

ห้องสมุดคณะเทคโนโลยีสารสนเทศ สจล.

การพัฒนาระบบประเมินฐานะการเงิน  
และผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก  
Development of Broker Information System



วัน เดือน ปี	26 ก.พ. 2550
เลขทะเบียน	02661
เลขเรียกหนังสือ	วท. ป 621ก 2541
"ห้องสมุดคณะเทคโนโลยีสารสนเทศ สจล."	

รายงานนี้เป็นส่วนหนึ่งของวิชาโครงการศึกษาระดับปริญญาตรี  
หลักสูตรวิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเทคโนโลยีสารสนเทศ  
ภาคเรียนที่ 2 ปีการศึกษา 2541  
คณะเทคโนโลยีสารสนเทศ  
สถาบันเทคโนโลยีพระจอมเกล้าเจ้าคุณทหารลาดกระบัง

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the document when use.



\*H002661\*

ชื่อหัวข้อ	การพัฒนาระบบประเมินฐานะและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก
นักศึกษา	ปิยะทิพย์ เจียมจรวงศ์
อาจารย์ที่ปรึกษา	ดร.ประจวบ วานิชชัชวาล
ระดับการศึกษา	วิทยาศาสตรมหาบัณฑิต สาขาวิชาเทคโนโลยีสารสนเทศ
แขนงวิชา	การจัดการเทคโนโลยีสารสนเทศ
ปีการศึกษา	2541

### บทคัดย่อ

โครงการศึกษากรณีพิเศษนี้ เป็นการศึกษาระบบและขั้นตอนการทำงานของหน่วยงานซึ่งทำหน้าที่ในการกำกับดูแลบริษัทสมาชิก ในส่วนที่เป็นการนำข้อมูลของบริษัทสมาชิกมาวิเคราะห์ แล้วจัดทำเป็นข้อมูลเพื่อประเมินถึงฐานะและผลการดำเนินงานของบริษัท รวมทั้งรวบรวมปัญหาของระบบงานเดิม และศึกษาถึงความต้องการที่ผู้ใช้ต้องการให้ระบบใหม่สามารถทำงานได้ เพื่อนำมาใช้ในการวิเคราะห์และออกแบบระบบการทำงาน และพัฒนาระบบประเมินฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก (Broker Information System หรือ BIS) ซึ่งจะเป็นการปรับปรุงระบบการทำงานให้มีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น และทำให้ผู้ใช้สามารถเรียกใช้ข้อมูลตามความต้องการใช้งานได้อย่างถูกต้อง และรวดเร็ว

**Title** Development of Broker Information System  
**Student** Miss Piyatip Jeamjaroungyong  
**Advisor** Prachuab Vanitchatchavan, Ph.D.  
**Level of Study** Master of Science in Information Technology  
**Major** Information Technology Management  
**Academic Year** 1998

## ABSTRACT

This special study project is conducted to study the existing procedures of a unit that is responsible for supervising member companies in particular, the duties of this unit are analyzing the financial data field by member for evaluating their financial status and operational performance. By collecting the problems of the existing system and user requirement of the new system. In order to use to analyzing and designing and developing Broker Information System (BIS) which improvement procedures to increasing efficiency.

## กิตติกรรมประกาศ

ความสำเร็จของโครงการศึกษาระดับปริญญาโท สาขาวิชาเทคโนโลยีพระจอมเกล้าเจ้าคุณทหารลาดกระบัง ผู้เขียนได้รับความกรุณาและความช่วยเหลือจากบุคคลหลายท่าน โดยเฉพาะอย่างยิ่ง อาจารย์ประจวบ วานิชชัชวาล อาจารย์ที่ปรึกษาโครงการศึกษาระดับปริญญาโท สาขาวิชาเทคโนโลยีพระจอมเกล้าเจ้าคุณทหารลาดกระบัง ซึ่งท่านได้ให้คำแนะนำ ปรึกษา และเสนอแนะข้อคิดเห็นต่าง ๆ เพื่อเป็นแนวทางในการศึกษาและดำเนินการให้เป็นไปอย่างต่อเนื่อง และสำเร็จลุล่วงไปได้ด้วยดี



ปิยะทิพย์ เจริญรุ่งรงค์

# สารบัญ

	หน้า
บทคัดย่อภาษาไทย.....	I
บทคัดย่อภาษาอังกฤษ.....	II
กิตติกรรมประกาศ.....	III
สารบัญ.....	IV
สารบัญตาราง.....	VI
สารบัญภาพ.....	VII
บทที่	
1. บทนำ.....	1
1.1 ความเป็นมา.....	1
1.2 วัตถุประสงค์ของโครงการ.....	2
1.3 ขอบเขตของการศึกษา.....	2
1.4 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากโครงการ.....	2
2. ภาพรวมขององค์กร และระบบงานในปัจจุบัน (Existing System).....	3
2.1 ประวัติและความเป็นมา.....	3
2.2 โครงสร้างขององค์กรในปัจจุบัน.....	4
2.3 ขั้นตอนการทำงานของระบบที่ใช้ในปัจจุบัน.....	8
2.4 ปัญหาและอุปสรรคของระบบงานปัจจุบัน.....	13
2.5 ความต้องการของผู้ใช้งาน(User Requirement).....	13
3. ระบบใหม่ที่นำเสนอ (Proposed System).....	14
3.1 แนวความคิดพื้นฐาน.....	14
3.2 การวิเคราะห์โครงสร้างของระบบใหม่.....	14
3.2.1 Context Diagram.....	14
3.2.2 Data Flow Diagram.....	16
3.3 แสดงรายละเอียด I/O Description.....	20
3.4 แสดงรายละเอียด Elementary Process Description.....	29
3.5 ความต้องการของระบบในการดำเนินงาน.....	34

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

4. การออกแบบโครงสร้างฐานข้อมูล .....	36
4.1 การออกแบบฐานข้อมูล (ER Diagram) .....	36
4.2 รายการข้อมูลและตารางข้อมูล .....	37
5. การพัฒนาโปรแกรม.....	44
5.1 การแสดงภาพรวมของโปรแกรม .....	44
5.2 รูปแบบการทำงานของระบบ .....	44
6. บทสรุปและข้อเสนอแนะ .....	60
6.1 สรุปผลการศึกษา.....	60
6.2 ข้อเสนอแนะ.....	61
บรรณานุกรม.....	62
ภาคผนวก ก. โครงสร้างของแฟ้มข้อมูล (Format of Text File) .....	63
ภาคผนวก ข. ตัวอย่างแบบรายงาน.....	77
ประวัติผู้เขียน.....	89

## สารบัญตาราง

หน้า

ตารางที่

1. แสดงแหล่งที่มาของข้อมูลที่ใช้ในการวิเคราะห์.....	9
2. แสดงหลักเกณฑ์ในการกำหนดเกรดของแต่ละ Parameter .....	12
3. แสดงหลักเกณฑ์ที่ใช้ในการหักคะแนน .....	12
4. แสดงหลักเกณฑ์ที่ใช้ในการจัดประเภทของระดับการติดตาม .....	12
5. แสดง External Entity ของระบบ BIS .....	15
6. แสดง I/O Description ของระบบ BIS .....	29
7. แสดง Elementary Process Description ของ 1.1 .....	29
8. แสดง Elementary Process Description ของ 1.2 .....	30
9. แสดง Elementary Process Description ของ 1.3 .....	30
10. แสดง Elementary Process Description ของ 1.4 .....	31
11. แสดง Elementary Process Description ของ 2.1 .....	31
12. แสดง Elementary Process Description ของ 2.2 .....	32
13. แสดง Elementary Process Description ของ 2.3 .....	32
14. แสดง Elementary Process Description ของ 2.4.1 .....	32
15. แสดง Elementary Process Description ของ 2.4.2 .....	33
16. แสดง Elementary Process Description ของ 2.4.3 .....	33
17. แสดง Elementary Process Description ของ 2.4.4 .....	33
18. แสดง Elementary Process Description ของ 2.4.5 .....	34
19. แสดงรายการข้อมูลและตารางข้อมูลที่ใช้ในระบบ BIS.....	39
20. แสดงคำอธิบายข้อมูลของตารางบริษัทสมาชิก.....	40
21. แสดงคำอธิบายข้อมูลของตารางข้อมูลบริษัทสมาชิก .....	42

# สารบัญภาพ

หน้า

รูปที่

1. แสดงแผนผังองค์กรของ The Stock Exchange of Thailand .....	5
2. แสดงแผนผังการจัดโครงสร้างฝ่ายกำกับและตรวจสอบสมาชิก.....	6
3. แสดง Context Diagram ของระบบใหม่ .....	14
4. แสดง Data Flow Diagram Level 1 ของระบบใหม่ .....	16
5. แสดง Data Flow Diagram Level 2 รูปที่ 1 ของระบบใหม่.....	17
6. แสดง Data Flow Diagram Level 2 รูปที่ 2 ของระบบใหม่.....	18
7. แสดง Data Flow Diagram Level 3 ของระบบใหม่.....	19
8. แสดง ER Diagram ของระบบ BIS.....	36
9. แสดงคำอธิบายข้อมูลของตารางบริษัทสมาชิก.....	40
10.แสดงคำอธิบายข้อมูลของตารางข้อมูลบริษัทสมาชิก .....	43
11.แสดงภาพรวมของฟังก์ชันการทำงานของระบบ BIS .....	44
12.แสดงรายละเอียดของหน้าจอแรกก่อนเข้าสู่ระบบ BIS.....	45
13.แสดงรายละเอียดของหน้าจอของระบบ BIS .....	45
14. แสดงรายละเอียด Menu Process Data ของระบบ BIS.....	46
15. แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Load ของระบบ BIS .....	47
16. แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Ratio ของระบบ BIS.....	48
17. แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Industry ของระบบ BIS .....	48
18. แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Compare ของระบบ BIS.....	49
19. แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Grade ของระบบ BIS.....	49
20. แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Score ของระบบ BIS .....	50
21. แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Level ของระบบ BIS .....	50
22. แสดงรายละเอียด Menu Display Data ของระบบ BIS.....	51
23. แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลระดับการติดตาม (Monitor Level) ในรูปแบบตัวเลข..	52
24. แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลระดับการติดตาม (Monitor Level) ในรูปแบบเกรด ....	53

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

25. แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลของบริษัทสมาชิก .....	54
26. แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลความเห็นเจ้าหน้าที่วิเคราะห์ .....	54
27. แสดงหน้าจอการเปลี่ยนแปลงข้อมูลความเห็นของเจ้าหน้าที่วิเคราะห์ .....	55
28. แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลรายละเอียด(Parameter Detail)ในรูปแบบตัวเลข.....	56
29. แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลรายละเอียด(Parameter Detail)ในรูปแบบเกรด.....	56
30. แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลแนวโน้ม(Trend)ในรูปแบบตัวเลข.....	57
31. แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลแนวโน้ม(Trend)ในรูปแบบเกรด .....	58
32. แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลจำนวนบริษัทในแต่ละระดับของแต่ละParameter .....	59
33. แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลรายชื่อของบริษัทในแต่ละระดับเกรดของ Parameter .	59



# บทที่ 1

## บทนำ

### 1. ความเป็นมา

ระบบการซื้อขายหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์นั้นบริษัทสมาชิก (Broker) ซึ่งทำหน้าที่ในการเป็นนายหน้าในการให้บริการซื้อขายหลักทรัพย์แก่ผู้ลงทุนนั้นถือได้ว่าเป็นกลไกที่สำคัญของการซื้อขายหลักทรัพย์เนื่องจากเป็นผู้ให้บริการที่ใกล้ชิดกับผู้ลงทุนมากที่สุด ดังนั้นตลาดหลักทรัพย์จึงได้ให้ความสำคัญในการกำกับดูแลบริษัทสมาชิกให้มีการบริการแก่ผู้ลงทุนเพื่อให้ดำเนินงานเป็นไปตามหลักเกณฑ์และข้อบังคับที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดอย่างเคร่งครัด โดยมีการติดตามฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิกอย่างต่อเนื่องรวมทั้งการเข้าตรวจสอบการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก

สำหรับในด้านการติดตามฐานะการเงินและผลการดำเนินงานนั้นตลาดหลักทรัพย์ได้กำหนดให้บริษัทหลักทรัพย์จัดส่งรายงานข้อมูลต่าง ๆ มายังฝ่ายกำกับและตรวจสอบสมาชิก (ฝ่ายกต.) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยผ่านทางระบบ Broker Reporting System (BRS) และเจ้าหน้าที่วิเคราะห์จะนำข้อมูลดังกล่าวไปประมวลผลเพื่อการวิเคราะห์ฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก และใช้เป็นเกณฑ์ในการพิจารณาบริษัทเพื่อเป็นข้อมูลในการประเมินผลนำเสนอต่อผู้บริหาร ซึ่งการดำเนินการด้วยวิธีการดังกล่าวเป็นการทำงานที่ทำให้การใช้ประโยชน์จากฐานข้อมูลของระบบ BRS ได้อย่างไม่มีประสิทธิภาพเท่าที่ควร เนื่องจากเจ้าหน้าที่วิเคราะห์จะต้องทำการนำข้อมูลจากระบบ BRS มาประมวลผลด้วยมือซึ่งต้องใช้เวลาที่ค่อนข้างมากและอาจก่อให้เกิดความผิดพลาดขึ้นได้

ดังนั้นเพื่อการทำให้งานวิเคราะห์มีการประเมินที่มีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้นทั้งในด้านความรวดเร็ว ถูกต้องและครบถ้วน ซึ่งจะทำให้เป็นการลดขั้นตอนการประมวลผลข้อมูลเพื่อการนำเสนอต่อผู้บริหารอีกทั้งเป็นการอำนวยความสะดวกในการทำงานวิเคราะห์ข้อมูล โดยเป็นการใช้ประโยชน์จากการนำข้อมูลจากระบบ BRS มาใช้งานได้อย่างรวดเร็ว ดังนั้นจึงมีความจำเป็นที่จะต้องนำระบบสารสนเทศมาใช้เพื่อช่วยในการพัฒนาระบบประเมินฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก (Broker Information System หรือ BIS) ขึ้นมา

## 1.2 วัตถุประสงค์ของโครงการ

โครงการนี้มีวัตถุประสงค์ที่สำคัญดังต่อไปนี้

1. เพื่อให้ได้ระบบที่สามารถประเมินได้ถึงฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิกสำหรับผู้บริหารที่ใช้ในการมองภาพรวม และแนวโน้มของบริษัทสมาชิก
2. เพื่อเป็นการนำระบบสารสนเทศมาประยุกต์ใช้ในการสร้างระบบเพื่อใช้ในการประเมินฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทให้แก่เจ้าหน้าที่วิเคราะห์ เพื่ออำนวยความสะดวกในการวิเคราะห์และประเมินบริษัทสมาชิก ซึ่งจะทำได้ทำงานได้อย่างมีประสิทธิภาพยิ่งขึ้นกว่าระบบเดิมทั้งในด้านความถูกต้องและรวดเร็ว

## 1.3 ขอบเขตของการศึกษา

1. ศึกษาลักษณะและขั้นตอนการทำงาน รวมถึงรายละเอียดต่าง ๆ ของระบบงานที่ใช้ในปัจจุบัน และรวบรวมปัญหาที่เกิดขึ้นในระบบงานเดิมและศึกษาความต้องการที่ผู้ใช้ต้องการให้ระบบใหม่สามารถทำงานได้
2. ทำการวิเคราะห์และออกแบบระบบงานใหม่ที่ผู้ใช้ต้องการ
3. พัฒนาระบบประเมินฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก (Broker Information System หรือ BIS) เพื่อเป็นต้นแบบ (Prototype) สำหรับการพัฒนาโปรแกรมเต็มระบบ

## 1.4 ประโยชน์ที่คาดว่าจะได้รับจากโครงการ

1. ทำให้สามารถลดขั้นตอนและเวลาในการวิเคราะห์ และประเมินถึงสถานะของบริษัทสมาชิก อีกทั้งทำให้ได้รับผลในการประเมินถึงฐานะและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก เพื่อนำเสนอต่อผู้บริหารได้อย่างถูกต้อง และรวดเร็ว
2. สามารถนำข้อมูลของฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิกที่ได้รับจากบริษัทสมาชิกซึ่งจัดเก็บอยู่บนระบบ BRS มาประกอบการวิเคราะห์ และประเมินบริษัทสมาชิกเพื่อเป็นการลดปริมาณของเอกสาร
3. สามารถออกแบบและพัฒนาระบบฐานข้อมูลซึ่งช่วยในการรวบรวมข้อมูลเพื่อให้ผู้บริหารและเจ้าหน้าที่ของส่วนงานที่เกี่ยวข้องในการกำกับดูแลบริษัทสมาชิกสามารถเรียกดูข้อมูลสำคัญเกี่ยวกับฐานะการเงิน และค่า Parameter ต่าง ๆ ที่ใช้เป็นเกณฑ์ในการพิจารณาบริษัทที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลในรูปแบบต่างๆตามความต้องการใช้งานได้ทันที

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

## บทที่ 2

### ภาพรวมขององค์กรและระบบงานในปัจจุบัน (Existing System)

#### 2.1 ประวัติและความเป็นมา

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเป็นองค์กรที่จัดตั้งเพื่อทำหน้าที่เป็นศูนย์กลางในการซื้อขายแลกเปลี่ยนหลักทรัพย์ หรือหุ้นประเภทต่างๆ และหุ้นที่จะซื้อหรือขายผ่านตลาดหลักทรัพย์ได้นั้น จะต้องเป็น หลักทรัพย์ที่ได้รับการจดทะเบียนจากตลาดหลักทรัพย์เท่านั้น

โดยเป็นองค์กรที่เป็นนิติบุคคลที่ตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2517 มีดำเนินการในรูปของหน่วยงานที่มีได้มุ่งหวังกำไร และมีอำนาจในการกำหนดระเบียบข้อบังคับเพื่อให้การซื้อขายหลักทรัพย์มีระเบียบ คล่องตัว และยุติธรรม

ต่อมาพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์พ.ศ. 2535 ได้กำหนดให้ตลาดหลักทรัพย์เป็นสถาบันภายใต้พระราชบัญญัติฉบับนี้แทนพระราชบัญญัติฉบับเดิม ซึ่งยังคงกำหนดให้ตลาดหลักทรัพย์เป็นนิติบุคคลที่ไม่แสวงหากำไรและเป็นองค์กรที่กำกับดูแลตนเอง (Self Regulatory Organization หรือ SRO) โดยให้ผู้บริหารตลาดเป็นผู้กำหนดนโยบายและบริหารองค์กรเอง โดยตลาดหลักทรัพย์มีรายได้หลักจากการเก็บค่าธรรมเนียมต่าง ๆ โดยมีได้ใช้งบประมาณของทางราชการแต่อย่างใด

ทางด้านการบริหารงานนั้นมีการบริหารงานโดยคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ ซึ่งจะเป็นผู้กำหนดนโยบายและควบคุมการดำเนินงานขององค์กร โดยอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ก.ล.ต.) ซึ่งมีรัฐมนตรีว่าการกระทรวงการคลังเป็นประธาน

การนำเทคโนโลยีสารสนเทศมาช่วยในการประมวลผลขององค์กร

2520: ได้นำระบบคอมพิวเตอร์มาช่วยในการประมวลผลและจัดเก็บรายชื่อผู้ถือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ การบันทึกการโอนหุ้น และการประมวลผลหลังการซื้อขายหลักทรัพย์ประจำวัน

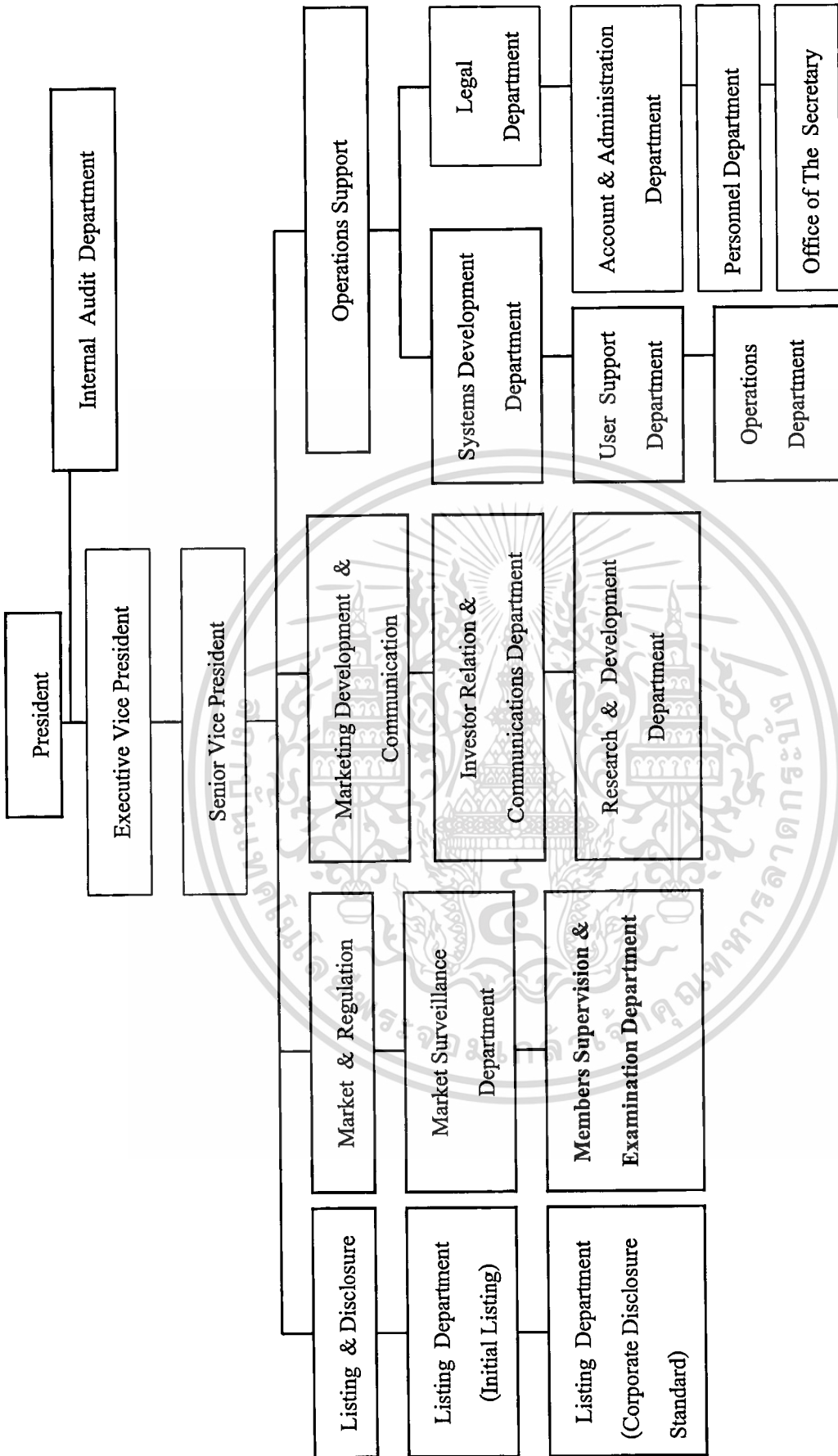
2534: ณ วันที่ 31 พฤษภาคม 2534 ตลาดหลักทรัพย์ได้ทำการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยระบบคอมพิวเตอร์เต็มรูปแบบ

## 2.2 โครงสร้างขององค์กรในปัจจุบัน

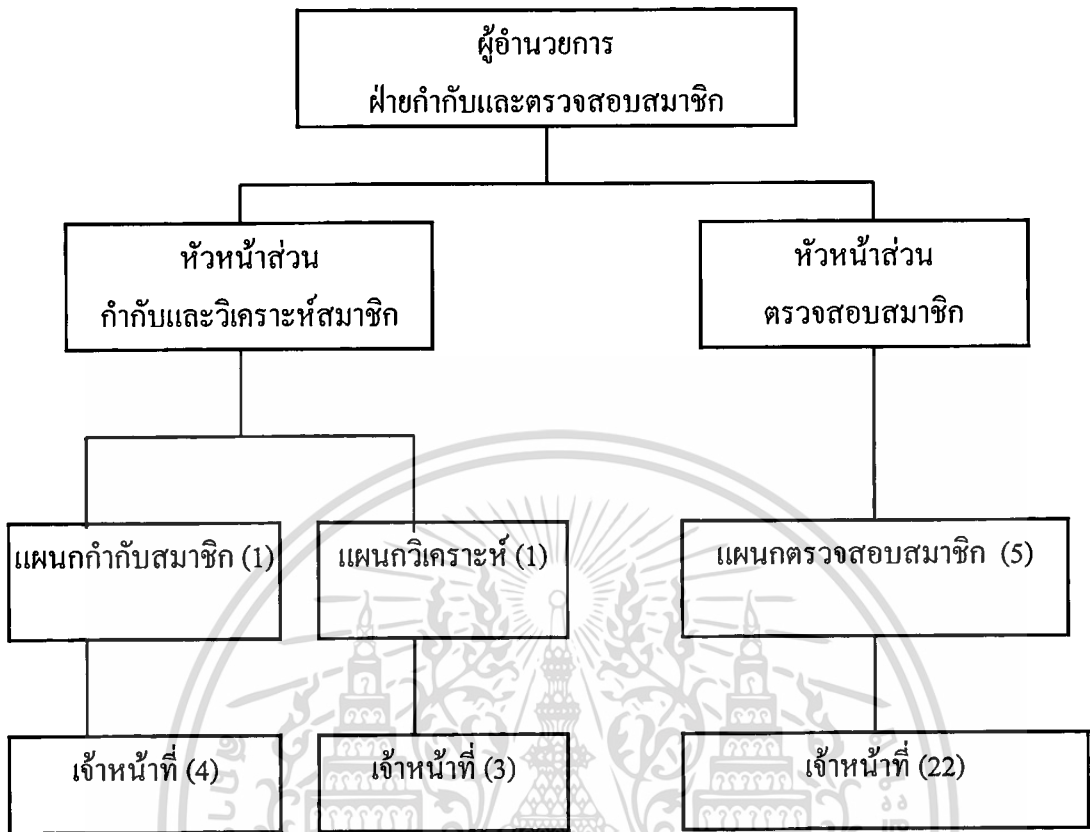
โครงสร้างองค์กรของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมีรายละเอียดดังรูปที่ 1 สำหรับการจัดสายงานการบังคับบัญชาของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยนั้นได้ทำการแบ่งสายงานออกเป็น 4 สายงาน ดังนี้

1. Listing & Disclosure คือ สายงานบริษัทจดทะเบียน โดยงานหลักที่อยู่ภายใต้ความรับผิดชอบ ได้แก่ การรับจดทะเบียนหลักทรัพย์ (Listing of Securities) และ การเพิกถอนหลักทรัพย์ (Delisting of Securities)
2. Market & Regulation คือ สายงานกำกับการซื้อขายหลักทรัพย์ โดยงานหลักที่อยู่ภายใต้ความรับผิดชอบ ได้แก่ การกำกับดูแลการซื้อขายหลักทรัพย์ (Market Supervision) และการคุ้มครองผู้ลงทุน (Investor Protection)
3. Marketing Development & Communication คือ สายงานส่งเสริมการลงทุน โดยงานหลักที่อยู่ภายใต้ความรับผิดชอบ ได้แก่ การให้บริการที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายหลักทรัพย์ (Market Information Services)
4. Operations Support คือ สายงานสนับสนุน โดยงานหลักที่อยู่ภายใต้ความรับผิดชอบ ได้แก่ การจัดระบบซื้อขายหลักทรัพย์ (Public Trading System) และ การให้บริการที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายหลักทรัพย์ (Back Office Services)

ทั้งนี้สำหรับฝ่ายกำกับและตรวจสอบสมาชิก (Members Supervision & Examination Department) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเป็นฝ่ายงานที่อยู่ภายใต้สายงานกำกับซื้อขายหลักทรัพย์ ซึ่งมีหน้าที่ในการกำกับดูแล และตรวจสอบบริษัทสมาชิกให้ทำหน้าที่เป็นไปตามกฎระเบียบข้อบังคับที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดนั้น หากบริษัทสมาชิกใดฝ่าฝืนหรือไม่ปฏิบัติตามอาจมีมติลงโทษบริษัทสมาชิคนั้น โดยการภาคทัณฑ์ในระยะเวลาที่คณะกรรมการกำหนด หรือให้พ้นจากสมาชิกภาพของตลาดหลักทรัพย์ เป็นต้น โครงสร้างของฝ่ายกำกับและตรวจสอบสมาชิกประกอบด้วย 2 ส่วน ได้แก่ ส่วนกำกับและวิเคราะห์สมาชิก และส่วนตรวจสอบสมาชิกโดยอยู่ภายใต้การบริหารงานของผู้อำนวยการฝ่าย ซึ่งจำนวนพนักงานภายในฝ่ายมีจำนวนทั้งสิ้นรวม 39 คน โดยรายละเอียดของโครงสร้างองค์กร ดังแสดงในรูปที่ 2



รูปที่ 1 แสดงแผนผังองค์กรของ The Stock Exchange of Thailand



รูปที่ 2 แสดงแผนผังการจัด โครงสร้างฝ่ายกำกับและตรวจสอบสมาชิก

ประเภทและลักษณะงานที่อยู่ภายใต้ความรับผิดชอบของแต่ละส่วนงานมีดังนี้

● ประเภทและลักษณะงาน

1. ส่วนกำกับและวิเคราะห์สมาชิก

1.1 แผนกกำกับสมาชิก

กำหนดและปรับปรุงกฎ ระเบียบ ข้อบังคับให้มีความทันสมัยและสอดคล้องกับการพัฒนาธุรกิจหลักทรัพย์ให้เป็นมาตรฐานสากล โดยหน้าที่งานในความรับผิดชอบมีดังนี้

- งานจัดทำรายงานการศึกษา
- งานยกร่างกฎ ระเบียบ ข้อบังคับ
- งานออกกฎ ระเบียบ ข้อบังคับ
- งานจัดประชุม
- งานรับทราบการทำสัญญาเป็นนายหน้าหรือตัวแทนซื้อขายหลักทรัพย์  
จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ให้แก่บริษัทหลักทรัพย์ต่างประเทศ

## 1.2 แผนวิเคราะห์สมาชิก

จัดทำบันทึกสรุปรายงานทั้งหมดที่บริษัทสมาชิกจัดส่งมายังตลาดหลักทรัพย์เสนอผู้บริหาร รวมทั้งวิเคราะห์และติดตามฐานะการเงิน และผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิกให้เป็นไปตามแนวทางที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด โดยหน้าทำงานในความรับผิดชอบมีดังนี้

- 2.1 งานรับสมาชิก คือ การพิจารณารับบริษัทหลักทรัพย์เข้าเป็นสมาชิกตลาดหลักทรัพย์ตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่กำหนด
- 2.2 งานโอนสิทธิการเป็นสมาชิก คือ การโอนสิทธิการเป็นสมาชิกเนื่องจากการแยกธุรกิจเงินทุนและธุรกิจหลักทรัพย์ หรือการโอนสิทธิการเป็นสมาชิกเนื่องจากการควบบริษัท
- 2.3 งานจัดทำรายงาน คือ การจัดทำรายงานต่าง ๆ ตามข้อมูลที่บริษัทสมาชิกรายงานผ่านระบบ BRS หรือ การจัดส่งเป็นเอกสาร ได้แก่
  - 1) การจัดทำรายงานยอดคงเหลือในบัญชีลูกหนี้ผ่อนชำระ (กต. 1/4)
  - 2) การจัดทำรายงานการขายหลักทรัพย์โดยไม่มีหลักทรัพย์ในครอบครอง (กต. 2/3)
  - 3) การจัดทำรายงานการส่งมอบหลักทรัพย์ล่าช้า (กต. 2/5)
  - 4) การจัดทำรายงานการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์รายปี
  - 5) การจัดทำรายงานการดำเนินงานด้านธุรกิจหลักทรัพย์ (กต. 2/1)
  - 6) การจัดทำรายงานการซื้อขายหลักทรัพย์เพื่อบริษัท (บล. 3/1)
  - 7) การจัดทำรายงานฐานะการเงินและผลการดำเนินงาน (บล.2 และ บล.2/1)
  - 8) การจัดทำรายงานอัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (บล. 4/1)
  - 9) การจัดทำรายงานข้อมูลลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ (กต. 1/2)
  - 10) การจัดทำรายงานการหักกลบราคาค่าซื้อและราคาค่าขายหลักทรัพย์เดียวกันในวันเดียวกัน
  - 11) การจัดทำรายงานสรุปการเปลี่ยนแปลงของบริษัทสมาชิก
  - 12) การจัดทำรายงานสรุปภาพรวม จากรายงานที่จัดทำในข้อ 1-11
- 2.4 งานออกใบอนุญาตเป็นเจ้าหน้าที่การตลาด
- 2.5 งานวิเคราะห์และติดตามฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก

## 2. ส่วนตรวจสอบสมาชิก

ทำหน้าที่ในการตรวจสอบบริษัทหลักทรัพย์เพื่อประเมินคุณภาพและความเสี่ยงของบริษัท รวมทั้งเพื่อให้แน่ใจว่าบริษัทหลักทรัพย์มีการปฏิบัติงานเป็นไปตามกฎระเบียบของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้อง

ประเภทของการตรวจสอบ

### 1. ตรวจสอบประจำปี

- ประเมินความมีประสิทธิภาพด้านการควบคุมภายในและการดำเนินงานของบริษัทหลักทรัพย์

### 2. ตรวจสอบเฉพาะเรื่อง

- ตรวจสอบความผิดปกติหรือสิ่งที่เป็นข้อสังเกตจากส่วนกำกับและวิเคราะห์สมาชิกหรือส่วนงานอื่นที่เกี่ยวข้อง
- ตรวจสอบตามข้อร้องเรียนของลูกค้า

## 2.3 ขั้นตอนการทำงานของระบบที่ใช้ในปัจจุบัน

สำหรับส่วนงานการทำงานของระบบงานที่จะนำระบบประเมินฐานะการเงินและผลการดำเนินงาน (Broker Information System หรือ BIS) มาใช้งานแทนนั้น คือ งานในส่วนของการวิเคราะห์และติดตามฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก ซึ่งขั้นตอนการทำงานเดิมรายละเอียดของการทำงานดังนี้

1. ทำการดึงข้อมูล (Download) ของบริษัทสมาชิกจากระบบ Broker Report System ที่อยู่ในฐานข้อมูลจากเครื่อง Unix Server มายังเครื่อง Personnel Computer ซึ่งจะได้รับข้อมูลที่อยู่ในแฟ้มประเภท Excel โดยรายละเอียดของข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณในแต่ละ Parameter มีแหล่งที่มาจากแบบรายงานต่าง ๆ ตามตารางที่ 1 ดังนี้

Parameter	แหล่งข้อมูล
1. NCR (%)	บล. 4/1 ข้อ 15 อัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
2. กำไร(ขาดทุน) และ กำไร(ขาดทุน)รวมตั้งแต่ต้นปี (ล้านบาท)	บล. 2/1 ข้อ 9 ช่องที่ 2 กำไร(ขาดทุน)สุทธิ ช่องที่ 3 กำไร(ขาดทุน)รวมตั้งแต่ต้นปี
3. ส่วนของผู้ถือหุ้น (ล้านบาท)	บล. 2 ข้อ 11.9 ช่องที่ 3 ส่วนของผู้ถือหุ้น

Parameter	แหล่งข้อมูล
4. เงินลงทุนในหลักทรัพย์ (ล้านบาท) ค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์	บล. 2 ข้อ 3.3.3 ช่องที่ 3 เงินลงทุนในหลักทรัพย์ (ล้านบาท) ข้อ 3.3.2 ช่องที่ 1 จำนวนที่กั้นไว้เพื่อการลดค่าหลักทรัพย์
5. D/E Ratio (เท่า) = <u>หนี้สินรวม (หนี้สินในข้อ 7-10)</u> ส่วนของผู้ถือหุ้น	บล. 2 ข้อ 7.2 ช่องที่ 3 เงินกู้ยืม (Debt) ข้อ 8 ช่องที่ 3 หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญา จะซื้อคืน (Debt) ข้อ 9.3 ช่องที่ 3 เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์ (Debt) ข้อ 10.4 ช่องที่ 3 หนี้สินอื่น ๆ (Debt) ข้อ 11.9 ส่วนของผู้ถือหุ้น (Equity)
6. ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์ 6.1 หลักประกันต่ำกว่ามูลหนี้ของ ลูกหนี้ที่มี $MM \leq 0 = (B+C-A)$ - จำนวน (ล้านบาท) - % ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น (%) 6.2 มูลหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย - จำนวน (ล้านบาท) - % ต่อมูลหนี้ Margin รวม 6.3 ลูกหนี้พ้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้ ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง (Cash) - จำนวน (ล้านบาท) - % ต่อมูลหนี้ Margin รวม	กต.1/2 ข้อ 3.4 Margin ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย $MM \leq 0$ ช่องที่ 3 มูลหนี้ลูกหนี้ (A) ช่องที่ 5 มูลค่าหลักทรัพย์ราคาตลาด (B) ช่องที่ 6 มูลค่าหลักประกัน (C) บล. 2 ข้อ 20.11 ช่องที่ 3 ส่วนของผู้ถือหุ้น กต.1/2 ข้อ 3.4 ลูกหนี้ ที่เข้าเกณฑ์บังคับขายที่ $MM \leq 15$ ข้อ 3.1 มูลหนี้รวม บล.4/1 ข้อ 5.1.2 + 5.1.3 ช่องที่ 1 ลูกหนี้พ้นกำหนดชำระ บล.2 ข้อ 4.1 ช่องที่ 2 ลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง

ตารางที่ 1 แสดงแหล่งที่มาของข้อมูลที่ใช้ในการวิเคราะห์

- นำข้อมูลที่เลือกไว้ตามข้อ 1 มาประมวลผลด้วยสูตรที่ใช้ในการคำนวณค่า Parameter ซึ่งมีการกำหนดไว้ในแต่ละ Cell ด้วยวิธีการแบบ Manual โดยรายละเอียดของสูตรที่ใช้ในการวิเคราะห์แบบรายงานมีดังนี้

1) นำอัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (NCR) นำมาเปรียบเทียบกับอัตราตามที่ข้อบังคับของสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ก.ล.ต.) กำหนด และนำมาเปรียบเทียบกับอัตรา NCR ของเดือนที่แล้วว่าเปลี่ยนแปลงเท่าใด

2) ผลการดำเนินงาน

ผลกำไร(ขาดทุน)รวมตั้งแต่ต้นปี = ผลรวมกำไร(ขาดทุน)ตั้งแต่ต้นปี

3) การลงทุนในหลักทรัพย์ (Investment Portfolio)

ค่าเพื่อการลดค่าของหลักทรัพย์เพิ่มขึ้น

$$= \frac{\text{ค่าเพื่อการลดค่าหลักทรัพย์เดือนนี้} - \text{ค่าเพื่อการลดค่าหลักทรัพย์เดือนที่แล้ว}}{\text{ค่าเพื่อเดือนนี้}} \times 100$$

4) ฐานะการเงิน

4.1 D/E Ratio สูงกว่าค่าเฉลี่ยของอุตสาหกรรม

$$= \frac{\text{D/E Ratio} - \text{D/E เฉลี่ยของอุตสาหกรรม}}{\text{D/E เฉลี่ยของอุตสาหกรรม}} \times 100$$

4.2 D/E สูงขึ้น

$$= \frac{\text{D/E Ratio เดือนนี้} - \text{D/E Ratio เดือนที่แล้ว}}{\text{D/E Ratio เดือนที่แล้ว}} \times 100$$

$$\text{(D/E Ratio} = \frac{\text{หนี้สินรวม}}{\text{ส่วนของผู้ถือหุ้น}} \times 100$$

$$\text{D/E เฉลี่ยของอุตสาหกรรม} = \frac{\text{ผลรวมหนี้สินรวมของทุก Broker}}{\text{ผลรวมของส่วนของผู้ถือหุ้นทุก Broker}} \times 100$$

5) ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์

5.1 % มูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อ Equity

$$= \frac{\text{(มูลหนี้-หลักประกันของลูกหนี้)ของลูกหนี้ Margin ที่ MM} \leq 0}{\text{ส่วนของผู้ถือหุ้น}} \times 100$$

(หลักประกันของลูกหนี้ Margin  $\leq 0$  = มูลค่าหลักทรัพย์ราคาตลาด + มูลค่าหลักประกัน)

5.2 % มูลหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย

$$= \frac{\text{มูลหนี้ของลูกหนี้ Margin ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย}}{\text{มูลหนี้ Margin รวม}} \times 100$$

$$5.3 \text{ \% ลูกหนี้พื่นกำหนดชำระต่อลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง (Cash)}$$

$$= \frac{\text{ลูกหนี้พื่นกำหนดชำระ}}{\text{ลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง}} \times 100$$

3. คำนวณหาค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรมของข้อมูลของบริษัทสมาชิก เพื่อไว้ใช้ในการวิเคราะห์หรือเปรียบเทียบกับข้อมูลของแต่ละบริษัท ในเรื่องต่างๆ ดังนี้

- อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ(NCR)
- หลักประกันต่ำกว่ามูลหนี้ของลูกหนี้ที่มี  $MM \leq 0$
- ส่วนของผู้ถือหุ้น
- อัตราส่วนหลักประกันต่ำกว่ามูลหนี้ของลูกหนี้ที่มี  $MM \leq 0$  ต่อ ส่วนของผู้ถือหุ้น (%)
- เงินลงทุนในหลักทรัพย์จดทะเบียนสุทธิ
- กำไร (ขาดทุน) รวมถึงแต่ต้นปี
- หนี้สินรวม
- หนี้สินรวมต่อส่วนของผู้ถือหุ้น

4. เมื่อได้ผลจากการคำนวณในข้อ 2 แล้วจะนำมาประมวลเพื่อจัดลำดับเกรดตามหลักเกณฑ์ที่เจ้าหน้าที่วิเคราะห์กำหนดขึ้นรายละเอียดตามตารางที่ 2

Parameter	OK	A	B	C	D
1. NCR (%)	มากกว่า 7	4.5 น้อยกว่า 7	4 – น้อยกว่า 4.5	3 – น้อยกว่า 4	น้อยกว่า 3
2. ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์ 2.1 % มูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกัน ต่อ Equity	$Y < 10\%$	$Y \geq 10\%$	$Y \geq 20\%$	$Y \geq 30\%$	$Y \geq 40\%$
2.2 % มูลหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย	$Y < 10\%$	$Y \geq 10\%$	$Y \geq 20\%$	$Y \geq 30\%$	$Y \geq 40\%$
2.3 % ลูกหนี้ผิดนัดชำระต่อ ลูกหนี้เงินสด (Cash)	$Y < 10\%$	$Y \geq 10\%$	$Y \geq 20\%$	$Y \geq 30\%$	$Y \geq 40\%$
3. เงินลงทุนในหลักทรัพย์ - ค่าเผื่อการลดค่าของ หลักทรัพย์เพิ่มขึ้น (%)	$Y < 10\%$	$Y \geq 10\%$	$Y \geq 20\%$	$Y \geq 30\%$	$Y \geq 40\%$

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

Parameter	OK	A	B	C	D
4. ผลการดำเนินงาน.					
4.1 ผลกำไร(ขาดทุน) ในเดือน	$Y > 0$	-	-	-	$Y < 0$
4.2 ผลกำไร(ขาดทุน)รวมตั้งแต่ต้นปี	$Y < 0$ (กำไร)	-	-	-	$Y < 0$ (ขาดทุน)
5. ฐานะการเงิน (%)					
5.1 D/E ratio สูงกว่าค่าเฉลี่ย	$Y < 10\%$	$Y \geq 10\%$	$Y \geq 20\%$	$Y \geq 30\%$	$Y \geq 40\%$
5.2 D/E สูงขึ้น	$Y < 10\%$	$Y \geq 10\%$	$Y \geq 20\%$	$Y \geq 30\%$	$Y \geq 40\%$
6. ส่วนของผู้ถือหุ้น (ล้านบาท)	มากกว่า 500	400 – น้อย กว่า 500	300 – น้อย กว่า 400	200 – น้อย กว่า 300	น้อยกว่า 200

ตารางที่ 2 แสดงหลักเกณฑ์ในการกำหนดเกรดของแต่ละ Parameter

5. นำผลของเกรดที่ได้จากข้อ 3 มาเปรียบเทียบเพื่อใช้เป็นหลักเกณฑ์ในการพิจารณาหักคะแนนบริษัท โดยระบบจะทำการหักคะแนนตามรายละเอียดตารางที่ 3 แล้วทำการรวมคะแนนที่หักทั้งหมดแล้วนำมาพิจารณาว่าบริษัทสมาชิกดังกล่าวอยู่ในระดับการติดตามใดตามรายละเอียดตารางที่ 4

เกรดที่เข้าเกณฑ์	คะแนนที่หัก
D	-4
C	-3
B	-2
A	-1
OK	0

ตารางที่ 3 แสดงหลักเกณฑ์ที่ใช้ในการหักคะแนน

ประเภทของระดับการติดตาม	ช่วงคะแนนของบริษัทสมาชิกที่ถูกหัก
ไม่ต้องติดตาม	น้อยกว่า (-10)
เริ่มติดตาม	(-10) ถึง (-13)
ติดตามปานกลาง	(-14) ถึง (-17)
ติดตามใกล้ชิด	มากกว่าหรือเท่ากับ (-18)

ตารางที่ 4 แสดงหลักเกณฑ์ที่ใช้ในการจัดประเภทของระดับการติดตาม

## 6. รวบรวมประเด็นที่ได้รับจากการประเมินผลในแต่ละบริษัทเพื่อจัดทำเป็นรายงานผลกา ประเมินเสนอต่อผู้บริหาร

### 2.4 ปัญหาและอุปสรรคของระบบปัจจุบัน

เนื่องจากการประเมินผลบริษัทสมาชิกในระบบงานเดิมนั้นเป็นการทำงานแบบด้วย Computer ซึ่งจะได้รับข้อมูลที่อยู่ในแฟ้มประเภท Excel โดยเป็นการคำนวณด้วยการกำหนดสูตร ด้วยวิธีการแบบ Manual จึงทำให้การปฏิบัติงานในการประเมินผลฐานะการเงินและผลการดำเนินงานเป็นไปได้อย่างล่าช้า และ อาจก่อให้เกิดความผิดพลาดในการปฏิบัติงานขึ้นได้ เนื่องจากเป็นการทำงานโดยเจ้าหน้าที่วิเคราะห์ในแต่ละรายตามการแบ่งแยกหน้าที่ที่ต้องรับผิดชอบดูแลและประเมินผลบริษัทสมาชิกในแต่ละบริษัท ดังนั้นจึงทำให้ต้องเสียเวลาในการรวบรวมข้อมูลเมื่อต้องการดูภาพรวมของทั้งอุตสาหกรรมหรือแต่ละประเภทของระดับการติดตาม ตลอดจนแนวโน้มของแต่ละบริษัท

### 2.5 ความต้องการของผู้ใช้งาน (User Requirement)

เมื่อพิจารณาถึงความต้องการของผู้ใช้งาน โดยการสัมภาษณ์พอสรุปความต้องการได้ดังนี้

1. ต้องการให้โปรแกรมในรูปแบบที่มีข้อมูลซึ่งสามารถนำเสนอเป็นรายงานต่อผู้บริหาร ด้วยความรวดเร็ว ถูกต้อง และเรียกใช้ได้ตามความต้องการของผู้บริหาร
2. ต้องการให้โปรแกรมซึ่งช่วยลดเวลาในการทำงาน
3. ต้องการโปรแกรมที่ทำให้ทราบถึงสถานะของบริษัทสมาชิก และสามารถเรียกค้นหาข้อมูลย้อนหลังของบริษัทสมาชิกได้อย่างมีระบบและมีความถูกต้องรวดเร็ว

## บทที่ 3

### ระบบใหม่ที่นำเสนอ

#### 2.1 แนวความคิดพื้นฐาน

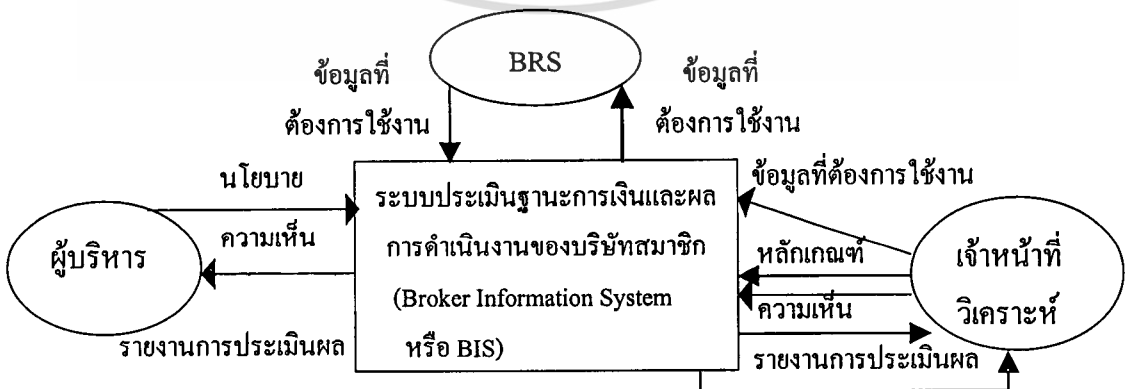
ระบบใหม่ที่จะนำเสนอนี้จะใช้หลักเกณฑ์และวิธีการคำนวณเช่นเดียวกับการประมวลผลด้วยมือ (Manual) แบบเดิมที่ผู้ใช้ใช้งานอยู่เดิมดังที่ได้นำเสนอไว้ในบทที่ 2 ยกเว้นในเรื่องของการจัดเก็บฐานข้อมูลนั้นระบบจะทำการดึงข้อมูลจากฐานข้อมูลของ BRS ที่อยู่ในเครื่อง UNIX Server มาไว้ที่เครื่อง NT Server แล้วทำการประมวลผลข้อมูลต่าง ๆ ตามหลักเกณฑ์และวิธีการที่กำหนดเก็บไว้ที่เครื่อง NT Server ทุก ๆ สิ้นเดือน โดยเมื่อผู้ใช้ต้องการเรียกใช้ข้อมูลสามารถเรียกได้โดยผ่านระบบ LAN ซึ่งรายละเอียดของฟังก์ชันการทำงานดังรายละเอียดที่จะกล่าวถึงในบทที่ 5

#### 3.2 การวิเคราะห์โครงสร้างของระบบใหม่

หลังจากที่ได้ศึกษาระบบงานและความต้องการของผู้ใช้แล้วสามารถนำมาสรุปโดยแสดงเป็นภาพรวมซึ่งแสดงการทำงานของระบบ BIS ได้ดังนี้

##### 3.2.1 Context Diagram

ระบบงานที่นำมาช่วยในการประเมินฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิคนั้นประกอบไปด้วยส่วนต่าง ๆ ดังมีรายละเอียดที่นำเสนอตามรูปที่ 3 ซึ่งแสดงให้เห็นถึงภาพรวมของระบบงานดังนี้



รูปที่ 3 แสดง Context Diagram ของระบบใหม่

จาก Context Diagram ดังรูปที่ 3 สรุปได้ว่าระบบ BIS มีส่วนที่เป็น External Entity ที่เกี่ยวข้องอยู่ 3 Entity โดยมีรายละเอียดของแต่ละ Entity ดังนี้

1. ระบบ Broker Reporting System (BRS) คือ ระบบที่มีการจัดเก็บข้อมูลที่ได้จากการจัดส่งรายงานข้อมูลต่าง ๆ ที่บริษัทสมาชิกส่งผ่านมาด้วยระบบคอมพิวเตอร์มายังฝ่ายกำกับและตรวจสอบสมาชิก (ฝ่ายกต.) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ไว้ที่เครื่อง Unix Server ซึ่งจะทำหน้าที่ในการจัดส่งข้อมูลตามที่ระบบ BIS ต้องการใช้งานซึ่งเป็นข้อมูลที่ผ่านการตรวจสอบแล้วว่าเป็นข้อมูลที่ถูกต้องเชื่อถือได้มาจัดเก็บไว้ที่เครื่อง NT Server สำหรับไว้ใช้พื้นฐานข้อมูลสำหรับระบบ BIS
2. ผู้บริหาร คือ ผู้อำนวยการฝ่าย ซึ่งทำหน้าที่เป็นผู้ที่กำหนดนโยบายในการประเมินฐานะการเงินและผลการดำเนินงาน (Broker Information System หรือ BIS) และสามารถเรียกดูผลการประเมินของบริษัทสมาชิก หรือความเห็นของเจ้าหน้าที่วิเคราะห์ได้ทันทีตามความต้องการใช้งานตามฟังก์ชันที่กำหนดได้ทันทีจากระบบ BIS
3. เจ้าหน้าที่วิเคราะห์ คือ ผู้ที่หน้าที่ในการกำหนดข้อมูลที่ต้องการใช้งานจากระบบ BRS และหลักเกณฑ์ที่ใช้ในการประเมินผลบริษัทสมาชิก รวมทั้งเป็นผู้ที่แสดงความเห็นเมื่อได้ทราบผลการประเมินจากระบบ BIS

โดยสามารถสรุปความสัมพันธ์ของ External Entity ใน Context Diagram ได้เป็นรูปแบบของตารางที่ 5

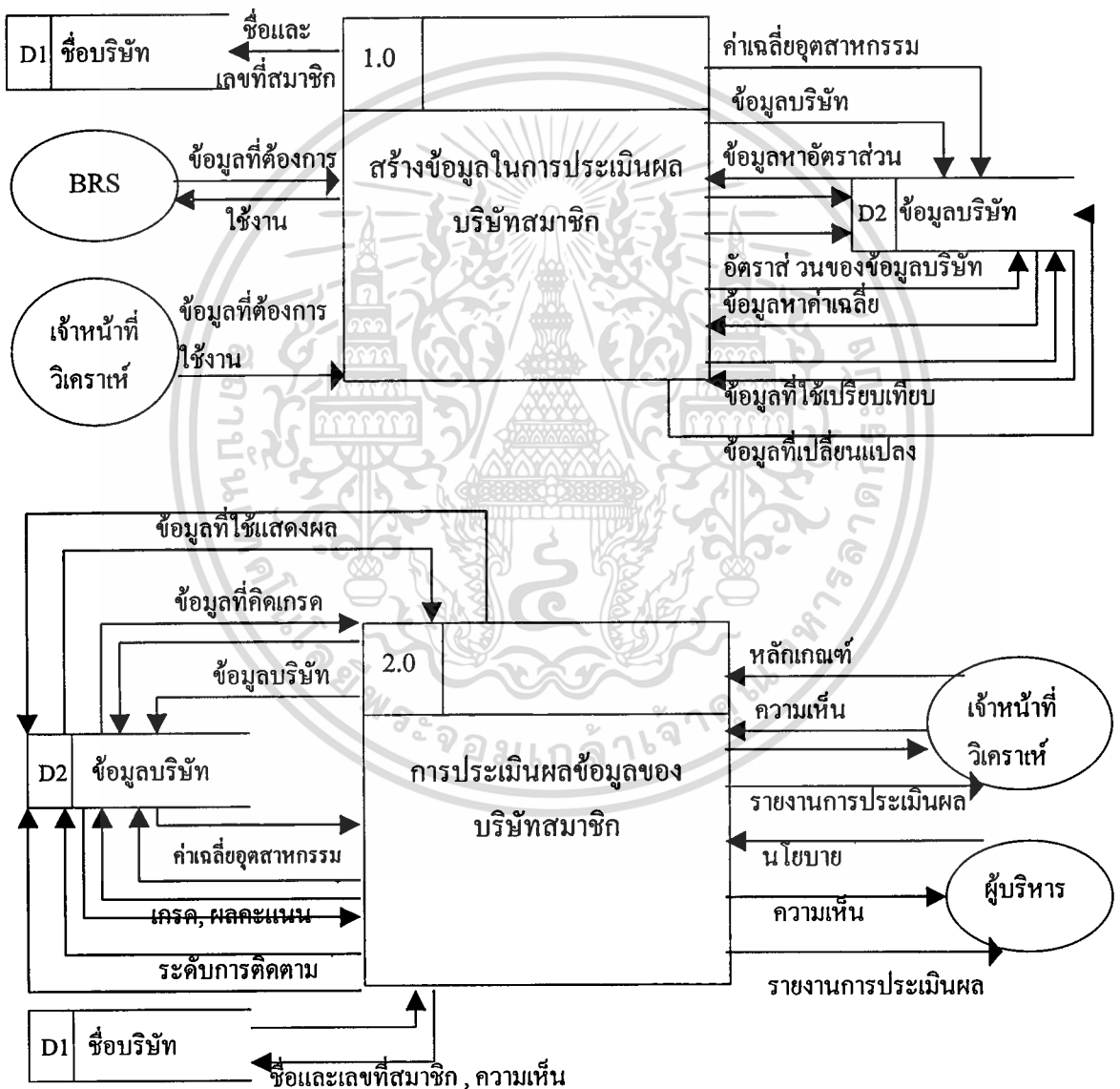
External Entity	Source or Recipient	Data Flow
BRS	R	ข้อมูลที่ต้องการใช้งาน
	S	ข้อมูลที่ต้องการใช้งาน
ผู้บริหาร	S	นโยบาย
	R	ผลการประเมิน
	R	ความเห็น
เจ้าหน้าที่วิเคราะห์	S	ข้อมูลที่ต้องการใช้งาน
	S	หลักเกณฑ์
	R	ผลการประเมิน
	S	ความเห็น
	R	ความเห็น

ตารางที่ 5 แสดง External Entity ของระบบ BIS

### 3.2.2 Data Flow Diagram

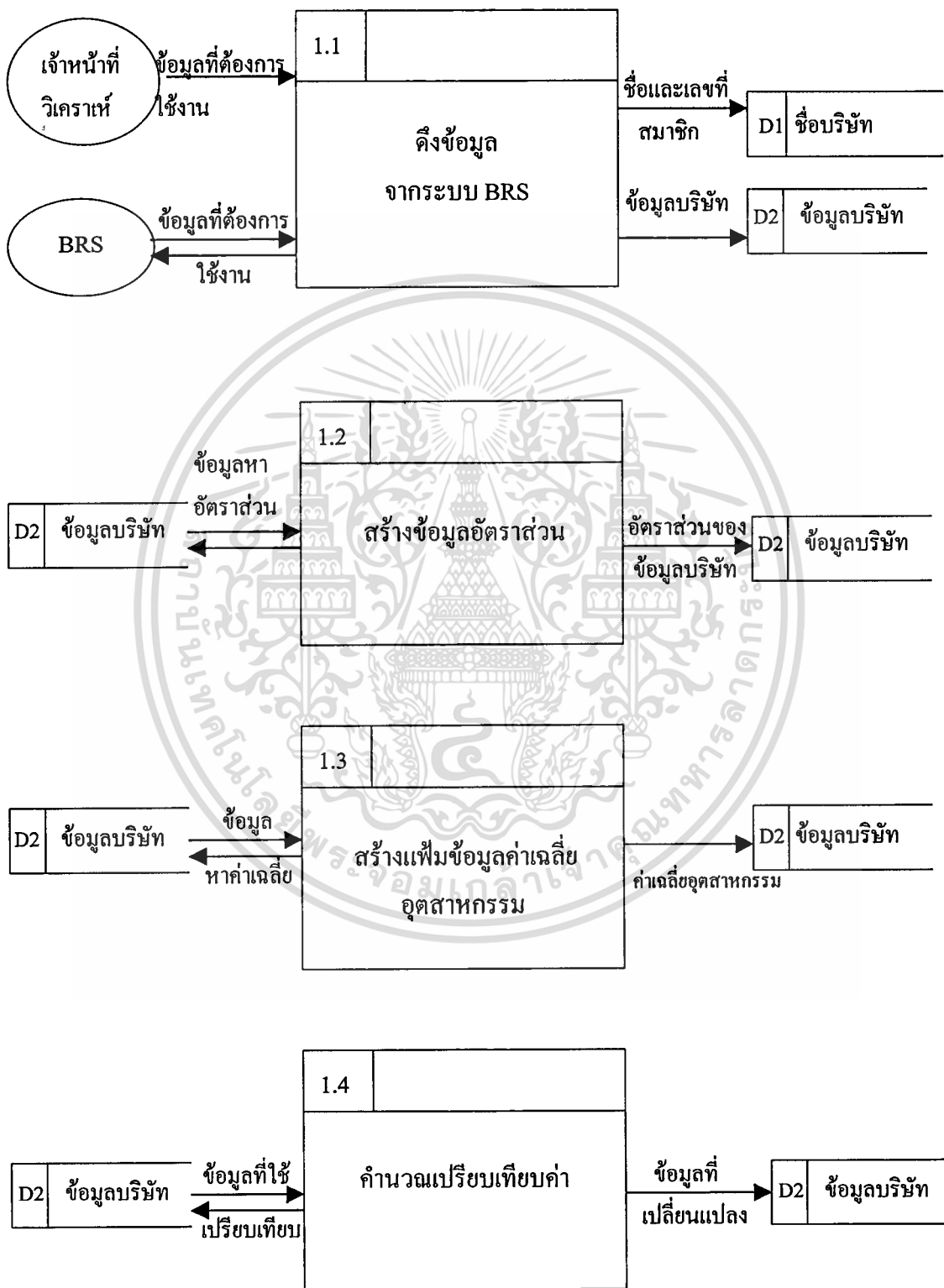
จากภาพรวมของระบบ BIS ดังกล่าวสามารถนำมาแสดงเป็นรายละเอียดของระบบงานในรูปแบบของ Data Flow Diagram ใน Level 1 และ Level 2 ดังนี้

#### 3.2.2.1 Data Flow Diagram Level 1



รูปที่ 4 แสดง Data Flow Diagram Level 1 ของระบบใหม่

3.3.2.2 Data Flow Diagram Level 2

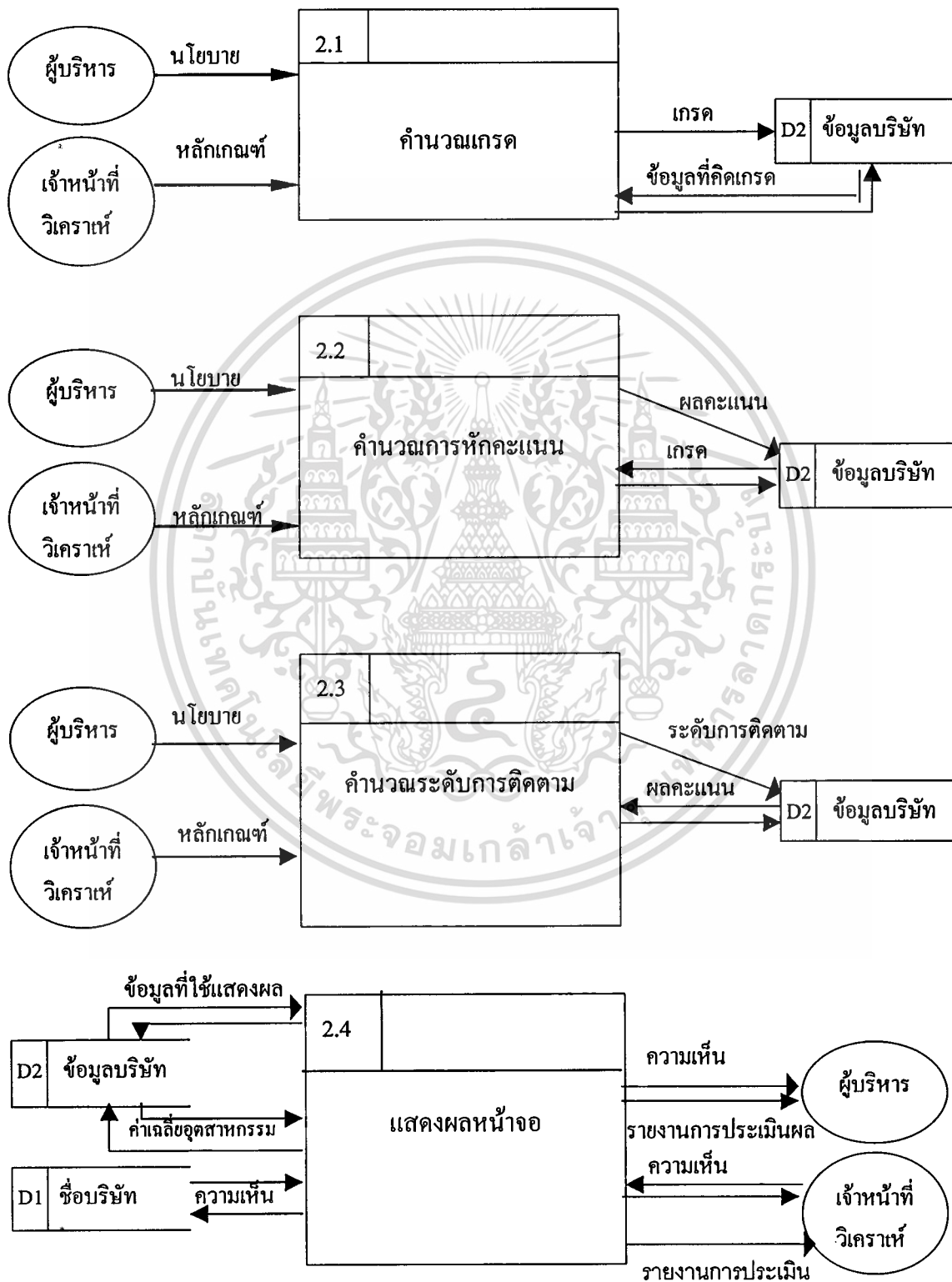


รูปที่ 5 แสดง Data Flow Diagram Level 2 รูปที่ 1 ของระบบใหม่

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

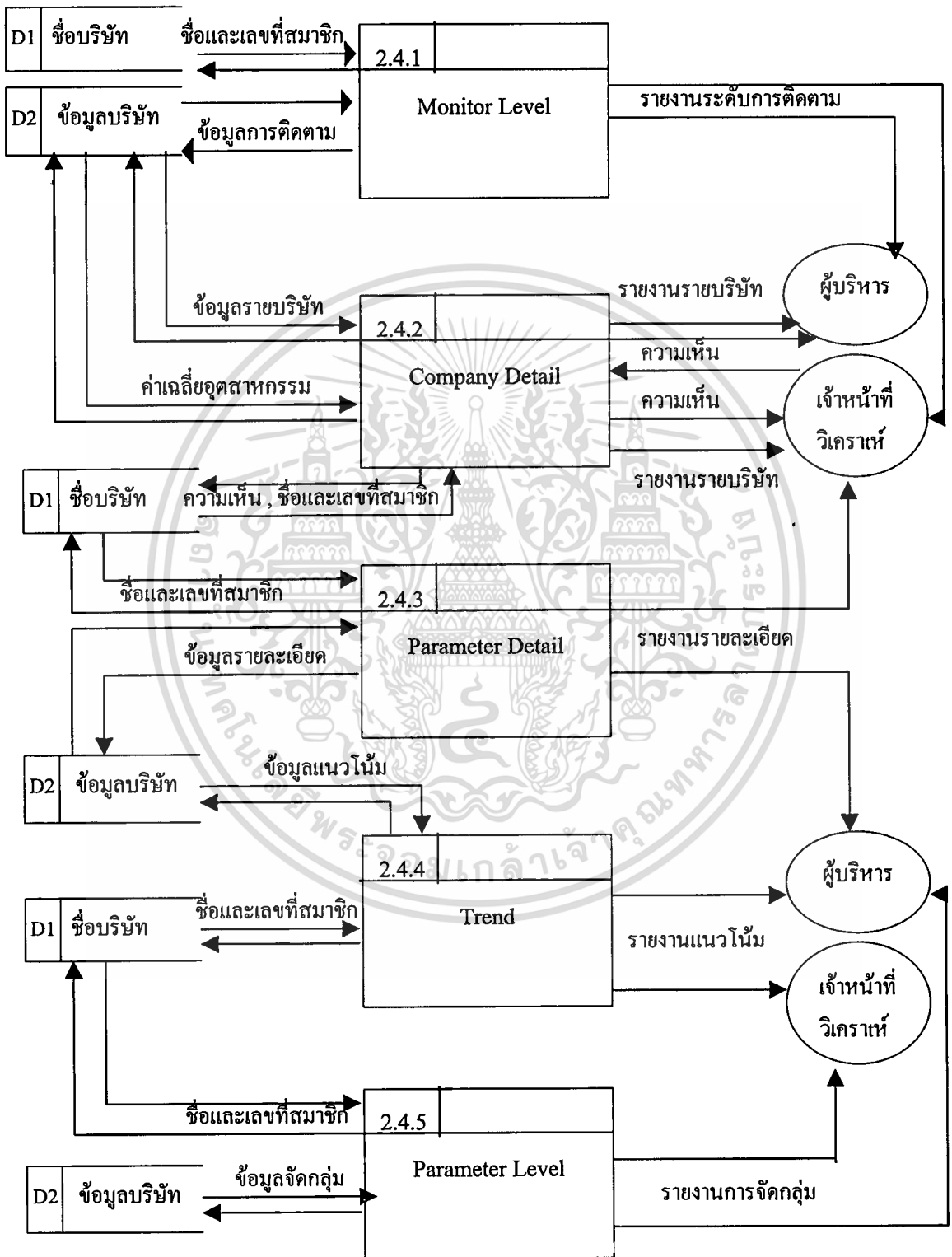
## 3.2.2.2 Data Flow Diagram Level 2



รูปที่ 6 แสดง Data Flow Diagram Level 2 รูปที่ 2 ของระบบใหม่

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

## 3.2.2.2.1 Data Flow Diagram Level 3



รูปที่ 7 แสดง Data Flow Diagram Level 3 ของระบบใหม่

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

## 3.3 แสดงรายละเอียด I/O Description

I/O Description			
From	To	Data Flow Name	Data Content
เจ้าหน้าที่วิเคราะห์	1.1	ข้อมูลที่ต้องการใช้งาน	- เลขที่บริษัทสมาชิก
1.1	BRS		- ชื่อบริษัทสมาชิก
BRS	1.1		- เดือน
			- ปี
			- อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
			- มูลค่าหุ้น Margin ที่เข้าเกณฑ์
			บังคับขายที่ MM. $\leq 0$
			- มูลค่าหลักทรัพย์ราคาตลาด
			- มูลค่าหลักประกัน
			- ส่วนของผู้ถือหุ้น
			- ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell)
			- ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์
			- ลูกหนี้พ้นกำหนดชำระ (Overdue)
			- ลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง (Cash)
			- เงินลงทุนในหลักทรัพย์
			- ค่าเพื่อการลดราคาขอหลักทรัพย์
			- ผลกำไร (ขาดทุน) รายเดือน
			- ผลกำไร (ขาดทุน) รวมตั้งแต่ต้นปี
			- เงินกู้ยืม
			- หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืน
			- เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์
			- หนี้สินอื่นๆ

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

I/O Description			
From	To	Data Flow Name	Data Content
1.1	D1	ชื่อและเลขที่	- เลขที่บริษัทสมาชิก
D1	2.4.1	สมาชิก	- ชื่อบริษัทสมาชิก
2.4.1	D1		
D1	2.4.2		
2.4.2	D1		
D1	2.4.3		
2.4.3	D1		
D1	2.4.4		
2.4.4	D1		
D1	2.4.5		
2.4.5	D1		
1.1	D2	ข้อมูลบริษัท	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เลขที่บริษัทสมาชิก</li> <li>- เดือน - ปี</li> <li>- อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ</li> <li>- มูลค่าที่ไม่มีหลักประกัน</li> <li>= (มูลค่า - มูลค่าราคาตลาด - มูลค่าหลักประกัน) ของ</li> <li>ลูกหนี้Marginที่เข้าเกณฑ์บังคับขายที่ MM. <math>\leq 0</math></li> <li>- ส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย(Force Sell)</li> <li>- ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์</li> <li>- ลูกหนี้พ้นกำหนดชำระ (Overdue)</li> <li>- ลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง (Cash)</li> <li>- เงินลงทุนในหลักทรัพย์</li> <li>- ค่าเผื่อการลดราคาของหลักทรัพย์</li> <li>- ผลกำไร (ขาดทุน) รายเดือน</li> <li>- ผลกำไร (ขาดทุน) รวมตั้งแต่ต้นปี</li> <li>- หนี้สินรวม = เงินกู้ยืม + หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญา</li> <li>จะ ซื้อคืน + เข้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์ + หนี้สินอื่น ๆ</li> </ul>

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

I/O Description			
From	To	Data Flow Name	Data Content
D2 1.2	1.2 D2	ข้อมูลหาอัตราส่วน	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เลขที่บริษัทสมาชิก</li> <li>- เดือน</li> <li>- ปี</li> <li>- มุลหนี่ที่ไม่มีหลักประกัน</li> <li>- ส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- ลูกหนี่ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell)</li> <li>- ลูกหนี่เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์</li> <li>- ลูกหนี่พื้นกำหนดชำระ</li> <li>- ลูกหนี่ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง</li> <li>- หนี่สินรวม</li> </ul>
1.2	D2	อัตราส่วนของข้อมูลบริษัท	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เลขที่บริษัทสมาชิก</li> <li>- เดือน</li> <li>- ปี</li> <li>- อัตราส่วนของมุลหนี่ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- อัตราส่วนของลูกหนี่ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell) ต่อลูกหนี่เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์</li> <li>- อัตราส่วนของลูกหนี่พื้นกำหนดชำระต่อลูกหนี่ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง</li> <li>- อัตราส่วนของหนี่สินรวมต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul>
D2 1.3	1.3 D2	ข้อมูลหาค่าเฉลี่ย	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เลขที่บริษัทสมาชิก</li> <li>- เดือน</li> <li>- ปี</li> <li>- อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ</li> <li>- มุลหนี่ที่ไม่มีหลักประกัน</li> <li>- ส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- อัตราส่วนของมุลหนี่ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- เงินลงทุนในหลักทรัพย์</li> <li>- ผลกำไร (ขาดทุน) รวมถึงแต่ต้นปี</li> <li>- อัตราส่วนของหนี่สินรวมต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul>

I/O Description			
From	To	Data Flow Name	Data Content
1.3 D2 2.4.2	D2 2.4.2 D2	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เดือน - ปี</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของอัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของมูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกัน</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของอัตราส่วนมูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของเงินลงทุนในหลักทรัพย์</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของผลกำไร (ขาดทุน) รวมถึงแต่ต้นปี</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของอัตราส่วนหนี้สินรวมต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul>
D2 1.4	1.4 D2	ข้อมูลที่ใช้เปรียบเทียบ	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เลขที่บริษัทสมาชิก</li> <li>- เดือน - ปี</li> <li>- ค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ของเดือนก่อนหน้า</li> <li>- ค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ของเดือนปัจจุบัน</li> <li>- อัตราส่วนของหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นของเดือนปัจจุบัน</li> <li>- อัตราส่วนของหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นของเดือนก่อนหน้า</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของสัดส่วนหนี้สินรวมต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul>
1.4	D2	ข้อมูลที่เปลี่ยนแปลง	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เลขที่บริษัทสมาชิก</li> <li>- เดือน</li> <li>- ปี</li> <li>- ค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เพิ่มขึ้นหรือลดลง</li> <li>- อัตราส่วนของหนี้สินรวมต่อส่วนของผู้ถือหุ้นที่สูงกว่าค่าเฉลี่ย</li> <li>- อัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินรวมต่อส่วนของผู้ถือหุ้นที่สูงขึ้น</li> </ul>

I/O Description7			
From	To	Data Flow Name	Data Content
D2	2.1	ข้อมูลที่เกิดเกรด	- เลขที่บริษัทสมาชิก
2.1	D2		- เดือน - ปี - อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ - อัตราส่วนของมูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น - อัตราส่วนของลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell) ต่อลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ - อัตราส่วนของลูกหนี้พ้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง - ค่าเผื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เพิ่มขึ้นหรือลดลง เมื่อเทียบกับเดือนก่อน - ผลกำไร (ขาดทุน) รายเดือน - ผลกำไร (ขาดทุน) รวมตั้งแต่ต้นปี - อัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นที่สูงกว่าค่าเฉลี่ย - อัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นที่สูงขึ้น - ส่วนของผู้ถือหุ้น
2.1	D2	เกรด	- เลขที่บริษัทสมาชิก
D2	2.2		- เดือน
2.2	D2		- ปี - เกรดของอัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ - เกรดของอัตราส่วนของมูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น - เกรดของอัตราส่วนของลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell) ต่อลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ - เกรดของอัตราส่วนของลูกหนี้พ้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง

I/O Description			
From	To	Data Flow Name	Data Content
2.1 D2 2.2	D2 2.2 D2	เกรด	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เกรดของค่าเผื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เพิ่มขึ้นหรือลดลงเมื่อเทียบกับเดือนก่อน</li> <li>- เกรดของผลกำไร (ขาดทุน) รายเดือน</li> <li>- เกรดของผลกำไร (ขาดทุน) รวมทั้งแต่ต้นปี</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อทุนที่สูงหรือต่ำกว่าค่าเฉลี่ย</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อทุนที่สูงขึ้นหรือต่ำลง</li> <li>- เกรดของส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul>
2.2 D2 2.3	D2 2.3 D2	ผลคะแนน	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เลขที่บริษัทสมาชิก</li> <li>- เดือน</li> <li>- ปี</li> <li>- ผลรวมของคะแนนที่ถูกหักในแต่ละระดับเกรด</li> </ul>
2.3	D2	ระดับการติดตาม	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เลขที่บริษัทสมาชิก</li> <li>- เดือน</li> <li>- ปี</li> <li>- ระดับการติดตาม</li> </ul>
D2 2.4	2.4 D2	ข้อมูลที่ใช้ แสดงผล	<ul style="list-style-type: none"> <li>- ข้อมูลการติดตาม</li> <li>- ข้อมูลรายบริษัท</li> <li>- ข้อมูลรายละเอียด</li> <li>- ข้อมูลแนวโน้ม</li> <li>- ข้อมูลจัดกลุ่ม</li> </ul>
2.4	ผู้บริหาร เจ้าหน้าที่ วิเคราะห์	รายงานการ ประเมินผล	<ul style="list-style-type: none"> <li>- รายงานระดับการติดตาม (Monitor Level)</li> <li>- รายงานรายบริษัท (Company Detail)</li> <li>- รายงานรายละเอียด (Parameter Detail)</li> <li>- รายงานแนวโน้ม (Trend)</li> <li>- รายงานการจัดกลุ่ม (Parameter Level)</li> </ul>

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

I/O Description			
From	To	Data Flow Name	Data Content
D2 2.4.1	2.4.1 D2	ข้อมูลการติดตาม	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เลขที่บริษัทสมาชิก</li> <li>- เดือน - ปี</li> <li>- ผลคะแนน</li> <li>- ระดับการติดตาม</li> <li>- อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ</li> </ul>
D2 2.4.1	2.4.1 D2	ข้อมูลการติดตาม	<ul style="list-style-type: none"> <li>- อัตราส่วนของมูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- ค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เพิ่มขึ้นหรือลดลงเมื่อเทียบกับเดือนก่อน</li> <li>- ผลกำไร(ขาดทุน)รวมตั้งแต่ต้นปี</li> <li>- อัตราส่วนของหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นที่สูงกว่าค่าเฉลี่ย</li> <li>- ส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- เกรดของอัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนของมูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- เกรดของค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เพิ่มขึ้นหรือลดลงเมื่อเทียบกับเดือนก่อน</li> <li>- เกรดของผลกำไร (ขาดทุน) รวมตั้งแต่ต้นปี</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนของหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นที่สูงกว่าค่าเฉลี่ย</li> <li>- เกรดของส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul>
D2 2.4.2	2.4.2 D2	ข้อมูลรายบริษัท	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เลขที่บริษัทสมาชิก</li> <li>- เดือน - ปี</li> <li>- อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ</li> <li>- มูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกัน</li> </ul>

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

I/O Description			
From	To	Data Flow Name	Data Content
D2 2.4.2	2.4.2 D2	ข้อมูลรายบริษัท	<ul style="list-style-type: none"> <li>- อัตราส่วนของมูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- เงินลงทุนในหลักทรัพย์</li> <li>- อัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- ผลกำไร (ขาดทุน) รวมถึงแต่ต้นปี</li> <li>- ส่วนของผู้ถือ</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของอัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของมูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกัน</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของอัตราส่วนของมูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของเงินลงทุนในหลักทรัพย์</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของสัดส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของผลกำไรขาดทุนรวมถึงแต่ต้นปี</li> <li>- ค่าเฉลี่ยของส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul>
D2 2.4.3	2.4.3 D2	ข้อมูลรายละเอียด	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เลขที่บริษัทสมาชิก</li> <li>- เดือน - ปี</li> <li>- อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ</li> <li>- อัตราส่วนของมูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- อัตราส่วนของลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย(Force Sell)ต่อลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์</li> <li>- อัตราส่วนของลูกหนี้ที่พ้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง</li> <li>- ค่าเผื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เพิ่มขึ้นหรือลดลงเมื่อเทียบกับเดือนก่อน</li> <li>- ผลกำไร (ขาดทุน) รายเดือน</li> <li>- ผลกำไร (ขาดทุน) รวมถึงแต่ต้นปี</li> <li>- อัตราส่วนของหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นที่สูงกว่าค่าเฉลี่ย</li> <li>- อัตราส่วนของหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นที่สูงขึ้น</li> <li>- ส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul>

I/O Description			
From	To	Data Flow Name	Data Content
		ข้อมูลรายละเอียด	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เกรดของอัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนของมูลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนของลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell) ต่อลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนของลูกหนี้พินกำหนดชำระต่อลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง</li> <li>- เกรดของค่าเผื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เพิ่มขึ้นหรือลดลงเมื่อเทียบกับเดือนก่อน</li> <li>- ผลกำไร(ขาดทุน)รายเดือน</li> <li>- เกรดของผลกำไร (ขาดทุน) รวมตั้งแต่ต้นปี</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนของหนี้สินต่อทุนที่สูงกว่าค่าเฉลี่ย</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนของหนี้สินต่อทุนที่สูงขึ้น</li> <li>- เกรดของส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul>
D2 2.4.4	2.4.4 D2	ข้อมูลแนวโน้ม	- เหมือนกับข้อมูลรายละเอียด แต่เป็นการดูข้อมูลรายบริษัทย้อนหลัง 1 ปี
D2 2.4.5	2.4.5 D2	ข้อมูลจัดกลุ่ม	- เหมือนกับข้อมูลการติดตามแต่เป็นการเรียกดูข้อมูลด้วยวิธีที่ต่างกัน
เจ้าหน้าที่วิเคราะห์ 2.4.2 D1 2.4.2 D1 2.4.2 D1 2.4.2	2.4.2 D1 2.4.2 ผู้บริหาร เจ้าหน้าที่วิเคราะห์	ความเห็น	<ul style="list-style-type: none"> <li>- บริษัท</li> <li>- ความเห็นของเจ้าหน้าที่วิเคราะห์ภายหลังจากการพิจารณาข้อมูลบริษัท ซึ่งเป็นหน้าที่ของเจ้าหน้าที่วิเคราะห์ในการเข้าไปทำการมีการเปลี่ยนแปลงได้</li> </ul>

I/O Description			
From	To	Data Flow Name	Data Content
2.4.1	ผู้บริหาร	รายงานระดับการติดตาม	- หน้าจอ Monitor Level (รายละเอียดตามภาพที่ 23-24)
2.4.1	เจ้าหน้าที่วิเคราะห์		
2.4.2	ผู้บริหาร	รายงานรายบริษัท	- หน้าจอ Company Detail (รายละเอียดตามภาพที่ 25-27)
2.4.2	เจ้าหน้าที่วิเคราะห์		
2.4.3	ผู้บริหาร	รายงานรายละเอียด	- หน้าจอ Parameter Detail (รายละเอียดตามภาพที่ 28-29)
2.4.3	เจ้าหน้าที่วิเคราะห์		
2.4.4	ผู้บริหาร	รายงานแนวโน้ม	- หน้าจอ Trend (รายละเอียดตามภาพที่ 30-31)
2.4.4	เจ้าหน้าที่วิเคราะห์		
2.4.5	ผู้บริหาร	รายงานการจัดกลุ่ม	- หน้าจอ Parameter Level (รายละเอียดตามภาพที่ 32-33)
2.4.5	เจ้าหน้าที่วิเคราะห์		

ตาราง 6 แสดง I/O Description ของระบบ BIS

### 3.4 รายละเอียด Elementary Process Description

Elementary Process Description
Process ID: 1.1
Process Name: ดึงข้อมูลจากระบบ BRS
<p>ทำการดึงข้อมูลที่ต้องการใช้งานจากฐานข้อมูลของระบบ BRS ที่อยู่ในเครื่อง UNIX Server แล้วนำมาคำนวณค่าดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- มูลค่าที่ไม่มีหลักประกัน = (มูลค่าราคาตลาด - มูลค่าหลักประกัน) ของลูกหนี้</li> <li>Margin ที่เข้าเกณฑ์บังคับขายที่ <math>MM. \leq 0</math></li> <li>- หนี้สินรวม = เงินกู้ยืม + หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืน + เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์ + หนี้สินอื่น ๆ</li> </ul> <p>แล้วนำมาสร้างเพิ่มข้อมูลดังมีรายละเอียดดังนี้</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. เพิ่มชื่อบริษัท (เพิ่ม D1) สำหรับจัดเก็บข้อมูลชื่อและเลขที่บริษัท ซึ่งจะทำการปรับปรุงข้อมูลเมื่อมีการเปลี่ยนแปลงจำนวน หรือชื่อของบริษัทสมาชิก</li> <li>2. เพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) สำหรับจัดเก็บข้อมูลซึ่งจะมีการปรับปรุง ข้อมูลทุกๆสิ้นเดือน โดยข้อมูลทั้ง 2 เพิ่มจะถูกจัดเก็บไว้ที่เครื่อง NT Server</li> </ol>

ตาราง 7 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 1.1

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

Elementary Process Description	
Process ID: 1.2	
Process Name: สร้างข้อมูลอัตราส่วน	
<p>นำข้อมูลอัตราส่วนของข้อมูลบริษัทจากเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) ซึ่งมีรายละเอียดดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- มุลหนี้ที่ไม่มีหลักประกัน</li> <li>- ส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell)</li> <li>- ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์</li> <li>- ลูกหนี้พ้นกำหนดชำระ</li> <li>- ลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง</li> <li>- หนี้สินรวม</li> </ul> <p>นำมาคำนวณหาอัตราส่วนต่าง ๆ ดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- อัตราส่วนมุลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- อัตราส่วนของลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell) ต่อลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์</li> <li>- อัตราส่วนลูกหนี้พ้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง</li> <li>- อัตราส่วนหนี้สินรวมต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul> <p>แล้วนำข้อมูลที่ได้ไปจัดเก็บไว้ในเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) ซึ่งถูกจัดเก็บไว้ที่เครื่อง NT Server โดยจะมีการปรับปรุงข้อมูลทุกๆสิ้นเดือน</p>	

ตาราง 8 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 1.2

Elementary Process Description	
Process ID: 1.3	
Process Name: สร้างเพิ่มข้อมูลค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม	
<p>นำข้อมูลค่าเฉลี่ย จากเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) ซึ่งมีรายละเอียดดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (NCR)</li> <li>- มุลหนี้ที่ไม่มีหลักประกัน</li> <li>- ส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- อัตราส่วนของมุลหนี้ที่ไม่มีหลักประกันต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- เงินลงทุนในหลักทรัพย์</li> <li>- กำไร (ขาดทุน)รวมตั้งแต่ต้นปี</li> <li>- หนี้สินรวม</li> <li>- อัตราส่วนของหนี้สินรวมต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul> <p>นำมาคำนวณหาค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม โดยการนำข้อมูลในแต่ละรายการของทุกบริษัทรวมกันแล้วหารด้วยจำนวนบริษัท แล้วนำข้อมูลที่ได้ไปจัดเก็บไว้ในเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) ซึ่งถูกจัดเก็บไว้ที่เครื่อง NT Server โดยจะมีการปรับปรุงข้อมูลทุกๆสิ้นเดือน</p>	

ตาราง 9 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 1.3

Elementary Process Description
Process ID: 1.4
Process Name: จำนวนเปรียบเทียบค่า
<p>นำข้อมูลที่ใช้เปรียบเทียบค่าจากเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) มาคำนวณเปรียบเทียบค่า เพื่อให้ได้ข้อมูลที่เปลี่ยนแปลง โดยมีวิธีการคำนวณดังนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- ค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์เพิ่มขึ้นหรือลดลง           <ul style="list-style-type: none"> <li>= ค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ของเดือนปัจจุบัน - ค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ของเดือนก่อนหน้า</li> </ul> </li> <li>- อัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นที่สูงกว่าค่าเฉลี่ย           <ul style="list-style-type: none"> <li>= อัตราส่วนของหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้น - ค่าเฉลี่ยของอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul> </li> </ul> <p>แล้วนำข้อมูลที่ได้ไปจัดเก็บไว้ในเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) ซึ่งถูกจัดเก็บไว้ที่เครื่อง NT Server โดยจะมีการปรับปรุงข้อมูลทุกๆสิ้นเดือน</p>

ตาราง 10 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 1.4

Elementary Process Description
Process ID: 2.1
Process Name: จำนวนเกรด
<p>นำข้อมูลที่คิดเกรดจากเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) มาเปรียบเทียบว่าข้อมูลของแต่ละบริษัทอยู่ในระดับเกรดใด ตามหลักเกณฑ์ในการกำหนดเกรดของแต่ละ Parameter ที่กำหนดไว้ในตารางที่ 2</p> <p>แล้วนำข้อมูลที่ได้ไปจัดเก็บไว้ในเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) ซึ่งถูกจัดเก็บไว้ที่เครื่อง NT Server โดยจะมีการปรับปรุงข้อมูลทุกๆสิ้นเดือน</p>

ตาราง 11 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 2.1

Elementary Process Description
Process ID: 2.2
Process Name: จำนวนการหักคะแนน
<p>นำข้อมูลเกรดจากเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) มาเปรียบเทียบกับข้อมูลเกรดของแต่ละบริษัทที่อยู่ในเกณฑ์ที่จะต้องถูกหักคะแนนเท่าใด ตามหลักเกณฑ์ที่ใช้ในการหักคะแนนที่กำหนดไว้ในตารางที่ 3</p> <p>แล้วนำข้อมูลที่ได้ไปจัดเก็บไว้ในเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) ซึ่งถูกจัดเก็บไว้ที่เครื่อง NT Server โดยจะมีการปรับปรุงข้อมูลทุกๆสิ้นเดือน</p>

ตาราง 12 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 2.2

Elementary Process Description
Process ID: 2.3
Process Name: จำนวนระดับการติดตาม
<p>นำข้อมูลผลคะแนนจากเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) มาเปรียบเทียบกับผลคะแนนที่ถูกหักของแต่ละบริษัทอยู่ในช่วงคะแนนจัดอยู่ในประเภทของระดับการติดตามระดับใดตามหลักเกณฑ์ที่ใช้ในการจัดประเภทของระดับการติดตามที่กำหนดไว้ในตารางที่ 4</p> <p>แล้วนำข้อมูลที่ได้ไปจัดเก็บไว้ในเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) ซึ่งถูกจัดเก็บไว้ที่เครื่อง NT Server โดยจะมีการปรับปรุงข้อมูลทุกๆสิ้นเดือน</p>

ตาราง 13 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 2.3

Elementary Process Description
Process ID: 2.4.1
Process Name: Monitor Level
<p>เมื่อผู้ใช้เลือกใช้ข้อมูล Monitor Level แล้วทำการกำหนดระดับของระดับการติดตามระยะเวลา และประเภทข้อมูล ของการเรียกใช้งานรายงานระดับการติดตาม (Monitor Level) ระบบจะเรียกข้อมูลชื่อและเลขที่สมาชิกจากเพิ่มชื่อบริษัท (เพิ่ม D1) และข้อมูลการติดตามจากเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) เพื่อนำมาใช้ในการแสดงข้อมูลของระดับการติดตามบริษัทสมาชิกแยกเป็นแต่ละระดับ พร้อมทั้งแสดงค่า Parameter 6 เรื่องที่ใช้เป็นเกณฑ์พิจารณาการหักคะแนนบริษัท</p>

ตาราง 14 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 2.4.1

Elementary Process Description
Process ID: 2.4.2
Process Name: Company Detail
<p>เมื่อผู้ใช้เลือกใช้ข้อมูล Company Detail แล้วทำการกำหนดบริษัท ระยะเวลา และประเภท ของการเรียกใช้งานรายงานรายบริษัท (Company Detail) ระบบจะเรียกข้อมูลชื่อและเลขที่สมาชิกจากเพิ่มชื่อบริษัท (เพิ่ม D1) และข้อมูลรายบริษัท และค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรมจากเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) เพื่อนำมาใช้ในการแสดงข้อมูลสำคัญเกี่ยวกับฐานะการเงินและผลการดำเนินงานรายบริษัท โดยเปรียบเทียบกับค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม</p>

ตาราง 15 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 2.4.2

Elementary Process Description
Process ID: 2.4.3
Process Name: Parameter Detail
<p>เมื่อผู้ใช้เลือกใช้ข้อมูล Parameter Detail แล้วทำการกำหนดบริษัท ระยะเวลา และประเภทของข้อมูล ของการเรียกใช้งานรายงานรายละเอียด (Parameter Detail) ระบบจะเรียกข้อมูลชื่อและเลขที่สมาชิกจากเพิ่มชื่อบริษัท (เพิ่ม D1) และข้อมูลรายบริษัท จากเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) เพื่อนำมาใช้ในการแสดงข้อมูลของระดับการเตือนของบริษัทสมาชิกในแต่ละเรื่องที่ใช้เป็น Parameter</p>

ตาราง 16 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 2.4.3

Elementary Process Description
Process ID: 2.4.4
Process Name: Trend
<p>เมื่อผู้ใช้เลือกใช้ข้อมูล Trend แล้วทำการกำหนดบริษัท ระยะเวลา และประเภทของข้อมูล ของการเรียกใช้งานรายงานแนวโน้ม (Trend) ระบบจะเรียกข้อมูลชื่อและเลขที่สมาชิกจากเพิ่มชื่อบริษัท (เพิ่ม D1) และข้อมูลแนวโน้มจากเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) เพื่อนำมาใช้ในการแสดงข้อมูลแนวโน้มของค่า Parameter รายบริษัท</p>

ตาราง 17 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 2.4.4

Elementary Process Description
Process ID: 2.4.5
Process Name: Parameter Level
เมื่อผู้ใช้เลือกใช้ข้อมูล Parameter Level แล้วทำการกำหนดบริษัท ระยะเวลา และประเภทของข้อมูล ของการเรียกใช้งานรายงานการจัดกลุ่ม (Parameter Level) ระบบจะเรียกข้อมูลชื่อและเลขที่สมาชิกจากเพิ่มชื่อบริษัท (เพิ่ม D1) และข้อมูลจัดกลุ่มจากเพิ่มข้อมูลบริษัท (เพิ่ม D2) เพื่อนำมาใช้ในการแสดงข้อมูลของจำนวนบริษัทในแต่ละระดับของ Parameter

ตาราง 18 แสดง Elementary Process Description ของ Process ID 2.4.5

### 3.5 ความต้องการของระบบในการดำเนินงาน (Hardware and Software Specification)

- Server Computer
- Hardware
  - CPU PENTIUM 133 MHz ขึ้นไป
  - RAM หน่วยความจำ 32 MB ขึ้นไป
  - Hard Disk 6.3 GB ขึ้นไป
  - CD-ROM Drive Speed 8X ขึ้นไป
  - Floppy Disk Drive 1.44 M
  - Network Card
  - Keyboard 101 keys
- Software
  - NT Server Window NT 4.0 รองรับผู้ใช้ได้ 200 ราย
  - SQL Server Version 6.5
  - Window 95 ขึ้นไป
  - Microsoft Visual Basic Version 5 ขึ้นไป

- Client Computer
- Hardware
  - CPU PENTIUM 75 MHz 486/60 ขึ้นไป
  - RAM หน่วยความจำ 16 MB ขึ้นไป
  - Hard Disk 500 MB ขึ้นไป
  - CD-ROM Drive Speed 8X ขึ้นไป
  - Floppy Disk Drive 1.44 M
  - Network Card
  - Keyboard 101 keys
- Software
  - Window 95 ขึ้นไป
  - Microsoft Visual Basic Version 5 ขึ้นไป
- Peopleware
  - Administrator People
  - User People
  - Technical Support (Hardware & Software)

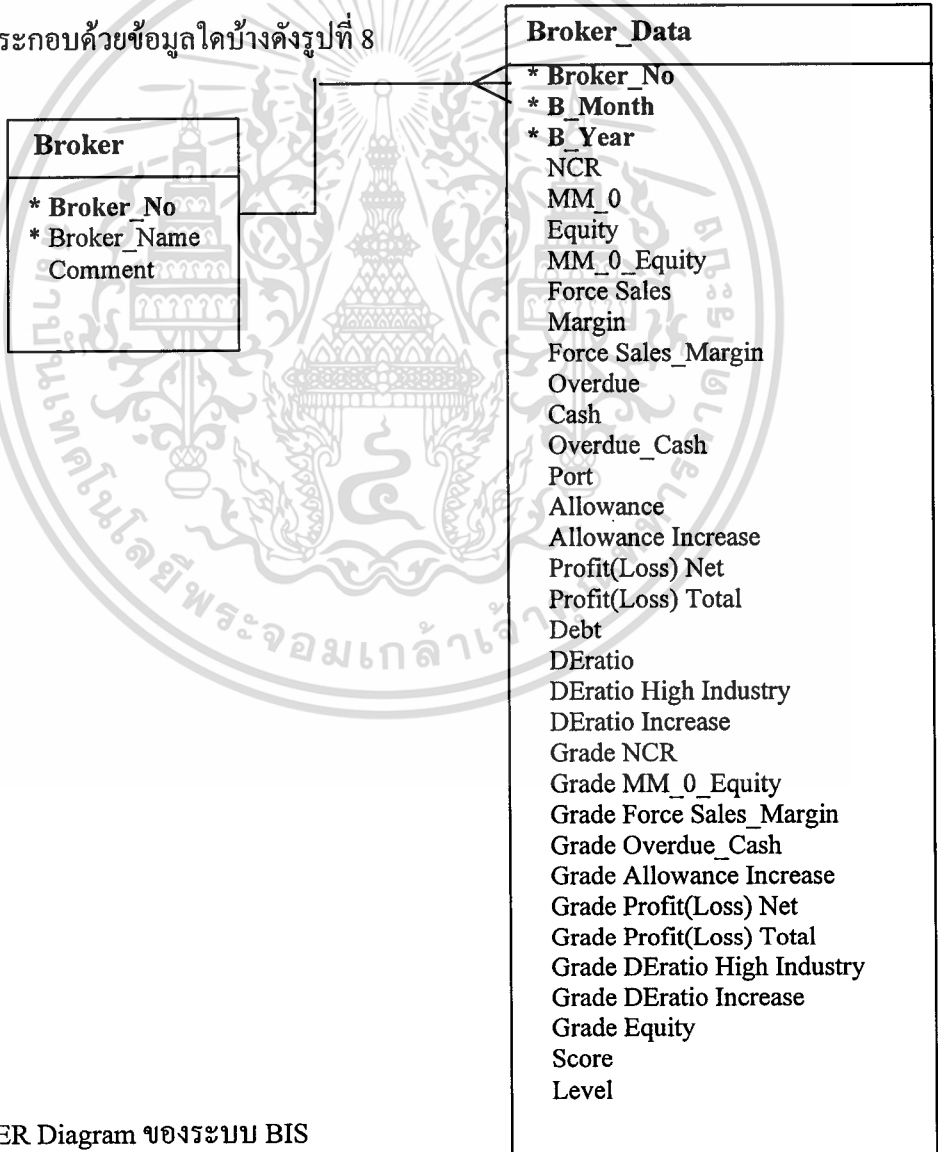


## บทที่ 4

### การออกแบบโครงสร้างฐานข้อมูล

#### 4.1 การออกแบบฐานข้อมูล

จากข้อมูลที่ได้จากการวิเคราะห์และออกแบบระบบใหม่ของระบบ BIS ดังกล่าวในบทที่ 3 นั้นสามารถนำมาทำการสร้างเป็น ER-Diagram เพื่อจำลองความสัมพันธ์ระหว่างข้อมูลในฐานข้อมูลว่าประกอบด้วยข้อมูลใดบ้างดังรูปที่ 8



รูปที่ 8 แสดง ER Diagram ของระบบ BIS

หมายถึง Attribute Name ที่เป็น Primary key

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

## 4.2 รายการข้อมูลและตารางข้อมูล

รายการข้อมูล	5 NF	ชื่อตารางข้อมูล
- เลขที่บริษัทสมาชิก	- เลขที่บริษัทสมาชิก	ตารางบริษัท
- ชื่อบริษัทสมาชิก	- ชื่อบริษัทสมาชิก	สมาชิก (Broker)
- เดือน		
- ปี		ตารางข้อมูลบริษัท
- อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ *	- เลขที่บริษัทสมาชิก	สมาชิก
- ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ที่มีหลักประกันไม่คุ้มหนี้ *	- เดือน	(Broker_Data)
- ส่วนของผู้ถือหุ้น *	- ปี	
- อัตราส่วนลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ที่มีหลักประกันไม่คุ้มหนี้ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น *	- อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ *	
- ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell)	- ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ที่มีหลักประกันไม่คุ้มหนี้ *	
- ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์	- ส่วนของผู้ถือหุ้น *	
- อัตราส่วนลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell) ต่อลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์	- อัตราส่วนลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ที่มีหลักประกันไม่คุ้มหนี้ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น *	
- ลูกหนี้เงินสดที่พ้นกำหนดชำระ (Overdue)	- ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell)	
- ลูกหนี้เงินสด	- ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์	
	- อัตราส่วนลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell) ต่อลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์	

รายการข้อมูล	5 NF	ชื่อตารางข้อมูล
<ul style="list-style-type: none"> <li>- อัตราส่วนลูกหนี้เงินสดที่พ้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้เงินสด</li> <li>- เงินลงทุนในหลักทรัพย์ *</li> <li>- ค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance)</li> <li>- อัตราส่วนการเพิ่มขึ้น/ลดลงของค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เมื่อเทียบกับเดือนก่อน</li> <li>- ผลกำไรขาดทุนรายเดือน</li> <li>- ผลกำไรขาดทุนรวมตั้งแต่ต้นปีถึงปัจจุบัน *</li> <li>- หนี้สินรวม</li> <li>- สัดส่วนหนี้สินต่อทุน *</li> <li>- อัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อทุนที่สูงหรือต่ำกว่าค่าเฉลี่ย</li> <li>- อัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อทุนที่สูงขึ้นหรือต่ำลง</li> <li>- เกรดของอัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ที่มีหลักประกันไม่คุ้มหนี้ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell) ต่อ ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>- ลูกหนี้เงินสดที่พ้นกำหนดชำระ (Overdue)</li> <li>- ลูกหนี้เงินสด</li> <li>- อัตราส่วนลูกหนี้เงินสดที่พ้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้เงินสด</li> <li>- เงินลงทุนในหลักทรัพย์ *</li> <li>- ค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance)</li> <li>- อัตราส่วนการเพิ่มขึ้น/ลดลงของค่าเพื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เมื่อเทียบกับเดือนก่อน</li> <li>- ผลกำไรขาดทุนรายเดือน</li> <li>- ผลกำไรขาดทุนรวมตั้งแต่ต้นปีถึงปัจจุบัน *</li> <li>- หนี้สินรวม</li> <li>- สัดส่วนหนี้สินต่อทุน *</li> <li>- อัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อทุนที่สูงหรือต่ำกว่าค่าเฉลี่ย</li> <li>- อัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อทุนที่สูงขึ้นหรือต่ำลง</li> <li>- เกรดของอัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ที่มีหลักประกันไม่คุ้มหนี้ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น</li> </ul>	<p>ตารางข้อมูลบริษัทสมาชิก (Broker_Data)</p>

รายการข้อมูล	5 NF	ชื่อตารางข้อมูล
<ul style="list-style-type: none"> <li>- เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้เงินสดที่พื้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้เงินสด</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนการเพิ่มขึ้น/ลดลงของค่าเผื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เมื่อเทียบกับเดือนก่อน</li> <li>- เกรดของผลกำไร(ขาดทุน)ในแต่ละเดือน</li> <li>- เกรดของผลกำไร (ขาดทุน) รวมตั้งแต่ต้นปี</li> <li>- เกรดของ D/E Ratio ที่มีค่าสูง/ต่ำกว่าค่าเฉลี่ยของอุตสาหกรรม</li> <li>- เกรดของ D/E Ratio ที่มีค่าเพิ่ม/ลดลงจากเดือนก่อน</li> <li>- เกรดของส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- คะแนนของการประเมินผล</li> <li>- สถานะของระดับการติดตามบริษัทสมาชิก</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>- เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย(Force Sell)ต่อลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้เงินสดที่พื้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้เงินสด</li> <li>- เกรดของอัตราส่วนการเพิ่มขึ้น/ลดลงของค่าเผื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เมื่อเทียบกับเดือนก่อน</li> <li>- เกรดของผลกำไร(ขาดทุน)ในแต่ละเดือน</li> <li>- เกรดของผลกำไร(ขาดทุน)รวมตั้งแต่ต้นปี</li> <li>- เกรดของ D/E Ratio ที่มีค่าสูง/ต่ำกว่าค่าเฉลี่ยของอุตสาหกรรม</li> <li>- เกรดของ D/E Ratio ที่มีค่าเพิ่ม/ลดลงจากเดือนก่อน</li> <li>- เกรดของส่วนของผู้ถือหุ้น</li> <li>- คะแนนของการประเมินผล</li> <li>- สถานะของระดับการติดตามบริษัทสมาชิก</li> </ul>	ตารางข้อมูลบริษัทสมาชิก (Broker_Data)

ตาราง 19 แสดงรายการข้อมูลและตารางข้อมูลที่ใช้ในระบบ BIS

หมายเหตุ : \* กรณีที่เลขที่บริษัทสมาชิกมีค่าเป็นศูนย์ (0) จะหมายถึงการแสดงผลของค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม

Table: Broker (ตารางบริษัทสมาชิก)

Attribute name	Attribute Definition	Type	Width	Decimal
<b>Broker_No</b>	เลขที่ของบริษัทสมาชิก	Number	2	
<b>Broker_Name</b>	ชื่อของบริษัทสมาชิก	Text	30	
<b>Comment</b>	ความเห็นของเจ้าหน้าที่	Text	200	

ตาราง 20 แสดงคำอธิบายข้อมูลของตารางบริษัทสมาชิก

ชื่อเขตข้อมูล	ชนิดข้อมูล	คำอธิบาย
Broker_No	Number	เลขที่ของบริษัทสมาชิก
Broker_Name	Text	ชื่อของบริษัทสมาชิก
Comment	Text	ความเห็นของเจ้าหน้าที่วิเคราะห์สำหรับบริษัทนั้น ๆ

คุณสมบัติของเขตข้อมูล

ทั่วไป   ค้นหา	
ขนาดเขตข้อมูล	Integer
รูปแบบ	
จุดทศนิยม	Auto
เครื่องหมายแทนค่า	
คำอธิบายเฉพาะ	
ค่าเริ่มต้น	0
กฎการตรวจสอบ	
ข้อความตรวจสอบ	
จำเป็น	ไม่
ดัชนี	ใช่ (มีค่าไม่ได้)

ชื่อเขตข้อมูลมีความยาวได้ถึง 64 อักขระรวมทั้งช่องว่าง กด F1 สำหรับวิธีใช้ ชื่อเขตข้อมูล

มุมมองออกแบบ F6 = สลับหน้าต่าง F1 = วิดีโอ

ภาพที่ 9 แสดงคำอธิบายข้อมูลของตารางบริษัทสมาชิก

Table: Broker\_Data (ตารางข้อมูลบริษัทสมาชิก)

Attribute name	Attribute Definition	Type	Width	Decimal
Broker_No	เลขที่ของบริษัทสมาชิก	Number	2	
B_Month	เดือน	Number	2	
B_Year	ปี	Number	4	
NCR	อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ	Number	10	2
MM_0	ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ที่มีหลักประกันไม่คุ้มหนี้	Number	20	2
Equity	ส่วนของผู้ถือหุ้น	Number	20	2
MM_0_Equity	อัตราส่วนลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ที่มีหลักประกันไม่คุ้มหนี้ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น	Number	3	2
Force Sales	ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell)	Number	20	2
Margin	ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์	Number	20	2
Force Sales_Margin	อัตราส่วนลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย (Force Sell) ต่อ ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์	Number	3	2
Overdue	ลูกหนี้เงินสดที่พ้นกำหนดชำระ (Overdue)	Number	20	2
Cash	ลูกหนี้เงินสด	Number	20	2
Overdue_Cash	อัตราส่วนลูกหนี้เงินสดที่พ้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้เงินสด	Number	3	2
Port	เงินลงทุนในหลักทรัพย์	Number	20	2
Profit(Loss) Net	ผลกำไรขาดทุนรายเดือน	Number	20	2
Profit(Loss) Total	ผลกำไรขาดทุนรวมตั้งแต่ต้นปีถึงปัจจุบัน	Number	20	2
Debt	หนี้สินรวม	Number	20	2
DEratio	สัดส่วนหนี้สินต่อทุน	Number	3	2
DEratio High Industry	อัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อทุนที่สูงหรือต่ำกว่าค่าเฉลี่ย	Number	3	2

Attribute name	Attribute Definition	Type	Width	Decimal
DEratio Increase	อัตราส่วนของสัดส่วนหนี้สินต่อทุนที่สูงขึ้นหรือต่ำลง	Number	3	
Grade NCR	เกรดของอัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ	Text	2	
Grade MM_0_Equity	เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ที่มีหลักประกันไม่คุ้มหนี้ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น	Text	2	
Grade Force Sales_Margin	เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย(Force Sell) ต่อ ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์	Text	2	
Grade Overdue_Cash	เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้เงินสดที่พ้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้เงินสด	Text	2	
Grade Allowance Increase	เกรดของอัตราส่วนการเพิ่มขึ้น/ลดลงของค่าเผื่อการลดราคาของหลักทรัพย์ (Allowance) เมื่อเทียบกับเดือนก่อน	Text	2	
Grade Profit (Loss) Net	เกรดของผลกำไร(ขาดทุน)ในแต่ละเดือน	Text	2	
Grade Profit (Loss) Total	เกรดของผลกำไร(ขาดทุน)รวมตั้งแต่ ต้นปี	Text	2	
Grade DEratio High Industry	เกรดของD/E Ratio ที่มีค่าสูง/ต่ำกว่าค่าเฉลี่ยของอุตสาหกรรม	Text	2	
Grade DEratio Increase	เกรดของD/E Ratio ที่มีค่าเพิ่ม/ลดลงจากเดือนก่อน	Text	2	
Grade Equity	เกรดของส่วนของผู้ถือหุ้น	Text	2	
Score	คะแนนของการประเมินผล	Number	10	
Level	สถานะของระดับการติดตามบริษัทสมาชิก	Text	10	

ตาราง 21 แสดงคำอธิบายข้อมูลของตารางข้อมูลบริษัทสมาชิก

ชื่อตัวแปร	ชนิดเลข	คำอธิบาย
Order No	Number	เลขที่ของบริษัทยุติการ : กรณีที่มีค่าเป็น 0 จะมีค่าของค่าเฉลี่ยของทุกบริษัทในเดือนนั้น ๆ
B_Month	Number	เดือน
B_Year	Number	ปี
NCR	Number	อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ : กรณีที่มีค่าเป็น 0 จะมีค่าของค่าเฉลี่ยของทุกบริษัทในเดือนนั้น ๆ
Equity	Number	ส่วนของผู้ถือหุ้น : กรณีที่มีค่าเป็น 0 จะมีค่าของค่าเฉลี่ยของทุกบริษัทในเดือนนั้น ๆ
MM_0	Number	ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้ออสังหาริมทรัพย์ที่มีหลักประกัน ไม่คุ้มครอง : กรณีที่มีค่าเป็น 0 จะมีค่าของค่าเฉลี่ยของทุกบริษัท
MM_0_Equity	Number	อัตราส่วนลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้ออสังหาริมทรัพย์ที่มีหลักประกัน ไม่คุ้มครองต่อส่วนของผู้ถือหุ้น : กรณีที่มีค่าเป็น 0
Force Sales	Number	ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย(Force Sell)
Margin	Number	ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้ออสังหาริมทรัพย์
Force Sales_Margin	Number	อัตราส่วนลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย(Force Sell) ต่อ ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้ออสังหาริมทรัพย์
Overdue	Number	ลูกหนี้เงินสดที่พ้นกำหนดชำระ(Overdue)
Cash	Number	ลูกหนี้เงินสด
Overdue_Cash	Number	อัตราส่วนลูกหนี้เงินสดที่พ้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้เงินสด
Pgrt	Number	เงินลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ : กรณีที่มีค่าเป็น 0 จะมีค่าของค่าเฉลี่ยของทุกบริษัทในเดือนนั้น ๆ
Allowance	Number	ค่าเผื่อการลดราคาของอสังหาริมทรัพย์(Allowance)
Allowance Increase	Number	อัตราส่วนการเพิ่มขึ้น/ลดลงของค่าเผื่อการลดราคาของอสังหาริมทรัพย์ (Allowance) เมื่อเทียบกับเดือนก่อน
Profit(Loss) Net	Number	ผลกำไรขาดทุนรายเดือน
Profit(Loss) Total	Number	ผลกำไรขาดทุนรวมทั้งตั้งแต่ต้นปีถึงเดือนปัจจุบัน : กรณีที่มีค่าเป็น 0 จะมีค่าของค่าเฉลี่ยของทุกบริษัทในเดือนนั้น
Debt	Number	หนี้สินรวม
DERatio	Number	อัตราส่วนหนี้สินต่อทุน : กรณีที่มีค่าเป็น 0 จะมีค่าของค่าเฉลี่ยของทุกบริษัทในเดือนนั้น ๆ
DERatio High Industry	Number	อัตราส่วนของอัตราส่วนหนี้สินต่อทุนที่สูงหรือต่ำกว่าค่าเฉลี่ย
DERatio Increase	Number	อัตราส่วนของอัตราส่วนหนี้สินต่อทุนที่สูงขึ้นหรือต่ำลง
Grade NCR	Text	เกรดของอัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
Grade MM_0_Equity	Text	เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้ออสังหาริมทรัพย์ที่มีหลักประกัน ไม่คุ้มครองต่อส่วนของผู้ถือหุ้น
Grade Force Sales_Margin	Text	เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย(Force Sell) ต่อ ลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้ออสังหาริมทรัพย์
Grade Overdue_Cash	Text	เกรดของอัตราส่วนลูกหนี้เงินสดที่พ้นกำหนดชำระต่อลูกหนี้เงินสด
Grade Allowance Increase	Text	เกรดของอัตราส่วนการเพิ่มขึ้น/ลดลงของค่าเผื่อการลดราคาของอสังหาริมทรัพย์ (Allowance) เมื่อเทียบกับเดือนก่อน
Grade Profit(Loss) Net	Text	เกรดของผลกำไร(ขาดทุน)ในแต่ละเดือน
Grade Profit(Loss) Total	Text	เกรดของผลกำไร(ขาดทุน)รวมทั้งตั้งแต่ต้นปี
Grade DERatio High Industry	Text	เกรดของD/E Ratio ที่มีค่าสูง/ต่ำกว่าค่าเฉลี่ยของอุตสาหกรรม
Grade DERatio Increase	Text	เกรดของD/E Ratio ที่มีค่าเพิ่ม/ลดลงจากเดือนก่อน
Grade Equity	Text	เกรดของส่วนของผู้ถือหุ้น
Score	Number	คะแนนของการประเมินผล
Level	Text	สถานะของระดับการติดตามบริษัทสมาชิก

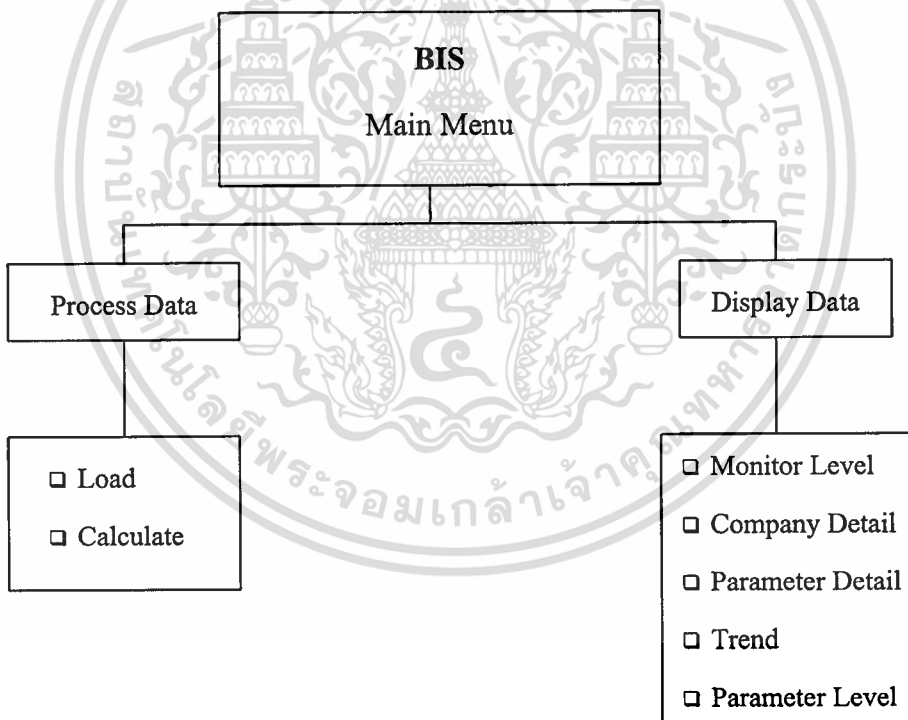
รูปที่ 10 แสดงคำอธิบายข้อมูลของตารางข้อมูลบริษัทสมาชิก

## บทที่ 5

### การพัฒนาโปรแกรม

#### 5.1 การแสดงภาพรวมของโปรแกรม

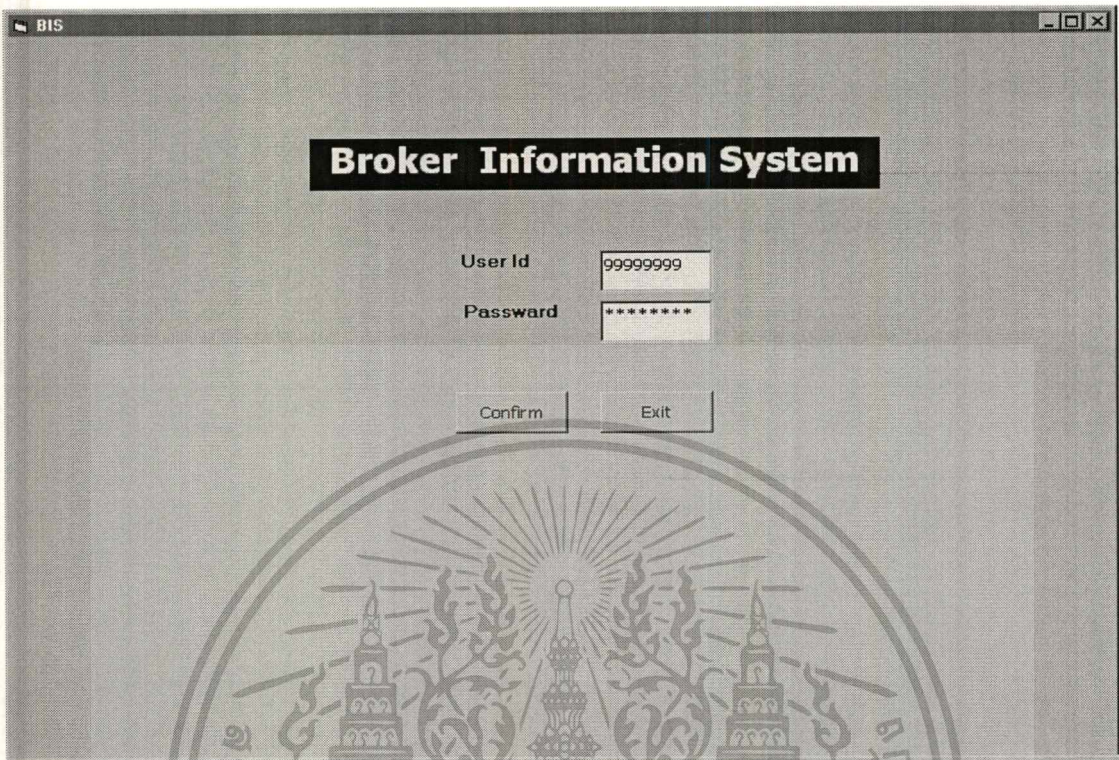
ภาพรวมของระบบการประเมินผลฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก (Broker Information System – BIS ) มีรายละเอียดของฟังก์ชันการทำงานดังรูปที่ 11



รูปที่ 11 แสดงภาพรวมของฟังก์ชันการทำงานของระบบ BIS

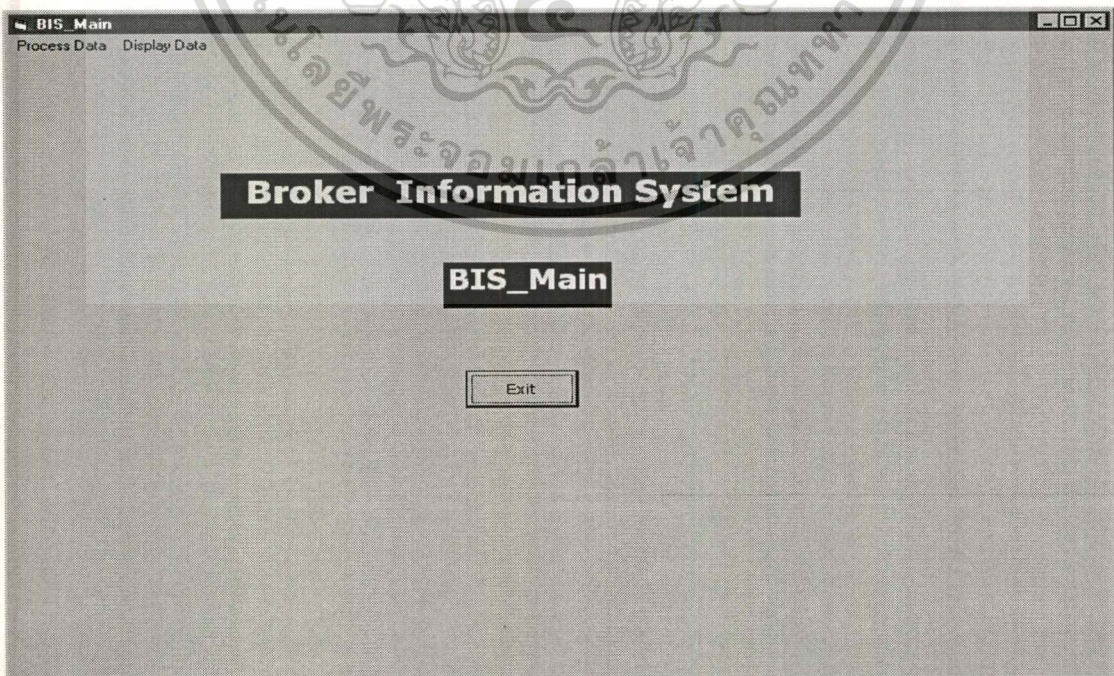
#### 5.2 รูปแบบการทำงานของระบบ

หน้าจอแรกก่อนเข้าสู่ระบบ BIS ผู้ที่จะเข้าไปเรียกใช้ข้อมูลจากระบบ BIS จะต้องระบุ User Id และ Password เพื่อขอเข้าสู่ระบบ BIS ดังแสดงรายละเอียดตามรูปที่ 12



รูปที่ 12 แสดงรายละเอียดหน้าจอแรกก่อนเข้าสู่ระบบ BIS

เมื่อผู้ใช้ระบุ User Id และ Password ได้ถูกต้องแล้วจะเข้าสู่หน้าจอการทำงานหลักของระบบ BIS ซึ่งประกอบด้วย Menu 2 ประเภท คือ Process Data กับ Display Data ดังแสดงในรูปที่ 13

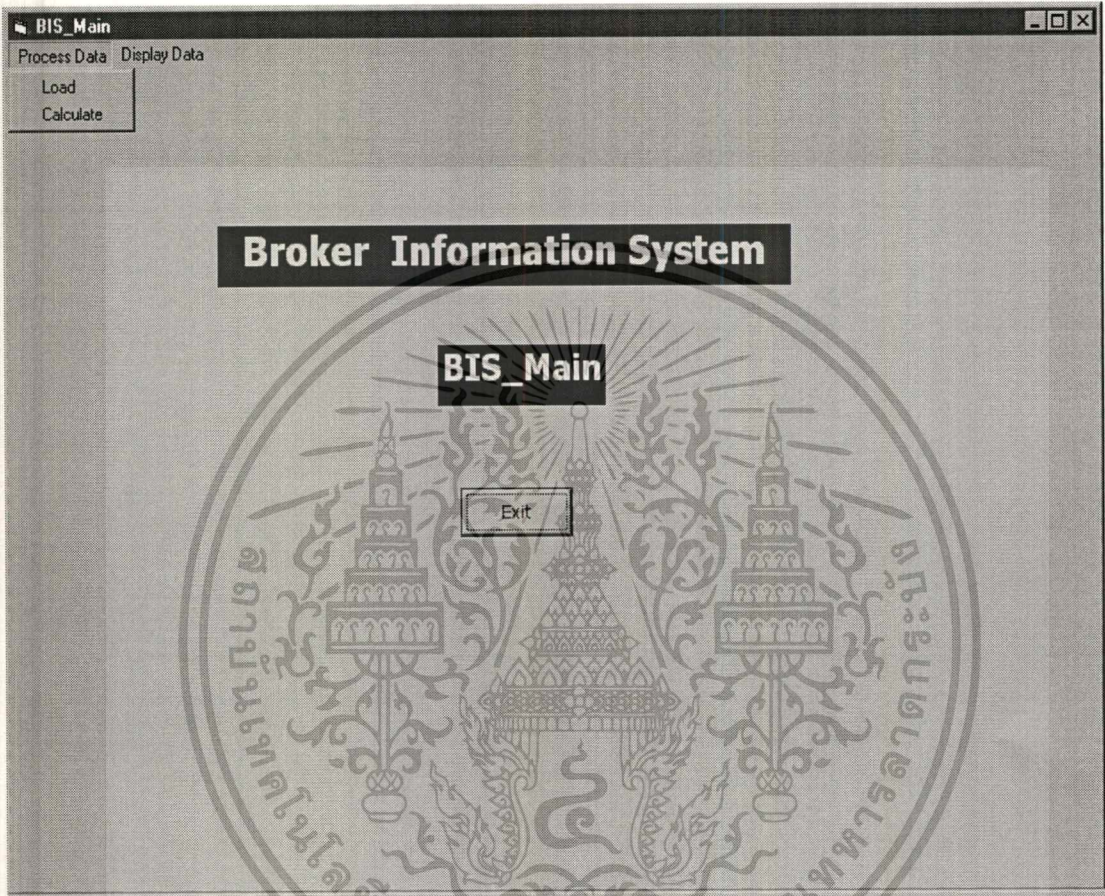


รูปที่ 13 แสดงรายละเอียดหน้าจอหลักของระบบ BIS

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

ในส่วนของรายละเอียดของ Menu ของ Process Data จะประกอบด้วยฟังก์ชันการทำงาน 2 ประเภท คือ Load กับ Calculate ดังแสดงตามรูปที่ 14



รูปที่ 14 แสดงรายละเอียด Menu Process Data ของระบบ BIS

ฟังก์ชัน Load จะเป็นการทำงานในขั้นตอนของการดึงข้อมูลบริษัทสมาชิกจากฐานข้อมูลของระบบ BRS ที่จัดเก็บอยู่ในรูปแบบของ Text file เข้าสู่ฐานข้อมูลของระบบ BIS และเมื่อเสร็จสิ้นขั้นตอนนี้แล้วจึงจะสามารถทำในขั้นตอนของฟังก์ชัน Calculate ได้ต่อไป ซึ่งขั้นตอนทั้ง 2 ฟังก์ชันใน Menu จะเป็นการทำงานทุก ๆ สัปดาห์

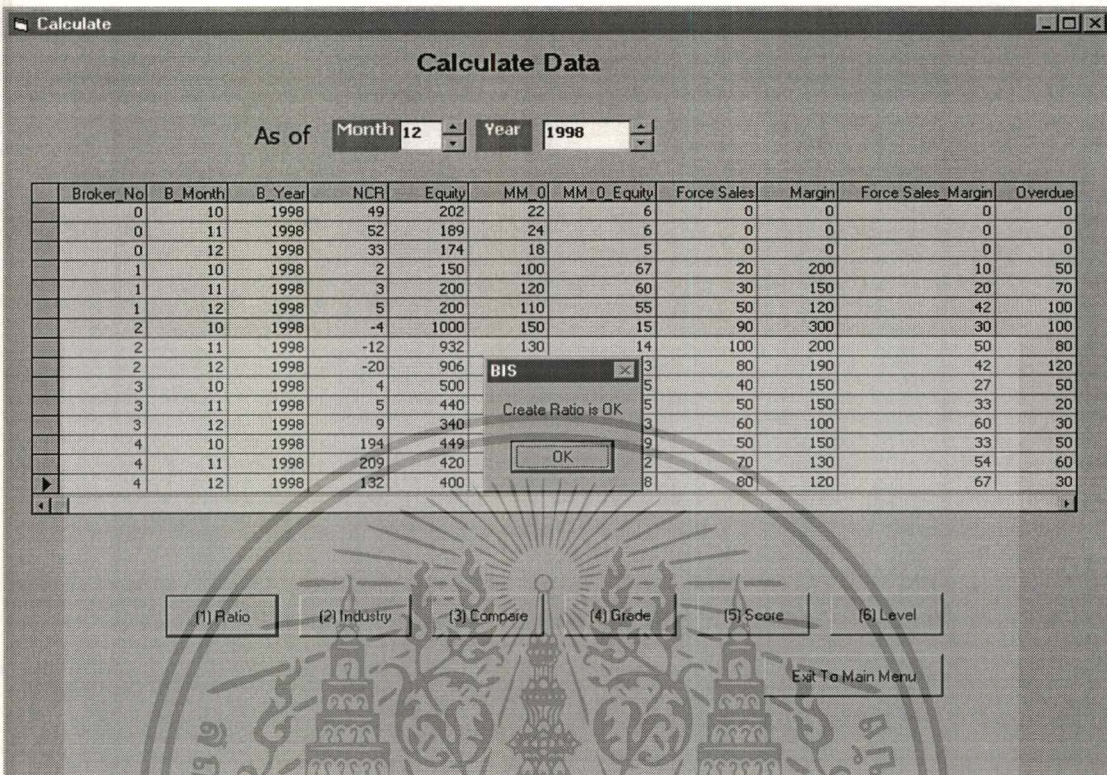
สำหรับฟังก์ชัน Calculate จะเป็นการนำข้อมูลที่ได้รับมาคำนวณเพื่อให้ได้ข้อมูลตามที่ระบบต้องการใช้งาน ซึ่งประกอบด้วยฟังก์ชันการทำงานย่อยอีก 6 ขั้นตอน ดังนี้

1. Ratio คือ ขั้นตอนในการคำนวณหาค่าของอัตราส่วนของข้อมูล
2. Industry คือ ขั้นตอนในการคำนวณหาค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรมของแต่ละเดือน
3. Compare คือ ขั้นตอนในการหาค่าเปลี่ยนแปลงหรือ การเปรียบเทียบกับค่าอุตสาหกรรม
4. Grade คือ ขั้นตอนในการนำข้อมูลมาเปรียบเทียบว่าอยู่ในระดับเกรดใด
5. Score คือ ขั้นตอนในการรวมคะแนนที่แต่ละบริษัทถูกหักว่ามีค่าเท่าใด
6. Level คือ ขั้นตอนในการเปรียบเทียบว่าแต่ละบริษัทมีสถานะอยู่ในระดับใด

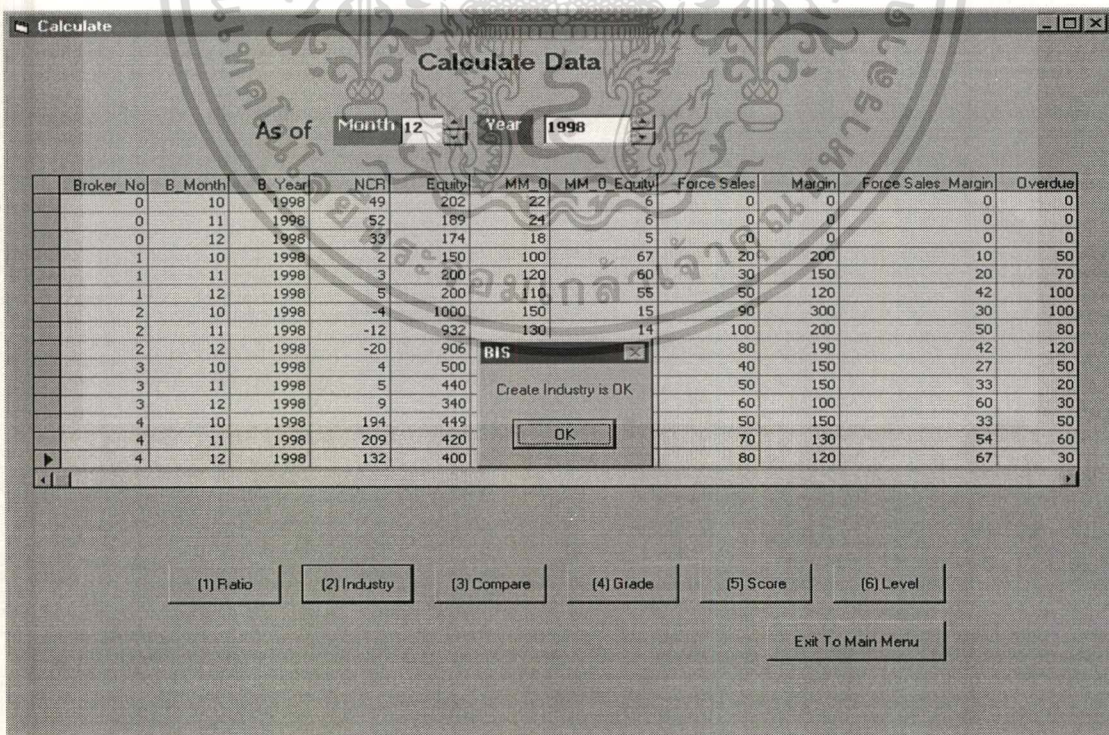
โดยในแต่ละหน้าจอถ้าหากมีการเลือกช่วงของข้อมูลที่ไม่มีปรากฏอยู่ในฐานข้อมูลจะมีข้อความว่า “Error” ขึ้นมาเตือนทุก ๆ หน้าจอ และเมื่อระบบทำงานเรียบร้อยแล้ว จะมีข้อความขึ้นมาบอกว่าระบบทำงานเรียบร้อยแล้ว ซึ่งตัวอย่างของหน้าจอการทำงานแต่ขั้นตอนปรากฏรายละเอียดตามรูปที่ 15-21

Broker No	B Month	B Year	NCR	Equity	MM 0	MM 0 Equity	Force Sales
0	10	1998	49	202	22	6	0
0	11	1998	52	189	24	6	0
0	12	1998	33	174	18	5	0
1	10	1998	2	150	100	67	20
1	11	1998			120	60	30
1	12	1998			110	55	50
2	10	1998			150	15	90
2	11	1998			130	14	100
2	12	1998			120	13	80
3	10	1998			25	5	40
3	11	1998			20	5	50
3	12	1998	9	340	10	3	60
4	10	1998	194	449	40	9	50
4	11	1998	209	420	50	12	70
4	12	1998	132	400	30	8	80

รูปที่ 15 แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Load ของระบบ BIS



รูปที่ 16 แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Ratio ของระบบ BIS



รูปที่ 17 แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Industry ของระบบ BIS

Calculate

### Calculate Data

As of Month **12** Year **1998**

Broker_No	B_Month	B_Year	NCR	Equity	MM_0	MM_0 Equity	Force Sales	Margin	Force Sales Margin	Overdue
0	10	1998	49	202	22	6	0	0	0	0
0	11	1998	52	189	24	6	0	0	0	0
0	12	1998	33	174	18	5	0	0	0	0
1	10	1998	2	150	100	67	20	200	10	50
1	11	1998	3	200	120	60	30	150	20	70
1	12	1998	5	200	110	55	50	120	42	100
2	10	1998	-4	1000	150	15	90	300	30	100
2	11	1998	-12	932	130	14	100	200	50	80
2	12	1998	-20	906			80	190	42	120
3	10	1998	4	500			40	150	27	50
3	11	1998	5	440			50	150	33	20
3	12	1998	9	340			60	100	60	30
4	10	1998	194	449			50	150	33	50
4	11	1998	209	420			70	130	54	60
4	12	1998	132	400			80	120	67	30

BIS  
Create Compare is OK  
OK

(1) Ratio (2) Industry (3) Compare (4) Grade (5) Score (6) Level  
Exit To Main Menu

รูปที่ 18 แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Compare ของระบบ BIS

Calculate

### Calculate Data

As of Month **12** Year **1998**

Broker_No	B_Month	B_Year	NCR	Equity	MM_0	MM_0 Equity	Force Sales	Margin	Force Sales Margin	Overdue
0	10	1998	49	202	22	6	0	0	0	0
0	11	1998	52	189	24	6	0	0	0	0
0	12	1998	33	174	18	5	0	0	0	0
1	10	1998	2	150	100	67	20	200	10	50
1	11	1998	3	200	120	60	30	150	20	70
1	12	1998	5	200	110	55	50	120	42	100
2	10	1998	-4	1000	150	15	90	300	30	100
2	11	1998	-12	932	130	14	100	200	50	80
2	12	1998	-20	906			80	190	42	120
3	10	1998	4	500			40	150	27	50
3	11	1998	5	440			50	150	33	20
3	12	1998	9	340			60	100	60	30
4	10	1998	194	449			50	150	33	50
4	11	1998	209	420			70	130	54	60
4	12	1998	132	400			80	120	67	30

BIS  
Create Grade is OK  
OK

(1) Ratio (2) Industry (3) Compare (4) Grade (5) Score (6) Level  
Exit To Main Menu

รูปที่ 19 แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Grade ของระบบ BIS

Calculate

### Calculate Data

As of Month **12** Year **1998**

Broker No	B Month	B Year	NCR	Equity	MM_0	MM_0 Equity	Force Sales	Margin	Force Sales Margin	Overdue
0	10	1998	49	202	22	6	0	0	0	0
0	11	1998	52	189	24	6	0	0	0	0
0	12	1998	33	174	18	5	0	0	0	0
1	10	1998	2	150	100	67	20	200	10	50
1	11	1998	3	200	120	60	30	150	20	70
1	12	1998	5	200	110	55	50	120	42	100
2	10	1998	-4	1000	150	15	90	300	30	100
2	11	1998	-12	932	130	14	100	200	50	80
2	12	1998	-20	906	906	14	80	190	42	120
3	10	1998	4	500	500	5	40	150	27	50
3	11	1998	5	440	440	5	50	150	33	20
3	12	1998	9	340	340	3	60	100	60	30
4	10	1998	194	449	449	9	50	150	33	50
4	11	1998	209	420	420	2	70	130	54	60
4	12	1998	132	400	400	8	80	120	67	30

BIS  
Create Score is OK  
OK

(1) Ratio (2) Industry (3) Compare (4) Grade (5) Score (6) Level  
Exit To Main Menu

รูปที่ 20 แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Score ของระบบ BIS

Calculate

### Calculate Data

As of Month **12** Year **1998**

Broker No	B Month	B Year	NCR	Equity	MM_0	MM_0 Equity	Force Sales	Margin	Force Sales Margin	Overdue
0	10	1998	49	202	22	6	0	0	0	0
0	11	1998	52	189	24	6	0	0	0	0
0	12	1998	33	174	18	5	0	0	0	0
1	10	1998	2	150	100	67	20	200	10	50
1	11	1998	3	200	120	60	30	150	20	70
1	12	1998	5	200	110	55	50	120	42	100
2	10	1998	-4	1000	150	15	90	300	30	100
2	11	1998	-12	932	130	14	100	200	50	80
2	12	1998	-20	906	906	14	80	190	42	120
3	10	1998	4	500	500	5	40	150	27	50
3	11	1998	5	440	440	5	50	150	33	20
3	12	1998	9	340	340	3	60	100	60	30
4	10	1998	194	449	449	9	50	150	33	50
4	11	1998	209	420	420	2	70	130	54	60
4	12	1998	132	400	400	8	80	120	67	30

BIS  
Create Level is OK  
OK

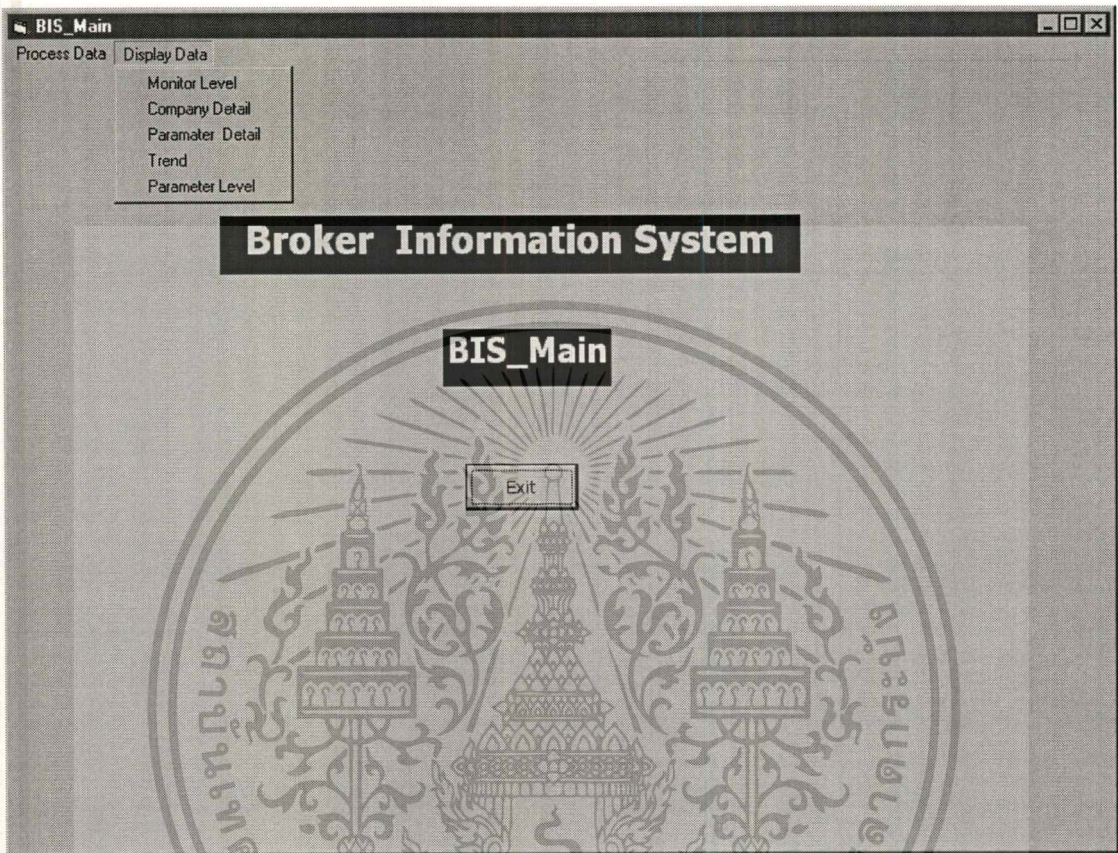
(1) Ratio (2) Industry (3) Compare (4) Grade (5) Score (6) Level  
Exit To Main Menu

รูปที่ 21 แสดงรายละเอียดการทำงานในขั้นตอน Level ของระบบ BIS

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

สำหรับรายละเอียดของ Menu ของ Display นั้นประกอบด้วยฟังก์ชันการทำงานของการเรียกดูข้อมูล ซึ่งแบ่งเป็น 5 รูปแบบ ดังแสดงตามรูปที่ 22 ดังนี้



รูปที่ 22 แสดงรายละเอียด Menu Display Data ของระบบ BIS

สำหรับฟังก์ชันย่อยที่อยู่ใน Menu Display นี้ ประกอบด้วยฟังก์ชันการทำงานต่าง ๆ ดังนี้

1. Monitor Level      แสดงข้อมูลของระดับการติดตามบริษัทสมาชิกแยกเป็นแต่ละระดับ
2. Company Detail    แสดงข้อมูลสำคัญเกี่ยวกับฐานะการเงินและผลการดำเนินการรายบริษัท
3. Parameter Detail    แสดงข้อมูลของระดับการเตือนของบริษัทสมาชิกในแต่ละเรื่องที่ใช้เป็น Parameter
4. Trend                แสดงข้อมูลแนวโน้มของค่า Parameter และ สถานะของแต่ละบริษัท
5. Parameter Level    แสดงข้อมูลของจำนวน และ รายชื่อของบริษัทในแต่ละระดับของ Parameter

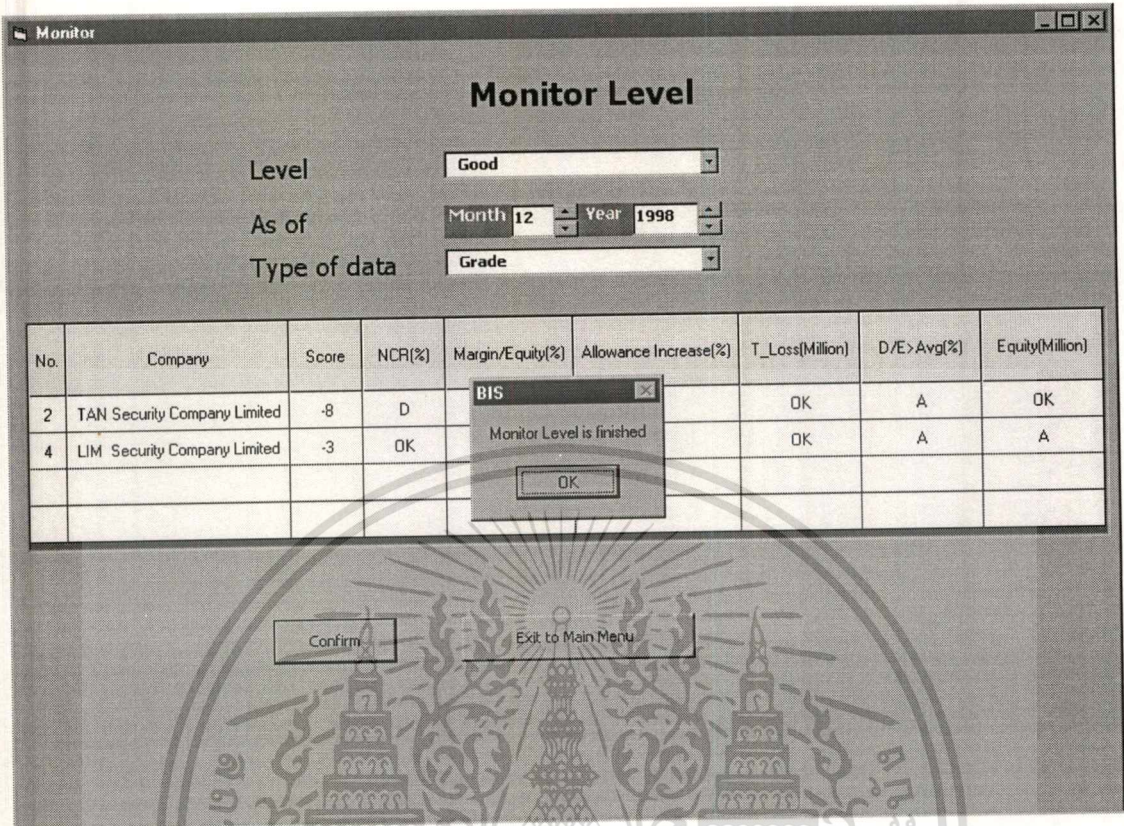
1. Monitor Level คือ แสดงระดับการติดตามบริษัทสมาชิกเรื่องฐานะการเงินและผลการดำเนินงาน แสดงรายชื่อบริษัทสมาชิก โดยสามารถเลือกดูได้ในแต่ละระดับของการติดตาม ตามที่กำหนด โดยจะเป็นหน้าจอที่แสดงค่าของ Parameter ที่สำคัญ รวมทั้งคะแนนที่ถูกหัก โดยรายละเอียดของหน้าจอเพื่อใช้กำหนดเงื่อนไขการดูข้อมูลเกี่ยวกับระดับการติดตามประกอบด้วย

- ช่องระดับการติดตาม เป็นการกำหนดเงื่อนไขว่าต้องการดูรายชื่อบริษัทที่อยู่ในระดับการติดตามประเภทใด
- ช่อง As of เป็นการกำหนดเงื่อนไขว่าต้องการดูข้อมูล ณ เมื่อใด
- ช่องประเภทของข้อมูล เป็นการกำหนดเงื่อนไขว่าต้องการดูข้อมูลเป็นตัวเลขหรือเกรด
- ปุ่ม Confirm กดเมื่อกำหนดเงื่อนไขเสร็จแล้ว ระบบจะแสดงหน้าจอตามเงื่อนไขที่กำหนด

ซึ่งตัวอย่างของการแสดงผลของหน้าจอในรูปแบบของตัวเลข และเกรดแสดงในรูปที่ 23 และ 24 ตามลำดับดังนี้

No.	Company	Score	NCR(%)	Margin/Equity(%)	Allowance Increase(%)	T_Loss(Million)	D/E>Avg(%)	Equity(Million)
2	TAN Security Company Limited	-8	-20	20	20	210	34	906
4	LIM Security Company Limited	-3	132	10	10	90	43	400

รูปที่ 23 แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลระดับการติดตาม (Monitor Level) ในรูปแบบตัวเลข



รูปที่ 24 แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลระดับการติดตาม (Monitor Level) ในรูปแบบเกรด

แสดงค่าในรายการต่างๆของฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิกบริษัทแต่ละรายในแต่ละเดือน เปรียบเทียบกับค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรมในเดือนนั้น ๆ รวมทั้งยังสามารถเรียกดูข้อมูลความเห็นของเจ้าหน้าที่วิเคราะห์เกี่ยวกับบริษัท และเจ้าหน้าที่วิเคราะห์สามารถเพิ่มเติมหรือเปลี่ยนแปลงความคิดเห็นได้ลงไปในฐานข้อมูลได้ด้วย

หน้าจอแสดงเงื่อนไขการดูข้อมูลของแต่ละบริษัท ประกอบด้วย

- ช่อง Company เป็นการกำหนดว่าต้องการเลือกดูบริษัทสมาชิกใด
  - ช่อง As of เป็นการกำหนดเงื่อนไขว่าต้องการดูข้อมูล ณ เมื่อใด
- เมื่อกำหนดขอบเขตของข้อมูลที่ต้องการเรียบร้อยแล้วให้กดปุ่มเพื่อเลือกประเภทของการใช้งานโดยที่
- ปุ่ม Company Data เป็นการเลือกดูข้อมูลของบริษัท รายละเอียดปรากฏตามรูปที่ 25
  - ปุ่ม Comment เป็นการเลือกดูข้อมูลความเห็นเจ้าหน้าที่วิเคราะห์รายละเอียดปรากฏตามภาพที่ 26

Company Detail

Company No. 1 OK Name SUN Security Company Limited As of Month 12 Year 1998

Company Data Comment Update

Topic	Company Data	Industry
NCR(%)	5	33
MM<0		
- Amount(Million)	110	
- %:Equity	55	
Port(Million)	130	
D/E Ratio	110	32
Total P/L(Million)	-470	1
Equity(Million)	200	174

BIS  
Company data is finished  
OK

Exit to Main Menu

รูปที่ 25 แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลของบริษัทสมาชิก

Company Detail

Company No. 1 OK Name SUN Security Company Limited As of Month 12 Year 1998

Company Data Comment Update

This company is not bad but should be always concern.  
We should to be monitor this company very much.

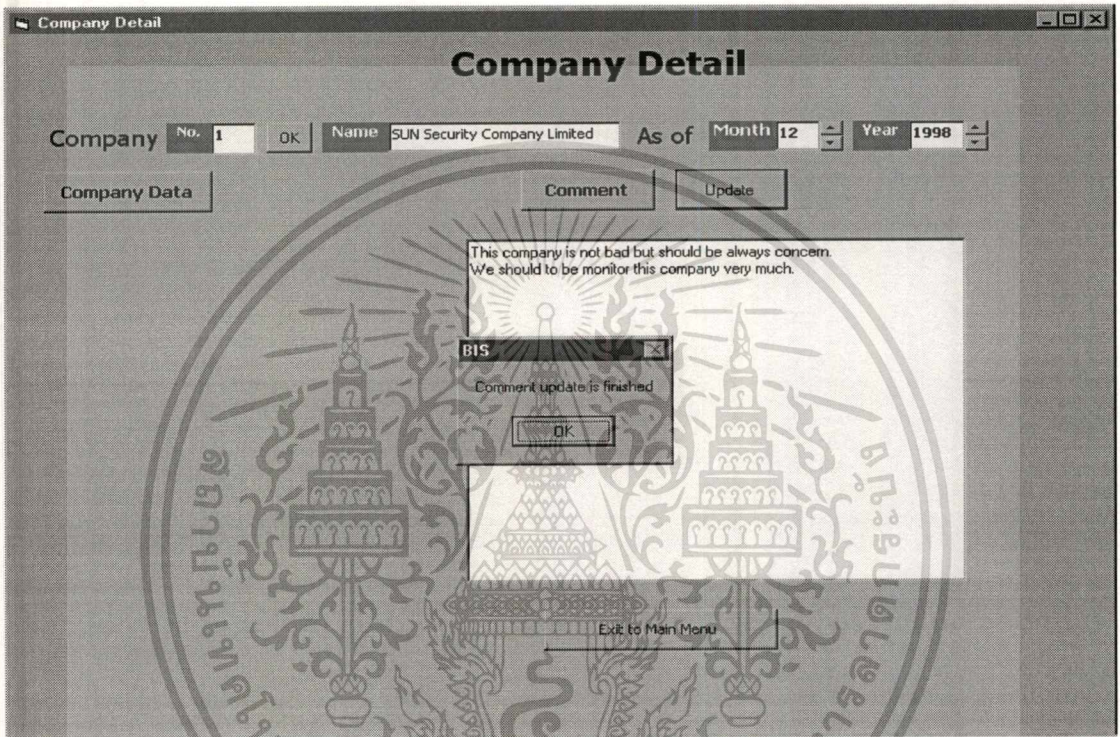
BIS  
Comment  
OK

Exit to Main Menu

This material is provided for personal and non-commercial use.

รูปที่ 26 แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลความเห็นของเจ้าหน้าที่วิเคราะห์  
Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

เมื่อเจ้าหน้าที่วิเคราะห์ต้องการการเปลี่ยนแปลงความเห็นให้กดปุ่ม Comment เพื่อเรียกข้อมูลความเห็นขึ้นมาเพื่อทำการเปลี่ยนแปลง และเมื่อเปลี่ยนแปลงเรียบร้อยแล้วให้กดปุ่ม Confirm เพื่อยืนยันข้อมูลที่ป้อนเข้าสู่ระบบ ข้อมูล Comment ในฐานข้อมูลก็จะถูกเปลี่ยนแปลงไป รายละเอียดดังรูปที่ 27

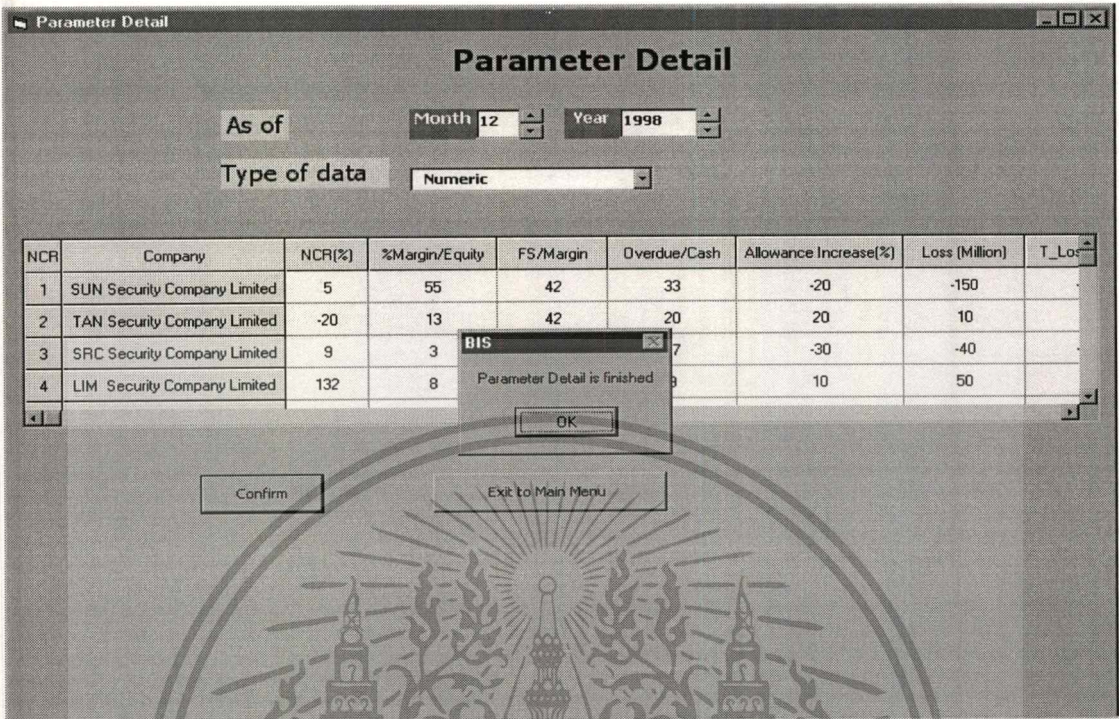


รูปที่ 27 แสดงหน้าจอการเปลี่ยนแปลงข้อมูลความเห็นของเจ้าหน้าที่วิเคราะห์

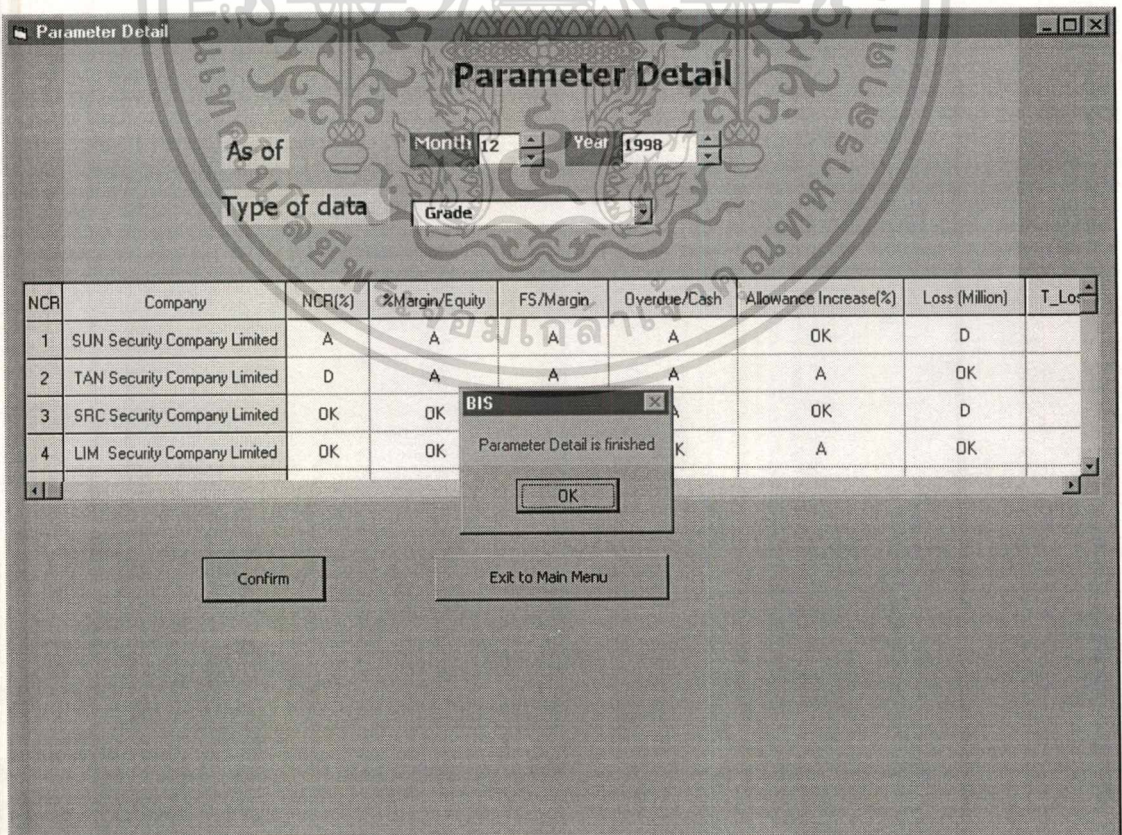
1. Parameter Detail คือ ข้อมูลของระดับการเตือนของบริษัทสมาชิกในแต่ละเรื่องที่ใช้เป็น Parameter

หน้าจอแสดงเงื่อนไขการดูข้อมูลของ Parameter ประกอบด้วย

- ช่อง As of เป็นการกำหนดเงื่อนไขว่าต้องการดูข้อมูล ณ เมื่อใด
- ช่อง Type of data เป็นการกำหนดประเภทของข้อมูลที่ต้องการเรียกใช้งาน โดยสามารถเรียกดูได้ทั้งแบบตัวเลขและเกรด ดังมีรายละเอียดปรากฏตามรูปที่ 28 และ 29 ตามลำดับ



รูปที่ 28 แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลรายละเอียด(Parameter Detail)ในรูปแบบตัวเลข



รูปที่ 29 แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลรายละเอียด(Parameter Detail)ในรูปแบบเกรด

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

4. Trend คือ ข้อมูลแนวโน้มค่าของ Parameter รายบริษัท เป็นนำเสนอข้อมูลย้อนหลังเกี่ยวกับรายละเอียดของค่า Parameter และระดับการติดตามในแต่ละบริษัท

หน้าจอแสดงเงื่อนไขการดูข้อมูลของแต่ละบริษัท ประกอบด้วย

- ช่อง Company เป็นการกำหนดว่าต้องการเลือกดูบริษัทสมาชิกใด
- ช่อง As of เป็นการกำหนดเงื่อนไขว่าต้องการดูข้อมูล ณ เมื่อใด
- ช่อง Type of data เป็นการกำหนดประเภทของข้อมูลที่ต้องการเรียกใช้งาน ซึ่งสามารถเรียกดูได้ทั้งแบบตัวเลขและเกรด ดังมีรายละเอียดปรากฏตามรูปที่ 30 และ 31 ตามลำดับ

The screenshot shows the 'Trend' application window. At the top, the title is 'Trend'. Below the title, there are input fields for 'Company' (No. 1, Name: SUN Security Company Limited), 'As of' (Month 12, Year 1998), and 'Type of data' (Numeric). The main area contains a table with the following data:

Parameter	1998	1996	1998
RISK	12	11	10
NCR(%)	5	3	2
%MM<0:Equity	55	60	67
Force:Margin	42	20	10
Overdue1:Cash	33	28	25
Allowance Increase(%)	-20	40	0
Performance			
Profit(Loss)/Month(Million)	-150	-120	-100
Profit(Loss)_Acc(Million)	-470	-320	-200
D/E Ratio>Mean(%)	78	70	134
D/E Ratio Increase(%)	10	-67	0
Equity(Million)	200	200	150
Level	Medium	Close	Close

At the bottom of the window, there are buttons for 'Confirm' and 'Exit to Main Menu'. A dialog box is overlaid on the table, displaying 'Data Trend is finished' and an 'OK' button.

รูปที่ 30 แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลแนวโน้ม(Trend)ในรูปแบบตัวเลข

**Trend**

Company No. 1 OK Name SUN Security Company Limited

As of Month 12 Year 1998

Type of data Grade

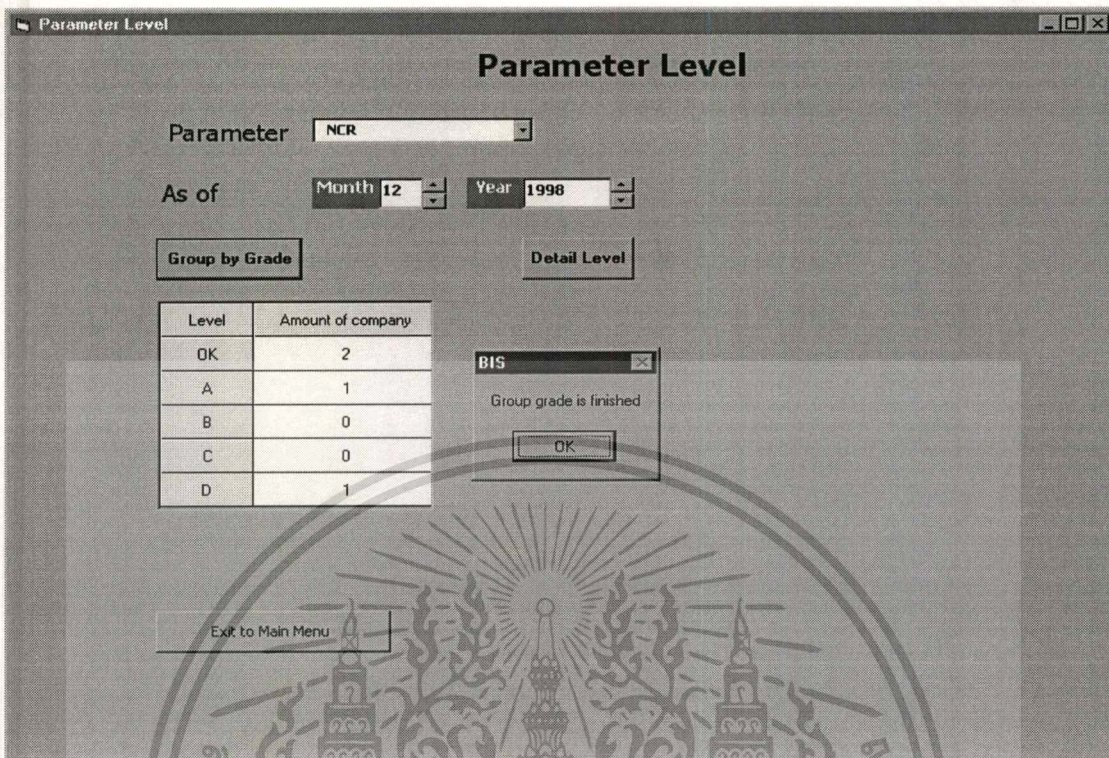
Parameter	1998	1998	1998
	12	11	10
RISK			
NCR(%)	A	C	D
%MM<0:Equity		A	A
Force:Margin		A	A
Overdue1:Cash		A	A
Allowance Increase(%)		A	OK
Performance			
Profit(Loss)/Month(Million)	D	D	D
Profit(Loss)_Acc(Million)	D	D	D
D/E Ratio>Mean(%)	A	A	A
D/E Ratio Increase(%)	A	OK	OK
Equity(Million)	C	C	D
Level	Medium	Close	Close

Confirm Exit to Main Menu

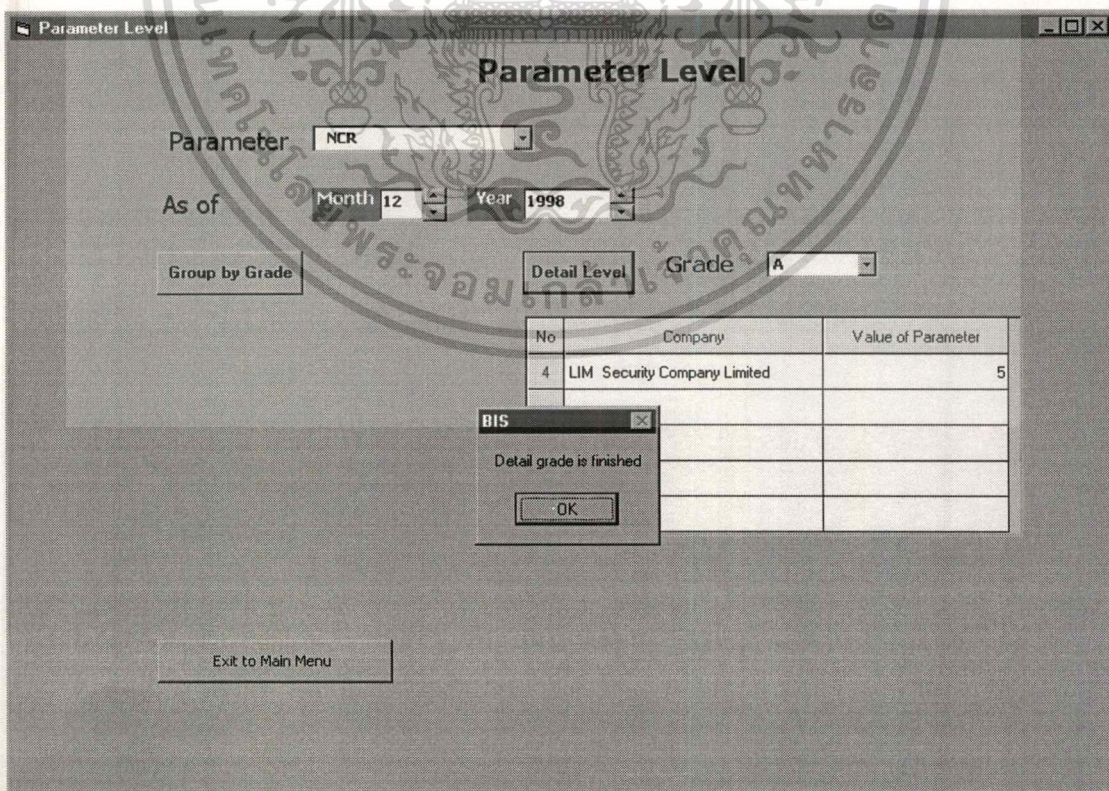
รูปที่ 31 แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลแนวโน้ม(Trend)ในรูปแบบเกรด

5. Parameter Level คือ ข้อมูลของจำนวน และรายชื่อบริษัทในแต่ละระดับของ Parameter หน้าจอแสดงเงื่อนไขการดูข้อมูลของแต่ละบริษัท ประกอบด้วย

- ช่อง Parameter เป็นการกำหนดว่าต้องการเลือกดู Parameter ใด
- ช่อง As of เป็นการกำหนดเงื่อนไขว่าต้องการดูข้อมูล ณ เมื่อใด  
เมื่อกำหนดขอบเขตของข้อมูลที่ต้องการเรียบร้อยแล้วให้กดปุ่มเพื่อเลือกประเภทของการใช้งาน โดยที่
  - ปุ่ม Group by Grade คือ การเรียกดูข้อมูลของของจำนวนบริษัทในแต่ละระดับของ Parameter รายละเอียดปรากฏตามรูปที่ 32
  - ปุ่ม Data Level คือ การเรียกดูรายละเอียดของข้อมูลในแต่ละระดับเกรดของแต่ละ Parameter ว่า ประกอบด้วยสมาชิกรายใดบ้าง รายละเอียดปรากฏตามรูปที่ 33



รูปที่ 32 แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลจำนวนบริษัทในแต่ละระดับของแต่ละParameter



รูปที่ 33 แสดงหน้าจอการเรียกดูข้อมูลรายชื่อของบริษัทในแต่ละระดับเกรดของ Parameter

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

## บทที่ 6

### บทสรุปและข้อเสนอแนะ

#### 6.1 สรุปผลการศึกษา

การพัฒนาระบบประเมินผลฐานะและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก ในโครงการการศึกษากรณีพิเศษนี้ เป็นการศึกษาถึงระบบและขั้นตอนการทำงานจริงซึ่งทำให้เข้าใจระบบและทราบถึงความต้องการของผู้ใช้อย่างแท้จริง ซึ่งสามารถช่วยในการนำระบบสารสนเทศมาปรับใช้ได้เหมาะสม โดยในโครงการการศึกษากรณีพิเศษนี้ในใช้โปรแกรม Microsoft Visual Basic Version 5 มีลักษณะการทำงานที่ง่าย และสะดวกในการใช้งานมาช่วยในการพัฒนาระบบ ซึ่งส่งผลทำให้ระบบการทำงานในส่วนงานวิเคราะห์และติดตามฐานะการเงินและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิก ทำงานได้อย่างมีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น ดังนี้

1. เป็นการช่วยลดขั้นตอนและเวลาในการรวบรวมเอกสารและข้อมูลต่าง ๆ ที่ต้องนำมาใช้ในการประเมินผล เพื่อจัดทำเป็นรายงานนำเสนอต่อผู้บริหาร ได้อย่างถูกต้อง และรวดเร็ว
2. เป็นระบบที่สามารถเรียกค้นหาข้อมูล ซึ่งจะช่วยให้ทราบถึงสถานะของบริษัทสมาชิกได้อย่างถูกต้อง และรวดเร็ว อันจะส่งผลให้สามารถดำเนินการวิเคราะห์และประเมินผลบริษัทสมาชิกได้อย่างมีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น

อย่างไรก็ตาม เนื่องจากการพัฒนาระบบประเมินผลฐานะและผลการดำเนินงานของบริษัทสมาชิกนี้ เป็นการพัฒนาด้วยโปรแกรม Microsoft Visual Basic Version 5 ซึ่งโปรแกรมนีเป็นการพัฒนา ในระดับเบื้องต้นที่เป็นเพียงแนวความคิดซึ่งจะต้องนำไปปรับใช้เมื่อมีการนำไปพัฒนาระบบงานจริง ดังนั้นจึงอาจยังมีความสมบูรณ์ไม่ครบถ้วนนัก เนื่องจากระยะเวลาในการพัฒนาระบบงานมีจำกัด อีกทั้งการใช้ โปรแกรม Microsoft Access Version 7 เป็นฐานข้อมูลนั้นซึ่งสามารถรองรับฐานข้อมูลได้ไม่มากนัก ดังนั้นในการนำไปพัฒนาในระบบงานจริง อาจต้องใช้ Application อื่นซึ่งมีประสิทธิภาพในการทำงานที่สูงกว่ามาใช้แทน รวมทั้งจะต้องทำการปรับปรุงลักษณะการทำงานให้สามารถเชื่อมโยงกับระบบงานอื่น โดยรวมของตลาดหลักทรัพย์ด้วย

#### 6.2 ข้อเสนอแนะ

จากข้อจำกัดดังกล่าวจึงเห็นว่ายังมีอีกหลายส่วนที่สามารถทำการพัฒนาต่อไปได้อีก คือ

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

1. เนื่องจากระบบงานของตลาดหลักทรัพย์กำลังจะมีการเปลี่ยนแปลงให้มีการใช้งานด้วยระบบ Intranet ที่มี Interface เป็นแบบ web มากยิ่งขึ้น ดังนั้นหากมีการนำไปพัฒนาให้มีการใช้งานที่สอดคล้องกับระบบงานโดยรวมแล้วจึงต้องมีการปรับใช้ Application ที่สอดคล้องกับการใช้งานด้วยระบบ web ด้วย
2. จะต้องทำนำข้อมูลก่อนที่จะมีการนำระบบงานนี้มาใช้งานเก็บเข้าไว้ในฐานข้อมูล
3. การต่อเชื่อมระบบเข้ากับข้อมูลของส่วนตรวจสอบเพื่อจะได้นำข้อมูลมาใช้ข้อมูลในการวิเคราะห์และตรวจสอบร่วมกัน

ซึ่งสิ่งเหล่านี้มีความเป็นไปได้ในอนาคตเนื่องจากทางฝ่ายกำกับและตรวจสอบสมาชิกได้ร่วมมือกับฝ่ายคอมพิวเตอร์เพื่อทำการศึกษาเพื่อพัฒนาระบบงานดังกล่าว ดังนั้นจึงมีความเป็นไปได้ในการดำเนิน โครงการนี้เป็นอย่างมาก



## บรรณานุกรม

DATE, C.J. An Introduction to DATABASE SYSTEM. Massachusetts: Addison-Wesley Publishing Company, 1995.

Laudon, Kenneth C. and Laudon, Jane P. . Management Information System. New Jersey: Prentice-Hall, 1996.

Nathan Gurewich and Ori Gurewich. Teach yourself VISUAL BASIC 5 IN 21 DAYS. Indiana:SAMS Publishing, 1997.

กิตติ ภัคดีวัฒนะกุล และ จำลอง ครูอุตสาหะ. Visual Basic ฉบับ โปรแกรมเมอร์. กรุงเทพฯ: ห.จ.ก.ไทยเจริญการพิมพ์, 2541.

คณิตา นามประสิทธิ์ และคณะ. เรื้อง่าย Style Microsoft Access 97 Visual Guide. กรุงเทพฯ: ห.จ.ก. ดี แอล เอส กรุงเทพฯ, 2541.

ดวงแก้ว สวามิภักดิ์. ระบบฐานข้อมูล (Database System). กรุงเทพฯ : ซีเอ็ดดูเคชั่น จำกัด, 2521.



This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

## โครงสร้างของแฟ้มข้อมูล (Format text file ) ของแบบรายงานในระบบ BRS

### 1. แบบ บ.ล. 2 รายงานฐานะการเงิน

File Name : SEC2000.DAT

รหัสรายงาน : M0800

#### Header Record:

รหัสรายงาน	รหัสบริษัท	วันที่รายงาน	ผู้จัดทำ	เบอร์โทร
X(5)	X(3)	yyyymmdd	X(40)	X(20)

#### Detail Record:

หน่วย :บาท

รายการ	ค่า field ที่ 1	ค่า field ที่ 2	ค่า field ที่ 3	ค่า field ที่ 4
9(5)	+9(12)V99	+9(12)V99	+9(12)V99	X(30)

#### ประเภทรายการ

- 010000 = 1. เงินสดและเงินฝากธนาคาร
- 010100 = 1.1 เงินสด
- 010200 = 1.2 เงินฝากในประเทศ
- 010201 = 1.2.1 เงินฝากธนาคาร
- 010202 = 1.2.2 เงินฝากสถาบันการเงิน
- 010300 = 1.3 เงินฝากต่างประเทศ
- 020000 = 2. หลักทรัพย์ซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน
- 030000 = 3. เงินลงทุนในหลักทรัพย์
- 030100 = 3.1 หลักทรัพย์รัฐบาล
- 030101 = 3.1.1 หลักทรัพย์รัฐบาลและรัฐบาลค้ำประกัน
- 030102 = 3.1.2 หลักทรัพย์ขององค์กรของรัฐที่รัฐบาลไม่ได้ค้ำประกัน
- 030200 = 3.2 หลักทรัพย์เอกชน
- 030201 = 3.2.1 หลักทรัพย์จดทะเบียน
- 030202 = 3.2.2 หุ้นกู้
- 030203 = 3.2.3 หลักทรัพย์อื่น
- 030300 = 3.3 รายการปรับมูลค่า
- 030301 = 3.3.1 ดอกเบี้ยและเงินปันผลค้างรับ
- 030302 = 3.3.2 จำนวนกันไว้เพื่อการลดค่าหลักทรัพย์

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

- 030303 = 3.3.3 อื่น ๆ
- 040000 = 4. ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์
- 040100 = 4.1 ชื่อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง
- 040200 = 4.2 เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์
- 040300 = 4.3 บัญชีระหว่างบริษัทหลักทรัพย์
- 040400 = 4.4 อื่น ๆ
- 040500 = 4.5 บวก ดอกเบี้ยค้างรับ
- 040600 = 4.6 หัก จำนวนกันไว้เพื่อหนี้สงสัยจะสูญ
- 050000 = 5. ที่ดิน อาคาร และอุปกรณ์
- 050100 = 5.1 ที่ดิน อาคาร
- 050200 = 5.2 สิทธิการเช่าที่ดินและอาคาร
- 050300 = 5.3 อุปกรณ์
- 060000 = 6. สินทรัพย์อื่น
- 060100 = 6.1 รายได้ค้างรับ
- 060200 = 6.2 ค่าใช้จ่ายล่วงหน้า
- 060300 = 6.3 รายจ่ายรอการตัดบัญชี
- 060400 = 6.4 อื่น ๆ (ระบุ)
- 060401 = 6.4.1 ..... (ระบุใน field ที่ 4)
- 060402 = 6.4.2 .....
- 060403 = 6.4.3 .....
- 060404 = 6.4.4 .....
- 060405 = 6.4.5 .....
- 069999 = รวมสินทรัพย์ (ข้อ 1 ถึง 6)
- 070000 = 7. เงินกู้ยืม
- 070100 = 7.1 จากสถาบันการเงินในประเทศ
- 070101 = 7.1.1 ธนาคารพาณิชย์
- 070102 = 7.1.2 สถาบันการเงินอื่น
- 070200 = 7.2 จากต่างประเทศ
- 080000 = 8. หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืน
- 090000 = 9. เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์

090100 =	9.1 ขยายหลักทรัพย์ตามคำสั่ง
090200 =	9.2 บัญชีลูกค้า
090300 =	9.3 บัญชีระหว่างบริษัทหลักทรัพย์
100000 =	10. หนี้สินอื่น
100100 =	10.1 ดอกเบี้ยค้างจ่าย
100200 =	10.2 ภาษีและค่าใช้จ่ายค้างจ่าย
100300 =	10.3 เงินทุนเลี้ยงชีพและบำเหน็จ
100400 =	10.4 อื่น ๆ (ระบุ)
100401 =	10.4.1 .....(ระบุใน field ที่ 4)
100402 =	10.4.2 .....
100403 =	10.4.3 .....
100404 =	10.4.4 .....
100405 =	10.4.5 .....
110000 =	11. ส่วนของผู้ถือหุ้น
110100 =	11.1 หุ้นสามัญ
110200 =	11.2 หุ้นบุริมสิทธิ
110300 =	11.3 ส่วนด้ามูลค่าหุ้น
110400 =	11.4 ทุนสำรอง
110500 =	11.5 เงินสำรองที่ได้จัดสรรจากกำไรสุทธิ
110600 =	11.6 กำไรสุทธิคงเหลือหลังจากการจัดสรร
110700 =	11.7 กำไรสุทธิงวดการบัญชีก่อนซึ่งยังไม่จัดสรร
110800 =	11.8 กำไรสุทธิระหว่างกิจการบัญชี
110900 =	11.9 รายการอื่น
119999 =	รวมหนี้สินและส่วนของผู้ถือหุ้น (ข้อ 7 ถึง 11)
120000 =	1. สินทรัพย์ที่มีภาระผูกพัน
120100 =	1.1 อสังหาริมทรัพย์
120200 =	1.2 เงินฝากประจำ
120300 =	1.3 อื่น ๆ

130000 = 2. อื่น ๆ (ระบุ)

130100 = 2.1 ..... (ระบุใน field ที่ 4)

130200 = 2.2 .....

130300 = 2.3 .....

139999 =รวมรายการตรงข้ามหนี้สินที่อาจเกิดขึ้นทรัพย์สินที่มีภาระผูกพันและภาระผูกพันอื่นๆ

## 2. แบบ บ.ล. 2 /รายงานรายได้และค่าใช้จ่าย

File Name : SEC2100.DAT

รหัสรายงาน : M0900

### Header Record:

รหัสรายงาน	รหัสบริษัท	วันที่รายงาน	ผู้จัดทำ	เบอร์โทร
X(5)	X(3)	yyyymmdd	X(40)	X(20)

### Detail Record:

รายการ	ค่า field ที่ 1	ค่า field ที่ 2	ค่า field ที่ 3	ค่า field ที่ 4
9(6)	+9(12)V99	+9(12)V99	+9(12)V99	X(30)

### ประเภทรายการ

010000 = 1.รายได้ธุรกิจหลักทรัพย์

010100 = 1.1 ค่านายหน้า

010200 = 1.2 กำไร(ขาดทุน)จากการซื้อขายหลักทรัพย์

010300 = 1.3 รายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ

020000 = 2. ค่าใช้จ่ายธุรกิจหลักทรัพย์

020100 = 2.1 ดอกเบี้ยเงินให้กู้ยืม

020200 = 2.2 ค่านายหน้าและค่าธรรมเนียม

030000 = 3. ค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญ

040000 = 4. ค่าใช้จ่ายดำเนินงาน

040100 = 4.1 ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับพนักงาน

040200 = 4.2 ค่าโฆษณาและส่งเสริมกิจการ

040300 = 4.3 ค่าเช่า

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

- 040400 = 4.4 ค่าเสื่อมราคา  
 040500 = 4.5 ค่าใช้จ่ายดำเนินงานอื่น  
 050000 = 5. รายได้(ค่าใช้จ่าย)อื่น  
 060000 = 6. กำไร (ขาดทุน)ก่อนค่าภาษีเงินได้และรายการพิเศษ  
 070000 = 7. ค่าภาษีเงินได้  
 080000 = 8. รายการพิเศษ  
 090000 = 9. กำไร(ขาดทุน)สุทธิ

### 3. แบบ บ.ล. 4/1 แบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

3.1 File Name : SEC4101.DAT

รหัสรายงาน : M1301 (เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ , การปรับค่าความเสี่ยง และการคำนวณความเพียงพอของเงินกองทุนของ บหลิม.)

Header Record:

รหัสรายงาน	รหัสบริษัท	วันที่รายงาน	ผู้จัดทำ	เบอร์โทร
X(5)	X(3)	yyyymmdd	X(40)	X(20)

Detail Record:

หน่วย :บาท

รายการ	ค่า field ที่ 1	ค่า field ที่ 2	ค่า field ที่ 3	ค่า field ที่ 4	ค่า field ที่ 5
9(8)	+9(12)V99	+9(12)V99	+9(12)V99	+9(12)V99	+9(12)V99

ประเภทรายการ

- 01000000 = 1. เงินสดและเงินฝากธนาคาร  
 02000000 = 2. ตัวสัญญาใช้เงินและตัวแลกเงินที่ออกโดยสถาบันการเงิน  
 02010000 = 2.1 สถาบันการเงินทั่วไป  
 02020000 = 2.2 สถาบันการเงินที่ถูกระงับกิจการ  
 02020100 = 2.2.1 P/N B/E ที่เปลี่ยนไม่ได้  
 02020200 = 2.2.2 P/N B/E ที่เปลี่ยนได้  
 03000000 = 3. เงินลงทุนในหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน  
 03010000 = 3.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงค้ำนี้  
 03020000 = 3.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่ค้ำนี้

- 04000000 = 4. เงินลงทุน
- 05000000 = 5. ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์
- 05010000 = 5.1 ลูกหนี้ซื้อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง
- 05010100 = 5.1.1 ลูกหนี้ยังไม่พ้นกำหนดชำระ
- 05010200 = 5.1.2 ลูกหนี้พ้นกำหนดชำระภายใน 30 วัน
- 05010201 = 5.1.2.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคຸ້ມหนี้
- 05010202 = 5.1.2.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คຸ້ມหนี้
- 05010300 = 5.1.3 ลูกหนี้พ้นกำหนดมากกว่า 30 วัน
- 05020000 = 5.2 ลูกหนี้บัญชีการค้า
- 05020100 = 5.2.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคຸ້ມหนี้
- 05020200 = 5.2.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คຸ້ມหนี้
- 05030000 = 5.3 ลูกหนี้ยืมหลักทรัพย์ (สถาบัน)
- 05030100 = 5.3.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคຸ້ມหนี้
- 05030200 = 5.3.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คຸ້ມหนี้
- 05040000 = 5.4 ลูกหนี้อื่น
- 05050000 = 5.5 บัญชีระหว่างบริษัทกับศูนย์รับฝากหลักทรัพย์
- 06000000 = 6. ลูกหนี้ทรัพย์สินวางประกัน
- 06010000 = 6.1 กรณีปกติ
- 06020000 = 6.2 กรณีวางหลักประกันไว้เกิน
- 07000000 = 7. ความเสี่ยง : จากการกระจุกตัวของลูกหนี้การค้า
- 08000000 = 8. ความเสี่ยง : จากการมีหนี้สินรวมขายหลักทรัพย์โดยมีสัญญาจะซื้อคืน
- 08010000 = 8.1 กรณีปกติ
- 08020000 = 8.2 กรณีหลักทรัพย์ที่ขาย > 150 % ราคาซื้อคืน
- 09000000 = 9. ความเสี่ยง : จากการรับประกันการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์
- 10000000 = 10. ความเสี่ยง : จากการมีฐานะเงินตราต่างประเทศ
- 11000000 = 11. สินทรัพย์สภาพคล่องสุทธิ
- 12000000 = 12. หักหนี้สินรวม
- 13000000 = 13. เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
- 14000000 = 14. หนี้สินทั่วไป
- 15000000 = 15. อัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไป (%)

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

- 16000000 = 16. สินทรัพย์และภาระผูกพันถ่วงน้ำหนักทั้งสิ้นของ บหลิม. ณ สิ้นเดือน
- 17000000 = 17. หัก สินทรัพย์และภาระผูกพันถ่วงน้ำหนักทั้งสิ้นของ บหลิม. ณ สิ้นเดือน
- 18000000 = 18. สินทรัพย์และภาระผูกพันถ่วงน้ำหนักของ บง.
- 19000000 = 19. เงินกองทุนของบหลิม.
- 20000000 = 20. หัก เงินกองทุนของธุรกิจหลักทรัพย์
- 21000000 = 21. เงินกองทุนของ บง.
- 22000000 = 22. หัก เงินกองทุนขั้นต่ำที่ บง. ต้องดำรง
- 23000000 = 23. เงินกองทุนส่วนเกิน (ขาด) ของ บง.
- 24000000 = 24. เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของ บล.
- 25000000 = 25. เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิขั้นต่ำที่ บล. ต้องดำรง
- 26000000 = 26. เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิส่วนเกิน (ขาด)
- 27000000 = 27. เงินกองทุนส่วนเกิน (ขาด) รวม
- 28000000 = 28. อัตราส่วนเงินกองทุนส่วนเกิน (ขาด) รวมต่อหนี้สินทั่วไป (%)

3.2 File Name : SEC4102.DAT

รหัสรายงาน : M1302 (หนี้สิน)

Header Record:

รหัสรายงาน	รหัสบริษัท	วันที่รายงาน	ผู้จัดทำ	เบอร์โทร
X(5)	X(3)	yyyymmdd	X(40)	X(20)

Detail Record:

หน่วย :บาท

รายการ	ค่า field ที่ 1	ค่า field ที่ 2	ค่า field ที่ 3	ค่า field ที่ 4	ค่า field ที่ 5
9(8)	+9(12)V99	+9(12)V99	+9(12)V99	+9(12)V99	+9(12)V99

ประเภทรายการ

- 01000000 = 1. เงินกู้ยืม (ไม่รวมเงินกู้ยืมโดยสิทธิที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 1 ปี)
- 01010000 = 1.1 จากสถาบันการเงินในประเทศ
- 01010100 = 1.1.1 ธนาคารพาณิชย์
- 01010200 = 1.1.2 สถาบันการเงินอื่น
- 01020000 = 1.2 จากต่างประเทศ

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

- 02000000 = 2. หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืน
- 03000000 = 3. บัญชีระหว่างบริษัทกับศูนย์รับฝาก
- 04000000 = 4. เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์
- 04010000 = 4.1 ขายหลักทรัพย์ตามคำสั่ง
- 04020000 = 4.2 บัญชีลูกค้าการันตุน
- 04030000 = 4.3 เจ้าหนี้หุ้นยืม
- 04040000 = 4.4 เจ้าหนี้ทรัพย์สินวางเป็นประกัน (เฉพาะลูกค้าสถาบัน)
- 05000000 = 5. หุ้นกู้และตราสารหนี้อื่น  
(ไม่รวมหุ้นกู้/ตราสารหนี้ด้อยสิทธิที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 1 ปี)
- 06000000 = 6. หนี้สินอื่น
- 06010000 = 6.1 ดอกเบี้ยค้างจ่าย
- 06020000 = 6.2 ภาษีและค่าใช้จ่ายค้างจ่าย
- 06030000 = 6.3 บัญชีระหว่างธุรกิจเงินทุนและหลักทรัพย์ (เฉพาะลูกค้าสถาบัน)
- 06040000 = 6.4 ผลต่างบัญชีระหว่างสำนักงานใหญ่และสาขา
- 06050000 = 6.5 เงินกู้ยืมจากกรรมการหรือบริษัทในเครือ
- 06060000 = 6.6 อื่น ๆ
- 07000000 = 7. ภาระผูกพัน
- 08000000 = 8. หนี้สินรวม
- 09000000 = 9. เงินกู้ยืม/หุ้นกู้ (> 6 เดือน)
- 09010000 = 9.1 6 เดือน – 1 ปี
- 09020000 = 9.2 > 1 ปี
- 10000000 = 10. หนี้สินที่คำนวณค่าความเสี่ยงแล้ว
- 11000000 = 11. ภาระผูกพัน (> 6 เดือน)
- 12000000 = 12. หนี้สินพิเศษอื่น
- 13000000 = 13. รวมหนี้สินพิเศษ
- 14000000 = 14. หนี้สินทั่วไป

## 3.3 File Name : SEC4103.DAT

รหัสรายงาน : M1303 (รายละเอียดเงินลงทุน)

## Header Record:

รหัสรายงาน	รหัสบริษัท	วันที่รายงาน	ผู้จัดทำ	เบอร์โทร
X(5)	X(3)	yyyymmdd	X(40)	X(20)

## Detail Record:

หน่วย :บาท

รายการ	ค่า field ที่ 1	ค่า field ที่ 2
9(8)	+9(12)V99	+9(12)V99

## ประเภทรายการ

- 01000000 = 1. หุ้นสามัญ/หุ้นบุริมสิทธิ
- 01010000 = 1.1 หุ้นใน SET 50 และหุ้นต่างประเทศในกลุ่มที่กำหนด
- 01020000 = 1.2 หุ้นนอก SET 50 และหุ้นใน BSDC
- 01030000 = 1.3 หุ้นอื่น ๆ
- 01040000 = 1.4 ความเสี่ยงของการลงทุนกระจุกตัว
- 02000000 = 2. Warrant / Covered Warrant
- 02010000 = 2.1 Warrant ของหุ้นใน SET 50
- 02020000 = 2.2 Warrant ของหุ้นนอก SET 50
- 02030000 = 2.3 Warrant อื่น ๆ
- 03000000 = 3. หุ้นกู้/หุ้นกู้แปลงสภาพที่ out-of-the-money / ตัวแลกเปลี่ยน / ตราสารหนี้อื่น
- 03010000 = 3.1 หลักทรัพย์รัฐบาลหรือรัฐบาลค้ำประกัน
- 03020000 = 3.2 AAA/A-1 หรือเทียบเท่า
- 03030000 = 3.3 AAA BBB / A-2 A-3 หรือเทียบเท่า
- 03040000 = 3.4 BB B/B หรือเทียบเท่า
- 03050000 = 3.5 rating อื่น ๆ หรือไม่ได้จัดอันดับ ที่ออกโดยสถาบันการเงิน
- Q3060000 = 3.6 rating อื่น ๆ หรือไม่ได้จัดอันดับ ที่ไม่ได้้ออกโดยสถาบันการเงิน
- 03070000 = 3.7 ฝัคนัดชำระดอกเบี้ย
- 03080000 = 3.8 ตราสารหนี้ที่ออกโดยสถาบันการเงินที่ถูกปิดกิจการ

04000000 = 4. หุ้นเปลี่ยนแปลงสภาพที่ in-the-money โดยมีหุ้นสามัญที่อ้างอิงคือ

04010000 = 4.1 หุ้นใน SET 50

04020000 = 4.2 หุ้นนอก SET 50

04030000 = 4.3 หุ้นอื่น ๆ

05000000 = 5. หน่วยลงทุน

05010000 = 5.1 กองทุนเปิด

05020000 = 5.2 กองทุนปิด

05030000 = 5.3 กองทุนอสังหาริมทรัพย์

05030100 = 5.3.1 จดทะเบียน

05030200 = 5.3.2 อื่น ๆ

06000000 = 6. รวม

3.4 File Name : SEC4104.DAT

รหัสรายงาน : M1304 (ความเสี่ยงจากการรับประกันการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์)

Header Record:

รหัสรายงาน	รหัสบริษัท	วันที่รายงาน	ผู้จัดทำ	เบอร์โทร
X(5)	X(3)	yyyymmdd	X(40)	X(20)

Detail Record:

หน่วย :บาท

รายการ	ชื่อหลักทรัพย์	ค่า field ที่ 1	ค่า field ที่ 2	ค่า field ที่ 3	ค่า field ที่ 4
9(8)	X(60)	+9(12)V99	+9(12)V99	+9(12)V99	+9(12)V99

ประเภทรายการ

01000000 = 1. ตราสารหนี้ / ตราสารหนี้ที่มีลักษณะคล้ายทุน

01010000 = 1.1 หลักทรัพย์รัฐบาลหรือองค์กรของรัฐ / ตราสารหนี้ที่มีสถาบันการเงินรองรับ  
ค่าประกัน อาวัล/มีประกันเต็ม

01010100 = 1.1.1 ระบุใน field ชื่อหลักทรัพย์

01010200 = 1.1.2 ระบุใน field ชื่อหลักทรัพย์

01020000 = 1.2 ตราสารหนี้ที่ไม่มีสถาบันการเงินรับรอง ค่าประกัน อาวัล / มีประกัน ไม่เต็ม

01020100 = 1.2.1 ระบุใน field ชื่อหลักทรัพย์

01020200 =	1.2.2 ระบุใน field ชื่อหลักทรัพย์
02000000 =	2. ตราสารทุน / หลักทรัพย์อื่น
02010000 =	2.1 หลักทรัพย์ที่ไม่มีราคาตลาด
02010100 =	2.1.1 ระบุใน field ชื่อหลักทรัพย์
02010200 =	2.1.2 ระบุใน field ชื่อหลักทรัพย์
02020000 =	2.2 หลักทรัพย์ที่มีราคาตลาด
02020100 =	2.2.1 ราคาเสนอขาย <= ราคาตลาด
02020101 =	2.2.1.1 ระบุใน field ชื่อหลักทรัพย์
02020102 =	2.2.1.2 ระบุใน field ชื่อหลักทรัพย์
02020200 =	2.2.2 ราคาเสนอขาย > ราคาตลาด
02020201 =	2.2.2.1 ระบุใน field ชื่อหลักทรัพย์
02020202 =	2.2.2.2 ระบุใน field ชื่อหลักทรัพย์

### 3.5 File Name : SEC4105.DAT

รหัสรายงาน : M1305 (ความเสี่ยงจากการมีฐานะเงินตราต่างประเทศ)

#### Header Record:

รหัสรายงาน	รหัสบริษัท	วันที่รายงาน	ผู้จัดทำ	เบอร์โทร
X(5)	X(3)	yyyymmdd	X(40)	X(20)

#### Detail Record:

หน่วย :บาท

รายการ	สกุลเงิน	ลำดับที่	ชื่อสินทรัพย์ /หนี้สิน	มูลค่าสินทรัพย์ / long	มูลค่าสินทรัพย์ / short	Spot Rate
9(4)	X(20)	9(3)	X(60)	9(12)V99	9(12)V99	9(12)V99

#### ประเภทรายการ

0100 = ฐานะเงินตราต่างประเทศแยกรายสกุล (Spot Rate เป็น blank)

0200 = สรุปรฐานะเงินตราต่างประเทศ (ชื่อสินทรัพย์/หนี้สินเป็น blank)

#### 4. แบบ ก.ต. 1 / 2 รายงานข้อมูลลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ (MARGIN)

File Name : SET1200.DAT

รหัสรายงาน : W0100

Header Record:

รหัสรายงาน	รหัสบริษัท	วันที่รายงาน	ผู้จัดทำ	เบอร์โทร
X(5)	X(3)	yyyymmdd	X(40)	X(20)

Detail Record:

หน่วย : พันบาท

(ยกเว้นมูลหนี้รวม มีหน่วย : ล้านบาท)

รายการ	จำนวน ราย	มูลหนี้	จำนวนเงิน	มูลค่า หลักทรัพย์	มูลค่า หลักประกัน	หมายเหตุ
9(6)	9(9)	9(9)V99	9(9)V99	9(9)V99	9(9)V99	X(30)

ประเภทรายการ

- 010000 = 1. มูลหนี้ทั้งสิ้น
- 020000 = 2. จำนวนลูกหนี้ทั้งสิ้น
- 030000 = 3. รายละเอียดลูกหนี้ MARGIN ในบัญชีเก่า
- 030100 = 3.1 มูลหนี้รวม
- 030200 = 3.2 จำนวนลูกหนี้รวม
- 030300 = 3.3 ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์ต้องเรียกหลักประกันเพิ่ม
- 030301 = 3.3.1  $20 < M.M. < 25$
- 030302 = 3.3.2  $15 < M.M. < 20$
- 030400 = 3.4 ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย
- 030401 = 3.4.1  $10 < M.M. < 15$
- 030402 = 3.4.2  $0 < M.M. < 10$
- 030403 = 3.4.3  $M.M. = < 0$
- 030500 = 3.5 ลูกหนี้ที่มีอัตรา MAINTENANCE ต่ำกว่า INITIAL MARGIN (IM.)
- 030501 = 3.5.1  $35 < M.M. < 40$
- 030502 = 3.5.2  $30 < M.M. < 35$
- 030503 = 3.5.3  $25 < M.M. < 30$

- 030600 = 3.6 การดำเนินการกับลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย
- 030601 = 3.6.1 จำนวนเงินที่บริษัทบังคับขาย หรือลูกค้าสั่งขาย
- 030602 = 3.6.2 จำนวนเงินคงเหลือ
- 030603 = 3.6.3 เหตุผลที่ไม่ได้บังคับขาย (ระบุใน field หมายเหตุ)
- 040000 = 4. รายละเอียดลูกหนี้ MARGIN ในบัญชีใหม่
- 040100 = 4.1 มูลหนี้รวม
- 040200 = 4.2 จำนวนลูกหนี้รวม
- 040300 = 4.3 ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์ต้องเรียกหลักประกันเพิ่ม
- 040301 = 4.3.1  $30 < M.M. < 35$
- 040302 = 4.3.2  $25 < M.M. < 30$
- 040400 = 4.4 ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย
- 040401 = 4.4.1  $20 < M.M. < 25$
- 040402 = 4.4.2  $15 < M.M. < 20$
- 040403 = 4.4.3  $10 < M.M. < 15$
- 040404 = 4.4.4  $0 < M.M. < 10$
- 040405 = 4.4.5  $M.M. = < 0$
- 050500 = 4.5 ลูกหนี้ที่มีอัตรา MAINTENANCE ต่ำกว่า INITIAL MARGIN (IM.)
- 040501 = 4.5.1  $35 < M.M. < 40$
- 040600 = 4.6 การดำเนินการกับลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย
- 040601 = 4.6.1 จำนวนเงินที่บริษัทบังคับขาย หรือลูกค้าสั่งขาย
- 040602 = 4.6.2 จำนวนเงินคงเหลือ
- 040603 = 4.6.3 เหตุผลที่ไม่ได้บังคับขาย (ระบุใน field หมายเหตุ)



แบบ บ.ล.2:

สำหรับเจ้าหน้าที่

บริษัทหลักทรัพย์ จำกัด  
รายงานฐานะการเงิน  
ณ วันที่

[ ]

หน้า 1 2

หน่วย : บาท

สินทรัพย์

1.	เงินสดและเงินฝากธนาคาร						
1.1	เงินสดและเงินฝากธนาคาร	1.1	183,319,212				
1.2	รายการเงินสดระหว่างเรียกเก็บ	1.2	0	183,319,212	1.		
2.	หลักทรัพย์ซื้อโดยมีสัญญาจะขายคืน					0	2.
3.	เงินลงทุนในหลักทรัพย์						
3.1	หลักทรัพย์รัฐบาล						
3.1.1	หลักทรัพย์รัฐบาลและที่รัฐบาลค้ำประกัน	3.1.1	0				
3.1.2	หลักทรัพย์ของค้ำประกันของรัฐที่รัฐบาลไม่ได้ค้ำประกัน	3.1.2	0	0	3.1		
3.2	หลักทรัพย์เอกชน						
3.2.1	หลักทรัพย์จดทะเบียน	3.2.1	31,417,550				
3.2.2	หุ้นกู้	3.2.2	0				
3.2.3	หลักทรัพย์อื่น	3.2.3	7,820,000	39,237,550	3.2		
3.3	รายการปรับมูลค่า						
3.3.1	ดอกเบียและเงินปันผลค้างรับ	3.3.1	0				
3.3.2	จำนวนเกินไว้เมื่อการลดค่าหลักทรัพย์	3.3.2	(37,467,550)		3.3		
3.3.3	อื่น ๆ	3.3.3	0	(37,467,550)	1,770,000	3.	
4.	ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์						
4.1	ชื่อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง	4.1	36,961,511				
4.2	เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์	4.2	0				
4.3	บัญชีระหว่างบริษัทหลักทรัพย์	4.3	204,626,733				
4.4	อื่น ๆ	4.4	10,358,460				
4.5	งวด ดอกเบียค้างรับ	4.5	265,053				
4.6	หัก จำนวนเกินไว้เมื่อหนี้สงสัยจะสูญ	4.6	(8,839,081)	243,372,676	4.		
5.	ที่ดิน อาคาร และอุปกรณ์						
5.1	ที่ดิน อาคาร	5.1	0				
5.2	สิทธิการเช่าที่ดินและอาคาร	5.2	5,457,790				
5.3	อุปกรณ์	5.3	24,156,292	29,614,082	5.		
6.	สินทรัพย์อื่น						
6.1	รายได้ค้างรับ	6.1	621,781				
6.2	ค่าใช้จ่ายล่วงหน้า	6.2	2,859,574				
6.3	รายการรอการตัดบัญชี	6.3	82,434,350				
6.4	อื่น ๆ	6.4	16,911,666	102,827,571	6.		
	เงินมัดจำ		9,632,010				
	ภาษีซื้อรอขอลดคืน		680,989				
	อื่น ๆ		6,598,667				
	รวมสินทรัพย์ (ข้อ 1 ถึง ข้อ 6)					560,903,841	

แบบ บ.ล.2

สำหรับเจ้าหน้าที่

บริษัทหลักทรัพย์

จำกัด

รายงานฐานะการเงิน

ณ วันที่

หน้า 2/2

หน่วย : บาท

**หนี้สินและส่วนของผู้ถือหุ้น**

<b>7. เงินกู้ยืม</b>				
7.1 จากสถาบันการเงินในประเทศ				
7.1.1 ภาครัฐพาณิชย์	7.1.1	1,361,422		
7.1.2 สถาบันการเงินอื่น	7.1.2	0	1,361,422	7.1
7.2 จากต่างประเทศ	7.2	0	1,361,422	7.
<b>8. หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืน</b>				0 8.
<b>9. เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์</b>				
9.1 ชายหลักทรัพย์ตามคำสั่ง	9.1	245,436,791		
9.2 บัญชีลูกค้า	9.2	658,460		
9.3 บัญชีระหว่างบริษัทหลักทรัพย์	9.3	0	246,095,251	9.
<b>10. หนี้สินอื่น</b>				
10.1 ดอกเบี้ยค้างจ่าย	10.1	0		
10.2 ภาษีและค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	10.2	37,224,820		
10.3 เงินทุนเลี้ยงชีพและบำเหน็จ	10.3	0		
10.4 อื่น ๆ	10.4	13,337,806	50,562,626	10.
ลูกหนี้เสียที่อาจต้องชำระคืนบริษัทเงินทุน พรีเมียร์ จำกัด		1,395,114		
ภาษีเงินได้หัก ณ ที่จ่าย และภาษีมูลค่าเพิ่มค้างจ่าย		4,507,957		
อื่น ๆ		6,934,735		
<b>11. ส่วนของผู้ถือหุ้น</b>				
11.1 หุ้นสามัญ (จดทะเบียน 40 ล้านหุ้น มูลค่าหุ้นละ 10 บาท)	11.1	400,000,000		
11.2 หุ้นบุริมสิทธิ (จดทะเบียน ..... หุ้น มูลค่าหุ้นละ ..... บาท)	11.2	0		
11.3 ส่วนล้ำมูลค่าหุ้น	11.3	0		
11.4 ทุนสำรอง	11.4	0		
11.5 เงินสำรองที่ได้จัดสรรจากกำไรสุทธิ	11.5	0		
11.6 กำไรสุทธิคงเหลือหลังจากการจัดสรร	11.6	(99,993.093)		
11.7 กำไรสุทธิคงเหลือจากการบัญชีที่ยังไม่จัดสรร	11.7	(30,904.963)		
11.8 กำไรระหว่างงวดการบัญชี (ตาราง บ.ล. 2/1 แนบ)	11.8	(6,217.397)		
11.9 รายการอื่น	11.9	0	262,884,542	11.
<b>รวมหนี้สินและส่วนของผู้ถือหุ้น (ข้อ 7 ถึง ข้อ 11)</b>			<b>560,903,841</b>	<b>12.</b>

หมายเหตุ

หน่วย : บาท

1. สิทธิพิเศษที่มีภาระผูกพัน :- อสังหาริมทรัพย์	13.	
- เงินฝากประจำ ธ.กสิกรไทย	14.	100,000
- อื่น ๆ	15.	
2. อื่น ๆ (ระบุ)		
.....		
.....		

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

.....เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจลงนาม)

( )

ผู้อำนวยการฝ่ายบัญชีและการเงิน

วันที่

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

บริษัทหลักทรัพย์  
รายได้และค่าใช้จ่าย  
สำหรับเดือน สิ้นสุดวันที่

จำกัด

หน่วย : บาท

		เดือนนี้ (A)	ยอดสะสม (B)	
1.	รายได้ธุรกิจหลักทรัพย์	1.	24,680,755	24,680,755 1.
1.1	ค่าหมายหน้า	1.1	23,786,339	23,786,339 1.1
1.2	กำไร (ขาดทุน) จากการซื้อขายหลักทรัพย์	1.2	751,472	751,472 1.2
1.3	รายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ	1.3	42,157	42,157 1.3
1.4	ดอกเบี้ยเงินกู้ยืม	1.4	100,287	100,287 1.4
1.5	ดอกเบี้ยและเงินปันผลจากเงินลงทุนในหลักทรัพย์	1.5	0	0 1.5
2.	ค่าใช้จ่ายธุรกิจหลักทรัพย์	2.	2,647,577	2,647,577 2.
2.1	ดอกเบี้ยเงินกู้ยืม	2.1	30,013	30,013 2.1
2.2	ค่าโฆษณาและค่าธรรมเนียม	2.2	2,617,564	2,617,564 2.2
3.	ค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญ	3.	(52,547)	(52,547) 3.
4.	ค่าใช้จ่ายดำเนินงาน	4.	27,968,893	27,968,893 4.
4.1	ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับพนักงาน (จำนวน 84 คน) [C]	4.1	20,564,884	20,564,884 4.1
4.2	ค่าโฆษณาและส่งเสริมกิจการ	4.2	336,078	336,078 4.2
4.3	ค่าเช่า	4.3	825,198	825,198 4.3
4.4	ค่าเสื่อมราคา	4.4	1,434,876	1,434,876 4.4
4.5	ค่าใช้จ่ายดำเนินงานอื่น	4.5	4,807,857	4,807,857 4.5
5.	รายได้ (ค่าใช้จ่าย) อื่น	5.	(334,229)	(334,229) 5.
6.	กำไร (ขาดทุน) ก่อนค่าภาษีเงินได้และรายการพิเศษ	6.	(6,217,397)	(6,217,397) 6.
7.	ค่าภาษีเงินได้	7.	0	0 7.
8.	รายการพิเศษ	8.	0	0 8.
9.	กำไร (ขาดทุน) สุทธิ	9.	(6,217,397)	(6,217,397) 9.

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

.....(เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจลงนาม)

( )

ผู้อำนวยการฝ่ายบัญชีและการเงิน

วันที่

แบบ บค.๙/1

แบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ  
บริษัทหลักทรัพย์ จำกัด  
ณ วันที่

ส่วนที่  
หน้า :  
หน่วย : บาท

เงินกองทุนสภาพคล่อง

1 เงินสดและเงินฝากธนาคาร									182,437,506	1
2 ตัวสัญญาใช้เงินและตัวแลกเงินที่ออกโดยสถาบันการเงิน										
2.1 สถาบันการเงินทั่วไป										
2.2 สถาบันการเงินที่ถูกระงับกิจการ	ก. มูลค่าหน้าตัว	ข. ค่าความเสี่ยง								
2.2.1 P/N B/E ที่เปลี่ยนไม่ได้									ข้อ 2.1 + 2.2.1 + 2.2.2	
2.2.2 P/N B/E ที่เปลี่ยนได้										
3 เงินลงทุนในหลักทรัพย์โดยมีสัญญาว่าจะขายคืน	ก. ราคาขายคืน									
3.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ้มครอง	ณ ปัจจุบัน	ข. หลักประกัน	ค. ค่าความเสี่ยง						ข้อ 3.1 - 3.2	
3.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ้มครอง										
4 เงินลงทุน (จากข้อ 6 ของส่วนที่ 3)	ก. มูลค่าเงินลงทุน	ข. ค่าความเสี่ยง							918,000	
5 ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์										
5.1 ลูกหนี้ชื่อหลักทรัพย์ตามคำสั่ง	ก. ลูกหนี้	ค. ค่าความเสี่ยง								
5.1.1 ลูกหนี้ยังไม่พ้นกำหนดชำระ	153,691,905	2,305,379							5.1.1	151,386,529
5.1.2 ลูกหนี้พ้นกำหนดชำระภายใน 30 วัน	ก. ลูกหนี้	ข. หลักประกัน	ค. ค่าความเสี่ยง							
5.1.2.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ้มครอง	0	0	0						5.1.2.1	0
5.1.2.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ้มครอง	0	0	0						5.1.2.2	0
5.1.3 ลูกหนี้พ้นกำหนดมากกว่า 30 วัน										
5.2 ลูกหนี้บัญชีมาร์จิน	ก. ลูกหนี้	ข. หลักประกัน	ค. ค่าความเสี่ยง							
5.2.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ้มครอง	0	0	0						5.2.1	0 + 0 + 0
5.2.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ้มครอง	2.หลักทรัพย์ที่นิยม	2.หลักทรัพย์ที่นิยม								
	4,493,133	1,086,850	111,785						5.2.2	954,785 + 0 + 0
5.3 ลูกหนี้อิหมหลักทรัพย์ (สถาบัน)	ก. ลูกหนี้	ข. หลักประกัน	ค. ค่าความเสี่ยง							
5.3.1 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงคุ้มครอง			1.หลักประกัน						5.3.1	ก
			2.หลักทรัพย์ที่นิยม							
5.3.2 หลักประกันหลังหักค่าความเสี่ยงไม่คุ้มครอง			1.หลักประกัน						5.3.2	ข + 0 + 0
			2.หลักทรัพย์ที่นิยม							
	ก. ลูกหนี้	ข. ส่วนครบ	ค. ค่าความเสี่ยง						ข้อ 5.1.1-5.1.2.1-5.1.2.2	
		กำหนด 1 ปี								+5.2.1+5.2.2+5.3.1
5.4 ลูกหนี้อื่น	8,340,607	1,243,180	124,318						5.4	1,118,852
5.5 บัญชีระหว่างบริษัทกับศูนย์รับฝากหลักทรัพย์									5.5	0
6 ลูกหนี้ทรัพย์สินวางประกัน	ก. หลักทรัพย์ที่นิยม	ข. หลักประกัน	ค. ค่าความเสี่ยง							
6.1 กรณีปกติ									6.1	ข
6.2 กรณีวางหลักประกันไว้เกิน									6.2	120% ก + 0

การปรับค่าความเสี่ยง

	ก มูลหนี้	เงิน ข. 15% เงินกองทุนสำรอง	
7 ความเสี่ยง : จากการระงับตัวของอุทกภัยน้ำจืด			7
8 ความเสี่ยง : จากกรณีธุรกิจกรรมขายหลักทรัพย์โดยมีสัญญาจะซื้อที่ดิน	ก หลักทรัพย์	ข. ราคาซื้อคืน ณ ปัจจุบัน	
8.1 กรณีปกติ			
8.2 กรณีหลักทรัพย์ที่ขาย > 150% ราคาซื้อคืน			8
9 ความเสี่ยง : จากกรณีรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์	(จากข้อ 3 ร ของส่วนที่ 2)		9
10 ความเสี่ยง : จากกรณีฐานะเงินตราต่างประเทศ	(จากข้อ 2 ค ของส่วนที่ 5)		10
11 สินทรัพย์สภาพคล่องสุทธิ	(ข้อ 1 - ข้อ 2 + ข้อ 3 + ข้อ 4 - ข้อ 5 + ข้อ 6) หักด้วย (ข้อ 7 + ข้อ 8 - ข้อ 9 + ข้อ 10)	335,315,859	11
12 หัก หนี้สินรวม	(จากข้อ 8 ของส่วนที่ 2)	211,830,788	12
13 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ	(ข้อ 11 - ข้อ 12)	123,485,071	13
14 หนี้สินทั่วไป	(จากข้อ 14 ของส่วนที่ 2)	208,440,353	14
15 อัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไป	(ข้อ 13 / ข้อ 14) (%)	59.03%	15

การคำนวณความเสี่ยงพอของเงินกองทุนของ บงล.

16 สินทรัพย์และการผูกพันถ่วงน้ำหนักทั้งสิ้นของ บงล. ณ สิ้นเดือน	(จากรายการ 19 ตาราง บง. 3.1)		16
17 หัก สินทรัพย์และการผูกพันถ่วงน้ำหนักของ บล. ณ สิ้นเดือน	(คำนวณจากงบแยกธุรกิจหลักทรัพย์)		17
18 สินทรัพย์และการผูกพันถ่วงน้ำหนักของ บง.	(ข้อ 16 - ข้อ 17)		18
19 เงินกองทุนตามกฎหมายของ บงล.	(จากข้อ 6 C ตาราง บง. 3.5)		19
20 หัก เงินกองทุนของธุรกิจหลักทรัพย์	(จากข้อ 20 แบบ บง. 3 ธุรกิจหลักทรัพย์)		20
21 เงินกองทุนของ บง.	(ข้อ 19 - ข้อ 20)		21
22 หัก เงินกองทุนขั้นต่ำที่ บง. ต้องดำรง	(อัตราเงินกองทุน * ข้อ 18)		22
23 เงินกองทุนส่วนเกิน (ขาด) ของ บง.	(ข้อ 21 - ข้อ 22)		23
24 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของ บล.	(จากข้อ 13)		24
25 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิขั้นต่ำ บล. ต้องดำรง	(อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ * ข้อ 14)		25
26 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิส่วนเกิน (ขาด)	(ข้อ 24 - ข้อ 25)		26
27 เงินกองทุนส่วนเกิน (ขาด) รวม	(ข้อ 23 - ข้อ 26)		27
28 อัตราส่วนเงินกองทุนส่วนเกิน (ขาด) รวมต่อหนี้สินทั่วไป (%)	(ข้อ 27 / ข้อ 14)		28

\* คำนวณโดยนำสินทรัพย์ทุกรายการที่ปรากฏอยู่ในงบแยกธุรกิจหลักทรัพย์ ยกเว้นรายการผลต่างระหว่างกันมาถ่วงน้ำหนักตามอัตราที่กำหนดในการคำนวณสินทรัพย์เสี่ยงตามแบบของ สปท.  
 \* อัตราเงินกองทุน = อัตราเงินกองทุนต่อสินทรัพย์เสี่ยงขั้นต่ำที่ บง. ต้องดำรงตามเกณฑ์ สปท.  
 \* อัตราเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ = อัตราใช้บังคับในขณะนั้นตามประกาศคณะกรรมการ กอศ.

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วน ตรงต่อความเป็นจริง

..... (เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจลงนาม)

( )  
ผู้อำนวยการฝ่ายบัญชีและการเงิน  
วันที่

## หนี้สิน

ส่วนที่  
หน่วย : บาท

1. เงินกู้ยืม (ไม่รวมเงินกู้ยืมด้วยสิทธิที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 1 ปี)

1.1 จากสถาบันการเงินในประเทศ เงินกองทุนสภาพคล่อง

1.1 ธนาคารพาณิชย์

9,071,573 1.1.1

1.1 สถาบันการเงินอื่น

0 1.1.2

1.2 จากต่างประเทศ

0 1.2

2. หลักทรัพย์ขายโดยมีสัญญาจะซื้อคืน

0 2

3. บัญชีระหว่างบริษัทกับศูนย์รับฝากหลักทรัพย์

124,263,450 3

4. เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์

4.1 ขายหลักทรัพย์ตามคำสั่ง

26,969,370 4.1

4.2 บัญชีลูกค้ำมาร์จิ้น

1,343,301 4.2

4.3 เจ้าหนี้หุ้นยืม

0 4.3

4.4 เจ้าหนี้ทรัพย์สินวางประกัน (เฉพาะลูกค้ำสถาบัน)

0 4.4

5. หุ้นกู้และตราสารหนี้อื่น (ไม่รวมหุ้นกู้/ตราสารหนี้ด้วยสิทธิที่มีอายุคงเหลือมากกว่า 1 ปี)

0 5

6. หนี้สินอื่น

6.1 ดอกเบี้ยค้างจ่าย

0 6.1

6.2 ภาษีและค่าใช้จ่ายค้างจ่าย

41,959,256 6.2

6.3 บัญชีระหว่างธุรกิจเงินทุนและหลักทรัพย์ (เฉพาะ บงค.)

0 6.3

6.4 ผลต่างบัญชีระหว่างสำนักงานใหญ่และสาขา

0 6.4

6.5 เงินกู้ยืมจากกรรมการหรือบริษัทในเครือ

0 6.5

6.6 อื่นๆ

5,473,704 6.6

7. การระงับหุ้น

1,895,114 7

8. หนี้สินรวม

(ผลรวมของข้อ 1 ถึง ข้อ 7)

211,680,768 8

หนี้สินพิเศษ

9. เงินกู้ยืม / หุ้นกู้ (&gt; 6 เดือน)

ก. มูลหนี้

ข. ดอกเบี้ยจ่ายใน 6 เดือน

9.1 6 เดือน - 1 ปี

ก - ข 9.1

9.2 &gt; 1 ปี

9.2 9

10. หนี้สินที่คำนวณค่าความเสี่ยงแล้ว

(ข้อ 2 - ข้อ 4.2 + ข้อ 4.3 - ข้อ 4.4)

1,343,301.30 10

11. การระงับหุ้น (&gt; 6 เดือน)

1,895,114 11

12. หนี้สินพิเศษอื่น

0 12

13. รวมหนี้สินพิเศษ

(ผลรวมของข้อ 9 ถึง ข้อ 12)

3,238,415 13

หนี้สินทั่วไป

14. หนี้สินทั่วไป

(ข้อ 8 หักด้วย ข้อ 13)

208,442,353 14

## รายละเอียดเงินลงทุน

ส่วนที่ 3

หน่วย : บาท

	ก. สินทรัพย์สภาพคล่อง	ข. ค่าความเสี่ยง เงินกองทุนสภาพคล่อง
<b>1. หุ้นสามัญ / หุ้นบุริมสิทธิ</b>		
1.1 หุ้นใน SET 50 และหุ้นต่างประเทศในกลุ่มที่กำหนด		102,000 (1.1 และ 1.2)
1.2 หุ้นนอก SET 50 และหุ้นใน BSOC	1,020,000	
1.3 หุ้นอื่น ๆ	6,852,680	6,852,680 100%
1.4 ความเสี่ยงของการลงทุนกระจุกตัว		
<b>2. Warrant / Covered Warrant</b>		
2.1 warrant ของหุ้นใน SET50		
2.2 warrant ของหุ้นนอก SET50		
2.3 warrant อื่น ๆ		100%
<b>3. หุ้นกู้ / หุ้นกู้แปลงสภาพที่ out-of-the-money / ตั๋วแลกเงิน / ตราสารหนี้ชนิดอื่น</b>		
3.1 หลักทรัพย์รัฐบาลหรือรัฐบาลค้าประกัน		
3.2 AAA / A-1 หรือเทียบเท่า		
3.3 AA A BBB / A-2 A-3 หรือเทียบเท่า		
3.4 BB B/B หรือเทียบเท่า		
3.5 rating อื่น ๆ หรือ ไม่ได้จัดอันดับ ที่ออกโดยสถาบันการเงิน		
3.6 rating อื่น ๆ หรือ ไม่ได้จัดอันดับ ที่ไม่ได้ออกโดยสถาบันการเงิน		
3.7 ผิดนัดชำระดอกเบี้ย		0%
3.8 ตราสารหนี้ที่ออกโดยสถาบันการเงินที่ถูกปิดกิจการ		
<b>4. หุ้นกู้แปลงสภาพที่ in-the-money โดยมีหุ้นสามัญที่อ้างอิง คือ</b>		
4.1 หุ้นใน SET 50		18%
4.2 หุ้นนอก SET 50		30%
4.3 หุ้นอื่น ๆ		100%
<b>5. หน่วยลงทุน</b>		
5.1 กองทุนเปิด		0 0%
5.2 กองทุนปิด		0%
5.3 กองทุนอสังหาริมทรัพย์		
5.3.1 จดทะเบียน		30%
5.3.2 อื่น ๆ		100%
<b>รวม</b>	<b>7,872,680</b> ก.ก	<b>6,954,680</b> 6%

This material is reserved for educational use only, not allowed for commercial use.

Forbidden to modify the content, and cite the document when use.

ความเสี่ยงจากการรับประกันการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์

ส่วนที่ 4

หน่วย : บาท

ชื่อหลักทรัพย์

ก. มูลค่า

ข. ค่าความเสี่ยง

เงินกองทุนสภาพคล่อง

จัดจำหน่ายสุทธิ

1. ตราสารหนี้ / ตราสารหนี้ที่มีลักษณะคล้ายหุ้น

1.1 หลักทรัพย์รัฐบาลหรือองค์การของรัฐ / ตราสารหนี้  
ที่มีสถาบันการเงินรับรอง ค่าประกัน ออวัล / มีประกันเต็ม

_____				} 0%
_____				

1.2 ตราสารหนี้ที่ไม่มีสถาบันการเงินรับรอง ค่าประกัน ออวัล /  
มีประกันไม่เต็ม

_____				} 5%
_____				

2. ตราสารทุน / หลักทรัพย์อื่น

2.1 หลักทรัพย์ที่ไม่มีราคาตลาด

_____				} 10%
_____				

2.2 หลักทรัพย์ที่มีราคาตลาด

2.2.1 ราคาเสนอขาย <= ราคาตลาด

	ราคาเสนอขาย	ราคาตลาด		
_____				} 0%
_____				

2.2.2 ราคาเสนอขาย > ราคาตลาด

_____				} (มูลค่าจัด จำหน่ายสุทธิ - มูลค่าตาม ราคาตลาด)
_____				

3. รวม

	3 ก	3 ข
--	-----	-----

ความเสี่ยงจากการมีฐานะเงินตราต่างประเทศ

ส่วนที่ 5

1. ฐานะเงินตราต่างประเทศแยกรายสกุล

สกุลเงิน (usd) เงินกองทุนสภาพคล่อง

ก. สินทรัพย์ / long

(usd)

ข. หนี้สิน / short

(usd)

1. \_\_\_\_\_
2. \_\_\_\_\_
3. \_\_\_\_\_

รวม

-

1. \_\_\_\_\_
2. \_\_\_\_\_
3. \_\_\_\_\_

รวม


สกุลเงิน

(YEN)

ก. สินทรัพย์ / long

(YEN)

ข. หนี้สิน / short

(YEN)

1. \_\_\_\_\_
2. \_\_\_\_\_
3. \_\_\_\_\_

รวม


1. \_\_\_\_\_
2. \_\_\_\_\_
3. \_\_\_\_\_

รวม


สกุลเงิน

2. สรุปฐานะเงินตราต่างประเทศ

สกุลเงิน	(1) สินทรัพย์ / long	(2) หนี้สิน / short	(3) = (1) - (2) ยอดสุทธิ	(4) spot rate	(5) = (3) x (4) ยอดสุทธิ (บาท)
1. USD			-		-
2. YEN					
3. ....					

บาท

ก. ยอดรวมสุทธิที่เป็นสินทรัพย์

	-
	-

ข. ยอดรวมสุทธิที่เป็นหนี้สิน

ค. ค่าความเสี่ยง

2ก. ผลรวมของยอดสุทธิทุกสกุลที่เป็น บาท

2ข. ผลรวมของยอดสุทธิทุกสกุลที่เป็น ลบ (ไว้ค่าที่ไม่คำนึงถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)

2ค. 8% ของค่าที่มากกว่าระหว่าง 2 ก และ 2 ข (ไว้ค่าที่ไม่คำนึงถึงเครื่องหมาย บวก/ลบ)

แผนก.๑/๒

**บริษัทหลักทรัพย์ จำกัด**  
**รายงานข้อมูลลูกหนี้เงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ (MARGIN)**  
**ณ วันที่**

- 1. มูลค่าทั้งสิ้น 235.04 ล้านบาท
- 2. จำนวนลูกหนี้ทั้งสิ้น 27 ราย
- 3. รายละเอียดลูกหนี้ MARGIN ในบัญชีเก่า (IM. = 40%, MARGIN CALL = 25% และ FORCE SALE = 15%)
  - 3.1) มูลค่ารวม 231.51 ล้านบาท
  - 3.2) จำนวนลูกหนี้รวม 16 ราย
  - 3.3) ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์ต้องเรียกหลักประกันเพิ่ม

หน่วย: ล้านบาท

อัตรา MAINTENANCE MARGIN (M.M.) %	จำนวนราย	มูลค่า	จำนวนเงินที่ต้องเรียกเพิ่ม
20 < M.M. < 25	-	-	-
15 < M.M. < 20	-	-	-

3.4) ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย

อัตรา MAINTENANCE MARGIN (M.M.) %	จำนวนราย	มูลค่า	จำนวนเงินที่ต้องบังคับขาย	มูลค่าหลักทรัพย์ราคาตลาด	มูลค่าหลักประกัน
10 < M.M. ≤ 15	-	-	-	-	-
0 < M.M. ≤ 10	-	-	-	-	-
M.M. ≤ 0	4	94,587.81	28,072.87	3,684.36	-

3.5) ลูกหนี้ที่มีอัตรา MAINTENANCE MARGIN ต่ำกว่าอัตรา INITIAL MARGIN (IM.)

อัตรา MAINTENANCE MARGIN (M.M.) %	จำนวนราย	มูลค่า	จำนวนเงินส่วนต่างจาก INITIAL MARGIN
35 ≤ M.M. < 40	-	-	-
30 < M.M. < 35	-	-	-
25 < M.M. < 30	-	-	-

3.6) การดำเนินการกับลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย ตามข้อ 3.4) ของรายงานในงวดก่อน

- 3.6.1) จำนวนเงินที่บริษัทบังคับขาย หรือลูกค้าตั้งขาย
- 3.6.2) จำนวนเงินคงเหลือ
- 3.6.3 เหตุผลที่ไม่ได้บังคับขายสำหรับจำนวนเงินคงเหลือในข้อ 3.6.2)
  - เหลือวันที่ไม่มีสภาพคล่อง
  - เหลือวันที่ติด suspended

มูลค่า	จำนวนราย
179.00	1
126,458.72	3
รวม 126,637.72	4

4. รายละเอียดลูกหนี้ MARGIN ในบัญชีใหม่ (IM. = 40%, MARGIN CALL = 35% และ FORCE SALE = 25%)

- 4.1) มูลค่ารวม 3.53 ล้านบาท
- 4.2) จำนวนลูกหนี้รวม 11 ราย
- 4.3) ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์ต้องเรียกหลักประกันเพิ่ม

อัตรา MAINTENANCE MARGIN (M.M.) %	จำนวนราย	มูลค่า	จำนวนเงินส่วนต่างจาก INITIAL MARGIN
$30 \leq M.M. < 35$	-	-	-
$25 < M.M. < 30$	-	-	-

4.4) ลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย

อัตรา MAINTENANCE MARGIN (M.M.) %	จำนวนราย	มูลค่า	จำนวนเงินที่ต้องบังคับขาย	มูลค่าหลักทรัพย์ราคาตลาด	มูลค่าหลักประกัน
$20 < M.M. \leq 25$	-	-	-	-	-
$15 < M.M. \leq 20$	-	-	-	-	-
$10 < M.M. < 15$	-	-	-	-	-
$0 < M.M. \leq 10$	-	-	-	-	-
$M.M. < 0$	-	-	-	-	-

4.5) ลูกหนี้ที่มีอัตรา MAINTENANCE MARGIN ต่ำกว่าอัตรา INITIAL MARGIN (IM.)

อัตรา MAINTENANCE MARGIN (M.M.) %	จำนวนราย	มูลค่า	จำนวนเงินส่วนต่างจาก INITIAL MARGIN
$35 \leq M.M. < 40$	-	-	-

4.6) การดำเนินการกับลูกหนี้ที่เข้าเกณฑ์บังคับขาย ตามข้อ 4.4) ของรายงานในวงก่อน

- 4.6.1) จำนวนเงินที่บริษัทบังคับขาย หรือถูกคำสั่งขาย
- 4.6.2) จำนวนเงินคงเหลือ
- 4.6.3) เหตุผลที่ไม่ได้บังคับขายสำหรับจำนวนเงินคงเหลือในข้อ 4.6.2)

มูลค่า	จำนวนราย
-	-
-	-
รวม	-

ขอรับรองว่ารายงานนี้ถูกต้องครบถ้วนตรงต่อความเป็นจริง

..... (เจ้าหน้าที่ผู้มีอำนาจลงนาม)  
 ( )  
 ผู้อำนวยการฝ่ายบัญชีและการเงิน  
 วันที่

## ประวัติผู้เขียน

นางสาวปิยะทิพย์ เจียมจรวงศ์ จบการศึกษาปริญญาตรีจากคณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ภาควิชาการบัญชี หลังจากจบการศึกษาได้เข้าทำงานที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ในฝ่ายกำกับและตรวจสอบสมาชิก เป็นเวลา 6 ปี ปัจจุบันอยู่ในตำแหน่งเจ้าหน้าที่ตรวจสอบสมาชิก อาวุโส

