

**สรุปการเปลี่ยนแปลง**

1. รายงานรายละเอียดของหลักทรัพย์และทรัพย์สินที่ทุกกองทุนรวมลงทุนหรือมีไว้
2. รายงานรายละเอียดของหลักทรัพย์และทรัพย์สินที่ทุกกองทุนรวมลงทุนหรือมีไว้
3. รายงานรายละเอียดของหลักทรัพย์และทรัพย์สินที่ทุกกองทุนสำรองเลี้ยงชีพลงทุนหรือมีไว้

**เดิม** ใช้รูปแบบแจ้งข้อความที่แนบกับจดหมายอิเล็กทรอนิกส์ ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2552

**ใหม่** มีการเปลี่ยนแปลงตามด้านล่าง (ดูเอกสารวิธีการจัดทำรายงาน รูปแบบรายงาน และ validation message ประกอบ)

1. เพิ่มประเภทของ Reference Underlying ที่สัญญาอ้างอิง

Format ตาม e-mail ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2552	Format ตามรายงานใหม่
-	131 – Hedge Fund Index 132 – Fixed Income Index

2. แก้ไข/ยกเลิกรหัสประเภทการทำ Credit Derivatives &ของ Reference Underlying บางรหัส ที่เหลือคงเดิม

รายละเอียด	Format ตาม e-mail ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2552	Format ตามรายงานใหม่
รหัสประเภทการทำ Credit Derivatives & Structured Finance	01 – Credit Default Swaps	01 – Single Name CDS
	03 – Credit Default Option	03 – First-to-Default Swap
	04 – Credit Default Swaption	04 – Proportionate Default Swap
	05 – Credit Spread Option	ยกเลิก
	06 – Credit Spread Forward	ยกเลิก
	08 – Recovery Swaps	ยกเลิก

3. เปลี่ยนแปลงการรายงานเกี่ยวกับ Rating ของ Structured Finance โดยถ้าเป็น Structured Finance ให้รายงาน rating ของ structured finance แต่ถ้าเป็น Credit Derivative ให้รายงาน rating ของ reference underlying
4. ปรับปรุงเอกสารเกี่ยวกับการ validate ข้อมูลให้เป็นปัจจุบัน (ดูเอกสารแนบ Validation Message ประกอบ)

4. รายงานสถานะลงทุนของแต่ละกองทุนรวม
5. รายงานสถานะลงทุนของแต่ละกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์
6. รายงานสถานะการลงทุนของแต่ละกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

เดิม ใช้รูปแบบแฟ้มข้อความที่แนบกับจดหมายอิเล็กทรอนิกส์ ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2552

ใหม่ มีการเปลี่ยนแปลงตามด้านล่าง (ดูเอกสารวิธีการจัดทำรายงาน รูปแบบรายงาน และ validation message ประกอบ)

รายละเอียด	Format ตาม e-mail ลงวันที่ 4 กุมภาพันธ์ 2552	Format ตามรายงานใหม่
1. การรายงานเลขที่จดทะเบียนกองทุน	เป็นตัวเลขครบ 3 หลัก ได้แก่ 001	1. กองทุนรวม และกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ที่จดทะเบียนก่อนปี 2554 ให้รายงานเหมือนเดิม คือ เป็นตัวเลขครบ 3 หลัก ได้แก่ 001 2. กองทุนรวม และกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ที่จดทะเบียนตั้งแต่ปี 2554 ให้รายงานขึ้นต้นด้วย MF และตามด้วยตัวเลขครบ 4 หลัก ได้แก่ MF0001 3. กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้รายงานเหมือนเดิม คือ เป็นตัวเลขครบ 3 หลัก ได้แก่ 001
2. เพิ่มรหัสประเภทหลักทรัพย์/หนี้สิน	-	450 – ทองคำแท่ง
3. เพิ่มประเภทของ Reference Underlying ที่สัญญาอ้างอิง	-	131 – Hedge Fund Index 132 – Fixed Income Index
4. แก้ไข/ยกเลิกรหัสประเภทการทำ Credit Derivatives ของ Reference Underlying บางรหัส ที่เหลือคงเดิม	01 – Credit Default Swaps 03 – Credit Default Option 04 – Credit Default Swaption 05 – Credit Spread Option 06 – Credit Spread Forward 08 – Recovery Swaps	01 – Single Name CDS 03 – First-to-Default Swap 04 – Proportionate Default Swap ยกเลิก ยกเลิก ยกเลิก

**7. รายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของแต่ละกองทุนรวมเปิด**

เดิม คือ ข้อมูลการจัดการกองทุนรวมตามประกาศสำนักงานที่ สข/น. 23/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดการกองทุน ลงวันที่ 28 กรกฎาคม 2552 โดยใช้รูปแบบของข้อมูลการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนเปิดเป็นรายการกองทุน ที่แนบท้ายประกาศสำนักงานที่ สน. 12/2547 เรื่อง การจัดทำและ การเพิ่มข้อมูลและแบบรายงานของบริษัทจัดการ ลงวันที่ 17 กุมภาพันธ์ 2547

ใหม่ เปลี่ยนรูปแบบรายงานใหม่ (ดูเอกสารวิธีการจัดทำรายงาน รูปแบบรายงาน และ validation message ประกอบ)

**8. รายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของแต่ละกองทุนรวมเปิด เฉพาะกองทุนรวมเปิดที่มีนโยบายการลงทุนในตราสารหนี้**

เดิม คือ รายงานมูลค่าขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนที่ส่งตาม น.(ว) 29/2547 เรื่อง การนำเสนอข้อมูลกองทุนรวมในรูปแบบแฟ้มข้อความผ่านระบบ FTRS ลงวันที่ 30 กันยายน 2547

ใหม่ มีการเปลี่ยนแปลงตามด้านล่าง (ดูเอกสารวิธีการจัดทำรายงาน รูปแบบรายงาน และ validation message ประกอบ)

1. ลดการรายงานจากให้รายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนเปิดทุกกองทุน” เหลือเพียงรายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของ กองทุนเปิดที่เป็นกอง retail fund ที่ลงทุนในตราสารหนี้ตั้งแต่ 50 % ขึ้นไป และมีระยะเวลาการไถ่ถอนหน่วยลงทุนน้อยกว่า 15 วัน ทั้งนี้ “ไม่รวมกองทุนรวมเพื่อ การเลี้ยงชีพ กองทุนรวมวายุภักษ์ และกองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุนต่างประเทศ
2. แก้ไขชื่อ fields ที่มีการเปลี่ยนแปลงเพื่อให้ความหมายชัดเจนขึ้น และสำนักงานได้นำตัวเลขดังกล่าวมาใช้ในการกำกับดูแลธุรกิจจัดการกองทุน ได้แก่ มูลค่าขายหน่วยลงทุนไม่รวม IPO (บาท) และมูลค่า Switch-In ไม่รวม IPO (บาท)
3. เพิ่มการรายงานบรรทัดแรกของ File
4. หลัง field สุดท้ายของแต่ละบรรทัด ไม่ต้องจบด้วยตัว delimiter
5. ตั้งแต่บรรทัดที่ 2 ถึงบรรทัดสุดท้าย เปลี่ยนการรายงานจาก “ชื่อของกองทุน” เป็น “เลขที่จดทะเบียนกองทุน” และ “ปีที่จดทะเบียนกองทุน” โดยถ้าเป็น กองทุนรวมที่จดทะเบียนก่อนปี 2554 ให้รายงานเหมือนเดิม คือ เป็นตัวเลขครบ 3 หลัก ได้แก่ 001 ส่วน Fund Code ของกองทุนรวมที่จดทะเบียนตั้งแต่ปี 2554 ให้รายงานขึ้นต้นด้วย MF และตามด้วยตัวเลขครบ 4 หลัก ได้แก่ MF0001
6. ปรับปรุงการ validate ข้อมูล (ดูเอกสารแนบ Validation Message ประกอบ)

**9. รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ของทุกกองทุนรวม**

เดิม คือ รายงานการซื้อ/ขายหลักทรัพย์ที่ส่งตาม น.(ว) 29/2547 เรื่อง การนำเสนอข้อมูลกองทุนรวมในรูปแบบแฟ้มข้อความผ่านระบบ FTRS ลงวันที่ 30 กันยายน 2547

**ใหม่** มีการเปลี่ยนแปลงตามด้านล่าง (ดูเอกสารวิธีการจัดทำรายงาน รูปแบบรายงาน และ validation message ประกอบ)

1. เพิ่มการรายงานบรรทัดแรกของ File โดยวางข้อมูลให้รายงานเป็นวันทำการสุดท้ายของแต่ละเดือนเสมอ
2. หลัง field สุดท้ายของแต่ละบรรทัด ไม่ต้องจบด้วยตัว delimiter
3. ตั้งแต่บรรทัดที่ 2 ถึงบรรทัดสุดท้าย เปลี่ยน format วันที่ชื่อ/ชาย จาก dd/mm/yyyy เป็น yyyy/mm/dd
4. วิธีการส่งข้อมูล หากสำนักงานให้ส่งข้อมูลที่มีเดือนต่างกัน เช่น ให้ส่งข้อมูลตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2553 ถึงวันที่ 15 พฤศจิกายน 2553 ให้ส่งแยกเป็น 2 file โดย file แรก ระบุงวดข้อมูลเป็น 20101029 และข้อมูลภายใน file เป็นข้อมูลตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2553 ถึงวันที่ 29 ตุลาคม 2553 File ที่ 2 ระบุงวดข้อมูลเป็น 20101130 และข้อมูลภายใน file เป็นข้อมูลตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน 2553 ถึงวันที่ 15 พฤศจิกายน 2553
5. ปรับปรุงการ validate ข้อมูล (ดูเอกสารแนบ Validation Message ประกอบ)

#### **10. รายงานสถานะและการลงทุนของทุกกองทุนส่วนบุคคล**

**เดิม** คือ รายงานข้อมูลการลงทุนของกองทุนส่วนบุคคลทุกกองทุนตามประกาศสำนักงานที่ สข/น. 23/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดการกองทุน ลงวันที่ 28 กรกฎาคม 2552 โดยใช้รูปแบบของที่แนบท้ายประกาศสำนักงานที่ สน. 13/2547 เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการจัดทำและส่งรายงาน และการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับการจัดการกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 17 กุมภาพันธ์ 2547

**ใหม่** มีเปลี่ยนแปลงการรายงานตามด้านล่าง (ดูจาก format validation message และวิธีการจัดทำรายงานตามแนบ)

1. เปลี่ยนแปลงการรายงานบรรทัดแรกของ File
2. เพิ่มการรายงานจำนวนกองทุน มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของบุคคลธรรมดา/นิติบุคคล มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนเป้าหมายรายไตรมาส กองทุนประกันสังคม และอื่นๆ แทนการส่งรายงานข้อมูลข้างต้นทางจดหมายอิเล็กทรอนิกส์
3. หลัง field สุดท้ายของแต่ละบรรทัด ไม่ต้องจบด้วยตัว delimiter

4. ปรับปรุงรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน ดังนี้

รายละเอียด	รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สินตามรายงาน PF1000 เดิม	รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สินตามรายงาน PF1000 ใหม่
<p>1. ปรับปรุงการรายงานรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน โดยยกเลิกรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สินตามรายงาน PF1000 เดิม</p>	<p>104 – หนี้กู้แปลงสภาพ                      105 – หนี้กู้ด้อยสิทธิ                      106 – หนี้กู้ด้อยสิทธิแปลงสภาพ                      107 – หนี้กู้ด้อยสิทธิควมใบสำคัญแสดงสิทธิ                      123 – ธุรกิจกรมการให้ยืมหลักทรัพย์ประเภทตราสารแห่งหนึ่ง                      201 – เงินฝากธนาคาร                      206 – พันธบัตรรัฐบาล                      207 – พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ                      208 – พันธบัตรที่กระทรวงการคลังเป็นผู้รับอวัล ผู้ค่าประกัน                      209 – พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย                      210 – พันธบัตรหรือตราสารหนี้ที่ FIDF เป็นผู้ออก ผู้รับอวัล ผู้ค่าประกัน                      499 – ประเภทหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นตามที่สำนักงานกำหนด</p>	<p>ให้รายงานเป็น 103 – หนี้กู้                      ให้รายงานเป็น 122 – ธุรกิจกรมการให้ยืมหลักทรัพย์                      ให้รายงานเป็น                      216 – เงินฝากธนาคารประเภทออมทรัพย์                      217 – เงินฝากธนาคารประเภทกระแสรายวัน                      218 – เงินฝากธนาคารประเภทประจำ                      ให้รายงานเป็น 213 พันธบัตร                      ยกเลิก</p>

รายละเอียด	รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สินตาม รายงาน PF1000 เดิม	รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สินตาม รายงาน PF1000 ใหม่
2. เปลี่ยนแปลงนิยามของรหัสประเภท สินทรัพย์/หนี้สิน	<p>122 - ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ประเภทตราสารแห่งทุน</p> <p>202 - บัตรเงินฝาก</p> <p>203 - ตั๋วสัญญาใช้เงิน</p> <p>204 - ตั๋วแลกเงิน</p> <p>213 - พันธบัตรต่างประเทศ</p> <p>404 - ออปชั่นในสถานะซื้อ (Long Option)</p>	<p>122 - ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์</p> <p>202 - บัตรเงินฝาก/หนังสือยืนยันการรับฝากเงินแบบมีระยะเวลา (NCD/CD Term)</p> <p>203 - ตั๋วสัญญาใช้เงินแบบมีระยะเวลา (PN Term)</p> <p>204 - ตั๋วแลกเงินแบบมีระยะเวลา (BE Term)</p> <p>213 - พันธบัตร</p> <p>ทั้งนี้ พันธบัตรทุกประเภทที่ออกในประเทศและต่างประเทศให้รายงานเป็นรหัสสินทรัพย์ทั้งหมด</p> <p>404 - ออปชั่น</p>
3. เพิ่มรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน		<p>124 - ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนผสม</p> <p>125 - ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงที่เป็นตราสารแห่งนี้</p> <p>129 - ใบสำคัญแสดงสิทธิ/ใบแสดงสิทธิที่จะซื้อหลักทรัพย์ประเภทอื่น ๆ</p> <p>139 - หน่วยลงทุนของกองทุนแบบอื่น ๆ</p> <p>216 - เงินฝากธนาคารประเภทออมทรัพย์</p> <p>217 - เงินฝากธนาคารประเภทกระแสรายวัน</p> <p>218 - เงินฝากธนาคารประเภทประจำ</p> <p>219 - สลากออมทรัพย์ที่สิ้นของชงส./สลากออมทรัพย์สิ้นของชงส.ที่ออกตามมาตรา 10(3) แห่งพระราชบัญญัติธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร พ.ศ. 2509 และที่มีลักษณะทำนองเดียวกันกับ สลากออมทรัพย์วีรสิน</p> <p>220 - สลากออมสินพิเศษของธนาคารออมสิน</p> <p>221 - ตั๋วสัญญาใช้เงินแบบเพื่อเรียก (PN Call)</p> <p>222 - Euro Commercial Paper</p> <p>223 - ตั๋วแลกเงินแบบเพื่อเรียก (BE Call)</p> <p>224 - บัตรเงินฝาก/หนังสือยืนยันการรับฝากเงินแบบเพื่อเรียก (NCD/CD Call)</p>

รายละเอียด	รหัสประเภทหลักทรัพย์/หนี้สินตามรายงาน PF1000 เดิม	รหัสประเภทหลักทรัพย์/หนี้สินตามรายงาน PF1000 ใหม่
3. เพิ่มรหัสประเภทหลักทรัพย์/หนี้สิน (ต่อ)		306 – สังหาริมทรัพย์ 307 – สัญญาค่าประกันของธนาคาร 308 – เชอริช อะพาร์ตเมนต์ 405 – ตราสารหนี้ที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Structured Notes) 406 – สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีการเคลื่อนย้ายความเสี่ยงทางด้านเครดิต (Credit Derivatives) 407 – Structured Finance 450 – ทองคำแท่ง 500 – เงินสดย่อย 503 – มาร์จิ้น หรือ เงิน/สินทรัพย์ที่วางเป็นประกัน 511 – ค่าเผื่อการด้อยค่าของหลักทรัพย์ 512 – ค่าเผื่อการด้อยค่าของสังหาริมทรัพย์/สังหาริมทรัพย์ 615 – ธุรกิจการขายโดยมีสัญญาซื้อคืน (REPO) 616 – ธุรกิจการกู้ยืมเงิน 617 – ธุรกิจขายหลักทรัพย์โดยที่ยังไม่มีหลักทรัพย์นั้นอยู่ในครอบครอง (Short Sale) 618 – ธุรกิจการกู้ยืมหลักทรัพย์

5. ปรับปรุงรหัสตลาด ดังนี้

รายละเอียด	รหัสตลาดตามรายงาน PF1000 เดิม	รหัสตลาดตามรายงาน PF1000 ใหม่
1. เปลี่ยนแปลงนิยามของรหัสตลาด	000 – No Market	000 – นอกตลาดในประเทศ (Local Over the Counter Market)
2. เปลี่ยนรหัสตลาด	008 – Other (MAI)	007 – ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (MAI)
3. ยกเลิก	002 - BSDC	-
4. เพิ่มรหัสตลาด		005 – ตลาดตราสารหนี้ (BEX) 006 – บริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX) 008 – ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย (AFET) 100 – นอกตลาดต่างประเทศ (International Over the Counter Market) 101 – ตลาดต่างประเทศ (International Market) 999 – อื่นๆ (Others)

6. เปลี่ยนแปลงชื่อ field และ/หรือ ความยาวของ field ดังนี้

การเปลี่ยนแปลง	PF1000 เดิม		PF1000 ใหม่	
	ชื่อ field	Length	ชื่อ field	Length
ชื่อ field และ length	1. จำนวนหน่วยยกมา	num(19,2)	จำนวนหน่วยยกมาจากสิ้นเดือนที่แล้ว	num(12,2)
	2. จำนวนหน่วยชื่อหรือเพิ่ม	num(19,2)	จำนวนหน่วยชื่อหรือเพิ่มในเดือนนี้	num(12,2)
ชื่อ field	3. มูลค่าขายหรือลด	num(12,2)	มูลค่าขายหรือลดในเดือนนี้	num(19,2)
	4. มูลค่ายกมา	num(19,2)	มูลค่ายกมาจากสิ้นเดือนที่แล้ว	คงเดิม
	5. มูลค่าชื่อหรือเพิ่ม	num(19,2)	มูลค่าชื่อหรือเพิ่มในเดือนนี้	คงเดิม
	6. จำนวนหน่วยขายหรือลด	num(12,2)	จำนวนหน่วยขายหรือลดในเดือนนี้	คงเดิม
	7. จำนวนหน่วยคงเหลือ	num(12,2)	จำนวนหน่วยคงเหลือ ณ สิ้นเดือนนี้	คงเดิม

7. ปรับปรุงการ validate ข้อมูล (ดูเอกสารแนบ Validation Message ประกอบ)