

Paper 6

หลักสูตรผู้แนะนำการลงทุนด้านโลหะมีค่า

ศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน

เมษายน 2555

หลักสูตรผู้แนะนำการลงทุนด้านโลหะมีค่า

ลักษณะข้อสอบ : ข้อสอบแบบตัวเลือก (Multiple Choice) โดยแต่ละข้อมี 4 ตัวเลือก

จำนวนข้อสอบ : ข้อสอบ 1 ชุด มี 80 ข้อ

ระยะเวลา : ให้เวลาทำข้อสอบ 2 ชั่วโมง

หลักเกณฑ์การผ่านการทดสอบ : 70 % และบังคับผ่านหมวด 2

รายละเอียดหลักสูตร	จำนวนข้อสอบ
หมวดที่ 2 กฎระเบียบที่เกี่ยวข้องและการให้คำแนะนำการลงทุนที่เหมาะสม	25
1. หลักเกณฑ์ในการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และการปฏิบัติงานของผู้ทำหน้าที่ติดต่อกับผู้ลงทุน	7
2. กฎหมายว่าด้วยการกระทำความผิดที่ไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์และกฎหมายป้องกันการฟอกเงิน	3
3. หลักเกณฑ์การกำกับดูแลการออกและเสนอขายตราสารประเภทต่างๆ	5
4. การให้คำแนะนำการลงทุนที่เหมาะสม	10
หมวดที่ 3 ความรู้เกี่ยวกับกองทุนรวมโลหะมีค่าและสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับโลหะมีค่า กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับกองทุนรวมโลหะมีค่าและสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับโลหะมีค่า	55
3.1 ความรู้เกี่ยวกับกองทุนรวมโลหะมีค่าและสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับโลหะมีค่า	40
3.1.1 ความรู้เกี่ยวกับกองทุนรวม และกองทุน ETF	8
3.1.2 ความรู้เกี่ยวกับโลหะมีค่า	8
3.1.3 ความรู้เบื้องต้นเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์	8
3.1.4 ความรู้เกี่ยวกับสัญญาฟิวเจอร์ส	8
3.1.5 สัญญาฟิวเจอร์สอ้างอิงโลหะมีค่า	8
3.2 กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับกองทุนรวมโลหะมีค่าและสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับโลหะมีค่า	15
3.2.1 การซื้อขายตราสารอนุพันธ์ในตลาดอนุพันธ์ TFEX	5
3.2.2 การชำระราคาและวางหลักประกันของสำนักหักบัญชี TCH	4
3.2.3 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและประกาศที่เกี่ยวข้อง	3
3.2.4 หลักเกณฑ์และวิธีการซื้อขายกองทุนรวม	3
	80

หลักสูตรผู้แนะนำการลงทุนด้านโลหะมีค่า

หมวดที่ 2

กฎระเบียบที่เกี่ยวข้องและการให้คำแนะนำการลงทุนที่สอดคล้องและเหมาะสมกับลูกค้า

1. หลักเกณฑ์ในการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และการปฏิบัติงานของผู้ทำหน้าที่ติดต่อผู้ลงทุน

หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. แนวทางปฏิบัติสำหรับผู้ทำหน้าที่ติดต่อกับผู้ลงทุน

- บทที่ 1 หลักเกณฑ์ในการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และการปฏิบัติงานของผู้ทำหน้าที่ติดต่อกับผู้ลงทุน

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้เข้าใจวัตถุประสงค์ในการกำกับดูแลบริษัทหลักทรัพย์ของสำนักงาน ก.ล.ต.
2. เพื่อให้เข้าใจถึงความสำคัญของการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์และสามารถระบุการปฏิบัติที่เป็นการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์ของบริษัทหลักทรัพย์และผู้ติดต่อกับผู้ลงทุน
3. เพื่อให้เข้าใจและสามารถระบุความแตกต่างระหว่างบัญชีที่ติดตามหรือ (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. เพื่อให้เข้าใจวัตถุประสงค์ของกา รจัดทำคู่มือการลงทุน และสามารถระบุส่วนประกอบต่างๆ ของคู่มือการลงทุนได้
11. เพื่อให้สามารถอธิบายจรรยาบรรณในการปฏิบัติงานกับผู้ประกอบวิชาชีพได้
12. เพื่อให้สามารถระบุคุณสมบัติและลักษณะต้องห้ามของผู้ติดต่อกับผู้ลงทุน ตลอดจนบทลงโทษสำหรับผู้ติดต่อกับผู้ลงทุนกรณีฝ่าฝืนหลักเกณฑ์
13. เพื่อให้เข้าใจประโยชน์และวัตถุประสงค์ของกระบวนการอนุญาตตลาดการ
14. เพื่อให้สามารถยกตัวอย่างลักษณะข้อพิพาทที่สามารถเข้าสู่กระบวนการอนุญาตตลาดการได้
15. เพื่อให้เข้าใจกระบวนการในการจัดตั้งอนุญาตตลาดการ และการพิจารณาอนุญาตตลาดการ คำชี้ขาด

2. กฎหมายว่าด้วยการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์และกฎหมายป้องกันการฟอกเงิน

หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. แนวทางปฏิบัติสำหรับผู้ทำหน้าที่ติดต่อกับผู้ลงทุน
 - บทที่ 2 กฎหมายว่าด้วยการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์และกฎหมายป้องกันการฟอกเงิน

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้เข้าใจการกระทำอันไม่เป็นธรรมตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์ฯ และสามารถประยุกต์ใช้มาตรการป้องกันการกระทำอันไม่เป็นธรรม
2. เพื่อให้เข้าใจและสามารถแบ่งแยกความแตกต่างระหว่างการแพร่ข่าวอันเป็นเท็จ การใช้ข้อมูลภายใน และการซื้อขายโดยอำนาจเพื่อให้บุคคลทั่วไปหลงผิดได้
3. เพื่อให้เข้าใจหลักเกณฑ์และวิธีการในการรายงานธุรกรรมของสถาบันการเงินได้ ตลอดจนสามารถระบุความผิดมูลฐานตามพระราชบัญญัติป้องกันและปราบปรามการฟอกเงินได้
4. เพื่อให้เข้าใจและสามารถประยุกต์ใช้ หลักเกณฑ์ในการจัดให้ลูกค้าแสดงตน 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

4. การให้คำแนะนำการลงทุนที่สอดคล้อง (Suitability) และเหมาะสม (Optimality) กับลูกค้า

หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. ตลาดการเงินและการลงทุนในหลักทรัพย์
 - บทที่ 9 การวางแผนการลงทุน

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้เข้าใจประโยชน์และวัตถุประสงค์ของการวางแผนการลงทุน
2. เพื่อให้เข้าใจถึงขั้นตอนการวางแผนการลงทุนให้กับลูกค้า
3. เพื่อให้เข้าใจเหตุผลและความจำเป็นของการทำความรู้จักลูกค้าก่อนการวางแผนการลงทุน
4. เพื่อให้เข้าใจถึงประเภทของข้อมูลเพื่อใช้ในการวางแผนการลงทุนให้กับลูกค้า
5. เพื่อให้เข้าใจถึงลักษณะและรูปแบบของ วัตถุประสงค์ในการลงทุนประเภทต่างๆ ของ ลูกค้า เช่น Capital Protection เป็นต้น
6. เพื่อให้เข้าใจถึงปัจจัยที่มีผลต่อระดับความสามารถในการรับความเสี่ยงของลูกค้า
7. เพื่อให้สามารถวิเคราะห์ประเภทของหลักทรัพย์ลงทุนที่สอดคล้องกับวัตถุประสงค์ที่ต้องการลงทุนของลูกค้าได้
8. เพื่อให้เข้าใจถึงลักษณะของข้อจำกัดและเงื่อนไขการลงทุนของลูกค้า รวมทั้ง สามารถวิเคราะห์ผลกระทบของข้อจำกัดและเงื่อนไขในการลงทุนดังกล่าวที่จะมีต่อการวางแผนการลงทุนของลูกค้าได้
9. เพื่อให้เข้าใจถึงองค์ประกอบสำคัญในการวางแผนการลงทุนให้กับลูกค้า
10. เพื่อให้เข้าใจแนวคิดพื้นฐานของการกระจายการลงทุน และแนวคิดการจัดสรรเงินลงทุน
11. เพื่อให้มีความเข้าใจแนวคิดการเลือกหลักทรัพย์ลงทุนที่เหมาะสม กับระดับความเสี่ยงของ ลูกค้า และเข้าใจแนวคิดการจัดสรรเงินลงทุนแบบพีระมิด
12. เพื่อให้มีความเข้าใจถึงลักษณะ ผลตอบแทน และความเสี่ยงของหลักทรัพย์ลงทุนแต่ละประเภทที่สอดคล้องกับระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ของลูกค้าแต่ละประเภท
13. เพื่อให้สามารถวิเคราะห์และให้คำแนะนำประเภทหลักทรัพย์ลงทุนที่สอดคล้องกับเป้าหมายการลงทุน และระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ของลูกค้าได้

หมวดที่ 3

ความรู้เกี่ยวกับกองทุนรวมโลหะมีค่า และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับโลหะมีค่า กฎระเบียบ และมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับกองทุนรวมโลหะมีค่า และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับโลหะมีค่า

หมวดที่ 3.1 ความรู้เกี่ยวกับกองทุนรวมโลหะมีค่าและสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับโลหะมีค่า

1. ความรู้เกี่ยวกับกองทุนรวม และกองทุน ETF

หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. ตลาดการเงินและการลงทุนในหลักทรัพย์

- บทที่ 12 กองทุนรวมและหน่วยลงทุน
 - กองทุนรวม (หน้า 525-552)
 - กองทุนอีทีเอฟ (Exchange – Traded Fund :ETF) (หน้า 583 – 594)
 - การวัดผลการดำเนินงานกองทุน (หน้า 594-601)
 - การลงทุนในกองทุนรวม (หน้า 602-616)
 - กองทุนรวมทองคำ (Gold Fund) (หน้า 630-634)

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้ สามารถ อธิบายลักษณะและรูปแบบของกองทุนรวมได้ ได้แก่ ความหมายของกองทุนรวม วิธีประกอบของกองทุน รวม ข้อดีและข้อเสียของการลงทุนในกองทุนรวม ผู้ที่มีส่วนร่วมในการจัดการกองทุนรวม ข้อกำหนดด้านการลงทุนของกองทุนรวม ลักษณะการลงทุนของกองทุนรวม ค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการบริหารกองทุน ประเภทของกองทุน ผลตอบแทนของการลงทุนในกองทุนรวม สิทธิประโยชน์ทางภาษีของกองทุนรวมและผู้ลงทุนในกองทุนรวม กลยุทธ์การลงทุนห้าประการของกองทุนรวม และข้อควรระวังในการลงทุนผ่านกองทุนรวม
2. เพื่อให้สามารถอธิบาย ลักษณะและรูปแบบของกองทุน ETF ได้แก่ รูปแบบและการลงทุนของกองทุน ETF กระบวนการสร้างและซื้อคืนในกองทุน ETF ประเภทของกองทุน ETF กองทุน ETF ในประเทศไทย และผลตอบแทนและความเสี่ยงจากการลงทุนในกองทุน ETF
3. เพื่อให้สามารถอธิบายลักษณะและรูปแบบของกองทุนรวมทองคำ
4. เพื่อให้สามารถจำแนกความแตกต่างระหว่างกองทุนรวมและกองทุนรวม ETF
5. เพื่อให้สามารถอธิบาย การวัดผลการดำเนินงานกองทุน ได้แก่ ความสำคัญของการ วัดผลการดำเนินงาน กระบวนการในการวัดผลการดำเนินงาน มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน และการวัดผลการลงทุนโดยใช้วิธี Risk – Adjusted Return
6. เพื่อให้สามารถคำนวณการวัดผลการลงทุนโดยใช้วิธี Risk – Adjusted Return ได้แก่ มาตรฐานวัดตามตัวแบบ Sharpe มาตรฐานวัดตามตัวแบบ Treynor มาตรฐานวัดตามตัวแบบ Jensen มาตรฐานวัดตามตัวแบบ information Ratio
7. เพื่อให้สามารถอธิบายการลงทุนในกองทุนรวม ได้แก่ ปัจจัยที่ควรคำนึงถึงก่อนการลงทุน ขั้นตอนการลงทุนในกองทุนรวม กลยุทธ์การลงทุนในกองทุนรวมของผู้ลงทุน และ ้องทางการติดตามผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

2. ความรู้เกี่ยวกับโลหะมีค่า

หนังสือประกอบการเรียนรู้ (Required Readings)

1. กลยุทธ์ดีด คลังการลงทุนใน... Gold Futures พิมพ์ครั้งที่ 2, ภาคภูมิ ภาคย์วิศาล, ศูนย์ส่งเสริมพัฒนาความรู้ตลาดทุน (TSI) ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
 - ตอนที่ 11 คู่มือเรื่องเรื่องทอง
 - ตอนที่ 12 Demand & Supply เรื่องง่ายๆ ที่ส่งผลต่อราคาทอง
 - ตอนที่ 13 รู้วิเคราะห์เจาะปัจจัยกระทบราคาทอง
 - ตอนที่ 14 ราคาทองไทย วิ่งตามอะไรกันแน่
 - ตอนที่ 15 ตลาดทองคำที่ไม่เคยหลับใหล
2. ซิลเวอร์ฟิวเจอร์สัญญาซื้อขายโลหะเงินล่วงหน้า (TFEX) หน้า 4-9
(สามารถDownloadได้ที่ www.tsi-thailand.org)

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายคุณลักษณะพื้นฐานของโลหะมีค่า ได้แก่ ความบริสุทธิ์ หน่วยวัดน้ำหนัก
2. เพื่อให้สามารถอธิบายรูปแบบการลงทุนในโลหะมีค่า
3. เพื่อให้สามารถอธิบายปัจจัยที่มีผลกระทบต่อการขึ้นลงของราคาโลหะมีค่าโลก และราคาโลหะมีค่าในประเทศไทย
4. เพื่อให้สามารถจำแนกความแตกต่างระหว่างราคาโลหะมีค่าของสมาคม และราคาโลหะมีค่าที่ใช้อ้างอิงในตลาดอนุพันธ์ TFEX

3. ความรู้เบื้องต้นเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์

หนังสือประกอบการเรียนรู้ (Required Readings)

1. ความรู้เบื้องต้นเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DR1)
 - บทที่ 1 ภาพรวมของตราสารอนุพันธ์

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถจำแนกความแตกต่างลักษณะตราสารอนุพันธ์ออกจากตราสารทางการเงินทั่วไปได้
2. เพื่อให้สามารถอธิบายถึงประโยชน์ของการมีตราสารอนุพันธ์ได้
3. เพื่อให้สามารถจำแนกความแตกต่างของตราสารอนุพันธ์ในแต่ละประเภทได้ เช่น สัญญาซื้อขายล่วงหน้า และออปชั่น
4. เพื่อให้สามารถจำแนกความแตกต่างระหว่าง ตลาดตราสารอนุพันธ์ ระหว่าง ตลาดที่เป็นทางการ (exchange) กับตลาดที่ไม่เป็นทางการ (over-the-counter)
5. เพื่อให้สามารถอธิบายบทบาทผู้มีส่วนร่วมในตลาดตราสารอนุพันธ์ได้ ได้แก่ ผู้ถัวความเสี่ยง นักเก็งกำไร และนักค้ากำไร
6. เพื่อให้สามารถแนะนำกลยุทธ์เบื้องต้นตามประเภทนักลงทุนได้

4. ความรู้เกี่ยวกับสัญญาฟิวเจอร์ส

หนังสือประกอบการเรียนรู้ (Required Readings)

1. ความรู้เบื้องต้นเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DR1)

- บทที่ 2 สัญญาฟิวเจอร์ส

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายลักษณะ ตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย และบริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)
2. เพื่อให้สามารถจำแนกความแตกต่างระหว่างสัญญาฟิวเจอร์สและสัญญาฟอร์เวิร์ด
3. เพื่อให้สามารถอธิบายการซื้อขาย ผลตอบแทนและความเสี่ยงของสัญญาฟิวเจอร์ส
4. เพื่อให้สามารถอธิบายประเภทของสัญญาฟิวเจอร์สได้ เช่น สัญญาฟิวเจอร์สในอัตราดอกเบี้ย สัญญาฟิวเจอร์สในเงินตราต่างประเทศ
5. เพื่อให้สามารถอธิบายกลไกการซื้อขาย การวางเงินประกัน การปรับมูลค่าราคาตลาด และการชำระราคาส่งมอบของสัญญาฟิวเจอร์ส
6. เพื่อให้สามารถคำนวณการวางเงินประกัน การปรับมูลค่าราคาตลาด และการชำระราคาส่งมอบของสัญญาฟิวเจอร์ส
7. เพื่อให้สามารถประยุกต์ใช้สัญญาฟิวเจอร์สในการป้องกันความเสี่ยง และการเก็งกำไร
8. เพื่อให้สามารถคำนวณหาราคาฟิวเจอร์สทางทฤษฎีในกรณีสินทรัพย์ทางการเงิน และกรณีสินค้าโภคภัณฑ์

5. สัญญาฟิวเจอร์สอ้างอิงโลหะมีค่า

หนังสือประกอบการเรียนรู้ (Required Readings)

1. กลยุทธ์เด็ด เคล็ดการลงทุนใน... Gold Futures พิมพ์ครั้งที่ 2 ภาคภูมิ ภาคยิวศาล, ศูนย์ส่งเสริมพัฒนาความรู้ตลาดทุน (TSI) ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
 - ตอนที่ 1 ปฐมบทแห่ง Gold futures ในไทย
 - ตอนที่ 2 ลงทุนในทองคำแบบไหนดี
 - ตอนที่ 4 อยากรู้ อยากดู อยากเห็น ราคาซื้อขาย Gold Futures
 - ตอนที่ 6 ตัวอย่างการลงทุนใน Gold Futures
 - ตอนที่ 7 เรื่องควรรู้ อยากให้ดูก่อนเริ่มเทรด
 - ตอนที่ 8 Gold Futures...โอกาสทองที่มาพร้อมข้อควรระวัง
 - ตอนที่ 9 มาทำกำไรใน Gold Futures กันเถอะ
 - ตอนที่ 10 รวมมิตรเทคนิคการวิเคราะห์ Gold Futures
 - ตอนที่ 16 สูตรสำเร็จเช็คราคา Gold Futures
 - ตอนที่ 17 ป้องกันเสี่ยง เลี่ยงขาดทุน ด้วย Gold Futures
 - ตอนที่ 18 แก้มกลยุทธ์ทำกำไรของ Arbitrager
2. ซิลเวอร์ฟิวเจอร์สซื้อขายโลหะเงินล่วงหน้า (TFEX) หน้า 10-32
(สามารถDownloadได้ที่ www.tsi-thailand.org)

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถจำแนกความแตกต่างระหว่างโลหะมีค่า และสัญญาฟิวเจอร์สอ้างอิงโลหะมีค่า
2. เพื่อให้สามารถอธิบายปัจจัยที่มีผลกระทบต่อราคาสัญญาฟิวเจอร์สอ้างอิงโลหะมีค่า
3. เพื่อให้สามารถอธิบายแนวคิดในทฤษฎีราคาตราสารอนุพันธ์ได้ ได้แก่ แนวคิดอาบิทราจ และกฎแห่งราคาเดียว
4. เพื่อให้สามารถอธิบาย แนวคิดการประเมินราคาสัญญาฟิวเจอร์ส ได้แก่ การบรรจุของราคาแบบจำลองต้นทุนการถือครอง
5. เพื่อให้สามารถคำนวณประเมินราคาสัญญาฟิวเจอร์ส ได้แก่ การบรรจุของราคาแบบจำลองต้นทุนการถือครอง
6. เพื่อให้สามารถอธิบายแนวคิดประเมินราคาสัญญาฟิวเจอร์สอ้างอิงโลหะมีค่า
7. เพื่อให้สามารถคำนวณหาราคาสัญญาฟิวเจอร์สของสัญญาฟิวเจอร์สอ้างอิงโลหะมีค่า
8. เพื่อให้สามารถคำนวณผลตอบแทน ความเสี่ยง ของกลยุทธ์การซื้อขายสัญญาฟิวเจอร์สอ้างอิงโลหะมีค่าได้แก่ การซื้อขายฟิวเจอร์สเพื่อการถ่วงความเสี่ยง การซื้อขายฟิวเจอร์สเพื่อการเก็งกำไร และการซื้อขายฟิวเจอร์สเพื่อการทำอาบิทราจ

3.2 กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับกองทุนรวมโลหะมีค่าและสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับโลหะมีค่า

1. แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับตลาดอนุพันธ์ TFEX

หนังสือประกอบการเรียนรู้ :

1. เอกสารเพิ่มเติม การซื้อขายสัญญาฟิวเจอร์สอ้างอิงโลหะมีค่าในตลาดอนุพันธ์ TFEX (สามารถDownloadได้ที่ www.tsi-thailand.org)

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายลักษณะของสัญญาของ Gold Futures และ Silver Futures
2. เพื่อให้สามารถคำนวณ Multiplier, Tick Size และ Position Limit

2. การชำระราคาและวางหลักประกันของสำนักหักบัญชี TCH

หนังสือประกอบการเรียนรู้ :

1. เอกสารเพิ่มเติม การชำระราคาและวางหลักประกันสัญญาฟิวเจอร์สอ้างอิงโลหะมีค่าของสำนักหักบัญชี TCH(สามารถDownloadได้ที่ www.tsi-thailand.org)

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

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

3. พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

หนังสือประกอบการเรียนรู้ :

1.แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)

- บทที่ 2 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และประกาศที่เกี่ยวข้อง

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายขอบเขตของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
2. เพื่อให้สามารถอธิบายเป้าหมาย และโครงสร้างการกำกับดูแล ของพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

4. หลักเกณฑ์การประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

หนังสือประกอบการเรียนรู้ :

1.แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)

- บทที่ 2 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และประกาศที่เกี่ยวข้อง

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายหลักเกณฑ์การประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทต่าง ๆ
2. เพื่อให้สามารถอธิบายประเภทของธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า การอนุญาต และหลักเกณฑ์ในการประกอบธุรกิจการซื้อขายสัญญาล่วงหน้า ตามพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

5. มาตรฐานการปฏิบัติงานของผู้ติดต่อกับผู้ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

หนังสือประกอบการเรียนรู้ :

1. แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)

- บทที่ 2 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และประกาศที่เกี่ยวข้อง

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายมาตรฐานการปฏิบัติงานของผู้ติดต่อกับผู้ลงทุนในธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และการกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

6. การกระทำอันไม่เป็นธรรมเกี่ยวกับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

หนังสือประกอบการเรียนรู้ :

แนวทางปฏิบัติเกี่ยวกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)

- บทที่ 2 พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และประกาศที่เกี่ยวข้อง

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้สามารถอธิบายมาตรการป้องกันการกระทำอันส่งผลกระทบต่อความมั่นคงและความเชื่อมั่นของตลาดทุน ตลอดจนไม่ให้ความร่วมมือในการใช้ตลาดทุนเป็นช่องทางในการกระทำผิดกฎหมาย

7. หลักเกณฑ์และวิธีการซื้อขายกองทุนรวม

หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. ตลาดการเงินและการลงทุนในหลักทรัพย์
 - บทที่ 12 กองทุนรวมและหน่วยลงทุน
 - ข้อกำหนดด้านการลงทุน (หน้า 534-537)
 - ค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการบริหารกองทุน (หน้า 539-540)
 - มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของสมาคมบริษัทจัดการลงทุน (หน้า 597-598)
 - ขั้นตอนการลงทุนในกองทุนรวม (หน้า 610-612)

วัตถุประสงค์การเรียนรู้

1. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายขั้นตอนการลงทุนในกองทุนรวม
2. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับราคาเสนอซื้อและราคาเสนอขายหน่วยลงทุน
3. เพื่อให้เข้าใจข้อกำหนด เงื่อนไขและข้อจำกัดด้านการลงทุนของกองทุนรวมที่ออกโดยหน่วยงานกำกับดูแลต่างๆ
4. เพื่อให้เข้าใจเกณฑ์มาตรฐานการวัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวมแต่ละนโยบายการลงทุนตามเกณฑ์อ้างอิงที่สมาคมบริษัทหลักทรัพย์จัดการลงทุนกำหนด
5. เพื่อให้เข้าใจค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการบริหารกองทุนรวม
