชนิดของตัวแปรอ้างอิง ทั้งนี้ กรณีเป็นธุรกรรมที่อ้างอิงตัวแปรที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด ให้ธนาคารพาณิชย์รายงานรายละเอียดหรือวิธีการคำนวณตัวแปรอ้างอิงโดยละเอียด

**20. Payout**

รายละเอียด (สูตร) การคำนวณในการรับ-จ่ายเงินในธุรกรรมดังกล่าวในมุมมองของธนาคารพาณิชย์ ทั้งนี้ ธนาคารพาณิชย์สามารถเลือกไม่รายงานรายการนี้ได้ แต่ต้องจัดเตรียมเอกสารรายละเอียดดังกล่าวไว้ที่สถานที่ทำการ เพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยตรวจสอบ หรือจัดส่งให้แก่ธนาคารแห่งประเทศไทยเมื่อมีการร้องขอ

**ตัวอย่าง** ธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรม seagull options เพื่อขายเงินสกุลดอลลาร์สหรัฐอเมริกา (USD) มูลค่า USD 1 ล้าน โดยมีองค์ประกอบย่อยเป็นธุรกรรม options 3 ธุรกรรม และจำนวนเงินตามสัญญาธุรกรรมละ USD 1 ล้าน ดังนี้

(1) ขาย put options @  $K_1$  (2) ซื้อ put options @  $K_2$  และ (3) ขาย call options @  $K_3$



**การรายงาน Payout ของธุรกรรม**

$S_T < K_1$	ธนาคารพาณิชย์ซื้อ USD มูลค่า USD 1 ล้าน @ $K_1$ ตามธุรกรรม (1) และขาย USD มูลค่า USD 1 ล้าน @ $K_2$ ตามธุรกรรม (2)
$K_1 < S_T < K_2$	ธนาคารพาณิชย์ขาย USD มูลค่า USD 1 ล้าน @ $K_2$ ตามธุรกรรม (2)
$K_2 < S_T < K_3$	ธนาคารพาณิชย์ขาย USD มูลค่า USD 1 ล้าน @ $S_T$
$S_T > K_3$	ธนาคารพาณิชย์ขาย USD มูลค่า USD 1 ล้าน @ $K_3$ ตามธุรกรรม (3)

**21. Derivatives Component**

รายละเอียดธุรกรรมอนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ทำ พร้อมทั้งระบุว่าธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมย่อยดังกล่าวในฐานะผู้ซื้อ หรือผู้ขาย หรือผู้รับ หรือผู้จ่าย ตามแต่ละธุรกรรมอนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดดังกล่าว ทั้งนี้ ในกรณีที่ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดดังกล่าวไม่สามารถแยกองค์ประกอบย่อยได้ ให้อธิบายรายละเอียดของธุรกรรม สำหรับธุรกรรมเงินให้สินเชื่อที่ธนาคารพาณิชย์ทำพร้อมธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด ให้ธนาคารพาณิชย์ชี้แจงรายละเอียดของทั้งธุรกรรมเงินให้สินเชื่อและธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดในรายการนี้ ทั้งนี้ ธนาคารพาณิชย์สามารถเลือกไม่รายงานรายการนี้ได้ แต่ต้องจัดเตรียมเอกสารรายละเอียดดังกล่าวไว้ที่สถานที่ทำการ เพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยตรวจสอบ หรือจัดส่งให้แก่ธนาคารแห่งประเทศไทยเมื่อมีการร้องขอ

**22. Type of Delivery**

ธุรกรรมกำหนดเงื่อนไขการส่งมอบและชำระราคาเป็นสินทรัพย์อ้างอิง (physical settlement) หรือเงินสด (cash settlement)

**23. Transaction Purpose**

วัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม (กรณีวัตถุประสงค์ "อื่น ๆ" โปรดระบุรายละเอียดในคอลัมน์ Notes)

**24. Effective Notional Amount**

จำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย "บาท" พร้อมทศนิยม 2 ตำแหน่ง โดยให้ธนาคารพาณิชย์อ้างอิงวิธีการหาจำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของคู่สัญญาสำหรับธุรกรรมอนุพันธ์ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Effective Notional Amount เป็น 0

**25. Mark-to-Market**

มูลค่าที่ได้จากการ mark-to-market ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด ณ วันที่รายงานเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย "บาท" พร้อมทศนิยม 2 ตำแหน่ง หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Mark-to-Market ด้วยมูลค่ายุติธรรม ณ วันที่ธุรกรรมสิ้นสุด

**26. Gain or Loss**

มูลค่ากำไรหรือขาดทุนจากการทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด ณ วันที่รายงานโดยเปรียบเทียบกับวันสิ้นเดือนก่อนหน้า เป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” พร้อมทศนิยม 2 ตำแหน่ง ทั้งนี้ ให้ใส่เครื่องหมายติดลบ (-) ในกรณีเป็นผลขาดทุน

**27. หนังสือให้ความเห็นชอบ**

เลขที่หนังสือให้ความเห็นชอบการทำธุรกรรมจากสายกำกับสถาบันการเงิน ในกรณีเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ต้องได้รับความเห็นชอบจากธนาคารแห่งประเทศไทย (ถ้ามี)

**28. Notes**

รายงานรายละเอียดเพิ่มเติมอื่น ๆ จากการทำธุรกรรม (ถ้ามี)

### 3. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง (DS\_MLN)

#### Data Set Description

ข้อมูลธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง

Reporting Scope : รายงานธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝงทุกประเภทที่มียอดคงค้างเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน

#### Data Set Overview

No	Data Element	Key	Req.	Data Type	Format	Validation	Classification
1	รหัสสถาบัน	PK	M	String	VarChar(40)		
2	งวดข้อมูล	PK	M	Date	Char(10)		
3	ชื่อผู้จัดทำ		M	String	VarChar(128)		
4	โทรศัพท์		M	String	Char(10)		
5	อีเมล		M	String	VarChar(40)		
6	Ref No.	PK	M	String	VarChar(128)		
7	New Product		M	Flag	Char(1)		
8	Trade Date		M	Date	Char(10)		
9	Value Date		M	Date	Char(10)		
10	Maturity Date		M	Date	Char(10)		
11	Name of Product		M	String	VarChar(128)		
12	Type of Product		M	Classification	VarChar(40)		Customer Investment Type Code
13	Derivatives Counterparty Type		M	Classification	VarChar(128)		Derivatives Counterparty Type Code
14	Counterparty Name		M	String	VarChar(128)		
15	Borrower or Lender		M	Flag	VarChar(10)		
16	Notional Outstanding Currency		M	Classification	Char(3)		Currency Code
17	Notional Outstanding Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
18	Notional Baht Equivalent		M	Numeric	Number(20,2)		
19	Reference Variables		M	Classification	VarChar(128)		Derivatives Reference Variables Code
20	Reference Variables Details		M	String	VarChar(128)		
21	Payout		O	String	VarChar(128)		
22	Delivery		M	Classification	VarChar(40)		Derivatives Delivery Code
23	Transaction Purpose		M	Classification	VarChar(128)		Derivatives Transaction Purpose Code

No	Data Element	Key	Req.	Data Type	Format	Validation	Classification
24	Embedded Derivatives - Derivatives Components		O	String	VarChar(128)		
25	Embedded Derivatives - Effective Notional Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
26	Embedded Derivatives - Mark-to-Market		M	Numeric	Number(20,2)		
27	Gain or Loss		M	Numeric	Number(20,2)		
28	Principal Protection (%)		O	Numeric	Number(20,2)		
29	หนังสือให้ความเห็นชอบ		O	String	VarChar(128)		
30	Notes		C	String	VarChar(400)	Purpose อื่นๆ OR product อื่น	

### Data Element Description

#### 1. รหัสสถาบัน

รหัสประจำตัวผู้รายงานข้อมูล หากเป็นธุรกิจสถาบันการเงินและธุรกิจการเงินอื่นที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) หรือจัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติ (พรบ.) พระราชกำหนด (พรก.) หรือกฎหมายอื่นที่เกี่ยวข้อง ให้รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสถาบันการเงิน” ที่เผยแพร่ที่ WWW.BOT.OR.TH (FI Code 3 หลัก) ผู้รายงานข้อมูลที่นอกจากข้างต้นให้รายงานด้วยเลขจดทะเบียนที่ออกโดยทางการ เช่น เลขทะเบียนนิติบุคคล 13 หลัก

#### 2. งวดข้อมูล

วันที่ ณ สิ้นเดือนของงวดการรายงาน ระบุเป็น ปี ค.ศ. (YYYY-MM-DD)

#### 3. ชื่อผู้จัดทำ

ชื่อผู้จัดทำรายงาน

#### 4. โทรศัพท์

เบอร์โทรศัพท์ผู้จัดทำรายงาน

#### 5. อีเมล

อีเมลผู้จัดทำรายงาน

#### 6. Ref No.

เลขที่อ้างอิงของธุรกรรม เช่น เลขที่บัญชี เลขที่ CONFIRMATION หรือเลขที่สัญญา

#### 7. New Product

ธุรกรรมใหม่

Y = ธุรกรรมในกรณีต่อไปนี้

- 1) เป็นธุรกรรมประเภทใหม่ที่ทำเป็นครั้งแรก
- 2) เป็นธุรกรรมประเภทเดิมที่เคยทำ แต่อ้างอิงตัวแปรประเภทหนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
- 3) เป็นธุรกรรมอนุพันธ์ที่อ้างอิง ดัชนีทางการเงินหรือกองทุนหนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
- 4) เป็นกรณีอื่น ๆ ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด



N = ไม่เข้าเงื่อนไขข้างต้น

**8. Trade Date**

วันที่ทำสัญญา

**9. Value Date**

วันที่กำหนดมูลค่า

**10. Maturity Date**

วันครบกำหนดสัญญา

**11. Name of Product**

ชื่อเรียกธุรกรรมซึ่งเป็นที่รู้จักกันทั่วไปหรือชื่อทางการค้าของธุรกรรมนั้น

**12. Type of Product**

ประเภทของธุรกรรมเงินกู้ยืม เช่น พันธบัตร หุ้นกู้ ตั๋วสัญญาใช้เงิน และตั๋วแลกเงิน (กรณีประเภทของธุรกรรมเงินกู้ยืม “อื่น ๆ” โปรดระบุรายละเอียดในคอลัมน์ NOTES)

**13. Counterparty Type**

ประเภทคู่สัญญา

**14. Counterparty Name**

ชื่อคู่สัญญาที่ทำธุรกรรมกับธนาคารพาณิชย์

**15. Borrower or Lender**

ธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมดังกล่าวในฐานะเป็นผู้กู้ยืมหรือผู้ให้กู้ยืม

**16. Notional Outstanding Currency**

สกุลเงินของจำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่ที่ WWW.BOT.OR.TH

**17. Notional Outstanding Amount**

จำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ ทั้งนี้ในกรณีธุรกรรมที่มีขารับหรือขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขาที่เป็นเงินตราต่างประเทศ หรือหากเป็นธุรกรรมที่ทั้งขารับและขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขารับ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Notional Outstanding Amount เป็น 0

**18. Notional Baht Equivalent**

จำนวนเงินในการทำธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับเงินตราต่างประเทศ โดยในการคำนวณมูลค่า baht equivalent ให้ใช้อัตรากลาง (mid rate) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศที่ประกาศทางเว็บไซต์ของธนาคารแห่งประเทศไทย ณ วันสิ้นงวดการรายงานซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยของอัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนและอัตราขายถัวเฉลี่ย  $(\text{อัตราซื้อถัวเฉลี่ย} + \text{อัตราขายถัวเฉลี่ย}) / 2$

**19. Reference Variables**

ประเภทของตัวแปรอ้างอิงตามประเภทที่กำหนด รวมถึงตัวแปรอ้างอิงอื่น ๆ ที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

**20. Reference Variables Details**

ชนิดของตัวแปรอ้างอิง ทั้งนี้ กรณีเป็นธุรกรรมที่อ้างอิงตัวแปรที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด ให้ธนาคารพาณิชย์รายงานรายละเอียดหรือวิธีการคำนวณตัวแปรอ้างอิงโดยละเอียด

## 21. Payout

รายละเอียด (สูตร) การคำนวณในการรับ-จ่ายเงินในธุรกรรมดังกล่าวในมุมมองของธนาคารพาณิชย์ ทั้งนี้ ธนาคารพาณิชย์สามารถเลือกไม่รายงานรายการนี้ได้ แต่ต้องจัดเตรียมเอกสารรายละเอียดดังกล่าวไว้ที่สถานที่ทำการ เพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยตรวจสอบ หรือจัดส่งให้แก่ธนาคารแห่งประเทศไทยเมื่อมีการร้องขอ

## 22. Delivery

เงื่อนไขการส่งมอบคืนหรือได้รับคืนในรูปแบบตราสารหนี้ ตราสารทุน หรือเงินตราต่างประเทศในมุมมองของธนาคารพาณิชย์ กรณีธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมเงินกู้ยืมที่ให้สิทธิผู้กู้ยืมในการชำระคืน หรือให้สิทธิผู้ให้กู้ยืมในการรับชำระคืนเงินต้นหรือผลตอบแทนเป็นตราสารหนี้ ตราสารทุน หรือให้สิทธิผู้กู้ยืมหรือผู้ให้กู้ยืมในการซื้อขายหรือแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ

## 23. Transaction Purpose

วัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม (กรณีวัตถุประสงค์ “อื่น ๆ” โปรดระบุรายละเอียดในคอลัมน์ Notes)

## 24. Embedded Derivatives - Derivatives Components

รายละเอียดของอนุพันธ์ด้านตลาดทั้งหมดที่แฝงอยู่ เช่น อนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบของอนุพันธ์แฝง แต่ละอนุพันธ์ย่อยนั้นธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมในด้านใด (ซื้อมา/จ่าย) จำนวนเงินในอนุพันธ์ย่อย (ระบุเฉพาะเจาะจงสำหรับแต่ละอนุพันธ์ย่อย) มีตัวแปรอ้างอิงใดบ้าง ราคาใช้สิทธิ อายุหรือวันสิ้นสุดของธุรกรรมย่อย เป็นต้น ในกรณีที่ธุรกรรมดังกล่าวไม่สามารถแยกองค์ประกอบย่อยได้ให้อธิบายรายละเอียดของธุรกรรม

ทั้งนี้ ธนาคารพาณิชย์สามารถเลือกไม่รายงานรายการนี้ได้ แต่ต้องจัดเตรียมเอกสารรายละเอียดดังกล่าวไว้ที่สถานที่ทำการ เพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยตรวจสอบ หรือจัดส่งให้แก่ธนาคารแห่งประเทศไทยเมื่อมีการร้องขอ

## 25. Embedded Derivatives - Effective Notional Amount

จำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงของอนุพันธ์ด้านตลาดทั้งหมดที่แฝงอยู่ เป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” พร้อมทศนิยม 2 ตำแหน่ง โดยให้ธนาคารพาณิชย์อ้างอิงวิธีการหาจำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของคู่สัญญาสำหรับธุรกรรมอนุพันธ์ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Mark-to-Market ด้วยมูลค่ายุติธรรม ณ วันที่ธุรกรรมสิ้นสุด

## 26. Embedded Derivatives - Mark-to-Market

มูลค่าที่ได้จากการ mark-to-market อนุพันธ์ด้านตลาดทั้งหมดที่แฝงอยู่ ณ วันที่รายงานเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” พร้อมทศนิยม 2 ตำแหน่ง หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Mark-to-Market ด้วยมูลค่ายุติธรรม ณ วันที่ธุรกรรมสิ้นสุด

## 27. Gain or Loss

มูลค่ากำไรหรือขาดทุนจากการทำธุรกรรม ณ วันที่รายงานโดยเปรียบเทียบกับวันสิ้นเดือนก่อนหน้า เป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” พร้อมทศนิยม 2 ตำแหน่ง ทั้งนี้ ให้ใส่เครื่องหมายติดลบ (-) ในกรณีเป็นผลขาดทุน

## 28. Principal Protection (%)

ร้อยละของเงินต้นขั้นต่ำที่ผู้ให้กู้ยืมจะได้รับชำระคืนเมื่อสิ้นสุดสัญญา (ถ้ามี)

## 29. หนังสือให้ความเห็นชอบ

เลขที่หนังสือให้ความเห็นชอบการทำธุรกรรมจากสายกำกับสถาบันการเงิน ในกรณีเป็นธุรกรรมที่ต้องได้รับความเห็นชอบจากธนาคารแห่งประเทศไทย (ถ้ามี)

### 30. Notes

รายละเอียดเพิ่มเติมอื่น ๆ จากการทำธุรกรรม (ถ้ามี)

#### 4. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต (DS\_CDD)

##### Data Set Description

ข้อมูลธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต

Reporting Scope : รายงานธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตทุกประเภทที่มียอดคงค้างเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน

##### Data Set Overview

No	Data Element	Key	Req.	Data Type	Format	Validation	Classification
1	รหัสสถาบัน	PK	M	String	VarChar(40)		
2	งวดข้อมูล	PK	M	Date	Char(10)		
3	ชื่อผู้จัดทำ		M	String	VarChar(128)		
4	โทรศัพท์		M	String	Char(10)		
5	อีเมล		M	String	VarChar(40)		
6	Ref No.	PK	M	String	VarChar(128)		
7	New Product		M	Flag	Char(1)		
8	Trade Date		M	Date	Char(10)		
9	Value Date		M	Date	Char(10)		
10	Maturity Date		M	Date	Char(10)		
11	Name of Product		M	String	VarChar(128)		
12	Derivatives Counterparty Type		M	Classification	VarChar(128)		Derivatives Counterparty Type Code
13	Counterparty Name		M	String	VarChar(128)		
14	Notional Outstanding Currency		M	Classification	Char(3)		Currency Code
15	Notional Outstanding Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
16	Notional Baht Equivalent		M	Numeric	Number(20,2)		
17	Reference Obligations Name / Series		M	String	VarChar(128)		
18	Reference Obligations Maturity		O	Date	Char(10)		
19	Reference Obligations Currency		M	Classification	Char(3)		Currency Code
20	Underlying Obligations Name / Series		O	String	VarChar(128)		
21	Underlying Obligations Maturity		O	Date	Char(10)		
22	Underlying Obligations Currency		O	Classification	Char(3)		Currency Code
23	Derivatives Components		O	String	VarChar(128)		
24	Transaction Purpose		M	Classification	VarChar(128)		Derivatives Transaction Purpose Code
25	Effective Notional Amount		M	Numeric	Number(20,2)		
26	Mark-to-Market		M	Numeric	Number(20,2)		

No	Data Element	Key	Req.	Data Type	Format	Validation	Classification
27	Gain or Loss		M	Numeric	Number(20,2)		
28	Protection Buyer or Seller		M	Flag	VarChar(20)		
29	Rating		O	String	VarChar(20)		
30	Type of Delivery		M	Flag	VarChar(10)		
31	หนังสือให้ความเห็นชอบ		O	String	VarChar(128)		
32	Notes		C	String	VarChar(400)	Purpose อื่นๆ	

## Data Element Description

### 1. รหัสสถาบัน

รหัสประจำตัวผู้รายงานข้อมูล หากเป็นธุรกิจสถาบันการเงินและธุรกิจการเงินอื่นที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) หรือจัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติ (พรบ.) พระราชกำหนด (พรก.) หรือกฎหมายอื่นที่เกี่ยวข้อง ให้รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสถาบันการเงิน” ที่เผยแพร่ที่ WWW.BOT.OR.TH (FI Code 3 หลัก) ผู้รายงานข้อมูลที่นอกจากข้างต้นให้รายงานด้วยเลขจดทะเบียนที่ออกโดยทางการ เช่น เลขทะเบียนนิติบุคคล 13 หลัก

### 2. งวดข้อมูล

วันที่ ณ สิ้นเดือนของงวดการรายงาน ระบุเป็น ปี ค.ศ. (YYYY-MM-DD)

### 3. ชื่อผู้จัดทำ

ชื่อผู้จัดทำรายงาน

### 4. โทรศัพท์

เบอร์โทรศัพท์ผู้จัดทำรายงาน

### 5. อีเมล

อีเมลผู้จัดทำรายงาน

### 6. Ref No.

เลขที่อ้างอิงของธุรกรรม เช่น เลขที่บัญชี เลขที่ confirmation หรือเลขที่สัญญา

### 7. New Product

ธุรกรรมใหม่

Y = ธุรกรรมในกรณีต่อไปนี้

- 1) เป็นธุรกรรมประเภทใหม่ที่ทำเป็นครั้งแรก
- 2) เป็นธุรกรรมประเภทเดิมที่เคยทำ แต่อ้างอิงตัวแปรประเภทหนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
- 3) เป็นธุรกรรมอนุพันธ์ที่อ้างอิง ดัชนีทางการเงินหรือกองทุนหนึ่งๆ เป็นครั้งแรก
- 4) เป็นกรณีอื่น ๆ ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

N = ไม่เข้าเงื่อนไขข้างต้น

### 8. Trade date

วันที่ทำสัญญา

### 9. Value date

วันที่กำหนดมูลค่า

**10. Maturity Date**

วันครบกำหนดสัญญา

**11. Name of product**

ชื่อเรียกธุรกรรมซึ่งเป็นที่รู้จักกันทั่วไปหรือชื่อทางการค้าของธุรกรรมนั้น

**12. Derivatives Counterparty Type**

ประเภทคู่สัญญา

**13. Counterparty Name**

ชื่อคู่สัญญาที่ทำธุรกรรมกับธนาคารพาณิชย์

**14. Notional Outstanding Currency**

สกุลเงินของจำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่ที่ [WWW.BOT.OR.TH](http://WWW.BOT.OR.TH)

**15. Notional Outstanding Amount**

จำนวนเงินตามสัญญาที่เหลืออยู่ ทั้งนี้ในกรณีธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่มีขารับหรือขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขาที่เป็นเงินตราต่างประเทศ หรือหากเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ทั้งขารับและขาจ่ายเป็นเงินตราต่างประเทศ ให้รายงาน outstanding currency และ outstanding amount ของขารับ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Notional Outstanding Amount เป็น 0

**16. Notional Baht Equivalent**

จำนวนเงินในการทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่เกี่ยวข้องกับเงินตราต่างประเทศ โดยในการคำนวณมูลค่า baht equivalent ให้ใช้อัตรากลาง (mid rate) ของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศที่ประกาศทางเว็บไซต์ของธนาคารแห่งประเทศไทย ณ วันสิ้นงวดการรายงานซึ่งคำนวณจากค่าเฉลี่ยของอัตราซื้อถัวเฉลี่ยเงินโอนและอัตราขายถัวเฉลี่ย ([(อัตราซื้อถัวเฉลี่ย + อัตราขายถัวเฉลี่ย) / 2])

**17. Reference Obligations Name / Series**

ชื่อ รุ่น ของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ใช้อ้างอิงสำหรับการจ่ายชำระเงินภายใต้สัญญาอนุพันธ์ด้านเครดิต

**18. Reference Obligations Maturity**

วันครบกำหนดสัญญาของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ใช้อ้างอิง (ถ้ามี)

**19. Reference Obligations Currency**

สกุลเงินของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ใช้อ้างอิง รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่ที่ [WWW.BOT.OR.TH](http://WWW.BOT.OR.TH)

**20. Underlying Obligations Name / Series**

ชื่อ รุ่น ของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันที่ธนาคารพาณิชย์มีฐานะอยู่และต้องการป้องกันความเสี่ยงโดยใช้ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต ซึ่งอาจเป็นสินทรัพย์หรือภาระผูกพันเดียวกับ reference obligations ได้ (ถ้ามี)

**21. Underlying Obligations Maturity**

วันครบกำหนดสัญญาของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันของธนาคารพาณิชย์ (ถ้ามี)

**22. Underlying Obligations Currency**

สกุลเงินของสินทรัพย์หรือภาระผูกพันของธนาคารพาณิชย์ รายงานด้วยรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่ที่ [WWW.BOT.OR.TH](http://WWW.BOT.OR.TH) (ถ้ามี)

### 23. Derivatives Component

รายละเอียดธุรกรรมอนุพันธ์ย่อยที่เป็นส่วนประกอบของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ทำ เฉพาะกรณีเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ความเห็นชอบ พร้อมทั้งฐานะของธนาคารพาณิชย์ในการทำธุรกรรมย่อยดังกล่าว ทั้งนี้ ในกรณีที่ธุรกรรมดังกล่าวไม่สามารถแยกองค์ประกอบย่อยได้ให้อธิบายรายละเอียดของธุรกรรม ทั้งนี้ ธนาคารพาณิชย์สามารถเลือกไม่รายงานรายการนี้ได้ แต่ต้องจัดเตรียมเอกสารรายละเอียดดังกล่าวไว้ที่สถานที่ทำการ เพื่อให้ธนาคารแห่งประเทศไทยตรวจสอบ หรือจัดส่งให้แก่ธนาคารแห่งประเทศไทยเมื่อมีการร้องขอ

### 24. Transaction Purpose

วัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม (กรณีวัตถุประสงค์ “อื่น ๆ” โปรดระบุรายละเอียดในคอลัมน์ Notes)

### 25. Effective Notional Amount

จำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” พร้อมทศนิยม 2 ตำแหน่ง โดยให้ธนาคารพาณิชย์อ้างอิงวิธีการหาจำนวนเงินตามสัญญาที่แท้จริงตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยหลักเกณฑ์การคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงด้านเครดิตของคู่สัญญาสำหรับธุรกรรมอนุพันธ์ หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Effective Notional Amount เป็น 0

### 26. Mark-to-Market

มูลค่าที่ได้จากการ mark-to-market ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต ณ วันที่รายงานเป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” พร้อมทศนิยม 2 ตำแหน่ง หากเป็นธุรกรรมใหม่ที่ทำและสิ้นสุดในระหว่างงวด ให้รายงาน Mark-to-Market ด้วยมูลค่ายุติธรรม ณ วันที่ธุรกรรมสิ้นสุด

### 27. Gain or Loss

มูลค่ากำไรหรือขาดทุนจากการทำธุรกรรม ณ วันที่รายงานโดยเปรียบเทียบกับวันสิ้นเดือนก่อนหน้า เป็นสกุลเงินบาทโดยใช้หน่วย “บาท” พร้อมทศนิยม 2 ตำแหน่ง ทั้งนี้ ให้ใส่เครื่องหมายติดลบ (-) ในกรณีเป็นผลขาดทุน

### 28. Protection Buyer or Seller

ธนาคารพาณิชย์ทำธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตดังกล่าวในฐานะเป็นผู้โอนความเสี่ยงด้านเครดิตให้รายงาน “Protection Buyer” หรือผู้รับโอนความเสี่ยงด้านเครดิตให้รายงาน “Protection Seller”

### 29. Rating

อันดับความน่าเชื่อถือของตราสารในกรณีเป็นธุรกรรม Funded Credit Derivatives ที่ได้รับจากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือภายนอก (ถ้ามี)

### 30. Type of Delivery

ธุรกรรมกำหนดเงื่อนไขการส่งมอบและชำระราคาเป็นสินทรัพย์อ้างอิงให้รายงาน “Physical” หรือเงินสดให้รายงาน “Cash”

### 31. หนังสือให้ความเห็นชอบ

เลขที่หนังสือให้ความเห็นชอบการทำธุรกรรมจากสายกำกับสถาบันการเงิน ในกรณีเป็นธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิตที่ต้องได้รับความเห็นชอบจากธนาคารแห่งประเทศไทย (ถ้ามี)

### 32. Notes

รายงานรายละเอียดเพิ่มเติมอื่น ๆ จากการทำธุรกรรม (ถ้ามี)

#### IV. Data Type

Data Type	Format	Sample Data Set : Data Element	Sample Value
Classification	Char(3)	DS_SDV : Notional Outstanding Currency	USD
	VarChar(40)	DS_MLN : Delivery	XXXXXXXXXX : เงินตราต่างประเทศ
	VarChar(128)	DS_MLN : Reference Variables	XXXXXXXXXX : ราคาตราสารหนี้
Date	Char(10)	DS_MLN : Maturity Date	2022-07-31 รายงานเป็น ปี ค.ศ. เดือน วัน
Flag	Char(1)	DS_CDD : New Product	Y
	VarChar(10)	DS_MLN : Borrower or Lender	Borrower
	VarChar(20)	DS_CDD : Protection Buyer or Seller	Protection Seller
Numeric	Number(20,2)	DS_SDV : Mark-to-Market	123456789.00
String	Char(10)	DS_CDD : โทรศัพท์	022836163
	VarChar(20)	DS_CDD : Rating	BBB
	VarChar(40)	DS_SDV : รหัสสถาบัน	001
	VarChar(128)	DS_MLN : Counterparty Name	บริษัท คล่องคำ จำกัด
	VarChar(400)	DS_SDV : Notes	ทำธุรกรรมประเภทนี้เป็นครั้งแรก



## V. Data Validation Overview

การตรวจสอบความถูกต้องของการรายงานข้อมูล ได้แก่ File Validation, All Entities Validation และ ICAS Data Validation ซึ่งประกอบด้วย 2 เรื่อง คือ

1. Consistency (CN) เพื่อตรวจสอบความสอดคล้องของข้อมูลตามธุรกิจ
2. Referential Integrity (RI) เพื่อตรวจสอบว่าทุกรายการข้อมูล (record) ที่มีการอ้างอิงความสัมพันธ์จะต้องมีการรายงานข้อมูลนั้นใน Data Entity ที่อยู่ลำดับก่อนหน้าเข้ามาด้วย

DATA ENTITY GROUP	DATA ENTITY NAME	ABBR	FILE VALIDATION	ALL ENTITIES VALIDATION	DRV DATA VALIDATION	
					CONSISTENCY	REFERENTIAL INTEGRITY

## VI. Data Validation Detail

### 1. File Validation

Validation Id	Description (TH)	Description (EN)	Validation Step
FV001	จำนวน Data Element ต้องครบตามที่กำหนดในเอกสาร	The number of Data Element must be the same as specified in this document.	Basic
FV002	รูปแบบไฟล์ต้องเป็นไฟล์นามสกุล .xlsx เท่านั้น	A file extension or file type must be .xlsx.	Basic
FV003	ข้อมูลต้องใช้ character encoding ในรูปแบบ UTF-8 เท่านั้น	The data must be saved with UTF-8 character encoding.	Basic

## 2. All Entities Validation

Validation Id	Description (TH)	Description (EN)	Validation Step
CN001	ข้อมูลต้องตรงกับ Data Type และ Format ตามที่ระบุในเอกสาร	Data type and data format must be the same as specified in this document.	Basic
CN002	Data Element ที่มีค่า Key เป็น PK ตามที่ระบุในเอกสารจะต้องมีค่าไม่ซ้ำกัน	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	Classification code must be in the code list of classification or view as specified in Classification Document.	Complex
CN005	Data Date ต้องตรงกับวันที่ของงวดข้อมูลที่เลือกบนระบบ DMS DA	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) ผู้รายงานข้อมูลทีนอกจากข้างต้นให้รายงานด้วยเลขจดทะเบียนที่ออกโดยทางการ 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

### 3. Data Validation

#### Consistency

Validation Id	Validation Rule	Description (TH)	Description (EN)	Validation Step
CNICSD001	[DER_ICSD.Clearing Date] = Previous_Business_Day([DER_ICSD.Data Date])	Clearing Date ต้องมีค่า และต้องเท่ากับ 1 วันทำการก่อนหน้า Data Date	The Clearing Date cannot be null. and must be the previous business day of the Data Date	Complex
CNICSD002	(([DER_ICSD.Settlement Date] = [DER_ICSD.Clearing Date]) or ([DER_ICSD.Settlement Date] = Next_Business_Day([DER_ICSD.Clearing Date])))	Settlement Date ต้องเป็นวันเดียวกับ Clearing Date หรือเท่ากับ 1 วันทำการถัดจากวันที่ Clearing Date	The Settlement Date must be the same as the Clearing Date or the next business day of the Clearing Date.	Complex
CNICSD003	[DER_ICSD.Cheque Amount] > 0	Cheque Amount ต้องมีค่ามากกว่า 0	The Cheque Amount must be greater than zero.	Basic
CNICSD004	[DER_ICSD.Paying Bank Received Fee] >= 0	Paying Bank Received Fee ต้องมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 0	The Cheque Amount must be greater than or equal to zero.	Basic
CNIASD001	[DER_IASD.Cheque Amount] > 0	Cheque Amount ต้องมีค่ามากกว่า 0	The Cheque Amount must be greater than zero.	Basic

#### Referential Integrity

Validation Id	Referential Data Entity	Validation Rule	Description (TH)	Description (EN)	Validation Step
RIIASD001	DER_IASD	Composited_Key_of ([DER_IASD.ICAS Unique ID, Clearing Date, Settlement Date]) EXISTS IN [DER_ICSD]	รายการ IAS Data Correction ต้องมีอยู่ใน ICS Cheque Detail	The IAS Data Corrected Cheque must exist in the ICS Cheque Detail.	Complex

## VII. Classification Summary

No.	Classification	1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด รายประเภทธุรกรรม	2. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด รายสัญญา	3. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มี อนุพันธ์ด้านตลาดแฝง	4. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้าน เครดิต	Data Set : Data Element
1	Currency Code		X	X	X	DS_SDVT : Notional Outstanding Currency DS_MLN : Notional Outstanding Currency DS_CDD : Notional Outstanding Currency, Reference Obligations Currency, Underlying Obligations Currency
2	Derivatives Counterparty Type Code		X	X	X	DS_SDVT : Derivatives Counterparty Type DS_MLN : Derivatives Counterparty Type DS_CDD : Derivatives Counterparty Type
3	Derivatives Product Group Code	X	X			DS_SDVP : Derivatives DS_SDVT : Group of Product
4	Derivatives Reference Variables Code		X	X		DS_SDVT : Reference Variables DS_MLN : Reference Variables
5	Derivatives Transaction Purpose Code		X	X	X	DS_SDVT : Transaction Purpose DS_MLN : Transaction Purpose DS_CDD : Transaction Purpose
6	Customer Investment Type Code			X		DS_MLN : Type of Product
7	Derivatives Delivery Code			X		DS_MLN : Delivery

## VIII. Classification Detail

### 1. Currency Code

รหัสสกุลเงิน โดยรายงานตามรหัสมาตรฐาน “รหัสสกุลเงิน” ที่เผยแพร่บน WWW.BOT.OR.TH

### 2. Derivatives Counterparty Type Code

ประเภทคู่สัญญา

Code	Value	Description
XXXXXXXXXX	ธนาคารพาณิชย์ไทย ซึ่งรวมถึงธนาคารพาณิชย์เพื่อรายย่อย	
XXXXXXXXXX	สาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ (ในประเทศไทย)	
XXXXXXXXXX	สาขาอื่นของธนาคารพาณิชย์	
XXXXXXXXXX	ธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ	
XXXXXXXXXX	สถาบันการเงินเฉพาะกิจ (ในประเทศไทย)	
XXXXXXXXXX	บริษัทหลักทรัพย์	
XXXXXXXXXX	บริษัทประกันชีวิตและบริษัทประกันวินาศภัย	
XXXXXXXXXX	หน่วยงานราชการ หน่วยงานของรัฐ รัฐวิสาหกิจ และธนาคารกลาง	
XXXXXXXXXX	ผู้ลงทุนสถาบันอื่นๆ	
XXXXXXXXXX	ผู้ลงทุนรายใหญ่ประเภทนิติบุคคลอื่นๆ	
XXXXXXXXXX	ผู้ลงทุนรายใหญ่ประเภทบุคคลธรรมดา	
XXXXXXXXXX	ผู้ลงทุนรายย่อยประเภทนิติบุคคล	
XXXXXXXXXX	ผู้ลงทุนรายย่อยประเภทบุคคลธรรมดา	

### 3. Derivatives Product Group Code

ประเภทของธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาด

Code	Value	V_SDVT	V_SDVP
XXXXXXXXXX	ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดขั้นพื้นฐาน	X	
XXXXXXXXXX	ธุรกรรม futures		X
XXXXXXXXXX	ธุรกรรม forwards		X
XXXXXXXXXX	ธุรกรรม swaps		X
XXXXXXXXXX	ธุรกรรม options		X
XXXXXXXXXX	ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ไม่ใช่ขั้นพื้นฐาน	X	
XXXXXXXXXX	ธุรกรรม Barrier derivatives		X
XXXXXXXXXX	ธุรกรรม Average derivatives		X
XXXXXXXXXX	ธุรกรรม Option derivatives		X
XXXXXXXXXX	ธุรกรรม FX pro-rata และ flexible derivatives		X
XXXXXXXXXX	ธุรกรรม Forward-start derivatives		X
XXXXXXXXXX	ธุรกรรมอื่น ๆ		X
XXXXXXXXXX	ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ธนาคารแห่งประเทศไทยให้ความเห็นชอบเป็นรายการนี้	X	
XXXXXXXXXX	ธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดที่ธนาคารแห่งประเทศไทยอนุญาตให้ทำได้ตามบทเฉพาะกาลของประกาศฉบับนี้	X	

### 4. Derivatives Reference Variables Code

ประเภทของตัวแปรอ้างอิงตามประเภทที่กำหนด รวมถึงตัวแปรอ้างอิงอื่น ๆ ที่ไม่เข้าข่ายตามหลักเกณฑ์ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

Code	Value	Description
XXXXXXXXXX	อัตราดอกเบี้ย	
XXXXXXXXXX	อัตราแลกเปลี่ยน	
XXXXXXXXXX	ราคาตราสารหนี้	
XXXXXXXXXX	ราคาตราสารทุน	
XXXXXXXXXX	ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ (commodities)	
XXXXXXXXXX	เครดิต	
XXXXXXXXXX	ผลดำเนินงานกองทุนหรือกองทรัสต์	
XXXXXXXXXX	ดัชนีทางการเงิน	
XXXXXXXXXX	อื่น ๆ	

## 5. Derivatives Transaction Purpose Code

วัตถุประสงค์ของการทำธุรกรรม

Code	Value	Description
XXXXXXXXXX	Bank's Funding	เป็นการทำเพื่อจัดหาแหล่งเงินทุนหรือบริหารสภาพคล่องของธนาคารพาณิชย์
XXXXXXXXXX	Bank's Hedging	เป็นการทำเพื่อป้องกันความเสี่ยงของธนาคารพาณิชย์
XXXXXXXXXX	Bank's Trading	เป็นการทำเพื่อการค้าหรือเก็งกำไรของธนาคารพาณิชย์
XXXXXXXXXX	Counterparty's Hedging	เป็นการทำเพื่อป้องกันความเสี่ยงของคู่สัญญา
XXXXXXXXXX	Counterparty's Trading	เป็นการทำเพื่อการค้าหรือเก็งกำไรของคู่สัญญา
XXXXXXXXXX	Others	อื่น ๆ

## 6. Structured Product Borrowing Type Code

ประเภทของธุรกรรมเงินกู้ยืม

Code	Value	Description
	ตราสารหนี้	
	พันธบัตร	
	หุ้นกู้	
	ตั๋วแลกเงิน	
	ตั๋วเงินอัตราดอกเบี้ยลอยตัว	
	บัตรเงินฝากอัตราดอกเบี้ยลอยตัว	
	ตั๋วสัญญาใช้เงิน	
	บัตรเงินฝาก	
	ตราสารหนี้อื่น ๆ	
	เงินฝาก	
	เงินกู้ยืมอื่น ๆ	

## 7. Derivatives Delivery Code

เงื่อนไขการส่งมอบคืนหรือได้รับคืนในรูปตราสารหนี้ ตราสารทุน หรือเงินตราต่างประเทศในมุมมองของธนาคารพาณิชย์

Code	Value	Description
XXXXXXXXXX	ตราสารหนี้	
XXXXXXXXXX	ตราสารทุน	
XXXXXXXXXX	เงินตราต่างประเทศ	
XXXXXXXXXX	ไม่มี	

## IX. Submission Format

### 1. File Format for Submission

Data Set Name	ABBR	Format	Description
1. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม	DS_SDV	Excel	Sheet "DS_SDVP"
2. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา	DS_SDV	Excel	Sheet "DS_SDVT"
3. ยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ยืมที่มีอนุพันธ์ด้านตลาดแฝง	DS_MLN	Excel	Sheet "DS_MLN"
4. ยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต	DS_CDD	Excel	Sheet "DS_CDD"

### 2. Naming Convention

เพื่อลดกระบวนการกำหนดค่าต่าง ๆ ในการนำส่งไฟล์จำนวนมาก ระบบจะอ่านชื่อไฟล์เพื่อระบุข้อมูลประกอบการนำส่ง โดยมีการกำหนดมาตรฐานชื่อไฟล์ ดังนี้

**FXXXNn\_YYYYMMDD\_Zz.xlsx**

สัญลักษณ์	ความหมายและข้อกำหนด
F	ความถี่ในการส่งข้อมูล (D: Daily, M: Monthly, Q: Quarterly, H: Half Yearly, Y: Yearly, A: As occur)
XXX	ชื่อย่อ Subject Area ของข้อมูล (สำหรับข้อมูล Derivatives คือ DRV)
Nn	รหัสประจำตัวผู้ส่งข้อมูล เช่น FI Code หรือ รหัสนิติบุคคล
YYYYMMDD	ปีเดือนวันของข้อมูล (ค.ศ.)
Zz	ชื่อย่อ Data Set
.xlsx	นามสกุลชุดข้อมูล

ตัวอย่าง: ส่งไฟล์ข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายประเภทธุรกรรม งวดวันที่ 31 มกราคม ปี พ.ศ. 2565 ของสถาบันการเงินที่มี Fi Code 001 ให้ตั้งชื่อไฟล์ ดังนี้ MDRV001\_20220131\_SDV.xlsx

### 3. Submission Channel

ธปท. มีช่องทางมาตรฐาน (DMS-DA) เพื่อการนำส่งข้อมูล คือ ช่องทาง Web Submission (Web based) รองรับการนำส่งข้อมูลผ่าน BOT Website