

รหัสบริษัทจัดการ		รหัสการสุ่มของเดือน				ประเภท	(เฉพาะข้อมูลบรรทัดแรก)																
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)	(14)	(15)	(16)	(17)		(18)	(19)	(20)	(21)		
เลขที่จดทะเบียน	ปีจดทะเบียน	รหัสประเภทหลักทรัพย์	รหัสตลาด	ชื่อหลักทรัพย์ (Issue Name)	จำนวนหน่วยออกมา (หน่วย)	มูลค่ายกมา (บาท)	จำนวนหน่วยซื้อหรือเพิ่ม (หน่วย)	มูลค่าซื้อหรือเพิ่ม (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท)	จำนวนหน่วยขายหรือลด (หน่วย)	มูลค่าขายหรือลด (รวมค่านายหน้าและ VAT) (บาท)	จำนวนหน่วยยกไป (หน่วย)	ราคาหน้าหัก (บาท)	ดอกเบี้ยค้างรับ (บาท)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	รหัสสกุลเงิน	รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ		ผู้รับประกัน	อันดับความน่าเชื่อถือของผู้รับประกัน	Rating ของผู้รับประกัน	ผู้รับรอง		
		101 - หุ้นสามัญ		000 - นอกตลาด (NO MARKET)											0 - สปท.	110 - ธนาคารแห่งประเทศไทย			00 - NONE				
		102 - หุ้นบุริมสิทธิ		001 - ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET)											1 - บาท	121 - ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศไทย			01 - TRIS				
		103 - หุ้นกู้		003 - ตลาดตราสารหนี้ไทย (THAIBMA)												122 - สาขานิติพาณิชย์ตั้งในประเทศไทย			02 - FITCH				
		108 - หน่วยลงทุนของกองทุนรวม		005 - ตลาดตราสารหนี้ (BEX)												123 - สถาบันการเงินเฉพาะกิจที่รับฝากเงิน			03 - S&P				
			006 - บริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX)												124 - บริษัทเงินทุน			04 - MOODY'S				
			008 - ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (MAI)												125 - สถาบันการเงินที่รับฝากเงินอื่นๆ							
				100 - ตลาดต่างประเทศ (INTERNATIONAL MARKET)												132 - บริษัทหลักทรัพย์							
				999 - อื่นๆ (OTHERS)												133 - กองทุนบำนาญรัฐบาลราชการ							
																134 - กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ							
																135 - กองทุนรวม							
																136 - บริษัทประกันวินาศภัย							
																137 - สถาบันการเงินที่ไม่มีรับฝากเงินอื่นๆ							
																138 - บริษัทประกันชีวิต							
																141 - ส่วนราชการสังกัดรัฐบาลกลาง							
																142 - กองทุนสำนักงานประกันสังคม							
																150 - รัฐนอกท้องถิ่น							
																160 - รัฐวิสาหกิจ และองค์การของรัฐ							
																170 - บริษัทและนิติบุคคล							
																180 - บุคคลธรรมดา							
																190 - สถาบันที่ไม่แสวงหากำไร							
																200 - บุคคลผู้มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ							
																201 - นิติบุคคลที่มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ							
																202 - สถาบันการเงินที่มีถิ่นพำนักต่างประเทศ							
																203 - ผู้ถิ่นที่อยู่ต่างประเทศอื่นๆ							
ตัวอย่าง																							
001	30	06		2006	M																		
005	2540	101		001	AAA	5,000.00	500,000.00	1,000.00	99,000.00	1,800.00	182,600.00	4,200.00	420,000.00	0.00	415,800.00	1		170					
005	2540	201		005	BBB070A	10,000.00	9,706,593.71	0.00	0.00	0.00	0.00	10,000.00	10,000,000.00	26,712.33	9,612,002.44	1		170					

(14)	(15)	(16)	(17)	(18)	(19)	(20)	(21)	(22)	(23)	(24)	(25)	(26)	(27)	(28)
ราคาหน้าตัว (บาท)	ดอกเบี้ยค้างรับ (บาท)	มูลค่ายุติธรรม (บาท)	รหัสสกุลเงิน	รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ	yield	วันที่ออก	เดือนที่ออก	ปีที่ออก (ปี ค.ศ.)	วันที่ครบกำหนด ออก	เดือนที่ครบกำหนด ออก	ปีที่ครบกำหนด ออก (ปี ค.ศ.)	ชื่อผู้ออกหลักทรัพย์ (Issuer Name)	รหัสสถาบันจัด อันดับความ น่าเชื่อถือของ หลักทรัพย์	Rating ของ หลักทรัพย์
			0 - ตปท.	110 - ธนาคารแห่งประเทศไทย										
			1 - บาท	121 - ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ									00 - NONE	
				122 - สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศที่จดทะเบียนในประเทศไทย									01 - TRIS	
				123 - สถาบันการเงินเฉพาะกิจที่รับฝากเงิน									02 - FITCH	
				124 - บริษัทเงินทุน									03 - S&P	
				125 - สถาบันการเงินที่รับฝากเงินอื่นๆ									04 - MOODY'S	
				132 - บริษัทหลักทรัพย์										
				133 - กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ										
				134 - กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ										
				135 - กองทุนรวม										
				136 - บริษัทประกันวินาศภัย										
				137 - สถาบันการเงินที่ไม่รับฝากเงินอื่นๆ										
				138 - บริษัทประกันชีวิต										
				141 - ส่วนราชการสังกัดรัฐบาลกลาง										
				142 - กองทุน/สำนักงานประกันสังคม										
				150 - รัฐบาลท้องถิ่น										
				160 - รัฐวิสาหกิจ และองค์การของรัฐ										
				170 - บริษัทและนิติบุคคล										
				180 - บุคคลธรรมดา										
				190 - สถาบันที่ไม่แสวงหากำไร										
				200 - บุคคลผู้มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ										
				201 - นิติบุคคลที่มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ										
				202 - สถาบันการเงินที่มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ										
				203 - ผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศอื่นๆ										
0.00	0.00	0.00	1	170								ABC PUBLIC COMPANY LIMITED	00	
0.00	0.00	500,000.00	1	170								BBC COMPANY LIMITED	00	
0.00	0.00	0.00	1	170	4.59	01	03	2003	31	03	2006	SSS	00	
2,200,000.00	16,153.42	2,216,153.42	1	170	4	15	01	2006	15	04	2006	GGG	00	

ภาคผนวก ก4

แบบรายงานการลงทุนใน Swap (MF04) หน้าที่ 2/4

(14)	(15)	(16)	(17)	(18)	(19)	(20)	(21)	(22)	(23)	(24)	(25)	(26)
รหัสประเภทหลักทรัพย์	รายละเอียดประเภทธุรกรรม	ประเภทของ Reference Underlying ที่สัญญาอ้างอิง	งวดการจ่ายดอกเบี้ย/ ผลตอบแทน	รายละเอียดของงวดการจ่ายอัตราผลตอบแทน	ชื่อของคู่สัญญา	รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ	Credit Rating ของคู่สัญญา (Counterparty)	รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	ประเทศของคู่สัญญา	วันที่สัญญาเริ่ม	เดือนที่สัญญาเริ่ม	ปีที่สัญญาเริ่ม
11 Interest Rate Swap	เพิ่มเติม (ถ้านี้)	111 Local Interest	1 ทุก 3 เดือน	เพิ่มเติม (ถ้านี้)		110 ธนาคารแห่งประเทศไทย		00 - NONE				
12 Currency Swap		112 Local Interest Index	2 ทุก 6 เดือน			121 ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ		01 - TRIS				
13 อื่น ๆ เช่น asset swap		113 Foreign Interest	3 ทุก 1 ปี			122 สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศที่จดทะเบียนในไทย		02 - FITCH				
		114 Foreign Interest Index	4 ครั้งเดียว ณ วันครบกำหนด			123 สถาบันการเงินเฉพาะกิจที่รับฝากเงิน		03 - S&P				
		115 Foreign Exchange Rate	9 อื่น ๆ			124 บริษัทเงินทุน		04 - MOODY'S				
		116 Foreign Exchange Index				125 สถาบันการเงินที่รับฝากเงินอื่นๆ						
		117 Local Equity				132 บริษัทหลักทรัพย์						
		118 Local Equity Index				133 กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ						
		119 Foreign Equity				134 กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ						
		120 Foreign Equity Index				135 กองทุนรวม						
		121 Commodity				136 บริษัทประกันวินาศภัย						
		122 Commodity Index				137 สถาบันการเงินที่ไม่รับฝากเงินอื่นๆ						
		123 Fixed Income				138 บริษัทประกันชีวิต						
		124 Other Financial Index				141 ส่วนราชการสังกัดรัฐบาลกลาง						
		125 Others				142 กองทุน/สำนักงานประกันสังคม						
		ระบุได้มากกว่า 1 ประเภท เช่น				150 รัฐบาลท้องถิ่น						
		Currency swap 01จนถึง 111,113,115				160 รัฐวิสาหกิจ และองค์กรของรัฐ						
						170 บริษัทและนิติบุคคล						
						180 บุคคลธรรมดา						
						...						
11	-	111	1		Bank C	121	A	01	ไทย	01	01	2006
12	-	111, 113, 115	3		Bank D	121	A	01	ไทย	30	03	2006

ภาคผนวก ก4

แบบรายงานการลงทุนใน Swap (MF04) หน้าที่ 3/4

(27)	(28)	(29)	(30)	(31)	(32)	(33)	(34)	(35)	(36)	(37)	(38)	(39)
วันที่ครบกำหนด	เดือนที่ครบกำหนด	ปีที่ครบกำหนด	สกุลเงินของ Notional Amount	รหัสสกุลเงิน	สกุลเงินด้านซื้อของ Notional Amount	รหัสสกุลเงิน	สกุลเงินด้านขายของ Notional Amount	รหัสสกุลเงิน	กองทุนอยู่ในฐานะผู้จ่ายกระแสวิกฤต	รายละเอียดกระแสเงินสดจ่าย	กองทุนอยู่ในฐานะผู้รับกระแสวิกฤต	รายละเอียดกระแสเงินสดรับ
			ระบุถ้าไม่ใช่สัญญา	0 คปท.	เฉพาะสัญญาอัตราแลกเปลี่ยน	0 คปท.	เฉพาะสัญญาอัตราแลกเปลี่ยน	0 คปท.	31 อ้างอิงกับ Fixed Local Interest Rate		41 อ้างอิงกับ Fixed Local Interest Rate	
			อัตราแลกเปลี่ยน	1 บาท	(ถ้า 12 เลือก 115 foreign exchange rate)	1 บาท	(ถ้า 12 เลือก 115 foreign exchange rate)	1 บาท	32 อ้างอิงกับ Float Local Interest Rate		42 อ้างอิงกับ Float Local Interest Rate	
									33 อ้างอิงกับ Fixed Foreign Interest Rate		43 อ้างอิงกับ Fixed Foreign Interest Rate	
									34 อ้างอิงกับ Float Foreign Interest Rate		44 อ้างอิงกับ Float Foreign Interest Rate	
									35 อ้างอิงกับ Equity		45 อ้างอิงกับ Equity	
									36 อ้างอิงกับ Equity Index		46 อ้างอิงกับ Equity Index	
									37 อ้างอิงกับอื่น ๆ		47 อ้างอิงกับอื่น ๆ	
01	04	2006	บาท	1	-	1	-	1	31	pay 2.5% THB	42	receive THBFIX 6M
30	09	2006	บาท	1	USD	0	บาท	1	32	pay THBFIX3M	44	receive LIBOR

ภาคผนวก ก5

แบบรายงานการลงทุนใน Option (MF05) หน้าที่ 1/2

รหัสบริษัทจัดการ		วันที่การสุดท้ายของเดือน			ประเภทรายงาน (เฉพาะข้อมูลบรรทัดแรก)															
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)	(14)	(15)	(16)	(17)	(18)	(19)	(20)	
เลขที่จดทะเบียน กองทุน	ปีที่จดทะเบียน กองทุน	วัตถุประสงค์การทำธุรกรรม	รายละเอียดการทำธุรกรรม (ฐานะ ประเภท และ ราคาใช้สิทธิ)	required covers [กรณี (3) คอบ 03]	available covers [กรณี (3) คอบ 03]	การใช้สิทธิ	ลักษณะการ hedge	มูลค่า underlying exposure ณ วันที่ทำสัญญา [กรณี (3) คอบ 01]	มูลค่าธุรกรรม ณ วันที่ทำสัญญา [กรณี (3) คอบ 01]	ประเภทการ hedge	รายละเอียดประเภทการ hedge	ชื่อหลักทรัพย์ที่ได้รับการป้องกัน ความเสี่ยง (hedged item)	ค่า correlation ratio	ค่า hedge ratio	delta	gamma	vega	ประเภทของ reference underlying ที่สัญญาอ้างอิง	รายละเอียดของ reference underlying ที่สัญญาอ้างอิง	
		01 Hedging/ลดความเสี่ยง					01 American Option	01 Full Hedge			01 Cross Hedge	เพิ่มเติม (ถั่ว)	ตั้งอยู่ใน MPF1000 แต่ถั่ว Hedge						111 Local Interest	
		02 ดตกขายขาด ประสิทธิภาพในการบริหาร					02 European Option	02 Partial Hedge			02 Same Underlying Hedge		ทั้ง Port (Column (7) เลือก 03) ให้ใช้						112 Local Interest Index	
		03 เพิ่มผลตอบแทน									03 Portfolio (Macro) Hedge		ซื้อกองทุน						113 Foreign Interest	
		04 อื่น ๆ (ระบุ)									04 Anticipatory Hedge								114 Foreign Interest Index	
											05 อื่น ๆ								115 Foreign Exchange Rate	
																			116 Foreign Exchange Index	
																			117 Local Equity	
																			118 Local Equity Index	
																			119 Foreign Equity	
																			120 Foreign Equity Index	
																			121 Commodity	
																			122 Commodity Index	
																			123 Fixed Income	
																			124 Other Financial Index	
																			125 Others	
ตัวอย่าง																				
001	2549	01	long put (50)				02	01	3,000,000	3,000,000	01	-	Bank A	0.95	1.1	1	0.01	75	117	
002	2549	03	covered call = long stock (105) + short call (110)				02	-	10,000,000	10,000,000	-	-	Bank A	-	-	1	0	80	117	
003	2549	01	long put (100)				02	02	6,000,000	6,000,000	03	-	กองทุน A	0.75	1.2	0.7	0.01	45	118	

หมายเหตุ

required cover หมายถึง มูลค่าของหลักทรัพย์และทรัพย์สินเพื่อใช้ในการ cover สัญญา

available cover หมายถึง มูลค่าของหลักทรัพย์และทรัพย์สินที่สามารถใช้ในการ cover สัญญา

ภาคผนวก ก5

แบบรายงานการลงทุนใน Option (MF05) หน้าที่ 2/2

(21)	(22)	(23)	(24)	(25)	(26)	(27)	(28)	(29)	(30)	(31)	(32)	(33)	(34)	(35)	(36)	(37)	(38)	(39)
option premium	รหัสตลาด	วิธีการส่งมอบ	ชื่อของผู้สัญญา	รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ	Credit Rating ผู้สัญญา (counterparty)	รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	ประเภทของผู้สัญญา	วันที่สัญญาเริ่มผล	เดือนที่สัญญาเริ่มผล	ปีที่สัญญาเริ่มผล	วันที่ครบกำหนด	เดือนที่ครบกำหนด	ปีที่ครบกำหนด	มูลค่าตามสัญญา	มูลค่าตามราคาตลาด	สกุลเงินของสัญญา	รหัสสกุลเงิน	ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market สัญญา
	000 - นอตลาด (NO MARKET)	0 physical	(กรณีที่ไม่ใช่ตลาด)	110 ธนาคารแห่งประเทศไทย	(กรณีที่ไม่ใช่ตลาด)	00 - NONE								(notional amount at exercise price)	(notional amount at market price)		0 ल्प.	
	001 - ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET)	1 cash		121 ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ		01 - TRIS											1 บาท	
	003 - สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (THAIBMA)			122 สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศที่จดทะเบียนในไทย		02 - FITCH												
	005 - ตลาดตราสารหนี้ (BEX)			123 สถาบันการเงินเฉพาะกิจที่รับฝากเงิน		03 - S&P												
	006 - บริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX)			124 บริษัทเงินทุน		04 - MOODY'S												
	008 - ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (MAI)			125 สถาบันการเงินที่รับฝากเงินอื่นๆ														
	100 - ตลาดต่างประเทศ (INTERNATIONAL MARKET)			132 บริษัทหลักทรัพย์														
	999 - อื่นๆ (OTHERS)			133 กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ														
				134 กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ														
				135 กองทุนรวม														
				136 บริษัทประกันวินาศภัย														
				137 สถาบันการเงินที่ไม่รับฝากเงินอื่นๆ														
				138 บริษัทประกันชีวิต														
				141 ส่วนราชการสังกัดรัฐบาลกลาง														
				142 กองทุน/สำนักงานประกันสังคม														
				150 รัฐบาลท้องถิ่น														
				...														
	000	1	Bank C	121	A	01	ไทย	01	01	2006	01	04	2006	3,000,000	3,100,000	บาท	1	100,000
	000	1	Bank C	121	A	01	ไทย	30	03	2006	30	09	2006	10,000,000	11,000,000	บาท	1	1,000,000
	000	1	Bank C	121	A	01	ไทย	25	02	2006	25	05	2006	6,000,000	6,050,000	บาท	1	50,000

ภาคผนวก ก6

แบบรายงานการลงทุนใน Structured Notes (MF06) หน้าที่ 1/2

รหัสบริษัทจัดการ	วันที่การสุดท้ายของเดือน			ประเภทรายงาน	(เฉพาะข้อมูลบรรทัดแรก)				
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)
เลขที่จดทะเบียน กองทุน	ปีที่จดทะเบียน กองทุน	ประเภทตราสาร	รายละเอียดเกี่ยวกับ ตราสาร	ประเภทของ Reference Underlying ที่ สัญญาอ้างอิง	รายละเอียดของ Reference Underlying ที่สัญญาอ้างอิง	งวดการจ่ายดอกเบี้ย/ ผลตอบแทน	รายละเอียดของงวดการจ่าย อัตราผลตอบแทน	รหัสตลาด	ชื่อของผู้ออกตราสาร
		21 Inverse Floater	เพิ่มเติม (ถ้ามี)	111 Local Interest		1 ทุก 3 เดือน	เพิ่มเติม (ถ้ามี)	000 - นอกตลาด (NO MARKET)	
		22 Range Accrual Notes		112 Local Interest Index		2 ทุก 6 เดือน		001 - ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET)	
		23 Structure Notes Linked to Index		113 Foreign Interest		3 ทุก 1 ปี		003 - สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (THAIBMA)	
		24 Quanto Notes		114 Foreign Interest Index		4 ครั้งเดียว ณ วันครบกำหนด		005 - ตลาดตราสารหนี้ (BEX)	
		30 Convertible Bond		115 Foreign Exchange Rate		9 อื่น ๆ		006 - บริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX)	
		31 Putable Bond		116 Foreign Exchange Index				008 - ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (MAI)	
		32 Callable Bond		117 Local Equity				100 - ตลาดต่างประเทศ (INTERNATIONAL MARKET)	
		33 อื่น ๆ		118 Local Equity Index				999 - อื่นๆ (OTHERS)	
				119 Foreign Equity					
				120 Foreign Equity Index					
				121 Commodity					
				122 Commodity Index					
				123 Fixed Income					
				124 Other Financial Index					
				125 Others					
ตัวอย่าง									
001	2549	23	DCI Index	116	-	1	-	000	bank A
002	2543	22	SET50 Index	111	4.25%*N1/N2, actual 366	2	-	000	bank B
003	2547	22	-	112	6 mt THBFIX	3	-	000	bank C

ภาคผนวก ก6

แบบรายงานการลงทุนใน Structured Notes (MF06) หน้าที่ 2/2

(11)	(12)	(13)	(14)	(15)	(16)	(17)	(18)	(19)	(20)	(21)	(22)	(23)	(24)	(25)	(26)	(27)
รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ	Credit Rating ของผู้ออกตราสาร	รหัสสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	Credit Rating ของตราสาร	ประเทศของผู้ออกตราสาร	วันที่สัญญา มีผล	เดือนที่ สัญญา มีผล	ปีที่สัญญา มีผล	วันที่ครบ กำหนด	เดือนที่ครบ กำหนด	ปีที่ครบ กำหนด	สกุลเงินของ ตราสาร	รหัสสกุลเงิน	มูลค่าหน้าตั๋ว	มูลค่าตามราคาตลาด	ร้อยละต่อ NAV (ตามมูลค่าตลาด)	ผลกำไร/ขาดทุนจากการ mark to market
110 ธนาคารแห่งประเทศไทย		00 - NONE										0 ลปท.				
121 ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ		01 - TRIS										1 บาท				
122 สาขานาคารพาณิชย์ต่างประเทศที่จดทะเบียนในไทย		02 - FITCH														
123 สถาบันการเงินเฉพาะกิจที่รับฝากเงิน		03 - S&P														
124 บริษัทเงินทุน		04 - MOODY'S														
125 สถาบันการเงินที่รับฝากเงินอื่นๆ																
132 บริษัทหลักทรัพย์																
133 กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ																
134 กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ																
135 กองทุนรวม																
136 บริษัทประกันวินาศภัย																
137 สถาบันการเงินที่ไม่รับฝากเงินอื่นๆ																
138 บริษัทประกันชีวิต																
141 ส่วนราชการสังกัดรัฐบาลกลาง																
142 กองทุน/สำนักงานประกันสังคม																
150 รัฐบาลท้องถิ่น																
...																
121	A	01	-	ไทย	01	01	2006	01	04	2006	บาท	1	300,000,000	295,000,000	10	-5,000,000
121	A	01	-	ไทย	30	03	2006	30	09	2006	บาท	1	100,000,000	101,000,000	15	1,000,000
121	A	01	-	ไทย	25	02	2006	25	05	2006	บาท	1	50,000,000	50,500,000	5	500,000

ภาคผนวก ก8

แบบรายงานการทำธุรกรรมซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (reverse repo) (MF08)

รหัสบริษัทจัดการ (1)	วันที่การสุดท้ายของเดือน			ประเภทรายงาน (เฉพาะข้อมูลบรรทัดแรก)				(9)	(10)	(11)	(12)	(13)	(14)	(15)	(16)	(17)	(18)	(19)	(20)	(21)	(22)	(23)	(24)	(25)	
	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)																		
เลขที่จดทะเบียน กองทุน	ปีที่ลด ทะเบียน กองทุน	หลักทรัพย์ที่ซื้อโดยมีสัญญาขายคืน						ชื่อของ คู่สัญญา	รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ	Credit Rating คู่สัญญา	รหัสสถาบันจัด อันดับความ น่าเชื่อถือ	วันที่ สัญญาเริ่ม ผล	เดือนที่ สัญญาเริ่ม ผล	ปีที่ สัญญาเริ่ม ผล	วันที่ครบ กำหนด	เดือนที่ ครบ กำหนด	ปีที่ครบ กำหนด	ผลตอบแทนจาก การทำธุรกรรม (ร้อยละ)	มูลค่าตรา สาร	มูลค่า ธุรกรรม	สกุล เงินตราสาร	รหัสสกุลเงิน	มูลค่าธุรกรรม (ร้อย ละ)	สัดส่วนมูลค่า ธุรกรรมต่อ NAV ณ สิ้นเดือน (ร้อยละ)	
		ผู้ซื้อ	ผู้ออกผู้รับรอง ตราสาร	rating ตราสาร	rating ผู้ออก ตราสาร	rating ผู้รับรอง ตราสาร	ประเทศผู้ออก ตราสาร																		
									110 ธนาคารแห่งประเทศไทย		00 - NONE												0 ต.ป.ก.		
									121 ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ		01 - TRIS												1 บาท		
									122 ธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศที่จดทะเบียนในไทย		02 - FITCH														
									123 สถาบันการเงินเฉพาะกิจที่รับฝากเงิน		03 - S&P														
									124 บริษัทเงินทุน		04 - MOODY'S														
									125 สถาบันการเงินที่รับฝากเงินอื่นๆ																
									132 บริษัทหลักทรัพย์																
									133 กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ																
									134 กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ																
									135 กองทุนรวม																
									136 บริษัทประกันวินาศภัย																
									137 สถาบันการเงินที่ไม่รับฝากเงินอื่นๆ																
									138 บริษัทประกันชีวิต																
									141 ส่วนราชการสังกัดรัฐบาลกลาง																
									142 กองทุน/สำนักงานประกันสังคม																
									150 รัฐบาลท้องถิ่น																
ตัวอย่าง									...																
001	2545	LB088	รัฐบาลไทย	-	-	-	-	bank A	121	A	01	01	01	2006	15	01	2006	5%	110	102	บาท	1	108%	10%	

ภาคผนวก ก10

แบบรายงานการทำธุรกรรมขายโดยมีสัญญาซื้อคืน (repo) และการกู้ยืมเงินโดยตรง (MF10)

รหัสบริษัทจัดการ	วันที่การสุดท้ายของเดือน			ประเภทรายงาน (เฉพาะข้อมูลบรรทัดแรก)						(10)	(11)	(12)	(13)	(14)	(15)	(16)	(17)	(18)	(19)	(20)	(21)	(22)	(23)	(24)
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)																
เลขที่จดทะเบียน กองทุน	ปีจดทะเบียน กองทุน	รหัสประเภท หลักทรัพย์	หลักทรัพย์ที่ขายโดยมีสัญญาซื้อคืน						ชื่อของ ผู้สัญญา	รหัสกลุ่มตราจูง	Credit Rating ผู้สัญญา	รหัสสถาบันจัด อันดับความ น่าเชื่อถือ	วันที่ สัญญามี ผล	เดือนที่ สัญญามี ผล	ปีที่ สัญญามี ผล	วันที่ ครบ	เดือนที่ ครบ	ปีที่ครบ กำหนด	อัตรา ดอกเบี้ยจ่าย (ร้อยละ)	มูลค่าธุรกรรม	สกุล เงินตราสาร	รหัสสกุลเงิน	ธุรกรรมต่อ NAV (ร้อยละ)	
			ชื่อหลักทรัพย์	ประเภท	ผู้ออก/ผู้รับรอง ตราสาร	rating ตรา สาร	rating ผู้ออก ตราสาร	rating ผู้ รับรองตราสาร																
		601	กู้ยืมเงิน โดยตรง							110 - ธนาคารแห่งประเทศไทย		00 - NONE											0 คปท.	
		602	Repo							121 - ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ		01 - TRIS											1 บาท	
										122 - สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศที่จดทะเบียนในประเทศไทย		02 - FITCH												
										123 - สถาบันการเงินเฉพาะกิจที่รับฝากเงิน		03 - S&P												
										124 - บริษัทเงินทุน		04 - MOODY'S												
										125 - สถาบันการเงินที่รับฝากเงินอื่นๆ														
										132 - บริษัทหลักทรัพย์														
										133 - กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ														
										134 - กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ														
										135 - กองทุนรวม														
										136 - บริษัทประกันวินาศภัย														
										137 - สถาบันการเงินที่ไม่รับฝากเงินอื่นๆ														
										138 - บริษัทประกันชีวิต														
										141 - ส่วนราชการสังกัดรัฐบาลกลาง														
										142 - กองทุน/สำนักงานประกันสังคม														
										150 - รัฐบาลท้องถิ่น														
ตัวอย่าง																								
002	2546	601	-	-	-	-	-	-	bank A	121	AA	01	01	03	2006	31	03	2006	8	100,000,000	บาท	1	1.5	
003	2547	602	BBL077	หุ้นกู้	BBL	AAA	-	-	bank B	121	AAA	01	05	02	2006	19	02	2006	5	200,000,000	บาท	1	5	

(13)	(14)	(15)	(16)	(17)	(18)	(19)	(20)	(21)	(22)	(23)	(24)	(25)	(26)	(27)	(28)
จำนวนหน่วยขายหรือลด (หน่วย)	มูลค่าขายหรือลด (รวมค่าขายหนี้และ VAT) (บาท)	จำนวนหน่วยยกไป (หน่วย)	อัตราดอกเบี้ยหน้าตั๋วปี(Coupon Rate/Year)	ราคาหน้าตั๋ว (บาท)	ดอกเบี้ยค้างรับ (บาท)	มูลค่าสุทธิรวม (บาท)	รหัสสกุลเงิน	รหัสกลุ่มเศรษฐกิจ	yield	วันที่ออก	เดือนที่ออก	ปีที่ออก (ปี ค.ศ.)	วันที่ครบกำหนดออก	เดือนที่ครบกำหนดออก	ปีที่ครบกำหนดออก (ปี ค.ศ.)
							0 - คปท.	110 - ธนาคารแห่งประเทศไทย							
							1 - บาท	121 - ธนาคารพาณิชย์จดทะเบียนในประเทศ							
								122 - สาขาธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศที่จดทะเบียนในประเทศไทย							
								123 - สถาบันการเงินเฉพาะกิจที่รับฝากเงิน							
								124 - บริษัทเงินทุน							
								125 - สถาบันการเงินที่รับฝากเงินอื่นๆ							
								132 - บริษัทหลักทรัพย์							
								133 - กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ							
								134 - กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ							
								135 - กองทุนรวม							
								136 - บริษัทประกันวินาศภัย							
								137 - สถาบันการเงินที่ไม่รับฝากเงินอื่นๆ							
								138 - บริษัทประกันชีวิต							
								141 - ส่วนราชการสังกัดรัฐบาลกลาง							
								142 - กองทุนสำรองเงินประกันสังคม							
								150 - รัฐบาลท้องถิ่น							
								160 - รัฐวิสาหกิจ และองค์การของรัฐ							
								170 - บริษัทและนิติบุคคล							
								180 - บุคคลธรรมดา							
								190 - สถาบันที่ไม่แสวงหากำไร							
								200 - บุคคลผู้มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ							
								201 - นิติบุคคลที่มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ							
								202 - สถาบันการเงินที่มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ							
								203 - ผู้มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศอื่นๆ							
0.00	0.00	5,000.00	5.20	26,000,000.00	0.00	32,000,000.00	0		141	01	04	2004	31	07	2006
0.00	0.00	20,000.00	6.00	100,000,000.00	0.00	140,000,000.00	0		160	01	08	2004	31	10	2008
0.00	0.00	8,000.00		36,000,000.00	0.00	38,500,000.00	0		135						

