

คำอธิบายข้อมูล	
รหัสของตาราง	TFIIC_TXN_SMY_001
ชื่อตาราง	ข้อมูลยอดคงค้างตราสารการเงิน จำแนกตามผู้ถือครอง (2545 - 2551)
ความถี่ของข้อมูล ความล่าช้าและ กำหนดเวลาเผยแพร่	ความถี่ : รายปี
ความครอบคลุม	ตราสารหนี้ : ครอบคลุมตราสารชนิดมีใบตราสาร (Scrip) และชนิดไร้ใบตราสาร (Scripless) ที่อยู่ใน (1) บัญชีฝากตราสารเพื่อตนเอง (Port) (2) บัญชีฝากตราสารเพื่อลูกค้า (Client) เฉพาะที่ฝากไว้กับผู้เก็บรักษาหลักทรัพย์ (Custodians) และนายหน้าค้าหลักทรัพย์ (Brokers) (3) ตราสารหนี้ที่ธนาคารแห่งประเทศไทยเป็นนายทะเบียน ตราสารทุน / ตราสารอนุพันธ์ : ครอบคลุมตราสารชนิดมีใบตราสาร (Scrip) และชนิดไร้ใบตราสาร (Scripless) ที่อยู่ใน (1) บัญชีฝากตราสารเพื่อตนเอง (Port) (2) บัญชีฝากตราสารเพื่อลูกค้า (Client) เฉพาะที่ฝากไว้กับผู้เก็บรักษาหลักทรัพย์ (Custodians) และนายหน้าค้าหลักทรัพย์ (Brokers)
การบันทึกข้อมูลและ มาตรฐานบัญชีที่ เกี่ยวข้อง	ตราสารหนี้ : แสดงมูลค่ายอดคงค้างตราสารหนี้ที่ยังมีอายุอยู่ในวันสิ้นงวดที่ระบุ (ยังไม่ครบกำหนดไถ่ถอน) บันทึกยอดคงค้างตราสารหนี้โดยใช้ราคาพาร์ ตราสารทุน / ตราสารอนุพันธ์ : แสดงมูลค่ายอดคงค้างของตราสารทุน / ตราสารอนุพันธ์ บันทึกยอดคงค้างตราสารทุน / ตราสารอนุพันธ์โดยใช้ราคาตลาด ณ วันสิ้นงวดที่ระบุ หน่วยลงทุน : แสดงมูลค่าสุทธิ (Net Asset Value: NAV) ณ วันสิ้นงวดที่ระบุ
นิยาม	ตราสารหนี้ คือ ตราสารแสดงความเป็นหนี้ หรือ สัญญาเงินกู้ที่บริษัทออกให้แก่ผู้ลงทุนทั่วไป โดยสัญญาว่าจะใช้เงินตามกำหนด และจ่ายดอกเบี้ยตามกำหนด กล่าวอีกนัยหนึ่งคือเป็นตราสารสิทธิที่แสดงความเป็น "เจ้าหนี้ของกิจการ" โดยทั่วไปแล้วการลงทุนในตราสารหนี้ จะมีความเสี่ยงน้อยกว่าการลงทุนในตราสารทุน ตราสารทุน คือ ตราสารที่แสดงความเป็นเจ้าของกิจการในฐานะผู้ถือหุ้น การลงทุนในตราสารทุนนี้ จะมีความเสี่ยงมากกว่าการลงทุนในตราสารหนี้ เพราะสิทธิเรียกร้องในทรัพย์สินของกิจการในกรณีที่เกิดการล้มละลายจะอยู่หลังเจ้าหนี้ ข้อดีของการเป็นเจ้าของ หรือผู้ถือหุ้นของกิจการก็คือ ถ้ากิจการมีกำไร จะมีส่วนแบ่งในกำไรของกิจการ อย่างเต็มที่ในรูปของเงินปันผล แต่ในทางกลับกันถ้ากิจการขาดทุน ผู้เป็นเจ้าของอาจจะไม่ได้รับผลตอบแทนเลย เพราะกิจการไม่สามารถจ่ายเงินปันผลได้นอกจากนี้ผู้ลงทุนในตราสารทุนก็อาจจะได้รับกำไร หรือขาดทุนจากการเปลี่ยนแปลงของราคาหุ้นที่อยู่ในตลาดด้วย ตราสารอนุพันธ์ เป็นตราสารการเงินซึ่งมูลค่าหรือราคาของตราสารเกี่ยวเนื่องกับมูลค่าของสินทรัพย์หรือตัวแปรอื่น ที่ตราสารนั้นอ้างอิงถึง (Underlying Assets) ซึ่งได้แก่ หุ้นสามัญ เงินตราต่างประเทศ พันธบัตร สินค้าโภคภัณฑ์ ดัชนีหลักทรัพย์ อัตราแลกเปลี่ยน อัตราดอกเบี้ย หน่วยลงทุน เป็นตราสารที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม (บลจ.) เพื่อการระดมเงินทุนจากประชาชนมาลงทุนให้ได้รับผลตอบแทนสูงสุด แล้วนำผลกำไรหรือขาดทุนมาเฉลี่ยคืนให้แก่ผู้ถือหุ้น หน่วยลงทุนในกองทุนอสังหาริมทรัพย์ เป็นหน่วยลงทุนในกองทุนรวมที่จัดตั้งขึ้นโดยมีวัตถุประสงค์หลักเพื่อลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ โดยนำเงินที่ได้จากการขาย หน่วยลงทุนไปซื้อหรือเช่าอสังหาริมทรัพย์ และหาผลประโยชน์จากอสังหาริมทรัพย์ดังกล่าว มีลักษณะเป็นกองทุนปิดและถูกกำหนดให้ต้องจดทะเบียนเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์หรือ เป็นหลักทรัพย์ขึ้นทะเบียนกับศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์ การจัดตั้งต้องมีขนาดกองทุนไม่ต่ำกว่า 500 ล้านบาท และมีผู้ถือหุ้นหน่วยลงทุนไม่น้อยกว่า 250 ราย
การจัดกลุ่ม	<u>กลุ่มผู้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศ และกลุ่มผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ</u> 1. กลุ่มผู้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศ (Residents) หมายถึง หน่วยสถาบันซึ่งประกอบด้วยครัวเรือนหรือองค์กรที่มีการดำเนินกิจกรรมหรือมีธุรกรรมทางเศรษฐกิจ (center of economic interest) ในประเทศที่ตั้งอยู่ (economic territory) อย่างชัดเจนและต่อเนื่องโดยมีระยะเวลาตั้งแต่ 1 ปี เป็นต้นไป ยกเว้นเจ้าหน้าที่ที่ปฏิบัติงานใน

คำอธิบายข้อมูล	
	หน่วยงานของรัฐ เช่น สถานทูต ฐานทัพทหาร รวมถึงนักเรียนหรือคนไข้ที่พำนักรุ ในต่างประเทศ ให้ถือว่าเป็นผู้มีถิ่นฐานในประเทศเดิมของตน ทั้งนี้ ผู้มีถิ่นที่อยู่ใน ประเทศจะรวมถึงหน่วยสถาบันที่เป็นบริษัทลูกของสถาบันต่างประเทศหรือบริษัทที่ผู้ ถือหุ้นส่วนใหญ่เป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ในต่างประเทศ (Ancillary Corporations) บริษัทร่วม ทุน (Holding Companies) บริษัทที่ตั้งขึ้นเพื่อวัตถุประสงค์พิเศษ (Special Purpose Entities: SPEs) ที่มีการดำเนินกิจกรรมตามลักษณะข้างต้นด้วย 2. ผู้มีถิ่นที่อยู่ต่างประเทศ (Non-residents) หมายถึง ผู้ที่มีถิ่นฐานในประเทศ ตามความหมายที่อธิบายข้างต้น ประเภทตราสาร 1. ตราสารหนี้ แบ่งเป็น 1.1 พันธบัตร เป็นตราสารหนี้ที่มีอายุตั้งแต่ 1 ปีขึ้นไป แบ่งตามกลุ่มผู้ออก ได้แก่ รัฐบาลโดยกระทรวงการคลัง รัฐวิสาหกิจ (องค์กรที่ได้รับการจัดตั้งขึ้นเพื่อ ดำเนินธุรกิจ โดยมีรัฐบาลหรือหน่วยงานของรัฐเป็นผู้ถือหุ้นหรือร่วมกันถือหุ้น ตั้งแต่ร้อยละ 50 ขึ้นไป) และธนาคารแห่งประเทศไทย 1.2 ตั๋วเงินคลัง เป็นตราสารหนี้ที่อายุไม่เกิน 1 ปี ออกจำหน่ายโดยรัฐบาล 1.3 หุ้นกู้ เป็นตราสารที่บริษัทเอกชนออกเพื่อกู้เงินระยะยาวจากผู้ลงทุน ผู้ลงทุน เมื่อตัดสินใจซื้อหุ้นกู้จะมีฐานะเป็นเจ้าหนี้ของกิจการ ผู้ออกจะต้องจ่าย ผลตอบแทนเป็นดอกเบี้ยให้แก่ผู้ถือตามระยะเวลา และอัตราที่กำหนด ผู้ถือจะ ได้เงินต้นคืน ครบถ้วน เมื่อสิ้นสุดอายุตามระบุในเอกสารทั้งนี้ จะรวมหุ้นกู้ของ บริษัทที่จัดเป็นรัฐวิสาหกิจ เช่น ปตท. เป็นต้น และพันธบัตรองค์กรบริหาร สินเชื่อสหกรณ์ทรัพย์ และพันธบัตรกองทุนน้ำมัน 2. ตราสารทุน แบ่งเป็น 2.1 หุ้นสามัญ (Common Stock) เป็นตราสารสิทธิที่แสดงความเป็นเจ้าของกิจการ ผู้ถือหุ้นประเภทนี้มีฐานะเป็นเจ้าของและมีสิทธิบริหารงานของบริษัทได้ โดย การเลือกตั้งกรรมการเพื่อบริหารงานแทนตน และเมื่อกิจการมีกำไรจากการ ดำเนินงาน ผู้ถือหุ้นสามัญจะได้รับเงินปันผลในอัตราที่จัดสรรโดยที่ประชุมใหญ่ ผู้ถือหุ้น โดยคำนวณตามสัดส่วนของจำนวนหุ้นที่ถือครอง ทั้งนี้ เงินปันผลอาจ มากหรือน้อยขึ้นอยู่กับผลกำไรจากการดำเนินงานประจำปีของกิจการ และเมื่อ บริษัทเลิกกิจการ ผู้ถือหุ้นจะได้รับส่วนแบ่งในสินทรัพย์เป็นกลุ่มสุดท้าย 2.2 หุ้นบุริมสิทธิ (Preferred Stock) เป็นตราสารสิทธิที่แสดงความเป็นเจ้าของ กิจการที่มีการจัดบุริมสิทธิไว้อย่างชัดเจนไม่สามารถยกเลิกได้ เมื่อกิจการมีกำไร จากการดำเนินงาน ผู้ถือหุ้นบุริมสิทธิจะได้รับเงินปันผลในอัตราคงที่ตามที่จัด บุริมสิทธิไว้ อาจจะมีมากหรือน้อยกว่าผู้ถือหุ้นสามัญก็ได้ แต่หากกิจการนั้นต้อง เลิกดำเนินการและมีการชำระบัญชีโดยการขายทรัพย์สิน ผู้ถือหุ้นบุริมสิทธิจะ ได้รับเงินคืนทุนก่อนผู้ถือหุ้นสามัญ ทั้งนี้ ให้รวมหุ้นบุริมสิทธิชนิดไม่รวมรับ 3. ตราสารอนุพันธ์ แบ่งเป็น 3.1 ใบสำคัญแสดงสิทธิในการซื้อหลักทรัพย์ (Warrant) ตราสารการเงิน ประเภทหนึ่งที่ให้สิทธิแก่ผู้ถือในการซื้อหลักทรัพย์ที่ใบสำคัญแสดงสิทธิชิ้น นั้นอ้างอิงอยู่ (Underlying Securities) ในจำนวน ราคา และตามระยะเวลาที่ กำหนดไว้ ทั้งนี้ หากผู้ลงทุนไม่เห็นประโยชน์ของการใช้สิทธิในการซื้อ หลักทรัพย์ตามที่ระบุไว้ ก็สามารถเลือกไม่ใช้สิทธิได้ โดยทั่วไปบริษัทผู้ออก หลักทรัพย์มักจะออกใบสำคัญแสดงสิทธิในการซื้อหุ้นสามัญ เพื่อให้สิทธิแก่ผู้ ถือหลักทรัพย์ในการจองซื้อหุ้นสามัญออกใหม่ของบริษัทตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ 3.2 ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivatives Warrant) ตราสารที่มีลักษณะ คล้ายคลึงกับใบสำคัญแสดงสิทธิทั่วไป (Warrant) แต่จะให้สิทธิแก่ผู้ถือในการ ซื้อ หรือขายหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) 4. หน่วยลงทุน 5. หน่วยลงทุนในกองทุนอสังหาริมทรัพย์
แหล่งที่มาของข้อมูล	1. ธนาคารแห่งประเทศไทย 2. ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย 3. สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ 4. สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย 5. ผู้เก็บรักษาหลักทรัพย์ (Custodians)

คำอธิบายข้อมูล	
สื่อที่ใช้ในการเผยแพร่	เว็บไซต์ ศูนย์ข้อมูลตราสารการเงินแห่งประเทศไทย (www.tfiic.org)
การปรับปรุงข้อมูล	
หมายเหตุ	