

13 ธันวาคม 2563

เรียน นายกสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภท
การจัดการกองทุนรวม

ที่ ก.ล.ต.น.จ.(ว) ๗๖ /2563 เรื่อง การรายงานข้อมูลเพื่อติดตามความเสี่ยงของกองทุนรวม

ตามที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“สำนักงาน ก.ล.ต.”) ได้มีหนังสือเวียนที่ ก.ล.ต.ก.ข.(ว) 26/2557 เรื่อง ขอความร่วมมือในการรายงานข้อมูลเพื่อประกอบการติดตามความเสี่ยงของกองทุนรวม ลงวันที่ 29 สิงหาคม 2557 โดยให้บริษัทจัดการรายงานข้อมูลการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่อง การไถ่ถอนหน่วยลงทุน และการลงทุนในตราสารหนี้ที่มีปัญหา ตามเงื่อนไขที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด นั้น

เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลและติดตามความเสี่ยงของกองทุนรวม รวมทั้งเตรียมการรองรับหากเกิดสถานการณ์ที่กระทบด้านสภาพคล่องและเสถียรภาพของกองทุนรวม สำนักงาน ก.ล.ต. ขอความร่วมมือดังต่อไปนี้

1. ให้บริษัทท่านเตรียมความพร้อมในการจัดทำข้อมูล และจัดส่งข้อมูล ดังต่อไปนี้
 - 1.1 ข้อมูลสรุปการถือครองหน่วยลงทุนของผู้ลงทุนในกองทุนรวมให้นำส่งเป็นรายเดือน และเมื่อได้รับการร้องขอระหว่างเดือน
 - 1.2 ข้อมูลพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมอย่างย่อให้นำส่งเมื่อได้รับการร้องขอ
 - 1.3 ข้อมูลการไถ่ถอนหน่วยลงทุนในภาวะไม่ปกติให้นำส่งเมื่อได้รับการร้องขอ
2. การจัดส่งข้อมูลข้างต้นให้จัดส่งผ่านระบบรับแบบรายงานอิเล็กทรอนิกส์ (“ระบบ OFAR”) โดยมีรายละเอียดของแบบรายงานและเงื่อนไขการจัดส่งตามเอกสารที่แนบมาพร้อมนี้ ซึ่งสำนักงาน ก.ล.ต. จะจัดให้มีการซักซ้อมการนำส่งข้อมูลตามข้อ 1.2 และ 1.3 เป็นรายครึ่งปี ในวันทำการแรกของเดือนเมษายน และตุลาคมของทุกปี เพื่อให้บริษัทจัดการทุกแห่งสามารถจัดส่งข้อมูลได้อย่างถูกต้อง ครบถ้วน และกำหนดให้จัดส่งครั้งแรกในวันที่ 1 เมษายน 2564 ส่วนข้อมูลตามข้อ 1.1 กำหนดให้เริ่มส่งข้อมูลงวดเดือนมีนาคม 2564 เป็นต้นไป
3. ในกรณีที่บริษัทจัดการมีการขายหน่วยลงทุนผ่านบริษัทหลักทรัพย์ที่ประกอบธุรกิจการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ การค้าหลักทรัพย์ หรือจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยลงทุน

(“LBDU”) แบบไม่เปิดเผยชื่อผู้ถือหน่วยลงทุน (“omnibus account”) โดยมีสัดส่วนการถือครองหน่วยลงทุนผ่านบัญชีประเภทดังกล่าวเกินกว่าร้อยละ 10 ของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนใด ๆ ให้บริษัทจัดการดำเนินการให้ LBDU จัดส่งข้อมูลให้บริษัทจัดการ เพื่อรวบรวมส่งให้สำนักงาน ก.ล.ต. ด้วย

อนึ่ง เพื่อรวบรวมการรายงานข้อมูลเพื่อประกอบการติดตามความเสี่ยงของกองทุนรวมไว้ในที่เดียวกัน สำนักงาน ก.ล.ต. ขอยกเลิกหนังสือเวียนที่ กตต.กธ.(ว) 26/2557 โดยใช้หนังสือเวียนฉบับนี้แทน ทั้งนี้ สำนักงาน ก.ล.ต. ได้หารือกับสมาคมบริษัทจัดการลงทุนและผู้ประกอบธุรกิจเกี่ยวกับข้อมูลที่ต้องจัดส่ง ซึ่งทุกฝ่ายเห็นความจำเป็นและยินดีให้ความร่วมมือ ในการนี้ สำนักงาน ก.ล.ต. ขอเสนอชื่อเจ้าหน้าที่ผู้ประสานงาน ได้แก่ นายพิศุทธิ์ บุญวัฒนสุนทร โทรศัพท์ 0-2033-9914 email: pisut@sec.or.th และนายทันตทัต พิทักษ์ศักดิ์พงศ์ โทรศัพท์ 0-2263-6517 email: tantatat@sec.or.th

จึงเรียนมาเพื่อโปรดดำเนินการ

ขอแสดงความนับถือ



(นางสาวนวิศ สุวรรณมงคล)

เลขาธิการ

- สิ่งที่ส่งมาด้วย 1. ภาพถ่ายหนังสือเวียนที่ กตต.นจ.(ว) 44 /2563 เรื่อง การจัดเตรียมข้อมูลการถือครองหน่วยลงทุนของบัญชีประเภทไม่เปิดเผยชื่อสำหรับการรายงานข้อมูลเพื่อติดตามความเสี่ยงของกองทุนรวม ลงวันที่ 23 ธันวาคม 2563
2. รูปแบบ เงื่อนไข และรายละเอียดแบบรายงานเพื่อประกอบการติดตามความเสี่ยงของกองทุนรวม

ฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการลงทุน

โทรศัพท์/โทรสาร 0-2033-4652

รูปแบบและเงื่อนไขของแบบรายงานเพื่อประกอบการติดตามความเสี่ยงของกองทุนรวม

วัตถุประสงค์	แบบรายงาน	เงื่อนไขการรายงาน	กำหนดส่ง
1. ข้อมูลโครงสร้างผู้ถือหน่วยลงทุนเพื่อใช้ประกอบการติดตามความเสี่ยงด้านการไถ่ถอนหน่วยลงทุน	สรุปการถือครองหน่วยลงทุนของผู้ลงทุนในกองทุนรวม (1) แยกตามกลุ่มผู้ลงทุน (2) แยกตามประเภทกอง (3) เฉพาะกองทุน SSF และ SSFX (4) รวมทุกกองทุนภายใต้การจัดการ	• กรณีของข้อมูลแยกตามกลุ่มผู้ลงทุนให้รายงานเฉพาะกองทุน MMF และ Daily FI แต่ไม่รวมกองทุนประเภท RMF กองทุนหน่วยลงทุนและ MF for PVD • ในกรณีการรายงานเมื่อสำนักงานร้องขอ อาจรวมถึงกองทุนอื่น ๆ นอกเหนือจาก MMF และ Daily FI ด้วย • กรณีข้อมูลรวมทุกกองทุนภายใต้การจัดการ ไม่รวมกองทุนวายุภักษ์ กองทุน Country Fund และกองทุน อสังหาริมทรัพย์ (กอง 2 และ 4)	• รายเดือนภายในวันที่ 20 ของเดือนถัดไป โดยใช้ข้อมูลในวันทำการสุดท้ายของเดือน • ในระหว่างเดือนเฉพาะเมื่อสำนักงานร้องขอ โดยใช้ข้อมูลในวันทำการก่อนหน้า
2. ข้อมูลพอร์ตเพื่อใช้ประกอบการติดตามความเสี่ยงด้านการกระจุกตัวของการลงทุน	พอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมอย่างย่อ (1) พอร์ตกองทุน MMF และ Daily FI แยกรายประเภทตราสาร (2) พอร์ตรายกองทุนแยกรายหลักทรัพย์	• พอร์ตกองทุน MMF และ Daily FI ไม่รวมกองทุนประเภท RMF กองทุนหน่วยลงทุนและ MF for PVD • พอร์ตรายกองทุนแยกรายหลักทรัพย์เฉพาะเมื่อร้องขอ และตามกองทุนที่สำนักงานกำหนด	เฉพาะเมื่อสำนักงานร้องขอ ตามเงื่อนไขที่กำหนด
3. ข้อมูลการไถ่ถอนและการดำรงสินทรัพย์สภาพคล่องเพื่อใช้ประกอบการติดตามความเสี่ยงด้านสภาพคล่องและเสถียรภาพของกองทุนรวม	การไถ่ถอนหน่วยลงทุนสุทธิในภาวะไม่ปกติ (1) การขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกอง MMF และ Daily FI ระหว่างวัน (2) การดำรงสภาพคล่องและการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนเปิดรายกองทุน เป็นรายวัน	• การขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุน MMF และ Daily FI ไม่รวมกองทุนประเภท RMF กองทุนหน่วยลงทุนและ MF for PVD • การดำรงสภาพคล่อง และการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนเปิดรายกองทุน : ทุกกองทุนเปิด โดยไม่รวมกองทุนตราสารหนี้ประเภท Term Fund, RMF และ MF for PVD	เฉพาะเมื่อสำนักงานร้องขอ ตามเงื่อนไขที่กำหนด

รายละเอียดแบบรายงานเพื่อประกอบการติดตามความยั่งยืนของกองทุนรวม

1. รายงานสรุปการถือครองหน่วยลงทุนของผู้ลงทุนในกองทุนรวม

1.1 รายการกองทุนแยกตามกลุ่มผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน

เลขที่จดทะเบียน	รหัสประเภท ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน	ชื่อ Selling Agent	จำนวนผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน (ราย)	มูลค่าหน่วยลงทุน ที่ถือครอง (ลบ.)	Subscription (ลบ.)	Redemption (ลบ.)
	1/	2/		(ลบ.)	3/	4/

1/ ใช้ชุด code ที่กำหนดในท้ายเอกสารนี้

2/ ให้รายงานชื่อ Selling Agent ของแต่ละประเภทผู้ลงทุน โดยหากกลุ่มประเภทผู้ลงทุนใดที่ชื่อหน่วยลงทุนผ่าน Selling Agent มากกว่า 1 แห่ง ให้รายงานชื่อ Selling Agent ที่ขายหน่วยลงทุนให้กับกลุ่มผู้ลงทุนประเภทนั้นให้ครบถ้วน

3/ Subscription ให้รายงานมูลค่าขายหน่วยลงทุน รวม switch in โดยเป็นยอดสะสมรายเดือน หรือตั้งแต่ต้นเดือนถึงวันที่สำนักงานร้องขอในระหว่างเดือน

4/ Redemption ให้รายงานมูลค่าซื้อคืนหน่วยลงทุน รวม switch out โดยเป็นยอดสะสมรายเดือน หรือตั้งแต่ต้นเดือนถึงวันที่สำนักงานร้องขอในระหว่างเดือน

Validation :

1. กรณีข้อมูลรายเดือน เฉพาะกอง MMF (ไม่รวม RMF และ MF for PVD) และ Daily FI (ไม่รวมกอง RMF กองหน่วยลงทุน และ MF for PVD)
2. กรณีข้อมูลในระหว่างเดือนตามที่สำนักงานร้องขอ อาจเป็นกองทุนประเภทอื่น ๆ นอกเหนือจากข้อ 1.
3. รหัสประเภทผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน เป็นไปตามชุด code ที่สำนักงานกำหนด
4. ทุกกองทุนต้องรายงานรหัสประเภทผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน = "91"
5. เลขที่จดทะเบียนเป็นไปตาม format ของสำนักงาน
6. ทุก field ห้ามเป็นตัวเลขติดลบ
7. not null ทุก field ยกเว้น field "ชื่อ Selling Agent" กรณีรหัสประเภทผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุน = "91"

1.2 รายประเภทกองทุน (ในรวมกองทุนหน่วยกิต กองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุนต่างประเทศ และกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (ทอง 2 และ 4))

ประเภทกองทุน	จำนวนผู้ถือหน่วยลงทุน (ราย) Retail	จำนวนผู้ถือหน่วยลงทุน (ราย) HNW	จำนวนผู้ถือหน่วยลงทุน (ราย) II	จำนวนผู้ถือหน่วยลงทุน (ราย) Corporate	มูลค่าหน่วยลงทุนที่ถือครอง (ลบ.) Retail	มูลค่าหน่วยลงทุนที่ถือครอง (ลบ.) HNW	มูลค่าหน่วยลงทุนที่ถือครอง (ลบ.) II	มูลค่าหน่วยลงทุนที่ถือครอง (ลบ.) Corporate
LTF								
RMF								
SSFX								
SSF (ไม่รวม SSM)								
กองทุน MMF (ไม่รวม RMF)								
กองทุน Daily FI								
กองทุน Term Fund								
กองทุนหุ้นระยะสั้น								
กองทุนหุ้นระยะยาว								
กองทุนผสมหุ้นและพันธบัตร								
กองทุนทรัพย์สินทางเลือก (alternative fund)								
กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง 1)								
ทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์								
กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน								

- alternative fund ได้แก่ กองค้ำหนุน และกองทุนรวมทรัพย์สินทางเลือกประเภทอื่น ๆ ที่ไม่ใช่งบประมาณของสำนักงานส่งเสริมวิสาหกิจขนาดกลางและขนาดย่อม
- จำนวนผู้ถือหุ้นรายละไม่เกิน 100 คน
- กรรมการบริหารและผู้ถือหุ้นสามัญต้องเป็นบุคคลธรรมดาหรือนิติบุคคลสัญชาติไทย
- กำไรสุทธิไม่น้อยกว่าร้อยละ 10 ของกำไรสุทธิหลังหักค่าเสื่อมราคา ค่าภาษีเงินได้ และค่าดอกเบี้ย
- เงินปันผลไม่น้อยกว่าร้อยละ 90 ของกำไรสุทธิหลังหักค่าเสื่อมราคา ค่าภาษีเงินได้ และค่าดอกเบี้ย
- HNW หมายถึง ผู้ลงทุน Retail ที่มีเงินลงทุนในกองทุนรวม > 10 ลบ.
- II หมายถึง ผู้ลงทุนตามนิยามในข้อ 4. ของประกาศที่ กอ.4/2560 เรื่อง การกำหนดนิยามผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และผู้ลงทุนรายใหญ่ (ฉบับปรับปรุง)

Validation:

1. ทุก field ยกเว้นประเภทของทุน ห้ามเป็นตัวเลขติดลบ 2. not null ทุก field

เลขที่จดทะเบียน 1/	การแบ่ง ชนิด หน่วย ลงทุน 2/	ชื่อ กอง 3/	ประเภท กอง 4/	จำนวน ผู้ถือ หน่วย ลงทุน (รวม) < 20 ปี	จำนวน ผู้ถือ หน่วย ลงทุน (รวม) 21-30 ปี	จำนวน ผู้ถือ หน่วย ลงทุน (รวม) 31-40 ปี	จำนวน ผู้ถือ หน่วย ลงทุน (รวม) 41-50 ปี	จำนวน ผู้ถือ หน่วย ลงทุน (รวม) 51-60 ปี	จำนวน ผู้ถือ หน่วย ลงทุน (รวม) > 60 ปี	มูลค่า หน่วย ลงทุนที่ ลดลง (ลบ.) < 20 ปี	มูลค่า หน่วย ลงทุน ที่ถือ ครอง (ลบ.) 21-30 ปี	มูลค่า หน่วย ลงทุน ที่ถือ ครอง (ลบ.) 31-40 ปี	มูลค่า หน่วย ลงทุน ที่ถือ ครอง (ลบ.) 41-50 ปี	มูลค่า หน่วย ลงทุน ที่ถือ ครอง (ลบ.) 51-60 ปี	มูลค่า หน่วย ลงทุน ที่ถือ ครอง (ลบ.) > 60 ปี	มูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ ต่อ หน่วย (บาท)	มูลค่า ทรัพย์สินสุทธิ (ลบ.)	Subscription (ลบ.) 5/	Redemption (ลบ.) 6/
-----------------------	---	-------------------	---------------------	---	--	--	--	--	---	---	---	---	---	---	--	---	-----------------------------------	-----------------------------	---------------------------

บทประพันธ์ของสมเด็จพระนางเจ้าสิริกิติ์ พระบรมราชินีนาถ พระบรมราชชนนีพันปีหลวง ในวาระที่ประเทศไทยได้ก้าวเข้าสู่สังคมดิจิทัล

หน้าห้องจดหมายพิเศษประเภท "N", "กระดาน" แห่งหอสมุดแห่งชาติ
2/29 หน้า "Y", "กระดาน" แห่งหอสมุดแห่งชาติ

3/ การเป็นกองหนุนสำหรับการแบ่งชนิดคหน้าवलทุน ในรื่องงานเป็นข้อข้อของชนิดคหน้าवलทุนนั้น

4. ให้ระบุ “SSF” กรณีที่กองทุนช่วยเหลือชนิตทุนนำยลกองทุนนเปนกองทุนรวมเพื่อการออม และระบุ “SSFx” กรณีที่กองทุนหรือชนิตทุนนำยลกองทุนนเปนกองทุนรวมเพื่อการออมหรือการออมพิเศษ

5/ subscription ให้รายงานมูลค่าขายหน่วยลงทุน รวม switch in โดยเป็นยอดสะสมรายเดือน

6/ redemption ให้รายงานมูลค่าซื้อขายกันหน่วยลงทุน รวม switch out โดยเป็นยอดสะสมรายเดือน

Validation:

1. เฉพาะกองทุน SSF และ SSFX

2. เลขที่จดทะเบียนเป็นไปตาม format ของสำนักงาน

3. การแบ่งชนิดคห่วยลงทุน ให้ระบุได้เฉพาะค่า “Y” และ “N” เท่านั้น

4. ประเภทของ ไร่ที่ได้ผลเฉพาะค่า “SF” และ “SFX” เท่านั้น

5. ทุก field ยกเว้นการแบ่งชนิดหน่วยลงทุน ชื่อย่อกอง และประเภทกอง ห้ามเป็นตัวเลขติดลบ

6. not null η_n field

1.4 รวมทุกกองทุนภายใต้การจัดการ (ไม่รวมกองทุนวายุภักษ์ กองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุนต่างประเทศ และกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง 2 และ 4))

จำนวนผู้ถือหน่วยลงทุน (ราย) Retail	จำนวนผู้ถือหน่วยลงทุน (ราย) HNW	จำนวนผู้ถือหน่วยลงทุน (ราย) II	จำนวนผู้ถือหน่วยลงทุน (ราย) Corporate	มูลค่าหน่วยลงทุน ที่ถือครอง (ลบ.) Retail	มูลค่าหน่วยลงทุน ที่ถือครอง (ลบ.) HNW	มูลค่าหน่วยลงทุน ที่ถือครอง (ลบ.) II	มูลค่าหน่วยลงทุน ที่ถือครอง (ลบ.) Corporate

- จำนวนผู้ถือหน่วยลงทุน “ไม่มีบัญชี” ผู้ลงทุนรายเดียวกัน

- กรณีกองทุนรวมและทรัสต์ที่ listed ในตลาดหลักทรัพย์ “ได้แก่” กองทุนรวม ETF กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน และทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ ให้รายงานโดยใช้อัตราจากวันที่ปิดสมุดทะเบียนล่าสุด

- HNW หมายถึง ผู้ลงทุน ที่มีเงินลงทุนในกองทุนรวม > 10 ลบ.

- II หมายถึง ผู้ลงทุนฉบับตามนิยามในข้อ 4. ของประกาศที่ กอ. 4/2560 เรื่อง การกำหนดนิยามผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และผู้ลงทุนรายใหญ่ (ฉบับประมวล)

Validation :

1. ทุก field ห้ามเป็นตัวเลขติดลบ

2. not null ทุก field

2. รายงานข้อมูลพอร์ตการลงทุนของกองทุนอย่างย่อ

2.1 ข้อมูลพอร์ตการลงทุน MMF และ Daily FI รายประเภทตราสาร

เลขที่ จดทะเบียน	nav (ถ.)	Saving (ถ.)	GOV (ถ.)	Time Deposit (ถ.)	Foreign Deposit (ถ.)	CORP ใน ประเภท ทั้งหมด (ถ.)	CORP ใน ประเภท Rating A ขึ้นไป (ถ.)	CORP ใน ประเภท Rating BBB+ (ถ.)	CORP ใน ประเภท Rating BBB (ถ.)	CORP ใน ประเภท Rating BBB- (ถ.)	CORP ใน ประเภท HYB (ถ.)	CORP ต่าง ประเภท ทั้งหมด (ถ.)	CORP ต่าง ประเภท Rating A ขึ้นไป (ถ.)	CORP ต่าง ประเภท Rating BBB+ (ถ.)	CORP ต่าง ประเภท Rating BBB (ถ.)	CORP ต่าง ประเภท Rating BBB- (ถ.)	CORP ต่าง ประเภท Rating HYB (ถ.)	อื่นๆ (ถ.)

ให้รายงานโดยข้อมูลในวันทำการก่อนหน้า (วันที่ t-1)

GOV หมายถึง ตราสารหนี้ภาครัฐ

CORP หมายถึง ตราสารหนี้ภาคเอกชน

HYB หมายถึง ตราสารหนี้กลุ่มที่มีความเสี่ยงสูง ได้แก่ ตราสารหนี้ที่มี Rating ต่ำกว่าระดับลงทุนได้ (Non-investment Grade) และตราสารหนี้ที่ไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (Unrated) อื่น ๆ ได้แก่ รายการเงินกู้ยืมหรือขายคืนหน่วยลงทุนที่ออกโดยตราสารหนี้ระยะสั้นผู้ลงทุน

Validation :

1. เลขเพิกงอก MMF (ไม่รวม RMF และ MF for PVD) และ Daily FI (ไม่รวมกอง RMF กองหน่วยลงทุน และ MF for PVD)
2. เลขที่จดทะเบียนเป็นไปตาม format ของสำนักงาน
3. ทุก field ยกเว้น เลขที่จดทะเบียน และ อื่น ๆ ห้ามเป็นค่าลบ
4. not null ทุก field

2.2 ข้อมูลพอสรุปการลงทุนของกองทุนรวมทุกกองทุนรายหลักทรัพย์

เลขที่ จดทะเบียน	ประเภท หลักทรัพย์ 1/	ประเภท การลงทุน 2/	ผู้ออก / ผู้สัญญา 3/	ชื่อย่อ หลักทรัพย์	อันดับ ความ น่าเชื่อถือ ของผู้ออก / ผู้สัญญา	Credit Rating Agency 4/	Notional Amount (ลบ.) 5/	วัตถุประสงค์ ในการ ทำธุรกรรม 6/	วันที่ออก 7/	วันที่ครบ กำหนด 8/	มูลค่าลงทุน (ลบ.) 9/	สัดส่วน มูลค่าลงทุน ต่อ nav (%)

ให้รายงาน โดยใช้ข้อมูลในวันทำการก่อนหน้า (วันที่ t-1)

1/ ใช้ชุด code ที่กำหนดในท้ายเอกสารนี้

2/ ประเภทการลงทุน ในประเทศให้ระบุ “D” ต่างประเทศให้ระบุ “F”

3/ ชื่อผู้ออก / ผู้สัญญา ให้ระบุเป็นชื่อเต็ม ห้ามตัวย่อ

4/ Rating agency ให้ระบุเป็นชื่อย่อ เช่น TRIS, FITCH, FITCH(Thailand), S&P, MOODY’S

5/ ให้รายงาน notional amount เฉพาะในกรณีที่เป็นสัญญาอนุพันธ์

6/ ให้รายงานวัตถุประสงค์ในการทำธุรกรรมในกรณีที่เป็นการทำสัญญาอนุพันธ์ โดยระบุ “H” กรณีที่มีวัตถุประสงค์เพื่อ hedge และ “T” กรณีที่มีวัตถุประสงค์เพื่อลงทุน

7/ และ 8/ วันที่ออกและวันที่ครบกำหนด ให้ใช้ format YYYYMMDD โดยให้ระบุเป็นปี ค.ศ.

9/ กรณีสัญญาอนุพันธ์ ให้รายงานมูลค่าลงทุนเป็นมูลค่า mark to market gain/loss

Validation :

1. เลขที่จดทะเบียนเป็นไปตาม format ของสำนักงาน
2. ประเภทหลักทรัพย์ เป็นไปตามชุด code ที่สำนักงานกำหนด
3. ประเภทการลงทุนให้ระบุได้เฉพาะ “D” หรือ “F”
4. notional amount ห้ามติดลบ
5. วัตถุประสงค์ในการทำธุรกรรม ให้ระบุได้เฉพาะ “H” หรือ “T”
6. วันที่ออกและวันที่ครบกำหนด ให้ใช้ format YYYYMMDD โดยให้ระบุเป็นปี ค.ศ.
7. not null สำหรับ field เลขที่จดทะเบียน ประเภทหลักทรัพย์ มูลค่าลงทุน และสัดส่วนมูลค่าลงทุนต่อ nav

3. รายงานข้อมูลการไถ่ถอนหน่วยลงทุนในภาวะไม่ปกติ

3.1 ข้อมูลการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวม MMF และ Daily FI ระหว่างวัน

เลขที่ จดทะเบียน	ประเภทกอง 1/	nav (ลบ.)	Subscription (ลบ.) 2/	Redemption (ลบ.) 3/	กรณี Net Redemption > 5%nav กองทุนมี cash reserve เพียงพอหรือไม่ 4/	กรณี Net Redemption > 5%nav สาเหตุการไถ่ถอนเกิดจากผู้ลงทุนกลุ่มใด 5/

- 1/ ประเภทกอง ได้แก่ กองทุนรวม MMF ให้รายงาน "MMF" และกองทุนรวม Daily FI ให้รายงาน "DFI"
- 2/ subscription ให้รายงานมูลค่าขายหน่วยลงทุน รวม switch in
- 3/ redemption ให้รายงานมูลค่าซื้อคืนหน่วยลงทุน รวม switch out
- 4/ ให้ระบุ "Y" กรณีที่กองทุนมี cash reserve เพียงพอรองรับ net redemption และ "N" กรณีที่กองทุนมี cash reserve ไม่เพียงพอรองรับ net redemption ทั้งนี้ cash reserve ได้แก่ เงินสด เงินฝากออมทรัพย์ที่คำนวณถึง พันธบัตรรัฐบาลแห่งประเทศไทยที่อายุคงเหลือ < 1 ปี และพันธบัตรรัฐบาลที่อายุคงเหลือ < 1 ปี
- 5/ ให้ระบุ "R" กรณีที่เกิดจากผู้ลงทุนกลุ่ม Retail และ "W" กรณีที่เกิดจากผู้ลงทุนกลุ่ม HNWI

Validation :

1. เฉพาะกอง MMF (ไม่รวม RMF และ MF for PVD) และ Daily FI (ไม่รวมกอง RMF กองหน่วยลงทุน และ MF for PVD)
2. เลขที่จดทะเบียนเป็นไปตาม format ของสำนักงาน
3. ประเภทกอง ให้ระบุได้เฉพาะ "MMF" หรือ "DFI"
4. nav, subscription และ redemption ห้ามนิเสธ
5. field กรณี Net Redemption > 5%nav กองทุนมี cash reserve เพียงพอหรือไม่ ให้ระบุได้เฉพาะ "Y" หรือ "N"
6. field กรณี Net Redemption > 5%nav สาเหตุการไถ่ถอนเกิดจากผู้ลงทุนกลุ่มใด ให้ระบุได้เฉพาะ "R" หรือ "W"
7. check ว่าถ้า (redemption – subscription) > 5%nav ต้องรายงาน field ตามข้อ 5. และ 6.
8. not null ทุก field ยกเว้น field ตามข้อ 5. และ 6.

3.2 ข้อมูลสภาพคล่องและการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมปิดรายกองทุน เป็นรายวัน

เลขที่ จดทะเบียน	รอบการ ไถ่ถอน หน่วยลงทุน	ระยะเวลา ชำระเงิน ค่าขายคืน หน่วยลงทุน ตามจริง	สินทรัพย์ สภาพคล่อง Cash Reserve (ลบ.)	สินทรัพย์ สภาพคล่อง Tier 1 (ลบ.)	สินทรัพย์ สภาพคล่อง Tier 2 (ลบ.)	สินทรัพย์ สภาพคล่อง หุ้น SET50 (ลบ.)	สินทรัพย์ สภาพคล่อง หุ้น ต่างประเทศ (ลบ.)	สินทรัพย์ สภาพคล่อง หน่วยลงทุน (ลบ.)	nav (ลบ.)	Subscription (ลบ.)	Redemption (ลบ.)	มูลค่า สุทธิ (ลบ.)	สถานะ การไถ่ถอน
1/	2/	3/	(ลบ.)	(ลบ.)	(ลบ.)	(ลบ.)	(ลบ.)	(ลบ.)	4/	5/	6/	7/	

ให้รายงานโดยใช้ข้อมูลในวันทำการที่สำนักงานร้องขอ (วันที่ t) ยกเว้นกรณีสินทรัพย์สภาพคล่อง ให้ใช้ข้อมูลในวันทำการก่อนหน้า (วันที่ t-1)

1/ รอบการไถ่ถอนหน่วยลงทุน ให้ระบุช่วงเวลาที่เป็นตัวเลข ให้ผู้ลงทุนเป็นตัวอักษร เช่น ทุกวันทำการ ทุกรอบสัปดาห์ ทุกรอบ 15 วัน ฯลฯ

2/ ระยะเวลาชำระเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนตามจริง ให้ระบุเป็นตัวตัวเลข เช่น +2 วัน ให้ระบุเป็นเลข “2” เป็นต้น

3/ cash reserve ได้แก่ เงินสด เงินฝากออมทรัพย์ ค่าเงินคงคลัง พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทยที่อายุคงเหลือ < 1 ปี และพันธบัตรรัฐบาลที่อายุคงเหลือ < 1 ปี

4/ subscription ให้รายงานมูลค่าขายหน่วยลงทุน รวม switch in

5/ redemption ให้รายงานมูลค่าซื้อคืนหน่วยลงทุน รวม switch out

6/ มูลค่าสุทธิ หมายถึง (มูลค่าขายรวม switch in) – (มูลค่าซื้อคืนรวม switch out)

7/ สถานการณ์ไถ่ถอนหน่วยลงทุน ให้พิจารณาจากมูลค่าสุทธิที่เป็นยอด net redemption > 5%nav หรือกองทุนมีสภาพคล่องไม่เพียงพอรองรับการไถ่ถอนหน่วยลงทุน โดยให้ระบุ “Y” กรณีที่เป็นปกติ และระบุ “N” กรณีที่ผิดปกติ

หมายเหตุ : ในกรณีที่พบว่ากองทุนรวม MMF และ Daily FI กองใด มีมูลค่า net redemption > 5%nav ขอให้ บลจ. แจ้งสำนักงานให้ทราบทางอีเมลหรือทางโทรศัพท์เกี่ยวกับรายละเอียดการไถ่ถอน เช่น กลุ่มผู้ลงทุนที่ไถ่ถอน และผู้ลงทุนดังกล่าวมีการแจ้งล่วงหน้าหรือไม่ เป็นต้น รวมทั้งความเพียงพอของสภาพคล่อง

Validation :

1. ทุกกองทุนเปิด โดยไม่รวมกองทุนตราหนี้ประเภท Term Fund, ETF, RMF และ MF for PVD
2. เลขที่จดทะเบียนเป็นไปตาม format ของสำนักงาน
3. field cash reserve, tier 1, tier 2, หุ้น SET50, หุ้นต่างประเทศ, nav, subscription และ redemption ห้ามติดลบ
4. check มูลค่าสุทธิ ต้องเท่ากับ subscription - redemption
5. field สถานะการไถ่ถอน ให้ระบุได้เฉพาะ “Y” หรือ “N”
6. not null สำหรับ field เลขที่จดทะเบียน รอบการไถ่ถอนหน่วย ระยะเวลารับเงินค่าขายคืนหน่วยลงทุนตามจริง, nav, subscription, redemption, มูลค่าสุทธิ และสถานะการไถ่ถอน

ชุด code ที่ใช้สำหรับการรายงาน

1. รหัสประเภทผู้ถือหุ้นรายลงทุน

รหัส	ประเภทผู้ถือหุ้นรายลงทุน	หมายเหตุ
01	Omnibus Account	
02	Pension & Contractual Savings	ได้แก่ กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ กองทุนประกันสังคม และกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
03	กองทุนรวม	
04	กองทุนส่วนบุคคล	
05	ธนาคารแห่งประเทศไทย	
06	หน่วยงานรัฐบาล	ได้แก่ รัฐบาลท้องถิ่น รัฐวิสาหกิจ และส่วนราชการสังกัดรัฐบาลกลางและกองทุนเงินทดแทน
07	ธนาคารพาณิชย์	ได้แก่ ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ สถาบันการเงินเฉพาะกิจที่รับฝาก และสาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ
08	สถาบันการเงินอื่น	ได้แก่ บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ บริษัทเงินทุน บริษัทหลักทรัพย์ และสถาบันการเงินที่ไม่รับฝากเงินอื่น ๆ
09	บริษัทประกันชีวิต	
10	บริษัทประกันภัย	
11	บริษัทและนิติบุคคลอื่นๆ	
12	บุคคลธรรมดาผู้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศ	
13	บุคคลธรรมดาผู้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศ ประเภท High Net Worth	
14	บุคคลธรรมดาผู้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศ ประเภท Ultra High Net Worth	
15	ผู้มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ ที่เป็นบุคคลธรรมดา	
16	ผู้มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ ที่เป็นบุคคลธรรมดา ประเภท High Net Worth	

รหัส	ประเภทผู้ถือหุ้นลงทุน	หมายเหตุ
17	ผู้ถือหุ้นในต่างประเทศ ที่เป็นบุคคลธรรมดา ประเภท Ultra High Net Worth	
18	ผู้ถือหุ้นที่อยู่ในต่างประเทศ ที่ใช้บุคคลธรรมดา	ได้แก่ ผู้ถือหุ้นในต่างประเทศที่เป็นนิติบุคคล ผู้ถือหุ้นที่อยู่ในต่างประเทศที่เป็นสถาบันการเงิน และผู้ถือหุ้นในต่างประเทศอื่น ๆ
19	สาธารณะ	ได้แก่ สาธารณชนหรือบุคคลอื่น ๆ
90	อื่น ๆ	
91	ผู้ถือหุ้นลงทุน 5 อันดับแรก (ไม่รวม Omnibus Account)	กรณีที่ยังไม่รวม "91" ไม่ควรรายงานชื่อ Selling Agent และให้ระบุจำนวนผู้ถือหุ้นลงทุนใน field "จำนวนผู้ถือหุ้นลงทุน" = 5 ราย

2. รหัสประเภทหลักทรัพย์

รหัส	ประเภทหลักทรัพย์
01	เงินฝากออมทรัพย์
02	เงินฝากประจำ
03	บัตรเงินฝาก
04	ตั๋วแลกเงิน
05	ตั๋วสัญญาใช้เงิน
06	หุ้นกู้
07	พันธบัตรรัฐบาล
08	หุ้นสามัญ
09	หน่วยลงทุน
10	Forward
11	Futures

รหัส	ประเภทหลักทรัพย์
12	Swap
13	Options
14	อื่น ๆ

นิยามของประเภทผู้ถือหุ้นรายลงทุน

ประเภทผู้ถือหุ้นรายลงทุน	นิยาม
รัฐบาลท้องถิ่น	กทม. เมืองพัทยา เทศบาล ผู้ขงาปบาล องค์การบริหารส่วนจังหวัด องค์การบริหารส่วนตำบล โรงเรียนหรือโรงพยาบาลสังกัด กทม. โรงเรียนหรือสถานพยาบาลสังกัดองค์การบริหารส่วนท้องถิ่น (อบท.) และ กองทุนของรัฐบาลท้องถิ่น คือ กองทุนส่งเสริมเทศบาล และกองทุนส่งเสริมกิจการเทศบาล
รัฐวิสาหกิจ	รัฐวิสาหกิจ และองค์การของรัฐ รวมถึงรัฐวิสาหกิจที่ดำเนินการในรูปแบบบริษัทที่รัฐบาลหรือหน่วยงานที่เป็นรัฐวิสาหกิจอื่นเข้าไปถือหุ้นร่วมทุน เินร้อยละห้าสิบของทุนทั้งหมด
ส่วนราชการสังกัดรัฐบาลกลางและกองทุนเงินทดแทน	รัฐบาลไทย กระทรวง ทบวง กรม สถานศึกษาและโรงพยาบาลของรัฐ สถานชุดไทย สำนักงานพระคลังข้างที่ สำนักงานทรัพย์สินส่วนพระมหากษัตริย์ กองทุนเงินนอกงบประมาณของรัฐบาล และหน่วยงานรัฐวิสาหกิจที่ดำเนินงานโดยรัฐบาลและไม่แสวงหากำไร
ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ	ธนาคารพาณิชย์ไทย ธนาคารพาณิชย์ไทยเพื่อย่อย ธนาคารพาณิชย์ที่เป็นบริษัทลูกของธนาคารต่างประเทศ (Subsidiary) ไม่รวมสาขาธนาคารไทยในต่างประเทศ
บริษัทหลักทรัพย์จดทะเบียน	บริษัทมหาชนจำกัดที่ได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจเครดิตฟองซิเอร์ สามารถทำธุรกิจโดยการรับฝากเงินจากประชาชน และให้สินเชื่อโดยวิธีรับจ้างนองส่งทรัพย์สินทรัพย์ และการรับซื้ออสังหาริมทรัพย์ด้วยวิธีฝากขายเท่านั้น
บริษัทหลักทรัพย์	บริษัทหลักทรัพย์ ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทต่าง ๆ เช่น การเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ การค้าหลักทรัพย์ การจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ เป็นต้น อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 และที่แก้ไขเพิ่มเติม
สถาบันการเงินที่ไม่รับฝากเงินอื่น ๆ	สำนักงานผู้แทนธนาคารต่างประเทศ กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงิน สถาบันคุ้มครองเงินฝาก บริษัทตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) บริษัทบริหารสินทรัพย์ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม โรรับขำนำ ธุรกิจเช่าซื้อ ธุรกิจสินเชื่อ ธุรกิจหลักทรัพย์ไทย ดำเนินงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ บริษัทผู้รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

ประเภทผู้ถือหุ้นรายลงทุน	นิยาม
	ผู้ประกอบธุรกิจที่ไม่ใช่ธนาคาร (Non-Bank) ผู้ประกอบธุรกิจให้สินเชื่อส่วนบุคคลที่ไม่ใช่ธนาคาร ผู้ประกอบธุรกิจบัตรเครดิตที่ไม่ใช่สถาบันการเงิน Money Changer และสถาบันการเงินเฉพาะกิจที่ไม่รับฝากเงิน เช่น บริษัทตลาดรองสินเชื่อที่อยู่อาศัย บริษัทประกันสินเชื่ออุตสาหกรรม ขนาดย่อม
สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ	สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ และสำนักงานวิเทศภารกิจของธนาคารต่างประเทศ
บริษัทประกันภัย	บริษัทที่ประกอบธุรกิจประกันภัย ประกันวินาศภัย ประกันสุขภาพ
บริษัทและนิติบุคคลอื่น ๆ	ห้างหุ้นส่วนจำกัด ห้างหุ้นส่วนสามัญนิติบุคคล บริษัทจำกัด บริษัทมหาชนจำกัด Holding Company สถาบันการศึกษาและโรงพยาบาล ของเอกชน รวมถึงองค์กรที่มีสถานภาพเป็นนิติบุคคล หรือจัดตั้งตามกฎหมายเฉพาะอื่นๆ (เช่น กิจการร่วมค้า นิติบุคคลอาคารชุด นิติบุคคล บ้านจัดสรร องค์การของรัฐบาลหรือหน่วยงานธุรกิจที่รัฐบาลเป็นเจ้าของและถือหุ้นน้อยกว่าร้อยละห้าสิบของทุนทั้งหมด รวมถึงสถาบันการเงิน ที่ปิดดำเนินการแล้วแต่ยังมีสภาพเป็นนิติบุคคลอยู่
สถาบันที่ไม่มีวัตถุประสงค์เพื่อการค้า	องค์กรสาธารณกุศล สมาคม สโมสร มูลนิธิ วัด ศาสนสถาน โบสถ์ มัสยิด สถานทนายความ หอการค้า พรรคการเมือง สถาบันการศึกษา หรือโรงพยาบาลของเอกชนที่จัดตั้งโดยสมาคม สโมสร หรือมูลนิธิ ต่าง ๆ
บุคคลธรรมดาผู้ถือหุ้นในประเทศ	บุคคลธรรมดา คณะบุคคล ห้างหุ้นส่วนสามัญ สถาบันการศึกษา หรือสถานพยาบาลของเอกชน (ที่เป็นของบุคคลธรรมดา) ธุรกิจเอกชนที่มีได้ดำเนินการในรูปแบบนิติบุคคล
บุคคลธรรมดาผู้ถือหุ้นในประเทศ ประเภท High Net Worth	บุคคลธรรมดาผู้ถือหุ้นในประเทศ ซึ่งมีเงินลงทุนในกองทุนรวม > 10 ลบ. แต่ไม่เกิน 25 ลบ.
บุคคลธรรมดาผู้ถือหุ้นในประเทศ ประเภท Ultra High Net Worth	บุคคลธรรมดาผู้ถือหุ้นในประเทศ ซึ่งมีเงินลงทุนในกองทุนรวม > 25 ลบ.
ผู้ถือหุ้นที่อยู่ในต่างประเทศ ที่เป็นนิติบุคคล	นิติบุคคลตามกฎหมายต่างประเทศ เช่น รัฐบาล องค์การของรัฐ องค์การระหว่างประเทศ สถานทูตต่างประเทศ บริษัทจำกัด เป็นต้น
ผู้ถือหุ้นในต่างประเทศที่เป็นบุคคลธรรมดา	บุคคลธรรมดาที่ไม่ใช่สัญชาติไทยและมีถิ่นกำเนิดหรืออยู่ในต่างประเทศ

ประเภทผู้ลงทุน	นิยาม
ผู้ลงทุนที่อยู่ในต่างประเทศที่เป็น บุคคลธรรมดา ประเภท High Net Worth	บุคคลธรรมดาผู้ลงทุนที่อยู่ในต่างประเทศ ซึ่งมีเงินลงทุนในกองทุนรวม > 10 ลบ. แต่ไม่เกิน 25 ลบ.
ผู้ลงทุนที่อยู่ในต่างประเทศที่เป็น บุคคลธรรมดา ประเภท Ultra High Net Worth	บุคคลธรรมดาผู้ลงทุนที่อยู่ในต่างประเทศ ซึ่งมีเงินลงทุนในกองทุนรวม > 25 ลบ.
ผู้ลงทุนที่อยู่ในต่างประเทศที่เป็น สถาบันการเงิน	สถาบันการเงินที่อยู่ในต่างประเทศ สาขาธนาคารพาณิชย์ไทยที่ตั้งในต่างประเทศ
ผู้ลงทุนที่อยู่ต่างประเทศอื่น ๆ	ผู้ลงทุนที่อยู่ต่างประเทศอื่น ๆ เช่น มัลดีฟส์ ฮ่องกง สวิตเซอร์แลนด์ที่อยู่ในต่างประเทศ
สหกรณ์ออมทรัพย์และสหกรณ์ เครดิตยูเนียน	สหกรณ์ออมทรัพย์ เป็นองค์การทางเศรษฐกิจและสังคมที่สมาชิกร่วมกันจัดตั้งขึ้นเพื่อการลงทุนร่วมกัน แต่ละคนมีสิทธิออกเสียงได้หนึ่งเสียงในการบริหารสหกรณ์ โดยไม่ขึ้นกับจำนวนหุ้นที่ถืออยู่ รวมชุมนุมสหกรณ์ออมทรัพย์ ส่วน Credit Union เป็นสถาบันการเงินที่สมาชิกเป็นเจ้าของและบริหารงานโดยสมาชิก มีจุดประสงค์ในการระดมเงินออมเพื่อใช้สำหรับเป็นทุนในการแก้ไขสมาชิกในรูปแบบของสินเชื่อโดยคิดอัตราดอกเบี้ยที่เหมาะสม และไม่นำผลกำไรที่จะถูกจัดสรรเป็นสวัสดิการต่าง ๆ ให้แก่สมาชิก
สหกรณ์อื่น ๆ ยกเว้น สหกรณ์ ออมทรัพย์และสหกรณ์เครดิตยูเนียน	สหกรณ์อื่น ๆ นอกเหนือจากสหกรณ์ออมทรัพย์และเครดิตยูเนียน เช่น สหกรณ์การเกษตร สหกรณ์ร้านค้า สหกรณ์บริการ