

รายงานยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์

มาตรฐานการตั้งชื่อไฟล์ข้อมูล : MDMSNn_YYYYMMDD_DRV.xlsx

M	ค่าคงที่ หมายถึง ความถี่ในการส่งข้อมูลเป็นรายเดือน
DMS	ค่าคงที่ หมายถึง Subject Area
Nn	รหัสของสถาบันผู้ส่งข้อมูล
YYYY	ปีของข้อมูลให้ใช้ปี ค.ศ. 4 หลัก เช่น 2021 เป็นต้น
MM	เดือนของข้อมูล มีค่า 01 , 02 , 03 , 04 , 05 , 06 , 07 , 08 , 09 , 10 , 11 , 12
DD	วันที่ของข้อมูลที่รายงาน มีค่าระหว่าง 01 - 31
DRV	เป็นค่าคงที่ หมายถึงแบบรายงานยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์
xlsx	เป็นค่าคงที่ หมายถึง นามสกุลของรูปแบบไฟล์ที่จัดส่งอยู่ในรูป Excel file

การจัดทำแบบรายงาน

1. แบบรายงานดังกล่าวไม่ต้องจัดทำ Hard Copy ส่งให้ธนาคารแห่งประเทศไทย
2. ความถี่ในการรายงาน คือ รายงานเป็นรายเดือน
3. บ่อนข้อมูลลงในช่องที่มีพื้นหลังเป็นสีฟ้าอ่อน (จำเป็น)

--
4. บ่อนข้อมูลลงในช่องว่างพื้นหลังสีขาว (Optional)

--
5.

คอลัมน์สีเหลือง

 หมายถึง ให้ระบุค่าตาม Dropdown List
6. บ่อนวันที่สิ้นเดือนของงวดการรายงาน (Data Set Date) ในรูปแบบ YYYY-MM-DD เป็นปี ค.ศ.
7. บ่อนรายละเอียดอื่น ๆ ตามหัวข้อที่กำหนดในตาราง
8. ส่งข้อมูลเป็น Excel File มายัง ธปท. ผ่านช่องทางการรับส่งข้อมูลระบบ DMS Data Acquisition (DA)

รายงานยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านเครดิต

รหัสสถาบัน	ไปรษณีย์พัฒนาการเงินของทาง
งวดข้อมูล (YYYY-MM-DD)	2022-06-30
ชื่อผู้จัดทำ	ชื่อ นามสกุล
โทรศัพท์	ไม่เกี่ยวข้อง -*-
อีเมล	

Ref No.	New product	Trade date	Value date	Maturity Date	Name of product	Counterparty Type	Counterparty Name	Notional Amount			Reference obligations			Underlying obligations			Derivatives components	Purpose	Effective notional amount	Mark-to-market	Gain or loss	Protection buyer or seller	Rating	Type of delivery	หนังสือให้ทราบเป็นขอบ	Notes	
								Notional Outstanding Currency	Notional Outstanding Amount	Notional Baht Equivalent	Reference obligations Name / Series	Reference obligations Maturity	Reference obligations Currency	Underlying obligations Name / Series	Underlying obligations Maturity	Underlying obligations Currency											

(หน่วย: บาท)

รายงานยอดคงค้างธุรกรรมเงินกู้ที่มีเงื่อนไขด้านตลาดแฝง

รหัสสถาบัน	ไปรษณีย์โทรเลขสถาบันการเงินของท่าน
งวดข้อมูล (YYYY-MM-DD)	2022-06-30
ชื่อผู้จัดทำ	ชื่อ นามสกุล
โทรศัพท์	ไม่ต้องใส่ "-"
อีเมล	

Ref No.	New product	Trade date	Value date	Maturity Date	Name of product	Type of product	Counterparty Type	Counterparty Name	Borrower or lender	Notional Amount			Reference variables	Reference variables Details	Payout	Delivery	Purpose	Embedded derivatives			Gain or loss	Principal protection (%)	หนังสือให้ความเห็นชอบ	Notes	
										Notional Outstanding Currency	Notional Outstanding Amount	Notional Baht Equivalent						Embedded derivatives - Derivative components	Embedded derivatives - Effective notional amount	Embedded derivatives - Mark-to-market					

(หน่วย: บาท)

รายงานยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์ด้านตลาดรายสัญญา

รหัสสถาบัน	ไปรษณีย์รหัสสถาบันการเงินของท่าน
งวดข้อมูล (YYYY-MM-DD)	2022-06-30
ชื่อผู้จัดทำ	ชื่อ นามสกุล
โทรศัพท์	ไม่ต้องใส่ "-"
อีเมล	

Ref No.	New Product	Trade date	Value date	Maturity Date	Name of product	Group of product	Counterparty Type	Counterparty Name	Notional Amount			Reference variables	Reference variables Details	Payout	Derivative component	Type of delivery	Purpose	Effective notional amount	Mark-to-market	Gain or loss	หนังสือให้ความเห็นชอบ	Notes	
									Notional Outstanding Currency	Notional Outstanding Amount	Notional Baht Equivalent												

(หน่วย: บาท)

