

DRT CLASSIFICATION DOCUMENT

เอกสาร Classification สำหรับข้อมูลยอดคงค้างธุรกรรมอนุพันธ์  
และยอดคงค้างธุรกรรมยืมและคืนตราสารหนี้/ตลาดซื้อคืน

Document information

Revision history

| Version number | Released Date | Effective Date | Summary of changes | Revision marks |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.0 | 2 May 2019 | 1 June 2019 | First version | No |

**Table of Contents**

[1. Provider Role and Responsibility 4](#_Toc2776095)

[2. End Investor Type 5](#_Toc2776096)

[3. Derivatives Type 6](#_Toc2776097)

[4. Underlying Asset Type 7](#_Toc2776098)

[5. Exchange Name 8](#_Toc2776099)

[6. Position 9](#_Toc2776100)

[7. Contract Type 10](#_Toc2776101)

[8. Securities Type/Collateral Type 11](#_Toc2776102)

|  |  |
| --- | --- |
| **Classification Name:** | Provider Role and Responsibility |

| **Value** | **Description** |
| --- | --- |
| ลงทุนเอง |  |
| ลงทุนผ่าน Broker |  |
| บล./บลจ.บริหาร |  |
| ฐานะ Market Maker |  |
| ฐานะ Broker |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Classification Name:** | End Investor Type |

| **Value** | **Description** |
| --- | --- |
| กองทุนรวม |  |
| กองทุนส่วนบุคคล |  |
| กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ |  |

|  |  |
| --- | --- |
| **Classification Name:** | Derivatives Type |

| **Value** | **Description** |
| --- | --- |
| Forward | ตราสารอนุพันธ์ที่คู่สัญญาได้ให้สัญญาต่อกันว่าจะซื้อหรือขายสินทรัพย์อ้างอิง ณ เวลาหนึ่งในอนาคต ในจำนวน และราคาที่กำหนดไว้ตั้งแต่วันทำสัญญา สินทรัพย์อ้างอิงนั้น อาจจะเป็น เงินตราต่างประเทศ ตราสารหนี้ ตราสารทุน สินค้าโภคภัณฑ์ หรือสินทรัพย์อื่น ๆ โดยไม่มีการซื้อขายในตลาดที่มีการจัดตั้ง |
| Futures | ตราสารอนุพันธ์ที่คู่สัญญาได้ให้สัญญาต่อกันว่าจะซื้อหรือขายสินทรัพย์อ้างอิง ณ เวลาหนึ่งในอนาคต ในจำนวน และราคาที่กำหนดไว้ตั้งแต่วันทำสัญญา สินทรัพย์อ้างอิงนั้น อาจจะเป็น เงินตราต่างประเทศ ตราสารหนี้ ตราสารทุน สินค้าโภคภัณฑ์ หรือสินทรัพย์อื่น ๆ โดยมีการซื้อขายในตลาดที่มีการจัดตั้ง มีลักษณะเหมือนกันทุกสัญญา และมีการปรับมูลค่า Futures ซึ่งเกิดจากการคำนวณกำไร ขาดทุน จากการเปลี่ยนแปลงราคา Futures ในตลาด ทุก ๆ สิ้นวันทำการ |
| Call Option | สัญญาที่ให้สิทธิแก่ผู้ซื้อ Option ในการซื้อสินทรัพย์อ้างอิงจากคู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง ตามจำนวน ราคา และภายในระยะเวลาที่กำหนดไว้ |
| Put Option | สัญญาที่ให้สิทธิแก่คู่สัญญาฝ่ายที่เป็นผู้ซื้อ Option ในการขายสินทรัพย์อ้างอิงให้แก่คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง ตามจำนวน ราคา และภายในระยะเวลาที่กำหนดไว้ |
| Swap | สัญญาในการแลกเปลี่ยนกระแสเงินสดที่จะเกิดขึ้นในอนาคตของคู่สัญญา |
| Warrant | ตราสารที่ระบุว่าผู้ถือครองจะได้รับสิทธิที่จะซื้อหุ้นสามัญ หุ้นบุริมสิทธิ หุ้นกู้ หรือหน่วยลงทุน ในราคาที่กำหนดเมื่อถึงเวลาที่ระบุไว้ (ซึ่งราคาที่จะซื้อหลักทรัพย์ตามสิทธิมักจะกำหนดไว้ต่ำ หรือบางครั้งอาจไม่เสียค่าใช้จ่ายใดๆ) |
| Call Derivative Warrant | เป็นตราสารที่ให้สิทธิแก่ผู้ถือ DW ในการซื้อหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) ซึ่งอาจเป็นหลักทรัพย์ (Stock) หรือดัชนีหลักทรัพย์ (Index) ในราคาใช้สิทธิ อัตราการใช้สิทธิ และระยะเวลาใช้สิทธิที่กำหนดไว้ โดยบริษัทผู้ออก DW (Issuer) จะเป็นผู้กำหนดว่า จะเลือกทำการส่งมอบให้แก่ผู้ถือ DW เป็นหลักทรัพย์ หรือเงินสดก็ได้ |
| Put Derivative Warrant | เป็นตราสารที่ให้สิทธิแก่ผู้ถือ DW ในการขายหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) ซึ่งอาจเป็นหลักทรัพย์ (Stock) หรือดัชนีหลักทรัพย์ (Index) ในราคาใช้สิทธิ อัตราการใช้สิทธิ และระยะเวลาใช้สิทธิที่กำหนดไว้ โดยบริษัทผู้ออก DW (Issuer) จะเป็นผู้กำหนดว่า จะเลือกทำการส่งมอบให้แก่ผู้ถือ DW เป็นหลักทรัพย์ หรือเงินสดก็ได้ |
| Others | ตราสารอนุพันธ์อื่น ๆ ที่ไม่ได้ระบุในรายการที่กล่าวข้างต้น |

|  |  |
| --- | --- |
| **Classification Name:** | Underlying Asset Type |

| **Value** | **Description** |
| --- | --- |
| Credit | เครดิต |
| Currency | เงินตราต่างประเทศ |
| Commodity - Gold | สินค้าโภคภัณฑ์ - ทอง |
| Commodity - Others | สินค้าโภคภัณฑ์ - อื่น ๆ |
| Debt Securities/Bond | ตราสารแสดงความเป็นหนี้ หรือ สัญญาเงินกู้ที่บริษัทออกให้แก่ผู้ลงทุนทั่วไป โดยสัญญาว่าจะใช้เงินตามกำหนด และจ่ายดอกเบี้ยตามกำหนด เช่น Bond, Debenture, Treasury Bill, Bill of Exchange และ Promissory Note เป็นต้น |
| Equity | ตราสารทุน |
| Interest rate | อัตราดอกเบี้ย |
| Others | อื่นๆ |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Classification Name:** | Exchange Market | |
| **Value** | | **Description** | |
| OTC | | Over-the-Counter | |
| CBOE | | Chicago Board Options Exchange | |
| CBOT | | Chicago Board Of Trade | |
| CME | | Chicago Mercantile Exchange | |
| COMEX | | Commodity Exchange | |
| EUREX | | EUREX Deutschland | |
| ICE | | Intercontinental Exchange | |
| KCBT | | Kansas City Board of Trade | |
| ICE Futures Europe | | Intercontinental Exchange - ICE Futures Europe | |
| LME | | London Metal Exchange | |
| MATIF | | Marche a Term International de France | |
| MGE | | Minneapolis Grain Exchange | |
| NASDAQ | | Nasdaq | |
| ICE Futures U.S. | | ICE FUTURES U.S. INC | |
| NYMEX | | New York Mercantile Exchange | |
| ONE | | OneChicago | |
| OSE | | Osaka Securities Exchange | |
| NFX | | NASDAQ OMX Futures Exchange | |
| PHLX | | NASDAQ OMX PHLX | |
| SGX | | Singapore Exchange | |
| TFX | | Tokyo Financial Exchange | |
| TSE | | Tokyo Stock Exchange | |
| TOCOM | | Tokyo Commodity Exchange | |
| Others | | Other Markets | |

|  |  |
| --- | --- |
| **Classification Name:** | Position |

| **Value** | **Description** |
| --- | --- |
| Long | สถานะซื้อ |
| Short | สถานะขาย |

|  |  |
| --- | --- |
| **Classification Name:** | Contract Type |

| **Value** | **Description** |
| --- | --- |
| Securities Borrowing | ธุรกรรมการยืมหลักทรัพย์ |
| Securities Lending | ธุรกรรมการให้ยืมหลักทรัพย์ |
| Repo | ธุรกรรมการขายตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะซื้อคืน |
| Reverse Repo | ธุรกรรมการซื้อตราสารหนี้โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน |

|  |  |
| --- | --- |
| **Classification Name:** | Securities Type/Collateral Type |

| **Value** | **Description** |
| --- | --- |
| Cash | เงินสด |
| Equity | ตราสารทุน |
| Debt securities | ตราสารแสดงความเป็นหนี้ หรือ สัญญาเงินกู้ที่บริษัทออกให้แก่ผู้ลงทุนทั่วไป โดยสัญญาว่าจะใช้เงินตามกำหนด และจ่ายดอกเบี้ยตามกำหนด เช่น Bond, Debenture, Treasury Bill, Bill of Exchange และ Promissory Note เป็นต้น |
| Others | อื่นๆ |