

2. ข้อชี้แจงผู้ลงทุนประเภทลูกค้าทั่วไป เพื่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ในตลาดอนุพันธ์  
เพื่อชี้แจงข้อมูลให้ลูกค้าเข้าใจถึงนโยบาย และระเบียบปฏิบัติของบริษัทฯ เกี่ยวกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในตลาดอนุพันธ์ ดังต่อไปนี้

## 2.1 คำจำกัดความ

### 2.1.1 ในสัญญานี้ คำว่า

“ช่วงเวลาซื้อขาย ภาคเช้า หรือ Morning Session” หมายความว่า ช่วงเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเปิดให้มีการซื้อขาย ในช่วง 9.45 น. ถึง 12.30 น. หรือตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประกาศกำหนดให้เป็นช่วงเวลาซื้อขายภาคเช้า

“ช่วงเวลาซื้อขาย ภาคบ่าย หรือ Afternoon Session” หมายความว่า ช่วงเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเปิดให้มีการซื้อขาย ในช่วง 14.15 น. ถึง 16.55 น. หรือตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประกาศกำหนดให้เป็นช่วงเวลาซื้อขายภาคบ่าย

“ช่วงเวลาซื้อขาย ภาคค่ำ หรือ Night Session” หมายความว่า ช่วงเวลาที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเปิดให้มีการซื้อขาย ในช่วง 19.00 น. ถึง 23.55 น. หรือตามที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประกาศกำหนดให้เป็นช่วงเวลาซื้อขายภาคค่ำ

“เวลาปิดทำการซื้อขายภาคปกติ” หมายความว่า เวลาปิดทำการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าภาคบ่ายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

“วันที่ T” หมายความว่า ช่วงเวลาซื้อขายภาคค่ำของวันที่ T-1 รวมกับ ช่วงเวลาซื้อขายภาคเช้าของวันที่ T และช่วงเวลาซื้อขายภาคบ่ายของวันที่ T

### ตัวอย่างเช่น

สำหรับสินค้าที่มีการซื้อขายในช่วงเวลาภาคค่ำ “วันที่ T” หมายความว่า ช่วงเวลา Night Session ของวันที่ T-1 ตลอดจนช่วงเวลา Morning Session และ Afternoon Session ของวันที่ T

สำหรับสินค้าที่ไม่มีการซื้อขายในช่วงเวลาภาคค่ำ “วันที่ T” หมายความว่า ช่วงเวลา Morning Session ของวันที่ T ตลอดจนช่วงเวลา Afternoon Session ของวันที่ T

## 2.2 อัตราหลักประกัน / ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายในการซื้อขาย

2.2.1 อัตราหลักประกัน / ค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายในการซื้อขาย สำหรับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า มีวิธีการคำนวณตามข้อกำหนดของสำนักงาน ก.ล.ด. ตลาดอนุพันธ์ สำนักหักบัญชีหรือสมาคม/ชมรมผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยบริษัทจะประกาศกำหนดเป็นคราวๆ

2.2.2 ค่าใช้จ่ายข้อ 2.2.1 ยังไม่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม

2.2.3 ค่าใช้จ่ายในการซื้อขาย ตามข้อ 2.2.1 อาจเปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นหรือลดลงได้ ตามข้อกำหนดของสำนักงาน ก.ล.ด. ตลาดอนุพันธ์ สำนักหักบัญชีหรือ สมาคม/ชมรมผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยบริษัทฯ จะประกาศกำหนดให้ทราบต่อไป

## 2.3 ประเภทของหลักประกัน

2.3.1 เงินสด หรือ ทรัพย์สินที่มีฐานะเทียบเท่าเงินสด เช่น เงินโอน หรือ เช็กที่ผ่านการเรียกเก็บเงินเรียบร้อยแล้ว

2.3.2 หลักประกันอื่นตามที่สำนักงาน ก.ล.ด. ตลาดอนุพันธ์ และสำนักหักบัญชีกำหนด

หมายเหตุ : ในขั้นต้นบริษัทฯ จะรับเฉพาะหลักประกันในข้อ 2.3.1 เท่านั้น หากมีการเปลี่ยนแปลงจะแจ้งให้ทราบต่อไป

## 2.4 การวางเงินเป็นหลักประกันครั้งแรกและการซื้อขาย

2.4.1 ลูกค้าจะต้องวางเงินเข้าบัญชีบริษัทฯ เพื่อเป็นหลักประกันเริ่มต้น ให้เพียงพอตามเกณฑ์ที่บริษัทฯ กำหนด ก่อนการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

2.4.2 การให้วงเงินลูกค้า บริษัทฯ จะประเมินจากทรัพย์สินสภาพคล่องที่ลูกค้าเปิดเผยต่อบริษัทฯ โดยพิจารณาจากความสามารถในการวางหลักประกันเริ่มต้น ซึ่งจำนวนสัญญาสูงสุดที่ลูกค้าสามารถเปิดฐานะสัญญาจะคำนวณจากวงเงินอนุมัติหารด้วยอัตราหลักประกันเริ่มต้น ที่บริษัทฯ ประกาศ

2.4.3 ลูกค้าไม่สามารถเปิดฐานะสัญญาเกินกว่าฐานะสัญญาล่วงหน้าสูงสุด ตามเกณฑ์ที่บริษัทฯ กำหนดไว้ได้

2.4.4 ลูกค้าไม่สามารถซื้อขายสัญญาได้เกินจากอำนาจซื้อที่บริษัทฯ กำหนด โดยอำนาจในการซื้อขายของลูกค้าจะคำนวณจากทรัพย์สินส่วนเกิน (Excess Equity) ในบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าหรือวงเงินที่ได้รับอนุมัติ แล้วแต่จำนวนใดจะต่ำกว่า

2.4.5 ในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทหรือชนิดใดชนิดหนึ่งต้องไม่กำหนดเพดานการให้สินเชื่อ (Concentration Limit) ที่บริษัทฯ อาจกำหนดขึ้น ซึ่งจะมีการพิจารณาและแจ้งให้ทราบเป็นคราวๆ ไป

## 2.5 การเรียกหลักประกันเพิ่ม (Call Margin) และการบังคับล้างฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Force Close)

2.5.1 ก่อนส่งคำสั่งซื้อขาย ลูกค้าจะต้องวางหลักประกันในจำนวนไม่ต่ำกว่าอัตราหลักประกันเริ่มต้น (Initial Margin ; IM) รวมค่านายหน้าและภาษีมูลค่าเพิ่มโดย IM อาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ตามประกาศของสำนักหักบัญชี (TCH)