

คู่มือการทดสอบหลักสูตร กฎระเบียบที่เกี่ยวข้อง  
ด้านสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

Paper 19

ศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน  
ประกาศใช้เมื่อ พฤศจิกายน 2557

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : 19
Date issued : November 2014	Version No. : 2
Related documents : -	

**โครงสร้างหลักสูตรทดสอบใบอนุญาต  
หลักสูตรกฏระเบียบที่เกี่ยวข้องด้านสัญญาซื้อขายล่วงหน้า**

ลักษณะข้อสอบ : ข้อสอบแบบตัวเลือก (Multiple Choice) โดยแต่ละข้อมี 4 ตัวเลือก

จำนวนข้อสอบ : ข้อสอบ 1 ชุด มี 40 ข้อ

ระยะเวลา : ให้ความเวลาทำข้อสอบ 1 ชั่วโมง

หลักเกณฑ์การผ่านการทดสอบ : 70 % และบังคับผ่านหมวด 2

รายละเอียดหลักสูตร	จำนวนข้อสอบ
<b>หมวดที่ 2 กฎระเบียบที่เกี่ยวข้องและการให้คำแนะนำการลงทุนที่เหมาะสม</b>	<u>25</u>
2.1 หลักเกณฑ์ในการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และการปฏิบัติงานของผู้ทำหน้าที่ติดต่อกับผู้ลงทุน	7
2.2 กฎหมายว่าด้วยการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์และกฎหมายป้องกันการฟอกเงิน	3
2.3 หลักเกณฑ์การกำกับดูแลการออกและเสนอขายตราสารประเภทต่างๆ	5
2.4 การให้คำแนะนำการลงทุนที่เหมาะสม	10
<b>หมวดที่ 3 ความรู้เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (เฉพาะหมวดที่ 3.2 กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า)</b>	
<b>3.2 กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า</b>	<u>15</u>
3.2.1 การซื้อขายตราสารอนุพันธ์ในตลาดอนุพันธ์ TFEX	5
3.2.2 การชำระราคาและวางหลักประกันของสำนักบัญชี TCH	5
3.2.3 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและประกาศที่เกี่ยวข้อง	5
	<u>40</u>

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : 19
Date issued : November 2014	Version No. : 2
Related documents : -	

**โครงสร้างหลักสูตรทดสอบใบอนุญาต  
หลักสูตรกฏระเบียบที่เกี่ยวข้องด้านสัญญาซื้อขายล่วงหน้า**

**หมวดที่ 2**

**กฏระเบียบที่เกี่ยวข้องและการให้คำแนะนำการลงทุนที่สอดคล้องและเหมาะสมกับลูกค้า**

**1. หลักเกณฑ์ในการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และการปฏิบัติงานของผู้ทำหน้าที่ติดต่อผู้ลงทุน**

**หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)**

1. แนวทางปฏิบัติสำหรับผู้ทำหน้าที่ติดต่อกับผู้ลงทุน
  - บทที่ 1 หลักเกณฑ์ในการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และการปฏิบัติงานของผู้ทำหน้าที่ติดต่อกับผู้ลงทุน

**วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :**

1. เพื่อให้เข้าใจวัตถุประสงค์ในการกำกับดูแลบริษัทหลักทรัพย์ของสำนักงาน ก.ล.ต.
2. เพื่อให้เข้าใจถึงความสำคัญของการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์และสามารถระบุการปฏิบัติที่เป็นการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์ของบริษัทหลักทรัพย์และผู้ติดต่อกับผู้ลงทุน
3. เพื่อให้เข้าใจและสามารถระบุความแตกต่างระหว่างบัญชีที่ติดตามหรือเฝ้าระวังการทำธุรกรรม (watch list) และบัญชีที่จำกัดการทำธุรกรรม (restricted list) ได้
4. เพื่อให้เข้าใจหลักปฏิบัติในการดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้า
5. เพื่อให้เข้าใจบทบาทและความสำคัญของหน่วยงานดูแลการปฏิบัติงานของบริษัทหลักทรัพย์ (compliance unit)
6. เพื่อให้เข้าใจวิธีปฏิบัติในการควบคุมการปฏิบัติงานของผู้ติดต่อกับผู้ลงทุนและระเบียบปฏิบัติของพนักงานรวมถึงสามารถระบุความแตกต่างระหว่างหน้าที่ของ front office และหน้าที่ของ back office
7. เพื่อให้เข้าใจระเบียบปฏิบัติในการดำเนินการแก้ไขข้อร้องเรียนของลูกค้า
8. เพื่อให้เข้าใจการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ทำหน้าที่ติดต่อกับผู้ลงทุน และสามารถประยุกต์ใช้หลักเกณฑ์ในการติดต่อ ชักชวน หรือให้คำแนะนำแก่ลูกค้าได้
9. เพื่อให้เข้าใจวัตถุประสงค์ของการจัดทำข้อมูลลูกค้า และสามารถนำข้อมูลของลูกค้าไปประยุกต์ใช้ได้
10. เพื่อให้เข้าใจวัตถุประสงค์ของการจัดทำคู่มือการลงทุน และสามารถระบุส่วนประกอบต่างๆ ของคู่มือการลงทุนได้
11. เพื่อให้สามารถอธิบายจรรยาบรรณในการปฏิบัติงานเยี่ยงผู้ประกอบการวิชาชีพได้
12. เพื่อให้สามารถระบุคุณสมบัติและลักษณะต้องห้ามของผู้ติดต่อกับผู้ลงทุน ตลอดจนบทลงโทษสำหรับผู้ติดต่อกับผู้ลงทุนกรณีฝ่าฝืนหลักเกณฑ์
13. เพื่อให้เข้าใจประโยชน์และวัตถุประสงค์ของกระบวนการอนุญาตตลาดการ
14. เพื่อให้สามารถยกตัวอย่างลักษณะข้อพิพาทที่สามารถเข้าสู่กระบวนการอนุญาตตลาดการได้
15. เพื่อให้เข้าใจกระบวนการในการจัดตั้งอนุญาตตลาดการ และการพิจารณาอนุญาตตลาดการ คำชี้ขาด

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : 19
Date issued : November 2014	Version No. : 2
Related documents : -	

## 2. กฎหมายว่าด้วยการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์และกฎหมายป้องกันการฟอกเงิน

### หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. แนวทางปฏิบัติสำหรับผู้ทำหน้าที่ติดต่อกับผู้ลงทุน
  - บทที่ 2 กฎหมายว่าด้วยการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์และกฎหมายป้องกันการฟอกเงิน

### วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้เข้าใจการกระทำอันไม่เป็นธรรมตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์ฯ และสามารถประยุกต์ใช้มาตรการป้องกันการกระทำอันไม่เป็นธรรม
2. เพื่อให้เข้าใจและสามารถแบ่งแยกความแตกต่างระหว่างการแพร่ข่าวอันเป็นเท็จ การใช้ข้อมูลภายใน และการซื้อขายโดยอำพรางเพื่อให้บุคคลทั่วไปหลงผิดได้
3. เพื่อให้เข้าใจหลักเกณฑ์และวิธีการในการรายงานธุรกรรมของสถาบันการเงินได้ ตลอดจนสามารถระบุความผิดมูลฐานตามพระราชบัญญัติป้องกันและปราบปรามการฟอกเงินได้
4. เพื่อให้เข้าใจและสามารถประยุกต์ใช้หลักเกณฑ์ในการจัดให้ลูกค้าแสดงตน และการบันทึกข้อเท็จจริงเกี่ยวกับธุรกรรมกับสถาบันการเงิน

## 3. หลักเกณฑ์การกำกับดูแลการออกและเสนอขายตราสารประเภทต่างๆ

### หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. แนวทางปฏิบัติสำหรับผู้ทำหน้าที่ติดต่อกับผู้ลงทุน
  - บทที่ 3 หลักเกณฑ์การกำกับดูแลการออกและเสนอขายตราสารประเภทต่างๆ

### วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายหลักเกณฑ์และขั้นตอนการออกเสนอขายหลักทรัพย์ได้
2. เพื่อให้เข้าใจและสามารถระบุหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ได้
3. เพื่อให้เข้าใจและสามารถประยุกต์ใช้หลักเกณฑ์และขั้นตอนการทำคำเสนอซื้อหลักทรัพย์ได้
4. เพื่อให้เข้าใจหลักเกณฑ์การจัดตั้งกองทุนรวมและสามารถแบ่งลักษณะกองทุนรวมแต่ละประเภทได้
5. เพื่อให้เข้าใจขั้นตอนการเสนอขายหน่วยลงทุน
6. เพื่อให้เข้าใจวัตถุประสงค์ของการกำหนดอัตราส่วนการลงทุน
7. เพื่อให้เข้าใจส่วนประกอบสำคัญที่ต้องระบุในรายละเอียดโครงการ
8. เพื่อให้เข้าใจวัตถุประสงค์ของการจัดทำหนังสือชี้ชวนและสามารถระบุส่วนประกอบที่สำคัญของหนังสือชี้ชวนได้
9. เพื่อให้เข้าใจวัตถุประสงค์ของการคำนวณ NAV รวมถึงหลักเกณฑ์ในการคำนวณ NAV เพื่อเปิดเผยต่อผู้ลงทุน

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : 19
Date issued : November 2014	Version No. : 2
Related documents : -	

#### 4. การให้คำแนะนำการลงทุนที่เหมาะสม

##### หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. ตลาดการเงินและการลงทุนในหลักทรัพย์
  - บทที่ 9 การวางแผนการลงทุน

##### วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เข้าใจความหมาย ความสำคัญ และกระบวนการให้คำแนะนำการลงทุนที่เหมาะสม
2. สามารถจำแนกประเภท และความแตกต่างของข้อมูลเชิงคุณภาพและเชิงปริมาณ รวมทั้งเข้าใจนัยสำคัญของข้อมูลแต่ละประเภทที่มีต่อการวางแผนการลงทุน
3. เข้าใจ และสามารถจำแนกวัตถุประสงค์การลงทุนตามรูปแบบของผลตอบแทนที่ต้องการ
4. เข้าใจความหมายของระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ รวมทั้ง สามารถวิเคราะห์องค์ประกอบ และสามารถจำแนกความแตกต่างของปัจจัยที่ใช้ในการประเมินระดับความเต็มใจในการรับความเสี่ยงและความสามารถในการรับความเสี่ยงของผู้รับคำปรึกษา
5. สามารถจำแนก และวิเคราะห์ข้อจำกัดหรือเงื่อนไขการลงทุนในแต่ละด้านของผู้รับคำปรึกษา
6. สามารถวิเคราะห์ และจำแนกลักษณะของผู้รับคำปรึกษาตามระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ในการลงทุนตามแบบทดสอบ(แบบประเมิน) ความเหมาะสมในการลงทุน (Suitability Test) ได้
7. เข้าใจความหมาย ความสำคัญ และกระบวนการจัดสรรสินทรัพย์ลงทุน รวมทั้ง ปัจจัยที่ใช้ในการประกอบการพิจารณาการจัดสรรสินทรัพย์ลงทุน
8. เข้าใจความหมายของประเภทชั้นสินทรัพย์ (asset class) และสามารถจำแนกหลักทรัพย์เพื่อจัดประเภทชั้นสินทรัพย์ลงทุนที่มีคุณสมบัติเดียวกัน
9. เข้าใจแนวคิดการสร้างกลุ่มสินทรัพย์ การบริหารกลุ่มหลักทรัพย์ และการวัดผลการลงทุน รวมทั้ง สามารถเข้าใจ แนวทางการปรับปรุงกลุ่มหลักทรัพย์ลงทุนให้สอดคล้องกับสภาพแวดล้อมและสถานการณ์ที่เปลี่ยนแปลงไปของผู้รับคำปรึกษา

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : 19
Date issued : November 2014	Version No. : 2
Related documents : -	

### หมวดที่ 3

## ความรู้เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

### หมวดที่ 3.2 กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

#### 1. แนวทางปฏิบัติที่เกี่ยวกับตลาดอนุพันธ์ TFX

##### หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)

- บทที่ 3 การซื้อขายตราสารอนุพันธ์

##### วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายลักษณะของสัญญาของ SET 50 Index Futures
2. เพื่อให้สามารถคำนวณ Multiplier, Tick Size และ Position Limit ได้
3. เพื่อให้สามารถอธิบายกระบวนการซื้อขาย และการชำระราคาตราสารอนุพันธ์ได้

#### 2. การชำระราคาและวางหลักประกันของสำนักหักบัญชี TCH

##### หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)

- บทที่ 4 การชำระราคาและวางหลักประกัน

##### วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายบทบาทหน้าที่ของสำนักหักบัญชี
2. เพื่อให้สามารถอธิบายมาตรการการบริหารความเสี่ยงของสำนักหักบัญชี ได้แก่ การกำหนดคุณสมบัติสมาชิกสำนักหักบัญชี การเรียกเก็บหลักประกัน การบริหารหลักประกัน แหล่งเงินทุนเพื่อความมั่นคงในระบบชำระหนี้ และมาตรการดำเนินการกรณีที่มีสมาชิกมีการบิดพลิ้วสัญญา

#### 3. พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

##### หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)

- บทที่ 2 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และประกาศที่เกี่ยวข้อง

##### วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายขอบเขตของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
2. เพื่อให้สามารถอธิบายเป้าหมาย และโครงสร้างการกำกับดูแล ของพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : 19
Date issued : November 2014	Version No. : 2
Related documents : -	

#### 4. หลักเกณฑ์การประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

##### หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)

- บทที่ 2 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และประกาศที่เกี่ยวข้อง

##### วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายหลักเกณฑ์การประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทต่าง ๆ
2. เพื่อให้สามารถอธิบายประเภทของธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า การอนุญาต และหลักเกณฑ์ในการประกอบธุรกิจการซื้อสัญญาล่วงหน้า ตามพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

#### 5. มาตรฐานการปฏิบัติงานของผู้ติดต่อกับผู้ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

##### หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)

- บทที่ 2 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และประกาศที่เกี่ยวข้อง

##### วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายมาตรฐานการปฏิบัติงานของผู้ติดต่อกับผู้ลงทุนในธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

#### 6. การกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

##### หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)

- บทที่ 2 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และประกาศที่เกี่ยวข้อง

##### วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายมาตรการป้องกันการกระทำอันส่งผลกระทบต่อความมั่นคงและความเชื่อมั่นของตลาดทุน ตลอดจนไม่ให้ความร่วมมือในการใช้ตลาดทุนเป็นช่องทางในการกระทำผิดกฎหมาย

\*\*\*\*\*