



Pi Securities PCL

“รู้จักเครื่องมือ และแนวทางการใช้”

TFEX CURRENCY FUTURES

Date: March 27, 2025

Presenter: Dethana Fangsaard, Assistant Managing Director



COMPANY OVERVIEW

Background

ลูกค้าเป็นบริษัทนำเข้าสินค้าอาหารสัตว์เลี้ยงที่มีประสบการณ์ยาวนานในธุรกิจนำเข้าส่งออก ทำให้มีความเข้าใจในกลไกของอัตราแลกเปลี่ยนเป็นอย่างดี

TFEX Products

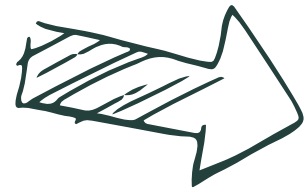
ลูกค้าใช้สกุลเงิน USD/THB และ EUR/THB ในการทำสัญญาป้องกันความเสี่ยง (Fully Hedge)



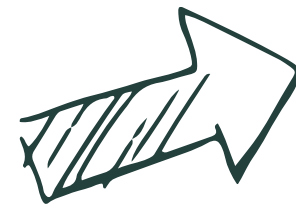
กลยุทธ์การวาง IM และการบริหารเงินทุน



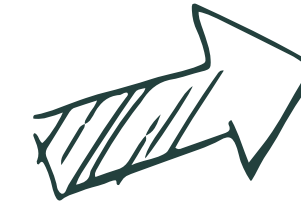
ลูกค้าเลือกวางเงินหลัก
ประกัน (IM) ในระดับ 1-
3 เท่าของ IM ที่กำหนด
แต่พร้อมที่จะเติมเงินสด
เข้ามาเพิ่มเติมทันทีหาก
ระดับ IM ลดลง



ลูกค้ามีการวางแผน
การนำเข้สินค้าที่ชัดเจน
และจะทำการซื้อขาย
สัญญา TFEX เมื่อมี
ความแน่นอนของ
แผนการนำเข้



ก่อนการทำออเดอร์
แต่ละครั้ง ลูกค้าจะตรวจ
สอบสถานการณ์และ
แนวโน้มของค่าเงิน
อย่างละเอียด



ลูกค้ามีการวางแผนการ
ใช้งานและทยอยทำออ
เดอร์ ทำให้สภาพคล่อง
ในตลาดยังเพียงพอต่อ
การทำธุรกรรม (ยกเว้น
EUR/THB ที่อาจมี
ปัญหาบ้าง)



การทำธุรกรรมและบัญชี



ลูกค้าเปิดบัญชีในนามบริษัท



เมื่อปิดสถานะ TFEX จะมีการบันทึกกำไรขาดทุนทางบัญชีทันที



ลูกค้าพร้อมที่จะเลื่อนสัญญา (Rollover) หากยังไม่มีการใช้งาน แต่โดยทั่วไปจะวางแผนให้สอดคล้องกับอายุสัญญา TFEX (เช่น ใช้ในเดือนพฤษภาคม ก็ทำสัญญาซีรีส์ M)



ในช่วงแรก ลูกค้ามีปัญหาเรื่องความเข้าใจในการทำบัญชีและภาษี เนื่องจากเข้าใจว่าเป็นการซื้อและเก็บต้นทุนเป็นชุดๆ แต่ระบบใช้การคำนวณต้นทุนแบบ FIFO อย่างไรก็ตาม ปัญหาได้รับการแก้ไขหลังจากการปรึกษากับสรรพากร



BENEFITS AND IMPACT

▶ Impact on Businesses

ตัดปัญหาความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนที่อาจจะส่งผลให้เกิดการขาดทุนของการดำเนินงาน ทำให้บริษัทดำเนินงานมุ่งเป้าไปที่ส่วนงานที่ถนัด เพิ่มประสิทธิภาพในภาพรวมให้ดีขึ้น

▶ Key Benefits

- มีความยืดหยุ่น ในการสั่งซื้อขาย
- สะดวก สามารถสั่งซื้อขายได้ถึงไตรมาส
- มีต้นทุนต่ำกว่า ราคาใกล้เคียงราคา Spot

ค่าคอมมิชชั่นเทรด USD/THB

01

By Marketing = 11.10 บาท / Contract
ถ้าเทรด 2,001 Contacts ขึ้นไป = 8.10 บาท / Contract

02

By Internet = 10.10 บาท / Contract
ถ้าเทรด 2,001 Contacts ขึ้นไป = 7.40 บาท / Contract



เอกสารเปิดบัญชีนิติบุคคล

- สำเนาหนังสือรับรองการจดทะเบียนเป็นนิติบุคคลจากกระทรวงพาณิชย์ (ย้อนหลังไม่เกิน 3 เดือน)
- สำเนาบัญชีรายชื่อผู้ถือหุ้นล่าสุด หรือเอกสารอื่นของบริษัทที่แสดงรายชื่อล่าสุดของผู้ถือหุ้น
- สำเนารายงานการประชุมคณะกรรมการบริษัทซึ่งมีมติอนุมัติให้ทำธุรกรรม รวมทั้งการแต่งตั้งหรือมอบอำนาจบุคคลให้กระทำการแทนในนามของบริษัท (ในกรณีการมอบอำนาจให้บุคคลอื่นที่ไม่ใช่กรรมการที่มีอำนาจดำเนินการตามหนังสือรับรองของบริษัท)
- สำเนาบัตรประชาชนของกรรมการผู้ที่มีอำนาจลงนามผูกพันบริษัท หรือบุคคลผู้ที่มีอำนาจลงนามในคำขอเปิดบัญชีและสัญญาแต่งตั้งตัวแทนฯ = 2 ชุด
- สำเนาทะเบียนบ้านของกรรมการผู้ที่มีอำนาจลงนาม = 2 ชุด
- สำเนางบการเงินงวดล่าสุด (ตามเกณฑ์ 2 ปีล่าสุด)
- สำเนาหน้าสมุดบัญชีเงินฝากธนาคารหน้าแรกที่มีเลขที่บัญชีของบริษัท

ตัวอย่างรายการซื้อขาย



บริษัทหลักทรัพย์ พีซี จำกัด (มหาชน)
PI Securities Public Company Limited
 132 อาคารนิมิตหมาย ชั้นที่ 3 ซอย 17, 18, 20, 27 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจตุจักร กรุงเทพฯ 10330
 132 Level 17, 18, 20, 27 Sindhon Tower 3 Wireless Road, Lumpini Pathumwan Bangkok 10330
 Tel : 0-2305-7800 Fax : 0-2305-7171
 เลขที่ใบจดทะเบียนหลักทรัพย์ 0107537800572
 Tax ID No. 0107537800572
 สถานที่ประกอบกิจการ "สำนักงานใหญ่" Place of Business "Head Office"

ใบยืนยันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า/ใบกำกับภาษี/ใบชำระราคา Confirmation Note / Tax Invoice / Settlement Statement

หน้า 1 / Page 1 / 2

บัญชีเลขที่ Account No.	สาขา Branch	วันที่ซื้อ-ขาย Trading Date
เอกสารเลขที่ Document No.	ใบกำกับภาษีเลขที่ Tax Invoice No.	วันที่ครบกำหนดชำระ Due Date
เจ้าหน้าที่การตลาด Marketing Officer		
เลขประจำตัวผู้เสียภาษีอากร Tax ID NO.		

Instrument Code	Contract No.	Long/Short	Status	No. of Contract	Cost Price	Premium/Settlement Amount	Commission and Fees*	VAT	W/H	Charge Amount
USD25		L	Open	7	33.34	0.00	70.70	4.95	2.12	73.53
USD25		L	Open	3	33.35	0.00	30.30	2.12	0.91	31.51
USD25		L	Open	1	33.34	0.00	10.10	0.71	0.30	10.51
USD25		L	Open	7	33.35	0.00	70.70	4.95	2.12	73.53
USD25		L	Open	13	33.34	0.00	131.30	9.19	3.94	136.55
USD25		L	Open	569	33.35	0.00	5,746.90	402.28	172.41	5,976.77
Total						0.00	6,060.00	424.20	181.80	6,302.40
Grand Total						0.00	6,060.00	424.20	181.80	6,302.40

ตัวอย่างสัญญาณซื้อขาย

