

เอกสารแนบ 1 : การปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนเพิ่มเติม ตามความเห็นของ ธปท.

เพื่อให้มีข้อมูลที่ครบถ้วนเพียงพอต่อการกำกับดูแล ธปท. ขอให้สำนักงานปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนเพิ่มเติมจากเอกสารรับฟังความคิดเห็นที่ อนุจ. 42/2562 เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ เผยแพร่เมื่อวันที่ 6 สิงหาคม 2562 ทั้งนี้ ข้อมูลที่ปรับปรุงเพิ่มเติมจากเอกสารรับฟังความคิดเห็นดังกล่าว แสดงด้วย**ตัวอักษรสีเขียว**

ข้อแตกต่างที่สำคัญระหว่างแบบรายงานของ ธปท. และแบบรายงานของสำนักงาน ในส่วนของการลงทุนในต่างประเทศ และตราสารอนุพันธ์ของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

ชุดข้อมูล	แบบรายงานของ ธปท. (แบบรายงาน PIA)	แบบรายงานของสำนักงาน (แบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุน)
ประเทศที่กองทุนไปลงทุน	ประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์	ประเทศที่หลักทรัพย์เสนอขาย
มูลค่าการลงทุนในหลักทรัพย์ หรือตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ	อยู่ในรูปสกุลเงินต่างประเทศ ของตราสารหรืออนุพันธ์ที่ลงทุน	อยู่ในรูปสกุลเงินบาท

เพื่อปิดความแตกต่างระหว่างข้อมูลชุดดังกล่าว สำนักงานจะพิจารณาปรับปรุงแบบรายงาน MF01 และ PVD01 โดยการเพิ่ม field ข้อมูลเพื่อรองรับการรายงานชุดข้อมูลของ ธปท. ที่สำนักงานยังไม่มี ดังต่อไปนี้

(1) เพิ่ม field “รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์” ให้ผู้ประกอบธุรกิจรายงานประเทศของผู้ออกตราสารหรือผู้รับฝากเงิน ที่กองทุนออกไปลงทุนหรือฝากเงิน โดยใช้ชุด code ที่สำนักงานกำหนด

(2) เพิ่ม field ที่เกี่ยวข้องกับมูลค่าการลงทุนในรูปสกุลเงินต่างประเทศที่ไปลงทุน โดยให้รายงานมูลค่าในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน ได้แก่

- ต้นทุนเฉลี่ยของผู้ออกหลักทรัพย์ สำหรับหลักทรัพย์ประเภทตราสารทุน ตราสารหนี้ หน่วยลงทุน และหลักทรัพย์อื่น ๆ ที่มีใช้ตราสารอนุพันธ์ structured notes และ credit derivatives & structured finance
- มูลค่าหน้าตัว สำหรับ structured notes และ credit derivatives & structured finance
- มูลค่ายุติธรรม สำหรับหลักทรัพย์ประเภทตราสารทุน ตราสารหนี้ และหลักทรัพย์อื่น ๆ ที่มีใช้ตราสารอนุพันธ์
- มูลค่า notional amount สำหรับตราสารอนุพันธ์
- มูลค่า option value ต่อสัญญา สำหรับตราสารอนุพันธ์ประเภท option
- มูลค่า option premium สำหรับตราสารอนุพันธ์ประเภท option
- ยอดคงค้าง excess cash และ margin รายกองทุน ในกรณีที่มีการลงทุนในตราสารอนุพันธ์

- ผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน สำหรับตราสารอนุพันธ์

structured notes และ credit derivatives & structured finance

- **มูลค่าธุรกรรม** สำหรับธุรกรรมประเภท reverse repo, repo และ security lending
- **มูลค่าหลักประกัน** สำหรับธุรกรรมประเภท reverse repo, repo และ security lending

ทั้งนี้ เมื่อ ธปท. ยกเลิกแบบรายงาน PIA ในส่วนของข้อมูลการลงทุนในตราสารต่างประเทศและอนุพันธ์ของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพแล้ว ให้ผู้ประกอบการรายงานชุดข้อมูลที่ได้มาจากแบบรายงาน PIA รวมถึงข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการทำธุรกรรมประเภท reverse repo, repo และ security lending ในแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนของสำนักงาน โดยมีรายละเอียดดังนี้ (ข้อมูลที่ปรับปรุงแสดงด้วยตัวอักษรตัวหนา (bold) สีแดง)

ชุดข้อมูลที่ได้มาจากแบบรายงาน PIA	การรายงานในแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนหลังจากที่ ธปท. ยกเลิกแบบรายงาน PIA
ประเภทของหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์	ใช้ field เดิมของแบบรายงาน ระบุชุด code รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน
ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ / คู่สัญญา / สถาบันรับฝากเงิน	ใช้ field เดิมของแบบรายงาน ระบุชื่อใน field “ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์” หรือ “ชื่อของคู่สัญญา” ในส่วน of feature ของหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์
ประเทศที่ออกไปลงทุน / ฝากเงิน	กำหนด field ขึ้นใหม่ ในกรณี equity & others และ fixed income feature : ให้ระบุรหัสประเทศเพิ่มเติมใน field “รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์” ใช้ field เดิมของแบบรายงาน สำหรับ feature ของตราสารอนุพันธ์ / structured notes / credit derivatives & structured finance : ให้ระบุรหัสประเทศใน field “รหัสประเทศของคู่สัญญา” ตามเดิม
สกุลเงินของหลักทรัพย์และอนุพันธ์ที่ไปลงทุน	ใช้ field เดิมของแบบรายงาน 1. กรณี equity & others และ fixed income feature : ให้ระบุรหัสสกุลเงินใน field “รหัสสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขาย” 2. กรณี futures, forward feature : ให้ระบุรหัสสกุลเงินใน field “รหัสสกุลเงินด้านซื้อของ notional amount” และ field “รหัสสกุลเงินด้านขายของ notional amount”

ชุดข้อมูลที่มาจกแบบรายงาน PIA	การรายงานในแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุน หลังจากที่ สปท. ยกเลิกแบบรายงาน PIA
	<p>3. ทรัพย์สิน <u>swap feature</u> :</p> <p>ให้ระบุทรัพย์สินใน field “ทรัพย์สินด้านรับของ notional amount” และ field “ทรัพย์สินด้านจ่ายของ notional amount”</p> <p>4. ทรัพย์สิน <u>option feature</u> :</p> <p>ให้ระบุทรัพย์สินใน field “ทรัพย์สินของ notional amount”</p> <p>5. ทรัพย์สิน <u>structured note feature</u> :</p> <p>ให้ระบุทรัพย์สินใน field “ทรัพย์สินของ structured notes”</p> <p>6. ทรัพย์สิน <u>credit derivatives & structured finance feature</u> :</p> <p>ให้ระบุทรัพย์สินใน field “ทรัพย์สินของสัญญา credit derivatives”</p>
<p>ยอดคงค้างการลงทุน (ไม่รวมตราสารอนุพันธ์)</p>	<p>กำหนด field ขึ้นใหม่</p> <p>1. ทรัพย์สิน <u>outstanding equity & others</u> และ <u>outstanding fixed income</u> :</p> <p>(ก) <u>ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน</u> ให้ระบุใน field “ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน”</p> <p>(ข) <u>มูลค่ายุติธรรมในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน</u> ให้ระบุมูลค่า mark to market ในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน ใน field “มูลค่ายุติธรรมในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน”</p> <p>2. ทรัพย์สิน <u>outstanding</u> ของ <u>structured notes</u> ต่างประเทศ</p> <p>(ก) <u>มูลค่าหน้าตัวในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน</u> ให้ระบุมูลค่าหน้าตัวในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน ใน field “มูลค่าหน้าตัวในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน”</p> <p>(ข) <u>มูลค่าตามราคาตลาดในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน</u> ให้ระบุมูลค่า mark to market ในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน ใน field “มูลค่ายุติธรรมในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน”</p>

ชุดข้อมูลที่มาจกแบบรายงาน PIA	การรายงานในแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุน หลังจากที่ ธปท. ยกเลิกแบบรายงาน PIA
	<p>(ค) <u>unrealized gain / loss ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน</u> ให้ระบุใน field “ผลกำไร / ขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน”</p> <p>3. <u>กรณี outstanding ของ credit derivatives & structured finance</u></p> <p>(ก) <u>มูลค่า reference asset หรือ มูลค่าหน้าตัวของ CLN ในรูปสกุลเงิน ที่ไปลงทุน</u> ให้ระบุใน field “มูลค่า reference asset หรือ มูลค่าหน้าตัวของ CLN ในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน”</p> <p>(ข) <u>มูลค่าตามราคาตลาดของ reference asset หรือ CLN ในรูป สกุลเงินที่ไปลงทุน</u> ให้ระบุใน field “มูลค่าตามราคาตลาดของ reference asset หรือ CLN ในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน”</p> <p>(ค) <u>unrealized gain / loss ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน</u> ให้ระบุใน field “ผลกำไร / ขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน”</p>
ยอดคงค้างตราสารอนุพันธ์	<p><u>กำหนด field ขึ้นใหม่</u> ในกรณี outstanding ของ futures, forward, swap, option</p> <p>(ก) <u>notional amount ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน</u> ให้ระบุใน field “มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดข้อมูลในรูปสกุลเงิน ของตราสารอนุพันธ์ที่ไปลงทุน”</p> <p>(ข) <u>unrealized gain / loss ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน</u> ให้ระบุใน field “ผลกำไร / ขาดทุนจากการ mark to market สัญญาในรูปสกุลเงินของตราสารอนุพันธ์ที่ไปลงทุน”</p> <p><u>กำหนดรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน ขึ้นใหม่</u> <u>เพื่อรองรับการรายงานมูลค่า excess cash และ margin รายกองทุน</u> <u>ในรูปสกุลเงินของตราสารอนุพันธ์ที่ไปลงทุน</u></p>

ชุดข้อมูลอื่น ๆ ที่ ธปท. ใช้กำกับดูแล	การรายงานในแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุน
การทำธุรกรรมประเภท reverse repo, repo และ security lending	<p>กำหนด field ขึ้นใหม่</p> <p>(ก) มูลค่าธุรกรรม ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน ให้ระบุใน field “มูลค่าธุรกรรม ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรม”</p> <p>(ข) มูลค่าหลักประกัน ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน</p> <ul style="list-style-type: none"> - กรณี reverse repo ให้ระบุใน field “มูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมีสัญญาขายคืน ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรม” - กรณี repo ให้ระบุใน field “มูลค่าหลักประกันที่เป็นประกัน ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรม” - กรณี security lending ให้ระบุใน field “มูลค่าหลักประกัน ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรม”

รายละเอียดการปรับปรุงแบบรายงานของสำนักงาน

วัตถุประสงค์	เพื่อรองรับการรายงานข้อมูลที่มาจกแบบรายงาน PIA ภายหลังจากที่ ธปท. ยกเลิกแบบรายงาน PIA ในส่วนของการลงทุนในต่างประเทศและตราสารอนุพันธ์ของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
ผู้เกี่ยวข้อง	บริษัทที่จัดการกองทุนรวมและบริษัทที่จัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
ขอบเขต	<ol style="list-style-type: none"> 1. กองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ 2. ประเภทหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์ ได้แก่ <ol style="list-style-type: none"> (1) ตราสารทุน (2) ตราสารหนี้ (3) ตราสารอนุพันธ์ ได้แก่ forward, futures, swap และ option (4) structured notes (5) credit derivatives และ structured finance (6) หลักทรัพย์อื่น ๆ ที่มีใช้ตราสารอนุพันธ์ เช่น หน่วยลงทุน เป็นต้น 3. ประเภทธุรกรรมทางการเงิน ได้แก่ ธุรกรรม reverse repo, repo และ security lending

แบบรายงาน	<p>พอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพซึ่งประกอบด้วย</p> <ol style="list-style-type: none"> feature ตราสาร ได้แก่ <ol style="list-style-type: none"> (1) equity & others feature (แบบรายงาน EQF) (2) fixed income feature (แบบรายงาน FIF) outstanding ตราสาร <ol style="list-style-type: none"> (1) กองทุนรวม (แบบรายงาน OS_MF01) (2) กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ (แบบรายงาน OS_PVD01) 												
ระบบงาน	ระบบ OFAR												
การปรับปรุง	เพิ่ม field และรหัสประเภทหลักทรัพย์/หนี้สิน เพื่อรองรับการรายงาน												
ความถี่	รายเดือน												
รายละเอียด	<p>1. เพิ่ม field ข้อมูลในแบบรายงาน ต่อไปนี้</p> <p>1.1 รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์</p> <p>แบบรายงานที่ปรับปรุง : แบบรายงาน EQF และ FIF</p> <p>รูปแบบของ field ข้อมูล :</p> <table border="1" data-bbox="443 1176 1468 1545"> <tr> <td>Field name</td> <td>Issuer Country Code</td> </tr> <tr> <td>Description</td> <td>รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์</td> </tr> <tr> <td>Format</td> <td>varchar(2)</td> </tr> <tr> <td>Not null</td> <td>Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)</td> </tr> <tr> <td>Possible Value</td> <td>ชุด code ที่สำนักงานกำหนด (Country code สากล)</td> </tr> <tr> <td>Remark</td> <td>พิจารณาจากการที่ผู้ออกหลักทรัพย์จดทะเบียนประกอบธุรกิจหลักในประเทศนั้น หรือมี head office อยู่ที่ประเทศนั้น</td> </tr> </table> <p>รูปแบบ text file ที่ปรับปรุง : ปรับปรุงเฉพาะส่วนของ data โดยมีรายละเอียด ดังนี้</p> <p>(ก) แบบรายงาน EQF</p> <p>ชื่อหลักทรัพย์ (issue name) เลขรหัสหลักทรัพย์สากล รหัสประเภทหลักทรัพย์/หนี้สิน รหัสตลาด ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ วันที่ออกจำหน่าย/จดทะเบียน วันที่เพิกถอน/ครบกำหนด รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์ รหัสประเทศที่หลักทรัพย์เสนอขาย รหัสสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขาย เวลาที่สร้างรายการ เวลาที่แก้ไขรายการ</p> <p>(ข) แบบรายงาน FIF</p> <p>ชื่อหลักทรัพย์ (issue name) เลขรหัสหลักทรัพย์สากล รหัสประเภทหลักทรัพย์/หนี้สิน </p>	Field name	Issuer Country Code	Description	รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์	Format	varchar(2)	Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)	Possible Value	ชุด code ที่สำนักงานกำหนด (Country code สากล)	Remark	พิจารณาจากการที่ผู้ออกหลักทรัพย์จดทะเบียนประกอบธุรกิจหลักในประเทศนั้น หรือมี head office อยู่ที่ประเทศนั้น
Field name	Issuer Country Code												
Description	รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์												
Format	varchar(2)												
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)												
Possible Value	ชุด code ที่สำนักงานกำหนด (Country code สากล)												
Remark	พิจารณาจากการที่ผู้ออกหลักทรัพย์จดทะเบียนประกอบธุรกิจหลักในประเทศนั้น หรือมี head office อยู่ที่ประเทศนั้น												

รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของหลักทรัพย์ | Rating ของหลักทรัพย์ |
 Bond Type | Secured/Unsecured | รหัสตลาด | ราคาหน้าตัวต่อหน่วย หรือราคา PAR
 (บาท) | ประเภทอัตราดอกเบี้ยหน้าตัว | อัตราดอกเบี้ยหน้าตัว (%) | ระยะเวลาการจ่าย
 ดอกเบี้ย (Coupon Payment) | เลขที่จดทะเบียนบริษัทของ Issuer | ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ |
รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์ | รหัสประเทศที่หลักทรัพย์เสนอขาย | รหัสสกุลเงิน
 ที่หลักทรัพย์ซื้อขาย | รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์ |
 Rating ของผู้ออกหลักทรัพย์ | รหัสผู้เกี่ยวข้อง (ผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลับหลัง/
 ผู้ค้ำประกัน/ผู้ส่งจ่าย) | เลขที่จดทะเบียนบริษัทของผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลับหลัง/
 ผู้ค้ำประกัน/ผู้ส่งจ่าย | ชื่อผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลับหลัง/ผู้ค้ำประกัน/ผู้ส่งจ่าย |
 รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลับหลัง/ผู้ค้ำประกัน |
 Rating ของผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลับหลัง/ผู้ค้ำประกัน | Collateral (Type of
 Guaranteed) | Claim Type | ราคาพาร์ปัจจุบัน | ชื่อนายทะเบียนหลักทรัพย์ |
 บริษัทผู้นำในการจัดจำหน่าย | ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ | ลักษณะการเสนอขายหลักทรัพย์ |
 วันที่ออกจำหน่าย/จดทะเบียน | วันที่ครบกำหนด | เวลาที่สร้างรายการ | เวลาที่แก้ไข
 รายการ

1.2 ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ของหลักทรัพย์ต่อไปนี้

- outstanding equity & others
- outstanding fixed income

รูปแบบของ field ข้อมูล :

Field name	Average Cost Value (Original Currency)
Description	ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)
Remark	รายงานต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ที่ราคาตลาด ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับ สกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขายซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน EQF หรือ FIF

1.3 มูลค่าหน้าตัวของหลักทรัพย์ในรูปสกุลเงินที่ลงทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ของหลักทรัพย์ต่อไปนี้

- outstanding structured notes
- outstanding credit derivatives & structured finance

รูปแบบของ field ข้อมูล กรณี outstanding structured notes :

Field name	Face Amount (Original Currency)
Description	มูลค่าหน้าตัว (ในรูปสกุลเงินที่ลงทุนไปลงทุนในต่างประเทศ)
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่มีการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)
Remark	รายงานมูลค่าหน้าตัวของหลักทรัพย์ ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินของ structured notes ซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน SNF

รูปแบบของ field ข้อมูล กรณี outstanding credit derivatives & structured finance :

Field name	Face Amount of Reference Asset (Original Currency)
Description	มูลค่า Reference Asset หรือ มูลค่าหน้าตัวของ CLN (ในรูปสกุลเงินที่ลงทุนไปลงทุนในต่างประเทศ)
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่มีการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)
Remark	รายงานมูลค่า Reference Asset หรือมูลค่าหน้าตัวของ CLN ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินของสัญญา credit derivatives ซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน CDF

1.4 มูลค่ายุติธรรมในรูปสกุลเงินที่ลงทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ของหลักทรัพย์ต่อไปนี้

- outstanding equity & others
- outstanding fixed income
- outstanding structured notes
- outstanding credit derivatives & structured finance

รูปแบบของ field ข้อมูล หนี้ outstanding equity & others และ fixed income :

Field name	Market Value (Original Currency)
Description	มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่มีการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)
Remark	รายงานมูลค่าค้างค้างของหลักทรัพย์ที่ราคาตลาด ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขายซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน EQF หรือ FIF

รูปแบบของ field ข้อมูล หนี้ outstanding structured notes :

Field name	Market Value (Original Currency)
Description	มูลค่าตามราคาตลาด (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่มีการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)
Remark	รายงานมูลค่าตามราคาตลาดของ structured notes ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินของ structured notes ซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน SNF

รูปแบบของ field ข้อมูล หนี้ outstanding credit derivatives & structured finance :

Field name	Market Value of Reference Asset (Original Currency)
Description	มูลค่าตามราคาตลาดของ Reference Asset หรือ CLN (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่มีการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)
Remark	รายงานมูลค่าตามราคาตลาดของ Reference Asset หรือ CLN ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินของสัญญา credit derivatives ซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน CDF

1.5 มูลค่า Notional Amount ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ของหลักทรัพย์ต่อไปนี้

- outstanding futures, forward
- outstanding swap
- outstanding option

รูปแบบของ field ข้อมูล :

Field name	Notional Amount (Original Currency)
Description	มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่มีการเข้าทำสัญญาตราสารอนุพันธ์ในต่างประเทศ)
Remark	รายงานมูลค่า notional ในรูปสกุลเงินที่นำไปลงทุนในต่างประเทศ

1.6 มูลค่า option value ต่อสัญญา ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding option

รูปแบบของ field ข้อมูล :

Field name	Option Value (Original Currency)
Description	Option value ต่อสัญญา ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (MTM) (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่มีการเข้าทำสัญญาตราสารอนุพันธ์ในต่างประเทศ)
Remark	รายงานมูลค่าของ option ในรูปสกุลเงินที่นำไปลงทุนในต่างประเทศ

1.7 มูลค่า option premium ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding option

รูปแบบของ field ข้อมูล :

Field name	Option Premium (Original Currency)
Description	มูลค่า Option premium (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่มีการเข้าทำสัญญาตราสารอนุพันธ์ในต่างประเทศ)
Remark	รายงานมูลค่าของ option premium ที่กองทุนได้รับในฐานะเป็นผู้ขาย (option writer) หรือที่กองทุนต้องจ่ายในฐานะเป็นผู้ซื้อ โดยอยู่ในรูปสกุลเงินที่นำไปลงทุนในต่างประเทศ

1.8 ผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ของหลักทรัพย์ต่อไปนี้

- outstanding futures, forward
- outstanding swap
- outstanding option
- outstanding structured notes
- outstanding credit derivatives & structured finance

รูปแบบของ field ข้อมูล :

Field name	Unrealized G/L (Original Currency)
Description	ผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์หรือการเข้าทำสัญญาตราสารอนุพันธ์ในต่างประเทศ)
Remark	<p>กรณี futures, forward, swap, option</p> <p>รายงานผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market สัญญาในรูปสกุลเงินที่นำไปลงทุนในต่างประเทศ</p> <p>กรณี structured notes</p> <p>รายงานผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินของ structured notes ซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน SNF</p> <p>กรณี credit derivatives & structured finance</p> <p>รายงานผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินของสัญญา credit derivatives ซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน CDF</p>

1.9 มูลค่าธุรกรรม ในรูปสกุลเงินที่กองทุนทำธุรกรรมในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 ส่วนของ outstanding ของธุรกรรมต่อไปนี้

- reverse repo
- repo
- security lending

รูปแบบของ field ข้อมูล :

Field name	Transaction Value (Original Currency)
Description	มูลค่าธุรกรรม (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ)
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการทำธุรกรรมในต่างประเทศ)
Remark	<p><u>กรณี reverse repo</u> รายงานมูลค่าซื้อตราสารแห่งหนึ่งร่วมกับผลประโยชน์ ที่พึงได้รับจนถึงวันที่คำนวณมูลค่าธุรกรรม</p> <p><u>กรณี repo</u> รายงานมูลค่าที่ผู้ยืมรวมดอกเบี้ยค้างจ่ายจนถึงวันที่คำนวณมูลค่าธุรกรรม</p> <p><u>กรณี security lending</u> รายงานมูลค่าของหลักทรัพย์ที่ให้ผู้ยืม ณ วันทำธุรกรรมรวมกับผลตอบแทนค้างรับจนถึงวันที่คำนวณมูลค่าธุรกรรม</p>

1.10 มูลค่าหลักประกัน ในรูปสกุลเงินที่กองทุนทำธุรกรรมในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 ส่วนของ outstanding ของธุรกรรมต่อไปนี้

- reverse repo
- repo
- security lending

รูปแบบของ field ข้อมูล :

Field name	Collateral Value (Original Currency)
Description	<p><u>กรณี reverse repo</u> มูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ)</p> <p><u>กรณี repo</u> มูลค่าหลักทรัพย์ที่เป็นประกัน (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ)</p> <p><u>กรณี security lending</u> มูลค่าหลักประกัน (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ)</p>
Format	Decimal(23,5)
Not null	Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการทำธุรกรรมในต่างประเทศ)

รูปแบบ text file ที่ปรับปรุง สำหรับข้อมูล outstanding ตามข้อ 1.2 – 1.10 :

ปรับปรุงเฉพาะส่วนของ data โดยมีรายละเอียด ดังนี้

(ก) ส่วนของ outstanding equity & others

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ชื่อย่อหลักทรัพย์ |
 รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | รหัสกลุ่มเศรษฐกิจผู้ออกหลักทรัพย์ | จำนวนหน่วย
 ยกมา (หน่วย) | มูลค่ายกมา (บาท) | จำนวนหน่วยซื้อหรือเพิ่ม (หน่วย) | มูลค่าซื้อ
 หรือเพิ่ม (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท) | จำนวนหน่วยขายหรือลด (หน่วย) |
 มูลค่าขายหรือลด (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท) | จำนวนหน่วยยกไป (หน่วย) |
 ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (บาท) | **ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงิน
 ที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)** | มูลค่ายุติธรรม (บาท) | **มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงิน
 ที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)**

(ข) ส่วนของ outstanding fixed income

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ชื่อย่อหลักทรัพย์ |
 รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | รหัสกลุ่มเศรษฐกิจผู้ออกหลักทรัพย์ | จำนวน
 หน่วยยกมา (หน่วย) | มูลค่ายกมา (บาท) | จำนวนหน่วยซื้อหรือเพิ่ม (หน่วย) | มูลค่าซื้อ
 หรือเพิ่ม (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท) | จำนวนหน่วยขายหรือลด (หน่วย) |
 มูลค่าขายหรือลด (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท) | จำนวนหน่วยยกไป (หน่วย) |
 ดอกเบี้ยค้างรับ (บาท) | ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (บาท) | **ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์
 (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)** | มูลค่ายุติธรรม (บาท) | **มูลค่ายุติธรรม
 (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)** | Yield to Maturity Per Year

(ค) ส่วนของ outstanding futures, forward

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ฐานะ | รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ
 (คู่สัญญา) | ชื่อย่อสัญญา | รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | วัตถุประสงค์
 การทำธุรกรรม | รายละเอียดการทำธุรกรรม | จำนวนสัญญา | ลักษณะการ hedge |
 ประเภทการ hedge | รายละเอียดประเภทการทำ hedging | ชื่อหลักทรัพย์ที่ได้รับ
 การป้องกันความเสี่ยง (hedged item) | มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท) |
มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) |
 มูลค่า hedged item ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท) | ผลกำไร/ขาดทุนจากการ
 mark to market สัญญา (นับจากวันเปิดสัญญา) (บาท) | **ผลกำไร/ขาดทุนจากการ**

**mark to market สัญญา (นับจากวันเปิดสัญญา) (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน
ในต่างประเทศ)**

(ง) ส่วนของ outstanding swap

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ชื่อสัญญา | รหัสประเภท
สินทรัพย์/หนี้สิน | รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา) | วัตถุประสงค์การทำธุรกรรม |
ลักษณะการ hedge | ประเภทการ hedge | รายละเอียดประเภทการทำ hedging |
ชื่อหลักทรัพย์ที่ได้รับการป้องกันความเสี่ยง (hedged item) | มูลค่า notional
ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท) | **มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (ในรูป
สกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)** | มูลค่า hedged item ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล
(บาท) | ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (บาท) | **ผลกำไร/ขาดทุน
จากการ mark to market สัญญา (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)**

(จ) ส่วนของ outstanding option

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ชื่อสัญญา | รหัสประเภท
สินทรัพย์/หนี้สิน | ฐานะ | รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา หรือ ตลาด) | วัตถุประสงค์
การทำธุรกรรม | ลักษณะการ hedge | ประเภทการ hedge | รายละเอียดประเภท
การทำ hedging | ชื่อหลักทรัพย์ที่ได้รับการป้องกันความเสี่ยง (hedged item) |
มูลค่า hedged item ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล(บาท) | มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวด
ของข้อมูล (บาท) | **มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (ในรูปสกุลเงิน
ที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)** | option value ต่อสัญญา ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (MTM)
(บาท) | Option value ต่อสัญญา ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (MTM) (ในรูปสกุลเงิน
ที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) | มูลค่า Option premium (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน
ในต่างประเทศ) | ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (บาท) |
**ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน
ในต่างประเทศ)**

(ฉ) ส่วนของ outstanding structured notes

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ชื่อตราสาร | รหัสประเภท
สินทรัพย์/หนี้สิน | รหัสกลุ่มเศรษฐกิจผู้ออกตราสาร (issuer) | มูลค่าหน้าตั๋ว (บาท) |
มูลค่าหน้าตั๋ว (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) | มูลค่าตามราคาตลาด (บาท) |

มูลค่าตามราคาตลาด (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) | ผลกำไร/ขาดทุน
จากการ mark to market (บาท) | ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market
(ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)

(ข) ส่วนของ outstanding credit derivatives & structured finance

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ชื่อย่อหลักทรัพย์/ชื่อย่อ
 สัญญา | รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | รหัสกลุ่มเศรษฐกิจคู่สัญญาหรือผู้ออก CLN |
 มูลค่า reference asset หรือ มูลค่าหน้าตัวของ CLN (บาท) | **มูลค่า reference asset หรือ**
มูลค่าหน้าตัวของ CLN (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) | มูลค่าตาม
 ราคาตลาดของ reference asset หรือ CLN (บาท) | **มูลค่าตามราคาตลาดของ**
reference asset หรือ CLN (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) | ผลกำไร/ขาดทุน
 จากการ mark to market สัญญา (บาท) | **ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market**
สัญญา (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)

(ค) ส่วนของ outstanding reverse repo

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ชื่อย่อสัญญา | รหัสประเภท
 ธุรกิจ / รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | รหัสประเทศของคู่สัญญา | ชื่อของคู่สัญญา |
 รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา) | ชื่อย่อหลักทรัพย์ที่ซื้อ โดยมีสัญญาขายคืน | รายละเอียด
 ของหลักทรัพย์ที่ซื้อ โดยมีสัญญาขายคืนเพิ่มเติม (ถ้ามี) | มูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อ โดยมี
 สัญญาขายคืน (บาท) | **มูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อ โดยมีสัญญาขายคืน (ในรูปสกุลเงิน**
ที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) | ดอกเบี้ยค้างรับ (บาท) | มูลค่าธุรกรรม (บาท) |
มูลค่าธุรกรรม (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) | รหัสสกุลเงินของการทำ
 ธุรกรรม | วันที่สัญญามีผล | วันที่ครบกำหนด

(ง) ส่วนของ outstanding repo

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ชื่อย่อสัญญา | รหัสประเภท
 ธุรกิจ / รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | รหัสประเทศของคู่สัญญา | ชื่อของคู่สัญญา |
 รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา) | ชื่อ / ชื่อย่อหลักประกัน | มูลค่าหลักทรัพย์ที่เป็น
 ประกัน (บาท) | **มูลค่าหลักทรัพย์ที่เป็นประกัน (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรม**
ในต่างประเทศ) | อัตราดอกเบี้ยจ่าย (ร้อยละ) | ดอกเบี้ยค้างจ่าย (บาท) | มูลค่าธุรกรรม
 (บาท) | **มูลค่าธุรกรรม (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) |** รหัสสกุลเงิน
 ของการทำธุรกรรม | วันที่สัญญามีผล | วันที่ครบกำหนด

(ญ) ส่วนของ outstanding security lending

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ชื่อสัญญา | รหัสประเภทธุรกรรม / รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | รหัสประเทศของคู่สัญญา | ชื่อของคู่สัญญา | รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของคู่สัญญา | Credit Rating ของคู่สัญญา (Counterparty) | รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา) | ชื่อย่อหลักทรัพย์ที่ให้ยืม | รหัสสกุลเงินของการทำธุรกรรม | มูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้ยืม (บาท) | รายละเอียดผลตอบแทนตามสัญญา | ผลตอบแทนค้างรับ (บาท) | มูลค่าธุรกรรม (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) | ชื่อย่อหลักทรัพย์ค้ำประกัน | รายละเอียดของหลักทรัพย์ค้ำประกันเพิ่มเติม (ถ้ามี) | มูลค่าหลักประกัน (บาท) | มูลค่าหลักประกัน (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) | วันที่สัญญามีผล | วันที่ครบกำหนด

2. เพิ่มรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน สำหรับการรายงานยอดคงค้าง excess cash และ margin
รายกองทุน ในรูปสกุลเงินที่ลงทุนในตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ ดังต่อไปนี้

- รหัส “963” : ยอดคงค้าง excess cash และ margin ในรูปสกุลเงินที่ลงทุนในอนุพันธ์ต่างประเทศ

รูปแบบ text file ที่รายงาน

ใช้ format การรายงานแบบเดียวกับกลุ่มข้อมูลการลงทุนในสินทรัพย์ / หนี้สินค้างรับ
 ค้างจ่าย มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ จำนวนหน่วยลงทุน และอื่น ๆ กล่าวคือ

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | รหัสประเภทสินทรัพย์/
 หนี้สิน | ยอดคงค้าง excess cash และ margin (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน
ในต่างประเทศ | รหัสสกุลเงิน

สรุปการปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนโดยเพิ่ม field ข้อมูล

ในแบบรายงานที่เกี่ยวข้อง

ประเภทหลักทรัพย์ ตราสารอนุพันธ์ และธุรกรรม	แบบรายงาน feature	แบบรายงาน outstanding
equity & others	เพิ่ม field รหัสประเทศของ ผู้ออกหลักทรัพย์	เพิ่ม field ต้นทุนเฉลี่ย และมูลค่า ยุติธรรมในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน
fixed income		
futures, forward	-	เพิ่ม field มูลค่า notional และ ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market และ มูลค่า option value และ option premium (เฉพาะกรณี option) ในรูป สกุลเงินที่ไปลงทุน
swap	-	
option	-	
structured notes	-	เพิ่ม field มูลค่าหน้าตัว มูลค่า ตามราคาตลาด และผลกำไร/ ขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน
credit derivatives & structured finance	-	
reverse repo, repo และ security lending	-	เพิ่ม field มูลค่าธุรกรรม และ มูลค่าหลักประกันในรูปสกุลเงิน ที่ทำธุรกรรม
ยอดคงค้าง excess cash และ margin	-	เพิ่มรหัสประเภทสินทรัพย์/ หนี้สิน เพื่อรองรับการรายงาน ยอดคงค้างดังกล่าว

ตัวอย่าง
การรายงาน

ในเดือน พ.ค. 62 บลจ. BCD (รหัสบริษัทจัดการ 0123456789) ซึ่งจัดการกองทุนรวม BCD International Allocation Fund (เลขที่จดทะเบียน MF4321/2562) มีการลงทุนในหลักทรัพย์ และตราสารอนุพันธ์ ดังนี้

- ลงทุนในหุ้น BB ซึ่งเป็นหลักทรัพย์ในต่างประเทศ
 - ออกโดยบริษัท BB Company ซึ่งประกอบธุรกิจหลักในประเทศจีน
 - ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฮ่องกง
 - เลขรหัสหลักทรัพย์สากล HK001
 - วันที่จดทะเบียน 19 พ.ย. 50
 - จำนวน 1,000 หุ้น

- มูลค่าซื้อ (รวมค่านายหน้าและ VAT) 4,000,600 บาท
- ต้นทุนเฉลี่ย 1,000,100 ดอลลาร์ฮ่องกง (4,000,600 บาท)
- มูลค่า ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน 1,001,000 ดอลลาร์ฮ่องกง (4,004,000 บาท)

2. ลงทุนในเงินฝากประจำธนาคาร CC ของประเทศจีน

- ชื่อหลักทรัพย์ FDCC001
- อันดับความน่าเชื่อถือของเงินฝากระยะสั้น A-1 (จัดอันดับโดย S&P)
- อันดับความน่าเชื่อถือของธนาคาร A (จัดอันดับโดย S&P)
- วันที่ฝากเงิน 15 พ.ค. 62
- วันที่ครบกำหนด 15 พ.ย. 62
- จำนวนที่ฝาก 1,780,000 บาท
- ต้นทุนเฉลี่ย 400,000 หยวน (1,780,000 บาท)
- ดอกเบี้ยค้างรับ ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน 450 บาท
- มูลค่า ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน 400,100 หยวน (1,772,000 บาท)

3. ทำสัญญา swap เพื่อป้องกันความเสี่ยงของค่าเงินหยวน

- ชื่อสัญญา SW001
- คู่สัญญา คือ ธนาคาร CC ของประเทศจีน
- วันที่ทำสัญญา 15 พ.ค. 62
- วันที่ครบกำหนดสัญญา 15 พ.ย. 62
- notional amount ณ ทำการสุดท้ายของเดือน 400,500 หยวน (1,774,000 บาท)
- มีผลกำไรนับแต่วันเข้าทำสัญญา 2,000 หยวน (8,900 บาท)

วิธีการรายงาน

1. การลงทุนในตราสารทุน ได้แก่ รายการลงทุนในหุ้น BB

ให้รายงานในแบบรายงาน EQF และ MF01 งวดเดือน พ.ค. 62 โดยมีรายละเอียด ดังนี้

(ก) แบบรายงาน EQF

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
ชื่อหลักทรัพย์	BB
เลขรหัสหลักทรัพย์สากล	HK001
รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน	101 (หุ้นสามัญ)
รหัสตลาด	101 (ตลาดต่างประเทศ)
ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์	BB Company

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
วันที่ออกจำหน่าย/จดทะเบียน	20071119
วันที่เพิกถอน/ครบกำหนด	-
รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์	CN
รหัสประเทศที่หลักทรัพย์เสนอขาย	HK
รหัสสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขาย	HKD
เวลาที่สร้างรายการ	20190616:183545
เวลาที่แก้ไขรายการ	-

(ข) แบบรายงาน OS_MF01 ในส่วนของ outstanding equity & others

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
เลขที่จดทะเบียนกองทุน	MF4321
ปีที่จดทะเบียนกองทุน	2562
นโยบายกองทุน PVD	-
ชื่อย่อหลักทรัพย์	BB
รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน	101 (หุ้นสามัญ)
รหัสกลุ่มเศรษฐกิจของผู้ออกหลักทรัพย์	170 (บริษัทและนิติบุคคล)
จำนวนหน่วยยกมา (หน่วย)	-
มูลค่ายกมา (บาท)	0
จำนวนหน่วยซื้อหรือเพิ่ม (หน่วย)	1,000
มูลค่าซื้อหรือเพิ่ม (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท)	4,000,600
จำนวนหน่วยขายหรือลด (หน่วย)	-
มูลค่าขายหรือลด (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท)	0
จำนวนหน่วยยกไป (หน่วย)	1,000
ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (บาท)	4,000,600
ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)	1,000,100
มูลค่ายุติธรรม (บาท)	4,004,000
มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)	1,001,000

2. การลงทุนในตราสารหนี้ ได้แก่ รายการลงทุนในเงินฝากประจำธนาคาร CC

ให้รายงานในแบบรายงาน FIF และ MF01 งวดเดือน พ.ค. 62 โดยมีรายละเอียดดังนี้

(ก) แบบรายงาน FIF

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
ชื่อหลักทรัพย์	FDCC001
เลขรหัสหลักทรัพย์สากล	-
รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน	218 (เงินฝากประจำ)
รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของหลักทรัพย์	03 (S&P)
Rating ของหลักทรัพย์	A-1
Bond Type	-
Secured/Unsecured	-
รหัสตลาด	100 (นอกตลาดต่างประเทศ)
ราคาหน้าตั๋วต่อหน่วย หรือ ราคา PAR (บาท)	-
ประเภทอัตราดอกเบี้ยหน้าตั๋ว	-
อัตราดอกเบี้ยหน้าตั๋ว (%)	-
ระยะเวลาการจ่ายดอกเบี้ย (Coupon Payment)	-
เลขที่จดทะเบียนบริษัทของ Issuer	-
ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์	CC Bank
รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์	CN
รหัสประเทศที่หลักทรัพย์เสนอขาย	CN
รหัสสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขาย	CNY
รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์	03 (S&P)
Rating ของผู้ออกหลักทรัพย์	A
รหัสผู้เกี่ยวข้อง (ผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลักหลัง/ผู้ค้ำประกัน/ผู้ส่งจ่าย)	00 (None)
เลขที่จดทะเบียนบริษัทของผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลักหลัง/ ผู้ค้ำประกัน/ผู้ส่งจ่าย	-
ชื่อผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลักหลัง/ผู้ค้ำประกัน/ผู้ส่งจ่าย	None
รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ ผู้สลักหลัง/ผู้ค้ำประกัน	00 (None)
Rating ของผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลักหลัง/ผู้ค้ำประกัน	None
Collateral (Type of Guaranteed)	-
Claim Type	-
ราคาพาร์ปัจจุบัน	-
ชื่อนายทะเบียนหลักทรัพย์	-
บริษัทผู้นำในการจัดจำหน่าย	-

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
ลักษณะการเสนอขายหลักทรัพย์	-
วันที่ออกจำหน่าย/จดทะเบียน	20190515 (วันที่ฝากเงิน)
วันที่ครบกำหนด	20191115
เวลาที่สร้างรายการ	20190616:183545
เวลาที่แก้ไขรายการ	-

(ข) แบบรายงาน OS_MF01 ในส่วนของ outstanding fixed income

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
เลขที่จดทะเบียนกองทุน	MF4321
ปีที่จดทะเบียนกองทุน	2562
นโยบายกองทุน PVD	-
ชื่อย่อหลักทรัพย์	FDCC001
รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน	218 (เงินฝากประจำ)
รหัสกลุ่มเศรษฐกิจของผู้ออกหลักทรัพย์	202 (สถาบันการเงินที่มี ถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ)
จำนวนหน่วยยกมา (หน่วย)	-
มูลค่ายกมา (บาท)	-
จำนวนหน่วยซื้อหรือเพิ่ม (หน่วย)	-
มูลค่าซื้อหรือเพิ่ม (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท)	1,780,000
จำนวนหน่วยขายหรือลด (หน่วย)	-
มูลค่าขายหรือลด (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท)	0
จำนวนหน่วยยกไป (หน่วย)	-
ดอกเบี้ยค้างรับ (บาท)	450
ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (บาท)	1,780,000
ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)	400,000
มูลค่ายุติธรรม (บาท)	1,772,000
มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)	400,100
Yield to Maturity Per Year	-

3. การทำสัญญา swap เงินหยวน

ให้รายงานในแบบรายงาน SWF และ MF01 งวดเดือน พ.ค. 62 โดยมีรายละเอียดดังนี้

(ก) แบบรายงาน SWF : ไม่มีการปรับปรุงเพิ่มเติม ให้รายงานตามปกติ

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
ชื่อย่อสัญญา	SW001
รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน	403 (สัญญาสวอป)
รหัสประเภทการทำ swap	12 (currency swap)
รายละเอียดประเภทธุรกรรม	-
ประเภทของ Reference Underlying ที่สัญญาใช้อ้างอิง	115 (foreign exchange rate)
รหัสสกุลเงินด้านรับของ notional amount	THB
รหัสสกุลเงินด้านจ่ายของ notional amount	CNY
กองทุนอยู่ในฐานะผู้จ่ายกระแสเงินสด	41 (อ้างอิงกับ foreign exchange rate)
รายละเอียดกระแสเงินสดจ่าย	-
กองทุนอยู่ในฐานะผู้รับกระแสเงินสด	61 (อ้างอิงกับ foreign exchange rate)
รายละเอียดกระแสเงินสดรับ	-
ความถี่ในการแลกเปลี่ยนกระแสเงินสด	-
รหัสตลาด	100 (นอกตลาดต่างประเทศ)
รหัสประเทศของคู่สัญญา	CN
ชื่อของคู่สัญญา	CC Bank
Credit Rating ของคู่สัญญา (Counterparty)	A
รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของคู่สัญญา	03 (S&P)
วันที่สัญญามีผล	20190515
วันที่ครบกำหนด	20191115
เวลาที่สร้างรายการ	20190616:183545
เวลาที่แก้ไขรายการ	-

(ข) แบบรายงาน OS_MF01 ในส่วนของ outstanding swap

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
เลขที่จดทะเบียนกองทุน	MF4321
ปีที่จดทะเบียนกองทุน	2562
นโยบายกองทุน PVD	-
ชื่อย่อสัญญา	SW001
รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน	403 (สัญญาสวอป)

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา)	202 (สถาบันการเงินที่มี ถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ)
วัตถุประสงค์การทำธุรกรรม	01 (hedging)
ลักษณะการ hedge	01 (full hedge)
ประเภทการ hedge	02 (same underlying hedge)
รายละเอียดประเภทการทำ hedging	-
ชื่อหลักทรัพย์ที่ได้รับการป้องกันความเสี่ยง (hedged item)	FDCC001
มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท)	1,774,000
มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน ในต่างประเทศ)	400,500 (สกุล CNY)
มูลค่า hedged item ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท)	1,772,000
ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (บาท)	8,900
ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (ในรูปสกุลเงิน ที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)	2,000 (สกุล CNY)

การรายงานในรูปแบบ text file จากข้อ 1 - 3

1. แบบรายงาน EQF

0123456789|EQF|20190531

BB|HK001|101|101|BB Company|20071119||CN|HK|HKD|20190616:183545|

2. แบบรายงาน FIF

0123456789|FIF|20190531

FDCC001||218|03|A-1||100||||CC Bank|CN|CN|CNY|03|A|00||None|00|None||||

20190515|20191115|20190616:183545|

3. แบบรายงาน SWF

0123456789|SWF|20190531

SW001|403|12||115|THB|CNY|41||61||100|CN|CC Bank|A|03|20190515|20191115|

20190616:183545|

4. แบบรายงาน OS_MF01

(เฉพาะในส่วน of outstanding equity & others fixed income และ swap)

0123456789|MF01|20190531

MF4321|2562||BB|101|170||0.00000|1000.00000|4000600.00000||0.00000|1000.00000|

	<p>4000600.00000 1000100.00000 4004000.00000 1001000.00000</p> <p>MF4321 2562 FDCC001 218 202 1780000.00000 0.00000 450.00000 1780000.00000 </p> <p>400000.00000 1772000.00000 400100.00000 </p> <p>MF4321 2562 SW001 403 202 01 01 02 FDCC001 1774000.00000 400500.00000 </p> <p>1772000.00000 8900.00000 2000.00000</p>
--	---

แบบสำรวจความคิดเห็น (เพิ่มเติม)

เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

ข้อมูลทั่วไป			
ชื่อผู้ตอบ		ตำแหน่ง	
ชื่อบริษัท			
โทรศัพท์		โทรสาร	
อีเมล			
สถานะของผู้ให้ข้อคิดเห็น (ตอบ ได้มากกว่า 1 ข้อ)			
<input type="checkbox"/> บริษัทจัดการ		<input type="checkbox"/> ตัวแทนขาย	
<input type="checkbox"/> ผู้ถือหน่วยลงทุน		<input type="checkbox"/> อื่น ๆ (ระบุ)	

กรุณาส่งแบบสำรวจความคิดเห็นกลับไปที่ ฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน
 สำนักงาน ก.ล.ต. 333/3 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900
 โทรสาร: 0-2263-6039, 0-2263-6511 หรือ e-mail: arthipha@sec.or.th

*** สำนักงานขอขอบคุณท่านที่ได้ให้ความร่วมมือในการแสดงความคิดเห็นในครั้งนี้ ***

field ข้อมูลที่เพิ่มเติม	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
11. มูลค่าธุรกรรม ในรูปสกุลเงินที่กองทุนทำธุรกรรมในต่างประเทศของธุรกรรมประเภท reverse repo, repo และ security lending	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม		
12. มูลค่าหลักประกัน ในรูปสกุลเงินที่กองทุนทำธุรกรรมในต่างประเทศของธุรกรรมประเภท reverse repo, repo และ security lending	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม		

field ข้อมูลที่เพิ่มเติม	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
13. ยอดคงค้าง excess cash และ margin รายการลงทุนในรูปสกุลเงินที่ลงทุนในอนุพันธ์ต่างประเทศ	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		