

คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงานการทำธุรกรรม (Activities Report)

คำอธิบาย ข้อ 1 รายละเอียดลูกค้า

(1) รายละเอียดการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์

ให้รายงานรายละเอียดขอรวมเกี่ยวกับการทำธุรกรรมการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์ ดังต่อไปนี้

รายการ	ความหมาย
ยอดรวมมูลค่าหลักทรัพย์ที่เป็นประกัน	แสดงผลรวมมูลค่าหลักทรัพย์ที่เป็นประกันของลูกค้าทุกราย และจำนวนลูกค้าที่มีหลักทรัพย์ที่เป็นประกัน
ยอดรวมมูลค่าหลักประกันอื่น	แสดงผลรวมมูลค่าหลักประกันประเภทอื่นที่มีใช้ประเภทหลักทรัพย์ของลูกค้าทุกราย และจำนวนลูกค้าที่มีหลักประกันอื่น
ยอดเงินให้กู้ยืมคงค้าง (margin loan)	แสดงผลรวมยอดเงินให้กู้ยืมคงค้างของลูกค้าทุกราย และจำนวนลูกค้าที่มียอดหนี้คงค้าง
ยอดรวม credit line ทั้งหมด	แสดงผลรวม credit line ของลูกค้าทุกราย และจำนวนลูกค้าที่มี credit line
ยอดรวมทรัพย์สินส่วนเกิน	แสดงผลรวมทรัพย์สินส่วนเกินของลูกค้าทุกราย และจำนวนลูกค้าที่มียอดทรัพย์สินส่วนเกิน

(2) การดำรงหลักประกันของบัญชีมาร์จิ้น และบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประจำเดือน

ให้รายงานรายละเอียดการดำรงหลักประกันของการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์ และการให้ยืมหลักทรัพย์เพื่อการขายชอร์ต ในบัญชีมาร์จิ้น รวมทั้งการดำรงหลักประกันของบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า แบ่งตาม call margin (การเรียกหลักประกันเพิ่ม) หรือ force sale/buy (การบังคับชำระหนี้) ที่เกิดขึ้นทุกรายการในเดือนนั้นๆ โดยมีรายละเอียดดังนี้

รายการ	ความหมาย
จำนวนราย	แสดงจำนวนรายลูกค้าที่ถูกเรียกให้วางหลักประกันเพิ่มหรือถูกบังคับชำระหนี้ในเดือนนั้นๆ โดยไม่ต้องนับซ้ำ
จำนวนเงินที่ต้องเรียกเพิ่มหรือบังคับชำระหนี้	แสดงยอดรวมจำนวนเงินที่ต้องเรียกเพิ่มหรือบังคับชำระหนี้ในเดือนนั้นๆ ทุกรายการ สำหรับมูลค่าของการ call แต่ละครั้งให้ใช้มูลค่าล่าสุดที่เกิดขึ้นจนวนรายการ call ดังกล่าวพ้นสภาพการ call
มูลค่าส่วนที่ไม่คุ้มหนี้จากการบังคับชำระหนี้	แสดงยอดรวมจำนวนเงินที่ไม่คุ้มหนี้จากการบังคับชำระหนี้ในเดือนนั้นๆ ทุกรายการ โดยให้หักยอดที่ลูกค้ามีการชำระหนี้เพิ่มเติมเข้ามาในช่วงเวลาที่มีการเรียกชำระหนี้ด้วย

หมายเหตุ: คำนวณมูลค่าจากราคาตลาดของหลักทรัพย์*

(3) รายละเอียดลูกค้ำมาร์จิ้น

ให้รายงานรายชื่อของลูกค้ำที่มียอดเงินให้กู้ยืมคงค้าง 20 อันดับแรก หรือมียอดกู้ยืมคงค้างคิดเป็น 10% ของส่วนของผู้ถือหุ้นของบริษัทที่รายงานแบบรายงานรายเดือนหรือราย 6 เดือนงวดล่าสุด โดยเรียงลำดับจากมากไปน้อย โดยมีรายละเอียดดังนี้

รายการ	ความหมาย												
เลขประจำตัว	แสดงเลขประจำตัว ตามประเภทของลูกค้ำ ดังนี้ <table border="1"><thead><tr><th>ประเภทลูกค้ำ</th><th>ID</th><th>ตัวอย่าง</th></tr></thead><tbody><tr><td>ก. บุคคลธรรมดา</td><td>- ไทย เลขประจำตัวประชาชน ตามที่ปรากฏ ในบัตรประชาชนหรือทะเบียนบ้าน</td><td>123456789123</td></tr><tr><td></td><td>- ต่างประเทศ เลขที่หนังสือเดินทาง</td><td>A12345</td></tr><tr><td>ข. นิติบุคคล</td><td>เลขทะเบียนที่จดทะเบียนกับกรมทะเบียนการค้า กระทรวงพาณิชย์</td><td>1234/2539 หรือ บมจ. 123</td></tr></tbody></table>	ประเภทลูกค้ำ	ID	ตัวอย่าง	ก. บุคคลธรรมดา	- ไทย เลขประจำตัวประชาชน ตามที่ปรากฏ ในบัตรประชาชนหรือทะเบียนบ้าน	123456789123		- ต่างประเทศ เลขที่หนังสือเดินทาง	A12345	ข. นิติบุคคล	เลขทะเบียนที่จดทะเบียนกับกรมทะเบียนการค้า กระทรวงพาณิชย์	1234/2539 หรือ บมจ. 123
ประเภทลูกค้ำ	ID	ตัวอย่าง											
ก. บุคคลธรรมดา	- ไทย เลขประจำตัวประชาชน ตามที่ปรากฏ ในบัตรประชาชนหรือทะเบียนบ้าน	123456789123											
	- ต่างประเทศ เลขที่หนังสือเดินทาง	A12345											
ข. นิติบุคคล	เลขทะเบียนที่จดทะเบียนกับกรมทะเบียนการค้า กระทรวงพาณิชย์	1234/2539 หรือ บมจ. 123											
คำนำหน้า	แสดงคำนำหน้าชื่อลูกค้ำ เช่น นาย, นางสาว, ม.ร.ว., Mr., Ms., บริษัท เป็นต้น												
ชื่อ - สกุล	แสดงชื่อ - สกุลของลูกค้ำตามประเภทของลูกค้ำ ดังนี้ <table border="1"><thead><tr><th>ประเภทลูกค้ำ</th><th>ชื่อสกุล</th></tr></thead><tbody><tr><td>ก. บุคคลธรรมดา</td><td>- ไทย ตามที่ปรากฏในบัตรประจำตัวประชาชนหรือทะเบียนบ้าน โดยให้เว้นวรรค 1 ช่องระหว่างชื่อและนามสกุล</td></tr><tr><td></td><td>- ต่างประเทศ ตามที่ปรากฏในหนังสือเดินทาง</td></tr><tr><td>ข. นิติบุคคล</td><td>ตามที่จดทะเบียนกับกรมทะเบียนการค้า กระทรวงพาณิชย์</td></tr></tbody></table>	ประเภทลูกค้ำ	ชื่อสกุล	ก. บุคคลธรรมดา	- ไทย ตามที่ปรากฏในบัตรประจำตัวประชาชนหรือทะเบียนบ้าน โดยให้เว้นวรรค 1 ช่องระหว่างชื่อและนามสกุล		- ต่างประเทศ ตามที่ปรากฏในหนังสือเดินทาง	ข. นิติบุคคล	ตามที่จดทะเบียนกับกรมทะเบียนการค้า กระทรวงพาณิชย์				
ประเภทลูกค้ำ	ชื่อสกุล												
ก. บุคคลธรรมดา	- ไทย ตามที่ปรากฏในบัตรประจำตัวประชาชนหรือทะเบียนบ้าน โดยให้เว้นวรรค 1 ช่องระหว่างชื่อและนามสกุล												
	- ต่างประเทศ ตามที่ปรากฏในหนังสือเดินทาง												
ข. นิติบุคคล	ตามที่จดทะเบียนกับกรมทะเบียนการค้า กระทรวงพาณิชย์												
credit line	แสดงยอด credit line ของลูกค้ำแต่ละราย												
ยอดเงินให้กู้ยืมคงค้าง (margin loan)	แสดงยอดเงินให้กู้ยืมคงค้างของลูกค้ำแต่ละราย												
หลักทรัพย์ให้ยืม	-ชื่อ แสดงชื่อย่อหลักทรัพย์ที่ให้ยืมทั้งหมด โดยเรียงลำดับตามจำนวนเงินจากมากไปน้อย -จำนวนหน่วย แสดงผลรวมจำนวนหน่วยของหลักทรัพย์ที่ให้ยืมแต่ละหลักทรัพย์ -จำนวนเงิน แสดงผลรวมมูลค่าตามราคาตลาดของหลักทรัพย์ที่ให้ยืมแต่ละหลักทรัพย์												
หลักประกันที่เป็นหลักทรัพย์	-ชื่อ แสดงชื่อย่อหลักทรัพย์ทั้งหมดที่ลูกค้ำวางเป็นประกัน โดยเรียงลำดับตามจำนวนเงินจากมากไปน้อย -จำนวนหน่วย แสดงผลรวมจำนวนหน่วยของหลักทรัพย์ที่ลูกค้ำวางเป็นประกันแต่ละหลักทรัพย์ -จำนวนเงิน แสดงผลรวมมูลค่าตามราคาตลาดของหลักทรัพย์ที่ลูกค้ำวางเป็นประกันแต่ละหลักทรัพย์												
หลักประกันอื่น ๆ	แสดงยอดรวมมูลค่าหลักประกันอื่น ๆ ของลูกค้ำ												
cash balance	แสดงยอดเงินของลูกค้ำแต่ละราย												
equity	แสดงยอดทรัพย์สินสุทธิของลูกค้ำแต่ละรายที่มีอยู่ทั้งหมดในบัญชีมาร์จิ้น												

(4) รายละเอียดหลักทรัพย์จดทะเบียนที่เป็นหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้น

ให้รายงานมูลค่าของหลักทรัพย์จดทะเบียนที่ใช้เป็นหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้นทุกรายการเรียงตามลำดับจากมากไปน้อยตามสัดส่วนมูลค่าของหลักประกันนั้นเทียบมูลค่าหลักประกันรวม โดยมีรายละเอียดดังนี้

รายการ	ความหมาย
ชื่อหลักทรัพย์จดทะเบียน (a)	แสดงชื่อย่อหลักทรัพย์จดทะเบียน แต่ไม่รวมถึงหลักทรัพย์ประเภทใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้ ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ออปชัน และใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทยที่มีหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นที่ใช้เป็นประกันการชำระหนี้ในบัญชีมาร์จิ้น
มูลค่าตามราคาตลาด (b)	แสดงจำนวนหลักทรัพย์ที่เป็นประกัน x ราคาตลาด* ณ สิ้นเดือนของหลักทรัพย์นั้น
%มูลค่าหลักประกันรวม (c)	แสดงสัดส่วนมูลค่าตามราคาตลาดของหลักทรัพย์นั้น (b) เทียบกับผลรวมของมูลค่าตามราคาตลาดของหลักทรัพย์ทุกตัวที่รายงานใน (b)
%มูลค่าหุ้นเรียกชำระแล้วของหลักประกันนั้น (d)	แสดงสัดส่วนมูลค่าตามราคาตลาดของหลักทรัพย์นั้น (b) เทียบกับมูลค่าตามราคาตลาดของจำนวนหุ้นที่เรียกชำระแล้วของหลักทรัพย์นั้น (ใช้จำนวนหุ้นที่เรียกชำระแล้วคูณด้วยราคาตลาด* ณ สิ้นเดือน)
มูลค่าหลักทรัพย์ในพอร์ตลงทุนของบริษัท (e)	แสดงมูลค่าตามราคาตลาดของหลักทรัพย์นั้นในพอร์ตลงทุนของบริษัท (Proprietary Port) ซึ่งรวมถึงเงินลงทุนในหลักทรัพย์ผ่าน private fund ของบริษัทด้วย
%มูลค่าในพอร์ตเทียบกับมูลค่าทั้งหมดของพอร์ต (f)	แสดงสัดส่วนมูลค่าตามราคาตลาดของหลักทรัพย์นั้นในพอร์ตลงทุนของบริษัท (e) เทียบกับมูลค่าทั้งหมดของเงินลงทุนในหลักทรัพย์ที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ในพอร์ตลงทุนและ private fund ของบริษัท โดยไม่นับเงินลงทุนในส่วนที่บริษัทมิได้มีวัตถุประสงค์เพื่อการลงทุนของบริษัทเอง เช่น เงินลงทุนในหลักทรัพย์ในการทำหน้าที่ Market Maker หรือการสร้าง ETF และ เงินลงทุนในบัญชี Error Port เป็นต้น

คำอธิบาย ข้อ 2 ข้อมูลการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาด

(1) ปริมาณการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ให้รายงานยอดรวมปริมาณการซื้อขายสัญญาฯ ทุกประเภทนับตามจำนวนสัญญา แยกตามประเภทสินค้าอ้างอิง และจำนวนลูกค้ำที่ทำการซื้อขายในตลาดอนุพันธ์ (TFEX) รวมถึงยอดรวมปริมาณการซื้อขายสัญญาฯ และจำนวนลูกค้ำที่ทำการซื้อขายในตลาดอื่น ได้แก่ ศูนย์ซื้อขายสินค้าเกษตรล่วงหน้า เป็นต้น โดยจำแนกรายละเอียดตามประเภทบัญชี ดังนี้

รายการ	ความหมาย
บัญชีเพื่อบริษัท	ประกอบด้วยบัญชีเพื่อการลงทุน บัญชีเพื่อการเป็น market maker และบัญชีเพื่อการซื้อขายผิดพลาด
บัญชีบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม	บัญชีของลูกค้าที่เป็นบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม
บัญชีบริษัทหลักทรัพย์อื่น (sub broker)	บัญชีของลูกค้าที่เป็นบริษัทหลักทรัพย์อื่นที่มีการส่งซื้อขายผ่านบริษัท (ถ้ามี ให้รายงานแยกตามแต่ละบริษัทหลักทรัพย์)
บัญชีลูกค้าต่างประเทศ	บัญชีของลูกค้าที่เป็นชาวต่างประเทศซึ่งถือหนังสือเดินทาง (PASSPORT) และชาวต่างประเทศที่มีถิ่นที่อยู่หรือประกอบธุรกิจในต่างประเทศ ทั้งนี้ไม่รวมถึงคนที่ถือใบต่างด้าวซึ่งมีถิ่นที่อยู่ในประเทศไทย สำหรับบัญชีลูกค้ำนิติบุคคลต่างประเทศ ให้หมายรวมถึง บริษัทต่างประเทศที่ทำหน้าที่เป็นตัวแทนหรือผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้ลูกค้าด้วย
บัญชีลูกค้าในประเทศ	บัญชีของลูกค้าในประเทศ ทั้งที่เป็นบุคคลธรรมดา นิติบุคคล หรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ โดยบัญชีลูกค้ำนิติบุคคลในประเทศ ให้แยกเป็น สถาบันการเงิน บริษัท ประกัน และอื่น ๆ ซึ่งสถาบันการเงินในที่นี้ หมายถึง สถาบันการเงินตามกฎหมายว่าด้วยดอกเบี้ยเงินให้กู้ยืมของสถาบันการเงิน อันได้แก่ ธนาคารแห่งประเทศไทย ธนาคารพาณิชย์ ธนาคารออมสิน ธนาคารอาคารสงเคราะห์ ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร บริษัทเงินทุน บริษัทหลักทรัพย์ บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ สหกรณ์ออมทรัพย์ ชุมชนสหกรณ์ออมทรัพย์ เป็นต้น สำหรับบริษัทประกัน ให้หมายถึงบริษัทประกันทุกประเภท สำหรับอื่นๆ หมายถึงนิติบุคคลอื่นๆ นอกเหนือจาก 2 ประเภทแรก

(2) ปริมาณการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าในประเทศ

ให้รายงานยอดรวมปริมาณการซื้อขาย ปริมาณการขาย ปริมาณรวม ของสัญญาฯ ทุกประเภทนับตามจำนวนสัญญา ในตลาดอนุพันธ์ (TFEX) ทั้งลูกค้ากรุงเทพมหานคร และลูกค้าต่างจังหวัด โดยแยกตามสถานที่ที่ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขาย ดังนี้

รายการ	ความหมาย
ตั้งซื้อขายผ่านสำนักงานใหญ่	ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายผ่านสำนักงานใหญ่ของบริษัท
ตั้งซื้อขายผ่านสาขา หรือสำนักงานตัวแทน	ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายผ่านสาขา หรือ สำนักงานตัวแทน โดยให้ระบุรหัสสาขา รหัสอำเภอ และรหัสจังหวัดด้วย

คำอธิบาย ข้อ 3 ข้อมูลการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านอกตลาด

(1) มูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านอกตลาด (Notional Amount) แบ่งตามตัวแปรอ้างอิง และประเภทสัญญา

ให้รายงานยอดรวมโดยใช้มูลค่าตามสัญญา (notional amount) ต่อสัญญาที่เกิดขึ้นในเดือนนั้น ตามแต่ละประเภทสัญญา ที่ซื้อขายนอกตลาด ได้แก่ Forward Swaps Long options Written options และอื่นๆ (ให้ระบุ) แยกตามสินค้า(ตัวแปร)อ้างอิง ได้แก่ ตราสารทุน(equity) อัตราดอกเบี้ย(interest rate) อัตราแลกเปลี่ยน(currency) สำหรับสินค้าอ้างอิงอื่นๆ หมายถึง สินค้าอ้างอิงที่นอกเหนือจากที่กล่าวมา เช่น ทองคำ น้ำมัน commodity เป็นต้น

(2) มูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านอกตลาด (Notional Amount) แบ่งตามประเภทคู่สัญญา

ให้รายงานยอดรวมโดยใช้มูลค่าตามสัญญา (notional amount) ต่อสัญญาที่เกิดขึ้นในเดือนนั้น ทั้งหมดของแต่ละประเภทคู่สัญญาที่มีการซื้อขายนอกตลาด ได้แก่ ธนาคารพาณิชย์ บริษัทหลักทรัพย์ สถาบันการเงินอื่น บริษัทจำกัด และอื่นๆ ตามนิยามผู้ลงทุนสถาบันตามมาตรา 3 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 และประกาศว่าด้วยการกำหนดประเภทนิติบุคคลที่เป็นผู้ลงทุนสถาบันเพิ่มเติม โดยแบ่งเป็นนิติบุคคลในประเทศ และนิติบุคคลต่างประเทศ

คำอธิบาย ข้อ 4 ข้อมูลการทำธุรกรรม SBL

ให้รายงานการให้ยืมหลักทรัพย์ทั้งในฐานะตัวการที่ยืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์ (principal) และในฐานะตัวแทนของผู้ยืมหรือผู้ให้ยืมหลักทรัพย์(agent) แยกตามประเภทลูกค้ำที่เป็นรายย่อย หรือสถาบัน โดยให้รายงานยอดมูลค่าการยืม (กรณี principal หมายถึงบริษัทเป็นผู้ยืม-borrower) ยอดมูลค่าการให้ยืม (กรณีprincipal หมายถึงบริษัทเป็นผู้ให้ยืม-lender) ทุกประเภทรวมถึง ETF และยอดมูลค่าหลักประกันตามราคาตลาด* มีรายละเอียดดังนี้

รายการ	ความหมาย
ธุรกรรมระหว่างเดือน	แสดงยอดมูลค่าการยืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์ที่เกิดขึ้นจริงในเดือนนั้นทุกรายการตามมูลค่าตลาด ณ วันที่เกิดธุรกรรมนั้น
มูลค่าคงค้างสิ้นเดือน	แสดงยอดคงเหลือของมูลค่าการยืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์ ณ สิ้นเดือนตามราคาตลาด*
มูลค่าหลักประกัน	แสดงยอดมูลค่าหลักประกัน ณ สิ้นเดือน ตามราคาตลาด*

คำอธิบาย ข้อ 5 รายละเอียดลูกหนี้ที่มีปัญหา

ให้รายงานยอดรวมมูลหนี้ของลูกหนี้ที่มีปัญหา (problem loans) ทั้งบัญชี cash บัญชี margin และ บัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เช่น ลูกหนี้ตั้งซื้อหลักทรัพย์ด้วยเงินสดที่ไม่สามารถชำระเงินได้ภายในระยะเวลาที่กำหนด ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์ที่ขอผ่อนชำระ หรือ ประenomหนี้ และลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์ด้วยคุณภาพอื่น ๆ ลูกหนี้จากการซื้อขายสัญญาฯ ลูกหนี้จากการทำธุรกรรม SBL เป็นต้น โดยมีรายละเอียด ดังต่อไปนี้

รายการ	ความหมาย
มูลหนี้รวม	แสดงยอดรวมมูลหนี้รวมทุกประเภทที่ค้างชำระ เช่น มูลหนี้ค่าซื้อหลักทรัพย์ สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ดอกเบี้ยค้างชำระ ผลขาดทุนจากการขายหลักทรัพย์ เป็นต้น
จำนวนราย	แสดงจำนวนลูกหนี้ที่มีมูลหนี้คงค้างตามมูลหนี้รวม
ลูกหนี้มีปัญหารายใหม่	แสดงจำนวนลูกหนี้ที่มีมูลหนี้คงค้างตามมูลหนี้รวมเฉพาะรายที่เพิ่มจากเดือนก่อน <u>กรณีบัญชีเงินสด</u> หมายถึงลูกหนี้ที่บังคับขายแล้วยังไม่คุ้มหนี้หรือขอผ่อนชำระ <u>กรณีบัญชีมาร์จิ้น</u> หมายถึงลูกหนี้ที่บังคับชำระหนี้แล้วยังไม่คุ้มหนี้ <u>กรณีบัญชียืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์ (principal)</u> หมายถึงลูกหนี้ที่มีการบังคับหลักประกันแล้วยังไม่คุ้มหนี้ <u>กรณีบัญชีซื้อขายสัญญาฯ</u> หมายถึง ลูกหนี้ที่บังคับปิดสถานะแล้วยังไม่คุ้มหนี้
หลักประกันรวม	แสดงมูลค่าหลักประกันทุกประเภทของลูกหนี้ที่นำมาวางเป็นประกันเพื่อการชำระหนี้
สำรองค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญ	แสดงจำนวนที่กั้นไว้เพื่อหักจากลูกหนี้ที่มีปัญหาที่คาดว่าจะเรียกเก็บไม่ได้

คำอธิบาย ข้อ 6 ข้อมูลเงินลงทุนนอกตลาดฯ หรือนอกสมาคมตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA)

ให้รายงานมูลค่าเงินลงทุนนอกตลาดฯ หรือนอกสมาคมตราสารหนี้ไทย ที่มีมูลค่าตามราคาทุนตั้งแต่ 10 ล้านบาทขึ้นไป หรือมีส่วนการถือครองคิดเป็นร้อยละ 10 ขึ้นไปของจำนวนหุ้นหรือหน่วยทั้งหมดของหลักทรัพย์นั้น โดยให้รวมถึงรายละเอียดของการลงทุนในกองทุนส่วนบุคคล (private fund) ด้วย โดยแบ่งประเภท ดังนี้

รายการ	ความหมาย
ตัวเงินที่ไม่เป็นหลักทรัพย์	หมายถึง ตัวเงินที่ไม่เข้าข่ายเป็นหลักทรัพย์ตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่ กจ. 31/2547 เรื่อง การกำหนดลักษณะของตัวเงินที่เป็นหลักทรัพย์
ตราสารหนี้ที่มีได้จดทะเบียนกับสมาคมตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA)	-
หุ้นทุนนอกตลาดหลักทรัพย์	-
อื่นๆ	-

คำอธิบาย ข้อ 7 มูลค่าเงินลงทุนในหลักทรัพย์ (เฉพาะบริษัทหลักทรัพย์เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์)

ให้รายงานมูลค่าเงินลงทุนในหลักทรัพย์ โดยมีรายละเอียดดังนี้

- (1) ให้รายงานมูลค่าเงินลงทุนทั้งหมด โดยแยกประเภทเป็น ตราสารทุน ตราสารหนี้ หน่วยลงทุน ตราสารอนุพันธ์ และอื่นๆ
- (2) ในกรณีของหน่วยลงทุนให้รายงานรายละเอียดของหน่วยลงทุนที่บริษัทถือเกินกว่าร้อยละ 10 ขึ้นไปของจำนวนหน่วยที่ออกจำหน่ายแล้วของกองทุน สำหรับหน่วยลงทุนที่ถือต่ำกว่าร้อยละ 10 ของจำนวนหน่วยที่ออกจำหน่ายแล้วของกองทุน ให้คำนวณรวมกันในช่องหน่วยลงทุน-อื่นๆ

หมายเหตุ * ราคาตลาด หรือ มูลค่าตามราคาตลาด ให้ใช้หลักการคำนวณตามประกาศว่าด้วยเรื่อง การปฏิบัติงานเกี่ยวกับการให้กู้ยืมเงิน เพื่อซื้อหลักทรัพย์และการให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าที่มีใช้ลูกค้าสถาบันเพื่อขายชอร์ต