

สิ่งที่ส่งมาด้วย 2 : สรุปรายละเอียดการปรับปรุงแบบรายงานทั้งหมด

1. ภาพรวมการปรับปรุงแบบรายงาน

| ข้อมูลที่ปรับปรุง | แบบรายงาน | ความถี่ | รายละเอียดการปรับปรุง |
|--|-------------------|-------------------------------------|--|
| 1. แบบรายงาน Stress Test | STRESSTEST | รายเดือน | เปิดเป็นแบบรายงานใหม่ |
| 2. รายงาน exposure | MF01 & PVD01 | รายเดือน | เพิ่มการรายงานค่าความเสี่ยง Gross Exposure, Net Exposure และ Value at Risk รายกองทุน |
| 3. รายงานกลยุทธ์ของ Hedge Fund | MF01 ระบบ OFAM | รายเดือน เมื่อจัดตั้ง โครงการ | เพิ่มการรายงาน exposure ของกลยุทธ์การลงทุน ที่กองทุนเลือกใช้ เพิ่มการรายงานกลยุทธ์การลงทุน |
| 4. รายงานการใช้ Prime Broker ของ Hedge Fund | ระบบ OFAM | เมื่อจัดตั้ง โครงการ | เพิ่มการรายงาน Prime Broker ที่กองทุนเลือกใช้ (ถ้ามี) |
| 5. รายงานการดำรงสินทรัพย์ สภาพคล่องของกองทุนรวม | MF01 | รายเดือน | เพิ่มการรายงานการจัดชั้นสภาพคล่องรายหลักทรัพย์ และ ค่า Portfolio Duration ของกองทุน |
| 6. รายงานการขายและ รับซื้อคืนหน่วยลงทุน | A-2 | รายวัน | เพิ่มขอบเขตของกองทุนที่ต้องรายงานเป็นกองทุนรวมเปิด ทุกกองทุน |
| 7. รายงานการลงทุน ในต่างประเทศและ ตราสารอนุพันธ์ | MF01 & PVD01 | รายเดือน | เพิ่มการรายงาน - ประเทศของผู้ถือหลักทรัพย์ - มูลค่าการลงทุนในหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์ ต่างประเทศในรูปสกุลเงินของประเทศที่กองทุนไปลงทุน |

2. รายละเอียดการปรับปรุงแบบรายงาน

2.1 แบบรายงาน Stress Test

| วัตถุประสงค์ | เพื่อใช้ติดตามความเสี่ยงของกองทุนรวม UI Fund และมีระบบรองรับการรายงานตามที่ประกาศสำนักงานกำหนด ¹ | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------------------------|---|----------------|----------|----------------|-------------|----|--|-------------|----|--|----------------|----|--|-------------|----|--|------------------------------|--|--|
| ผู้เกี่ยวข้อง | บลจ. ที่จัดการกองทุนรวม | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ขอบเขต | กองทุนรวม UI Fund <u>เฉพาะ</u> ที่ระบุค่าความเสี่ยงสูงสุดเมื่อตั้งกองในระบบ OFAM ดังต่อไปนี้ 1. มีการทำธุรกรรมสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ไม่ซับซ้อนโดยมีวัตถุประสงค์มิใช่เพื่อป้องกันความเสี่ยง หรือมีการทำธุรกรรม financing อื่น ๆ (ได้แก่ กู้ยืมเงินและ REPO เพื่อประโยชน์ในการจัดการลงทุน และ short sell) และระบุมูลค่าการทำธุรกรรมรวมสูงสุด > 100%nav 2. มีการทำธุรกรรมสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ซับซ้อนโดยมีวัตถุประสงค์มิใช่เพื่อป้องกันความเสี่ยง และระบุค่าความเสี่ยงสูงสุด absolute VaR > 20%nav หรือ relative VaR > 2 เท่าของ Benchmark | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| แบบรายงาน | แบบรายงาน Stress Test | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ระบบงาน | ระบบ OFAR | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| การปรับปรุง | เปิดแบบรายงานใหม่ รายงานในรูปแบบ text file | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ความถี่ | รายเดือน | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| รายละเอียด | รายงานผล Stress Test โดยให้ระบุข้อมูล (1) Risk Factor (2) ข้อสมมติ และ (3) ผลกระทบ (%nav) ดังต่อไปนี้ <table><tr><th>Risk Factor</th><th>ข้อสมมติ</th><th>ผลกระทบ (%nav)</th></tr><tr><td>Market Risk</td><td>1/</td><td></td></tr><tr><td>Credit Risk</td><td>2/</td><td></td></tr><tr><td>Liquidity Risk</td><td>3/</td><td></td></tr><tr><td>Other Risks</td><td>4/</td><td></td></tr><tr><td>ผล Stress Test ของทั้งกอง 5/</td><td></td><td></td></tr></table> 1/ เช่น การเปลี่ยนแปลงของราคา หรือดัชนีราคาหุ้น, yield curve, ราคาสินค้าโภคภัณฑ์ อัตราแลกเปลี่ยน หรืออื่น ๆ 2/ เช่น การเปลี่ยนแปลงของ credit spread, probability of default หรืออื่น ๆ 3/ เช่น การเปลี่ยนแปลงของ liquidity spread การกำหนด liquidity haircut หรืออื่น ๆ 4/ ความเสี่ยงอื่น ๆ ที่อาจส่งผลกระทบต่อพอร์ตกองทุน 5/ ผลกระทบโดยรวมต่อพอร์ตกองทุน หมายเหตุ : 1. ให้ บลจ. เลือก Risk Factor เอง โดยมีข้อสมมติจาก most likely stress event | Risk Factor | ข้อสมมติ | ผลกระทบ (%nav) | Market Risk | 1/ | | Credit Risk | 2/ | | Liquidity Risk | 3/ | | Other Risks | 4/ | | ผล Stress Test ของทั้งกอง 5/ | | |
| Risk Factor | ข้อสมมติ | ผลกระทบ (%nav) | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Market Risk | 1/ | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Credit Risk | 2/ | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Liquidity Risk | 3/ | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Other Risks | 4/ | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ผล Stress Test ของทั้งกอง 5/ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

¹ ข้อ 6 ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 13/2560 เรื่อง ระบบงานและการรายงานเกี่ยวกับการทำธุรกรรมของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ ลงวันที่ 20 กุมภาพันธ์ 2560

| | <div>2. รายละเอียดของแบบจำลองและที่มาของข้อมูล ให้จัดเก็บไว้ที่ บลจ.</div> <div>ทั้งนี้ ให้รายงานในรูปแบบของ text file ซึ่งประกอบด้วย</div> <div>1. Header ประกอบด้วย</div> <div>รหัสบริษัทจัดการ ชื่อแบบรายงาน (STRESSTEST) งวดข้อมูล</div> <div>2. Data ประกอบด้วย</div> <div>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน Risk Factor (01-05) ข้อมูล ผลกระทบ (%nav)</div> | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|---|----------------|--------|----------------|------------------|--------------|----------|------------------|--|--|---------------------|--|--|------------------|--|----------|--------------------------------|--|----------|
| <div>ตัวอย่าง</div> <div>การรายงาน</div> | <div>บลจ. BCD (รหัสบริษัทจัดการ 0123456789) จัดการกองทุน BCD Equity Flexible Hedge Fund ซึ่งจดทะเบียนเป็นกองทุน UI Fund (เลขที่จดทะเบียน MF1234/2561) มีการใช้กลยุทธ์ Volatility Arbitrage โดยมีการลงทุนใน options ที่มีความซับซ้อน ซึ่ง บลจ. ได้ระบุไว้ในโครงการว่าจะคำนวณค่าความเสี่ยงโดยใช้ Absolute VaR และมีเพดานความเสี่ยงไม่เกิน 25%nav ซึ่งต้องรายงานผลการจัดทำ stress test ของกองทุนดังกล่าวให้สำนักงานทุกเดือน โดยในเดือน ก.ย. 61 บลจ. ได้จัดทำ stress test โดยกำหนด risk factors ที่เกี่ยวข้อง ได้แก่ Market Risk และ Volatility Risk โดยมีผลการจัดทำ ดังต่อไปนี้</div> <table><tr><th>Risk Factor</th><th>ข้อมูล</th><th>ผลกระทบ (%nav)</th></tr><tr><td>01 : Market Risk</td><td>หุ้นขึ้น 20%</td><td>25.18420</td></tr><tr><td>02 : Credit Risk</td><td></td><td></td></tr><tr><td>03 : Liquidity Risk</td><td></td><td></td></tr><tr><td>04 : Other Risks</td><td>Volatility ของหุ้น underlying ลดลง 10%</td><td>15.64096</td></tr><tr><td>05 : ผล Stress Test ของทั้งกอง</td><td></td><td>30.16245</td></tr></table> <div>วิธีการรายงาน ให้รายงานข้อมูลเป็น text file ดังนี้</div> <div><div>Header</div><div>0123456789 STRESSTEST 20180928</div><div><div>Data</div><div>MF1234 2561 01 หุ้นขึ้น 20% 25.18420</div><div>MF1234 2561 02 </div><div>MF1234 2561 03 </div><div>MF1234 2561 04 Volatility ของหุ้น underlying ลดลง 10% 15.64096</div><div>MF1234 2561 05 30.16245</div></div></div> | Risk Factor | ข้อมูล | ผลกระทบ (%nav) | 01 : Market Risk | หุ้นขึ้น 20% | 25.18420 | 02 : Credit Risk | | | 03 : Liquidity Risk | | | 04 : Other Risks | Volatility ของหุ้น underlying ลดลง 10% | 15.64096 | 05 : ผล Stress Test ของทั้งกอง | | 30.16245 |
| Risk Factor | ข้อมูล | ผลกระทบ (%nav) | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 01 : Market Risk | หุ้นขึ้น 20% | 25.18420 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 02 : Credit Risk | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 03 : Liquidity Risk | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 04 : Other Risks | Volatility ของหุ้น underlying ลดลง 10% | 15.64096 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 05 : ผล Stress Test ของทั้งกอง | | 30.16245 | | | | | | | | | | | | | | | | | |

2.2 รายงาน Exposure

| | |
|---------------|---|
| วัตถุประสงค์ | เพื่อติดตามฐานะการลงทุนและ leverage ของกองทุน |
| ผู้เกี่ยวข้อง | 1. บลจ. ที่จัดการกองทุนรวมหรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ 2. บล. และบ.ประกัน ที่จัดการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ |
| ขอบเขต | กองทุนรวมและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพที่มีการทำธุรกรรมสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีใช้เพื่อป้องกันความเสี่ยง หรือทำธุรกรรมกู้ยืมเงินและ REPO เพื่อประโยชน์ในการจัดการลงทุน หรือทำธุรกรรม Short Sell |
| แบบรายงาน | OS_MF01 และ OS_PVD01 |
| ระบบงาน | ระบบ OFAR |
| การปรับปรุง | ปรับปรุงเพิ่มเติมจากแบบรายงานเดิม |
| ความถี่ | รายเดือน |
| รายละเอียด | <p>1. เจาะเนิการรายงาน</p> <p>1.1 ให้รายงานค่าความเสี่ยง max, min, average และค่า ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน (กรณี PVD ให้ใช้ค่า ณ วันสิ้นเดือน) โดยรายงานค่า Net Exposure ที่คำนวณตามวิธี Commitment Approach หรือค่า Absolute VaR หรือค่า Relative VaR (รายงานค่าตามที่ระบุไว้ในรายละเอียดโครงการจัดการกองทุนรวม)²</p> <p>1.2 ให้รายงานค่าความเสี่ยง Gross Exposure³ ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน (กรณี PVD ให้ใช้ค่า ณ วันสิ้นเดือน) โดยกรณี 1.2 ให้รายงานทุกกองทุนรวม</p> <p>2. รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน</p> <p>เพิ่มรหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สินเพื่อรองรับการรายงานค่าความเสี่ยงของกองทุน ได้แก่</p> <p>รหัส 921 : Net Exposure ที่คำนวณตามวิธี Commitment Approach (ค่า max ในระหว่างเดือน)</p> <p>รหัส 922 : Net Exposure ที่คำนวณตามวิธี Commitment Approach (ค่า min ในระหว่างเดือน)</p> <p>รหัส 923 : Net Exposure ที่คำนวณตามวิธี Commitment Approach (ค่า average ในระหว่างเดือน)</p> <p>รหัส 924 : Net Exposure ที่คำนวณตามวิธี Commitment Approach (ค่า ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน)*</p> <p>รหัส 925 : ค่า Absolute VaR ที่คำนวณตามวิธี VaR Approach (ค่า max ในระหว่างเดือน)</p> <p>รหัส 926 : ค่า Absolute VaR ที่คำนวณตามวิธี VaR Approach (ค่า min ในระหว่างเดือน)</p> <p>รหัส 927 : ค่า Absolute VaR ที่คำนวณตามวิธี VaR Approach (ค่า average ในระหว่างเดือน)</p> <p>รหัส 928 : ค่า Absolute VaR ที่คำนวณตามวิธี VaR Approach (ค่า ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน)*</p> <p>รหัส 929 : ค่า Relative VaR ที่คำนวณตามวิธี VaR Approach (ค่า max ในระหว่างเดือน)</p> |

² ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 92/2558 เรื่อง หลักเกณฑ์เพิ่มเติมกรณี กองทุนลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง ลงวันที่ 17 ธันวาคม 2558

³ Gross Exposure = เงินลงทุน + Notional Amount ของ derivatives (รวม embedded derivatives ใน structured notes) + Borrowing + REPO + Short Sell + Securities Borrowing

| | |
|-----------------------|---|
| | <p>รหัส 930 : ค่า Relative VaR ที่คำนวณตามวิธี VaR Approach (ค่า min ในระหว่างเดือน)</p> <p>รหัส 931 : ค่า Relative VaR ที่คำนวณตามวิธี VaR Approach (ค่า average ในระหว่างเดือน)</p> <p>รหัส 932 : ค่า Relative VaR ที่คำนวณตามวิธี VaR Approach (ค่า ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน)*</p> <p>รหัส 933 : ค่า Gross Exposure ของกองทุน (ค่า ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน)*</p> <p>* กรณี PVD ให้รายงานค่า ณ วันสิ้นเดือน</p> <p>3. การรายงานในรูปแบบ text file</p> <p>ยังคงใช้ format การรายงานแบบเดียวกับกลุ่มข้อมูลการลงทุนในสินทรัพย์ / หนี้สินค้างรับค้างจ่าย มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ จำนวนหน่วยลงทุน และอื่น ๆ กล่าวคือ</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน ค่าความเสี่ยงที่คำนวณได้ (หน่วยบาทในกรณี Exposure, หน่วย % ในกรณี Absolute VaR หรือ หน่วยเท่าในกรณี Relative VaR) รหัสสกุลเงิน</p> |
| ตัวอย่าง การรายงาน | <p>ในเดือน ก.ย. 61 ฝ่ายบริหารความเสี่ยงของบลจ. BCD ได้คำนวณค่า Absolute VaR ของกองทุน BCD Equity Flexible Hedge Fund โดยคำนวณค่า max, min และ average ระหว่างเดือน ได้เท่ากับ 24.10973%, 16.55242% และ 20.45127% ตามลำดับ และมีค่า ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน เท่ากับ 22.66360% ขณะที่ค่า Gross Exposure ของกองทุน ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน คำนวณได้เท่ากับ 180,139,240.105468 บาท</p> <p><u>วิธีการรายงาน</u></p> <p>ให้รายงานข้อมูลในส่วนของ text file data ในแบบรายงาน MF01 เพื่อแสดงถึงค่าความเสี่ยง Absolute VaR ซึ่งประกอบไปด้วยค่า max ระหว่างเดือน (รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน 925) ค่า min ระหว่างเดือน (รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน 926) ค่า average ระหว่างเดือน (รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน 927) ค่า ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน (รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน 928) และ ค่า Gross Exposure ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน (รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน 933) ดังต่อไปนี้</p> <p>...</p> <p>MF1234 2561 925 24.10973 THB</p> <p>MF1234 2561 926 16.55242 THB</p> <p>MF1234 2561 927 20.45127 THB</p> <p>MF1234 2561 928 22.66360 THB</p> <p>MF1234 2561 933 180139240.105468 THB</p> |

2.3 รายงานกลยุทธ์การลงทุนของ Hedge Fund

| วัตถุประสงค์ | เพื่อติดตามความเสี่ยงพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวม UI Fund โดยเฉพาะกองทุนประเภท Hedge Fund ที่มีกลยุทธ์การลงทุนแบบซับซ้อนหรือเสี่ยงสูง รวมทั้งเปิดเผยกลยุทธ์การลงทุนของกองทุนให้ผู้ลงทุนทราบ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|------------------------------------|--|-----------------|-----------------|------------------------------------|----------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|-------------------------|------------------------------------|---------------------------|------------------|---------------------|---------------------|----------------------------|-----------------------|-------|-------------------|-----------------|------------------------|----------------|----------------------------|--------|
| ผู้เกี่ยวข้อง | บลจ. ที่จัดการกองทุนรวม | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ขอบเขต | เฉพาะกองทุนรวม UI Fund | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| แบบรายงาน | แบบรายงาน MF01 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ระบบงาน | ระบบ OFAM | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| การปรับปรุง | 1. แบบรายงาน OS_MF01 : ปรับปรุงเพิ่มเติมจากแบบรายงานเดิม 2. ระบบ OFAM : เพิ่ม 1 หัวข้อให้รายงาน | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ความถี่ | 1. แบบรายงาน OS_MF01 : รายเดือน 2. ระบบ OFAM : เมื่อตั้งกอง | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| รายละเอียด | <p>1. ระบบ OFAM : เมื่อจัดตั้งกอง</p> <p>กำหนดเงื่อนไขกรณีกองทุนรวม UI Fund ให้มีการรายงานกลยุทธ์การลงทุน โดยเพิ่มหัวข้อ “กลยุทธ์การลงทุนของกองทุน (Investment Strategy)” เพื่อรองรับการรายงานในลักษณะของ drop down list เพื่อให้เลือกกลยุทธ์การลงทุนของกองทุน</p> <ul style="list-style-type: none"> - หากเลือกกลยุทธ์การลงทุน = “อื่น ๆ” ระบบจะแสดง text box เพื่อให้ระบุชื่อกลยุทธ์การลงทุน - หากเลือกกลยุทธ์การลงทุน = “Multi Strategy” บลจ. ต้องรายงานข้อมูลทุกวันทำการสุดท้ายของเดือนของกองทุนดังกล่าวในแบบรายงาน OS_MF01 เพื่อให้ทราบการเปลี่ยนแปลงกลยุทธ์การลงทุนในแต่ละเดือน <p>ทั้งนี้ ประเภทกลยุทธ์การลงทุนของกองทุน (Investment Strategy) ที่ให้เลือก ประกอบด้วย</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>กลยุทธ์การลงทุน</th> <th>กลยุทธ์การลงทุน</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Plain Strategy* : หุ้น หรือกองหุ้น</td> <td>Volatility Arbitrage</td> </tr> <tr> <td>Plain Strategy* : หนี้ หรือกองหนี้</td> <td>Distress / Restructuring Assets</td> </tr> <tr> <td>Plain Strategy* : ผสม หรือกองผสม</td> <td>Risk / Merger Arbitrage</td> </tr> <tr> <td>Plain Strategy : สินทรัพย์ทางเลือก</td> <td>Equity Special Situations</td> </tr> <tr> <td>Equity Long Bias</td> <td>Credit Long / Short</td> </tr> <tr> <td>Equity Long / Short</td> <td>Credit Asset Based Lending</td> </tr> <tr> <td>Equity Market Neutral</td> <td>Macro</td> </tr> <tr> <td>Equity Short Bias</td> <td>Managed Futures</td> </tr> <tr> <td>Fixed Income Arbitrage</td> <td>Multi Strategy</td> </tr> <tr> <td>Convertible Bond Arbitrage</td> <td>อื่น ๆ</td> </tr> </tbody> </table> <p>* เช่น การลงทุนแบบ Less Diversification</p> | กลยุทธ์การลงทุน | กลยุทธ์การลงทุน | Plain Strategy* : หุ้น หรือกองหุ้น | Volatility Arbitrage | Plain Strategy* : หนี้ หรือกองหนี้ | Distress / Restructuring Assets | Plain Strategy* : ผสม หรือกองผสม | Risk / Merger Arbitrage | Plain Strategy : สินทรัพย์ทางเลือก | Equity Special Situations | Equity Long Bias | Credit Long / Short | Equity Long / Short | Credit Asset Based Lending | Equity Market Neutral | Macro | Equity Short Bias | Managed Futures | Fixed Income Arbitrage | Multi Strategy | Convertible Bond Arbitrage | อื่น ๆ |
| กลยุทธ์การลงทุน | กลยุทธ์การลงทุน | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Plain Strategy* : หุ้น หรือกองหุ้น | Volatility Arbitrage | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Plain Strategy* : หนี้ หรือกองหนี้ | Distress / Restructuring Assets | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Plain Strategy* : ผสม หรือกองผสม | Risk / Merger Arbitrage | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Plain Strategy : สินทรัพย์ทางเลือก | Equity Special Situations | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Equity Long Bias | Credit Long / Short | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Equity Long / Short | Credit Asset Based Lending | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Equity Market Neutral | Macro | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Equity Short Bias | Managed Futures | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Fixed Income Arbitrage | Multi Strategy | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Convertible Bond Arbitrage | อื่น ๆ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| | <p>2. แบบรายงาน OS_MF01 : หลังจากจัดตั้งกองแล้ว</p> <p>กำหนดให้เฉพาะกองทุน UI Fund ที่เลือกกลยุทธ์การลงทุนของกองทุน (Investment Strategy) = “Multi Strategy” เท่านั้น ที่ บลจ. ต้องรายงานข้อมูล exposure ของกลยุทธ์การลงทุนที่กองทุนเลือกใช้ ณ วันทำการสุดท้ายของแต่ละเดือน โดยสำนักงานจะเพิ่มรหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สินเพื่อรองรับการรายงาน ดังนี้</p> <table><tr><th>รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน</th><th>กลยุทธ์การลงทุน</th><th>รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน</th><th>กลยุทธ์การลงทุน</th></tr><tr><td>941</td><td>Plain Strategy* : หุ้น หรือกองทุน</td><td>951</td><td>Volatility Arbitrage</td></tr><tr><td>942</td><td>Plain Strategy* : หนี้ หรือกองทุน</td><td>952</td><td>Distress / Restructuring Assets</td></tr><tr><td>943</td><td>Plain Strategy* : ผสม หรือกองทุนผสม</td><td>953</td><td>Risk / Merger Arbitrage</td></tr><tr><td>944</td><td>Plain Strategy : สินทรัพย์ทางเลือก</td><td>954</td><td>Equity Special Situations</td></tr><tr><td>945</td><td>Equity Long Bias</td><td>955</td><td>Credit Long / Short</td></tr><tr><td>946</td><td>Equity Long / Short</td><td>956</td><td>Credit Asset Based Lending</td></tr><tr><td>947</td><td>Equity Market Neutral</td><td>957</td><td>Macro</td></tr><tr><td>948</td><td>Equity Short Bias</td><td>958</td><td>Managed Futures</td></tr><tr><td>949</td><td>Fixed Income Arbitrage</td><td>959</td><td>อื่น ๆ</td></tr><tr><td>950</td><td>Convertible Bond Arbitrage</td><td></td><td></td></tr></table> <p>* เช่น การลงทุนแบบ Less Diversification</p> <p>การรายงานในรูปแบบ text file กรณีที่ต้องรายงานผ่านแบบรายงาน MF01</p> <p>ยังคงใช้ format การรายงานแบบเดียวกับกลุ่มข้อมูลการลงทุนในสินทรัพย์ / หนี้สินค้างรับค้างจ่าย มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ จำนวนหน่วยลงทุน และอื่น ๆ กล่าวคือ</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน exposure ของกลยุทธ์การลงทุนนั้น ๆ (บาท) รหัสสกุลเงิน</p> | รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน | กลยุทธ์การลงทุน | รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน | กลยุทธ์การลงทุน | 941 | Plain Strategy* : หุ้น หรือกองทุน | 951 | Volatility Arbitrage | 942 | Plain Strategy* : หนี้ หรือกองทุน | 952 | Distress / Restructuring Assets | 943 | Plain Strategy* : ผสม หรือกองทุนผสม | 953 | Risk / Merger Arbitrage | 944 | Plain Strategy : สินทรัพย์ทางเลือก | 954 | Equity Special Situations | 945 | Equity Long Bias | 955 | Credit Long / Short | 946 | Equity Long / Short | 956 | Credit Asset Based Lending | 947 | Equity Market Neutral | 957 | Macro | 948 | Equity Short Bias | 958 | Managed Futures | 949 | Fixed Income Arbitrage | 959 | อื่น ๆ | 950 | Convertible Bond Arbitrage | | |
|---|--|----------------------------|---------------------------------|----------------------------|-----------------|-----|-----------------------------------|-----|----------------------|-----|-----------------------------------|-----|---------------------------------|-----|-------------------------------------|-----|-------------------------|-----|------------------------------------|-----|---------------------------|-----|------------------|-----|---------------------|-----|---------------------|-----|----------------------------|-----|-----------------------|-----|-------|-----|-------------------|-----|-----------------|-----|------------------------|-----|--------|-----|----------------------------|--|--|
| รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน | กลยุทธ์การลงทุน | รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน | กลยุทธ์การลงทุน | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 941 | Plain Strategy* : หุ้น หรือกองทุน | 951 | Volatility Arbitrage | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 942 | Plain Strategy* : หนี้ หรือกองทุน | 952 | Distress / Restructuring Assets | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 943 | Plain Strategy* : ผสม หรือกองทุนผสม | 953 | Risk / Merger Arbitrage | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 944 | Plain Strategy : สินทรัพย์ทางเลือก | 954 | Equity Special Situations | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 945 | Equity Long Bias | 955 | Credit Long / Short | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 946 | Equity Long / Short | 956 | Credit Asset Based Lending | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 947 | Equity Market Neutral | 957 | Macro | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 948 | Equity Short Bias | 958 | Managed Futures | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 949 | Fixed Income Arbitrage | 959 | อื่น ๆ | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 950 | Convertible Bond Arbitrage | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ตัวอย่างกรณีการรายงานผ่านแบบรายงาน MF01 | <p>กองทุน BCD Equity Flexible Hedge Fund เป็นกองทุนที่กำหนดกลยุทธ์การลงทุน (Investment Strategy) ในโครงการเป็น “Multi Strategy” โดยในเดือน พ.ย. 61 กองทุนได้เปลี่ยนกลยุทธ์จาก Volatility Arbitrage ไปเป็นกลยุทธ์ Equity Long / Short และกลยุทธ์ Convertible Bond Arbitrage ทั้งนี้ exposure ของกลยุทธ์ Equity Long / Short คิดเป็น 157,029,189.00351 บาท ขณะที่ exposure ของกลยุทธ์ Convertible Bond Arbitrage คิดเป็น 28,236,165.42708 บาท</p> <p>วิธีการรายงาน</p> <p>ให้รายงานข้อมูลในส่วนของ text file data ในแบบรายงาน MF01 เพื่อแสดงถึง exposure ของการใช้กลยุทธ์การลงทุน Equity Long / Short (รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน 946) และการใช้กลยุทธ์การลงทุน Convertible Bond Arbitrage (รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน 950) ดังต่อไปนี้</p> <p>...</p> <p>MF1234 2561 946 157029189.00351 THB</p> <p>MF1234 2561 950 28236165.42708 THB</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

2.4 รายงานการใช้ Prime Broker ของ Hedge Fund

| | |
|---------------|---|
| วัตถุประสงค์ | เพื่อเปิดเผย Prime Broker ที่กองทุน UI Fund ประเภท Hedge Fund ใช้บริการให้ผู้ลงทุนทราบ และติดตามความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับ Prime Broker ดังกล่าว |
| ผู้เกี่ยวข้อง | บลจ. ที่จัดการกองทุนรวม |
| ขอบเขต | เฉพาะกองทุนรวม UI Fund |
| แบบรายงาน | - |
| ระบบงาน | ระบบ OFAM |
| การปรับปรุง | เพิ่ม 1 หัวข้อให้รายงาน |
| ความถี่ | เมื่อตั้งกอง |
| รายละเอียด | กำหนดเงื่อนไขกรณีกองทุนรวม UI Fund ให้มีการรายงานการใช้ Prime Broker โดยเพิ่มหัวข้อ “Prime Broker” เพื่อรองรับการรายงานชื่อ Prime Broker ที่กองทุนใช้บริการ (ถ้ามี) |

2.5 รายงานการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องของกองทุนรวม

| | |
|---------------|--|
| วัตถุประสงค์ | เพื่อรองรับการจัดทำและรายงานการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องและ portfolio duration ของกองทุนรวม โดยสำนักงานจะนำข้อมูลดังกล่าวไปใช้วิเคราะห์ติดตามความเสี่ยงด้านตลาด และด้านสภาพคล่องของกองทุนรวมที่เน้นลงทุนในตราสารหนี้ เพื่อประกอบการกำกับดูแล |
| ผู้เกี่ยวข้อง | บลจ. ที่จัดการกองทุนรวม |
| ขอบเขต | <p>กองทุนรวมต่อไปนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. กองทุนรวมเปิด retail fund ที่มีนโยบายตราสารหนี้ 2. กองทุนรวมเปิด retail fund ที่มีนโยบายผสมแบบกำหนดสัดส่วนการลงทุนในตราสารหนี้ ไม่น้อยกว่า 60%nav หรือโดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่า 60%nav 3. กองทุนรวมเปิด retail fund ที่มีนโยบายผสมโดยมีตราสารหนี้เป็นองค์ประกอบของ benchmark ของกองทุนไม่น้อยกว่า 60% <p>โดยกองทุนรวมข้างต้นมีวิธีการรับซื้อคืน ดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> - มีวิธีการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนแบบปกติ และระยะเวลาการรับซื้อคืนไม่เกิน 15 วันทำการ - มีวิธีการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนแบบปกติและอัตโนมัติ และระยะเวลาการรับซื้อคืนไม่เกิน 15 วันทำการ <p>ทั้งนี้ <u>ไม่รวมถึง</u>กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ</p> |
| แบบรายงาน | <ul style="list-style-type: none"> ● OS_MF01 ● OS_PVD01 และ OS_MF02 ให้ปรับปรุง field ข้อมูลในแต่ละบรรทัดให้เป็นรูปแบบเดียวกันกับ OS_MF01* แต่<u>ไม่ต้อง</u>รายงานข้อมูลใน field ที่ปรับปรุงนั้น <p>* เนื่องจากแบบรายงานทั้งสามใช้ format outstanding ร่วมกัน จึงต้องปรับปรุงให้เป็นรูปแบบเดียวกัน</p> |
| ระบบงาน | ระบบ OFAR |
| การปรับปรุง | เพิ่ม field และรหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน เพื่อรองรับการรายงาน |
| ความถี่ | รายเดือน |

| | |
|------------|---|
| รายละเอียด | <p>1. การดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องของกองทุนรวม</p> <p>เดิม : ให้รายงานเป็นรายกองทุน ผ่านแบบรายงาน NSR-LQ</p> <p>ปรับปรุงเป็น : ให้รายงานเป็นรายหลักทรัพย์ที่กองทุนรวมลงทุน โดยปรับปรุงแบบรายงาน OS_MF01 เพื่อรองรับการรายงาน ดังต่อไปนี้</p> <p>(1) เพิ่ม field “การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์” เพื่อระบุการจัดชั้นสภาพคล่องสำหรับประเภทสินทรัพย์ต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ● Equity and Others ● Fixed Income ● Structured Notes ● Structured Finance ● Reverse Repo <p>(2) กำหนดชุด code สำหรับการจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์ตามข้อ 1(1) ดังต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ● รหัส “01” หมายถึง หลักทรัพย์ที่ถูกจัดชั้นเป็น tier 1 ● รหัส “02” หมายถึง หลักทรัพย์ที่ถูกจัดชั้นเป็น tier 2 ● รหัส “03” หมายถึง หลักทรัพย์ที่ไม่ได้ถูกจัดชั้นเป็นทั้ง tier 1 และ tier 2 (Non-tier) <p>(3) เพิ่มรหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สินเพื่อรองรับการรายงานมูลค่าค้างรับหักค้างจ่ายสุทธิที่ถูกจัดชั้นเป็น tier 1 หรือ tier 2 ดังต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ● รหัส “961” : รายการค้างรับหักค้างจ่ายสุทธิที่ถูกจัดชั้นเป็น tier 1 ● รหัส “962” : รายการค้างรับหักค้างจ่ายสุทธิที่ถูกจัดชั้นเป็น tier 2 <p>2. portfolio duration ของกองทุนรวม</p> <p>เดิม : ให้รายงานผ่านแบบรายงาน NSR-LQ</p> <p>ปรับปรุงเป็น : ให้รายงานผ่านแบบรายงาน OS_MF01 โดยเพิ่มรหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สินเพื่อรองรับการรายงาน ดังต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ● รหัส “934” : ค่า portfolio duration ของกองทุนรวม <p>3. การรายงานในรูปแบบ text file</p> <p>3.1 การดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องของกองทุนรวม</p> <p>(1) รายการสินทรัพย์ประเภท Equity and Others, Fixed Income, Structured Notes, Structured Finance และ Reverse Repo</p> <p>ให้ระบุชุด code การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์ โดยรายงานใน field “การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์” ซึ่งจะเปิดเป็น field ใหม่ field สุดท้ายของรายการข้อมูล outstanding สำหรับแต่ละประเภทสินทรัพย์ข้างต้น กล่าวคือ</p> <ul style="list-style-type: none"> ● Outstanding Equity and Others <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อหลักทรัพย์ รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน รหัสกลุ่มเศรษฐกิจผู้ออกหลักทรัพย์ จำนวนหน่วยยกมา (หน่วย) </p> |
|------------|---|

| | |
|--|---|
| | <p>มูลค่ายกมา (บาท) จำนวนหน่วยซื้อหรือเพิ่ม (หน่วย) มูลค่าซื้อหรือเพิ่ม (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท) จำนวนหน่วยขายหรือลด (หน่วย) มูลค่าขายหรือลด (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท) จำนวนหน่วยยกไป (หน่วย) ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (บาท) ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) มูลค่ายุติธรรม (บาท) มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์</p> <ul style="list-style-type: none"> ● Outstanding Fixed Income <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อย่อหลักทรัพย์ รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน รหัสกลุ่มเศรษฐกิจผู้ออกหลักทรัพย์ จำนวนหน่วยยกมา (หน่วย) มูลค่ายกมา (บาท) จำนวนหน่วยซื้อหรือเพิ่ม (หน่วย) มูลค่าซื้อหรือเพิ่ม (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 การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์</p> ● Outstanding Structured Notes <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อตราสาร รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน รหัสกลุ่มเศรษฐกิจผู้ออกตราสาร (issuer) มูลค่าหน้าตั๋ว (บาท) มูลค่าหน้าตั๋ว (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) มูลค่าตามราคาตลาด (บาท) มูลค่าตามราคาตลาด (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market (บาท) ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์</p> ● Outstanding Structured Finance <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อย่อหลักทรัพย์/ชื่อย่อสัญญา รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน รหัสกลุ่มเศรษฐกิจคู่สัญญาหรือผู้ออก CLN มูลค่า reference asset หรือ มูลค่าหน้าตั๋วของ CLN (บาท) มูลค่า reference asset หรือ มูลค่าหน้าตั๋วของ CLN (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) มูลค่าตามราคาตลาดของ reference asset หรือ CLN (บาท) มูลค่าตามราคาตลาดของ reference asset หรือ CLN (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (บาท) ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์</p> ● Outstanding Reverse Repo <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อย่อสัญญา รหัสประเภทธุรกรรม / รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน รหัสประเทศของคู่สัญญา ชื่อของคู่สัญญา รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา) ชื่อย่อหลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมีสัญญาขายคืน รายละเอียดของหลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมีสัญญาขายคืนเพิ่มเติม (ถ้ามี) มูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (บาท) </p> |
|--|---|

| | |
|-----------------------|--|
| | <p>มูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) ดอกเบี้ยค้างรับ (บาท) มูลค่าธุรกรรม (บาท) มูลค่าธุรกรรม (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) รหัสสกุลเงินของการทำธุรกรรม วันที่สัญญามีผล วันที่ครบกำหนด การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์</p> <p>(2) รายการค้างรับหักค้างจ่ายสุทธิ</p> <p>ให้รายงานมูลค่าค้างรับหักค้างจ่ายสุทธิ ตามรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สินที่สำนักงานกำหนดขึ้นใหม่ (รหัส “961” หรือ “962”) ทั้งนี้ ยังคงใช้ format การรายงานแบบเดียวกับกลุ่มข้อมูลการลงทุนในสินทรัพย์ / หนี้สินค้างรับหักจ่าย มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ จำนวนหน่วยลงทุน และอื่น ๆ กล่าวคือ</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน มูลค่าค้างรับหักค้างจ่ายสุทธิ (บาท) รหัสสกุลเงิน</p> <p>3.2 portfolio duration ของกองทุนรวม</p> <p>ให้รายงานค่า portfolio duration ของกองทุนรวม ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน ตามรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สินที่สำนักงานกำหนดขึ้นใหม่ (รหัส “934”) โดยใช้ format การรายงานแบบเดียวกับกลุ่มข้อมูลการลงทุนในสินทรัพย์ / หนี้สินค้างรับหักจ่าย มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ จำนวนหน่วยลงทุน และอื่น ๆ กล่าวคือ</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน ค่าดูเรชันของพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวม (portfolio duration) รหัสสกุลเงิน</p> |
| ตัวอย่าง การรายงาน | <p>ตัวอย่างที่ 1</p> <p>บลจ. BCD (รหัสบริษัทจัดการ 0123456789) จัดการกองทุน BCD Fixed Income Fund (เลขที่จดทะเบียน MF1234/2562) โดยเมื่อวันที่ 24 มิ.ย. 62 กองทุนได้ซื้อพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย (รหัสกลุ่มเศรษฐกิจผู้ออกหลักทรัพย์ = “110”) ชื่อย่อ CB20604A ครบกำหนดวันที่ 4 มิ.ย. 63 จำนวน 1,000 หน่วย มูลค่า 981,140.30306 บาท ต้นทุนเฉลี่ย 981,140.30306 บาท โดยมี Yield to Maturity และมูลค่ายุติธรรมเมื่อวันที่ 28 มิ.ย. 62 ซึ่งเป็นวันทำการสุดท้ายของเดือน มิ.ย. ที่ 2.00% ต่อปี และ 981,354.26889 บาท ตามลำดับ</p> <p>วิธีการรายงาน</p> <p>ในกรณีนี้ เนื่องจากพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย ครบกำหนดวันที่ 4 มิ.ย. 63 เป็นตราสารหนี้ภาครัฐสกุลเงินบาท (รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน = “213”) ซึ่งมีอายุคงเหลือไม่เกิน 3 ปี จึงจัดเป็นสินทรัพย์สภาพคล่องระดับชั้น Tier 1 (ชุด code ที่ระบุการจัดชั้นสินทรัพย์สภาพคล่อง = “01”) โดย บลจ. BCD จะรายงานข้อมูลทั้งหมดของตราสารหนี้ดังกล่าวในส่วนของ Outstanding Fixed Income ในรูป text file สำหรับมูลค่าการลงทุน ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน มิ.ย. 62 ดังต่อไปนี้</p> <p>...</p> <p>MF1234 2562 CB20604A 213 110 1000.00000 981,140.30306 </p> <p>1000.00000 981,140.30306 981,354.26889 2.00 01</p> <p>...</p> |

ตัวอย่างที่ 2

ในวันทำการสุดท้ายของเดือน มิ.ย. 62 กองทุน BCD Fixed Income Fund มีรายการค้างรับและค้างจ่าย ดังนี้

| รายการ | ประเภท | ครบกำหนดภายใน | มูลค่า (บาท) |
|----------------------|----------|---------------|--------------|
| ค่าขายตราสารหนี้ A | ค้างรับ | 1 วัน | 500,000 |
| ค่าขายตราสารหนี้ B | ค้างรับ | 2 วัน | 1,000,000 |
| ค้างรับอื่น ๆ | ค้างรับ | 12 วัน | 30,000 |
| ค่าซื้อตราสารหนี้ | ค้างจ่าย | 2 วัน | 800,000 |
| ค่าธรรมเนียมค้างจ่าย | ค้างจ่าย | 9 วัน | 50,000 |

วิธีการรายงาน

ให้แบ่งประเภทรายการค้างรับและค้างจ่ายออกเป็นกลุ่มที่ถูกจัดชั้น tier 1 ซึ่งเป็นรายการที่จะครบกำหนดภายในไม่เกิน 7 วัน และกลุ่มที่ถูกจัดชั้น tier 2 ซึ่งเป็นรายการที่จะครบกำหนดภายใน 8 – 14 วัน และนำมาคำนวณรวมเป็นมูลค่าค้างรับหักด้วยค้างจ่ายสุทธิ ดังนี้

| ประเภท | กลุ่ม Tier 1 (ครบกำหนดไม่เกิน 7 วัน) | กลุ่ม Tier 2 (ครบกำหนดภายใน 8 – 14 วัน) |
|----------|--|---|
| ค้างรับ | - ค่าขายตราสารหนี้ A 500,000 บาท - ค่าขายตราสารหนี้ B 1,000,000 บาท | - ค้างรับอื่น ๆ 30,000 บาท |
| ค้างจ่าย | - ค่าซื้อตราสารหนี้ 800,000 บาท | - ค่าธรรมเนียมค้างจ่าย 50,000 บาท |
| สุทธิ | $500,000 + 1,000,000 - 800,000 = \underline{700,000 \text{ บาท}}$ | $30,000 - 50,000 = \underline{-20,000 \text{ บาท}}$ |

ในกรณีนี้ มูลค่าค้างรับหักด้วยค้างจ่ายที่ถูกจัดชั้นเป็น Tier 1 = 700,000 บาท (รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน = “961”) ขณะที่มูลค่าค้างรับหักด้วยค้างจ่ายที่ถูกจัดชั้นเป็น tier 2 (รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน = “962”) มีมูลค่าติดลบ ซึ่งเป็นรายการที่รอจ่ายสุทธิ จึงไม่นับเป็นรายการสภาพคล่องและไม่ต้องรายงานในแบบรายงาน

ในส่วนนี้ บลจ. BCD จะรายงาน text file ข้อมูลรายการค้างรับหักค้างจ่ายสุทธิ ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน มิ.ย. 62 ตามรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สินที่สำนักงานกำหนดให้แสดงถึงการจัดชั้นสภาพคล่อง tier 1 และ tier 2 ดังต่อไปนี้

...

MF1234|2562||961|700000.00000|THB

| | |
|--|--|
| | <p>ตัวอย่างที่ 3</p> <p>ในวันทำการสุดท้ายของเดือน มิ.ย. 62 กองทุน BCD Fixed Income Fund มีค่า portfolio duration เท่ากับ 1.68 ปี</p> <p>วิธีการรายงาน</p> <p>ให้รายงาน portfolio duration (รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน = “934”) โดยไม่ต้องรายงาน รหัสสกุลเงิน ซึ่งมีวิธีการรายงานตามรูปแบบ text file ดังต่อไปนี้</p> <p>...</p> <p>MF1234 2562 934 1.68000 </p> |
|--|--|

2.6 การปรับปรุงแบบรายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนรายวัน (แบบรายงาน A-2)

| | |
|---------------|---|
| วัตถุประสงค์ | เพื่อรองรับการจัดทำและรายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเปิดทุกกองทุน โดยสำนักงานจะนำข้อมูลดังกล่าวไปใช้วิเคราะห์ประกอบการกำหนดนโยบาย และจัดทำสถิติ เพื่อเผยแพร่ต่อสาธารณะ |
| ผู้เกี่ยวข้อง | บลจ. ที่จัดการกองทุนรวม |
| ขอบเขต | <p>เดิม : กองทุนรวมเปิด โดยไม่รวม</p> <ul style="list-style-type: none"> ● กองทุนรวม Non-Retail Fund ● กองทุนรวมวายุภักษ์ ● กองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุนต่างประเทศ ● กองทุนรวมที่มีวิธีการรับซื้อคืนแบบอัตโนมัติอย่างเดียว ● กองทุนรวมที่มีระยะเวลาในการรับซื้อคืนมากกว่า 15 วัน <p>ปรับปรุงเป็น : กองทุนรวมเปิดทุกกองทุน</p> |
| แบบรายงาน | A-2 |
| ระบบงาน | ระบบ OFAR |
| การปรับปรุง | ปรับปรุงขอบเขตเป็นกองทุนรวมเปิดทุกกองทุน ทั้งนี้ รูปแบบและวิธีการรายงานยังคงเดิม |
| ความถี่ | รายวัน |

2.7 รายงานการลงทุนในต่างประเทศและตราสารอนุพันธ์

| | | | | | | | | | | | | | |
|----------------|---|------------|---------------------|-------------|-------------------------------|--------|------------|----------|--|----------------|--|--------|---|
| 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 | <ol style="list-style-type: none"> 1. feature ตราสาร ได้แก่ <ol style="list-style-type: none"> (1) equity & others feature (แบบรายงาน MS_EQF) (2) fixed income feature (แบบรายงาน MS_FIF) 2. outstanding ตราสาร : แบบรายงาน OS_MF01, OS_MF02 และ OS_PVD01 | | | | | | | | | | | | |
| ระบบงาน | ระบบ OFAR | | | | | | | | | | | | |
| การปรับปรุง | เพิ่ม field และรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน เพื่อรองรับการรายงาน | | | | | | | | | | | | |
| ความถี่ | รายเดือน | | | | | | | | | | | | |
| รายละเอียด | <ol style="list-style-type: none"> 1. เพิ่ม field ข้อมูลในแบบรายงาน ต่อไปนี้ <ol style="list-style-type: none"> 1.1 <u>รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์</u> แบบรายงานที่ปรับปรุง : แบบรายงาน MS_EQF และ MS_FIF รูปแบบของ field ข้อมูล : <table border="1"> <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 codeสากล)</td></tr> <tr> <td>Remark</td><td>พิจารณาจากการที่ผู้ออกหลักทรัพย์จดทะเบียนประกอบธุรกิจหลักในประเทศนั้น หรือมี head office อยู่ในประเทศนั้น</td></tr> </table> รูปแบบ text file ที่ปรับปรุง : ปรับปรุงเฉพาะส่วนของ data โดยมีรายละเอียด ดังนี้ (ก) แบบรายงาน MS_EOF ชื่อหลักทรัพย์ (issue name) เลขรหัสหลักทรัพย์สากล รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน | Field name | Issuer Country Code | Description | รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์ | Format | varchar(2) | Not null | Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ) | Possible Value | ชุด code ที่สำนักงานกำหนด (Country codeสากล) | Remark | พิจารณาจากการที่ผู้ออกหลักทรัพย์จดทะเบียนประกอบธุรกิจหลักในประเทศนั้น หรือมี head office อยู่ในประเทศนั้น |
| Field name | Issuer Country Code | | | | | | | | | | | | |
| Description | รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์ | | | | | | | | | | | | |
| Format | varchar(2) | | | | | | | | | | | | |
| Not null | Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ) | | | | | | | | | | | | |
| Possible Value | ชุด code ที่สำนักงานกำหนด (Country codeสากล) | | | | | | | | | | | | |
| Remark | พิจารณาจากการที่ผู้ออกหลักทรัพย์จดทะเบียนประกอบธุรกิจหลักในประเทศนั้น หรือมี head office อยู่ในประเทศนั้น | | | | | | | | | | | | |

รหัสตลาด | ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ | วันที่ออกจำหน่าย/จดทะเบียน | วันที่เพิกถอน/
ครบกำหนด | **รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์** | รหัสประเทศที่หลักทรัพย์เสนอขาย |
รหัสสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขาย | เวลาที่สร้างรายการ | เวลาที่แก้ไขรายการ

(ข) แบบรายงาน MS_FIE

ชื่อหลักทรัพย์ (issue name) | เลขรหัสหลักทรัพย์สากล | รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน |
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 ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ในรูปสกุลเงินที่ลงทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

OS_MF01, OS_MF02 และ OS_PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ต่อไปนี้

- outstanding equity & others
- outstanding fixed income

รูปแบบของ field ข้อมูล :

| Field name | Average Cost Value (Original Currency) |
|-------------|---|
| Description | ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงินที่ลงทุนไปลงทุนในต่างประเทศ) |
| Format | Decimal(23,5) |
| Not null | Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ) |
| Remark | รายงานต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ที่ราคาตลาด ในรูปสกุลเงิน เดียวกันกับสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขายซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน MS_EQF หรือ MS_FIF |

1.3 มูลค่าหน้าตัวของหลักทรัพย์ในรูปสกุลเงินที่ลงทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

OS_MF01, OS_MF02 และ OS_PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ต่อไปนี้

- 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 (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ) |
| Remark | รายงานมูลค่าหน้าตัวของหลักทรัพย์ ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินของ structured notes ซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน MS_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 (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ) |
| Remark | รายงานมูลค่า Reference Asset หรือมูลค่าหน้าตัวของ CLN ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินของสัญญา credit derivatives ซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน MS_CDF |

1.4 มูลค่ายุติธรรมในรูปสกุลเงินที่ลงทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

OS_MF01, OS_MF02 และ OS_PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ต่อไปนี้

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

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

| | |
|--------------------|--|
| Field name | Market Value (Original Currency) |
| Description | มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) |
| Format | Decimal(23,5) |
| Not null | Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ) |
| Remark | รายงานมูลค่าคงค้างของหลักทรัพย์ที่ราคาตลาด ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขายซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน MS_EQF หรือ MS_FIF |

รูปแบบของ field ข้อมูล กรณี outstanding structured notes :

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

รูปแบบของ field ข้อมูล กรณี 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 (เฉพาะกรณีที่เป็นการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศ) |
| Remark | รายงานมูลค่าตามราคาตลาดของ Reference Asset หรือ CLN ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินของสัญญา credit derivatives ซึ่งได้รายงานในแบบรายงาน MS_CDF |

1.5 มูลค่า Notional Amount ในรูปสกุลเงินที่กองทุนไปลงทุนในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

OS_MF01, OS_MF02 และ OS_PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ต่อไปนี้

- 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 :

OS_MF01, OS_MF02 และ OS_PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ต่อไปนี้

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 :

OS_MF01, OS_MF02 และ OS_PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ต่อไปนี้

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 :

OS_MF01, OS_MF02 และ OS_PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ต่อไปนี้

- 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><u>กรณี futures, forward, swap, option</u></p> <p>รายงานผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market สัญญาในรูปสกุลเงินที่นำไปลงทุนในต่างประเทศ</p> <p><u>กรณี structured notes</u></p> <p>รายงานผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินของ structured notes ซึ่งได้รายงานในรูปแบบรายงาน MS_SNF</p> <p><u>กรณี credit derivatives & structured finance</u></p> <p>รายงานผลกำไรขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงินเดียวกันกับสกุลเงินของสัญญา credit derivatives ซึ่งได้รายงานในรูปแบบรายงาน MS_CDF</p> |

1.9 มูลค่าธุรกรรม ในรูปสกุลเงินที่กองทุนทำธุรกรรมในต่างประเทศ

แบบรายงานที่ปรับปรุง :

OS_MF01, OS_MF02 และ OS_PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ต่อไปนี้

- 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) |

| | | | | | | | | |
|--------------------|---|-------------------|--------------------------------------|--------------------|--|---------------|---------------|-----------------|
| | <p>Remark</p> <p><u>กรณี reverse repo</u> รายงานมูลค่าซื้อตราสารแห่งนี้รวมกับผลประโยชน์ ที่พึงได้รับจนถึงวันที่คำนวณมูลค่าธุรกรรม</p> <p><u>กรณี repo</u> รายงานมูลค่าที่กู้ยืมรวมดอกเบี้ยค้างจ่ายจนถึงวันที่คำนวณมูลค่าธุรกรรม</p> <p><u>กรณี security lending</u> รายงานมูลค่าของหลักทรัพย์ที่ให้อืม ณ วันที่ทำธุรกรรมรวมกับผลตอบแทนค้างรับจนถึงวันที่คำนวณมูลค่าธุรกรรม</p> | | | | | | | |
| | <p>1.10 มูลค่าหลักประกัน ในรูปสกุลเงินที่กองทุนทำธุรกรรมในต่างประเทศ</p> <p><u>แบบรายงานที่ปรับปรุง :</u></p> <p>OS_MF01, OS_MF02 และ OS_PVD01 เฉพาะส่วนของ outstanding ต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ● reverse repo ● repo ● security lending <p><u>รูปแบบของ field ข้อมูล :</u></p> <table> <tr> <td>Field name</td><td>Collateral Value (Original Currency)</td></tr> <tr> <td>Description</td><td> <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> </td></tr> <tr> <td>Format</td><td>Decimal(23,5)</td></tr> <tr> <td>Not null</td><td>Yes (เฉพาะกรณีที่เป็นการทำธุรกรรมในต่างประเทศ)</td></tr> </table> <p><u>รูปแบบ text file ที่ปรับปรุง สำหรับข้อมูล outstanding ตามข้อ 1.2 – 1.10 :</u></p> <p>ปรับปรุงเฉพาะส่วนของ data โดยมีรายละเอียด ดังนี้</p> <p>(ก) <u>ส่วนของ outstanding equity & others</u></p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อย่อหลักทรัพย์ รหัสประเภทหลักทรัพย์/หนี้สิน รหัสกลุ่มเศรษฐกิจผู้ออกหลักทรัพย์ จำนวนหน่วยยกมา (หน่วย) มูลค่ายกมา (บาท) จำนวนหน่วยซื้อหรือเพิ่ม (หน่วย) มูลค่าซื้อหรือเพิ่ม (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท) จำนวนหน่วยขายหรือลด (หน่วย) มูลค่าขายหรือลด (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท) จำนวนหน่วยยกไป (หน่วย) ต้นทุน</p> | 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 |
| 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) | | | | | | | |

| | |
|--|--|
| | <p>เฉลี่ยของหลักทรัพย์ (บาท) <u>ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> มูลค่ายุติธรรม (บาท) <u>มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์</p> <p>(ข) ส่วนของ outstanding fixed income</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อย่อหลักทรัพย์ รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน รหัสกลุ่มเศรษฐกิจผู้ออกหลักทรัพย์ จำนวนหน่วยยกมา (หน่วย) มูลค่ายกมา (บาท) จำนวนหน่วยซื้อหรือเพิ่ม (หน่วย) มูลค่าซื้อหรือเพิ่ม (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท) จำนวนหน่วยขายหรือลด (หน่วย) มูลค่าขายหรือลด (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท) จำนวนหน่วยยกไป (หน่วย) ดอกเบี้ยค้างรับ (บาท) ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (บาท) <u>ต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> มูลค่ายุติธรรม (บาท) <u>มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> Yield to Maturity Per Year การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์</p> <p>(ค) ส่วนของ outstanding futures, forward</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ฐานะ รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา) ชื่อย่อสัญญา รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน วัตถุประสงค์การทำธุรกรรม รายละเอียดการทำธุรกรรม จำนวนสัญญา ลักษณะการ hedge ประเภทการ hedge รายละเอียดประเภทการทำ hedging ชื่อหลักทรัพย์ที่ได้รับ การป้องกันความเสี่ยง (hedged item) มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท) <u>มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> มูลค่า hedged item ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท) ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (นับจากวันเปิดสัญญา) (บาท) <u>ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (นับจากวันเปิดสัญญา) (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u></p> <p>(ง) ส่วนของ outstanding swap</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อย่อสัญญา รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา) วัตถุประสงค์การทำธุรกรรม ลักษณะการ hedge ประเภทการ hedge รายละเอียดประเภทการทำ hedging ชื่อหลักทรัพย์ที่ได้รับการป้องกันความเสี่ยง (hedged item) มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท) <u>มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> มูลค่า hedged item ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (บาท) ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (บาท) <u>ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u></p> <p>(จ) ส่วนของ outstanding option</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อย่อสัญญา รหัสประเภท</p> |
|--|--|

| | |
|--|--|
| | <p>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) <u>มูลค่า notional ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (ในรูปสกุลเงิน ที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> option value ต่อสัญญา ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (MTM) (บาท) <u>Option value ต่อสัญญา ณ วันสิ้นงวดของข้อมูล (MTM) (ในรูปสกุลเงิน ที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> <u>มูลค่า Option premium (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน ในต่างประเทศ)</u> ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (บาท) <u>ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุน ในต่างประเทศ)</u></p> <p>(ฉ) ส่วนของ outstanding structured notes</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อตราสาร รหัสประเภท สินทรัพย์/หนี้สิน รหัสกลุ่มเศรษฐกิจผู้ออกตราสาร (issuer) มูลค่าหน้าตั๋ว (บาท) <u>มูลค่าหน้าตั๋ว (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> มูลค่าตามราคาตลาด (บาท) <u>มูลค่าตามราคาตลาด (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> ผลกำไร/ขาดทุน จากการ mark to market (บาท) <u>ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์</p> <p>(ช) ส่วนของ outstanding credit derivatives & structured finance</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อย่อหลักทรัพย์/ชื่อย่อสัญญา รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน รหัสกลุ่มเศรษฐกิจคู่สัญญาหรือผู้ออก CLN มูลค่า reference asset หรือ มูลค่าหน้าตั๋วของ CLN (บาท) <u>มูลค่า reference asset หรือ มูลค่าหน้าตั๋วของ CLN (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> มูลค่าตาม ราคาตลาดของ reference asset หรือ CLN (บาท) <u>มูลค่าตามราคาตลาดของ reference asset หรือ CLN (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> ผลกำไร/ ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (บาท) <u>ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ)</u> การจัดชั้นสภาพคล่อง ของหลักทรัพย์</p> <p>(ซ) ส่วนของ outstanding reverse repo</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อย่อสัญญา รหัสประเภท ธุรกรรม / รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน รหัสประเทศของคู่สัญญา ชื่อของคู่สัญญา รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา) ชื่อย่อหลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมีสัญญาขายคืน รายละเอียด ของหลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมีสัญญาขายคืนเพิ่มเติม (ถ้ามี) มูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมี สัญญาขายคืน (บาท) <u>มูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (ในรูปสกุลเงิน ที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ)</u> ดอกเบี้ยค้างรับ (บาท) มูลค่าธุรกรรม (บาท) </p> |
|--|--|

| | |
|--|--|
| | <p>มูลค่าธุรกรรม (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) รหัสสกุลเงินของการทำธุรกรรม วันที่สัญญามีผล วันที่ครบกำหนด การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์</p> <p>(ณ) ส่วนของ outstanding repo</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อย่อสัญญา รหัสประเภทธุรกรรม / รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน รหัสประเทศของคู่สัญญา ชื่อของคู่สัญญา รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา) ชื่อ / ชื่อย่อหลักประกัน มูลค่าหลักทรัพย์ที่เป็นประกัน (บาท) มูลค่าหลักทรัพย์ที่เป็นประกัน (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) อัตราดอกเบี้ยจ่าย (ร้อยละ) ดอกเบี้ยค้างจ่าย (บาท) มูลค่าธุรกรรม (บาท) มูลค่าธุรกรรม (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) รหัสสกุลเงินของการทำธุรกรรม วันที่สัญญามีผล วันที่ครบกำหนด</p> <p>(ณ) ส่วนของ outstanding security lending</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD ชื่อย่อสัญญา รหัสประเภทธุรกรรม / รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน รหัสประเทศของคู่สัญญา ชื่อของคู่สัญญา รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของคู่สัญญา Credit Rating ของคู่สัญญา (Counterparty) รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ (คู่สัญญา) ชื่อย่อหลักทรัพย์ที่ให้อืม รหัสสกุลเงินของการทำธุรกรรม มูลค่าหลักทรัพย์ที่ให้อืม (บาท) รายละเอียดผลตอบแทนตามสัญญา ผลตอบแทนค้างรับ (บาท) มูลค่าธุรกรรม (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) ชื่อย่อหลักทรัพย์ค้ำประกัน รายละเอียดของหลักทรัพย์ค้ำประกันเพิ่มเติม (ถ้ามี) มูลค่าหลักประกัน (บาท) มูลค่าหลักประกัน (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) วันที่สัญญามีผล วันที่ครบกำหนด</p> <p>2. เพิ่มรหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน สำหรับการรายงานยอดคงค้าง excess cash และ margin รายกองทุน ในรูปสกุลเงินที่ลงทุนในตราสารอนุพันธ์ต่างประเทศ ดังต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> ● รหัส “963” : ยอดคงค้าง excess cash และ margin ในรูปสกุลเงินที่ลงทุนในอนุพันธ์ต่างประเทศ <p>รูปแบบ text file ที่รายงาน</p> <p>ใช้ format การรายงานแบบเดียวกับกลุ่มข้อมูลการลงทุนในสินทรัพย์ / หนี้สินค้างรับ ค้างจ่าย มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ จำนวนหน่วยลงทุน และอื่น ๆ กล่าวคือ</p> <p>เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน ยอดคงค้าง excess cash และ margin (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) รหัสสกุลเงิน</p> |
|--|--|

| | | | |
|-----------------------|---|---|--|
| | สรุปการปรับปรุงแบบรายงานพอร์ตการลงทุนของกองทุนโดยเพิ่ม field ข้อมูลในแบบรายงานที่เกี่ยวข้อง | | |
| | ประเภทหลักทรัพย์ ตราสารอนุพันธ์ และธุรกรรม | แบบรายงาน feature | แบบรายงาน outstanding |
| | equity & others | เพิ่ม field รหัสประเทศของ ผู้ออกหลักทรัพย์ | เพิ่ม field ต้นทุนเฉลี่ย และ มูลค่ายุติธรรมในรูปสกุลเงิน ที่ไปลงทุน |
| | fixed income | | |
| | futures, forward | - | เพิ่ม field มูลค่า notional และผลกำไร/ขาดทุนจาก การ mark to market และ มูลค่า option value และ option premium (เฉพาะ กรณี option) ในรูปสกุลเงิน ที่ไปลงทุน |
| | swap | - | |
| | option | - | |
| | structured notes | - | เพิ่ม field มูลค่าหน้าตัว มูลค่า ตามราคาตลาด และผลกำไร/ ขาดทุนจากการ mark to market ในรูปสกุลเงิน ที่ไปลงทุน |
| | credit derivatives & structured finance | - | |
| | reverse repo, repo และ security lending | - | เพิ่ม field มูลค่าธุรกรรม และ มูลค่าหลักประกันในรูป สกุลเงินที่ทำธุรกรรม |
| | ยอดคงค้าง excess cash และ margin | - | เพิ่มรหัสประเภทสินทรัพย์/ หนี้สิน เพื่อรองรับการรายงาน ยอดคงค้างดังกล่าว |
| ตัวอย่าง การรายงาน | <p>ในเดือน พ.ค. 62 บลจ. BCD (รหัสบริษัทจัดการ 0123456789) ซึ่งจัดการกองทุนรวม BCD International Allocation Fund (เลขที่จดทะเบียน MF4321/2562) มีการลงทุนในหลักทรัพย์ และตราสารอนุพันธ์ ดังนี้</p> <p>1. ลงทุนในหุ้น BB ซึ่งเป็นหลักทรัพย์ในต่างประเทศ</p> <ul style="list-style-type: none"> • 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 MS_EQF และ OS_MF01 งวดเดือน พ.ค. 62 โดยมีรายละเอียด ดังนี้

(ก) แบบรายงาน MS_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 |
| | การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์ | 01 |
| 2. การลงทุนในตราสารหนี้ ได้แก่ รายการลงทุนในเงินฝากประจำธนาคาร CC ให้รายงานในแบบรายงาน MS_FIF และ OS_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 | - |
| | อัตราดอกเบี้ยหน้าตั๋ว (%) | - |
| | ระยะเวลาการจ่ายดอกเบี้ย (Coupon Payment) | - |
| | เลขที่จดทะเบียนบริษัทของ Issuer | - |
| | ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ | CC Bank |
| | รหัสประเทศของผู้ออกหลักทรัพย์ | CN |
| | รหัสประเทศที่หลักทรัพย์เสนอขาย | CN |
| | รหัสสกุลเงินที่หลักทรัพย์ซื้อขาย | CNY |
| | รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์ | 03 (S&P) |
| | Rating ของผู้ออกหลักทรัพย์ | A |
| | รหัสผู้เกี่ยวข้อง (ผู้รับรอง/ผู้รับอาวัล/ผู้สลักหลัง/ผู้ค้ำประกัน/ผู้ส่งจ่าย) | 00 (None) |
| | เลขที่จดทะเบียนบริษัทของผู้รับรอง/ผู้รับอาวัล/ผู้สลักหลัง/ผู้ค้ำประกัน/ผู้ส่งจ่าย | - |
| | ชื่อผู้รับรอง/ผู้รับอาวัล/ผู้สลักหลัง/ผู้ค้ำประกัน/ผู้ส่งจ่าย | None |
| | รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้รับรอง/ผู้รับอาวัล/ผู้สลักหลัง/ผู้ค้ำประกัน | 00 (None) |
| | Rating ของผู้รับรอง/ผู้รับอาวัล/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 (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนใน ต่างประเทศ) | 400,000 |
| | มูลค่ายุติธรรม (บาท) | 1,772,000 |
| | มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) | 400,100 |
| | Yield to Maturity Per Year | - |
| | การจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์ | 02 |

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) |
| วันที่สัญญาเริ่มผล | 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 (สถาบันการเงินที่มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ) |
| 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 (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) | 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 (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) | 2,000 (สกุล CNY) |

การรายงานในรูปแบบ text file จากข้อ 1 - 3

1. แบบรายงาน EOF

0123456789|EQF|20190531

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

2. แบบรายงาน FIE

0123456789|FIF|20190531

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

20190515|20191115|20190616:183545|

3. แบบรายงาน SWE

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|01

| | |
|--|---|
| | MF4321 2562 FDCC001 218 202 1780000.00000 0.00000 450.00000 1780000.00000 400000.00000 1772000.00000 400100.00000 02 MF4321 2562 SW001 403 202 01 01 02 FDCC001 1774000.00000 400500.00000 1772000.00000 8900.00000 2000.00000 |
|--|---|