



สมาคมบริษัท
จัดการลงทุน

ASSOCIATION OF INVESTMENT MANAGEMENT COMPANIES

ประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ที่ สจก.ร. 1/2557

เรื่อง การนำส่งข้อมูลพอร์ตการลงทุนรายกองทุนเพื่อการจัดประเภทกองทุนรวม

ตามความในข้อ 42 (8) ประกอบกับข้อ 9 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทช. 35/2556 เรื่อง มาตรฐานการประกอบธุรกิจ โครงสร้างการบริหารงาน ระบบงาน และการให้บริการของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลงวันที่ 6 กันยายน 2556 คณะกรรมการสมาคมบริษัทจัดการลงทุนจึงออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“สมาคม” หมายความว่า สมาคมบริษัทจัดการลงทุน

“กองทุนรวม” หมายความว่า กองทุนปิดและกองทุนเปิด

“สมาชิก” หมายความว่า สมาชิกของสมาคมบริษัทจัดการลงทุนที่ได้รับใบอนุญาตให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวม

“ประเภทกองทุนรวม” หมายความว่า ประเภทกองทุนรวมที่แบ่งตามพอร์ตโฟลิโอการลงทุนจริงของแต่ละกองทุน ภายใต้ความเห็นชอบของคณะทำงานพิจารณาการจัดประเภทกองทุนรวม

“คณะทำงานพิจารณาการจัดประเภทกองทุนรวม” หมายความว่า คณะทำงานพิจารณาการจัดประเภทกองทุนรวม ที่แต่งตั้งโดยสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

“สำนักงาน ก.ล.ต.” หมายความว่า สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 2 ขอให้สมาชิคนำส่งข้อมูลพอร์ตการลงทุนรายกองทุนให้กับสมาคม หรือบุคคลที่สมาคมว่าจ้างเพื่อจัดประเภทกองทุนรวม โดยมีรูปแบบในการนำส่งข้อมูลตามที่สมาคมกำหนดตามภาคผนวก ทั้งนี้ บุคคลที่สมาคมว่าจ้างจะต้องทำสัญญาเพื่อรักษาข้อมูลที่เป็นความลับของสมาชิกในส่วนที่ไม่สามารถเปิดเผยได้

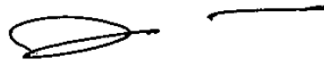
ข้อ 3 ขอให้สมาชิกนำส่งข้อมูลพอร์ตการลงทุนรายกองทุนให้กับสมาคม หรือบุคคลที่สมาคมว่าจ้างเพื่อจัดประเภทกองทุนรวมเป็นรายไตรมาส ภายใน 10 วันทำการ นับจากวันสิ้นงวดไตรมาส เพื่อให้สมาคมหรือบุคคลที่สมาคมว่าจ้างดำเนินการจัดประเภทกองทุนรวมและแจ้งสมาคมเพื่อเผยแพร่ทางเว็บไซต์สมาคมให้กับสมาชิกและผู้ที่เกี่ยวข้องทราบ

ทั้งนี้ สำหรับการนำส่งข้อมูลพอร์ตการลงทุนรายกองทุนครั้งแรก ให้สมาชิกนำส่งข้อมูลสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2557 ให้กับสมาคมหรือบุคคลที่สมาคมว่าจ้างภายในวันที่ 16 มีนาคม 2558

ข้อ 4 กรณีมีการย้ายประเภทกองทุนรวมของสมาชิก สมาคมแจ้งให้สมาชิกทราบภายใน 20 วัน นับจากวันที่สมาชิกส่งข้อมูลพอร์ตการลงทุนรายกองทุน หากสมาชิกมีข้อโต้แย้งจากการย้ายประเภทกองทุนรวม ให้สมาชิกแจ้งมายังสมาคมภายใน 5 วันทำการนับจากวันที่ได้รับแจ้งเรื่องดังกล่าวจากสมาคม เพื่อให้สมาคมนำเสนอข้อมูลดังกล่าวเป็นวาระการประชุมของคณะทำงานพิจารณาการจัดประเภทกองทุนรวม

ข้อ 5 ประกาศนี้ให้มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2558 เป็นต้นไป และให้สมาชิกถือปฏิบัติโดยเคร่งครัด

ประกาศ ณ วันที่ 26 ธันวาคม พ.ศ. 2557



(นางวรวรรณ ชาราภูมิ)

นายกสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ภาคผนวก

ตัวอย่างรูปแบบการจัดส่งข้อมูลเพื่อจัดทำข้อมูลสถิติกองทุนรวม – กองทุนรวมตราสารหนี้



Morningstar Standardized Global Portfolio File Template

Morningstar requires all funds to report complete holdings, including cash equivalents and short-term positions, on a > Portfolio holdings should be reported as of the last day of the month.

> An initial portfolio should be sent immediately for new funds activation. Thereafter, if Morningstar already publishes some of your funds, please add the new funds to the existing portfolio file transmission.

Delivery Methods

1. FTP, File Transfer Protocol
2. Internet, please e-mail DataPortfolioTeam@morningstar.com to obtain a login and password.

Acceptable file types

1. Text
2. .XLS (Worksheets, NOT Workbooks)

PORTFOLIO AS OF DATE	UNIQUE PORTFOLIO IDENTIFIER	FUND NAME	SECURITY IDENTIFIER	SECURITY DESCRIPTION	SHARES/ PAR VALUE	BASE MARKET VALUE	COUPON RATE / STRIKE PRICE	MATURITY DATE/ EXPIRATION DATE	PORTFOLIO BASE CURRENCY	Local Asset Type
(mm/dd/yyyy) or (yyyy-mm-dd) The month end date on which the portfolio data was extracted. Must be the last day of the month (e.g. 09/30/2002 or 10/31/2002). All other dates will be rounded (rounded forward where dd =>16)	Char(75) This can be an internal code unique to each fund, or it can be as simple as the fund name. Must be kept consistent per portfolio and from delivery to delivery.	Char(75) Must be kept consistent per fund, per portfolio file. Can vary from delivery to delivery due to name changes.	Char(12) This is a required field that can contain a maximum of 12 characters. Our system matches securities using any one of the following identifiers: 1) CUSIP \ CINs 2) ISIN 3) Sedol 4) Valoren 5) Sicovam 6) WPK 7) Common Code 8) Quick Code 9) Custom Identifier (see below for samples)	Char(75) Please include a full description. This would include descriptions such as ADR, 144A, CMO, REMIC, PFD, CV, FRN, etc..	Numeric (19.2) Shares for equity holdings or par value for fixed-income holdings.	Numeric (19.5)	Numeric(9.5) Only for fixed-income holdings. Expressed as a percentage (5.55), not as a number (.0555).	(mm/dd/yyyy) or (yyyy-mm-dd) If maturity date falls before the date of the portfolio or not formatted as mm/dd/yyyy the values will be null.	Char(3) Must contain 3 character ISO currency code corresponding to the currency in which all of the portfolio holding's market values are reported. Reporting currency must be consistent for every asset in a fund.	Internal Used, e.g. Brazil TipoDeAtivo

Example of information that should be in each field:

29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	CB14904B	Bank of Thailand	4,500,000.00	4,491,496.00		9/4/2014	THB	213
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	CB14911B	Bank of Thailand	4,700,000.00	46,892,808.00		9/11/2014	THB	213
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	CB14918A	Bank of Thailand	34,000.00	33,909,698.00		9/18/2014	THB	213
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	CB14918B	Bank of Thailand	14,000.00	13,962,542.00		9/18/2014	THB	213
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	FD140919_1AM-DAILY	Name of the Bank	50,000,000.00	50,153,151.00			THB	218
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	FD141008_1AM-DAILY	Name of the Bank		30,049,315.00			THB	218
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	FD141024_1AM-DAILY	Name of the Bank		50,027,397.00			THB	218
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	FD141024_1DAILY	Name of the Bank		50,027,397.00			THB	218
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	FD141029_1AM-DAILY	Name of the Bank		70,014,384.00			THB	218
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	FD141029_1DAILY	Name of the Bank		35,007,192.00			THB	218
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	FD141119_1AM-DAILY	Name of the Bank		20,343,364.00			THB	218
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	ICBCTL149A	ICBC (Thai) Leasing Company Li	20,000,000.00	20,343,364.00	3.79	9/26/2014	THB	103
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	KEXIM14NA	Export-Import Bank of Korea	15,000,000.00	15,223,353.00	4.16	11/25/2014	THB	103
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	KK140A	Kiatnakin Bank Public Company I	10,000,000.00	10,065,191.00	4	10/18/2014	THB	103
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	KTBL14911B	KTBL LEASING COMPANY LIMITE	10,000,000.00	9,990,949.00			THB	204
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	PN140909_1AM-DAILY	Name of the issuer		20,085,671.00			THB	203
29/8/2014	03532550	1 A.M. Daily	PN140917_1AM-DAILY	Name of the issuer		10,036,370.00			THB	203

24 ธันวาคม 2557

เรียน นายกสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ที่ กสท.กธ. 3303 /2557 เรื่อง การให้ความเห็นชอบร่างประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุน
เกี่ยวกับการนำส่งข้อมูลพอร์ตการลงทุนรายกองทุนเพื่อการจัดประเภทกองทุนรวม

ตามที่สมาคมท่านได้มีหนังสือที่ สจก.ร. 006/2557 ลงวันที่ 18 ธันวาคม 2557
ขอความเห็นชอบร่างประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุนเกี่ยวกับการนำส่งข้อมูลพอร์ตการลงทุน
รายกองทุนเพื่อการจัดประเภทกองทุนรวม ความละเอียดแจ้งแล้ว นั้น

สำนักงานพิจารณาแล้ว เห็นชอบร่างประกาศสมาคมฉบับดังกล่าว และขอให้
สมาคมท่านแจ้งและซักซ้อมความเข้าใจเพื่อให้สมาชิกปฏิบัติได้อย่างถูกต้องด้วย

จึงเรียนมาเพื่อ โปรดทราบและดำเนินการต่อไป

ขอแสดงความนับถือ



(นายวรพล โสคติยานุรักษ์)
เลขาธิการ

ฝ่ายกำกับและพัฒนาธุรกิจหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 0-2695-9566

โทรสาร 0-2695-9777