

Paper 7

หลักสูตรเพิ่มความรู้กรรมด้านตราสารหนี้ (สำหรับผู้แนะนำฯด้านตราสารทุน,ด้านกองทุน,ด้านสัญญาฯ)

ศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน
เมษายน 2555

หลักสูตรเพิ่มความรู้กรรมการด้านตราสารหนี้
(สำหรับผู้แนะนำด้านตราสารทุน,ด้านกองทุน,ด้านสัญญาฯ)

ลักษณะข้อสอบ : ข้อสอบแบบตัวเลือก (Multiple Choice) โดยแต่ละข้อมี 4 ตัวเลือก

จำนวนข้อสอบ : ข้อสอบ 1 ชุด มี 40 ข้อ

ระยะเวลา : ให้ความทำข้อสอบ 1 ชั่วโมง

หลักเกณฑ์การผ่านการทดสอบ : 70 %

รายละเอียดหลักสูตร	จำนวนข้อสอบ
หมวดที่ 3 ความรู้เกี่ยวกับหลักทรัพย์ กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับหลักทรัพย์ (เฉพาะความรู้เกี่ยวกับตราสารหนี้ รวมทั้ง กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับตราสารหนี้)	40
3.1 ความรู้เกี่ยวกับตราสารหนี้	35
3.1.1 ตลาดตราสารหนี้	10
3.1.2 ตราสารหนี้	25
3.2 กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับตราสารหนี้	5
3.2.1 หลักเกณฑ์และวิธีการซื้อขายตราสารหนี้	5
	40

หลักสูตรเพิ่มความรู้ด้านตราสารหนี้
(สำหรับผู้แนะนำด้านตราสารทุน, ด้านกองทุน, ด้านสัญญาฯ)

หมวดที่ 3

ความรู้เกี่ยวกับหลักทรัพย์ กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับหลักทรัพย์

หมวดที่ 3.1 ความรู้เกี่ยวกับหลักทรัพย์

1. ตลาดตราสารหนี้

หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. ตลาดการเงินและการลงทุนในหลักทรัพย์
 - บทที่ 3 ตลาดตราสารหนี้

วัตถุประสงค์การเรียนรู้

1. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับบทบาทของตลาดตราสารหนี้ที่มีต่อระบบเศรษฐกิจทั้งด้านการระดมทุนและการลงทุน
2. เพื่อให้เข้าใจถึงประโยชน์ของตลาดตราสารหนี้ที่ครอบคลุมถึงประโยชน์ต่อระบบเศรษฐกิจของประเทศ ประโยชน์ต่อผู้ออกตราสารหนี้และประโยชน์ต่อผู้ลงทุน
3. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับกระบวนการออกตราสารหนี้ในตลาดแรกทั้งในส่วนของ พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรรัฐวิสาหกิจและหุ้นกู้ภาคเอกชน
4. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับการซื้อขายในตลาดรองของตราสารหนี้ รวมถึงเข้าใจบทบาทหน้าที่ของตลาดตราสารหนี้(BEX) และสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (Thai BMA)
5. เพื่อให้เข้าใจถึงบทบาทและหน้าที่ของผู้ที่มีส่วนเกี่ยวข้องในตลาดตราสารหนี้
6. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับการลงทุนในตลาดตราสารหนี้ทั้งในตลาดแรก ตลาดรองและทางอ้อม
7. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับการจองซื้อและการยื่นประมูลพันธบัตรรัฐบาล

2. ตราสารหนี้

หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. ตลาดการเงินและการลงทุนในหลักทรัพย์

- บทที่ 11 ตราสารหนี้

วัตถุประสงค์การเรียนรู้

1. เพื่อให้เข้าใจองค์ประกอบของตราสารหนี้และสามารถอธิบายถึงผลกระทบขององค์ประกอบตราสารหนี้ที่มีต่อราคาตราสารหนี้ได้
2. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายลักษณะของตราสารหนี้ที่ถูกแบ่งตามลักษณะต่าง ๆ ได้
3. เพื่อให้เข้าใจและสามารถประยุกต์ใช้ อัตราดอกเบี้ยสูงสุด (Cap) และอัตราดอกเบี้ยต่ำสุด (Floor) จากการลงทุนในตราสารหนี้ได้
4. เพื่อให้เข้าใจประเภทผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้และสามารถอธิบายหลักการพื้นฐานในการประเมินมูลค่าตราสารหนี้ได้
5. เพื่อให้สามารถประเมินมูลค่าตราสารหนี้แบบต่างๆ ได้
6. เพื่อให้สามารถอธิบายและคำนวณ Gross Price และ Clean Price ได้
7. เพื่อให้เข้าใจความหมายของค่าดูเรชัน ปัจจัยที่ส่งผลกระทบและข้อจำกัดของการใช้ค่าดูเรชัน
8. เพื่อให้สามารถประยุกต์ใช้ค่าดูเรชันและคอนเวกซิตีสำหรับการประเมินมูลค่าตราสารหนี้ได้
9. เพื่อให้สามารถอธิบายและคำนวณอัตราผลตอบแทนแบบต่างๆ ของตราสารหนี้ได้
10. เพื่อให้สามารถอธิบายลักษณะเส้นอัตราผลตอบแทนแบบต่างๆ รวมถึงประโยชน์ของเส้นอัตราผลตอบแทนได้
11. เพื่อให้สามารถอธิบายถึงปัจจัยที่ส่งผลกระทบต่อมูลค่าและผลตอบแทนของตราสารหนี้ได้
12. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับความสัมพันธ์ระหว่างราคาและอัตราผลตอบแทนของตราสารหนี้แบบต่างๆ
13. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับความเสี่ยงประเภทต่างๆ ของการลงทุนในตราสารหนี้
14. เพื่อให้เข้าใจแนวคิดการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ และสัญลักษณ์ที่ใช้ในการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของตราสารหนี้ รวมทั้งมีความเข้าใจถึงที่มาของสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือในประเทศไทย
15. เพื่อให้สามารถอธิบายและคำนวณอัตราส่วนที่แสดงความน่าเชื่อถือของตราสารหนี้ได้
16. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับการภาวการณ์จากการลงทุนในตราสารหนี้ตามประเภทของผู้ลงทุน

หมวดที่ 3.2 กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับหลักทรัพย์

1. หลักเกณฑ์และวิธีการซื้อขายตราสารหนี้

หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. ตลาดการเงินและการลงทุนในหลักทรัพย์
 - บทที่ 3 ตลาดตราสารหนี้
 - หลักเกณฑ์และวิธีการซื้อ/ขายตราสารหนี้ (หน้า 141-144)
2. เอกสารเผยแพร่ความรู้เรื่องตราสารหนี้ชุดที่ 5 BUY BOND BEX (สามารถ Download ได้ที่ www.tsi-thailand.org)
3. เอกสารเพิ่มเติม “รู้จักตราสารหนี้” (สามารถ Download ได้ที่ www.tsi-thailand.org)

วัตถุประสงค์การเรียนรู้

1. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับระบบและวิธีการซื้อขายตราสารหนี้ของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
2. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับขั้นตอนในการซื้อขาย ครอบคลุมตั้งแต่การเปิดบัญชี การส่งคำสั่งซื้อขาย การชำระราคาและส่งมอบของตลาดตราสารหนี้ (BEX)
3. เพื่อให้เข้าใจถึงระบบการซื้อขาย วิธีการซื้อขายและหลักเกณฑ์การซื้อขายของตลาดตราสารหนี้ (BEX)
4. เพื่อให้สามารถอธิบายสัญลักษณ์ที่แสดงชื่อของตราสารหนี้ที่ซื้อขายในตลาดตราสารหนี้ (BEX) ได้
5. เพื่อให้เข้าใจวัตถุประสงค์และความหมายของเครื่องหมายการให้สิทธิประโยชน์และการกำกับดูแลการซื้อขายตราสารหนี้
