

คู่มือการทดสอบหลักสูตร กฎระเบียบและมาตรฐาน
การปฏิบัติงานเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

Paper 25

ศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน
ประกาศใช้เมื่อ กรกฎาคม 2557

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : 25
Date issued : July 2014	Version No. : 1
Related documents : -	

หลักสูตรกฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ลักษณะข้อสอบ : ข้อสอบแบบตัวเลือก (Multiple Choice) โดยแต่ละข้อมี 4 ตัวเลือก

จำนวนข้อสอบ : ข้อสอบ 1 ชุด มี 30 ข้อ

ระยะเวลา : ให้ความทำข้อสอบ 45 นาที

หลักเกณฑ์การผ่านการทดสอบ : 70 %

รายละเอียดหลักสูตร	จำนวนข้อสอบ
3.2 กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	
3.2.1 การซื้อขายตราสารอนุพันธ์ในตลาดอนุพันธ์ TFEX	10
3.2.2 การชำระราคาและวางหลักประกันของสำนักหักบัญชี TCH	10
3.2.3 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและประกาศที่เกี่ยวข้อง	10
	30

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : 25
Date issued : July 2014	Version No. : 1
Related documents : -	

หลักสูตรกฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
หมวดที่ 3
ความรู้เกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับ
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า

หมวดที่ 3.2 กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

1. แนวทางปฏิบัติที่เกี่ยวกับตลาดอนุพันธ์ TFEX

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 และมาตรการดำเนินการกรณีที่สมาชิกมีการบิดพลิ้วสัญญา

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. : 25
Date issued : July 2014	Version No. : 1
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
