



ประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ที่ สจก.ร. 1/2551

เรื่อง การยกเลิกประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุนที่เกี่ยวกับหลักเกณฑ์และวิธีการในการจัดทำ
รายงานการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมประเภทต่างๆ

ตามความแห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่
กน. 29/2547 เรื่อง การยกเลิกประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่เกี่ยวกับการจัดการกองทุนรวมและกองทุนส่วนบุคคล ลงวันที่ 10 มิถุนายน พ.ศ. 2547
กำหนดให้ยกเลิกประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กน. 46/2541 เรื่อง
หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการจัดตั้งและจัดการกองทุนรวม ลงวันที่ 16 ธันวาคม พ.ศ. 2541
ซึ่งกำหนดให้สมาคมบริษัทจัดการลงทุนประกาศกำหนดหลักเกณฑ์และวิธีการในการจัดทำรายงาน
การลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินอื่นหรือการหาผลตอบแทนโดยวิธีอื่นตามที่
สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์กำหนดหรือให้ความเห็นชอบ
เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมประเภทต่างๆ อาศัยอำนาจตามความในข้อ 25 แห่งข้อบังคับของ
สมาคมบริษัทจัดการลงทุน คณะกรรมการสมาคมบริษัทจัดการลงทุนจึงออกข้อกำหนดไว้
ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุน ที่ สจก.ร. 3/2542 เรื่อง หลักเกณฑ์
และวิธีการในการจัดทำรายงานการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์ เพื่อเป็นทรัพย์สินของ
กองทุนรวมประเภทต่างๆ ลงวันที่ 28 พฤษภาคม พ.ศ. 2542

ข้อ 2 ประกาศนี้ให้มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 27 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2551 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2551



(นายมาริช ทำราบ)

นายกสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

หมายเหตุ :

ตามความในประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สช/น. 1/2549 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดการกองทุน ลงวันที่ 7 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2549 (ประกาศสำนักงาน ก.ล.ต. ที่ สช/น. 1/2549) ส่วนที่ 5 การจัดทำรายงานของกองทุนรวม กำหนดให้บริษัทจัดการกองทุนรวมจัดทำรายงานการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวม ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีที่กำหนดในการจัดทำรายงานดังกล่าว ตามประกาศสำนักงานดังกล่าว หากปรากฏว่า บริษัทจัดการกองทุนรวมไม่สามารถลงทุน ให้เป็นไปตามสัดส่วนการลงทุนที่กำหนดไว้ในโครงการนั้น บริษัทจัดการกองทุนรวมยังสามารถ นำแบบรายงานและคำอธิบายประกอบการจัดทำแบบรายงานที่สมาคมเคยกำหนดตามประกาศ สมาคมบริษัทจัดการลงทุน ที่ สจก.ร. 3/2542 เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการในการจัดทำรายงาน การลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์ เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมประเภทต่างๆ ลงวันที่ 28 พฤษภาคม พ.ศ. 2542 มาพิจารณาใช้เพื่อจัดทำรายงานการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์ เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมได้ตามความเหมาะสม

คำอธิบายประกอบแบบ ร. 3/2542-1 แบบ ร.3/2542-2 และแบบ ร. 3/2542-3

1. ให้ส่งข้อมูลตามแบบรายงานพร้อมแผ่น diskette ในรูปแบบ Excel File
2. ชื่อกองทุนรวม : ชื่อเต็มภาษาไทย
ถ้าเป็นแบบ ร. 3/2542-2 และแบบ ร. 3/2542-3 ให้พิมพ์ทุกบรรทัด
3. ประเภทกองทุนรวม : CE หมายถึง กองทุนปิด
OE หมายถึง กองทุนเปิด
4. นโยบายการลงทุน : EQ หมายถึง ตราสารแห่งทุน
FF หมายถึง หน่วยลงทุน
WA หมายถึง ใบสำคัญแสดงสิทธิ
SE หมายถึง กลุ่มธุรกิจ
SF หมายถึง ตราสารแห่งหนี้ระยะสั้น
LF หมายถึง ตราสารแห่งหนี้ระยะยาว
5. รอบระยะเวลาบัญชี : format วันเริ่ม และวันสิ้นสุด เป็น d คคค bbbb
6. รอบระยะเวลาเฉลี่ย (เดือน) : ทศนิยม 2 ตำแหน่ง เศษของเดือนให้ใช้ 30 เป็นตัวหาร
7. อัตราส่วนการลงทุน (ทั้ง 3 แบบรายงาน) : ทศนิยม 2 ตำแหน่ง
8. วันที่ : format เป็น d คคค bbbb
9. อัตราส่วนการลงทุนในตราสารแห่งทุน (ที่กำหนดในโครงการที่ประกาศกำหนด) ในช่องสัญลักษณ์ :
 - < ในกรณีที่ระบุไว้ในโครงการหรือประกาศว่า “น้อยกว่า”
 - <= ในกรณีที่ระบุไว้ในโครงการหรือประกาศว่า “ไม่เกิน” หรือคำที่มีความหมายเทียบเท่า
 - >= ในกรณีที่ระบุไว้ในโครงการหรือประกาศว่า “ไม่น้อยกว่า” หรือคำที่มีความหมายเทียบเท่า
 - > ในกรณีที่ระบุไว้ในโครงการหรือประกาศว่า “มากกว่า”
10. พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชัน (portfolio duration) : ทศนิยม 2 ตำแหน่ง
11. พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชัน (portfolio duration) (ที่กำหนดในโครงการที่ประกาศกำหนด) ในช่องสัญลักษณ์ :
 - < ในกรณีที่ระบุไว้ในโครงการหรือประกาศว่า “น้อยกว่า”
 - <= ในกรณีที่ระบุไว้ในโครงการหรือประกาศว่า “ไม่เกิน” หรือคำที่มีความหมายเทียบเท่า
 - >= ในกรณีที่ระบุไว้ในโครงการหรือประกาศว่า “ไม่น้อยกว่า” หรือคำที่มีความหมายเทียบเท่า
 - > ในกรณีที่ระบุไว้ในโครงการหรือประกาศว่า “มากกว่า”
12. ในกรณีที่รายละเอียดของกองทุนแต่ละกองในบาง column ไม่สามารถแสดงในกระดาษได้หมด ให้สามารถแสดงหลายบรรทัดได้ แต่ใน diskette ขอให้แสดงรายละเอียดของกองทุนแต่ละกองในบรรทัดเดียวเท่านั้น

รายงานการลงทุนในหลักทรัพย์หรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์เพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวม
 ของกองทุนรวมตราสารหนี้ กองทุนรวมหน่วยลงทุน กองทุนรวมใบสำคัญแสดงสิทธิ และกองทุนรวมกลุ่มธุรกิจ
 บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม จำกัด
 สิ้นสุด ณ วันที่ เดือน พ.ศ.

| ชื่อกองทุนรวม | ประเภท กองทุนรวม | นโยบาย การลงทุน | รอบระยะเวลาบัญชี | | รอบระยะเวลา เฉลี่ย (เดือน) | อัตราส่วนการลงทุน (ร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม) | | เหตุผลกรณีไม่เป็นไปตามที่ กำหนดในโครงการ |
|---------------|---------------------|--------------------|------------------|------------|-------------------------------|--|--------------------|---|
| | | | วันเริ่ม | วันสิ้นสุด | | ที่กำหนด ในโครงการ | ที่ประกาศ กำหนด | |
| | | | | | | | | |

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตามความเป็นจริง
 (ผู้มีอำนาจลงนามผู้แทนบริษัท)
 ตำแหน่ง
 วันที่

ประทับตราบริษัท

รายงานการลงทุนในตราสารแห่งของกองทุนรวมผสม

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม จำกัด

ประจำเดือน พ.ศ.

| ชื่อกองทุนรวม | วันที่ | อัตราส่วนการลงทุนในตราสารแห่งทุน (ร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม) | | | | เหตุผลกรณีไม่เป็นไปตามที่กำหนดในโครงการ |
|---------------|--------|---|-----------|----------------|-----------|---|
| | | ที่กำหนดในโครงการ | | ที่ประกาศกำหนด | | |
| | | ต่ำสุด | สูงสุด | ต่ำสุด | สูงสุด | |
| | | สัญญาซื้อขายอัตราส่วน | อัตราส่วน | อัตราส่วน | อัตราส่วน | |

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตามความเป็นจริง
.....ผู้มีอำนาจลงนามผูกพันบริษัท

(.....)

ตำแหน่ง

วันที่

ประทับตราบริษัท

รายงานพอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น (portfolio duration)

ของกองทุนรวมตราสารแห่งระยะสั้น / กองทุนรวมตราสารแห่งระยะยาว

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม จำกัด

ประจำเดือน พ.ศ.

| ชื่อกองทุนรวม | วันที่ | ประเภท กองทุนรวม | นโยบาย การลงทุน | ขณะใดขณะหนึ่ง | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น (portfolio duration) (หน่วย : ปี) | | | ที่ประกาศกำหนด | เหตุผลกรณีไม่เป็นไปตามที่กำหนดในโครงการ |
|---------------|--------|---------------------|--------------------|---------------|--|----------------------|-----------|----------------------|---|
| | | | | | ที่กำหนดในโครงการ | | | | |
| | | | | | ต่ำสุด | สูงสุด | ดูเรชั่น | | |
| | | | | | สัญญาชั้น | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | สัญญาชั้น | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | |

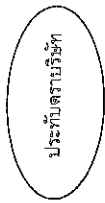
ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตามความเป็นจริง
ผู้มีอำนาจลงนามจากผู้บริหาร
 (.....)
 ตำแหน่ง
 วันที่

ประทับตราบริษัท

ตัวอย่าง
 รายงานการลงทุนในตราสารแห่งหุ้น
 บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม เอ จำกัด
 ประจำปีเดือน กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2542

| ชื่อกองทุนรวม | วันที่ | อัตราส่วนการลงทุนในตราสารแห่งหุ้น (ร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม) | | | | | | เหตุผลกรณีไม่เป็นไปตามที่กำหนดในโครงการ | | | | |
|----------------|--------------|--|--------|-----------|----------------|--------|-----------|---|-------|----|-------|---|
| | | ที่กำหนดในโครงการ | | | ที่ประกาศกำหนด | | | | | | | |
| | | ต่ำสุด | สูงสุด | อัตราส่วน | ต่ำสุด | สูงสุด | อัตราส่วน | | | | | |
| กองทุนเปิด กนก | 1 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 2 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 3 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 4 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 5 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 8 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 9 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 10 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 11 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 12 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 15 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 17 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 18 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 19 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 22 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 23 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 24 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 25 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |
| กองทุนเปิด กนก | 26 ก.พ. 2542 | >= | <= | 40.00 | 65.00 | >= | <= | 35.00 | 65.00 | <= | 65.00 | - |

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตามความเป็นจริง
 (ผู้รายงานผลงานผูกพันบริษัท)
 ตำแหน่ง
 วันที่



ตัวอย่าง

รายงานพอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น (portfolio duration)
ของกองทุนรวมตราสารหนี้ระยะสั้น
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม เอ จำกัด
ประจำเดือน กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2542

| ชื่อกองทุนรวม | วันที่ | ประเภท กองทุนรวม | นโยบาย การลงทุน | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น (portfolio duration) (หน่วย : ปี) | | | | | | เหตุผลกรณีไม่เป็นไปตามที่กำหนดในรายการ | | |
|---------------|--------------|---------------------|--------------------|--|--------|--------|----------------|--------|----------------------|--|------|---|
| | | | | ดูเรชั่น | | | ที่ประกาศกำหนด | | | | | |
| | | | | ชั้สุด | ต่ำสุด | สูงสุด | ชั้สุด | ต่ำสุด | สูงสุด | | | |
| กองทุนรวม ขชช | 1 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 2 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 3 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 4 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 5 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 8 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 9 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 10 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 11 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 12 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 15 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 17 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 18 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 19 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 22 ก.พ. 2542 | OE | SF | 1.00 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 23 ก.พ. 2542 | OE | SF | 0.75 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 24 ก.พ. 2542 | OE | SF | 0.75 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 25 ก.พ. 2542 | OE | SF | 0.75 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |
| กองทุนรวม ขชช | 26 ก.พ. 2542 | OE | SF | 0.75 | >= | 0.50 | <= | 1.00 | พอร์ตโฟลิโอ ดูเรชั่น | <= | 1.00 | - |

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตามความเป็นจริง

(ผู้มีอำนาจลงนามผู้แทนบริษัท)

ตำแหน่ง
วันที่

ประทับตราบริษัท