

ส่วนที่ 2

ผู้ค้าประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และผู้ที่เป็นคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงของบริษัทที่ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้จัดให้มีผู้ค้าประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และจัดให้มีการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อป้องกันความเสี่ยงในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ดังนี้

1. ผู้ค้าประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

1.1 ข้อมูลทั่วไป

ชื่อผู้ค้าประกัน	:	ธนาคารเจพีมอร์แกน เซส JPMorgan Chase Bank, National Association
ประเภทธุรกิจ	:	การธนาคารและบริการทางการเงินอื่น ๆ
เลขทะเบียนบริษัท	:	FC 004891
ที่ตั้งสำนักงาน	:	เลขที่ 383 เมดิสัน อเวนิว นิวยอร์ก เอ็นวาย 10179 ประเทศ สหรัฐอเมริกา
Homepage	:	www.jpmorganchase.com
โทรศัพท์	:	+1 212 270 6000
โทรสาร	:	-
ข้อมูลการติดต่อ		
ที่อยู่	:	ธนาคารเจพีมอร์แกน เซส เลขที่ 4 เมโทรเทคเซ็นเตอร์ ชั้น 15 บรูคลิน นิวยอร์ก 11245
ชื่อผู้ติดต่อ	:	Peter W Smith, JPMorgan Interentity Analysis Group (IAG)
โทรสาร	:	+1 917 746 2267

1.2 ลักษณะการประกอบธุรกิจโดยย่อ

1.2.1 ประวัติ การพัฒนา และโครงสร้างองค์กร

ผู้ค้าประกันเป็นธนาคารซึ่งเป็นบริษัทย่อยที่หุ้นทั้งหมดถือโดย JPMorgan Chase & Co. (“เจพีมอร์แกนเชส”) ซึ่งเป็นบริษัทที่เป็นผู้นำการให้บริการทางการเงินรายใหญ่ระดับโลก และเป็นหนึ่งในสถาบันการเงินที่ใหญ่ที่สุดในประเทศสหรัฐอเมริกา ที่มีการประกอบธุรกิจอยู่ทั่วโลก ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 ผู้ค้าประกันมีสำนักงานหลักอยู่ที่เมืองโคลัมบัส รัฐโอไฮโอ และมีสาขาใน 38 รัฐ และในกรุงวอชิงตัน ดี.ซี. ทั้งนี้ เจพีมอร์แกนเชส (รวมถึงผู้ค้าประกันและบริษัทย่อยอื่นๆ) รวมเรียกว่า “องค์กร”) ผู้ค้าประกันประกอบธุรกิจในประเทศสหรัฐอเมริกา รวมถึงผ่านทางสาขาและบริษัทย่อยอื่นที่ไม่ใช่สัญชาติสหรัฐอเมริกา รวมทั้งผ่านทางสำนักงานผู้แทน โดยหนึ่งในบริษัทย่อยหลักนั้นตั้งอยู่นอกประเทศสหรัฐอเมริกา คือ เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตีส์ พีแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) ซึ่งเป็นบริษัทย่อยที่ตั้งอยู่ในสหราชอาณาจักร โดย เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตีส์ พีแอลซี จะทำหน้าที่เป็นคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงสำหรับการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในครั้งนี้ (โปรดดูรายละเอียดเพิ่มเติมตามที่ระบุในหัวข้อที่ 2. ด้านล่างนี้)

ผู้ค้าประกัน (ทั้งโดยการดำเนินงานโดยตรงหรือผ่านทาง สำนักงานสาขา บริษัทย่อย และสำนักงาน) ได้มีการให้บริการทางการเงินแก่ทั้งลูกค้าในประเทศสหรัฐอเมริกา และนอกประเทศสหรัฐอเมริกา รวมถึงการให้บริการธนาคารเพื่อการลงทุน การให้บริการทางการเงินแก่ลูกค้าและธุรกิจขนาดเล็ก การธนาคารเพื่อการพาณิชย์ กระบวนการการทำธุรกรรมทางการเงิน และการจัดการสินทรัพย์ ทั้งนี้ ภายใต้ชื่อทางการค้าของเจพีมอร์แกนเชสนั้น ผู้ค้าประกันมีการให้บริการแก่ลูกค้าเป็นจำนวนหลายล้านรายในประเทศสหรัฐอเมริกาและทั่วโลก และลูกค้าที่มีชื่อเสียงระดับโลก ทั้งบริษัท สถาบันและรัฐบาล

ผู้ค้าประกันเป็นสมาคมธนาคารแห่งชาติที่จัดตั้งขึ้นภายใต้กฎหมายสหพันธรัฐของประเทศสหรัฐอเมริกา ผู้ค้านั้น เดิมจัดตั้งขึ้นเป็นธนาคารในรัฐนิวยอร์กเมื่อวันที่ 26 พฤศจิกายน 2511 และได้เปลี่ยนสถานะเป็นสมาคมธนาคารแห่งชาติเมื่อวันที่ 13 พฤศจิกายน 2547 ผู้ค้าประกันเป็นธนาคารที่ได้รับใบอนุญาตและธุรกิจของธนาคารอยู่ภายใต้การตรวจสอบและกฎเกณฑ์ของสำนักงานผู้ควบคุมเงินตรา (Office of the Comptroller of the Currency) (“OCC”) ซึ่งเป็นสำนักงานของกรมธนารักษ์ ประเทศสหรัฐอเมริกา ผู้ค้าประกันเป็นสมาชิกของระบบธนาคารกลาง (Federal Reserve System) ประเทศสหรัฐอเมริกาและเงินฝากในประเทศสหรัฐอเมริกาได้รับประกันโดยสถาบันประกันเงินฝากของสหรัฐอเมริกา (Federal Deposit Insurance Corporation) (“FDIC”) หมายเลขประจำตัวธนาคารกลางแห่งประเทศไทย (Federal Reserve Bank Identification Number) คือ 852218

อำนาจของผู้ค้าประกันได้ระบุไว้ในพระราชบัญญัติธนาคารแห่งชาติ (National Banking Act) ของประเทศสหรัฐอเมริกา โดยรวมถึงอำนาจทั้งหมดที่จำเป็นในการประกอบธุรกิจธนาคาร การขายลดตั๋วสัญญาใช้เงินที่เปลี่ยนมือได้ คราฟต์ ตัวแลกเงิน และหลักฐานแห่งหนี้อื่นๆ การรับฝากเงิน การซื้อขายและการแลกเปลี่ยนเงินตรา เหรียญ และทองคำแท่ง การให้กู้ยืมเงินโดยมีหลักประกัน และจัดหา ออก และหมุนเวียนธนบัตร

สำนักงานจดทะเบียนของผู้ค้าประกัน ตั้งอยู่ที่ เลขที่ 1111 โพลาริส พาร์คเวย์ โคโลัมบัส โอไฮโอ 43240 ประเทศสหรัฐอเมริกา สถานที่ประกอบธุรกิจหลักของผู้ค้าประกัน ตั้งอยู่ที่ เลขที่ 383 เมดิสัน อเวนิว นิวยอร์ก เอ็นวาย 10179 ประเทศสหรัฐอเมริกา หมายเลขโทรศัพท์ +1 212 270 6000

1.2.2 กิจกรรมหลักและตลาดหลัก

กิจกรรมต่างๆ ของผู้ค้าประกันได้ถูกจัดระเบียบและรวมอยู่ในธุรกิจต่างๆ ของเจพีมอร์แกนเชส ดังนั้นการดำเนินธุรกิจของผู้ค้าประกันจึงขึ้นอยู่กับเจพีมอร์แกนเชส (รวมถึงบริษัทย่อยต่างๆ ของเจพีมอร์แกนเชส และของผู้ค้าประกัน) โปรดดูคำอธิบายธุรกิจต่างๆ และผลิตภัณฑ์และการบริการที่เจพีมอร์แกน เชส และผู้ค้าประกันมอบให้แก่ลูกค้าของตนแต่ละรายดังที่ระบุไว้ในข้อ 3.1 ของส่วนที่ 1 ของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้

1.2.3 ผู้บริหารและกรรมการ

ผู้บริหาร

บุคคลดังต่อไปนี้เป็นผู้บริหารของผู้ค้าประกัน ณ วันที่ของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ โดยที่อยู่ทางธุรกิจของผู้บริหารแต่ละราย คือ เลขที่ 383 เมดิสัน อเวนิว นิวยอร์ก เอ็นวาย 10179 ประเทศสหรัฐอเมริกา

<u>ชื่อ</u>	<u>ตำแหน่ง</u>
James Dimon	ประธานเจ้าหน้าที่บริหารและกรรมการผู้จัดการใหญ่
Ashley Bacon	ประธานเจ้าหน้าที่ด้านความเสี่ยง
Lori A. Beer	ประธานเจ้าหน้าที่ด้านข้อมูล
Mary Callahan Erdoes	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร ฝ่ายการบริหารสินทรัพย์และความมั่งคั่ง
Stacey Friedman	ที่ปรึกษาทั่วไป
Marianne Lake	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร การบริการด้านบัตรและการให้สินเชื่อแก่ผู้บริโภค
Robin Leopold	หัวหน้าฝ่ายทรัพยากรมนุษย์
Douglas B. Petno	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร ฝ่ายการธนาคารเพื่อการพาณิชย์
Jennifer Piepszak	ประธานเจ้าหน้าที่บริหารด้านการเงิน
Daniel E. Pinto	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร ฝ่ายการธนาคารเพื่อการลงทุนและองค์กร
Peter Scher	หัวหน้าฝ่ายความรับผิดชอบต่อสังคม
Gordon A. Smith	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร ฝ่ายการธนาคารเพื่อลูกค้าและชุมชน

กรรมการ

บุคคลดังต่อไปนี้เป็นผู้เป็นสมาชิกในคณะกรรมการของผู้ถือหุ้น ณ วันที่ของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ โดยที่อยู่ทางธุรกิจของกรรมการแต่ละราย คือ เลขที่ 383 เมดิสัน อเวนิว นิวยอร์ก เอ็นวาย 10179 ประเทศสหรัฐอเมริกา

ชื่อ	อาชีพหลัก
Linda B. Bammann	รองหัวหน้าฝ่ายบริหารความเสี่ยงของเจพีมอร์แกนเชส (เกษียณ)
James A. Bell*	รองกรรมการผู้จัดการใหญ่ (เกษียณ) บริษัท The Boeing Company
Stephen B. Burke ประธานกรรมการ ของคณะกรรมการที่ไม่ได้เป็นผู้บริหาร	ประธานเจ้าหน้าที่บริหารบริษัท NBCUniversal, LLC
Todd A. Combs	เจ้าหน้าที่ด้านการลงทุนบริษัท Berkshire Hathaway Inc.
James S. Crown	ประธานและประธานเจ้าหน้าที่บริหารของบริษัท Henry Crown and Company
James Dimon	ประธานกรรมการและประธานเจ้าหน้าที่บริหารของเจพีมอร์แกนเชส
Timothy P. Flynn	ประธาน (เกษียณ) และประธานเจ้าหน้าที่บริหารของบริษัท KPMG International
Mellody Hobson	ประธานบริษัท Ariel Investments, LLC
Laban P. Jackson, Jr.*	ประธานและประธานเจ้าหน้าที่บริหารบริษัท Clear Creek Properties, Inc.
Michael A. Neal	ประธานบริษัท General Electric (เกษียณ) ประธานและประธานเจ้าหน้าที่บริหาร (เกษียณ) บริษัท GE Capital
Lee R. Raymond	ประธานและประธานเจ้าหน้าที่บริหาร (เกษียณ) บริษัท ExxonMobil Corporation

*เมื่อวันที่ 19 มีนาคม 2563 JPMorgan Chase & Co. ได้ประกาศว่า James A. Bell และ Laban P. Jackson, Jr. ได้ตัดสินใจออกจากความเป็นคณะกรรมการบริษัทของ JPMorgan Chase & Co. และผู้ถือหุ้น โดยให้มีผลเมื่อครบกำหนดวาระการดำรงตำแหน่ง ณ วันก่อนวันที่มีการจัดประชุมสามัญผู้ถือหุ้นประจำปี 2563 ของ JPMorgan Chase & Co.

1.2.4 ข้อมูลทางการเงิน

ผู้ค้าประกันจัดทำงบการเงินรวมประจำปีและครึ่งปีตามหลักการบัญชีที่ยอมรับโดยทั่วไปของประเทศสหรัฐอเมริกา (“U.S. GAAP”) นอกจากนี้ นโยบายการบัญชีและการรายงานทางการเงินของผู้ค้าประกันเป็นไปตามแนวปฏิบัติทางการบัญชีและการรายงานที่กำหนดโดยหน่วยงานกำกับดูแลธนาคารของประเทศสหรัฐอเมริกาในกรณีที่เกี่ยวข้อง งบการเงินรวมที่ได้รับการตรวจสอบแล้วของผู้ค้าประกัน ณ และสำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 และ 31 ธันวาคม 2561 ซึ่งประกอบด้วยงบดุลรวม ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 และ 2561 และงบกำไรขาดทุนรวม งบแสดงการเปลี่ยนแปลงส่วนของผู้ถือหุ้น งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบกระแสเงินสดสำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 ได้รวมอยู่ในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ นอกจากนี้ งบการเงินรวมประจำปีและครึ่งปีของผู้ค้าประกัน สามารถดูได้จากเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์ลักเซมเบิร์ก (www.bourse.lu) National Storage Mechanism แห่งสหราชอาณาจักร (www.morningstar.co.uk/uk/nsm) และ Euronext Dublin (www.ise.ie) ผู้ค้าประกันยื่นรายงานสภาพและรายได้รวมประจำปีไตรมาสสำหรับธนาคารที่มีสำนักงานทั้งในและต่างประเทศ (“Call Report”) กับสภาการตรวจสอบสถาบันการเงินแห่งรัฐบาลของประเทศสหรัฐอเมริกา (Federal Financial Institutions Examination Council) (“FFIEC”) โดยข้อมูลส่วนที่ไม่ได้เป็นข้อมูลความลับใน Call Report สามารถดูได้ในเว็บไซต์ของ FFIEC ที่ <https://cdr.ffiec.gov/public/> ทั้งนี้ รายงาน Call Report จัดทำขึ้นตามกฎระเบียบที่ออกโดย FFIEC มิใช่ U.S. GAAP รายงาน Call Report เป็นเอกสารเกี่ยวกับการกำกับดูแลทางกฎหมาย มิใช่เอกสารหลักทางบัญชี ไม่ได้เป็นไปตาม U.S. GAAP และไม่ได้ให้รายละเอียดการเปิดเผยข้อมูลทางการเงินทั้งหมดของผู้ค้าประกัน รายงาน Call Report ไม่ได้ถูกรวมอยู่ในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้โดยการอ้างอิง และไม่ถือเป็นส่วนหนึ่งของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้

1.2.5 การบริหารความเสี่ยง

การบริหารความเสี่ยงเป็นส่วนหนึ่งของการดำเนินธุรกิจของเจฟิเมอร์แกนเซส เมื่อเจฟิเมอร์แกนเซสมีการปล่อยสินเชื่อให้แก่ผู้บริโภคหรือธุรกิจขนาดใหญ่ การให้คำแนะนำแก่ลูกค้าในการตัดสินใจลงทุน การทำการตลาดในหลักทรัพย์ หรือการเสนอขายผลิตภัณฑ์และบริการ เจฟิเมอร์แกนเซสมีการประเมินความเสี่ยงในบางระดับ โดยวัตถุประสงค์โดยทั่วไปของเจฟิเมอร์แกนเซสนั้นเพื่อการบริหารธุรกิจ และความเสี่ยงที่เกี่ยวข้อง ในลักษณะที่ทำให้มีความสมดุลของส่วนได้เสียของลูกค้า นักลงทุน และปกป้องให้การบริการของเจฟิเมอร์แกนเซสมีความปลอดภัย

เจฟิเมอร์แกนเซสเชื่อว่าการบริหารความเสี่ยงอย่างมีประสิทธิภาพนั้นจำเป็นต้องรวมถึงสิ่งดังต่อไปนี้ ตัวอย่างเช่น

- ขอมรับซึ่งหน้าที่ความรับผิดชอบ รวมถึงการบ่งชี้และการนำเสนอประเด็นความเสี่ยงโดยบุคคลทั้งหมดภายในเจฟิเมอร์แกนเซส
- ความเป็นผู้รับผิดชอบในการบ่งชี้ความเสี่ยง การประเมิน การจัดการและข้อมูลภายในแต่ละหน่วยธุรกิจ (line of business (“LOB”)) และองค์กร และ
- โครงสร้างทั่วโลกของการจัดการความเสี่ยงที่ดี

เจฟิเมอร์แกนเซสได้มีการปรับปรุงอย่างต่อเนื่องผ่านความพยายามในการสร้างการควบคุม การฝึกอบรมพนักงาน และการพัฒนา การดำรงไว้ซึ่งพนักงานที่มีความสามารถ และมาตรการอื่นๆ เจฟิเมอร์แกนเซสได้ดำเนินการตามกฎเกณฑ์และกรอบ

การจ่ายค่าตอบแทนที่มีความสมดุลกับการจัดการที่ดีและเข้มแข็งภายใน ความเป็นอิสระในการตรวจสอบของ คณะกรรมการ (“คณะกรรมการ”) ผลกระทบของความเสี่ยงและประเด็นในการควบคุมนั้นจะมีการพิจารณาในการ ประเมินผลการปฏิบัติงานของเจพีมอร์แกนเชสและกระบวนการในการจ่ายค่าตอบแทนและผลประโยชน์

กรอบการดูแลจัดการและการกำกับความเสี่ยง

การจัดการความเสี่ยงที่ดีของเจพีมอร์แกนเชสและกรอบการกำกับดูแลนั้นเกี่ยวข้องกับการนำไปสู่ความเข้าใจซึ่งความเสี่ยง ประเภทความเสี่ยง และผลกระทบของความเสี่ยง

ตัวขับเคลื่อนความเสี่ยง

ตัวขับเคลื่อนความเสี่ยงนั้นเป็นปัจจัยที่ทำให้ความเสี่ยงยังคงมีอยู่ โดยตัวขับเคลื่อนความเสี่ยงนั้นรวมถึง สภาพแวดล้อมทาง เศรษฐกิจ กฎเกณฑ์และนโยบายของรัฐ คู่แข่งและสถานะทางการตลาด การตัดสินใจทางธุรกิจ กระบวนการและการ ตัดสินใจที่ผิดพลาด การกระทำความผิดที่มีการไตร่ตรองไว้ก่อน ตลาดที่มีความผิดปกติ และภัยธรรมชาติ

ประเภทความเสี่ยง

ประเภทของความเสี่ยงนั้นถูกจำแนกออกมาตามลักษณะที่แสดงออกของความเสี่ยงนั่นเอง ทั้งนี้ โดยทั่วไปแล้วสามารถแยก ความเสี่ยงออกได้เป็นสี่ประเภทดังนี้

- ความเสี่ยงทางกลยุทธ์ซึ่งเป็นความเสี่ยงด้านรายได้ เงินทุน สภาพคล่อง หรือชื่อเสียงที่เกี่ยวข้องกับการ ออกแบบแผนธุรกิจที่ผิดพลาดหรือไม่ดีพอ หรือการโต้ตอบต่อความเปลี่ยนแปลงในสภาพแวดล้อมของ การประกอบกิจการที่ไม่เพียงพอ
- ความเสี่ยงด้านการลงทุนและเครดิตซึ่งเป็นความเสี่ยงที่มีความเกี่ยวข้องกับการผิมนัดหรือการ เปลี่ยนแปลงประวัติทางเครดิตของลูกค้า หรือคู่สัญญา หรือความสูญเสียไปซึ่งเงินลงทุน การลดลงของ ผลตอบแทนจากเงินลงทุนที่คาดหวัง รวมถึงความเสี่ยงทางเครดิตของผู้บริโภค ความเสี่ยงทางเครดิต ของธุรกิจขนาดใหญ่ และความเสี่ยงด้านพอร์ตการลงทุน
- ความเสี่ยงด้านการตลาดซึ่งเป็นความเสี่ยงที่มีความเกี่ยวข้องกับการเปลี่ยนแปลงในปัจจัย ทางการตลาด เช่น อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศและดอกเบี้ย ราคาสินค้าอุปโภคบริโภคและ เงินทุน ความผันผวนของส่วนต่างทางเครดิต มูลค่าของสินทรัพย์และความรับผิดชอบในระยะสั้นและ ระยะยาว
- ความเสี่ยงด้านการปฏิบัติการซึ่งเป็นความเสี่ยงที่มีความเกี่ยวข้องกับการกระทบในทางลบอันเกิดขึ้นจาก ความไม่เพียงพอของกระบวนการภายใน หรือระบบ ปัจจัยเกี่ยวกับมนุษย์ หรือเหตุการณ์ภายนอกซึ่ง

ส่งผลกระทบต่อกระบวนการหรือระบบของเจพีมอร์แกนเชส อันรวมถึงการปฏิบัติตามกฎหมาย การปฏิบัติงาน กฎหมาย และความเสี่ยงทางรูปแบบและการประเมิน

ผลกระทบของความเสี่ยง

ผลกระทบของความเสี่ยงนั้นเป็นผลมาจากความเสี่ยง ทั้งในด้านปริมาณและคุณภาพ ผลกระทบหลายประการที่แสดงถึงความเสี่ยง เช่น การลดลงของรายได้และเงินทุน การขาดสภาพคล่อง และค่าปรับ หรือโทษ หรือผลกระทบด้านคุณภาพ เช่น ความเสียหายต่อชื่อเสียง การสูญเสียลูกค้า และการดำเนินการบังคับคดีและการปฏิบัติตามกฎหมาย

กรอบการดูแลและการบริหารจัดการที่ดีเกี่ยวกับความเสี่ยงของเจพีมอร์แกนเชสนั้นมีการบริหารจัดการบนพื้นฐานของระดับองค์กร เจพีมอร์แกนเชสมีหน่วยงานที่บริหารความเสี่ยงอย่างเป็นอิสระ (“IRM”) ซึ่งประกอบด้วยหน่วยงานการปฏิบัติตามกฎหมายและการบริหารความเสี่ยง โดยประธานเจ้าหน้าที่บริหาร (Chief Executive Officer (CEO)) ได้แต่งตั้งโดยความเห็นชอบของคณะกรรมการความเสี่ยง (“คณะกรรมการความเสี่ยง”) ตำแหน่ง Chief Risk Office (CRO) ของเจพีมอร์แกนเชสเป็นผู้นำในหน่วยงาน IRM และบริหาร โครงสร้างการจัดการความเสี่ยงของเจพีมอร์แกนเชส กรอบหลักเกณฑ์นั้นจะต้องได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการความเสี่ยงในรูปแบบของนโยบายการบริหารความเสี่ยงหลัก CRO ของเจพีมอร์แกนเชสจะกำกับดูแลและมอบหมายอำนาจให้แก่ LBO CROs, Firmwide Risk Executives (“FREs”) และ Chief Compliance Office (“CCO”) ของเจพีมอร์แกนเชส ซึ่งแต่ละหน่วยงานดังกล่าวจะจัดตั้งหน่วยงานในการปฏิบัติตามกฎหมายและการจัดการความเสี่ยงเพื่อกำหนดนโยบายการบริหารจัดการความเสี่ยงและมาตรฐาน รวมทั้งกำหนดและกำกับดูแลการปฏิบัติให้เป็นไปตามการจัดการความเสี่ยงของเจพีมอร์แกนเชส ทั้งนี้ LBO CROs จะรับผิดชอบสำหรับความเสี่ยงที่เกิดขึ้นในหน่วยงาน LOBs ในขณะที่หน่วยงาน FREs นั้นจะกำกับดูแลเกี่ยวกับความเสี่ยงที่ขยายไปถึงตัวบุคคลใน LOBs หน่วยงานต่างๆ และในภูมิภาค

การป้องกันสามลำดับขั้น

เจพีมอร์แกนเชสเชื่อมั่นในแต่ละหน่วยงานของ LOBs และหน่วยงาน Corporate ที่มีผลต่อความเสี่ยงในการดำเนินงานภายในตัวแปรที่ระบุโดยหน่วยงาน IRM และภายในความเสี่ยงที่มีการบ่งชี้และมาตรฐานการควบคุม แต่ละ LOB ฝ่ายการคลังและ CIO รวมถึงหน่วยงานอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องในทางการจัดการการควบคุม เทคโนโลยี การดำเนินงาน ซึ่งเป็นผู้รับผิดชอบลำดับแรกของเจพีมอร์แกนเชส และมีหน้าที่ในการบ่งชี้ความเสี่ยง เช่นเดียวกันกับการออกแบบและการดำเนินการควบคุม ในการจัดการความเสี่ยง ผู้รับผิดชอบในลำดับแรกต้องรับผิดชอบในการปฏิบัติตามกฎหมาย ระเบียบ ข้อบังคับ และเพื่อการดำเนินการตามโครงสร้างการบริหารความเสี่ยง ซึ่งรวมถึงนโยบาย มาตรฐาน ข้อจำกัด สัดส่วน และการควบคุม) ซึ่งจัดให้มีขึ้นโดย IRM

หน่วยงาน IRM นั้น เป็นอิสระในทางธุรกิจและเป็น “ผู้รับผิดชอบในลำดับที่สอง” ของเจพีมอร์แกนเชส หน้าที่ของ IRM นั้น คือ กำหนดการกำกับดูแลโครงสร้างการบริหารความเสี่ยงสำหรับการกำกับดูแลความเสี่ยงในระดับวงกว้างของทั้งองค์กร และมีอิสระในการประเมินและการทำทนายต่อผู้รับผิดชอบในลำดับแรก IRM มีหน้าที่รับผิดชอบในการปฏิบัติตามกฎหมาย ระเบียบ ข้อบังคับ และเพื่อการดำเนินการตามโครงสร้างการบริหารความเสี่ยงที่จัดให้มีขึ้นโดย IRM (ซึ่งรวมถึงนโยบาย มาตรฐาน ข้อจำกัด สัดส่วน และการควบคุม) ที่เกี่ยวกับกระบวนการของหน่วยงานของตนเอง

หน่วยงานการตรวจสอบภายในดำเนินงานอย่างเป็นอิสระจากหน่วยงานส่วนอื่นๆ ของเจพีมอร์แกนเชส และดำเนินการทดสอบอย่างเป็นอิสระ และมีกระบวนการในการประเมินและการควบคุมครอบคลุมเจพีมอร์แกนเชสในฐานะ “ผู้รับผิดชอบลำดับที่สาม” หน่วยงานการตรวจสอบภายในมี General Auditor เป็นหัวหน้า ซึ่งรายงานต่อ Audit Committee และการบริหารโดย CEO

นอกจากนี้ ยังมีหน่วยงานอื่นๆ ที่มีส่วนช่วยในสถานะแวดล้อมของการควบคุมองค์กรของเจพีมอร์แกนเชส รวมถึง การเงิน ทรัพยากรบุคคล กฎหมาย และการจัดการการควบคุม

การบ่งชี้ความเสี่ยงและความรับผิดชอบ

แต่ละ LOB และหน่วยงาน Corporate นั้นรับผิดชอบในการบ่งชี้ความเสี่ยงที่มีอยู่ รวมถึงการออกแบบและการกำหนดการควบคุม รวมถึงการควบคุมที่มีการระบุใน IRM เพื่อการจัดการความเสี่ยงต่างๆ ดังกล่าว และเพื่อสนับสนุนการกระทำดังกล่าวนั้น เจพีมอร์แกนเชสนั้นมีกระบวนการในการระบุความเสี่ยงที่กำหนดขึ้นเพื่ออำนวยความสะดวกให้แก่ผู้รับผิดชอบในการบ่งชี้ความเสี่ยงที่สำคัญที่มีผลต่อเจพีมอร์แกนเชส จัดทำความเสี่ยงให้อยู่ในรูปแบบการรวมศูนย์และทบทวนความเสี่ยงที่มีความสำคัญที่สุดเป็นประจำ โดย IRM นั้นจะต้องทบทวนและทดสอบการบ่งชี้ความเสี่ยงโดย LOB และ Corporate การดำรงไว้ซึ่งการรวมศูนย์และการจัดให้มีการรวมผลของทั้งองค์กรให้แก่ JPMorgan Chasewide Risk Committee (“FRC”) และ คณะกรรมการจัดการความเสี่ยง

ความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (Risk Appetite) ความเสี่ยงที่ยอมรับได้ของเจพีมอร์แกนเชสอยู่ภายใต้กรอบของ ความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (Risk Appetite) กรอบหลักเกณฑ์และความเสี่ยงที่ยอมรับได้ของเจพีมอร์แกนเชสกำหนดขึ้นโดย CEO, Chief Finance Officer (“CFO”) และ CRO โดยปัจจัยเกี่ยวกับคุณภาพและตัวชี้วัดปริมาณถูกนำมาใช้ในการติดตามและชี้วัดความสามารถของเจพีมอร์แกนเชสในการรับความเสี่ยงที่สอดคล้องกับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ที่กำหนดไว้ ปัจจัยทางคุณภาพนั้นได้จัดให้มีขึ้นเพื่อประเมินความเสี่ยงด้านการดำเนินงาน ซึ่งส่งผลกระทบต่อชื่อเสียงของเจพีมอร์แกนเชส ผลกระทบของความเสี่ยงที่ยอมรับได้นั้นมีการรายงานให้แก่คณะกรรมการความเสี่ยง

โครงสร้างการกำกับดูแลและการจัดการความเสี่ยง

สถานะที่เป็นอิสระของหน่วยงาน IRM นั้นได้รับการสนับสนุนจากโครงสร้างการกำกับดูแลซึ่งกำหนดให้มีการเสนอประเด็นความเสี่ยงไปยังผู้บริหารระดับสูง FRC และคณะกรรมการบริษัท ตามที่เหมาะสม

คณะกรรมการการปฏิบัติงาน (Operating Committee) ของเจพีมอร์แกนเชสประกอบด้วย CEO, CRO, CFO และผู้บริหารระดับสูงของเจพีมอร์แกนเชส ซึ่งมีหน้าที่รับผิดชอบและอาจเสนอเรื่องไปยังคณะกรรมการของเจพีมอร์แกนเชส คณะกรรมการการปฏิบัติงาน (Operating Committee) มีหน้าที่รับผิดชอบในการเสนอเรื่องไปยังคณะกรรมการบริษัทเท่าที่จำเป็นในการอำนวยความสะดวกในการปฏิบัติหน้าที่ของคณะกรรมการ

การดูแลของคณะกรรมการ

คณะกรรมการของเจพีมอร์แกนเชสมีการกำกับดูแลความเสี่ยง โดยมีคณะกรรมการความเสี่ยงเป็นคณะกรรมการหลักซึ่งกำกับดูแลเรื่องที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยง คณะกรรมการตรวจสอบ (Audit Committee) กำกับดูแลสถานะแวดล้อมการควบคุม

คณะกรรมการการพัฒนาการบริหารและค่าตอบแทน (Compensation & Management Development Committee) กำกับดูแลเรื่องค่าตอบแทนและเรื่องอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องกับการบริหาร โดยแต่ละคณะกรรมการของคณะกรรมการบริษัทนั้นจะกำกับดูแลความเสี่ยงเกี่ยวกับชื่อเสียง และความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติงานภายในขอบอำนาจหน้าที่ความรับผิดชอบของตน

คณะกรรมการบริษัทของผู้ค้าประกันนั้นมีหน้าที่รับผิดชอบในการกำกับดูแลการบริหารจัดการของธนาคาร โดยคณะกรรมการบริษัทของผู้ค้าประกันนั้นสามารถกระทำหน้าที่นี้ได้ทั้งโดยตรงและโดยผ่านคณะกรรมการที่มีอยู่ของคณะกรรมการบริษัทของเจพีมอร์แกนเชส การกำกับดูแลและการควบคุมความเสี่ยงในนามของผู้ค้าประกันนั้นเป็นความรับผิดชอบหลักของคณะกรรมการความเสี่ยงและคณะกรรมการตรวจสอบ ตามลำดับ โดยในส่วนที่เกี่ยวข้องกับค่าตอบแทนและเรื่องอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องกับการบริหารนั้นจะเป็นความรับผิดชอบของคณะกรรมการพัฒนาการจัดการและค่าตอบแทน (Compensation & Management Development Committee)

คณะกรรมการความเสี่ยงช่วยเหลือคณะกรรมการบริษัทในการตรวจสอบความรับผิดชอบของผู้บริหารในการปฏิบัติให้เป็นไปตามกรอบหลักเกณฑ์การจัดการความเสี่ยงทั่วโลกที่มีการกำหนดตามสมควรในการบ่งชี้ ความรับผิดชอบของคณะกรรมการความเสี่ยงรวมถึงการอนุมัตินโยบายความเสี่ยงหลักที่เกี่ยวข้อง การทบทวนกรอบหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องบางประการ การวิเคราะห์และการรายงานที่กำหนดโดยฝ่ายบริหาร การฝ่าฝืนความเสี่ยงที่ยอมรับได้ และประเด็นเกี่ยวกับตัวแปรต่างๆ ซึ่งอาจส่งผลกระทบในทางลบอย่างมีนัยสำคัญต่อเจพีมอร์แกนเชส รวมถึงประเด็นเกี่ยวกับเงินทุนและสภาพคล่อง และประเด็นสำคัญอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องจะมีการนำเสนอไปยังคณะกรรมการความเสี่ยงตามที่เหมาะสม

คณะกรรมการตรวจสอบ (Audit Committee) ช่วยเหลือคณะกรรมการบริษัทในการกำกับดูแลความรับผิดชอบของฝ่ายบริหารในการทำให้มั่นใจว่ามีระบบการควบคุมที่มีประสิทธิภาพที่ออกแบบอย่างเหมาะสมในการปกป้องสินทรัพย์และรายได้ของเจพีมอร์แกนเชส มั่นใจได้ถึงความสมบูรณ์ของงบการเงินของเจพีมอร์แกนเชสและการดำรงไว้ซึ่งการปฏิบัติตามกฎหมายของเจพีมอร์แกนเชส ตามมาตรฐานจริยธรรม นโยบาย แผน และวิธีการ กฎหมายและกฎระเบียบต่างๆ คณะกรรมการตรวจสอบยังช่วยเหลือคณะกรรมการบริษัทในการกำกับดูแลคุณสมบัติของบริษัทที่เป็นผู้จัดทำบัญชีที่มีการขึ้นทะเบียนอย่างเป็นอิสระ ความมีอิสระและผลการปฏิบัติงาน และผลการปฏิบัติงานของหน่วยงานการตรวจสอบภายในของเจพีมอร์แกนเชส

คณะกรรมการการพัฒนาการบริหารและค่าตอบแทน (Compensation & Management Development Committee (“CMDC”)) ช่วยเหลือคณะกรรมการบริษัทในการกำกับดูแลแนวปฏิบัติและหลักเกณฑ์เกี่ยวกับค่าตอบแทนของเจพีมอร์แกนเชส โดย CMDC จะมีการทบทวนและอนุมัติโครงการเกี่ยวกับค่าตอบแทนและผลประโยชน์ของเจพีมอร์แกนเชส นอกจากนี้ คณะกรรมการดังกล่าวยัง จะทบทวนการปฏิบัติงานของสมาชิกของคณะกรรมการการปฏิบัติงานต่อเป้าหมาย และอนุมัติรางวัล CMDC จะมีการทบทวนการพัฒนาและการสืบทอดตำแหน่งสำหรับผู้บริหารรายสำคัญๆ และกำกับดูแลวัฒนธรรมของเจพีมอร์แกนเชส รวมถึงการทบทวนสิ่งใหม่ๆ จากการจัดการเกี่ยวกับประเด็นการปฏิบัติงานที่สำคัญ และการกระทำของลูกจ้างที่เกี่ยวข้อง รวมถึงการดำเนินการที่เกี่ยวกับค่าตอบแทน

คณะกรรมการการรับผิดชอบต่อสาธารณะ (Public Responsibility Committee) ช่วยเหลือคณะกรรมการบริษัทในการกำกับดูแลสถานะของเจพีมอร์แกนเชสและเรื่องที่เกี่ยวข้องกับการรับผิดชอบต่อสาธารณะในการลงทุนในชุมชน การให้กู้ยืมเงินที่เป็นธรรม การดำรงไว้ การปฏิบัติต่อผู้บริโภค และประเด็นนโยบายอื่นเกี่ยวกับสาธารณะซึ่งส่งผลกระทบต่อมูลค่าของเจพีมอร์

แกนเซส ลักษณะ และอาจส่งผลกระทบต่อชื่อเสียงของเจพีมอร์แกนเซสระหว่างผู้มีส่วนได้เสียที่เกี่ยวข้อง คณะกรรมการนี้ยังมีการให้คำแนะนำในเรื่องต่างๆ ที่เกี่ยวกับการบริหารจัดการและคณะกรรมการบริษัทตามที่เหมาะสม

คณะกรรมการการแต่งตั้งและการกำกับดูแลที่ดีของกิจการ (*Corporate Governance & Nominating Committee*) กำกับดูแลทั่วไปเกี่ยวกับการดูแลกิจการที่ดีของคณะกรรมการบริษัท โดยคณะกรรมการนี้จะมีการประเมินและให้คำแนะนำแก่คณะกรรมการบริษัทในด้านแนวทางการจัดการที่ดีของกิจการที่มีผลใช้บังคับต่อเจพีมอร์แกนเซส รวมถึงการประเมินกรอบหลักเกณฑ์สำหรับการประเมินผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการบริษัทและการประเมินตนเอง

การกำกับดูแลของผู้บริหาร

ในระหว่างคณะกรรมการของผู้บริหารระดับสูงของเจพีมอร์แกนเซสนั้นจะมีหน้าที่รับผิดชอบหลักเกี่ยวกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงซึ่งรวมถึง

JPMorgan Chasewide Risk Committee เป็นคณะกรรมการในระดับการบริหารความเสี่ยงที่สูงที่สุด ซึ่งกำกับดูแลความเสี่ยงที่มีต่อธุรกิจของเจพีมอร์แกนเซส และทำหน้าที่ในการหิบบกหัวข้อและประเด็นความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องที่มีการนำเสนอโดยคณะกรรมการที่เกี่ยวข้อง และ/หรือ สมาชิกของ FRC

JPMorgan Chasewide Control Committee เป็นคณะกรรมการที่จะคอยหิบบกและนำเสนอความเสี่ยงไปยังผู้บริหารอาวุโสเพื่อทบทวนและหารือเกี่ยวกับสภาพแวดล้อมเกี่ยวกับความเสี่ยงในการปฏิบัติการของ JPMorgan Chasewide รวมถึงความเสี่ยงที่มีการบ่งชี้ การวัดความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงาน และเหตุการณ์สำคัญที่มีการนำเสนอ

JPMorgan Chasewide Fiduciary Risk Governance Committee ดูแลกรอบการกำกับดูแลความเสี่ยงเกี่ยวกับการดูแลทรัพย์สินหรือความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับความขัดแย้งทางผลประโยชน์ที่เกิดขึ้นกับแต่ละ LOB ของเจพีมอร์แกนเซส FERGC นั้นจะอนุมัตินโยบายหรือการปฏิบัติการตามความเสี่ยงที่เป็นข้อบกพร่อง รายงานการทบทวนจาก LOB และหน่วยงานที่ควบคุม รวมถึงการวัดการดูแลทรัพย์สินและแนวโน้มการควบคุม *JPMorgan Chasewide Estimation Risk Committee* ดูแลกรอบการกำกับดูแลที่เกี่ยวข้องกับการประเมินทางคุณภาพและปริมาณ และรูปแบบที่กำหนดในนโยบายการบริหารจัดการรูปแบบและการประเมิน โดย FERC ยังมีความรับผิดชอบในการกำหนดลำดับความสำคัญของการประเมินและกิจกรรมรูปแบบความเสี่ยง และดำเนินการให้สอดคล้องกัน โดยผ่านการทบทวนการดำเนินกิจกรรมต่างๆ ของ LOB และประเด็นต่างๆ ที่มีการนำเสนอ

Conduct Risk Steering Committee ("CRSC") รับผิดชอบในการทบทวน การชี้วัด และการรวบรวมความเสี่ยงที่ยอมรับได้ในการปฏิบัติงานในระดับองค์กรและการกำหนดทิศทางสำหรับโครงการเกี่ยวกับความเสี่ยงในการปฏิบัติงานของเจพีมอร์แกนเซส

Line of Business and Regional Risk Committee มีความรับผิดชอบในการกำกับดูแลการบริหารจัดการที่ดี ข้อจำกัด และการควบคุมที่มีการกำหนดไว้โดยผ่านขอบเขตของการปฏิบัติงานต่างๆ โดยคณะกรรมการนี้จะมีการทบทวนวิธีการที่ LOB หรือหน่วยงานธุรกิจอื่น มีการใช้ในการทำธุรกิจตามกฎหมายบางภูมิภาคซึ่งอาจส่งผลให้เกิดผลกระทบในทางลบโดยมุ่งเน้นไปยังการระบุ การยอมรับ การนำเสนอ และ/หรือการกำหนดการเยียวยาในเรื่องที่นำไปสู่คณะกรรมการต่างๆ ดังกล่าว

Line of Business and Corporate Control Committee กำกับดูแลภาวะแวดล้อมในการควบคุมธุรกิจหรือหน่วยงาน โดยส่วนหนึ่งของหน้าที่นั้นจะต้องรับผิดชอบในการทบทวนตัวบ่งชี้ความเสี่ยงที่มีอยู่ในระดับสูงขึ้นหรือความเสี่ยงที่มีการปรากฏออกมา และข้อมูลอื่นๆ ที่อาจส่งผลกระทบต่อถึงคุณภาพและความมั่นคงในกระบวนการของธุรกิจหรือหน่วยงาน การแสดงประเด็นความเสี่ยงการปฏิบัติงานที่สำคัญ มุ่งเน้นไปยังกระบวนการเกี่ยวกับความกังวลในเรื่องของการควบคุม การขยาย การควบคุม

Line of Business Reputation Risk Committees มีหน้าที่ทบทวนและประเมินธุรกรรม การดำเนินกิจกรรมต่างๆ และลูกค้าที่มีความเป็นไปได้ที่จะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญต่อชื่อเสียงของเจพีมอร์แกนเชส

JPMorgan Chasewide Asset and Liability Committee รับผิดชอบในการกำกับดูแลสินทรัพย์และการจัดการความรับผิดชอบของเจพีมอร์แกนเชส (“ALM”) การจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง งบดุล ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ย และความเสี่ยงด้านเงินทุน ALCO นั้นได้รับการสนับสนุนจากคณะกรรมการ Treasurer และ คณะกรรมการการกำกับดูแลเงินทุน (Capital Governance Committee) โดยคณะกรรมการ Treasurer นั้นจะรับผิดชอบในการติดตามงบดุลโดยภาพรวมของเจพีมอร์แกนเชส ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง และความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ย คณะกรรมการการกำกับดูแลเงินทุน (Capital Governance Committee) นั้นมีหน้าที่รับผิดชอบและให้คำแนะนำเกี่ยวกับความมีผลบังคับใช้ของ กรอบการดูแลเงินทุน นโยบายด้านเงินทุน และการปฏิบัติให้เป็นไปตามข้อกำหนดของกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องกับเงินทุน

JPMorgan Chasewide Valuation Governance Forum ประกอบด้วยผู้บริหารทางการเงินและความเสี่ยง โดยมีหน้าที่รับผิดชอบในการกำกับดูแลการบริหารความเสี่ยงมูลค่ายุติธรรม ที่เกิดขึ้นจากกิจกรรมการประเมินมูลค่าที่กระทำทั่วทั้งเจพีมอร์แกนเชส

1.2.6 การกำกับดูแลและกฎเกณฑ์

ผู้กำกับดูแลดำเนินการและอยู่ภายใต้กฎเกณฑ์ภายใต้กฎหมายธนาคารของสหพันธรัฐและรัฐ และกฎหมายอื่นๆ ของประเทศสหรัฐอเมริกา รวมถึงพระราชบัญญัติธนาคารแห่งชาติ (National Banking Act) และพระราชบัญญัติการประกันเงินฝาก (Federal Deposit Insurance Act) รวมทั้งกฎหมายที่เกี่ยวข้องของแต่ละประเทศภายนอกสหรัฐอเมริกาที่ผู้กำกับดูแลประกอบธุรกิจ สำหรับข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับการกำกับดูแลและกฎเกณฑ์ของผู้กำกับดูแลและกฎหมายและกฎเกณฑ์ที่สำคัญที่ใช้บังคับกับผู้กำกับดูแล โปรดดู “Supervision and regulation” ในหมายเหตุ 1 ของงบการเงินรวมของผู้กำกับดูแลสำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 ของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้

1.2.7 ข้อมูลทางการเงิน

ข้อมูลทางการเงินบางส่วน

ข้อมูลทางการเงินบางส่วนที่ระบุในตารางด้านล่างนี้ได้คัดลอกมาจากงบการเงินรวมที่ผ่านการตรวจสอบแล้วของผู้กำกับดูแล สำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 ข้อมูลนี้ควรอ่านควบคู่กับหมายเหตุประกอบงบการเงินรวมและรายละเอียดข้อมูลทางการเงินอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องกับผู้กำกับดูแล

ทั้งนี้ เมื่อวันที่ 18 พฤษภาคม 2562 JPMorgan Chase & Co. ได้รวมกิจการกับ Chase Bank USA, National Association และผู้ค้าประกัน โดยผู้ค้าประกันเป็นนิติบุคคลที่ยังคงดำรงอยู่ โดยตาม U.S. GAAP การรวมกิจการนั้นถือว่าเป็นธุรกรรมระหว่างนิติบุคคลที่อยู่ภายใต้อำนาจควบคุมเดียวกันและถือว่าการเปลี่ยนแปลงในนิติบุคคลที่เป็นผู้รายงาน ดังนั้น สินทรัพย์สุทธิของ Chase Bank USA, National Association ณ มูลค่าที่ดำรงอยู่นั้นจึงถูกรวมเข้าอยู่ในงบการเงินรวมของผู้ค้าประกันโดยมีผลย้อนหลังสำหรับระยะเวลาทั้งหมดดังกล่าว

ข้อมูลในงบกำไรขาดทุนบางส่วน
(ล้านดอลลาร์สหรัฐ)

ปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม

2562 2561

รายได้สุทธิรวม	105,583	99,884
สำรองสำหรับความสูญเสียทางเครดิต	5,593	4,872
ค่าใช้จ่ายที่ไม่ใช่ดอกเบี้ยรวม	60,231	57,634
รายได้ก่อนค่าใช้จ่ายภาษีเงินได้	39,759	37,378
รายได้สุทธิ	31,339	28,953

ข้อมูลในงบดุลบางส่วน
(ล้านดอลลาร์สหรัฐ)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม

2562 2561

สินทรัพย์เพื่อการค้า	263,504	264,533
หลักทรัพย์เพื่อการลงทุน	397,203	260,146
เงินกู้สุทธิจากค่าเผื่อความสูญเสียในเงินกู้	945,109	969,708
สินทรัพย์รวม	2,337,646	2,291,480
เงินฝาก	1,650,488	1,557,411
หนี้ระยะยาว	121,719	110,236
ส่วนของผู้ถือหุ้นรวม	246,097	250,829

ผู้สอบบัญชี

งบการเงินรวมของผู้ค้าประกันสำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 ได้รับการตรวจสอบโดย PricewaterhouseCoopers LLP ซึ่งเป็นผู้สอบบัญชีอิสระ ที่อยู่เลขที่ 300 เมดิสันเอเวนิว นิวยอร์ก นิวยอร์ก 10017 ประเทศสหรัฐอเมริกา อย่างไม่มีเงื่อนไข สำเนาของรายงานของผู้สอบบัญชีอยู่ในหน้า 1 ของงบการเงินดังกล่าว

นักลงทุนสามารถศึกษางบการเงินรวมของผู้ค้าประกัน สำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 ตามที่ได้แนบมาพร้อมกับแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวน

1.2.8 ข้อพิพาท

สำหรับสรุปกระบวนการพิจารณาคดีทางกฎหมายที่สำคัญเกี่ยวกับผู้ค้าประกันนั้น สามารถดูได้ที่หมายเหตุ 28 ของงบการเงินรวมของผู้ค้าประกัน สำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 ซึ่งได้รวมอยู่ในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้

1.2.9 การจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

ณ วันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2563 ธนาคารเจเอ็มอีแอนด์ เชส (JPMorgan Chase Bank, National Association) ในฐานะผู้ค้าประกันได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือจาก Moody's ในอันดับความน่าเชื่อถือระดับ Aa2 (Stable Outlook)

ทั้งนี้ อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ค้าประกันนั้นเป็นเพียงการประเมินโดย Moody's ซึ่งความสามารถทางการเงินโดยรวมของผู้ค้าประกันในการชำระหนี้ระยะยาวเท่านั้น

จากข้อมูลบนเว็บไซต์ของ Moody's อันดับความน่าเชื่อถือที่ Aa2 หมายถึง อันดับความน่าเชื่อถือที่สูงที่สุดในสามอันดับแรกจากทั้งหมดสิบอันดับ (ซึ่งรวมตัวเลข 1, 2 และ 3 รวมทั้งอันดับความน่าเชื่อถือย่อย) ที่จัดอันดับโดย Moody's

โปรดดูความหมายของการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของ Moody's ที่ออกโดย Moody's ตามที่ระบุในข้อที่ 4 ของส่วนที่ 1 (ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์)

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะเสนอขายและที่ได้รับการค้าประกันโดยผู้ค้าประกัน จะไม่ได้รับการจัดอันดับ เว้นแต่ได้ระบุเป็นประการอื่นในประกาศการเสนอขายและเอกสารจดทะเบียนเพิ่มเติมเกี่ยวกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าว ตารางด้านล่างนี้ได้แสดงให้เห็นถึงความประสงค์จะซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ทราบเพื่อความสะดวกเท่านั้น โดยได้ระบุถึงการจัดอันดับความน่าเชื่อถือสำหรับหนี้ระยะยาวของผู้ค้าประกัน (ณ วันที่ 28 กุมภาพันธ์ 2563) การจัดอันดับความน่าเชื่อถือดำเนินการโดยสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือโดยใช้ข้อมูลที่สถาบันเหล่านั้นได้รับจากลูกหนี้ที่เกี่ยวข้องรวมถึงข้อมูลที่สถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือได้รับจากแหล่งข้อมูลอื่น การจัดอันดับความน่าเชื่อถือไม่ใช่คำแนะนำให้ซื้อ ถือครอง หรือขายหลักทรัพย์ใดๆ และอาจเปลี่ยนแปลง ถูกแทนที่ หรือเพิกถอนได้ในเวลาใดๆ โดยสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ผู้ที่จะซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ควรตรวจสอบการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ค้าประกันล่าสุด ก่อนซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ใดๆ ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ข้อมูลเกี่ยวกับการจัดอันดับหนี้ของผู้ค้าประกันล่าสุดนั้น สามารถขอรับได้จากสถาบันจัด

อันดับความน่าเชื่อถือที่เกี่ยวข้องและสามารถดูได้จากหน้านักลงทุนสัมพันธ์ในเว็บไซต์ของเจพีมอร์แกนเชสที่ <https://jpmorganchaseco.gcs-web.com/financial-information/sec-filings> ทั้งผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ค้าประกัน ไม่มีหน้าที่ปรับปรุงข้อมูลที่ระบุในตารางด้านล่างให้เป็นปัจจุบัน

สถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

การจัดอันดับความน่าเชื่อถือปัจจุบันของ
หนี้ระยะยาวของผู้ค้าประกัน (ณ วันที่ 28
กุมภาพันธ์ 2563)

Moody's Investors Service, Inc.

Aa2 (stable outlook)

ข้อมูลเพิ่มเติม

ข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับผู้ค้าประกัน รวมถึงรายงานประจำปีตามแบบฟอร์ม 10-K รายงานประจำไตรมาสตามแบบฟอร์ม 10-Q และรายงานปัจจุบันตามแบบฟอร์ม 8-K ของเจพีมอร์แกนเชส เจพีมอร์แกนเชสได้ยื่นกับคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“รายงานตามระยะเวลา”) โดยสามารถดูได้ในเว็บไซต์ของคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่ www.sec.gov นอกจากนี้รายงานดังกล่าวและข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับผู้ค้าประกันสามารถดูได้จากหน้านักลงทุนสัมพันธ์ในเว็บไซต์ของเจพีมอร์แกนเชสที่ <http://jpmorganchaseco.gcs-web.com/financial-information/sec-filings> เว็บไซต์อื่นที่ไม่ได้ระบุหรืออ้างถึงในที่นี้ไม่ถือเป็นส่วนหนึ่ง และไม่ได้รวมอยู่ในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ โดยการอ้างอิง รายงานตามระยะเวลาไม่ได้รวมหรือถูกรวมโดยการอ้างอิงใน และไม่ถือเป็นส่วนหนึ่งของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้

1.3 ข้อมูลอื่นที่อาจมีผลกระทบต่อผลการดำเนินงานของผู้ค้าประกันและบริษัทย่อยของผู้ค้าประกัน หรือการตัดสินใจลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ในกรณีที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือผู้ค้าประกันผิวนัดชำระหนี้เงินภายใต้สัญญาผู้ค้าประกัน (ในจำนวนวงเงินผู้ค้าประกันตามที่อธิบายไว้ด้านล่าง) ผู้ลงทุนอาจจะสูญเสียเงินต้นทั้งจำนวนที่ลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้

1.4 สารสำคัญของสัญญาผู้ค้าประกัน

1.4.1 การผู้ค้าประกัน

ภายใต้ข้อกำหนดและเงื่อนไขที่ระบุในสัญญาผู้ค้าประกัน ภาระผูกพันของผู้ค้าประกันภายใต้สัญญาผู้ค้าประกันเป็นการผูกพันโดยตรง ไม่มีเงื่อนไข ไม่มีประกัน และไม่ด้อยสิทธิ ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้จากร่างสัญญาผู้ค้าประกันที่แนบท้ายแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวน

1.4.2 สถานะของการผู้ค้าประกัน

การค้ำประกันของผู้ค้ำประกันสำหรับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น (1) เป็นการผูกพันทั่วไปแบบไม่มีประกัน และไม่ค้ำยสิทธิของผู้ค้ำประกันและไม่ใช่ของบริษัทในเครือใดๆ ของผู้ค้ำประกัน (2) ไม่ใช่บัญชีออมทรัพย์หรือเงินฝากของผู้ค้ำประกันหรือบริษัทย่อยหรือบริษัทในเครือทั้งที่เป็นธนาคารหรือไม่ใช่ธนาคารของผู้ค้ำประกัน และ (3) จะมีสิทธิเท่าเทียมกับหนี้แบบไม่มีประกันและไม่ค้ำยสิทธิอื่นๆ ทั้งหมดของผู้ค้ำประกัน เว้นแต่การผูกพันต่างๆ ซึ่งรวมถึงเงินฝากในประเทศสหรัฐอเมริกาของผู้ค้ำประกันที่มีสิทธิพิเศษหรือนิรรมสิทธิตามกฎหมาย การค้ำประกันของผู้ค้ำประกัน ไม่ใช่เงินฝากที่มีการรับประกันโดยสถาบันประกันเงินฝากของสหรัฐอเมริกา (Federal Deposit Insurance Corporation) (“FDIC”) กองทุนประกันเงินฝากของสหรัฐอเมริกา (Deposit Insurance Fund) หรือหน่วยงานรัฐอื่นใดหรือส่วนใดส่วนหนึ่งของหน่วยงานรัฐ

ทั้งนี้ กฎหมายสหพันธรัฐของสหรัฐอเมริกาที่นำมาบังคับใช้ในปี 2536 กำหนดให้สิทธิในการรับชำระเงินจากการเรียกร้องบางประเภทในการชำระบัญชีหรือการแก้ไขปัญหาค้างคาอื่นๆ ของสถาบันเงินฝากที่มี FDIC เป็นผู้รับประกัน ซึ่งรวมถึงผู้ค้ำประกันเป็นนิรรมสิทธิ กฎหมายดังกล่าวกำหนดให้มีการชำระค่าเรียกร้องตามลำดับดังนี้

- ลำดับแรก ค่าใช้จ่ายในการบริหารของผู้พิทักษ์ทรัพย์
- ลำดับสอง ความรับผิดชอบในเงินฝากใดๆ ของสถาบันเงินฝาก
- ลำดับสาม ความรับผิดชอบทั่วไปหรือไม่ค้ำยสิทธิอื่นใดของสถาบันเงินฝากที่ไม่ได้ระบุไว้ด้านล่าง
- ลำดับสี่ ภาระผูกพันใดๆ ที่ค้ำยสิทธิกว่าเงินฝากหรือเจ้าหนี้ทั่วไปที่ไม่ได้ระบุไว้ด้านล่าง และ
- ลำดับห้า ภาระผูกพันใดๆ ต่อผู้ถือหุ้นหรือสมาชิก (รวมถึงบริษัทที่ถือหุ้นของสถาบันเงินฝากใดๆ หรือผู้ถือหุ้นหรือเจ้าหนี้ใดๆ ของบริษัทดังกล่าว)

FDIC ได้ตีความความรับผิดชอบในเงินฝากว่ารวมถึงเงินฝากใดๆ ที่ต้องชำระ ณ สำนักงานของสถาบันเงินฝากที่ได้รับการประกันในประเทศสหรัฐอเมริกา และไม่รวมถึงเงินฝากในกิจการวิเทศกิจหรือเงินฝากที่ต้องชำระ ณ สำนักงานของสถาบันเงินฝากที่ได้รับการประกันที่อยู่นอกประเทศสหรัฐอเมริกาแต่เพียงผู้เดียว

ผู้ค้ำประกันไม่ต้องรับผิดชอบภายใต้สัญญาค้ำประกัน (1) สำหรับจำนวนเงินหรือการชำระเงินที่ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้รับยกเว้นให้ไม่ต้องชำระภายใต้ข้อกำหนดสิทธิฯ หรือกฎหมายที่เกี่ยวข้อง (2) สำหรับจำนวนเงินที่เกินจากจำนวนหนี้ที่ถึงกำหนดชำระที่ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีหน้าที่ต้องชำระให้แก่ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (3) ในกรณีที่ผู้ค้ำประกันตกอยู่ภายใต้ข้อห้าม หรือไม่สามารชำระหนี้เงินได้ไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน อันเนื่องมาจากภาวะสงคราม การจลาจล สถานการณ์ความขัดแย้งรุนแรง การดำเนินการของรัฐบาล หน่วยราชการ หรือส่วนใดส่วนหนึ่งของรัฐหรือหน่วยงานราชการ (ไม่ว่าโดยนิตินัย หรือพฤตินัย) ข้อจำกัดทางกฎหมาย การก่อการร้าย ภัยพิบัติ การก่อความไม่สงบ เหตุการณ์ภัยพิบัติ

1.4.3 ข้อจำกัดการค้ำประกัน

การค้ำประกันของผู้ค้ำประกันสำหรับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นี้จำกัดเฉพาะการชำระเงินของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และภาระผูกพันอื่นๆ อันเกี่ยวกับผลิตภัณฑ์ดังกล่าว และให้ผู้ค้ำประกันสามารถได้รับประโยชน์จาก

บรรดาการยกเว้น ข้อยกเว้น และการต่อสู้ทั้งหมดที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีภายใต้ข้อกำหนดและเงื่อนไขของ
ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นี้และตามกฎหมาย

นอกจากนี้ในบางกรณี ผู้ค้าประกันไม่ต้องรับผิดชอบภายใต้ข้อกำหนดของการค้าประกันในการชำระเงินแทนผู้ออก
ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือภาระผูกพันอื่นๆ อันเกี่ยวกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แม้ว่าผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์ไม่ได้ปฏิบัติตามภาระผูกพันดังกล่าวก็ตาม ตัวอย่างเช่น หากผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ตกอยู่ภายใต้ข้อห้าม
หรือไม่สามารถ หรือไม่ชำระเงิน ไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน หรือปฏิบัติตามภาระผูกพันอื่นใด เนื่องจากหรือเกิดจากภาวะ
สงคราม การจลาจล สถานการณ์ความขัดแย้งรุนแรง การดำเนินการของรัฐบาล หน่วยราชการ หรือส่วนใดส่วนหนึ่งของรัฐ
หรือหน่วยงานราชการ (ไม่ว่าโดยนิตินัย หรือพฤตินัย) ข้อจำกัดทางกฎหมาย การก่อการร้าย การก่อความไม่สงบ หรือ
เหตุการณ์ภัยพิบัติ และผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ผิดนัดชำระหนี้หรือภาระผูกพันอื่นๆ อันเกี่ยวกับใบสำคัญแสดง
สิทธิอนุพันธ์ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ค้าประกันจะไม่มีภาระผูกพันภายใต้ข้อกำหนดของการค้าประกันของ
ตนในการชดเชยภาระผูกพันที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นผู้ผิดนัด

1.4.4 การบังคับใช้

การค้าประกันนี้เป็นการที่ผู้ค้าประกันได้ค้าประกันการชำระหนี้เงินในจำนวนวงเงินค้าประกันเท่านั้น ทั้งนี้ ภายใต้
ข้อกำหนดและเงื่อนไขของสัญญาการค้าประกัน ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ไม่มีหน้าที่ในการใช้สิทธิหรือดำเนินการอื่น
ใดกับผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือบุคคลหรือนิติบุคคล หรือหลักประกันอื่นใดเพื่อเป็นเงื่อนไขให้ผู้ค้าประกัน
ต้องชำระเงินจำนวนใด ๆ ภายใต้จำนวนวงเงินค้าประกัน ทั้งนี้ ผู้ค้าประกันสงวนไว้ซึ่งสิทธิในข้อต่อสู้ของคนที่อยู่ภายใต้
กฎหมายที่เกี่ยวข้อง บรรดาข้อต่อสู้ทั้งหลาย สิทธิการหักกลบลบหนี้หรือสิทธิการโต้แย้งที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์มีต่อผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อยู่เช่นไร ผู้ค้าประกันก็จะมีสิทธิในการยกข้อต่อสู้ สิทธิการหักกลบลบหนี้
หรือข้อโต้แย้งเช่นว่านั้นขึ้นอ้างต่อผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้เท่ากับสิทธิที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีอยู่
และเท่าที่ผู้ค้าประกันมีสิทธิยกขึ้นอ้างได้เกี่ยวกับหนี้ของตนภายใต้สัญญาการค้าประกัน ทั้งนี้ ไม่ว่าผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์จะได้อ้างขึ้นอ้างหรือไม่ก็ตาม

1.4.5 การรับช่วงสิทธิ

ผู้ค้าประกัน (1) มีสิทธิในการเข้ารับไปซึ่งสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในการชำระหนี้
แก่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ รวมถึงสิทธิของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในการแก้ไขเหตุผิดนัดใด ๆ โดย
หรือที่เกี่ยวข้องกับผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยไม่คำนึงถึงว่าผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะได้มีการแจ้งถึง
เหตุผิดนัดหรือเลิกสัญญาไปยังผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แล้ว และมีสิทธิยกเลิกการแจ้งถึงเหตุผิดนัดหรือเลิกสัญญา
โดยผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์รายนั้น ๆ หรือไม่ และ (2) มีสิทธิเข้ารับช่วงสิทธิซึ่งสิทธิของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์ที่มีต่อผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในจำนวนเงินที่ผู้ค้าประกันได้ชำระไปตามข้อตกลงตามที่กำหนดใน
สัญญาการค้าประกัน โดยมีเงื่อนไขว่าผู้ค้าประกันจะไม่มีสิทธิในการบังคับเอาเงินหรือรับจำนวนเงินที่เกิดขึ้นหรือมาจากสิทธิ
การรับช่วงสิทธิเกินกว่าหนี้ทั้งจำนวนของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ถึงกำหนดชำระต่อผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์ที่มีอยู่จนถึงการรับช่วงสิทธินั้น ๆ ได้ชำระครบเต็มจำนวนแล้ว

1.4.6 ระยะเวลาการค้ำประกัน

สัญญาค้ำประกันฉบับนี้จะมีผลสมบูรณ์และมีผลใช้บังคับจนกว่าจะมีการชำระเงินในจำนวนวงเงินค้ำประกันเสร็จสิ้นและไม่มีใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ได้รับประโยชน์จากการค้ำประกันคงเหลืออยู่ และไม่มีการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เพิ่มเติมโดยผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อีก

1.4.7 กฎหมายที่เกี่ยวข้อง

สัญญาค้ำประกันฉบับนี้ให้อยู่ภายใต้บังคับและการตีความตามกฎหมายมลรัฐนิวยอร์ก ประเทศสหรัฐอเมริกา

1.4.8 ปัจจัยความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับผู้ค้ำประกัน

ปัจจัยความเสี่ยงที่ระบุในส่วนที่ 1 รวมถึงข้อมูลอื่นๆ ที่ระบุในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ และเอกสารที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมอาจเป็นข้อมูลสำคัญต่อการประเมินความเสี่ยงทางธุรกิจซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อธุรกิจและผลกำไรของผู้ค้ำประกัน

2. ผู้ที่เป็นผู้สัญญาบริหารความเสี่ยงเพื่อป้องกันความเสี่ยงทั้งจำนวนของบริษัทที่ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะต้องมีการบริหารความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น

ในการบริหารความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจดำเนินการบริหารความเสี่ยงด้วยตนเอง และ/หรือทำสัญญาบริหารความเสี่ยงกับคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง โดยการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีข้อกำหนดและเงื่อนไขให้บริษัทเป็นผู้รับชำระหนี้จากการคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงในจำนวนและระยะเวลาเดียวกันหรือใกล้เคียงกันกับจำนวนและระยะเวลาที่บริษัทจะต้องชำระหนี้ให้ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Back-to-Back Agreement)

ในเบื้องต้น ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ตกลงแต่งตั้ง เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตีส์ พีแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) เป็นคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง โดยจะมีการบริหารความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

โดยผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Back-to-Back Agreement) ก่อนวันที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะเข้าทำการซื้อขายวันแรกในตลาดหลักทรัพย์

สัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีลักษณะและเงื่อนไขการใช้สิทธิเหมือนกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ แต่เป็นสถานะตรงกันข้ามกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ทั้งนี้ เพื่อเป็นการปิดความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ทั้งหมด

ทั้งนี้ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะระบุนายละเอียดโดยสรุปของกลุ่มผู้บริหารความเสี่ยง และสัญญาบริหารความเสี่ยง ไว้ในส่วนที่ 2 ของแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) ที่ยื่นต่อสำนักงาน ก.ล.ต. เป็นคราว ๆ ไป

ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจเลือกที่จะเข้าทำสัญญาบริหารความเสี่ยงกับคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงรายอื่นนอกเหนือจาก เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตีส์ พีแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) หรืออาจมีการใช้วิธีการบริหารความเสี่ยงอื่น ๆ ด้วยตนเอง

ซึ่งหากมีการเปลี่ยนแปลงคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง (หรือสัญญาบริหารความเสี่ยง (แล้วแต่กรณี)) หรือวิธีการบริหารความเสี่ยง ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะมีการเปิดเผยข้อมูลแก่ผู้ลงทุนโดยการระบุนายชื่อคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงและวิธีการบริหารความเสี่ยง ในแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short)

ผู้ลงทุนจึงควรศึกษาข้อมูลดังกล่าวให้ครบถ้วนก่อนการลงทุน

2.1 ข้อมูลทั่วไป

คู่สัญญาบริหารความเสี่ยง	:	เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตีส์ พีแอลซี J.P. Morgan Securities plc
ลักษณะการประกอบธุรกิจ	:	การให้บริการธนาคารเพื่อการลงทุนและหลักทรัพย์
เลขทะเบียนบริษัท	:	02711006
ที่ตั้งสำนักงานใหญ่	:	25 แบงส์สตรีท ชั้น 20 แคนารีวาร์ฟ ลอนดอน อี14 5เจพี สหราชอาณาจักร
โฮมเพจ	:	www.jpmmorganchase.com
โทรศัพท์	:	+44 20 7777 2000
โทรสาร	:	+44 20 7325 9225

2.2 ลักษณะการประกอบธุรกิจโดยย่อ

เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตีส์ พีแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) (“คู่สัญญาบริหารความเสี่ยง”) เป็นบริษัทมหาชนจำกัดที่จัดตั้งขึ้นและดำรงอยู่ใน สหราชอาณาจักร ซึ่งเป็นบริษัทย่อยโดยอ้อมของผู้ถือหุ้น (โปรดดูรายละเอียดของผู้ถือหุ้น (ในฐานะผู้ถือหุ้น) ตามที่ระบุข้างต้น) และเป็นบริษัทย่อยหลักของผู้ถือหุ้น

คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงเป็นบริษัทย่อยหลักของผู้ถือหุ้น ซึ่งอยู่ในเขตเศรษฐกิจของสหราชอาณาจักรและยุโรป (European Economic Area (“EEA”)) คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงให้บริการธนาคารเพื่อการลงทุนระหว่างประเทศ

รวมถึงการดำเนินกิจกรรมต่างๆ ระหว่างตลาดต่างๆ รวมทั้งการให้บริการแก่ผู้ลงทุนและการธนาคารเพื่อธุรกิจ โดยสำหรับในธุรกิจประเภทนี้ การดำเนินงานของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงรวมไปถึงการจัดจำหน่ายพันธบัตรของรัฐบาลและบริษัทต่างๆ หลักทรัพย์ประเภททุน และหลักทรัพย์อื่นๆ การจัดจำหน่ายตราสารหนี้และหลักทรัพย์แปลงสภาพให้แก่บุคคลในวงจำกัด การค้าตราสารหนี้ ตราสารทุน สินค้าโภคภัณฑ์ สวอปส์ และอนุพันธ์อื่นๆ การให้บริการการเป็นนายหน้าและสำนักหักบัญชีสำหรับการแลกเปลี่ยนสัญญาออปชั่นส์และฟิวเจอร์ส การให้กู้ยืมและการให้คำปรึกษาด้านการธนาคารเพื่อการลงทุน โดยคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงเป็นสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ต่างๆ มากกว่า 20 แห่ง และเป็นสมาชิกของสำนักหักบัญชีต่างๆ จำนวนมาก ซึ่งรวมถึง LME Clear Limited, Eurex Clearing AG และ ICE Clear Europe

คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงเป็นธนาคารของสหราชอาณาจักร และเป็นสถาบันการให้สินเชื่อภายใต้ EEA Capital Requirement Directive IV ซึ่งตามกฎหมายแล้วหมายถึง การประกอบธุรกิจในการรับฝากเงินหรือเงินลงทุนที่จ่ายคืนได้อย่างอื่นจากประชาชน และการให้สินเชื่อเพื่อตนเอง

คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงได้รับใบอนุญาตจาก Prudential Regulation Authority (“PRA”) และอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของ PRA และ Financial Conduct Authority ในสหราชอาณาจักร

2.3 อันดับความน่าเชื่อถือ

คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงได้รับอันดับความน่าเชื่อถือดังนี้

ณ วันที่ 13 มีนาคม 2563 คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับ Aa3 โดย Moody's จากข้อมูลบนเว็บไซต์ของ Moody's อันดับความน่าเชื่อถือที่ Aa3 สะท้อนถึงอันดับความน่าเชื่อถือที่สูงที่สุดในสี่อันดับแรกจากทั้งหมดสิบอันดับ ที่จัดอันดับโดย Moody's

สำหรับรายละเอียดเพิ่มเติม โปรดศึกษาในเว็บไซต์ของ Moody's ทั้งนี้ แหล่งที่มาของข้อมูลดังกล่าวเป็นข้อมูลที่มีอยู่ ณ ปัจจุบัน ซึ่งอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ในอนาคต

ทั้งนี้ ข้อมูลใดๆ ที่ปรากฏบนเว็บไซต์ดังกล่าวของ Moody's นั้น ไม่ได้เป็นส่วนหนึ่งของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ และผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้องหรือความสมบูรณ์ของข้อมูลที่ปรากฏบนเว็บไซต์ดังกล่าว และไม่อาจรับประกันได้ว่าข้อมูลดังกล่าวจะไม่มีมีการแก้ไขเพิ่มเติมโดย Moody's ในอนาคต ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ไม่มีความรับผิดชอบที่จะต้องแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบถึงการแก้ไขดังกล่าว หากผู้ลงทุนไม่แน่ใจเกี่ยวกับข้อมูลใดๆ ที่ระบุในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ และ/หรือ ความหมายของการจัดอันดับความน่าเชื่อถือผู้ลงทุนควรขอคำแนะนำจากที่ปรึกษาอิสระด้วยตนเอง

2.4 ฐานะทางการเงินและผลการดำเนินงาน

ตามงบการเงินล่าสุดของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2561 คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงมีรายได้จากการประกอบธุรกิจ เป็นจำนวน 10,025 ล้านดอลลาร์สหรัฐ และมีกำไรสุทธิจากการประกอบธุรกิจเป็นจำนวน 3,369 ล้านดอลลาร์สหรัฐ

นอกจากนี้ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2561 คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงมีสินทรัพย์รวม 668,042 ล้านดอลลาร์สหรัฐ
หนี้สินรวม 623,138 ล้านดอลลาร์สหรัฐ และส่วนของผู้ถือหุ้น 44,904 ล้านดอลลาร์สหรัฐ

สำหรับข้อมูลทางการเงินอื่นๆ ของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง ผู้ลงทุนสามารถศึกษาได้จากงบการเงินของคู่สัญญา
บริหารความเสี่ยง ซึ่งได้เปิดเผยไว้ ณ <https://beta.companieshouse.gov.uk/company/02711006>

2.5 วิธีการบริหารความเสี่ยง

ในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจจะมีการบริหารความ
เสี่ยงโดยการเข้าทำสัญญา Back-to-Back Agreement กับคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง (หรือคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงรายอื่น
นอกเหนือไปจาก เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตี้ส์ พีแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) (แล้วแต่กรณี)) โดยคู่สัญญาบริหารความ
เสี่ยงมีหน้าที่ในการบริหารความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยการเปิดสถานะการลงทุน
ตรงกันข้ามกับการสถานะของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ทั้งนี้ สัญญา Back-to-Back Agreement (หรือสัญญาการบริหารความเสี่ยงอื่น) ดังกล่าว มีลักษณะของสัญญาและ
เงื่อนไขต่าง ๆ เช่น หลักทรัพย์อ้างอิง อายุของสัญญา วันครบกำหนดอายุ เหมือนกันกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

2.6 สรุปสาระสำคัญของสัญญาบริหารความเสี่ยงโดยย่อ

- | | | |
|------------------------------|---|---|
| ชื่อคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง | : | เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตี้ส์ พีแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) |
| ลักษณะของสัญญา | : | ผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เข้าทำสัญญากับคู่สัญญา
บริหารความเสี่ยงก่อนวันซื้อขายวันแรกในตลาดหลักทรัพย์
ของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยสัญญาบริหารความเสี่ยง
ของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น จะมีลักษณะและ
เงื่อนไขของสัญญา เช่น หลักทรัพย์อ้างอิง อายุสัญญา เป็นต้น
เหมือนกันกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
ทั้งนี้ ผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ จะทำสัญญาในทางตรง
ข้ามกันกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ กับคู่สัญญาบริหาร
ความเสี่ยง เพื่อเป็นการปิดความเสี่ยงจากการออกและเสนอขาย
ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ |
| การชำระราคาและส่งมอบ | : | เมื่อถึงวันชำระราคาและส่งมอบ
<ul style="list-style-type: none">- ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ มีสถานะเป็น Out of
The Money (OTM) หรือ At The Money (ATM) ณ วันซื้อ
ขายวันสุดท้าย คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงจะไม่มีชำระ
ราคาใด ๆ แก่ผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ |

- ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีสถานะเป็น In The Money (ITM) ณ วันซื้อขายวันสุดท้าย คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงมีหน้าที่ต้องส่งมอบส่วนต่างเงินสด เป็นจำนวนเท่ากับเงินสดส่วนต่างจากการใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือ ส่งมอบเป็นหลักทรัพย์ หรือ สินค้าอ้างอิงใด ตามข้อตกลงที่ระบุไว้ในสัญญาบริหารความเสี่ยง

ภาระผูกพัน : ภาระผูกพันในการบริหารความเสี่ยงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่นแยกขาดจากกัน โดยเด็ดขาด

ทั้งนี้ ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจมีการพิจารณาเปลี่ยนแปลงหรือยกเลิกคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง และเงื่อนไขในการบริหารความเสี่ยงได้ตามความเหมาะสมโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า

ทั้งนี้ การเปลี่ยนแปลงดังกล่าวผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะคำนึงถึงผลกระทบ (หรืออาจมีผลกระทบ) ต่อผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นสำคัญ เพื่อไม่ให้ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ต้องเสียสิทธิหรือผลประโยชน์ที่ควรจะได้รับจากการถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น ๆ

โดยรายละเอียดของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ผู้ลงทุนสามารถศึกษาได้จากแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) ที่ได้ยื่นต่อสำนักงาน ก.ล.ต. และเปิดเผยไว้ใน www.sec.or.th

ข้อมูลเกี่ยวกับคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงที่เปิดเผยไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) ให้ถือว่าเป็นปัจจุบัน และมีผลบังคับใช้แทนที่ข้อมูลของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงที่เปิดเผยไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Full)

3. การติดตามข้อมูลของผู้รับประกันและคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง

ข้อมูลของผู้รับประกันและคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง อาจมีการปรับปรุงเปลี่ยนแปลงได้

ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลจากแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) เป็นหลัก ทั้งนี้ หากมีการเปลี่ยนแปลงอื่นใดที่ส่งผลกระทบต่อการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือ ฐานะทางการเงินและผลการดำเนินงานของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือฐานะทางการเงินและผลการดำเนินงานของผู้รับประกันและคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะมีการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าว ตามรอบระยะเวลาที่กฎหมายหรือประกาศที่เกี่ยวข้องกำหนดไว้

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถอ่านข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับผู้รับประกัน และคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงได้จาก <https://www.jpmmorganchase.com>

ส่วนที่ 3

รายละเอียดกรณีมีการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีประกันเต็มจำนวนหรือที่มีประกันบางส่วน (ถ้ามี)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่บริษัทออกและเสนอขายนี้ เป็นใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ชนิดไม่มีหลักประกัน

เอกสารแนบ 1

ข้อมูลเกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงและดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง

1. ข้อมูลเกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
ADVANC	บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	ADVANCED INFO SERVICE PCL.	เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	อาคารเอไอเอส ทาวเวอร์ 1, 414 ถนนพหลโยธิน แขวงสามเสนใน เขตพญาไท กทม.	0-2029-5000	0-2029-5165	http://investor.ais.co.th
AEONTS	บริษัท อีออน ธนสินทรัพย์ (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL.	เงินทุนและหลักทรัพย์	อาคารเอ็กเซน ทาวเวอร์ ชั้น 27, 388 ถนนสุขุมวิท แขวงคลองเตย เขตคลองเตย กทม.	0-2665-0123, 0-2689-7197	0-2689-7007	www.aeon.co.th
AMATA	บริษัท อมตะ คอร์ปอเรชัน จำกัด (มหาชน)	AMATA CORPORATION PCL.	พัฒนาอสังหาริมทรัพย์	อาคารกรมฉัษฎ 2126 ถนนเพชรบุรีตัดใหม่ แขวงบางกะปิ เขตห้วยขวาง กทม.	0-2318-0007, 0-2792-0000	0-2318-1096	http://www.amata.com
AOT	บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)	AIRPORTS OF THAILAND PCL.	ขนส่งและโลจิสติกส์	333 หมู่ที่ 7 ถนนเชิดวุฒากาศ แขวงสีกัน เขตดอนเมือง กทม.	0-2535-1111	0-2531-5559, 0-2535-4061	www.airportthai.co.th

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
AWC	บริษัท แอสเสท เวิร์ด คอร์ป จำกัด (มหาชน)	ASSET WORLD CORP PCL.	พัฒนา อสังหาริมทรัพย์	เลขที่ 1 อาคารเอ็มไพร์ทาว เวอร์ ชั้นที่ 56 ถนนสาทรใต้ แขวงยานนาวา เขตสาทร กทม.	0-2180-9999	0-2180-9966	https://www.assetworldcorp-th.com/
BANPU	บริษัท บานปู จำกัด (มหาชน)	BANPU PCL.	ปิโตรเคมีและ เคมีภัณฑ์	อาคารธนภูมิ ชั้น 26-28, 1550 ถนนเพชรบุรีตัดใหม่ แขวง มักกะสัน เขตราชเทวี กทม.	0-2694-6600	0-2207-0696	http://www.banpu.com
BBL	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	BANGKOK BANK PCL.	ธนาคาร	333 ถนนสีลม เขตบางรัก กทม.	0-2231-4333	0-2231-4890	www.bangkokbank.com
BCH	บริษัท บางกอก เซน สอสปีทอล จำกัด (มหาชน)	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL.	การแพทย์	44 หมู่ 4 ตำบลปากเกร็ด อำเภอปากเกร็ด นนทบุรี	0-2836-9999	0-2106-4858	www.bangkokchainhospital.com
BCPG	บริษัท บีซีพีจี จำกัด (มหาชน)	BCPG PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	อาคาร เอ็ม ทาวเวอร์ ชั้น 12 เลขที่ 2098 ถนนสุขุมวิท แขวงบางจาก เขตพระโขนง กทม.	-	-	www.bcpgroup.com
BDMS	บริษัท กรุงเทพดุสิตเวช การ จำกัด (มหาชน)	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL.	การแพทย์	เลขที่ 2 ซอยศูนย์วิจัย 7 ถนน เพชรบุรีตัดใหม่ แขวงบาง กะปิ เขตห้วยขวาง กทม.	0-2310-3000	0-2318-1546 , 0-2310-3327	www.bangkokhospital.com
BEAUTY	บริษัท บิวตี้ คอมมูนิตี้ จำกัด (มหาชน)	BEAUTY COMMUNITY PCL.	พาณิชย์	เลขที่ 10/915 ซอยนวลจันทร์ 34 แขวงนวลจันทร์ เขตบึงกุ่ม กทม.	0-2946-0700-6	0-2946-1571	WWW.BEAUTYCOMMUNITY.CO.TH

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
BEC	บริษัท บีอีซี เวิลด์ จำกัด (มหาชน)	BEC WORLD PCL.	สื่อและสิ่งพิมพ์	อาคารมาลีนนท์ ทาวเวอร์, 3199 ถนนพระรามสี่ แขวง คลองตัน เขตคลองเตย กทม.	0-2204-3333,	0-2204-1384	www.becworld.com
BEM	บริษัท ทางด่วนและ รถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL.	ขนส่งและโลจิสติกส์	587 ถนนสุขุมวิทวิมลชัย แขวงรัชดาภิเษก เขตดินแดง กทม.	0-2641-4611, 0-2354-2000	0-2641-4610, 0-2354-2040	www.bemple.co.th
BGRIM	บริษัท บี.กริม เพาเวอร์ จำกัด (มหาชน)	B.GRIMM POWER PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	5 ถนนกรุงเทพกรีฑา แขวง หัวหมาก เขตบางกะปิ กทม.	0-2710-3400	0-2379-4245	http://www.bgrimmpower.com
BH	บริษัท โรงพยาบาลบำรุง ราษฎร์ จำกัด (มหาชน)	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL.	การแพทย์	33 ถนนสุขุมวิท ซอย 3 (ซอย นานาเหนือ) แขวงคลองเตย เหนือ เขตวัฒนา กทม.	0-2667-1000	0-2667-2525	www.bumrungrad.com
BJC	บริษัท เบอร์ลี่ ยุคเกอร์ จำกัด (มหาชน)	BERLI JUCKER PCL.	พาณิชย์	อาคารเบอร์ลี่ ยุคเกอร์ 99 ซอย รู่เบีย ถนนสุขุมวิท 42 แขวง พระโขนง เขตคลองเตย กทม.	0-2367-1111, 0-2381-4520-39	0-2367-1000, 0-2381-4545	www.bjc.co.th
BTS	บริษัท บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน)	BTS GROUP HOLDINGS PCL.	ขนส่งและโลจิสติกส์	อาคารทีเอสที ทาวเวอร์, 21 ซอยเฉยพวง ถนนวิภาวดี- รังสิต แขวงจอมพล เขต จตุจักร กทม.	0-2273-8511-15, 0-2273-8611-15	0-2273-8610, 0-2273-8616	http://www.btsgroup.co.th

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
CBG	บริษัท การาวาอูรูป จำกัด (มหาชน)	CARABAO GROUP PCL.	อาหารและเครื่องดื่ม	393 อาคาร 393 สีส้ม ชั้น 7-10 ถนนสีลม แขวงสีลม เขตบาง รัก กทม.	0-2636-6111	0-2636-7949	www.carabaogroup.com
CENTEL	บริษัท โรงแรมเซ็นทรัล พลาซา จำกัด (มหาชน)	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL.	การท่องเที่ยวและ สันทนาการ	1695 ถนนพหลโยธิน แขวง จตุจักร เขตจตุจักร กทม.	0-2769-1234	0-2769-1235	www.centarahotelsresorts.com
CHG	บริษัท โรงพยาบาลจุฬา รัตน์ จำกัด (มหาชน)	CHULARAT HOSPITAL PCL.	การแพทย์	88/8-9 หมู่ที่ 11 ตำบลบางปลา อำเภอบางพลี สมุทรปราการ	0-2769-2900	0-2769-2967	www.chularat.com
CK	บริษัท ช.การช่าง จำกัด (มหาชน)	CH. KARNCHANG PCL.	บริการรับเหมา ก่อสร้าง	อาคารวิริยะถาวร, 587 ถนน สุทธิสารวินิจฉัย แขวง รัชดาภิเษก เขตดินแดง กทม.	0-2277-0460, 0-2275-0026	0-2275-7029	http://www.ch-karnchang.co.th
CKP	บริษัท ซีเค พาวเวอร์ จำกัด (มหาชน)	CK POWER PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	เลขที่ 587 อาคารวิริยะถาวร ชั้น 19 ถนนสุทธิสารวินิจฉัย แขวงดินแดง เขตดินแดง กทม.	0-2691-9720-2	0-2691-9723	www.ckpower.co.th
COM7	บริษัท คอมเซเว่น จำกัด (มหาชน)	COM7 PCL.	พาณิชย์	549/1 ถนนสรรพาวุธ แขวง บางนา เขตบางนา กทม.	0-2017-7777	-	www.comseven.com

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
CPALL	บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน)	CP ALL PCL.	พาณิชย์	เลขที่ 313 อาคารซีพี ทาวเวอร์ ชั้น 24 ถนนสีลม แขวงสีลม เขตบางรัก กทม.	0-2071-9000	0-2071-8617	www.cpall.co.th
CPF	บริษัท เจริญโภคภัณฑ์ อาหาร จำกัด (มหาชน)	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL.	อาหารและเครื่องดื่ม	อาคาร ซี.พี. ทาวเวอร์ ชั้น 15, 313 ถนนสีลม แขวงบางรัก เขตบางรัก กทม.	0-2766-8000	0-2638-2942	www.cpfworldwide.com
CPN	บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน)	CENTRAL PATTANA PCL.	พัฒนา อสังหาริมทรัพย์	อาคารสำนักงานเซ็นทรัลเวิลด์ ชั้น 31-33, 999/9 ถนน พระราม 1 แขวงปทุมวัน เขต ปทุมวัน กทม.	0-2667-5555	0-2264-5593	www.cpn.co.th
CRC	บริษัท เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	พาณิชย์	เลขที่ 22 ซอยสมคิด ถนน เพลินจิต แขวงลุมพินี เขต ปทุมวัน กทม.	0-2650-3600	-	https://www.centralretail.com/
DTAC	บริษัท โทเทิล แอ็กเซ็ส คอมมูนิเคชั่น จำกัด (มหาชน)	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL.	เทคโนโลยี สารสนเทศและการ สื่อสาร	เลขที่ 319 อาคารจัตุรัสจามจุรี ชั้น 41 ถนนพญาไท แขวง ปทุมวัน เขตปทุมวัน กทม.	0-2202-8000	-	www.dtac.co.th

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
EA	บริษัท พลังงานบริสุทธิ์ จำกัด (มหาชน)	ENERGY ABSOLUTE PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	บริษัท พลังงานบริสุทธิ์ จำกัด (มหาชน) ที่อยู่ชั้น 16 อาคารเอไอเอ แคปปิตอล เซ็นเตอร์ เลขที่ 89 ถนนรัชดาภิเษก เขตดินแดง กทม.	0-2248-2488-92, 0-2002-3667-9	0-2248-2493	http://www.energyabsolute.co.th
EGCO	บริษัท ผลิตไฟฟ้า จำกัด (มหาชน)	ELECTRICITY GENERATING PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	อาคารเอ็กโก, 222 หมู่ 5 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงทุ่งสองห้อง เขตหลักสี่ กทม.	0-2998-5000, 0-2998-5999	0-2955-0956-9	http://www.egco.com
ESSO	บริษัท เอสโซ่ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	ESSO (THAILAND) PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	เลขที่ 3195/17-29 ถนนพระรามที่ 4 แขวงคลองตัน เขตคลองเตย กทม.	0-2262-4000	0-2262-4800	http://www.esso.co.th
GLOBAL	บริษัท สยามโกลบอลเฮ้าส์ จำกัด (มหาชน)	SIAM GLOBAL HOUSE PCL.	พาณิชย์	232 หมู่ที่ 19 ตำบลรอบเมือง อำเภอเมืองร้อยเอ็ด ร้อยเอ็ด	0-4361-9850-99	0-4351-9777	www.globalhouse.co.th
GPSC	บริษัท โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี จำกัด (มหาชน)	GLOBAL POWER SYNERGY PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	555/2 ศูนย์เอนเนอร์ยี่คอมเพล็กซ์ อาคารบี ชั้น 5 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กทม.	0-2140-5318, 0-2140-4646, 0-2140-4628	-	http://www.gpscgroup.com
GULF	บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน)	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	พลังงานและ สาธารณูปโภค	87 อาคารเอ็มไทย ทาวเวอร์ ออลซีซั่นเพลส ชั้น 11 ถนนวิทย์ แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กทม.	0-2080-4499	0-2080-4455	www.gulf.co.th

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
GUNKUL	บริษัท กันกุลเอ็นจิเนียริง จำกัด (มหาชน)	GUNKUL ENGINEERING PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	เลขที่ 1177 อาคารเฟิร์ล แบงก์ ลือก ชั้น 8 ถนนพลโยธิน แขวงพญาไท เขตพญาไท กทม.	0-2242-5800	0-2242-5818-9	http://www.gunkul.com
HANA	บริษัท ฮานา ไม โครอิเล็กทรอนิกส์ จำกัด (มหาชน)	HANA MICROELECTRONICS PCL.	ชิ้นส่วน อิเล็กทรอนิกส์	เลขที่ 65/98 ซอยวิภาวดี-รังสิต 64 แขวงตลาดบางเขน เขตหลักสี่ กทม.	0-2551-1297, 0-2521-4935-9	0-2551-1299 , 0-2552-4906	www.hanagroup.com
HMPRO	บริษัท โฮม โปรดักส์ เซ็นเตอร์ จำกัด (มหาชน)	HOME PRODUCT CENTER PCL.	พาณิชย์	31 ถนนประชาชื่นนนทบุรี ตำบลบางเขน อำเภอเมือง นนทบุรี นนทบุรี	0-2832-1000	0-2832-1400	www.homepro.co.th
INTUCH	บริษัท อินทัช โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน)	INTOUCH HOLDINGS PCL.	เทคโนโลยี สารสนเทศและการ สื่อสาร	349 อาคารเอสเจ อินฟินิตี้ วัน บิสซิเนส คอมเพล็กซ์ ชั้นที่ 29 และ 30 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กทม.	0-2118-6900	0-2118-6947	www.intouchcompany.com
IRPC	บริษัท ไออาร์พีซี จำกัด (มหาชน)	IRPC PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	เลขที่ 555/2 ศูนย์เอนเนอร์ยี่ คอมเพล็กซ์ อาคาร บี ชั้น 6 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวง จตุจักร เขตจตุจักร กทม.	0-2765-7000	0-2765-7001	www.irpc.co.th
IVL	บริษัท อินโดรามา เวน เจอร์ส จำกัด (มหาชน)	INDORAMA VENTURES PCL.	ปิโตรเคมีและ เคมีภัณฑ์	75/102 อาคารโอเชียนทาว เวอร์ 2 ชั้น 37 ซอยสุขุมวิท 19 ถนนอโศก แขวงคลองเตย เหนือ เขตวัฒนา กทม.	0-2661-6661	0-2661-6664-5	www.indoramaventures.com

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
JAS	บริษัท จัสมิน อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)	JASMINE INTERNATIONAL PUBLIC COMPANY LIMITED	เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	อาคารจัสมินอินเตอร์เนชั่นแนล ชั้น 29-30, 200 หมู่ 4 ถนนแจ้งวัฒนะ ตำบลปากเกร็ด อำเภอปากเกร็ด นนทบุรี	0-2100-3000	0-2100-3150-2	http://www.jasmine.com
KBANK	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	KASIKORNBANK PCL.	ธนาคาร	เลขที่ 1 ซอยราษฎร์บูรณะ 27/1 ถนนราษฎร์บูรณะ แขวงราษฎร์บูรณะ เขตราษฎร์บูรณะ กทม.	0-2222-0000, 0-2888-8888	0-2470-1144	www.kasikornbank.com
KCE	บริษัท เคซีอี อิเล็กทรอนิกส์ จำกัด (มหาชน)	KCE ELECTRONICS PCL.	ชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์	เลขที่ 72-72/1-3 ซอยฉลองกรุง 31 แขวงลำปลาทิว เขตลาดกระบัง กทม.	0-2326-0196-9	0-2326-0300	www.kcethai.in.th
KKP	ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน)	KIATNAKIN BANK PCL.	ธนาคาร	อาคารอัมรินทร์ทาวเวอร์ ชั้น 12, 500 ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กทม.	0-2165-5555	0-2256-9933	http://kiatnakin.co.th
KTB	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	KRUNG THAI BANK PCL.	ธนาคาร	35 ถนนสุขุมวิท แขวงคลองเตยเหนือ เขตวัฒนา กทม.	0-2255-2222	0-2255-9391-6	http://www.ktb.co.th
KTC	บริษัท บัตรกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	KRUNGTHAI CARD PCL.	เงินทุนและหลักทรัพย์	อาคารสมัชชชาวาณิช 2 ชั้น 14, 591 แขวงคลองตันเหนือ เขตวัฒนา กทม.	0-2123-5000, 0-2123-5100	0-2828-5064	www.ktc.co.th

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
LH	บริษัทแลนด์แอนด์เฮาส์ จำกัด (มหาชน)	LAND AND HOUSES PCL.	พัฒนา อสังหาริมทรัพย์	อาคารคิวเฮาส์ ลุมพินี ชั้น 37- 38, 1 ถนนสาทรใต้ แขวงทุ่ง มหาเมฆ เขตสาทร กทม.	0-2343-8900	0-2230-8130	www.lh.co.th
MINT	บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์ เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)	MINOR INTERNATIONAL PCL.	อาหารและเครื่องดื่ม	อาคารเบอร์ลี่โยคเกอร์ ชั้น 16, 99 ซอยรู่เบีย ถนนสุขุมวิท 42 แขวงพระโขนง เขตคลองเตย กทม.	0-2381-5151	0-2381-5777-8	www.minor.com
MTC	บริษัท เมืองไทย แคปปิตอล จำกัด (มหาชน)	MUANGTHAI CAPITAL PCL.	เงินทุนและ หลักทรัพย์	32/1 ถนนเจริญสนิทวงศ์ แขวง บางอ้อ เขตบางพลัด กทม.	0-2880-1033	0-2880-1173	www.muangthaicap.com
ORI	บริษัท ออริจิ้น พร็อพ เพอร์ตี้ จำกัด (มหาชน)	ORIGIN PROPERTY PCL.	พัฒนา อสังหาริมทรัพย์	496 หมู่ที่ 9 ตำบลสำโรงเหนือ อำเภอเมืองสมุทรปราการ	0-2030-0000	0-2029-1939	www.origin.co.th
OSP	บริษัท โอสอัสกา จำกัด (มหาชน)	OSOTSPA PCL.	อาหารและเครื่องดื่ม	348 ถนนรามคำแหง แขวง หัวหมาก เขตบางกะปิ กทม.	0-2351-1000	0-2351-1125	www.osotspa.com
PLANB	บริษัท แพลน บี มีเดีย จำกัด (มหาชน)	PLAN B MEDIA PCL.	สื่อและสิ่งพิมพ์	1213/420 ซอยลาดพร้าว 94 แขวงพลับพลา เขตวัง ทองหลาง กทม.	0-2530-8053-6	0-2530-8057	www.planbmedia.co.th
PRM	บริษัท ปริมา มารีเน จำกัด (มหาชน)	PRIMA MARINE PCL.	ขนส่งและโลจิสติกส์	เลขที่ 80 ซอยบางนา-ตราด 30 แขวงบางนาใต้ เขตบางนา กทม.	0-2016-0190-4	0-2016-0199	www.primamarine.co.th

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
PTG	บริษัท พีทีจี เอ็นเนอวี่ จำกัด (มหาชน)	PTG ENERGY PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	เลขที่ 90 อาคารซีดับเบิลยู ทาวเวอร์ เอ ชั้นที่ 33 ถนน รัชดาภิเษก แขวงห้วยขวาง เขตห้วยขวาง กทม.	0-2168-3377, 0-2168-3388	0-2168-3379, 0-2168-3389	www.ptgenergy.co.th
PTT	บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)	PTT PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	555 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวง จตุจักร เขตจตุจักร กทม.	0-2537-2000	0-2537-3498-9	http://www.pttplc.com
PTTEP	บริษัท ปตท. สำรวจและ ผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน)	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	เลขที่ 90 อาคารซีดับเบิลยู ทาวเวอร์ เอ ชั้นที่ 33 ถนน รัชดาภิเษก แขวงห้วยขวาง เขตห้วยขวาง กทม.	0-2168-3377, 0-2168-3388	0-2168-3379, 0-2168-3389	www.ptgenergy.co.th
PTTGC	บริษัท พีทีที โกลบอล เค มิคอล จำกัด (มหาชน)	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL.	ปิโตรเคมีและ เคมีภัณฑ์	เลขที่ 555/1 ศูนย์เอนเนอร์ยี่ คอมเพล็กซ์ อาคารเอ ชั้น 14- 18 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวง จตุจักร เขตจตุจักร กทม.	0-2265-8400	0-2265-8500	www.pttgcgroup.com
RATCH	บริษัท ผลิตไฟฟ้าราชบุรี โฮลดิ้ง จำกัด (มหาชน)	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	72 ถนนงามวงศ์วาน ตำบล บางเขน อำเภอเมืองนนทบุรี นนทบุรี	0-2794-9999	0-2794-9998	www.ratch.co.th
ROBINS	บริษัท โรบินสัน จำกัด (มหาชน)	ROBINSON PCL.	พาณิชย์	สำนักงานใหญ่ 9/9 ชั้น 14-17 ถนนพระราม 9 แขวงห้วย ขวาง เขตห้วยขวาง กรุงเทพมหานคร 10310	0-2169-2500	0-2169-2577	http://robins- th.listedcompany.com

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
RS	บริษัท อาร์เอส จำกัด (มหาชน)	RS PCL.	พาณิชย์	เลขที่ 27 อาคารอาร์เอสกรุ๊ป ทาวเวอร์ เอ ถนนประเสริฐมนู กิจ แขวงเสนานิคม เขตจตุจักร กทม.	0-2037-8888	-	http://www.rs.co.th
SAWAD	บริษัท ศรีสวัสดิ์ คอร์ ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	SRISAWAD CORPORATION PCL.	เงินทุนและ หลักทรัพย์	99/392 อาคารศรีสวัสดิ์ ชั้น 4, 6 ซอยแจ้งวัฒนะ 10 แขวง 3 ถนนแจ้งวัฒนะ แขวงทุ่งสอง ห้อง เขตหลักสี่ กทม.	0-2693-5555	0-2573-1565	http://www.meebaanmecerod.com
SCB	ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)	THE SIAM COMMERCIAL BANK PCL.	ธนาคาร	9 ถนนรัชดาภิเษก แขวง จตุจักร เขตจตุจักร กทม.	0-2544-1111, 0-2777-7777	0-2937-7931	www.scb.co.th
SCC	บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด(มหาชน)	THE SIAM CEMENT PCL.	วัสดุก่อสร้าง	1 ถนนปูนซิเมนต์ไทย แขวง บางซื่อ เขตบางซื่อ กทม.	0-2586-3333, 0-2586-4444	0-2587-2199, 0-2587-2201	www.scg.com
SGP	บริษัท สยามแก๊ส แอนด์ ปิโตรเคมีคัลส์ จำกัด (มหาชน)	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL.	พลังงานและ สารเคมีปิโตรเคมี	553 อาคารเดอะพลาเดียม อาคาร A ชั้น 30 ถนนราช ปรารก แขวงมักกะสัน เขต ราชเทวี กทม.	0-2120-9999	0-2250-6008	www.siamgas.com

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
SPALI	บริษัท สุपालย์ จำกัด (มหาชน)	SUPALAI PCL.	พัฒนา อสังหาริมทรัพย์	อาคารสุपालย์แกรนด์ทาวเวอร์ 1011 ถนนพระราม 3 แขวง ช่องนนทรี เขตยานนาวา กทม.	0-2725-8888	0-2683-2177	http://www.supalai.com
SPRC	บริษัท สตาร์ ปิโตรเลียม รีไฟน์นิ่ง จำกัด (มหาชน)	STAR PETROLEUM REFINING PCL	พลังงานและ สาธารณูปโภค	เลขที่ 1 ถนนไอ - สามบี ตำบล มาบตาพุด อำเภอเมืองระยอง ระยอง	0-3869-9000	0-3869-9999	www.sprc.co.th
STA	บริษัท ศรีตรังแอโกร อินดัสทรี จำกัด (มหาชน)	SRI TRANG AGRO- INDUSTRY PCL.	อาหารและเครื่องดื่ม	10 ซอย 10 ถนนเพชรเกษม ตำบลหาดใหญ่ อำเภอ หาดใหญ่ สงขลา	0-7434-4663	0-7434-4676, 0-7434-4677, 0-7423-7423	www.sritranggroup.com
STEC	บริษัท ชิโน-ไทย เอ็นจิ เนียริงแอนด์คอน สตรัคชั่น จำกัด (มหาชน)	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL.	บริการรับเหมา ก่อสร้าง	อาคารชิโน-ไทย ทาวเวอร์ ชั้น 29-30, 32/59-60 ถนนอโศก สุขุมวิท 21 แขวงคลองเตย เหนือ เขตวัฒนา กทม.	0-2260-1321-2	0-2260-1339, 0-2258-3436	www.stecon.co.th
TASCO	บริษัท ทิปกัสแอสฟัลท์ จำกัด (มหาชน)	TIPCO ASPHALT PCL.	วัสดุก่อสร้าง	118/1 ถนนพระราม 6 แขวง พญาไท เขตพญาไท กทม.	0-2273-6000	0-2273-6030	http://www.tipcoasphalt.com
TCAP	บริษัท ทุนธนชาต จำกัด (มหาชน)	THANACHART CAPITAL PCL.	ธนาคาร	444 อาคารเอ็มบีเค ทาวเวอร์ ชั้น 16-17 ถนนพญาไท แขวง วังใหม่ เขตปทุมวัน กทม.	0-2217-8000, 0- 2217-8199, 0- 2217-8444	0-2217-8312	www.thanachart.co.th

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
THANI	บริษัท ราชธานีลีซซิ่ง จำกัด (มหาชน)	RATCHTHANI LEASING PCL.	เงินทุนและ หลักทรัพย์	อาคารสินสาทรทาวเวอร์ ชั้น 11 UP, 77/35-36 ถนนกรุงธนบุรี แขวงคลองตันใต้ เขต คลองสาน กทม.	0-2440-0844	0-2440-0848	www.ratchthani.com
TISCO	บริษัท ทีเอสไอไฟแนนเชียลกรุ๊ป จำกัด (มหาชน)	TISCO FINANCIAL GROUP PCL.	ธนาคาร	48/49 อาคารทีเอสไอทาวเวอร์ ชั้น 21 ถนนสาทรเหนือ แขวง สีลม เขตบางรัก กทม.	0-2633-6888	0-2633-6880	http://www.tisco.co.th
TKN	บริษัท เต้าแก่น้อย ฟู๊ด แอนด์มาร์เก็ตติ้ง จำกัด (มหาชน)	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL.	อาหารและเครื่องดื่ม	337 ถนนบอนด์สตรีท ตำบล บางพูด อำเภอปากเกร็ด นนทบุรี	0-2984-0666	0-2984-0118	www.taokaenoi.co.th
TMB	ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน)	TMB BANK PCL.	ธนาคาร	3000 ถนนพหลโยธิน แขวง จอมพล เขตจตุจักร กทม.	0-2299-1111, 0-2617-9111	0-2299-2758	http://www.tmbbank.com
TOA	บริษัท ทีโอเอ เพ้นท์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	TOA PAINT (THAILAND) PCL.	วัสดุก่อสร้าง	31/2 หมู่ 3 ถนนบางนา-ตราด ตำบลบางเสาธง อำเภอบางเสาธง สมุทรปราการ	0-2335-5555	0-2312-8919	www.toagroup.com
TOP	บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน)	THAI OIL PCL.	พลังงานและ สาธารณูปโภค	555/1 ศูนย์เอนเนอร์ยี คอมเพล็กซ์ อาคารเอ ชั้น 11 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจตุจักร เขต จตุจักร กทม.	0-2797-2999, 0-2299-0000	0-2797-2970	www.thaioilgroup.com
TRUE	บริษัท ทรู คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	TRUE CORPORATION PCL.	เทคโนโลยี สารสนเทศและการ สื่อสาร	อาคารทรูทาวเวอร์, 18 ถนนรัชดาภิเษก เขตห้วยขวาง กทม.	0-2859-1111	0-2859-9134	http://www.truecorp.co.th

หลักทรัพย์ อ้างอิง	ชื่อบริษัท (ภาษาไทย)	ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ)	ประเภทธุรกิจ	ที่ตั้งสำนักงาน	โทรศัพท์	โทรสาร	เว็บไซต์
TU	บริษัท ไทยยูเนี่ยน กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)	THAI UNION GROUP PCL.	อาหารและเครื่องดื่ม	อาคารเอส เอ็ม ทาวเวอร์ ชั้น M, 979/12 ถนนพหลโยธิน แขวงพญาไท เขตพญาไท กทม.	02-298-0024, 0-2298-0537-41	0-2298-0553	www.thaiunion.com
VGI	บริษัท วีจีไอ จำกัด (มหาชน)	VGI PUBLIC COMPANY LIMITED	สื่อและสิ่งพิมพ์	21 อาคารทีเอสที ทาวเวอร์ ชั้น 9 ถนนวิภาวดี-รังสิต แขวง จอมพล เขตจตุจักร	0-2273-8884	0-2273-8883	www.vgi.co.th
WHA	บริษัท ดับบลิวเอชเอ คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	WHA CORPORATION PCL.	พัฒนา อสังหาริมทรัพย์	1121 หมู่ 3 ถนนเทพารักษ์ ตำบลเทพารักษ์ อำเภอเมือง สมุทรปราการ	0-2753-3750	0-2753-2750	www.wha.co.th

2. ข้อมูลเกี่ยวกับดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง กรณีเป็นการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในดัชนีหลักทรัพย์

ดัชนีหลักทรัพย์ SET50 Index

ชื่อดัชนีหลักทรัพย์	SET50 Index
ชื่อภาษาอังกฤษ	SET50 Index
ผู้คำนวณ	ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ที่ตั้งสำนักงาน	เลขที่ 93 ชั้น 17 ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพมหานคร 10400
หมายเลขโทรศัพท์	0-2009-9000
Home Page	http://www.set.or.th

ทั้งนี้ ทางผู้คำนวณดัชนีราคา SET50 Index จะมีการปรับรายการหลักทรัพย์ทุก 6 เดือน ดังต่อไปนี้

- (i) รอบทบทวนเดือนมิถุนายน: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนกรกฎาคม – ธันวาคมปีเดียวกัน
- (ii) รอบทบทวนเดือนธันวาคม: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนมกราคม – มิถุนายนปีถัดไป

โดยในรอบปีที่ผ่านมาได้มีการเปลี่ยนแปลงส่วนประกอบของดัชนีดังกล่าว ดังนี้



Section 2 of Annex 1
to Form 56 (Underlyir

โดยแหล่งข้อมูลอ้างอิงที่ผู้ลงทุนจะสามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับข้อมูลดัชนีหลักทรัพย์ดังกล่าวได้ที่

<http://www.set.or.th/th/market/constituents.html>

<http://www.set.or.th/set/dwunderlying.do?language+th&country+TH>

SET50 & SET100 INDEX CONSTITUENTS

(Published on Feb 20, 2020)

For calculating the index during Jan 1 - Jun 30, 2020

SET50 INDEX CONSTITUENTS

Rank by alphabet

No.	Symbol	SET50 Company	Sector	No.	Symbol	SET50 Company	Sector
1	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	Information & Communication Technology	31	LH	LAND AND HOUSES PCL	Property Development
2	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	Transportation & Logistics	32	MINT	MINOR INTERNATIONAL PCL	Food and Beverage
3	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	Property Development	33	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PCL	Finance and Securities
4	BANPU	BANPU PCL	Energy & Utilities	34	OSP	OSOTSPA PCL	Food and Beverage
5	BBL	BANGKOK BANK PCL	Banking	35	PTT	PTT PCL	Energy & Utilities
6	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	Health Care Services	36	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	Energy & Utilities
7	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	Transportation & Logistics	37	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	Petrochemicals & Chemicals
8	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	Energy & Utilities	38	RATCH	RATCH GROUP PCL	Energy & Utilities
9	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	Health Care Services	39	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PCL	Finance and Securities
10	BJC	BERLI JUCKER PCL	Commerce	40	SCB	THE SIAM COMMERCIAL BANK PCL	Banking
11	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	Transportation & Logistics	41	SCC	THE SIAM CEMENT PCL	Construction Materials
12	CBG	CARABAO GROUP PCL	Food and Beverage	42	TCAP	THANACHART CAPITAL PCL	Banking
13	CPALL	CP ALL PCL	Commerce	43	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	Banking
14	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	Food and Beverage	44	TMB	TMB BANK PCL	Banking
15	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	Property Development	45	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PCL	Construction Materials
16	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	Commerce	46	TOP	THAI OIL PCL	Energy & Utilities
17	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	Electronic Components	47	TRUE	TRUE CORPORATION PCL	Information & Communication Technology
18	DTAC	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	Information & Communication Technology	48	TU	THAI UNION GROUP PCL	Food and Beverage
19	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	Energy & Utilities	49	VGI	VGI PCL	Media & Publishing
20	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	Energy & Utilities	50	WHA	WHA CORPORATION PCL	Property Development
21	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	Commerce	Reserve list of SET50			
22	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	Energy & Utilities	1	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL	Finance and Securities
23	GULF	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	Energy & Utilities	2	BPP	BANPU POWER PCL	Energy & Utilities
24	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PCL	Commerce	3	CKP	CK POWER PCL	Energy & Utilities
25	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PCL	Information & Communication Technology	4	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PCL	Information & Communication Technology
26	IRPC	IRPC PCL	Energy & Utilities	5	KKP	KIATNAKIN BANK PCL	Banking
27	IVL	INDORAMA VENTURES PCL	Petrochemicals & Chemicals	6	TTW	TTW PCL	Energy & Utilities
28	KBANK	KASIKORNBANK PCL	Banking	SET50 Inclusion: CRC			SET50 Exclusion: BPP
29	KTB	KRUNG THAI BANK PCL	Banking	For more information visit: www.set.or.th/set50			
30	KTC	KRUNGTHAI CARD PCL	Finance and Securities	or contact us: IndexTeam@set.or.th +662 009 9573 - 4			
				Sales-Information Services: Infoproducts@set.or.th +662 009 9621			

Disclaimer: The Stock Exchange of Thailand (SET) issues this document for providing general information only. While thorough care has been taken in preparing and updating the data to ensure complete, accurate, and reliable information, SET cannot guarantee the validity of the information found here. SET thus cannot be held responsible, obligated, or liable for any kind of inaccuracies, delays, interruptions, errors, or omissions.



SET50 & SET100 INDEX CONSTITUENTS

(Published on Feb 20, 2020)

For calculating the index during Jan 1 - Jun 30, 2020

SET100 INDEX CONSTITUENTS

Rank by alphabet

No.	Symbol	SET100 Company	Sector	No.	Symbol	SET100 Company	Sector
1	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	Information & Communication Technology	54	KTC	KRUNGTHAI CARD PCL	Finance and Securities
2	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL	Finance and Securities	55	LH	LAND AND HOUSES PCL	Property Development
3	AMATA	AMATA CORPORATION PCL	Property Development	56	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	Media & Publishing
4	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	Transportation & Logistics	57	MBK	MBK PCL	Property Development
5	AP	AP (THAILAND) PCL	Property Development	58	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PCL	Commerce
6	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	Property Development	59	MINT	MINOR INTERNATIONAL PCL	Food and Beverage
7	BANPU	BANPU PCL	Energy & Utilities	60	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PCL	Finance and Securities
8	BBL	BANGKOK BANK PCL	Banking	61	ORI	ORIGIN PROPERTY PCL	Property Development
9	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL	Health Care Services	62	OSP	OSOTSPA PCL	Food and Beverage
10	BCP	BANGCHAK CORPORATION PCL	Energy & Utilities	63	PLANB	PLAN B MEDIA PCL	Media & Publishing
11	BCPG	BCPG PCL	Energy & Utilities	64	PRM	PRIMA MARINE PCL	Transportation & Logistics
12	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	Health Care Services	65	PSH	PRUKSA HOLDING PCL	Property Development
13	BEC	BEC WORLD PCL	Media & Publishing	66	PSL	PRECIOUS SHIPPING PCL	Transportation & Logistics
14	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	Transportation & Logistics	67	PTG	PTG ENERGY PCL	Energy & Utilities
15	BGC	BG CONTAINER GLASS PCL	Packaging	68	PTT	PTT PCL	Energy & Utilities
16	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	Energy & Utilities	69	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	Energy & Utilities
17	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	Health Care Services	70	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	Petrochemicals & Chemicals
18	BJC	BERLI JUCKER PCL	Commerce	71	QH	QUALITY HOUSES PCL	Property Development
19	BPP	BANPU POWER PCL	Energy & Utilities	72	RATCH	RATCH GROUP PCL	Energy & Utilities
20	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	Transportation & Logistics	73	RS	RS PCL	Commerce
21	CBG	CARABAO GROUP PCL	Food and Beverage	74	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PCL	Finance and Securities
22	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL	Tourism & Leisure	75	SCB	THE SIAM COMMERCIAL BANK PCL	Banking
23	CHG	CHULARAT HOSPITAL PCL	Health Care Services	76	SCC	THE SIAM CEMENT PCL	Construction Materials
24	CK	CH. KARNCHANG PCL	Construction Services	77	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL	Energy & Utilities
25	CKP	CK POWER PCL	Energy & Utilities	78	SPALI	SUPALAI PCL	Property Development
26	COM7	COM7 PCL	Commerce	79	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PCL	Energy & Utilities
27	CPALL	CP ALL PCL	Commerce	80	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL	Agribusiness
28	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	Food and Beverage	81	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	Construction Services
29	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	Property Development	82	STPI	STP&I PCL	Construction Services
30	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	Commerce	83	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PCL	Energy & Utilities
31	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	Electronic Components	84	TASCO	TIPCO ASPHALT PCL	Construction Materials
32	DTAC	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	Information & Communication Technology	85	TCAP	THANACHART CAPITAL PCL	Banking
33	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	Energy & Utilities	86	THAI	THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL	Transportation & Logistics
34	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	Energy & Utilities	87	THANI	RATCHTHANI LEASING PCL	Finance and Securities
35	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PCL	Construction Materials	88	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL	Health Care Services
36	ERW	THE ERAWAN GROUP PCL	Tourism & Leisure	89	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	Banking
37	ESSO	ESSO (THAILAND) PCL	Energy & Utilities	90	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL	Food and Beverage
38	GFPT	GFPT PCL	Agribusiness	91	TMB	TMB BANK PCL	Banking
39	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	Commerce	92	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PCL	Construction Materials
40	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	Energy & Utilities	93	TOP	THAI OIL PCL	Energy & Utilities
41	GULF	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	Energy & Utilities	94	TPIPP	TPI POLENE POWER PCL	Energy & Utilities
42	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PCL	Energy & Utilities	95	TQM	TQM CORPORATION PCL	Insurance
43	HANA	HANA MICROELECTRONICS PCL	Electronic Components	96	TRUE	TRUE CORPORATION PCL	Information & Communication Technology
44	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PCL	Commerce	97	TTW	TTW PCL	Energy & Utilities
45	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PCL	Information & Communication Technology	98	TU	THAI UNION GROUP PCL	Food and Beverage
46	IRPC	IRPC PCL	Energy & Utilities	99	VGI	VGI PCL	Media & Publishing
47	IVL	INDORAMA VENTURES PCL	Petrochemicals & Chemicals	100	WHA	WHA CORPORATION PCL	Property Development
48	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PCL	Information & Communication Technology	Reserve list of SET100			
49	JMT	JMT NETWORK SERVICES PCL	Finance and Securities	1	AAV	ASIA AVIATION PCL	Transportation & Logistics
50	KBANK	KASIKORN BANK PCL	Banking	2	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PCL	Commerce
51	KCE	KCE ELECTRONICS PCL	Electronic Components	3	JMART	JAY MART PCL	Information & Communication Technology
52	KKP	KIATNAKIN BANK PCL	Banking	4	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PCL	Property Development
53	KTB	KRUNG THAI BANK PCL	Banking	5	SISB	SISB PCL	Professional Services
SET100 Inclusion: CRC			SET100 Exclusion: AAV	6	WORK	WORKPOINT ENTERTAINMENT PCL	Media & Publishing

Disclaimer: The Stock Exchange of Thailand (SET) issues this document for providing general information only. While thorough care has been taken in preparing and updating the data to ensure complete, accurate, and reliable information, SET cannot guarantee the validity of the information found here. SET thus cannot be held responsible, obligated, or liable for any kind of inaccuracies, delays, interruptions, errors, or omissions.

