

## สัญญาเกี่ยวกับการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trade) สำหรับสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ลูกค้าประสงค์จะทำธุรกรรมซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงหุ้นสามัญที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (Single Stock Futures หรือ “SSF”) และ/หรือ สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นสิทธิในการ “ซื้อ” หรือ “ขาย” ดัชนี SET50 (“SET50 Index Option”) กับบริษัทหลักทรัพย์ พาย จำกัด (มหาชน) (“บริษัท”) ผ่านระบบซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นการซื้อขายรายใหญ่ (“Block Trade”) ของบริษัทตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (“TFEX”)

ลูกค้าจึงขอทำหนังสือฉบับนี้ให้ไว้กับบริษัท เพื่อรับทราบข้อกำหนดในการทำธุรกรรม Block Trade และตกลงยินยอมที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดดังต่อไปนี้อย่างเคร่งครัดในธุรกรรมซื้อขายรายใหญ่ที่ลูกค้ามีคำสั่งมายังบริษัท

1. ในการทำธุรกรรมซื้อขาย Block Trade นั้น ลูกค้าจะต้องมีคำสั่งมายังบริษัท ผ่านหมายเลขโทรศัพท์ที่มีระบบบันทึกเสียงตามที่บริษัท กำหนดขึ้นเท่านั้น โดยข้อตกลงในการส่งมอบ และ/หรือ การชำระราคา ฯลฯ ให้เป็นไปตามสัญญาแต่งตั้งตัวแทนเพื่อซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ลูกค้าทำไว้กับบริษัท โดยลูกค้าและบริษัทฯ เป็นคู่สัญญา Block Trade โดยทำการซื้อขายผ่านกระดานซื้อขายรายใหญ่ใน TFEX

2. จำนวนสัญญาขั้นต่ำในการทำรายการ Block Trade ให้เป็นไปตามเกณฑ์ที่ตลาด TFEX กำหนด

3. ในการเปิดสถานะ Block Trade นั้น บริษัทจะเรียกเก็บดอกเบี้ยจากลูกค้าในอัตราไม่เกิน 6.0 ต่อปี นับจากวันที่เปิดสถานะจนถึงวันปิดสถานะ โดยดอกเบี้ยจะถูกคิดขั้นต่ำที่ 4 วัน (ถ้าลูกค้าทำการปิดสถานะก่อน 4 วัน ดอกเบี้ยจะถูกคำนวณที่ 4 วัน) ซึ่งดอกเบี้ยที่ถูกคำนวณได้นั้นจะถูกปิดเศษในทศนิยมหลักที่ 5 หากเลขในหลักดังกล่าวน้อยกว่า 0.00005 จะถูกปิดเศษทิ้งและจะถูกปิดเศษขึ้นหากจำนวนดังกล่าวมากกว่า หรือเท่ากับ 0.00005 ทั้งนี้ บริษัทขอสงวนสิทธิในการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยและจำนวนวันขั้นต่ำ

4. ราคาสูงสุด/ ต่ำสุด ให้เป็นไปตามเกณฑ์ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด (Ceiling/ Floor)

5. ลูกค้ารับทราบเป็นอย่างดีว่า เมื่อบริษัทได้รับคำสั่งทำการซื้อขาย Block Trade ของลูกค้าแล้ว บริษัทจะดำเนินการตามขั้นตอนเพื่อทำการซื้อขาย Block Trade กับลูกค้าทันที เมื่อรายการ Block Trade ของลูกค้าได้จับคู่เรียบร้อยแล้ว ลูกค้ามีหน้าที่

5.1 ต้องทำการซื้อขาย Block Trade ผ่านกระดานซื้อขายรายใหญ่ใน TFEX ตามคำสั่งดังกล่าวภายในวันทำการเดียวกันนั้น หรือ

5.2 ต้องทำการซื้อขาย Block Trade ผ่านกระดานซื้อขายรายใหญ่ใน TFEX ภายในเวลา 12.30 น. ของวันทำการถัดไป หากลูกค้าไม่สามารถทำการซื้อขายได้ตามกำหนดระยะเวลาใน 5.1 โดยมีเหตุจำเป็นและสมควร

ทั้งนี้ ในกรณีที่ลูกค้าไม่สามารถดำเนินการตาม 5.1 หรือ 5.2 ได้ ไม่ว่าด้วยกรณีใดๆ บริษัทขอสงวนสิทธิในการยกเลิกรายการ Block Trade ดังกล่าวและลูกค้าตกลงที่จะชดเชยให้บริษัทฯ ซึ่งความเสียหายใดๆ ที่บริษัทได้รับจากการเตรียมรายการ Block Trade ให้แก่ลูกค้า

6. เพื่อเป็นการยืนยันว่าลูกค้าจะต้องมาปิดสถานะ Block Trade กับ บริษัท ดังนั้นในการเปิดสถานะ Block Trade นั้น บริษัทอาจจะนำดอกเบี้ยคำนวณล่วงหน้าในอัตราร้อยละ 3.0 ต่อปีนับจากวันเปิดสถานะจนครบกำหนดอายุของสัญญาซื้อขายนั้นมาคำนวณรวมกันด้วย โดย

ก) ในกรณีการเปิดสถานะซื้อ หรือ “Long Position” ราคา Block Trade จะเท่ากับราคาหุ้น/สัญญาอ้างอิง หรือ “Underlying” บวกกับดอกเบี้ย

ข) ในกรณีการเปิดสถานะขาย หรือ "Short Position" ราคา Block Trade จะเท่ากับราคาของหุ้น/สัญญาอ้างอิงลบด้วยดอกเบี้ย

ทั้งนี้บริษัทขอสงวนสิทธิในการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ยล่วงหน้า อย่างไรก็ตามลูกค้าอาจจะต้องจ่ายดอกเบี้ยเพิ่มเติมจากที่จ่ายไว้ล่วงหน้าหรือได้รับดอกเบี้ยที่จ่ายล่วงหน้าคืนตามการคำนวณอัตราดอกเบี้ยที่กำหนดไว้ในข้อ 3

7. เมื่อลูกค้าได้มีสถานะ Block Trade SSF กับบริษัทเรียบร้อยแล้ว ลูกค้ามีหน้าที่

7.1 ต้องปิดสถานะ Block Trade SSF กับบริษัทเท่านั้น ลูกค้าไม่สามารถปิดสถานะเองใน TFE

7.2 ในวันทำการซื้อขายวันสุดท้ายของ SSF ลูกค้าจะต้องปิดสถานะ Block Trade SSF ก่อนเวลา 12.30 น. ของวันดังกล่าว โดยไม่สามารถปล่อยให้ SSF ที่ถืออยู่นั้นหมดอายุไปเองได้

ในกรณีที่ลูกค้าไม่ดำเนินการตาม 7.1 และ 7.2 ลูกค้ายินยอให้บริษัทซึ่งค่าเสียหายและค่าใช้จ่ายใดๆ ที่บริษัทจะต้องปิดสถานะทั้ง Underlying และ SSF ผ่านตลาดหลักทรัพย์และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

8. ถ้าบริษัทผู้ออกหุ้นอ้างอิงได้กำหนดจ่ายเงินปันผล

8.1 ลูกค้าเปิดสถานะซื้อ SSF ก่อนวันที่ขึ้นเครื่องหมาย XD บนหุ้นอ้างอิงตัวนั้นมีสิทธิได้รับการชำระคืนเงินปันผลในอัตรา 90% ของเงินปันผล โดยบริษัทจะคืนเงินปันผลดังกล่าวให้ลูกค้าเมื่อมีการปิดสถานะซื้อ โดยลูกค้าจะไม่ได้รับดอกเบี้ย และ/หรือ ผลประโยชน์ใดๆ เพิ่มเติมบนเงินปันผลนั้นๆ

8.2 สำหรับลูกค้าที่เปิดสถานะขาย Single Stock Futures ก่อนวันที่ขึ้นเครื่องหมาย XD บนหุ้นอ้างอิงตัวนั้น ลูกค้าจะต้องชำระคืนเงินจำนวน 100% ของเงินปันผลให้แก่บริษัท โดยบริษัทจะคำนวณเงินดังกล่าวบวกเพิ่มเข้าไปในราคา Single Stock Futures เมื่อมีการปิดสถานะขาย

9. การเปิดสถานะซื้อ SSF ลูกค้าอาจจะไม่ได้รับสิทธิใดๆ ที่ผู้ถือหุ้นอ้างอิงนั้นๆ จะได้รับซึ่งรวมถึงและไม่จำกัดเพียงสิทธิในการออกเสียง, เงินปันผลพิเศษ, การแจกหุ้นปันผลหรือใบสำคัญแสดงสิทธิ หรือ "Warrant", สิทธิในการจองซื้อหุ้นเพิ่มทุน ฯลฯ

10. บริษัทมีสิทธิที่จะปฏิเสธการทำธุรกรรมซื้อขาย SSF บน Underlying ใดๆ หรือกับลูกค้ารายใดๆ หากบริษัทเล็งเห็นถึงความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการเข้าทำธุรกรรมดังกล่าว

11. บริษัทสงวนสิทธิในการที่จะขอปิดสถานะ SSF ของลูกค้าก่อนวัน X-Date ต่างๆ ซึ่งรวมถึงแต่ไม่จำกัดเฉพาะ XD, XR, XT, XW, XS, XM, XB และ Corporate Action ต่างๆ หรือกรณีอื่นใด เช่น บริษัทจำเป็นต้องคืนหุ้นอ้างอิงที่ยืมมาจากธุรกรรม SBL หรือหุ้นอ้างอิงมีสิทธิที่อาจจะหยุดการซื้อขายโดยตลาดหลักทรัพย์ เป็นต้น โดยการขอปิดสถานะจะให้ผู้ดูแลบัญชีแจ้งต่อลูกค้าโดยทันที

12. ในการทำรายการ Block Trade ทุกครั้ง ลูกค้าขอรับรองว่า

12.1 ลูกค้ามีศักยภาพและความสามารถที่จะเข้าทำธุรกรรมได้ อาทิ มี Excess Equity (EE) และมีวงเงินในบัญชีอย่างเพียงพอ

12.2 ลูกค้าจะไม่ทำรายการ Block Trade ตามข้อตกลงนี้ในลักษณะที่ทำให้หรืออาจทำให้เกิดการกระทำไม่เป็นธรรมต่อการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใน TFE เช่น การทำให้ราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าผิดไปจากสภาพปกติของตลาด เป็นต้น

13. การที่บริษัทยอมผ่อนผัน สละสิทธิ หรือไม่บังคับใช้เงื่อนไขข้อใดๆ ในข้อตกลงนี้ หรือยอมผ่อนผันเมื่อลูกค้าผิดข้อตกลงหรือผิดนัด มิให้ถือว่าการผ่อนผันดังกล่าวมีผลต่อเนื่อง อีกทั้งการผ่อนผันดังกล่าวนี้ จะไม่ถือเป็นการสละสิทธิของบริษัท และจะไม่เป็นผลเป็นการตัดสิทธิบริษัทที่จะบังคับใช้เงื่อนไขข้อกำหนดใดๆ ของข้อตกลงนี้ในภายหลัง การใช้สิทธิทางศาลหรือกระทำการใดๆ เมื่อลูกค้าผิดข้อตกลงหรือผิดนัดในภายหลัง