

บันทึกแนบท้าย
สัญญาแต่งตั้งตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

วันที่

บันทึกแนบท้ายฉบับนี้ จัดทำขึ้นระหว่าง..... ซึ่งต่อไปจะเรียกว่า “**ลูกค้า**” คู่สัญญาฝ่ายหนึ่ง กับบริษัท
หลักทรัพย์ อาร์เอชบี (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ซึ่งต่อไปจะเรียกว่า “**บริษัท**” คู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง โดยคู่สัญญาทั้งสองฝ่ายเข้าทำบันทึกแนบท้ายฉบับ
นี้ เพื่อวัตถุประสงค์ในการทำธุรกรรมการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภท Single Stock Futures ผ่านระบบซื้อขายสัญญาล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย
รายใหญ่ (ซึ่งต่อไปจะเรียกว่า “**ธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade**”) กับบริษัท [คู่สัญญาทั้งสองฝ่าย]ตกลงให้บันทึกแนบท้ายฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของ
สัญญาแต่งตั้งนายหน้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้าระหว่าง..... กับบริษัท ฉบับลงวันที่.....
(ซึ่งต่อไปจะเรียกว่า “**สัญญาแต่งตั้งตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า**”) เพื่อให้การทำธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade ระหว่างลูกค้าและบริษัทมี
ข้อตกลงที่ชัดเจน คู่สัญญาทั้งสองฝ่ายจึงตกลงร่วมกันดังต่อไปนี้

1. การส่งคำสั่งซื้อขายสำหรับธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade จะดำเนินการผ่านทางโทรศัพท์ที่มีกรบันทึกเลข และ/หรือ ช่องทางการส่งคำสั่ง
ซื้อขายหลักทรัพย์ หรือ สัญญาซื้อขายล่วงหน้าของบริษัทเป็นผู้อนุญาตให้ลูกค้าของบริษัทใช้งานได้ และ/หรือ ช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ หรือ ช่องทางอื่นใดที่
ได้รับอนุญาตจากบริษัทหรือหน่วยงานผู้ทำหน้าที่กำกับดูแลที่เกี่ยวข้อง

ในกรณีที่มีข้อพิพาทหรือการดำเนินการทางกฎหมายใด ๆ สามารถนำเทบบันทึกเสียง รวมถึงข้อมูลในเทบบันทึกเสียงดังกล่าว มาเปิดเผยและใช้เป็น
พยานหลักฐาน โดยถูกต้องตามกฎหมาย สำหรับการดำเนินการเกี่ยวกับข้อพิพาท และ/หรือ การดำเนินการทางกฎหมายดังกล่าว

2. ในกรณีที่ลูกค้าแจ้งบริษัทถึงความประสงค์ที่จะส่งคำสั่งซื้อขายสำหรับธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade ตามที่กำหนดไว้ในข้อ 1. เพื่อเปิดฐานะ
สัญญา (Open Position) หรือ ปิดหรือล้างฐานะสัญญา (Close Position) ให้ถือว่าความประสงค์ดังกล่าวมีผลผูกพันลูกค้า ดังนั้น เมื่อบริษัท
ดำเนินการใด ๆ เพื่อเข้าผูกพันธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade ตามความประสงค์ลูกค้าดังกล่าว ไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน [และ] หากปรากฏว่า
ลูกค้าไม่สามารถส่งคำสั่งธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade ไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน และ/หรือ ยกเลิก หรือ แก้ไขคำสั่งซื้อขายดังกล่าว ไม่ว่าทั้งหมด
หรือบางส่วน ด้วยเหตุผลใดก็ตาม ซึ่งทำให้ธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade ตามที่ตกลงไว้กับบริษัทไม่สำเร็จ ลูกค้าตกลงและยินยอมชำระค่าใช้จ่าย
และ/หรือ ค่าเสียหายทั้งหมดให้แก่บริษัท รวมถึงดอกเบี้ยในอัตราร้อยละ 7.5 ต่อปี หรืออัตราดอกเบี้ยคิดค้นชำระราคาของบริษัทได้ประกาศกำหนดไว้ นับ
จากวันที่ธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade ตามที่ตกลงไว้กับบริษัทไม่สำเร็จ จนถึงวันที่บริษัทได้รับชำระค่าใช้จ่าย และ/หรือ ค่าเสียหายทั้งหมดตามที่
กำหนดไว้ในข้อ 2. นี้ เพิ่มจำนวน

3. ลูกค้าตกลงว่า การวางเงินหลักประกันให้เพียงพอในการทำธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade เป็นความรับผิดชอบของลูกค้าแต่เพียงฝ่ายเดียว
ลูกค้าจะไม่นำเหตุที่ลูกค้าไม่สามารถจัดหาหรือเตรียมเงินหลักประกันให้เพียงพอก่อนส่งคำสั่งซื้อขายสำหรับธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade มา
กล่าวอ้างกับบริษัทในการปฏิเสธหรือยกเลิกธุรกรรมดังกล่าว ในกรณีที่บริษัทได้รับความเสียหายจากกรณีที่ลูกค้าที่ไม่สามารถจัดหาหรือเตรียมเงิน
หลักประกันที่เพียงพอได้ก่อนส่งคำสั่งซื้อขายสำหรับธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade นั้น ลูกค้าตกลงและยินยอมชำระค่าใช้จ่าย และ/หรือ
ค่าเสียหายเพิ่มจำนวน รวมถึงดอกเบี้ยในอัตราร้อยละ 7.5 ต่อปีหรืออัตราดอกเบี้ยคิดค้นชำระราคาของบริษัทได้ประกาศกำหนดไว้ ให้กับบริษัท นับจากวันที่
ธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade ตามที่ตกลงไว้กับบริษัทไม่สำเร็จ จนถึงวันที่บริษัทได้รับชำระค่าใช้จ่าย และ/หรือ ค่าเสียหายทั้งหมดตามที่กำหนด
ไว้ในข้อ 3. นี้ เพิ่มจำนวน

4. ลูกค้าให้คำรับรองว่า ก่อนเข้าทำธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade ทุกครั้ง ลูกค้าได้รับทราบและทำความเข้าใจข้อมูลผลิตภัณฑ์ ค่าใช้จ่ายต่าง ๆ
ที่เกี่ยวกับผลิตภัณฑ์ อัตราดอกเบี้ยและค่าธรรมเนียมที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องอย่างครบถ้วนแล้ว และลูกค้าจะไม่นำเหตุเรื่องความไม่
เข้าใจในข้อมูลผลิตภัณฑ์ และความเสี่ยงใด ๆ ที่เกี่ยวข้องมากล่าวอ้างกับบริษัทเพื่อปฏิเสธหรือยกเลิกธุรกรรมใด ๆ ที่ได้รับการยืนยันไปแล้ว

5. ลูกค้าให้คำรับรองว่า ก่อนเข้าทำธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade ลูกค้าได้รับทราบและเข้าใจกฎและระเบียบที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย SSF
Block Trade รวมถึงการส่งคำสั่งซื้อขาย Block Trade ที่กำหนดโดยคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ สำนักงานคณะกรรมการกำกับ
หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หน่วยงานของรัฐ หรือ ฝ่ายใด ๆ ของบริษัท ตลอดจนแนวปฏิบัติในการดำเนินธุรกิจที่
เกี่ยวข้องกับธุรกรรมซื้อขาย SSF Block Trade วิธีการส่งคำสั่งซื้อขาย Block Trade และวิธีคำนวณราคา อย่างครบถ้วนแล้ว และลูกค้าตกลงปฏิบัติตาม
[กฎและระเบียบทั้งหมดนี้] อย่างเคร่งครัด ในกรณีที่มีการปรับปรุง [และ] แก้ไขกฎและระเบียบที่เกี่ยวข้อง ภายหลังจากวันที่ของบันทึกแนบท้ายฉบับนี้
ลูกค้าจะไม่นำเหตุที่ลูกค้าไม่ทราบถึงการปรับปรุง [และ] แก้ไขดังกล่าว หรือ ไม่ได้เข้าใจและรับทราบกฎและระเบียบที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย SSF Block
Trade รวมถึงการส่งคำสั่งซื้อขาย Block Trade ที่กำหนดขึ้นโดยคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ สำนักงานคณะกรรมการกำกับ
หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หน่วยงานของรัฐ หรือ ฝ่ายใด ๆ ของบริษัท และแนวปฏิบัติในการดำเนินธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับ

ธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade และวิธีการส่งคำสั่งซื้อขาย Block Trade อย่างครบถ้วน มากล่าวอ้างกับบริษัทเพื่อปฏิเสธหรือยกเลิกธุรกรรมใด ๆ ที่ได้รับการยืนยันแล้ว

6. ลูกค้าให้คำรับรองว่า สัญญาแต่งตั้งตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและบันทึกแนบท้ายฉบับนี้ รวมถึงการเข้าทำสัญญาทั้งสองฉบับดังกล่าว เป็นธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade เพื่อตัวของลูกค้าเอง และข้อมูลทั้งหมดในสัญญาทั้งสองฉบับนั้น เป็นข้อมูลที่ได้มาจากข้อมูลที่ลูกค้าส่งให้บริษัทในแบบฟอร์มเอกสารคำขอ (Application Form) ลูกค้าให้คำรับรองว่า ลูกค้าจะไม่อนุญาตให้บุคคลภายนอกหรือพนักงานของบริษัท กระทำการแทนลูกค้าในธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade เว้นแต่ ลูกค้าจะได้มอบอำนาจให้บุคคลภายนอกหรือพนักงานบริษัทตามระเบียบที่บริษัทกำหนด ทั้งนี้ เพื่อกำหนดให้ชัดเจนยิ่งขึ้น ลูกค้าต้องจัดทำหนังสือมอบอำนาจและส่งมายังบริษัท ณ วันที่ทำธุรกรรม หรือก่อนการทำธุรกรรม SSF Block Trade นอกจากนี้ ลูกค้าเข้าใจและรับทราบว่าการยินยอมให้ผู้อื่นใช้บัญชีของตน ในการดำเนินการซื้อขาย SSF Block Trade อาจขัดต่อพระราชบัญญัติป้องกันและปราบปรามการฟอกเงิน พ.ศ. 2542

7. ในระหว่างดำเนินการซื้อขาย SSF Block Trade ลูกค้าตกลงที่จะปิดหรือล้างฐานะสัญญา (Close Position) SSF Block Trade ระหว่างลูกค้ากับบริษัททั้งจำนวนกับบริษัทเท่านั้น โดยลูกค้าตกลงจะไม่ดำเนินการปิดหรือล้างฐานะ (Close Position) บนกระดานซื้อขายของบริษัทตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX) หรือกับบุคคลอื่นใด ทั้งนี้ หากลูกค้าฝ่าฝืน [ความในข้อนี้] โดยการปิดหรือล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าบนกระดานซื้อขายของบริษัทตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX) หรือ กับบุคคลอื่นใด บริษัทจะคำนวณกำไรและขาดทุน โดยใช้ราคาที่ใช้ชำระวันสุดท้าย (Final Settlement Price) ตามที่บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า(ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX) กำหนด นอกจากนี้ ในกรณีที่บริษัทได้รับความเสียหายจากกรณีที่ลูกค้าปิดหรือล้างฐานะสัญญา (Close Position) บนกระดานการซื้อขายของบริษัทตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX) หรือกับบุคคลอื่น ลูกค้าตกลงและยินยอมชดเชยค่าเสียหายเต็มจำนวนให้บริษัท ทั้งนี้ ให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ และวิธีการที่บริษัทกำหนดภายใต้บทบัญญัติของกฎและระเบียบที่เกี่ยวข้อง

8. ลูกค้าตกลงว่า ลูกค้าต้องปิดหรือล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าก่อนเวลา 12.30 น. ในวันซื้อขายวันสุดท้ายของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ลูกค้าจะไม่ถือครองฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจนครบกำหนดอายุสัญญา เว้นแต่ [ลูกค้า] จะได้รับความยินยอมเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทก่อน ทั้งนี้ ในการขอความยินยอมดังกล่าว ลูกค้าจะต้องส่งคำร้องขอมายังบริษัท ไม่น้อยกว่า 14 วัน ก่อนวันครบกำหนดอายุสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในกรณีที่ลูกค้าฝ่าฝืน [ความในข้อนี้] และถือครองฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจนถึงวันครบกำหนดอายุสัญญา ลูกค้าตกลงและยินยอมให้ฐานะการซื้อขายสัญญาปิดลงโดยอัตโนมัติ ทั้งนี้ บริษัทจะคำนวณกำไรและขาดทุน โดยใช้ราคาที่ใช้ชำระวันสุดท้าย (Final Settlement Price) ตามที่บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX) กำหนด นอกจากนี้ ในกรณีที่บริษัทได้รับความเสียหายจากกรณีที่ลูกค้าถือครองฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจนถึงวันครบกำหนดอายุสัญญา ลูกค้าตกลงและยินยอมชำระค่าเสียหายเต็มจำนวนให้บริษัท ทั้งนี้ ให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ และวิธีการที่บริษัทกำหนดภายใต้บทบัญญัติของกฎและระเบียบที่เกี่ยวข้อง

9. ในกรณีที่หลักทรัพย์อ้างอิงถูกระงับการซื้อขายโดยตลาดหลักทรัพย์ อาทิเช่น มีการขึ้นเครื่องหมายห้ามซื้อขายหลักทรัพย์ (SP) และ ฐานะสัญญา TFEX ที่เปิดไว้ครบกำหนดอายุสัญญาในระยะเวลาห้ามซื้อขายหลักทรัพย์นั้น หรือ ในกรณีฉุกเฉินอื่นใด ซึ่งส่งผลให้บริษัทไม่สามารถซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวในตลาดหลักทรัพย์ก่อนวันครบกำหนดอายุสัญญา SSF ได้ ลูกค้าตกลงดังต่อไปนี้

(1) รับ หรือ ชำระค่าส่วนต่างในกำไรหรือขาดทุนระหว่าง ราคาที่ใช้ชำระราคาที่ใช้ชำระวันสุดท้าย (Final Settlement Price) ซึ่งกำหนดโดย TFEX และราคาหลักทรัพย์อ้างอิงในวันแรกที่กลับมาซื้อขายได้ รวมทั้งค่าธรรมเนียม Block Trade (ตามที่ระบุในเอกสารแนบท้าย) หรือ

(2) กรณีมีฐานะเปิดสัญญาซื้อ (Long Open Position) บริษัทจะ โอนหลักทรัพย์ให้ลูกค้า และลูกค้าต้องชำระราคาที่ใช้ชำระวันสุดท้าย (Final Settlement Price) ซึ่งกำหนดโดย TFEX เต็มจำนวน รวมกับค่าธรรมเนียม Block Trade (ตามที่ระบุในเอกสารแนบท้าย)

บริษัทขอสงวนสิทธิในการเลือกดำเนินการตามข้อใดข้อหนึ่งตามที่กำหนดไว้ข้างต้น โดยบริษัทจะคำนึงถึงเวลาและระยะเวลาในการดำเนินการเป็นสำคัญ

10. ลูกค้าตกลงและยินยอมให้การคำนวณที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมการซื้อขาย SSF Block Trade เป็นไปตามเอกสารแนบท้ายของบันทึกแนบท้ายฉบับนี้ ทั้งนี้ บริษัทขอสงวนสิทธิในการเปลี่ยนแปลงเอกสารแนบท้าย โดยจะประกาศให้ลูกค้าทราบผ่านทางเว็บไซต์บริษัท และ/หรือ แจ้งให้ลูกค้ารับทราบเป็นลายลักษณ์อักษร

11. ในกรณีที่บริษัทขอให้ลูกค้าดำเนินการปิดหรือล้างฐานะสัญญา (Close Position) เนื่องจากมีเหตุจำเป็น และ/หรือ เมื่อบริษัทผู้ออกหุ้นอ้างอิงที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้านั้นอ้างอิงอยู่ มีการประกาศสิทธิประโยชน์แก่ผู้ถือหุ้น (Corporate Action) เช่น การจ่ายเงินปันผล การจัดสรรหุ้นเพิ่มทุน เป็นต้น ที่อาจก่อให้เกิดความเสียหายแก่บริษัท และ/หรือ กรณีมีการเรียกคืนหุ้นจากผู้ถือหุ้น Short หุ้น ลูกค้าตกลงยินยอมดำเนินการปิดหรือล้างฐานะสัญญา (Close Position) ในราคาตามที่ระบุในเอกสารแนบท้าย ตามที่บริษัทได้ร้องขอ

12. กรณีที่ลูกค้าถูกเรียกให้วางเงินหลักประกันเพิ่ม (Call Margin) หรือมูลค่าหลักประกันของลูกค้าลดลงจนถึงระดับที่ต้องบังคับปิดสถานะ (Force Close) แล้วแต่กรณี และลูกค้าเลือกที่จะปิดฐานะของ SSF Block Trade แทนการวางหลักประกันเพิ่มเติม การปิดฐานะสัญญาชั้นนั้น หรือ การรักษาระยะสัญญาที่คงเหลือ จะต้องเป็นไปตามจำนวนซื้อขาย SSF Block Trade ชั้นต่ำ ซึ่งกำหนดโดยคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือ บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX) และ/หรือ ประกาศคณะกรรมการชรมผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

13. ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงจำนวนสัญญาชั้นต่ำในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตามประกาศ และ/หรือ ข้อกำหนดของ TFEX ไม่ว่าจะด้วยเหตุผลใดก็ตาม ลูกค้าจะต้องปฏิบัติตามข้อกำหนดดังต่อไปนี้ ภายใน 14 วัน

(1) เพิ่ม จำนวนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า SSF Block Trade จนถึงจำนวนที่เป็นไปตามข้อกำหนดที่มีการเปลี่ยนแปลงนั้น และสามารถทำการซื้อขายต่อไปได้ หรือ

(2) ปิด ฐานะสัญญา SSF Block Trade ก่อนวันที่มีการเปลี่ยนแปลงจำนวนสัญญาชั้นต่ำดังกล่าวจะมีผลใช้บังคับ

14. บริษัทขอสงวนสิทธิในการบังคับปิดฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Force Close) ในกรณีดังต่อไปนี้

(1) บริษัทประเมินแล้วว่า ฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีความเสี่ยงที่ไม่สามารถจัดการได้ อันเกิดจากความผิดปกติของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงหรือเหตุผลอื่นใด

(2) ลูกค้าไม่ปฏิบัติตามที่กำหนดไว้ในข้อ 12. ภายในระยะเวลาที่กำหนด

บริษัทจะทำการแจ้งลูกค้าล่วงหน้าก่อนทำการปิดฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ทั้งนี้ให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ และวิธีการที่บริษัทกำหนดภายใต้บทบัญญัติของกฎระเบียบที่เกี่ยวข้อง

15. ในกรณีที่มีการปิดฐานะ SSF Block Trade ไม่ว่าจะในกรณีใดก็ตาม รวมถึงกรณีพื้นฐาน SSF Block Trade ครบกำหนดอายุสัญญา และลูกค้าได้เปิดฐานะ SSF Block Trade ใหม่ บริษัทจะนำค่าธรรมเนียม ดอกเบี้ย และเงินปันผล มาคำนวณเพื่อกำหนดราคาปิดหรือล้างฐานะสัญญา ตามที่กำหนดในบันทึกข้อตกลงฉบับนี้ และกฎและระเบียบที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ เพื่อกำหนดให้ชัดเจนยิ่งขึ้น ในกรณีที่มีการปิดฐานะ SSF Block Trade ให้ดำเนินการชำระหรือรับเงินปันผลใดหรือดอกเบี้ยใด ๆ ที่ได้รับ จาก SSF Block Trade ที่จะปิดฐานะนั้น ให้เสร็จสิ้น

16. บริษัทขอสงวนสิทธิในการแก้ไขหรือเปลี่ยนแปลงบันทึกแนบท้ายฉบับนี้แต่เพียงฝ่ายเดียว โดยบริษัทจะแจ้งให้ลูกค้าทราบเป็นลายลักษณ์อักษร และภายใน 30 วันนับตั้งแต่วันที่ได้รับหนังสือแจ้งการเปลี่ยนแปลงนั้น ลูกค้าจะต้องพิจารณาและแจ้งความประสงค์ของลูกค้ามายังบริษัท ดังนี้

(1) ลูกค้าตกลงยอมรับการแก้ไขหรือเปลี่ยนแปลงที่บริษัทเสนอ หรือ

(2) ลูกค้าไม่ตกลงยอมรับการแก้ไขหรือเปลี่ยนแปลงที่บริษัทเสนอ

หากเป็นกรณีตามข้อ (2) ให้บันทึกแนบท้ายฉบับนี้สิ้นสุดลง และคู่สัญญาทั้งสองฝ่ายจะต้องร่วมกันตกลงเกี่ยวกับจำนวนคงค้างใด ๆ ที่เกี่ยวข้องกับบันทึกแนบท้ายฉบับนี้ ภายในบันทึกแนบท้ายฉบับนี้

ในกรณีที่ลูกค้าไม่แจ้งความประสงค์มายังบริษัทภายในระยะเวลาที่กำหนดไว้ ให้ถือว่าลูกค้าตกลงยอมรับการแก้ไขหรือเปลี่ยนแปลงที่บริษัทเสนอ และให้การแก้ไขหรือเปลี่ยนแปลงที่บริษัทเสนอดังกล่าวมีผลใช้บังคับ

17. บันทึกแนบท้ายฉบับนี้ให้ตีความและใช้บังคับตามกฎหมายไทย

..... ลูกค้า

..... บริษัท/ ผู้มีอำนาจลงนาม

(.....)

บริษัทหลักทรัพย์ อาร์เอชบี (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

..... พยาน

..... พยาน

(.....)

(.....)

เอกสารแนบท้าย
การคำนวณเกี่ยวกับธุรกรรม SSF Block Trade

สมมุติฐานสำหรับการคำนวณและคำนวณ

- ◆ ราคาหุ้นอ้างอิง หมายถึง ราคาหุ้นอ้างอิงตามคำสั่งซื้อหรือขายของลูกค้าที่ได้รับการยืนยันจากทางบริษัทแล้ว
- ◆ ค่าธรรมเนียมล่วงหน้า หมายถึง ดอกเบี้ยมัดจำซึ่งสามารถขึ้นอยู่กับการตกลงกัน ในแต่ละครั้ง หรือถ้าไม่ได้ตกลงกันก็จะใช้ค่ามาตรฐานเท่ากับศูนย์
- ◆ อัตราดอกเบี้ย หมายถึง อัตราดอกเบี้ย Block Trade ตามประกาศของบริษัท
- ◆ จำนวนวันขั้นต่ำสำหรับคำนวณดอกเบี้ย หมายถึง สาม (3) วันทำการ ขึ้นอยู่กับกาเปลี่ยนแปลงใด ๆ ตามที่บริษัทแจ้งให้ลูกค้าทราบ
- ◆ จำนวนวันที่ใช้ในการคำนวณ หมายถึง จำนวนวันที่มากกว่าระหว่าง จำนวนวันขั้นต่ำสำหรับคำนวณดอกเบี้ย หรือ จำนวนวันที่ถือครองตามจริง
- ◆ จำนวนวันที่ถือครองตามจริง หมายถึง จำนวนวันที่ลูกค้าเปิดฐานะซึ่งเท่ากับ วันที่ปิดฐานะ - วันเปิดฐานะ
- ◆ ค่าธรรมเนียม TFEX หมายถึง ค่าธรรมเนียมของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า single stock futures เป็นไปตามประกาศของบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) และ บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด
- ◆ ขนาดสัญญา หมายถึง จำนวนหุ้นต่อหนึ่งสัญญา ซึ่งประกาศโดย บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (TFEX)

1. การคำนวณราคาที่ใช้ในการเปิดฐานะสัญญา

ฐานะซื้อ หรือ Long position	<p>ราคาเปิดฐานะสัญญา = ราคาหุ้นอ้างอิง + ค่าธรรมเนียมล่วงหน้า</p> <p>ตัวอย่างเช่น ลูกค้าส่งคำสั่ง Long Open สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงหุ้น A ที่ราคา 100 บาท หากรายการซื้อได้รับการยืนยัน และตกลงกันว่าจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมล่วงหน้า</p> <p>ราคาเปิดฐานะสัญญา = 100 + 0 = 100 บาท</p>
ฐานะขาย หรือ Short position	<p>ราคาเปิดฐานะสัญญา = ราคาหุ้นอ้างอิง - ค่าธรรมเนียมล่วงหน้า</p> <p>ตัวอย่างเช่น ลูกค้าส่งคำสั่ง Short Open สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงหุ้น A ที่ราคา 110 บาท หากรายการขายหุ้นได้รับการยืนยัน และตกลงกันว่าจะไม่เรียกเก็บค่าธรรมเนียมล่วงหน้า</p> <p>ราคาเปิดฐานะสัญญา = 110 - 0 = 110 บาท</p>

2. การคำนวณราคาปิดฐานะสัญญา

ฐานะซื้อ หรือ Long position	<p>ราคาปิดฐานะสัญญา = ราคาหุ้นอ้างอิง + ค่าธรรมเนียมล่วงหน้า - ค่าธรรมเนียม Block Trade</p> <p>ตัวอย่างเช่น ลูกค้าส่งคำสั่ง Short Close สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงหุ้น A ที่ราคา 120 บาท หากลูกค้าถือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจำนวน 20 สัญญา (สัญญาละ 1,000 หุ้น) และมีค่าธรรมเนียม SSF Block Trade จำนวน 10,000 บาท</p> <p>ราคาปิดฐานะสัญญา = [(120 x 20 x 1,000) - 10,000] / (20 x 1,000) = 119.50 บาท</p>
ฐานะขาย หรือ Short position	<p>ราคาปิดฐานะสัญญา = ราคาหุ้นอ้างอิง + ค่าธรรมเนียมล่วงหน้า + ค่าธรรมเนียม Block Trade</p> <p>ตัวอย่างเช่น ลูกค้าส่งคำสั่ง Long Close สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงหุ้น A ที่ราคา 90 บาท หากลูกค้าถือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจำนวน 20 สัญญา (สัญญาละ 1,000 หุ้น) และมีค่าธรรมเนียม SSF Block Trade จำนวน 10,000 บาท</p> <p>ราคาปิดฐานะสัญญา = [(90 x 20 x 1,000) + 10,000] / (20 x 1,000) = 90.50 บาท</p>

3. การคำนวณค่าธรรมเนียมต่าง ๆ

ค่าใช้จ่ายทั้งหมดที่เกี่ยวข้องในการทำธุรกรรม

Block Trading = ค่าธรรมเนียม Block Trade + ค่าธรรมเนียมนายหน้า + ค่าธรรมเนียม TFEX

ค่าธรรมเนียม Block Trade	ราคาหุ้นอ้างอิง x จำนวนสัญญา x ขนาดสัญญา x จำนวนวันที่ใช้ในการคำนวณ/365 x อัตราดอกเบี้ย
ค่าธรรมเนียมนายหน้า	ราคาหุ้นอ้างอิง x ค่าธรรมเนียมนายหน้า x จำนวนสัญญา x ขนาดสัญญา x VAT 7%
ค่าธรรมเนียม TFEX	<ul style="list-style-type: none"> 5.10 บาท/จำนวนสัญญา (ในกรณีที่ราคาหุ้นอ้างอิงมากกว่า 100 บาทขึ้นไป) + VAT 7% 0.51 บาท/จำนวนสัญญา (ในกรณีที่ราคาหุ้นอ้างอิงน้อยกว่า 100 บาท) + VAT 7%

4. การจ่ายเงินปันผล

ในกรณีที่ลูกค้าถือครองฐานะซื้อ หรือ Long position ผ่าน วันที่ไม่ได้รับสิทธิรับเงินปันผล (XD) ลูกค้าจะได้รับเงินปันผล คิดเป็นร้อยละ 90 ของอัตราจ่ายเงินปันผล (บาทต่อหุ้น) x จำนวนสัญญาทั้งหมด x ขนาดสัญญา

ตัวอย่างเช่น ลูกค้าถือครองฐานะซื้อ หรือ Long position ของหุ้น A จำนวน 20 สัญญา (ขนาดสัญญาละ 1,000 หุ้น) ผ่านวันที่ไม่ได้รับสิทธิรับเงินปันผล หลังจากนั้น หุ้น A ประกาศจ่ายปันผลในอัตรา 0.10 บาท ต่อหุ้น ลูกค้าจะได้รับเงินปันผล ดังนี้

$$\begin{aligned} \text{เงินปันผล} &= 90\% \times \text{อัตราจ่ายเงินปันผล (บาทต่อหุ้น)} \times \text{จำนวนสัญญาทั้งหมด} \times \text{ขนาดสัญญา} \\ &= 90\% \times 0.1 \times 20 \times 1,000 = 1,800 \text{ บาท} \end{aligned}$$

โดยบริษัทจะจ่ายเงินปันผลให้กับลูกค้า เมื่อปิดฐานะสัญญา ดังนี้

ฐานะซื้อ หรือ Long position	<p>ราคาปิดฐานะสัญญา = ราคาหุ้นอ้างอิง + ค่าธรรมเนียมล่วงหน้า - ค่าธรรมเนียม Block Trade + เงินปันผลตัวอย่างเช่น นักลงทุนส่งคำสั่ง Short Close สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงหุ้น A ที่ราคา 120 บาท หากลูกค้าถือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจำนวน 20 สัญญา (สัญญาละ 1,000 หุ้น) และมีค่าธรรมเนียม SSF Block Trade จำนวน 10,000 บาท เงินปันผลที่จะได้รับ จำนวน 1,800 บาท</p> <p>ราคาปิดฐานะสัญญา [จะเป็นดังนี้]</p> $= [(120 \times 20 \times 1,000) - 10,000 + 1,800] / (20 \times 1,000) = 119.59 \text{ บาท}$
-----------------------------	---

ในกรณีที่ลูกค้าถือครองฐานะขาย หรือ Short position ผ่าน วันที่ไม่ได้รับสิทธิรับเงินปันผล (XD) ลูกค้าจะต้องจ่ายเงินปันผล คิดเป็นร้อยละ 100 ของอัตราจ่ายเงินปันผล (บาทต่อหุ้น) x จำนวนสัญญาทั้งหมด x ขนาดสัญญา

ตัวอย่างเช่น ลูกค้าถือครองฐานะขาย หรือ Short position ของหุ้น A จำนวน 20 สัญญา (ขนาดสัญญาละ 1,000 หุ้น) ผ่านวันที่ไม่ได้รับสิทธิรับเงินปันผล หลังจากนั้น หุ้น A ประกาศจ่ายปันผลในอัตรา 0.10 บาท ต่อหุ้น ลูกค้าจะต้องจ่ายเงินปันผล ดังนี้

$$\begin{aligned} \text{เงินปันผล} &= 100\% \times \text{อัตราจ่ายเงินปันผล (บาทต่อหุ้น)} \times \text{จำนวนสัญญาทั้งหมด} \times \text{ขนาดสัญญา} \\ &= 100\% \times 0.1 \times 20 \times 1,000 = 2,000 \text{ บาท} \end{aligned}$$

โดยบริษัทจะเรียกเก็บเงินปันผลจากลูกค้า เมื่อปิดฐานะสัญญา ดังนี้

ฐานะขาย หรือ Short position	<p>ราคาปิดฐานะสัญญา = ราคาหุ้นอ้างอิง - ค่าธรรมเนียมล่วงหน้า + ค่าธรรมเนียม Block Trade + เงินปันผลตัวอย่างเช่น นักลงทุนส่งคำสั่ง Short Close สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงหุ้น A ที่ราคา 120 บาท หากลูกค้าถือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจำนวน 20 สัญญา (สัญญาละ 1,000 หุ้น) และมีค่าธรรมเนียม SSF Block Trade จำนวน 10,000 บาท เงินปันผลที่จะได้รับ จำนวน 2,000 บาท</p> <p>ราคาปิดฐานะสัญญา [จะเป็นดังนี้]</p> $= [(120 \times 20 \times 1,000) - 10,000 + 2,000] / (20 \times 1,000) = 120.60 \text{ บาท}$
-----------------------------	---