

คู่มือการทดสอบหลักสูตร  
ความรู้เกี่ยวกับตราสารที่มีความซับซ้อน  
: ตราสารหนี้ และ กองทุนรวม

**Complex Products : Bond and Mutual Fund (P2)**

สำหรับ

- ใช้ประกอบการขึ้นทะเบียนเป็น “ผู้แนะนำการลงทุนตราสารซับซ้อนประเภท 2”  
หรือ
- ใช้ประกอบการขึ้นทะเบียนเป็น “ผู้แนะนำการลงทุนตราสารซับซ้อนประเภท 1”

ฝ่ายพัฒนาความรู้ผู้ประกอบการวิชาชีพ  
ศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน

**Version 1 : 15 พฤศจิกายน 2560**

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : P2
Date issued : November 2017	Version No. : 1
Related documents : -	

**หลักสูตรความรู้เกี่ยวกับตราสารที่มีความซับซ้อน : ตราสารหนี้ และ กองทุนรวม**

ลักษณะข้อสอบ : ข้อสอบแบบตัวเลือก (Multiple Choice) โดยแต่ละข้อมี 4 ตัวเลือก

จำนวนข้อสอบ : ข้อสอบ 1 ชุด มี 25 ข้อ

ระยะเวลา : ให้ความเวลาทำข้อสอบ 40 นาที

อัตราค่าธรรมเนียมสอบ : ข้อสอบภาษาไทย 850 บาท

หลักเกณฑ์การผ่านการทดสอบ : 70 % ของคะแนนรวม

รายละเอียดหลักสูตร	จำนวนข้อสอบ
<b>ความรู้เกี่ยวกับตราสารที่มีความซับซ้อน : ตราสารหนี้และกองทุนรวม</b>	<b><u>25</u></b>
1. ตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน	10
2. กองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน	10
3. การให้คำแนะนำการลงทุนในตราสารหนี้และกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน	5

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : P2
Date issued : November 2017	Version No. : 1
Related documents : -	

## ความรู้เกี่ยวกับตราสารที่มีความซับซ้อน : ตราสารหนี้และกองทุนรวม

### หนังสืออ่านประกอบ (Required Readings)



### “ความรู้เกี่ยวกับผลิตภัณฑ์ตลาดทุน : ตราสารที่มีความซับซ้อน (ตราสารหนี้และกองทุนรวม)”

#### บทที่ 1: ตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน

##### วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :

- 1.1 อธิบายและจำแนกลักษณะของตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนอันเนื่องมาจากการมีลักษณะคล้ายตราสารทุน มีอนุพันธ์แฝง และมีความเสี่ยงสูงจากการไม่ได้จัดอันดับเครดิตหรือมีอันดับเครดิตต่ำกว่าระดับที่สามารถลงทุน
- 1.2 จำแนกความแตกต่างของตราสารหนี้ทั่วไปกับตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน
- 1.3 อธิบายรูปแบบผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนแต่ละประเภท
- 1.4 คำนวณหาผลตอบแทน (payoff) จากการลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนแต่ละประเภท
- 1.5 อธิบายประเภทความเสี่ยงของตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนแต่ละประเภท
- 1.6 เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนและความเสี่ยงจากการลงทุนในตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนแต่ละประเภท
- 1.7 เปรียบเทียบลักษณะของตราสารหนี้ทั่วไปกับตราสารหนี้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- 1.8 ระบุความแตกต่างระหว่างหุ้นกู้อนุพันธ์กับตราสารหนี้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทอื่นๆ ได้
- 1.9 วิเคราะห์ผลตอบแทนและเงินต้นที่คาดว่าจะได้รับคืนจากการลงทุนในตราสารหนี้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละประเภท
- 1.10 อธิบายความหมายและสามารถตีความอันดับเครดิตแต่ละอันดับ
- 1.11 อธิบายและตีความของ credit spread ของการลงทุนในตราสารหนี้
- 1.12 เปรียบเทียบผลกระทบที่มีต่อราคาตราสารหนี้โดยลิตทิกกับราคาตราสารหนี้ทั่วไปเมื่ออัตราดอกเบี้ยตลาดเปลี่ยน
- 1.13 ตีความระดับการยอมรับความเสี่ยงของผู้ลงทุน เพื่อเลือกตราสารหนี้ที่เหมาะสมได้

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : P2
Date issued : November 2017	Version No. : 1
Related documents : -	

**บทที่ 2: กองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน**

**วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :**

- 2.1 อธิบายลักษณะพื้นฐานของกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนแต่ละประเภท
- 2.2 จำแนกประเภทของกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน
- 2.3 อธิบายลักษณะพื้นฐาน ผลตอบแทนและความเสี่ยงของตราสารและผลิตภัณฑ์การลงทุนที่อยู่ในขอบเขตการลงทุนของกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนสามารถลงทุนได้
- 2.4 กำหนดหาอัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน
- 2.5 อธิบายและจำแนกประเภทความเสี่ยงของกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนแต่ละประเภท
- 2.6 ให้คำแนะนำในกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนให้สอดคล้องกับวัตถุประสงค์การลงทุนของผู้ลงทุน
- 2.7 อธิบายประโยชน์ ข้อจำกัด และข้อควรพิจารณาของการลงทุนในกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนแต่ละประเภท

**บทที่ 3: การให้คำแนะนำการลงทุนในตราสารหนี้และกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน**

**วัตถุประสงค์การเรียนรู้ :**

- 3.1 อธิบายแนวทางการให้คำแนะนำลงทุนในตราสารหนี้และกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน
- 3.2 อธิบายกระบวนการให้คำแนะนำการลงทุนในตราสารหนี้และกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อนให้กับผู้ลงทุนได้
- 3.3 อธิบายช่องทางการลงทุนและแหล่งข้อมูลที่ใช้ประกอบการตัดสินใจลงทุน
- 3.4 ประยุกต์ใช้แนวปฏิบัติในการให้คำแนะนำการลงทุนในตราสารหนี้และกองทุนรวมที่มีความเสี่ยงสูงหรือมีความซับซ้อน

\*\*\*\*\*

Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : P2
Date issued : November 2017	Version No. : 1
Related documents : -	

### ช่องทางการซื้อตำรา

- INVESTORY Shop อาคารตลาดหลักทรัพย์ฯ (ข้างสถานทูตจีน) ชั้นใต้ดิน อาคาร B (เปิดทำการทุกวันจันทร์)
- สั่งซื้อในรูปแบบ E-book ผ่าน <https://www.set.or.th/setbook>
- ศูนย์หนังสือแห่งจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย ติดต่อสอบถามข้อมูลและบริการต่างๆ ได้ที่  
โทรศัพท์ 0-2218-9891 , 0-2218-9879 Email : [info@cubook.chula.ac.th](mailto:info@cubook.chula.ac.th) , [customer@cubook.chula.ac.th](mailto:customer@cubook.chula.ac.th)
- สั่งซื้อผ่านร้านหนังสือ SE-ED Book Center ทุกสาขา (โดยมีระยะเวลาในการรับสินค้าเป็นไปตามที่แต่ละสาขา กำหนด)

### ช่องทางการสมัครสอบ



ศูนย์ความรู้วิชาชีพทางการเงิน สมาคมบริษัทจัดการลงทุน

Website : <http://www.aimc.or.th>

Phone: 0-2264-0900 ต่อ 1

E-mail : [aimc@ksc.th.com](mailto:aimc@ksc.th.com), [contact@aimc.or.th](mailto:contact@aimc.or.th)

ที่อยู่ : อาคารชุดเลอกรีชดาออฟฟิศคอมเพล็กซ์ 2 ชั้น 3 ถ.รัชดาภิเษก คลองเตย กทม.10110



ศูนย์ทดสอบความรู้ ศูนย์ฝึกอบรม สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

Website : <http://www.ati-asco.org>

Phone : 02-264-0909 ต่อ 203,204

Email : [Examination@ati-asco.org](mailto:Examination@ati-asco.org)

ที่อยู่ : อาคารชุดเลอกรีชดาออฟฟิศคอมเพล็กซ์ 2 ชั้น 2 ถ.รัชดาภิเษก คลองเตย กทม. 10110



Document title : SD-EXAM-TSI	Paper No. : P2
Date issued : November 2017	Version No. : 1
Related documents : -	

## แนวทางการขึ้นทะเบียน

