

Paper 8

หลักสูตรเพิ่มธุรกรรมด้านกองทุน (สำหรับผู้แนะนำด้านตราสารทุน, ด้านตราสารหนี้, ด้านสัญญาฯ)

ศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน
เมษายน 2555

หลักสูตรเพิ่มความรู้ด้านกองทุน
(สำหรับผู้แนะนำด้านตราสารทุน, ด้านตราสารหนี้, ด้านสัญญาฯ)

ลักษณะข้อสอบ : ข้อสอบแบบตัวเลือก (Multiple Choice) โดยแต่ละข้อมี 4 ตัวเลือก

จำนวนข้อสอบ : ข้อสอบ 1 ชุด มี 40 ข้อ

ระยะเวลา : ให้อเวลาทำข้อสอบ 1 ชั่วโมง

หลักเกณฑ์การผ่านการทดสอบ : 70 %

รายละเอียดหลักสูตร	จำนวนข้อสอบ
หมวดที่ 3 ความรู้เกี่ยวกับหลักทรัพย์ กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับหลักทรัพย์ (เฉพาะความรู้เกี่ยวกับกองทุน รวมทั้ง กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับกองทุน)	40
3.1 ความรู้เกี่ยวกับกองทุน	35
3.1.1 กองทุนรวมและหน่วยลงทุน	35
3.2 กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับกองทุน	5
3.2.1 หลักเกณฑ์และวิธีการซื้อขายกองทุน	5
	40

หลักสูตรเพิ่มความรู้ด้านกองทุน
(สำหรับผู้นำด้านตราสารทุน, ด้านตราสารหนี้, ด้านสัญญาฯ)

หมวดที่ 3

ความรู้เกี่ยวกับหลักทรัพย์ กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับหลักทรัพย์

หมวดที่ 3.1 ความรู้เกี่ยวกับหลักทรัพย์

1. กองทุนรวมและหน่วยลงทุน

หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)

1. ตลาดการเงินและการลงทุนในหลักทรัพย์
 - บทที่ 12 กองทุนรวมและหน่วยลงทุน

วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

1. เพื่อให้เข้าใจความหมายของกองทุนรวม (mutual fund) และสามารถอธิบายได้ถึงวิธีประกอบกองทุนรวม
2. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายได้เกี่ยวกับข้อดีและข้อจำกัดของการลงทุนในกองทุนรวม
3. เพื่อให้เข้าใจบทบาทและความสำคัญของผู้ที่มีส่วนร่วมในการบริหารจัดการกองทุนรวม
4. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายถึงข้อกำหนด เงื่อนไขและข้อจำกัดด้านการลงทุนของกองทุนรวมแต่ละประเภท
5. เพื่อให้เข้าใจลักษณะการลงทุนของกองทุนรวม ตลอดจนค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการบริหารกองทุน
6. เพื่อให้เข้าใจและสามารถแบ่งประเภท (classify) ของกองทุนรวมโดยใช้เกณฑ์ในการแบ่งประเภทที่สำคัญได้แก่ 1) แบ่งตามประเภทของค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหน่วยลงทุน 2) แบ่งตามประเภทของการขายคืนหน่วยลงทุน 3) แบ่งตามประเภทของนโยบายการลงทุน และ 4) แบ่งตามแหล่งที่มาและแหล่งที่นำเงินไปลงทุน
7. เพื่อให้เข้าใจถึงรายละเอียดทั่วไปของกองทุนรวม รวมถึงปัจจัยที่มีผลกระทบต่อมูลค่าของกองทุนรวม
8. เพื่อให้เข้าใจแนวคิดของการกำหนดราคาหน่วยลงทุนของกองทุนรวม (Net Asset Value: NAV)
9. เพื่อให้สามารถอธิบายได้ถึงสิทธิประโยชน์ทางภาษีของกองทุนรวมและผู้ลงทุนในกองทุนรวม
10. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายได้เกี่ยวกับผลตอบแทนของการลงทุนในกองทุนรวมและความเสี่ยงจากการลงทุนในกองทุนรวม
11. เพื่อให้เข้าใจปัจจัยที่ควรพิจารณาก่อนการลงทุนในกองทุนรวม ขั้นตอนการลงทุนในกองทุนรวม กลยุทธ์การลงทุนในกองทุนรวม
12. เพื่อให้สามารถแนะนำการลงทุนในกองทุนรวมที่เหมาะสมให้แก่ผู้รับคำปรึกษา โดยพิจารณาจากวัตถุประสงค์และเป้าหมายในการลงทุน (investment objectives), ความสามารถในการรับความเสี่ยง (risk tolerance) และข้อจำกัดในการลงทุน (investment constraints) ของผู้รับคำปรึกษาแต่ละราย
13. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายได้ถึงนโยบายการลงทุนของกองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ (retirement mutual fund: RMF) และกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (long-term equity fund: LTF)

14. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายได้ถึงเงื่อนไขการลงทุน และสิทธิประโยชน์ทางภาษีจากการลงทุนในกองทุน RMF และกองทุนรวม LTF
15. เพื่อให้สามารถแนะนำได้ว่าการลงทุนในกองทุนรวม RMF และกองทุนรวม LTF เหมาะกับผู้ลงทุนประเภทใด และมีข้อดีและข้อควรระวังในการลงทุนอย่างไร
16. เพื่อให้สามารถเปรียบเทียบการลงทุนในกองทุนรวม RMF และกองทุนรวม LTF
17. เพื่อให้เข้าใจความหมาย วัตถุประสงค์ ส่วนประกอบของกองทุน สถานะของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ตลอดจนข้อบังคับของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
18. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายถึงผลตอบแทนและสิทธิประโยชน์ทางภาษีของการลงทุนในกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
19. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายได้ถึงนโยบายการลงทุนของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
20. เพื่อให้เข้าใจข้อดีและข้อเสียของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
21. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายได้ถึงความหมายของกองทุนส่วนบุคคล (private fund) รวมถึงโครงสร้างของกองทุนส่วนบุคคล
22. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายได้ถึงข้อดีและข้อเสียของการลงทุนในกองทุนส่วนบุคคล
23. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายได้ถึงผลตอบแทนและสิทธิประโยชน์ทางภาษีของการลงทุนในกองทุนส่วนบุคคล
24. เพื่อให้เข้าใจลักษณะการลงทุนของกองทุน Hedge Fund
25. เพื่อให้เข้าใจความแตกต่างระหว่างกองทุน Hedge Fund กับกองทุนรวมทั่วไป
26. เพื่อให้เข้าใจเกี่ยวกับกลยุทธ์การลงทุนของกองทุน Hedge Fund และความเสี่ยงของกองทุน Hedge Fund
27. เพื่อให้รู้และเข้าใจลักษณะ ประเภท และโครงสร้างของกองทุน ETF (Exchange Traded Fund: ETF)
28. เพื่อให้เข้าใจลักษณะของผลตอบแทนและความเสี่ยงของกองทุน ETF
29. เพื่อให้สามารถประยุกต์ใช้ประโยชน์ของกองทุน ETF ในการลงทุนได้อย่างเหมาะสม
30. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายได้ถึงลักษณะและรูปแบบการลงทุนของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ (property fund)
31. เพื่อให้เข้าใจนโยบาย ประเภท และข้อจำกัดของกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์
32. เพื่อให้เข้าใจถึงลักษณะของผลตอบแทนและความเสี่ยงของการลงทุนในกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์
33. เพื่อให้สามารถแนะนำได้ว่าการลงทุนในกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์เหมาะกับผู้ลงทุนประเภทใด
34. เพื่อให้เข้าใจลักษณะและรูปแบบการลงทุนของกองทุนรวมทองคำ
35. เพื่อให้เข้าใจลักษณะของผลตอบแทนและความเสี่ยงของกองทุนรวมทองคำ
36. เพื่อให้เข้าใจถึงแนวทางการวิเคราะห์การลงทุนในกองทุนรวมทองคำ
37. เพื่อให้เข้าใจถึงความสำคัญของการวัดและประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวม
38. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายได้ถึงกระบวนการในการวัดและประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวม
39. เพื่อให้เข้าใจและสามารถอธิบายได้ถึงความสำคัญของการวัดและประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวม โดยใช้วิธี Risk-Adjusted Return
40. เพื่อให้สามารถคำนวณ วัดและประเมินผลการดำเนินงานของกองทุนรวม โดยใช้มาตรวัดตามตัวแบบของ Sharpe (Sharpe's Ratio), มาตรวัดตามตัวแบบของ Treynor (Treynor's Ratio), มาตรวัดตามตัวแบบของ Jensen (Jensen Measure) และมาตรวัดแบบ Information Ratio

หมวดที่ 3.2 กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานเกี่ยวกับหลักทรัพย์

1. 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
