

# เอกสารอ้างอิง

## ภาษาไทย

ชวลิต ธนะชานันท์ 2536. ธุรกิจกองทุนรวมในประเทศไทย บทบาทและผลประโยชน์  
ต่อเศรษฐกิจไทย. ใน Chulalongkorn Review 18 : 31-59

ปราณี เล็กศรีสกุล. 2538. พฤติกรรมการกระจายการลงทุนของธุรกิจกองทุนรวม .  
สำนักวิจัยและพัฒนาตลาดทุน สำนักงานคณะกรรมการหลักทรัพย์  
และตลาดหลักทรัพย์

พัชรภากรณ์ คงเจริญ. 2535. หน่วยลงทุนในประเทศไทย อัตราผลตอบแทน ความเสี่ยงและ  
กลยุทธ์การลงทุน. วิทยานิพนธ์ปริญญาโทมหาบัณฑิต คณะเศรษฐศาสตร์  
บัณฑิตวิทยาลัย จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

วรางคณา บุญเทียม. 2540. การศึกษาพฤติกรรมทางเลือกลงทุนของกองทุนรวมในประเทศ  
ไทย. วิทยานิพนธ์ปริญญาโทมหาบัณฑิต สาขาเศรษฐศาสตร์ธุรกิจ  
บัณฑิตวิทยาลัย มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์.

สมาคมบริษัทจัดการลงทุน. 2539. เอกสารประกอบการอบรม โครงการอบรมด้านกฎหมาย  
และจรรยาบรรณของผู้จัดการกองทุน .

สุวรรณะ สมสวัสดิ์. 2538. บทบาทกองทุนรวมต่อการพัฒนาตลาดทุนในปี พ.ศ.2537  
และ 2538. วิทยานิพนธ์ปริญญาโทมหาบัณฑิต สาขารัฐประศาสนศาสตร์  
บัณฑิตวิทยาลัย จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย.

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์. 2535. พระราชบัญญัติหลัก  
ทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ.2535 . (ม.ป.ท.)

## ภาษาอังกฤษ

Chawin Leenabanchong. Mutual Fund Performance in Thailand .

Faculty of Economics, Thammasat University ( n.p. , n.d. )

Fletcher, M. 1996. Whom To Trust?. Asiaweek Sept 96 : 51-530.

Kreps, D. 1990. A Course in Microeconomic Theory . Cambridge  
: University Press.

Levy, H. and Sarnet, M., 1984. Portfolio and Investment Selection : Theory and Practice.  
Cambridge : Prentice Hall.

Oertmann, P. and Zimmermann, H. 1996. U.S. Mutual Fund Characteristics Across the  
Investment Spectrum. The Journal of Investing Fall : 56-67

Taylor, Walton R.L. and Yoder, J.A. 1994. Mutual Fund Trading Activity and Investor  
Utility. Financial Analysts Journal May-June : 66-69

Varian, Hal R. 1992. Microeconomic Analysis . New York : W.W.Norton&Company

สถาบันวิทยบริการ  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

## ภาคผนวก ก

### กฎระเบียบที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจกองทุนรวม

- ประกาศสำนักงานคณะกรรมการหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ ก.ล.ต.(ว) 10/2538 เรื่อง การขอข้อมูลการลงทุนของกองทุนรวม
- แบบ บลจ. 1 ถึง 6
- ประกาศสำนักงานคณะกรรมการหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ ก.ล.ต.(ว) 26/2538 เรื่อง ชักข้อมความเข้าใจเกี่ยวกับการรายงานการลงทุนในหรือมีไว้ซึ่งหลักทรัพย์ของกองทุนรวมเกิน อัตราส่วนที่กฎหมายกำหนด



สถาบันวิทยบริการ  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

31 พฤษภาคม 2538

เรียน กรรมการผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวมทุกบริษัท

ที่ กสท.ก.(ว) 10 /2538 เรื่อง การขอข้อมูลการลงทุนของกองทุนรวม

เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลการดำเนินงานของบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม  
สำนักงานใคร่ขอความร่วมมือจากบริษัทท่านในการจัดทำรายงานดังต่อไปนี้ส่งให้สำนักงาน

1. รายงานการลงทุนในหลักทรัพย์ของกองทุนรวม
2. รายงานมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม
3. รายงานอัตราส่วนค่านายหน้าและอัตรากาไรหมุนเวียนในการซื้อขายหลักทรัพย์

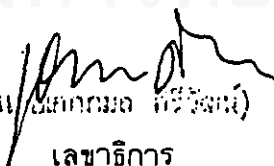
ต่อมูลค่าทรัพย์สินสุทธิโดยเฉลี่ย

4. รายงานการขายและการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนเปิด
5. รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์ระหว่างกองทุนรวม
6. รายงานการจ่ายเงินปันผล

ทั้งนี้ ขอให้บริษัทท่านจัดส่งรายงานพร้อม Diskette ให้ฝ่ายกำกับตลาดทุน พร้อมทั้ง  
จัดส่งสำเนาของรายงานดังกล่าวให้ฝ่ายตรวจสอบตลาดทุนของสำนักงานภายในวันที่ 15 ของเดือน  
ถัดไป โดยให้จัดทำข้อมูลเริ่มตั้งแต่เดือนมิถุนายน 2538 เป็นต้นไป

จึงเรียนมาเพื่อทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

  
(นายสมภพ กวีรัตน์)  
เลขาธิการ

สิ่งที่ส่งมาด้วย แบบ บลจ. 1-6 พร้อมรูปแบบตารางข้อมูลใน Diskette

ฝ่ายกำกับตลาดทุน

โทร. 2523223 ต่อ 1234

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ..... จำกัด

รายงานการลงทุนในหลักทรัพย์ของกองทุนรวม ..... กองทุน

ณ วันที่ (วันสิ้นเดือน) .....

	จำนวนหุ้น ยกมา	ซื้อ		ขาย		คงเหลือ		จำนวนหุ้นที่จำหน่าย ได้แล้วทั้งหมดของ แต่ละบริษัท (C) (หุ้น)	ร้อยละของจำนวนหุ้น ที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ของแต่ละบริษัท [A x 100] / C (%)	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สิน [(B x 100) / E (%)
		จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า (พันบาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า (พันบาท)	จำนวนหุ้น (A) (หุ้น)	ตามราคาตลาด (B) (พันบาท)			
<b>1. เงินลงทุนในหลักทรัพย์</b>										
1.1 หลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาด หุ้นสามัญ										
- กลุ่ม .....										
.....										
.....										
รวมกลุ่ม .....										
- กลุ่ม .....										
.....										
.....										
รวมกลุ่ม .....										
รวมหุ้นสามัญ										
ใบสำคัญแสดงสิทธิ										
.....										
.....										
รวมใบสำคัญแสดงสิทธิ										
หุ้นบริษัทรื										
.....										
.....										



บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ..... จำกัด  
 รายงานการกองทุนในหลักทรัพย์ของกองทุนรวม ..... กองทุน  
 ณ วันที่ (วันสิ้นเดือน) .....

	จำนวนหุ้น ออกมา	ซื้อ		ขาย		คงเหลือ		จำนวนหุ้นที่จำหน่าย ได้แล้วทั้งหมดของ แต่ละบริษัท (C) (หุ้น)	ร้อยละของจำนวนหุ้น ที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ของแต่ละบริษัท [A x 100] / C (%)	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สิน [(B x 100) / I (%)
		จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า (พันบาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า (พันบาท)	จำนวนหุ้น (A) (หุ้น)	ตามราคาตลาด (B) (พันบาท)			
ใบสำคัญแสดงสิทธิ ..... .....										
รวมใบสำคัญแสดงสิทธิ										
หุ้นบุริมสิทธิ ..... .....										
รวมหุ้นบุริมสิทธิ										
หุ้นกู้ ..... .....										
รวมหุ้นกู้										
พันธบัตร ..... .....										
รวมพันธบัตร										
หน่วยลงทุน ..... .....										

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ..... จำกัด

รายงานการกองทุนในหลักทรัพย์ของกองทุนรวม ..... กองทุน

ณ วันที่ (วันถึงเดือน) .....

	จำนวนหุ้น ยกมา	ซื้อ		ขาย		คงเหลือ		จำนวนหุ้นที่จำหน่าย ได้แล้วทั้งหมดของ แต่ละบริษัท (C) (หุ้น)	ร้อยละของจำนวนหุ้น ที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมด ของแต่ละบริษัท [A x 100] / C (%)	ร้อยละของ มูลค่าทรัพย์สิน [(B x 100) / (%)
		จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า (พันบาท)	จำนวนหุ้น (หุ้น)	มูลค่า (พันบาท)	จำนวนหุ้น (A) (หุ้น)	ตามราคาตลาด (B) (พันบาท)			
รวมหน่วยลงทุน										
รวมหลักทรัพย์นอกตลาด										
รวมเงินลงทุนในหลักทรัพย์										
2. เงินฝากธนาคาร ตั๋วสัญญาใช้เงิน และตั๋วแลกเงิน										
3. สินทรัพย์อื่นๆ										
4. หนี้สินอื่น										
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิทั้งสิ้น							D			100

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

ประทับตราบริษัท

..... เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจลงนาม

( )

ตำแหน่ง .....

วันที่ .....

สถาบันวิทยบริการ  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย



## คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงาน

### แบบ มดจ 1 รายงานการลงทุนในหลักทรัพย์ของกองทุนรวม

1.1 ให้ บลจ. จัดทำรายงานแสดงการลงทุนในหลักทรัพย์ของกองทุนรวมทุกกองทุนโดยรวมการซื้อขายระหว่างกองทุนรวมด้วย ภายใต้การบริหารของบริษัท ณ วันสิ้นเดือน

1.2 เงินลงทุนในหลักทรัพย์ให้แสดงรายละเอียดรายหลักทรัพย์ที่ลงทุน โดยจัดแบ่งกลุ่มตามรายงาน

1.3 ชื่อหลักทรัพย์

- ในกรณีที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อย่อภาษาอังกฤษ

- ในกรณีที่ไม่ได้เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อเต็มภาษาอังกฤษ

1.4 มูลค่าซื้อ ให้รวมค่านายหน้าด้วย และมูลค่าขาย ให้ลบค่านายหน้าออกด้วย

จำนวนหุ้น ไม่ต้องแสดงทศนิยม

มูลค่าตามราคาตลาด ให้แสดงทศนิยม 2 ตำแหน่ง

ร้อยละ ให้แสดงทศนิยม 2 ตำแหน่ง

1.5 หนี้สินอื่น รวมถึง ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย ได้แก่ เงินปันผลค้างจ่าย, ค่าซื้อหลักทรัพย์ค้างจ่าย

1.6 ร้อยละของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของแต่ละบริษัท

$$= \frac{\text{จำนวนหุ้นคงเหลือ} \times 100}{\text{จำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของแต่ละบริษัท}}$$

$$= \frac{\text{จำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของแต่ละบริษัท}}{\text{จำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของแต่ละบริษัท}} \times 100$$

1.7 ร้อยละของมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ =  $\frac{\text{มูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด} \times 100}{\text{มูลค่าทรัพย์สินสุทธิทั้งสิ้น}}$

1.8 ในกรณีของหลักทรัพย์ที่ซื้อขายในศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ให้แสดงรายการค่างาการค้าของหลักทรัพย์จดทะเบียน โดยแยกเป็นรายกลุ่ม (ถ้ามี)

สถาบันวิทยบริการ  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม \_\_\_\_\_ จำกัด

รายงานมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม

๗ วันที่ (วันสิ้นเดือน) \_\_\_\_\_

หน่วย : ล้านบาท

กองทุนรวมที่มีนโยบายการลงทุนในตราสารทุน

ชื่อกองทุนรวม	มูลค่าทรัพย์สิน					หนี้สินอื่น	มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	มูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วย (บาท)		ราคาปิด (บาทต่อหน่วย)	
	หลักทรัพ์จดทะเบียน	หลักทรัพ์อื่น	เงินฝากธนาคารและคำสัญญาไ้เงิน	สินทรัพ์อื่น	รวม			๗ วันสิ้นสุดวันแล้ว	๗ วันสิ้นสุดวันนี้	๗ วันสิ้นสุดวันแล้ว	๗ วันสิ้นสุดวันนี้
รวม											

กองทุนรวมที่มีนโยบายการลงทุนในตราสารหนี้

หน่วย : ล้านบาท

ชื่อกองทุนรวม	มูลค่าทรัพย์สิน					หนี้สินอื่น	มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	มูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วย (บาท)		ราคาปิด (บาทต่อหน่วย)	
	พันธบัตร	หุ้นกู้	เงินฝากธนาคารและคำสัญญาไ้เงิน	สินทรัพ์อื่น	รวม			๗ วันสิ้นสุดวันแล้ว	๗ วันสิ้นสุดวันนี้	๗ วันสิ้นสุดวันแล้ว	๗ วันสิ้นสุดวันนี้
รวม											

กองทุนรวมที่มีนโยบายการลงทุนแบบผสม

หน่วย : ล้านบาท

ชื่อกองทุนรวม	มูลค่าทรัพย์สิน					หนี้สินอื่น	มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	มูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วย (บาท)		ราคาปิด (บาทต่อหน่วย)	
	ตราสารหนี้	ตราสารทุน	เงินฝากธนาคารและคำสัญญาไ้เงิน	สินทรัพ์อื่น	รวม			๗ วันสิ้นสุดวันแล้ว	๗ วันสิ้นสุดวันนี้	๗ วันสิ้นสุดวันแล้ว	๗ วันสิ้นสุดวันนี้
รวมทั้งสิ้น											

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนและเป็นจริง



..... ตำแหน่งที่ปรึกษา/ผู้อำนวยการ

( )

ตำแหน่ง .....

วันที่ .....

## คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงาน

แบบ บลจ\_2 รายงานมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม

- 2.1 ให้ บลจ. จัดทำรายงานแสดงรายละเอียดในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม ทุกกองทุนรวม ภายใต้การบริหารของบริษัท ณ วันสิ้นเดือน
- 2.2 ชื่อหลักทรัพย์ และชื่อกองทุนรวม
  - ในกรณีที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อย่อภาษาอังกฤษ
  - ในกรณีที่มิได้เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อเต็มภาษาอังกฤษ
- 2.3 แยกการรายงานตามประเภทของนโยบายการลงทุนของกองทุนรวม เช่น ลงทุนในตราสารทุน ลงทุนในตราสารหนี้ และลงทุนแบบผสม
- 2.4 ราคาปิด
  - ในกรณีที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ หมายถึง ราคาปิด
  - ในกรณีที่เป็นกองทุนปิด และมิได้จดทะเบียนในตลาดฯ หมายถึง ราคาที่ทำการซื้อขายครั้งสุดท้าย
  - ในกรณีที่เป็นกองทุนเปิด หมายถึง ราคารับซื้อคืนหน่วยลงทุน
- 2.5 มูลค่าทรัพย์สิน หนี้สินอื่น และมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ให้แสดงทศนิยม 2 ตำแหน่ง  
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิต่อหน่วย และราคาปิด ให้แสดงทศนิยม 2 ตำแหน่ง
- 2.6 ในกรณีของหลักทรัพย์ที่ซื้อขายในศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ให้รวมอยู่ในหลักทรัพย์อื่น

สถาบันวิทยบริการ  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ..... จำกัด  
 รายงานการวัดมูลค่าทรัพย์สิน และอัตราผลตอบแทนในการซื้อขายหลักทรัพย์ ต่อ มูลค่าทรัพย์สินสุทธิโดยเฉลี่ย  
 ประจำเดือน.....

ชื่อกองทุนรวม	ประเภทกองทุน CE = กองทุนเปิด OE = กองทุนปิด	นโยบายการลงทุน EQ = ตลาดหุ้น FI = ตลาดพันธบัตร BL = หนี้	มูลค่าซื้อ/ขาย (ล้านบาท)			มูลค่าขายหน้า (ล้านบาท)			มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (ล้านบาท)			อัตราผลตอบแทนในการซื้อขายหลักทรัพย์ต่อมูลค่าทรัพย์สินสุทธิโดยเฉลี่ย (ร้อยละ) (C ± 100) / I	คำนวณหน้าภาษีซื้อขายต่อมูลค่าทรัพย์สินสุทธิโดยเฉลี่ย (ร้อยละ) (F ± 100) / I
			มูลค่าซื้อหลักทรัพย์ A	มูลค่าขายหลักทรัพย์ B	มูลค่าซื้อหรือขยที่ต่ำกว่า C = A or B	ซื้อหลักทรัพย์ D	ขายหลักทรัพย์ E	รวมซื้อ+ขาย F = D + E	๗ วัน สิ้นเดือนที่แล้ว G	๗ วัน สิ้นเดือนนี้ H	เฉลี่ย I = (G + H) / 2		
รวม													

สถาบันวิทยบริการ  
 จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

ประทับตราบริษัท

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง  
 \_\_\_\_\_ เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจของบพ  
 ( \_\_\_\_\_ )  
 ตำแหน่ง \_\_\_\_\_  
 วันที่ \_\_\_\_\_

## คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงาน

แบบ.บดจ.๓ รายงานอัตราส่วนค่าขายหน้า และอัตราส่วนการหมุนเวียนในการซื้อขายหลักทรัพย์ ต่อ มูลค่าหลักทรัพย์สิทธิโดยเฉลี่ย

3.1 ให้ บดจ. จัดทำรายงานแสดงอัตราส่วนค่าขายหน้า และอัตราส่วนการหมุนเวียนในการซื้อขายหลักทรัพย์ ต่อมูลค่าหลักทรัพย์สิทธิโดยเฉลี่ย ของกองทุนรวมรายกองทุน เป็นรายเดือน ณ วันสิ้นเดือนโดยรวมการซื้อขายระหว่างกองทุนรวมด้วย

3.2 อัตราส่วนค่าขายหน้าจากการซื้อขาย ต่อ มูลค่าหลักทรัพย์สิทธิโดยเฉลี่ย

$$= \frac{\text{ค่าขายหน้าจากการซื้อขาย}}{\text{มูลค่าหลักทรัพย์สิทธิโดยเฉลี่ย}} \quad \text{ให้แสดงทศนิยม 2 ตำแหน่ง}$$

3.3 อัตราการหมุนเวียนในการซื้อขายหลักทรัพย์ ต่อ มูลค่าหลักทรัพย์สิทธิโดยเฉลี่ย

$$= \frac{\text{ค่าที่ต่ำกว่าระหว่างมูลค่าซื้อหรือขาย}}{\text{มูลค่าหลักทรัพย์สิทธิโดยเฉลี่ย}} \quad \text{ให้แสดงทศนิยม 2 ตำแหน่ง}$$

3.4 เรียงลำดับกองทุนรวมตามประเภท และนโยบายการลงทุนดังนี้

- กองทุนปิด      นโยบายลงทุนในตราสารทุน  
                          นโยบายลงทุนในตราสารหนี้  
                          นโยบายลงทุนแบบผสม
- กองทุนเปิด    นโยบายลงทุนในตราสารทุน  
                          นโยบายลงทุนในตราสารหนี้  
                          นโยบายลงทุนแบบผสม

3.5 ชื่อกองทุนรวม

- ในกรณีที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อย่อภาษาอังกฤษ
- ในกรณีที่ไม่ได้เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อเต็มภาษาอังกฤษ

สถาบันวิทยบริการ  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ..... จำกัด  
 รายงานการขายและการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนเปิด  
 ประจำเดือน .....

ชื่อกองทุนรวม	นโยบายการลงทุน EQ = คราสารทุน FI = คราสารหนี้ BL = ผสม	มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันสิ้นเดือนที่แล้ว (บาท)	มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ ณ วันสิ้นเดือนนี้ (บาท)	มูลค่าขาย หน่วยลงทุน (บาท)	มูลค่ารับซื้อคืน หน่วยลงทุน (บาท)	มูลค่าขาย (รับซื้อคืน) สุทธิ (บาท)
รวม						

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง -

ประทับตราบริษัท

..... เจ้าหน้าที่ผู้ยื่นอำนาจลงนาม

( )

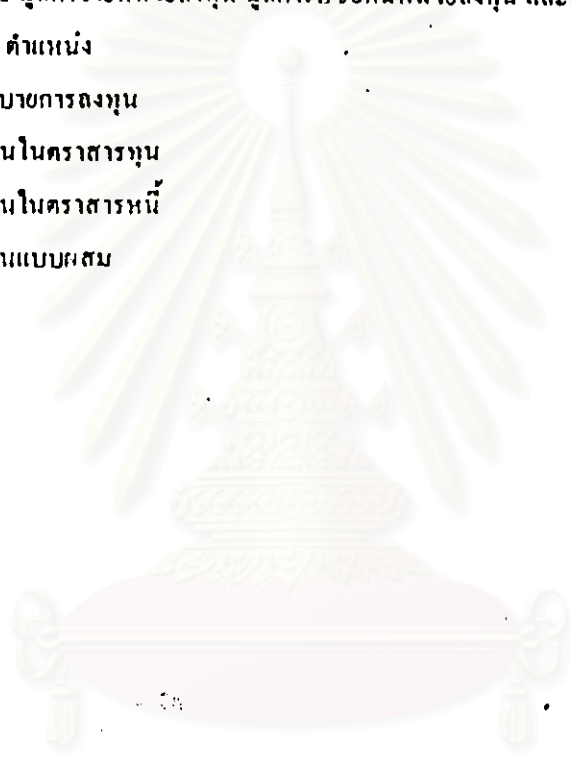
ตำแหน่ง .....

วันที่ .....

## คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงาน

แบบ บลจ. 4 รายงานการขายและการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนเปิด

- 4.1 ให้ บลจ. จัดทำรายงานแสดงการขายและการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนของกองทุนเปิดรายกองทุน เป็นรายเดือน ณ วันสิ้นเดือน
- 4.2 ชื่อกองทุนรวม
  - ในกรณีที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อย่อภาษาอังกฤษ
  - ในกรณีที่ไม่ได้เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อเต็มภาษาอังกฤษ
- 4.3 มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ มูลค่าขายหน่วยลงทุน มูลค่ารับซื้อคืนหน่วยลงทุน และมูลค่าขาย (รับซื้อคืน) สุทธิ ให้แสดงทศนิยม 2 ตำแหน่ง
- 4.4 เรียงลำดับตามนโยบายการลงทุน
  - นโยบายลงทุนในตราสารทุน
  - นโยบายลงทุนในตราสารหนี้
  - นโยบายลงทุนแบบผสม



สถาบันวิทยบริการ  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ..... จำกัด

รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์ระหว่างกองทุนรวม

ประจำเดือน .....

วัน เดือน ปี	ชื่อหลักทรัพย์	ชื่อกองทุนรวม ที่ซื้อ	ชื่อกองทุนรวม ที่ขาย	จำนวนหน่วย (หุ้น)	ราคาต่อหน่วย (บาท)	ราคาสูงสุด (บาท)	ราคาค่าสุด (บาท)	จำนวนเงิน (บาท)	หมายเหตุ
รวม									

ประทับตราบริษัท

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

..... เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจลงนาม

( )  
ตำแหน่ง .....

วันที่ .....

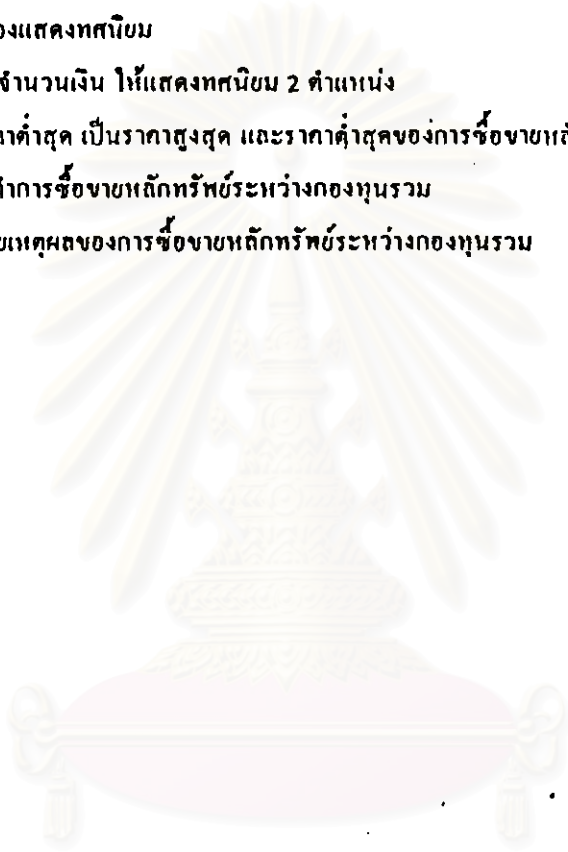


## คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงาน

แบบ มจธ. ๕ รายงานการซื้อขายหลักทรัพย์ระหว่างกองทุนรวม

- 5.1 ให้ บลจ. จัดทำรายงานผลการซื้อขายหลักทรัพย์ระหว่างกองทุนรวมรายกองทุน เป็นรายเดือน ณ วันสิ้นเดือน
- 5.2 ชื่อหลักทรัพย์ และชื่อกองทุนรวม
  - ในกรณีที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อย่อภาษาอังกฤษ
  - ในกรณีที่มิได้เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อเต็มภาษาอังกฤษ
- 5.3 จำนวนหน่วย ไม่ต้องแสดงทศนิยม
 

ราคาต่อหน่วย และจำนวนเงิน ให้แสดงทศนิยม 2 ตำแหน่ง
- 5.4 ราคาสูงสุด และราคาต่ำสุด เป็นราคาสูงสุด และราคาต่ำสุดของการซื้อขายหลักทรัพย์นั้นในตลาดฯ ณ สิ้นวันของวันที่ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ระหว่างกองทุนรวม
- 5.5 หมายเหตุ ให้อธิบายเหตุผลของการซื้อขายหลักทรัพย์ระหว่างกองทุนรวม



สถาบันวิทยบริการ  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ..... จำกัด

รายงานการจ่ายเงินปันผล

ประจำเดือน .....

ชื่อกองทุนรวม	วันที่มีมติ	วันที่ประกาศ XD	วันที่ปิด สมุดทะเบียน	วันที่จ่าย	อัตราค่อนหน่วย (บาท)	จำนวนเงินรวม (ล้านบาท)
รวม						

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

ประทับตราบริษัท

..... เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจลงนาม

( )

ตำแหน่ง .....

วันที่ .....

## คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงาน

### แบบบมจ. ๘ รายงานการจ่ายเงินปันผล

- 6.1 ให้ บดจ. จัดทำรายงานแสดงการจ่ายเงินปันผล ของกองทุนรวมต่างๆ ในเฉพาะเดือนที่มีการจ่ายเงินปันผลแต่ละเดือน
- 6.2 ชื่อกองทุนรวม
  - ในกรณีที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อย่อภาษาอังกฤษ
  - ในกรณีที่ไม่ได้เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดฯ ให้แสดงชื่อเต็มภาษาอังกฤษ
- 6.3 วันที่มีมติ วันที่ประกาศ XD วันที่ปิดสมุดทะเบียน วันที่จ่าย ให้กรอกตามแบบตัวอย่าง ดังนี้  
วัน/เดือน/ปี เช่น 25/01/37
- 6.4 อัตราค่อนหน่วย และจำนวนเงินรวมให้แสดงทศนิยม 2 ตำแหน่ง



สถาบันวิทยบริการ  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย



สำนักงานคณะกรรมการทรัพยากรธรรมชาติและสิ่งแวดล้อมแห่งชาติ

25 ธันวาคม 2538

เรียน ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวมทุกบริษัท และ

ผู้ดูแลผลประโยชน์ทุกราย

ที่ กสศ.ก. (ว) ๕๕ /2538 เรื่อง ซักซ้อมความเข้าใจเกี่ยวกับการรายงานการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงหลักทรัพย์ของกองทุนรวมเกินอัตราส่วนที่กฎหมายกำหนด

เพื่อให้เกิดความเข้าใจที่ชัดเจน และเพื่อให้บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวมและผู้ดูแลผลประโยชน์ปฏิบัติตามเงื่อนไขของกฎกระทรวงกระทรวงพาณิชย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 รวมถึงประกาศที่เกี่ยวข้องเกี่ยวกับการรายงานค้ำประกันงานกรณีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวมลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สบ. 7/2537 เรื่อง การกำหนดอัตราส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงหลักทรัพย์เกินอัตราส่วนกองทุนรวม (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 15 สิงหาคม 2537 และประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สบ. 8/2537 เรื่อง การกำหนดอัตราส่วนการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงหลักทรัพย์ของบริษัทเพื่อเป็นทรัพย์สินของกองทุนรวมประเภทเร้าที่คิดเป็นหน่วยลงทุน (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 15 สิงหาคม 2537

สำนักงานขอเรียนชี้แจงวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการรายงานเรื่องดังกล่าวข้างต้นดังต่อไปนี้

1. กรณีที่บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวมลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงหลักทรัพย์เกินอัตราส่วนโดยเกิดจากการลงทุนหรือได้มาเพิ่ม (ซึ่งรวมถึงกรณีการได้สิทธิที่ซ้อนกันเพิ่มเติม)

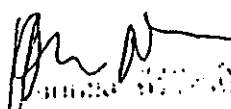
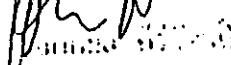
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม	ผู้ดูแลผลประโยชน์
1. ชี้แจงข้อเท็จจริงให้สำนักงานทราบทันทีที่บริษัทท่านรู้ถึงเหตุการณ์ 2. หลังจากที่บริษัทท่านแก้ไขแล้ว ให้ชี้แจงให้สำนักงานทราบทันที	ต้องจัดทำรายงานข้อเท็จจริงข้อเท็จจริงให้สำนักงานทราบ ภายใน 5 วันนับแต่วันที่ผู้ดูแลผลประโยชน์รู้ถึงเหตุการณ์ดังกล่าว (ตามประกาศ 128 แห่งกระทรวงพาณิชย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535)

๒. กรณีที่บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม กุญแจปริศมีไว้ชื่อ หลักทรัพย์เป็นอัตราส่วน โดถูกได้เกิดจากผลการ กุญแจปริศมีได้แก่

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม	ผู้ดูแลผลประโยชน์
<p>๑. บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม กุญแจปริศมีไว้ชื่อ หลักทรัพย์ไม่ต่อไปได้</p> <p>๒. ต้องจัดการรายวันโดยระบุชื่อ จำนวน อัตราส่วน ผลการ กุญแจปริศมีไว้ชื่อ หลักทรัพย์นั้น และวันที่หลักทรัพย์ที่มูลค่าเกินอัตราที่กำหนด พร้อมเวลาเหตุ และส่งให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ บรรดาภายใน ๖ วันทำการนับแต่วันหลักทรัพย์ที่มีมูลค่าเกินอัตราที่กำหนด</p> <p>๓. ส่งรายการตามข้อที่ ๒ เป็นรายไตรมาสตาม ปฏิทิน และส่งให้สำนักงานภายใน 15 วันนับแต่ วันสิ้นสุดไตรมาสนั้น โดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการ กองทุนรวมจะมอบหมายให้ผู้ดูแลผลประโยชน์ เป็นผู้สรุป และส่งรายงานแทนก็ได้ (ตามประกาศ สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และ ตลาดหลักทรัพย์ ที่ สค. 7/2537 และ ที่ สค. 8/2537)</p>	<p>๑. ในกรณีที่ผู้ดูแลผลประโยชน์ได้รับมอบหมาย จากบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวมไปเป็นผู้สรุปและส่งรายงานรายไตรมาสตามปฏิทิน ให้สำนักงานแทน ผู้ดูแลผลประโยชน์ จัดส่งรายงานข้างต้นนี้ให้สำนักงานภายใน 15 วันนับแต่วันสิ้นสุดไตรมาสนั้น</p> <p>๒. ในกรณีที่ผู้ดูแลผลประโยชน์ได้รับมอบหมาย จากบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ไปเป็นผู้สรุปและส่ง รายงานรายไตรมาสตาม ปฏิทินให้สำนักงานแทน ผู้ดูแลผลประโยชน์ ไม่ถือ จัดส่งรายงานดังกล่าว ให้สำนักงาน</p>

จึงเรียนมาเพื่อทราบและถือปฏิบัติ

ขอแสดงความนับถือ

  
 (นาย )  
 เลขานุการ

# ภาคผนวก ข

## ข้อมูลกองทุนรวมที่สำคัญ

- ตารางแสดงมูลค่าซื้อขายหุ้นของกองทุน และ NAV Index
- ตารางแสดงผลตอบแทนรายไตรมาสของกองทุนปิด 58 กองทุน ช่วง พ.ศ.2538- 2539



สถาบันวิทยบริการ  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

• ตารางแสดงมูลค่าซื้อขายหุ้นของกองทุน และ NAV Index

Date	Treading Value <sub>t</sub> (1)	NAV <sub>t</sub> of all equity funds (2)	SET Index (3)	New Funds (4)	Dividend (5)	Net flow ( D <sub>t</sub> ) (4) - (5)	Base <sub>t</sub> * (6)	NAV Index [(2) / (6)] x100	Turnover <sub>t</sub> ** (7)
Jun-95	74,457.39	185,672.31	1,394.77	0.00	0.00	0.00	185,672.31	100.00	
Jul-95	41,995.46	183,844.60	1,383.10	148.02	158.19	-10.17	185,662.04	99.02	22.73%
Aug-95	23,653.15	173,863.10	1,314.90	3,021.01	2,780.94	240.07	185,918.75	93.52	13.22%
Sep-95	34,931.10	172,521.40	1,294.23	738.43	1,147.17	-408.74	185,479.32	93.01	20.17%
Oct-95	27,063.24	170,007.80	1,270.76	50.00	382.90	-332.90	185,116.63	91.84	15.80%
Nov-95	22,040.85	161,377.49	1,196.62	50.80	697.44	-646.64	184,378.03	87.53	13.30%
Dec-95	32,399.74	171,256.50	1,280.81	0.00	190.00	-190.00	184,173.69	92.99	19.48%
Jan-96	56,519.78	186,870.10	1,410.33	0.00	363.95	-363.95	183,815.69	101.66	31.56%
Feb-96	21,099.85	169,110.40	1,321.87	0.00	911.25	-911.25	182,830.51	92.50	11.85%
Mar-96	31,263.53	166,113.50	1,289.73	50.57	524.12	-473.55	182,310.79	91.12	18.65%
Apr-96	21,406.04	166,684.00	1,292.61	0.00	0.00	0.00	182,310.79	91.43	12.86%
May-96	31,416.25	168,152.80	1,311.91	50.00	737.90	-687.90	181,568.01	92.61	18.77%
Jun-96	28,276.82	159,691.50	1,247.08	0.00	287.43	-287.43	181,241.79	88.11	17.25%
Jul-96	24,002.27	137,483.00	1,064.04	0.00	535.18	-535.18	180,539.01	76.15	16.15%
Aug-96	16,305.96	152,683.80	1,102.04	10,597.27	916.46	9,680.81	192,760.88	79.21	11.24%
Sep-96	17,524.78	152,763.60	1,099.01	0.00	575.00	-575.00	192,038.05	79.55	11.47%
Oct-96	18,310.70	131,786.80	910.33	397.30	80.50	316.80	192,500.79	68.46	12.87%
Nov-96	17,538.44	133,613.30	925.97	0.00	408.48	-408.48	191,914.08	69.62	13.22%
Dec-96	14,472.27	122,933.20	831.57	808.21	0.00	808.21	193,184.14	63.64	11.28%

ที่มา : สำนักงานคณะกรรมการหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

สมาคมบริษัทจัดการลงทุน , DEFT Research

หมายเหตุ : Treading Value, NAV of all equity funds, New Funds, Dividend หน่วยเป็นล้านบาท

\* Base<sub>t</sub> = Base<sub>t-1</sub> x ( NAV<sub>t</sub> / (NAV<sub>t</sub> - D<sub>t</sub>) )

\*\* Turnover<sub>t</sub> = [ Treading value<sub>t</sub> / (( NAV<sub>t</sub> + NAV<sub>t-1</sub>) / 2 ) ]

• ตารางแสดงผลตอบแทนรายไตรมาสของกองทุนปิด 58 กองทุน ช่วง พ.ศ.2538- 2539

(หน่วย : %)

ชื่อย่อกองทุน	ผลตอบแทนของกองทุนรายไตรมาส (2538 - 2539)							
	Q1/2538	Q2/2538	Q3/2538	Q4/2538	Q1/2539	Q2/2539	Q3/2539	Q4/2539
AGF	-10.80	20.00	-7.24	-2.13	1.82	-6.76	-14.77	-21.51
BMF	-7.91	13.16	-6.00	0.79	2.30	-3.16	-14.39	-15.97
CMICRK	-9.46	14.96	-5.35	1.11	3.70	-0.32	-14.69	-17.33
DE-1	-12.68	16.41	-4.87	-1.28	0.05	-4.62	-17.38	-21.03
KPLUS	-9.17	10.84	-6.15	0.35	1.75	-3.44	-15.91	-18.79
KPLUS2	-9.64	10.84	-6.33	0.36	1.65	-3.49	-15.78	-18.88
NTF	-14.19	20.62	-4.97	1.22	3.54	-5.04	-18.20	-23.20
ONE+1	-8.22	9.03	-5.44	1.20	2.79	-0.41	-14.30	-17.45
ONE-D	-8.77	8.77	-5.09	0.99	2.82	-0.25	-14.35	-17.20
ONE-G	-8.43	9.04	-5.68	0.62	3.01	-0.22	-14.07	-17.17
ONE-PR	-8.64	8.42	-5.27	0.93	2.69	-0.28	-14.07	-18.07
ONE-WE	-8.37	8.72	-6.42	1.15	2.12	-1.53	-14.16	-17.80
ONEUB	-8.31	9.99	-6.16	0.99	2.80	-0.37	-14.50	-17.98
ONEUB2	-8.49	10.22	-6.01	0.81	2.82	-0.27	-14.20	-17.94
ONEUB3	-8.30	9.59	-6.14	1.09	2.45	-0.73	-14.35	-17.74
ONEUB4	-8.51	8.13	-5.74	0.68	2.12	-0.49	-14.03	-17.80
ONEUB5	-6.83	10.18	-5.66	0.95	2.76	-0.53	-13.73	-18.00
OSA	-2.00	13.06	-4.60	0.09	3.38	-2.51	-16.62	-18.62
OSC	-9.31	13.12	-3.19	0.77	4.58	-2.29	-16.01	-18.04
OSK1	-8.84	16.27	-4.98	1.08	3.73	-3.18	-16.76	-18.47
OSP	-9.64	13.18	-4.76	0.85	3.80	-1.82	-15.64	-13.69
OSU	-9.61	13.73	-5.11	1.22	5.30	-1.95	-16.11	-20.37
OSU2	-9.82	13.62	-5.19	1.22	5.30	-1.95	-16.11	-20.37
RKF	-9.16	15.12	-5.15	1.34	4.74	0.63	-15.07	-17.50
RKF-HI	-9.61	14.92	-5.13	0.99	3.93	-0.32	-14.35	-17.49
RKF2	-9.22	16.10	-5.32	1.30	3.93	0.27	-14.51	-17.43
RKF3	-9.82	15.21	-5.25	1.37	3.95	0.19	-14.76	-17.08
RKF4	-8.95	15.17	-5.25	0.96	3.58	0.10	-14.30	-17.28
RPF2	-11.28	15.91	-4.50	-2.55	4.29	-2.93	-15.11	-17.94



• ตารางแสดงผลตอบแทนรายไตรมาสของกองทุนปิด 58 กองทุน ช่วง พ.ศ.2538- 2539 (ต่อ)

ชื่อย่อกองทุน	ผลตอบแทนของกองทุนรายไตรมาส (2538 - 2539)							
	Q1/2538	Q2/2538	Q3/2538	Q4/2538	Q1/2539	Q2/2539	Q3/2539	Q4/2539
RRF1	-12.54	17.81	-5.34	2.42	4.06	-5.12	-17.84	-21.62
SAN	-9.25	16.00	-4.44	2.04	3.47	-3.86	-16.58	-19.18
SCBMF	-12.32	13.78	-4.04	-1.41	2.27	-3.27	-15.08	-22.45
SCBMF2	-12.31	13.31	-4.00	-1.53	2.02	-3.37	-14.79	-21.66
SCBMF3	-12.43	13.48	-4.76	-1.36	1.36	-3.89	-15.41	-22.41
SCBMF4	-12.29	13.28	-3.98	-1.49	1.94	-1.59	-14.93	-12.37
SCBMF5	-11.88	12.43	-4.80	-1.20	0.55	-1.87	-15.17	-12.19
SCBPG	-11.81	14.45	-5.85	-2.94	0.45	-2.35	-13.40	-15.61
SCBTS	-13.64	14.95	-4.37	-1.52	3.65	-4.26	-16.82	-22.89
SCBTS2	-13.70	14.90	-4.36	-1.56	3.61	-4.58	-14.73	-17.54
SCBTS3	-13.58	14.76	-4.36	-1.41	3.52	-4.04	-14.17	-13.68
SCDF	-11.78	18.03	-3.77	0.82	0.92	-4.25	-17.63	-19.51
SCIF	-12.00	19.32	-5.63	-0.24	1.78	-6.05	-16.56	-20.62
SCIF-2	-10.81	17.58	-5.67	0.22	1.80	-5.84	-16.84	-18.80
SF4	-10.66	19.15	-5.90	-1.02	-0.22	-6.36	-16.69	-20.97
SF5	-10.67	18.53	-6.29	-0.48	1.02	-6.47	-17.03	-19.84
SF7	-12.02	17.79	-6.08	2.22	4.35	-5.50	-19.00	-20.91
SPF	-12.01	17.16	-5.71	1.88	3.03	-4.68	-16.31	-16.77
STD	-13.13	18.05	-5.54	-0.98	0.37	-6.41	-16.07	-19.47
STD2	-12.65	19.55	-3.38	-2.44	-0.42	-7.10	-16.64	-19.60
SW2	-9.98	15.63	-4.65	2.11	4.40	-3.55	-15.95	-18.41
THANA1	-9.19	10.54	-6.08	1.66	1.81	-1.31	-14.10	-17.98
THOR	-9.97	14.44	-4.75	0.66	5.47	-1.34	-14.70	-15.36
THOR-2	-9.44	13.31	-4.83	1.20	5.57	-1.32	-14.78	-15.38
THOR3	-10.18	12.73	-7.94	-0.36	5.79	-1.37	-15.14	-15.40
THOR4	-10.81	13.16	-5.16	0.10	6.83	-1.62	-15.32	-17.18
TNP	-11.78	15.61	-5.72	0.19	2.19	-4.97	-16.34	-19.82
UNF	-15.03	16.17	-4.37	-0.53	0.40	-4.97	-14.30	-21.44
WTF	-11.59	17.38	-4.96	0.65	3.47	-5.08	-17.27	-20.51

ที่มา : ตมคคมบริษัทจัดการลงทุน

## ประวัติผู้วิจัย

นายอัคนันท์ คิตตสม เกิดวันที่ 6 มิถุนายน พ.ศ.2516 กรุงเทพมหานคร สำเร็จการศึกษาปริญญาตรีเศรษฐศาสตรบัณฑิต(เกียรตินิยมอันดับสอง) สาขาการเงินและการคลัง คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย ในปีการศึกษา 2536 จากนั้นในปี พ.ศ. 2537 ได้เข้าทำงานในตำแหน่งเจ้าหน้าที่วิเคราะห์หลักทรัพย์ บงล.ตะวันออกฟายแนนซ์ (1991) จำกัด (มหาชน) มีหน้าที่รับผิดชอบหลักในวิเคราะห์กองทุนรวม และเผยแพร่ความรู้ด้านกองทุนรวม แก่นักลงทุนผ่านบทความ "Mutual Fund Desk Report" ตีพิมพ์ในหนังสือพิมพ์กรุงเทพธุรกิจ ฉบับถนนนักลงทุน ตั้งแต่กลางปีพ.ศ. 2538 ถึงกลางปีพ.ศ. 2540

ปัจจุบัน (ปีพ.ศ.2541) เป็นอาจารย์ประจำภาควิชาการเงินและการธนาคาร และบรรณาธิการวารสารบริหารธุรกิจเทคโนโลยีมหานคร คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีมหานคร เขตหนองจอก กรุงเทพมหานคร



สถาบันวิทย์บริการ  
จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย