

ส่วนที่ 1  
ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

1. ข้อมูลทั่วไป

|                       |  |
|-----------------------|--|
| ชื่อบริษัท            | บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด<br>(SCB Securities Company Limited)   |
| ลักษณะการประกอบธุรกิจ | บริษัทฯ ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 และพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546  |
| ที่ตั้งสำนักงานใหญ่   | เลขที่ 19 อาคาร 3 ชั้น 2, 20-21 ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า ถนนรัชดาภิเษก แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพมหานคร 10900   |
| เลขทะเบียนบริษัท      | 0105538025143  |
| โฮมเพจบริษัท          | www.scbs.com   |
| โทรศัพท์              | 0-2949-1000  |
| โทรสาร                | 0-2949-1001  |
| อีเมล                 | scbs.customerservice@scb.co.th   |
| สำนักงานสาขา          | ณ วันที่ 14 พฤษภาคม 2563 มีสาขา 6 แห่ง ดังนี้<br><br>1) สาขาเฉลิมนคร<br>เลขที่ 269 อาคารมมถนนเจริญกรุง-วรจักร แขวงป้อมปราบ เขตป้อมปราบศัตรูพ่าย กรุงเทพมหานคร 10100<br><br>2) สาขาสินธร<br>เลขที่ 130-132 อาคารสินธรทาวเวอร์ 1 ชั้น G ถนนวิฑู แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330 |

|                            |  |
|----------------------------|--|
|                            | <p>3) สาขารามาธิบดี<br/>เลขที่ 270 ถนนพระราม 6 แขวงทุ่งพญาไท เขตราชเทวี กรุงเทพมหานคร 10400</p> <p>4) สาขาถนนราชกรีฑินดี (หาดใหญ่)<br/>เลขที่ 16/4 ชั้น 2 ถนนราชกรีฑินดี ตำบลคอหงส์ อำเภอหาดใหญ่ จังหวัดสงขลา 90110</p> <p>5) สาขาเซ็นทรัลพลาซ่า ปิ่นเกล้า<br/>เลขที่ 7/222 อาคารศูนย์การค้าเซ็นทรัลพลาซ่า ปิ่นเกล้า ชั้น 4 ห้องเลขที่ 431 ถนนบรมราชชนนี แขวงอรุณ อัมรินทร์ เขตบางกอกน้อย กรุงเทพมหานคร 10700</p> <p>6) สาขาเชียงใหม่<br/>เลขที่ 90/1 ชั้น 5 ยูนิต 512 โครงการแอร์ พอร์ต บิสิเนส พาร์ค อาคาร D ถนนมหิดล ตำบลหายยา อำเภอเมืองเชียงใหม่ จังหวัดเชียงใหม่ 50100</p> |
| ทุนจดทะเบียน               | 2,400 ล้านบาท ประกอบด้วย หุ้นสามัญจำนวน 240,000,000 หุ้น<br>มูลค่าหุ้นที่ตราไว้หุ้นละ 10 บาท   |
| ทุนที่ออกและชำระเต็มมูลค่า | 2,100 ล้านบาท ประกอบด้วย หุ้นสามัญจำนวน 210,000,000 หุ้น<br>มูลค่าหุ้นที่ตราไว้หุ้นละ 10 บาท   |
| นายทะเบียนหลักทรัพย์       | <p>บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด</p> <p>เลขที่ 93 ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพมหานคร 10400</p> <p>โทรศัพท์ : 0-2009-9000 โทรสาร : 0-2009-9991</p> <p>SET Contact Center: 0 2009-9999</p> <p>Website: <a href="http://www.set.or.th/tsd">http://www.set.or.th/tsd</a></p> <p>E-mail: SETContactCenter@set.or.th</p>  |

|                  |  |
|------------------|--|
| ผู้สอบบัญชี      | บริษัท เคพีเอ็มจี ภูมิไทย สอบบัญชี จำกัด<br>เลขที่ 1 อาคาร เอ็มไพร์ ทาวเวอร์ ชั้น 48-50 ถนนสาทรใต้ แขวงยาน<br>นาวา เขตสาทร กรุงเทพมหานคร 10210<br>โทรศัพท์ : 0-2677-2000                               |
| ผู้ดูแลสภาพคล่อง | บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด<br>เลขที่ 19 อาคาร 3 ชั้น 2, 20-21 ไทยพาณิชย์ ปาร์ค พลาซ่า<br>ถนนรัชดาภิเษก แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กรุงเทพมหานคร 10900<br>โทรศัพท์ : 0-2949-1000 โทรสาร: 0-2949-1001 |

## 2. ปัจจัยความเสี่ยง

### 2.1 ความเสี่ยงเกี่ยวกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

#### 2.1.1 ความเสี่ยงจากความผันผวนของราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีคุณสมบัติคล้ายตราสารอนุพันธ์ทั่วไป คือ เป็น Leverage Product กล่าวคือ ใช้เงินลงทุนที่น้อยกว่าเพื่อสร้างโอกาสได้รับอัตราผลตอบแทนที่มากกว่า และในขณะเดียวกัน ราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ก็อาจมีการเปลี่ยนแปลงขึ้นลงอย่างรวดเร็ว ซึ่งเป็นโอกาสในการสร้างผลกำไรให้กับนักลงทุนได้สูง และในทางตรงกันข้ามถ้านักลงทุนคาดการณ์ทิศทางราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ผิดก็จะทำให้เกิดผลขาดทุนที่สูงด้วยเช่นกัน โดยผลขาดทุนสูงสุดจะจำกัดที่เงินลงทุนที่นักลงทุนใช้ในการซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ดังนั้น ก่อนตัดสินใจลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ นักลงทุนควรศึกษาปัจจัยที่มีผลกระทบต่อราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อย่างระมัดระวังก่อนตัดสินใจลงทุน

ปัจจัยสำคัญที่มีผลต่อราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ มีดังนี้

##### (ก) อุปสงค์และอุปทานของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ราคาซื้อขายของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจปรับตัวสูงขึ้นหรือลดลงอย่างรวดเร็ว ตามอุปสงค์และอุปทานของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์รุ่นนั้น ๆ

##### (ข) ปัจจัยที่มีผลต่อราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ตามทฤษฎีของ Black & Scholes

นักลงทุนควรศึกษาปัจจัยที่มีผลต่อราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ทั้งประเภทสิทธิในการซื้อ (“คอลลอร์แรนต์”) และประเภทสิทธิในการขาย (“พุทเทอร์แรนต์”) โดยปัจจัยที่มีผลต่อราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ มีทั้งหมด 6 ปัจจัย คือ ราคาของสินค้ายอ้างอิง ราคาใช้สิทธิ ความผันผวนของราคาสินค้ายอ้างอิง อายุคงเหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ อัตราดอกเบี้ย และเงินปันผลของสินค้ายอ้างอิง (ถ้ามี) ซึ่งเมื่อปัจจัยต่างๆ เหล่านี้มีการเปลี่ยนแปลง โดยทฤษฎีแล้วจะทำให้ราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีการเปลี่ยนแปลงตามไปด้วย ซึ่งสามารถสรุปได้ ดังต่อไปนี้

##### 1. ราคาสินค้ายอ้างอิง (เช่น ราคาหุ้นอ้างอิง ราคาดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง เป็นต้น)

- เมื่อราคาสินค้ายอ้างอิงปรับตัวสูงขึ้น ราคาคอลลอร์แรนต์จะปรับตัวสูงขึ้น ในขณะที่ราคาพุทเทอร์แรนต์จะปรับตัวลดลง
- เมื่อราคาสินค้ายอ้างอิงปรับตัวลดลง ราคาคอลลอร์แรนต์จะปรับตัวลดลง ในขณะที่ราคาพุทเทอร์แรนต์จะปรับตัวเพิ่มขึ้น

## 2. ราคาใช้สิทธิ

- เมื่อราคาใช้สิทธิที่นักลงทุนเป็นผู้เลือกสูงขึ้น ราคาคอลลอร์แรนต์จะลดลง ในขณะที่ราคาพวอร์แรนต์จะเพิ่มขึ้น
- เมื่อราคาใช้สิทธิที่นักลงทุนเป็นผู้เลือกลดลง ราคาคอลลอร์แรนต์จะสูงขึ้น ในขณะที่ราคาพวอร์แรนต์จะลดลง

## 3. ความผันผวนของราคาสินค้าอ้างอิง

- เมื่อความผันผวนของราคาสินค้าอ้างอิงปรับตัวสูงขึ้น ราคาคอลลอร์แรนต์ และราคาพวอร์แรนต์จะปรับตัวเพิ่มขึ้นโดยส่วนใหญ่
- เมื่อความผันผวนของราคาสินค้าอ้างอิงปรับตัวลดลง ราคาคอลลอร์แรนต์ และราคาพวอร์แรนต์จะปรับตัวลดลงโดยส่วนใหญ่

## 4. อายุคงเหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

- เมื่ออายุคงเหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ลดลง ราคาคอลลอร์แรนต์ และราคาพวอร์แรนต์จะปรับตัวลดลงโดยส่วนใหญ่

## 5. อัตราดอกเบี้ย

- เมื่ออัตราดอกเบี้ยปรับตัวสูงขึ้น ราคาคอลลอร์แรนต์จะปรับตัวสูงขึ้น ในขณะที่ราคาพวอร์แรนต์จะปรับตัวลดลง
- เมื่ออัตราดอกเบี้ยปรับตัวลดลง ราคาคอลลอร์แรนต์จะปรับตัวลดลง ในขณะที่ราคาพวอร์แรนต์จะปรับตัวเพิ่มขึ้น

## 6. เงินปันผลของสินค้านอ้างอิง

- เมื่ออัตราเงินปันผลของสินค้านอ้างอิงปรับตัวสูงขึ้น ราคาคอลลอร์แรนต์จะปรับตัวลดลง ในขณะที่ราคาพวอร์แรนต์จะปรับตัวเพิ่มขึ้น
- เมื่ออัตราเงินปันผลของสินค้านอ้างอิงปรับตัวลดลง ราคาคอลลอร์แรนต์จะปรับตัวสูงขึ้น ในขณะที่ราคาพวอร์แรนต์จะปรับตัวลดลง

### 2.1.2 ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

เนื่องจากจำนวนของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ออกในแต่ละวันนั้นมีปริมาณที่น้อยเมื่อเทียบกับหลักทรัพย์ทั่วไปที่ทำการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ ดังนั้นนักลงทุนจึงอาจมีความเสี่ยงด้านสภาพคล่องในการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้

การกระจายการถือครองใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของนักลงทุนยังส่งผลต่อสภาพคล่องของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ด้วย กล่าวคือ ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีแนวโน้มที่จะมีสภาพคล่องสูงเมื่อมีการกระจายการถือครองให้นักลงทุนจำนวนมาก และมีแนวโน้มที่จะมีสภาพคล่องต่ำเมื่อเป็นการกระจายให้นักลงทุนเพียงน้อยราย นักลงทุนสามารถหาข้อมูลการกระจายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้จากเว็บไซต์ตลาดหลักทรัพย์ฯ และในกรณีที่ผู้ออกสามารถกระจายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้เกินกว่า 50% ของจำนวนที่ขออนุญาต ผู้ออกสามารถออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ส่วนเพิ่ม เพื่อเสนอขายให้แก่นักลงทุนเพิ่มเติมได้ ซึ่งจะช่วยเพิ่มสภาพคล่องให้กับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ทั้งนี้ เพื่อเป็นการดูแลสภาพคล่องให้กับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ออกได้จัดให้มีผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market Maker) สำหรับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องคือการส่งราคาเสนอซื้อและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เพื่อให้ส่วนต่างระหว่างราคาเสนอซื้อและเสนอขายของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อยู่ในกรอบราคา และปริมาณที่กำหนดไว้ นอกจากนี้ ผู้ดูแลสภาพคล่องอาจซื้อหรือขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์โดยไม่ใช่เป็นการตั้งราคาเสนอซื้อหรือราคาเสนอขายได้ด้วย อย่างไรก็ตาม กรณีที่การซื้อขายเปลี่ยนมือของตราสารในตลาดรองอาจมีไม่มากนัก สภาพคล่องของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ขึ้นอยู่กับอุปสงค์หรืออุปทานของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และความสามารถในการรักษาสภาพคล่องของผู้ดูแลสภาพคล่อง รวมทั้งข้อกำหนดในการดูแลสภาพคล่องของผู้ดูแลสภาพคล่องแต่ละราย ซึ่งนักลงทุนมีความเสี่ยงที่อาจจะไม่สามารถขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในจำนวนที่ต้องการได้หากระบบของผู้ดูแลสภาพคล่องเกิดขัดข้อง ทั้งนี้ นักลงทุนควรศึกษาถึงกฎระเบียบ เงื่อนไข และข้อกำหนดของผู้ดูแลสภาพคล่อง ในส่วนที่ 1 ของข้อกำหนดสิทธิอย่างละเอียดก่อนการลงทุน

### 2.1.3 ความเสี่ยงด้านความสามารถในการชำระราคา หรือส่งมอบหลักทรัพย์ตามภาระผูกพันของผู้ออก

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ออกและเสนอขายนี้เป็นใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ชนิดไม่มีการรับฝากทรัพย์สินเป็นหลักประกัน นักลงทุนจึงมีความเสี่ยงเกี่ยวกับความสามารถของผู้ออกในการชำระราคา หรือส่งมอบหลักทรัพย์ตามภาระผูกพันของผู้ออก โดยนักลงทุนจัดเป็นเจ้าหนี้ลำดับเดียวกันกับเจ้าหนี้ของผู้ออกประเภทเจ้าหนี้ไม่มีหลักประกันที่มีรายชื่ออยู่ในช่วงที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้นๆ ยังไม่ครบกำหนดอายุ

นักลงทุนควรศึกษาข้อมูลและคุณสมบัติของผู้ออก พร้อมทั้งศึกษาปัจจัยความเสี่ยงที่เกี่ยวกับการดำเนินงานของผู้ออก ฐานะการเงิน ผลการดำเนินงานที่ผ่านมา และอันดับเครดิต โดยผู้ออกได้รับการ

จัดอันดับความน่าเชื่อถือจากบริษัท ฟิทช์ เรตติ้งส์ (ประเทศไทย) จำกัด ที่อันดับความน่าเชื่อถือเท่ากับ AA(thai) (ข้อมูล ณ วันที่ 2 เมษายน 2563) ซึ่งเป็นคุณสมบัติหนึ่งของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ตามเกณฑ์ของสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลของผู้ออกเพิ่มเติมได้จากแบบ 69-DW-full รวมทั้ง ศึกษาเหตุผลผิดนัดและผลของการผิดนัดตามส่วนที่ 2 ของข้อกำหนดสิทธิอย่างละเอียดก่อนการลงทุน

## 2.2 ความเสี่ยงที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิง

ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง (“บริษัทอ้างอิง”) อาจมีการกระทำการบางอย่าง (Corporate Action) ที่ส่งผลกระทบต่อราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ วันครบกำหนดอายุ อัตราใช้สิทธิต่อหน่วย หรือราคาใช้สิทธิได้เพื่อประโยชน์สูงสุดของนักลงทุน ผู้ออกอาจพิจารณาปรับสิทธิใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ตามสูตรคำนวณและเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น โดยสามารถสรุปผลกระทบจาก Corporate Action ต่อ ข้อกำหนดดังกล่าวข้างต้นได้ดังนี้

- **กรณีที่บริษัทอ้างอิงทำการจัดสรรหุ้นใหม่ให้ผู้ถือหุ้นเดิมของบริษัทอ้างอิง โดยราคาของซื้อหุ้นใหม่ ต่ำกว่าราคาปิดของหุ้นอ้างอิง ณ วันทำการสุดท้ายก่อนขึ้นเครื่องหมาย XR**  
ราคาใช้สิทธิหลังการปรับสิทธิจะลดลง และอัตราการใช้สิทธิต่อหน่วยจะถูกปรับสูงขึ้น
- **กรณีบริษัทอ้างอิงมีการจ่ายหุ้นปันผล**  
ราคาใช้สิทธิหลังการปรับสิทธิจะลดลง และอัตราการใช้สิทธิต่อหน่วยจะถูกปรับสูงขึ้น
- **กรณีบริษัทอ้างอิงมีการแบ่งแยกหุ้น**  
ราคาใช้สิทธิหลังการปรับสิทธิจะลดลง และอัตราการใช้สิทธิต่อหน่วยจะถูกปรับสูงขึ้น
- **กรณีบริษัทอ้างอิงมีการรวมหุ้น**  
ราคาใช้สิทธิหลังการปรับสิทธิจะสูงขึ้น และอัตราการใช้สิทธิต่อหน่วยจะถูกปรับลดลง
- **กรณีบริษัทอ้างอิงมีการควบรวมกิจการ**

ผู้ออกจะเลื่อนวันครบกำหนดอายุของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นวันทำการซื้อขายสุดท้ายของหุ้นอ้างอิง ทั้งนี้ นักลงทุนยังคงใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิ

ในสถานะที่ปัจจัยอื่น ๆ คงที่ การเลื่อนวันครบกำหนดอายุของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ให้เป็นวันทำการซื้อขายสุดท้ายของหุ้นอ้างอิง จะทำให้อายุคงเหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ลดลง ส่งผลให้ราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ปรับตัวลดลง

- **กรณีบริษัทอ้างอิงเพิกถอนหุ้นอ้างอิงจากการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์**

ในกรณีที่มีการเพิกถอนหุ้นอ้างอิงออกจากการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ก่อนวันครบกำหนดอายุของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์โดยคำสั่งของตลาดหลักทรัพย์ฯ หรือที่ประชุมผู้ถือหุ้นของบริษัทอ้างอิง ผู้ออกจะทำการเลื่อนวันครบกำหนดอายุของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นวันทำการที่สาม (3) นับถัดจากวันทำการซื้อขายสุดท้ายของใบสำคัญแสดงสิทธิ ส่งผลให้อายุคงเหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ลดลง โดยส่วนใหญ่จะทำให้ราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ประเภทคอลลอร์แวร์และพุทวอร์แวร์จะปรับตัวลดลงด้วย

- **กรณีหุ้นอ้างอิงถูกระงับหรือหยุดการซื้อขาย**

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะถูกระงับการซื้อขาย หรือหยุดส่งคำสั่งซื้อโดยการขึ้นเครื่องหมาย Suspension (SP) หรือ Halt (H) เช่นเดียวกับหุ้นอ้างอิง ซึ่งจะทำให้นักลงทุนไม่สามารถซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้

- **กรณีการชำระบัญชีของบริษัทอ้างอิง**

ในกรณีที่ที่ประชุมผู้ถือหุ้นของบริษัทอ้างอิงมีมติให้เลิกบริษัทอ้างอิง หรือแต่งตั้งผู้ชำระบัญชี หรือศาลมีคำสั่งถึงที่สุดให้เลิกบริษัทอ้างอิง หรือให้พิทักษ์ทรัพย์เด็ดขาด ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ยังไม่ได้ใช้สิทธิทั้งหมดจะถูกยกเลิกและไม่สามารถนำไปใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้อีก โดยใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะถูกยกเลิก ณ วันที่ที่ประชุมผู้ถือหุ้นของบริษัทอ้างอิงมีมติ หรือตามวันที่ที่ศาลกำหนดหรือมีคำสั่ง แล้วแต่กรณี การยกเลิกดังกล่าว ส่งผลให้ราคาทางทฤษฎีของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์กลายเป็นศูนย์ทันที

ผู้ออกอาจพิจารณาทำการปรับอัตราสิทธิต่อหน่วย และ/หรือราคาใช้สิทธิ (“การปรับสิทธิ”) เพื่อให้มีความเหมาะสมกับสภาพตลาดและสถานการณ์ที่เกี่ยวข้อง อย่างไรก็ตาม หากอัตราการใช้สิทธิหรือราคาใช้สิทธิภายหลังการปรับสิทธิ ไม่ว่าจะกรณีใดๆ เปลี่ยนแปลงไปจากเดิมน้อยกว่าร้อยละสาม (3) (หลังจากได้มีการปรับทศนิยมตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิแล้ว) ผู้ออกไม่จำเป็นต้องทำการปรับสิทธิ แต่จำนวนที่มีได้ทำการปรับสิทธินี้ จะต้องนำไปคำนวณรวมในการปรับสิทธิครั้งต่อไป (ถ้ามี) นักลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลการปรับสิทธิได้ในส่วนที่ 3 ของข้อกำหนดสิทธิ



## 2.3 ปัจจัยความเสี่ยงที่เกี่ยวกับการดำเนินงานของผู้ออก

### 2.3.1 ความเสี่ยงจากความผันผวนของภาวะตลาด

รายได้หลักของบริษัทฯ ได้รับจากค่าธรรมเนียมหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งผลการดำเนินงานของธุรกิจดังกล่าวขึ้นอยู่กับปัจจัยภายนอกหลายประการที่อยู่นอกเหนือการควบคุมของบริษัทฯ เช่น ภาวะเศรษฐกิจ ความมั่นคงทางการเมือง และความเชื่อมั่นของนักลงทุน ซึ่งเป็นปัจจัยที่อาจก่อให้เกิดความผันผวนทางด้านราคาหลักทรัพย์ และส่งผลกระทบต่อรายได้หลักของบริษัทฯ ทั้งนี้ บริษัทฯ มีนโยบายและแนวทางเพื่อลดความเสี่ยงจากผลกระทบดังกล่าว และเพื่อสร้างรายได้ที่สม่ำเสมอให้กับองค์กร โดยที่ผ่านมา บริษัทฯ ได้ดำเนินการขยายขอบเขตการดำเนินธุรกิจการเงินในหน่วยงานที่เกี่ยวข้องอย่างต่อเนื่อง ภายใต้นโยบายดำเนินธุรกิจร่วมกับธนาคารไทยพาณิชย์ พัฒนาเครือข่ายในการให้บริการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ต เพื่อเพิ่มศักยภาพในการให้บริการและเป็นการขยายฐานลูกค้าของบริษัทฯ ได้ในระยะยาว

### 2.3.2 ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์

ในปัจจุบันธุรกิจหลักทรัพย์มีการแข่งขันที่รุนแรง ส่วนหนึ่งเกิดจากการควบรวมกิจการระหว่างบริษัทหลักทรัพย์ด้วยกันหรือสถาบันการเงินอื่นหรือบริษัทแม่ ได้แก่ ธนาคาร หรือสถาบันการเงินในต่างประเทศเพื่อเพิ่มศักยภาพในการแข่งขันและเพิ่มส่วนแบ่งทางการตลาดมากยิ่งขึ้น ประกอบกับการเปิดเสรีในธุรกิจหลักทรัพย์อย่างเต็มรูปแบบ

ทั้งนี้ บริษัทฯ มีนโยบายเพื่อรองรับผลกระทบจากการแข่งขันที่มีความรุนแรงด้วยกลยุทธ์การพัฒนาทางด้านเทคโนโลยี นวัตกรรมทางการเงิน ความหลากหลายของผลิตภัณฑ์ การเพิ่มคุณภาพในบทวิเคราะห์หลักทรัพย์ และประสิทธิภาพของบุคลากร เพื่อเป็นการตอบสนองความต้องการ และเสริมสร้างความไว้วางใจให้กับลูกค้า รวมถึงเป็นการเพิ่มมูลค่าผลิตภัณฑ์ในการให้บริการของบริษัทฯ ได้เป็นอย่างดี

### 2.3.3 ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่

บริษัทฯ ยังคงตระหนักถึงความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่และมีนโยบายลดความเสี่ยงจากการกระจุกตัวของกลุ่มลูกค้า โดยมีนโยบายขยายฐานลูกค้าหลักทรัพย์ และมุ่งเน้นการให้บริการในรูปแบบที่หลากหลายสำหรับลูกค้ารายย่อยและสถาบันเพื่อตอบสนองความต้องการของลูกค้าในแต่ละกลุ่ม อีกทั้งบริษัทฯ มีนโยบายสนับสนุนให้ทีมผู้แนะนำการลงทุนมุ่งเน้นในการขยายฐานลูกค้าของตนเองอย่างต่อเนื่อง เพื่อเป็นการเพิ่มสัดส่วนรายได้จากฐานลูกค้าใหม่ และลดความเสี่ยงจากการกระจุกตัวของกลุ่มลูกค้ารายใหญ่ได้อย่างต่อเนื่อง

### 2.3.4 ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่าย และความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ในการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์อาจมีความเสี่ยงจากผลขาดทุนและสภาพคล่องทางการเงิน หากบริษัทไม่สามารถจำหน่ายหลักทรัพย์ที่รับประกันการจำหน่ายได้ทั้งหมด และต้องรับหลักทรัพย์ที่เหลือดังกล่าวเข้าบัญชีของบริษัท ซึ่งปัจจัยที่มีผลกระทบต่อความเสี่ยงจากการจัดจำหน่าย ได้แก่ การกำหนดราคาขายที่ไม่เหมาะสม ความผันผวนของตลาดเงินและตลาดทุน เป็นต้น อย่างไรก็ตาม บริษัทมีมาตรการในการป้องกันความเสี่ยงดังกล่าว โดยกำหนดให้มีแนวทางการขออนุมัติสำหรับการรับประกันการจำหน่ายที่ชัดเจน รวมถึงได้ร่วมมือกับธนาคารไทยพาณิชย์ ซึ่งเป็นบริษัทแม่ที่มีความเชี่ยวชาญเฉพาะด้าน และมีฐานลูกค้ารายใหญ่เป็นจำนวนมาก เป็นผู้ทำการวิเคราะห์ราคาเสนอขายที่เหมาะสมของหลักทรัพย์ และทางบริษัทได้มีการสำรวจความต้องการซื้อหลักทรัพย์ของนักลงทุน ศึกษาและเผยแพร่ข้อมูลจุดเด่นของหลักทรัพย์ที่เสนอขาย และทำหน้าที่ติดตามประเมินสถานะตลาดเงินและตลาดทุนอย่างใกล้ชิดและต่อเนื่อง ก่อนที่จะตกลงรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์นั้น นอกจากนี้บริษัทได้รับการสนับสนุนด้านวงเงินกู้ยืมเงินจากธนาคารไทยพาณิชย์ เพื่อรองรับการดำเนินงานกองทุนสภาพคล่อง (NCR) ของบริษัทในสถานะการณ์ฉุกเฉินให้เป็นไปตามเกณฑ์ที่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์กำหนด

### 2.3.5 ความเสี่ยงจากการผิมนัดชำระเงินจากลูกค้า

บริษัท มีความเสี่ยงจากการผิมนัดชำระเงินของลูกค้าจากธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์และความเสี่ยงจากการเรียกให้วางหลักประกัน หรือแม้จะมีการบังคับขายหลักประกันแต่มูลค่าที่ได้รับไม่เพียงพอต่อมูลหนี้ที่เกิดขึ้นจากธุรกรรมดังกล่าว บริษัทมีนโยบายที่จะป้องกันความเสี่ยงจากการผิมนัดชำระหนี้และหนี้สูญ โดยให้ความสำคัญในการพิจารณาคัดเลือกลูกค้าเพื่อให้ได้ลูกค้าที่มีคุณภาพ รวมทั้งมีแนวทางกำหนดวงเงินให้เหมาะสมตามฐานะการเงิน ความสามารถในการชำระหนี้ สภาพคล่องทางการเงิน และประสิทธิภาพการลงทุนของลูกค้า อีกทั้ง บริษัทกำหนดให้มีการทบทวนวงเงินของลูกค้าอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง เพื่อให้เหมาะสมกับการลงทุนของลูกค้า รวมทั้งมีมาตรการดำเนินการสำหรับลูกค้าที่มีการชำระราคาหลักทรัพย์ล่าช้า และกำหนดให้ลูกค้าวางหลักประกันสำหรับการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสดเต็มจำนวน ก่อนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่บริษัทพิจารณาแล้วมีความเห็นว่าเป็นหลักทรัพย์ที่มีความเสี่ยงสูง ซึ่งถือว่าเป็นมาตรการที่ช่วยลดความเสี่ยงดังกล่าวได้เช่นกัน

สำหรับการให้บริการบัญชีเครดิตบาลานซ์ บริษัทฯมีแนวทางคัดเลือกหลักทรัพย์คุณภาพจากปัจจัยพื้นฐานและสภาพคล่องหลักทรัพย์เพื่อการปล่อยกู้หลักทรัพย์ที่มีคุณภาพและสามารถควบคุมความเสี่ยงด้านการให้สินเชื่อของบริษัทฯให้อยู่ในระดับที่ยอมรับได้

### 2.3.6 ความเสี่ยงทางด้านบุคลากร

ธุรกิจหลักทรัพย์เป็นธุรกิจการให้บริการต้องอาศัยความรู้ ความสามารถ ความเชี่ยวชาญและประสบการณ์ของบุคลากรเป็นสำคัญ ดังนั้น การสูญเสียบุคลากร โดยเฉพาะบุคลากรหลักอาจส่งผลกระทบต่อความต่อเนื่องในการดำเนินงานหรือการสูญเสียลูกค้าที่สำคัญได้ซึ่งส่งผลกระทบต่อชื่อเสียงและรายได้ของบริษัทฯ ดังนั้น เพื่อป้องกันการสูญเสียบุคลากร บริษัทฯมีโครงการอบรมทั้งในระยะสั้นและโครงการอบรมแบบต่อเนื่อง เพื่อพัฒนาความรู้ความสามารถของพนักงานในทุกระดับและทุกสายงาน เพื่อให้ได้รับความรู้สำหรับธุรกรรมใหม่ๆของบริษัทฯ และความรู้ในด้านต่าง ๆ ที่เพิ่มทักษะในการให้บริการ และได้มีการกำหนด Career Path ของแต่ละสายงานอย่างชัดเจน ประกอบกับได้จัดให้มีผลตอบแทนที่เหมาะสม สอดคล้องกับสถานะอุตสาหกรรมและข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ในการกำหนดอัตราผลตอบแทนสำหรับเจ้าหน้าที่การตลาด เช่น เงินเดือน โบนัส สวัสดิการ ทั้งนี้ เพื่อเป็นแรงจูงใจสำหรับพนักงาน และลดความเสี่ยงจากการสูญเสียเจ้าหน้าที่การตลาดได้อีกทางหนึ่ง

### 2.3.7 ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบคอมพิวเตอร์

ระบบคอมพิวเตอร์เป็นปัจจัยที่สำคัญในการประกอบธุรกิจ การขัดข้องของระบบดังกล่าวจะส่งผลกระทบต่อตรงต่อการดำเนินงานและความน่าเชื่อถือของบริษัทฯ ปัจจุบันบริษัทฯ ใช้ระบบซอฟต์แวร์สำหรับธุรกิจนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ ซึ่งเป็นระบบคอมพิวเตอร์หลักที่ใช้ในธุรกิจหลักทรัพย์ ประกอบด้วยระบบที่สำคัญ ได้แก่ ส่วนระบบ Front Office Integrated System (FIS) และ Settrade ซึ่งเป็นระบบซื้อขายหลักทรัพย์แบบเรียลไทม์ (Real Time) ทำให้ลูกค้าสามารถส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้โดยการเชื่อมต่อผ่านระบบเครือข่ายอินเทอร์เน็ต และระบบ Securities Back-Office Automation (SBA) ระบบ Back office Service Bureau (BSB) ซึ่งเป็นระบบเกี่ยวกับการชำระราคาซื้อขายหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าระหว่างบริษัทกับลูกค้าและศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ รวมทั้งประมวลผลและจัดการระบบข้อมูลต่างๆ เช่น การดูแลรักษาทรัพย์สินของลูกค้า วงเงินเครดิตของลูกค้า รายงานอัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ เป็นต้น

บริษัทฯ ได้ร่วมมือกับธนาคารไทยพาณิชย์ ในการทำหน้าที่เป็นผู้ดูแล สนับสนุน พัฒนาระบบคอมพิวเตอร์ รวมถึงระบบความปลอดภัยในการใช้ข้อมูล การเข้าถึงข้อมูลของลูกค้า และพนักงาน ซึ่งมีการพัฒนา ปรับปรุงและเพิ่มประสิทธิภาพของระบบอย่างต่อเนื่อง ทำให้เกิดการใช้ทรัพยากรได้อย่างมี

ประสิทธิภาพและคุ้มค่าต่อการลงทุน โดยธนาคารไทยพาณิชย์มีศูนย์คอมพิวเตอร์สำรองเพื่อรองรับกรณีเกิดเหตุการณ์ฉุกเฉินสำหรับบริษัทฯ ได้อย่างมีประสิทธิภาพ

บริษัทฯ กำหนดให้มีการจัดทำแผนทดสอบระบบคอมพิวเตอร์และระบบการปฏิบัติการ (Disaster Recovery Testing :DRT) ตลอดจนทดสอบแผนรองรับการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง (Business Continuity Plan : BCP) เป็นประจำทุกปีอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง ทั้งนี้ เพื่อให้เกิดความมั่นใจว่าเมื่อเกิดเหตุการณ์วิกฤต บริษัทฯ มีแผนฉุกเฉินที่สามารถรองรับการทำงานได้อย่างมีประสิทธิภาพ

## 2.4 ความเสี่ยงจากเหตุการณ์ขัดข้องในการชำระราคา

“เหตุการณ์ขัดข้องในการชำระราคา” หมายถึง เหตุการณ์ที่อยู่นอกเหนือการควบคุมของผู้ออก และไม่ได้เกิดจากความผิดของผู้ออก ซึ่งทำให้ผู้ออกไม่สามารถชำระราคาให้ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ใช้สิทธิได้ ซึ่งรวมถึงแต่ไม่จำกัดเฉพาะเหตุการณ์ดังต่อไปนี้

- 1) เกิดสงครามหรือจลาจลในประเทศหรือต่างประเทศ หรือเหตุอื่นใดที่มีผลทำให้ไม่สามารถซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ได้ตามปกติ
- 2) ตลาดหลักทรัพย์ฯ สั่งพักการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงไม่ว่าด้วยเหตุใด
- 3) มีข้อกำหนดตามกฎหมาย หรือคำสั่งของหน่วยงานที่เกี่ยวข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และ/หรือ ที่มีผลกระทบต่อการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงจนทำให้ไม่สามารถหาราคาอ้างอิงได้

โดยหากมีเหตุการณ์ขัดข้องในการชำระราคาเกิดขึ้น ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจได้รับเงินส่วนต่างสุทธิ (ถ้ามี) ค่าซ้ำ ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ควรศึกษาการใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และการชำระราคา ในส่วนที่ 3 ของข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้นๆ อย่างละเอียดถี่ถ้วน

## 2.5 ความเสี่ยงด้านความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Credit Risk)

ความเสี่ยงที่บริษัทผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะผิดนัดชำระราคาเมื่อถึงเวลาใช้สิทธิ ถือเป็นความเสี่ยงหนึ่งที่ผู้ลงทุนต้องให้ความสนใจ โดยผู้ลงทุนอาจศึกษาข้อมูลคุณสมบัติของผู้ที่สามารถออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จากหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง พร้อมทั้งศึกษาฐานะทางการเงินของบริษัท อันดับความน่าเชื่อถือ และผลการดำเนินงานที่ผ่านมา เพื่อสร้างความมั่นใจในการลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของ

ผู้ออกรายนั้น ๆ เป็นการป้องกันความเสี่ยงจากการผันผวนของราคาหุ้น ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลของผู้ออกได้จากแบบ 69-DW-Full Form ซึ่งจะมีการปรับปรุงให้เป็นปัจจุบันอยู่เสมอ

ทั้งนี้ บริษัทฯ ได้รับการจัดอันดับเครดิตจาก บริษัท ฟิทช์ เรตติ้ง (ประเทศไทย) ที่ 'AA (tha)' สำหรับอันดับเครดิตในประเทศระยะยาว โดยมีแนวโน้มอันดับเครดิตมีเสถียรภาพ และอันดับเครดิตภายในประเทศระยะสั้น ที่ 'F1+ (tha)' (ข้อมูล ณ วันที่ 2 เมษายน 2563) ซึ่งสะท้อนถึงความน่าเชื่อถือ และประสิทธิภาพในการดำเนินงานของบริษัท

## 2.6 ความเสี่ยงอื่นที่เกี่ยวข้อง

### 2.6.1 ความเสี่ยงเนื่องจากผู้ดูแลสภาพคล่องไม่สามารถปฏิบัติหน้าที่ได้

การซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้นจะมีผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market Maker) ทำการเสนอซื้อและเสนอขายโดยมีช่วงห่างระหว่างราคาเสนอซื้อและเสนอขาย จำนวนเสนอซื้อและเสนอขายขั้นต่ำ และระยะเวลาการเสนอซื้อเสนอขายตามที่กำหนดไว้ในส่วนที่ 1 ของข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น ๆ ยกเว้นกรณีที่กำหนดไว้ในส่วนที่ 2 ของข้อกำหนดสิทธิ ดังต่อไปนี้

- (1) มีเหตุการณ์ขัดข้องในการชำระราคาและส่งมอบ
- (2) ตลาดหลักทรัพย์สั่งพักการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิง หรือหยุดคำนวณดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง (แล้วแต่กรณี) และ/หรือสั่งพักการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เพียงพอที่จะปฏิบัติตามหน้าที่
- (3) เมื่อผู้ดูแลสภาพคล่องไม่มีใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เพียงพอที่จะปฏิบัติตามหน้าที่
- (4) เมื่อราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีราคาต่ำกว่าราคาที่กำหนดในส่วนที่ 1 ของข้อกำหนดสิทธิ (ข้อกำหนดในการดูแลสภาพคล่อง)
- (5) ตั้งแต่สิบสี่ (14) วันทำการก่อนวันครบกำหนดอายุ
- (6) เมื่อการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์มีความผันผวนรุนแรงผิดปกติ
- (7) เมื่อผู้ออกมีเหตุผิดนัดตามที่กำหนดในส่วนที่ 2 ของข้อกำหนดสิทธิ
- (8) กรณีอื่นๆ ตามที่ผู้ดูแลสภาพคล่องได้เปิดเผยข้อมูลผ่านตลาดหลักทรัพย์

ทั้งนี้ นักลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลผลการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องได้จากเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

## 2.6.2 ความเสี่ยงจากการเรียกใช้สิทธิก่อนกำหนด

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ออกและเสนอขายนี้เป็นใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ชนิดไม่มีการเรียกใช้สิทธิก่อนกำหนด นักลงทุนจึงไม่มีความเสี่ยงเกี่ยวกับการเรียกใช้สิทธิก่อนกำหนด ทั้งนี้ เนื่องจากใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ออกและเสนอขายโดยบล. ไทยพาณิชย์ จำกัด เป็นใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ประเภทใช้สิทธิครั้งเดียวในวันครบกำหนดอายุ (European Type) ดังนั้น หากนักลงทุนถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จนถึงวันครบกำหนดอายุ และใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีสถานะเป็น In-the-money (ITM) จะสามารถใช้สิทธิรับเงินสดส่วนต่างได้ โดยอาจเสียค่าธรรมเนียมในการใช้สิทธิ (ถ้ามี) และเงินสดที่ได้จากการใช้สิทธิถือเป็นเงินได้พึงประเมินต้องนำไปรวมคำนวณเพื่อเสียภาษีประจำปีด้วย

## 2.6.3 ความเสี่ยงอื่น ๆ

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นเครื่องมือทางการเงินในตลาดทุนไทย นักลงทุนจึงควรศึกษาข้อมูลที่เกี่ยวข้องอย่างละเอียด และตระหนักถึงข้อจำกัดต่างๆ ก่อนการลงทุน เช่น อาจคงเหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่เหมาะสมกับพฤติกรรมการลงทุนของนักลงทุนแต่ละประเภท รวมทั้งค่าธรรมเนียมการซื้อขาย ค่าธรรมเนียมการใช้สิทธิ และค่าธรรมเนียมอื่น ๆ เป็นต้น

นักลงทุนทั้งที่เป็นบุคคลธรรมดาและนิติบุคคลต้องนำเงินสดส่วนต่างจากการใช้สิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ก่อนหักต้นทุน ไปรวมคำนวณรวมเป็นรายได้เพื่อเสียภาษีเงินได้ ตามมาตรา 40(8) แห่งประมวลรัษฎากร

ทั้งนี้ การลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีความเสี่ยง ซึ่งผู้ลงทุนต้องศึกษาข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และหนังสือชี้ชวนรวมทั้งข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออก และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่นที่เกี่ยวข้องให้ครบถ้วน เพื่อให้มั่นใจว่าผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นได้ในอนาคต

### 3. ลักษณะการประกอบธุรกิจ

บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด ก่อตั้งขึ้นเมื่อปี 2538 ซึ่งมีทุนจดทะเบียนชำระแล้ว 2,100 ล้านบาท โดยธนาคารไทยพาณิชย์ถือหุ้นทั้ง 100% ในปัจจุบัน เพื่อประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกรรมตลาดทุนของเครือธนาคาร บริษัทให้บริการซื้อขายหลักทรัพย์ และนำเสนอผลิตภัณฑ์และบริการด้านตราสารทุนแก่นักลงทุนทั้งนักลงทุนรายย่อยและลูกค้าสถาบัน ด้วยการให้บริการที่สำนักงานใหญ่ (SCB Park Plaza) และผ่านสาขา 6 แห่ง ได้แก่ สาขาเฉลิมนคร สาขาสินธร สาขารามาริบดี สาขาถนนราชวิถี (หาดใหญ่) สาขาเซ็นทรัลพลาซ่าปิ่นเกล้า สาขาเชียงใหม่ รวมทั้งช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ผ่านทางเว็บไซต์ [www.scbsonline.com](http://www.scbsonline.com)

บริษัทได้รับใบอนุญาตประเภท ก. ภายใต้พรบ.หลักทรัพย์ ให้ประกอบธุรกิจ ดังต่อไปนี้

- 1) การเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
- 2) การค้าหลักทรัพย์
- 3) การเป็นที่ปรึกษาการลงทุน
- 4) การจัดจำหน่ายหลักทรัพย์
- 5) การจัดการกองทุนส่วนบุคคล
- 6) กิจการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Principle และ Agent)

นอกเหนือจากนั้นบริษัทยังได้รับอนุญาตจากกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยให้ประกอบธุรกิจภายใต้พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยมีใบอนุญาตประเภท ส-1 ให้สามารถประกอบธุรกิจคือ

- 1) เป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- 2) การเป็นผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ขอจดทะเบียนให้บริการลูกค้าเฉพาะลูกค้าที่เป็นผู้ลงทุนสถาบัน)

ปัจจุบันบริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ได้รับความเชื่อถือจากนักลงทุนและจัดเป็นบริษัทหลักทรัพย์ชั้นนำแห่งหนึ่งของประเทศ

### ผลการดำเนินงานปี 2562

- ในปี 2562 มูลค่าการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวัน (ไม่รวมพอร์ตการลงทุนของบริษัทหลักทรัพย์) อยู่ที่ 46 พันล้านบาท ลดลงร้อยละ 9 จากปี 2561 ที่มีมูลค่าการซื้อขาย 51 พันล้านบาท โดยหลัก

มาจากการซื้อขายของนักลงทุนรายย่อยที่ลดลงอย่างมากเมื่อเทียบกับปีที่ผ่านมา ในขณะที่การซื้อขายของลูกค้านต่างประเทศเพิ่มสูงขึ้นมาก อย่างไรก็ตาม ด้วยอัตราค่าธรรมเนียมหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้านต่างประเทศที่ต่ำกว่าลูกค้าย่อยบุคคล สัดส่วนการซื้อขายที่เพิ่มขึ้นของลูกค้านต่างประเทศได้ส่งผลให้อัตราค่าธรรมเนียมหน้าซื้อขายหลักทรัพย์โดยเฉลี่ยของทั้งอุตสาหกรรมปรับตัวลดลง

- ในภาวะการณ์การแข่งขันในตลาดที่รุนแรงขึ้น และการเข้ามาของบริษัทหลักทรัพย์จากต่างประเทศ บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์มีส่วนแบ่งการตลาดอยู่ที่ร้อยละ 3.42 ลดลงจากระดับร้อยละ 3.69 ในปี 2561 และครองอันดับที่ 12 เมื่อเทียบกับบริษัทหลักทรัพย์ทั้งหมดในอุตสาหกรรม 39 บริษัท ซึ่งลดลงจากอันดับที่ 11 ในปีก่อน

- ในส่วนของผลประกอบการ บริษัทมีรายได้รวม 1.96 พันล้านบาท ปรับลดลงร้อยละ 10 โดยหลักเกิดจากรายได้กำไรและผลตอบแทนจากเครื่องมือทางการเงิน และรายได้ค่านายหน้าปรับตัวลดลงตามมูลค่าการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ กำไรสุทธิของบริษัทในปี 2562 มีจำนวน 360 ล้านบาท ลดลงร้อยละ 12 จากปีที่ผ่านมา จากรายได้รวมที่ปรับตัวลดลงทั้งในส่วนของบริษัทหลักทรัพย์ ธุรกิจตราสารอนุพันธ์ และธุรกิจอื่นๆ บริษัทมีอัตราผลตอบแทนต่อส่วนของผู้ถือหุ้น (ROE) อยู่ที่ร้อยละ 15 ซึ่งสูงกว่าอัตราค่าเฉลี่ยในอุตสาหกรรม

### จุดเด่นของปี 2562

- บริษัทได้ทำการยกระดับบัญชีเป็นบัญชีลงทุนที่สามารถลงทุนได้ทุกผลิตภัณฑ์ทางการเงิน (SCBS INVESTMENT ACCOUNT) และพัฒนาช่องทางการเปิดบัญชีลงทุนเพิ่มมากขึ้นภายใต้แนวความคิด “Easy & Smart” โดยผ่านสาขาธนาคาร (I-Onboarding), แอปพลิเคชัน SCB Easy และแอปพลิเคชัน SCBS Let's Invest
- บริษัทพัฒนาระบบ Multi-Trading Platform ที่เรียกว่า Easy Invest โดยในช่วงแรกสามารถซื้อขายได้ในส่วนของกองทุนรวมและตราสารหนี้ และกำลังพัฒนาอย่างต่อเนื่องเพื่อซื้อขายผลิตภัณฑ์ทางการเงินประเภทอื่นต่อไป
- บริษัทพัฒนาระบบ Algo Trading (ลงทุนหุ้นอัตโนมัติ) และ Robo Advisor หรือ Goal Invest (ซึ่งเป็นการลงทุนในกองทุนรวมอัตโนมัติ) ทั้งในรูปแบบ Hybrid Model และ AI Model เพื่อช่วยตอบโจทย์ความต้องการในการลงทุนให้กับลูกค้ามากขึ้น
- บริษัทพัฒนาทีม Wealth Research เพื่อให้คำแนะนำการลงทุนที่ครอบคลุมทุกผลิตภัณฑ์ทางการเงินให้กับลูกค้า
- บริษัทได้รับการจัดอันดับเครดิตภายในประเทศระยะยาวเป็น AA(thai) โดย “ฟิทช์เรตติ้งส์”





- บริษัทได้รับรางวัลบริษัทหลักทรัพย์ยอดเยี่ยมด้านการให้บริการแก่นักลงทุนรายย่อยบุคคล จากตลาดหลักทรัพย์ (SET AWARDS 2019) เป็นปีที่สองติดต่อกัน ซึ่งสะท้อนถึงคุณภาพในการให้บริการของบริษัทเป็นอย่างดี

#### 4. การจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

ผู้ออกได้รับการจัดอันดับความเครดิตภายในประเทศ (National Rating) ระยะยาวที่ระดับ “AA(thai)” โดยบริษัท ฟิทช์ เรตติ้งส์ จำกัด (ข้อมูล ณ วันที่ 2 เมษายน 2563) โดยมีแนวโน้มอันดับเครดิตที่ “Stable” หรือ “มีเสถียรภาพ” ในขณะเดียวกัน ฟิทช์ เรตติ้งส์ ประกาศคงอันดับเครดิตภายในประเทศระยะสั้นที่ “F1+(thai)”

ฟิทช์ เรตติ้งส์ ใช้สัญลักษณ์ตัวอักษรแสดงผลการจัดอันดับเครดิตระยะยาวภายในประเทศ จำนวน 11 อันดับ โดยเริ่มจาก AAA(xxx) ซึ่งเป็นอันดับเครดิตสูงสุด จนถึง D(xxx) ซึ่งเป็นอันดับต่ำสุด โดยอันดับเครดิต AA มีความหมายดังนี้

AA คือ มีความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้ต่ำมาก เมื่อเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้อื่นภายในประเทศเดียวกัน โดยความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้ที่ต่ำกว่าผู้ออกตราสารหนี้ที่ได้อันดับเครดิตระยะยาวภายในประเทศสูงสุดเพียงเล็กน้อย

โดยอันดับเครดิตจาก AAA(xxx) ถึง CCC (xxx) อาจมีเครื่องหมายบวก (+) หรือ (-) ต่อท้าย เพื่อจำแนกความแตกต่างของคุณภาพของอันดับเครดิตภายในระดับเดียวกัน

นอกจากนี้ ฟิทช์ เรตติ้งส์ ยังได้กำหนดสัญลักษณ์ สำหรับ ผลการจัดอันดับเครดิตภายในประเทศระยะสั้น โดยมี 7 อันดับ ดังนี้ F1(xxx), F2(xxx), F3(xxx), B(xxx), C(xxx), RD(xxx), และ D(xxx) โดย อันดับเครดิต F1 มีความหมายดังนี้

F1 คือ มีความสามารถในการชำระหนี้ระยะสั้นสูงสุด หรือ ความเสี่ยงในการผิดชำระหนี้ต่ำสุด เมื่อเทียบกับผู้ออกตราสารหนี้อื่นในประเทศเดียวกัน โดยเครื่องหมาย + แสดงถึง สภาพคล่องที่แข็งแกร่งของบริษัท

## 5. การบริหารความเสี่ยง

### 5.1 วัตถุประสงค์ในการซื้อขายหรือออกตราสาร

เพื่อเพิ่มผลผลิตภัณฑการลงทุนให้แก่นักลงทุน และเพิ่มรายได้ของบริษัท

### 5.2 กลยุทธ์ในการป้องกันความเสี่ยงต่างๆ ที่อาจเกิดขึ้น (Hedging Strategy)

ผู้ออกในฐานะที่มีภาระในการชำระราคาให้กับนักลงทุน ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้นมีมูลค่า ณ วันครบกำหนดอายุ ดังนั้น ผู้ออกจึงได้กำหนดกลยุทธ์ในการป้องกันความเสี่ยงโดยเลือกใช้หลักการ Dynamic Delta Hedging ด้วยการคำนวณค่า Delta ที่ระดับราคาของหลักทรัพย์อ้างอิง และทำการซื้อหรือขายหลักทรัพย์อ้างอิงในปริมาณที่คำนวณได้จากค่า Delta นั้น ทั้งนี้โมเดลที่ใช้ในการคำนวณค่า Delta นั้น ผู้ออกได้ใช้ Black & Scholes Model เป็นหลักในการคำนวณ

นอกจากนี้ ผู้ออกอาจเลือกพิจารณาการป้องกันความเสี่ยงโดยการซื้อหรือขายตราสารอนุพันธ์อื่นทั้งในตลาดและนอกตลาด (OTC Market) บนหลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงเดียวกันกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เพื่อเป็นการลดความเสี่ยงด้วย ทั้งนี้ กลยุทธ์ในการป้องกันความเสี่ยงต่างๆ ที่ผู้ออกเลือกใช้จะเป็นไปเพื่อลดความเสี่ยงในการชำระราคาของผู้ออก และเพื่อผลประโยชน์สูงสุดของนักลงทุนผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

### 5.3 การบริหารความเสี่ยงของผู้ออก

ผู้ออกได้จัดให้มีการบริหารความเสี่ยง เพื่อบรรเทาและจัดการความเสี่ยงซึ่งอาจเกิดขึ้นจากการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ดังนี้

- การบริหารความเสี่ยงด้านเครดิต (Credit Risk)

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีผลผูกพันระหว่างผู้ออกและนักลงทุนผู้ซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยผู้ออกมีภาระในการชำระราคาในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีมูลค่า ณ วันครบกำหนดอายุ โดยนักลงทุนมีฐานะเป็นผู้ซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของผู้ออก ดังนั้น นักลงทุนจึงถือว่ามีฐานะเป็นเจ้าหนี้ของผู้ออกด้วยในขณะที่ผู้ออกตกอยู่ในฐานะลูกหนี้ ดังนั้น ผู้ออกจึงไม่มีความเสี่ยงด้านเครดิตกับนักลงทุน

- การบริหารความเสี่ยงด้านตลาด (Market Risk)

ความเสี่ยงด้านตลาด เกิดจากความผันผวนของสินค้าอ้างอิงและใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ซึ่งมีผลโดยตรงต่อสถานะกำไร/ขาดทุนของผู้ออกซึ่งผู้ออกมีนโยบายในการบริหารความเสี่ยงด้านตลาดที่

ผ่านการอนุมัติจากคณะกรรมการบริษัทผู้ออก โดยมีการกำหนดระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ เช่น ฐานอนุพันธ์โดยรวม (Notional Limit) มูลค่าเสียหายสูงสุดในเชิงสถิติ (Value-at-Risk Limit) Greek Limit และ Stop Loss Trigger Limit เป็นต้น

สำหรับแนวทางบริหารความเสี่ยงของพอร์ตผู้ออกได้มีการทำ Delta Neutral Hedging Strategy ซึ่งเป็นการควบคุมค่า Delta รวมของแต่ละหลักทรัพย์อ้างอิงในพอร์ตฯ ด้วยการซื้อหรือขายหลักทรัพย์อ้างอิงเพื่อให้ Delta มีค่าใกล้ 0 มากที่สุด เพื่อเป็นการลดความเสี่ยงด้านตลาด

นอกจากนี้ ผู้ออกได้กำหนดให้มีแนวทางการควบคุม ติดตาม และรายงานฐานะความเสี่ยง โดยหน่วยงานสนับสนุนด้านบริหารความเสี่ยงให้แก่ผู้บริหารและคณะกรรมการที่เกี่ยวข้องรับทราบอย่างสม่ำเสมอ นอกจากนี้ ผู้ออกได้มีการพัฒนาเครื่องมือเพื่อใช้ในการประเมินฐานะความเสี่ยงด้านตลาด คำนวณมูลค่าหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ทั้งนี้ กำหนดให้มีการปรับปรุงโมเดลและทบทวนสมมติฐานที่ใช้ในการคาดการณ์ให้มีความเป็นปัจจุบัน และสอดคล้องกับภาวะตลาดที่มีการเปลี่ยนแปลงอยู่เสมอ

- **การบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง (Liquidity Risk)**

ความเสี่ยงทางด้านสภาพคล่อง คือ ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการที่หลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสภาพคล่องไม่เพียงพอ ซึ่งแนวทางการบริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่องนี้ บริษัทฯ ได้พิจารณาหลักเกณฑ์ในการกำหนดหลักทรัพย์อ้างอิงที่มีสภาพคล่องในตลาดสูง และมีปัจจัยพื้นฐานดีเป็นหลัก โดยการวิเคราะห์ในเชิงสถิติจากข้อมูลการซื้อขายย้อนหลังเพื่อเป็นการป้องกันความเสี่ยงด้านสภาพคล่องของหลักทรัพย์อ้างอิง

- **การบริหารความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ (Operational Risk)**

ความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ คือ ความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากความบกพร่อง ความไม่รัดกุมเพียงพอของการปฏิบัติงาน บุคลากร ระบบฐานข้อมูล และระบบควบคุมภายใน

ผู้ออกได้ดำเนินการจัดสรรทรัพยากร (ทั้งด้านการเงินและบุคลากร) ที่เพียงพอต่อการจัดการและการพัฒนาระบบฐานข้อมูลเพื่อรองรับการประกอบธุรกิจตราสารอนุพันธ์ โดยพิจารณาจากปริมาณธุรกรรมและรูปแบบความซับซ้อนของธุรกรรมเป็นเกณฑ์ การจัดสรรทรัพยากรด้านบุคลากร ผู้ออกจะพิจารณาความรู้ ความสามารถ และความเชี่ยวชาญของพนักงานในแต่ละด้านเป็นหลัก เพื่อความเหมาะสมกับความต้องการของงานในแต่ละด้าน โดยคำนึงถึงความคุ้มค่าทางการเงินเป็นปัจจัยสำคัญในการตัดสินใจด้วย

ผู้ออกมีการแบ่งแยกหน้าที่และความรับผิดชอบระหว่างฝ่ายชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์กับสายงานบริหารการลงทุนและค้าหลักทรัพย์ไว้อย่างชัดเจน โดยฝ่ายชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์จะรายงานต่อสายงานสนับสนุนและปฏิบัติการ ฝ่ายบริหารความเสี่ยงจะรายงานต่อประธานเจ้าหน้าที่บริหาร ฝ่ายกำกับและตรวจสอบจะรายงานต่อคณะกรรมการบริษัทฯ ในขณะที่สายงานบริหารการลงทุนและค้าหลักทรัพย์ ซึ่งทำหน้าที่รับผิดชอบในธุรกิจตราสารอนุพันธ์จะรายงานต่อประธานเจ้าหน้าที่บริหาร

ผู้ออกให้ความสำคัญกับการพัฒนาออกผลิตภัณฑ์ใหม่และการปรับปรุงผลิตภัณฑ์เดิม โดยในการออกจำหน่ายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของผู้ออก ต้องเป็นไปตามกระบวนการพิจารณาอนุมัติผลิตภัณฑ์ฯ ซึ่งกำหนดให้มีการระบุและประเมินความเสี่ยงอย่างครอบคลุม จัดทำคู่มือการปฏิบัติงานโดยคณะกรรมการและสายงานบริหารการลงทุนและค้าหลักทรัพย์การนำเสนออนุมัติการออกผลิตภัณฑ์ตามอำนาจอนุมัติที่บริษัทผู้ออกกำหนด

ผู้ออกมีการจัดทำแผนฉุกเฉินเพื่อรองรับการบริหารความต่อเนื่องทางธุรกิจอันเนื่องมาจากสถานการณ์และเหตุการณ์ที่นอกเหนือความคาดหมาย โดยผู้ออกกำหนดให้มีการทดสอบและทบทวนแผนฉุกเฉินเป็นประจำ อย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง

- **การบริหารความเสี่ยงด้านกฎหมาย (Legal Risk)**

ผู้ออกกำหนดให้สายงานธุรกิจนำส่งเอกสารสัญญาที่ผู้ออกตกลงทำกับคู่สัญญาให้กลุ่มงานกฎหมาย ธนาคารไทยพาณิชย์ พิจารณาให้ความเห็นชอบก่อนการลงนามในสัญญาทุกครั้ง สำหรับรูปแบบสัญญาใดที่มีรูปแบบมาตรฐานสามารถนำเสนอกลุ่มงานกฎหมายให้ความเห็นชอบรูปแบบสัญญามาตรฐานไว้ล่วงหน้า ในขณะที่การใช้สัญญาที่มีไม่มาตรฐาน รูปแบบและเนื้อหาของสัญญาจะต้องได้รับความเห็นชอบจากกลุ่มงานกฎหมายก่อนทุกครั้ง เพื่อให้เกิดความมั่นใจในการมีผลบังคับใช้ตามกฎหมายเป็นกรณีๆ ไป

- **การบริหารความเสี่ยงด้านบุคลากร (People Risk)**

ผู้ออกให้ความสำคัญกับการบริหารความเสี่ยงด้านบุคลากร โดยเฉพาะสำหรับธุรกิจหลักทรัพย์เป็นธุรกิจการให้บริการ ต้องอาศัยความรู้ ความสามารถ ความเชี่ยวชาญและประสบการณ์ของบุคลากรเป็นสำคัญ ดังนั้น การสูญเสียบุคลากร โดยเฉพาะบุคลากรหลักอาจส่งผลกระทบต่อความต่อเนื่องในการดำเนินงานหรือการสูญเสียลูกค้าที่สำคัญได้ซึ่งส่งผลกระทบต่อชื่อเสียงและรายได้ของผู้ออก ดังนั้น เพื่อป้องกันการสูญเสียบุคลากร ผู้ออกมีโครงการอบรมทั้งในระยะสั้นและโครงการอบรมแบบต่อเนื่องเพื่อพัฒนาความรู้ความสามารถของพนักงานในทุกระดับและทุกสายงาน เพื่อให้ได้รับความรู้สำหรับ

ธุรกรรมใหม่ๆ ของบริษัท และความรู้ในด้านต่าง ๆ ที่เพิ่มทักษะในการให้บริการ และได้มีการกำหนด Career Path ของแต่ละสายงานอย่างชัดเจน ประกอบกับได้จัดให้มีผลตอบแทนที่เหมาะสม สอดคล้องกับภาวะอุตสาหกรรมและข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ในการกำหนดอัตราผลตอบแทนสำหรับผู้แนะนำการลงทุน เช่น เงินเดือน โบนัส สวัสดิการ ทั้งนี้ เพื่อเป็นแรงจูงใจสำหรับพนักงาน และลดความเสี่ยงจากการสูญเสียผู้แนะนำการลงทุนได้อีกทางหนึ่ง นอกจากนี้ ผู้ออกยังให้ความสำคัญกับแผนสืบทอดงาน (Succession Planning) ผ่านการระบุ กำหนด และพัฒนาผู้บริหารรุ่นใหม่ขึ้นมาในแต่ละสายงาน/ฝ่ายงานเพื่อรองรับ และทดแทนผู้บริหารที่มีอยู่ในปัจจุบันสำหรับรองรับงานในอนาคต

#### 5.4 บทบาทของผู้บริหารระดับสูงในการกำกับดูแลระบบบริหารความเสี่ยง

คณะกรรมการบริษัทจะเป็นผู้อนุมัตินโยบายบริหารความเสี่ยงด้านต่าง ๆ ซึ่งได้ผ่านความเห็นชอบจากคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงของธนาคารไทยพาณิชย์ โดยกรอบการบริหารความเสี่ยงของบริษัท ประกอบด้วย การกำหนดระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ วิธีการบริหารความเสี่ยงที่เหมาะสมกับประเภทและปริมาณธุรกรรมของผู้ออก ทั้งนี้ ต้องไม่ต่ำกว่ามาตรฐานที่หน่วยงานกำกับดูแลกำหนด โดยมีหน่วยงานสนับสนุนด้านบริหารความเสี่ยงทำหน้าที่ควบคุมและติดตามให้เป็นไปตามแนวทางที่บริษัทกำหนด และจัดทำรายงานสถานะความเสี่ยงนำเสนอต่อผู้บริหาร และคณะกรรมการบริษัทผู้ออกอย่างสม่ำเสมอ

#### 5.5 การควบคุมการดำรงสถานะหรือสภาพคล่องของผู้ออก

บริษัทฯ ได้ดำรงอัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (NCR) ตามเกณฑ์การดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. และระดับเกณฑ์ขั้นต่ำ (Early Warning) ของสำนักงานก.ล.ต. กำหนดที่อัตราขั้นต่ำร้อยละ 7 และร้อยละ 21 (หรือ 3 เท่าของสำนักงาน ก.ล.ต.) ตามลำดับ อีกทั้งบริษัทมีมาตรการป้องกันไม่ให้เกิดเหตุการณ์ดังกล่าวขึ้น เมื่อระดับ NCR ตกลงมาต่ำกว่าระดับพึงระวังที่บริษัทกำหนด (ปัจจุบันอยู่ที่ระดับ 35%) ฝ่ายบริหารความเสี่ยงต้องแจ้งให้คณะกรรมการจัดการบริษัททราบ อีกทั้งบริษัทมีการตรวจสอบ NCR ก่อนการทำธุรกรรมที่มีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญทุกครั้ง เช่น การมีธุรกรรมการซื้อขายรายใหญ่ (Big Lot) การออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (DW) เพื่อให้มั่นใจว่าบริษัทสามารถดำรงอัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (NCR) ตามเกณฑ์ที่กำหนด

## 5.6 การบริหารความเสี่ยงจากการใช้ธุรกิจหลักทรัพย์เป็นช่องทางในการฟอกเงิน

เนื่องจากธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์และการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอาจเป็นที่ดึงดูดใจของนักฟอกเงินจากสภาพคล่องของตราสารที่เปลี่ยนมือได้ง่าย ดังนั้น บริษัทฯจึงมีนโยบายในการบริหารความเสี่ยงด้านการป้องกันและปราบปรามการฟอกเงินและการป้องกันและปราบปรามการสนับสนุนทางการเงินแก่การก่อการร้าย รวมถึงแนวปฏิบัติในการตรวจสอบเพื่อทราบข้อเท็จจริงเกี่ยวกับลูกค้า/ตัวแทนและผู้ดำเนินการแทน และแนวปฏิบัติเรื่องการรายงานธุรกรรมทางการเงินและการจัดให้ลูกค้าแสดงตน เพื่อยึดถือเป็นแนวทางปฏิบัติและใช้เป็นแนวทางป้องกันมิให้บริษัทเป็นช่องทางหรือเป็นตัวกลางในการฟอกเงินและสนับสนุนทางการเงินแก่การก่อการร้าย

## 6. ประวัติการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ในปี 2562 บริษัทฯ เสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ทั้งหมด 70 รุ่น ดังนี้

| ชื่อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์   | ชื่อย่อตราสาร | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2562 |
|--|---------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บีซีพีจี จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                         | BCPG23C1905A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ออริจิ้น พร็อพเพอร์ตี้ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A           | ORI23C1905A   | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A         | BEM23C1905A   | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท พีทีจี เอ็นเนอยี จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                 | PTG23C1905A   | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เบอร์ลี่ ยุคเกอร์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                | BJC23C1905A   | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A          | SAWA23C1905A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท คาราบาวกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                     | CBG23C1905A   | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท คอมเซเว่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                        | COM723C1905A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | GULF23C1905A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เคซีอี อีเล็คโทรนิคส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A            | KCE23C1905A   | Expired                       |



| ชื่อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์  | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2562 |
|---|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน พฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A        | ADVA23C1905A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน พฤษภาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A        | MINT23C1905A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                          | KBAN23C1906A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                    | SCC23C1906A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน มิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A           | STA23C1906A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เอเซีย เอวิเอชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                | AAV23C1906A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ซูเปอร์ เอนเนอร์ยี คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขาย สุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | SUPE23C1906A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บี.กริม เพาเวอร์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                 | BGRI23C1906A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ราชธานีลิสซิ่ง จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                   | THAN23C1906A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน มิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A            | BH23C1906A   | Expired                       |

| ชื่อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์  | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2562 |
|---|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัทแลนด์แอนด์เฮาส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A             | LH23C1906A   | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A              | CPN23C1906A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ทีโอเอ เพ้นท์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A  | TOA23C1906A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | GPSC23C1906A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บางจาก คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A         | BCP23C1907A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ทีปโก้แอสฟัลท์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A              | TASC23C1907A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โรงพยาบาลจุฬารัตน์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A          | CHG23C1907A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ทีเอสไอไฟแนนเชียลกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A      | TISC23C1907A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ช.การช่าง จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                   | CK23C1907A   | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท นามันพีชไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                 | TVO23C1907A  | Expired                       |

| ชื่อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์   | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2562 |
|--|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ซีเค พาวเวอร์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                          | CKP23C1907A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท กันกุลเอ็นจิเนียริง จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                    | GUNK23C1907A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ฟรีเซียส ชิปปิ้ง จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                       | PSL23C1907A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท สตาร์ ปิโตรเลียม รีไฟน์นิ่ง จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A            | SPRC23C1907A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บางกอก เชน ฮอสปิเทล จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                    | BCH23C1907A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ชีโน-ไทย เอ็นจิเนียริงแอนด์คอนสตรัคชั่น จำกัด(มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกรกฎาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | STEC23C1907A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บัตรกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนสิงหาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                            | KTC23C1908A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท พีทีที โกลบอล เคมิคอล จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนสิงหาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                  | PTTG23C1908A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท สยามแก๊ส แอนด์ ปิโตรเคมีคัลส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนสิงหาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A          | SGP23C1908A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนสิงหาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                    | CENT23C1908A | Expired                       |

| ชื่อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์   | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2562 |
|--|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน<br>สิงหาคม 2562 ประเภทสิทธิในการขาย รุ่น A     | ADVA23P1908A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท คาราบาวกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนสิงหาคม<br>2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                  | CBG23C1908A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน<br>สิงหาคม 2562 ประเภทสิทธิในการขาย รุ่น A                | AOT23P1908A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เอสซี (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน<br>สิงหาคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A            | ESSO23C1908A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บ้านปู จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนสิงหาคม 2562<br>ประเภทสิทธิในการขาย รุ่น A                         | BANP23P1908A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท อินทัช โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนสิงหาคม<br>2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A              | INTU23C1908A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด(มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน<br>สิงหาคม 2562 ประเภทสิทธิในการขาย รุ่น A             | BDMS23P1908A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ไออาร์พีซี จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนสิงหาคม 2562<br>ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                    | IRPC23C1908A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โทเทิล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้าย<br>เดือนสิงหาคม 2562 ประเภทสิทธิในการขาย รุ่น A | DTAC23P1908A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท พลังงานบริสุทธิ์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน<br>2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A              | EA23C1909A   | Expired                       |

| ชื่อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์  | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2562 |
|---|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท อินโดรามา เวนเจอร์ส จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2562 ประเภทสิทธิในการขาย รุ่น A            | IVL23P1909A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท แพลน บี มีเดีย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                | PLAN23C1909A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท พรินา มารีน จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                   | PRM23C1909A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2562 ประเภทสิทธิในการขาย รุ่น A     | PTTE23P1909A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท อาร์เอส จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                       | RS23C1909A   | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เวิร์คพอยท์ เอ็นเทอร์เทนเมนท์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | WORK23C1909A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท จีเอฟพีที จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                     | GFPT23C1909A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โรบินสัน จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                      | ROBI23C1909A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                        | PTT23C1911A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2563 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A      | ADVA23C2001A | Trading                       |

| ชื่อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์   | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2562 |
|--|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ศรีสวัสดิ์ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน พฤศจิกายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A           | SAWA23C1911A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้าย เดือนมกราคม 2563 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A             | BEM23C2001A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน พฤศจิกายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A             | STA23C1911A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เบอร์ลี่ ยุคเกอร์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2563 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                     | BJC23C2001A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท แก้วแก่น้อย ฟู้ดแอนด์มาร์เก็ตติ้ง จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้าย เดือนพฤศจิกายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | TKN23C1911A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เคซีอี อีเล็คโทรนิคส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน พฤศจิกายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A             | KCE23C1911A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2563 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                              | TOP23C2001A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน มกราคม 2563 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A            | MINT23C2001A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เมืองไทย แคปปิตอล จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน พฤศจิกายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                 | MTC23C1911A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท อริจัน พร็อพเพอร์ตี้ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน พฤศจิกายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A              | ORI23C1911A  | Expired                       |

โดยรายละเอียดของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่นที่เสนอขายในปี 2562 มีดังนี้ (ข้อมูล ณ วันที่ 16 มีนาคม 2563)

| ชื่อย่อ      | หลักทรัพย์<br>อ้างอิง | การส่งมอบเมื่อใช้<br>สิทธิ | ประเภทการใช้สิทธิ                    | จำนวนที่<br>ออก (ล้าน<br>หน่วย) | อัตราการใช้<br>สิทธิต่อหน่วย<br>(DW: 1<br>Underlying) | ราคาใช้<br>สิทธิ<br>(บาท) | วันซื้อขายวัน<br>แรก | วันซื้อขายวัน<br>สุดท้าย | วันครบ<br>กำหนดอายุ |
|--------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------------------|---------------------------------|---|---------------------------|----------------------|--------------------------|---------------------|
| ADVA23C1905A | ADVANC                | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 21.00   | 190.00                    | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| BCPG23C1905A | BCPG                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 4.50  | 18.00                     | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| BEM23C1905A  | BEM                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 3.20  | 11.00                     | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| BJC23C1905A  | BJC                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 9.00  | 58.00                     | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| CBG23C1905A  | CBG                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 13.00   | 38.00                     | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| COM723C1905A | COM7                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 5.00  | 15.50                     | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| GULF23C1905A | GULF                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 10.00   | 100.00                    | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| KCE23C1905A  | KCE                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 12.00   | 34.00                     | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| MINT23C1905A | MINT                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 10.00   | 43.00                     | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| ORI23C1905A  | ORI                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 2.50  | 8.30                      | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| PTG23C1905A  | PTG                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 2.50  | 10.80                     | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| SAWA23C1905A | SAWAD                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 13.00   | 56.00                     | 24-Jan-2019          | 31-May-2019              | 5-Jun-2019          |
| AAV23C1906A  | AAV                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 0.90  | 4.60                      | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |
| BGRI23C1906A | BGRIM                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 11.00   | 35.00                     | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |
| BH23C1906A   | BH                    | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 19.00   | 220.00                    | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |
| CPN23C1906A  | CPN                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 10.00   | 92.00                     | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |
| GPSC23C1906A | GPSC                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 11.00   | 73.00                     | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |
| KBAN23C1906A | KBANK                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 19.00   | 225.00                    | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |
| SCC23C1906A  | SCC                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 75.00   | 530.00                    | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |
| STA23C1906A  | STA                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 4.80  | 17.50                     | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |

| ชื่อย่อ      | หลักทรัพย์<br>อ้างอิง | การส่งมอบเมื่อใช้<br>สิทธิ | ประเภทการใช้สิทธิ                    | จำนวนที่<br>ออก (ล้าน<br>หน่วย) | อัตราการใช้<br>สิทธิต่อหน่วย<br>(DW: 1<br>Underlying) | ราคาใช้<br>สิทธิ<br>(บาท) | วันซื้อขายวัน<br>แรก | วันซื้อขายวัน<br>สุดท้าย | วันครบ<br>กำหนดอายุ |
|--------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------------------|---------------------------------|---|---------------------------|----------------------|--------------------------|---------------------|
| SUPE23C1906A | SUPER                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 0.50  | 0.90                      | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |
| THAN23C1906A | THANI                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 2.70  | 7.90                      | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |
| LH23C1906A   | LH                    | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 3.70  | 12.40                     | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |
| TOA23C1906A  | TOA                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 10.50   | 42.00                     | 5-Feb-2019           | 28-Jun-2019              | 3-Jul-2019          |
| BCH23C1907A  | BCH                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 4.40  | 20.00                     | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| BCP23C1907A  | BCP                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 11.00   | 37.00                     | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| CHG23C1907A  | CHG                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 0.60  | 2.40                      | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| CK23C1907A   | CK                    | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 9.00  | 30.00                     | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| CKP23C1907A  | CKP                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 1.40  | 6.00                      | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| GUNK23C1907A | GUNKUL                | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 0.90  | 3.90                      | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| PSL23C1907A  | PSL                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 2.70  | 10.50                     | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| SPRC23C1907A | SPRC                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 4.50  | 13.00                     | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| STEC23C1907A | STEC                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 4.50  | 27.00                     | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| TASC23C1907A | TASCO                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 4.50  | 17.00                     | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| TISC23C1907A | TISCO                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 10.00   | 100.00                    | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| TVO23C1907A  | TVO                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 12.00   | 34.00                     | 25-Feb-2019          | 31-Jul-2019              | 5-Aug-2019          |
| CENT23C1908A | CENTEL                | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 11.00   | 52.00                     | 27-Mar-2019          | 30-Aug-2019              | 4-Sep-2019          |
| CBG23C1908A  | CBG                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 14.00   | 70.00                     | 27-Mar-2019          | 30-Aug-2019              | 4-Sep-2019          |
| ESSO23C1908A | ESSO                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 4.80  | 12.50                     | 27-Mar-2019          | 30-Aug-2019              | 4-Sep-2019          |
| INTU23C1908A | INTUCH                | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 9.00  | 66.00                     | 27-Mar-2019          | 30-Aug-2019              | 4-Sep-2019          |
| IRPC23C1908A | IRPC                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 2.20  | 6.70                      | 27-Mar-2019          | 30-Aug-2019              | 4-Sep-2019          |



| ชื่อย่อ      | หลักทรัพย์อ้างอิง | การส่งมอบเมื่อใช้สิทธิ | ประเภทการใช้สิทธิ                    | จำนวนที่ออก (ล้านหน่วย) | อัตราการใช้สิทธิต่อหน่วย (DW: 1 Underlying) | ราคาใช้สิทธิ (บาท) | วันซื้อขายวันแรก | วันซื้อขายวันสุดท้าย | วันครบกำหนดอายุ |
|--------------|-------------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------|---|--------------------|------------------|----------------------|-----------------|
| KTC23C1908A  | KTC               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 15.00                                       | 37.00              | 27-Mar-2019      | 30-Aug-2019          | 4-Sep-2019      |
| PTTG23C1908A | PTTGC             | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 11.00                                       | 80.00              | 27-Mar-2019      | 30-Aug-2019          | 4-Sep-2019      |
| SGP23C1908A  | SGP               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 2.60  | 11.00              | 27-Mar-2019      | 30-Aug-2019          | 4-Sep-2019      |
| ADVA23P1908A | ADVANC            | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 12.00                                       | 150.00             | 27-Mar-2019      | 30-Aug-2019          | 4-Sep-2019      |
| AOT23P1908A  | AOT               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 6.00  | 56.00              | 27-Mar-2019      | 30-Aug-2019          | 4-Sep-2019      |
| BANP23P1908A | BANPU             | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 3.50  | 14.00              | 27-Mar-2019      | 30-Aug-2019          | 4-Sep-2019      |
| BDMS23P1908A | BDMS              | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 2.70  | 19.00              | 27-Mar-2019      | 30-Aug-2019          | 4-Sep-2019      |
| DTAC23P1908A | DTAC              | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 8.00  | 43.00              | 27-Mar-2019      | 30-Aug-2019          | 4-Sep-2019      |
| EA23C1909A   | EA                | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 13.60                                       | 58.00              | 18-Apr-2019      | 30-Sep-2019          | 3-Oct-2019      |
| IVL23P1909A  | IVL               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 8.50  | 42.00              | 18-Apr-2019      | 30-Sep-2019          | 3-Oct-2019      |
| PLAN23C1909A | PLANB             | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 2.50  | 8.00               | 18-Apr-2019      | 30-Sep-2019          | 3-Oct-2019      |
| PRM23C1909A  | PRM               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 3.00  | 7.60               | 18-Apr-2019      | 30-Sep-2019          | 3-Oct-2019      |
| PTTE23P1909A | PTTEP             | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 17.00                                       | 110.00             | 18-Apr-2019      | 30-Sep-2019          | 3-Oct-2019      |
| RS23C1909A   | RS                | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 6.00  | 22.00              | 18-Apr-2019      | 30-Sep-2019          | 3-Oct-2019      |
| WORK23C1909A | WORK              | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 5.80  | 26.00              | 18-Apr-2019      | 30-Sep-2019          | 3-Oct-2019      |
| GFPT23C1909A | GFPT              | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 5.80  | 17.50              | 18-Apr-2019      | 30-Sep-2019          | 3-Oct-2019      |
| ROBI23C1909A | ROBINS            | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 11.00                                       | 67.00              | 2-May-2019       | 30-Sep-2019          | 3-Oct-2019      |
| ADVA23C2001A | ADVANC            | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 28.00                                       | 200.00             | 27-May-2019      | 31-Jan-2020          | 5-Feb-2020      |
| BEM23C2001A  | BEM               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 5.50  | 12.50              | 27-May-2019      | 31-Jan-2020          | 5-Feb-2020      |
| BJC23C2001A  | BJC               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 12.00                                       | 56.00              | 27-May-2019      | 31-Jan-2020          | 5-Feb-2020      |
| KCE23C1911A  | KCE               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                      | 5.80  | 23.00              | 27-May-2019      | 28-Nov-2019          | 3-Dec-2019      |

| ชื่อย่อ      | หลักทรัพย์<br>อ้างอิง | การส่งมอบเมื่อใช้<br>สิทธิ | ประเภทการใช้สิทธิ                    | จำนวนที่<br>ออก (ล้าน<br>หน่วย) | อัตราการใช้<br>สิทธิต่อหน่วย<br>(DW: 1<br>Underlying) | ราคาใช้<br>สิทธิ<br>(บาท) | วันซื้อขายวัน<br>แรก | วันซื้อขายวัน<br>สุดท้าย | วันครบ<br>กำหนดอายุ |
|--------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------------------|---------------------------------|---|---------------------------|----------------------|--------------------------|---------------------|
| MINT23C2001A | MINT                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 13.00   | 42.00                     | 27-May-2019          | 31-Jan-2020              | 5-Feb-2020          |
| MTC23C1911A  | MTC                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 13.00   | 56.00                     | 27-May-2019          | 28-Nov-2019              | 3-Dec-2019          |
| ORI23C1911A  | ORI                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 2.90  | 7.80                      | 27-May-2019          | 28-Nov-2019              | 3-Dec-2019          |
| PTT23C1911A  | PTT                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 11.00   | 54.00                     | 27-May-2019          | 28-Nov-2019              | 3-Dec-2019          |
| SAWA23C1911A | SAWAD                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 13.00   | 58.00                     | 27-May-2019          | 28-Nov-2019              | 3-Dec-2019          |
| STA23C1911A  | STA                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 4.80  | 13.50                     | 27-May-2019          | 28-Nov-2019              | 3-Dec-2019          |
| TKN23C1911A  | TKN                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 2.70  | 10.50                     | 27-May-2019          | 28-Nov-2019              | 3-Dec-2019          |
| TOP23C2001A  | TOP                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 30                              | 13.00   | 73.00                     | 27-May-2019          | 31-Jan-2020              | 5-Feb-2020          |

ในปี 2561 บริษัทฯ เสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ทั้งหมด 88 รุ่น ดังนี้

| ชื่อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์  | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2561 |
|---|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน มิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                | AOT23C1906A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บ้านปู จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                         | BANP23C1906A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บิวดี้ คอมมูนิตี้ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A              | BEAU23C1906A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โทเทิล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้าย เดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | DTAC23C1906A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท สยามโกลบอลเฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน มิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A              | GLOB23C1906A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท อินโดรามา เวนเจอร์ส จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน มิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A           | IVL23C1906A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                       | TOP23C1906A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท อมตะ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน มิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A             | AMAT23C1906A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                         | BBL23C1906A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด(มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน มิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A             | BDMS23C1906A | Trading                       |

| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์   | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2561 |
|--|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                  | CPAL23C1906A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                      | KTB23C1906A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เมืองไทย แคปปิตอล จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A           | MTC23C1906A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                        | PTT23C1906A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ปตท.สำรวจและผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A  | PTTE23C1906A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท พีทีที โกลบอล เคมิคอล จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A       | PTTG23C1906A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                      | TMB23C1906A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมิถุนายน 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A   | WHA23C1906A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกุมภาพันธ์ 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | ADVA23C1902A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บีซีพีจี จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกุมภาพันธ์ 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                  | BCPG23C1902A | Trading                       |

| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์   | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2561 |
|--|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน<br>กุมภาพันธ์ 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A               | CENT23C1902A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกุมภาพันธ์<br>2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                            | KBAN23C1902A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เมก้า ไลฟ์ไชนส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน<br>กุมภาพันธ์ 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                   | MEGA23C1902A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ทีปโก้แอสฟัลท์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกุมภาพันธ์<br>2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                     | TASC23C1902A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เถ้าแก่น้อย ฟู้ดแอนด์มาร์เก็ตติ้ง จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้าย<br>เดือนกุมภาพันธ์ 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | TKN23C1902A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ทู คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน<br>กุมภาพันธ์ 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                   | TRUE23C1902A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน<br>กุมภาพันธ์ 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                 | TU23C1902A   | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท อนันดา ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือน<br>มกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                 | ANAN23C1901A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บ้านปู จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562<br>ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                                 | BANP23C1901A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เบอร์ลี ยุคเกอร์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม<br>2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                       | BJC23C1901A  | Trading                       |

| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์  | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2561 |
|---|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บ้านปู เพาเวอร์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                        | BPP23C1901A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท คอมเซเว่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                              | COM723C1901A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท พลังงานบริสุทธิ์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                       | EA23C1901A   | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ไทรีเซนไทย เอเยนต์ชีส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                 | TTA23C1901A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ไมโน เทคโนโลยี จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                         | MONO23C1901A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ยูนิค เอ็นจิเนียริง แอนด์ คอนสตรัคชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | UNIQ23C1901A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โกลบอลกรีนเคมิคอล จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                      | GGC23C1901A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท แลนด์แอนด์เฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                       | LH23C1901A   | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เอพี (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                        | AP23C1901A   | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บิวตี้ คอมมูนิตี้ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                      | BEAU23C1901A | Trading                       |

| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์  | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2561 |
|---|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ทางด่วนและรถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A       | BEM23C1901A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A         | HMPR23C1901A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เคซีอี อีเล็คโทรนิคส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A          | KCE23C1901A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                           | PTT23C1901A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                           | PTTE23C1901A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท พีทีที โกลบอล เคมิคอล จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A          | PTTG23C1901A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ซูเปอร์ เอนเนอจี้ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | SUPE23C1901A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท การบินไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                      | THAI23C1901A | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท คาราบาวกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนมกราคม 2562 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                   | CBG23C1901A  | Trading                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เอเซีย เอวิเอชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A           | AAV23C1811A  | Expired                       |

| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์   | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2561 |
|--|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                   | BBL23C1811A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บางกอก เชน ฮอสพิทอล จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A      | BCH23C1811A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โรงพยาบาลจุฬารัตน์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A       | CHG23C1811A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ผลิตไฟฟ้า จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                | EGCO23C1811A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท สยามโกลบอลเฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A         | GLOB23C1811A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ฮานา ไมโครอิเล็กทรอนิกส์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | HANA23C1811A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                   | KTB23C1811A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท พกษา โฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A             | PSH23C1811A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด(มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A             | SCC23C1811A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท แสนสิริ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                  | SIRI23C1811A | Expired                       |



| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์  | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2561 |
|---|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ศุภาลัย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A         | SPAL23C1811A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ซูเปอร์บล็อก จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A    | SUPE23C1811A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนพฤศจิกายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A        | TOP23C1811A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บัตรกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A       | KTC23C1809A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท อมตะ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A  | AMAT23C1810A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด(มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A  | BDMS23C1810A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ซีเค พาวเวอร์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A      | CKP23C1810A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A         | CPAL23C1810A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | CPF23C1810A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เชนทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A       | CPN23C1810A  | Expired                       |

| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์   | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2561 |
|--|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ไออาร์พีซี จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                              | IRPC23C1810A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท อินโดรามา เวนเจอร์ส จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                     | IVL23C1810A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A               | MINT23C1810A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท สตาร์ ปิโตรเลียม รีไฟน์นิ่ง จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A             | SPRC23C1810A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                                  | TMB23C1810A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนตุลาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A               | WHA23C1810A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บัตรกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                            | KTC23C1809A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ซีโน-ไทย เอ็นจีเนียริงแอนด์คอนสตรัคชั่น จำกัด(มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนสิงหาคม 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | STEC23C1808A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บีอีซี เวิลด์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                          | BEC23C1809A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท เอสซี (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A                      | ESSO23C1809A | Expired                       |

| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์   | ชื่อย่อ      | สถานะ ณ<br>31 ธันวาคม<br>2561 |
|--|--------------|-------------------------------|
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท บัตรกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A            | KTC23C1809A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท แม็คกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A              | MC23C1809A   | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท โมโน เทคโนโลยี จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A         | MONO23C1809A | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ออริจิ้น พร็อพเพอร์ตี้ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A | ORI23C1809A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท พรีเมียม ชิปปิ้ง จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A       | PSL23C1809A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ศรีตรังแอโกรอินดัสทรี จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A  | STA23C1809A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ทีพีไอ โพลีน เพาเวอร์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A  | TPI23C1809A  | Expired                       |
| ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้นสามัญของ บริษัท ยูนิเวนเจอร์ จำกัด (มหาชน) ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ไทยพาณิชย์ จำกัด ซื้อขายสุดท้ายเดือนกันยายน 2561 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น A           | UV23C1809A   | Expired                       |

โดยรายละเอียดของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่นที่เสนอขายในปี 2561 มีดังนี้ (ข้อมูล ณ วันที่ 15 มีนาคม 2562)

| ชื่อย่อ      | หลักทรัพย์อ้างอิง | การส่งมอบเมื่อใช้สิทธิ | ประเภทการใช้สิทธิ                    | จำนวนที่ออก (ล้านหน่วย) | อัตราการใช้สิทธิต่อหน่วย (DW: 1 Underlying) | ราคาใช้สิทธิ (บาท) | วันซื้อขายวันแรก | วันซื้อขายวันสุดท้าย | วันครบกำหนดอายุ |
|--------------|-------------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------|---|--------------------|------------------|----------------------|-----------------|
| BEC23C1809A  | BEC               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 5.00000                                     | 13.000             | 26/02/2018       | 28/09/2018           | 4-Oct-2018      |
| ESSO23C1809A | ESSO              | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 4.66396                                     | 19.588             | 26/02/2018       | 28/09/2018           | 4-Oct-2018      |
| KTC23C1809A  | KTC               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 5.11771                                     | 27.550             | 26/02/2018       | 28/09/2018           | 4-Oct-2018      |
| MC23C1809A   | MC                | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 4.88472                                     | 15.631             | 26/02/2018       | 28/09/2018           | 4-Oct-2018      |
| MONO23C1809A | MONO              | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 0.79378                                     | 5.457              | 26/02/2018       | 28/09/2018           | 4-Oct-2018      |
| ORI23C1809A  | ORI               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 4.85814                                     | 23.320             | 26/02/2018       | 28/09/2018           | 4-Oct-2018      |
| PSL23C1809A  | PSL               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 4.00000                                     | 15.000             | 26/02/2018       | 28/09/2018           | 4-Oct-2018      |
| STA23C1809A  | STA               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 3.91803                                     | 13.713             | 26/02/2018       | 28/09/2018           | 4-Oct-2018      |
| TPI23C1809A  | TPIPP             | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 1.92916                                     | 8.199              | 26/02/2018       | 28/09/2018           | 4-Oct-2018      |
| UV23C1809A   | UV                | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 4.00000                                     | 15.000             | 26/02/2018       | 28/09/2018           | 4-Oct-2018      |
| AMAT23C1810A | AMATA             | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 3.89150                                     | 25.295             | 20/03/2018       | 31/10/2018           | 5-Nov-2018      |
| BDMS23C1810A | BDMS              | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 3.97994                                     | 25.870             | 20/03/2018       | 31/10/2018           | 5-Nov-2018      |
| CKP23C1810A  | CKP               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 0.79531                                     | 4.474              | 20/03/2018       | 31/10/2018           | 5-Nov-2018      |
| CPAL23C1810A | CPALL             | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 9.87362                                     | 93.799             | 20/03/2018       | 31/10/2018           | 5-Nov-2018      |
| CPF23C1810A  | CPF               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 3.90701                                     | 27.349             | 20/03/2018       | 31/10/2018           | 5-Nov-2018      |
| CPN23C1810A  | CPN               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 9.50000                                     | 90.000             | 20/03/2018       | 31/10/2018           | 5-Nov-2018      |
| IRPC23C1810A | IRPC              | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 1.97122                                     | 8.378              | 20/03/2018       | 31/10/2018           | 5-Nov-2018      |
| IVL23C1810A  | IVL               | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 10.76890                                    | 58.743             | 20/03/2018       | 31/10/2018           | 5-Nov-2018      |
| MINT23C1810A | MINT              | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 9.90001                                     | 44.550             | 20/03/2018       | 31/10/2018           | 5-Nov-2018      |
| SPRC23C1810A | SPRC              | ชำระเงินสดส่วนต่าง     | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                     | 4.61404                                     | 17.533             | 20/03/2018       | 31/10/2018           | 5-Nov-2018      |

| ชื่อย่อ      | หลักทรัพย์<br>อ้างอิง | การส่งมอบเมื่อใช้<br>สิทธิ | ประเภทการใช้สิทธิ                    | จำนวนที่<br>ออก (ล้าน<br>หน่วย) | อัตราการใช้<br>สิทธิต่อหน่วย<br>(DW: 1<br>Underlying) | ราคาใช้<br>สิทธิ<br>(บาท) | วันซื้อขายวัน<br>แรก | วันซื้อขายวัน<br>สุดท้าย | วันครบ<br>กำหนดอายุ |
|--------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------------------|---------------------------------|---|---------------------------|----------------------|--------------------------|---------------------|
| TMB23C1810A  | TMB                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 0.78110   | 3.222                     | 20/03/2018           | 31/10/2018               | 31/10/2018          |
| WHA23C1810A  | WHA                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 0.88000   | 4.400                     | 20/03/2018           | 31/10/2018               | 31/10/2018          |
| AAV23C1811A  | AAV                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 1.87175   | 5.615                     | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| BBL23C1811A  | BBL                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 38.71467  | 217.834                   | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| BCH23C1811A  | BCH                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 4.44109   | 18.258                    | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| CHG23C1811A  | CHG                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 0.39439   | 2.170                     | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| EGCO23C1811A | EGCO                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 38.97116  | 253.305                   | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| GLOB23C1811A | GLOBAL                | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 4.50000   | 18.000                    | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| HANA23C1811A | HANA                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 11.69591  | 35.089                    | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| KTB23C1811A  | KTB                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 3.86668   | 20.783                    | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| PSH23C1811A  | PSH                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 3.89666   | 23.380                    | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| SCC23C1811A  | SCC                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 98.13543  | 520.077                   | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| SIRI23C1811A | SIRI                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 0.34146   | 1.951                     | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| SPAL23C1811A | SPALI                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 3.93422   | 24.588                    | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| SUPE23C1811A | SUPER                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 0.40000   | 1.200                     | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| TOP23C1811A  | TOP                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 10.80264  | 106.066                   | 11/04/2018           | 29/11/2018               | 29/11/2018          |
| CBG23C1901A  | CBG                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 14.93206  | 73.669                    | 09/05/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| AP23C1901A   | AP                    | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 2.00000   | 12.000                    | 05/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| BEAU23C1901A | BEAUTY                | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 1.96626   | 35.393                    | 05/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| BEM23C1901A  | BEM                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 2.48225   | 9.333                     | 05/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| HMPR23C1901A | HMPRO                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 2.67244   | 21.776                    | 05/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |

| ชื่อย่อ      | หลักทรัพย์<br>อ้างอิง | การส่งมอบเมื่อใช้<br>สิทธิ | ประเภทการใช้สิทธิ                    | จำนวนที่<br>ออก (ล้าน<br>หน่วย) | อัตราการใช้<br>สิทธิต่อหน่วย<br>(DW: 1<br>Underlying) | ราคาใช้<br>สิทธิ<br>(บาท) | วันซื้อขายวัน<br>แรก | วันซื้อขายวัน<br>สุดท้าย | วันครบ<br>กำหนดอายุ |
|--------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------------------|---------------------------------|---|---------------------------|----------------------|--------------------------|---------------------|
| KCE23C1901A  | KCE                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 6.42467   | 59.305                    | 05/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| PTT23C1901A  | PTT                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 9.85222   | 68.963                    | 05/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| PTTE23C1901A | PTTEP                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 13.82743  | 219.274                   | 05/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| PTTG23C1901A | PTTGC                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 9.78953   | 127.267                   | 05/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| SUPE23C1901A | SUPER                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 0.70000   | 2.100                     | 05/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| THAI23C1901A | THAI                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 1.00000   | 40.000                    | 05/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| ANAN23C1901A | ANAN                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 25                              | 0.78214   | 6.355                     | 29/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| BANP23C1901A | BANPU                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 3.43584   | 26.996                    | 29/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| BJC23C1901A  | BJC                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 11.96315  | 69.785                    | 29/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| BPP23C1901A  | BPP                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 4.44444   | 31.605                    | 29/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| COM723C1901A | COM7                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 4.00000   | 23.500                    | 29/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| EA23C1901A   | EA                    | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 13.00000  | 47.000                    | 29/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| TTA23C1901A  | TTA                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 1.80000   | 10.200                    | 29/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| MONO23C1901A | MONO                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 1.00000   | 3.350                     | 29/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| UNIQ23C1901A | UNIQ                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 3.60000   | 18.500                    | 29/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| GGC23C1901A  | GGC                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 3.70000   | 17.800                    | 29/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| LH23C1901A   | LH                    | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 3.28472   | 13.815                    | 29/06/2018           | 31/01/2019               | 31/01/2019          |
| ADVA23C1902A | ADVANC                | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 22.15821  | 245.682                   | 25/07/2018           | 28/02/2019               | 28/02/2019          |
| BCPG23C1902A | BCPG                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 4.91449   | 21.624                    | 25/07/2018           | 28/02/2019               | 28/02/2019          |
| CENT23C1902A | CENTEL                | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 75                              | 13.00000  | 58.000                    | 25/07/2018           | 28/02/2019               | 28/02/2019          |
| KBAN23C1902A | KBANK                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 21.94426  | 252.377                   | 25/07/2018           | 28/02/2019               | 28/02/2019          |

| ชื่อย่อ        | หลักทรัพย์<br>อ้างอิง | การส่งมอบเมื่อใช้<br>สิทธิ | ประเภทการใช้สิทธิ                    | จำนวนที่<br>ออก (ล้าน<br>หน่วย) | อัตราการใช้<br>สิทธิต่อหน่วย<br>(DW: 1<br>Underlying) | ราคาใช้<br>สิทธิ<br>(บาท) | วันซื้อขายวัน<br>แรก | วันซื้อขายวัน<br>สุดท้าย | วันครบ<br>กำหนดอายุ |
|----------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------------------|---------------------------------|---|---------------------------|----------------------|--------------------------|---------------------|
| MEGA23C1902A   | MEGA                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 75                              | 13.87925  | 52.540                    | 25/07/2018           | 28/02/2019               | 28/02/2019          |
| TASC23C1902A   | TASCO                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 5.50000   | 17.500                    | 25/07/2018           | 28/02/2019               | 28/02/2019          |
| TKN23C1902A    | TKN                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 5.93014   | 18.779                    | 25/07/2018           | 28/02/2019               | 28/02/2019          |
| TRUE23C1902A   | TRUE                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 100                             | 2.80000   | 7.700                     | 25/07/2018           | 28/02/2019               | 28/02/2019          |
| TU23C1902A     | TU                    | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 75                              | 3.74784   | 19.725                    | 25/07/2018           | 28/02/2019               | 28/02/2019          |
| AMAT23C1906A   | AMATA                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 3.50000   | 33.000                    | 15/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| BBL23C1906A    | BBL                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 30.00000  | 260.000                   | 15/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| BDMS23C1906A   | BDMS                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 3.96810   | 29.761                    | 15/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| CPAL23C1906A   | CPALL                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 5.70000   | 90.000                    | 15/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| KTB23C1906A    | KTB                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 3.70000   | 23.000                    | 15/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| MTC23C1906A    | MTC                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 12.65000  | 65.000                    | 15/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| PTT23C1906A    | PTT                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 6.92521   | 63.400                    | 15/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| PTTE23C1906A   | PTTEP                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 20.46664  | 170.395                   | 15/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| PTTG23C1906A   | PTTGC                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 4.48692   | 115.789                   | 15/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| TMB23C1906A    | TMB                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 0.80000   | 2.750                     | 15/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| WHA23C1906A    | WHA                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 0.47000   | 6.000                     | 15/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| AOT23C1906A    | AOT                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 12.59129  | 73.779                    | 20/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| BANP23C1906A   | BANPU                 | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 4.00000   | 21.000                    | 20/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| BEAU23C1906A   | BEAUTY                | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 4.30000   | 15.000                    | 20/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| DTAC23C1906A   | DTAC                  | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 12.50000  | 62.000                    | 20/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| GLOBAL23C1906A | GLOBAL                | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 3.76676   | 22.600                    | 20/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |

| ชื่อย่อ     | หลักทรัพย์<br>อ้างอิง | การส่งมอบเมื่อใช้<br>สิทธิ | ประเภทการใช้สิทธิ                    | จำนวนที่<br>ออก (ล้าน<br>หน่วย) | อัตราการใช้<br>สิทธิต่อหน่วย<br>(DW: 1<br>Underlying) | ราคาใช้<br>สิทธิ<br>(บาท) | วันซื้อขายวัน<br>แรก | วันซื้อขายวัน<br>สุดท้าย | วันครบ<br>กำหนดอายุ |
|-------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------------------|---------------------------------|---|---------------------------|----------------------|--------------------------|---------------------|
| IVL23C1906A | IVL                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 13.41202  | 64.579                    | 20/11/2018           | 28/06/2019               | 28/06/2019          |
| TOP23C1906A | TOP                   | ชำระเงินสดส่วนต่าง         | ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ | 50                              | 14.37195  | 88.592                    | 25/07/2018           | 28/02/2019               | 28/02/2019          |



## 7. ความขัดแย้งทางผลประโยชน์จากการออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ผู้ออกเป็นบริษัทในเครือ ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) โดยธนาคารไทยพาณิชย์ ถือหุ้นทั้งหมด 100% โดยธนาคารไทยพาณิชย์และบริษัทในเครือมีการให้บริการทางการเงินและการลงทุนกับลูกค้าอย่างครบวงจร ซึ่งครอบคลุมบริการทางการเงิน ธุรกิจค้าหลักทรัพย์ ธุรกิจตราสารอนุพันธ์ทั้งในตลาดและนอกตลาด ธุรกิจวาณิชธนกิจ ธุรกิจการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ ธุรกิจจัดการกองทุนรวม ธุรกิจจัดการกองทุนส่วนบุคคล ธุรกิจประกันภัย เป็นต้น นอกจากนี้ ผู้ออกยังมีการลงทุนในบัญชีตนเอง โดยมีจุดประสงค์เพื่อหาทำกำไรเพื่อบริหารความเสี่ยง หรือเพื่อสร้างสภาพคล่อง เป็นต้น

ดังนั้น ผู้ออก ธนาคารไทยพาณิชย์และบริษัทในเครืออาจมีการถือครองหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ ดัชนีอ้างอิง รวมถึงถือครองใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ด้วย

ทั้งนี้เพื่อเป็นการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์จากการออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ออกจึงได้จัดให้มีมาตรการในการควบคุมภายใน โดยให้แต่ละส่วนงานมีการเก็บรักษาข้อมูลภายในฝ่ายของตนเองเป็นความลับ และไม่สามารถเข้าถึงข้อมูลได้จากส่วนงานอื่น โดยไม่จำเป็น (Chinese Wall)



## 8. โครงสร้างเงินทุน

### 8.1 แหล่งที่มาของเงินทุน

บริษัทฯ ใช้แหล่งเงินทุนส่วนใหญ่จากส่วนของผู้อถือหุ้น โดย ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 บริษัทฯ มีทุนจดทะเบียน 2,400 ล้านบาทชำระแล้วจำนวน 2,100 ล้านบาท บริษัทฯ มีวงเงินกู้ยืมกับธนาคารไทยพาณิชย์จำนวน 2,000 ล้านบาท เพื่อใช้เป็นแหล่งเงินทุนสำรองเพื่อความคล่องตัวทางการเงินในการดำเนินธุรกิจ

### 8.2 หลักทรัพย์ของบริษัทฯ

ผู้ออกมีทุนจดทะเบียนและทุนที่ออกชำระแล้ว ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 ดังนี้

|                      |  |
|----------------------|--|
| ทุนจดทะเบียน         | 2,400 ล้านบาท ประกอบด้วย หุ้นสามัญจำนวน 240,000,000 หุ้น มูลค่าที่ตราไว้<br>หุ้นละ 10 บาท  |
| ทุนที่ออกและชำระแล้ว | 2,000 ล้านบาท ประกอบด้วย หุ้นสามัญจำนวน 200,000,000 หุ้น มูลค่าที่ตราไว้<br>หุ้นละ 10 บาท<br>400 ล้านบาท ประกอบด้วย หุ้นสามัญจำนวน 40,000,000 หุ้น มูลค่าที่ตราไว้<br>หุ้นละ 10 บาท เรียกชำระ 2.50 บาท |

### 8.3 ผู้อถือหุ้น

รายชื่อผู้อถือหุ้น ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 เป็นดังนี้

| ชื่อผู้อถือหุ้น                   | จำนวนหุ้น   | ร้อยละ |
|-----------------------------------|-------------|--------|
| 1. ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) | 239,999,998 | 100.00 |
| 2. นางสาวชนกานต์ อนันตคุณากร      | 1           | 0.00   |
| 3. นางสาวอัจฉรา ศัสตราศาสตร์      | 1           | 0.00   |
| รวม                               | 240,000,000 | 100.00 |



11. ข้อมูลอื่นที่เกี่ยวข้อง

- ไม่มี -



ส่วนที่ 2

ผู้กำกับการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์  
และผู้ที่เป็นคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงของบริษัทที่ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

-ไม่มี-



ส่วนที่ 3

รายละเอียดกรณีมีการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีประกันเต็มจำนวน  
หรือที่มีประกันบางส่วน

- ไม่มี -