

**คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงานการทำธุรกรรม (Activities Report)**

**คำอธิบาย ข้อ 1 รายละเอียดลูกค้า**

**(1) รายละเอียดการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์**

ให้รายงานรายละเอียดยอครวมเกี่ยวกับการทำธุรกรรมการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์ ดังต่อไปนี้

รายการ	ความหมาย
ยอดรวมมูลค่าหลักทรัพย์ที่เป็นประกัน	แสดงผลรวมมูลค่าหลักทรัพย์ที่เป็นประกันของลูกค้าทุกราย และจำนวนลูกค้าที่มีหลักทรัพย์ที่เป็นประกัน
ยอดรวมมูลค่าหลักประกันอื่น	แสดงผลรวมมูลค่าหลักประกันประเภทอื่นที่มีใช้ประเภทหลักทรัพย์ของลูกค้าทุกราย และจำนวนลูกค้าที่มีหลักประกันอื่น
ยอดเงินให้กู้ยืมคด้าง (margin loan)	แสดงผลรวมยอดเงินให้กู้ยืมคด้างของลูกค้าทุกราย และจำนวนลูกค้าที่มียอดหนี้คด้าง
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) ที่เกิดขึ้นทุกรายการ ในเดือนนั้นๆ โดยมีรายละเอียดดังนี้

รายการ	ความหมาย
จำนวนราย	แสดงจำนวนรายลูกค้าที่ถูกเรียกให้วางหลักประกันเพิ่มหรือถูกบังคับชำระหนี้ในเดือนนั้นๆ โดยไม่ต้องนับซ้ำ
จำนวนเงินที่ต้องเรียกเพิ่มหรือบังคับชำระหนี้	แสดงยอดรวมจำนวนเงินที่ต้องเรียกเพิ่มหรือบังคับชำระหนี้ในเดือนนั้นๆ ทุกรายการ สำหรับมูลค่าของการ call แต่ละครั้งให้ใช้มูลค่าล่าสุดที่เกิดขึ้นจนวนรายการ call ดังกล่าวพื้นสภาพการ 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>เลขทะเบียนที่จดทะเบียนกับกรมทะเบียน การค้า 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	เลขทะเบียนที่จดทะเบียนกับกรมทะเบียน การค้า กระทรวงพาณิชย์	1234/2539 หรือ บมจ. 123
ประเภทลูกค้ำ	ID	ตัวอย่าง											
ก. บุคคลธรรมดา	- ไทย เลขประจำตัวประชาชน ตามที่ปรากฏ ในบัตรประชาชนหรือทะเบียนบ้าน	123456789123											
	- ต่างประเทศ เลขที่หนังสือเดินทาง	A12345											
ข. นิติบุคคล	เลขทะเบียนที่จดทะเบียนกับกรมทะเบียน การค้า 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												
ยอดเงินให้กู้ยืมคง ค้าง (margin loan)	แสดงยอดเงินให้กู้ยืมคงค้างของลูกค้ำแต่ละราย												
หลักทรัพย์ให้ยืม -ชื่อ -จำนวนหน่วย -จำนวนเงิน	แสดงชื่อย่อหลักทรัพย์ที่ให้ยืมทั้งหมด โดยเรียงลำดับตามจำนวนเงินจากมากไปน้อย แสดงผลรวมจำนวนหน่วยของหลักทรัพย์ที่ให้ยืมแต่ละหลักทรัพย์ แสดงผลรวมมูลค่าตามราคาตลาดของหลักทรัพย์ที่ให้ยืมแต่ละหลักทรัพย์												
หลักประกันที่เป็น หลักทรัพย์ -ชื่อ -จำนวนหน่วย -จำนวนเงิน	แสดงชื่อย่อหลักทรัพย์ทั้งหมดที่ลูกค้ำวางเป็นประกัน โดยเรียงลำดับตามจำนวนเงินจากมากไปน้อย แสดงผลรวมจำนวนหน่วยของหลักทรัพย์ที่ลูกค้ำวางเป็นประกันแต่ละหลักทรัพย์ แสดงผลรวมมูลค่าตามราคาตลาดของหลักทรัพย์ที่ลูกค้ำวางเป็นประกันแต่ละหลักทรัพย์												
หลักประกันอื่น ๆ	แสดงยอดรวมมูลค่าหลักประกันอื่น ๆ ของลูกค้ำ												
cash balance	แสดงยอดเงินของลูกค้ำแต่ละราย												
equity	แสดงยอดทรัพย์สินสุทธิของลูกค้ำแต่ละรายที่มีอยู่ทั้งหมดในบัญชีมาร์จิ้น												

(4) รายละเอียดหลักทรัพย์จดทะเบียนที่เป็นหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้น

ให้รายงานมูลค่าของหลักทรัพย์จดทะเบียนที่ใช้เป็นหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้นทุกรายการเรียงตามลำดับจากมากไปน้อยตามสัดส่วนมูลค่าของหลักประกันนั้นเทียบกับมูลค่าหลักประกันรวม 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	บัญชีของลูกค้ำที่เป็นบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม
บัญชีบริษัทหลักทรัพย์อื่น (sub broker)	บัญชีของลูกค้ำที่เป็นบริษัทหลักทรัพย์อื่นที่มีการส่งซื้อขายผ่านบริษัท (ถ้ามี ให้รายงานแยกตามแต่ละบริษัทหลักทรัพย์)
บัญชีลูกค้ำต่างประเทศ	บัญชีของลูกค้ำที่เป็นชาวต่างประเทศซึ่งถือหนังสือเดินทาง (PASSPORT) และชาวต่างประเทศที่มีถิ่นที่อยู่หรือประกอบธุรกิจในต่างประเทศ ทั้งนี้ไม่รวมถึงคนที่ถือใบต่างด้าวซึ่งมีถิ่นที่อยู่ในประเทศไทย สำหรับบัญชีลูกค้ำนิติบุคคลต่างประเทศ ให้หมายรวมถึง บริษัทต่างประเทศที่ทำหน้าที่เป็นตัวแทนหรือผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้ลูกค้ำด้วย
บัญชีลูกค้ำในประเทศ	บัญชีของลูกค้ำในประเทศ ทั้งที่เป็นบุคคลธรรมดา นิติบุคคล หรือกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ โดยบัญชีลูกค้ำนิติบุคคลในประเทศ ให้แยกเป็น สถาบันการเงิน บริษัท ประกัน และอื่น ๆ ซึ่งสถาบันการเงินในที่นี้ หมายถึง สถาบันการเงินตามกฎหมายว่าด้วยดอกเบี้ยเงินให้กู้ยืมของสถาบันการเงิน อันได้แก่ ธนาคารแห่งประเทศไทย ธนาคารพาณิชย์ ธนาคารออมสิน ธนาคารอาคารสงเคราะห์ ธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร บริษัทเงินทุน บริษัทหลักทรัพย์ บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ สหกรณ์ออมทรัพย์ ชุมนุมสหกรณ์ออมทรัพย์ เป็นต้น สำหรับบริษัทประกัน ให้หมายถึงบริษัทประกันทุกประเภท สำหรับอื่นๆ หมายถึงนิติบุคคลอื่นๆ นอกเหนือจาก 2 ประเภทแรก

**(2) ปริมาณการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้ำในประเทศ**

ให้รายงานยอดรวมปริมาณการซื้อขาย ปริมาณการขาย ปริมาณรวม ของสัญญาฯ ทุกประเภทนับตามจำนวนสัญญา ในตลาดอนุพันธ์ (TFEX) ทั้งลูกค้ำกรุงเทพมหานคร และลูกค้ำต่างจังหวัด โดยแยกตามสถานที่ที่ลูกค้ำส่งคำสั่งซื้อขาย ดังนี้

รายการ	ความหมาย
สั่งซื้อขายผ่านสำนักงานใหญ่	ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายผ่านสำนักงานใหญ่ของบริษัท
สั่งซื้อขายผ่านสาขา หรือสำนักงานตัวแทน	ลูกค้าส่งคำสั่งซื้อขายผ่านสาขา หรือ สำนักงานตัวแทน โดยให้ระบุรหัสสาขา รหัสอำเภอ และรหัสจังหวัดด้วย

**คำอธิบาย ข้อ 3 ข้อมูลการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านอกตลาด**

**(1) มูลค่าการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านอกตลาด (Notional Amount) แบ่งตามตัวแปรอ้างอิง  
และประเภทสัญญา**

ให้รายงานยอดรวมโดยใช้มูลค่าตามสัญญา (notional amount) ต่อสัญญาที่เกิดขึ้นในเดือนนั้น ตามแต่ละประเภทสัญญาฯ 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) แยกตามประเภทลูกค้าที่เป็นรายย่อย หรือสถาบัน โดยให้รายงานยอดมูลค่าการยืม (กรณี principal หมายถึงบริษัทเป็นผู้ยืม-borrower) ยอดมูลค่าการให้ยืม (กรณีprincipal หมายถึงบริษัทเป็นผู้ให้ยืม-lender) ทุกประเภทรวมถึง ETF และยอดมูลค่าหลักประกันตามราคาตลาด มีรายละเอียดดังนี้

รายการ	ความหมาย
ธุรกรรมระหว่างเดือน	แสดงยอดมูลค่าการยืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์ที่เกิดขึ้นจริงในเดือนนั้นทุกรายการ ตามมูลค่าตลาด 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 ลูกหนี้สั่งซื้อหลักทรัพย์ด้วยเงินสดที่ไม่สามารถชำระเงินได้ภายในระยะเวลาที่กำหนด ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์ที่ขอผ่อนชำระ หรือ ประenomหนี้ และลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์ด้วยคุณภาพอื่น ๆ ลูกหนี้จากการซื้อขายสัญญาฯ ลูกหนี้จากการทำธุรกรรม SBL เป็นต้น โดยมีรายละเอียด ดังต่อไปนี้

รายการ	ความหมาย
มูลหนี้รวม	แสดงยอดรวมมูลหนี้รวมทุกประเภทที่ค้างชำระ เช่น มูลหนี้ค่าซื้อหลักทรัพย์ สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ดอกเบี้ยค้างชำระ ผลขาดทุนจากการขายหลักทรัพย์ เป็นต้น
จำนวนราย	แสดงจำนวนลูกหนี้ที่มีมูลหนี้ค้างตามมูลหนี้รวม
ลูกหนี้มีปัญหารายใหม่	แสดงจำนวนลูกหนี้ที่มีมูลหนี้ค้างตามมูลหนี้รวมเฉพาะรายที่เพิ่มจากเดือนก่อน กรณีบัญชีเงินสด หมายถึงลูกหนี้ที่บังคับขายแล้วยังไม่คุ้มหนี้หรือขอผ่อนชำระ กรณีบัญชีมาร์จิ้น หมายถึงลูกหนี้ที่บังคับชำระหนี้แล้วยังไม่คุ้มหนี้ กรณีบัญชียืมหรือให้ยืมหลักทรัพย์ (principal) หมายถึงลูกหนี้ที่มีการบังคับหลักประกันแล้วยังไม่คุ้มหนี้ กรณีบัญชีซื้อขายสัญญาฯ หมายถึง ลูกหนี้ที่บังคับปิดสถานะแล้วยังไม่คุ้มหนี้
หลักประกันรวม	แสดงมูลค่าหลักประกันทุกประเภทของลูกหนี้ที่นำมาวางเป็นประกันเพื่อการชำระหนี้
สำรองค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญ	แสดงจำนวนที่กันไว้เพื่อหักจากลูกหนี้ที่มีปัญหาที่คาดว่าจะเรียกเก็บไม่ได้

**คำอธิบาย ข้อ 6 ข้อมูลเงินลงทุนนอกตลาดฯ หรือนอกสมาคมตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA)**

ให้รายงานมูลค่าเงินลงทุนนอกตลาดฯ หรือนอกสมาคมตราสารหนี้ไทย ที่มีมูลค่าตามราคาทุนตั้งแต่ 10 ล้านบาท ขึ้นไป 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 ของจำนวนหน่วยที่ออกจำหน่ายแล้วของกองทุนให้คำนวณรวมกันในช่องหน่วยลงทุน-อื่นๆ

หมายเหตุ \* ราคาตลาด หรือ มูลค่าตามราคาตลาด ให้ใช้หลักการคำนวณตามประกาศว่าด้วยเรื่อง การปฏิบัติงานเกี่ยวกับการให้กู้ยืมเงิน เพื่อซื้อหลักทรัพย์และการให้ยืมหลักทรัพย์แก่ลูกค้าที่มีใช้ลูกค้าสถาบันเพื่อขายชอร์ต