

เอกสารรับฟังความคิดเห็น

เลขที่ ่อนจ. 42/2561

เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานกองทุน

เผยแพร่เมื่อวันที่ 18 ตุลาคม 2561

สำนักงานได้จัดทำเอกสารฉบับนี้ขึ้นเพื่อรับฟังความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้อง
ท่านสามารถ download เอกสารเผยแพร่ฉบับนี้ได้จาก www.sec.or.th

ท่านสามารถส่งความเห็นหรือข้อเสนอแนะให้สำนักงานได้
ตามที่ติดต่อด้านล่าง หรือ e-mail: arthipha@sec.or.th; teerawat@sec.or.th
วันสุดท้ายของการแสดงความคิดเห็น วันที่ 19 พฤศจิกายน 2561

ท่านสามารถติดต่อสอบถามข้อมูลเพิ่มเติมได้จากเจ้าหน้าที่ของสำนักงาน ดังนี้

1. นายอภิภัทร พูลถนอมสุข โทรศัพท์/โทรสาร 0-2263-6039
2. นายธีรวัตร มุกดาพิทักษ์ โทรศัพท์/โทรสาร 0-2263-6511

สำนักงานขอขอบคุณทุกท่านที่เข้าร่วมแสดงความคิดเห็น
และให้ข้อเสนอแนะ มา ณ โอกาสนี้

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
เลขที่ 333/3 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900
โทรศัพท์ 1207 หรือ 0-2033-9999 โทรสาร 0-2033-9660

1. ที่มา

ด้วยที่ผ่านมา ธุรกิจจัดการกองทุนมีการเติบโตอย่างต่อเนื่อง ส่งผลให้มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของธุรกิจจัดการกองทุนรวม กองทุนส่วนบุคคล และกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ณ สิ้นเดือนมิถุนายน 2561 มีขนาด 7.08 ล้านล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 44 เมื่อเทียบกับผลิตภัณฑ์มวลรวมของประเทศ (Gross Domestic Product : GDP) ขณะเดียวกัน สำนักงานได้ปรับปรุงหลักเกณฑ์เพื่อช่วยผู้ลงทุนมีทางเลือกในการลงทุนในกองทุนรวมที่หลากหลายขึ้น เช่น การอนุญาตให้มีการจัดตั้งกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษซึ่งมีลักษณะการลงทุนที่ไม่จำกัดรูปแบบ เป็นต้น

ขนาดที่เพิ่มขึ้นอย่างมีนัยสำคัญประกอบกับความหลากหลายของผลิตภัณฑ์ ส่งผลให้ธุรกิจจัดการลงทุนมีความสำคัญและเชื่อมโยงกับผู้เกี่ยวข้องในระบบเศรษฐกิจ เช่น ผู้ลงทุน ผู้เล่นอื่น ๆ ในตลาด ผู้ออกตราสารหรือคู่สัญญา รวมถึงธนาคารพาณิชย์ในฐานะบริษัทแม่เพิ่มขึ้น ด้วยเหตุดังกล่าว หากกองทุนได้รับผลกระทบจากความผันผวนของตลาดทุน ก็อาจส่งผลให้เกิดความเสี่ยงต่อระบบ (“systemic risk”) ที่ลุกลามเป็นวงกว้างไปยังผู้เกี่ยวข้องอื่น ๆ ในตลาดและกระทบต่อไปยังภาคเศรษฐกิจจริง (“real sector”) ในที่สุด ทั้งนี้ โอกาสและความรุนแรงของการส่งผ่านผลกระทบจากกองทุนไปยังผู้เกี่ยวข้องในระบบขึ้นอยู่กับลักษณะการลงทุนของกองทุนว่ามีความเสี่ยงมากเพียงใด ยิ่งกองทุนมีการลงทุนในหลักทรัพย์เสี่ยง หรือหลักทรัพย์ที่มีสภาพคล่องต่ำ หรือมีฐานะการลงทุนที่สูงกว่าเงินลงทุน (“leverage”) กองทุนจะยิ่งมีความเปราะบางต่อการได้รับผลกระทบจากตลาดมากยิ่งขึ้น

สำนักงานจึงมีแนวคิดที่จะปรับปรุงแบบรายงานข้อมูลกองทุนรวม กองทุนส่วนบุคคล กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และข้อมูลผู้ถือหน่วยลงทุน โดยเน้นปรับปรุงในส่วนของข้อมูลฐานะการลงทุนและค่าความเสี่ยงของกองทุน การกระจุกตัวของผู้ถือหน่วยลงทุน กลยุทธ์และการใช้ prime broker ของ hedge fund เพื่อให้มีข้อมูลที่เพียงพอในการติดตามความเสี่ยง systemic risk ของธุรกิจจัดการลงทุนและมีมาตรการรองรับได้อย่างทันต่อเหตุการณ์ ซึ่งจะช่วยชะลอหรือยับยั้งผลกระทบที่อาจเกิดขึ้นกับเศรษฐกิจ ตลาดทุน และผู้ลงทุน

ในการนี้ สำนักงานจึงเห็นควรให้มีการรับฟังความคิดเห็นจากผู้ที่เกี่ยวข้องเกี่ยวกับแนวทางและรายละเอียดของการปรับปรุงแบบรายงานดังกล่าว โดยสำนักงานจะนำข้อคิดเห็นต่าง ๆ จากผู้ที่เกี่ยวข้องไปใช้เป็นข้อมูลประกอบการพิจารณาปรับปรุงเหมาะสมในทางปฏิบัติต่อไป ทั้งนี้ การรับฟังความคิดเห็นจะมีไปจนถึงวันที่ 19 พฤศจิกายน 2561 โดยผู้ที่ประสงค์จะแสดงความคิดเห็นสามารถส่งความคิดเห็นและข้อเสนอแนะต่อสำนักงานได้ทั้งในรูปแบบเอกสารหรือ e-mail ตามรายละเอียดที่ระบุไว้

2. เป้าหมายที่ต้องการบรรลุ (Intended Outcome)

มีข้อมูลอย่างเพียงพอในการติดตามและประเมินความเสี่ยง systemic risk ของธุรกิจจัดการลงทุน รวมทั้งสามารถกำหนดมาตรการเพื่อรักษาเสถียรภาพของตลาดทุน

3. แนวทางปรับปรุงแบบรายงาน

เพื่อให้มีข้อมูลครบถ้วนและเพียงพอต่อการติดตามความเสี่ยง systemic risk และลดภาระของผู้ประกอบธุรกิจ สำนักงานเห็นควรปรับปรุงแบบรายงาน โดยมีรายละเอียดดังต่อไปนี้

3.1 แบบรายงานการฝากทรัพย์สินของกองทุนส่วนบุคคลกับผู้รับฝากทรัพย์สินแต่ละราย¹

ให้ยกเลิกแบบรายงานดังกล่าว โดยให้จัดทำและนำส่งตามที่สำนักงานร้องขอเป็นรายกรณีไป

3.2 แบบรายงาน Stress Test

วัตถุประสงค์	เพื่อใช้ติดตามความเสี่ยงของกองทุนรวม UI Fund และมีระบบรองรับการรายงานตามที่ประกาศสำนักงานกำหนด ²
ผู้เกี่ยวข้อง	บลจ. ที่จัดการ MF
ขอบเขต	กองทุนรวม UI Fund เฉพาะที่ระบุค่าความเสี่ยงสูงสุดเมื่อตั้งกองในระบบ OFAM ดังต่อไปนี้ 1. มีการทำธุรกรรมสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ไม่ซับซ้อน โดยมีวัตถุประสงค์มิใช่เพื่อป้องกันความเสี่ยง หรือมีการทำธุรกรรม financing อื่น ๆ (ได้แก่ กู้ยืมเงินและ REPO เพื่อประโยชน์ในการจัดการลงทุน และ short sell) และระบุนุมูลค่าการทำธุรกรรมรวมสูงสุด > 100%nav 2. มีการทำธุรกรรมสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ซับซ้อน โดยมีวัตถุประสงค์มิใช่เพื่อป้องกันความเสี่ยง 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

¹ ข้อ 159 ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 87/2558 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีรายได้ย่อย กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนประเภทสถาบัน และกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558

² ข้อ 6 ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 13/2560 เรื่อง ระบบงานและการรายงานเกี่ยวกับการทำธุรกรรมของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ ลงวันที่ 20 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2560

<p>รายละเอียด</p>	<p>รายงานผล Stress Test โดยให้ระบุข้อมูล (1) Risk Factor (2) ข้อสมมติ และ (3) ผลกระทบ (%nav) ดังต่อไปนี้</p> <table border="1" data-bbox="459 264 1410 577"> <thead> <tr> <th>Risk Factor</th> <th>ข้อสมมติ</th> <th>ผลกระทบ (%nav)</th> </tr> </thead> <tbody> <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 (โป้รคระนุ)</td> <td>4/</td> <td></td> </tr> <tr> <td>ผล Stress Test ของท้งกอง 5/</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table> <p>1/ เช่น การเปล้ยนเปลงของราคา หรือด้ชน้ราคาห้่น, yield curve, ราคาสนค้้าโภคก้ณฑ์ อ้คราเลกเปล้ยน หรืออ้่น ๆ 2/ เช่น การเปล้ยนเปลงของ credit spread, probability of default หรืออ้่น ๆ 3/ เช่น การเปล้ยนเปลงของ liquidity spread การก้้าหนด liquidity haircut หรืออ้่น ๆ 4/ ความเล้ยงอ้่น ๆ ท้้อาสง้ผลกระทบต้อพ้อร้คกองทูน 5/ ผลกระทบโดยรวมต้อพ้อร้คกองทูน</p> <p>หมายเหตุ : 1. ให้ บลจ. เลือค Risk Factor เอง โดยม้ข้อสมมติจาก most likely stress event 2. รายละเอียดของแบบจ้าลองและท้มาของข้อสมมติ ให้จ้ดเก้บไว้ท้ บลจ.</p> <p>ท้้งน้ ให้รายงานในรูปแบบของ text file ซ้่งประกอบด้วย</p> <p>1. Header ประกอบด้วย รหัสบร้ษท้จ้ดการ ช้ือแบบรายงาน (STRESS TEST) งวค้ข้อมูล</p> <p>2. Data ประกอบด้วย เลกท้จ้ดทะเบียน ปีท้จ้ดทะเบียน Risk Factor ข้อสมมติ ผลกระทบ (%nav)</p>	Risk Factor	ข้อสมมติ	ผลกระทบ (%nav)	Market Risk	1/		Credit Risk	2/		Liquidity Risk	3/		Other Risks (โป้รคระนุ)	4/		ผล Stress Test ของท้งกอง 5/		
Risk Factor	ข้อสมมติ	ผลกระทบ (%nav)																	
Market Risk	1/																		
Credit Risk	2/																		
Liquidity Risk	3/																		
Other Risks (โป้รคระนุ)	4/																		
ผล Stress Test ของท้งกอง 5/																			
<p>ตัวอย่าง การรายงาน</p>	<p>ตัวอย่างที่ 1</p> <p>บลจ. BCD (รหัสบร้ษท้จ้ดการ 0123456789) จ้ดการกองทูน BCD Equity Flexible Hedge Fund ซ้่งจ้ดทะเบียนเป็นกองทูน UI Fund (เลกท้จ้ดทะเบียน MF1234/2561) ม้การใช้กลยุทธ์ Volatility Arbitrage โดยม้การลงทูนใน options ท้ม้ความซ้บซ้อน ซ้่ง บลจ. ใ้ระบุน้ไว้ในคอรกการว้จะค้านวณค้้าความเล้ยงโดยใช้ Absolute VaR และมีเพดานความเล้ยงไม่เก้ิน 25%nav ซ้่งต้อรายงานผลการจ้ดท้้า stress test ของกองทูนด้งกล้่าวให้ส้านกงานทุกเดือน โดยในเดือน ก.ย. 61 บลจ. ใ้จ้ดท้้า stress test โดยก้้าหนด risk factors ท้เก้ียวซ้อง ใ้แก่ Market Risk และ Volatility Risk โดยมีผลการจ้ดท้้า ด้งต้อไปน้</p> <table border="1" data-bbox="459 1541 1410 1854"> <thead> <tr> <th>Risk Factor</th> <th>ข้อสมมติ</th> <th>ผลกระทบ (%nav)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Market Risk</td> <td>ห้่นซ้่น 20%</td> <td>25.18420</td> </tr> <tr> <td>Credit Risk</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Liquidity Risk</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Other Risks (Volatility ของห้่น underlying)</td> <td>Volatility ลดลจ 10%</td> <td>15.64096</td> </tr> <tr> <td>ผล Stress Test ของท้งกอง</td> <td></td> <td>30.16245</td> </tr> </tbody> </table>	Risk Factor	ข้อสมมติ	ผลกระทบ (%nav)	Market Risk	ห้่นซ้่น 20%	25.18420	Credit Risk			Liquidity Risk			Other Risks (Volatility ของห้่น underlying)	Volatility ลดลจ 10%	15.64096	ผล Stress Test ของท้งกอง		30.16245
Risk Factor	ข้อสมมติ	ผลกระทบ (%nav)																	
Market Risk	ห้่นซ้่น 20%	25.18420																	
Credit Risk																			
Liquidity Risk																			
Other Risks (Volatility ของห้่น underlying)	Volatility ลดลจ 10%	15.64096																	
ผล Stress Test ของท้งกอง		30.16245																	

	วิธีการรายงาน ให้รายงานข้อมูลเป็น text file ดังนี้
Header	0123456789 STRESS TEST 20180928
Data	MF1234 2561 Market Risk หุ้นขึ้น 20% 25.18420
	MF1234 2561 Credit Risk
	MF1234 2561 Liquidity Risk
	MF1234 2561 Other Risk (Volatility ของหุ้น Underlying) Volatility ลดลง 10% 15.64096
	MF1234 2561 ผล Stress Test ของทั้งกอง 30.16245

3.3 แบบรายงาน Exposure

3.3.1 สำหรับ MF และ PVD

วัตถุประสงค์	เพื่อติดตามฐานะการลงทุนและ leverage ของกองทุน
ผู้เกี่ยวข้อง	1. บลจ. ที่จัดการ MF หรือ PVD 2. บล. และบ. ประกัน ที่จัดการ PVD
ขอบเขต	MF และ PVD ที่มีการทำธุรกรรมสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีใช้เพื่อป้องกันความเสี่ยง หรือ ทำธุรกรรมกู้ยืมเงิน และ REPO เพื่อประโยชน์ในการจัดการลงทุน หรือทำธุรกรรม Short Sell
แบบรายงาน	MF01 และ PVD01
ระบบงาน	ระบบ OFAR
การปรับปรุง	ปรับปรุงเพิ่มเติมจากแบบรายงานเดิม
ความถี่	รายเดือน
รายละเอียด	<p>1. เงื่อนไขการรายงาน</p> <p>1.1 ให้รายงานค่าความเสี่ยง max, min, average และค่า ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน (กรณี PVD ให้ใช้ค่า ณ วันสิ้นเดือน) โดยเลือกรายงานค่า Net Exposure ที่คำนวณตามวิธี Commitment Approach หรือค่า Absolute VaR หรือค่า Relative VaR อย่างใดอย่างหนึ่ง (ตามวิธีการที่สำนักงานกำหนด)³</p> <p>1.2 ให้รายงานค่าความเสี่ยง Gross Exposure⁴ ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน (กรณี PVD ให้ใช้ค่า ณ วันสิ้นเดือน)</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>

³ ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สน. 92/2558 เรื่อง หลักเกณฑ์เพิ่มเติมกรณีกองทุนลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง ลงวันที่ 17 ธันวาคม พ.ศ. 2558

⁴ Gross Exposure = เงินลงทุน + Notional Amount ของ derivatives (รวม embedded derivatives ใน structured notes) + Borrowing + REPO + Short Sell + Securities Borrowing

	<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> <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 style="text-align: center;">* กรณี PVD ให้รายงานค่า ณ วันสิ้นเดือน</p> <p>3. การรายงานในรูปแบบ text file</p> <p>ยังคงใช้ format การรายงานแบบเดียวกับกลุ่มข้อมูลการลงทุนในสินทรัพย์ / หนี้สินค้างรับค้างจ่าย มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ จำนวนหน่วยลงทุน และอื่น ๆ กล่าวคือ</p> <p style="padding-left: 40px;">เลขที่จดทะเบียน ปีที่จดทะเบียน นโยบายกองทุน PVD รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน ค่าความเสี่ยงที่คำนวณได้ (หน่วยบาทในกรณี Exposure, หน่วย % ในกรณี Absolute VaR หรือหน่วยเท่าในกรณี Relative VaR) รหัสสกุลเงิน</p>
<p>ตัวอย่าง การรายงาน</p>	<p>ตัวอย่างที่ 2</p> <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>วิธีการรายงาน</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) และค่า Gross Exposure ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน (รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน 933) ดังต่อไปนี้</p> <p>...</p> <p>MF1234 2561 921 </p> <p>MF1234 2561 922 </p> <p>MF1234 2561 923 </p> <p>MF1234 2561 924 </p> <p>MF1234 2561 925 24.10973 THB</p> <p>MF1234 2561 926 16.55242 THB</p>

MF1234 2561 927 20.45127 THB
MF1234 2561 928 22.66360 THB
MF1234 2561 929
MF1234 2561 930
MF1234 2561 931
MF1234 2561 932
MF1234 2561 933 180139240.105468 THB

3.3.2 สำหรับ PF

วัตถุประสงค์	เพื่อติดตามฐานะการลงทุนและ leverage ของกองทุน						
ผู้เกี่ยวข้อง	1. บลจ. ที่จัดการ PF 2. บล. และบ.ประกัน ที่จัดการ PF						
ขอบเขต	เฉพาะกองทุน PF ที่มีค่าความเสี่ยง Gross Exposure ⁵ > 200% ของเงินลงทุน						
แบบรายงาน	PF1000						
ระบบงาน	ระบบ OFAR						
การปรับปรุง	ปรับปรุงเพิ่มเติมจากแบบรายงานเดิม						
ความถี่	รายเดือน						
รายละเอียด	<p>รายงานข้อมูลเป็นรายกองทุน โดยให้ระบุข้อมูล (1) ชื่อกองทุน (2) NAV และ (3) Gross Exposure ดังต่อไปนี้</p> <table border="1" data-bbox="456 1205 1409 1312"> <thead> <tr> <th>ชื่อกองทุน</th> <th>NAV (บาท)</th> <th>Gross Exposure (บาท)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td> </td> <td> </td> <td> </td> </tr> </tbody> </table> <p>การรายงานในรูปแบบ text file ให้รายงานต่อจาก part ข้อมูลพอร์ตการลงทุน โดยเปิดเป็น header และ data ใหม่ กล่าวคือ</p> <p>1. Header ประกอบด้วย รหัสบริษัทจัดการ ชื่อแบบรายงาน (EXPOSURE) งวดข้อมูล</p> <p>2. Data ประกอบด้วย ชื่อกองทุน NAV (บาท) Gross Exposure (บาท)</p>	ชื่อกองทุน	NAV (บาท)	Gross Exposure (บาท)			
ชื่อกองทุน	NAV (บาท)	Gross Exposure (บาท)					
ตัวอย่างการรายงาน	<p>ตัวอย่างที่ 3</p> <p>ณ สิ้นเดือน ก.ย. 61 บล. M (รหัสบริษัทจัดการ 0000000001) ซึ่งจัดการกองทุนส่วนบุคคล O และ P ที่มีการทำธุรกรรม futures หุ้นเพื่อเพิ่มผลตอบแทนของกองทุน โดย ณ สิ้นเดือน ก.ย. 61 พบว่ากองทุน O และ P มี Gross Exposure > 200% ของเงินลงทุน โดยมีรายละเอียด ดังนี้</p>						

⁵ Gross Exposure = เงินลงทุน + Notional Amount ของ derivatives (รวม embedded derivatives ใน structured notes) + Borrowing + REPO + Short Sell + Securities Borrowing

กองทุน	NAV (บาท)	Notional Amount ของสัญญา (บาท) (1)	เงินลงทุน (บาท) (2)	Gross Exposure (บาท) (1) + (2)
O	305,126,860.10448	351,748,932.63387	314,270,956.38477	666,019,889.01864
P	62,305,557.12019	100,032,095.91828	66,063,172.05578	166,095,267.97406

part พอร์ต
การลงทุน
(รายงาน
ตามปกติ)

วิธีการรายงาน ให้รายงานสถานะของกองทุน O และ P ใน part Exposure (**bold font**) ดังนี้

0000000001|PF1000|20180928|5|522617565.11829|
...
...

part Exposure (ถ้ามี)
(รายงาน เป็นรายกอง)

0000000001|EXPOSURE|20180928
กองทุน O|305126860.10448|666019889.01864
กองทุน P|62305557.12019|166095267.97406

รายงานต่อจาก part พอร์ตการลงทุน (ถ้ามี)

3.4 แบบรายงาน MPF7000 เพื่อใช้ติดตามการกระจุกตัวของผู้ถือหน่วยลงทุน

วัตถุประสงค์	เพื่อใช้ติดตามการกระจุกตัวของผู้ถือหน่วยลงทุน และประเมินความเสี่ยงจากการไถ่ถอนหน่วยลงทุน
ผู้เกี่ยวข้อง	1. บลจ. ที่จัดการ MF 2. LBDU เฉพาะที่มีลูกค้า omnibus account
ขอบเขต	กองทุนรวมทุกกอง ยกเว้นกองทุนวายุภักษ์ และกองทุน country fund
แบบรายงาน	MPF7000
ระบบงาน	ระบบ OFAR
การปรับปรุง	ปรับปรุงรูปแบบจากแบบรายงานเดิม + ปรับปรุงวิธีการนำเสนอให้ส่งผ่านระบบ OFAR
ความถี่	รายไตรมาส ⁶
รายละเอียด	1. ผู้ประกอบธุรกิจที่ต้องนำส่งรายงาน 1.1 บลจ. ที่จัดการ MF : ให้รายงานผู้ถือหน่วยทุกราย ของแต่ละกอง โดยกรณีที่เป็น omnibus account ให้รายงานเป็นบัญชีของ LBDU กล่าวคือ ให้รายงานประเภทผู้ถือหน่วยลงทุนเป็น omnibus account

⁶ กรณีกองทุนรวมที่ listed ในตลาดหลักทรัพย์ ได้แก่ กองทุนรวม ETF กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ และกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน ให้รายงานโดยใช้ข้อมูลจากวันที่ปิดสมุดทะเบียนล่าสุด

และนับ LBDU รายนั้นเป็นนิติบุคคล โดยรายงานเลขทะเบียนนิติบุคคลของ LBDU นั้น ๆ พร้อมทั้ง ข้อมูลอื่น ๆ ที่จำเป็นต้องรายงานในกรณีที่เป็นนิติบุคคล ตาม format ของแบบรายงาน

1.2 **LBDU** : ให้รายงานเฉพาะ omnibus account ของแต่ละกอง โดยให้รายงานข้อมูลของผู้ถือหุ้นราย ในบัญชี omnibus account ดังกล่าวเป็นราย ID ผู้ถือหุ้นรายให้ครบทุกราย

2. ปรับปรุงแบบรายงาน MPF7000 ดังต่อไปนี้

2.1 ยกเลิก 6 fields : ข้อมูลวันเดือนปีที่ลงทะเบียน และวันเดือนปีที่จดทะเบียนนิติบุคคล

2.2 เพิ่ม 1 field : เพื่อใช้ระบุกลุ่มบุคคลเดียวกัน⁷ โดยให้ บลจ. และ LBDU เป็นผู้ประเมินกลุ่มบุคคล เดียวกัน ทั้งนี้ ให้ระบุ ID ผู้ถือหุ้นที่เป็นกลุ่มบุคคลเดียวกัน โดยใช้ชื่อย่อกองทุนและตามด้วยตัวเลข 4 หลักที่แสดงลำดับที่ของกลุ่มบุคคล (เช่น ABC0001, ABC0002, ... เป็นต้น)

2.3 เพิ่มประเภทผู้ถือหุ้นลงทุนที่เป็น omnibus account

ทั้งนี้ แบบรายงาน MPF7000 ที่ปรับปรุงใหม่ มีโครงสร้างตามตาราง ดังนี้

Field Name	คำอธิบาย
เลขที่จดทะเบียนกองทุน	ตาม format ที่ยื่นจดทะเบียนกองทุนกับสำนักงาน
ปีที่จดทะเบียนกองทุน	ปี พ.ศ.
ประเภทผู้ถือหุ้นลงทุน	ชุด code ที่กำหนด (บุคคลธรรมดา / นิติบุคคล / New Omnibus Account)
จำนวนหน่วยลงทุนของกองทุน	จำนวนหน่วยลงทุนที่ขายได้แล้วทั้งหมดของกองทุน
NAV ของกองทุน	หน่วย (บาท)
NAV ต่อหน่วยของกองทุน	หน่วย (บาท)
จำนวนหน่วยลงทุนของผู้ถือหุ้น	ผลรวมทุกราย - จำนวนหน่วยลงทุนของกองทุน
NAV ของผู้ถือหุ้น	หน่วย (บาท) ; - NAV ต่อหน่วยของกองทุน x จำนวนหน่วยลงทุนของผู้ถือหุ้น ; ผลรวมทุกรายต้องใกล้เคียง NAV กองทุน
เพศ	ชุด code ที่กำหนด (เพศ)
วันที่เกิด	ระบุเป็นตัวเลขครบ 2 หลัก ตั้งแต่ 01 - 31
เดือนที่เกิด	ระบุเป็นตัวเลขครบ 2 หลัก ตั้งแต่ 01 - 12
ปีที่เกิด	ระบุเป็นตัวเลขครบ 4 หลัก เป็นปี ค.ศ.
ประเภทบัตร	เฉพาะบุคคลธรรมดา ; ชุด code ที่กำหนด (ประเภทบัตร)
เลขที่บัตร	ระบุตัวเลขให้ครบถ้วน ตาม format ของแต่ละประเภทบัตร
เลขทะเบียนบริษัท	ระบุเลขทะเบียนนิติบุคคลให้ครบถ้วน กรณีเป็นนิติบุคคล หรือ LBDU กรณี Omnibus Account
เลขประจำตัวผู้เสียภาษี	ระบุเลขที่บัตรประชาชนสำหรับบุคคลธรรมดา และเลขประจำตัวผู้เสียภาษีสำหรับนิติบุคคล
รหัสไปรษณีย์	ระบุเป็นตัวเลขครบ 5 หลัก
รหัสจังหวัด	ชุด code ที่กำหนด (จังหวัด)
รหัสสัญชาติ	ชุด code ที่กำหนด (สัญชาติ)
สัญชาติอื่น ๆ (ระบุ)	ให้ระบุ กรณีที่ระบุรหัสสัญชาติ เป็น "0"
รหัสประเทศ	ชุด code ที่กำหนด (ประเทศ)
ประเทศอื่น ๆ (ระบุ)	ให้ระบุ กรณีที่ระบุรหัสสัญชาติ เป็น "0"
New! flag กลุ่มบุคคลเดียวกัน	fields ที่เพิ่มใหม่ ให้ระบุชื่อย่อกอง ตามด้วยเลข 4 หลักในกรณีที่กลุ่มบุคคลเดียวกัน เช่น ABC0001 เป็นต้น

⁷ ใช้นิยามเดียวกันกับประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์เกี่ยวกับข้อกำหนดการถือหน่วยลงทุนในกองทุนรวมและหน้าที่ของบริษัทจัดการ ซึ่งกำหนดให้กลุ่มบุคคลเดียวกัน หมายถึง บุคคลที่มีความสัมพันธ์ในลักษณะใดลักษณะหนึ่งหรือหลายลักษณะ ดังต่อไปนี้

- (1) คู่สมรสและบุตรที่ยังไม่บรรลุนิติภาวะ
- (2) นิติบุคคล และผู้ถือหุ้นหรือผู้เป็นหุ้นส่วนของนิติบุคคลนั้นซึ่งถือหุ้นหรือเป็นหุ้นส่วนในนิติบุคคลดังกล่าวไม่ว่าทางตรงหรือทางอ้อม > 50% ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดหรือความเป็นหุ้นส่วนทั้งหมด
- (3) กองทุนส่วนบุคคลของบุคคลตาม (1) หรือ (2) ที่ไม่ใช่กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ

	<p>3. เงื่อนไขการรายงาน</p> <p>3.1 ให้ทั้ง บลจ. และ LBDU จัดทำรายงานในรูปแบบ text file และนำส่งผ่านระบบ OFAR</p> <p>3.2 เพื่อเป็นการคุ้มครองข้อมูลส่วนบุคคล กรณี field “เลขที่บัตร” “เลขทะเบียนบริษัท” และ “เลขประจำตัวผู้เสียภาษี” ให้บริษัทจัดการและ LBDU ทำการแปลงข้อมูลเลขที่บัตรประชาชน เลขทะเบียนบริษัท และเลขประจำตัวผู้เสียภาษี ให้อยู่ในรูปแบบที่ไม่สามารถระบุตัวตนได้ (anonymization) ก่อนรายงานในแบบรายงาน MPF7000 ทั้งนี้ สำนักงานจะจัดหาเครื่องมือและวิธีการ (algorithm) ในการจัดทำ data anonymization ดังกล่าวให้บริษัทจัดการต่อไป</p> <p>หมายเหตุ สำหรับ LBDU ที่ไม่เคยนำส่งแบบรายงาน MPF7000 สำนักงานจะจัดให้มีการซักซ้อมเพิ่มเติม นอกจากนี้ สำนักงานจะจัดเตรียมคู่มืออธิบายวิธีการจัดทำและนำส่งรายงาน และกำหนดให้มีการทดสอบการนำส่งแบบรายงานก่อนให้ผู้ประกอบธุรกิจนำส่งแบบรายงานอย่างเป็นทางการต่อไป</p>																																																																																																																																															
ตัวอย่าง	<p>ตัวอย่างที่ 4</p> <p>ณ สิ้นเดือน ก.ย. 61 บลจ. J และผู้สนับสนุนการขายหน่วยลงทุน บล. K ขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม LMN เลขที่จดทะเบียน MF9999/2560 ซึ่งมีมูลค่า NAV = 102,349.0800 บาท มูลค่า NAV ต่อหน่วย 10.8882 บาท จำนวนหน่วยที่ขายได้แล้วทั้งหมด 9,400.0000 หน่วย มีข้อมูลผู้ถือหน่วยลงทุนดังต่อไปนี้</p> <p>ข้อมูลที่ บลจ. J มองเห็น</p> <table border="1" data-bbox="391 1070 1452 1332"> <thead> <tr> <th>ชื่อ</th> <th>บัตรประชาชน (code 01)</th> <th>หนังสือเดินทาง (code 02)</th> <th>เลขทะเบียนบริษัท</th> <th>วันเดือนปีเกิด</th> <th>รหัสไปรษณีย์</th> <th>จังหวัด</th> <th>สัญชาติ</th> <th>ประเทศ</th> <th>จำนวนหน่วย</th> <th>มูลค่า NAV (บาท)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1 นายบุญ จักดี</td> <td>3 1011 02345 22 4</td> <td></td> <td></td> <td>22 ต.ค. 1976</td> <td>10120</td> <td>กรุงเทพฯ (code 32)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>1,000.0000</td> <td>10,888.2000</td> </tr> <tr> <td>2 นางสาว จักดี</td> <td>3 1018 02345 22 4</td> <td></td> <td></td> <td>7 ก.ย. 1980</td> <td>10120</td> <td>กรุงเทพฯ (code 32)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>1,500.0000</td> <td>16,332.3000</td> </tr> <tr> <td>3 น. โสเทธ คอร์เปอเรชั่น จำกัด</td> <td></td> <td></td> <td>0 1254 94018 24 6</td> <td></td> <td>10900</td> <td>กรุงเทพฯ (code 32)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>900.0000</td> <td>9,799.3800</td> </tr> <tr> <td>4 ผู้สนับสนุนการขาย บล. K</td> <td></td> <td></td> <td>0 1334 50089 24 6</td> <td></td> <td>10900</td> <td>กรุงเทพฯ (code 32)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>5,000.0000</td> <td>54,441.0000</td> </tr> <tr> <td>5 นางสาวปราณี ไกรภคณา</td> <td>3 1012 03046 10 4</td> <td></td> <td></td> <td>8 ม.ค. 1982</td> <td>10330</td> <td>กรุงเทพฯ (code 32)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>1,000.0000</td> <td>10,888.2000</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>9,400.0000</td> <td>102,349.0800</td> </tr> </tbody> </table> <p>สมมติให้นายบุญและนางสาวราย เป็นคู่สมรสกัน</p> <p>ข้อมูลเฉพาะ omnibus account ที่ LBDU บล. K มองเห็น</p> <table border="1" data-bbox="391 1444 1452 1646"> <thead> <tr> <th>ชื่อ</th> <th>บัตรประชาชน (code 01)</th> <th>หนังสือเดินทาง (code 02)</th> <th>เลขทะเบียนบริษัท</th> <th>วันเดือนปีเกิด</th> <th>รหัสไปรษณีย์</th> <th>จังหวัด</th> <th>สัญชาติ</th> <th>ประเทศ</th> <th>จำนวนหน่วย</th> <th>มูลค่า NAV (บาท)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>4.1 นายประสิทธิ์ อิ่มยิ้ม</td> <td>3 2573 30296 50 8</td> <td></td> <td></td> <td>4 พ.ย. 1985</td> <td>73120</td> <td>นครปฐม (code 19)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>1,300.0000</td> <td>14,154.6600</td> </tr> <tr> <td>4.2 นายศักดิ์ นิจจันทร์</td> <td>3 3165 14183 60 2</td> <td></td> <td></td> <td>16 ส.ค. 1979</td> <td>40000</td> <td>ขอนแก่น (code 05)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>2,000.0000</td> <td>21,776.4000</td> </tr> <tr> <td>4.3 นางสาวรณ ทองคำเปลว</td> <td>3 1824 08006 00 8</td> <td></td> <td></td> <td>10 พ.ค. 1978</td> <td>31000</td> <td>บุรีรัมย์ (code 27)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>ไทย (code T)</td> <td>700.0000</td> <td>7,621.7400</td> </tr> <tr> <td>4.4 Mr.Owen Microwiche</td> <td></td> <td>AAG995200</td> <td></td> <td>20 ส.ค. 1965</td> <td></td> <td></td> <td>Russia (code O)</td> <td>Russia (code O)</td> <td>1,000.0000</td> <td>10,888.2000</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>5,000.0000</td> <td>54,441.0000</td> </tr> </tbody> </table> <p>วิธีการรายงาน</p> <p>(ก) กรณี บลจ. รายงาน มีข้อสังเกต ดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. นายบุญ และนางสาวราย ซึ่งเป็นคู่สมรสกัน จัดเป็นบุคคลกลุ่มเดียวกัน ดังนั้น สำหรับบรรทัดที่รายงาน ข้อมูลของบุคคลทั้งคู่ ให้รายงานใน field “flag กลุ่มบุคคลเดียวกัน” เป็น LMN0001 ทั้งสองบรรทัด 2. กรณี omnibus account ที่ขายผ่าน LBDU บล. K ให้รายงานประเภทผู้ลงทุนเป็น omnibus account และรายงานผู้ถือหน่วยลงทุนในกรณีนี้เป็น LBDU บล. K โดยให้เตรียมข้อมูลเลขทะเบียนนิติบุคคล (ไม่ต้องทำ anonymization ข้อมูล) และข้อมูลอื่น ๆ ที่เกี่ยวข้องของ บล. K สำหรับรายงานในแบบรายงาน 	ชื่อ	บัตรประชาชน (code 01)	หนังสือเดินทาง (code 02)	เลขทะเบียนบริษัท	วันเดือนปีเกิด	รหัสไปรษณีย์	จังหวัด	สัญชาติ	ประเทศ	จำนวนหน่วย	มูลค่า NAV (บาท)	1 นายบุญ จักดี	3 1011 02345 22 4			22 ต.ค. 1976	10120	กรุงเทพฯ (code 32)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	1,000.0000	10,888.2000	2 นางสาว จักดี	3 1018 02345 22 4			7 ก.ย. 1980	10120	กรุงเทพฯ (code 32)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	1,500.0000	16,332.3000	3 น. โสเทธ คอร์เปอเรชั่น จำกัด			0 1254 94018 24 6		10900	กรุงเทพฯ (code 32)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	900.0000	9,799.3800	4 ผู้สนับสนุนการขาย บล. K			0 1334 50089 24 6		10900	กรุงเทพฯ (code 32)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	5,000.0000	54,441.0000	5 นางสาวปราณี ไกรภคณา	3 1012 03046 10 4			8 ม.ค. 1982	10330	กรุงเทพฯ (code 32)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	1,000.0000	10,888.2000										9,400.0000	102,349.0800	ชื่อ	บัตรประชาชน (code 01)	หนังสือเดินทาง (code 02)	เลขทะเบียนบริษัท	วันเดือนปีเกิด	รหัสไปรษณีย์	จังหวัด	สัญชาติ	ประเทศ	จำนวนหน่วย	มูลค่า NAV (บาท)	4.1 นายประสิทธิ์ อิ่มยิ้ม	3 2573 30296 50 8			4 พ.ย. 1985	73120	นครปฐม (code 19)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	1,300.0000	14,154.6600	4.2 นายศักดิ์ นิจจันทร์	3 3165 14183 60 2			16 ส.ค. 1979	40000	ขอนแก่น (code 05)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	2,000.0000	21,776.4000	4.3 นางสาวรณ ทองคำเปลว	3 1824 08006 00 8			10 พ.ค. 1978	31000	บุรีรัมย์ (code 27)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	700.0000	7,621.7400	4.4 Mr.Owen Microwiche		AAG995200		20 ส.ค. 1965			Russia (code O)	Russia (code O)	1,000.0000	10,888.2000										5,000.0000	54,441.0000
ชื่อ	บัตรประชาชน (code 01)	หนังสือเดินทาง (code 02)	เลขทะเบียนบริษัท	วันเดือนปีเกิด	รหัสไปรษณีย์	จังหวัด	สัญชาติ	ประเทศ	จำนวนหน่วย	มูลค่า NAV (บาท)																																																																																																																																						
1 นายบุญ จักดี	3 1011 02345 22 4			22 ต.ค. 1976	10120	กรุงเทพฯ (code 32)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	1,000.0000	10,888.2000																																																																																																																																						
2 นางสาว จักดี	3 1018 02345 22 4			7 ก.ย. 1980	10120	กรุงเทพฯ (code 32)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	1,500.0000	16,332.3000																																																																																																																																						
3 น. โสเทธ คอร์เปอเรชั่น จำกัด			0 1254 94018 24 6		10900	กรุงเทพฯ (code 32)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	900.0000	9,799.3800																																																																																																																																						
4 ผู้สนับสนุนการขาย บล. K			0 1334 50089 24 6		10900	กรุงเทพฯ (code 32)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	5,000.0000	54,441.0000																																																																																																																																						
5 นางสาวปราณี ไกรภคณา	3 1012 03046 10 4			8 ม.ค. 1982	10330	กรุงเทพฯ (code 32)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	1,000.0000	10,888.2000																																																																																																																																						
									9,400.0000	102,349.0800																																																																																																																																						
ชื่อ	บัตรประชาชน (code 01)	หนังสือเดินทาง (code 02)	เลขทะเบียนบริษัท	วันเดือนปีเกิด	รหัสไปรษณีย์	จังหวัด	สัญชาติ	ประเทศ	จำนวนหน่วย	มูลค่า NAV (บาท)																																																																																																																																						
4.1 นายประสิทธิ์ อิ่มยิ้ม	3 2573 30296 50 8			4 พ.ย. 1985	73120	นครปฐม (code 19)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	1,300.0000	14,154.6600																																																																																																																																						
4.2 นายศักดิ์ นิจจันทร์	3 3165 14183 60 2			16 ส.ค. 1979	40000	ขอนแก่น (code 05)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	2,000.0000	21,776.4000																																																																																																																																						
4.3 นางสาวรณ ทองคำเปลว	3 1824 08006 00 8			10 พ.ค. 1978	31000	บุรีรัมย์ (code 27)	ไทย (code T)	ไทย (code T)	700.0000	7,621.7400																																																																																																																																						
4.4 Mr.Owen Microwiche		AAG995200		20 ส.ค. 1965			Russia (code O)	Russia (code O)	1,000.0000	10,888.2000																																																																																																																																						
									5,000.0000	54,441.0000																																																																																																																																						

3. บลจ. ทำการแปลงข้อมูลเลขที่บัตรประชาชน เลขทะเบียนบริษัท และเลขประจำตัวผู้เสียภาษี ให้อยู่ในรูปแบบที่ไม่สามารถระบุตัวตนได้ (anonymization) โดยใช้เครื่องมือและวิธีการที่สำนักงาน จัดเตรียมให้

ทั้งนี้ การเตรียมข้อมูลก่อนการรายงานในรูปแบบ text file เป็นไปตามตารางต่อไปนี้ (กรณีการแปลงข้อมูลด้วย วิธีการ anonymization สมมติให้เมื่อแปลงแล้วได้ค่าตามที่ปรากฏในตาราง)

Field Name	นายมนูญ	นางสำรวย	บ.ไฮเทคฯ	Omnibus A/C	นส.ปราณี
เลขที่จดทะเบียนกองทุน	MF9999	MF9999	MF9999	MF9999	MF9999
ปีที่จดทะเบียนกองทุน	2561	2561	2561	2561	2561
ประเภทผู้ถือหุ้นลงทุน	P	P	C	O	P
จำนวนหน่วยลงทุนของกองทุน	9400.0000	9400.0000	9400.0000	9400.0000	9400.0000
NAV ของกองทุน	102349.0800	102349.0800	102349.0800	102349.0800	102349.0800
NAV ต่อหน่วยของกองทุน	10.8882	10.8882	10.8882	10.8882	10.8882
จำนวนหน่วยลงทุนของผู้ถือหุ้น	1000.0000	1500.0000	900.0000	5000.0000	1000.0000
NAV ของผู้ถือหุ้น	10888.2000	16332.3000	9799.3800	54441.0000	10888.2000
เพศ	M	F			F
วันที่เกิด	22	07			08
เดือนที่เกิด	10	09			01
ปีที่เกิด	1976	1980			1982
ประเภทบัตร	01	01			01
เลขที่บัตร	*&A)\$#/\^	#< >+(<]@_#+&S]"
เลขทะเบียนบริษัท)+'["*":	0133450089246	
เลขประจำตัวผู้เสียภาษี]Q%)"%[\	-["_(~-%]%;;<]#<'	0133450089246	(#%["^,<@'
รหัสไปรษณีย์	10120	10120	10900	10900	10330
รหัสจังหวัด	32	32	32	32	32
รหัสสัญชาติ	T	T	T	T	T
สัญชาติอื่น ๆ (ระบุ)					
รหัสประเทศ	T	T	T	T	T
ประเทศอื่น ๆ (ระบุ)					
flag กลุ่มบุคคลเดียวกัน	LMN0001	LMN0001			

(ข) **กรณี LBDU รายงาน :**

1. ให้รายงานเฉพาะ omnibus account (ตามตัวอย่าง สมมติให้ omnibus account ดังกล่าว ประกอบด้วย บุคคลธรรมดา 4 ราย ได้แก่ นายประสิทธิ์ นายภักดี นางสาวรณ และ Mr.Owen) โดยให้รายงานข้อมูล ผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนภายใต้บัญชี omnibus account ดังกล่าวให้ครบทั้ง 4 ราย
2. LBDU ทำการแปลงข้อมูลเลขที่บัตรประชาชน เลขทะเบียนบริษัท และเลขประจำตัวผู้เสียภาษี ให้อยู่ในรูปแบบที่ไม่สามารถระบุตัวตนได้ (anonymization) โดยใช้เครื่องมือและวิธีการที่สำนักงาน จัดเตรียมให้

ตัวอย่างการเตรียมข้อมูลก่อนการรายงานในรูปแบบ text file เป็นไปตามตารางต่อไปนี้ (กรณีการแปลงข้อมูล ด้วยวิธีการ anonymization สมมติให้เมื่อแปลงแล้วได้ค่าตามที่ปรากฏในตาราง)

Field Name	นายประสิทธิ์	นายภักดี	นางสุวรรณ	Mr.Owen
เลขที่จดทะเบียนกองทุน	MF9999	MF9999	MF9999	MF9999
ปีที่จดทะเบียนกองทุน	2561	2561	2561	2561
ประเภทผู้ถือหุ้นกองทุน	P	P	P	P
จำนวนหน่วยลงทุนของกองทุน	9400.0000	9400.0000	9400.0000	9400.0000
NAV ของกองทุน	102349.0800	102349.0800	102349.0800	102349.0800
NAV ต่อหน่วยของกองทุน	10.8882	10.8882	10.8882	10.8882
จำนวนหน่วยลงทุนของผู้ถือหุ้นหน่วย	1300.0000	2000.0000	700.0000	1000.0000
NAV ของผู้ถือหุ้นหน่วย	14154.6600	21776.4000	7621.7400	10888.2000
เพศ	M	M	F	M
วันที่เกิด	04	16	10	20
เดือนที่เกิด	11	08	05	08
ปีที่เกิด	1985	1979	1978	1965
ประเภทบัตร	01	01	01	02
เลขที่บัตร	%%,-^-[7~	&-[.,\$,'	<'@?'('H	'),('I7.~
เลขทะเบียนบริษัท				
เลขประจำตัวผู้เสียภาษี	,+?+^*+."(--'+[;:%-	@;~\$(';%<	
รหัสไปรษณีย์	73120	40000	31000	
รหัสจังหวัด	19	05	27	
รหัสสัญชาติ	T	T	T	O
สัญชาติอื่น ๆ (ระบุ)				Russia
รหัสประเทศ	T	T	T	O
ประเทศอื่น ๆ (ระบุ)				Russia
flag กลุ่มบุคคลเดียวกัน				

3.5 การรายงานกลยุทธ์การลงทุนของ Hedge Fund

วัตถุประสงค์	เพื่อติดตามความเสี่ยงพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวม UI Fund โดยเฉพาะกองทุนประเภท Hedge Fund ที่มีกลยุทธ์การลงทุนแบบซับซ้อนหรือเสี่ยงสูง รวมทั้งเปิดเผยกลยุทธ์การลงทุนของกองทุนให้ผู้ลงทุนทราบ
ผู้เกี่ยวข้อง	บลจ. ที่จัดการ MF
ขอบเขต	เฉพาะกองทุนรวม UI Fund
แบบรายงาน	แบบรายงาน MF01
ระบบงาน	ระบบ OFAM
การปรับปรุง	1. แบบรายงาน MF01 : ปรับปรุงเพิ่มเติมจากแบบรายงานเดิม 2. ระบบ OFAM : เพิ่ม 1 หัวข้อให้รายงาน
ความถี่	1. แบบรายงาน 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 Stragegy” บลจ. ต้องรายงานข้อมูลทุกวันทำการสุดท้ายของเดือนของกองทุนดังกล่าว เพื่อให้ทราบการเปลี่ยนแปลงกลยุทธ์การลงทุนในแต่ละเดือน <p>ทั้งนี้ ประเภทกลยุทธ์การลงทุนของกองทุน (Investment Strategy) ที่ให้เลือก ประกอบด้วย</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; text-align: center;"> <thead> <tr style="background-color: #003366; color: white;"> <th style="padding: 5px;">กลยุทธ์การลงทุน</th> <th style="padding: 5px;">กลยุทธ์การลงทุน</th> </tr> </thead> <tbody> <tr><td style="padding: 5px;">Plain Strategy* : หุ้น หรือกองทุน</td><td style="padding: 5px;">Volatility Arbitrage</td></tr> <tr><td style="padding: 5px;">Plain Strategy* : หนี้ หรือกองทุน</td><td style="padding: 5px;">Distress / Restructuring Assets</td></tr> <tr><td style="padding: 5px;">Plain Strategy* : ผสม หรือกองผสม</td><td style="padding: 5px;">Risk / Merger Arbitrage</td></tr> <tr><td style="padding: 5px;">Plain Strategy : สินทรัพย์ทางเลือก</td><td style="padding: 5px;">Equity Special Situations</td></tr> <tr><td style="padding: 5px;">Equity Long Bias</td><td style="padding: 5px;">Credit Long / Short</td></tr> <tr><td style="padding: 5px;">Equity Long / Short</td><td style="padding: 5px;">Credit Asset Based Lending</td></tr> <tr><td style="padding: 5px;">Equity Market Neutral</td><td style="padding: 5px;">Macro</td></tr> <tr><td style="padding: 5px;">Equity Short Bias</td><td style="padding: 5px;">Managed Futures</td></tr> <tr><td style="padding: 5px;">Fixed Income Arbitrage</td><td style="padding: 5px;">Multi Strategy</td></tr> <tr><td style="padding: 5px;">Convertible Bond Arbitrage</td><td style="padding: 5px;">อื่น ๆ</td></tr> </tbody> </table> <p style="color: red; margin-top: 10px;">* เช่น การลงทุนแบบ Less Diversification</p> <p>2. แบบรายงาน MF01 : หลังจากจัดตั้งกองแล้ว</p> <p>กำหนดให้เฉพาะกองทุน UI Fund ที่เลือกกลยุทธ์การลงทุนของกองทุน (Investment Strategy) = “Multi Strategy” เท่านั้น ที่ บลจ. ต้องรายงานข้อมูล exposure ของกลยุทธ์การลงทุนที่กองทุนเลือกใช้ ณ วันทำการสุดท้ายของแต่ละเดือน โดยสำนักงานจะเพิ่มรหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สินเพื่อรองรับการรายงาน ดังนี้</p>	กลยุทธ์การลงทุน	กลยุทธ์การลงทุน	Plain Strategy* : หุ้น หรือกองทุน	Volatility Arbitrage	Plain Strategy* : หนี้ หรือกองทุน	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 หรือกองทุน	Volatility Arbitrage																						
Plain Strategy* : หนี้ หรือกองทุน	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																						

รหัสประเภท สินทรัพย์หนี้สิน	กลยุทธ์การลงทุน	รหัสประเภท สินทรัพย์หนี้สิน	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		

* เช่น การลงทุนแบบ Less Diversification

การรายงานในรูปแบบ text file กรณีที่ต้องรายงานผ่านแบบรายงาน MF01
ยังคงใช้ format การรายงานแบบเดียวกับกลุ่มข้อมูลการลงทุนในสินทรัพย์ / หนี้สินค้างรับค้างจ่าย มูลค่า
ทรัพย์สินสุทธิ จำนวนหน่วยลงทุน และอื่น ๆ กล่าวคือ

เลขที่จดทะเบียน | ปีที่จดทะเบียน | นโยบายกองทุน PVD | รหัสประเภทสินทรัพย์หนี้สิน |
exposure ของกลยุทธ์การลงทุนนั้น ๆ (บาท) | รหัสสกุลเงิน

ตัวอย่างกรณี การรายงาน ผ่านแบบ รายงาน MF01	<p>ตัวอย่างที่ 5</p> <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 941 </p> <p>MF1234 2561 942 </p> <p>MF1234 2561 943 </p> <p>MF1234 2561 944 </p>
---	---

MF1234 2561 945
MF1234 2561 946 157029189.00351 THB
MF1234 2561 947
MF1234 2561 948
MF1234 2561 949
MF1234 2561 950 28236165.42708 THB
MF1234 2561 951
MF1234 2561 952
MF1234 2561 953
MF1234 2561 954
MF1234 2561 955
MF1234 2561 956
MF1234 2561 957
MF1234 2561 958
MF1234 2561 959

3.6 การรายงานการใช้ Prime Broker ของ Hedge Fund

วัตถุประสงค์	เพื่อเปิดเผย Prime Broker ที่กองทุน UI Fund ประเภท Hedge Fund ใช้บริการให้ผู้ลงทุนทราบ และติดตามความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับ Prime Broker ดังกล่าว
ผู้เกี่ยวข้อง	บลจ. ที่จัดการ MF
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)

3.7 ช่วงเวลาที่คาดว่าจะใช้บังคับ

ประกาศออกภายในไตรมาส 4 ของปี 2561 โดยมีผลใช้บังคับในต้นไตรมาส 2 ของปี 2562

แบบสำรวจความคิดเห็น
เรื่อง การปรับปรุงแบบรายงานกองทุน

ข้อมูลทั่วไป			
ชื่อผู้ตอบ		ตำแหน่ง	
ชื่อบริษัท			
โทรศัพท์		โทรสาร	
อีเมล			
สถานะของผู้ให้ข้อคิดเห็น (ตอบได้มากกว่า 1 ข้อ)			
<input type="checkbox"/> บริษัทจัดการ	<input type="checkbox"/> ตัวแทนขาย		
<input type="checkbox"/> ผู้ถือหน่วยลงทุน	<input type="checkbox"/> อื่น ๆ (ระบุ)		

กรุณาส่งแบบสำรวจความคิดเห็นกลับไปที่ ฝ่ายนโยบายธุรกิจจัดการกองทุน
สำนักงาน ก.ล.ต. 333/3 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900
โทรสาร: 0-2263-6039, 0-2263-6511 หรือ e-mail: arthipha@sec.or.th; teerawat@sec.or.th

*** สำนักงานขอขอบคุณท่านที่ได้ให้ความร่วมมือในการแสดงความคิดเห็นในครั้งนี้ ***

แบบสำรวจความคิดเห็น

ท่านเห็นด้วยหรือไม่กับที่สำนักงานปรับปรุงแบบรายงานกองทุน ดังนี้

แบบรายงานที่ปรับปรุง / ยกเลิก	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
3.1 ยกเลิกแบบรายงานการฝากทรัพย์สินของกองทุนส่วนบุคคลกับผู้รับฝากทรัพย์สินแต่ละราย	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม		
3.2 Stress Test	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม		
3.3 Exposure	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม		

แบบรายงานที่ปรับปรุง / ยกเลิก	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
3.4 การกระจุกตัวของผู้ถือหน่วยลงทุน	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		
3.5 กลยุทธ์ของ Hedge Fund	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		
3.6 การใช้ Prime Broker ของ Hedge Fund	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
ข้อเสนอแนะหรือข้อสังเกตเพิ่มเติม <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/> <hr/>		

3.7 ข้อเสนอแนะอื่น ๆ
