

คำถาม-คำตอบ

เกี่ยวกับแบบรายงานการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

วิธีการส่งข้อมูล

1. หลักทรัพย์ listed ใน SET MAI BEX TFEX และ ThaiBMA ยังคงต้องส่ง feature หรือไม่
ตอบ ไม่ต้องส่ง feature ให้ส่งเฉพาะ Outstanding เท่านั้น

2. การรายงาน Equity & Others Feature จะรายงานเฉพาะในกรณีที่มี transaction ที่เกิดขึ้น
ภายในเดือนนั้น หรือให้รายงานทุกเดือนที่ยังมี outstanding เช่น สิ้นเดือนที่ 1 กองทุนถือหุ้น BBL
ในพอร์ต ระหว่างเดือนที่ 2 มีการซื้อ TMB เพิ่ม สิ้นเดือนที่ 2 กองทุนถือหุ้น BBL และ TMB ใน
พอร์ต ดังนั้น (1) บริษัทจัดการต้องรายงานทั้ง BBL และ TMB หรือ (2) รายงานเฉพาะ TMB
ตอบ ขึ้นอยู่กับบริษัทจัดการส่ง Master File แบบไหน

แบบที่ 1 เดือนแรกที่ส่งรายงาน รายงาน Equity & Others Feature และ Fixed Income Feature ของ
หลักทรัพย์ที่คงเหลือใน Port ณ วันที่รายงาน และหลักทรัพย์ที่มีการขายหรือลดในเดือนนั้น ส่วน
รายงาน Feature ประเภทอื่น ให้รายงานเฉพาะหลักทรัพย์ที่คงเหลือใน Port ณ วันที่รายงาน

เดือนถัดมา รายงานเฉพาะ feature ของหลักทรัพย์ที่มีการลงทุนเพิ่ม และที่เปลี่ยนแปลงจาก
ที่เคยส่งสำนักงานแล้ว

แบบที่ 2 เดือนแรกส่งเหมือนแบบที่ 1

และเดือนถัดมา ก็ยังคงส่งเหมือนเดือนแรก คือ รายงาน Equity & Others Feature และ
Fixed Income Feature ของหลักทรัพย์ที่คงเหลือใน Port ณ วันที่รายงาน และหลักทรัพย์ที่มีการขาย
หรือลดในเดือนนั้น ส่วนรายงาน Feature ประเภทอื่น ให้รายงานเฉพาะหลักทรัพย์ที่คงเหลือใน
Port ณ วันที่รายงาน

ถ้าบริษัทจัดการเลือกส่งแบบที่ 1 เดือนที่ 2 ให้ส่งเฉพาะ TMB แต่ถ้าบริษัทจัดการเลือกส่ง
แบบที่ 2 จะส่งทั้ง BBL และ TMB (ทั้งนี้ สมมติว่า BBL และ TMB เป็นหลักทรัพย์ OTC หรือ
หลักทรัพย์ต่างประเทศ เพราะโดยปกติหลักทรัพย์ที่ listed ไม่ต้องส่ง feature ให้ส่งเฉพาะ
outstanding

3. ถ้ากองทุนไม่ได้ลงทุนในหลักทรัพย์ เช่น ไม่ลงทุนใน Future และ Forward ต้องส่ง file Future,
Forward feature ให้สำนักงานหรือไม่

ตอบ ไม่ต้องส่ง

4. ข้อมูลเงินลงทุนในตราสารหนี้/ตราสารทุนออกใหม่, ข้อมูลรหัสกองทุนรวม และกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และตารางอ้างอิงต่าง ๆ ตามที่ได้รับทาง e-mail จากสำนักงาน เป็นข้อมูลที่บริษัทจัดการต้องจัดทำส่งให้หรือไม่

ตอบ บริษัทจัดการไม่ต้องจัดทำเพื่อส่งสำนักงาน และเป็นข้อมูลที่สำนักงานต้องจัดทำเพื่อส่งธนาคารแห่งประเทศไทย

5. ใน Fixed Income Feature กรณี Coupon Type เป็นแบบ Float จะให้ระบุ Rate ของตราสารอย่างไร

ตอบ ให้กรอกตาม Rate ปัจจุบัน

6. ถ้าไปลงทุนในหน่วยลงทุนในต่างประเทศ รหัสประเภทสินทรัพย์จะใส่เป็นอะไร

ตอบ รหัสประเภทสินทรัพย์ 108 -109, 117-121 และ 139 เหมือนหน่วยลงทุนในประเทศ ทั้งนี้ขึ้นอยู่กับว่าเป็นหน่วยลงทุนประเภทใด และให้รายงานรหัสตลาดให้ถูกต้อง คือ “ตลาดต่างประเทศ” หรือ “นอกตลาดต่างประเทศ”

7. ชื่อย่อหลักทรัพย์ต่างประเทศ โดยทั่วไปจะใช้ ISIN Code ถ้าไม่ใช่ ISIN Code จะให้ใช้อะไรเป็นชื่อย่อหลักทรัพย์

ตอบ ในกรณีของหลักทรัพย์ต่างประเทศที่มี ISIN Code ขอให้บริษัทจัดการรายงาน ISIN Code ในรายการ ISIN Code

8. ตราสารที่สามารถขายในหลายประเทศ เช่น ECP ให้ระบุรหัสประเทศอะไร

ตอบ ให้ระบุรหัสประเทศเป็นประเทศที่กองทุนไปลงทุน โดยถ้ากองทุนมีการลงทุนใน ECP นั้นมากกว่า 1 ประเทศ ให้แยกรายงาน feature ตามแต่ละประเทศ

9. กรณีตราสารที่มีลักษณะของตราสารในช่วงแรกเป็น Amortizing และช่วงหลังเป็น Straight ให้ระบุในรายงานอย่างไร

ตอบ ให้ระบุ Bond Type เป็น Amortized & Straight

10. ในกรณีที่หลักทรัพย์นั้นมีทั้งผู้ออกหลักทรัพย์ และผู้รับอวัล ให้ส่งใคร

ตอบ ให้ส่งทั้งผู้ออก และผู้รับอวัล ทั้งนี้ ผู้ออกหลักทรัพย์จำเป็นต้องส่ง ส่วนนิติบุคคลอื่นที่เกี่ยวข้อง เช่น ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลักหลัง ผู้ค้ำประกัน หรือผู้ส่งจ่าย ถ้ามีมากกว่า 1 ให้เลือกส่งอย่างใดอย่างหนึ่ง ถ้าไม่มี ให้ใส่ none

11. การระบุชื่อผู้ออกหลักทรัพย์/คู่สัญญา ชื่อผู้รับรอง/ผู้รับอวัล/ผู้สลักหลัง/ผู้ค้ำประกัน/ผู้ส่งจ่าย ควรมีหลักเกณฑ์ในการตั้งชื่อเพื่อใช้เป็นแนวทางเดียวกัน

ตอบ เพื่อให้เป็นมาตรฐานเดียวกัน ขอให้ทุกแห่งใช้ชื่อเต็มภาษาอังกฤษ แต่ถ้าเป็นชื่อเดียวกับบริษัทจดทะเบียนจะใช้ชื่อย่อหรือชื่อเต็มภาษาอังกฤษก็ได้

12. ในกรณีที่รับโอนกองทุนมาจากบล.อื่น วันที่เปิดบัญชีของเงินฝากต้องเป็นวันไหน ระหว่าง (1) วันที่รับโอน (2) วันเปิดบัญชี (3) วันเริ่มลงทุน

ตอบ กรณีที่ไม่ทราบวันเปิดบัญชี ให้ระบุเป็นวันที่รับโอน

13. Create Date Time และ Update Date Time ที่ทางสำนักงานกำหนดให้รายงานนั้น มีไว้เพื่อใช้ในวัตถุประสงค์ใด

ตอบ เพื่อช่วยในเก็บประวัติการเปลี่ยนแปลง feature ของหลักทรัพย์ แต่ถ้าบริษัทจัดการไม่ส่งทั้ง 2 รายการนี้เข้ามา และในเดือนถัดๆมา มีการส่ง feature ของหลักทรัพย์ตัวเดิมเข้ามาอีก ระบบของสำนักงานจะจัดเก็บ feature ของหลักทรัพย์ตัวนั้น ตามที่ส่งข้อมูลเข้ามาใหม่แทนที่ feature เดิมที่เคยส่ง

14. ธุรกิจ Swap ต้องรายงานทั้ง 2 ขาหรือไม่?

ตอบ ต้องรายงานทั้งด้านรับและจ่ายให้ครบถ้วน

15. ใน Outstanding File เราจะรู้ได้อย่างไรว่าแต่ละ Record จะเป็นของ Equity & Others, Fixed Income, Futures, Forward, etc... ในเมื่อให้ส่งเป็น file เดียวกัน น่าจะมี Field Type ที่จะบอกว่าแต่ละ Record คือข้อมูลของอะไร

ตอบ สามารถดูได้จากเอกสารแนบ (รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน) จะมีรายละเอียดบอกว่า ให้รายงานรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สินใน File Feature ประเภทไหน ซึ่งการรายงานรายการใน Outstanding File จะต้องรายงานเป็นประเภทเดียวกันด้วย และสำหรับรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สินที่ไม่ได้ระบุให้รายงาน File Feature ได้แก่ Reverse Repo, Repo, Direct Borrowing, Short

Sale ให้ส่งรายการตามประเภทของตัวเอง ที่เหลือให้ส่งรายการตามการลงทุนในสินทรัพย์/หนี้สิน
ค้างรับและค้างจ่าย ฯลฯ

**16. รายงานการทำธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (Reverse REPO) และรายงานการทำ
ธุรกรรมให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Lending) จากเดิมที่บริษัทฯ ต้องจัดทำและเก็บไว้ที่บริษัท
เพื่อให้สำนักงานสามารถตรวจสอบได้ ยังคงต้องจัดทำและเก็บไว้อีกต่อไปหรือไม่**

ตอบ บริษัทจัดการยังคงต้องจัดเก็บรายการที่เป็น transaction เพื่อให้สำนักงานเข้าตรวจสอบไว้
ส่วนข้อมูล outstanding รายเดือน บริษัทจัดการยังคงต้องจัดทำและส่งสำนักงานเป็น hard copy อยู่
และจะถูกทดแทนด้วยข้อมูล Outstanding Reverse REPO และ Outstanding Security Lending ตาม
รายงานใหม่

**17. ข้อมูลรหัสต่าง ๆ เช่น รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ หรือ Country Code จะมีการ update เพิ่มหรือ
เปลี่ยนแปลงหรือไม่ และหากมีการเปลี่ยนแปลง จะทราบได้อย่างไร**

ตอบ ถ้ามีการเพิ่มเติม/เปลี่ยนแปลง จะ e-mail แจ้งให้ทราบ และนำข้อมูลขึ้น Website สำนักงานให้

**18. Issuer ID ถ้าไม่รู้ หรือไม่มีเลขที่จดทะเบียนกับกระทรวงพาณิชย์ เช่น ธ.อาคารสงเคราะห์ หรือ
ตราสารที่ผู้ออกเป็นรัฐบาล/นิติบุคคลต่างประเทศ จะกรอกอย่างไร**

ตอบ เป็นรายการที่ไม่จำเป็นต้องกรอก (Not Null ไม่ได้ระบุเป็น Y)

**19. รายงานตราสารแห่งนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุนของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่ต้อง
นำส่งลูกค้า ยังต้องทำอยู่หรือไม่**

ตอบ ต้องทำส่งลูกค้าตามเดิม

**20. ในทุกรายงานที่ไม่ระบุ Not Null เท่ากับ Y หมายถึงไม่บังคับให้ใส่ข้อมูลใน Field นั้น ใช่
หรือไม่**

ตอบ ใช่

กำหนดส่งรายงาน

21. ขอเปลี่ยนแปลงการส่งรายงานการลงทุนของกองทุนรวมเป็นภายในวันที่ 20 ของเดือนถัดไป เหมือนกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

ตอบ สำนักงานจะเปลี่ยนแปลงให้ตามที่ขอ แต่สำหรับรายงานที่ส่งอยู่ในปัจจุบันยังคงต้องส่ง ภายในวันที่ 15 ของเดือนถัดไปเหมือนเดิม

22. ขอนำส่งข้อมูลการลงทุนของกองทุนรวม กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และกองทุนรวม

อสังหาริมทรัพย์ทุกประเภทพร้อมกันหมดได้หรือไม่

ตอบ สำนักงานจะเปลี่ยนกำหนดส่งรายงานการลงทุนของกองทุนใหม่ โดยถ้าเป็นกองทุนรวมและ กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้ส่งเป็นรายเดือน ภายในวันที่ 20 ของเดือนถัดไป ส่วนกองทุนรวม อสังหาริมทรัพย์ ให้ส่งเป็นรายครึ่งปี และรายปี ภายใน 45 วัน นับแต่วันสุดท้ายของเดือนมิถุนายน และธันวาคม ตามลำดับ ทั้งนี้ เป็นไปตามความเห็นของบริษัทจัดการในวันที่จัดบรรยาย

23. สำนักงานควรให้เวลาในการจัดทำระบบเพื่อออกรายงานเป็นเวลาอย่างน้อย 1 ปี สำหรับรายงาน ที่มีความยุ่งยากและซับซ้อนขนาดนี้

ตอบ โดยที่บริษัทจัดการส่วนใหญ่ไม่มีปัญหาในการจัดส่งข้อมูลในเดือนตุลาคม 2551 มีเพียงบริษัท จัดการ 1 แห่งเท่านั้นที่ comment ในเรื่องดังกล่าว สำนักงานจึงเห็นควรยืดเวลาการจัดการเป็น ภายในสิ้นปี 2551 ทั้งนี้ เพื่อให้ทันกำหนดการที่ commit ไว้กับธนาคารแห่งประเทศไทย

การยกเลิกแบบรายงาน

24. ตามที่สำนักงานจะยกเลิกรายงาน mpf1000 นั้น สำหรับรายงาน mpf2000 ซึ่งเป็นการสรุป รายงานจาก mpf1000 จะถูกยกเลิกด้วยหรือไม่ และถ้าไม่ยกเลิก รูปแบบของรายงาน mpf2000 จะ คงไว้ในรูปแบบ (Layout) เดิมหรือจะถูกรวมไว้ในรายงานฉบับปรับปรุงหรือไม่ ซึ่งบริษัทจัดการมี ความเห็นว่าสำนักงานควรจะยกเลิกรายงานดังกล่าวและปรับปรุงให้อยู่ในรูปแบบเดียวกัน

ตอบ สำนักงานจะยกเลิกแบบรายงาน mpf2000 ด้วย

25. การรายงานการลงทุนในรูปแบบใหม่นี้ จะครอบคลุมถึงรายงานการลงทุนของกองทุนส่วนบุคคลทุกกองทุน (PF1000) ด้วยหรือไม่ ซึ่งบจ.อยุธยาเห็นว่าสำนักงานควรจะปรับปรุงให้อยู่ในรูปแบบเดียวกัน โดยมีเหตุผลว่า 1) รายงานรูปแบบใหม่จะให้ข้อมูลที่มากกว่า ซึ่งน่าจะตรงกับความ ต้องการของสำนักงาน ที่จะใช้ข้อมูลเพื่อประมวลผลในด้านต่าง ๆ 2) เนื้อหาของข้อมูล โดยรวมของ PF1000 เหมือนกับรายงานการลงทุนของกองทุนรวมทุกกองทุน (MPF2000) และ

รายงานการลงทุนของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพทุกกองทุน (PVD1000) แต่สำนักงาน กลับเปลี่ยนแปลงเพียง PVD1000 เท่านั้น 3) บริษัทจัดการจะต้องจัดให้มีระบบเพื่อจัดทำรายงาน 2 รายงานที่แตกต่างกัน โดยที่เนื้อหาของรายงานคล้ายคลึงกัน ซึ่งจะเป็นการเพิ่มภาระให้กับบริษัท ตอบ สำนักงาน ได้ขอมติจากตัวแทนจากบริษัทจัดการทุกแห่งในวันที่จัดบรรยายและตอบคำถาม เกี่ยวกับแบบรายงานการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพสรุปว่า บริษัทจัดการ ขอให้ส่งรายงาน PF1000 ตามรูปแบบเดิม ทั้งนี้ กรณี PF1000 จะมีการปรับแก้ไขรหัสประเภท สิทธิทรัพย์/หนี้สิน ให้สอดคล้องกับรายงานการลงทุนของกองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และเพิ่มให้ส่งจำนวนกองทุน และมูลค่าทรัพย์สินสุทธิจำแนกตามบุคคลธรรมดา/นิติบุคคล กบข. และประกันสังคม

26. รายงานของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ แบบรายงานที่จะยกเลิกคือ PVD1000 เท่านั้น ใช่หรือไม่ ส่วน PVD2000 – 3000 ยังคงใช้ format เหมือนเดิม

ตอบ ใช่

27. รายงานสรุปเงินลงทุนในตราสารหนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน เป็นรายงานที่ส่งให้สำนักงานตามประกาศสำนักงาน ที่ สน. 28/2549 ใช่หรือไม่ และยังคงต้องเปิดเผยบน Website ของบริษัทจัดการอยู่ โดยจะยกเลิกเฉพาะการส่งรายงานให้สำนักงานเป็น Hard Copy ใช่หรือไม่

ตอบ ใช่ บริษัทจัดการยังคงต้องเปิดเผยรายงานดังกล่าวบน website บริษัทจัดการตามเดิม และเปลี่ยนจากการส่งรายงานให้สำนักงานเป็น Hard Copy เป็น Text File แทน

28. บริษัทได้รับทราบจากเจ้าหน้าที่ของสำนักงานว่าจะยกเลิกรายงาน LQ1 และ LQ2 ด้วย ซึ่งจากเอกสารที่สำนักงานส่งมาให้ ไม่พบการยกเลิกรายงานดังกล่าว จึงขอสอบถามว่ารายงาน LQ1 และ LQ2 ยังคงต้องจัดทำต่อไปหรือไม่

ตอบ สำนักงาน ได้แจ้งต่อบริษัทจัดการทุกแห่งในวันที่จัดบรรยายแล้วว่า สำนักงานพิจารณายกเลิก รายงาน LQ1 และ LQ2 ในอนาคต โดยอยู่ระหว่างการพิจารณา ดังนั้น บริษัทจัดการยังคงต้องจัดทำ รายงานดังกล่าวต่อไปก่อน

29. แบบรายงานที่อยู่ระหว่างพิจารณายกเลิกนั้น ยังต้องนำส่งแบบเดิมต่อไปใช่หรือไม่ และถ้ายัง ต้องส่งต่อ บลจ.ต้องส่งต่อจนถึงเมื่อใด ถึงจะทราบผลสรุปว่าจะยกเลิกแบบรายงานเมื่อใด

ตอบ บริษัทจัดการยังต้องนำส่งแบบรายงานเดิมอยู่ จนกว่าสำนักงานจะออกประกาศ/หนังสือเวียน เพื่อยกเลิกแบบรายงานนั้นๆ

**30. รายงานการแก้ไขเพิ่มเติมจำนวนและมูลค่าหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของกองทุน
เปิด ที่จะยกเลิก คืออะไร**

ตอบ เป็นรายงานตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ เรื่อง หลักเกณฑ์
และวิธีการจดทะเบียนทรัพย์สินเป็นกองทุนรวมประเภทรับซื้อคืนหน่วยลงทุน พ.ศ. 2536 ลงวันที่
30 กรกฎาคม พ.ศ. 2536 ที่ให้ส่งสำนักงานภายในวันทำการที่เจ็ดของเดือนถัดไป

31. รายงานการปฏิบัติ – หยุด ของผู้จัดการกองทุนบุคคล จะยกเลิกหรือไม่

ตอบ ยกเลิกไปแล้ว ปัจจุบันให้ส่งแบบขอแจ้งแต่งตั้ง/ สิ้นสุดผู้จัดการกองทุนหรือผู้จัดการลงทุน
ตามประกาศสำนักงาน ที่ สน. 27/2550 แทน

อื่นๆ

**32. หนังสือชี้ชวนที่ต้องส่งสำนักงาน ขอให้สำนักงานไป download จาก Web บริษัทจัดการ หรือ
ขอส่งเป็น File ได้หรือไม่**

ตอบ ถ้าเป็นหนังสือชี้ชวนของกองทุนรวมทั่วไป และกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์เพื่อผู้ลงทุน
ทั่วไป จำเป็นต้องให้ส่งเป็น File ผ่านระบบ MRAP ของสำนักงานอยู่แล้ว ส่วนกองทุนรวม
อสังหาริมทรัพย์ประเภทอื่นๆ ยังคงต้องส่งเป็น Hard Copy ให้สำนักงานทั้งนี้ เพื่อให้เป็นไปตามที่
ประกาศกำหนด

**33. ขอยายระยะเวลาการส่ง “รายงานการชำระบัญชี” ของกองทุนที่ได้รับการผ่อนผันระยะเวลา
การชำระบัญชีจากสำนักงาน เป็นปีละ 1-2 ครั้ง หรือเมื่อมีการเปลี่ยนแปลงอย่างมีสาระสำคัญ แทน
การส่งเป็นรายเดือน**

ตอบ ยังคงส่งเป็นรายเดือนเหมือนเดิม เนื่องจากสำนักงานต้องการใช้รายงานดังกล่าวเพื่อดูความ
พยายามของบริษัทจัดการในการขายหลักทรัพย์เพื่อคืนเงินให้แก่ผู้ถือหน่วยลงทุน โดยเร็ว ซึ่ง
ประกาศคณะกรรมการ กำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กน. 9/2540 เรื่อง หลักเกณฑ์
เงื่อนไข และวิธีการชำระบัญชีของกองทุนรวม ลงวันที่ 17 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2540 ได้กำหนดให้
ผู้ชำระบัญชีต้องชำระบัญชีให้เสร็จสิ้นภายในเก้าสิบวันนับตั้งแต่วันถัดจากวันเลิกกองทุนรวม