

ที่ สจก.ร. 021/2554

23 ธันวาคม 2554

เรียน กรรมการผู้จัดการ
บริษัทสมาชิกกลุ่มธุรกิจกองทุนรวม

เรื่อง ชักซ้อมความเข้าใจเกี่ยวกับประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุนที่ สจก.ร. 2/2554 เรื่อง
หลักเกณฑ์และวิธีการกำหนดมูลค่ายุติธรรมของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ
ที่ไปลงทุนไว้ เพื่อใช้ในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม ลงวันที่
22 ธันวาคม 2554

ด้วยสมาคมบริษัทจัดการลงทุน (สมาคม) ได้ออกประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุนที่
สจก.ร. 2/2554 เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการกำหนดมูลค่ายุติธรรมของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตรา
ต่างประเทศที่ไปลงทุนไว้ เพื่อใช้ในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม ลงวันที่
22 ธันวาคม 2554 (ประกาศสมาคมที่ สจก.ร. 2/2554) ดังนั้น เพื่อให้บริษัทสมาชิกกลุ่มธุรกิจกองทุน
รวม (บริษัทสมาชิก) มีความเข้าใจที่ตรงกันและถือปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ที่ประกาศกำหนดได้
อย่างถูกต้อง สมาคมจึงขอชักซ้อมความเข้าใจเกี่ยวกับประเด็นในประกาศและวิธีปฏิบัติ โดยมี
รายละเอียดดังนี้

จากหลักเกณฑ์ตามประกาศสมาคมที่ สจก.ร. 2/2554 ปัจจุบันจะมีแหล่งข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยน
เงินตราต่างประเทศ (อัตราแลกเปลี่ยน) ที่บริษัทสมาชิกสามารถนำข้อมูลมาใช้ในการประมาณมูลค่า
ยุติธรรมของกองทุนรวมเบื้องต้นอยู่ 3 แหล่ง ดังนี้

1. แหล่งข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนของธนาคารแห่งประเทศไทย

เนื่องจากข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนของธนาคารแห่งประเทศไทยนั้น มีข้อมูลทั้งที่เป็น
อัตราแลกเปลี่ยนระหว่างธนาคารพาณิชย์และอัตราแลกเปลี่ยนที่ธนาคารพาณิชย์ใช้ซื้อขายกับลูกค้า
อยู่รวมกันในหน้า web site บริษัทสมาชิกจึงต้องนำข้อมูลเฉพาะที่เป็น “อัตราแลกเปลี่ยนตัวเฉลี่ยถ่วง
น้ำหนักระหว่างธนาคาร” ณ สิ้นวันทำการหรือวันทำการซื้อขายแล้วแต่กรณีมาใช้เท่านั้น ซึ่งปัจจุบัน
จะมีข้อมูลสำหรับอัตราแลกเปลี่ยนของสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐอเมริกาเพียงสกุลเดียวเท่านั้น
(ตามตัวอย่างในเอกสารแนบ 1) ส่วนอัตราแลกเปลี่ยนของสกุลเงินอื่นๆ ไม่สามารถนำมาใช้ได้

../2

เนื่องจากไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศสมาคมที่ สจก.ร. 2/2554 คือ ไม่ได้เป็นอัตราแลกเปลี่ยนที่ซื้อขายกันระหว่างผู้ลงทุนสถาบัน

อย่างไรก็ดี หากบริษัทสมาชิกยังคงต้องการใช้การอ้างอิงข้อมูลของธนาคารแห่งประเทศไทย สำหรับกรณีอัตราแลกเปลี่ยนของสกุลเงินอื่นๆ ให้บริษัทสมาชิกสืบค้นและนำอัตราแลกเปลี่ยนสกุลเงินนั้นกับสกุลเงินดอลลาร์สหรัฐอเมริกาที่เผยแพร่จากธนาคารกลางของประเทศที่เป็นเจ้าของสกุลเงิน ณ สิ้นวันทำการหรือวันทำการซื้อขายแล้วแต่กรณี มาคำนวณแปลงค่ากับ “อัตราแลกเปลี่ยนถัวเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักระหว่างธนาคาร” สำหรับเงินสกุลดอลลาร์สหรัฐอเมริกาคือเงินสกุลบาทของธนาคารแห่งประเทศไทยอีกทอดหนึ่ง หรือเลือกใช้แหล่งข้อมูลที่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในประกาศสมาคมที่ สจก.ร. 2/2554 อื่นๆ

2. แหล่งข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนของ Reuters หรือ APEX (Reuters ภาาภาษาไทย)

บริษัทสมาชิกสามารถนำอัตราแลกเปลี่ยนจากหน้า fixing rate หรือ real time rate มาใช้ได้ (ตามตัวอย่างในเอกสารแนบ 2) แต่อัตราแลกเปลี่ยนดังกล่าวจะต้องเป็นอัตราแลกเปลี่ยนหลังจากเวลาปิดรับคำสั่งซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมนั้นแล้ว ทั้งนี้ เมื่อบริษัทสมาชิกเลือกใช้ข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนจากหน้าใดและ ณ เวลาใดแล้ว ควรจะใช้อัตราแลกเปลี่ยนในลักษณะนั้นอย่างสม่ำเสมอ

3. แหล่งข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนของ Bloomberg

บริษัทสมาชิกสามารถนำอัตราแลกเปลี่ยนจากหน้า BFIX rate หรือ real time rate มาใช้ได้ (ตามตัวอย่างในเอกสารแนบ 3) แต่อัตราแลกเปลี่ยนดังกล่าวจะต้องเป็นอัตราแลกเปลี่ยนหลังจากเวลาปิดรับคำสั่งซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมนั้นแล้ว ทั้งนี้ เมื่อบริษัทสมาชิกเลือกใช้ข้อมูลอัตราแลกเปลี่ยนจากหน้าใดและ ณ เวลาใดแล้ว ควรจะใช้อัตราแลกเปลี่ยนในลักษณะนั้นอย่างสม่ำเสมอ

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ
สมาคมบริษัทจัดการลงทุน



(นางวรรณ ชาราณมิ)

นายกสมาคมและประธานกลุ่มธุรกิจกองทุนรวม

ผู้จัดการบริการ [ขารี \(0-2283-5170\)](tel:0-2283-5170) [อัมขลิ \(0-2356-7329\)](tel:0-2356-7329)

อัตราแลกเปลี่ยนประจำวัน

อัตราแลกเปลี่ยนเฉลี่ยของธนาคารพาณิชย์ (เลือกช่วงเวลา : เดือน ไตรมาส ปี)
อัตราแลกเปลี่ยนประจำวันย้อนหลัง ปี 2541 - 2542 (PDF)รพท. เพิ่มช่องทางเผยแพร่อัตราแลกเปลี่ยนประจำวันล่าสุด
www.thaifxrates.netดาวน์โหลด     RSS Feedวันที่ 7 มิ.ย. 2554 

(ข้อมูลย้อนหลังตั้งแต่ 4 มกราคม 2543 เป็นต้นไป)

ถ้าต้องการข้อมูลย้อนหลังโดยระบุสกุลเงิน โปรด Click ที่นี่

อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ ประจำวันที่ 7 มิถุนายน 2554

อัตราแลกเปลี่ยนกัวเจิลยี่ต่งนำหน้ากระหว่างธนาคาร = 30.300 บาท ต่อ 1 ดอลลาร์ สหรัฐ.

1. อัตราแลกเปลี่ยนกัวเจิลยี่ต่งนำหน้ากระหว่างธนาคารพาณิชย์ใช้ซื้อขายกับลูกค้า

(บาท ต่อ 1 หน่วยเงินตราต่างประเทศ)

ประเทศ	สกุลเงิน	อัตราซื้อกัวเจิลยี่ต่งนำหน้า		อัตราขายกัวเจิลยี่ต่งนำหน้า
		ตัวเงิน	ทางโทรเลข	
สหรัฐอเมริกา	USD	30.0660	30.1646	30.4472
สหราชอาณาจักร	GBP	49.0247	49.1887	49.9077
ยูโรโซน	EUR	43.7686	43.9094	44.5502
ญี่ปุ่น (ต่อ 100 เยน)	JPY	37.2949	37.4084	38.1570
ฮ่องกง	HKD	3.8506	3.8661	3.9258
มาเลเซีย	MYR	9.8665	9.9234	10.2123
สิงคโปร์	SGD	24.2928	24.3726	24.8631
บรูไนดารุสซาลาม	BND	23.9100	24.3037	24.9362
ฟิลิปปินส์	PHP	0.6780	0.6911	0.7130
อินโดนีเซีย (ต่อ 1000 รูเปีย)	IDR	3.2004	3.2950	3.8494
อินเดีย	INR	0.6018	0.6190	0.7270
สวิตเซอร์แลนด์	CHF	35.8488	35.9528	36.6236
ออสเตรเลีย	AUD	32.0668	32.1749	32.7614
นิวซีแลนด์	NZD	24.4148	24.4957	24.9918
ปากีสถาน	PKR	0.3413	0.3430	0.3635
แคนาดา	CAD	30.5702	30.6698	31.2119
สวีเดน	SEK	4.8443	4.8622	4.9525
เดนมาร์ก	DKK	5.8639	5.8836	5.9842
นอร์เวย์	NOK	5.5754	5.5949	5.6903
จีน	CNY	4.5816	4.6124	4.7633

2. อัตราในตลาดต่างประเทศ (ทอมสันรอยเตอร์) จำนวนผ่านอัตราซื้อขายเงินดอลลาร์ สหรัฐ. ในตลาดกรุงเทพฯ

เม็กซิโก	MXN	2.5676	2.5917
แอฟริกาใต้	ZAR	4.4475	4.4891
เกาหลีใต้	KRW	0.0279	0.0282
ไต้หวัน	TWD	1.0534	1.0633
คูเวต	KWD	109.9694	110.9996

ซาอุดีอาระเบีย	SAR	8.0437	8.1190
สหรัฐอาหรับเอมิเรตส์	AED	8.2125	8.2895
พม่า	MMK	4.6876	4.7315
บังกลาเทศ	BDT	0.4087	0.4126
สาธารณรัฐเช็ก	CZK	1.8093	1.8262
กัมพูชา	KHR	0.0074	0.0074
เคนยา	KES	0.3467	0.3500
ลาว	LAK	0.0038	0.0038
รัสเซีย	RUB	1.0828	1.0929
เวียดนาม	VND	0.0015	0.0015
อียิปต์	EGP	5.0774	5.1249
โปแลนด์	PLN	11.1022	11.2062
ศรีลังกา	LKR	0.2753	0.2779
อิรัก	IQD	0.0258	0.0261
บาห์เรน	BHD	80.0122	80.7618
โอมาน	OMR	78.3496	79.0836
จอร์แดน	JOD	42.5513	42.9499
กาตาร์	QAR	8.2847	8.3623
มัลดีฟส์	MVR	1.9638	1.9822
เนปาล	NPR	0.4212	0.4252
ปาปัวนิวกินี	PGK	13.0009	13.1227
อิสราเอล	ILS	8.9295	9.0131
ฮังการี	HUF	0.1653	0.1668

คำถามถามบ่อย

หมายเหตุ : ธนาคารแห่งประเทศไทย เผยแพร่ข้อมูลเพิ่มเติม 11 สกุลเงิน ได้แก่ LKR ถึง HUF ตั้งแต่วันที่ 2 มีนาคม 2553 เป็นต้นไป
(รายละเอียดโปรดดูจาก คำถามถามบ่อย)

ทรัพย์สินของกองทุนที่เป็นสกุลเงินต่างประเทศ

AUD THB	APEX code
EUR THB	RTXADTB
GBP THB	RTXEUTB
HKD THB	RTXUKTB
JPY THB	RTXHKTb
NZD THB	RTXJYTB
SGD THB	RTXNZTB
USD THB	RTXSDTB
	RTXUSTBT

KRW USD	THB	USD	THB	KRW USD	RTXUSKW
CNY USD	THB	USD	THB	CNY USD	RTXUSCY

หน้าจอ Fixing แบบที่ 1 ของ Reuters ผ่าน APEX

APEX Page 11489

THB Ref Rate		Average		Sibor (USD)		Daycount	
Symbol	Rate	Rate	Rate	Rate	Rate	Rate	Rate
TBOWFIX	2.73761b	0.2150	0.13900b	0.16000b	0.20009b	6.2700	0.20009b
TBTNFIX	2.60997b	0.6080	0.16000b	0.17389b	0.20009b	6.2700	0.20009b
TBSWFIX	2.50132b	1.5400	0.17389b	0.20009b	0.20009b	6.2700	0.20009b
TB1MFIx	2.64507b					6.2700	0.20009b

REUTERS File Edit View Insert Format Tools Object Window Help Controll

Back

↑ Q THBFX-TH

Home daily:summary swap Untitled1

Data Store x Flex 1 Flex 2

THBFX-TH

↑ Q THBFX-TH

THBFX=TH	SPAT	2M	3M	6M	9M	1Y	Value	THBFX Date
THB REF RATE		2.63729	2.73332	3.03770	3.19095	3.37346		19MAY11
AVERAGE	30, 2214	12.50	19.14	39.45	59.33	79.03		19MAY11
SIBOR_USD		0.23667	0.25528	0.31694	0.37528	0.44761		19MAY11
DAYCOUNT		63	92	184	276	366		19MAY11

Two selected the item Display Object named Item Display 1.

4:01 PM NUM REUTER

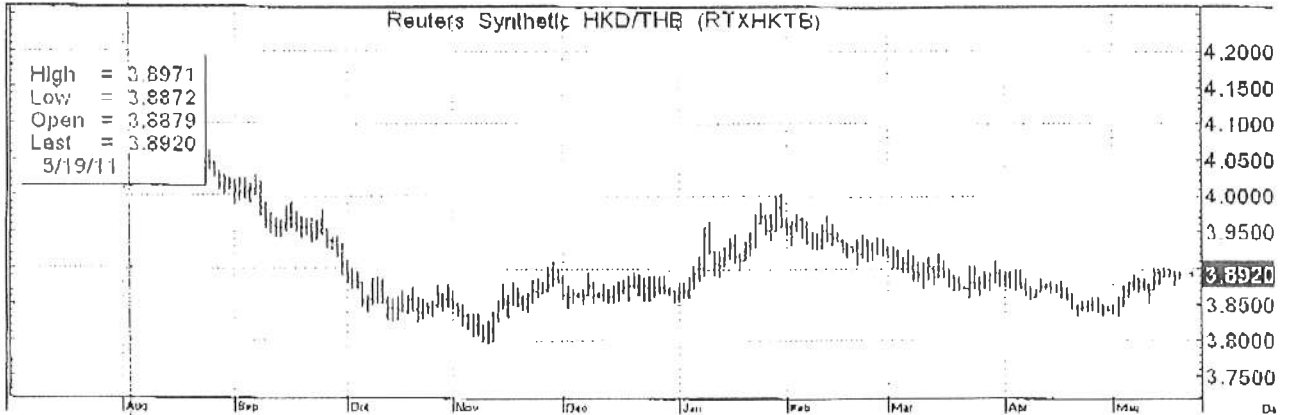
Reuters 3000 Xtra - [...]

หน้าจอ Realtime แบบที่ 1 ของ Reuters

APEX บัญชี N

RTXHKT6: Reuters Synthetic HKD/THB Time & Sales

BATSV	3/19/11		
14:20	3.8886b:1	3.8929a:1	
14:30	3.8872b:1	3.8920a:1	
14:40	3.8897b:1	3.8915a:1	
14:50	3.8897b:1	3.8953a:1	
15:00	3.8907b:1	3.8951a:1	
15:10	3.8896b:1	3.8950a:1	
15:20	3.8936b:1	3.8949a:1	
15:30	3.8882b:1	3.8951a:1	
15:40	3.8889b:1	3.8938a:1	
15:50	3.8909b:1	3.8965a:1	
16:00	3.8920b:1	3.8977a:1	



Apex © 2011 Bisnews AFE (Thailand) Limited. All Rights Reserved.

หน้าจอ Fixing แบบที่ 3 ของ Reuters

THB FIX=TH	THAI BARRIBLINDINGS RATE FIXING - THAM						THB FIX	
	SPOT	2M	3M	6M	9M	1Y	Value	Date
THB REF RATE		2.63729	2.78332	3.01770	3.19095	3.37946		19MAY11
AVERAGE	30.2214	12.50	19.14	39.45	59.33	79.03		19MAY11
SIBOR_USD		0.23667	0.26528	0.41694	0.57528	0.74161		19MAY11
DAYCOUNT		63	92	184	276	366		19MAY11

<HELP> for explanation. BFIX Msg:J.Krissanap
 At 16:00 Op 30.28 Hi 30.43 Lo 30.28 Close 30.29 Value 5/25/11

USDTHB TermSpot Bloomberg Fixings

USD/THB Fixings Mid Bid/Ask 05/23/2011 16:24:27 Local

Time	Mid	Time	Mid	Time	Mid	Time	Mid
1)00:00	--	13)06:00	30.29	25)12:00	30.38	37)18:00	
2)00:30	--	14)06:30	30.30	26)12:30	30.38	38)18:30	
3)01:00	--	15)07:00	30.30	27)13:00	30.41	39)19:00	
4)01:30	--	16)07:30	30.29	28)13:30	30.41	40)19:30	
5)02:00	--	17)08:00	30.31	29)14:00	30.43	41)20:00	
6)02:30	--	18)08:30	30.37	30)14:30	30.40	42)20:30	
7)03:00	--	19)09:00	30.39	31)15:00	30.40	43)21:00	
8)03:30	--	20)09:30	30.41	32)15:30	30.40	44)21:30	
9)04:00	--	21)10:00	30.39	33)16:00	30.42	45)22:00	
10)04:30	--	22)10:30	30.42	34)16:30		46)22:30	
11)05:00	30.29	23)11:00	30.37	35)17:00		47)23:00	
12)05:30	30.29	24)11:30	30.38	36)17:30		48)23:30	

Australia 61 2 9777 8600 Brazil 5511 3048 4500 Europe 44 20 7330 7500 Germany 49 69 9204 1210 Hong Kong 852 2977 6000
 Japan 81 3 3201 8900 Singapore 65 6212 1000 U.S. 1 212 318 2000 Copyright 2011 Bloomberg Finance L.P.
 SN 192663 GMT+7:00 G671-1156-3 23-May-2011 16:24:27

GRAB

Index FXC

90<GO> Make this my default view, XDF<GO> to set default pricing source

2) Currency Group - Key Cross Currency Rates - User Defined Monitor Fixings Source BFIX

05/24/11 Rate Spot as of 17:00 Bloomberg Fixings

	 USD	 EUR	 JPY	 GBP	 CHF	 CAD	 AUD	 NZD	 HKD	 KRW	 THB
THB	30.390	42.871	37.115		34.511		32.119	24.254	3.9080	.02780	-
KRW	1093.4	1538.3	13.360	1762.0					140.59	-	35.967
HKD	7.7763	10.970	9.4972	12.546	8.8307	7.9649	8.2188	6.2063	-	.00711	.25588
NZD	1.2530	1.7676	.01530	2.0216	1.4229	1.2834	1.3243	-	.16113		
AUD	.94616	1.3348	1.1555	1.5265	1.0745	.96911	-	.75513	.12167		3.1134
CAD	.97630	1.3773	1.1924	1.5752	1.1087	-	1.0319	.77920	.12555		
CHF	.88060	1.2423	1.0755	1.4208	-	.90196	.93071	.70281	11.324		2.8977
GBP	.61981	.87436	.75697	-	.70385	.63484	.65508	.49467	.07970	.56754	
JPY	81.880	115.51	-	132.11	92.982	83.866	86.539	65.348	10.529		2.6943
EUR	.70887	-	.86574	1.1437	.80498	.72606	.74920	.56575	.09116	.65007	.02333
USD	-	1.4107	.01221	1.6134	1.1356	1.0243	1.0569	.79810	.12860	.09146	.03291

x100

หน้า Fixing วันที่ 2 ของ Bloomberg

Gray means no fixing for the displayed time. Latest fixings shown.

Australia 61 2 9777 8600 Brazil 5511 3048 4500 Europe 44 20 7330 7500 Germany 49 69 9204 1210 Hong Kong 852 2977 6000
 Japan 81 3 3201 8900 Singapore 65 6212 1000 U.S. 1 212 318 2000
 Copyright 2011 Bloomberg Finance L.P.
 SH 652763 6732-742-1 24-May-11 17:21:58

GRAB

Index FXC

90<GO> Make this my default view, XDF<GO> to set default pricing source

2) Currency Group Rate Spot Monitor Last Price Key Cross Currency Rates - User Defined Source **BGMT**

05/24/11 Bloomberg BGN(Tokyo)

	USD	EUR	JPY	GBP	CHF	CAD	AUD	NZD	HKD	KRW	THB
THB	30.415	42.829	37154	49.039	34.525	31.139	32.111	24.253	3.9111	2.7817	-
KRW	1093.4	1539.7	13.357	1762.9	1241.2	1119.2	1154.4	871.89	140.60	-	35.950
HKD	7.7765	10.950	09500	12.538	8.8275	7.9601	8.2101	6.2010	-	7.1121	25568
NZD	1.2541	1.7659	01532	2.0220	1.4236	1.2837	1.3240	-	16126	11469	04123
AUD	94719	13338	01157	1.5272	1.0752	96956	-	75529	12180	08663	03114
CAD	97693	13757	01193	1.5751	1.1090	-	1.0314	77900	12563	08935	03212
CHF	88094	1.2405	01076	1.4204	-	90175	93006	70247	11328	08057	02896
GBP	62022	87337	00758	-	70404	63487	65480	49457	07976	05672	02039
JPY	81.861	115.27	-	131.99	92.924	83.794	86.425	65.276	10.527	7.4867	26915
EUR	71015	-	00868	1.1450	80612	72692	74975	56628	09132	06495	02385
USD	-	1.4081	01222	1.6123	1.1351	1.0236	1.0558	79740	1.2859	09146	03288
											x100

Color

Increased

Unchanged

Decreased

Realtime Bloomberg