

เอกสารรับฟังความคิดเห็น

เลขที่ อนจ. 24/2562

เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

เผยแพร่เมื่อวันที่ 6 สิงหาคม 2562

สำนักงานได้จัดทำเอกสารฉบับนี้ขึ้นเพื่อรับฟังความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้อง

ท่านสามารถ download เอกสารเผยแพร่ฉบับนี้ได้จาก [www.sec.or.th](http://www.sec.or.th)

ท่านสามารถส่งความเห็นหรือข้อเสนอแนะให้สำนักงานได้

ตามที่ติดต่อด้านล่าง หรือ e-mail: [arthipha@sec.or.th](mailto:arthipha@sec.or.th)

วันสุดท้ายของการแสดงความคิดเห็น วันที่ 9 กันยายน 2562

ท่านสามารถติดต่อสอบถามข้อมูลเพิ่มเติมได้จากเจ้าหน้าที่ของสำนักงาน ดังนี้

นายอภิภัทร พูลถนอมสุข โทรศัพท์/โทรสาร 0-2263-6039

สำนักงานขอขอบคุณทุกท่านที่เข้าร่วมแสดงความคิดเห็น

และให้ข้อเสนอแนะ มา ณ โอกาสนี้

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

เลขที่ 333/3 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900

โทรศัพท์ 1207 หรือ 0-2033-9999 โทรสาร 0-2033-9660

## 1. ที่มา

ตามที่สำนักงานมีแนวทางที่จะปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ (“แบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุน”) โดยปรับปรุงในส่วนของคุณลักษณะการลงทุนและค่าความเสี่ยงของกองทุน เพื่อให้มีข้อมูลสำหรับการติดตามความเสี่ยงต่อระบบ (“systemic risk”) ของธุรกิจจัดการลงทุนได้อย่างทันต่อเหตุการณ์ ซึ่งสำนักงานได้จัดให้มีการรับฟังความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้องแล้ว นั้น

เนื่องด้วยที่ผ่านมามาตราการแห่งประเทศไทย (“ชปท.”) กำหนดให้ผู้ประกอบธุรกิจนำส่งข้อมูลการลงทุน ในต่างประเทศและตราสารอนุพันธ์ของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพเป็นรายเดือนเพื่อใช้ติดตามเสถียรภาพ ของตลาดเงินผ่านแบบรายงานการลงทุนในตราสารในต่างประเทศและอนุพันธ์ (“แบบรายงาน PIA”) และขณะเดียวกัน ผู้ประกอบธุรกิจก็ต้องนำส่งแบบรายงานพอร์ตการลงทุนที่รวมถึงสถานะการลงทุนในต่างประเทศและตราสารอนุพันธ์ ของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพต่อสำนักงานเป็นรายเดือนเช่นกัน ทำให้ผู้ประกอบธุรกิจเห็นว่าการนำส่งข้อมูล ดังกล่าวมีความซ้ำซ้อนและเป็นภาระ ชปท. จึงได้หารือร่วมกับสำนักงานเกี่ยวกับแนวทางในการปรับปรุงแบบรายงาน เพื่อลดภาระของผู้ประกอบธุรกิจโดยยังคงสามารถใช้ข้อมูลเพื่อการกำกับดูแลได้อย่างมีประสิทธิภาพ และเห็นชอบร่วมกัน ที่จะยกเลิกแบบรายงาน PIA ในส่วนของการลงทุนในต่างประเทศและตราสารอนุพันธ์ของกองทุนรวมและ กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ โดย ชปท. จะใช้ข้อมูลดังกล่าวจากแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนของสำนักงานแทน

อย่างไรก็ดี เมื่อสำนักงานและ ชปท. ได้พิจารณาร่วมกันเกี่ยวกับโครงสร้างของแบบรายงานแล้วพบว่า ยังมีข้อมูล บางประเภทในแบบรายงาน PIA ของ ชปท. ที่มีความแตกต่างจากข้อมูลในแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของสำนักงาน ดังนั้น สำนักงานจึงเห็นควรปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนเพิ่มเติม เพื่อให้มีข้อมูลที่ครบถ้วนเพียงพอ และทดแทนแบบรายงาน PIA ได้

ทั้งนี้ สำนักงานเห็นควรให้มีการรับฟังความคิดเห็นจากผู้ที่เกี่ยวข้องเกี่ยวกับรายละเอียดของการปรับปรุง แบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนเพิ่มเติม ก่อนดำเนินการปรับปรุงแบบรายงานต่อไป

## 2. เป้าหมายที่ต้องการบรรลุ

เพื่อลดความซ้ำซ้อนและภาระของผู้ประกอบธุรกิจในการรายงานข้อมูลสถานะการลงทุนในต่างประเทศและ ตราสารอนุพันธ์ของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ขณะที่สำนักงานและ ชปท. ยังคงมีข้อมูลที่ครบถ้วนเพียงพอ ต่อการกำกับดูแล

### 3. รายละเอียดการปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนเพิ่มเติม

สำนักงานเห็นควรมีการปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนเพิ่มเติมเพื่อปิดข้อแตกต่าง (gap) ระหว่างแบบรายงาน PIA กับแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมด้วยการเพิ่มเติมข้อมูลที่สำคัญจากแบบรายงานของ ธปท. ดังนี้

#### 3.1 ข้อแตกต่างที่สำคัญระหว่างแบบรายงานของ ธปท. และแบบรายงานของสำนักงาน ในส่วนของการลงทุนในต่างประเทศและตราสารอนุพันธ์ของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

ชุดข้อมูล	แบบรายงานของ ธปท. (แบบรายงาน PIA)	แบบรายงานของสำนักงาน (แบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุน)
ประเทศที่กองทุนไปลงทุน	ประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์	ประเทศที่หลักทรัพย์เสนอขาย
มูลค่าการลงทุนในหลักทรัพย์หรือตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ	อยู่ในรูปสกุลเงินต่างประเทศของตราสารหรืออนุพันธ์ที่ลงทุน	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

- ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ 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
- ผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน สำหรับตราสารอนุพันธ์ structured notes และ credit derivatives & structured finance

ทั้งนี้ เมื่อ ธปท. ยกเลิกแบบรายงาน PIA ในส่วนของการลงทุนในต่างประเทศและตราสารอนุพันธ์ของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพแล้ว ให้ผู้ประกอบการรายงานชุดข้อมูลที่มาจกแบบรายงาน PIA ในแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนของสำนักงาน โดยมีรายละเอียดดังนี้ (ข้อมูลที่ปรับปรุงแสดงด้วยตัวอักษรตัวหนา (bold) สีแดง)

ชุดข้อมูลที่มาจกแบบรายงาน 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	<b>กำหนด field ขึ้นใหม่</b> <b>ในกรณี equity &amp; others และ fixed income feature :</b> <b>ให้ระบุรหัสประเทศเพิ่มเติมใน field “รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์”</b> 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” 3. กรณี swap feature : ให้ระบุรหัสสกุลเงินใน field “รหัสสกุลเงินด้านรับของ notional amount” และ field “รหัสสกุลเงินด้านจ่ายของ notional amount” 4. กรณี option feature : ให้ระบุรหัสสกุลเงินใน field “รหัสสกุลเงินของ notional amount”

ชุดข้อมูลที่มาจกแบบรายงาน PIA	การรายงานในแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุน หลังจากที่ ธปท. ยกเลิกแบบรายงาน PIA
	<p>5. <u>กรณี structured note feature</u> :</p> <p>ให้ระบุรหัสสกุลเงินใน field “รหัสสกุลเงินของ structured notes”</p> <p>6. <u>กรณี credit derivatives &amp; structured finance feature</u> :</p> <p>ให้ระบุรหัสสกุลเงินใน field “รหัสสกุลเงินของสัญญา credit derivatives”</p>
<p>ยอดคงค้างการลงทุน (ไม่รวมตราสารอนุพันธ์)</p>	<p><b><u>กำหนด field ขึ้นใหม่</u></b></p> <p><b>1. <u>กรณี outstanding equity &amp; others และ outstanding fixed income</u> :</b></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><b>2. <u>กรณี outstanding ของ structured notes ต่างประเทศ</u></b></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> <p>(ค) <u>unrealized gain / loss ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน</u> ให้ระบุใน field “ผลกำไร / ขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน”</p>

ชุดข้อมูลที่มาจกแบบรายงาน PIA	การรายงานในแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุน หลังจากที่ ธปท. ยกเลิกแบบรายงาน PIA
	<p><b>3. กรณี outstanding ของ credit derivatives &amp; structured finance</b></p> <p>(ก) มูลค่า reference asset หรือ มูลค่าหน้าตัวของ CLN ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน ให้ระบุใน field “มูลค่า reference asset หรือ มูลค่าหน้าตัวของ CLN ในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน”</p> <p>(ข) มูลค่าตามราคาตลาดของ reference asset หรือ CLN ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน ให้ระบุใน field “มูลค่าตามราคาตลาดของ reference asset หรือ CLN ในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน”</p> <p>(ค) unrealized gain / loss ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน ให้ระบุใน field “ผลกำไร / ขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินของหลักทรัพย์ที่ไปลงทุน”</p>
ยอดคงค้างตราสารอนุพันธ์	<p><b>กำหนด field ขึ้นใหม่</b> ในกรณี outstanding ของ futures, forward, swap, option</p> <p>(ก) notional amount ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน ให้ระบุใน field “มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดข้อมูลในรูปสกุลเงินของตราสารอนุพันธ์ที่ไปลงทุน”</p> <p>(ข) unrealized gain / loss ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน ให้ระบุใน field “ผลกำไร / ขาดทุนจากการ mark to market สัญญาในรูปสกุลเงินของตราสารอนุพันธ์ที่ไปลงทุน”</p>

### 3.2 รายละเอียดการปรับปรุงแบบรายงานของสำนักงาน

วัตถุประสงค์	เพื่อรองรับการรายงานข้อมูลที่มาจกแบบรายงาน PIA ภายหลังจากที่ ธปท. ยกเลิกแบบรายงาน PIA ในส่วนของการลงทุนในต่างประเทศและตราสารอนุพันธ์ของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
ผู้เกี่ยวข้อง	บริษัทที่จัดการกองทุนรวมและบริษัทที่จัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

ขอบเขต	<p>1. กองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ</p> <p>2. ประเภทหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์ ได้แก่</p> <p>(1) ตราสารทุน</p> <p>(2) ตราสารหนี้</p> <p>(3) ตราสารอนุพันธ์ ได้แก่ forward, futures, swap และ option</p> <p>(4) structured notes</p> <p>(5) credit derivatives และ structured finance</p> <p>(6) หลักทรัพย์อื่น ๆ ที่มิใช่ตราสารอนุพันธ์ เช่น หน่วยลงทุน เป็นต้น</p>												
แบบรายงาน	<p>พอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพซึ่งประกอบด้วย</p> <p>1. feature ตราสาร ได้แก่</p> <p>(1) equity &amp; others feature (แบบรายงาน EQF)</p> <p>(2) fixed income feature (แบบรายงาน FIF)</p> <p>2. outstanding ตราสาร</p> <p>(1) กองทุนรวม (แบบรายงาน OS_MF01)</p> <p>(2) กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ (แบบรายงาน OS_PVD01)</p>												
ระบบงาน	ระบบ OFAR												
การปรับปรุง	เพิ่ม field เพื่อรองรับการรายงาน												
ความถี่	รายเดือน												
รายละเอียด	<p>เพิ่ม field ข้อมูลในแบบรายงาน ต่อไปนี้</p> <p><b>1. รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์</b></p> <p><b>แบบรายงานที่ปรับปรุง :</b> แบบรายงาน EQF และ FIF</p> <p><b>รูปแบบของ field ข้อมูล :</b></p> <table border="1" data-bbox="443 1675 1465 2047"> <tr> <td><b>Field name</b></td> <td>Issuer Country Code</td> </tr> <tr> <td><b>Description</b></td> <td>รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์</td> </tr> <tr> <td><b>Format</b></td> <td>varchar(2)</td> </tr> <tr> <td><b>Not null</b></td> <td>Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)</td> </tr> <tr> <td><b>Possible Value</b></td> <td>ชุด code ที่สำนักงานกำหนด (Country code สากล)</td> </tr> <tr> <td><b>Remark</b></td> <td>พิจารณาจากการที่ผู้ออกหลักทรัพย์จดทะเบียนประกอบธุรกิจหลักในประเทศนั้น หรือมี head office อยู่ที่ประเทศนั้น</td> </tr> </table>	<b>Field name</b>	Issuer Country Code	<b>Description</b>	รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์	<b>Format</b>	varchar(2)	<b>Not null</b>	Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)	<b>Possible Value</b>	ชุด code ที่สำนักงานกำหนด (Country code สากล)	<b>Remark</b>	พิจารณาจากการที่ผู้ออกหลักทรัพย์จดทะเบียนประกอบธุรกิจหลักในประเทศนั้น หรือมี head office อยู่ที่ประเทศนั้น
<b>Field name</b>	Issuer Country Code												
<b>Description</b>	รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์												
<b>Format</b>	varchar(2)												
<b>Not null</b>	Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)												
<b>Possible Value</b>	ชุด code ที่สำนักงานกำหนด (Country code สากล)												
<b>Remark</b>	พิจารณาจากการที่ผู้ออกหลักทรัพย์จดทะเบียนประกอบธุรกิจหลักในประเทศนั้น หรือมี head office อยู่ที่ประเทศนั้น												

**รูปแบบ text file ที่ปรับปรุง :** ปรับปรุงเฉพาะส่วนของ data โดยมีรายละเอียด ดังนี้

**(ก) แบบรายงาน EQF**

ชื่อหลักทรัพย์ (issue name) | เลขรหัสหลักทรัพย์สากล | รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | รหัสตลาด | ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ | วันที่ออกจำหน่าย/จดทะเบียน | วันที่เพิกถอน/ครบกำหนด | **รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์** | รหัสประเทศที่หลักทรัพย์เสนอขาย | รหัสสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขาย | เวลาที่สร้างรายการ | เวลาที่แก้ไขรายการ

**(ข) แบบรายงาน FIF**

ชื่อหลักทรัพย์ (issue name) | เลขรหัสหลักทรัพย์สากล | รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของหลักทรัพย์ | Rating ของหลักทรัพย์ | Bond Type | Secured/Unsecured | รหัสตลาด | ราคาหน้าตั๋วต่อหน่วย หรือราคา PAR (บาท) | ประเภทอัตราดอกเบี้ยหน้าตั๋ว | อัตราดอกเบี้ยหน้าตั๋ว (%) | ระยะเวลาการจ่ายดอกเบี้ย (Coupon Payment) | เลขที่จดทะเบียนบริษัทของ Issuer | ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ | **รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์** | รหัสประเทศที่หลักทรัพย์เสนอขาย | รหัสสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขาย | รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์ | Rating ของผู้ออกหลักทรัพย์ | รหัสผู้เกี่ยวข้อง (ผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลับหลัง/ผู้ค้ำประกัน/ผู้ตั้งจ่าย) | เลขที่จดทะเบียนบริษัทของผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลับหลัง/ผู้ค้ำประกัน/ผู้ตั้งจ่าย | ชื่อผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลับหลัง/ผู้ค้ำประกัน/ผู้ตั้งจ่าย | รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลับหลัง/ผู้ค้ำประกัน | Rating ของผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลับหลัง/ผู้ค้ำประกัน | Collateral (Type of Guaranteed) | Claim Type | ราคาพาร์ปัจจุบัน | ชื่อนายทะเบียนหลักทรัพย์ | บริษัทผู้นำในการจัดจำหน่าย | ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ | ลักษณะการเสนอขายหลักทรัพย์ | วันที่ออกจำหน่าย/จดทะเบียน | วันที่ครบกำหนด | เวลาที่สร้างรายการ | เวลาที่แก้ไขรายการ

**2. ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ**

**แบบรายงานที่ปรับปรุง :**

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ของหลักทรัพย์ต่อไปนี้

- outstanding equity & others
- outstanding fixed income



**รูปแบบของ field ข้อมูล :**

<b>Field name</b>	Average Cost Value (Original Currency)
<b>Description</b>	ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)
<b>Format</b>	Decimal(23,5)
<b>Not null</b>	Yes (เฉพาะกรณีที่มีการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ)
<b>Remark</b>	รายงานต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ที่ราคาตลาด ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขายซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน EQF หรือ FIF

**3. มูลค่าหน้าตัวของหลักทรัพย์ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ**

**แบบรายงานที่ปรับปรุง :**

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ของหลักทรัพย์ต่อไปนี้

- outstanding structured notes
- outstanding credit derivatives & structured finance

**รูปแบบของ field ข้อมูล กรณี outstanding structured notes :**

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

**รูปแบบของ field ข้อมูล กรณี outstanding credit derivatives & structured finance :**

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

#### 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 กรณี outstanding equity & others และ fixed income :

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

##### รูปแบบของ field ข้อมูล กรณี outstanding structured notes :

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

##### รูปแบบของ field ข้อมูล กรณี outstanding credit derivatives & structured finance :

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

### 5. มูลค่า Notional Amount ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

#### แบบรายงานที่ปรับปรุง :

แบบรายงาน MF01 และ PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ของหลักทรัพย์ต่อไปนี้

- outstanding futures, forward
- outstanding swap
- outstanding option

#### รูปแบบของ field ข้อมูล :

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

### 6. 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 :

<b>Field name</b>	Unrealized G/L (Original Currency)
<b>Description</b>	ผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)
<b>Format</b>	Decimal(23,5)
<b>Not null</b>	Yes (เฉพาะกรณีที่มีการลงทุนในหลักทรัพย์หรือการเข้าทำสัญญาตราสารอนุพันธ์ในต่างประเทศ)

**รูปแบบของ field ข้อมูล (ต่อ) :**

<b>Remark</b>	<p>กรณี <u>futures, forward, swap, option</u>          รายงานผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market สัญญาในรูปสกุลเงิน          ที่นำไปลงทุนในต่างประเทศ</p> <p>กรณี <u>structured notes</u>          รายงานผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับ          สกุลเงินของ structured notes ซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน SNF</p> <p>กรณี <u>credit derivatives &amp; structured finance</u>          รายงานผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับ          สกุลเงินของสัญญา credit derivatives ซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน CDF</p>
---------------	---

**รูปแบบ text file ที่ปรับปรุง สำหรับข้อมูล outstanding ตามข้อ 2 - 6 :**

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) | ชื่อคู่สัญญา | รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | วัตถุประสงค์การทำธุรกรรม | รายละเอียดการทำธุรกรรม | จำนวนสัญญา | ลักษณะการ hedge | ประเภทการ hedge | รายละเอียดประเภทการทำ hedging | ชื่อหลักทรัพย์ที่ได้รับการป้องกันความเสี่ยง (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) (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)**

(ง) ส่วนของ outstanding swap

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ชื่อคู่สัญญา | รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา) | วัตถุประสงค์การทำธุรกรรม | ลักษณะการ hedge | ประเภทการ hedge | รายละเอียดประเภทการทำ hedging | ชื่อหลักทรัพย์ที่ได้รับการป้องกันความเสี่ยง (hedged item) | มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท) | **มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)** | มูลค่า hedged item ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท) | ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (บาท) | **ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)**

(จ) ส่วนของ outstanding option

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | ชื่อคู่สัญญา | รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | ฐานะ | รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา หรือ ตลาด) | วัตถุประสงค์การทำธุรกรรม | ลักษณะการ hedge | ประเภทการ hedge | รายละเอียดประเภทการทำ hedging | ชื่อหลักทรัพย์ที่ได้รับการป้องกันความเสี่ยง (hedged item) | มูลค่า hedged item ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล(บาท) | มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท) | **มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)** | option value ต่อสัญญา ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (MTM)

	<p>(บาท)   ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (บาท)   <b>ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b></p> <p>(ค) ส่วนของ outstanding structured notes</p> <p>เลขที่จดทะเบียน   ปีที่จดทะเบียน   นโยบายกองทุน PVD   ชื่อตราสาร   รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน   รหัสกลุ่มเศรษฐกิจผู้ออกตราสาร (issuer)   มูลค่าหน้าตั๋ว (บาท)   <b>มูลค่าหน้าตั๋ว (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b>   มูลค่าตามราคาตลาด (บาท)   <b>มูลค่าตามราคาตลาด (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b>   ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market (บาท)   <b>ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b></p> <p>(ข) ส่วนของ outstanding credit derivatives &amp; structured finance</p> <p>เลขที่จดทะเบียน   ปีที่จดทะเบียน   นโยบายกองทุน PVD   ชื่อย่อหลักทรัพย์/ชื่อย่อสัญญา   รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน   รหัสกลุ่มเศรษฐกิจคู่สัญญาหรือผู้ออก CLN   มูลค่า reference asset หรือ มูลค่าหน้าตั๋วของ CLN (บาท)   <b>มูลค่า reference asset หรือมูลค่าหน้าตั๋วของ CLN (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b>   มูลค่าตามราคาตลาดของ reference asset หรือ CLN (บาท)   <b>มูลค่าตามราคาตลาดของ reference asset หรือ CLN (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b>   ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (บาท)   <b>ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b></p>
--	--

**สรุปการปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนโดยเพิ่ม field ข้อมูล**

**ในแบบรายงานที่เกี่ยวข้อง**

ประเภทหลักทรัพย์ และตราสารอนุพันธ์	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 ในรูปสกุลเงิน ที่ไปลงทุน
swap	-	
option	-	
structured notes	-	เพิ่ม field มูลค่าหน้าตั๋ว มูลค่า ตามราคาตลาด และผลกำไร/ ขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน
credit derivatives & structured finance	-	

ตัวอย่าง

การรายงาน

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

1. 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 วันทำการสุดท้ายของเดือน 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
วันที่ออกจำหน่าย/จดทะเบียน	20071119
วันที่เพิกถอน/ครบกำหนด	-
<b>รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์</b>	<b>CN</b>
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
รหัสประเภทหลักทรัพย์/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
<b>ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b>	<b>1,000,100</b>
มูลค่ายุติธรรม (บาท)	4,004,000
<b>มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b>	<b>1,001,000</b>

**2. การลงทุนในตราสารหนี้ ได้แก่ รายการลงทุนในเงินฝากประจำธนาคาร CC**

ให้รายงานในแบบรายงาน FIF และ MF01 งวดเดือน พ.ค. 62 โดยมีรายละเอียดดังนี้

**(ก) แบบรายงาน FIF**

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
ชื่อหลักทรัพย์	FDCC001
เลขรหัสหลักทรัพย์สากล	-
รหัสประเภทหลักทรัพย์/หนี้สิน	218 (เงินฝากประจำ)
รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของหลักทรัพย์	03 (S&P)
Rating ของหลักทรัพย์	A-1
Bond Type	-
Secured/Unsecured	-
รหัสตลาด	100 (นอกตลาดต่างประเทศ)
ราคาหน้าตั๋วต่อหน่วย หรือ ราคา PAR (บาท)	-
ประเภทอัตราดอกเบี้ยหน้าตั๋ว	-

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
อัตราดอกเบี้ยหน้าตัว (%)	-
ระยะเวลาการจ่ายดอกเบี้ย (Coupon Payment)	-
เลขที่จดทะเบียนบริษัทของ Issuer	-
ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์	CC Bank
<b>รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์</b>	<b>CN</b>
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	-
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้	-
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

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน	218 (เงินฝากประจำ)
รหัสกลุ่มเศรษฐกิจของผู้ออกหลักทรัพย์	202 (สถาบันการเงินที่มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ)
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
<b>ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b>	<b>400,000</b>
มูลค่ายุติธรรม (บาท)	1,772,000
<b>มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b>	<b>400,100</b>
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)

field ข้อมูล	รายละเอียดที่รายงาน
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)
รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา)	202 (สถาบันการเงินที่มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ)
วัตถุประสงค์การทำธุรกรรม	01 (hedging)
ลักษณะการ hedge	01 (full hedge)
ประเภทการ hedge	02 (same underlying hedge)
รายละเอียดประเภทการทำ hedging	-
ชื่อหลักทรัพย์ที่ได้รับการป้องกันความเสี่ยง (hedged item)	FDCC001
มูลค่า notional ณ วันสิ้นสุดของข้อมูล (บาท)	1,774,000
<b>มูลค่า notional ณ วันสิ้นสุดของข้อมูล (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b>	<b>400,500 (สกุล CNY)</b>
มูลค่า hedged item ณ วันสิ้นสุดของข้อมูล (บาท)	1,772,000
ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (บาท)	8,900
<b>ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</b>	<b>2,000 (สกุล CNY)</b>

**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**

(เฉพาะในส่วนของ 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|  
 4000600.00000|**1000100.00000**|4004000.00000|**1001000.00000**  
 MF4321|2562||FDCC001|218|202|||1780000.00000||0.00000||450.00000|1780000.00000|  
**400000.00000**|1772000.00000|**400100.00000**|  
 MF4321|2562||SW001|403|202|01|01|02||FDCC001|1774000.00000|**400500.00000**|  
 1772000.00000|8900.00000|**2000.00000**

#### 4. การมีผลใช้บังคับ

สำนักงานกำหนดให้ผู้ประกอบธุรกิจจัดทำและนำเสนอแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพตามการปรับปรุงในครั้งนี้ไปพร้อมกับ (1) ส่วนที่ปรับปรุงเพื่อรองรับข้อมูลการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องของกองทุนรวมซึ่งจะเปิดให้มีการรับฟังความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้องในระยะเวลาเดียวกันกับการรับฟังความคิดเห็นในครั้งนี้ และ (2) ข้อมูลฐานะการลงทุนและค่าความเสี่ยงของกองทุนซึ่งสำนักงานได้เปิดรับฟังความคิดเห็นแล้วเสร็จ<sup>1</sup> โดยทั้งหมดให้มีผลใช้บังคับภายในไตรมาส 4 ของปี 2562

---

<sup>1</sup> เอกสารรับฟังความคิดเห็น เลขที่ อนุจ. 42/2561 เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานกองทุน เผยแพร่เมื่อวันที่ 18 ตุลาคม 2561

## แบบสำรวจความคิดเห็น

เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

ข้อมูลทั่วไป			
ชื่อผู้ตอบ		ตำแหน่ง	
ชื่อบริษัท			
โทรศัพท์		โทรสาร	
อีเมล			
สถานะของผู้ให้ข้อคิดเห็น (ตอบได้มากกว่า 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](mailto:arthipha@sec.or.th)

\*\*\* สำนักงานขอขอบคุณท่านที่ได้ให้ความร่วมมือในการแสดงความคิดเห็นในครั้งนี้ \*\*\*

## แบบสำรวจความคิดเห็น

ท่านเห็นด้วยหรือไม่กับที่สำนักงานปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ดังนี้

field ข้อมูลที่เพิ่มเติม	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
<b>1. รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์</b>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		
<b>2. ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ</b>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		
<b>3. มูลค่าหน้าตัว*ของหลักทรัพย์ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ</b>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		



field ข้อมูลที่เพิ่มเติม	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
<b>4. มูลค่ายุติธรรมในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ</b>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		
<b>5. มูลค่า Notional Amount ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ</b>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		
<b>6. ผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ</b>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		

field ข้อมูลที่เพิ่มเติม	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
7. การมีผลใช้บังคับ	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		
8. ข้อเสนอแนะอื่น ๆ		
<hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		