

ภาคผนวก ข.

ตัวอย่างแบบรายงานต่างๆ

รายงานการขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินเพื่อบริษัทจัดการ
ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ณ วันที่

ประเภทหลักทรัพย์	ชื่อตลาดที่ซื้อขายหลักทรัพย์	ชื่อหลักทรัพย์	ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์	วันที่ซื้อ	จำนวนหน่วยที่ซื้อ (หน่วย)	มูลค่าที่ซื้อ (บาท)	วันที่ออก	วันที่ครบกำหนด	วันที่ขาย	จำนวนหน่วยที่ขาย (หน่วย)	มูลค่าที่ขายได้ (บาท)	สถานะที่ขายกรณีถือไม่เกิน 1 ปีขายก่อนกำหนด
	1. NO MARKET 2. SET 3. MAI 4. BEX 5. TFEX 6. THAIBMA 7. INTERNATIONAL MARKET 8. OTHERS											

หมายเหตุ : ให้รายงานให้สำนักงานทราบดีภายใน 5 วันทำการนับจากวันที่ขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

- สำหรับตลาดที่มีอายุต่ำกว่า 1 ปี และบริษัทขายก่อนครบอายุ บริษัทจะต้องกรอกให้ครบทุกรายการ
- สำหรับหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินที่บริษัทถือไม่เกิน 1 ปี บริษัทจะต้องกรอกให้ครบทุกรายการ เช่นวันที่ครบกำหนด ให้กรอกเฉพาะกรณีเป็นตลาดที่มีอายุของตลาด
- ชื่อตลาดที่ซื้อขายหลักทรัพย์ให้ระบุตามที่กำหนดให้
- หลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาด ให้กรอกชื่อหลักทรัพย์โดยตรงกับชื่อหลักทรัพย์ในตลาดดังกล่าว โดยถ้าเป็นหลักทรัพย์ใน THAIBMA ให้ใช้ Issue

รายงานการจำหน่ายหน่วยลงทุนของกองทุนเปิดภายใต้การจัดการของต้นที่ลงทุนเพื่อบริษัทจัดการ

ของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ณ วันที่

ชื่อกองทุน (ภาษาไทย)	วันที่ซื้อ	จำนวนหน่วยที่ซื้อ (หน่วย)	มูลค่าที่ซื้อ (บาท)	สาเหตุที่ซื้อ	วันที่ขาย	จำนวนหน่วยที่ขาย (หน่วย)	มูลค่าที่ขายได้ (บาท)

หมายเหตุ : ให้รายงานให้สำนักงานทราบเป็นเอกสารภายในวันทำการถัดจากวันที่จำหน่าย และกรอกสาเหตุที่ซื้อทุกรายการ

รูปแบบเพิ่มข้อความ AMC03.TXT ข้อมูลการลงทุนของบริษัทจัดการ

Header

Description (AMC03.TXT)	Length
รหัสบริษัทจัดการ	char(3)
001 บลจ.กรุงไทย จำกัด (มหาชน)	
002 บลจ.กสิกรไทย จำกัด	
003 บลจ.เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)	
004 บลจ.ทหารไทย จำกัด	
005 บลจ.ทิสโก้ จำกัด	
006 บลจ.ไทยพาณิชย์ จำกัด	
007 บลจ.ธนาชาติ จำกัด	
008 บลจ.อเบอร์ดีน จำกัด	
009 บลจ.บัวหลวง จำกัด	
010 บลจ.ยูโอบี (ไทย) จำกัด	
011 บลจ.พรีมาเวสต์ จำกัด	
012 บลจ.ววรรณ จำกัด	
013 บลจ.อยุธยาเจเอฟ จำกัด	
014 บลจ.ไอเอ็นจี (ประเทศไทย) จำกัด	
030 บลจ.ซีมิโก้ ไนท์ ฟินด์ แมเนจเม้นท์ จำกัด	
032 บลจ.นครหลวงไทย จำกัด	
033 บลจ.แอสเซท พลัส จำกัด	
034 บลจ.ฟินันซ่า จำกัด	
035 บลจ.บีที จำกัด	
036 บลจ.เอสซีบี ควอนท์ จำกัด	
รหัสบริษัทย่อยหรือบริษัทร่วม	char(3)
038 บริษัท เอ็ม เอฟ โฮลดิ้งส์ จำกัด	
039 ASIAN INVESTMENT TRUST	
วันที่รายงาน (วันที่ทำการสุดท้ายของเดือน)	char(2)
เดือนที่รายงาน	char(2)
ปีที่รายงาน (ปี ค.ศ.)	char(4)
ประเภทรายงาน	char(1)
D ข้อมูลประจำวัน	
M ข้อมูลประจำเดือน	
Y ข้อมูลประจำปี	

Data

Description (AMC03.TXT)	Length
รหัสประเภทการลงทุนย่อย	char(3)
101 หุ้นสามัญ	
102 หุ้นบุริมสิทธิ	
103 หุ้นกู้	
108 หน่วยลงทุนของกองทุนตราสารทุน	
109 หน่วยลงทุนของกองทุนตราสารหนี้	
110 ไบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนตราสารหนี้	
111 ไบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนตราสารทุน	

Description (AMC03.TXT)	Length
112 ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น	
113 ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้	
114 ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	
115 ใบแสดงสิทธิในการซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้ (Transferable Subscription Rights)	
116 ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงที่เป็นตราสารแห่งทุน	
117 หน่วยลงทุนของกองทุนรวมแบบผสม	
118 หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์	
119 หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์เพื่อแก้ไขปัญหาในระบบสถาบันการเงิน	
120 หน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อแก้ไขปัญหาในระบบสถาบันการเงิน	
121 หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์และสิทธิเรียกร้อง	
122 ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ประเภทตราสารแห่งทุน	
123 ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ประเภทตราสารแห่งหนี้	
124 ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนผสม	
129 ใบสำคัญแสดงสิทธิ/ใบแสดงสิทธิที่จะซื้อหลักทรัพย์ประเภทอื่นๆ	
139 หน่วยลงทุนของกองทุนแบบอื่นๆ	
199 เงินลงทุนในหลักทรัพย์อื่นๆ	
201 เงินฝากธนาคาร	
202 บัตรเงินฝาก	
203 ตั๋วสัญญาใช้เงิน	
204 ตั๋วแลกเงิน	
205 ตั๋วเงินคลัง (Treasury Bill)	
206 พันธบัตรรัฐบาล (Government Bond)	
207 พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ (State Owned Enterprise Bond)	
209 พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	
210 พันธบัตรหรือตราสารหนี้ที่ FIDF เป็นผู้ออก ผู้รับรอง ผู้อ่าวล ผู้ค้ำประกัน	
211 ธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (REVERSE REPO)	
212 พันธบัตรนิติบุคคลที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น	
213 พันธบัตรต่างประเทศ (Foreign Bonds)	
214 ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ประเภทอื่น	
299 ประเภทสินทรัพย์สภาพคล่องอื่นๆ	
301 อสังหาริมทรัพย์	
302 สิทธิการเช่าอสังหาริมทรัพย์	
303 สิทธิเรียกร้องที่มีอสังหาริมทรัพย์เป็นหลักประกัน	
304 สิทธิเรียกร้องที่เกิดจากการประกอบธุรกิจของสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งหรือที่จดทะเบียนจัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทย	
401 สัญญาฟิวเจอร์	
402 สัญญาฟอร์เวิร์ด	
403 สัญญาสวอป	
404 ออปชั่น	
405 ตราสารหนี้ที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Notes)	
406 สัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives)	
499 ประเภทหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นใดตามที่สำนักงานกำหนด	
615 ธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืน (REPO)	

Data

Description (AMC03.TXT)	Length
616 อุดหนุนการกู้ยืมเงิน	
906 มูลค่าเงินลงทุนรวม	
รหัสตลาดที่ซื้อขายหลักทรัพย์	char(3)
000 NO MARKET	
001 SET	
003 THAIBMA	
005 BEX	
006 TFEX	
008 MAI	
100 INTERNATIONAL MARKET	
999 OTHERS	
ชื่อย่อหลักทรัพย์ (Issue Name)	char(20)
ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ (Issuer Name)	char(100)
จำนวนหน่วยยกมา (หน่วย)	num(12,2)
มูลค่ายกมา (บาท)	num(19,5)
วันที่ซื้อ	char(2)
เดือนที่ซื้อ	char(2)
ปีที่ซื้อ (ปี ค.ศ.)	char(4)
จำนวนหน่วยซื้อหรือเพิ่ม (หน่วย)	num(12,2)
มูลค่าซื้อหรือเพิ่ม (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท)	num(19,5)
วันที่ขาย	char(2)
เดือนที่ขาย	char(2)
ปีที่ขาย (ปี ค.ศ.)	char(4)
จำนวนหน่วยขายหรือลด (หน่วย)	num(12,2)
มูลค่าขายหรือลด (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท)	num(19,5)
จำนวนหน่วยยกไป (หน่วย)	num(12,2)
อัตราดอกเบี้ยหน้าตัว/ปี (%)	num(7,4)
ราคาหน้าตัว (บาท)	num(19,5)
ดอกเบี้ยค้างรับ (บาท)	num(19,5)
มูลค่ายุติธรรม (บาท)	num(19,5)
รหัสสกุลเงิน	char(1)
0 ต่างประเทศ	
1 บาท	
yield	char(50)
วันที่ออก	char(2)
เดือนที่ออก	char(2)
ปีที่ออก (ปี ค.ศ.)	char(4)
วันที่ครบกำหนดดอกเบี้ย	char(2)
เดือนที่ครบกำหนดดอกเบี้ย	char(2)
ปีที่ครบกำหนดดอกเบี้ย (ปี ค.ศ.)	char(4)

คำอธิบายรูปแบบเพิ่มข้อความ (AMC03.TXT)

1. การจัดส่งเพิ่มข้อความ ข้อมูลการลงทุนของบริษัทจัดการ “AMC03.TXT” ให้ใช้ข้อมูลสิ้นสุด ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน และส่งให้สำนักงานภายในวันที่ 15 ของเดือนถัดไป โดยสำหรับบลจ.เอ็มเอฟซี ให้จัดส่งเพิ่มข้อความของบริษัทย่อย/บริษัทร่วมแทนบริษัทดังกล่าวด้วย
2. สำหรับบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนที่ได้รับใบอนุญาตกองทุนรวมเท่านั้น และบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนที่ได้รับใบอนุญาตกองทุนรวมและกองทุนส่วนบุคคล ให้ส่งเพิ่มข้อความ AMC03.TXT ผ่านระบบ Investment Management Reporting System (IMRS) ส่วนบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนที่ได้รับใบอนุญาตกองทุนส่วนบุคคลเท่านั้น ให้ส่งเพิ่มข้อความ AMC03.TXT ผ่านระบบ Provident Fund and Private Fund Reporting System (PARS)
3. ข้อมูลในเพิ่มข้อความ (text file) แต่ละ field กำหนดให้ใช้ “|”(delimiter)เป็นตัวแบ่ง และใน field ใดที่**ไม่มีข้อมูลรายงานประจำงวดนั้น ให้ใช้ตัว delimiter ปิด field นั้น โดยห้ามมีช่องว่างระหว่าง delimiter** และแต่ละบรรทัดให้**จบด้วยตัว delimiter** เท่านั้น
4. ในการจัดทำและจัดส่งเพิ่มข้อความ AMC03.TXT ให้จัดทำข้อมูลดังนี้
 - 4.1 Header เป็นบรรทัดแรกของ text file ประกอบด้วย
รหัสบริษัทจัดการ|รหัสบริษัทย่อยหรือบริษัทร่วม|วันที่รายงาน (วันทำการสุดท้ายของเดือน)|เดือนที่รายงาน|ปีที่รายงาน (ปี ค.ศ.)|ประเภทรายงาน|
 - 4.2 Data เป็นบรรทัดที่สองของ text file ถึง บรรทัดสุดท้าย แต่ละบรรทัดประกอบด้วย
รหัสประเภทการลงทุนย่อย|รหัสตลาดที่ซื้อขายหลักทรัพย์|ชื่อย่อหลักทรัพย์(Issue Name)|ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ (Issuer Name)|จำนวนหน่วยยกมา (หน่วย)|มูลค่าหน่วยยกมา (บาท)|วันที่ซื้อ|เดือนที่ซื้อ|ปีที่ซื้อ (ปี ค.ศ.)|จำนวนหน่วยซื้อหรือเพิ่ม (หน่วย)|มูลค่าซื้อหรือเพิ่ม (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท)|จำนวนขายหรือลด (หน่วย)|มูลค่าขายหรือลด (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท)|จำนวนหน่วยยกไป (หน่วย)|อัตราดอกเบี้ยหน้าตั๋ว/ปี|ราคาหน้าตั๋ว (บาท)|ดอกเบี้ยค้างรับ (บาท)|มูลค่ายุติธรรม (บาท)|รหัสสกุลเงิน|yield|วันที่ออก|เดือนที่ออก|ปีที่ออก (ปี ค.ศ.)|วันที่ครบกำหนดออก|เดือนที่ครบกำหนดออก|ปีที่ครบกำหนดออก (ปี ค.ศ.)|
5. กรณีที่บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน**ไม่มีการลงทุนของบริษัทจัดการ** ให้จัดส่งเพิ่มข้อความ AMC03.TXT โดยมีเฉพาะส่วนของ Header เท่านั้นผ่านระบบ
6. Length num (19,5) หรือ (12,2) หมายถึง ความยาวของข้อมูลตัวเลข (numeric) ดังนี้ (19,5) เท่ากับตัวเลขจำนวนเต็ม 14 ตัว และมีทศนิยม 5 ตำแหน่ง และ (12,2) เท่ากับตัวเลขจำนวนเต็ม 10 ตัว และมีทศนิยม 2 ตำแหน่ง โดยห้ามใส่เครื่องหมาย “;” **กรณีที่มีความยาวสั้นกว่าที่กำหนด** เช่น กำหนดเป็น num(12,2) แต่ข้อมูลจริงเป็น num(9,2) **ให้ใส่ delimiter ปิดท้ายตามข้อมูลจริง โดยไม่ต้องเติม blank ด้านหน้าหรือท้ายข้อมูล**
7. หลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดต่างๆ ในประเทศไทย ให้รายงานชื่อย่อหลักทรัพย์ให้ตรงกับชื่อย่อหลักทรัพย์ในตลาดนั้นๆ และถ้าเป็นหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนใน ThaiBMA ให้ใช้ Issue
8. หลักทรัพย์ที่ลงทุนที่ซื้อในช่วง IPO และ ณ วันทำการสุดท้าย ยังไม่ได้จดทะเบียนในตลาดต่างๆ ในประเทศไทย ให้รายงานรหัสตลาดที่ซื้อขายหลักทรัพย์เป็น 000 (No Market) เข้ามาจนกว่าหลักทรัพย์นั้นจะจดทะเบียนแล้ว

9. ประเภทการลงทุนย่อยที่มีการซื้อหรือเพิ่ม หรือขายหรือลด ในเดือนนั้น ให้รายงานวัน/เดือน/ปีที่ซื้อ หรือวัน/เดือน/ปีที่ขาย เข้ามาทุกรายการ
10. ให้รายงาน หลักทรัพย์ที่คงเหลือ ณ วันทำการสุดท้ายของเดือนก่อน และได้ขายไปทั้งหมดภายในเดือนที่รายงาน เข้ามาด้วย
11. การตรวจสอบการคำนวณของข้อมูลที่ส่ง ยอดรวมของ มูลค่ายุติธรรมของรหัสประเภทการลงทุนย่อย ตั้งแต่ 101 ถึง 499 หักด้วย ยอดรวมของ มูลค่ายุติธรรมของรหัสประเภทการลงทุนย่อย ตั้งแต่ 615 ถึง 616 จะเท่ากับ มูลค่ายุติธรรมของรหัสประเภทการลงทุนย่อย 906

รายงานข้อมูลการทำธุรกรรมระหว่างกองทุน (crossing)^{1/}

ประจำเดือน..... พ.ศ.....

มคอ.....

ชื่อกองทุน	ชื่อกลาง (broker หรือ dealer)	วันเดือนปี ที่ทำธุรกรรม	ชื่อหลักทรัพย์	การเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน/ ทะเบียน ^{2/}	ประเภททรัพย์สิน	ชื่อผู้ออก	อันดับความน่าเชื่อถือ ^{3/}	อายุคงเหลือ ^{4/} (ปี)	สภาพคล่องของหลักทรัพย์ ^{5/}	มูลค่าธุรกรรม (ลบ.) ที่คำนวณโดยวิธี		สัดส่วนมูลค่า (ราคาซื้อขาย) ต่อ NAV ณ ต้นเดือน	เหตุผลในการทำธุรกรรม ^{7/}
										ราคาปิด	ราคาอ้างอิง ^{6/} ราคาที่ซื้อขาย		
กอง B	-	12/9/48	AOT	SET50	หุ้น	บมจ. การท่าเรือ		56	52	4%	อัตราส่วนการลงทุนใน AOT ของกอง C เดิมเพดาน โดยไม่ได้ลงทุนเพิ่ม ขณะที่กอง B ยังสามารถรับ AOT ซึ่งมีจูงใจอันดับสูงได้ ทั้งนี้ ใช้ราคาปิด ณ วันที่ตัดสินใจซื้อขาย
กอง C	-	12/9/48	AOT	SET50	หุ้น	บมจ. การท่าเรือ		56	52	10%	
กอง E	dealer 1	15/9/49	AA	non-registered	ค่าเผือกเงิน	บมจ. A	-	0.5		-	28	2%	yield = 5.49% (ต้องการเพิ่มผลตอบแทนให้กับกองทุนและ บมจ. A ก็เป็นบริษัทที่มีปัจจัยพื้นฐานดี) ทั้งนี้ บมจ. ได้ shop rate จาก dealer 3 ราย ได้แก่ TISCO, KGI และ PATRA แล้ว โดยที่ yield เหลืออยู่ที่ประมาณ 5.5%
กอง F	dealer 1	...	AA	non-registered	ค่าเผือกเงิน	บมจ. A	-	0.5		-	28	3%	yield = 5.50% (ต้องการสภาพคล่องเพื่อรองรับการไถ่ถอนหน่วยลงทุน)
กอง G	dealer 1	...	AA	non-registered	ค่าเผือกเงิน	บมจ. A	-	0.5		-	28	5%	yield = 5.50% (ต้องการสภาพคล่องเพื่อรองรับการไถ่ถอนหน่วยลงทุน)

หมายเหตุ:

1/ หมายเหตุรวมเดิม (1) การซื้อ/ขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินตรงข้ามกันของกองทุนรวม กองทุนส่วนบุคคล และกองทุนเลี้ยงชีพภายใต้การจัดการในรอบ 5 วันที่ผ่านมา ทั้งที่ผ่านและไม่ผ่านตัวกลาง

(2) กรณีที่ใช้ตัวกลางจะต้องเป็นคู่กลางรายเดียวกัน และมีมูลค่าเท่ากัน (face value) รวมของหลักทรัพย์ที่ crossing ของกองทุนที่ซื้อเท่ากับมูลค่าหน้าตั๋วรวมของหลักทรัพย์ที่ crossing ของกองทุนที่ขาย

(3) ตัวกลางที่ crossing จะเป็นบุคคลที่เกี่ยวข้องหรือไม่ก็ได้

2/ รายการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนหรือขึ้นทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET50, non-SET50) ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (MAI) ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (BEX) และสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (Thai BMA) หรือ ไม่จดทะเบียน (non-SET) หรือ ไม่จดทะเบียน (non-registered)

3/ ระบุกรณีเป็นตราสารหนี้ ทั้งนี้ เป็นอันดับความน่าเชื่อถือตามลำดับ ดังนี้ 1) ของผู้ตราสาร (issue rating) 2) ของผู้รับรอง/ อนุมัติ/ สกัดหลัง/ คุ้มครอง/ หรือ 3) ของผู้ออกตราสาร (issuer rating) จากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงาน

4/ ระบุ กรณีเป็นตราสารหนี้

5/ พิจารณาสภาพคล่องของหลักทรัพย์ด้วยหลักเกณฑ์ตามหนังสือเวียนที่ กคค.ม.ว.1.5712547 ลงวันที่ 22 พฤศจิกายน 2547 ว่าเป็น Tier 1, Tier 2 หรือ non-Tier

6/ ราคาปิด หมายถึงราคาปิด ณ วันที่ทำธุรกรรม

7/ ราคาอ้างอิงในกรณีตราสารหุ้น, ราคาอ้างอิงอาจหมายถึง ค่าเฉลี่ยระหว่างราคาสูงสุดและราคาต่ำสุดในวันที่มีการซื้อขาย กรณีตราสารหนี้, ราคาอ้างอิงอาจหมายถึง ราคาที่ dealer quote เพื่อใช้ในการซื้อขาย ณ วันที่มีรายการเกิดขึ้น และ ให้ระบุที่มาของราคาอ้างอิงด้วยว่ามาจากอะไร

8/ เหตุผลในการทำธุรกรรม กรณีราคาซื้อขายไม่เท่ากับราคาอ้างอิง หรือราคาซื้อขายไม่เท่ากับราคาปิด ทั้งนี้ กรณีเป็นตราสารหนี้ที่ไประบุ yield ที่ใช้ในการซื้อขายด้วย

รายงานข้อมูลการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง

ประจำเดือน.....พ.ศ.....

บจก.

ชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง**	วันเดือนปี ที่ทำธุรกรรม	ประเภทธุรกรรม	ชื่อทรัพย์สิน	ประเภททรัพย์สิน	ชื่อผู้ออก	อันดับความน่าเชื่อถือ ²	อายุหนังสือ ³ (ปี)	สภาพคล่องของหลักทรัพย์		ความแตกต่างระหว่างมูลค่าที่ตีที่สุดและมูลค่าซื้อขาย (บาท) ⁵	มูลค่าธุรกรรม		เหตุผลในการทำธุรกรรม ⁶
									ได้รับ	ไม่ได้รับ		ด้านบาท	สัดส่วนต่อ NAV ณ ต้นเดือน	
บจก. A	ABC	2/9/48	ขาย	TOP	หุ้น	บมจ. ไทยออยล์ ⁴	-50,000	60,000	10%	เนื่องจากเห็นราคา 60 บาท เป็นราคาที่เหมาะสม จึงได้มีการขายหุ้นดังกล่าวในช่วงเช้า โดยต่อมราคาได้มีการปรับตัวสูงขึ้นจนกระทั่งช่วงบ่ายที่ปิดตลาด	
บจก. D	PATRA	2/9/48	ซื้อ	XYZ	หุ้นกู้	บมจ. XYZ	AA	1.5	ได้รับ	-100,000	10	10%	บจก. ได้ shop rate จาก dealer 3 ราย ได้แก่ TISCO, KGI และ PATRA โดย PATRA เสนอราคาต่ำสุดที่ yield = 9%	

หมายเหตุ :

- 1/ ข้อมูลธุรกรรม ได้แก่
 1. การซื้อขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินผ่านนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ที่เป็นบุคคลที่เกี่ยวข้อง
 2. การซื้อขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินโดยตรงกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง
 3. การซื้อหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินที่ถือใหม่ ที่บุคคลที่เกี่ยวข้องเป็นผู้จำหน่าย (underwriter) หรือผู้จัดการโครงการประมุขตราสารแห่งหนึ่ง (arranger) หรือที่ปรึกษาทางการเงิน (financial advisor)
 4. การซื้อหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินที่บุคคลที่เกี่ยวข้องเป็นผู้ออก วันแตกการลงทุนในเงินฝาก บัตรเงินสด หรือตั๋วสัญญาใช้เงิน ซึ่งมีอายุไม่เกิน 1 ปี ที่ บพ. ธนาคารอื่นที่มีกม. เฉพาะจัดตั้งขึ้น บริษัทเงินทุน หรือบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ เป็นสื่อกลางเพื่อการบริหารสภาพคล่อง
 5. การซื้อตราสารแห่งหนึ่งที่บุคคลที่เกี่ยวข้องเป็นผู้รับรอง รับอ่าวัด หรือหลักทรัพย์ โฉนดที่ดิน
 6. การซื้อขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินระหว่างกองทุนรวมและกองทุนส่วนบุคคล
 7. อื่น ๆ (ระบุประเภทธุรกรรม และ/หรือ การทำหน้าที่ของบุคคลที่เกี่ยวข้อง)
- 3/ระบุ กรณีตราสารหนี้
- 4/เป็นอันดับความน่าเชื่อถือตามลำดับ ดังนี้ 1) ของตัวตราสาร (issue rating) 2) ของผู้รับรอง/อ่าวัด/ สกัดหลัง/ ค่าประกัน หรือ 3) ของผู้ออกตราสาร (issuer rating) จากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงาน กนง.
- 5/พิจารณาสภาพคล่องของหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์ในหนังสือเวียนที่ กคค.บ.(ว.) 57/2547 ลงวันที่ 22 พฤศจิกายน 2547
- 6/กรณีซื้อตราสาร ความแตกต่างจะเท่ากับ มูลค่าราคาตลาดมูลค่าต่ำสุด - มูลค่าซื้อ; กรณีขายตราสาร ความแตกต่างจะเท่ากับ มูลค่าขาย - มูลค่าราคาตลาดมูลค่าสูงสุด (คิดลบ แต่คงว่า ซื้อแพง ขายถูก ซึ่งต้องแสดงเหตุผลประกอบการตัดสินใจลงทุน)
- 7/เหตุผลในการทำธุรกรรมมีที่ซื้อแพงหรือขายถูกกว่าราคาตลาด และกรณีที่ตราสาร ไม่ใช่ quality assets

รายงานข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ที่เป็นบุคคลที่เกี่ยวข้อง

ประจำเดือน พ.ศ.

บลจ.

ชื่อกองทุน	รายชื่อนายหน้า ที่เป็นบุคคลที่เกี่ยวข้อง	มูลค่าการซื้อขาย หลักทรัพย์ (ลบ.)	ค่านายหน้าซื้อขาย หลักทรัพย์ (ลบ.)	ความถี่ในการซื้อขาย* (ครั้ง)	เหตุผล
กอง G	กิมฮวด	555	1.3	5	- การเลือกใช้นายหน้าเป็นไปตามแนว ทางการคัดเลือกและจัดอันดับ และ room ที่ เหลือสำหรับ บล.กิมฮวด โดย บล.กิมฮวดเป็น บล. ที่ให้บริวิเคราะห์ที่เป็นประโยชน์ต่อ การตัดสินใจลงทุนของผู้จัดการกองทุน

หมายเหตุ : ความถี่ในการซื้อขายหมายถึง จำนวนครั้งที่ บลจ. ส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ให้นายหน้าแต่ละราย ดังนั้น กรณีที่เป็นการส่งคำสั่งซื้อขายจำนวนมาก
ในแต่ละครั้ง (warehousing) จะนับเป็น 1 ครั้งเท่านั้น แม้ว่าบริษัทหลักทรัพย์จะใช้เวลาในการซื้อขายหลักทรัพย์ตามคำสั่งมากกว่า 1 วันทำการ

รายงานข้อมูลการทำธุรกรรมตราสารหนี้กับบุคคลที่เกี่ยวข้อง

ประจำเดือน พ.ศ.
 ปีที่ พ.ศ.

ชื่อบุคคล ที่เกี่ยวข้อง	รายชื่อ บุคคลที่ เกี่ยวข้อง**	วันที่/ วันที่ทำ ธุรกรรม	ประเภท ธุรกรรม	ลักษณะธุรกรรม	ลักษณะการ ออกของหนี้		ผู้ออก	การเป็นหลักทรัพย์ค้ำประกัน		สภาพคล่อง		ความแตกต่าง ระหว่างมูลค่าตลาด และมูลค่าซื้อขาย (BPM) ^๕	% NAV ณ สิ้นเดือน	หมายเหตุ/เหตุผลในการทำธุรกรรมดังกล่าว ^๖				
					ประเภท หลักทรัพย์	อายุของหนี้ (ปี) ^๖		rating	ความเสี่ยง	rating	ชื่อ				non-registered	Tier I	Tier II	เปรียบเทียบมูลค่า (ลบ)
กองบว	PATRA	2/9/48	2	/	XYZ	6	1.5	/	AA	-	-	10	9.9	-100,000	มูลค่าซื้อขาย ณ dealer 3 ราย ได้แก่ TISCO, KGI และ PATRA Imo PATRA เสนอราคาซื้อขายที่ yield = 9%			

หมายเหตุ :

- ข้อมูลธุรกรรม ได้แก่
- การซื้อขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินผ่านนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ที่เป็นบุคคลที่เกี่ยวข้อง
- การซื้อขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินโดยตรงกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง
- การซื้อขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินที่ออกใหม่ ที่บุคคลที่เกี่ยวข้องเป็นผู้จำหน่าย (underwriter) หรือผู้ให้การโครงการระดมทุนทางการเงิน (financial advisor)
- การซื้อขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินที่ออกใหม่ในลักษณะการระดมทุนในเงินฝาก บัญชีเงินฝาก ค่าเผื่อเงิน หรือตั๋วสัญญาใช้เงิน ซึ่งมีอายุไม่เกิน 1 ปี ที่ธนาคารพาณิชย์ ธนาคารอื่นที่มีใบอนุญาตจะจัดตั้งขึ้น บริษัทเงินทุน หรือบริษัทหลักทรัพย์อื่น เป็นผู้ออก เพื่อบริหารสภาพคล่อง
- การซื้อขายระหว่างนี้ที่บุคคลที่เกี่ยวข้องเป็นผู้รับรอง รับจำนำ หรือค้ำหลังโอนประเภทสิทธิได้แก่
- การซื้อขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินระหว่างของธุรกรรมและของส่วนบุคคล
- อื่น ๆ (ระบุประเภทธุรกรรม และ/หรือ การทำหน้าที่ของบุคคลที่เกี่ยวข้อง)

2/ประเภททรัพย์สิน ได้แก่ (โปรดระบุประเภทของตราสารหนี้)

- พันธบัตร
- ค้ำเงินคลัง
- บัตรเงินฝาก
- ตั๋วสัญญาใช้เงิน
- ค้ำมรดกเงิน
- หุ้นกู้

3/ระบุผู้คงเหลือของตราสาร

- ไม่ระบุผู้คงเหลือของตราสาร
- บริษัทหรือหน่วยงานที่ความน่าเชื่อถือเพียง 1 แห่ง ตามลักษณะของตราสาร โดยจะต้องระบุอันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร (issue rating) ก่อน หาก ไม่มี issue rating ให้ใช้อันดับความน่าเชื่อถือของผู้รับรอง/ออก/ค้ำประกัน/ค้ำประกันเงิน และ/หรืออันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออก (issuer rating) เป็นค่าเทียบเท่ากรณีไม่มี issue rating และ rating ของผู้รับรอง/ออก/ค้ำประกัน
- มูลค่าตลาดให้ใช้ราคาปิดตามประกาศของกรมการบัญชีการคลัง วันที่ออกถึงกึ่งปีและวิธีการกำหนดมูลค่าสุทธิตราสาร
- กรณีซื้อขายตราหนี้ ความแตกต่างจะเท่ากับมูลค่าราคาตลาด - มูลค่าซื้อ; กรณีซื้อขายตราหนี้ ความแตกต่างจะเท่ากับ มูลค่าขาย - มูลค่าราคาตลาด (คิดลบแสดงว่าประกอบงบการเงินในงบทุน)
- เหตุผลในการทำธุรกรรมที่มีชื่อเฉพาะหรือจากกฎว่าราคาตลาด และการมีคุณภาพการ ไม่ใช่ quality assets

4/บริษัทหรือหน่วยงานที่ความน่าเชื่อถือเพียง 1 แห่ง ตามลักษณะของตราสาร โดยจะต้องระบุอันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร (issue rating) ก่อน หาก ไม่มี issue rating

ให้ใช้อันดับความน่าเชื่อถือของผู้รับรอง/ออก/ค้ำประกัน/ค้ำประกันเงิน และ/หรืออันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออก (issuer rating) เป็นค่าเทียบเท่ากรณีไม่มี issue rating และ rating ของผู้รับรอง/ออก/ค้ำประกัน

มูลค่าตลาดให้ใช้ราคาปิดตามประกาศของกรมการบัญชีการคลัง วันที่ออกถึงกึ่งปีและวิธีการกำหนดมูลค่าสุทธิตราสาร

กรณีซื้อขายตราหนี้ ความแตกต่างจะเท่ากับ มูลค่าราคาตลาด - มูลค่าซื้อ; กรณีซื้อขายตราหนี้ ความแตกต่างจะเท่ากับ มูลค่าขาย - มูลค่าราคาตลาด (คิดลบแสดงว่าประกอบงบการเงินในงบทุน)

เหตุผลในการทำธุรกรรมที่มีชื่อเฉพาะหรือจากกฎว่าราคาตลาด และการมีคุณภาพการ ไม่ใช่ quality assets

รายงานข้อมูลการทำธุรกรรมตราสารทุนกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง

ประจำเดือน พ.ศ.

โดย.....

ชื่อกองทุน	รายชื่อบุคคลที่เกี่ยวข้อง	วันเดือน/ปี ที่ทำธุรกรรม	ประเภทธุรกรรม ^{1/}	ลักษณะธุรกรรม		ชื่อหลักทรัพย์	ชื่อผู้ออก	ตราสารทุน				NAV ณ สิ้นเดือน	หมายเหตุ/เหตุผลในการทำธุรกรรมดังกล่าว ^{5/}		
				ซื้อ	ขาย			การเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน		เปรียบเทียบมูลค่า (ฐานบาท)				ความแตกต่างระหว่างมูลค่าที่ซื้อ/ที่ขาย และมูลค่าซื้อขาย (บาท) ^{4/}	
								SET	MAI	non-listed	มูลค่าซื้อขาย				มูลค่าสูงสุด ^{3/}
กอง A	ABC	2/9/48	2	/	ขาย	TOP	บมจ. ไทยออยล์	1	/	-	60*10000 = 60,000	65*10000 = 65,000	65*10000 = 65,000	-50,000	เนื่องจากเห็นว่าราคาที่เหมาะสม จึงได้มีการขายหุ้นดังกล่าวในช่วงเช้า โดยต่อมาราคาได้มีการปรับตัวสูงขึ้นจนกระทั่งช่วงบ่ายที่ปิดตลาด

หมายเหตุ :

1/ ข้อมูลธุรกรรม ได้แก่

1. การซื้อขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินผ่านนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ที่เป็นบุคคลที่เกี่ยวข้อง
2. การซื้อขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินโดยตรงกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง
3. การซื้อหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินที่ออกใหม่ ที่บุคคลที่เกี่ยวข้องเป็นผู้จัดจำหน่าย (underwriter) หรือผู้จัดการโครงการตราสารแห่งหนึ่ง (arranger) หรือที่ปรึกษาทางการเงิน (financial advisor)
4. การซื้อหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินที่บุคคลที่เกี่ยวข้องเป็นผู้ออก เว้นแต่การลงทุนในเงินฝาก บัตรเงินฝาก บัตรแลกเงิน หรือตั๋วสัญญาใช้เงิน ซึ่งถืออยู่ไม่เกิน 1 ปี ที่ธนาคารพาณิชย์ ธนาคารอื่นที่กฎหมายระบุไว้ หรือบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ เป็นผู้ออก เพื่อบริการสภาพคล่อง
5. การซื้อขายตราแห่งหนึ่งที่มีมูลค่าที่เกี่ยวข้องเป็นหุ้นรับรอง รับอวอร์ด หรือหลักทรัพย์ โอนประเภทมีสิทธิได้เสีย
6. การซื้อขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินระหว่างกองทุนรวมและกองทุนส่วนบุคคล
7. อื่น ๆ (ระบุประเภทธุรกรรม และ/หรือ การทำหน้าที่ของบุคคลที่เกี่ยวข้อง)

2/ ประเภททรัพย์สิน ได้แก่ (โปรดระบุขนาดตามประเภทของตราสารทุน)

1. หุ้น
2. หน่วยลงทุนหรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของตราสารแห่งหนึ่งหรือกองทุนรวมอื่นที่มีนโยบายการลงทุนในตราสารแห่งหนึ่ง
3. ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น
4. ใบแสดงสิทธิในการซื้อหุ้นที่มอบให้
5. ใบแสดงสิทธิที่มีหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นหุ้น หรือใบแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น
6. หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่น (โปรดระบุ)

3/ มูลค่า = ราคา * จำนวนที่ซื้อขาย มูลค่าสูงสุดให้ใช้ราคาสูงสุด มูลค่าต่ำสุดให้ใช้ราคาต่ำสุด

ส่วนมูลค่า ณ ราคาปิดให้ใช้ราคาตามประกาศกรมการบัญชีการกองทุน ว่าด้วยหลักเกณฑ์และวิธีการกำหนดมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม

4/ กรณีซื้อตราสารทุน ความแตกต่างจะเท่ากับ มูลค่าที่ซื้อ - มูลค่าที่ซื้อ - มูลค่าขาย - มูลค่าสูงสุด (คิดลบ แสดงว่า ซื้อแพง ขายถูก ซึ่งต้องแสดงเหตุผลประกอบการตัดสินใจลงทุน)

5/ เหตุผลในการทำธุรกรรมกรณีซื้อแพงหรือขายถูกกว่าราคาตลาด และกรณีซื้อขาย ไม่ใช่ quality assess

รายงานข้อมูลการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง

การรายงานการทำธุรกรรม แบ่งเป็น 2 ลักษณะ ดังนี้

(1) แบบรายงานภายใน ซึ่งเป็นรายงานที่ทำ และเก็บไว้ที่บริษัทจัดการ แต่จะนำส่งสำนักงานเมื่อมีการร้องขอเท่านั้น (เช่น ผู้ตรวจสอบร้องขอข้อมูลย้อนหลังก่อนเข้าตรวจสอบบริษัทจัดการ) ทั้งนี้ แบบรายงานภายในจะเป็นแบบรายงานที่มีเนื้อหาค่อนข้างละเอียด โดยจะแยกเป็นการทำธุรกรรมตราสารหนี้กับบุคคลที่เกี่ยวข้อง (เอกสารแนบ 1) การทำธุรกรรมตราสารทุนกับบุคคลที่เกี่ยวข้อง (เอกสารแนบ 2)

(2) แบบรายงานภายนอก ซึ่งเป็นรายงานที่เปิดเผยมต่อผู้ลงทุน โดยข้อมูลที่ปรากฏในแบบรายงาน จะเป็นการรวมข้อมูลทั้งการทำธุรกรรมตราสารหนี้ และตราสารทุนที่ให้รายละเอียดเฉพาะประเด็นสำคัญที่ผู้ลงทุนควรทราบ (เอกสารแนบ 3) รวมทั้งจะมีรายงานข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ที่เป็นบุคคลที่เกี่ยวข้อง (เอกสารแนบ 4) และรายงานการทำธุรกรรมระหว่างกองทุน (crossing)* (เอกสารแนบ 5) เพิ่มเติมด้วย ทั้งนี้ บริษัทจัดการมีหน้าที่ต้องเปิดเผยต่อผู้ลงทุน ดังนี้

(2.1) เปิดเผยผ่าน website ของ บริษัทจัดการเป็นรายเดือน อย่างไรก็ตาม ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบข้อมูลรายเดือนดังกล่าวนี้ได้ที่ website ของสำนักงานเช่นเดิม โดยสำนักงานจะทำรวม link ไปยังข้อมูลของแต่ละบริษัทจัดการต่อไป

(2.2) เปิดเผยในรายงาน 6 เดือน และรายงานประจำปีกรณีกองทุนรวมเปิด และเปิดเผยในรายงานประจำปีกรณีกองทุนรวมปิด โดยให้บริษัทจัดการเปิดเผยรายชื่อของบุคคลที่เกี่ยวข้องที่มีการทำธุรกรรมกับกองทุนรวมในช่วง 6 เดือน และ 1 ปีที่ผ่านมา และเพิ่มข้อความว่า “ผู้ลงทุนสามารถตรวจสอบการทำธุรกรรมกับบุคคลที่เกี่ยวข้องกับกองทุนรวมได้ที่ บริษัทจัดการ โดยตรง หรือที่ website ของบริษัทจัดการและสำนักงาน ก.ล.ต.”

อนึ่ง จะนำระบบ “point system” มาใช้ โดยจะมีการหักคะแนนหากการจัดส่งข้อมูลไม่ถูกต้อง หรือไม่สมบูรณ์ตามแบบรายงานที่กำหนด

* หมายความว่ารวมถึง (1) การซื้อ/ขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินตรงข้ามกันของกองทุนรวม กองทุนส่วนบุคคล และกองทุนสำรองเลี้ยงชีพภายใต้การจัดการในรอบ 5 วันที่ผ่านมา ทั้งที่ผ่านและไม่ผ่านตัวกลาง และ (2) กรณีที่ใช้ตัวกลางจะต้องเป็นตัวกลางรายเดียวกัน และมีมูลค่าหน้าตั๋ว (face value) รวมของหลักทรัพย์ที่ crossing ของกองทุนที่ซื้อเท่ากับมูลค่าหน้าตั๋วรวมของหลักทรัพย์ที่ crossing ของกองทุนที่ขาย (3) ตัวกลางที่ crossing จะเป็นบุคคลที่เกี่ยวข้องหรือไม่ก็ได้