

ภาคผนวก 1

[แนบท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 87/2558 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติม
โดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทน. 20/2569 (ฉบับที่ 37)]

คำศัพท์

ส่วนที่ 1: ขอบเขต

ให้ใช้คำอธิบายคำศัพท์ตามภาคผนวกนี้เพื่อประกอบการอธิบายคำย่อและความหมายของคำย่อ
รวมถึงคำศัพท์ที่ปรากฏในภาคผนวกท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการลงทุนของกองทุน

ส่วนที่ 2: คำอธิบายศัพท์

คำศัพท์

“กระดานหลัก”

“กระดาน mai”

“กลุ่มกิจการ”

“กองทุนฟื้นฟู”

“กองทุนรวม
พันธบัตรเอเชีย”

“กองทุน AI”

คำอธิบายศัพท์

กระดานซื้อขายหลักทรัพย์ของ SET ซึ่งไม่รวมถึงกระดานซื้อขาย
ที่เป็นตลาดหลักทรัพย์เอ็มเอไอ (mai) และตลาดหลักทรัพย์
ไลฟ์เอ็กซ์เชนจ์ (LIVEx)

กระดานซื้อขายหลักทรัพย์ของ SET ที่เป็นตลาดหลักทรัพย์
เอ็มเอไอ (mai)

บริษัทใหญ่และบริษัทย่อยตามมาตรฐานการบัญชีที่สภาวิชาชีพ
บัญชีกำหนดให้จัดทำงบการเงินรวม

กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาระบบสถาบันการเงินตามกฎหมาย
ว่าด้วยธนาคารแห่งประเทศไทย

กองทุนรวมอีทีเอฟที่สร้างขึ้นเพื่อส่งเสริมการพัฒนาตลาดพันธบัตร
สกุลเงินท้องถิ่นในภูมิภาคตามโครงการจัดตั้งกองทุนพันธบัตร
เอเชียระยะที่สอง (Asian Bond Fund 2) ตามมติของที่ประชุม
กลุ่มธนาคารกลางสมาชิก Executives Meeting of East Asia
and Pacific Central Banks (EMEAP)

กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย (Accredited Investor
Mutual Fund)

คำศัพท์

“กองทุน buy & hold”

คำอธิบายศัพท์

กองทุนรวมที่มุ่งเน้นลงทุนเพียงครั้งเดียวโดยถือทรัพย์สินที่ลงทุนไว้จนครบกำหนดอายุของทรัพย์สิน หรือครบอายุของรอบการลงทุนของกองทุนรวม หรือครบอายุของกองทุนรวม

“กองทุน CIS
ต่างประเทศ”

กองทุนที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศซึ่งมีลักษณะเป็นโครงการลงทุนแบบกลุ่ม (collective investment scheme) ทั้งนี้ ไม่ว่ากองทุนดังกล่าวจะจัดตั้งในรูปบริษัท ทรัสต์ หรือรูปอื่นใด แต่ไม่รวมถึงกองทุน property กองทุน infra กองทุน private equity ที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศ

“กองทุน Crypto ETF”

กองทุนอย่างใดอย่างหนึ่ง ดังต่อไปนี้

1. กองทุนรวมคริปโทอีทีเอฟซึ่งจัดตั้งขึ้นในประเทศไทย
2. กองทุน ETF ต่างประเทศที่มีคริปโทเคอร์เรนซีเป็นสินทรัพย์อ้างอิงในการลงทุน

“กองทุน daily-fixed
income”

กองทุนรวมตราสารหนี้ที่เปิดรับซื้อคืนหน่วยลงทุนทุกวันทำการ

“กองทุน ETF
ต่างประเทศ”

กองทุน exchange traded fund ที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศ

“กองทุน infra”

รูปแบบการลงทุนในทรัพย์สินที่เกี่ยวข้องกับโครงสร้างพื้นฐานของประเทศต่าง ๆ ซึ่งได้แก่

1. กองทุนโครงสร้างพื้นฐานที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ หรือตามกฎหมายว่าด้วยทรัสต์เพื่อธุรกรรมในตลาดทุน
2. กองทุนโครงสร้างพื้นฐานต่างประเทศที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศซึ่งมีวัตถุประสงค์หลักในการลงทุนในลักษณะทำนองเดียวกับกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐานตาม 1. ทั้งนี้ ไม่ว่ากองทุนโครงสร้างพื้นฐานดังกล่าวจะจัดตั้งในรูปบริษัท ทรัสต์ หรือรูปอื่นใด

คำศัพท์

“กองทุน private equity”

คำอธิบายศัพท์

กิจการเงินร่วมลงทุน (private equity) ที่อาจจัดตั้งขึ้นในรูปของบริษัท ทรัสต์ หรือรูปแบบอื่นใด และมีลักษณะของกิจการอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้

1. กิจการเงินร่วมลงทุนที่กำหนดไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการจัดการเงินทุนของกิจการเงินร่วมลงทุนที่ไม่ถือเป็นการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนส่วนบุคคล
2. กิจการเงินร่วมลงทุนตามกฎหมายต่างประเทศที่มีลักษณะครบถ้วนดังนี้
 - (ก) มีวัตถุประสงค์เพื่อการลงทุนร่วมกันของผู้ลงทุนตั้งแต่ 2 รายขึ้นไป ทั้งนี้ ต้องมิได้เป็นไปเพื่อแสวงหาประโยชน์จากการจัดการทรัพย์สินส่วนตัวของบุคคลใดหรือกลุ่มบุคคลใดเป็นการเฉพาะ
 - (ข) มีการมอบหมายให้บุคคลหนึ่งบุคคลใดเป็นผู้จัดการเงินทุนและทรัพย์สินที่เกิดจากเงินทุน
 - (ค) มีนโยบายการลงทุนในกิจการอื่นผ่านการเข้าทำสัญญาการลงทุนในหุ้นหรือการสนับสนุนทางการเงินที่ก่อให้เกิดสิทธิในการได้มาซึ่งหุ้นของกิจการนั้นในภายหลัง โดยมีส่วนในการกำกับดูแลแผนธุรกิจ การดำเนินงานหรือการปรับปรุงการดำเนินงาน หรือการดำเนินการอื่นใดในลักษณะที่สะท้อนถึงการมีบทบาทต่อการดำเนินธุรกิจของกิจการดังกล่าว

“กองทุน property”

กองทรัพย์สินที่เกี่ยวข้องกับอสังหาริมทรัพย์ซึ่งอยู่ในรูปแบบอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้

1. กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ที่อยู่ภายใต้บังคับประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์การจัดการกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์

คำศัพท์**คำอธิบายศัพท์**

	2. ทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายว่าด้วยทรัสต์เพื่อธุรกรรมในตลาดทุน 3. foreign REIT
“กองทุน Thai ESG”	กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืน (Thailand ESG Fund)
“กองทุน Thai ESGX”	กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษ (Thailand ESG Extra Fund)
“กองทุน UI”	กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ (Ultra Accredited Investor Mutual Fund)
“การลดความเสี่ยง”	การลดความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการลงทุนโดยการเข้าเป็นคู่สัญญาใน derivatives ที่มีลักษณะครบถ้วนดังนี้ 1. ไม่มีวัตถุประสงค์เพื่อหาผลประโยชน์โดยการเก็งกำไร (speculate) 2. มีผลให้ความเสี่ยงในการลงทุนโดยรวมของกองทุนลดลง 3. เป็นการลดความเสี่ยงทั่วไปและความเสี่ยงเฉพาะของทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยง 4. สามารถลดความเสี่ยงได้อย่างมีประสิทธิภาพ
“โครงการ”	โครงการจัดการกองทุนรวม
“เงินฝากหรือ ตราสารเทียบเท่า เงินฝาก”	ทรัพย์สินดังนี้ 1. เงินฝาก เงินฝากอิสลามหรือตราสารอื่นที่มีลักษณะทำนองเดียวกับเงินฝาก 2. สลากออมทรัพย์ที่ออกตามกฎหมายว่าด้วยธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร 3. สลากออมสินพิเศษที่ออกตามกฎหมายว่าด้วยธนาคารออมสิน

คำศัพท์**คำอธิบายศัพท์**

4. สลากออมทรัพย์ที่ออกตามกฎหมายว่าด้วยธนาคาร
อาคารสงเคราะห์

“เงินฝากอิสลาม”

ข้อตกลงที่เป็นไปตามหลักชะรีอะฮ์ (Shariah) และมีลักษณะ
ที่เทียบเคียงได้กับเงินฝาก โดยคู่สัญญาที่เทียบเคียงได้กับผู้ฝาก
สามารถเรียกคืนเงินต้นจากคู่สัญญาฝ่ายที่เทียบเคียงได้กับ
ผู้รับฝากได้เต็มจำนวน ณ เวลาใด ๆ

“ดัชนีกลุ่มสินค้า
โภคภัณฑ์”

ดัชนีที่มีองค์ประกอบเป็นสินค้าโภคภัณฑ์หลายชนิด

“ดัชนีเงินเฟ้อ”

ดัชนีที่จัดทำขึ้นโดยมีวัตถุประสงค์เพื่อสะท้อนอัตราเงินเฟ้อ

“ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน”

ตราสารทางการเงินที่มีเงื่อนไขให้แปลงสภาพเป็นหุ้นได้

“ตราสารภาครัฐไทย”

ตราสารดังนี้

1. ตั๋วเงินคลัง
2. พันธบัตรรัฐบาล หรือพันธบัตร ธปท.
3. พันธบัตร B/E P/N สุญก หรือหุ้นกู้ ที่กระทรวงการคลังหรือ
กองทุนฟื้นฟูเป็นผู้มีภาระผูกพัน

“ตราสารภาครัฐ
ต่างประเทศ”

ตราสารที่มีรูปแบบทำนองเดียวกับตราสารภาครัฐไทย
ที่รัฐบาลต่างประเทศ กระทรวงการคลัง ธนาคารกลาง หรือ
หน่วยงานของรัฐบาลต่างประเทศ หรือองค์การระหว่างประเทศ
เป็นผู้ออกหรือผู้ค้ำประกัน แต่ไม่รวมถึงตราสารที่ออกโดย
องค์กรปกครองส่วนท้องถิ่นของประเทศนั้น

“ตราสารหนี้
ด้อยคุณภาพ”

ตราสารหนี้ที่ได้รับอนุญาตให้เสนอขายตามประกาศคณะกรรมการ
กำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขาย
ตราสารหนี้ที่ออกใหม่ และมีลักษณะอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้

1. ตราสารหนี้ที่มีการผิดนัดชำระหนี้ตามข้อกำหนดสิทธิ

คำศัพท์**คำอธิบายศัพท์**

	2. ตราสารหนี้ของบริษัทที่ศาลล้มละลายกลางมีคำสั่งรับคำร้องขอฟื้นฟูกิจการ
“ตราสารหนี้ที่มีความเสี่ยงสูง”	ตราสารหนี้ที่ไม่มีลักษณะพิเศษ (plain bond) ซึ่งได้รับอนุญาตให้เสนอขายตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ และมี credit rating ของ issue rating หรือของ issuer rating ที่ต่ำกว่าอันดับที่ลงทุนได้ (non-investment grade) หรือไม่มี credit rating (unrated)
“ตราสารหนี้ที่มีปัญหาในการชำระหนี้คืน”	ตราสารหนี้ซึ่งได้รับอนุญาตให้เสนอขายตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ ที่มีลักษณะดังนี้ 1. ตราสารหนี้ที่อยู่ระหว่างผิदनชำระหนี้ (distressed bond) 2. ตราสารหนี้ที่มีการเลื่อนกำหนดชำระหนี้คืน (rescheduled bond) 3. ตราสารหนี้ที่ผู้ออกอยู่ในกระบวนการฟื้นฟูกิจการ 4. ตราสารหนี้ที่ผู้ออกอยู่ระหว่างการปรับปรุงโครงสร้างหนี้ (restructured bond) 5. ตราสารหนี้ที่มีการผิदनชำระหนี้เนื่องจากเหตุผิदनของหุ้นกู้ชุดอื่น ๆ (cross default) 6. ตราสารหนี้ด้อยสิทธิที่มีลักษณะคล้ายทุน (subordinated perpetual bond) ที่ผู้ออกมีปัญหาในการชำระหนี้คืน 7. ตราสารหนี้อื่นใดที่ผู้ออกเป็นบุคคลเดียวกับผู้ออกตราสารหนี้ที่มีลักษณะตาม 1. 2. หรือ 5.
“ตราสารหนี้ด้อยสิทธิที่มีลักษณะคล้ายทุน (subordinated perpetual bond)”	ตราสารหนี้ด้อยสิทธิตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหลักเกณฑ์ในรายละเอียดเกี่ยวกับการติดต่อและให้บริการลูกค้าสำหรับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

คำศัพท์

“ตราสาร Basel III”

“ตลาดซื้อขาย
หลักทรัพย์
ต่างประเทศ”

“ธปท.”

“ธพ.”

“บค.”

“บง.”

“บล.”

“บลจ.”

“บริษัทจดทะเบียน”

คำอธิบายศัพท์

ตราสารเพื่อการนับเป็นเงินกองทุนของสถาบันการเงินไม่ว่าตามกฎหมายไทยหรือต่างประเทศ ที่มีการอ้างอิงจากหลักเกณฑ์การกำกับดูแลสถาบันการเงินของ Basel Committee on Banking Supervision (Basel III)

ศูนย์กลางหรือเครือข่ายใด ๆ ที่จัดให้มีขึ้นเพื่อการซื้อขายหลักทรัพย์ในต่างประเทศ โดยมีลักษณะครบถ้วนดังนี้

1. มีการรวบรวมคำเสนอซื้อเสนอขายหลักทรัพย์จากผู้เสนอซื้อหลายรายและผู้เสนอขายหลายราย
2. มีการกำหนดหลักเกณฑ์หรือจัดให้มีระบบ ซึ่งกำหนดเกี่ยวกับวิธีการในการซื้อขายหลักทรัพย์ไว้เป็นการล่วงหน้า โดยผู้ให้บริการไม่อาจใช้ดุลยพินิจในการจัดการซื้อขายเป็นประการอื่น และผู้เสนอซื้อเสนอขายยินยอมที่จะผูกพันตามหลักเกณฑ์หรือระบบนั้น

ธนาคารแห่งประเทศไทย

ธนาคารพาณิชย์

บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

บริษัทเงินทุน

บริษัทหลักทรัพย์

บล. ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวม หรือการจัดการกองทุนส่วนบุคคล

บริษัทที่มีหลักทรัพย์ที่ได้รับการจดทะเบียนหรือได้รับการอนุญาตให้ทำการซื้อขายได้ใน SET

คำศัพท์

“บริษัทย่อย”

คำอธิบายศัพท์

บริษัทย่อยตามมาตรฐานการบัญชีเกี่ยวกับการจัดทำงบการเงินรวม โดยพิจารณาตามงบการเงินรวมที่มีการจัดทำและเปิดเผยล่าสุด ทั้งนี้ หากไม่มีงบการเงินรวมให้พิจารณาตามสัดส่วนการถือหุ้นที่ปรากฏในบัญชีรายชื่อผู้ถือหุ้นล่าสุด

“บริษัทใหญ่”

บริษัทใหญ่ตามมาตรฐานการบัญชีเกี่ยวกับการจัดทำงบการเงินรวม โดยพิจารณาตามงบการเงินรวมที่มีการจัดทำและเปิดเผยล่าสุด ทั้งนี้ หากไม่มีงบการเงินรวมให้พิจารณาตามสัดส่วนการถือหุ้นที่ปรากฏในบัญชีรายชื่อผู้ถือหุ้นล่าสุด

“แบบ filing”

แบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายหลักทรัพย์

“ใบแสดงสิทธิ
ในผลประโยชน์”

ใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงซึ่งกำหนดให้เป็นหลักทรัพย์ตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการกำหนดประเภทหลักทรัพย์เพิ่มเติม

“ผู้มีภาระผูกพัน”

ผู้ที่มีภาระผูกพันในการชำระหนี้ตามตราสารทางการเงินในฐานะผู้ออก ผู้ส่งจ่าย ผู้รับรอง ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกันแล้วแต่กรณี

“ศูนย์ซื้อขาย
สินทรัพย์ดิจิทัล”

ศูนย์ซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัลที่จัดตั้งตามกฎหมายว่าด้วยการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล โดยศูนย์ซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัลดังกล่าวอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของทางการหรือหน่วยงานที่ทำหน้าที่กำกับดูแลด้านสินทรัพย์ดิจิทัลหรือทรัพย์สินที่มีลักษณะทำนองเดียวกับสินทรัพย์ดิจิทัล

คำศัพท์

“ศูนย์ซื้อขาย
derivatives”

คำอธิบายศัพท์

ศูนย์ซื้อขายดังนี้

1. ศูนย์ซื้อขาย derivatives ที่ได้รับใบอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
2. ศูนย์ซื้อขาย derivatives ซึ่งจัดตั้งขึ้นและให้บริการได้ตามกฎหมายต่างประเทศและได้รับการยอมรับจากสำนักงาน

“หน่วย CIS”

หน่วยของกองทุนอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้

1. หน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่อยู่ภายใต้บังคับประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์การจัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนประเภทสถาบัน และกองทุนส่วนบุคคล
2. หน่วยของกองทุน CIS ต่างประเทศ

“หน่วย Crypto ETF”

หน่วยลงทุนหรือหน่วยของกองทุน Crypto ETF

“หน่วย infra”

หน่วยของกองทรัสต์สินที่เกี่ยวข้องกับโครงสร้างพื้นฐานซึ่งอยู่ในรูปแบบอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้

1. กองทุนโครงสร้างพื้นฐานที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัสต์และตลาดหลักทรัสต์ หรือตามกฎหมายว่าด้วยทรัสต์เพื่อธุรกรรมในตลาดทุน
2. กองทุนโครงสร้างพื้นฐานต่างประเทศที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศซึ่งมีวัตถุประสงค์หลักในการลงทุนในลักษณะทำนองเดียวกับกองทุนโครงสร้างพื้นฐานตาม 1. ทั้งนี้ไม่ว่าจะจัดตั้งในรูปบริษัท ทรัสต์ หรือรูปแบบอื่นใด

“หน่วย private
equity”

หน่วยของกิจการเงินร่วมลงทุน (private equity) อันได้แก่ หุ้นใบทรัสต์ ตราสารหรือหลักฐานแสดงสิทธิในทรัพย์สินของกิจการอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้ ทั้งนี้ ไม่ว่ากิจการดังกล่าวจะจัดตั้งขึ้นในรูปของบริษัท ทรัสต์ หรือรูปแบบอื่นใด

คำศัพท์**คำอธิบายศัพท์**

1. ทริสต์เพื่อประกอบกิจการเงินร่วมลงทุนตามประกาศ
คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วย
การกำหนดประเภทธุรกรรมในตลาดทุนที่ใช้ทริสต์ได้
2. กิจการเงินร่วมลงทุนตามกฎหมายต่างประเทศที่มีลักษณะ
ครบถ้วนดังนี้
 - (ก) มีวัตถุประสงค์เพื่อการลงทุนร่วมกันของผู้ลงทุนตั้งแต่
2 รายขึ้นไป ทั้งนี้ ต้องมิได้เป็นไปเพื่อแสวงหา
ประโยชน์จากการจัดการทรัพย์สินส่วนตัวของบุคคลใด
หรือกลุ่มบุคคลใดเป็นการเฉพาะ
 - (ข) มีการมอบหมายให้บุคคลหนึ่งบุคคลใดเป็นผู้จัดการ
เงินทุนและทรัพย์สินที่เกิดจากเงินทุน
 - (ค) มีนโยบายการลงทุนในกิจการอื่นผ่านการเข้าทำสัญญา
การลงทุนในหุ้นหรือการสนับสนุนทางการเงิน
ที่ก่อให้เกิดสิทธิในการได้มาซึ่งหุ้นของกิจการนั้น
ในภายหลัง โดยมีส่วนในการกำกับดูแลแผนธุรกิจ
การดำเนินงานหรือการปรับปรุงการดำเนินงาน
หรือการดำเนินการอื่นใดในลักษณะที่สะท้อน
ถึงการมีบทบาทต่อการดำเนินธุรกิจของกิจการดังกล่าว

“หน่วย property”

หน่วยของกองทรัพย์สินที่เกี่ยวข้องกับอสังหาริมทรัพย์ซึ่งอยู่
ในรูปแบบอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้

1. กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ที่อยู่ภายใต้บังคับประกาศ
คณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์การจัดการ
กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์
2. ทริสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ที่จัดตั้งขึ้นตาม
กฎหมายว่าด้วยทริสต์เพื่อธุรกรรมในตลาดทุน
3. foreign REIT

“หุ้นกู้ระยะสั้น”

หุ้นกู้ที่มีกำหนดเวลาชำระหนี้ไม่เกิน 270 วันนับแต่วันที่ออกหุ้นกู้

คำศัพท์

“active
management”

“B/E”

“benchmark”

“CIS operator”

“concentration limit”

“CRA”

“credit derivatives”

“credit event”

คำอธิบายศัพท์

กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนสูงกว่า benchmark

ตั๋วแลกเงิน (Bill of Exchange)

ตัวชี้วัดของกองทุน ซึ่งเป็นดัชนีหรือองค์ประกอบของดัชนีที่มีการเผยแพร่อย่างกว้างขวางและสอดคล้องกับนโยบายการลงทุนของกองทุนนั้น

บุคคลดังนี้

1. บลจ. หรือ
2. ผู้ทำหน้าที่บริหารจัดการกองทุน CIS ต่างประเทศ

อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามความมีส่วนได้เสียในกิจการที่ลงทุน

สถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (Credit Rating Agency) ที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน เว้นแต่ที่กำหนดไว้เป็นการเฉพาะในภาคผนวก 5 ส่วนที่ 5

derivatives ที่มีลักษณะเป็นการเคลื่อนย้ายความเสี่ยงด้านเครดิตของทรัพย์สินที่ได้รับการประกันความเสี่ยงจากคู่สัญญาฝ่ายหนึ่งไปยังคู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่งตามมาตรฐานสากล โดยคู่สัญญาฝ่ายหนึ่งซึ่งมีภาระผูกพันที่จะต้องชำระเงินให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง เมื่อเกิดเหตุการณ์ที่มีผลต่อการชำระหนี้ (credit event) ของทรัพย์สินที่ได้รับการประกันความเสี่ยง จะได้รับผลตอบแทนหรือค่าธรรมเนียมสำหรับการมีภาระผูกพันดังกล่าว

เหตุการณ์ที่เกี่ยวข้องกับความสามารถในการชำระหนี้ตามที่ระบุในข้อตกลงของตราสารหรือสัญญา

คำศัพท์

“credit rating”

คำอธิบายศัพท์

อันดับความน่าเชื่อถือที่จัดทำโดย CRA ซึ่งเป็นการประเมินความสามารถในการชำระหนี้ตามตราสารหรือสัญญา

“currency risk”

ความเสี่ยงด้าน FX

“delta”

อัตราเปรียบเทียบการเปลี่ยนแปลงของราคาตราสารหรือสัญญากับราคา underlying ของตราสารหรือสัญญา แล้วแต่กรณี

“derivatives”

สัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“derivatives on
organized
exchange”

derivatives ที่ซื้อขายในศูนย์ซื้อขาย derivatives

“discount rate”

อัตราส่วนลดของหลักทรัพย์หรือตราสารที่มีการลงทุนที่จะใช้ในการคำนวณมูลค่าของหลักทรัพย์หรือตราสารนั้น

“DW”

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants)

“foreign REIT”

กองทรัสต์หรือกองอสังหาริมทรัพย์ที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศซึ่งมีวัตถุประสงค์หลักในการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์หรือในกิจการที่ประกอบธุรกิจพัฒนาอสังหาริมทรัพย์ ทั้งนี้ ไม่ว่ากองทรัสต์หรือกองดังกล่าวจะจัดตั้งในรูปบริษัท ทรัสต์ หรือรูปแบบใด

“FX”

อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ (Foreign Exchange)

“GMS”

ประเทศกลุ่มอนุภูมิภาคแม่น้ำโขง (Greater Mekong Subregion) ซึ่งได้แก่ ราชอาณาจักรกัมพูชา สาธารณรัฐประชาธิปไตยประชาชนลาว สาธารณรัฐแห่งสหภาพเมียนมาร์ สาธารณรัฐสังคมนิยมเวียดนาม และสาธารณรัฐประชาชนจีน (เฉพาะมณฑลยูนนาน)

คำศัพท์

“group limit”

คำอธิบายศัพท์

อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามกลุ่มกิจการ โดยการนำ
อัตราส่วนการลงทุนในแต่ละบริษัทที่อยู่ในกลุ่มกิจการ
มาคำนวณรวมกัน

“guarantor rating”

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้มีภาระผูกพันในฐานะผู้รับรอง
ผู้รับอาวัล ผู้สลักหลัง หรือผู้ค้ำประกัน

“HNW”

ผู้ลงทุนรายใหญ่ ตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และ
ตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการกำหนดบทนิยามผู้ลงทุนสถาบัน
ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และผู้ลงทุนรายใหญ่

“II”

ผู้ลงทุนสถาบัน ตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และ
ตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการกำหนดบทนิยามผู้ลงทุนสถาบัน
ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และผู้ลงทุนรายใหญ่

“international scale”

มาตรฐานการจัดทำ credit rating ในระดับที่ใช้เปรียบเทียบ
ระหว่างประเทศ

“inverse
management”

กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนตรงกันข้าม
กับผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง

“investment grade”

credit rating ในระดับที่สามารถลงทุนได้

“IOSCO”

International Organization of Securities Commissions

“IPO”

การเสนอขายตราสารต่อประชาชนเป็นการทั่วไปในครั้งแรก
(Initial Public Offering)

“issue rating”

อันดับความน่าเชื่อถือของหลักทรัพย์หรือทรัพย์สิน

“issuer rating”

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสารหรือคู่สัญญา

คำศัพท์

“leveraged
management”

“market price”

“MF”

“MMF”

“national scale”

“NAV”

“net exposure”

“Non-retail MF”

“Non-retail PF”

“notional amount”

คำอธิบายศัพท์

กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนที่คู่กันกับ
ผลตอบแทนรายวันของดัชนีที่กองทุนรวมใช้อ้างอิง

มูลค่าตามราคาตลาด

กองทุนรวม (Mutual Fund)

กองทุนรวมตลาดเงิน (Money Market Fund)

มาตรฐานการจัดทำ credit rating ในระดับที่ใช้เปรียบเทียบ
ภายในประเทศ

มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (Net Asset Value)

มูลค่าการลงทุนสุทธิในทรัพย์สินไม่ว่าเป็นการลงทุนโดยตรงหรือ
โดยอ้อมผ่านการลงทุนในตราสาร สัญญา หรือคริปโทแอสเซต ที่ให้
ผลตอบแทนโดยอ้างอิงอยู่กับทรัพย์สิน ซึ่งเป็นผลให้กองทุนมี
ความเสี่ยงในทรัพย์สินนั้น

กองทุนรวมที่มีผู้ถือหน่วยลงทุนทั้งหมดเป็นผู้ลงทุนประเภทสถาบัน
ซึ่งอยู่ภายใต้บังคับของประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน
ว่าด้วยหลักเกณฑ์การจัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป
กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุน
ประเภทสถาบัน และกองทุนส่วนบุคคล

กองทุนส่วนบุคคลที่จำกัดผู้มอบหมายให้จัดการลงทุนไว้เฉพาะ
ผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ

มูลค่าตามหน้าสัญญาของ derivatives

คำศัพท์

“obligation”

คำอธิบายศัพท์

ประเภทและลักษณะของทรัพย์สินที่ซื้อตกลงตาม credit derivatives อ้างอิงถึง (obligation category & obligation characteristics)

“options”

สัญญาที่มีลักษณะตาม (3) ของนิยาม “สัญญาซื้อขายล่วงหน้า” ในมาตรา 3 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546

“OTC derivatives”

derivatives ซึ่งซื้อขายนอกศูนย์ซื้อขาย derivatives

“P/N”

ตัวสัญญาใช้เงิน (Promissory Note)

“passive
management”

กลยุทธ์ในการบริหารจัดการลงทุนที่มุ่งหวังผลตอบแทนตาม การเคลื่อนไหวของดัชนีที่ MF ใช้อ้างอิง

“PF”

กองทุนส่วนบุคคล (Private Fund)

“portfolio duration”

อายุเฉลี่ยของทรัพย์สินที่ลงทุน ซึ่งได้จากการคำนวณ ค่าตามมาตรฐานสากล

“product limit”

อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามประเภททรัพย์สิน

“PVD”

กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ (Provident Fund)

“regulated market”

ศูนย์กลางที่จัดช่องทางการสื่อสารระหว่างผู้ค้าเพื่อให้เกิด การเจรจาต่อรองซื้อขายตราสารระหว่างกันได้ รวมทั้งให้ข้อมูล ต่าง ๆ ที่เกี่ยวกับตราสารนั้น โดยศูนย์กลางดังกล่าวอยู่ภายใต้ การกำกับดูแลของทางหรือหน่วยงานที่ทำหน้าที่กำกับดูแล ด้านหลักทรัพ์หรือตราสารที่มีลักษณะทำนองเดียวกับหลักทรัพ์

“repo”

ธุรกรรมการขายโดยมีสัญญาซื้อคืน (repurchase agreement)

คำศัพท์

“retail MF”

“retail PF”

“reverse repo”

“SBL”

“securities lending”

“SET”

“share warrants”

“single entity limit”

“SIP”

“SN”

“sovereign rating”

“TBMA”

คำอธิบายศัพท์

กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป (retail Mutual Fund)

กองทุนส่วนบุคคลที่ผู้มอบหมายให้จัดการลงทุนเป็นผู้ลงทุนทั่วไป โดยไม่จำกัดผู้ลงทุนไว้เฉพาะผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่ พิเศษ (retail Private Fund)

ธุรกรรมการซื้อโดยมีสัญญาขายคืน (reverse repurchase agreement)

ธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทกิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending)

ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น

อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สินหรือคู่สัญญา

Specific Investment Products

ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structured Note)

อันดับความน่าเชื่อถือระดับประเทศของประเทศที่ผู้ออกตราสาร มีถิ่นที่อยู่ ซึ่งเป็นการประเมินความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้ ของรัฐบาลของประเทศนั้น

สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (Thai Bond Market Association)

คำศัพท์

“TSFC”

คำอธิบายศัพท์

บล. ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภท
การให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ (Securities Finance
Corporation) ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และ
ตลาดหลักทรัพย์

“TSR”

ใบแสดงสิทธิในการซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่โอนสิทธิได้ (Transferable
Subscription Right)

“underlying”

สินค้า ตัวแปร หรือหลักทรัพย์อ้างอิง

“WFE”

World Federation of Exchanges