

คำศัพท์ส่วนที่ 1 ขอบเขต

ให้ใช้คำอธิบายคำศัพท์ตามภาคผนวกนี้เพื่อประกอบการอธิบายคำย่อและความหมายของคำย่อ รวมถึงคำศัพท์ที่ปรากฏในภาคผนวกแนบท้ายประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยหนังสือชี้ชวนเสนอขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย และกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนประเภทสถาบัน

ส่วนที่ 2 คำอธิบายศัพท์

| <u>คำศัพท์</u>            | <u>คำอธิบายศัพท์</u>                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|---------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| “กองทุนรวมปิด”            | กองทุนรวมประเภทไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุน                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| “กองทุนรวมเปิด”           | กองทุนรวมประเภทรับซื้อคืนหน่วยลงทุน                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| “กองทุนรวม<br>buy & hold” | กองทุนรวมที่มุ่งเน้นลงทุนเพียงครั้งเดียวโดยถือทรัพย์สินที่ลงทุนไว้จนครบกำหนดอายุของทรัพย์สิน หรือครบอายุของรอบการลงทุนของกองทุนรวม หรือครบอายุของกองทุนรวม                                                                                                                                                                         |
| “กองทุนรวม ETF”           | กองทุนรวมอีทีเอฟตามประกาศการลงทุน                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| “กองทุนรวม Thai ESG”      | กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนตามประกาศการลงทุน                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| “กองทุนรวม<br>Thai ESGX   | กองทุนรวมไทยเพื่อความยั่งยืนแบบพิเศษตามประกาศการลงทุน                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| “กองทุนรวม trigger”       | กองทุนรวมที่ระบุว่าจะเลิกกองทุนรวมหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุนอัตโนมัติเมื่อหน่วยลงทุนมีมูลค่าตามเป้าหมายที่กำหนด                                                                                                                                                                                                                      |
| “การลดความเสี่ยง”         | การเข้าเป็นคู่สัญญาในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีลักษณะครบถ้วนดังนี้<br>(1) ไม่มีวัตถุประสงค์เพื่อหาผลประโยชน์โดยการเก็งกำไร (speculate)<br>(2) มีผลให้ความเสี่ยงในการลงทุนโดยรวมของกองทุนรวมลดลง<br>(3) เป็นการลดความเสี่ยงทั่วไปและความเสี่ยงเฉพาะของทรัพย์สินที่ต้องการลดความเสี่ยง<br>(4) สามารถลดความเสี่ยงได้อย่างมีประสิทธิภาพ |
| “ข้อมูลผูกพัน”            | ข้อมูลผูกพันระหว่างผู้ถือหน่วยลงทุนกับ บลจ.                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

**คำศัพท์****คำอธิบายศัพท์**

“คริปโทแอสเซต”

คริปโทแอสเซตตามประกาศการลงทุน

“โครงการ”

โครงการจัดการกองทุนรวม

“ความเสี่ยงเกี่ยวกับ  
ต่างประเทศ”

ความเสี่ยงจากการลงทุนในทรัพย์สินหรือการเข้าเป็นคู่สัญญาในธุรกรรมทางการเงินในลักษณะใดลักษณะหนึ่งหรือหลายลักษณะดังนี้

- (1) ความเสี่ยงด้านผู้ออกตราสารหรือคู่สัญญาในต่างประเทศ แต่ไม่รวมถึงกรณีที่ผู้ออกหรือคู่สัญญาเป็นสาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศที่ได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจธนาคารพาณิชย์ในประเทศไทย
- (2) ความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ

“เงินทุน”

เงินที่ผู้ลงทุนแต่ละรายชำระเป็นค่าซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวม มุ่งรักษาเงินทุน ทั้งนี้ ไม่รวมถึงค่าธรรมเนียมการซื้อหน่วยลงทุน

“เงินทุนโครงการ”

เงินทุนโครงการที่ บลจ. ยื่นขอจดทะเบียนไว้กับสำนักงานตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการจดทะเบียนกองทรัสต์สิน เป็นกองทุนรวมและการแก้ไขเพิ่มเติมรายการทางทะเบียน

“เงินฝากหรือตราสาร  
เทียบเท่าเงินฝาก”

ทรัสต์สินดังนี้

- (1) เงินฝาก เงินฝากอิสลาม หรือตราสารอื่นที่มีลักษณะทำนองเดียวกับเงินฝาก
- (2) สลากออมทรัพย์ที่ออกตามกฎหมายว่าด้วยธนาคารเพื่อการเกษตรและสหกรณ์การเกษตร
- (3) สลากออมสินพิเศษที่ออกตามกฎหมายว่าด้วยธนาคารออมสิน

“ตราสารภาครัฐไทย”

ตราสารดังนี้

- (1) ตั๋วเงินคลัง
- (2) พันธบัตรรัฐบาล หรือพันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย
- (3) พันธบัตร ตั๋วแลกเงิน ตั๋วสัญญาใช้เงิน ศุภก หรือหุ้นกู้ ที่กระทรวงการคลังหรือกองทุนฟื้นฟูเป็นผู้มีภาระผูกพัน

**คำศัพท์****คำอธิบายศัพท์**

“ตราสารภาครัฐ  
ต่างประเทศ”

ตราสารที่มีรูปแบบทำนองเดียวกับตราสารภาครัฐไทย ที่รัฐบาลต่างประเทศ  
กระทรวงการคลัง ธนาคารกลาง หรือหน่วยงานของรัฐบาลต่างประเทศ  
หรือองค์การระหว่างประเทศ เป็นผู้ออกหรือผู้ค้ำประกัน แต่ไม่รวมถึง  
ตราสารที่ออกโดย องค์การปกครองส่วนท้องถิ่นของประเทศไทย

“ตลาดซื้อขายหลักทรัพย์  
ต่างประเทศ”

ศูนย์กลางหรือเครือข่ายใด ๆ ที่จัดให้มีขึ้นเพื่อการซื้อขายหลักทรัพย์  
ในต่างประเทศ โดยมีลักษณะครบถ้วนดังนี้  
(1) มีการรวบรวมคำเสนอซื้อเสนอขายหลักทรัพย์จากผู้เสนอซื้อ  
หลายรายและผู้เสนอขายหลายราย  
(2) มีการกำหนดหลักเกณฑ์หรือจัดให้มีระบบ ซึ่งกำหนดเกี่ยวกับ  
วิธีการในการซื้อขายหลักทรัพย์ไว้เป็นการล่วงหน้า โดยผู้ให้บริการ  
ไม่อาจใช้ดุลยพินิจในการจัดการซื้อขาย เป็นประการอื่น และผู้เสนอซื้อ  
เสนอขายยินยอมที่จะผูกพัน ตามหลักเกณฑ์หรือระบบนั้น

“ทรัพย์สินประเภท SIP”

ทรัพย์สินที่จัดอยู่ในประเภท Specific Investment Product (SIP)  
ดังต่อไปนี้ แล้วแต่กรณี

- (1) ทรัพย์สินตามข้อ 9 ในตอนที่ 1.1 : อัตราส่วนการลงทุนสำหรับ MF  
ทั่วไป ของส่วนที่ 1 : อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สิน  
หรือคู่สัญญา (single entity limit) ในภาคผนวก 4-retail MF อัตราส่วน  
การลงทุนของ retail MF แห่งประกาศการลงทุน ในกรณีที่เป็น  
กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป
- (2) ทรัพย์สินตามข้อ 9 ในตอนที่ 1.1 : อัตราส่วนการลงทุนสำหรับกองทุน  
AI ทั่วไป ของส่วนที่ 1 : อัตราส่วนการลงทุนที่คำนวณตามผู้ออกทรัพย์สิน  
หรือคู่สัญญา (single entity limit) ในภาคผนวก 4-AI อัตราส่วนการลงทุน  
ของกองทุน AI แห่งประกาศการลงทุน ในกรณีที่เป็นกองทุนรวมเพื่อ  
ผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย

“โทเคนดิจิทัล  
เพื่อการลงทุน”

โทเคนดิจิทัลเพื่อการลงทุนตามประกาศการลงทุน

“บลจ.”

บริษัทหลักทรัพย์ที่ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภท  
การจัดการกองทุนรวม

**คำศัพท์****คำอธิบายศัพท์**

“ประกาศการจัดการ  
กองทุน”

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์การจัดการ  
กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย  
กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนประเภทสถาบัน และกองทุนส่วนบุคคล

“ประกาศการลงทุน”

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยการลงทุนของกองทุน

“ประกาศที่  
สน. 69/2564 ”

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์  
ที่ สน. 69/2564 เรื่อง หนังสือชี้ชวนเสนอขายหน่วยลงทุนของ  
กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนทั่วไป กองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนที่มีใช้รายย่อย  
และกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนประเภทสถาบัน ลงวันที่ 23 ธันวาคม พ.ศ. 2564  
และที่แก้ไขเพิ่มเติม (ถ้ามี)

“ผู้ค้าหน่วยลงทุนร่วม”

ผู้ลงทุนรายใหญ่ที่ บลจ. ระบุอย่างเฉพาะเจาะจงไว้ในโครงการ  
ให้ทำการซื้อหรือขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม ETF กับ บลจ. ได้

“ผู้ดูแลผลประโยชน์”

ผู้ดูแลผลประโยชน์ของกองทุนรวม

“ผู้ดูแลสภาพคล่อง”

ผู้ลงทุนรายใหญ่ที่ได้รับการแต่งตั้งจาก บลจ. ให้ทำหน้าที่เพื่อให้ราคา  
ซื้อขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวม ETF ในตลาดรองสะท้อนมูลค่า  
หน่วยลงทุนที่คำนวณจาก NAV ได้อย่างใกล้เคียงกัน

“ผู้ประกัน”

บุคคลที่ให้การประกันว่า หากผู้ลงทุนได้ลงทุนในหน่วยลงทุน  
ของกองทุนรวมมีประกันจนครบตามระยะเวลาที่กำหนดในโครงการ  
ผู้ลงทุนจะได้รับชำระเงินลงทุนหรือผลตอบแทนจากการไถ่ถอนหรือ  
ขายคืนหน่วยลงทุน แล้วแต่กรณี ตามจำนวนเงินที่ประกันไว้

“ผู้ลงทุนรายใหญ่”

ผู้ลงทุนที่ซื้อหรือขายหน่วยลงทุนของกองทุนรวมกับ บลจ. ในปริมาณ  
หรือมูลค่าตามที่กำหนดไว้ในโครงการซึ่งต้องไม่น้อยกว่า 10 ล้านบาท  
หรือตามที่ได้รับผ่อนผันจากสำนักงานเป็นรายกรณี

“ผู้สนับสนุนการขายหรือ  
รับซื้อคืน”

บุคคลที่ บลจ. มอบหมายให้ทำหน้าที่ขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน  
แล้วแต่กรณี ของกองทุนรวม

“มูลค่าหน่วยลงทุน”

มูลค่าทรัพย์สินสุทธิหารด้วยจำนวนหน่วยลงทุนที่จำหน่ายได้ทั้งหมด  
เมื่อสิ้นวันทำการที่คำนวณนั้น

**คำศัพท์****คำอธิบายศัพท์**

“ลงทุน”

การจัดการลงทุนในทรัพย์สินหรือการเข้าเป็นคู่สัญญาในธุรกรรมทางการเงิน หรือการได้มาหรือมีไว้ซึ่งทรัพย์สินหรือธุรกรรมดังกล่าว

“ศูนย์ซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล”

ศูนย์ซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัลตามกฎหมายว่าด้วยการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล โดยศูนย์ซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัลดังกล่าวอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของทางการหรือหน่วยงานที่ทำหน้าที่กำกับดูแลด้านสินทรัพย์ดิจิทัลหรือทรัพย์สินที่มีลักษณะทำนองเดียวกับสินทรัพย์ดิจิทัล

“ศูนย์ซื้อขาย derivative”

ศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ได้รับใบอนุญาตตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศ ซึ่งสามารถให้บริการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้ตามกฎหมายของประเทศนั้นและได้รับการยอมรับจากสำนักงาน

“สมาคม”

สมาคมที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจหลักทรัพย์ที่จัดตั้งโดยได้รับใบอนุญาตและจดทะเบียนกับสำนักงาน โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อทำการส่งเสริมและพัฒนาธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทที่เกี่ยวกับการจัดการลงทุน

“หน่วย private equity”

หน่วยของกิจการเงินร่วมลงทุน (private equity) อันได้แก่ หุ้น ใบทรัสต์ ตราสารหรือหลักฐานแสดงสิทธิในทรัพย์สินของกิจการอย่างใดอย่างหนึ่ง ดังนี้ ทั้งนี้ ไม่ว่ากิจการดังกล่าวจะจัดตั้งขึ้นในรูปของบริษัท ทรัสต์ หรือรูปแบบอื่นใด

(1) ทรัสต์เพื่อประกอบกิจการเงินร่วมลงทุนตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการกำหนดประเภทธุรกรรมในตลาดทุนที่ใช้ทรัสต์ได้

(2) กิจการเงินร่วมลงทุนตามกฎหมายต่างประเทศที่มีลักษณะครบถ้วน ดังนี้

(ก) มีวัตถุประสงค์เพื่อการลงทุนร่วมกันของผู้ลงทุนตั้งแต่ 2 รายขึ้นไป ทั้งนี้ ต้องมิได้เป็นไปเพื่อแสวงหาประโยชน์จากการจัดการทรัพย์สินส่วนตัวของบุคคลใดหรือกลุ่มบุคคลใดเป็นการเฉพาะ

(ข) มีการมอบหมายให้บุคคลหนึ่งบุคคลใดเป็นผู้จัดการเงินทุน และทรัพย์สินที่เกิดจากเงินทุน

(ค) มีนโยบายการลงทุนในกิจการอื่นผ่านการเข้าทำสัญญา การลงทุนในหุ้นหรือการสนับสนุนทางการเงินที่ก่อให้เกิดสิทธิในการได้มาซึ่งหุ้น

**คำศัพท์****คำอธิบายศัพท์**

|                             |                                                                                                                                                                                          |
|-----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| “active management”         | ของกิจการนั้นในภายหลัง โดยมีส่วนในการกำกับดูแลแผนธุรกิจ การดำเนินงานหรือการปรับปรุงการดำเนินงาน หรือการดำเนินการอื่นใด ในลักษณะที่สะท้อนถึงการมีบทบาทต่อการดำเนินธุรกิจของกิจการดังกล่าว |
| “benchmark”                 | ตัวชี้วัดของกองทุน ซึ่งเป็นดัชนีหรือองค์ประกอบของดัชนีที่มีการเผยแพร่อย่างกว้างขวางและสอดคล้องกับนโยบายการลงทุนของกองทุนนั้น                                                             |
| “complex derivative”        | การลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีกลยุทธ์แบบซับซ้อน (complex strategic investment) หรือการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีความซับซ้อน (exotic derivative)                               |
| “crystallization frequency” | ความถี่ในการเรียกเก็บและจ่ายค่าธรรมเนียมตามผลการดำเนินงานที่สะสมให้กับ บลจ.                                                                                                              |
| “derivative”                | สัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามกฎหมายต่างประเทศที่มีลักษณะในทำนองเดียวกัน                                                           |
| “excess performance ”       | ความแตกต่างระหว่างผลการดำเนินงานสุทธิของกองทุนรวมและผลการดำเนินงานของ benchmark หรือ reference indicator                                                                                 |
| “fulcrum fee model”         | วิธีการคำนวณค่าธรรมเนียมโดยสามารถปรับอัตราค่าธรรมเนียมขึ้นหรือลงได้ตามผลการดำเนินงานซึ่งเปรียบเทียบกับตัวชี้วัดอ้างอิง                                                                   |
| “High Water Mark model”     | วิธีการคำนวณค่าธรรมเนียมโดยอ้างอิงระดับของผลการดำเนินงานสูงสุดของกองทุนรวมที่ผ่านมา                                                                                                      |
| “HWM”                       | ค่าสูงสุดของ NAV ต่อหน่วยลงทุนในรอบ performance reference period                                                                                                                         |
| “inverse management”        | inverse management ตามประกาศการลงทุน                                                                                                                                                     |

| <u>คำศัพท์</u>                 | <u>คำอธิบายศัพท์</u>                                                                                                                                                                                |
|--------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| “leveraged management”         | leveraged management ตามประกาศการลงทุน                                                                                                                                                              |
| “NAV”                          | มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (Net Asset Value)                                                                                                                                                              |
| “net exposure”                 | มูลค่าการลงทุนสุทธิในทรัพย์สินไม่ว่าเป็นการลงทุนโดยตรงหรือโดยอ้อมผ่านการลงทุนในตราสาร สัญญา หรือคริปโทแอสเซตที่ให้ผลตอบแทนโดยอ้างอิงอยู่กับทรัพย์สิน ซึ่งเป็นผลให้กองทุนมีความเสี่ยงในทรัพย์สินนั้น |
| “Over-the-Counter derivative”  | derivative ที่ซื้อขายนอกศูนย์ซื้อขาย derivative                                                                                                                                                     |
| “performance reference period” | ระยะเวลาที่ใช้วัดผลการดำเนินงานของกองทุนรวม และนำไปเปรียบเทียบกับ reference indicator ซึ่งเมื่อครบช่วงเวลาดังกล่าว กองทุนสามารถเริ่มนับการชดเชยผลการดำเนินงานที่ติดลบหรือขาดทุนสะสมใหม่ได้          |
| “portfolio duration”           | ข้อมูลอายุเฉลี่ยของทรัพย์สินที่ลงทุน ซึ่งได้จากการคำนวณค่าตามมาตรฐานสากล                                                                                                                            |
| “reference indicator”          | benchmark หรือตัวชี้วัดอ้างอิงอื่นที่ใช้ในการเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวม                                                                                                               |
| “SET”                          | ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย                                                                                                                                                                         |
| “SN”                           | ตราสารที่มีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแฝง (Structure Note)                                                                                                                                                 |
| “VaR”                          | มูลค่าความเสียหายสูงสุด (value-at-risk)                                                                                                                                                             |