

### เอกสารแนบ 3 : วิธีการจัดทำและส่งรายงาน

#### Version Revision

การปรับปรุง	วันที่ปรับปรุง	วันที่มีผล	แบบรายงานที่มีการปรับปรุงตัวอย่างวิธีการจัดทำ
ครั้งที่ 1	30 ม.ค. 63	1 ก.ค. 63	<ul style="list-style-type: none"><li>• แบบรายงาน MS_EQF และ MS_FIF</li><li>• แบบรายงาน OS_MF01, OS_MF02 และ OS_PVD01</li><li>• แบบรายงาน NSR-LQ (ยกเลิกแบบรายงาน)</li><li>• แบบรายงาน STRESSTEST (แบบรายงานที่เพิ่มใหม่)</li></ul>

## วิธีการจัดทำและส่งรายงาน

### ทกรายงาน

บริษัทจัดการมีหน้าที่ในการส่งรายงานจนกว่าจะได้รับ mail แจ้งตามตัวอย่างด้านล่าง หรือ สถานะการส่งรายงาน ที่เมนู Submission Status ในระบบ OFAR เป็น "Confirmed" เท่านั้น

เรียน บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน xxxx
<b>สำนักงานได้รับข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ซึ่งเป็นไปตามข้อกำหนดทางเทคนิคแล้ว</b> ดังนี้
แบบรายงาน : xxxxxx
งวดวันที่ : dd/mm/yyyy
ผู้ส่งข้อมูล : xxxxx@xxx.xxx
วัน-เวลาที่รับข้อมูล : dd/mm/yyyy hr:min:sec
รหัสอ้างอิง : OFAR-xxxxxxxx-xxxx
ผลการตรวจสอบ : ไม่พบข้อผิดพลาดด้านเทคนิค

หากได้รับ mail แจ้งดังต่อไปนี้ หรือสถานะแบบรายงานฉบับร่าง ที่เมนู "Create/Submit Report" แถบค้นหาแบบรายงาน ในระบบ OFAR เป็น "In Progress" หรือ สถานะการส่งรายงาน ที่เมนู Submission Status ในระบบ OFAR เป็น "Validating" หรือ "Error"สำนักงานจะยังถือว่า สำนักงานยังไม่ได้รับรายงาน หรือถือเสมือนบริษัทท่านยังไม่ส่งรายงานให้สำนักงาน

เรียน บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน xxxx
<b>พบข้อผิดพลาดในการตรวจสอบข้อกำหนดทางเทคนิค</b> ดังนี้
แบบรายงาน : xxxxxx
งวดวันที่ : dd/mm/yyyy
ผู้ส่งข้อมูล : xxxxx@xxx.xxx
วัน-เวลาที่รับข้อมูล : dd/mm/yyyy hr:min:sec
รหัสอ้างอิง : OFAR-xxxxxxxx-xxxx
ผลการตรวจสอบ : บรรทัดที่ xx: .....
: บรรทัดที่ xx: .....
: .....
Complex Validate Fail.

1. รายงานรายละเอียดของหลักทรัพย์และทรัพย์สินที่ทุกกองทุนรวมลงทุนหรือมีไว้
  2. รายงานรายละเอียดของหลักทรัพย์และทรัพย์สินที่ทุกกองทุนสำรองเลี้ยงชีพลงทุนหรือมีไว้
  3. รายงานรายละเอียดของหลักทรัพย์และทรัพย์สินที่ทุกกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ลงทุนหรือมีไว้
  4. รายงานรายละเอียดของหลักทรัพย์และทรัพย์สินที่ทุกกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐานลงทุนหรือมีไว้
- ("Master File") ประกอบด้วย Feature File ทั้งหมด 7 file คือ

Master File	ข้อมูลที่รายงาน	
	กองทุนรวม/กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ	กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์/ กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน
1. EQ & Others Feature	ข้อมูล feature ของหุ้นสามัญ หุ้นบุริมสิทธิ หน่วยลงทุน ใบสำคัญแสดงสิทธิ และ ใบแสดงสิทธิ ที่ไม่ได้ listed/กำลังจะ listed ใน SET และ MAI ที่คงเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน รวมถึง หลักทรัพย์ที่ซื้อหรือเพิ่ม หรือขายหรือลดในระหว่างงวดทุกรายการ	เหมือนกองทุนรวม/กองทุน สำรองเลี้ยงชีพ กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ เป็นข้อมูลที่คงเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือนของเดือนมิถุนายน สำหรับงวดครึ่งปี หรือ ณ วันสิ้นเดือนของเดือนธันวาคม สำหรับงวดปี กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน เป็น ข้อมูลที่คงเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือนของวันสิ้นไตรมาสต่างๆ
2. Fixed Income Feature	ข้อมูล feature ของหุ้นกู้ เงินฝากทุกประเภท บัตรเงินฝาก ตัวแลกเงิน ตัวสัญญาใช้เงิน ตัวเงินคลัง พันธบัตร สลากออมทรัพย์ของ ธกส. สลากออมสินพิเศษของธนาคารออมสิน ที่ไม่ได้/กำลังจะ listed/registered ใน BEX และ ThaiBMA ที่คงเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน รวมถึง หลักทรัพย์ที่ซื้อหรือเพิ่ม หรือขายหรือลดในระหว่างงวดทุกรายการ	
3. Futures, Forward Feature	ข้อมูล feature ของ Futures ที่ไม่ได้ listed ใน TFEX และ Forward ที่คงเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน	
4. Swap Feature	ข้อมูล feature ของ Swap ที่คงเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน	
5. Option Feature	ข้อมูล feature ของ Option ที่ไม่ได้ listed ใน TFEX ที่คงเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน	
6. Structured Notes Feature	ข้อมูล feature ของ Structured Notes ที่ไม่ได้ listed/registered ใน BEX/ThaiBMA ที่คงเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน	
7. Credit Derivatives & Structured Finance Feature	ข้อมูล feature ของ Credit Derivatives และ Structured Finance ที่คงเหลืออยู่ ณ วันสิ้นเดือน	

**ชื่อ file ที่ส่ง**

Master File	ชื่อ File ที่ส่ง
1. Equity & Others Feature	MS_EQF.TXT
2. Fixed Income Feature	MS_FIF.TXT
3. Futures, Forward Feature	MS_F_FWF.TXT

4. Swap Feature	MS_SWF.TXT
5. Option Feature	MS_OF.TXT

DRAFT

Master File	ชื่อ File ที่ส่ง
6. Structured Notes Feature	MS_SNF.TXT
7. Credit Derivatives & Structured Finance Feature	MS_CDF.TXT

#### การปรับปรุงแบบรายงานเพิ่มเติม

- เพิ่มรหัสประเทศผู้ออกหลักทรัพย์ สำหรับไฟล์ MS\_EQF.TXT และ MS\_FIF.TXT ตามที่ระบุ **ตัวหนังสือสีแดง** ในตัวอย่างข้อมูล

#### ตัวอย่างข้อมูล

##### MS\_EQF.TXT

0000000001|EQF|20080131  
BB|HK001|101|101|BB Company Co.Ltd.|20060101||CN|HK|HKD|20080105:085305|

##### MS\_FIF.TXT

0000000001|FIF|20080131  
FDCC001||218|03|A-1|||100|||||CC Bank|CN|CNY|03|A|00||None|00|None|||||20080115|20090115|20080115:135040|

##### MS\_F\_FWF.TXT

0000000001|F\_FWF|20080131  
FUT001|401||120|101|1|CN|CFEX|None|00|20080101|20081231|CNY|CNY|20080110:135040|

##### MS\_SWF.TXT

0000000001|SWF|20080131  
SW001|403|12||115|THB|CNY|41||61|||100|CN|CC Bank|A|03|20080101|20090630|20080120:135040|

##### MS\_OF.TXT

0000000001|OF|20080131  
OPT001|404|01|02||10.50000||40.00000|02|1|119|DD Company Co.Ltd. Price|100|CN|CC Bank|A|03|20080114|20090114|CNY|20080114:135040|

##### MS\_SNF.TXT

0000000001|SNF|20080131  
SNDD001|405|100|34||119||6|CN|EE Bank|A|03|A|03|CNY|20080101|20080331|20080109:135040|

##### MS\_CDF.TXT

0000000001|CDF|20080131  
CDS001|406|01|||1|CC Bank Bond|CC Bank|A|03|A|03|CN|EE Bank|A|03|10000.00000||ส่วนต่างของมูลค่า ณ วันเกิด event กับ ราคาหน้าตัว (par)  
ของตราสาร|CNY|20080105|20080105|20080105:135040|

#### วิธีการจัดทำและส่งข้อมูล

1. แต่ละ field กำหนดให้ใช้ "|" (delimiter) เป็นตัวแบ่ง
2. field ใดที่ไม่มีข้อมูล ให้ใช้ตัว delimiter ปิด field นั้น โดยห้ามมีช่องว่างระหว่าง Delimiter และหลัง field สุดท้ายของแต่ละบรรทัด ไม่ต้องจบด้วยตัว delimiter
3. field ที่มี format เป็น varchar กรณีความยาวข้อมูลน้อยกว่าที่กำหนด ห้ามมีช่องว่างก่อนหรือหลังข้อมูลนั้น ให้กรอก field นั้นหลัง delimiter และปิด field นั้นด้วย delimiter ทันที

4. field Report Period ที่บรรทัดแรกของ Master File ทุก File ให้รายงานเป็นวันสุดท้ายของงวดเสมอ
5. field Market Code (รหัสตลาด) ที่รายงานได้ คือ 000 100 และ 101 เท่านั้น
6. การเรียงข้อมูลในแต่ละ File : ให้เรียงข้อมูลตาม 1) Asset/Liab Code 2) Market Code และ 3) Issue/Contract Code
7. การส่งข้อมูล
  - 7.1 หากกองทุนไม่มีการลงทุนหลักทรัพย์ประเภทใด ก็ไม่ต้องส่ง Feature File ของหลักทรัพย์นั้นเข้ามา เช่น ไม่มีการลงทุนใน Credit Derivatives หรือ Structured Finance บริษัทจัดการก็ไม่ต้องส่ง File Credit Derivatives & Structured Finance เข้ามา
  - 7.2 ให้รายงานหลักทรัพย์และทรัพย์สินที่ทุกกองทุนรวม กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐานลงทุนเข้ามาในแต่ละ Master File ให้ครบถ้วน
  - 7.3 บริษัทจัดการจำเป็นต้องส่ง Master File ให้ผ่านครบทุก File ก่อนส่ง Outstanding File

5. รายงานสถานะลงทุนของแต่ละกองทุนรวม เป็นข้อมูล outstanding ของหลักทรัพย์และทรัพย์สินของกองทุนรวม ณ วันทำการสุดท้ายของเดือน
6. รายงานสถานะลงทุนของแต่ละกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ เป็นข้อมูล outstanding ของหลักทรัพย์และทรัพย์สินของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ณ วันสิ้นเดือน
7. รายงานสถานะลงทุนของแต่ละกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ และ/หรือแต่ละกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน เป็นข้อมูล outstanding ของหลักทรัพย์และทรัพย์สินของแต่ละกอง ณ วันที่ของข้อมูลตามกำหนดในตาราง

ประเภทกองทุน	วันที่ของข้อมูล
กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์สำหรับผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์เพื่อแก้ไขปัญหาในระบบสถาบันการเงิน กองทุนรวมเพื่อแก้ไขปัญหาในระบบสถาบันการเงิน และกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์และสิทธิเรียกร้อง	ณ วันสิ้นเดือนมิถุนายน สำหรับงวดครึ่งปี และ ณ วันสิ้นเดือนธันวาคม สำหรับงวดปี
กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน	ณ วันสิ้นไตรมาสของแต่ละกองทุนตามรอบระยะเวลาบัญชีของกองทุน

#### ชื่อ file ที่ส่ง

Outstanding File	ชื่อ File ที่ส่ง
รายงานสถานะลงทุนของแต่ละกองทุนรวม	OS_MF01.TXT
รายงานสถานะลงทุนของแต่ละกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ	OS_PVD01.TXT
รายงานสถานะลงทุนของแต่ละกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ และ/หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน	OS_MF02.TXT

#### การปรับปรุงแบบรายงานเพิ่มเติม

- เพิ่มต้นทุนเฉลี่ยของหลักทรัพย์ (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) และ มูลค่ายุติธรรม (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) สำหรับ **outstanding equity & others** และ **outstanding fixed income** ตามที่ระบุตัวหนังสือสีแดงในตัวอย่างข้อมูล
- เพิ่มมูลค่า notional และผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) สำหรับ **outstanding futures, forward, outstanding swap** และ **outstanding option** ตามที่ระบุตัวหนังสือสีส้มในตัวอย่างข้อมูล

- เพิ่มมูลค่า **option value** ต่อสัญญา ณ วันสิ้นงวดข้อมูล (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) และมูลค่า **option premium** (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) สำหรับ **outstanding option** ตามที่ระบุตัวหนังสือสีฟ้าในตัวอย่างข้อมูล
- เพิ่มมูลค่าหน้าตัว มูลค่าตามราคาตลาด และผลกำไร/ขาดทุนจากการ **mark to market** (ในรูปสกุลเงินที่ไปลงทุนในต่างประเทศ) สำหรับ **outstanding structured notes** และ **outstanding credit derivatives & structured finance** ตามที่ระบุตัวหนังสือสีม่วงในตัวอย่างข้อมูล
- เพิ่มมูลค่าธุรกรรม (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) มูลค่าหลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) มูลค่าหลักทรัพย์ที่เป็นหลักประกัน (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) และมูลค่าหลักประกัน (ในรูปสกุลเงินที่ทำธุรกรรมในต่างประเทศ) สำหรับ **outstanding reverse repo, outstanding repo** และ **outstanding security lending** ตามที่ระบุตัวหนังสือสีเหลืองในตัวอย่างข้อมูล
- เพิ่มการระบุการจัดชั้นสภาพคล่องของหลักทรัพย์ สำหรับ **outstanding equity & others, outstanding fixed income, outstanding structured notes, outstanding credit derivatives & structured finance** และ **outstanding reverse repo** ตามที่ระบุตัวหนังสือสีเขียวในตัวอย่างข้อมูล
- เพิ่มค่าความเสี่ยง **max, min, average** และค่า ณ วันทำการสุดท้ายของเดือนสำหรับกองทุนรวม (หรือ ณ วันสุดท้ายของเดือนสำหรับกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ) โดยให้เลือกรายงานค่า **net exposure** ที่คำนวณตามวิธี **Commitment Approach** หรือค่า **Absolute VaR** หรือค่า **Relative VaR** ใดอย่างหนึ่ง รวมทั้งเพิ่มค่า **Gross Exposure** ณ วันทำการสุดท้ายของเดือนสำหรับกองทุนรวม (หรือ ณ วันสุดท้ายของเดือนสำหรับกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ) (รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน 921 - 933) ตามที่ระบุตัวหนังสือสีชมพูในตัวอย่างข้อมูล
- เพิ่ม **exposure** ของกลยุทธ์การลงทุนที่กองทุนรวมเลือกใช้ ณ วันทำการสุดท้ายของแต่ละเดือน (รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน 941 - 959) เฉพาะกรณีที่กองทุนรวม **UI Fund** ระบุกลยุทธ์การลงทุนของกองทุน (**Investment Strategy**) = **"Multi Strategy"** ในระบบ **OFAM** ตามที่ระบุตัวหนังสือสีน้ำเงินในตัวอย่างข้อมูล
- เพิ่มยอดคงค้าง **excess cash** และ **margin** ในรูปสกุลเงินที่ลงทุนในอนุพันธ์ต่างประเทศ (รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน 963) ตามที่ระบุตัวหนังสือสีเทาในตัวอย่างข้อมูล

#### ตัวอย่างข้อมูล

##### OS MF01.TXT

```

0000000001|MF01|20110131
001|2550||BB|101|170||0.0000|1000.0000|4000600.0000||0.0000|1000.0000|4000600.0000|1000100.0000|4004000.0000|1001000.0000|01
001|2550||FDCC001|218|202||0.0000||1780000.0000||0.0000||450.0000|1780000.0000|400000.0000|1772000.0000|400100.0000|02
001|2550||10|202|FUT001|401|02||20|||1500000.0000|337000.0000||1000.0000|225.0000
001|2550||SW001|403|202|01|01|02||FDCC001|1774000.0000|400500.0000|1772000.0000|8900.0000|2000.0000
001|2550||OPT001|404|20|202|02|||0.0000|2250000.0000|505000.0000|556000.0000|125000.0000|105000.0000|-90000.0000|
-20000.0000
001|2550||SNDD001|405|202|1000000.0000|225000.0000|1200000.0000|270000.0000|200000.0000|45000.0000|02
001|2550||CDS001|406|202|1000000.0000|225000.0000|1050000.0000|233300.0000|2500.0000|600.0000|03

```

001|2550||ReverseRepo001|211|CN|EE Bank|202|SECURITY H||80000.00000|**18000.00000**|5000.00000|6000.00000|**1400.00000**|CNY|20080110|  
 20090110|**03**  
 001|2550||Repo001|615|CN|EE Bank|202|SECURITY K|900000.00000|**200000.00000**|15.55|90000.00000|80000.00000|**18000.00000**|CNY|  
 20080110|20090110  
 001|2550||SecurityLending001|122|CN|EE Bank|03|A|202|LENDING SECURITY L|CNY|50000.00000||15000.00000|**11300.00000**|Collateral Security L||  
 80000.00000|**18000.00000**|20080110|20090110  
 001|2550||Short Sale K1|617|300000.00000|50000.00000|6.00000|80000.00000|500.50000|THB|TH|BANK PD|125||8000.25000|Collateral Security code  
 K145|185000.50000|20080110|20090110  
 001|2550||606|50000.55000|THB  
 001|2550||901|9873503.14000|THB  
 001|2550||902|130501.55000|THB  
 001|2550||903|9743001.59000|THB  
 001|2550||904|990526.35000|THB  
 001|2550||905|9.83619|THB  
 001|2550||910|10000000.00000|THB  
 001|2550||911|-65000.00000|THB  
 001|2550||912|-191998.41000|THB  
 001|2550||913|0.00000|THB  
 001|2550||914|50000.00000|THB  
 001|2550||915|0.00000|THB  
 001|2550||916|0.00000|THB  
 001|2550||917|0.00000|THB  
 001|2550||**925|24.10973**|THB  
 001|2550||**926|16.55242**|THB  
 001|2550||**927|20.45127**|THB  
 001|2550||**928|22.66360**|THB  
 001|2550||**933|180139240.105468**|THB  
 001|2550||**946|157029189.00351**|THB  
 001|2550||**950|28236165.42708**|THB  
 001|2550||**963|173409.21106**|CNY  
 002|2553||BB|101|170||0.00000|1000.00000|4000600.00000||0.00000|1000.00000|4000600.00000|**1000100.00000**|4004000.00000|**1001000.00000**|**01**  
 002|2553||FDCC001|218|202||0.00000||1780000.00000||0.00000||450.00000|1780000.00000|**400000.00000**|1772000.00000|**400100.00000**|**02**  
 002|2553||10|202|FUT001|401|02||20|||1500000.00000|**337000.00000**||1000.00000|**225.00000**  
 002|2553||SW001|403|202|01|01|02||FDCC001|1774000.00000|**400500.00000**|1772000.00000|8900.00000|**2000.00000**  
 002|2553||OPT001|404|20|202|02|||0.00000|2250000.00000|**505000.00000**|556000.00000|**125000.00000**|**105000.00000**|-90000.00000|  
**-20000.00000**



002|2553||SNDD001|405|202|1000000.00000|225000.00000|1200000.00000|270000.00000|200000.00000|45000.00000|02  
002|2553||CDS001|406|202|1000000.00000|225000.00000|1050000.00000|233300.00000|2500.00000|600.00000|03  
002|2553||ReverseRepo001|211|CN|EE Bank|202|SECURITY H||80000.00000|18000.00000|5000.00000|6000.00000|1400.00000|CNY|20080110|  
20090110|03  
002|2553||Repo001|615|CN|EE Bank|202|SECURITY K|900000.00000|200000.00000|15.55|90000.00000|80000.00000|18000.00000|CNY|  
20080110|20090110  
002|2553||SecurityLending001|122|CN|EE Bank|03|A|202|LENDING SECURITY L|CNY|50000.00000||15000.00000|11300.00000|Collateral Security L||  
80000.00000|18000.00000|20080110|20090110  
002|2553||Short Sale K1|617|300000.00000|50000.00000|6.00000|80000.00000|500.50000|THB|TH|BANK PD|125||8000.25000|Collateral Security code  
K145|185000.50000|20080110|20090110  
002|2553||606|50000.55000|THB  
002|2553||901|9873503.14000|THB  
002|2553||902|130501.55000|THB  
002|2553||903|9743001.59000|THB  
002|2553||904|990526.35000|THB  
002|2553||905|9.83619|THB  
002|2553||910|10000000.00000|THB  
002|2553||911|-65000.00000|THB  
002|2553||912|-191998.41000|THB  
002|2553||913|0.00000|THB  
002|2553||914|50000.00000|THB  
002|2553||915|0.00000|THB  
002|2553||916|0.00000|THB  
002|2553||917|0.00000|THB  
002|2553||925|24.10973|THB  
002|2553||926|16.55242|THB  
002|2553||927|20.45127|THB  
002|2553||928|22.66360|THB  
002|2553||933|180139240.105468|THB  
002|2553||946|157029189.00351|THB  
002|2553||950|28236165.42708|THB  
002|2553||963|173409.21106|CNY

**OS\_PVD01.TXT**

0000000001|PVD01|20100131  
006|2550|07|BB|101|170||0.00000|1000.00000|4000600.00000||0.00000|1000.00000|4000600.00000|**1000100.00000**|4004000.00000|**1001000.00000**|  
006|2550|07|FDCC001|218|202||0.00000||1780000.00000||0.00000||450.00000|1780000.00000|**400000.00000**|1772000.00000|**400100.00000**|  
006|2550|07|10|202|FUT001|401|02||20|||1500000.00000|**337000.00000**||1000.00000|**225.00000**  
006|2550|07|SW001|403|202|01|01|02||FDCC001|1774000.00000|**400500.00000**|1772000.00000|8900.00000|**2000.00000**  
006|2550|07|OPT001|404|20|202|02|||0.00000|2250000.00000|**505000.00000**|556000.00000|**125000.00000**|**105000.00000**|-90000.00000|  
**-20000.00000**  
006|2550|07|SNDD001|405|202|1000000.00000|**225000.00000**|1200000.00000|**270000.00000**|200000.00000|**45000.00000**|  
006|2550|07|CDS001|406|202|1000000.00000|**225000.00000**|1050000.00000|**233300.00000**|2500.00000|**600.00000**|  
006|2550|07|ReverseRepo001|211|CN|EE Bank|202|SECURITY H||80000.00000|**18000.00000**|5000.00000|6000.00000|**1400.00000**|CNY|20080110|  
20090110|  
006|2550|07|Repo001|615|CN|EE Bank|202|SECURITY K|900000.00000|**200000.00000**|15.55|90000.00000|80000.00000|**18000.00000**|CNY|  
20080110|20090110|  
006|2550|07|SecurityLending001|122|CN|EE Bank|03|A|202|LENDING SECURITY L|CNY|50000.00000||15000.00000|**11300.00000**|Collateral Security L||  
80000.00000|**18000.00000**|20080110|20090110|  
000|2550|07|Short Sale K1|617|300000.00000|50000.00000|6.00000|80000.00000|500.50000|THB|TH|BANK PD|125||8000.25000|Collateral Security code  
K145|185000.50000|20080110|20090110|  
006|2550|07|606|50000.55000|THB  
006|2550|07|901|9873503.14000|THB  
006|2550|07|902|130501.55000|THB  
006|2550|07|903|9743001.59000|THB  
006|2550|07|904|990526.35000|THB  
006|2550|07|905|9.83619|THB  
006|2550|07|910|10000000.00000|THB  
006|2550|07|911|-65000.00000|THB  
006|2550|07|912|-191998.41000|THB  
006|2550|07|913|0.00000|THB  
006|2550|07|914|50000.00000|THB  
006|2550|07|915|0.00000|THB  
006|2550|07|916|0.00000|THB  
006|2550|07|917|0.00000|THB  
006|2550|07|**925|24.10973**|THB  
006|2550|07|**926|16.55242**|THB  
006|2550|07|**927|20.45127**|THB  
006|2550|07|**928|22.66360**|THB  
006|2550|07|**933|180139240.105468**|THB

006|2550|07|963|173409.21106|CNY  
004|2553|07|BB|101|170||0.00000|1000.00000|4000600.00000||0.00000|1000.00000|4000600.00000|1000100.00000|4004000.00000|1001000.00000|  
004|2553|07|FDCC001|218|202||0.00000||1780000.00000||0.00000||450.00000|1780000.00000|400000.00000|1772000.00000|400100.00000|  
004|2553|07|10|202|FUT001|401|02||20||||1500000.00000|337000.00000||1000.00000|225.00000  
004|2553|07|SW001|403|202|01|01|02||FDCC001|1774000.00000|400500.00000|1772000.00000|8900.00000|2000.00000  
004|2553|07|OPT001|404|20|202|02||||0.00000|2250000.00000|505000.00000|556000.00000|125000.00000|105000.00000|-90000.00000|  
-20000.00000  
004|2553|07|SNDD001|405|202|1000000.00000|225000.00000|1200000.00000|270000.00000|200000.00000|45000.00000|  
004|2553|07|CDS001|406|202|1000000.00000|225000.00000|1050000.00000|233300.00000|2500.00000|600.00000|  
004|2553|07|ReverseRepo001|211|CN|EE Bank|202|SECURITY H||80000.00000|18000.00000|5000.00000|6000.00000|1400.00000|CNY|20080110|  
20090110|  
004|2553|07|Repo001|615|CN|EE Bank|202|SECURITY K|900000.00000|200000.00000|15.55|90000.00000|80000.00000|18000.00000|CNY|  
20080110|20090110  
004|2553|07|SecurityLending001|122|CN|EE Bank|03|A|202|LENDING SECURITY L|CNY|50000.00000||15000.00000|11300.00000|Collateral Security L|  
80000.00000|18000.00000|20080110|20090110  
004|2553|07|Short Sale K1|617|300000.00000|50000.00000|6.00000|80000.00000|500.50000|THB|TH|BANK PD|125||8000.25000|Collateral Security code  
K145|185000.50000|20080110|20090110  
004|2553|07|606|50000.55000|THB  
004|2553|07|901|9873503.14000|THB  
004|2553|07|902|130501.55000|THB  
004|2553|07|903|9743001.59000|THB  
004|2553|07|904|990526.35000|THB  
004|2553|07|905|9.83619|THB  
004|2553|07|910|10000000.00000|THB  
004|2553|07|911|-65000.00000|THB  
004|2553|07|912|-191998.41000|THB  
004|2553|07|913|0.00000|THB  
004|2553|07|914|50000.00000|THB  
004|2553|07|915|0.00000|THB  
004|2553|07|916|0.00000|THB  
004|2553|07|917|0.00000|THB  
004|2553|07|925|24.10973|THB  
004|2553|07|926|16.55242|THB  
004|2553|07|927|20.45127|THB  
004|2553|07|928|22.66360|THB  
004|2553|07|933|180139240.105468|THB  
004|2553|07|963|173409.21106|CNY

**OS MF02.TXT**

0000000001|MF02|20080131  
008|2550||BB|101|170||0.00000|1000.00000|4000600.00000||0.00000|1000.00000|4000600.00000|**1000100.00000**|4004000.00000|**1001000.0000** |  
008|2550||FDCC001|218|202||0.00000||1780000.00000||0.00000||450.00000|1780000.00000|**400000.00000**|1772000.00000|**400100.00000** |  
008|2550||10|202|FUT001|401|02||20||||1500000.00000|**337000.00000**||1000.00000|**225.00000** |  
008|2550||SW001|403|202|01|01|02||FDCC001|1774000.00000|**400500.00000**|1772000.00000|8900.00000|**2000.00000** |  
008|2550||OPT001|404|20|202|02||||0.00000|2250000.00000|**505000.00000**|556000.00000|**125000.00000**|**105000.00000**|-90000.00000|  
**-20000.00000** |  
008|2550||SNDD001|405|202|1000000.00000|**225000.00000**|1200000.00000|**270000.00000**|200000.00000|**45000.00000** |  
008|2550||CDS001|406|202|1000000.00000|**225000.00000**|1050000.00000|**233300.00000**|2500.00000|**600.00000** |  
008|2550||ReverseRepo001|211|CN|EE Bank|202|SECURITY H||80000.00000|**18000.00000**|5000.00000|6000.00000|**1400.00000**|CNY|20080110|  
20090110|  
008|2550||Repo001|615|CN|EE Bank|202|SECURITY K|900000.00000|**200000.00000**|15.55|90000.00000|80000.00000|**18000.00000**|CNY|  
20080110|20090110|  
008|2550||SecurityLending001|122|CN|EE Bank|03|A|202|LENDING SECURITY L|CNY|50000.00000||15000.00000|**11300.00000**|Collateral Security L||  
80000.00000|**18000.00000**|20080110|20090110|  
008|2550||Short Sale K1|617|300000.00000|50000.00000|6.00000|80000.00000|500.50000|THB|TH|BANK PD|125||8000.25000|Collateral Security code  
K145|185000.50000|20080110|20090110|  
008|2550||606|50000.55000|THB  
008|2550||901|9873503.14000|THB  
008|2550||902|130501.55000|THB  
008|2550||903|9743001.59000|THB  
008|2550||904|990526.35000|THB  
008|2550||905|9.83619|THB  
008|2550||910|10000000.00000|THB  
008|2550||911|-65000.00000|THB  
008|2550||912|-191998.41000|THB  
008|2550||913|0.00000|THB  
008|2550||914|50000.00000|THB  
008|2550||915|0.00000|THB  
008|2550||916|0.00000|THB  
008|2550||917|0.00000|THB  
008|2550||**963|173409.21106**|CNY  
MF0001|2554||BB|101|170||0.00000|1000.00000|4000600.00000||0.00000|1000.00000|4000600.00000|**1000100.00000**|4004000.00000|  
**1001000.0000** |  
MF0001|2554||FDCC001|218|202||0.00000||1780000.00000||0.00000||450.00000|1780000.00000|**400000.00000**|1772000.00000|**400100.00000** |  
MF0001|2554||10|202|FUT001|401|02||20||||1500000.00000|**337000.00000**||1000.00000|**225.00000** |

MF0001|2554||SW001|403|202|01|01|02||FDCC001|1774000.00000|400500.00000|1772000.00000|8900.00000|2000.00000  
MF0001|2554||OPT001|404|20|202|02|||0.00000|2250000.00000|505000.00000|556000.00000|125000.00000|105000.00000|-90000.00000|  
-20000.00000  
MF0001|2554||SNDD001|405|202|1000000.00000|225000.00000|1200000.00000|270000.00000|200000.00000|45000.00000|  
MF0001|2554||CDS001|406|202|1000000.00000|225000.00000|1050000.00000|233300.00000|2500.00000|600.00000|  
MF0001|2554||ReverseRepo001|211|CN|EE Bank|202|SECURITY H||80000.00000|18000.00000|5000.00000|6000.00000|1400.00000|CNY|20080110|  
20090110|  
MF0001|2554||Repo001|615|CN|EE Bank|202|SECURITY K|900000.00000|200000.00000|15.55|90000.00000|80000.00000|18000.00000|CNY|  
20080110|20090110  
MF0001|2554||SecurityLending001|122|CN|EE Bank|03|A|202|LENDING SECURITY L|CNY|50000.00000||15000.00000|11300.00000|Collateral Security L||  
80000.00000|18000.00000|20080110|20090110  
MF0001|2554||Short Sale K1|617|300000.00000|50000.00000|6.00000|80000.00000|500.50000|THB|TH|BANK PD|125||8000.25000|Collateral Security code  
K145|185000.50000|20080110|20090110  
MF0001|2554||606|50000.55000|THB  
MF0001|2554||901|9873503.14000|THB  
MF0001|2554||902|130501.55000|THB  
MF0001|2554||903|9743001.59000|THB  
MF0001|2554||904|990526.35000|THB  
MF0001|2554||905|9.83619|THB  
MF0001|2554||910|10000000.00000|THB  
MF0001|2554||911|-65000.00000|THB  
MF0001|2554||912|-191998.41000|THB  
MF0001|2554||913|0.00000|THB  
MF0001|2554||914|50000.00000|THB  
MF0001|2554||915|0.00000|THB  
MF0001|2554||916|0.00000|THB  
MF0001|2554||917|0.00000|THB  
MF0001|2554||963|173409.21106|CNY

### วิธีการจัดทำและส่งข้อมูล

1. แต่ละ field กำหนดให้ใช้ "|" (delimiter) เป็นตัวแบ่ง
2. field ใดที่ไม่มีข้อมูล ให้ใช้ตัว delimiter ปิด field นั้น โดยห้ามมีช่องว่างระหว่าง Delimiter และหลัง field สุดท้ายของแต่ละบรรทัด ไม่ต้องจบด้วยตัว delimiter
3. field ที่มี format เป็น varchar กรณีความยาวข้อมูลน้อยกว่าที่กำหนด ห้ามมีช่องว่างก่อนหรือหลังข้อมูลนั้น ให้กรอก field นั้นหลัง delimiter และปิด field นั้นด้วย delimiter หันที่
4. กองทุนรวม กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน ที่มีการลงทุนในตราสารหนี้ให้รายงานจำนวนเงินลงทุนในตราสารแห่ง  
หนี้ เงินฝาก หรือตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุนที่จัดอยู่ในกลุ่มตามด้านล่าง ให้ครบถ้วน

4.1 ตราสารภาครัฐไทยและตราสารภาครัฐต่างประเทศ	รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน 913
4.2 ตราสารที่ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น ธนาคารพาณิชย์ หรือบริษัทเงินทุน เป็นผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอวัล ผู้สลับหลัง หรือผู้ค้ำประกัน	รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน 914
4.3 ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับที่สามารถลงทุนได้ (Investment grade)	รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน 915
4.4 ตราสารที่มีอันดับความน่าเชื่อถืออยู่ในอันดับต่ำกว่าอันดับที่สามารถลงทุนได้	รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน 916
4.5 ที่ประกาศไม่อนุญาตให้กองทุนสามารถลงทุนได้	รหัสประเภทสินทรัพย์/หนี้สิน 917

5. การเรียงข้อมูลในแต่ละ File : ให้เรียงข้อมูลตาม 1) Registered Year 2) Fund Code 3) PVD Policy Code 4) Asset/Liab Code และ 5) Issue Code

6. การส่งข้อมูล

6.1 บริษัทจัดการจำเป็นต้องส่ง Outstanding File หลังส่ง Master File ผ่านระบบครบทุก File แล้ว

6.2 หากมีการส่งแก้ไข Master File ของงวดใดๆ เรียบร้อยแล้ว จำเป็นต้องส่งรายงานสถานะลงทุนของแต่ละกองทุนรวม รายงานสถานะลงทุนของแต่ละกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ หรือรายงานสถานะลงทุนของแต่ละกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ และ/หรือกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน ของงวดนั้นเข้ามาใหม่ทุกครั้ง เพื่อให้ระบบตรวจสอบได้ว่า Master File ที่แก้ไขส่งเข้ามาใหม่ ได้รายงานหลักทรัพย์และทรัพย์สินที่กองทุนรวม กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ และกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน ลงทุนครบถ้วน

**8. รายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของแต่ละกองทุนรวมเปิด** เป็นรายงานการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเปิด "ทุกกองทุน" เป็นรายวัน

**ชื่อ File ที่ส่ง** A-2.TXT

**ตัวอย่างข้อมูล**

0000000001|A-2|20100131

001|2550|19610000.00000|15000.00000|14700000.00000|0.00000|311960000.0004|97.95|2.05|0.00000|ผู้ถือหน่วยรายใหญ่ขอไถ่ถอน

MF0002|2554|0.00000|0.00000|0.00000|0.00000|1085500000.0000|||

**วิธีการจัดทำข้อมูล**

1. แต่ละ field กำหนดให้ใช้ "|" (delimiter) เป็นตัวแบ่ง
2. field ใดที่ไม่มีข้อมูล ให้ใช้ตัว delimiter ปิด field นั้น โดยห้ามมีช่องว่างระหว่าง Delimiter และหลัง field สุดท้ายของแต่ละบรรทัด ไม่ต้องจบด้วยตัว delimiter
3. field ที่มี format เป็น char กรณีความยาวข้อมูลน้อยกว่าที่กำหนด ห้ามมีช่องว่างก่อนหรือหลังข้อมูลนั้น ให้กรอก field นั้นหลัง delimiter และปิด field นั้นด้วย delimiter หันที่
4. การเรียงข้อมูลใน File : ให้เรียงข้อมูลตาม 1) ปีที่จดทะเบียนกองทุน 2) เลขที่จดทะเบียนกองทุน

**9. รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ของทุกกองทุนรวม** เป็นรายงานการซื้อขายหลักทรัพย์เฉพาะที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ไม่รวม MAI BEX TFEX ของทุกกองทุนรวม และให้รายงานเมื่อสำนักงานร้องขอ

บรรทัดของรายงาน	รายละเอียด
บรรทัดแรกของ File	รหัสบริษัทจัดการในระบบ Control ชื่อรายงาน งวดข้อมูล ตัวอย่าง : 0000000001 A-1 20101029
บรรทัดที่ 2 ถึงบรรทัดสุดท้าย	วันที่ซื้อ/ขาย ชื่อย่อหลักทรัพย์ มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ (ไม่รวมค่านายหน้าและ vat) มูลค่าการขายหลักทรัพย์ (ไม่รวมค่านายหน้าและ vat) ตัวอย่าง : 20101001 BBL 500000.00000 2000000.00000 20101004 SCC 3500000.00000

**ชื่อ File ที่ส่ง** A-1.TXT

**ตัวอย่างข้อมูล**

0000000001|A-1|20101029  
20101001|BBL|500000.00000|2000000.00000  
20101004|SCC|3500000.00000|

**วิธีการจัดทำ และส่งข้อมูล**

- แต่ละ field กำหนดให้ใช้ "|" (delimiter) เป็นตัวแบ่ง
- field ใดที่ไม่มีข้อมูล ให้ใช้ตัว delimiter ปิด field นั้น โดยห้ามมีช่องว่างระหว่าง Delimiter และหลัง field สุดท้ายของแต่ละบรรทัด ไม่ต้องจบด้วยตัว delimiter
- field ที่มี format เป็น char กรณีความยาวข้อมูลน้อยกว่าที่กำหนด ห้ามมีช่องว่างก่อนหรือหลังข้อมูลนั้น ให้กรอก field นั้นหลัง delimiter และปิด field นั้นด้วย delimiter หันที่
- การเรียงข้อมูลใน File : ให้เรียงข้อมูลตาม 1) วันที่ซื้อ/ขายจากน้อยไปมาก 2) ชื่อย่อหลักทรัพย์
- งวดของข้อมูลที่ส่งให้เป็นวันทำการสุดท้ายของแต่ละเดือนเสมอ
- การส่งข้อมูล หากสำนักงานให้ส่งข้อมูลที่มีเดือนต่างกัน เช่น ให้ส่งข้อมูลตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2553 ถึงวันที่ 15 พฤศจิกายน 2553 ให้ส่งแยกเป็น 2 file โดย file แรก ระบุงวดข้อมูลเป็น 20101029 และข้อมูลภายใน file เป็นข้อมูลตั้งแต่วันที่ 15 ตุลาคม 2553 ถึงวันที่ 29 ตุลาคม 2553 File ที่ 2 ระบุงวดข้อมูลเป็น 20101130 และข้อมูลภายใน file เป็นข้อมูลตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน 2553 ถึงวันที่ 15 พฤศจิกายน 2553

**10. รายงานสถานะและการลงทุนของทุกกองทุนส่วนบุคคล** เป็นรายงานสถานะและการลงทุนของทุกกองทุนส่วนบุคคลเป็นรายงาน โดยใช้ข้อมูล ณ วันสิ้นเดือน

**ชื่อ File ที่ส่ง** PF1000.TXT

**ตัวอย่างข้อมูล**

0000000001|PF1000|20100131|50|58776064.85|600000000.00  
101|Bank A|A|001|4000000.00|400000000.00|100000.00|1000000.00|30000.00|3000000.00|4070000.00|432603000.00  
101|ABC CO., LTD.|ABC|001|400000.00|800000.00|0.00|0.00|0.00|0.00|400000.00|799440.00  
103|D PLC.|D001A|003|22500.00|23784593.63|0.00|0.00|0.00|0.00|22500.00|23573213.10  
108|F Fund|FFF|000|109850.00|83413246.37|0.00|0.00|0.00|0.00|109850.00|84212177.15  
109|G FIXED-INCOME FUND|GFIX1|000|0.00|0.00|200000.00|3002389.00|0.00|0.00|200000.00|3002329.00  
213|BBB CO., LTD.|BBB002C|101|50000.00|61293599.92|40000.00|44428775.00|0.00|0.00|90000.00|104395905.60  
216|Bank X|X|000|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|10000000.00  
502|||0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|10000000.00  
599|||0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|200000.00  
601|||0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|9000000.00  
609|||0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|10000.00  
613|||0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|700000.00  
699|||0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|300000.00  
901|||0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|668786064.85  
902|||0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|10010000.00  
903|||0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|0.00|658776064.85

**วิธีการจัดทำข้อมูล**

1. แต่ละ field กำหนดให้ใช้ “|” (delimiter) เป็นตัวแบ่ง
2. field ใดที่ไม่มีข้อมูล ให้ใช้ตัว delimiter ปิด field นั้น โดยห้ามมีช่องว่างระหว่าง Delimiter และหลัง field สุดท้ายของแต่ละบรรทัด ไม่ต้องจบด้วยตัว delimiter
3. field ที่มี format เป็น char กรณีความยาวข้อมูลน้อยกว่าที่กำหนด ห้ามมีช่องว่างก่อนหรือหลังข้อมูลนั้น ให้กรอก field นั้นหลัง delimiter และปิด field นั้นด้วย delimiter หัน
4. การเรียงข้อมูลใน File : ให้เรียงข้อมูลตาม 1) รหัสประเภทหลักทรัพย์/หนี้สิน จากน้อยไปมาก 2) ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์/คู่สัญญา และ 3) ชื่อย่อหลักทรัพย์/สัญญา



**11. รายงานช่องทางขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมทั้งหมดภายใต้การจัดการ** เป็นรายงานผลรวมมูลค่าขายหน่วยลงทุนผ่านช่องทางผู้ให้บริการขายหน่วยลงทุนประเภทต่าง ๆ ภายในรอบระยะเวลาครึ่งปี ของกองทุนรวมทั้งหมดภายใต้การจัดการของบริษัทจัดการ ทั้งนี้ ไม่รวมกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบัน (non-retail fund) กองทุนรวมวายุภักษ์ กองทุนรวมสำหรับผู้ลงทุนต่างประเทศ กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (กอง 2 – 4) และกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน

**ข้อมูลที่รายงาน**

ข้อมูลที่รายงาน	รายละเอียด
ประเภทรหัสของผู้ให้บริการ	ให้รายงานตามชุด code ของสำนักงาน ดังต่อไปนี้ รหัส 01 คือ เลขประจำตัวประชาชน รหัส 02 คือ เลขที่จดทะเบียนนิติบุคคล รหัส 03 คือ เลขประจำตัวผู้เสียภาษี รหัส 04 คือ รหัสหน่วยงานราชการของรัฐบาลไทย
รหัสของผู้ให้บริการ	1. กรณีรายงานประเภทรหัสของผู้ให้บริการเป็น 01, 02 หรือ 03 ให้รายงานรหัสของผู้ให้บริการเป็นตัวเลข 13 หลักเท่านั้น 2. กรณีรายงานประเภทรหัสของผู้ให้บริการเป็น 04 ให้รายงานรหัสของผู้ให้บริการเป็นตัวเลข 5 หลักเท่านั้น โดยให้รายงานตามชุด code ของสำนักงาน
ชื่อผู้ให้บริการ	ให้รายงานโดยมีความยาวไม่เกิน 200 ตัวอักษร
มูลค่าขายหน่วยลงทุนในรอบระยะเวลาครึ่งปีที่รายงาน (บาท)	ให้รายงานดังนี้ 1. รายงานเฉพาะมูลค่า IPO และมูลค่าขายหน่วยลงทุน (subscription) เท่านั้น 2. รายงานผลรวมทั้งหมดของ IPO + subscription ที่เกิดขึ้นภายในรอบระยะเวลาที่รายงาน เช่น 2.1 รอบรายงานงวดเดือนมิถุนายน : ให้รายงานผลรวมทั้งหมดที่เกิดขึ้นตั้งแต่วันที่ทำการแรกของเดือนมกราคม ถึง วันที่ทำการสุดท้ายของเดือนมิถุนายน 2.2 รอบรายงานงวดเดือนธันวาคม : ให้รายงานผลรวมทั้งหมดที่เกิดขึ้นตั้งแต่วันที่ทำการแรกของเดือนกรกฎาคม ถึง วันที่ทำการสุดท้ายของเดือนธันวาคม 3. มูลค่าที่รายงานมีหน่วยเป็นบาท

**ชื่อ File ที่ส่ง** DC.TXT

**ตัวอย่างข้อมูล**

000000001|DC|20150630  
001|2558|01|3101020040100|นายทดสอบ ช่องทางขาย|3419807.50000  
001|2558|02|1001009150000|บริษัททดสอบช่องทางขาย จำกัด|71605119.45000  
007|2558|04|50705|ธ.อาคารสงเคราะห์|50000000.00000

**วิธีการจัดทำข้อมูล**

- แต่ละ field กำหนดให้ใช้ “|” (delimiter) เป็นตัวแบ่ง
- field ใดที่ไม่มีข้อมูล ให้ใช้ตัว delimiter ปิด field นั้น โดยห้ามมีช่องว่างระหว่าง Delimiter และหลัง field สุดท้ายของแต่ละบรรทัด ไม่ต้องจบด้วยตัว delimiter

- field ที่มี format เป็น char กรณีความยาวข้อมูลน้อยกว่าที่กำหนด ห้ามมีช่องว่างก่อนหรือหลังข้อมูลนั้น ให้กรอก field นั้นหลัง delimiter และปิด field นั้นด้วย delimiter ทันที
- การเรียงข้อมูลใน File : ให้เรียงข้อมูลตามปีที่จดทะเบียน เลขที่จดทะเบียนกองทุน

### การปรับปรุงแบบรายงานเพิ่มเติม

- เพิ่มแบบรายงาน **Stress Test**

**12. รายงาน Stress Test** เป็นรายงานผลการทดสอบผลกระทบต่อพอร์ตการลงทุนของกองทุนรวมในภาวะวิกฤติ โดยให้รายงานเฉพาะกองทุนรวม UI Fund ที่ระบุค่าความเสี่ยงสูงสุดเมื่อตั้งโครงการในระบบ OFAM เป็น

(1) มีการทำธุรกรรมสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ไม่ซับซ้อนโดยมีวัตถุประสงค์มิใช่เพื่อป้องกันความเสี่ยง หรือมีการทำธุรกรรม financing อื่น ๆ (ได้แก่ กู้ยืมเงินและ REPO เพื่อประโยชน์ในการจัดการลงทุน และ short sell) และระบุนมูลค่าการทำธุรกรรมรวมสูงสุด > 100%nav หรือ

(2) มีการทำธุรกรรมสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ซับซ้อนโดยมีวัตถุประสงค์มิใช่เพื่อป้องกันความเสี่ยง และระบุค่าความเสี่ยงสูงสุด absolute VaR > 20%nav หรือ relative VaR > 2 เท่าของ Benchmark

### ข้อมูลที่รายงาน

ข้อมูลที่รายงาน	รายละเอียด
ประเภทความเสี่ยงและผล Stress Test ของทั้งกองทุน	<p>ให้ระบุประเภทความเสี่ยงให้ครบทั้ง 5 รายการ รายการละบรรทัด (ยกเว้นรายการที่ 4 ที่อาจระบุได้มากกว่า 1 บรรทัด) ได้แก่</p> <p>รายการที่ 1 (ความเสี่ยงด้านตลาด : Market Risk) : ระบุชุด code = "01"</p> <p>รายการที่ 2 (ความเสี่ยงด้านเครดิต : Credit Risk) : ระบุชุด code = "02"</p> <p>รายการที่ 3 (ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง : Liquidity Risk) : ระบุชุด code = "03"</p> <p>รายการที่ 4 (ความเสี่ยงอื่น ๆ : Other Risk) : ระบุชุด code = "04" ตามด้วยการระบุประเภทความเสี่ยงเป็น text เช่น "04 ความผันผวนของราคาหลักทรัพย์ (Price Risk)" เป็นต้น</p> <p>- หากไม่มีความเสี่ยงรายการที่ 4 ให้ระบุเพียงชุด code = "04" โดยไม่ต้องตามด้วยการระบุประเภทความเสี่ยงเป็น text</p> <p>- หากมีความเสี่ยงรายการที่ 4 มากกว่า 1 ประเภท ให้ระบุชุด code "04" ตามด้วยการระบุประเภทความเสี่ยงเป็น text ในบรรทัดถัดไป</p> <p>รายการที่ 5 (ผล Stress Test ของทั้งกองทุน : เป็นผลรวมของผลกระทบจากรายการที่ 1 - 4) : ระบุชุด code = "05"</p>

ข้อมูลที่รายงาน	รายละเอียด
ข้อสมมติ	ระบุข้อสมมติ หรือ input parameter ที่ใช้จัดทำ stress test สำหรับแต่ละประเภทความเสี่ยง เช่น "SET Index ปรับลดลง x%" เป็นต้น - หากไม่มีความเสี่ยงรายการใด ไม่ต้องระบุข้อสมมติสำหรับความเสี่ยงประเภทนั้น โดยปล่อย field ให้เป็นค่าว่าง (blank) - กรณีที่ระบุชุด code เป็น "05" ใน field "ประเภทความเสี่ยงและผล Stress Test ของทั้งกองทุน" ไม่ต้องระบุข้อสมมติ โดยปล่อย field "ข้อสมมติ" ให้เป็นค่าว่าง (blank)
ผลกระทบ	ระบุผลกระทบของแต่ละประเภทความเสี่ยงตามข้อสมมติ หรือ input parameter ที่กำหนด โดยระบุหน่วยเป็นบาท ทั้งนี้ - กรณีที่เป็นผลกระทบเชิงลบ ให้ระบุค่าติดลบก่อนตัวเลข เช่น -300.18000 เป็นต้น - กรณีที่ระบุชุด code เป็น "01" หรือ "02" หรือ "03" หรือ "04" ใน field "ประเภทความเสี่ยงและผล Stress Test ของทั้งกองทุน" ถ้าไม่ได้ระบุข้อสมมติใน field ถัดไป ไม่ต้องระบุผลกระทบ โดยปล่อย field "ผลกระทบ" ให้เป็นค่าว่าง (blank) - กรณีที่ระบุชุด code เป็น "05" ใน field "ประเภทความเสี่ยงและผล Stress Test ของทั้งกองทุน" ต้องระบุผลกระทบใน field "ผลกระทบ" ห้ามปล่อยเป็นค่าว่าง (blank)

**ชื่อ File ที่ส่ง** STRESSTEST.TXT

**ตัวอย่างข้อมูล**

0123456789|STRESS TEST|20180928  
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

**วิธีการจัดทำข้อมูล**

1. แต่ละ field กำหนดให้ใช้ "|" (delimiter) เป็นตัวแบ่ง
2. field ใดที่ไม่มีข้อมูล ให้ใช้ตัว delimiter ปิด field นั้น โดยห้ามมีช่องว่างระหว่าง Delimiter และหลัง field สุดท้ายของแต่ละบรรทัด ไม่ต้องจบด้วยตัว delimiter
3. field ที่มี format เป็น char กรณีความยาวข้อมูลน้อยกว่าที่กำหนด ห้ามมีช่องว่างก่อนหรือหลังข้อมูลนั้น ให้กรอก field นั้นหลัง delimiter และปิด field นั้นด้วย delimiter ทันที
4. การเรียงข้อมูลใน File : ให้เรียงข้อมูลตามปีที่จดทะเบียน เลขที่จดทะเบียนกองทุน