

แบบแสดงรายการข้อมูลเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น

บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
Finansia Syrus Securities Public Company Limited
เสนอขาย

โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
 มูลค่าเสนอขายรวมทั้งสิ้นไม่เกิน 300 ล้านบาท

“โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566”

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นชนิดระบุชื่อผู้ถือ ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน ไม่มีการแปลงสภาพ ไม่มีดอกเบี้ยว หรือ ที่อัตราดอกเบี้ยร้อยละ [●] ต่อปี สำหรับกรณีหุ้นกู้ประเภทมีดอกเบี้ยว ไม่สามารถโอนได้หรือโอนเปลี่ยนมือได้อย่างจำกัด และไม่มีผู้แทนถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยมีอายุไม่เกิน 270 วัน นับจากวันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง มีอัตราส่วนลดร้อยละ 0-30 และราคาเสนอขายร้อยละ 70-100 ของราคาหน้าหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทไม่มีดอกเบี้ยว ตามข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นแต่ละประเภทหรือแต่ละชุด

บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) (“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง” หรือ “บริษัท”) มีความประสงค์ออกและเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นคราวๆ โดยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุดที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอยู่ภายใต้บังคับข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง รวมถึงข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

ประเภทการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	เสนอขายในวงจำกัดให้แก่ผู้ลงทุนสถาบัน และ/หรือผู้ลงทุนรายใหญ่
อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือหรือเครดิตภายในประเทศ (National Rating) ระยะยาวที่ระดับ “BBB+ (tha)” โดยบริษัท พิทช์เรตติ้งส์ จำกัด (ข้อมูล ณ วันที่ 29 ธันวาคม 2565) โดยมีแนวโน้มอันดับเครดิตที่ “Stable” ในขณะเดียวกัน พิทช์เรตติ้งส์ ประกาศจัดอันดับเครดิตในประเทศระยะสั้นที่ “F2(tha)” โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดให้มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในวันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงรุ่นแรก ภายใต้โครงการ และตลอดอายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
ระยะเวลาการเสนอขาย	:	21 พฤศจิกายน 2566 – 15 พฤศจิกายน 2568
ผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
วันที่ยื่นแบบแสดงรายการข้อมูลและหนังสือชี้ชวน	:	18 ตุลาคม 2566
วันที่แบบแสดงรายการข้อมูลและหนังสือชี้ชวนมีผลใช้บังคับ	:	21 พฤศจิกายน 2566
ปัจจัยอ้างอิง	:	(1) หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 หรือ (2) ตะกร้าหลักทรัพย์ (Basket Securities) ซึ่งประกอบด้วยหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET 100 หรือ (3) ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย หรือ (4) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ (Exchange Traded Fund) ที่จดทะเบียนและซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
รูปแบบและมูลค่าการไถ่ถอนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	ไถ่ถอนเป็นเงินสดหรือหลักทรัพย์อ้างอิง โดยสามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง

คำเตือน: ก่อนตัดสินใจลงทุน ผู้ลงทุนต้องใช้วิจารณญาณในการพิจารณาข้อมูลรายละเอียดเกี่ยวกับ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง รวมทั้งความเหมาะสมในการลงทุน และความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องเป็นอย่างดี การมีผลใช้บังคับของแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ มิได้เป็นการแสดงว่าคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ คณะกรรมการกำกับตลาดทุน หรือสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์แนะนำให้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย หรือมิได้ประกันราคา หรือผลตอบแทนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย หรือรับรองความครบถ้วนและถูกต้องของข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด ทั้งนี้ การรับรองความถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้เป็นความรับผิดชอบของผู้เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หากแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีข้อความหรือรายการที่เป็นเท็จ หรือขาดข้อความที่ควรต้องแจ้งในสาระสำคัญ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ได้ซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่เกินหนึ่งปีนับแต่วันที่แบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นมีผลใช้บังคับ มีสิทธิเรียกร้องค่าเสียหายจากบริษัทหรือเจ้าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ตามมาตรา 82 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ทั้งนี้ ภายในหนึ่งปีนับแต่

วันที่ได้รู้หรือควรได้รู้ว่าแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นเท็จหรือขาดข้อมูลที่ควรต้องแจ้งในสาระสำคัญ แต่ไม่เกินสองปีนับจากวันที่แบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีผลใช้บังคับ

ทั้งนี้มูลค่าไถ่ถอนรวมของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะขึ้นอยู่กับราคาหลักทรัพย์อ้างอิงในวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ซึ่งอาจทำให้มูลค่าไถ่ถอนรวมของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต่ำกว่ามูลค่าเงินต้นที่ผู้ลงทุนชำระให้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ได้จัดให้มีการประกันมูลค่าไถ่ถอนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน

ทั้งหมดหรือบางส่วน

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้านเช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน

บุคคลทั่วไปสามารถขอตรวจสอบหรือขอสำเนาแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนได้ที่ศูนย์สารนิเทศ สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ 333/3 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพมหานคร ในเวลาทำการของสำนักงาน หรือทาง <http://www.sec.or.th>

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องไม่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใด ๆ ให้แก่บุคคลที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่ตามประเภทและลักษณะที่นิยามไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่ กจ. 39/2564 เรื่อง การกำหนดคบทนิยามผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และผู้ลงทุนรายใหญ่ ฉบับลงวันที่ 24 ธันวาคม พ.ศ. 2564 (และที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่)

การลงทุนมีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลโดยละเอียดก่อนการลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

999/9 อาคาร ดี ออฟฟิศแอส แอท เซ็นทรัลเวิลด์ ชั้น 18 ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร
โทร 0-2658-9000 โทรสาร 0-2658-9110 เว็บไซต์ www.fnsyrus.com

สารบัญ

		หน้า
ส่วนที่ 1	สรุปข้อมูลสำคัญของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Fact Sheet)	ส่วนที่ 1 หน้า 1
ส่วนที่ 2	ข้อมูลสรุป (Executive Summary)	ส่วนที่ 2 หน้า 1
ส่วนที่ 3	ข้อมูลเกี่ยวกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	ส่วนที่ 3 หน้า 1
ส่วนที่ 4	ข้อมูลเกี่ยวกับการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น	ส่วนที่ 4 หน้า 1

เอกสารแนบ	1. ข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
	2. งบการเงินล่าสุดงวดครึ่งปี 2566 ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
	3. งบการเงินล่าสุดสำหรับปี 2565 ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น

เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Equity Linked Notes (ELN) แบบมีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็น
หลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน [กรณีอ้างอิงกับดัชนีหลักทรัพย์ จะไถ่ถอนเป็นเงินเท่านั้น]
ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน วันที่ [●]

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ ร้อยละ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย	เป็นไปตามลักษณะพิเศษ ผลตอบแทน และความเสี่ยง สำคัญของตราสาร
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจุบัน	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/ดัชนี SET[●]/ หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนิน กิจการทั่วไป และป้องกัน ความเสี่ยงตามนโยบายของ บริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ นายทะเบียนหุ้นกู้	ไม่มี บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผัน ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตรา ผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ วันครบกำหนด	<input checked="" type="checkbox"/> มี ณ วันครบกำหนดอายุผู้ ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะ ชำระคืนเงินสด อย่างน้อย ร้อยละ [●] ของเงินลงทุน

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)
ตัวอย่าง



หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความ
เสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้
ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสาร
อนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยี
สารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่าย
หลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืม
หลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยง
เพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยง
ของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

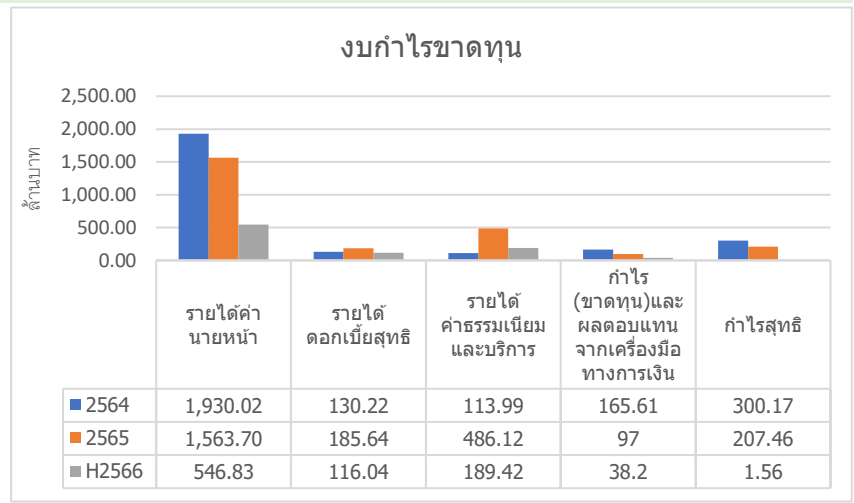
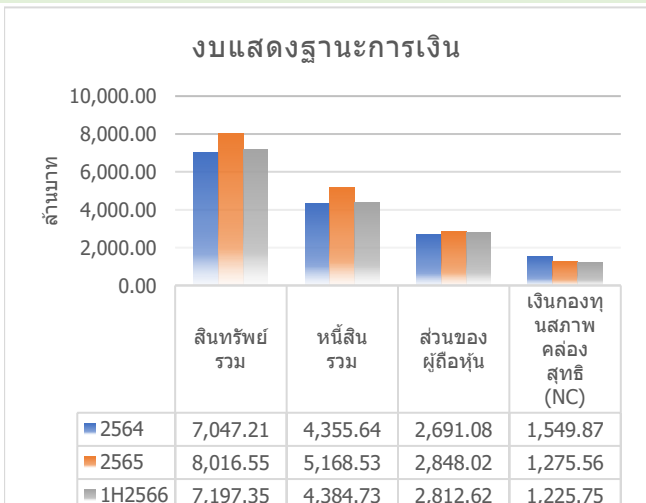
ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

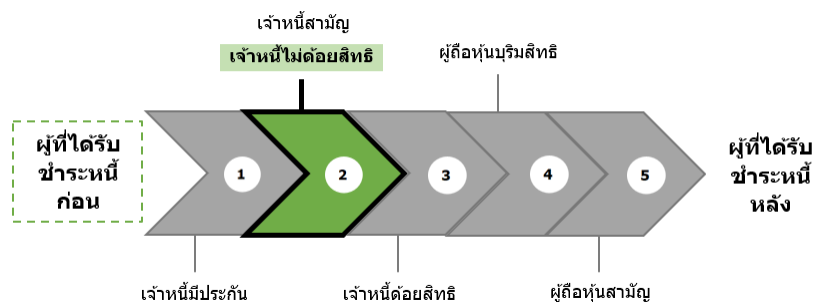
เป็น ไม่เป็น

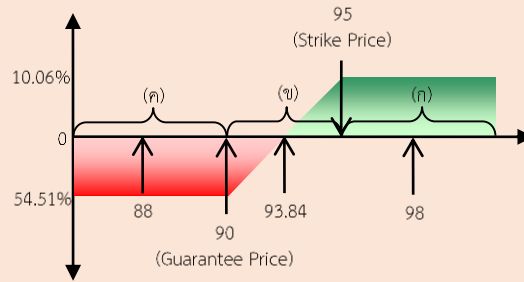
สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง



ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท





กรณีไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือเงิน

- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K_1) แต่มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price: K_2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบและชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ค) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) น้อยกว่าราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price: K_2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบและชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และจะชำระเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นเงินเท่ากับ [(ราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น - ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย) x จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ] ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

กรณีไถ่ถอนเป็นเงิน

- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K_1) แต่มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price: K_2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ลบออกด้วย [(ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย - ราคาหลักทรัพย์อ้างอิง) x จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ] ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ค) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) น้อยกว่าราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price: K_2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ลบออกด้วย [(ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย - ราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น) x จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ] ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ตัวอย่าง

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้นสามัญของบริษัท AAA
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	100 บาท
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	95 บาท
ราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price)	90 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	30 วัน
มูลค่าที่ตราไว้ (Par)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Offered Price)	991,800.00 บาท (99.18% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	10,500 หุ้น [10,526.3158 หุ้น กรณีไถ่ถอนด้วยเงิน]
อัตราดอกเบี้ย/อัตราผลตอบแทน (Yield)	10.06% ต่อปี

กรณีส่งมอบเป็นหลักทรัพยอ้างอิง และ/หรือเงิน

- (ก) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพยอ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 98 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินให้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง 1,000,000 บาท หรือผู้ลงทุนได้กำไร 10.06% ต่อปี $[(1,000,000 - 991,800) / 991,800] \times 365/30$
- (ข) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพยอ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 92 บาท ภายในวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นสามัญของบริษัท AAA จำนวน 10,500 หุ้น* และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา 2,421.05 บาท $[(1,000,000 / 95) - 10,500] \times 92$ หรือผู้ลงทุนขาดทุน 28.68% ต่อปี $[(92 \times 10,500) + 2,421.05 - 991,800] / 991,800 \times 365/30$
- (ค) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพยอ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 88 บาท ภายในวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นสามัญของบริษัท AAA จำนวน 10,500 หุ้น* และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา 2,368.42 บาท $[(1,000,000 / 95) - 10,500] \times 90$ บาท และชำระเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น 21,000 บาท $[(90 - 88) \times 10,500]$ รวมเป็นมูลค่า 947,368.42 บาท หรือผู้ลงทุนขาดทุน 54.51% ต่อปี $[(947,368.42 - 991,800) / 991,800] \times 365/30$

กรณีส่งมอบเป็นเงิน

- (ก) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพยอ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 98 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินให้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง 1,000,000 บาท หรือผู้ลงทุนได้กำไร 10.06% ต่อปี $[(1,000,000 - 991,800) / 991,800] \times 365/30$
- (ข) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพยอ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 92 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินเท่ากับ 968,421.05 บาท $[1,000,000 - ((95 - 92) \times 10,526.3158)]$ หรือผู้ลงทุนขาดทุน 28.68% ต่อปี $[(968,421.05 - 991,800) / 991,800] \times 365/30$
- (ค) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพยอ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 88 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินให้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง 947,368.42 บาท $[(1,000,000 - ((95 - 90) \times 10,526.3158)]$ หรือผู้ลงทุนขาดทุน 54.51% ต่อปี $[(947,368.42 - 991,800) / 991,800] \times 365/30$

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นหรือตราสารอื่นทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non - listed co. และ unrated : หุ้นที่ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนคำนวณเงิน

Factsheet



ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น

เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Equity Linked Notes (ELN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็น
หลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน [กรณีอ้างอิงกับดัชนีหลักทรัพย์ จะไถ่ถอนเป็นเงินเท่านั้น]
ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน วันที่ [●]

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ ร้อยละ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/	เป็นไปตามลักษณะพิเศษ ผลตอบแทนและความเสี่ยง สำคัญของตราสาร
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/ดัชนี SET[●]/ หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนิน กิจการทั่วไป และป้องกัน ความเสี่ยงตามนโยบายของ บริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ
ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร
ขึ้นอยู่กับราคาและความผัน
ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง
และราคาที่ดินลงไว้ล่วงหน้า
สำหรับการซื้อขาย/อัตรา
ผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน
ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
 ไม่มี

การคุ้มครองเงินต้น ณ
วันครบกำหนด

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)

ตัวอย่าง



หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความ
เสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้
ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตรา
สารอนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยี
สารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการ
จำหน่ายหลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืม
หลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความ
เสี่ยงเพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยง
ของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

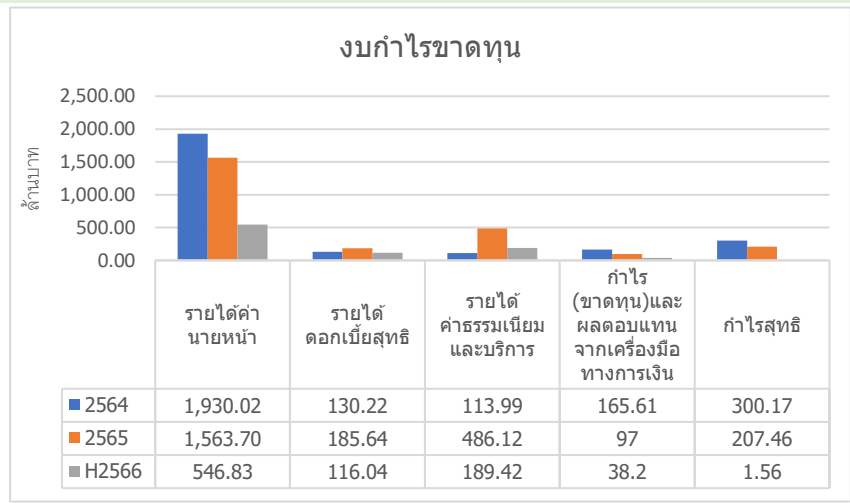
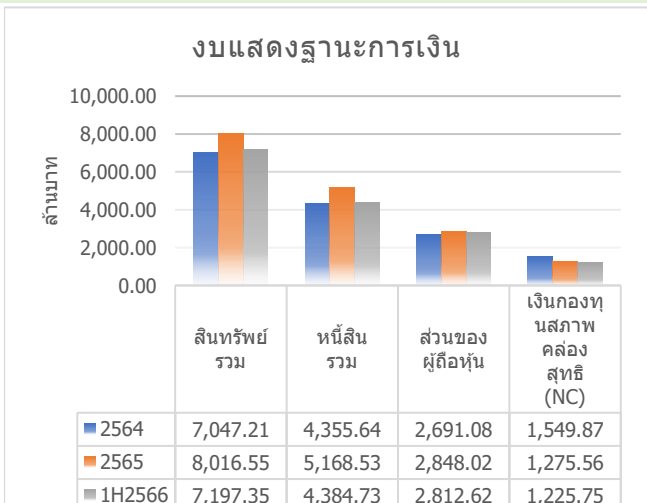
ข้อกำหนดในการดํารงอัตราส่วนทางการเงิน

ไม่มีข้อกำหนดในการดํารงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

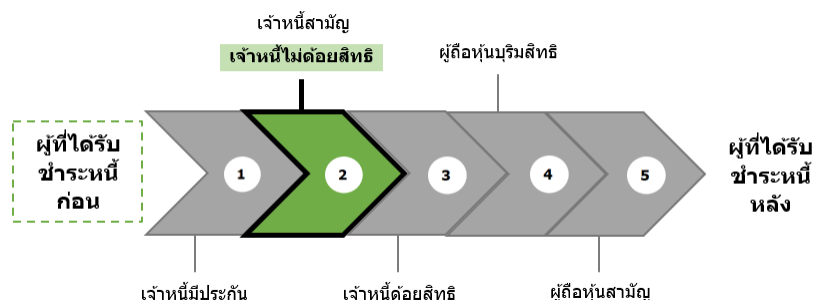
เป็น ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง

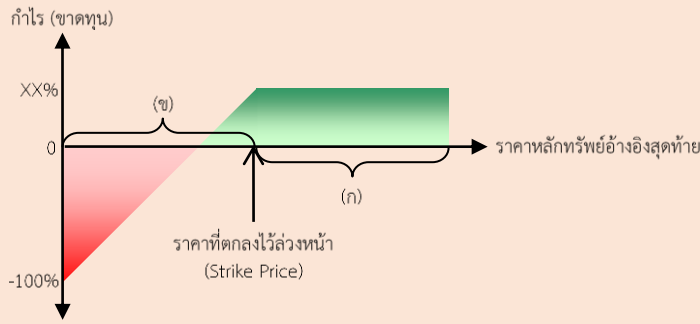


ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร



กรณีไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือเงิน

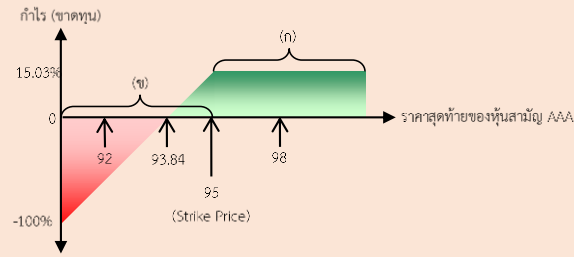
- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยเงินสดส่วนต่างคำนวณจาก มูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หักด้วยราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย หักออกด้วยจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ คูณด้วย ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย

กรณีไถ่ถอนเป็นเงิน

- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ลบออกด้วย [(ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย - ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย) x จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ] ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ตัวอย่าง

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้นสามัญของบริษัท AAA
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	100 บาท
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	95 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	30 วัน
มูลค่าที่ตราไว้ (Par)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Offered Price)	987,800.00 บาท (98.78% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	10,500 หุ้น [10,526.3158 หุ้น กรณีไถ่ถอนด้วยเงิน]
อัตราดอกเบี้ย/อัตราผลตอบแทน (Yield)	15.03% ต่อปี



กรณีส่งมอบเป็นหลักทรัพยอ้างอิง และ/หรือเงิน

- (ก) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพยอ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 98 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินให้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง 1,000,000 บาท หรือผู้ลงทุนได้กำไร 15.03% ต่อปี $[(1,000,000 - 987,800) / 987,800] \times 365/30$
- (ข) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพยอ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 92 บาท ภายในวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นสามัญของบริษัท AAA จำนวน 10,500 หุ้น* และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา 2,421.05 บาท $[(1,000,000 / 95) - 10,500] \times 92$ หรือผู้ลงทุนขาดทุน 23.87% ต่อปี $[(92 \times 10,500) + 2,421.05 - 987,800] / 987,800 \times 365/30$

กรณีส่งมอบเป็นเงิน

- (ก) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพยอ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 98 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินให้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง 1,000,000 บาท หรือผู้ลงทุนได้กำไร 15.03% ต่อปี $[(1,000,000 - 987,800) / 987,800] \times 365/30$
- (ข) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพยอ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 92 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระเงินเท่ากับ ราคาหน้าตัวลบด้วยมูลค่าจากการใช้สิทธิ ซึ่งเท่ากับ 968,421.05 บาท $[1,000,000 - ((95 - 92) \times 10,526.3158)]$ หรือผู้ลงทุนขาดทุน 23.87% ต่อปี $[(968,421.05 - 987,800) / 987,800] \times 365/30$

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นหรือตราสารนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non-listed co. และ unrated : หุ้นไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็นเสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Basket ELN แบบมีการคุ้มครองเงินต้น
ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน
วันที่ [●]

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ ร้อยละ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/ ผลตอบแทน	เป็นไปตามลักษณะพิเศษ และความเสี่ยงสำคัญของตรา สาร
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนิน กิจการทั่วไป และป้องกัน ความเสี่ยงตามนโยบายของ บริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผัน ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตรา ผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ วันครบกำหนด	<input checked="" type="checkbox"/> มี ณ วันครบกำหนดอายุผู้ ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะ ชำระคืนเงินสด อย่างน้อย ร้อยละ [●] ของเงินลงทุน

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)
ตัวอย่าง

หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความ
เสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้
ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสาร
อนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยี
สารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่าย
หลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืม
หลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ง
เพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยง
ของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

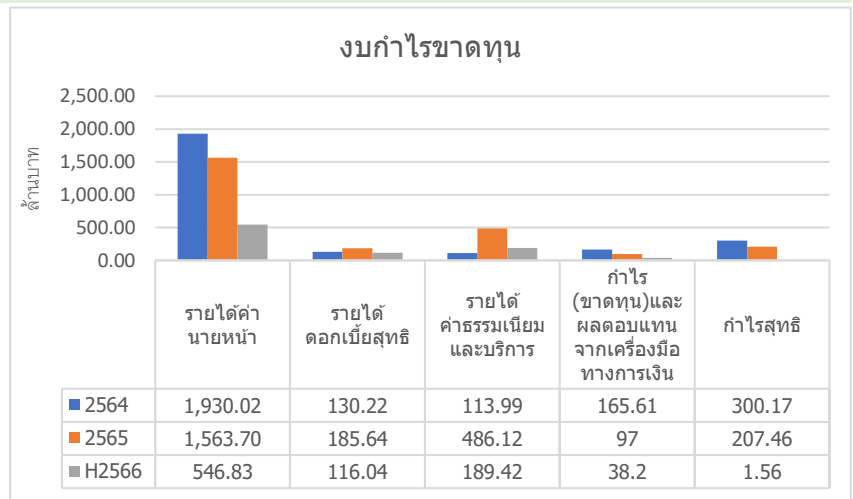
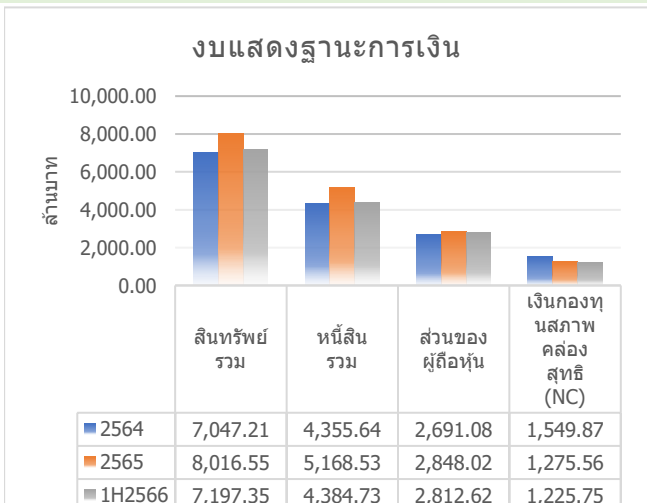
ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

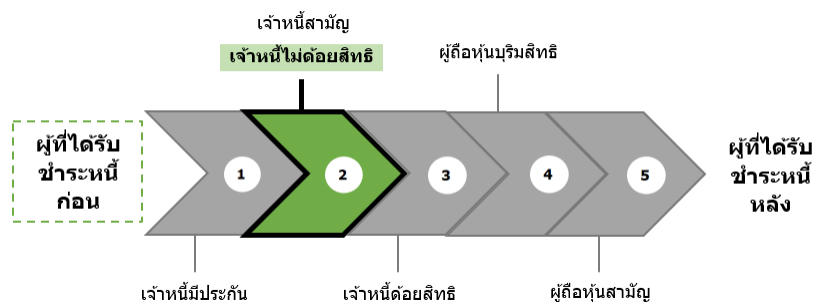
เป็น ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง

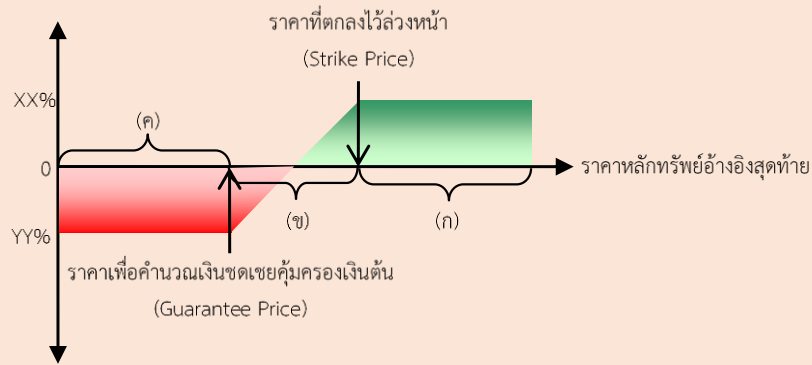


ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

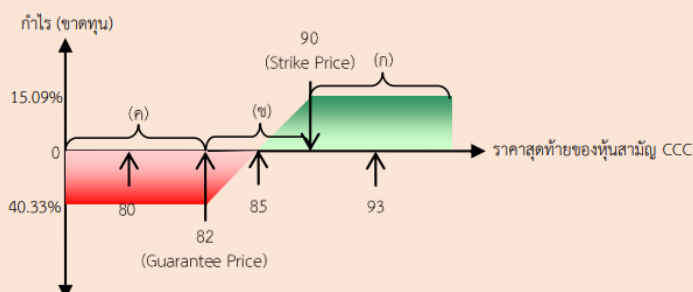


กรณีไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือเงิน

- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SL_T) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SL_T) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL_1) แต่มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นของ Least Performing Security (Guarantee Price: KL_2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least Performing Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยเงินสดส่วนต่างคำนวณจาก มูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หักด้วยราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย หักออกด้วยจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ คูณด้วย ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security
- (ค) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Least Performing Security Price: SL_T) น้อยกว่าราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นของ Least Performing Security (Guarantee Price: KL_2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least Performing Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และจะชำระเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นเงินเท่ากับ [(ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น – ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย) x จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบของ Least Performing Security] ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

“Least Performing Security” หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีอัตราร้อยละที่เปลี่ยนแปลงไปของราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายต่ำที่สุดจากราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย โดยจะคำนวณจาก [(ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ลบด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ) หักด้วยราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ] หากมีหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้ผลการคำนวณเท่ากับสองหลักทรัพย์หรือมากกว่า ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะใช้ดุลยพินิจในการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เป็น Least Performing Security สำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หากหลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้ามีเพียงหนึ่งหลักทรัพย์ ให้ Least Performing Security หมายถึงหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ตัวอย่าง



หลักทรัพย์อ้างอิง	1) หุ้นสามัญของบริษัท AAA, 2) หุ้นสามัญของบริษัท BBB, 3) หุ้นสามัญของบริษัท CCC
ราคารับจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	1) หุ้น AAA : 50 บาท, 2) หุ้น BBB : 77 บาท, 3) หุ้น CCC : 100 บาท
ราคาที่ยกเลิกกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	1) หุ้น AAA : 45 บาท, 2) หุ้น BBB : 70 บาท, 3) หุ้น CCC : 90 บาท
ราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price)	1) หุ้น AAA : 40 บาท, 2) หุ้น BBB : 65 บาท, 3) หุ้น CCC : 82 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	60 วัน
มูลค่าที่ตราไว้ (Par)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มี อนุพันธ์แฝง (Offered Price)	975,800.00 บาท (97.58% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	1) หุ้น AAA : 22,200 หุ้น, 2) หุ้น BBB : 14,200 หุ้น, 3) หุ้น CCC : 11,100 หุ้น
อัตราดอกเบี้ย/อัตราผลตอบแทน (Yield)	15.09% ต่อปี

กำหนดให้หุ้นสามัญ CCC เป็น least performing security

(ก) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ CCC = 93 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง 1,000,000 บาท หรือผู้ลงทุนได้กำไร 15.09% ต่อปี $[(1,000,000 - 975,800) / 975,800 \times 365/60]$

(ข) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ CCC = 85 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นสามัญของบริษัท CCC จำนวน 11,100 หุ้น* และจะชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา 944.44 บาท $[(1,000,000 / 90) - 11,100] \times 85]$ รวมเป็นมูลค่า 944,444.44 บาท หรือผู้ลงทุนขาดทุน 19.55% ต่อปี $[(944,444.44 - 975,800) / 975,800 \times 365/60]$

(ค) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ CCC = 80 บาท ภายในวันครบกำหนดอายุ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นสามัญของบริษัท CCC จำนวน 11,100 หุ้น* และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา 911.11 บาท $[(1,000,000 / 90) - 11,100] \times 82]$ บาท และชำระเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น 22,200 บาท $[(82 - 80) \times 11,100]$ รวมเป็นมูลค่า 911,111.11 บาท หรือผู้ลงทุนขาดทุน 40.33% ต่อปี $[(911,111.11 - 975,800) / 975,800] \times 365/30]$

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น

เสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Basket ELN แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น

ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน

วันที่ [●]

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ ร้อยละ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/ ผลตอบแทน	เป็นไปตามลักษณะพิเศษ และความเสี่ยงสำคัญของตรา สาร
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนิน กิจการทั่วไป และป้องกัน ความเสี่ยงตามนโยบายของ บริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผัน ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่เกิดกลไกรั่วล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตรา ผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ วันครบกำหนด	<input checked="" type="checkbox"/> ไม่มี

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)

ตัวอย่าง



หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความ
เสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้
ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสาร
อนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยี
สารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่าย
หลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืม
หลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยง
เพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยง
ของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

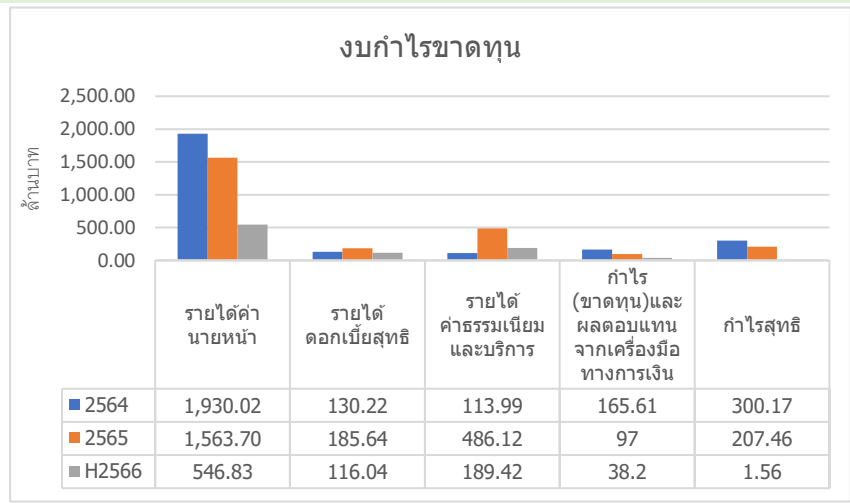
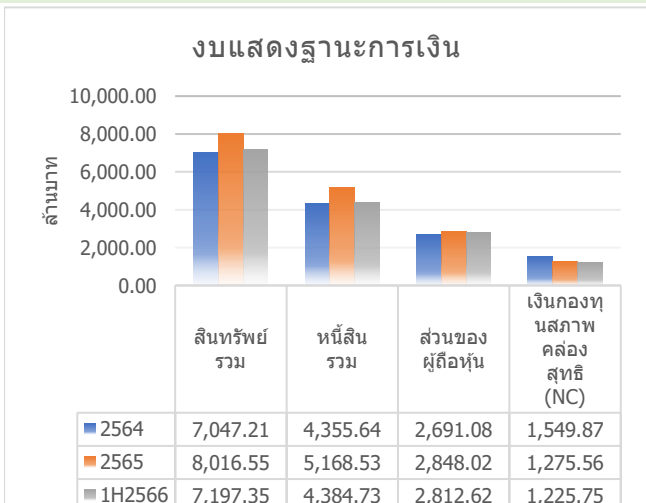
ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

เป็น

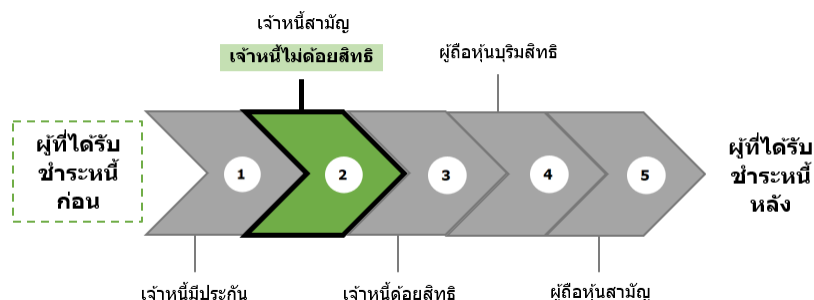
ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง

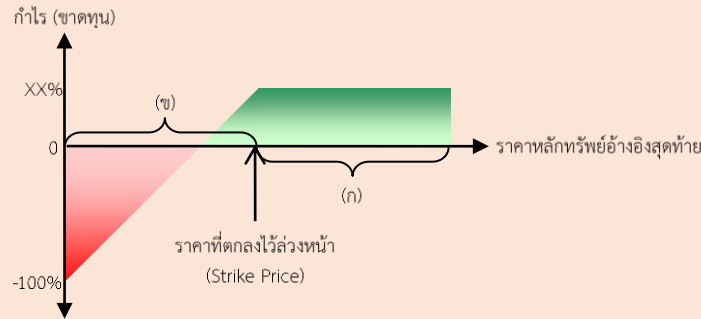


ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

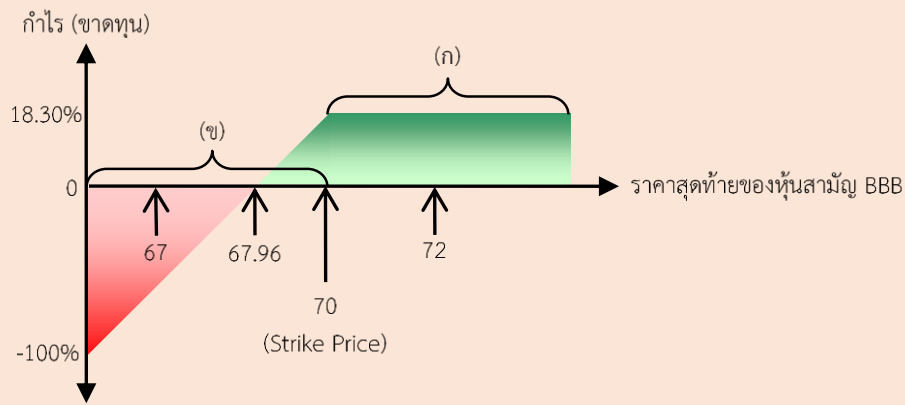


- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SL_T) มากกว่าหรือเท่ากับราคาตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SL_T) น้อยกว่าราคาตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least Performing Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยเงินสดส่วนต่างคำนวณจาก มูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หักด้วยราคาตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย หักออกด้วยจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ คูณด้วย ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ของ Least Performing Security

“Least Performing Security” หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีอัตราร้อยละที่เปลี่ยนแปลงไปของราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายต่ำที่สุดจากราคาตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย โดยจะคำนวณจาก [(ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ลบด้วย ราคาตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ) หักด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ] หากมีหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้ผลการคำนวณเท่ากันสองหลักทรัพย์หรือมากกว่า ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะใช้ดุลยพินิจในการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เป็น Least Performing Security สำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หากหลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้ามีเพียงหนึ่งหลักทรัพย์ ให้ Least Performing Security หมายถึงหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ตัวอย่าง

หลักทรัพย์อ้างอิง	1) หุ้นสามัญของบริษัท AAA 2) หุ้นสามัญของบริษัท BBB 3) หุ้นสามัญของบริษัท CCC
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	1) หุ้น AAA : 50 บาท 2) หุ้น BBB : 77 บาท 3) หุ้น CCC : 100 บาท
ราคาตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	1) หุ้น AAA : 45 บาท 2) หุ้น BBB : 70 บาท 3) หุ้น CCC : 90 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	60 วัน
มูลค่าที่ตราไว้ (Par)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มี อนุพันธ์แฝง (Offered Price)	970,800.00 บาท (97.08% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	1) หุ้น AAA : 22,200 หุ้น 2) หุ้น BBB : 14,200 หุ้น 3) หุ้น CCC : 11,100 หุ้น
อัตราดอกเบี้ย/อัตราผลตอบแทน (Yield)	18.30% ต่อปี



กำหนดให้หุ้นสามัญ BBB เป็น least performing security

- (ก) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ BBB = 72 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง 1,000,000 บาท หรือผู้ลงทุนได้กำไร 18.30% ต่อปี $[(1,000,000 - 970,800) / 970,800 \times 365/60]$
- (ข) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ BBB = 67 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นสามัญของบริษัท BBB จำนวน 14,200 หุ้น* และจะชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา 5,742.86 บาท $[(1,000,000 / 70) - 14,200] \times 67$ รวมเป็นมูลค่า 957,142.86 บาท หรือผู้ลงทุนขาดทุน 8.56% ต่อปี $[(957,142.86 - 970,800) / 970,800 \times 365/60]$

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น

เสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Reverse Equity Linked Note (RELN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้นที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์และ/หรือเงิน ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน วันที่ [●]

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/ผลตอบแทน	เป็นไปตามลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี (เว้นแต่กรณีระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง)
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจุบัน	[●]
ปัจจุบันอ้างอิง	หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนินกิจการทั่วไป และป้องกันความเสี่ยงตามนโยบายของบริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผันผวนของหลักทรัพย์อ้างอิงและราคาที่ดินกลางไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย/อัตราผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุนร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ วันครบกำหนด	<input checked="" type="checkbox"/> ไม่มี

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ) ตัวอย่าง



หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความเสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสารอนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยงเพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยงของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

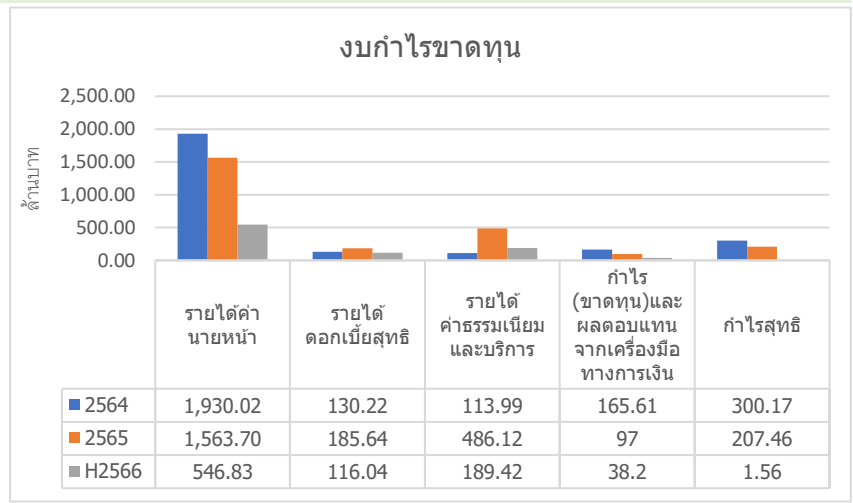
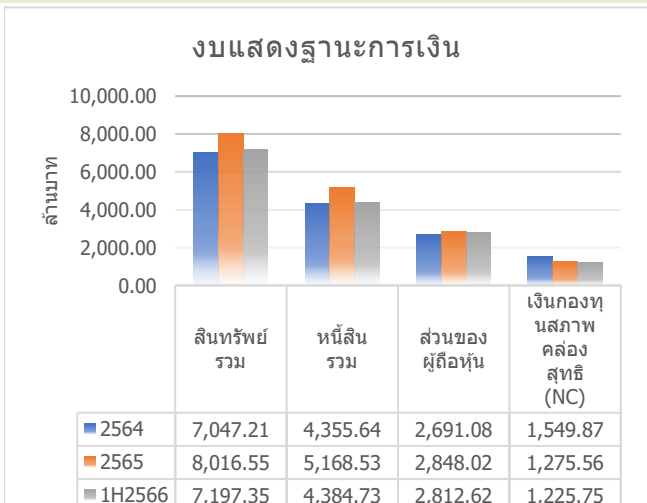
ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

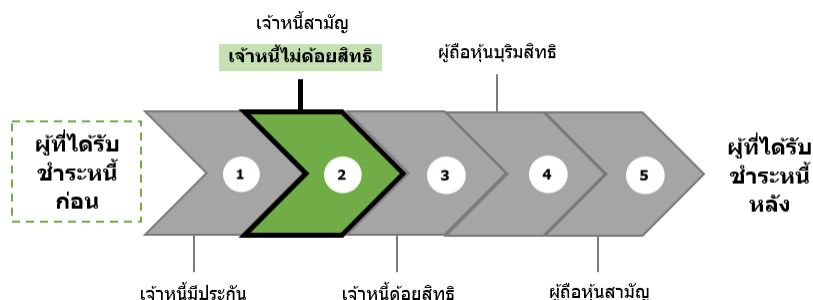
เป็น ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง

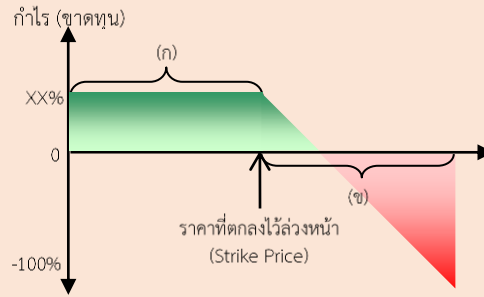


ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



กรณีไถ่ถอนเป็นหลักทรัพยอ้างอิง และ/หรือเงิน



- (ก) หากราคาหลักทรัพยอ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) น้อยกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเป็นหลักทรัพยที่ตกลงจะส่งมอบ และชำระดอกเบี้ย ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพยอ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) มากกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเป็นเงินเท่ากับ [หลักทรัพยที่ตกลงจะส่งมอบ x ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1)] และชำระดอกเบี้ย ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ตัวอย่าง

หลักทรัพยอ้างอิง	หุ้นสามัญของบริษัท ABC
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพยอ้างอิง (Spot Price)	100 บาท
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	105.000 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	90 วัน
มูลค่าหลักทรัพยที่ตราไว้	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Offered Price)	1,000,000 บาท (100% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพยอ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	10,000 หุ้น
อัตราดอกเบี้ย/อัตราผลตอบแทน (Yield)	5.58% ต่อปี

(ก) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ ABC = 98 บาท ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นสามัญ ABC จำนวน 10,000 หุ้น* คืนให้ผู้ลงทุนและชำระผลตอบแทน 13,759.90 บาท ในวันครบกำหนดไถ่ถอน หรือผู้ลงทุนได้กำไร 5.58% ต่อปี $[=13,759.90 / 1,000,000 \times 365/90]$

(ข) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ ABC = 107 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระเงิน 1,050,000 บาท $[=10,000 \times 105]$ และชำระผลตอบแทนเงินสด 13,759.90 บาท $[=(1,000,000 \times 5.58\% \times 90/365)]$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นมูลค่ารวม 1,063,758.90 หรือผู้ลงทุนขาดทุน 2.53% ต่อปี $[=(1,063,758.90 - (10,000 \times 107)) / 1,000,000] \times 365/90]$

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น
 เสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Callable Fixed Coupon Note (FCN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
 ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน
 วันที่ [●]

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/ ผลตอบแทน	งวดที่ 1 วันที่ [●], งวดที่ 2 วันที่ [●] งวดที่ 3 วันที่ [●], งวดที่ 4 วันที่ [●] งวดที่ 5 วันที่ [●], งวดที่ 6 วันที่ [●] งวดที่ 7 วันที่ [●], งวดที่ 8 วันที่ [●] งวดที่ 9 วันที่ [●], งวดที่ 10 วันที่ [●]
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ผู้ออกตราสารสามารถไถ่ถอน ก่อนกำหนดได้ (Callable)
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนิน กิจการทั่วไป และป้องกัน ความเสี่ยงตามนโยบายของ บริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
 เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผัน ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตรา ผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ วันครบกำหนด	<input checked="" type="checkbox"/> ไม่มี

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)
ตัวอย่าง



หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความ
 เสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้
 ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสาร
อนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยี
สารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่าย
หลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืม
หลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยง
 เพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยง
 ของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

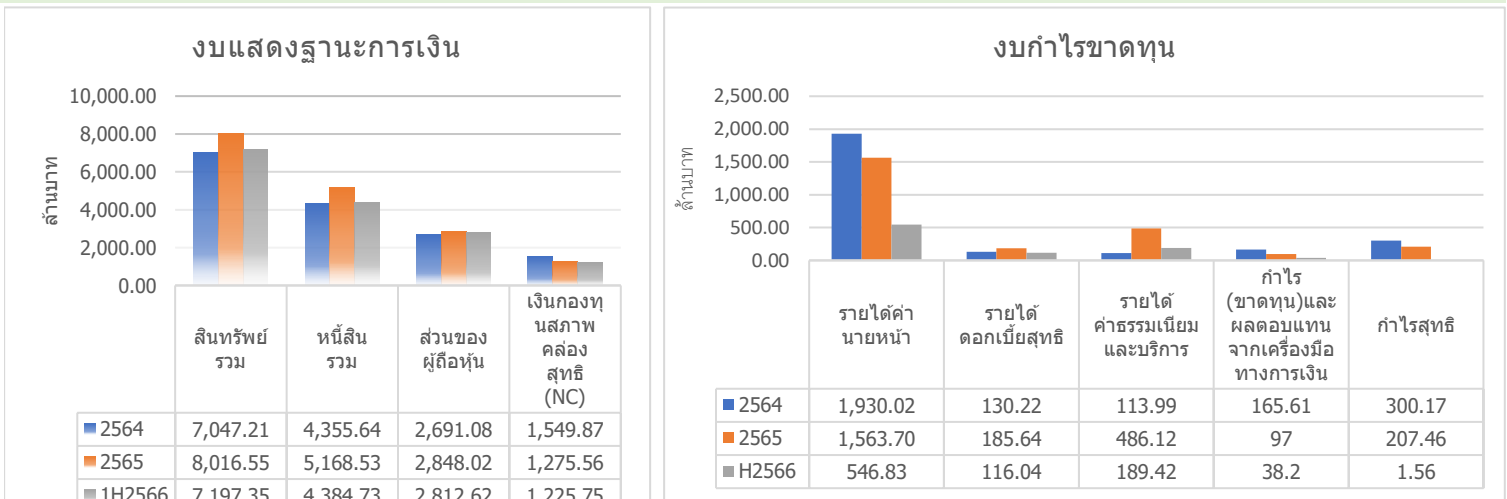
ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

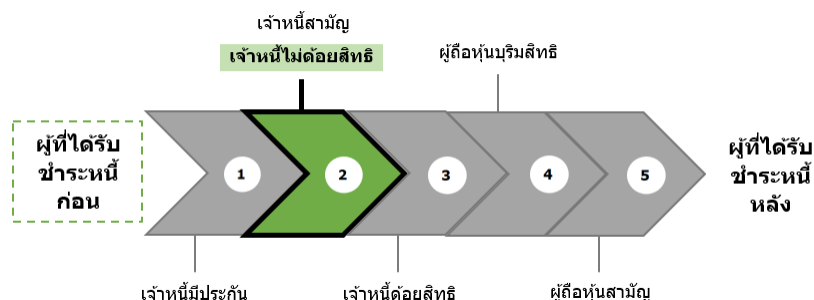
เป็น ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง



ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

กรณีที่ 1: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event Occurs)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการชำระหนี้เพื่อไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดที่ออกภายใต้ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้องให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระเงินค่าไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 (หนึ่งร้อย) ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงถืออยู่ และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่เกิดเหตุแห่งการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดในวันไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

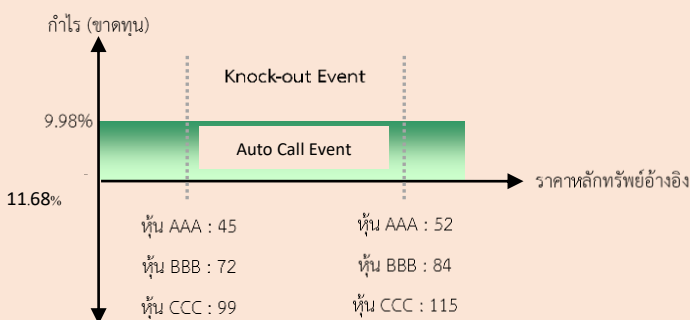
กรณีที่ 2: กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (No Auto Call Event)

(ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SL_T) มากกว่าหรือเท่ากับราคาต่ำสุดล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SL_T) น้อยกว่าราคาต่ำสุดล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least Performing Settlement Security) และชำระเงินส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระด้วยเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

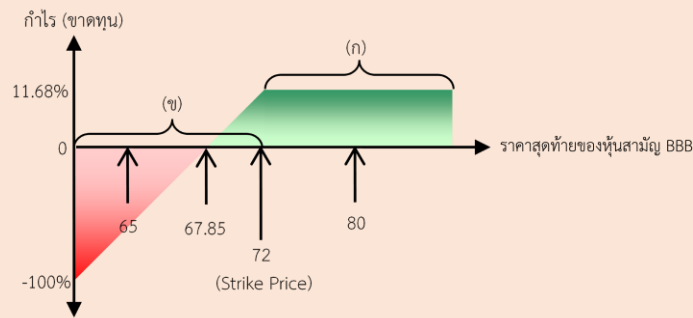
ตัวอย่าง (สมมติให้หุ้น BBB เป็น Least Performing Security)

หลักทรัพย์อ้างอิง	1) หุ้นสามัญของบริษัท AAA, 2) หุ้นสามัญของบริษัท BBB, 3) หุ้นสามัญของบริษัท CCC
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	1) หุ้น AAA : 50 บาท, 2) หุ้น BBB : 80 บาท, 3) หุ้น CCC : 110 บาท
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	1) หุ้น AAA : 45 บาท, 2) หุ้น BBB : 72 บาท, 3) หุ้น CCC : 99 บาท
ราคาเพื่อเตรียมไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Price)	1) หุ้น AAA : 52 บาท, 2) หุ้น BBB : 84 บาท, 3) หุ้น CCC : 115 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	180 วัน
มูลค่าที่ตราไว้ และราคาเสนอขาย (Par, Offered Price)	1,000,000 บาท , 1,000,000 บาท (100% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	1) หุ้น AAA : 22,200 หุ้น, 2) หุ้น BBB : 13,800 หุ้น 3) หุ้น CCC : 10,100 หุ้น
ดอกเบี้ยของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest)	9,600 บาทต่องวด เป็นจำนวน 6 งวด



กรณีที่ 1: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

(ก) ถ้า ณ วันที่เตรียมไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดของงวดดอกเบี้ยงวดที่ 1 ราคาของหุ้น AAA เท่ากับ 54 บาท ราคาหุ้น BBB เท่ากับ 85 บาท และราคาหุ้น CCC เท่ากับ 116 บาท ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินเป็นเงินจำนวน 1,000,000 บาท และชำระเงินค่าดอกเบี้ยสำหรับงวดที่ 1 เป็นจำนวน 9,600 บาท คิดเป็นอัตราผลกำไร 11.68% ต่อปี $[(1,000,000 + 9,600) - 1,000,000] / 1,000,000 \times 365/30$



กรณีที่ 2: กรณีไม่เกิดเหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

(ก) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ BBB = 80 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง 1,000,000 บาท และชำระเงินค่าดอกเบี้ยงวดสุดท้ายเป็นจำนวน 9,600 บาท รวมดอกเบี้ย 6 งวดเป็นเงิน 57,600 บาท หรือผู้ลงทุนได้กำไร 11.68% ต่อปี $[= ((1,000,000 + 57,600 - 1,000,000) / 1,000,000 \times 365/180)]$

(ข) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ BBB = 65 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นสามัญของบริษัท BBB จำนวน 13,800 หุ้น* และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา 5,777.78 บาท $[= ((1,000,000/72) - 13,800) \times 65]$ และชำระเงินค่าดอกเบี้ยงวดสุดท้ายเป็นจำนวน 9,600 บาท รวมดอกเบี้ย 6 งวดเป็นเงิน 57,600 บาท หรือผู้ลงทุนขาดทุน 8.03% ต่อปี $[= ((13,800 \times 65) + 5,777.78 + 57,600 - 1,000,000) / 1,000,000 \times 365/180]$

“Least Performing Security” หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีอัตราผลตอบแทนที่เปลี่ยนแปลงไปของราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายต่ำที่สุดจากราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย โดยจะคำนวณจาก [(ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ลบด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ)หารด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ] หากมีหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้ผลการคำนวณเท่ากันสองหลักทรัพย์หรือมากกว่า ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะใช้ดุลยพินิจในการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เป็น Least Performing Security สำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หากหลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้ามีเพียงหนึ่งหลักทรัพย์ ให้ Least Performing Security หมายถึงหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

“เหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event)” หมายถึง กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิงทุกหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันที่กำหนดเหตุการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Auto Call Price: KP) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็นเสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Callable Fixed Coupon Note (FCN) แบบมีการคุ้มครองเงินต้น
ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน
วันที่ [●]

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/ พิเศษ ผลตอบแทน	งวดที่ 1 วันที่ [●], งวดที่ 2 วันที่ [●] งวดที่ 3 วันที่ [●], งวดที่ 4 วันที่ [●] งวดที่ 5 วันที่ [●], งวดที่ 6 วันที่ [●] งวดที่ 7 วันที่ [●], งวดที่ 8 วันที่ [●] งวดที่ 9 วันที่ [●], งวดที่ 10 วันที่ [●]
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ผู้ออกตราสารสามารถไถ่ถอน ก่อนกำหนดได้ (Callable)
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนิน กิจการทั่วไป และป้องกัน ความเสี่ยงตามนโยบายของ บริษัท

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)

ตัวอย่าง



หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความเสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสารอนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยงเพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยงของบริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผัน ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตรา ผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ วันครบกำหนด	<input checked="" type="checkbox"/> มี ณ วันครบกำหนดอายุผู้ ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะ ชำระคืนเงินสด อย่างน้อย ร้อยละ [●] ของเงินลงทุน

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

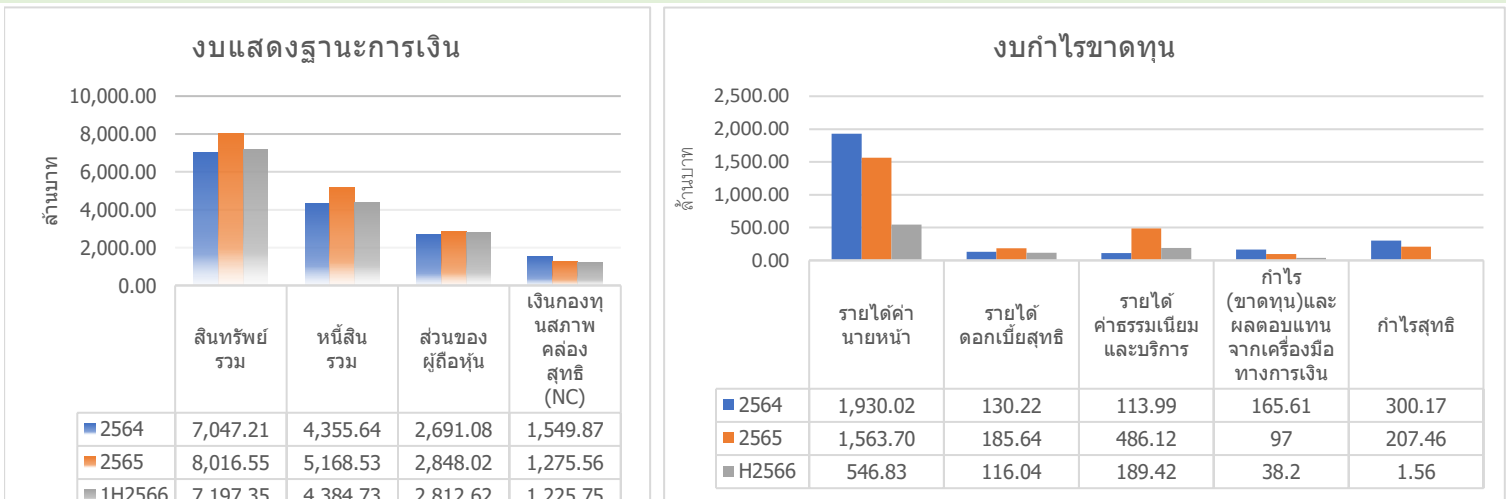
ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

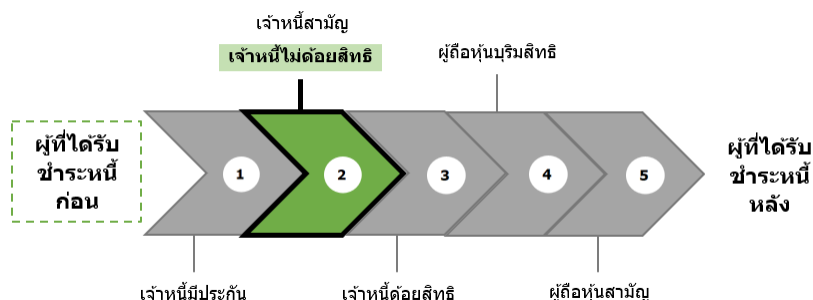
เป็น ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง



ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

กรณีที่ 1: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event Occurs)

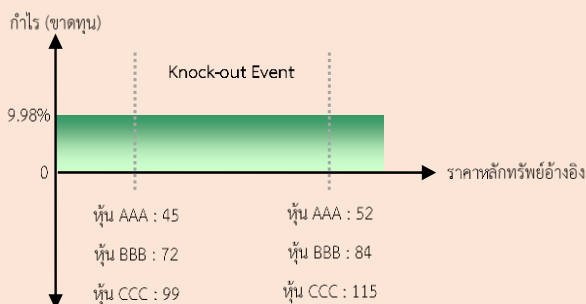
ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการชำระหนี้เพื่อไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดที่ออกภายใต้ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้องให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระเงินค่าไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 (หนึ่งร้อย) ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงถืออยู่และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

กรณีที่ 2: กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (No Auto Call Event)

- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SL_T) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL_1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SL_T) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL_1) แต่มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นของ Least Performing Security (Guarantee Price : KL_2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least Performing Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระด้วยเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ค) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SL_T) น้อยกว่าราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นของ Least Performing Security (Guarantee Price: KL_2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least Performing Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระด้วยเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และจะชำระเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นเงินเท่ากับ [(ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นของ Least Performing Security – ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security) x จำนวนหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ] ในวันเดียวกัน

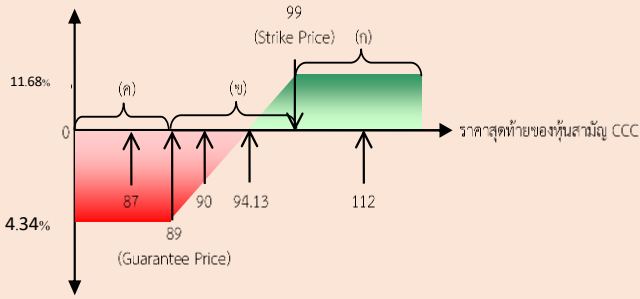
ตัวอย่าง สมมติให้หุ้น CCC เป็น Least Performing Security

หลักทรัพย์อ้างอิง	1) หุ้นสามัญของบริษัท AAA, 2) หุ้นสามัญของบริษัท BBB 3) หุ้นสามัญของบริษัท CCC
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	1) หุ้น AAA : 50 บาท, 2) หุ้น BBB : 80 บาท, 3) หุ้น CCC : 110 บาท
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	1) หุ้น AAA : 45 บาท, 2) หุ้น BBB : 72 บาท, 3) หุ้น CCC : 99 บาท
ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Price)	1) หุ้น AAA : 52 บาท, 2) หุ้น BBB : 84 บาท, 3) หุ้น CCC : 115 บาท
ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price)	1) หุ้น AAA : 42 บาท, 2) หุ้น BBB : 68 บาท, 3) หุ้น CCC : 89 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	180 วัน
มูลค่าที่ตราไว้ (Par) เท่ากับราคาเสนอขาย (Offered Price)	1,000,000 บาท, 1,000,000 บาท (100% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	1) หุ้น AAA : 22,200 หุ้น, 2) หุ้น BBB : 13,800 หุ้น 3) หุ้น CCC : 10,100 หุ้น
ดอกเบี้ยของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest)	9,600 บาทต่องวด เป็นจำนวน 6 งวด



กรณีที่ 1: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

(ก) ถ้า ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดของงวดดอกเบี้ยงวดที่ 1 ราคาของหุ้น AAA เท่ากับ 54 บาท ราคาหุ้น BBB เท่ากับ 85 บาท และราคาหุ้น CCC เท่ากับ 116 บาท ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระเป็นเงินจำนวน 1,000,000 บาท และชำระเงินค่าดอกเบี้ยสำหรับงวดที่ 1 เป็นจำนวน 9,600 บาท คิดเป็นอัตราผลกำไร 11.68% ต่อปี $[= (1,000,000 + 9,600) - 1,000,000] / 1,000,000 \times 365/30]$



(ข) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ CCC = 92 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นสามัญของบริษัท CCC จำนวน 10,100 หุ้น* และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา 92.93 บาท $[= ((1,000,000/99) - 10,100) \times 92]$ พร้อมทั้งชำระเงินสดดอกเบี้ยงวดสุดท้ายเป็นจำนวน 9,600 บาท รวมดอกเบี้ย 6 งวดเป็นเงิน 57,600 บาท หรือผู้ลงทุนขาดทุน 2.66% ต่อปี $[=(57,600 + 92.93 + (10,100 * 92) - 1,000,000)/1,000,000 \times 365/180]$

กรณีที่ 2: กรณีไม่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

(ก) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ CCC = 112 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง 1,000,000 บาท และชำระเงินสดดอกเบี้ยงวดสุดท้ายเป็นจำนวน 9,600 บาท รวมดอกเบี้ย 6 งวดเป็นเงิน 57,600 บาท หรือผู้ลงทุนได้กำไร 11.68% ต่อปี $[=(1,000,000 + 57,600 - 1,000,000) / 1,000,000 \times 365/180]$

(ค) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ CCC = 87 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นสามัญของบริษัท CCC จำนวน 10,100 หุ้น* และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา 87.88 บาท $[= ((1,000,000/99) - 10,100) \times 87]$ และเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น 20,200 บาท $[= (89 - 87) \times 10,100]$ พร้อมทั้งชำระเงินสดดอกเบี้ยงวดสุดท้ายเป็นจำนวน 9,600 บาท รวมดอกเบี้ย 6 งวดเป็นเงิน 57,600 บาท หรือผู้ลงทุนขาดทุน 8.80% ต่อปี $[= (((57,600 + 87.88 + (10,100 * 87) + 20,200) / 1,000,000) - 1) \times 365/180]$

“Least Performing Security” หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีอัตราร้อยละที่เปลี่ยนแปลงไปของราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายต่ำที่สุดจากราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย โดยจะคำนวณจาก [(ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ลบด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ)หารด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ] หากมีหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้ผลการคำนวณเท่ากันสองหลักทรัพย์หรือมากกว่า ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะใช้ดุลยพินิจในการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เป็น Least Performing Security สำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หากหลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้ามีเพียงหนึ่งหลักทรัพย์ ให้ Least Performing Security หมายถึงหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

“เหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event)” หมายถึง กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิงทุกหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Auto Call Price: KP) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น

เสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Accumulator แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น

ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน

วันที่ [●]

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	<input type="checkbox"/> ไม่มี <input type="checkbox"/> คงที่ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/ ผลตอบแทน	<input type="checkbox"/> ไม่มี <input type="checkbox"/> เป็นไปตามลักษณะ และความเสี่ยงสำคัญของตรา สาร
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ผู้ออกตราสารสามารถไถ่ถอน ก่อนกำหนดได้ (Callable)
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนิน กิจการทั่วไป และป้องกัน ความเสี่ยงตามนโยบายของ บริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้ (มหาชน)	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด
ที่มีอนุพันธ์แฝง	
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผัน ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตรา ผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ	<input checked="" type="checkbox"/> ไม่มี

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)

ตัวอย่าง



หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความ
เสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้
ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสาร
อนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยี
สารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่าย
หลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืม
หลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยง
เพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยง
ของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

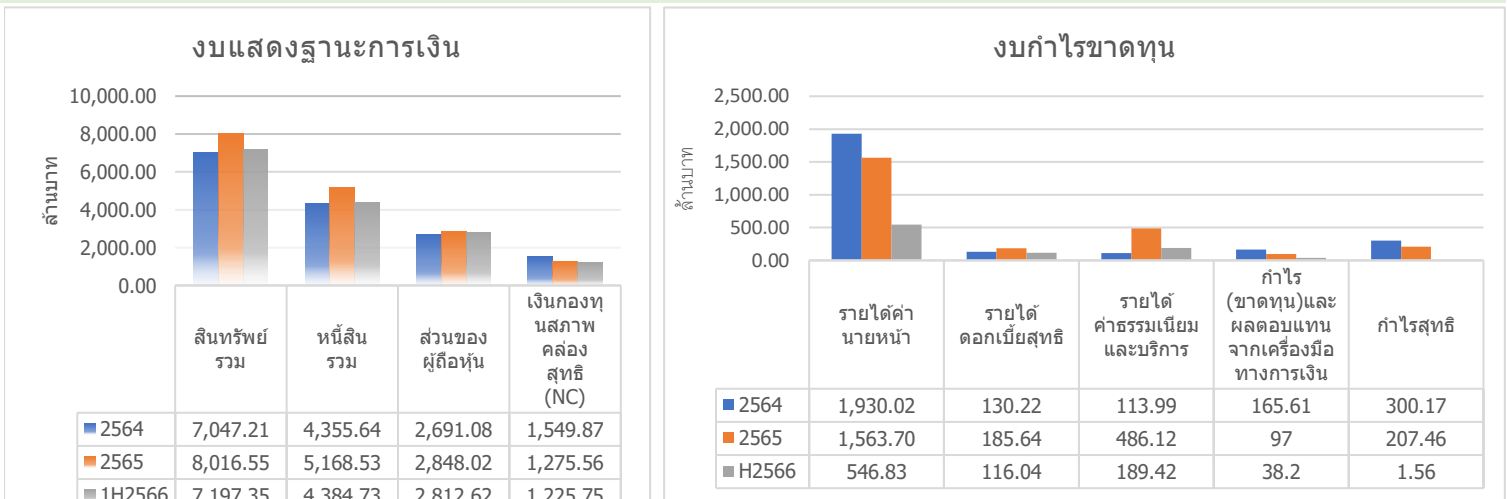
ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

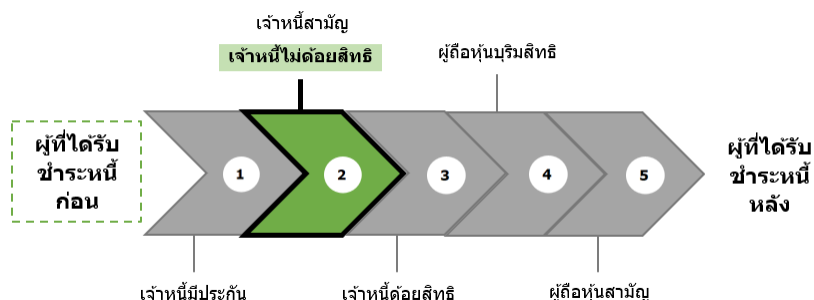
เป็น ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง

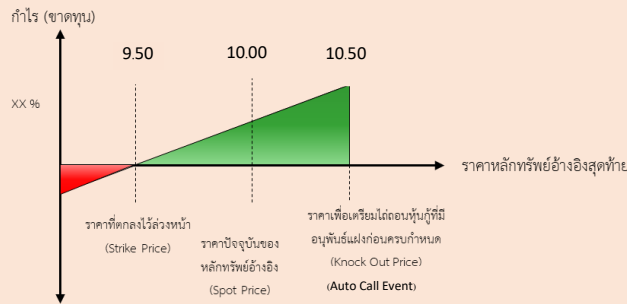


ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร



กรณีที่ 1: กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Trigger/Auto Call Event)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทยอยชำระหนี้เพื่อไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ เป็นจำนวนเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบในแต่ละวัน คุณด้วย จำนวนวันในแต่ละรอบชำระราคา โดยหากจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต้องส่งมอบให้แก่ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง มีหน่วยย่อย (Odd Lot) ของ 1 (หนึ่ง) หน่วยการซื้อขายที่กำหนดโดยตลาดหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะตัดจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) ดังกล่าวนั้นออก และจะชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง แทนการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงที่เป็นหน่วยย่อยนั้น

กรณีที่ 2: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trigger/Auto Call Event Occurs)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด โดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นจำนวนเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบในแต่ละวัน คุณด้วย จำนวนวันตั้งแต่วันเริ่มต้นของรอบชำระราคานั้น จนถึง (แต่ไม่นับรวม) วันที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด และชำระเงินสดส่วนต่าง (ถ้ามี) และชำระเงินเป็นจำนวน เท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย คุณด้วย จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบในแต่ละวัน คุณด้วย จำนวนวัน ตั้งแต่ (และรวมถึง) วันที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดจนถึง (และรวมถึง) วันกำหนดค่าหลักทรัพย์

“เหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trigger Event)” หมายถึง กรณีที่ [ราคา ปิด/ราคาต่ำสุด] ของหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Trigger Event Observation Date(s)) น้อยกว่าหรือ เท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ตัวอย่าง

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้นสามัญของบริษัท ACC
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	10.00 บาท
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	9.50 บาท
ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Price)	10.50 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	122 วัน
มูลค่าที่ตราไว้ (Par)	1,159,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (offered amount)	1,159,000 บาท (100% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	1,000 หุ้น ต่อวัน

รอบการชำระราคา

รอบที่	วันเริ่มต้น	วันสิ้นสุด	จำนวนวันทำการ
1	1 มกราคม 2564	31 มกราคม 2564	21
2	1 กุมภาพันธ์ 2564	28 กุมภาพันธ์ 2564	20
3	1 มีนาคม 2564	31 มีนาคม 2564	21
4	1 เมษายน 2564	30 เมษายน 2564	18
5	1 พฤษภาคม 2564	31 พฤษภาคม 2564	21
6	1 มิถุนายน 2564	30 มิถุนายน 2564	21

(ก) ถ้าราคาปิดของหุ้น ACC น้อยกว่า 10.50 บาททุกวัน ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2564 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2564 ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทยอยชำระหนี้เพื่อการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในเวลา 2 วันทำการ นับจากวันสิ้นสุดแต่ละรอบ โดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง ดังนี้

- 1) หุ้น ACC จำนวน 21,000 หุ้น* [=1,000 x 21]
- 2) หุ้น ACC จำนวน 20,000 หุ้น* [=1,000 x 20]
- 3) หุ้น ACC จำนวน 21,000 หุ้น* [=1,000 x 21]
- 4) หุ้น ACC จำนวน 18,000 หุ้น* [=1,000 x 18]
- 5) หุ้น ACC จำนวน 21,000 หุ้น* [=1,000 x 21]
- 6) หุ้น ACC จำนวน 21,000 หุ้น* [=1,000 x 21]

สมมติให้ราคาปิดของแต่ละวันเท่ากับ 10.20 บาท จะได้ผลตอบแทนรวม 7.37%

กำไรจากส่วนต่างราคา/Par [=(((122,000*10.20)-1,159,000)/ 1,159,000)*100]

(ข) ถ้าราคาปิดของหุ้น ACC มากกว่าหรือเท่ากับ 10.50 บาท ในวันที่ 13 มีนาคม 2564 ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทยอยชำระหนี้เพื่อการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในเวลา 2 วันทำการ นับจากวันสิ้นสุดแต่ละรอบ โดยการส่งมอบหุ้นอ้างอิงและชำระหนี้ค่าไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนี้

- 1) หุ้น ACC จำนวน 21,000 หุ้น* [=1,000 x 21]
- 2) หุ้น ACC จำนวน 20,000 หุ้น* [=1,000 x 20]
- 3) หุ้น ACC จำนวน 7,000 หุ้น* [=1,000 x 7] และชำระเงินสดเท่ากับ 703,000 บาท [1,000 x 74 x 9.50] ภายใน 2 วันทำการนับจากวันที่ 13 มีนาคม 2564

สมมติให้ราคาปิดของแต่ละวันเท่ากับ 10.20 บาท จะได้ผลตอบแทนรวม 2.89%

(กำไรจากส่วนต่างราคา + เงินสดชำระคืน)/Par

[=(((489,600+703,000) / 1,159,000)-1)*100]

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ต. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยพฤตินัยย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น
เสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Decumulator แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน
วันที่ [●]

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	<input type="checkbox"/> ไม่มี <input type="checkbox"/> คงที่ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/ ลักษณะพิเศษ ผลตอบแทน	<input type="checkbox"/> ไม่มี <input type="checkbox"/> เป็นไปตาม และความเสี่ยงสำคัญของตรา สาร
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ผู้ออกตราสารสามารถไถ่ถอน ก่อนกำหนดได้ (Callable)
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนิน กิจการทั่วไป และป้องกัน ความเสี่ยงตามนโยบายของ บริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้ (มหาชน)	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด
ที่มีอนุพันธ์แฝง	
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผัน ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตรา ผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ	<input checked="" type="checkbox"/> ไม่มี

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)
ตัวอย่าง



หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความ
เสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้
ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสาร
อนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยี
สารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่าย
หลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืม
หลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยง
เพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยง
ของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

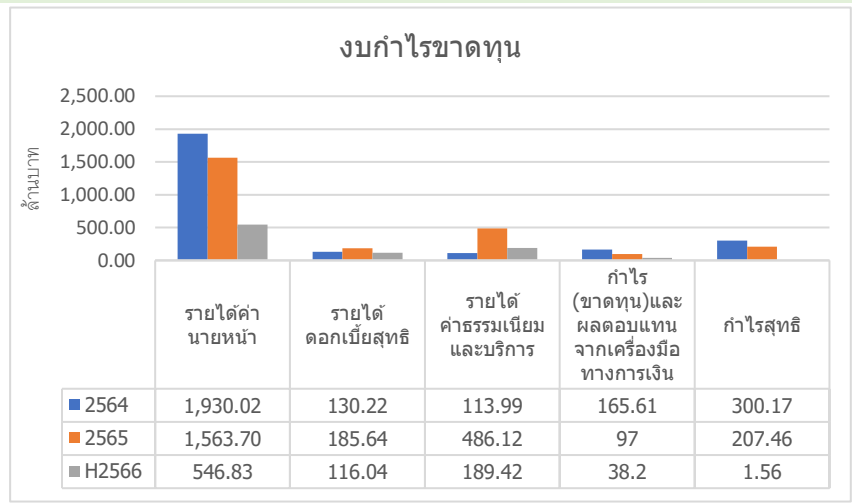
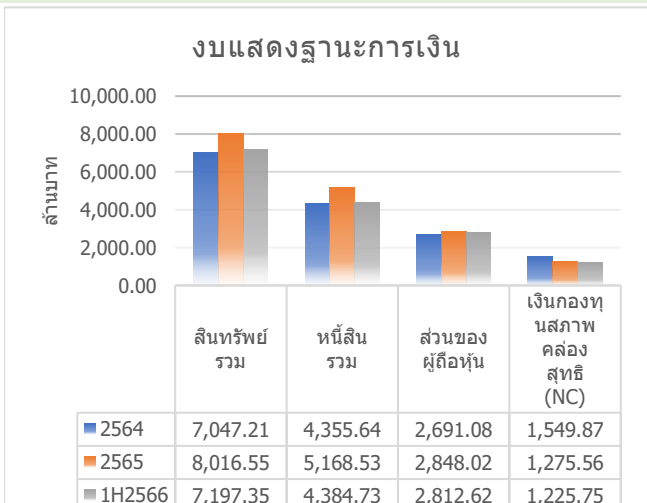
ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

เป็น

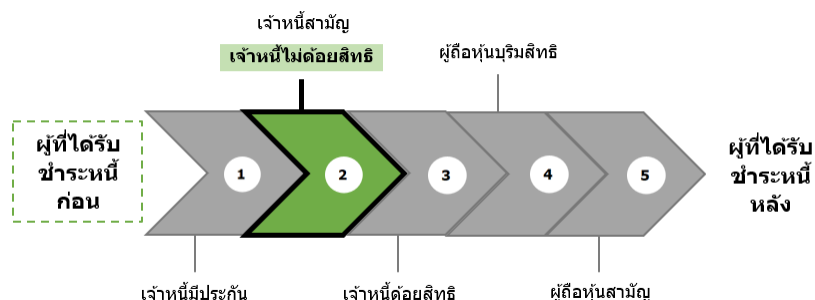
ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง

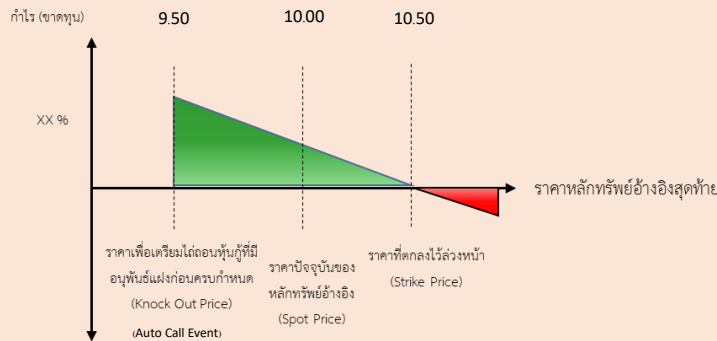


ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร



กรณีที่ 1: กรณีที่ไม่เกิดเหตุการณ์เปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Trigger/Auto Call Event)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทยอยชำระหนี้เพื่อการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระเงินค่าราคาไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันที่ตกลงจะชำระมูลค่าหลักทรัพย์ เป็นจำนวนเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะจำหน่ายในแต่ละวัน คุณด้วยจำนวนวันในแต่ละรอบชำระราคา คุณด้วย ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย หลังหักค่าใช้จ่ายในการส่งมอบหลักทรัพย์ (ถ้ามี)

กรณีที่ 2: กรณีที่เกิดเหตุการณ์เปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trigger/Auto Call Event Occurs)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด โดยการชำระเงินค่าราคาไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นจำนวนเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะจำหน่ายในแต่ละวัน คุณด้วย จำนวนวันตั้งแต่ (และรวมถึง) วันเริ่มต้นของรอบชำระราคา นั้น จนถึง (แต่ไม่นับรวม) วันที่เกิดเหตุการณ์ไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด คุณด้วย ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย และส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นจำนวนเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะจำหน่ายในแต่ละวัน คุณด้วย จำนวนวันตั้งแต่ (และรวมถึง) วันที่เกิดเหตุการณ์ไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด จนถึง (และรวมถึง) วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และชำระเงินสดส่วนต่าง (ถ้ามี)

“เหตุการณ์เปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trigger Event)” หมายถึง กรณีที่ [ราคาปิด/ราคาต่ำสุด] ของหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Trigger Event Observation Date(s)) น้อยกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ตัวอย่าง

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้นสามัญของบริษัท DEC
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	10.00 บาท
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	10.50 บาท
ราคาเพื่อเตรียมไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Price)	9.50 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	122 วัน
มูลค่าหลักทรัพย์ที่ตราไว้	1,281,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Offered Price)	1,281,000บาท (100% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	1,000 หุ้น ต่อวัน

รอบการชำระราคา

รอบที่	วันเริ่มต้น	วันสิ้นสุด	จำนวนวันทำการ
1	1 มกราคม 2564	31 มกราคม 2564	21
2	1 กุมภาพันธ์ 2564	28 กุมภาพันธ์ 2564	20
3	1 มีนาคม 2564	31 มีนาคม 2564	21
4	1 เมษายน 2564	30 เมษายน 2564	18
5	1 พฤษภาคม 2564	31 พฤษภาคม 2564	21
6	1 มิถุนายน 2564	30 มิถุนายน 2564	21

(ก) ถ้าราคาปิดของหุ้น DEC มากกว่า 9.50 บาททุกวัน ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2564 ถึงวันที่ 30 มิถุนายน 2564 ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะทยอยชำระหนี้เพื่อการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในเวลา 2 วันทำการ นับจากวันสิ้นสุดแต่ละรอบ โดยการชำระเงินค่าไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนี้

- 1) 220,500 บาท [=1,000 x 21 x 10.50]
- 2) 210,000 บาท [=1,000 x 20 x 10.50]
- 3) 220,500 บาท [=1,000 x 21 x 10.50]
- 4) 189,000 บาท [=1,000 x 18 x 10.50]
- 5) 220,500 บาท [=1,000 x 21 x 10.50]
- 6) 220,500 บาท [=1,000 x 21 x 10.50]

สมมติให้ราคาปิดเฉลี่ยของแต่ละวันเท่ากับ 10.20 บาท จะได้ผลตอบแทนรวมขาดทุน 2.86%

กำไรจากส่วนต่างราคา x จำนวนหุ้นที่ต้องส่งมอบทั้งหมด / Par [=(((10.50-10.20)*122,000)/ 1,281,000)*100]

(ข) ถ้าราคาปิดของหุ้น DEC น้อยกว่าหรือเท่ากับ 9.50 บาท ในวันที่ 13 มีนาคม 2564 ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะทยอยชำระหนี้เพื่อการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในเวลา 2 วันทำการ นับจากวันสิ้นสุดแต่ละรอบ โดยการชำระเงินค่าไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและส่งมอบหลักทรัพย์ ดังนี้

- 1) 220,500 บาท [=1,000 x 21 x 10.50]
- 2) 210,000 บาท [=1,000 x 20 x 10.50]
- 3) 73,500 บาท [=1,000 x 7 x 10.50] และส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นจำนวนเท่ากับ 74,000 หุ้น* [1,000 x 74] ภายใน 2 วันทำการนับจากวันที่ 13 มีนาคม 2564

สมมติให้ราคาปิดของแต่ละวันเท่ากับ 10.20 บาท จะได้ผลตอบแทนรวม 1.12%

กำไรจากส่วนต่างราคา x จำนวนหุ้นที่ส่งมอบไปแล้ว / Par [=(((10.50-10.20)*48,000)/ 1,281,000)*100]

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น

เสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Basket Knock-In Knock-Out Fixed Coupon Note (Basket KIKO FCN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน (กรณีไม่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอน)

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	<input type="checkbox"/> ไม่มี <input type="checkbox"/> คงที่ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/พิเศษ ผลตอบแทน	งวดที่ 1 วันที่ [●], งวดที่ 2 วันที่ [●] งวดที่ 3 วันที่ [●], งวดที่ 4 วันที่ [●] งวดที่ 5 วันที่ [●], งวดที่ 6 วันที่ [●] งวดที่ 7 วันที่ [●], งวดที่ 8 วันที่ [●] งวดที่ 9 วันที่ [●], งวดที่ 10 วันที่ [●]
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ผู้ออกตราสารสามารถไถ่ถอนก่อนกำหนดได้ (Callable)
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนินกิจการทั่วไป และป้องกันความเสี่ยงตามนโยบายของบริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผันผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตราผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ วันครบกำหนด	<input checked="" type="checkbox"/> ไม่มี

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)
ตัวอย่าง

หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความเสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสารอนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยงเพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยงของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

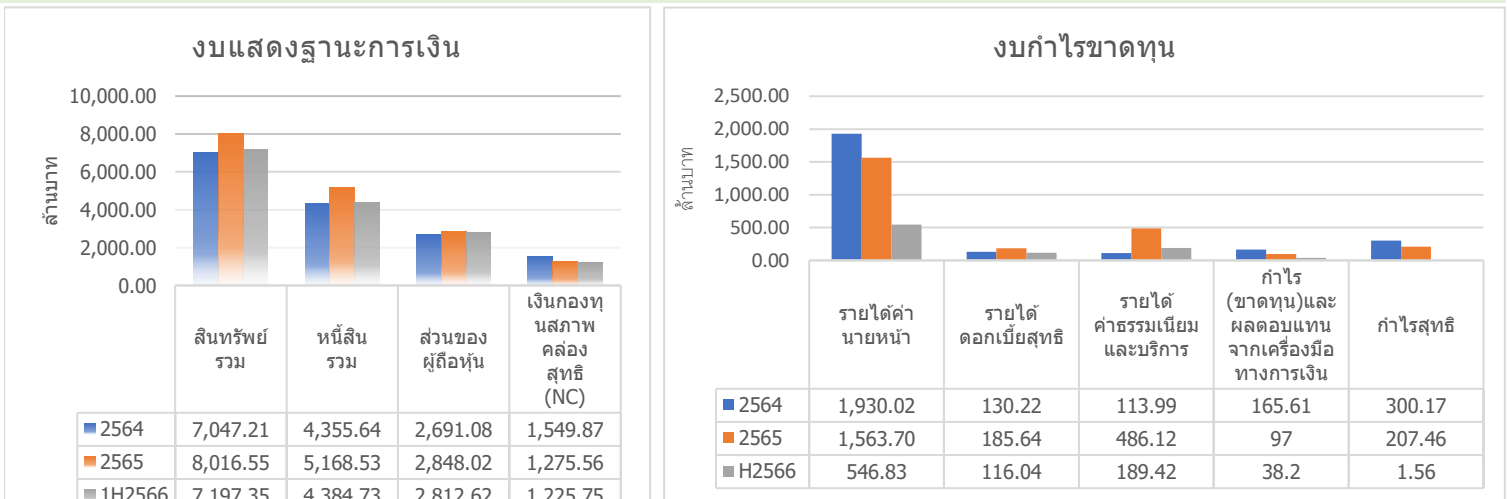
ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

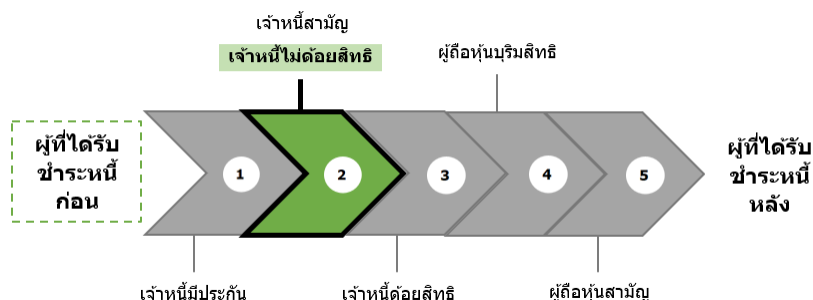
เป็น ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง



ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

กรณีที่ 1: เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event Occurs)

หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิงทุกหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอน (Knock-Out Price) ในวันที่เป็นวันสังเกตการณ์ (Observation date) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเท่ากับ ร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

กรณีที่ 2: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out และไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-In

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเท่ากับ ร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง พร้อมผลตอบแทน ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

กรณีที่ 3: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out และเกิดเหตุการณ์ Knock-In

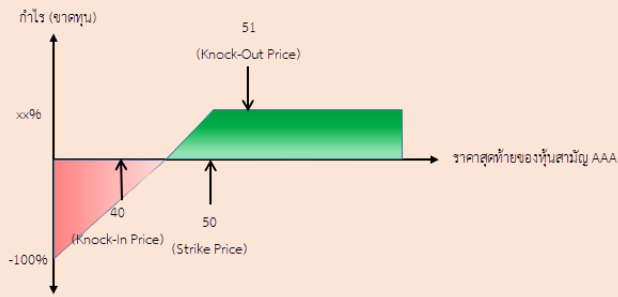
กรณีที่ราคาปิดของหลักทรัพย์ตัวใดตัวหนึ่งในตะกร้า ณ วันกำหนดเหตุการณ์ Knock-In ต่ำกว่าราคา Knock-In ของหลักทรัพย์ตัวนั้น จะถือว่าเกิดเหตุการณ์ Knock-In เกิดขึ้น จะต้องพิจารณาว่าหลักทรัพย์ตัวใดมี Performance น้อยสุด ณ วันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ (Fixing Date) จึงจะถือเป็น Least Performing Underlying

(ก) กรณีราคาอ้างอิงของ Least Performing Underlying ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ สูงกว่าหรือเท่ากับ ราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระมูลค่ารวมและดอกเบี้ยงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ข) กรณีราคาอ้างอิงของ Least Performing Underlying ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ต่ำกว่า ราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระด้วยเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) และชำระเงินค่าผลตอบแทนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ตัวอย่าง สมมติให้หลักทรัพย์ AAA เป็น Least Performing Security

หลักทรัพย์อ้างอิง	1) หุ้นสามัญของบริษัท AAA, 2) หุ้นสามัญของบริษัท BBB 3) หุ้นสามัญของบริษัท CCC
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	1) หุ้น AAA : 50 บาท, 2) หุ้น BBB : 100 บาท, 3) หุ้น CCC : 200 บาท
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	1) หุ้น AAA : 50 บาท, 2) หุ้น BBB : 100 บาท, 3) หุ้น CCC : 200 บาท (100% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์)
ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอน (Knock-Out Price)	1) หุ้น AAA : 51 บาท, 2) หุ้น BBB : 102 บาท, 3) หุ้น CCC : 160 บาท (102% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์)
ราคาเพื่อกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Price)	1) หุ้น AAA : 40 บาท, 2) หุ้น BBB : 80 บาท, 3) หุ้น CCC : 84 บาท (80% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์)
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	6 เดือน (184 วัน)
มูลค่าที่ตราไว้ (Par)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Offered Price)	1,000,000 บาท (100% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	1) หุ้น AAA : 20,000 หุ้น, 2) หุ้น BBB : 10,000 หุ้น 3) หุ้น CCC : 5,000 หุ้น
อัตราดอกเบี้ย/อัตราผลตอบแทน (Yield)	12.00% ต่อปี



กรณีที่ 1: เกิดเหตุแห่งการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event Occurs)

กรณีเกิดเหตุการณ์ ณ วันสังเกตเหตุการณ์ ของงวดที่ 2 หากราคาปิดของหลักทรัพย์ทุกตัวในตะกร้า มากกว่าหรือเท่ากับราคา Knock-Out (AAA = 53.00 บาท, BBB = 105.00 บาท, CCC = 210.00 บาท) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันชำระราคา Knock-Out งวดที่ 2 เป็นจำนวนเงิน 1,000,000.00 บาท และชำระเงินค่าผลตอบแทนงวดที่ 2 เป็นจำนวนเงิน 10,000.00 บาท (ได้รับผลตอบแทนรวม 2 งวด งวดละ 10,000.00 บาท รวมเป็น 20,000.00 บาท) (คิดเป็นอัตราผลตอบแทน 2% เทียบเท่า 12% ต่อปี)

กรณีที่ 2: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out และไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-In

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันชำระราคา Knock-Out งวดที่ 6 เป็นจำนวนเงิน 1,000,000.00 บาท และชำระเงินค่าผลตอบแทนงวดสุดท้าย เป็นจำนวนเงิน 10,000.00 บาท (ได้รับผลตอบแทนรวม 6 งวด งวดละ 10,000.00 บาท รวมเป็น 60,000.00 บาท) (คิดเป็นอัตราผลตอบแทน 6% เทียบเท่า 12% ต่อปี)

กรณีที่ 3: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out แต่เกิดเหตุการณ์ Knock-In (สมมติให้ AAA เป็น Least Performing Security)

(ก) ราคาปิดของหุ้น AAA มากกว่าหรือเท่ากับราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันชำระราคางวดที่ 6 เป็นจำนวนเงิน 1,000,000.00 บาท และชำระเงินค่าผลตอบแทนงวดสุดท้ายเป็นจำนวนเงิน 10,000.00 บาท (ได้รับผลตอบแทนรวม 6 งวด งวดละ 10,000.00 บาท รวมเป็น 60,000.00 บาท) (คิดเป็นอัตราผลตอบแทน 6% เทียบเท่า 12% ต่อปี)

(ข) ราคาปิดของหุ้น AAA = 45.00 บาท น้อยกว่าราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้น AAA จำนวน 20,000 หุ้น และรับเงินจากเศษหุ้นเท่ากับ $0.0000 \times 45.00 = 0.00$ บาท พร้อมทั้งชำระผลตอบแทนงวดสุดท้ายเป็นจำนวนเงิน 10,000.00 บาท (ได้รับผลตอบแทนรวม 6 งวด งวดละ 10,000.00 บาท รวมเป็น 60,000.00 บาท) (คิดเป็นอัตราผลตอบแทน -4.00% เทียบเท่า -7.93% ต่อปี) $\{-4\% = [(45.00 \times 20,000 + 60,000)/1,000,000 - 1] \times 100\}$

“Least Performing Security” หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีอัตราร้อยละที่เปลี่ยนแปลงไปของราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายต่ำที่สุดจากราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย โดยจะคำนวณจาก $[(\text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย} \text{ ลบด้วย } \text{ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ}) \text{หารด้วย } \text{ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ}]$ หากมีหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้ผลการคำนวณเท่ากันสองหลักทรัพย์หรือมากกว่า ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะใช้ดุลยพินิจในการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เป็น Least Performing Security สำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หากหลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้ามีเพียงหนึ่งหลักทรัพย์ ให้ Least Performing Security หมายถึงหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

“เหตุแห่งการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event)” หมายถึง กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิงทุกหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันสังเกตการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-out Price) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

“เหตุแห่งการกำหนดวิธีไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Event)” หมายถึง กรณีที่วันใดวันหนึ่งหากราคาปิดของหลักทรัพย์ตัวใดตัวหนึ่งในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ น้อยกว่าราคาเพื่อกำหนดวิธีไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Price) ณ วันไถถอนหลักทรัพย์ จะพิจารณาราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายที่ต่ำที่สุด หากต่ำกว่าราคาราคาใช้สิทธิ จะไถถอนโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ แต่ถ้าหาก ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายที่ต่ำที่สุดมากกว่าหรือเท่ากับราคาใช้สิทธิ จะชำระมูลค่ารวมและดอกเบี้ยงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยง และศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น

เสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Single Stock Callable Fixed Coupon Note (Single Stock Callable FCN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพยอ้างอิง และ/หรือ เงิน ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/พิเศษ ผลตอบแทน	งวดที่ 1 วันที่ [●], งวดที่ 2 วันที่ [●] งวดที่ 3 วันที่ [●], งวดที่ 4 วันที่ [●] งวดที่ 5 วันที่ [●], งวดที่ 6 วันที่ [●] งวดที่ 7 วันที่ [●], งวดที่ 8 วันที่ [●] งวดที่ 9 วันที่ [●], งวดที่ 10 วันที่ [●]
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ผู้ออกตราสารสามารถไถ่ถอนก่อนกำหนดได้ (Callable)
มูลค่าการเสนอขายรวมหลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	[●] บาท ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนินกิจการทั่วไป และป้องกันความเสี่ยงตามนโยบายของบริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผันผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตราผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ	<input checked="" type="checkbox"/> ไม่มี

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)
ตัวอย่าง

หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความเสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสารอนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยงเพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยงของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

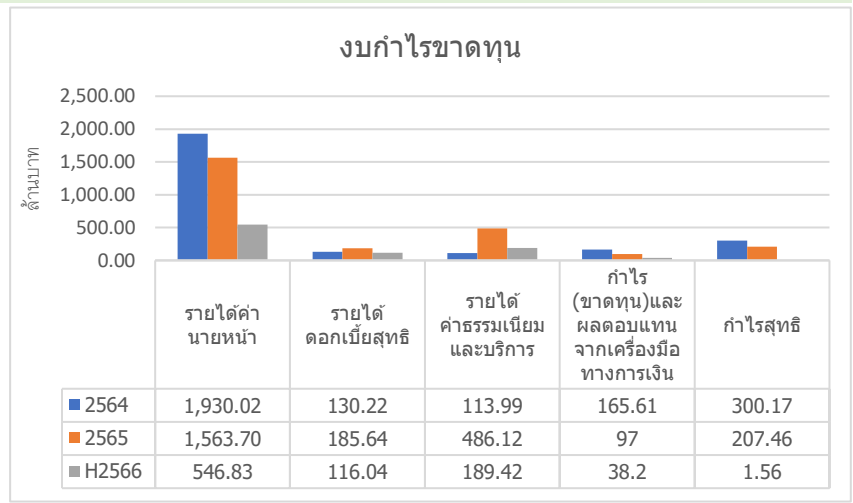
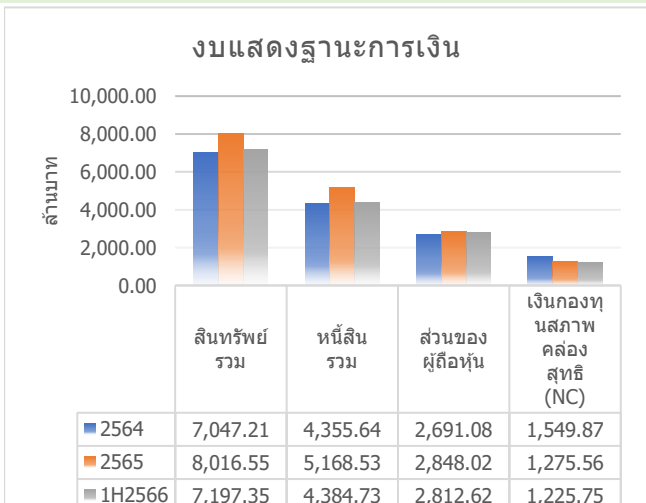
ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

เป็น

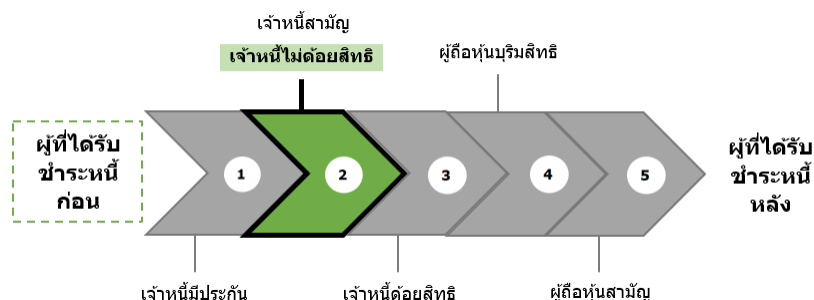
ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง



ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



กรณีที่ 1: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event Occurs)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการชำระหนี้เพื่อไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดที่ออกภายใต้ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้องให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระเงินค่าไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 (หนึ่งร้อย) ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงถืออยู่ และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่เกิดเหตุแห่งการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดในวันไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

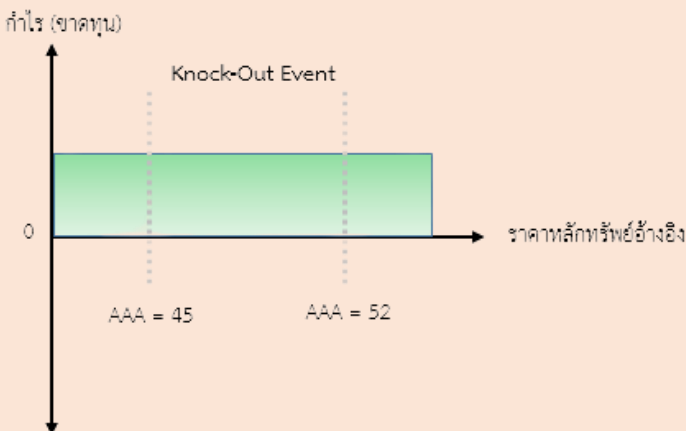
กรณีที่ 2: กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (No Auto Call Event)

(ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย มากกว่าหรือเท่ากับราคาต่กลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระเงินด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย น้อยกว่าราคาต่กลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ ที่ตกลงจะส่งมอบ และชำระเงินส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

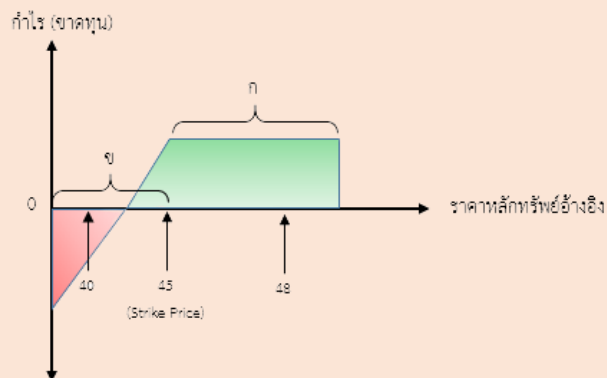
ตัวอย่าง

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้นสามัญของบริษัท AAA
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	หุ้น AAA : 50 บาท
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	หุ้น AAA : 45 บาท
ราคาเพื่อเตรียมไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Price)	หุ้น AAA : 52 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	180 วัน
มูลค่าที่ตราไว้ และราคาเสนอขาย (Par, Offered Price)	1,000,000 บาท , 1,000,000 บาท (100% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	หุ้น AAA : 22,200 หุ้น
ผลตอบแทนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Coupon rate)	9,600 บาทต่องวด เป็นจำนวน 6 งวด



กรณีที่ 1: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

ถ้า ณ วันสังเกตการณ์ ของงวดดอกเบี้ยงวดที่ 1 ราคาของหุ้น AAA ปิดที่ 54 บาท ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระเป็นเงินจำนวน 1,000,000 บาท และชำระเงินค่าดอกเบี้ยสำหรับงวดที่ 1 เป็นจำนวน 9,600 บาท คิดเป็นอัตราผลกำไร 11.68% ต่อปี $[(1,000,000 + 9,600) - 1,000,000] / 1,000,000 \times 365/30$



กรณีที่ 2: กรณีไม่เกิดเหตุแห่งการไถถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

- (ก) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดค่าราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 48 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเงินให้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง 1,000,000 บาท และชำระเงินค่าดอกเบี้ยงวดสุดท้ายเป็นจำนวน 9,600 บาท รวมดอกเบี้ย 6 งวดเป็นเงิน 57,600 บาท หรือผู้ลงทุนได้กำไร 11.68% ต่อปี

$$[= ((1,000,000 + 57,600 - 1,000,000) / 1,000,000 \times 365/180)]$$
- (ข) ถ้าราคาปิด ณ วันที่กำหนดค่าราคาหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นสามัญ AAA = 40 บาท เมื่อถึงวันครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นสามัญของบริษัท AAA จำนวน 22,200 หุ้น* และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา 888.89 บาท $[= ((1,000,000/45) - 22,200) \times 40]$ และชำระเงินค่าดอกเบี้ยงวดสุดท้ายเป็นจำนวน 9,600 บาท รวมดอกเบี้ย 6 งวดเป็นเงิน 57,600 บาท หรือผู้ลงทุนขาดทุน 10.85%

$$[= ((22,200 \times 40) + 888.89 + 57,600 - 1,000,000) / 1,000,000 \times 365/180]$$

“เหตุแห่งการไถถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event)” หมายถึง กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันสังเกตการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (Auto Call Price: KP) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นหรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

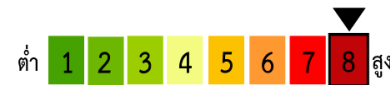
สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น

เสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Single Stock Knock-In Knock-Out Fixed Coupon Note (Single Stock KIKO FCN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	<input type="checkbox"/> ไม่มี <input type="checkbox"/> คงที่ [●]% ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/พิเศษ ผลตอบแทน	งวดที่ 1 วันที่ [●], งวดที่ 2 วันที่ [●] งวดที่ 3 วันที่ [●], งวดที่ 4 วันที่ [●] งวดที่ 5 วันที่ [●], งวดที่ 6 วันที่ [●] งวดที่ 7 วันที่ [●], งวดที่ 8 วันที่ [●] งวดที่ 9 วันที่ [●], งวดที่ 10 วันที่ [●]
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ผู้ออกตราสารสามารถไถ่ถอนก่อนกำหนดได้ (Callable)
มูลค่าการเสนอขายรวมหลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	[●] บาท ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนินกิจการทั่วไป และป้องกันความเสี่ยงตามนโยบายของบริษัท

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)
ตัวอย่าง

หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความเสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสารอนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยงเพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยงของบริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผันผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตราผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ วันครบกำหนด	<input checked="" type="checkbox"/> ไม่มี

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

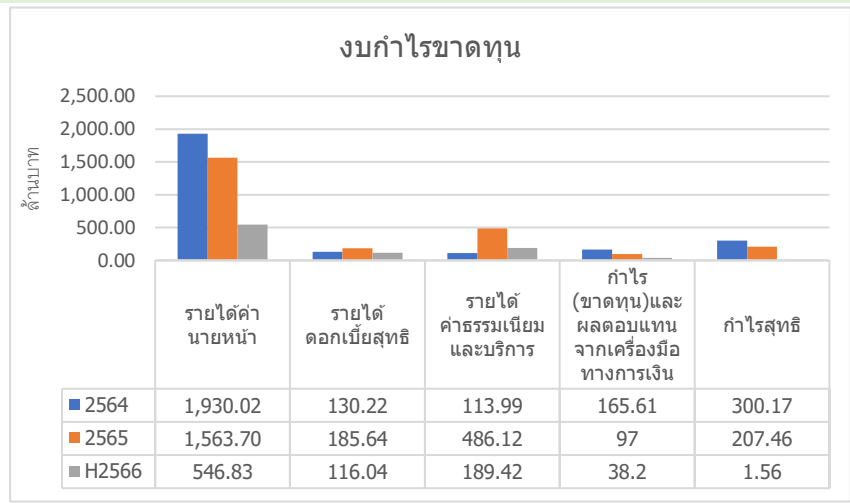
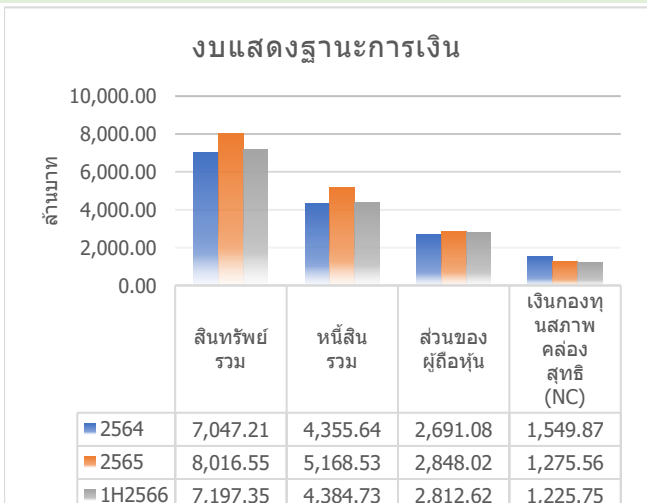
ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

เป็น

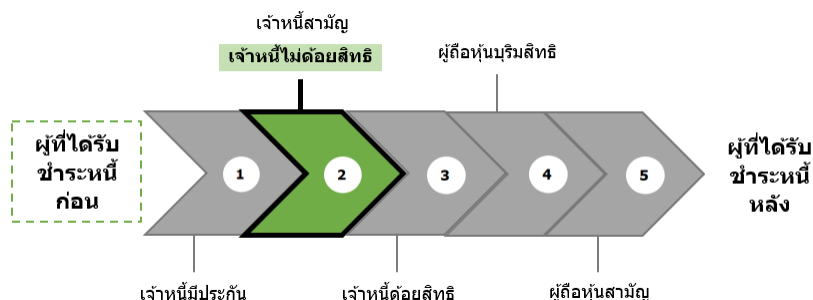
ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง



ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

กรณีที่ 1: เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event Occurs)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการชำระหนี้เพื่อไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดที่ออกภายใต้ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้องให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระเงินค่าไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 (หนึ่งร้อย) ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงถืออยู่และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

กรณีที่ 2: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out และไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-In

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเท่ากับ ร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง พร้อมผลตอบแทนให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

กรณีที่ 3: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out และเกิดเหตุการณ์ Knock-In

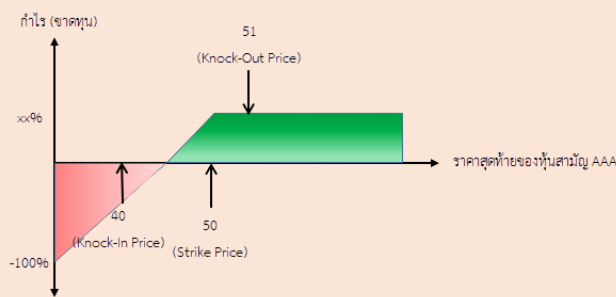
กรณีที่ราคาปิดของหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดเหตุการณ์ Knock-In ต่ำกว่าราคา Knock-In จะถือว่าเกิดเหตุการณ์ Knock-In เกิดขึ้น จะต้องพิจารณาดังนี้

(ก) หากราคาอ้างอิงของหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ สูงกว่าหรือเท่ากับ ราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระมูลค่ารวมและดอกเบี้ยงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ น้อยกว่า ราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ ที่ตกลงจะส่งมอบ และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระด้วยเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ตัวอย่าง

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้นสามัญของบริษัท BBB
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	หุ้น BBB : 100 บาท,
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	หุ้น BBB : 100 บาท, (100% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์)
ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอน (Knock-Out Price)	หุ้น BBB : 102 บาท (102% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์)
ราคาเพื่อกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Price)	หุ้น BBB : 80 บาท, (80% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์)
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	6 เดือน (184 วัน)
มูลค่าที่ตราไว้ (Par)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Offered Price)	1,000,000.00 บาท (100% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	หุ้น BBB : 10,000 หุ้น
อัตราดอกเบี้ย/อัตราผลตอบแทน (Yield)	12.00% ต่อปี



กรณีที่ 1: เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event Occurs)

กรณีเกิดเหตุการณ์ ณ วันสังเกตเหตุการณ์ ของงวดที่ 2 หากราคาปิดของหลักทรัพย์ มากกว่าหรือเท่ากับราคา Knock-Out (BBB = 105.00 บาท) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันชำระราคา Knock-Out งวดที่ 2 เป็นจำนวนเงิน 1,000,000.00 บาท และชำระเงินค่าผลตอบแทนงวดที่ 2 เป็นจำนวนเงิน 10,000.00 บาท (ได้รับผลตอบแทนรวม 2 งวด งวดละ 10,000.00 บาท รวมเป็น 20,000 บาท) (คิดเป็นอัตราผลตอบแทน 2% เทียบเท่า 12% ต่อปี)

กรณีที่ 2: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out และไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-In

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันชำระราคางวดสุดท้าย เป็นจำนวนเงิน 1,000,000.00 บาท และชำระเงินค่าผลตอบแทนงวดสุดท้าย เป็นจำนวนเงิน 10,000.00 บาท (ได้รับผลตอบแทนรวม 6 งวด งวดละ 10,000.00 บาท รวมเป็น 60,000.00 บาท) (คิดเป็นอัตราผลตอบแทน 6% เทียบเท่า 12% ต่อปี)

กรณีที่ 3: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out และเกิดเหตุการณ์ Knock-In

(ก) ราคาปิดของหุ้น BBB = 101 บาท ปิดมากกว่าหรือเท่ากับราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระราคางวดสุดท้ายเป็นจำนวนเงิน 1,000,000 บาท และชำระเงินค่าผลตอบแทนงวดสุดท้าย เป็นจำนวนเงิน 10,000 บาท (ได้รับผลตอบแทนรวม 6 งวด งวดละ 10,000 บาท รวมเป็น 60,000 บาท) (คิดเป็นอัตราผลตอบแทน 6% เทียบเท่า 12% ต่อปี)

(ข) ราคาปิดของหุ้น BBB = 90.00 บาท น้อยกว่าราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นจำนวน 10,000 หุ้น และรับเงินจากเศษหุ้นเท่ากับ $0.0000 \times 90.00 = 0.00$ บาท พร้อมทั้งชำระผลตอบแทนงวดสุดท้ายเป็นจำนวนเงิน 10,000.00 บาท (ได้รับผลตอบแทนรวม 6 งวด งวดละ 10,000 บาท รวมเป็น 60,000 บาท) (คิดเป็นอัตราผลตอบแทน -4.00% เทียบเท่า -7.93% ต่อปี) $\{-4\% = [(90 \times 10,000 + 60,000)/1,000,000 - 1] \times 100\}$

“เหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event)” หมายถึง กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-out Price) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

“เหตุแห่งการกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Event)” หมายถึง กรณีที่วันใดวันหนึ่งหากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ น้อยกว่าราคาเพื่อกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Price) ณ วันไถ่ถอนหลักทรัพย์ จะพิจารณาราคาหลักทรัพย์อ้างอิง หากต่ำกว่าราคาใช้สิทธิ จะไถ่ถอนโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ แต่ถ้าหาก ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย มากกว่าหรือเท่ากับราคาใช้สิทธิ จะชำระมูลค่ารวมและดอกเบี้ยงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนคำนวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น
 เสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Knock-out Equity Linked Notes (KO-ELN) แบบมีการคุ้มครองเงินต้น ที่มี
 การไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน [กรณีอ้างอิงกับดัชนีหลักทรัพย์ จะไถ่ถอนเป็นเงินเท่านั้น]
 ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ ร้อยละ [●] ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/ ผลตอบแทน	เป็นไปตามลักษณะพิเศษ และความเสี่ยงสำคัญของตรา สาร
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ผู้ออกตราสารสามารถไถ่ถอน ก่อนกำหนดได้ (Callable)
มูลค่าการเสนอขายรวม หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	[●] บาท ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/ดัชนี SET[●]/ หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนิน กิจการทั่วไป และป้องกัน ความเสี่ยงตามนโยบายของ บริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ นายทะเบียนหุ้นกู้	ไม่มี บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผัน ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตรา ผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ ออวันครบกำหนด	<input checked="" type="checkbox"/> มี ณ วันครบกำหนดอายุผู้ ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะ ชำระคืนเงินสด อย่างน้อย ร้อยละ [●] ของเงินลงทุน

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)
ตัวอย่าง



หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความ
เสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้
ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสาร
อนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยี
สารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่าย
หลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืม
หลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยง
เพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยง
ของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

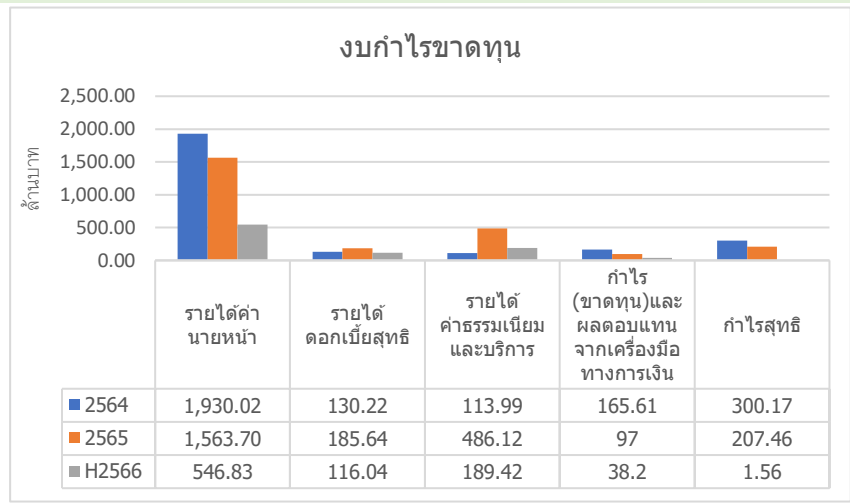
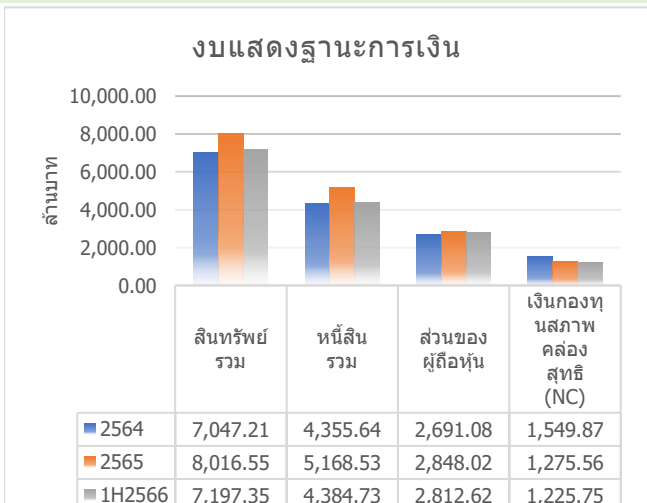
ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

เป็น

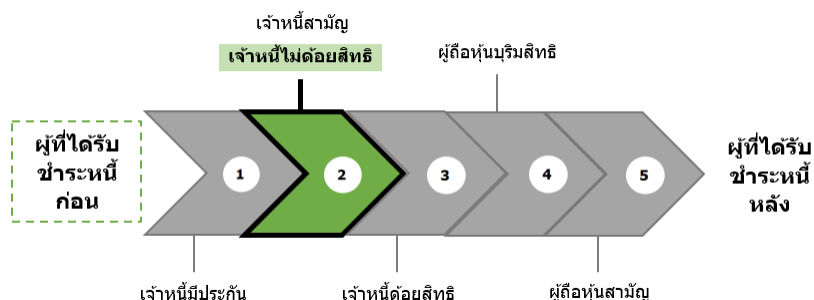
ไม่เป็น

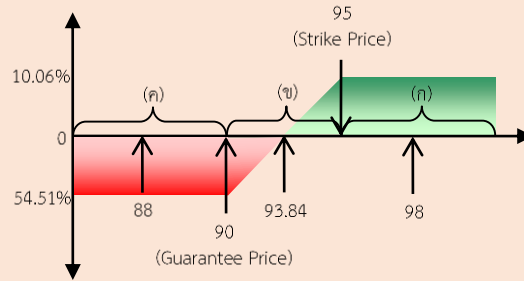
สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง



ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท





กรณีไถ่ถอนเป็นหลักทรัพยอ้างอิง และ/หรือเงิน

(1) กรณีเกิด Knock-out Event

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง จะชำระเงินในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด เป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(2) กรณีไม่เกิด Knock-out Event

(ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระเงินในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) น้อยกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย แต่มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น

กรณีไถ่ถอนโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ และชำระเงินสัดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา แทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (ถ้ามี) ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ค) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) น้อยกว่า ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น

กรณีไถ่ถอนโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ และชำระเงินสัดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา และจะชำระเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นเงินเท่ากับ [(ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น - ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย) x จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ] ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

“เหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event)” หมายถึง กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-out Price) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ตัวอย่าง

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้นสามัญของบริษัท AAA
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	10.00 บาท
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	9.50 บาท
ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price)	9.00 บาท
ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด	10.50 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	30 วัน
มูลค่าที่ตราไว้ (Par)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Offered Price)	985,000.00 บาท (98.5% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	105,200 หุ้น [105,263.1579 หุ้น กรณีไถ่ถอนด้วยเงิน]

- 1) กรณีเกิด Knock-out Event (ประมาณ 15 วัน) เช่น ราคาหุ้น AAA เท่ากับ 12.00 บาท ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนวันครบกำหนด โดยการชำระเงินเป็นจำนวน 1,000,000 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราผลกำไรร้อยละ 1.52 ต่ออายุตราสาร หรืออัตราผลกำไรร้อยละ 37.06 ต่อปี
- 2) กรณีไม่เกิด Knock-out Event สามารถแบ่งได้เป็น 3 กรณี ดังนี้
 - (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายมากกว่าหรือเท่ากับ 9.50 บาท ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระเงินเป็นจำนวน 1,000,000 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราผลกำไรร้อยละ 1.52 ต่ออายุตราสาร หรืออัตราผลกำไรร้อยละ 18.53 ต่อปี
 - (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายน้อยกว่า 9.50 บาท เช่นราคาหุ้น AAA เท่ากับ 9.00 บาท ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง จะส่งมอบหุ้น AAA จำนวน 105,200 หุ้น และชำระเงินจำนวน 568.42 บาท (63.1579×9.00) แทนการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราผลตอบแทนร้อยละ 3.82 หรือร้อยละ 46.48 ต่อปี $[(105,263.1579 \times 9.00 - 985,000)/985,000 \times 365 / 30]$
 - (ค) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายน้อยกว่า 9.00 บาท เช่นราคาหุ้น AAA เท่ากับ 8.50 บาท ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง จะส่งมอบหุ้น AAA จำนวน 105,200 หุ้น และชำระเงินจำนวน 536.84 บาท (63.1579×8.50) และชำระเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นเป็นจำนวนเงิน 52,600 บาท $(105,200 \times (9.00 - 8.50))$ คิดเป็นอัตราผลตอบแทนร้อยละ 3.82 ต่ออายุตราสาร หรืออัตราผลตอบแทนร้อยละ 46.52 ต่อปี $[(105,263.1579 \times 8.50) + (105,200 \times (9.00 - 8.50)) - 985,000]/985,000 \times 365 / 30]$

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น

เสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Knock-out Equity Linked Note (KO-ELN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน [กรณีอ้างอิงกับดัชนีหลักทรัพย์ จะไถ่ถอนเป็นเงินเท่านั้น] ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ ร้อยละ [●] ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/ ผลตอบแทน	เป็นไปตามลักษณะพิเศษ และความเสี่ยงสำคัญของตรา สาร
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ผู้ออกตราสารสามารถไถ่ถอน ก่อนกำหนดได้ (Callable)
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	Physical และ/หรือ Cash
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/ดัชนี SET[●]/ หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนิน กิจการทั่วไป และป้องกัน ความเสี่ยงตามนโยบายของ บริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ นายทะเบียนหุ้นกู้	ไม่มี บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผัน ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตรา ผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ วันครบกำหนด	<input checked="" type="checkbox"/> ไม่มี

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)
ตัวอย่าง



หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความ
เสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้
ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสาร
อนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยี
สารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่าย
หลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืม
หลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยง
เพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยง
ของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

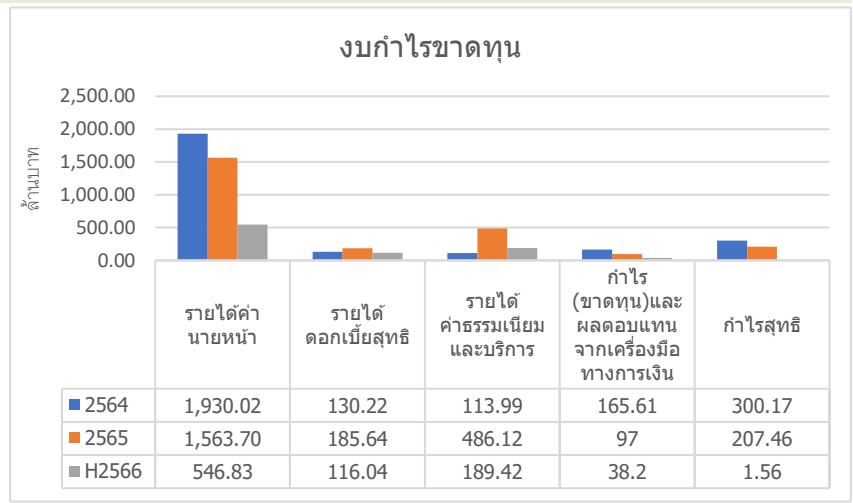
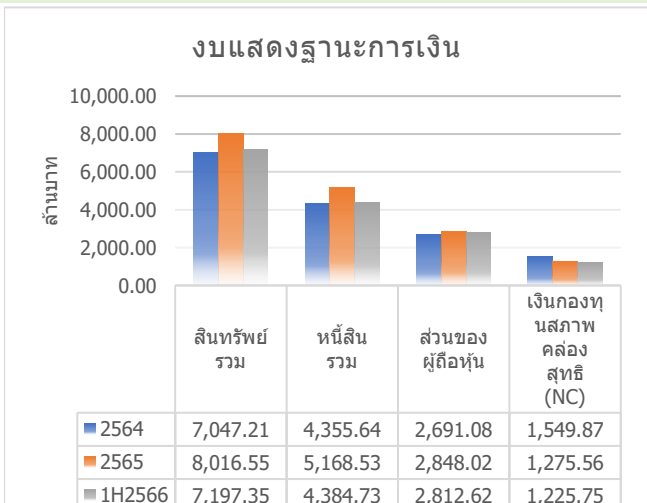
ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

เป็น

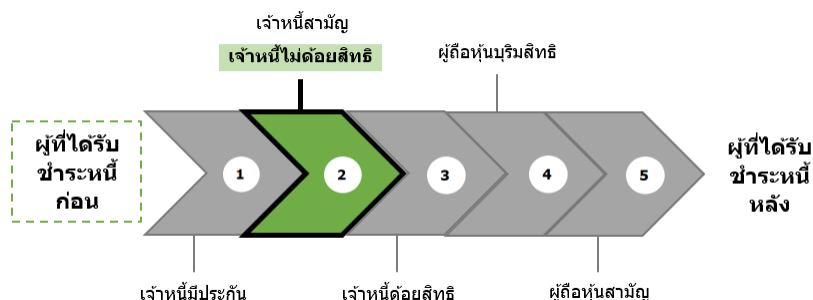
ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง

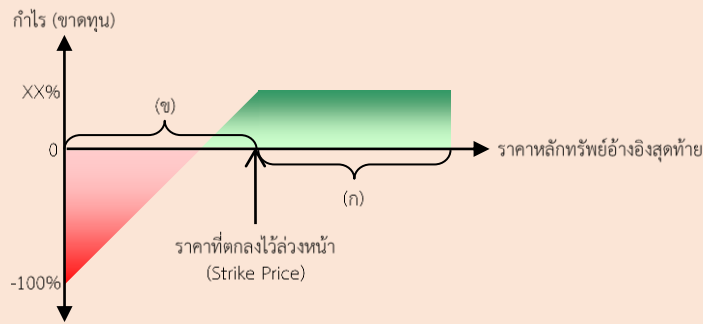


ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร



กรณีไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือเงิน

(1) กรณีเกิด Knock-out Event

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง จะชำระเงินในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด เป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(2) กรณีไม่เกิด Knock-out Event

(ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระเงินในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: S_T) น้อยกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย แต่มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น

กรณีไถ่ถอนโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา แทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (ถ้ามี) ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

“เหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event)” หมายถึง กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันสังเกตการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-out Price) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ตัวอย่าง

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้นสามัญของบริษัท AAA
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	10.00 บาท
ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	9.50 บาท
ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Price)	10.50 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	30 วัน
มูลค่าที่ตราไว้ (Par)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Offered Price)	985,000.00 บาท (98.5% ของมูลค่าที่ตราไว้)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities)	105,200 หุ้น [105,263.1579 หุ้น กรณีไถ่ถอนด้วยเงิน]

- 1) กรณีเกิด Knock-out Event (ประมาณ 15 วัน) เช่น ราคาหุ้น AAA เท่ากับ 12.00 บาท ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนวันครบกำหนด โดยการชำระเงินเป็นจำนวน 1,000,000 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราผลกำไรร้อยละ 1.52 ต่ออายุตราสาร หรืออัตราผลกำไรร้อยละ 37.06 ต่อปี
- 2) กรณีไม่เกิด Knock-out Event สามารถแบ่งได้เป็น 2 กรณี ดังนี้
 - (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายมากกว่าหรือเท่ากับ 9.50 บาท ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระเงินเป็นจำนวน 1,000,000 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราผลกำไรร้อยละ 1.52 ต่ออายุตราสาร หรืออัตราผลกำไรร้อยละ 18.53 ต่อปี
 - (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายน้อยกว่า 9.50 บาท เช่นราคาหุ้น AAA เท่ากับ 9.00 บาท ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง จะส่งมอบหุ้น AAA จำนวน 105,200 หุ้น และชำระเงินจำนวน 568.42 บาท (63.1579×9.00) แทนการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราผลตอบแทนร้อยละ 3.82 หรือร้อยละ 46.48 ต่อปี $[(105,263.1579 \times 9.00 - 985,000)/985,000 \times 365 / 30]$

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

Factsheet

ชื่อบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ลักษณะการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : เป็น ไม่เป็น
เสนอขาย หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ประเภท Bull Principal Protection Note แบบมีการคุ้มครองเงินต้น

ที่มีการไถ่ถอนเป็นเงินเท่านั้น ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน วันที่ [●]

ลักษณะตราสาร

สกุลเงิน	ไทยบาท
อายุ	[●] วัน
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ ร้อยละ [●] ต่อปี
งวดการชำระดอกเบี้ย/ ผลตอบแทน	เป็นไปตามลักษณะพิเศษ และความเสี่ยงสำคัญของตรา สาร
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
รูปแบบการไถ่ถอน	เป็นเงินเท่านั้น
วันกำหนดค่าปัจจัย	[●]
ปัจจัยอ้างอิง	หุ้นสามัญ/ดัชนี SET[●]/ หน่วยลงทุนของ ETF
วัตถุประสงค์การใช้งาน	เพื่อประโยชน์ในการดำเนิน กิจการทั่วไป และป้องกัน ความเสี่ยงตามนโยบายของ บริษัท

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหลักทรัพย์

อันดับ BBB+(tha) แนวโน้มอันดับเครดิต Stable
เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565 โดย Fitch Ratings

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	[●]
วันที่ครบกำหนดอายุ	[●]
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บล. ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด	อัตราผลตอบแทนสูงสุด คือ ร้อยละ [●] ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับราคาและความผัน ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง และราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขาย/อัตรา ผลตอบแทนต่ำสุดขาดทุน ร้อยละ 100 ต่ออายุตราสาร
การคุ้มครองเงินต้น ณ วันครบกำหนด	<input checked="" type="checkbox"/> มี

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)
ตัวอย่าง

หมายเหตุ: การชำระเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

เนื่องจากผู้ออกประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ จึงอาจมีความ
เสี่ยงที่กระทบในทางลบต่อความสามารถในการชำระหนี้
ของผู้ออกดังต่อไปนี้

1. ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2. ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์
3. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสาร
อนุพันธ์
4. ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยี
สารสนเทศ
5. ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ
6. ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่าย
หลักทรัพย์
7. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์
8. ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืม
หลักทรัพย์
9. ความเสี่ยงด้านบุคลากร
10. ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดของความเสี่ยง
เพิ่มเติมได้ในแบบ filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.1 ความเสี่ยง
ของบริษัท

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก

อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า)	ค่าเฉลี่ยอุตสาหกรรม (ล่าสุด)	งวด 6 เดือน ปี 2566	ปี 2565	ปี 2564
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (NCR) (ร้อยละ) ¹	ไม่มีข้อมูล	29.64	26.48	36.86
อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current Ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	1.94	1.97	1.72
ความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	0.12	0.94	N/A
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) (ร้อยละ) ³	ไม่มีข้อมูล	0.02	2.59	4.62
ความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (Interest Coverage ratio : ICR) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	3.57	7.68	11.94
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า) ²	ไม่มีข้อมูล	0.35	0.34	0.19
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (interest bearing debt to EBITDA ratio) (เท่า)	ไม่มีข้อมูล	8.65	2.05	0.89

¹ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

² ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรได้มาก

ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

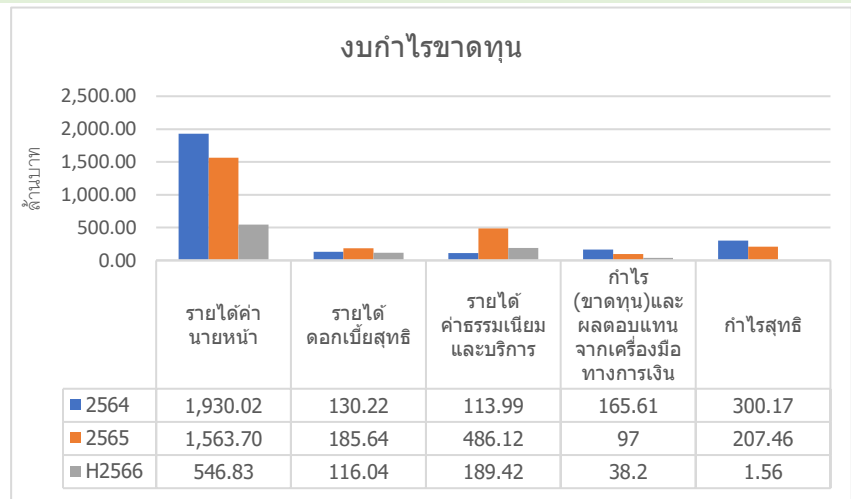
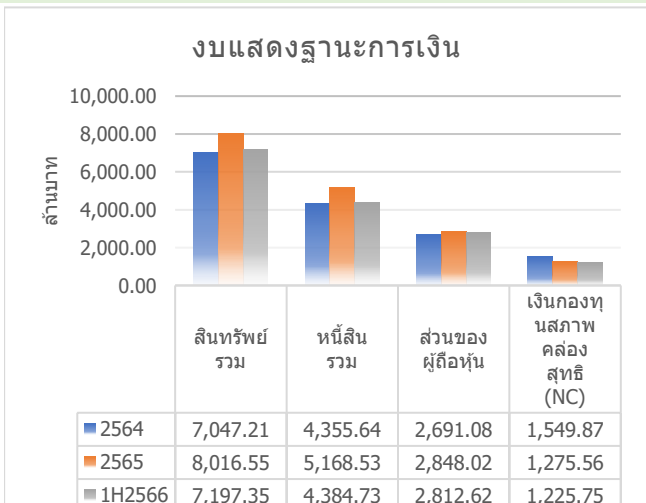
ไม่มีข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

การเป็นบุคคลภายใน

เป็น

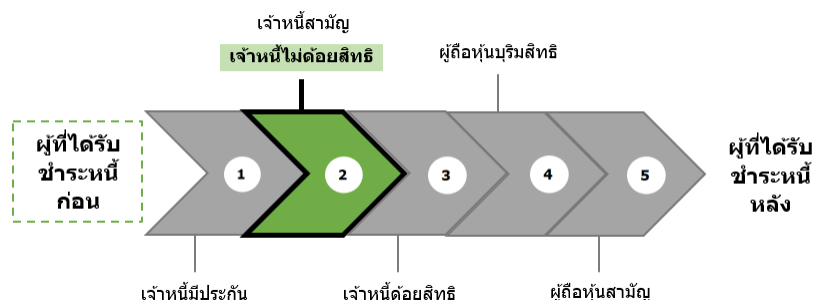
ไม่เป็น

สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและปีล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง

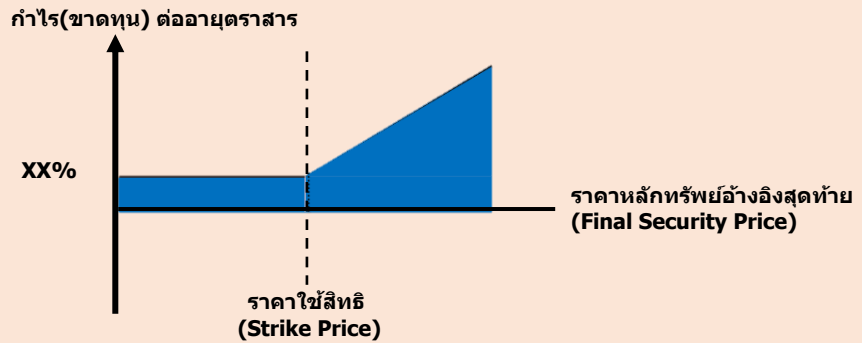


ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือ มีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร



กรณีไถ่ถอนตราสารเป็นเงิน

การชำระคืนเงินต้นและดอกเบี้ย: ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะได้รับการไถ่ถอนคืนเป็นเงินสด โดยเมื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะได้รับชำระผลตอบแทนขึ้นอยู่กับราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายดังนี้

กรณีที่ 1 ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายมากกว่าหรือเท่ากับราคาใช้สิทธิ

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระราคาด้วยเงินจำนวน (มูลค่าเงินหลักประกัน + ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง(ถ้ามี) + ผลตอบแทนพิเศษ) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผลตอบแทนพิเศษ จะคำนวณจาก มูลค่าที่ตราไว้ $\times \{(\text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย} - \text{ราคาใช้สิทธิ}) / \text{ราคาใช้สิทธิ}\} \times$ อัตราการมีส่วนร่วม

กรณีที่ 2 ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ต่ำกว่าราคาใช้สิทธิ

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระราคาด้วยเงินจำนวน (มูลค่าเงินหลักประกัน + ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง(ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ตัวอย่าง

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้นสามัญของบริษัท AAA
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	27.75 บาท
ราคาที่ยกเลิกกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	27.75 บาท
อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	183 วัน
มูลค่าที่ตราไว้ (Par)	1,000,000 บาท
จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขายทั้งหมด	3 หน่วย
ราคาเสนอขาย	ร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้
จำนวนเงินที่ต้องชำระ	3,000,000 บาท
อัตราการมีส่วนร่วม (Participation rate)	15%
อัตราดอกเบี้ยของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	ร้อยละ 1 ต่อปี ของมูลค่าที่ตราไว้รวม
ดอกเบี้ยของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	15,041.10 บาท $\{(183/365 \times 1/100 \times 3,000,000)\}$

กรณีที่ 1

หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายปิดที่ 30 บาท ซึ่งมากกว่าหรือเท่ากับราคาใช้สิทธิกำหนดไว้ 27.75 บาท ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระราคาด้วยเงินจำนวน 3,051,527.59 บาท $[3,000,000 + 15,041.10 + 36,486.49]$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับผลตอบแทนร้อยละ 3.43 ต่อปี $[(3,034,500.56 - 3,000,000) / 3,000,000 \times 365 / 183]$ และผลตอบแทนพิเศษเท่ากับ 36,486.49 $[(3,000,000 \times (30 - 27.75) / 27.75 \times 15\%)]$

กรณีที่ 2

หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายปิดที่ 20 บาท ซึ่งน้อยกว่าราคาใช้สิทธิกำหนดไว้ 27.75 บาท ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระราคาด้วยเงินจำนวน 3,015,041.10 บาท $[3,000,000 + 15,041.10]$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับผลตอบแทนร้อยละ 1.00 ต่อปี $[(3,015,041.10 - 3,000,000) / 3,000,000 \times 365 / 183]$

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
- การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
- เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
- กรณี non – listed co. และ unrated : หุ้นกู้ไม่มีอันดับความน่าเชื่อถือ และ ผู้ออกไม่ได้เป็นบริษัทจดทะเบียนกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ข้อมูลจึงมีจำกัด ควรศึกษาและติดตามข้อมูลของผู้ออกอย่างต่อเนื่อง

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดความเสี่ยงของการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ในแบบ Filing ส่วนที่ 3 หัวข้อที่ 2.2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ต. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี

- การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติ และงบการเงิน

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ ตัวแทนค่านวณเงิน

ส่วนที่ 2

ข้อมูลสรุป (Executive Summary)

บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) (“บริษัทฯ”) ให้บริการทางการเงินที่ครบวงจรชั้นนำของประเทศ ด้วยการนำเสนอผลิตภัณฑ์และบริการที่หลากหลายเพื่อตอบสนองความต้องการของลูกค้าทุกกลุ่ม โดย บริษัทฯ มีเครือข่ายการให้บริการทางการเงินในประเทศที่กว้างขวาง เพื่อให้บริการซื้อขายหลักทรัพย์ ตราสารอนุพันธ์ และตราสารหนี้ รวมถึงผลิตภัณฑ์กองทุนเพื่อการลงทุน สำหรับลูกค้ารายบุคคล ลูกค้าธุรกิจขนาดใหญ่ ขนาดกลาง และขนาดย่อม นอกจากนี้ บริษัทฯ ให้บริการที่ปรึกษาทางการเงินวาณิชธนกิจ รวมถึงบริการทางการเงินอื่นๆ ด้วย โดย บริษัทฯ เป็นสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ฯ หมายเลข 24 และเป็นสมาชิกของศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่งประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 (รวมทั้งที่ได้มีการแก้ไขเพิ่มเติม) ซึ่ง บริษัทฯ ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภท ก. ได้แก่

- (1) การเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
- (2) การค้าหลักทรัพย์
- (3) การเป็นที่ปรึกษาการลงทุน
- (4) การจัดจำหน่ายหลักทรัพย์
- (5) กิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Principal และ Agent) และ
- (6) การจัดการกองทุนส่วนบุคคล (กองทุนส่วนบุคคล)

ทั้งนี้ บริษัทฯ ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าภายใต้พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 (รวมทั้งที่ได้มีการแก้ไขเพิ่มเติม) โดยได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภท ส-1 ได้แก่

- (1) การเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และ
- (2) การเป็นผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

นอกจากนี้ บริษัทฯ ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ต. ในการประกอบธุรกิจเพิ่มเติม ได้แก่

- (1) ที่ปรึกษาทางการเงิน
- (2) ตัวแทนซื้อ/ขายคืนหน่วยลงทุน (Selling Agent) และ
- (3) ตัวแทนซื้อและขายตราสารหนี้ของศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย

บริษัทฯ ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือหรือเครดิตภายในประเทศ (National Rating) ระยะยาวที่ระดับ “BBB+ (tha)” โดยบริษัท ฟีทซ์เรตติ้งส์ จำกัด (ข้อมูล ณ วันที่ 29 ธันวาคม 2565) โดยมีแนวโน้มอันดับเครดิตที่ “Stable” หรือ “มีเสถียรภาพ” ในขณะเดียวกัน ฟีทซ์เรตติ้งส์ ประกาศคงอันดับเครดิตในประเทศระยะสั้นที่ “F2(tha)”

ผลการดำเนินงานและฐานะทางการเงินสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2563 – 2565 และสำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566

การวิเคราะห์และคำอธิบายของฝ่ายจัดการเกี่ยวกับฐานะทางการเงินรวมและผลการดำเนินงานรวมของบริษัทฯ สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2563 - 2564 ซึ่ง เป็นฐานะทางการเงินรวมและผลการดำเนินงานรวมก่อนการเข้าซื้อหุ้น

FSL ในสัดส่วนร้อยละ 100.00 และก่อนการเข้าซื้อหุ้น FSSIA ในสัดส่วนร้อยละ 3.75 และปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2565 และสำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566 ซึ่งเป็นฐานะทางการเงินรวมและผลการดำเนินงานรวมภายหลังการเข้าซื้อหุ้นของ FSL ในสัดส่วนร้อยละ 100.00 และ FSSIA เพิ่มเติมอีกร้อยละ 3.75 สามารถสรุปได้ดังต่อไปนี้

1) ผลการดำเนินงาน: รายได้รวม

บริษัทฯ เป็นบริษัทหลักทรัพย์ที่ให้บริการทางการเงินที่ครบวงจรโดยรายได้ของบริษัทฯ สามารถจำแนกได้เป็น 6 ประเภท ประกอบด้วย (1) ค่านายหน้า (2) ค่าธรรมเนียมและบริการ (3) ดอกเบี้ย (4) กำไรและผลตอบแทนจากเครื่องมือทางการเงิน (5) ส่วนแบ่งกำไร (ขาดทุน) จากเงินลงทุนในบริษัทร่วม และ (6) รายได้อื่น ทั้งนี้ รายได้หลักมาจากค่านายหน้าและค่าธรรมเนียมและบริการ คิดเป็นสัดส่วนประมาณร้อยละ 79.82 – 85.40 ของรายได้รวม

สำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566 บริษัทฯ มีรายได้รวม 922.35 ล้านบาท ลดลงร้อยละ 17.90 เมื่อเทียบกับงวดเดียวกันของปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การลดลงของรายได้ค่านายหน้า 352.87 ล้านบาท เนื่องจากปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวันของบริษัทฯ ลดลงจาก 9,017 ล้านบาท เป็น 5,138 ล้านบาท หรือลดลงร้อยละ 43.0 โดยบริษัทฯ มีส่วนแบ่งการตลาดลดลงจากร้อยละ 5.60 เป็นร้อยละ 4.71 และ (2) การลดลงของกำไรและผลตอบแทนจากเครื่องมือทางการเงิน 15.42 ล้านบาท เนื่องจากการลดลงของกำไรจากตราสารอนุพันธ์เป็นหลัก

ในปี 2565 บริษัทฯ มีรายได้รวม 2,400.39 ล้านบาท เพิ่มขึ้นร้อยละ 0.16 จากปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของรายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ 372.13 ล้านบาท เนื่องจากการรวมธุรกิจจากการซื้อเงินลงทุนใน FSL ทำให้บริษัทฯ มีรายได้จากการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์และมีรายได้ที่ปรึกษาทางการเงินเพิ่มขึ้น และ (2) การเพิ่มขึ้นของรายได้ดอกเบี้ย 55.42 ล้านบาท เนื่องจากการปรับขึ้นของอัตราดอกเบี้ยของตลาดเงิน อย่างไรก็ตามรายได้ค่านายหน้าลดลง 366.32 ล้านบาท เนื่องจากปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวันของบริษัทฯ ลดลงจาก 9,490 ล้านบาท เป็น 7,549 ล้านบาท หรือ ลดลงร้อยละ 20.45 ส่วนแบ่งการตลาดลดลงจากร้อยละ 5.58 เป็นร้อยละ 5.34

ในปี 2564 บริษัทฯ มีรายได้รวม 2,396.55 ล้านบาท เพิ่มขึ้นร้อยละ 37.17 จากปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของรายได้ค่านายหน้า 615.27 ล้านบาท เนื่องจากปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวันซึ่งเพิ่มขึ้นจาก 7,433 ล้านบาทเป็น 9,490 ล้านบาท หรือเพิ่มขึ้นร้อยละ 28 แม้ว่าบริษัทฯ จะมีส่วนแบ่งการตลาดลดลงจากร้อยละ 6.06 เป็น ร้อยละ 5.58 และ (2) การเพิ่มขึ้นของรายได้ดอกเบี้ย 45.45 ล้านบาท เนื่องจากมูลค่าเงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ในปี 2564 ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 69.3 จากปี 2563 ตามปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์ที่เพิ่มมากขึ้น

ในปี 2563 บริษัทฯ มีรายได้รวม 1,747.10 ล้านบาท เพิ่มขึ้นร้อยละ 34.88 จากปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของรายได้ค่านายหน้า 400.59 ล้านบาท เนื่องจากปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวัน ซึ่งเพิ่มขึ้นจาก 6,701 ล้านบาทเป็น 7,433 ล้านบาท หรือเพิ่มขึ้นร้อยละ 10.92 และส่วนแบ่งการตลาดลดลงจากร้อยละ 6.15 เป็นร้อยละ 6.06 และ (2) การเพิ่มขึ้นของรายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ 41.40 ล้านบาท เนื่องจากการเพิ่มขึ้นของรายได้จากการวิเคราะห์หลักทรัพย์ รายได้จากการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์และการเป็นที่ปรึกษาทางการเงิน และรายได้ค่าธรรมเนียมจากการซื้อขายหน่วยลงทุน

2) ผลการดำเนินงาน: กำไรสุทธิ

สำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566 บริษัทฯ มีกำไรสุทธิ 1.56 ล้านบาท ลดลง 98.69 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 98.44 เมื่อเทียบกับงวดเดียวกันของปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจากการลดลงของรายได้ 2 ส่วนคือ รายได้ค่านายหน้าและกำไรและผลตอบแทนจากเครื่องมือทางการเงินที่ลดลง ในขณะที่รายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ และรายได้ดอกเบี้ยเพิ่มขึ้น

ในปี 2565 บริษัทฯ มีกำไรสุทธิ 207.46 ล้านบาท ลดลง 92.71 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 30.89 จากปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจากการเพิ่มขึ้นของค่าใช้จ่ายอื่น เช่น ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงผู้ถือหุ้นและการปรับโครงสร้างของบริษัทฯ ค่าขาดผลเสียหายจากการส่งคำสั่งผิดพลาด สำรองผลเสียหายจากคดีความที่อาจเกิดขึ้น ค่าบริการข้อมูลและค่าบริการเชื่อมต่อตลาดหลักทรัพย์ฯ และค่าใช้จ่ายในการส่งเสริมการตลาด ในขณะที่รายได้เพิ่มขึ้นในอัตราที่น้อยกว่าอัตราการเพิ่มขึ้นของค่าใช้จ่ายข้างต้น

ในปี 2564 บริษัทฯ มีกำไรสุทธิ 300.17 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 218.12 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 265.84 จากปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจากการเพิ่มขึ้นของรายได้ 2 ส่วนคือ รายได้ค่านายหน้าและรายได้ดอกเบี้ย ทำให้ครอบคลุมค่าใช้จ่ายคงที่และค่าใช้จ่ายผันแปรของบริษัทฯ และมีผลกำไรดังกล่าว

ในปี 2563 บริษัทฯ มีกำไรสุทธิ 82.05 ล้านบาท ขณะที่ปี 2562 มีผลขาดทุนสุทธิ ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจากการเพิ่มขึ้นของรายได้ 2 ส่วนคือ รายได้ค่านายหน้าและรายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ ซึ่งครอบคลุมค่าใช้จ่ายคงที่และค่าใช้จ่ายผันแปรของบริษัทฯ และมีผลกำไรเท่ากับยอดดังกล่าว

3) ฐานะทางการเงิน: สินทรัพย์รวม

สำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566 บริษัทฯ มีสินทรัพย์รวม 7,197.35 ล้านบาท ลดลง 819.20 ล้านบาทหรือคิดเป็นร้อยละ 10.22 เมื่อเทียบกับ ณ สิ้นปี 2565 ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การลดลงของลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า 1,078.27 ล้านบาท (2) การเพิ่มขึ้นของลูกหนี้สำนักหักบัญชีและบริษัทหลักทรัพย์ 511.55 ล้านบาท โดย (1) และ (2) เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงของปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี ซึ่งการเพิ่มขึ้นหรือลดลงของรายการดังกล่าวถือเป็นการดำเนินธุรกิจตามปกติของบริษัทฯ ซึ่งเป็นการเปลี่ยนแปลงที่มีได้มีผลกระทบต่อภาระอย่างมีนัยสำคัญต่อการประกอบธุรกิจของบริษัทฯ และ (3) การลดลงของเงินลงทุน 236.59 ล้านบาท เนื่องจากการลดลงของมูลค่ายุติธรรมของเงินลงทุนและเงินลงทุนที่วัดมูลค่าด้วยราคาทุนตัดจำหน่าย

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565 บริษัทฯ มีสินทรัพย์รวม 8,016.55 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 969.34 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 13.75 เมื่อเทียบกับ ณ สิ้นปี 2564 ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของอาคารและอุปกรณ์ - สุทธิ 387.68 ล้านบาท เนื่องจากการซื้อ FSL มาเป็นบริษัทย่อยของ FSSIA ทำให้ได้มาซึ่งอาคารและอุปกรณ์อันเป็นที่ตั้งของสำนักงานใหญ่ของ FSL (2) การเพิ่มขึ้นของเงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด 275.17 ล้านบาท และ (3) สินทรัพย์อื่น - สุทธิ 210.88 ล้านบาท เนื่องจากการเพิ่มขึ้นของรายการเงินฝากธนาคารเพื่อลูกค้าภายใต้ยึดตามคำสั่งสำนักงานป้องกันและปราบปรามการฟอกเงินและรายการเงินสมทบกองทุนทดแทนความเสียหายในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2564 บริษัทฯ มีสินทรัพย์รวม 7,047.21 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 1,100.26 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 18.50 เมื่อเทียบกับ ณ สิ้นปี 2563 ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า 580.44 ล้านบาท และ (2) การเพิ่มขึ้นของลูกหนี้สำนักหักบัญชีและบริษัทหลักทรัพย์ 589.58 ล้านบาท โดย (1) และ (2) เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงของปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี ซึ่งการเพิ่มขึ้นหรือลดลงของรายการดังกล่าวถือเป็นการดำเนินธุรกิจตามปกติของบริษัทฯ ซึ่งเป็นการเปลี่ยนแปลงที่มีได้มีผลกระทบต่อภาระอย่างมีนัยสำคัญต่อการประกอบธุรกิจของบริษัทฯ

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 บริษัทฯ มีสินทรัพย์รวม 5,946.95 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 1,670.00 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 39.05 เมื่อเทียบกับ ณ สิ้นปี 2562 ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า 1,200.96 ล้านบาท และ (2) การเพิ่มขึ้นของลูกหนี้สำนักหักบัญชีและบริษัทหลักทรัพย์ 140.19 ล้านบาท โดย (1) และ (2) เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงของปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวด

บัญชี ซึ่งการเพิ่มขึ้นหรือลดลงของรายการดังกล่าวถือเป็นการดำเนินธุรกิจตามปกติของบริษัทฯ ซึ่งเป็นการเปลี่ยนแปลงที่มีได้มีผลกระทบต่ออย่างมีนัยสำคัญต่อการประกอบธุรกิจของบริษัทฯ

4) ฐานะทางการเงิน: หนี้สินและส่วนของผู้ถือหุ้น

ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566 บริษัทฯ มีหนี้สิน 4,384.73 ล้านบาท และส่วนของผู้ถือหุ้น 2,812.62 ล้านบาท โดยเป็นอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเท่ากับ 1.56 เท่า ทั้งนี้ รายการหลักของหนี้สิน คือ (1) เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งรายการดังกล่าวจะเปลี่ยนแปลงไปตามปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี และ (2) หนี้กู้ยืมที่เสนอขายต่อนักลงทุนสถาบันและนักลงทุนรายใหญ่ในระหว่างปี 2564 - 2565 ขณะที่รายการหลักของส่วนของผู้ถือหุ้นคือ ทุนที่ออกและชำระแล้ว และส่วนเกินมูลค่าหุ้น รวมถึงกำไรสะสม ซึ่งเพิ่มขึ้นตามกำไรสุทธิของบริษัทฯ ดังนั้น หากพิจารณาอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นโดยที่ไม่รวมรายการเจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแล้ว บริษัทฯ จะมีอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเพียง 0.52 เท่า

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565 บริษัทฯ มีหนี้สิน 5,168.53 ล้านบาท และส่วนของผู้ถือหุ้น 2,848.02 ล้านบาท โดยเป็นอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเท่ากับ 1.81 เท่า ทั้งนี้ รายการหลักของหนี้สินคือ (1) เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งรายการดังกล่าวจะเปลี่ยนแปลงไปตามปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี และ (2) หนี้กู้ยืมที่เสนอขายต่อนักลงทุนสถาบันและนักลงทุนรายใหญ่ ขณะที่รายการหลักของส่วนของผู้ถือหุ้นคือ ทุนที่ออกและชำระแล้ว และส่วนเกินมูลค่าหุ้น รวมถึงกำไรสะสม ซึ่งเพิ่มขึ้นตามกำไรสุทธิของบริษัทฯ ดังนั้น หากพิจารณาอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นโดยที่ไม่รวมรายการเจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแล้ว บริษัทฯ จะมีอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเพียง 1.03 เท่า

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2564 บริษัทฯ มีหนี้สิน 4,355.66 ล้านบาท และส่วนของผู้ถือหุ้น 2,691.06 ล้านบาท โดยคิดเป็นอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเท่ากับ 1.62 เท่า ทั้งนี้ รายการหลักของหนี้สิน คือเจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งรายการดังกล่าวจะเปลี่ยนแปลงไปตามปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี ขณะที่รายการหลักของส่วนของผู้ถือหุ้นคือทุนที่ออกและชำระแล้ว และส่วนเกินมูลค่าหุ้นรวมถึงกำไรสะสม ซึ่งเพิ่มขึ้นตามกำไรสุทธิของบริษัทฯ ดังนั้น หากพิจารณาอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นโดยที่ไม่รวมรายการดังกล่าวแล้ว บริษัทฯ จะมีอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเพียง 0.50 เท่า

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 บริษัทฯ มีหนี้สิน 3,515.77 ล้านบาท และส่วนของผู้ถือหุ้น 2,430.79 ล้านบาท โดยคิดเป็นอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเท่ากับ 1.45 เท่า ทั้งนี้ รายการหลักของหนี้สิน คือเจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งรายการดังกล่าวจะเปลี่ยนแปลงไปตามปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี ขณะที่รายการหลักของส่วนของผู้ถือหุ้นคือทุนที่ออกและชำระแล้ว และส่วนเกินมูลค่าหุ้น รวมถึงกำไรสะสม ซึ่งเพิ่มขึ้นตามกำไรสุทธิของบริษัทฯ ดังนั้น หากพิจารณาอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นโดยที่ไม่รวมรายการดังกล่าวแล้ว บริษัทฯ จะมีอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเพียง 0.65 เท่า

ตารางแสดงโครงสร้างรายได้ของบริษัทฯ สำหรับงวด 6 เดือน สิ้นสุด 30 มิถุนายน 2566 และ 3 ปีย้อนหลัง

ประเภท รายได้	ปี						งวด 6 เดือน สิ้นสุด 30 มิถุนายน			
	2563		2564		2565		2565		2566	
	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ
ค่านายหน้า	1,314.75	75.25	1,930.02	80.53	1,563.70	65.15	899.69	80.08	546.83	59.29
ค่าธรรมเนียม และบริการ	122.79	7.03	113.99	4.76	486.12	20.25	52.89	4.71	189.42	20.54

ประเภท รายได้	ปี						งวด 6 เดือน สิ้นสุด 30 มิถุนายน			
	2563		2564		2565		2565		2566	
	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ
ดอกเบี้ย	84.77	4.85	130.22	5.43	185.64	7.73	84.05	7.48	116.04	12.58
กำไรและ ผลตอบแทน จากเครื่องมือ ทางการเงิน	168.83	9.66	165.61	6.91	97.00	4.04	53.63	4.77	38.20	4.14
ส่วนแบ่งกำไร (ขาดทุน) จาก เงินลงทุนใน บริษัทร่วม	5.26	0.30	3.08	0.13	4.10	0.17	0.94	0.08	1.14	0.12
รายได้อื่น	50.70	2.91	53.63	2.24	63.83	2.66	32.29	2.87	30.72	3.33
รายได้รวม	1,747.10	100.00	2,396.55	100.00	2,400.38	100.00	1,123.49	100.00	922.35	100.0

ที่มา : งบการเงินรวมของบริษัทฯ ฉบับตรวจสอบและสอบทานโดยผู้สอบบัญชีอนุญาต

บริษัทฯ มีความประสงค์จะออกและเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ซึ่งมีมูลค่าเสนอขายรวมไม่เกิน 300 ล้านบาท เสนอขายในวงจำกัดแก่ผู้ลงทุนสถาบันและ/หรือผู้ลงทุนรายใหญ่ ตามคำนิยามในประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ต.ที่ กจ. 39/2564 โดยระบุชื่อผู้ถือประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ และจัดซื้อจำกัดการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไว้กับสำนักงาน ก.ล.ต. โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดก หรือคำสั่งศาล ทั้งนี้ บริษัทฯ จะออกและเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นคราวๆ ภายใต้ข้อบังคับข้อกำหนดด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิ”) รวมถึงข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด (“ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคา”)

โดยโครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ของบริษัทฯ ที่เสนอขายในครั้งนี้นี้ มีลักษณะการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอ้างอิงกับหลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง ซึ่งสามารถไถ่ถอนได้เมื่อครบกำหนดอายุ หรือก่อนครบกำหนดอายุขึ้นอยู่กับข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด โดยหลักทรัพย์อ้างอิงได้แก่ (1) หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 หรือ (2) ตะกร้าหลักทรัพย์ (Basket Securities) ซึ่งประกอบด้วยหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET 100 หรือ (3) ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย หรือ (4) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ (Exchange Traded Fund) ที่จดทะเบียนและซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

การบริหารความเสี่ยงที่ใช้ในการออกและเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง บริษัทฯ ดำเนินการฝ่ายควบคุมความเสี่ยงและผลิตภัณฑ์ และฝ่ายควบคุมความเสี่ยงด้านปฏิบัติการ ตามนโยบายการบริหารความเสี่ยงจากคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงของบริษัทฯ ซึ่งมีการติดตาม ทบทวน และปรับปรุงให้ทันสมัยอยู่เสมอ บริษัทฯ ใช้การบริหารความเสี่ยงโดยเน้นบริหารความเสี่ยงทางด้านราคา รวมทั้งการดูแลควบคุมในด้านจำนวนและมูลค่าการเสนอขายในแต่ละขณะ ที่สอดคล้องกับความต้องการของผู้ลงทุน และสอดคล้องกับนโยบายการบริหารความเสี่ยงของบริษัทฯ โดยคำนึงถึงปัจจัยตลาดที่เกี่ยวข้องต่างๆ เช่น

ปัจจัยต่างๆที่ส่งผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง ปริมาณเงินสดที่ต้องใช้ในการบริหารความเสี่ยง ความเสี่ยงด้านคู่สัญญา และความเสี่ยงเนื่องจากธุรกรรมอื่นที่เกี่ยวข้อง

บริษัทฯมีวัตถุประสงค์ที่จะนำเงินที่ได้จากการออกและเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ไปใช้ในการป้องกันความเสี่ยงของการเปลี่ยนแปลงราคาของหลักทรัพย์อ้างอิงที่อาจเกิดขึ้นกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และใช้ในการดำเนินธุรกิจต่างๆของบริษัทฯ รวมถึงการรักษาฐานลูกค้าเดิมและขยายฐานลูกค้าเพิ่มเติม เพื่อเป็นการเพิ่มทางเลือกในการลงทุนแก่นักลงทุน และเพิ่มความสามารถในการให้บริการทางการเงินแบบครบวงจร ทั้งงานด้านนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ ตราสารอนุพันธ์และบริการอื่นๆที่เกี่ยวข้อง ให้สอดคล้องกับความต้องการของลูกค้า

การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีความเสี่ยง ซึ่งผู้สนใจลงทุนควรพิจารณาความเสี่ยงต่างๆที่เกี่ยวข้องด้วยความรอบคอบ ผู้สนใจลงทุนต้องใช้วิจารณญาณของตนเองในการศึกษาข้อมูลผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และข้อมูลที่ปรากฏในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายหลักทรัพย์ รวมทั้งความเสี่ยงที่เกี่ยวข้อง ผู้ที่ได้รับแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายหลักทรัพย์ จะต้องไม่ถือว่าข้อมูลที่ระบุในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายหลักทรัพย์เป็นการให้การศึกษาทางกฎหมาย ธุรกิจ หรือภาษีที่เกี่ยวข้อง ผู้ลงทุนควรปรึกษาที่ปรึกษาทางกฎหมาย ธุรกิจ และภาษีที่เกี่ยวข้อง กับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงด้วยตัวเอง

ผู้ลงทุนควรอ่านรายละเอียดข้อมูลในส่วนที่ 3 และส่วนที่ 4 ก่อนตัดสินใจจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ส่วนที่ 3

ข้อมูลเกี่ยวกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

1. ข้อมูลทั่วไป

1.1. ข้อมูลของบริษัท

ชื่อบริษัท	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) (“บริษัทฯ” หรือ “ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง”)
ประเภทธุรกิจ	ธุรกิจหลักทรัพย์ และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
ที่ตั้งสำนักงานใหญ่	ชั้น 18 อาคาร ดี ออฟฟิศเสส แอท เซ็นทรัลเวิลด์ 999/9 ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330
โทรศัพท์	02 658 9500
โทรสาร	02 658 9110
เว็บไซต์	www.fmsyrus.com
ทะเบียนนิติบุคคลเลขที่	0107547000079
ทุนจดทะเบียน	930,244,840.00 บาท ประกอบด้วยหุ้นสามัญ จำนวน 581,403,025 หุ้น มูลค่าหุ้นละ 1.60 บาท (ณ วันที่ 3 กรกฎาคม 2566)
ทุนที่ออกและชำระเต็มมูลค่า	930,244,840.00 บาท ประกอบด้วยหุ้นสามัญ จำนวน 581,403,025 หุ้น มูลค่าหุ้นละ 1.60 บาท (ณ วันที่ 3 กรกฎาคม 2566)
อันดับความน่าเชื่อถือ	“BBB+ (tha)” แนวโน้ม “Stable” โดยบริษัท ฟิทช์เรตติ้งส์ จำกัด (ข้อมูล ณ วันที่ 29 ธันวาคม 2565)
การผิดนัดชำระ	บริษัทฯ ไม่มีประวัติการผิดนัดชำระหนี้เงินต้นหรือดอกเบี้ยของตราสารหนี้ หรือการผิดนัดชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นและการผิดเงื่อนไขในการปฏิบัติตามข้อกำหนดสิทธิ 3 ปีย้อนหลัง

วัตถุประสงค์การใช้เงิน

บริษัทฯ มีวัตถุประสงค์ที่จะนำเงินที่ได้จากการออกและเสนอขายหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ภายใต้โครงการหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ไปใช้ในการป้องกันความเสี่ยงของการเปลี่ยนแปลงราคาของหลักทรัพย์อ้างอิงที่อาจเกิดขึ้นกับหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง และใช้ในการดำเนินธุรกิจต่างๆของบริษัทฯ รวมถึงการรักษาฐานลูกค้าเดิมและขยายฐานลูกค้าเพิ่มเติม เพื่อเป็นการเพิ่มทางเลือกในการลงทุนแก่นักลงทุน และเพิ่มความสามารถในการให้บริการทางการเงินแบบครบวงจร ทั้งงานด้านนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ ตราสารอนุพันธ์ และบริการอื่นๆที่เกี่ยวข้อง ให้สอดคล้องกับความต้องการของลูกค้า

1.2. ข้อมูลบุคคลอ้างอิง

<u>นายทะเบียนหลักทรัพย์</u>	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
<u>สถานที่ตั้ง</u>	ชั้น 18 อาคาร ดิ ออฟฟิศเคส แอท เซ็นทรัลเวิลด์ 999/9 ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330
โทรศัพท์	02 658 9500
โทรสาร	02 658 9110
เว็บไซต์	www.fnsyrus.com
อีเมล	structuredproducts@fnsyrus.com
<u>ผู้รับประกันโครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง</u>	ไม่มี
<u>ผู้สอบบัญชี</u>	นางสาว วรณวิไล เพชรสร้าง ผู้สอบบัญชีรับอนุญาต เลขทะเบียน 5315 นางสาว บงกต เกรียงพินธุ์อมร ผู้สอบบัญชีรับอนุญาต เลขทะเบียน 6777 นางสาว สมใจ คุณปสุต ผู้สอบบัญชีรับอนุญาต เลขทะเบียน 4499 บริษัท สำนักงาน อีวาย จำกัด
<u>สถานที่ตั้ง</u>	193/136-137 อาคารเลครัชดา ออฟฟิศคอมเพล็กซ์ ชั้น 33 ถนนรัชดาภิเษก แขวงคลองเตย เขตคลองเตย กรุงเทพฯ 10110
โทรศัพท์	02 264 9090
โทรสาร	02 264 0789-90
อีเมล	ey.thailand@th.ey.com
เว็บไซต์	www.ey.com/en_th
<u>สถาบันการเงินที่ติดต่อประจำ</u>	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) สาขาสยามสแควร์ 394 ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330 ธนาคารกรุงไทย สาขานานาเหนือ อาคารนานาเหนือ ชั้น 2 35 ถ.สุขุมวิท แขวงคลองเตย เหนือ เขตวัฒนา กรุงเทพมหานคร 10110 ธนาคารยูโอบี จำกัด (มหาชน) สาขาสยามสแควร์ 410-410/1 ซอยสยามสแควร์ ซอย 6 ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10500

2. ปัจจัยความเสี่ยง

2.1. ความเสี่ยงของบริษัทฯ หรือผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

2.1.1. นโยบายและแผนบริหารความเสี่ยงของบริษัทฯ

บริษัทฯ เล็งเห็นว่า ความเสี่ยงเป็นสิ่งสำคัญที่อาจทำให้บริษัทฯ ได้รับความเสียหายเป็นอย่างมาก หากบริษัทฯ ไม่ได้วัดข้อมูล ประเมินผล และบริหารความเสี่ยง ดังนั้น บริษัทฯ ได้มีการรับรู้และตอบสนองต่อความเสี่ยงในแต่ละด้านเพื่อประโยชน์แก่บริษัท นักลงทุน และผู้มีส่วนได้ส่วนเสีย ดังนี้

บริษัทฯ มีการจัดทำนโยบายบริหารความเสี่ยงที่ครอบคลุมทุกความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจที่บริษัทฯ ดำเนินการเป็นลายลักษณ์อักษรและได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการบริษัท เพื่อให้ความเสี่ยงรวมอยู่ในระดับที่ยอมรับได้ โดยเริ่มจากธุรกิจหลัก ได้แก่ นายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ที่บริษัทมีขั้นตอนในการตรวจสอบลูกค้าแต่ละรายที่จะเปิดบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์กับบริษัททั้งด้านแหล่งที่มาของรายได้และผู้รับผลประโยชน์ที่แท้จริง มีการคำนวณสินทรัพย์ของลูกค้าว่าเป็นไปตามเกณฑ์สำหรับวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ที่ต้องการหรือไม่ โดยบริษัทมีการกระจายอำนาจการอนุมัติวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ไปยังกรรมการบริหารสูงสุดของสายงานธุรกิจต่างๆ จนถึงระดับคณะกรรมการบริษัท ขึ้นอยู่กับจำนวนวงเงินที่ลูกค้าต้องการ เพื่อความคล่องตัวในการบริการลูกค้า และมีการควบคุมความเสี่ยงด้านเครดิตให้อยู่ในระดับที่เหมาะสม นอกจากนี้ บริษัทมีการติดตามการใช้วงเงินและหลักประกันของลูกค้าอย่างสม่ำเสมอ หากหลักประกันที่มีอยู่ไม่เพียงพอตามเกณฑ์ที่กำหนดไว้ บริษัทมีการกำหนดขั้นตอนปฏิบัติงานอย่างชัดเจนในการเรียกหลักประกันเพิ่มเติมจากลูกค้าหรืออาจบังคับขายหลักทรัพย์เพื่อนำเงินมาชำระหนี้ ซึ่งในการติดตามสถานะการใช้วงเงินและหลักประกันของลูกค้าที่มีบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์กับบริษัท บริษัทได้มีการนำเอาระบบเทคโนโลยีสารสนเทศเข้ามาช่วยให้การติดตามมีประสิทธิภาพมากขึ้น ด้วยเหตุผลที่กล่าวมาข้างต้น ทำให้บริษัทสามารถควบคุมความเสี่ยงทางด้านเครดิตให้อยู่ในระดับที่เหมาะสมสำหรับการดำเนินธุรกิจนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์

สำหรับความเสี่ยงด้านตลาดจากการดำเนินธุรกิจที่หลากหลายของบริษัทฯ เช่น ธุรกิจลงทุนเพื่อบัญชีบริษัท (Proprietary Trading) ธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrant) ธุรกิจซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trading) นั้น บริษัทได้มีการกำหนดนโยบายบริหารความเสี่ยงสำหรับแต่ละธุรกิจโดยตรง ทำให้สามารถประเมินความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจนั้นๆ ได้อย่างรอบด้าน และสามารถกำหนดกลยุทธ์เพื่อใช้ควบคุมความเสี่ยงเหล่านั้น เช่น การกำหนดขอบเขตหลักทรัพย์ที่สามารถลงทุนได้ (Investment Universe) ที่จะพิจารณาทั้งด้านสภาพคล่องและความผันผวนของราคาของแต่ละหลักทรัพย์ การจำกัดผลขาดทุนสูงสุดที่ยอมรับได้ (Stop-Loss Limit) การกำหนดวงเงินลงทุน (Credit Limit) การกำหนดเกณฑ์การกระจุกตัว (Concentration Limit) การกำหนดเกณฑ์ค่าความเสี่ยงเฉพาะ (Delta Limit, Gamma Limit, Vega Limit) การจัดทำรายงานสถานะความเสี่ยงในแต่ละธุรกิจ ณ สิ้นวันทำการ รวมถึงการวางแผนทางปฏิบัติการแก้ไขกรณีที่เกิดเหตุการณ์ค่าความเสี่ยงต่างๆ เกินเกณฑ์ที่กำหนด

สำหรับความเสี่ยงด้านสภาพคล่องทางการเงิน บริษัทฯ มีการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิในทุกวันทำการ เพื่อควบคุมและติดตามสถานะว่ามีแนวโน้มที่บริษัทจะไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ตามเกณฑ์ที่กำหนดหรือไม่ นอกจากนี้ บริษัทยังมีการกำหนดให้มีการทดสอบก่อนการทำการธุรกรรมที่อาจส่งผลกระทบต่อระดับเงินกองทุนของบริษัทอย่างมีนัยสำคัญ ว่าระดับเงินกองทุนในปัจจุบันเพียงพอต่อการรองรับธุรกรรมนั้นๆ หรือไม่ รวมถึงมีการกำหนดแผนรองรับฉุกเฉินกรณีที่บริษัทไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ตามเกณฑ์ เพื่อลดผลกระทบต่อ การดำเนินการตามแผนธุรกิจของบริษัท

สำหรับความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงานบริษัทฯ กำหนดให้แต่ละฝ่ายงานมีการจัดทำคู่มือการปฏิบัติงานเพื่อให้สามารถปฏิบัติงานได้อย่างถูกต้องครบถ้วนตามที่ นอกจากนี้ บริษัทฯ ยังมีการจัดทำแผนรองรับการดำเนินธุรกิจอย่างต่อเนื่อง (Business Continuity Plan : BCP) และทำการทดสอบเป็นประจำทุกปี เพื่อให้สามารถรับมือกับสถานการณ์ฉุกเฉินต่างๆ ได้อย่างมีประสิทธิภาพซึ่งจะช่วยลดความเสี่ยงด้านนี้ได้

2.1.2. ปัจจัยความเสี่ยงต่อการดำเนินธุรกิจของบริษัทฯ

(1) ความเสี่ยงจากความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ

รายได้หลักของบริษัทฯ มาจากรายได้ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ ซึ่งมีความสัมพันธ์กับภาวะเศรษฐกิจ สภาพของตลาดเงินและตลาดทุน ปริมาณการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ รวมถึงความเชื่อมั่นของนักลงทุนทั้งในประเทศและต่างประเทศ ผลการดำเนินงานของธุรกิจหลักทรัพย์ฯ จึงขึ้นอยู่กับหลายปัจจัย เช่น สถานการณ์ทางการเมืองและภาวะเศรษฐกิจทั้งในประเทศและต่างประเทศ ซึ่งอยู่เหนือการควบคุมของบริษัทฯ ซึ่งหากเกิดความผันผวนจะส่งผลกระทบต่อมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ ทำให้รายได้ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ผันผวนตามไปด้วย เช่น เมื่อกำหนดให้ปัจจัยอื่นๆ คงที่แล้ว หากมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ลดลง จะส่งผลให้รายได้ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ลดลงด้วย แต่หากมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์เพิ่มขึ้น จะส่งผลให้รายได้ค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์เพิ่มขึ้นเช่นกัน ซึ่งแนวโน้มความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์ฯ มีมาอย่างต่อเนื่อง อีกทั้ง แนวโน้มทิศทางอัตราดอกเบี้ยสหรัฐที่เป็นขาขึ้นจากอัตราเงินเฟ้อที่สูงเป็นประวัติการณ์ที่จะส่งผลกระทบต่อตลาดหุ้นทั่วโลก อย่างไรก็ตาม ปัจจัยดังกล่าวยังไม่มีความแน่นอนในทิศทางของผลลัพธ์ รวมถึงอาจมีปัจจัยความเสี่ยงภายนอกอื่นๆ ที่สามารถส่งผลกระทบต่อความผันผวนของตลาด

จากสาเหตุข้างต้น บริษัทฯ มีแผนลดการพึ่งพิงรายได้จากค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ ด้วยการเพิ่มรายได้จากธุรกิจอื่นๆ เช่น ธุรกิจออกขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants) พร้อมกับการนำเครื่องมือต่างๆ มาใช้ในการบริหารความเสี่ยงจากความผันผวนที่ส่งผลกระทบต่อรายได้จากธุรกิจนี้ เช่น การกำหนดระดับสูงสุดของค่าความเสี่ยงที่ยอมรับได้ในด้านต่างๆ เช่น Stop-Loss Limit หรือการทำ Stress Test เพื่อประเมินความเสียหายในกรณีที่สถานะตลาดมีความผันผวนสูง นอกจากนี้ ยังมีการกำหนดให้มีการทบทวนค่าความเสี่ยงที่ยอมรับได้อย่างสม่ำเสมอ

(2) ความเสี่ยงจากการแข่งขันในธุรกิจหลักทรัพย์

ธุรกิจหลักทรัพย์เป็นธุรกิจที่มีการแข่งขันสูง เนื่องจากมีลักษณะการให้บริการที่ใกล้เคียงกัน และมีจำนวนผู้ประกอบการค่อนข้างมาก อีกทั้ง การเปิดเสรีอัตราค่านายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ ทำให้การแข่งขันด้านราคาถูก

นำมาใช้เป็นกลยุทธ์ในการดำเนินธุรกิจ โดยในอนาคต การดำเนินธุรกิจหลักทรัพย์มีแนวโน้มที่จะเพิ่มสูงขึ้น ซึ่งจะมีการพัฒนาการบริการของแต่ละบริษัท ด้วยการนำเทคโนโลยีเข้ามามีบทบาทในการให้บริการมากขึ้น เพื่อตอบสนองต่อความต้องการและความสะดวกสบายให้แก่ลูกค้าหรือนักลงทุน ซึ่งอาจทำให้บริษัทฯ ต้องมีการปรับเปลี่ยนกลยุทธ์เพื่อดึงดูดลูกค้า รวมถึงอาจมีการลงทุนในการพัฒนาผลิตภัณฑ์และบริการของบริษัทให้มีประสิทธิภาพและตอบสนองตรงต่อความต้องการของนักลงทุนเพิ่มมากขึ้น เพื่อมิให้ส่งผลกระทบต่อรายได้ของบริษัท

เพื่อรองรับผลกระทบอาจที่เกิดขึ้นดังกล่าวบริษัทฯ ได้เตรียมความพร้อมด้วยการสร้างความแข็งแกร่งทางธุรกิจ โดยมีการปรับแผนกลยุทธ์ให้สอดคล้องกับสถานการณ์ต่างๆ อย่างทันท่วงที และมุ่งเน้นคุณภาพและมาตรฐานในการให้บริการ พัฒนาความรู้ความสามารถของบุคลากรอยู่เสมอๆ รวมถึงพัฒนาระบบเทคโนโลยีสารสนเทศให้ล้ำสมัยและมีความปลอดภัย สร้างสรรค์ผลิตภัณฑ์และบริการใหม่ๆ เพื่ออำนวยความสะดวกและตอบสนองความต้องการของลูกค้า

(3) ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสารอนุพันธ์

ธุรกิจนายหน้าซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีความเสี่ยงสูงจากความผันผวนของราคาและความซับซ้อนของลักษณะสินค้า โดยแนวโน้มการผันผวนของราคาขึ้นอยู่กับภาวะทางเศรษฐกิจทั้งในและต่างประเทศที่ส่งผลกระทบต่อราคาของสินทรัพย์อ้างอิง ซึ่งภาพรวมของแนวโน้มในปี 2566 การฟื้นตัวของเศรษฐกิจโลกยังคงชะลอตัว ภายใต้อิทธิพลของความไม่แน่นอนที่สูงขึ้น เนื่องจากบางประเทศเข้าสู่ภาวะเศรษฐกิจถดถอย ซึ่งกำลังเผชิญกับปัญหาอัตราเงินเฟ้อที่สูงต่อเนื่อง หรือลดลงช้า อุปสงค์บริการที่จะเพิ่มขึ้น วิกฤติพลังงานที่ยืดเยื้อ และนโยบายการเงินทั่วโลกที่ค่อนข้างเข้มงวด อาจส่งผลให้ตลาดการเงินผันผวนสูงขึ้น สภาพคล่องในตลาดการเงินและภาวะการเงินโลกตึงตัวขึ้นมาก โดยประเทศไทยอาจได้รับประโยชน์ภาคการท่องเที่ยว เนื่องจากการผ่อนคลายมาตรการล็อกดาวน์และการควบคุมการเดินทาง ทำให้เริ่มฟื้นตัวอย่างช้าๆ แต่ก็ยังคงเผชิญกับปัญหาเงินเฟ้อและการเพิ่มขึ้นของอัตราดอกเบี้ย อีกทั้งราคาสินค้าปรับสูงขึ้น จากการผลักราคาต้นทุนต่างๆ ของผู้ผลิตไปยังผู้บริโภค และเป็นปัจจัยที่ไม่อาจควบคุมได้ ทำให้เกิดความเสี่ยงที่สูงขึ้นจากความผันผวนของราคาสินทรัพย์อ้างอิง ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อสถานะหลักประกันของบริษัทฯ และก่อให้เกิดความเสียหายทางการเงินต่อ บริษัทฯ ได้

บริษัทฯ ได้มีการกำหนดการบริหารความเสี่ยงที่เข้มงวดและรัดกุม โดยคัดเลือกลูกค้าที่มีความรู้ มีประสบการณ์การลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และพิจารณาวงเงินให้เหมาะสมกับฐานะและความสามารถในการชำระหนี้ของลูกค้า รวมถึงได้กำหนดการวางเงินประกัน (Margin) ให้เพียงพอก่อนส่งคำสั่งซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าทั่วไป และกำหนดขั้นตอนการปฏิบัติงานที่ชัดเจนในการเรียกหลักประกันเพิ่มหรือการบังคับปิดฐานะ โดยมีการตรวจสอบสถานะ Intraday Force ณ เวลา 12.30 น. ของทุกวันทำการ นอกจากนี้ บริษัทฯ ยังได้จัดอบรมเพื่อให้ความรู้ และสร้างความเข้าใจในการให้บริการในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าให้กับบุคลากรของบริษัทอย่างต่อเนื่อง

ในส่วนของธุรกรรม SSF Block Trade นอกจากจะมีการขึ้นตอนการกำกับดูแลความเสี่ยงตามรายละเอียดข้างต้นแล้ว บริษัทฯ ยังกำหนดให้ลูกค้าที่ต้องการทำธุรกรรมต้องลงนามในบันทึกแนบท้ายสัญญาแต่งตั้งตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าก่อนเริ่มทำธุรกรรม เพื่อรับทราบถึงข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของธุรกรรม และบริษัทฯ ได้กำหนดการบริหารความเสี่ยงภายใน (Risk Policy) เป็นการควบคุมความเสี่ยงเฉพาะธุรกรรมนี้เพิ่มเติมด้วย

(4) ความเสี่ยงจากการขัดข้องของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ

ปัจจุบันความก้าวหน้าและการแข่งขันด้านการพัฒนาเทคโนโลยีสารสนเทศในด้านต่างๆ มีส่วนสำคัญอย่างมาก โดยถือเป็นกลไกสำคัญในการขับเคลื่อนธุรกิจให้บรรลุเป้าหมาย สอดคล้องกับ วิสัยทัศน์ พันธกิจ และกลยุทธ์ของบริษัทฯ เพิ่มประสิทธิภาพและศักยภาพในการแข่งขัน ตอบสนองความต้องการของลูกค้าด้วยผลิตภัณฑ์และบริการที่หลากหลายได้อย่างสะดวกและรวดเร็วยิ่งขึ้น อย่างไรก็ตาม ความซับซ้อนและขยายตัวทางด้านเทคโนโลยีสารสนเทศนี้ ทำให้บริษัทฯ ต้องเผชิญความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศมากขึ้น ได้แก่ ความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการนำเทคโนโลยีสารสนเทศมาใช้ในการดำเนินธุรกิจ และความเสี่ยงที่เกิดจากภัยคุกคามทางไซเบอร์ เป็นต้น ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อผลการดำเนินงาน ชื่อเสียง และความเชื่อมั่นในการใช้บริการและผลิตภัณฑ์ต่างๆ

เพื่อมุ่งเน้นการเสริมสร้างประสิทธิภาพในกระบวนการดำเนินงาน การพัฒนานวัตกรรมทางการเงินผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ ซึ่งช่วยลดต้นทุนและเพิ่มศักยภาพในการแข่งขันทางธุรกิจ อย่างต่อเนื่อง บริษัทฯ จึงได้ให้ความสำคัญในการจัดเตรียมระบบเทคโนโลยีสารสนเทศให้พร้อมรับการเปลี่ยนแปลงที่เป็นไปอย่างรวดเร็ว โดยการสรรหาเลือกใช้เทคโนโลยีสารสนเทศที่มีคุณภาพ มีประสิทธิภาพ และพัฒนาระบบต่างๆ อยู่เสมอ เช่น การพัฒนาแอปพลิเคชัน One Stop Trading Platform กล่าวคือ การนำ Product & Services ต่างๆ ของ บริษัทฯ ไม่ว่าจะ เป็นระบบการซื้อขาย Equity Derivatives Global Trading Mutual Fund และอื่นๆ รวมไว้ในแอปพลิเคชันเดียวกัน ซึ่งจะช่วยอำนวยความสะดวก ตอบโจทย์การใช้งานของลูกค้าได้ครบถ้วนภายในทีเดียว อีกทั้ง บริษัทฯ ยังได้อัปเดต ปรับเปลี่ยนระบบงานและอุปกรณ์ต่างๆ เพื่อรองรับการเปลี่ยนระบบซื้อขายใหม่ของตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่มีการเริ่มใช้งานในเดือนพฤษภาคม 2566

ภายใต้สภาวะแวดล้อมด้านธุรกิจหลักทรัพย์ที่ปัจจุบันมีความผันผวนสูงและยากต่อการคาดเดา บริษัทฯ ต้องปรับตัวให้เท่าทัน และต้องเผชิญกับความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศในหลายมิติ และส่งผลกระทบต่อความรุนแรงและเป็นวงกว้างมากขึ้น ดังเช่น เหตุการณ์ภัยคุกคามทางไซเบอร์ที่เกิดขึ้นทั่วโลก ไม่ว่าจะเป็นกรณีการโจมตีไปยังผู้พัฒนาซอฟต์แวร์ Supply chain attacks การเรียกค่าไถ่ด้วย Ransomware หรือ Malware ภัยจากการหลอกลวงโดยใช้อีเมล Phishing หรือ ภัยจากการถูกโจมตี DDoS เพื่อขัดขวางการทำงานของระบบจนทำให้ระบบไม่สามารถให้บริการได้ เป็นต้น ดังนั้น เพื่อให้การกำกับดูแลและการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ เป็นไปตามประกาศของสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ.37/2559 ลงวันที่ 12 กันยายน 2559 ว่าด้วยเรื่อง ข้อกำหนดในรายละเอียดเกี่ยวกับการจัดให้มีระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ โดยมีการบริหารจัดการความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศอย่างมีประสิทธิภาพ มีความมั่นคงปลอดภัย และสามารถดำเนินงานได้อย่างต่อเนื่อง รวมทั้งป้องกันปัญหาที่อาจเกิดขึ้นจากการใช้งานระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ และการสื่อสารที่ไม่ถูกต้อง ตลอดจนการถูกคุกคามจากภัยต่างๆ ซึ่งอาจก่อให้เกิดความเสียหายแก่บริษัทฯ อันเป็นความผิดตามพระราชบัญญัติว่าด้วยการกระทำความผิดเกี่ยวกับคอมพิวเตอร์ พ.ศ. 2560 และกฎหมายอื่นที่เกี่ยวข้อง บริษัทฯ ได้กำหนดนโยบายและขั้นตอนการปฏิบัติงานในการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบเทคโนโลยีสารสนเทศไว้ โดยแบ่งเป็นนโยบาย 3 นโยบาย และขั้นตอนการปฏิบัติ 26 เล่ม โดยมีสาระสำคัญเกี่ยวกับการบริหารจัดการความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศอย่างเป็นระบบและต่อเนื่อง เพื่อยกระดับความพร้อมรับมือต่อความเสี่ยงและภัยคุกคามไซเบอร์ที่บริษัทฯ อาจกำลังเผชิญ โดยได้กำหนดให้มีการกำกับดูแลและบริหารจัดการบุคลากร กระบวนการ และการนำเทคโนโลยีสารสนเทศมาใช้ ภายใต้การบริหารความเสี่ยงอย่างเหมาะสมและเพียง

พอที่จะรองรับกับความเสี่ยงที่อาจจะเกิดขึ้น มีการประเมินความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศให้เท่าทันต่อการเปลี่ยนแปลงความเสี่ยงขององค์กร (Company risk profile) ที่อาจจะเกิดจากปัจจัยทั้งภายในและภายนอกองค์กร เช่น การออกผลิตภัณฑ์ใหม่ การเปลี่ยนแปลงมาตรฐานและข้อกำหนดทางด้านเทคโนโลยีสารสนเทศในอุตสาหกรรม การตรวจพบหรือมีข้อบ่งชี้ด้านความเสี่ยงทางเทคโนโลยีใหม่เกิดขึ้น เป็นต้น

นอกจากนั้น บริษัทฯ ได้กำหนดกรอบการบริหารความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศที่ชัดเจน พร้อมทั้งกำหนดดัชนีชี้วัด เพื่อให้สามารถติดตามและประเมินแนวโน้มความเสี่ยง และสามารถทบทวนมาตรการควบคุมความเสี่ยงได้อย่างมีประสิทธิภาพ มีการสื่อสารแผนการบริหารความเสี่ยงไปยังทุกส่วนงานที่เกี่ยวข้องให้รับทราบ และร่วมกันกำหนดแนวทางในการจัดการความเสี่ยง เพื่อให้ความเสี่ยงที่เหลืออยู่ (Residual risk) อยู่ในระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (Risk appetite) นอกจากนี้ยังมีการสื่อสารเพื่อสร้างวัฒนธรรมและพฤติกรรมร่วมของคนในองค์กรให้ตระหนักถึงความเสี่ยงอย่างรอบด้านและเป็นรูปธรรม เพื่อให้มั่นใจว่า บริษัทฯ สามารถรับมือ หากเกิดเหตุการณ์ภัยคุกคามในรูปแบบต่างๆ ได้อย่างทันท่วงที เพื่อให้ธุรกิจสามารถดำเนินการไปได้อย่างต่อเนื่อง และเกิดประสิทธิภาพสูงสุด

(5) ความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและหนี้สูญ

การดำเนินธุรกิจด้านการเงินตามปกติมีความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระเงินของลูกค้าและการก่อให้เกิดหนี้สูญ ซึ่งมีสาเหตุจากปัจจัยทางเศรษฐกิจโดยรวมของประเทศ ซึ่งส่งผลกระทบต่อสินทรัพย์ การลงทุน และโครงสร้างทางการเงิน ทำให้เกิดการผิดนัดชำระหนี้ของลูกค้า หรือมีสาเหตุจากคุณภาพของหลักประกัน คุณภาพของลูกค้า และกระแสเงินสดในอนาคตที่จะนำมาใช้ในการชำระหนี้ โดยการผิดนัดชำระหนี้จะกลายเป็นค่าใช้จ่ายของทางบริษัทซึ่งกระทบต่อกำไรและรายได้ รวมถึงสภาพคล่องของบริษัท ทั้งนี้ แนวโน้มของเศรษฐกิจในปีหน้าอาจมีการฟื้นตัวจากปีก่อนซึ่งอาจทำให้การผิดนัดชำระหนี้มีอัตราที่ลดลง อย่างไรก็ตาม ขึ้นอยู่กับปัจจัยภายนอกอื่นๆ ด้วย ซึ่งอาจไม่สามารถระบุหรือคาดการณ์แนวโน้มได้อย่างแน่ชัด

ทั้งนี้ บริษัทฯ มีการลดความเสี่ยงจากการผิดนัดชำระราคา โดยได้พิจารณาคัดเลือกลูกค้าที่มีคุณภาพ มีฐานะทางการเงินที่มั่นคง พร้อมทั้งนี้ได้มีการกำหนดหลักเกณฑ์การพิจารณาวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ให้เป็นตามเกณฑ์ของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย อีกทั้งยังมีการดำเนินการพิจารณาทบทวนวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ให้เหมาะสมกับฐานะการเงินของลูกค้า กรณีลูกค้ามีการผิดนัดชำระราคา บริษัทฯ จะมีขั้นตอนในการดำเนินการอย่างมีประสิทธิภาพ ซึ่งโดยทั่วไปแล้ว บริษัทฯ สามารถบังคับขายหลักทรัพย์เพื่อชำระหนี้ของลูกค้าได้ทันที เนื่องจากลูกค้าจะมีหลักทรัพย์ในบัญชี สำหรับประเภทบัญชีที่มีเครดิตทอเมหรือมีเงินกู้ ประกอบกับตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้กำหนดให้ลูกค้ารายย่อยทุกรายต้องวางหลักประกันสำหรับการซื้อขายหลักทรัพย์ในบัญชีเงินสดไม่ต่ำกว่าร้อยละ 20 ของวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์

นอกจากนี้ บริษัทฯ ได้มีบริการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์แก่ลูกค้า (ประเภทบัญชีเครดิตบาลานซ์) ซึ่งมีหลักเกณฑ์ในการพิจารณาอนุมัติวงเงินและการควบคุมติดตามอย่างเคร่งครัดและรัดกุม โดยมีการคัดเลือกหลักทรัพย์ และกำหนดอัตรามาร์จิ้นเริ่มต้น (Initial Margin Rate) ตลอดจนมีการทบทวนรายชื้อหลักทรัพย์อย่างสม่ำเสมอ นอกจากนี้ บริษัทฯ กำหนดให้ลูกค้าต้องวางหลักประกันไว้ในบัญชีเครดิตบาลานซ์และหากทรัพย์สินของ

ลูกค้ามีมูลค่าลดลงต่ำกว่าอัตรามาร์จิ้นรักษาสภาพ บริษัทฯ จะดำเนินการเรียกหลักประกันเพิ่มหรือบังคับขายโดยพลัน แล้วแต่กรณี

(6) ความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์

แม้ว่าการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์สามารถสร้างรายได้ให้แก่ บริษัทฯ และเป็นปัจจัยหนึ่งในการรักษาและขยายฐานลูกค้า แต่ บริษัทฯ มีความเสี่ยงในฐานะผู้รับประกันการจำหน่ายหากไม่สามารถจำหน่ายหลักทรัพย์ได้หมดตามที่รับประกันไว้ โดย บริษัทฯ จะต้องรับหลักทรัพย์ที่เหลือจากการจำหน่ายเข้าไปบัญชีการลงทุนของ บริษัทฯ อันอาจทำให้ บริษัทฯ ต้องรับรู้ผลขาดทุนหากราคาของหลักทรัพย์ดังกล่าวภายหลังที่เข้าซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ แล้ว ลดลงต่ำกว่าราคาที่รับประกันการจำหน่าย นอกจากนี้ อาจส่งผลกระทบต่อสภาพคล่องของ บริษัทฯ อีกด้วย โดยความเสี่ยงที่เกิดขึ้นนี้อาจเป็นผลมาจากปัจจัยต่างๆ เช่น การกำหนดราคาขายหลักทรัพย์ที่ไม่เหมาะสมกับความต้องการของนักลงทุน และความไม่แน่นอนในตลาดเงินและตลาดทุน เป็นต้น

เพื่อป้องกันความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้น บริษัทฯ จึงให้ความสำคัญอย่างมากในการคัดเลือกลูกค้า โดยจะทำการศึกษาข้อมูลเบื้องต้นของบริษัทผู้เสนอขายอย่างละเอียด พิจารณาถึงลักษณะการประกอบธุรกิจ ภาวะอุตสาหกรรมและการแข่งขัน ผลการดำเนินงาน และแนวโน้มผลการดำเนินงานในอนาคต เพื่อพิจารณาความน่าสนใจและจุดเด่นของบริษัทผู้เสนอขายหลักทรัพย์ รวมถึงประเมินความสนใจของลูกค้าและผู้ลงทุน โดยมีกระบวนการในการกำหนดราคาเสนอขายที่เหมาะสม สอดคล้องกับผลประกอบการ และภาวะตลาดหลักทรัพย์ในขณะนั้น และก่อนการรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์ ฝ่ายวาณิชธนกิจจะต้องเสนอเรื่องต่อคณะกรรมการบริหารหรือคณะกรรมการบริษัท แล้วแต่กรณี เพื่อพิจารณาอนุมัติการเข้าร่วมจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายทุกครั้ง ซึ่งจะคำนึงถึงผลกระทบต่อการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องของบริษัท ทั้งนี้ จากการดำเนินงานที่ผ่านมา บริษัทฯ ไม่เคยประสบปัญหาอันสืบเนื่องจากความเสี่ยงจากการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหลักทรัพย์ อีกทั้ง บริษัทฯ มีการดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (Net Capital Rule: NCR) ในอัตราที่สูงเกินกว่าเกณฑ์ที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนดมาโดยตลอด

(7) ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

(7.1) ความเสี่ยงเกี่ยวกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ความเสี่ยงจากความผันผวนของราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

เนื่องจากราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีการเปลี่ยนแปลงอย่างรวดเร็ว และมีความซับซ้อนในการหาราคาทฤษฎีที่แท้จริงเพราะขึ้นกับปัจจัยหลายประการที่ส่งผลกระทบต่อ โดยใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นผลิตภัณฑ์ทางการเงินที่ใช้เงินลงทุนต่ำแต่ให้ผลตอบแทนสูง ซึ่งในขณะเดียวกันผู้ลงทุนมีโอกาสที่จะขาดทุนสูงด้วยเช่นกัน หากทิศทางราคาเป็นไปในทิศทางตรงกันข้ามกับที่ผู้ลงทุนคาดการณ์ไว้ โดยการขาดทุนจะถูกจำกัดเท่ากับจำนวนเงินที่ผู้ลงทุนใช้ในการซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ดังนั้น การลงทุนในผลิตภัณฑ์ดังกล่าวจึงมีความเสี่ยงซึ่งผู้ลงทุนควรศึกษาทำความเข้าใจก่อนทำการลงทุนอย่างละเอียด โดยปัจจัยที่มีผลกระทบต่อเปลี่ยนแปลงของราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ประกอบด้วย

- อุปสงค์และอุปทานของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ : ราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจปรับตัวเพิ่มขึ้นหรือลดลงอย่างรวดเร็ว ขึ้นกับปริมาณความต้องการในการซื้อและขาย (อุปสงค์และอุปทาน) ของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ณ ขณะนั้น

- ราคาหลักทรัพย์หรือราคาดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง (เมื่อปัจจัยอื่นๆ คงที่) : (1) กรณีที่ราคาหลักทรัพย์หรือราคาดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงปรับตัวเพิ่มขึ้น จะส่งผลให้ราคา Call Warrant ปรับตัวเพิ่มขึ้น ขณะที่ราคา Put Warrant ปรับตัวลดลง และ (2) กรณีที่ราคาหลักทรัพย์หรือราคาดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงปรับตัวลดลง จะส่งผลให้ราคา Call Warrant ปรับตัวลดลง ในขณะที่ราคา Put Warrant ปรับตัวเพิ่มขึ้น
- ราคาใช้สิทธิ (เมื่อปัจจัยอื่นๆ คงที่) : (1) กรณีที่ราคาใช้สิทธิปรับตัวสูงขึ้น จะส่งผลให้ราคา Call Warrant ปรับตัวลดลง ขณะที่ราคา Put Warrant ปรับตัวเพิ่มขึ้น และ (2) กรณีที่ราคาใช้สิทธิปรับตัวลดลง จะส่งผลให้ราคา Call Warrant ปรับตัวเพิ่มขึ้น ขณะที่ราคา Put Warrant ปรับตัวลดลง
- ความผันผวนของราคาหลักทรัพย์หรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง (เมื่อปัจจัยอื่นๆ คงที่) : (1) กรณีที่ความผันผวนของราคาหลักทรัพย์หรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงปรับตัวเพิ่มขึ้น ราคา Call Warrant และ Put Warrant อาจปรับตัวสูงขึ้นด้วย และ (2) กรณีที่ความผันผวนของราคาหลักทรัพย์หรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงปรับตัวลดลง ราคา Call Warrant และ Put Warrant อาจปรับตัวลดลงด้วย
- อายุคงเหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (เมื่อปัจจัยอื่นๆ คงที่) : เมื่ออายุคงเหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ลดน้อยลง ราคา Call Warrant และ Put Warrant จะปรับตัวลดลงตามไปด้วย
- อัตราดอกเบี้ย (เมื่อปัจจัยอื่นๆ คงที่) : (1) กรณีที่อัตราดอกเบี้ยปรับตัวเพิ่มขึ้น ราคา Call Warrant จะปรับตัวเพิ่มขึ้น ขณะที่ราคา Put Warrant จะปรับตัวลดลง และ (2) กรณีที่อัตราดอกเบี้ยปรับตัวลดลง ราคา Call Warrant จะปรับตัวลดลง ขณะที่ราคา Put Warrant จะปรับตัวเพิ่มขึ้น
- อัตราเงินปันผลของหลักทรัพย์อ้างอิง (เมื่อปัจจัยอื่นๆ คงที่) : (1) กรณีที่อัตราเงินปันผลปรับตัวเพิ่มขึ้น ราคา Call Warrant จะปรับตัวลดลง ขณะที่ราคา Put Warrant อาจปรับตัวเพิ่มขึ้น และ (2) กรณีที่อัตราเงินปันผลปรับตัวลดลง ราคา Call Warrant จะปรับตัวเพิ่มขึ้น ขณะที่ราคา Put Warrant อาจปรับตัวลดลง

ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่นที่ทำการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ อาจมีความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง เนื่องจากจำนวนที่ถูกรอกออกมาในแต่ละรุ่นมีปริมาณน้อย เมื่อเทียบกับหลักทรัพย์ทั่วไปที่ทำการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ นอกจากนี้ สภาพคล่องของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจลดน้อยลงไป เมื่อการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงปรับตัวลดลง

อย่างไรก็ดี ผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market Maker) จะทำหน้าที่ในการส่งคำสั่งเสนอซื้อและเสนอขายเพื่อควบคุมราคา และปริมาณ ให้เป็นไปตามข้อกำหนดที่ระบุไว้ในข้อกำหนดด้วยสิทธิ เพื่อให้ผู้ลงทุนสามารถทำการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้เมื่อต้องการ ทั้งนี้ ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลจากแบบ 69-DW-Full และ/หรือ แบบ 69-DW-Short รวมถึงข้อกำหนดสิทธิโดยละเอียดก่อนตัดสินใจลงทุน

(7.2) ความเสี่ยงที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง

กรณีที่บริษัทเป็นผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงให้สิทธิพิเศษต่างๆ แก่ผู้ถือหุ้นเดิม

บริษัทฯ อาจทำการปรับสิทธิให้กับผู้ลงทุน โดยการเปลี่ยนแปลงราคาใช้สิทธิ และ/หรือ อัตราใช้สิทธิต่อหน่วย สำหรับใบสำคัญสิทธิอนุพันธ์ที่หลักทรัพย์อ้างอิงเป็นหุ้น โดยคำนวณจากสูตรที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิ ในกรณีที่บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง (บริษัทอ้างอิง) ให้สิทธิพิเศษต่างๆ แก่ผู้ถือหุ้นเดิม ซึ่งได้แก่ การ

จัดสรรหุ้นใหม่ให้ผู้ถือหุ้นเดิมของบริษัทอ้างอิง การจ่ายหุ้นปันผลของบริษัทอ้างอิง การจ่ายเงินปันผลของบริษัทอ้างอิง หรือการแบ่งหรือรวมหุ้นของบริษัทอ้างอิง

การถูกระงับหรือหยุดการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงหรือการหยุดการคำนวณดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง

หลักทรัพย์อ้างอิงใดที่ถูกระงับหรือหยุดการซื้อขาย โดยการประกาศขึ้นเครื่องหมาย Suspension (SP) หรือ Halt (H) จะทำส่งผลให้โบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่อ้างอิงหลักทรัพย์ดังกล่าวถูกระงับการซื้อขายไปด้วย ผู้ลงทุนจะไม่สามารถทำการซื้อขายโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ในช่วงเวลาดังกล่าว รวมไปถึงในกรณีที่หลักทรัพย์อ้างอิงเป็นดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงที่มีการหยุดการคำนวณค่าดัชนี ก็จะทำให้ส่งผลต่อโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เช่นเดียวกัน

การเพิกถอนหลักทรัพย์อ้างอิงจากการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ

การเพิกถอนหลักทรัพย์อ้างอิงจากการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ ก่อนวันครบกำหนดอายุของโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ บริษัทฯ จะทำการเลื่อนวันครบกำหนดอายุของโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เข้ามาให้เร็วขึ้น ส่งผลให้อายุที่คงเหลือของโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ลดลงอย่างรวดเร็ว และอาจจะทำให้ราคาโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ลดลงอย่างรวดเร็วเช่นกัน

การชำระบัญชีของบริษัทอ้างอิง

ในกรณีที่ประชุมผู้ถือหุ้นของบริษัทอ้างอิงมีมติให้เลิกบริษัทอ้างอิง หรือแต่งตั้งผู้ชำระบัญชี หรือศาลมีคำสั่งถึงที่สุดให้เลิกบริษัทอ้างอิง หรือให้พิทักษ์ทรัพย์เด็ดขาด กรณีโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ประเภทสิทธิในการซื้อ (Call warrant) ที่ยังไม่ได้ใช้สิทธิทั้งหมดจะถูกยกเลิกและไม่สามารถนำไปใช้สิทธิตามโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้อีก โดยโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะถูกยกเลิก ณ วันที่ที่ประชุมผู้ถือหุ้นของบริษัทอ้างอิงมีมติ หรือตามวันที่ศาลกำหนดหรือมีคำสั่ง แล้วแต่กรณี โดยการยกเลิกดังกล่าวจะผลกระทบทำให้มูลค่าของโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ลดลงไปในทันที กรณีโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ประเภทสิทธิในการขาย (Put warrant) ให้ผู้ออกโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ประกาศแจ้งราคายุติธรรมของหลักทรัพย์อ้างอิงให้ผู้ถือโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ทราบภายในห้าสิบ (50) วันหลังจากวันที่ที่ประชุมผู้ถือหุ้นของบริษัทอ้างอิงมีมติให้เลิกบริษัทอ้างอิง หรือแต่งตั้งผู้ชำระบัญชี หรือศาลมีคำสั่งถึงที่สุดให้เลิกบริษัทอ้างอิง หรือให้พิทักษ์ทรัพย์เด็ดขาด โดยทั้งนี้ “ราคายุติธรรม” หมายถึง ราคายุติธรรมที่จัดทำโดยที่ปรึกษาการเงินอิสระที่อยู่ในบัญชีที่สำนักงาน ก.ล.ต. ให้ความเห็นชอบ โดยราคายุติธรรมดังกล่าวต้องถูกจัดทำขึ้นไม่เกินกว่าห้าสิบ (50) วันก่อนวันที่ผู้ออกโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ประกาศแจ้งราคายุติธรรม โดยถือว่าราคายุติธรรมคือราคาอ้างอิง ให้ผู้ออกโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ชำระเงินสดส่วนต่างสุทธิ (ถ้ามี) ให้ผู้ถือโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยชำระเข้าบัญชีธนาคารของผู้ถือโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือเป็นเช็คระบุชื่อขีดคร่อมส่งจ่ายให้ผู้ถือโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ที่มีรายชื่อตามสมุดทะเบียน ณ วันใช้สิทธิอัตโนมัติ และจัดส่งให้ทางไปรษณีย์ลงทะเบียน ภายในเก้า (9) วันทำการนับจากวันที่ประกาศราคายุติธรรมหรือมีราคาอ้างอิง แล้วแต่กรณี

ในกรณีที่โบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อ้างอิงกับดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง บริษัทฯ จะไม่ทำการปรับตัวคุณดัชนีและ/หรือราคาใช้สิทธิ เว้นแต่ผู้ออกโบ้สำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เห็นแล้วว่ามีความเหตุอันควรซึ่งส่งผล

กระทบอย่างมีนัยสำคัญต่อผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ บริษัทฯ จะทำการพิจารณาหาวิธีการที่เหมาะสมในการปรับตัวคุณดัชนี และ/หรือราคาใช้สิทธิอย่างเป็นธรรม รวมไปถึงการกำหนดวันที่มีการปรับตัวคุณดัชนี และ/หรือราคาใช้สิทธิตลอดจนวันที่มีผลบังคับใช้ โดยไม่ทำให้สิทธิของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ลดน้อยไปกว่าเดิม ทั้งนี้ บริษัทฯ จะแจ้งให้ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ทราบตามระเบียบและวิธีการของตลาดหลักทรัพย์ฯ และหน่วยงานอื่นที่เกี่ยวข้อง

(7.3) ความเสี่ยงจากเหตุการณ์ขัดข้องในการชำระราคาและส่งมอบ

เหตุการณ์ขัดข้องในการชำระราคา หมายถึง เหตุการณ์ที่อยู่นอกเหนือการควบคุมของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และไม่เกิดจากความผิดของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ซึ่งทำให้ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ไม่สามารถชำระราคาให้ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ที่ใช้สิทธิได้ ซึ่งรวมถึงแต่ไม่จำกัดเฉพาะเหตุการณ์ดังต่อไปนี้

- เกิดสงครามหรือจลาจลในประเทศหรือต่างประเทศ หรือเหตุอื่นใดที่มีผลทำให้ไม่สามารถซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ตามปกติ
- ตลาดหลักทรัพย์ฯ สั่งพักการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงไม่ว่าด้วยเหตุใดๆ
- มีข้อกำหนดตามกฎหมาย หรือคำสั่งของหน่วยงานที่เกี่ยวข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และ/หรือที่มีผลกระทบต่อการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงจนทำให้ไม่สามารถหาราคาอ้างอิงได้

(7.4) ความเสี่ยงด้านความสามารถในการส่งมอบหลักทรัพย์หรือการจ่ายเงินสดส่วนต่างตามภาระผูกพันของบริษัท (Credit Risk)

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เป็นใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ชนิดที่ไม่มีทรัพย์สินเป็นหลักประกัน ดังนั้น ความเสี่ยงของผู้ลงทุนที่ลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ จึงขึ้นกับความน่าเชื่อถือของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ค้าประกันการชำระหนี้ หากผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือผู้ค้าประกันการชำระหนี้ไม่สามารถชำระหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ลงทุนจะมีสถานะเดียวกันกับเจ้าหนี้ไม่มีประกันของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือผู้ค้าประกันการชำระหนี้ โดยไม่คำนึงถึงผลตอบแทนของหลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีอ้างอิง และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะไม่ได้รับเงินคืน ไม่ว่าจะเงินเต็มจำนวนหรือบางส่วนของจำนวนหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยผู้ลงทุนไม่มีสิทธิเรียกร้องใดๆ เกี่ยวกับเงื่อนไขของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จากบริษัทผู้ออกหุ้นอ้างอิงหรือผู้จัดทำดัชนีหลักทรัพย์

นักลงทุนควรศึกษาข้อมูลและคุณสมบัติของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ พร้อมทั้งศึกษาปัจจัยความเสี่ยงที่เกี่ยวกับการดำเนินงานของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ฐานะทางการเงิน ผลการดำเนินงานที่ผ่านมา และอันดับความน่าเชื่อถือ (Credit Rating) โดยผู้ออกได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือจากบริษัท พิทช์เรตติ้งส์ (ประเทศไทย) จำกัด ที่อันดับความน่าเชื่อถือเท่ากับ BBB+ (ณ วันที่ 29 ธันวาคม 2565) ซึ่งเป็นคุณสมบัติหนึ่งในการขอออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ตามเกณฑ์ของสำนักงาน ก.ล.ต. ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลของผู้ถือเพิ่มเติมได้จากแบบ 69-DW-Full และ/หรือ แบบ 69-

DW-Short ร่างข้อกำหนดสิทธิ รวมทั้งศึกษาเหตุผิติดนัดและผลของการผิติดนัดตามส่วนที่ 1 ของข้อกำหนดสิทธิอย่างละเอียดก่อนการลงทุน

(8) ความเสี่ยงจากการประกอบธุรกิจการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์

เนื่องจากส่วนใหญ่ลูกค้าจะนำธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ไปใช้เป็นเครื่องมือเพื่อป้องกันความเสี่ยงและหาผลตอบแทนในสถานะที่ตลาดมีความผันผวนมาก ความเสี่ยงหลักซึ่งสามารถเกิดขึ้นจากการผิติดนัดของคู่สัญญาและราคาหลักทรัพย์ที่มีความผันผวน อาจก่อให้เกิดการผิติดนัดชำระหนี้หรือการไม่คืนหลักทรัพย์และหลักประกันเมื่อถึงวันครบกำหนดของสัญญา ซึ่งส่งผลกระทบต่อรายได้ ระบบการทำงานและสภาพคล่องของ บริษัทฯ โดยแนวโน้มความผันผวนของตลาดและราคาของหลักทรัพย์ยังคงมีอยู่เสมอนขึ้นอยู่กับปัจจัยหลักทางเศรษฐกิจ การเมืองและการเงินเป็นสำคัญ ถึงแม้ว่าเศรษฐกิจจะมีแนวโน้มที่ดีขึ้นในปีหน้าแต่ยังคงมีแนวโน้มที่ไม่แน่นอนของผลลัพธ์นโยบายทางเศรษฐกิจและการเงินทั้งในประเทศและต่างประเทศ มาตรการการรับมือของสถานการณ์โควิด-19 รวมถึงปัจจัยอื่นๆ ว่าจะมีประสิทธิภาพมากน้อยเพียงใด

ดังนั้น บริษัทฯ จึงได้มีการป้องกันความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการทำธุรกรรมของลูกค้า โดยกำหนดให้ลูกค้าผู้ยืมจะต้องวางเงินหลักประกันก่อนการยืมหลักทรัพย์ไม่น้อยกว่าเกณฑ์ที่ บริษัทฯ กำหนด และจะต้องดำรงมูลค่าหลักประกันไว้ไม่น้อยกว่าระดับหลักประกันที่ บริษัทฯ กำหนดไว้ ซึ่งหากมูลค่าหลักประกันการยืมหลักทรัพย์ของผู้ยืมลดลงต่ำกว่าหลักประกันที่กำหนด บริษัทฯ จะมีขั้นตอนการแจ้งให้ลูกค้าผู้ยืมนำเงินหลักประกันมาวางเพิ่มให้ถึงระดับหลักประกันที่กำหนด

(9) ความเสี่ยงด้านบุคลากร

บุคลากรถือเป็นปัจจัยสำคัญในการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ซึ่งเป็นธุรกิจให้บริการ โดยเฉพาะบุคลากรด้านผู้แนะนำการลงทุน วาณิชธนกิจ และวิเคราะห์หลักทรัพย์ ซึ่งถือว่าเป็นวิชาชีพที่ใช้ความรู้ความชำนาญเฉพาะด้านและเป็นที่ต้องการของตลาดแรงงานเป็นอย่างมาก ทั้งนี้ การโยกย้ายบุคลากรดังกล่าว อาจส่งผลกระทบต่อเนื่องของการดำเนินงาน และผลการดำเนินงานของบริษัทฯ ได้

เพื่อเป็นการลดความเสี่ยงและผลกระทบที่อาจเกิดขึ้นกับธุรกิจ อันเนื่องมาจากการลาออกของบุคลากร บริษัทฯ จึงมีนโยบายพัฒนาและเพิ่มพูนความรู้ความสามารถของพนักงานในทุกระดับและสายงาน เพื่อให้สามารถทำงานทดแทนกันได้กรณีที่มีการลาออก นอกจากนี้ บริษัทฯ ยังมีมาตรการจูงใจพนักงานด้วยการให้ผลตอบแทนที่เหมาะสมและสอดคล้องกับสถานะตลาดในรูปแบบต่างๆ เช่น เงินเดือน โบนัส สวัสดิการ เป็นต้น รวมไปถึงการดูแลที่ดีจากคณะผู้บริหารของ บริษัทฯ ที่ให้ความใส่ใจในการปรับปรุงสภาพแวดล้อมในการทำงานให้ทันสมัย และมีคุณภาพชีวิตที่ดีในการทำงาน ทั้งยังมีนโยบายมุ่งเน้นการเสริมสร้างความผูกพันของบุคลากรภายในองค์กร สนับสนุนการทำงานร่วมกันเป็นทีมงานที่ดี พร้อมกับมีแผนในการพัฒนาบุคลากรเพื่อให้เกิดการพัฒนาขีดความสามารถในการทำงานและเกิดความก้าวหน้าในอาชีพอย่างมั่นคง

(10) ความเสี่ยงจากการพึ่งพิงลูกค้ารายใหญ่หรือน้อยราย

ในปัจจุบัน บริษัทฯ ไม่มีการพึ่งพิงรายได้จากลูกค้ารายใดรายหนึ่งเกินกว่าร้อยละ 30.00 ของรายได้รวม (ข้อมูล ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566) อย่างไรก็ตาม บริษัทฯ ได้ตระหนักถึงผลกระทบที่อาจเกิดขึ้น จึงมีแนวทางในการรองรับ

ความเสี่ยงดังกล่าว โดยมุ่งเน้นการขยายฐานลูกค้าบุคคลทั่วไป และลูกค้าสถาบันทั้งในและต่างประเทศให้มีจำนวนมากขึ้น รวมไปถึง การพัฒนาระบบการส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตในการให้บริการและอำนวยความสะดวกให้แก่ลูกค้า เพื่อให้มีฐานลูกค้าที่มากขึ้น และไม่พึ่งพาลูกค้ารายใหญ่หรือมีจำนวนลูกค้าน้อยรายจนเกินไป

(11) ความเสี่ยงจากผู้ถือหุ้นรายใหญ่เกินร้อยละ 25.00

บริษัท ฟินันเซีย เอกซ์ จำกัด (มหาชน) เป็นผู้ถือหุ้นรายใหญ่ซึ่งถือหุ้นร้อยละ 99.74 ของทุนที่ออกจำหน่ายและชำระแล้วของบริษัทฯ (ข้อมูล ณ วันที่ 17 สิงหาคม 2566) จึงเป็นผู้ที่มีอำนาจในการบริหารจัดการ และสามารถควบคุมคะแนนเสียงในการลงมติที่ประชุมผู้ถือหุ้น หรือเรื่องที่กฎหมายหรือข้อบังคับของ บริษัทฯ กำหนดให้ต้องได้คะแนนเสียงเห็นชอบ 3 ใน 4 ของที่ประชุมผู้ถือหุ้น ดังนั้น ผู้ถือหุ้นรายอื่นของ บริษัทฯ จึงมีความเสี่ยงจากการไม่สามารถรวบรวมคะแนนเสียง เพื่อตรวจสอบและถ่วงดุลในเรื่องที่ผู้ถือหุ้นรายใหญ่เสนอได้ อย่างไรก็ตาม บริษัทฯ มีกรรมการอิสระซึ่งดำรงตำแหน่งกรรมการตรวจสอบจำนวน 3 ท่าน จากกรรมการบริษัทจำนวน 9 ท่าน และมีความเป็นอิสระจากฝ่ายบริหารและผู้ถือหุ้นรายใหญ่ เพื่อทำหน้าที่ควบคุมดูแลตรวจสอบ รวมทั้งให้คำแนะนำการดำเนินงานของ บริษัทฯ ให้มีความถูกต้อง โปร่งใส และรักษาผลประโยชน์ต่อผู้ถือหุ้นทุกราย

(12) ความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงของเทคโนโลยี

ตามที่ บริษัทฯ ได้เปลี่ยนแปลงกลยุทธ์หลักของบริษัتماเป็นการให้บริการนักลงทุนด้วยระบบซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านอินเทอร์เน็ตที่ได้มีการเปิดตัวไปเมื่อวันที่ 23 มีนาคม 2561 ที่ผ่านมามีรายได้ชื่อ Finansia Hero นั้น บริษัทฯ ตระหนักดีว่า เทคโนโลยีสารสนเทศมีการเปลี่ยนแปลงที่รวดเร็วตลอดเวลา เนื่องจากเทคโนโลยีที่ใช้มีการพัฒนาและเปลี่ยนแปลงอยู่เสมอ ดังนั้น บริษัทฯ อาจมีความเสี่ยงในการนำเสนอระบบการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านอินเทอร์เน็ต ซึ่งเป็นเครื่องมือการลงทุนที่ไม่ทันสมัยให้กับนักลงทุน ซึ่งจะทำให้มูลค่าเพิ่ม (Value Added) ของบริการโดย บริษัทฯ ลดลง และทำให้ บริษัทฯ ลดความสามารถในการแข่งขันในระยะยาวได้

อย่างไรก็ดี ความเสี่ยงด้านการล้ำสมัยของเทคโนโลยี คาดว่ามีผลกระทบกับ บริษัทฯ น้อยมาก เนื่องจากก่อนที่ บริษัทฯ ตัดสินใจเข้าร่วมการพัฒนาพัฒนาระบบการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านอินเทอร์เน็ตดังกล่าว บริษัทฯ ได้ทำการศึกษาและเปรียบเทียบกับระบบซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านอินเทอร์เน็ตที่มีอยู่ในตลาดแล้ว ปรากฏว่า เทคโนโลยีจากพันธมิตร เช่น บริษัทหลักทรัพย์ Kiwoom ของประเทศเกาหลีมีความล้ำหน้าอย่างมาก อีกทั้งการร่วมมือกันพัฒนาดังกล่าวมิใช่เป็นเพียงการซื้อขายโปรแกรมคอมพิวเตอร์เท่านั้น แต่ยังเป็นการศึกษาถึงพฤติกรรมนักลงทุน เพื่อนำมาพัฒนาระบบซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านอินเทอร์เน็ตดังกล่าวขึ้นมาด้วย โดยใช้หลักคิดที่ว่า Customer Centric กอรปกับ บริษัทฯ ได้มีการป้องกันโดยมีการติดตามความเคลื่อนไหวและแนวโน้มพฤติกรรมการลงทุนของนักลงทุน ตลอดจนเทคโนโลยีและนวัตกรรมใหม่ๆ ที่จะมีการนำเสนอสู่ตลาด ซึ่งจะสามารถนำมาเสนอและตอบสนองความต้องการของนักลงทุนได้ โดยแหล่งข้อมูลอาจมาจากนักลงทุน พันธมิตร ชาวสารบบโลก Cyber ต่างๆ งานสัมมนาด้านเทคโนโลยีในระดับโลก และอื่นๆ ทั้งนี้ บริษัทฯ ได้มีการจัดตั้งฝ่ายไอทีฟินันเซียเทคโนโลยี ซึ่งประกอบด้วย นักพัฒนาโปรแกรมผู้เชี่ยวชาญที่เคยไปประจำอยู่กับบริษัทหลักทรัพย์ Kiwoom ที่ประเทศเกาหลี จำนวน 5-6 คน ซึ่งมีความรู้และประสบการณ์เกี่ยวกับเทคโนโลยีสารสนเทศในสาขาต่างๆ เพื่อร่วมกันพิจารณาและกำหนดการออกแบบ features ต่างๆ เพื่อเป็นทางเลือกสำหรับเครื่องมือการลงทุนและนวัตกรรมใหม่ๆ เหล่านี้ต่อนักลงทุน นอกจากนี้ บริษัทฯ มีวัฒนธรรมองค์กรที่ให้ความสำคัญต่อการปรับตัวเปิดรับต่อเทคโนโลยีและนวัตกรรมใหม่ๆ ตลอดเวลา

ทั้งนี้ อายุเฉลี่ยของพนักงานของ บริษัทฯ ฝ่ายไอทีและเทคโนโลยีอยู่ที่ประมาณ 25-26 ปี ซึ่งเป็นกลุ่มที่มีความพร้อมที่จะเรียนรู้และตอบรับเทคโนโลยีใหม่เสมอ และสามารถปรับตัวได้อย่างรวดเร็ว

(13) ความเสี่ยงจากการให้บริการที่ปรึกษาทางการเงิน

การให้บริการที่ปรึกษาทางการเงินในด้านต่างๆ ของบริษัทฯ เช่น การออกและเสนอขายหลักทรัพย์ การควบรวมกิจการ การเข้าทำรายการประเภทต่างๆ ของบริษัทจดทะเบียน เพื่อให้เป็นไปตามกฎระเบียบของสำนักงาน ก.ล.ต. และตลาดหลักทรัพย์ฯ เช่น การได้มาและจำหน่ายไปซึ่งสินทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียน หรือการเข้าทำรายการเกี่ยวโยงกันของบริษัทจดทะเบียน การเพิกถอนหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียน เป็นต้น อาจทำให้บริษัทฯ มีความเสี่ยงในกรณีที่ต้องมีความรับผิดชอบร่วมกับลูกค้าในการเปิดเผยข้อมูลที่ถูกต้องครบถ้วนต่อสาธารณชน ซึ่งบริษัทฯ ตระหนักถึงความเสี่ยงดังกล่าว จึงให้ความสำคัญกับการอบรมและพัฒนาบุคลากรในฝ่ายวาณิชธนกิจให้มีความรู้ความเข้าใจในกฎเกณฑ์และกฎหมายที่เกี่ยวข้อง และเพื่อให้การปฏิบัติงานของบุคลากรในฝ่ายเป็นไปอย่างมีมาตรฐานและมีประสิทธิภาพ บริษัทฯ ได้จัดทำคู่มือการปฏิบัติงานอย่างละเอียด โดยระบุขั้นตอนในการตรวจสอบข้อมูลลูกค้า (Due Diligence) เพื่อเป็นแนวทางการปฏิบัติงานให้แก่บุคลากรในฝ่าย โดยจะมีผู้ควบคุมการปฏิบัติงาน ซึ่งเป็นผู้ที่มีประสบการณ์ในธุรกิจวาณิชธนกิจมาอย่างยาวนาน รับผิดชอบในการตรวจสอบความถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลและเอกสารอย่างละเอียดและรัดกุม

(14) ความเสี่ยงในการให้บริการนายหน้าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล

การให้บริการนายหน้าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล (อยู่ระหว่างการดำเนินการขอใบอนุญาตโดย FDA) อาจได้รับผลกระทบจากความผันผวนของราคาและความซับซ้อนของลักษณะสินทรัพย์ดิจิทัล ภายใต้ความไม่แน่นอนที่อยู่ในระดับสูง รวมถึงภาวะการเงินโลกมีการตึงตัวขึ้นมาก ความต้องการในการซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัลอาจผันผวนตามสถานการณ์ดังกล่าว โดยผลการดำเนินงานของธุรกิจนายหน้าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัลอาจได้รับผลกระทบจากความผันผวนดังกล่าวเช่นกัน ทั้งนี้ บริษัทฯ ได้ทำการศึกษาความเป็นได้และความเสี่ยงของธุรกิจนายหน้าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล รวมถึงได้มีการกำหนดการบริหารความเสี่ยงที่เข้มงวดและรัดกุมเพื่อลดผลกระทบที่อาจเกิดขึ้นกรณีที่ผลการดำเนินงานของธุรกิจนายหน้าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัลไม่เป็นตามที่คาด

(15) ความเสี่ยงจากการทุจริตคอร์รัปชัน

บริษัทฯ ได้เล็งเห็นและตระหนักในการเข้าไปมีส่วนร่วมในการแก้ไขปัญหาคอร์รัปชันผ่านการเข้าร่วมเป็นสมาชิก CAC ผ่านการกำหนดนโยบายและกลไกป้องกันคอร์รัปชัน ซึ่งส่งผลโดยตรงต่อการลดความเสี่ยงของปัญหาสินบน ทั้งนี้ จากกระแสการต่อต้านคอร์รัปชัน บริษัทฯ สามารถสร้างให้เกิด critical mass และก่อให้เกิดแรงกดดันทั้งภายในองค์กรและต่อผู้ประกอบการอื่นๆ เพื่อยกระดับมาตรฐานการต่อต้านคอร์รัปชันให้ขึ้นมาอยู่ระดับเดียวกับสมาชิก CAC เมื่อปราศจากการจ่ายสินบนแล้วก็จะทำให้ภูมิทัศน์ของภาคธุรกิจโดยรวมเปลี่ยนแปลงไป และการคอร์รัปชันในทุกรูปแบบจะกลายเป็นพฤติกรรมน่ารังเกียจที่ภาคธุรกิจไม่สามารถทนรับได้อีกต่อไป

(16) ความเสี่ยงในการบริหารความเสี่ยงของเงินกองทุน

ประกาศคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ กธ. 26/2563 ลงวันที่ 8 ตุลาคม 2563 ข้อ 4 ให้ผู้ประกอบการธุรกิจดำรงเงินกองทุนทุกสิ้นวันทำการ และข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนของที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์) หมวด 400 การบริหารความเสี่ยง ข้อ 403 (2.2) ในกรณีที่สมาชิกมีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเมื่อสิ้นวันทำการใดๆ ลดลงมาอยู่ที่ระดับ

น้อยกว่าหรือเท่ากับ 3 เท่าของหลักเกณฑ์ขั้นต่ำที่ต้องดำรงไว้ตามที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. หรือคณะกรรมการกำกับตลาดทุนกำหนด ให้สมาชิกจัดส่งรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิให้กับสำนักหักบัญชีทุกวัน โดยให้จัดส่งภายในวันทำการถัดจากวันที่เกิดกรณีดังกล่าวจนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดให้รายงานเป็นเวลา 7 วันทำการติดต่อกัน หรือตามระยะเวลาที่สำนักหักบัญชีกำหนด ทั้งนี้ ตามตารางการดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ (แนบท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่ กธ.26/2563) กำหนดให้ผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า จะต้องดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิมากกว่าหรือเท่ากับ 25 ล้านบาท หรือมากกว่าหรือเท่ากับร้อยละ 7 ของหนี้สินทั่วไป และทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (ถ้ามี) และตามข้อบังคับของสำนักหักบัญชี (ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์) หมวด 400 การบริหารความเสี่ยง ข้อ 403 (2.2) กำหนดให้ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิมากกว่าหรือเท่ากับ 75 ล้านบาท หรือมากกว่าหรือเท่ากับร้อยละ 21 ของหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (ถ้ามี) ทั้งนี้ ตลอดระยะเวลา 5 ปีที่ผ่านมา บริษัทฯ สามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิและอัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิให้เป็นไปตามที่กฎเกณฑ์กำหนด ทั้งนี้ รายละเอียด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 - 2565 และวันที่ 30 มิถุนายน 2566 มีรายละเอียดดังนี้

เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิและอัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของ บริษัทฯ

รายการ	ณ 31 ธันวาคม			ณ 30 มิถุนายน
	2563	2564	2565	2566
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ล้านบาท)	1,344.56	1,549.87	1,275.56	1,225.75
อัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ร้อยละ)	41.31	36.86	26.48	29.64

หาก บริษัทฯ ไม่สามารถดำรงอัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ตามที่กฎเกณฑ์กำหนด สำนักหักบัญชีอาจกำหนดให้ บริษัทฯ พ้นจากการเป็นสมาชิกได้ ส่งผลให้ บริษัทฯ ไม่สามารถขยายการประกอบธุรกิจ และจะต้องจัดทำแผนแก้ไขให้เงินกองทุนกลับมาเป็นปกติภายใน 90 วัน และหาก บริษัทฯ ไม่สามารถกลับไปดำรงอัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องได้ตามช่วงระยะเวลาดังกล่าวได้ บริษัทฯ จะต้องหยุดประกอบธุรกิจทั้งหมด อย่างไรก็ตาม บริษัทฯ มีการบริหาร ติดตามผล และรายงานสถานะของอัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ตลอดจนจัดทำประมาณการความต้องการเงินกองทุนในอนาคตและการทดสอบภาวะวิกฤต รวมถึงได้มีการกำหนดเป้าหมายอัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ เพื่อสะท้อนเป้าหมายของเงินกองทุนต่อระดับความเสี่ยงที่ บริษัทฯ ยอมรับได้

บริษัทฯ เชื่อมั่นว่าสถานะของเงินกองทุนในปัจจุบันซึ่งอยู่ในระดับที่แข็งแกร่งและสูงกว่าเกณฑ์ขั้นต่ำที่กำหนด ส่งผลให้ สามารถประกอบธุรกิจได้อย่างคล่องตัวและพร้อมสำหรับการเติบโตอย่างทันที่หากมีโอกาสทางธุรกิจใหม่ๆ เกิดขึ้นในอนาคต

2.1.3. ปัจจัยเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎระเบียบ ข้อบังคับ และข้อกำหนดที่เข้มงวด

เนื่องจากธุรกิจด้านหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นธุรกิจที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแลและควบคุมโดยกฎหมายที่เกี่ยวข้องของหน่วยงานกำกับดูแลต่างๆ เช่น สำนักงาน ก.ล.ต. ตลาดหลักทรัพย์ฯ บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) สำนักงานป้องกันและปราบปรามการฟอกเงิน และสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย เป็นต้น ดังนั้น บริษัทฯ อาจได้รับผลกระทบทั้งในด้านการปฏิบัติงาน เช่น ต้นทุนในการดำเนินการที่เพิ่มขึ้น และความมั่ง

ความเข้าใจของฝ่ายงานที่เกี่ยวข้อง จากการกำหนด และ/หรือการเปลี่ยนแปลงหลักเกณฑ์นโยบาย รวมทั้งมาตรการในการกำกับดูแลธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของภาครัฐหรือหน่วยงานที่กำกับดูแล นอกจากนี้ บริษัทฯ อาจมีความเสี่ยงจากข้อผิดพลาดในการดำเนินธุรกิจในด้านต่างๆ เช่น ความผิดพลาดในการปฏิบัติหน้าที่ของฝ่ายงานต่างๆ การไม่ปฏิบัติตามมาตรฐานการปฏิบัติงานและจรรยาบรรณของผู้แนะนำการลงทุนและนักวิเคราะห์หลักทรัพย์ เป็นต้น ซึ่งข้อผิดพลาดดังกล่าวอาจส่งผลกระทบต่อชื่อเสียงของบริษัทฯ และมีความเสี่ยงที่บริษัทฯ อาจถูกพิจารณาเพื่อปรับและ/หรือดำเนินการอื่นๆ ตามที่กฎหมายกำหนด และ/หรือ พนักงานของ บริษัทฯ อาจถูกพิจารณาลงโทษตั้งแต่กำชับตักเตือนจนถึงถูกสั่งพักการปฏิบัติหน้าที่ดังกล่าว ทั้งนี้ ข้อเท็จจริงในอดีตเกี่ยวกับการไม่สามารถปฏิบัติตามเกณฑ์รวมถึงรายงานผลการตรวจสอบโดยหน่วยงานกำกับดูแล ได้เปิดเผยไว้ที่ [www. https://market.sec.or.th/LicenseCheck](http://www.https://market.sec.or.th/LicenseCheck) อย่างไรก็ดี บริษัทฯ ได้ดำเนินการและกำหนดแนวทางการจัดการและการปฏิบัติงาน รวมถึงกำหนดให้มีระบบควบคุมภายในเพื่อป้องกันความเสี่ยงจากการไม่สามารถปฏิบัติตามกฎหมายและข้อกำหนดอย่างเคร่งครัดเพื่อไม่ให้เกิดปัญหาซ้ำอีกในอนาคต

อย่างไรก็ดี บริษัทฯ มีนโยบายให้มีฝ่ายตรวจสอบภายในและฝ่ายกำกับดูแลการปฏิบัติงานเพื่อทำหน้าที่ในการกำกับดูแลควบคุมและตรวจสอบให้พนักงานทุกระดับ ปฏิบัติงานได้อย่างถูกต้องเป็นไปตามข้อกำหนดและหลักเกณฑ์ต่างๆ ของหน่วยงานที่กำกับดูแลอย่างเคร่งครัด และเมื่อมีการแก้ไขข้อกำหนด และ/หรือ กฎเกณฑ์ต่างๆ บริษัทฯ จะจัดให้มีการแจ้งประกาศกฎเกณฑ์ให้พนักงานที่เกี่ยวข้องทุกคนได้รับทราบอย่างทั่วถึงกัน เพื่อให้รับทราบและปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ที่เป็นปัจจุบัน และเพื่อป้องกันความเสี่ยงดังกล่าวข้างต้น บริษัทฯ ได้มอบหมายให้ฝ่ายกำกับและตรวจสอบ ทำหน้าที่ควบคุมดูแล ติดตามและตรวจสอบอย่างสม่ำเสมอ ให้หน่วยงานต่างๆ ปฏิบัติงานให้เป็นไปตามกฎ ข้อบังคับของทางการ นโยบายและระเบียบของ บริษัทฯ ติดตามการเปลี่ยนแปลงในเรื่องกฎเกณฑ์ของทางการและแจ้งให้หน่วยงานและเจ้าหน้าที่ที่เกี่ยวข้องได้รับทราบและถือปฏิบัติโดยทั่วกัน

2.2. ความเสี่ยงของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

2.2.1. ความเสี่ยงของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นกู้หรือตราสารหนี้ทั่วไป โดยความเสี่ยงจากการลงทุนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น จะมีความเสี่ยงในหลายด้านเข้ามาเกี่ยวข้อง เช่น ความเสี่ยงของหลักทรัพย์อ้างอิง หรือสินทรัพย์อ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกหุ้นกู้ เป็นต้น ซึ่งนักลงทุนจะต้องทำความเข้าใจและศึกษารายละเอียดที่เกี่ยวข้องนี้อย่างละเอียดถี่ถ้วนก่อนการลงทุน เพื่อให้การลงทุนเกิดประโยชน์สูงสุดแก่ตัวนักลงทุนเอง

2.2.2. ความเสี่ยงอันเนื่องมาจากการเปลี่ยนแปลงราคาหลักทรัพย์อ้างอิง อันได้แก่ หุ้นไทย หรือ ตระกร้าหุ้นไทย หรือ

ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย หรือ หน่วยลงทุน ETF ซึ่งจดทะเบียนและซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ผลตอบแทนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขึ้นอยู่กับราคาของสินทรัพย์อ้างอิง ณ วันกำหนดราคา เช่น หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภท Equity Linked Note, Basket Equity Linked Note หรือ ELN, Basket ELN ตามลำดับ โดยเฉพาะในช่วงวันกำหนดราคา ซึ่งหากนักลงทุนได้รับชำระหรือส่งมอบเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง นักลงทุนอาจมีความเสี่ยงในการรับรู้ขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้น หากหลักทรัพย์อ้างอิงปรับตัวต่ำกว่าราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าก่อนการซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและ/หรือข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นๆ

ในกรณีที่เป็นการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ประเภท Reverse Equity Linked Note หรือ Reverse ELN ที่มีการส่งมอบและชำระราคาเป็นเงินซึ่งทำให้นักลงทุนต้องรับรู้ผลขาดทุนที่อาจเกิดขึ้นหากหลักทรัพย์อ้างอิงปรับตัวสูงกว่าราคาที่ตั้งล่วงหน้าไว้ล่วงหน้าก่อนการซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ/หรือข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ๆ

ในกรณีที่เป็นการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ประเภท Callable Fixed Coupon Note, Single Stock Callable Fixed Coupon Note, Basket Knock-In Knock-Out Fixed Coupon Note, Single Stock Knock-In Knock-Out Fixed Coupon Note, Accumulator โดยเฉพาะในช่วงวันกำหนดราคาหากนักลงทุนได้รับชำระหรือส่งมอบเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง นักลงทุนอาจมีความเสี่ยงในการรับรู้ขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้น หากหลักทรัพย์อ้างอิงปรับตัวต่ำกว่าราคาที่ตั้งล่วงหน้าไว้ล่วงหน้าก่อนการซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ/หรืออาจถูกเรียกไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและ/หรือข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ๆ

ในกรณีที่เป็นการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ประเภท Decumulator ที่มีการส่งมอบและชำระราคาเป็นเงินซึ่งทำให้นักลงทุนต้องรับรู้ผลขาดทุนที่อาจเกิดขึ้นหากหลักทรัพย์อ้างอิงปรับตัวสูงกว่าราคาที่ตั้งล่วงหน้าไว้ล่วงหน้าก่อนการซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ/หรืออาจถูกเรียกไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ/หรือข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ๆ

ในการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องทำธุรกรรมบนหลักทรัพย์อ้างอิงตามนโยบายการบริหารความเสี่ยงที่กำหนดไว้ ในการบริหารความเสี่ยงดังกล่าว ผู้ออกจะต้องดำเนินการป้องกันความเสี่ยงโดยการทำ Delta Hedging อย่างต่อเนื่องจนกว่าหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นจะครบกำหนดอายุหรือมีการไถ่ถอน

2.2.3. ความเสี่ยงอันเนื่องมาจากบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง

การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง อาจมีความเสี่ยงจากบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงนั้น ๆ โดยเฉพาะหลักทรัพย์อ้างอิงที่เป็นหุ้นสามัญ นักลงทุนจึงควรศึกษาข้อมูลของบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงเพิ่มเติม เพื่อให้เกิดความมั่นใจในสถานะทางการเงิน และความมั่นคงของบริษัทว่าจะไม่ทำให้ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงเปลี่ยนแปลงไปมากกว่าที่คาดการณ์ไว้ล่วงหน้า โดยเฉพาะในช่วงวันกำหนดราคา ซึ่งหากนักลงทุนได้รับชำระหรือส่งมอบเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง นักลงทุนอาจมีความเสี่ยงในการรับรู้ขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้น หรืออาจเกิดขึ้นจากการเปลี่ยนแปลงราคาของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้น

2.2.4. ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่ก่อให้เกิดภาระผูกพันแก่ผู้ออกในการที่จะต้องรองรับการชำระหนี้เมื่อครบกำหนดอายุหรือเมื่อสิ้นสุดสัญญา ผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงที่บริษัทผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจไม่สามารถชำระหนี้ที่เกิดขึ้นภายใต้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามจำนวนที่ตั้งล่วงหน้าไว้ได้ทั้งหมดหรือตรงตามกำหนดเวลาที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ/หรือข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

2.2.5. ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีได้จดทะเบียนซื้อขายในตลาดตราสารหนี้ อีกทั้งยังเป็นการเสนอขายแก่นักลงทุนในวงจำกัด ดังนั้นจึงไม่สามารถโอนเปลี่ยนมือได้ หรือโอนเปลี่ยนมือได้อย่างจำกัด ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิ

และหน้าที่ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ/หรือข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

2.2.6. ความเสี่ยงจากการเข้าทำธุรกรรมบนหลักทรัพย์อ้างอิงของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ในการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องทำธุรกรรมบนหลักทรัพย์อ้างอิงตามนโยบายการบริหารความเสี่ยงที่กำหนดไว้ ในการบริหารความเสี่ยงดังกล่าว ผู้ออกจะต้องดำเนินการป้องกันความเสี่ยงโดยการทำ Delta Hedging อย่างต่อเนื่องจนกว่าหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นจะครบกำหนดอายุหรือมีการไถ่ถอน ซึ่งนักลงทุนจะต้องยอมรับว่าการทำธุรกรรมบนหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าว อาจส่งผลกระทบต่อมูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือสิทธิประโยชน์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นได้

2.2.7. ความเสี่ยงด้านราคา

การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นการลงทุนที่มีความเสี่ยง ซึ่งหมายถึงความเสี่ยงที่เกิดจากการเปลี่ยนแปลงของราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปลี่ยนแปลงอาจขึ้นอยู่กับปัจจัยหลายประการ เช่น ราคาของหลักทรัพย์อ้างอิง, อายุคงเหลือของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง, อัตราดอกเบี้ย หรือเงินปันผลของหลักทรัพย์อ้างอิง (กรณีไม่มีการปรับสิทธิ) เป็นต้น ซึ่งปัจจัยที่สำคัญที่สุดจะขึ้นกับราคาของหลักทรัพย์อ้างอิง ดังนั้นนักลงทุนควรศึกษารายละเอียดเพิ่มเติมใน “ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง” ที่เกี่ยวข้องของแต่ละรุ่นก่อนการลงทุน

2.2.8. ความเสี่ยงด้านความขัดแย้งทางผลประโยชน์

กรณีผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทำหน้าที่เป็นผู้ออก ตัวแทนค่านิยมเงิน ผู้จัดการ ผู้สนับสนุนหรือผู้รับประกันการจัดจำหน่ายปัจจัยอ้างอิงที่เป็นหลักทรัพย์ไม่ว่าโดยตรงโดยผ่านบริษัทในเครือ ผลประโยชน์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้องกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวอาจขัดแย้งกับผลประโยชน์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ หากผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและบริษัทในเครือของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

- (1) ทำการซื้อขาย ดูแลสภาพคล่อง (market making activities) และ/หรือ อาจมีฐานะซื้อ (long positions) หรือฐานะขาย (short positions) ในปัจจัยอ้างอิงที่เกี่ยวข้อง ในบัญชีซื้อขายเพื่อตนเอง (proprietary accounts) หรือบัญชีอื่นซึ่งอยู่ภายใต้การจัดการของตน
- (2) ในอนาคตเป็นผู้รับประกันการจัดจำหน่ายสำหรับการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่อ้างอิงกับปัจจัยอ้างอิงตัวเดียวกับปัจจัยอ้างอิงสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกโดยผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามเอกสารฉบับนี้
- (3) เข้าทำธุรกรรมป้องกันความเสี่ยงธุรกรรมใดธุรกรรมหนึ่งหรือหลายธุรกรรมเพื่อป้องกันความเสี่ยงจากปัจจัยอ้างอิงหรือที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

ทั้งนี้ เนื่องจากการกระทำดังกล่าวของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ/หรือบริษัทในเครืออาจมีผลกระทบต่อราคาตลาด สภาพคล่อง หรือมูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และอาจจะถือว่ามีความขัดแย้งทางผลประโยชน์กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง แม้ว่าผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะได้มีความมุ่งหมายให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ดังกล่าวก็ตาม นอกจากนี้บริษัทในเครือบางแห่งของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีหรือเข้าถึงข้อมูลเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ปัจจัยอ้างอิงและตราสารที่มีอนุพันธ์แฝงที่อ้างอิงปัจจัยอ้างอิงดังกล่าวเป็นครั้งคราว ไม่ว่าในฐานะผู้

รับประกันการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ที่ปรึกษาหรือในฐานะอื่นใด โดยบริษัทในเครือเหล่านั้นจะไม่มีข้อผูกพันต้องเปิดเผย และจะไม่เปิดเผย ข้อมูลใดๆ ดังกล่าวต่อผู้ซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

2.2.9. ความเสี่ยงอื่นๆ

นักลงทุนอาจมีความเสี่ยงอื่น ๆ จากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งที่ยังไม่สามารถระบุได้ในตอนนี้ เช่น ความเสี่ยงจากสถานการณ์ที่ไม่สามารถคาดเดาได้ล่วงหน้า เช่น ภัยธรรมชาติ การเปลี่ยนแปลงทางการเมืองและ/หรือ การเปลี่ยนแปลงนโยบายการกำกับดูแลของหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนเหตุการณ์อื่น ๆ ที่อาจมีผลกระทบต่อราคาสินทรัพย์ อ้างอิง วันกำหนดราคา ตลอดจนการชำระราคาและส่งมอบเมื่อครบกำหนดอายุ และความเสี่ยงอื่น ๆ ของหลักทรัพย์ อ้างอิงเช่น การควบรวมกิจการ การเปลี่ยนแปลงโครงสร้างของหลักทรัพย์อ้างอิง ซึ่งมีผลทำให้เกิดการเปลี่ยนแปลงราคาของสินทรัพย์อ้างอิงดังกล่าว อันจะก่อให้เกิดความเสี่ยงจากการรับรู้ผลขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้น หรืออาจเกิดขึ้นของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงรุ่นนั้น ๆ นักลงทุนจึงต้องยอมรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นทั้งหมด และควรศึกษาข้อมูลต่าง ๆ ให้ครบถ้วนก่อนการลงทุน

3. ลักษณะการประกอบธุรกิจ

3.1. ภาพรวมธุรกิจ

ให้บริการทางการเงินที่ครบวงจรชั้นนำของประเทศ ด้วยการนำเสนอผลิตภัณฑ์และบริการที่หลากหลายเพื่อตอบสนองความต้องการของลูกค้าทุกกลุ่ม โดย บริษัทฯ มีเครือข่ายการให้บริการทางการเงินในประเทศที่กว้างขวาง เพื่อให้บริการซื้อขายหลักทรัพย์ ตราสารอนุพันธ์ และตราสารหนี้ รวมถึงผลิตภัณฑ์กองทุนเพื่อการลงทุน สำหรับลูกค้ารายบุคคล ลูกค้าธุรกิจขนาดใหญ่ ขนาดกลาง และขนาดย่อม นอกจากนี้ บริษัทฯ ให้บริการที่ปรึกษาทางการเงินวาณิชธนกิจ รวมถึงบริการทางการเงินอื่นๆ ด้วย โดย บริษัทฯ เป็นสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ฯ หมายเลข 24 และเป็นสมาชิกของศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย ซึ่งประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 (รวมทั้งที่ได้มีการแก้ไขเพิ่มเติม) ซึ่ง บริษัทฯ ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภท ก. ได้แก่

- (1) การเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์
- (2) การค้าหลักทรัพย์
- (3) การเป็นที่ปรึกษาการลงทุน
- (4) การจัดจำหน่ายหลักทรัพย์
- (5) กิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Principal และ Agent) และ
- (6) การจัดการกองทุนส่วนบุคคล (กองทุนส่วนบุคคล)

ทั้งนี้ บริษัทฯ ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าภายใต้พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 (รวมทั้งที่ได้มีการแก้ไขเพิ่มเติม) โดยได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภท ส-1 ได้แก่ (1) การเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และ (2) การเป็นผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้า นอกจากนี้ บริษัทฯ ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ต. ในการประกอบธุรกิจเพิ่มเติม ได้แก่ (1) ที่ปรึกษาทางการเงิน (2) ตัวแทนซื้อ/ขายสินทรัพย์ลงทุน (Selling Agent) และ (3) ตัวแทนซื้อและขายตราสารหนี้ของศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย

รายละเอียดใบอนุญาตของบริษัทฯ สามารถสรุปได้ ดังนี้

ประเภทใบอนุญาต	การประกอบธุรกิจ
ประเภท ก	<ul style="list-style-type: none"> การจัดการกองทุนส่วนบุคคล (กองทุนส่วนบุคคล) การเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ การค้าหลักทรัพย์ การเป็นที่ปรึกษาการลงทุน การจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ กิจการการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Principal และ Agent)
ประเภท ส-1	<ul style="list-style-type: none"> การเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า การเป็นผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

3.2. โครงสร้างรายได้

ตั้งแต่ปี 2563 เป็นต้นมา บริษัทฯ มีรายได้เพิ่มขึ้นอย่างต่อเนื่อง โดยสำหรับปี 2563 - 2565 บริษัทฯ มีรายได้รวมจำนวน 1,747.10 ล้านบาท 2,396.55 ล้านบาท และ 2,400.38 ล้านบาท ตามลำดับ และสำหรับงวด 3 เดือนสิ้นสุด 30 มิถุนายนของปี 2565 และ 2566 เท่ากับ 1,123.49 ล้านบาท และ 922.35 ล้านบาท โดยสำหรับปี 2563 - 2565 และงวด 6 เดือนสิ้นสุด 30 มิถุนายน ปี 2566 รายได้หลักของบริษัทฯ คือ รายได้ค่านายหน้า ซึ่งเท่ากับ 1,314.75 ล้านบาท 1,930.02 ล้านบาท 1,563.70 ล้านบาท และ 899.69 ล้านบาท ตามลำดับ คิดเป็นร้อยละ 75.25 ร้อยละ 80.53 ร้อยละ 65.15 และร้อยละ 80.08 ของรายได้รวม ตามลำดับ ทั้งนี้ โครงสร้างรายได้รวมของบริษัทฯ มีรายละเอียดดังนี้

โครงสร้างรายได้รวมของบริษัทฯ สำหรับปี 2563 - 2565 และงวด 3 เดือนปี 2565 และ 2566

ประเภทรายได้	ปี						งวด 6 เดือน			
	2563		2564		2565		2565		2566	
	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ
ค่านายหน้า	1,314.75	75.25	1,930.02	80.53	1,563.70	65.15	899.69	80.08	546.83	59.29
ค่าธรรมเนียมและบริการ	122.79	7.03	113.99	4.76	486.12	20.25	52.89	4.71	189.42	20.54
ดอกเบี้ย	84.77	4.85	130.22	5.43	185.64	7.73	84.05	7.48	116.04	12.58
กำไรและผลตอบแทนจากเครื่องมือทางการเงิน	168.83	9.66	165.61	6.91	97.00	4.04	53.63	4.77	38.20	4.14
ส่วนแบ่งกำไร (ขาดทุน) จาก	5.26	0.30	3.08	0.13	4.10	0.17	0.94	0.08	1.14	0.12

ประเภทรายได้	ปี						งวด 6 เดือน			
	2563		2564		2565		2565		2566	
	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ	ล้านบาท	ร้อยละ
เงินลงทุนในบริษัทร่วม										
รายได้อื่น	50.70	2.91	53.63	2.24	63.83	2.66	32.29	2.87	30.72	3.33
รายได้รวม	1,747.10	100.00	2,396.55	100.00	2,400.38	100.00	1,123.49	100.00	922.35	100.00

ที่มา : งบการเงินรวมของ บริษัทฯ ฉบับตรวจสอบและสอบทานโดยผู้สอบบัญชีรับอนุญาต

3.3. ลักษณะผลิตภัณฑ์หรือบริการ

ลักษณะผลิตภัณฑ์หรือบริการของ บริษัทฯ สามารถแบ่งออกเป็น 9 กลุ่มธุรกิจ ดังนี้

- 1) ธุรกิจนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ (Securities Brokerage) และธุรกิจการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending: SBL)

บริษัทฯ ให้บริการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดหลักทรัพย์เอ็มเอไอ (mai) แก่ลูกค้ารายบุคคลและลูกค้าสถาบันทั้งในประเทศและต่างประเทศ โดยลูกค้าสามารถเลือกเปิดบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ได้ 3 ประเภท คือ บัญชีเงินสด (Cash Account) บัญชีที่วางหลักประกันเต็มจำนวน (Cash Balance) และบัญชีกู้ยืมเงินเพื่อซื้อขายหลักทรัพย์ (Credit Balance) และลูกค้าสามารถเลือกช่องทางการซื้อขายหลักทรัพย์ได้ 2 ช่องทางคือ การซื้อขายผ่านผู้แนะนำการลงทุน และการซื้อขายผ่านระบบอินเทอร์เน็ต Finansia HERO ซึ่งเป็นระบบซื้อขายหลักทรัพย์ออนไลน์ที่สามารถส่งคำสั่งได้รวดเร็ว รองรับการทำงานทั้งแบบ Mobile ซึ่งเรียกว่า Mobile Trading System (MTS) ที่รองรับทั้งระบบ iOS และ Android และการทำงานแบบ Desktop ซึ่งเรียกว่า Home Trading System (HTS) ทั้งนี้ Finansia HERO และบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ มีรายละเอียดดังนี้

Finansia HERO

ระบบซื้อขายหลักทรัพย์ออนไลน์ที่รองรับการทำงานทั้งแบบ Mobile และ Desktop โดยแยกเป็น 2 Applications ดังนี้

- (1) Mobile Trading System (MTS)

รองรับ 2 ค่ายมือถือยอดนิยมในประเทศไทย โดยสามารถดาวน์โหลดเพื่อติดตั้งโปรแกรมได้โดยตรงจาก iOS App Store และ Android Play Store

- (2) Home Trading System (HTS)

รองรับระบบปฏิบัติการวินโดวส์ ซึ่งเหมาะสำหรับนักลงทุนที่ต้องการใช้จอใหญ่ และใช้ข้อมูลสำหรับการวิเคราะห์มากขึ้น โดยสามารถใช้งานได้ทั้งบน Notebook, Windows Tablet และ PC Desktop นอกจากนี้ ยังรองรับ PC Desktop ที่เป็น Multi Monitors อีกด้วย

บัญชีซื้อขายหลักทรัพย์

ลูกค้าของ บริษัทฯ สามารถเลือกเปิดบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ได้ 3 ประเภท ดังนี้

- (1) บัญชีเงินสด (Cash Account)

เป็นบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ที่ลูกค้าต้องวางหลักประกันอย่างน้อยร้อยละ 20 ของมูลค่าที่ต้องการจะลงทุน ทำให้ไม่จำเป็นต้องนำเงินลงทุนทั้งหมดที่มีอยู่ไปฝากไว้กับ บริษัทฯ ทั้งนี้ บริษัทฯ จะกำหนดวงเงินซื้อขายให้แก่ลูกค้า โดยพิจารณาจากความสามารถในการชำระเงิน และฐานะทางการเงิน ซึ่งลูกค้าจะซื้อขายได้ไม่เกินวงเงินที่กำหนด ส่วนการชำระเงินนั้น จะชำระเงินค่าซื้อหลักทรัพย์โดยตัดบัญชีธนาคารภายใน 2 วันทำการ (T+2) หลังจากวันที่ซื้อหลักทรัพย์ และ บริษัทฯ จะส่งมอบเงินจากการขายหลักทรัพย์ให้แก่ลูกค้าที่ขายหลักทรัพย์ในวันทำการที่ 2 นับถัดจากวันที่ส่งขายหลักทรัพย์

(2) บัญชีที่วางหลักประกันเต็มจำนวน (Cash Balance)

เป็นบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ที่ลูกค้าต้องนำเงินสดมาค้ำประกันไว้กับ บริษัทฯ ร้อยละ 100 ก่อนการลงทุน ซึ่งเงินค้ำประกันที่ฝากไว้ จะได้รับดอกเบี้ยจาก บริษัทฯ ด้วย โดยจำนวนเงินที่ลูกค้านำมาฝากไว้ดังกล่าว จะเป็นวงเงินที่ลูกค้าสามารถซื้อหลักทรัพย์ได้ และกำลังซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าจะเปลี่ยนแปลงตามยอดกำลังซื้อเงินสดคงเหลือในบัญชีของลูกค้า

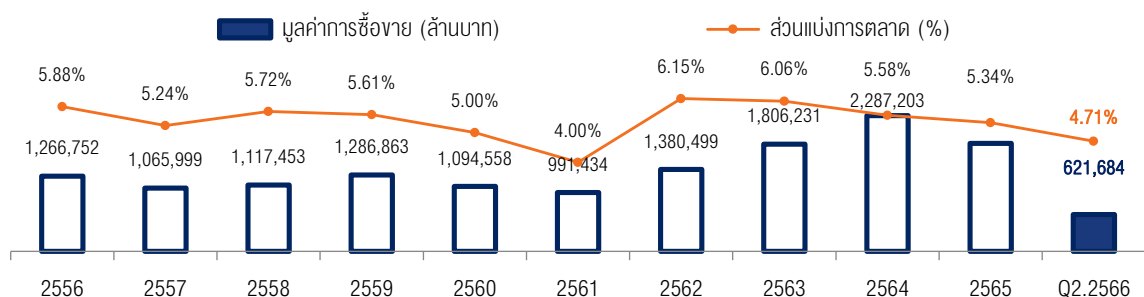
(3) บัญชีกู้ยืมเงินเพื่อซื้อขายหลักทรัพย์ (Credit Balance)

เป็นบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์สำหรับนักลงทุนที่ต้องการมีกำลังซื้อเพิ่มขึ้น ด้วยการกู้ยืมเงินจาก บริษัทฯ โดยลูกค้าจะต้องวางเงินหรือหลักทรัพย์มูลค่าอย่างน้อยเท่ากับ Initial Margin เพื่อเป็นหลักประกันการกู้เงินและใช้ในการคำนวณกำลังซื้อ ซึ่งลูกค้าจะได้รับดอกเบี้ยจาก บริษัทฯ หากจำนวนเงินสดที่วางเป็นหลักประกันสูงกว่ายอดหนี้ และจะต้องจ่ายดอกเบี้ยเงินกู้ยืมหากยอดหนี้สูงเกินกว่าเงินสดที่วางเป็นหลักประกัน

ส่วนในของธุรกิจการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (Securities Borrowing and Lending: SBL) บริษัทฯ ได้รับอนุญาตจากกระทรวงการคลังให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทกิจการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ เมื่อวันที่ 25 สิงหาคม 2553 และเริ่มให้บริการตั้งแต่วันที่ 16 กันยายน 2553 เป็นต้นมา โดย บริษัทฯ ทำหน้าที่เป็นคู่สัญญา (Principal) กับผู้ยืมและผู้ให้ยืมหลักทรัพย์ โดยจัดให้ลูกค้าผู้มีความประสงค์จะ ยืมหลักทรัพย์ หรือ ให้ยืมหลักทรัพย์ สามารถดำเนินการตามความประสงค์ การทำธุรกรรมนี้ส่งเสริมให้นักลงทุนมีทางเลือกในการลงทุนเพิ่มขึ้นในสภาวะที่ตลาดมีความผันผวน และยังเป็นอีกทางเลือกหนึ่งในการบริหารความเสี่ยงและเพิ่มผลตอบแทนให้กับนักลงทุน นอกจากนี้ ยังเป็นการสนับสนุนการประกอบธุรกิจอื่นๆ ของ บริษัทฯ เช่น ธุรกิจนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ ธุรกิจการลงทุน ธุรกิจ นายหน้าซื้อขายตราสารอนุพันธ์ ธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เป็นต้น

ทั้งนี้ มูลค่าการซื้อขายและส่วนแบ่งการตลาดของ บริษัทฯ สำหรับปี 2556 - 2565 และงวด 6 เดือนปี 2566 มีรายละเอียดดังนี้

มูลค่าการซื้อขายและส่วนแบ่งการตลาดของ บริษัทฯ สำหรับปี 2556 - 2565 และงวด 6 เดือนปี 2566



หมายเหตุ: ข้อมูลจาก SETSMART

ในปี 2565 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมีจำนวนนักลงทุนที่เปิดบัญชีทั้งหมด 3.4 ล้านราย เพิ่มขึ้นร้อยละ 9.66 จากสิ้นปี 2564 ทั้งนี้ การเพิ่มขึ้นของจำนวนนักลงทุนที่เปิดบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์นั้น มาจาก 3 ปัจจัยหลัก คือ 1. ภาวะดอกเบี้ยต่ำทำให้นักลงทุนสนใจสินทรัพย์ที่มีผลตอบแทนที่ดีขึ้นและภาวะเงินเฟ้อที่สูงขึ้น 2. การทำงานที่บ้าน (Work from Home : WFH) หนุนให้นักลงทุนมีความคุ้นชินกับการใช้ดิจิทัลมากขึ้น อาทิ เรียนออนไลน์ หาข้อมูลออนไลน์ ช้อปปิ้งออนไลน์ และทำให้การเปิดบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ทำได้ง่ายขึ้น 3. บริษัทจดทะเบียนมีการกระจายหุ้นให้กับนักลงทุนรายย่อยจำนวนมาก ซึ่งเป็นสิ่งที่กระตุ้นทำให้มีการเปิดบัญชีใหม่เพิ่มขึ้น

2) ธุรกิจนายหน้าซื้อขายตราสารอนุพันธ์ (Derivatives Brokerage)

บริษัทฯ ได้รับอนุญาตจากสำนักงาน ก.ล.ต. เมื่อวันที่ 14 ตุลาคม 2548 ให้ประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า รวมทั้งมีคุณสมบัติครบถ้วนในการเป็นสมาชิกประเภทตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (Thailand Futures Exchange : TFEX) และบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด (Thailand Clearing House : TCH) โดย บริษัทฯ ได้เริ่มให้บริการการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตั้งแต่วันที่ 17 มีนาคม 2551 เป็นต้นมา

นอกจากนี้ ในเดือนกรกฎาคม ปี 2558 บริษัทฯ ได้เปิดบริการรับเข้าเป็นคู่สัญญาของ Single Stock Future ผ่านกระดานซื้อขายรายใหญ่ เพื่อช่วยเสริมสภาพคล่องของ Single Stock Future โดย บริษัทฯ คาดหวังว่าจะสามารถรองรับปริมาณธุรกรรมที่สูงขึ้น และเป็นการเพิ่มช่องทางรายได้ให้แก่ บริษัทฯ เนื่องจากตลาด TFEX เป็นตลาดที่นักลงทุนกำลังให้ความสนใจ ทำให้ภาพรวมของปริมาณการซื้อขายของตลาด TFEX เพิ่มสูงขึ้นทุกปี โดยเฉพาะ Single Stock Future

ทั้งนี้ แผนงานธุรกิจและแผนงานด้านการตลาดของธุรกิจนายหน้าซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า จะสร้างฐานลูกค้าจากกลุ่มลูกค้าเดิมที่ซื้อขายหลักทรัพย์กับ บริษัทฯ เนื่องจากลูกค้ากลุ่มนี้จะมีความรู้ความเข้าใจในการลงทุนระดับหนึ่ง และสำหรับลูกค้ารายใหม่ของ บริษัทฯ จะเน้นลูกค้าที่มีฐานะทางการเงินที่มั่นคง มีความรู้และความเข้าใจเกี่ยวกับธุรกรรมทั้งการลงทุนในหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นอย่างดี นอกจากนี้ บริษัทฯ ยังได้จัดอบรมให้ความรู้กับลูกค้าและผู้สนใจ ให้เข้าใจถึงกลยุทธ์การลงทุน รวมถึงผลตอบแทนและความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากการลงทุน เพื่อให้สามารถใช้ประโยชน์จากตราสารอนุพันธ์ในการลงทุน หรือใช้เพื่อป้องกันความเสี่ยงได้

3) ธุรกิจวาณิชธนกิจ (Investment Banking)

บริษัทฯ ประกอบธุรกิจวาณิชธนกิจโดยให้บริการเป็นที่ปรึกษาทางการเงินในด้านต่างๆ โดยทีมงานด้านวาณิชธนกิจของบริษัทฯ ประกอบด้วยบุคลากรหลักที่มีความเชี่ยวชาญและประสบการณ์มาอย่างยาวนาน อีกทั้งมีความรู้ในด้านตลาดทุนอย่างลึกซึ้ง ทั้งนี้ บริษัทฯ ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ต. ในการให้บริการเป็นที่ปรึกษาทางการเงินตั้งแต่วันที่ 30 กันยายน 2545 และได้รับใบอนุญาตจากกระทรวงการคลังให้ประกอบธุรกิจการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์อีกด้วย โดยการให้บริการด้านวาณิชธนกิจของ บริษัทฯ มีรายละเอียดดังนี้

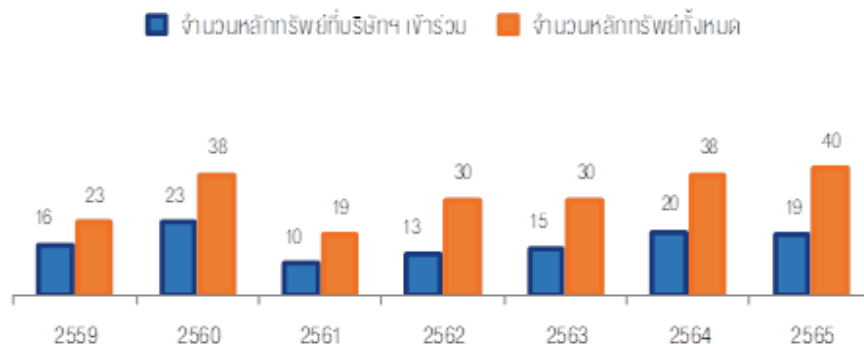
- การออกและเสนอขายหลักทรัพย์ประเภทต่างๆ รวมถึงการนำบริษัทเข้าจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ (Securities Issuance & Offering)
- การจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ (Securities Underwriting)

- การควบรวมกิจการ (Merger & Acquisition)
- การประเมินมูลค่ากิจการ (Corporate Valuation)
- การปรับโครงสร้างทางการเงิน (Financial Restructuring)
- การศึกษาความเป็นไปได้ทางการเงิน (Financial Feasibility)
- การเข้าทำรายการประเภทต่างๆ ของบริษัทจดทะเบียน เพื่อให้เป็นไปตามกฎระเบียบของสำนักงาน ก.ล.ต. และตลาดหลักทรัพย์ฯ เช่น การได้มาและจำหน่ายไปซึ่งสินทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียน การเข้าทำรายการเกี่ยวโยงกันของบริษัทจดทะเบียน และการเพิกถอนหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียน เป็นต้น

ในรอบปีที่ผ่านมา บริษัทฯ ได้ให้บริการเป็นที่ปรึกษาทางการเงินในการเสนอขายหุ้นต่อประชาชนทั่วไปเป็นครั้งแรก ได้แก่ บมจ. ไอ-เทล คอร์ปอเรชั่น รวมถึงได้เข้าร่วมจัดจำหน่ายหุ้นสามัญที่เสนอขายต่อประชาชนทั่วไปเป็นครั้งแรก (IPO) จำนวน 19 หลักทรัพย์ โดย บริษัทฯ ทำหน้าที่เป็นผู้จัดการการจัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหุ้นสามัญจำนวน 2 บริษัท และเป็นผู้จัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหุ้นสามัญจำนวน 17 บริษัท

ทั้งนี้ ผลงานการเป็นผู้จัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหุ้นสามัญที่เสนอขายต่อประชาชนทั่วไปเป็นครั้งแรก (IPO) ของ บริษัทฯ สำหรับปี 2559 - 2565 มีรายละเอียดดังนี้

**ผลงานการเป็นผู้จัดจำหน่ายและรับประกันการจำหน่ายหุ้นสามัญ
ที่เสนอขายต่อประชาชนทั่วไปเป็นครั้งแรก (IPO) ของ บริษัทฯ สำหรับปี 2559 - 2565**



นอกจากนี้ ในระหว่างปี 2565 บริษัทฯ ได้เข้าลงทุนในบริษัทย่อยทางอ้อม คือ FSL ซึ่งลงทุนผ่าน บริษัทฯIA โดย FSL เป็นบริษัทที่ปรึกษาทางการเงิน ซึ่งขอเขตการให้บริการด้านที่ปรึกษาทางการเงินของ FSL มีรายละเอียดดังนี้

- การให้คำปรึกษาทางการเงิน
- การจัดหาเงินทุนสนับสนุนโครงการ
- การเสนอขายหลักทรัพย์แบบเฉพาะเจาะจงและการเสนอขายหลักทรัพย์ต่อประชาชน
- การควบรวมและการเข้าซื้อกิจการ
- การจัดทำรายงานแสดงความคิดเห็นที่เป็นกลาง
- การปรับโครงสร้างทางการเงินและโครงสร้างบริษัท
- การให้คำปรึกษาการลงทุนส่วนบุคคล

การลงทุนใน FSL จะช่วยเสริมจุดแข็งของบริษัทฯ ในธุรกิจที่ปรึกษาทางการเงิน กล่าวคือ FSL มีทีมงานผู้บริหารที่มีความรู้และประสบการณ์ในธุรกิจมาอย่างยาวนาน มาช่วยเพิ่มศักยภาพ สร้างความแข็งแกร่งให้กับธุรกิจที่ปรึกษาทางการเงิน

4) ธุรกิจลงทุน (Investment)

บริษัทฯ ได้จัดให้มีฝ่ายค้าหลักทรัพย์เพื่อรับผิดชอบดูแลธุรกิจการลงทุนของ บริษัทฯ ซึ่งมีนโยบายลงทุนในตราสารทุน ตราสารหนี้ หุ้นกู้ หน่วยลงทุน หรือลงทุนในกิจการนอกตลาดหลักทรัพย์ฯ ภายใต้กฎระเบียบตามที่กำหนดอย่างเคร่งครัด และมีวัตถุประสงค์เพื่อการค้าทั้งในระยะสั้นและลงทุนในระยะยาว โดยคณะกรรมการบริษัทจะเป็นผู้พิจารณาจัดสรรวงเงิน กำหนดแนวทาง หลักเกณฑ์ ระเบียบวิธีปฏิบัติ และนโยบายการลงทุนที่ชัดเจนและสอดคล้องกับการกำกับดูแลตามประกาศที่เกี่ยวข้องของสำนักงาน ก.ล.ต. ซึ่ง บริษัทฯ ได้รับผลตอบแทนเป็นกำไรจากการซื้อขายหลักทรัพย์ เงินปันผล และดอกเบี้ยรับ นอกจากนี้ บริษัทฯ ได้จัดตั้งคณะกรรมการบริหารการลงทุนและคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง ซึ่งผ่านความเห็นชอบจากคณะกรรมการของ บริษัทฯ ให้ทำหน้าที่กำหนดกลยุทธ์หรือนโยบายการลงทุนของ บริษัทฯ ทั้งประเภทระยะสั้นและระยะยาว โดยกระจายความเสี่ยงในการลงทุนของ บริษัทฯ ตามสัดส่วนการลงทุนที่เหมาะสม จำกัดผลขาดทุนที่อาจเกิดขึ้นและรายงานสถานะการลงทุนของ บริษัทฯ ให้แก่คณะกรรมการบริษัทเพื่อให้สามารถติดตามการลงทุนของ บริษัทฯ ได้อย่างมีประสิทธิภาพ

5) ธุรกิจบริหารสินทรัพย์ลงทุนลูกค้า (Wealth Management)

บริษัทฯ ได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนส่วนบุคคล (Private Fund) ในวันที่ 18 กุมภาพันธ์ 2563 ทำให้ บริษัทฯ สามารถให้บริการในลักษณะการบริหารจัดการสินทรัพย์ (Portfolio Management) โดยทีมงานผู้จัดการกองทุนส่วนบุคคล ภายใต้กรอบที่ลูกค้าสามารถมีส่วนร่วมในการกำหนดกลยุทธ์ เป้าหมายการลงทุน เงื่อนไข และข้อจำกัดในการลงทุน ที่ตอบโจทย์เฉพาะบุคคลมากขึ้น ซึ่งทีมงานกองทุนส่วนบุคคลมีนโยบายการลงทุนที่ครอบคลุมสินทรัพย์หลายประเภท อาทิเช่น ตราสารทุน ตราสารหนี้ และกองทุนทางเลือกอื่นๆ ทั้งในและต่างประเทศเพื่อเข้าถึงกลุ่มลูกค้าในทุกระดับความเสี่ยง โดยมีการติดตามและรายงานสถานะการลงทุนของลูกค้าอย่างใกล้ชิด รวมทั้งสรรหาโอกาสในการลงทุนใหม่ๆ อยู่เสมอ

นอกจากนี้ บริษัทฯ มีการให้บริการซื้อขายกองทุนรวมซึ่งอำนวยความสะดวกแก่ลูกค้าภายใต้แนวคิดการให้บริการจุดเดียวแบบครบวงจร โดยลูกค้าสามารถทำรายการซื้อ ขาย สับเปลี่ยนกองทุนรวมได้ทุกประเภท จากทุกบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม (บลจ.) ที่ บริษัทฯ เป็นตัวแทน โดยไม่มีค่าใช้จ่ายเพิ่มเติม พร้อมมีข้อมูลเชิงเปรียบเทียบ และการนำเสนอสรุปรายการลงทุนทั้งหมดในรายงานฉบับเดียว ซึ่งเป็นการอำนวยความสะดวกให้แก่การลงทุนในกองทุนรวมของลูกค้า ทั้งนี้ บริษัทฯ มีบริการเปิดบัญชีซื้อขายหน่วยลงทุน 2 ประเภท ดังนี้

(1) บัญชีประเภท Omnibus

เป็นบริการที่ลูกค้าสามารถทำรายการซื้อ ขาย สับเปลี่ยนกองทุนรวมของทุก บลจ. ที่เป็นตัวแทน ภายใต้บัญชีเพียงบัญชีเดียว (แบบไม่เปิดเผยชื่อ) โดยทำรายการผ่านช่องทางโทรศัพท์ หรือลงนามในแบบฟอร์มการทำรายการ นอกจากนี้ ยังมีบริการสรุปยอดหน่วยลงทุนคงเหลือประจำเดือนจากทุก บลจ. ไว้ในรายงานฉบับเดียว จึงสะดวกในการตรวจสอบสถานะและบริหารจัดการเงินลงทุน

(2) บัญชีประเภท Selling Agent

เป็นบริการสำหรับลูกค้าที่ต้องการลงทุนในกองทุนรวมทั่วไป และยังรวมถึงกองทุนรวมหุ้นระยะยาว (LTF) กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ (RMF) และ กองทุนอสังหาริมทรัพย์ (Property Fund) ที่เสนอขายครั้งแรกครั้งเดียว

โดยรายละเอียดของบัญชีซื้อขายหน่วยลงทุนทั้ง 2 ประเภท สามารถสรุปได้ดังนี้

สรุปรายละเอียดบัญชีซื้อขายหน่วยลงทุนของ บริษัทฯ

ประเภทบัญชี	Omnibus	Selling Agent
การเปิดบัญชี	เปิดบัญชีเดียว (แบบไม่เปิดเผยชื่อ) สามารถซื้อขายได้ทุก บลจ. ที่ บริษัทฯ เป็นตัวแทน	เปิดบัญชี (แบบฟอร์ม FCN) ชุดเดียวรวมรายบลจ.
ประเภทกองทุนที่ให้บริการ	สามารถทำรายการได้ทุกประเภทกองทุน ยกเว้นกองทุน RMF/SSF	สามารถทำรายการได้ทุกประเภทกองทุนรวมกองทุน RMF/SSF
ช่องทางการทำรายการ	ส่งคำสั่งทางโทรศัพท์ หรือใบคำสั่งซื้อขาย หรือ Finansia Fund Online	ส่งใบคำสั่งซื้อขายของแต่ละ บลจ. หรือ Finansia Fund Online
ช่วงเวลาทำรายการ	ภายใน 14.30 น. ของทุกวันทำการ ซึ่งอาจมีการเปลี่ยนแปลงตามเงื่อนไขของแต่ละกองทุน	ภายในเวลาที่แต่ละ บลจ. กำหนด
การชำระเงินและการรับเงิน	ผ่านระบบของ Finansia, โอนตรง บลจ. หรือ QR Payment	ผ่านระบบของ Finansia, โอนตรง บลจ. หรือ QR Payment และ Credit card (สำหรับกองทุน RMF, SSF ตามเงื่อนไขของแต่ละบลจ.)
เอกสารและรายงานการลงทุน	ออกโดย Finansia <ul style="list-style-type: none"> หนังสือยืนยันการทำรายการ รายงานยอดหน่วยลงทุน คงเหลือสรุปรวมทุก บลจ. 	ออกโดย บลจ. แต่ละแห่ง <ul style="list-style-type: none"> หนังสือยืนยันการทำรายการ รายงานยอดหน่วยลงทุนคงเหลือ

นอกจากนี้ บริษัทฯ ยังมีบริการ Trading Plus ซึ่งเป็นบริการเพิ่มผลตอบแทนของเงินลงทุนสำหรับลูกค้าที่ซื้อขายหลักทรัพย์ โดยการนำเงินที่ได้จากการขายหลักทรัพย์เข้าลงทุนในกองทุนรวมตลาดเงินโดยอัตโนมัติ และเมื่อมีการซื้อหลักทรัพย์ จะทำการขายกองทุนเพื่อชำระค่าซื้อหลักทรัพย์โดยอัตโนมัติเช่นกัน ซึ่งกองทุนที่ บริษัทฯ เลือกมีระดับความเสี่ยงต่ำและมีโอกาสได้รับผลตอบแทนที่ดีกว่าอัตราดอกเบี้ยเงินฝาก

ณ 31 มีนาคม 2566 บริษัทฯ รับเป็นตัวแทนสนับสนุนการขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนให้กับ บลจ. จำนวน 18 แห่ง โดย บริษัทฯ ยังคงมีแผนที่จะเพิ่มจำนวน บลจ. ในการเป็นตัวแทนสนับสนุนการขายและรับซื้อคืน เพื่อเพิ่มความหลากหลายของผลิตภัณฑ์กองทุนรวมและมีแผนงานพัฒนาระบบการให้บริการด้านกองทุนรวมอย่างต่อเนื่อง อันจะตอบสนองความต้องการและสร้างความพึงพอใจสูงสุดแก่ลูกค้า

6) ธุรกิจนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศ (Global Trading)

บริษัทฯ ให้บริการลูกค้าด้านการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศ ด้วยโปรแกรมการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตที่มีประสิทธิภาพ และมีระบบรักษาความปลอดภัยของข้อมูลที่ได้มาตรฐานและเป็นที่ยอมรับในระดับสากล

สามารถซื้อขายหลักทรัพย์ได้กว่า 25 ประเทศ 36 ตลาดทุนทั่วโลก โดยระบบซื้อขายอำนวยความสะดวกให้นักลงทุนสามารถจัดการ Portfolio การลงทุนเองได้อย่างง่ายดาย ภายใต้การเปิดบัญชีครั้งเดียว ทั้งยังรองรับการชำระราคาได้หลายสกุลเงิน (Multi-Currency Settlement) โดยไม่ต้องเปิดบัญชีเงินฝากต่างประเทศ (Foreign Currency Deposit Account : FCD) ทำให้ลูกค้าสามารถย้ายเงินลงทุนจากตลาดอื่นไปสู่ตลาดที่มีแนวโน้มที่ผลตอบแทนที่สูงกว่าได้ตลอดเวลา สำหรับด้านการชำระราคาระหว่างประเทศ บริษัทฯ สามารถทำธุรกรรมดังกล่าวผ่านตัวแทนต่างประเทศที่มีความมั่นคงและเชี่ยวชาญในด้านการชำระราคาระหว่างประเทศ ทั้งนี้ เพื่อเพิ่มความเชื่อมั่นให้กับนักลงทุนด้านประสิทธิภาพในการชำระราคา และความปลอดภัยในการลงทุนต่างประเทศ โดยตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศที่บริษัทฯ ให้บริการมีดังนี้

- ทวีปเอเชีย : ฮองกง กัมพูชา สิงคโปร์ ลาว ญีปุ่น และเวียดนาม
- ทวีปยุโรป : เนเธอร์แลนด์ อิตาลี โปรตุเกส ฟินแลนด์ เยอรมนี นอร์เวย์ สวิตเซอร์แลนด์ เดนมาร์ก ออสเตรเลีย สวีเดน เบลเยียม สเปน ฝรั่งเศส โปแลนด์ สหราชอาณาจักร
- ทวีปอเมริกาเหนือ : สหรัฐอเมริกา
- ทวีปออสเตรเลีย : ออสเตรเลีย

ในการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศนั้น บริษัทฯ ต้องมีใบอนุญาตการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ ซึ่งได้รับการอนุญาตจากกระทรวงการคลัง รวมถึงต้องปฏิบัติตามเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนในหลักทรัพย์ต่างประเทศที่กำหนดโดยธนาคารแห่งประเทศไทย

7) ธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrant : DW)

บริษัทฯ ได้ออกและเสนอขาย Derivative Warrants (DW) ครั้งแรกในเดือนกุมภาพันธ์ 2559 ในลักษณะการเสนอขายผ่านระบบซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ (Direct Listing) ซึ่งในปี 2564 บริษัทฯ ได้ออกและเสนอขาย DW ทั้งหมดจำนวน 108 รุ่น โดยได้รับการตอบรับจากนักลงทุนเป็นอย่างดี ทั้งนี้ บริษัทฯ ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (Credit Rating) ระยะยาวในระดับ “BBB+(tha)” มีแนวโน้มอันดับเครดิตที่ “Stable” หรือ “แนวโน้มอันดับเครดิตคงที่” และได้รับเครดิตในประเทศระยะสั้นระดับ “F2(thai)” จากบริษัท Fitch Ratings (ประเทศไทย) เมื่อวันที่ 29 ธันวาคม 2565

DW เป็นผลิตภัณฑ์ในช่วงหลายปีที่ผ่านมา นักลงทุนได้เข้ามาศึกษา เรียนรู้ และให้ความสนใจกันมากขึ้น ในการพัฒนาธุรกิจ DW ให้เจริญเติบโตอย่างยั่งยืนนั้น บริษัทฯ ได้ให้ความสำคัญกับการให้ความรู้แก่นักลงทุนเป็นอย่างมาก เพื่อให้ นักลงทุนเข้าใจถึงผลิตภัณฑ์ที่มีความซับซ้อน และรับรู้ถึงความเสี่ยงและผลตอบแทนจากการลงทุนใน DW โดย บริษัทฯ ได้จัดสรรให้มีช่องทางการให้ข้อมูลเกี่ยวกับ DW หลายช่องทาง เช่น เว็บไซต์ (<http://www.dwarrant24.com>) Line Official Account (Line ID: @dw24) และ Facebook (<https://www.facebook.com/Dwarrant24>) เพื่อเป็นตัวช่วยในการตัดสินใจ นอกจากนี้ บริษัทฯ มีการจัดทำทวีตเตอร์เพื่อใช้เป็นเครื่องมือในการซื้อขายให้แก่ักลงทุนอีกด้วย

8) ธุรกิจนายหน้าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล (Digital Asset Brokerage)

เมื่อวันที่ 22 มีนาคม 2565 คณะกรรมการบริษัทได้มีมติอนุมัติให้ บริษัทฯ จัดตั้งบริษัทย่อย คือ FDA เพื่อประกอบธุรกิจธุรกิจนายหน้าหรือตัวแทนเพื่อซื้อขายหรือแลกเปลี่ยนสินทรัพย์ดิจิทัลให้แก่บุคคลอื่นโดยกระทำเป็นทางค้าปกติและได้รับค่าธรรมเนียมหรือค่าตอบแทนอื่น แต่ไม่รวมถึงการเป็นนายหน้าหรือตัวแทนในลักษณะที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศกำหนด ทั้งนี้ FDA อยู่ระหว่างการเตรียมการยื่นขอใบอนุญาตการประกอบธุรกิจนายหน้าซื้อขายโทเคนดิจิทัล และนายหน้าซื้อขายคริปโทเคอร์เรนซี คาดว่าจะได้รับการอนุมัติการขอใบอนุญาตภายในปี 2566

9) ธุรกิจตราสารหนี้ (Bond)

บริษัทฯ เป็นสมาชิกของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (Thai Bond Market Association : Thai BMA) และตลาดตราสารหนี้แห่งประเทศไทยในการให้บริการเป็นตัวแทนและซื้อขายตราสารหนี้ให้แก่นักลงทุน โดย บริษัทฯ ให้บริการเป็นตัวแทนจำหน่ายตราสารหนี้และหุ้นกู้ให้แก่นักลงทุน และเป็นตัวแทนนายหน้าซื้อขายตราสารหนี้ในตลาดรอง ซึ่งการดำเนินธุรกิจตราสารหนี้ เป็นการตอบสนองความต้องการของลูกค้าภายใต้แนวคิดการให้บริการจุดเดียวแบบครบวงจร (One Stop Service) ซึ่งถือเป็นทางเลือกในการลงทุนที่สร้างรายได้คงที่ผ่านตราสารหนี้ทั้งภาครัฐและภาคเอกชนทั้งระยะสั้นและระยะยาว เพื่อช่วยวางแผนการเงินให้สอดคล้องกับความต้องการการลงทุนในตราสารหนี้ ไม่ว่าจะเป็นการรับอัตราผลตอบแทนที่สูงขึ้น สำหรับผู้ที่มีความสามารถในการรับความเสี่ยงได้มากขึ้น การกระจายความเสี่ยงพอร์ตการลงทุน หรือการเป็นทางเลือกการลงทุนในกรณีสินทรัพย์อื่นมีความผันผวน เนื่องจากสามารถซื้อขายได้สะดวกและรวดเร็ว ทั้งนี้ บริษัทฯ ให้บริการตราสารหนี้ทั้งในตลาดแรกและตลาดรอง โดยมีรายละเอียดดังนี้

(1) ตลาดแรก (Primary Market)

การออกและเสนอขายตราสารทางการเงินประเภทต่างๆ เพื่อระดมทุน โดยเป็นตราสารใหม่ที่จำหน่ายแก่ผู้ลงทุนครั้งแรก

(2) ตลาดรอง (Secondary Market)

การซื้อขายตราสารทางการเงินประเภทต่างๆ ที่ได้ผ่านการซื้อขายในตลาดแรกมาแล้ว โดยผู้ลงทุนสามารถซื้อขายตราสารทางการเงินได้อย่างคล่องตัว และทำให้ตราสารทางการเงินประเภทนั้นๆ ได้รับความสนใจจากผู้ลงทุนมากยิ่งขึ้น

4. **ทรัพย์สินที่ใช้ในการประกอบธุรกิจ**

4.1. **ทรัพย์สินถาวรหลักที่ใช้ในการประกอบธุรกิจ**

บริษัทฯ มีอาคารชุดและอุปกรณ์ซึ่งเป็นทรัพย์สินถาวรหลักที่ใช้ในการประกอบธุรกิจ ในงบการเงินรวมโดยมีมูลค่าตามบัญชีสุทธิ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565 และวันที่ 30 มิถุนายน 2566 จำนวน 485.71 ล้านบาท และ 476.34 ล้านบาท ตามลำดับ ทั้งนี้ อาคารชุดและอุปกรณ์ของบริษัทฯ มีรายละเอียดดังนี้

อาคารชุดและอุปกรณ์รวมของบริษัทฯ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565 และ 31 มีนาคม 2566

รายการ	สิทธิในทรัพย์สิน	มูลค่าสุทธิหลังหักค่าเสื่อมราคา (หน่วย : ล้านบาท)		ภาวะผูกพัน
		31 ธ.ค. 65	30 มิ.ย. 66	
อาคารชุดและส่วนปรับปรุง	กรรมสิทธิ์	392.46	384.04	ไม่มี
อุปกรณ์สำนักงาน	กรรมสิทธิ์	52.76	52.91	ไม่มี
เครื่องตกแต่งและติดตั้ง	กรรมสิทธิ์	19.16	22.99	ไม่มี
ยานพาหนะ	กรรมสิทธิ์	15.90	14.65	ไม่มี
อุปกรณ์ระหว่างติดตั้ง	กรรมสิทธิ์	5.44	1.75	ไม่มี

ที่มา : งบการเงินรวมของ บริษัทฯ ฉบับตรวจสอบและงบการเงินระหว่างกาลของ บริษัทฯ ฉบับสอบทาน

สินทรัพย์ไม่มีตัวตนและสินทรัพย์สิทธิการใช้

บริษัทฯ มีสินทรัพย์ไม่มีตัวตน ประกอบด้วย ค่าสมาชิกและตลาดอนุพันธ์ ค่าซื้อส่วนงานนายหน้าลูกค้ารายย่อย โปรแกรมคอมพิวเตอร์ สิทธิในการใช้ระบบ และโปรแกรมคอมพิวเตอร์ระหว่างพัฒนา โดยมีมูลค่าตามราคาทุนหักค่าตัดจำหน่าย

สะสมตามงบการเงินรวม ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565 และวันที่ 30 มิถุนายน 2566 จำนวน 212.45 ล้านบาท และ 209.45 ล้านบาท ตามลำดับ นอกจากนี้ บริษัทฯ มีใบอนุญาตการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ครบทั้ง 9 ประเภท ซึ่งมีได้แสดงมูลค่าอยู่ในงบการเงิน ประกอบด้วย ใบอนุญาตการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ ใบอนุญาตการค้าหลักทรัพย์ ใบอนุญาตการเป็นที่ปรึกษาการลงทุน ใบอนุญาตการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ ใบอนุญาตการเป็นที่ปรึกษาทางการเงิน ใบอนุญาตการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ใบอนุญาตการจัดการกองทุนรวม ใบอนุญาตการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ และใบอนุญาตการจัดการกองทุนส่วนบุคคล (กองทุนส่วนบุคคล) ทั้งนี้ สินทรัพย์ไม่มีตัวตนและสินทรัพย์สิทธิการใช้ของบริษัทฯ มีรายละเอียด ดังนี้

สินทรัพย์ไม่มีตัวตนและสินทรัพย์สิทธิการใช้ของบริษัทฯ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565 และ 30 มิถุนายน 2566

รายการ	สิทธิในทรัพย์สิน	มูลค่าสุทธิหลังหักค่าเสื่อมราคา (หน่วย : ล้านบาท)		ภาวะผูกพัน
		31 ธ.ค. 65	30 มิ.ย. 66	
สินทรัพย์ไม่มีตัวตน	กรรมสิทธิ์	212.45	209.45	ไม่มี
สินทรัพย์สิทธิการใช้	สัญญาเช่า	200.88	173.59	ไม่มี

ที่มา : งบการเงินรวมของ บริษัทฯ ฉบับตรวจสอบ และงบการเงินระหว่างกาลของ บริษัทฯ ฉบับสอบทาน

4.2. นโยบายการลงทุน

บริษัทฯ มีนโยบายการลงทุนในบริษัทย่อยและบริษัทร่วมที่ประกอบธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจหลักทรัพย์ หรือธุรกิจอื่น เพื่อให้สามารถสนับสนุนการดำเนินงานของ บริษัทฯ หรือการทำธุรกิจให้มีความหลากหลาย และเพิ่มความสามารถในการแข่งขันมากยิ่งขึ้น โดย บริษัทฯ ได้มีการแต่งตั้งบุคลากรของบริษัทฯ เข้าร่วมเป็นกรรมการ เพื่อร่วมบริหารจัดการและกำหนดนโยบายการดำเนินการต่างๆ

5. ข้อพิพาททางกฎหมาย

ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566 บริษัทฯ มีคดีซึ่งถูกฟ้องร้องเรียกค่าเสียหายจำนวน 3 คดี คิดเป็นมูลฟ้องจำนวนรวมประมาณ 16 ล้านบาท ซึ่งผลของคดียังไม่เป็นที่สิ้นสุด ฝ่ายบริหารของ บริษัทฯ ประเมินว่าอาจจะได้รับผลเสียหายบางส่วน จึงได้ตั้งสำรองค่าเผื่อผลเสียหายที่คาดว่าจะเกิดขึ้นจำนวนประมาณ 9 ล้านบาทแล้วในงบการเงินปี 2565 และงบการเงินระหว่างกาลงวด 6 เดือนปี 2566

ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566 บริษัทฯ ถูกฟ้องเป็นคดีแพ่งในข้อหาฝ่าฝืนพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 เพิกถอนตัวแลกเงิน เพิกถอนสัญญาจำนอง เพิกถอนหนังสือรับสภาพหนี้ ละเมิด เรียกค่าเสียหาย จำนวนทุนทรัพย์ 1,432 ล้านบาท ร่วมกับจำเลยทั้ง 24 ราย (บริษัทฯ เป็นจำเลยที่ 10 ทุนทรัพย์ตามหน้าตัวแลกเงินมูลค่า 430 ล้านบาท) คดีอยู่ระหว่างจำเลยทั้ง 24 ราย ยื่นคำให้การ ซึ่งผลของคดียังไม่เป็นที่สิ้นสุด ฝ่ายบริหารของ บริษัทฯ ภายใต้ความเห็นทางกฎหมาย ประเมินว่า บริษัทฯ จะไม่ได้รับผลเสียหายจากคดีดังกล่าวต่องบการเงิน

6. โครงสร้างเงินทุน

6.1. หลักทรัพย์ของบริษัทฯ

ณ วันที่ 17 สิงหาคม 2566 บริษัทมีทุนจดทะเบียน 930,244,840.00 บาท เรียกชำระแล้วเต็มจำนวน แบ่งเป็นหุ้นสามัญ จำนวน 581,403,025 หุ้น มูลค่าที่ตราไว้ต่อหุ้น 1.60 บาท

6.2. ผู้ถือหุ้น

ผู้ถือหุ้นและสัดส่วนของบริษัท ณ วันที่ 17 สิงหาคม 2566 มีรายละเอียดดังนี้

ลำดับ	รายชื่อผู้ถือหุ้น	จำนวนหุ้น (หุ้น)	สัดส่วนการถือหุ้น (ร้อยละ)
1	บริษัท ฟินันเซีย เอกซ์ จำกัด (มหาชน)	579,919,416	99.74
2	ผู้ถือหุ้นรายย่อยอื่น	1,483,564	0.26
จำนวนหุ้นทั้งหมด		581,403,025	100.00

โดยกรรมการของบริษัทมีทั้งหมด 9 ท่าน ตามรายชื่อดังนี้

1. นายชัชวาลย์ เจียรนวนนท์
2. นายสมภพ กิระสุนทรพงษ์
3. พลตำรวจเอกวิสนุ ปราสาททองโอสถ
4. นายไพบุลย ศิริภาณุเสถียร
5. นายชวงชัย นະวงค์
6. นายกิตติศักดิ์ เบญจฤทธิ
7. นายวรภัค ธีนยาวงษ์
8. นายเสกสรร ชุณหเสรีชัย
9. นายวราห สุจริตกุล

ชื่อและจำนวนกรรมการ ซึ่งมีอำนาจลงลายมือชื่อแทนบริษัท คือ นายสมภพ กิระสุนทรพงษ์ นายชวงชัย นະวงค์

นายชัชวาลย์ เจียรนวนนท์ นายวราห สุจริตกุล สองในสี่คนนี้ลงลายมือชื่อรวมกันและประทับตราสำคัญของบริษัท

หมายเหตุ: กรรมการของบริษัทฯ (ยกเว้นนายวราห สุจริตกุล) มีการดำรงตำแหน่งกรรมการในบริษัท ฟินันเซีย เอกซ์ จำกัด (มหาชน) ซึ่งเป็นผู้ถือหุ้นใหญ่ของบริษัทในสัดส่วนร้อยละ 99.74

6.3. นโยบายการจ่ายปันผล

บริษัทมีนโยบายจ่ายเงินปันผลไม่ต่ำกว่าร้อยละ 40.00 ของกำไรสุทธิจากงบเฉพาะกิจการของบริษัทภายหลังจากหักภาษีเงินได้นิติบุคคลและการจัดสรรทุนสำรองต่างๆ ทุกประเภทตามที่ได้กำหนดไว้ในกฎหมายและข้อบังคับของบริษัท ทั้งนี้ การจ่ายเงินปันผลอาจน้อยกว่าอัตราที่กำหนดข้างต้นโดยคำนึงถึงปัจจัยต่างๆ เช่น ภาวะเศรษฐกิจ ผลการดำเนินงานและฐานะทางการเงิน กระแสเงินสด เงินทุนหมุนเวียน แผนการลงทุนและการขยายธุรกิจภาวะหนี้สิน เงื่อนไขและข้อจำกัดตามที่กำหนดในสัญญากู้ยืมเงิน และความเหมาะสมอื่นๆ ตามที่คณะกรรมการบริษัทพิจารณาเห็นสมควร

ข้อมูลการจ่ายเงินปันผลสำหรับปี 2563 - 2565 ของบริษัทก่อนการปรับโครงสร้างการถือหุ้นมีรายละเอียดดังนี้

รายการ	ปี 2563	ปี 2564	ปี 2565
กำไรสุทธิ (ล้านบาท)	87.57	296.43	218.16

รายการ	ปี 2563	ปี 2564	ปี 2565
อัตรากำไรสุทธิ (บาทต่อหุ้น)	0.15	0.51	0.38
กำไรสุทธิหลังจากหักเงินสำรองตามกฎหมาย (ล้านบาท)	83.19	286.42	218.16
เงินปันผลจ่าย (ล้านบาท)	34.88	58.14	40.70
อัตรากำไรเงินปันผลต่อหุ้น (บาทต่อหุ้น)	0.06	0.10	0.07
อัตรากำไรจ่ายเงินปันผลต่อกำไรสุทธิหลังจากหักเงิน สำรองตามกฎหมาย ^{/1} (ร้อยละ)	41.93	20.30	18.66
อัตรากำไรจ่ายเงินปันผลต่อกำไรสุทธิ (ร้อยละ)	39.84	19.61	18.66

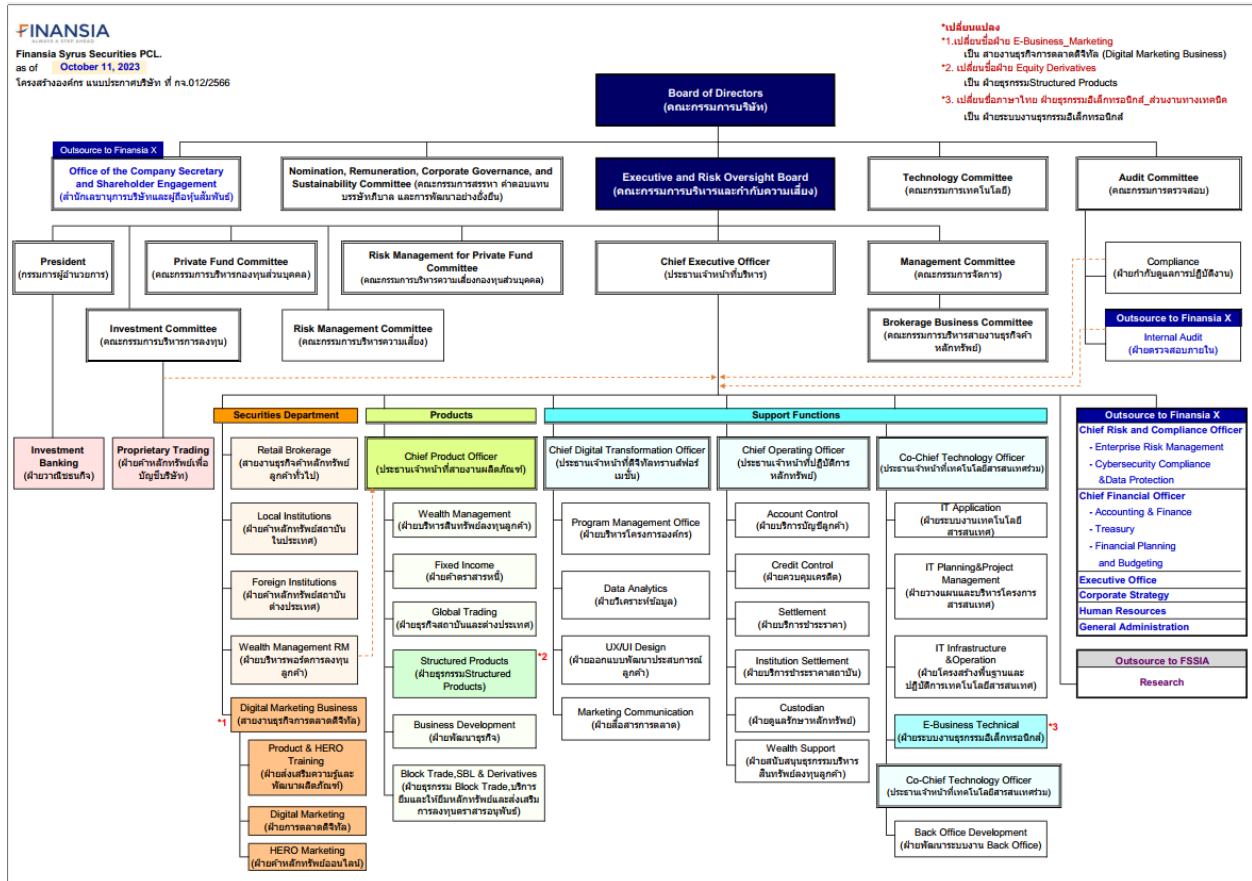
หมายเหตุ : /1 อัตรากำไรจ่ายเงินปันผลคำนวณจากงบการเงินเฉพาะกิจการ โดยใช้กำไรสุทธิของบริษัทฯ หลังหักเงินสำรองตามกฎหมาย จำนวนร้อยละ 5.00 ตามเกณฑ์เงินสด

6.4. ยอดหนี้ค้างชำระในการออกหุ้นกู้/ตั๋วเงินครั้งก่อน

ณ วันที่ 11 ตุลาคม 2566 บริษัทฯ มีการออกตราสารหนี้ประเภทหุ้นกู้ที่ยังไม่ถึงกำหนดชำระ รวมมูลค่า 713.40 ล้านบาท แบ่งออกเป็นหุ้นกู้ครบกำหนดชำระน้อยกว่า 1 ปี มูลค่า 465.40 ล้านบาท และหุ้นกู้ครบกำหนดชำระระหว่าง 1 - 5 ปี มูลค่า 248.00 ล้านบาท

7. โครงสร้างการจัดการ

7.1. โครงสร้างการจัดการ (Organisation Chart) ข้อมูล ณ วันที่ 11 ตุลาคม 2566



7.2. คณะกรรมการบริษัท

โครงสร้างคณะกรรมการบริษัท ณ วันที่ 11 ตุลาคม 2566 มีรายละเอียดดังนี้

รายชื่อคณะกรรมการของบริษัท

ลำดับ	รายชื่อ	ตำแหน่ง
1	นายชัชวาลย์ เจียรนวนนท์	ประธานกรรมการ
2	นายวรภัค รัตนาวงษ์ ^{/1}	รองประธานกรรมการ
3	นายช่วงชัย นงวงศ์ ^{/1}	กรรมการ / ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร / กรรมการผู้อำนวยการ
4	นายสมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ / กรรมการผู้อำนวยการ
5	นายเสกสรร ชุณหะวัณ ^{/2}	กรรมการ
6	นายวราห์ สุจริตกุล ^{/3}	กรรมการ
7	พล.ต.อ.วิสนุ ปราสาททองโอสถ	กรรมการอิสระ / ประธานกรรมการตรวจสอบ
8	นายไพบูลย์ ศิริภาณเสถียร	กรรมการอิสระ / กรรมการตรวจสอบ
9	นายกิตติศักดิ์ เบญจฤทธิ์	กรรมการอิสระ / กรรมการตรวจสอบ

หมายเหตุ: /1 นายวรภัต ธีนยาวงษ์ และ นายช่วงชัย นะวงศ์ ถือหุ้นของบริษัทฯ ผ่านการถือหุ้นใน Pilgrim Finansa Investment Holding Pte. Ltd. (“Pilgrim”) ซึ่งเป็นผู้ถือหุ้นรายใหญ่ของ FSS ในสัดส่วนร้อยละ 60.00 และร้อยละ 40.00 ของทุนจดทะเบียนที่ชำระแล้วของ Pilgrim ตามลำดับ โดย Pilgrim ถือหุ้นใน FSS ในสัดส่วนร้อยละ 29.29 ของทุนจดทะเบียนที่ชำระแล้ว

/2 นายเสกสรร ชุมนต์เสรีชัย เข้าดำรงตำแหน่งกรรมการบริษัท เมื่อวันที่ 1 กรกฎาคม 2565 แทนนางสาวกาญจนา วงศ์รัตนกุลธน ซึ่งลาออกจาก การดำรงตำแหน่งกรรมการบริษัทฯ เมื่อวันที่ 15 มิถุนายน 2565

/3 นายวราห์ สุจริตกุล เข้าดำรงตำแหน่งกรรมการบริษัท เมื่อวันที่ 21 พฤษภาคม 2565 แทนนางพรพริ้ง สุขสันติสุวรรณ ซึ่งลาออกจาก การดำรงตำแหน่งกรรมการบริษัทฯ เมื่อวันที่ 26 ตุลาคม 2565

กรรมการผู้มีอำนาจลงนาม

ชื่อและจำนวนกรรมการ ซึ่งมีอำนาจลงลายมือชื่อแทนบริษัทฯ คือ นายสมภพ กิระสุนทรพงษ์ นายช่วงชัย นะวงศ์ นาย ชัชวาลย์ เจียรนวนนท์ นายวราห์ สุจริตกุล สองในสี่คนนี้ลงลายมือชื่อร่วมกัน และประทับตราสำคัญของบริษัทฯ

รายชื่อคณะกรรมการชุดย่อยของบริษัทฯ

ลำดับ	รายชื่อ	กรรมการ บริหารและกำกับความ เสี่ยง	กรรมการตรวจสอบ	กรรมการสรรหา ค่าตอบแทน บรรษัทภิบาล และ การพัฒนาอย่าง ยั่งยืน	กรรมการเทคโนโลยี
1	นายชัชวาลย์ เจียรนวนนท์	-	-	✓	-
2	นายวรภัต ธีนยาวงษ์	-	-	✓	-
3	นายช่วงชัย นะวงศ์	✓	-	-	✓
4	นายสมภพ กิระสุนทรพงษ์	✓	-	-	-
5	นายวราห์ สุจริตกุล ^{/1}	ประธาน	-	✓	-
6	พล.ต.อ.วิสนุ ปราสาททองโอสถ	-	ประธาน	ประธาน	-
7	นายไพบุลย์ ศิริภาณุเสถียร	-	✓	✓	-
8	นายกิตติศักดิ์ เบญจฤทธิ	-	✓	✓	-
9	นายโมเชิต ธรรมธาดา	-	-	-	✓
10	นางสาวกรรณทิพย์ งามรุ่งนรินทร์	-	-	-	✓

ลำดับ	รายชื่อ	กรรมการบริหารและกำกับความเสี่ยง	กรรมการตรวจสอบ	กรรมการสรรหา ค่าตอบแทน บริษัทกิบาล และ การพัฒนาอย่าง ยั่งยืน	กรรมการเทคโนโลยี
11	นางนิตา ทรัพย์สมบูรณ์ ^{/2}	-	-	-	ประธาน
12	นายวิษณุ ศรีเจริญ	-	-	-	✓
13	นายเมธี จันทวิมล	-	-	-	✓

หมายเหตุ: /1 นายวราห์ สุจริตกุล เข้าดำรงตำแหน่งกรรมการบริษัท เมื่อวันที่ 21 พฤษภาคม 2565 แทนนางพรพริ้ง สุขสันติสุวรรณ ซึ่งลาออกจากการดำรงตำแหน่งกรรมการบริษัท เมื่อวันที่ 26 ตุลาคม 2565

/2 นางนิตา ทรัพย์สมบูรณ์ ได้รับการแต่งตั้งให้ดำรงตำแหน่งประธานคณะกรรมการเทคโนโลยีและประธานเจ้าหน้าที่เทคโนโลยีสารสนเทศร่วมของ FSS เมื่อวันที่ 27 ธันวาคม 2565

/3 นายวิษณุ ศรีเจริญ ได้รับการแต่งตั้งให้ดำรงกรรมการเทคโนโลยีของ FSS เมื่อวันที่ 25 กรกฎาคม 2566

/4 นายเมธี จันทวิมล ได้รับการแต่งตั้งให้ดำรงกรรมการเทคโนโลยีของ FSS เมื่อวันที่ 19 กันยายน 2566

ทั้งนี้ ประธานกรรมการและผู้บริหารสูงสุดของ บริษัทฯ มิได้เป็นบุคคลเดียวกัน โดย บริษัทฯ ได้มีการแบ่งแยกตำแหน่งและอำนาจหน้าที่ของประธานกรรมการ และประธานเจ้าหน้าที่บริหารไว้อย่างชัดเจน เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติหน้าที่ การกำกับดูแล และความโปร่งใสของการดำเนินงานภายใน โดยมีรายละเอียดดังต่อไปนี้

ประธานกรรมการ

ประธานกรรมการของบริษัทฯ ต้องเป็นกรรมการที่ไม่เป็นผู้บริหาร โดยประธานกรรมการไม่มีส่วนร่วมในการบริหารงานประจำของ บริษัทฯ ซึ่งเป็นไปตามหลักการแบ่งแยกหน้าที่ระหว่างกรรมการกำหนดนโยบาย การกำกับดูแลกิจการ และการบริหารงาน โดยประธานกรรมการมีบทบาทและหน้าที่สำคัญในการกำกับดูแลการทำหน้าที่ของคณะกรรมการบริษัทฯ ให้เป็นไปตามหลักธรรมาภิบาลและนโยบายที่วางไว้ ดูแลให้การประชุมคณะกรรมการบริษัทฯ เป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ มีวาระการประชุมที่สำคัญและจำเป็นต่อการดำเนินธุรกิจของบริษัทฯ โดยเฉพาะเรื่องยุทธศาสตร์องค์กร จัดสรรเวลาให้ฝ่ายบริหารมีการนำเสนอข้อมูลที่ชัดเจนและทันการณ์ เปิดโอกาสให้กรรมการที่เข้าร่วมประชุมได้แสดงความคิดเห็นและสอบถามได้อย่างทั่วถึง ตลอดจนดูแลให้มีมติที่ประชุมมีความชัดเจน พร้อมให้มีการบันทึกรายงานการประชุมอย่างถูกต้อง ครบถ้วน รวมถึงทำหน้าที่เป็นประธานในที่ประชุมผู้ถือหุ้น นอกจากนี้ ประธานกรรมการยังมีหน้าที่สำคัญในการดูแลให้กรรมการกำกับดูแลกิจการของบริษัทฯ เป็นไปตามนโยบายที่กำหนดไว้

ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร

ประธานเจ้าหน้าที่บริหารเป็นผู้บริหารสูงสุดของบริษัทฯ ซึ่งมีบทบาทหน้าที่หลักในการกำกับดูแลการขับเคลื่อนการดำเนินงานของบริษัทฯ ให้เป็นไปตามนโยบาย กลยุทธ์ และเป้าหมายที่กำหนดโดยคณะกรรมการบริษัทฯ เสนอแนะทางเลือกและกล

ยุทธศาสตร์สอดคล้องกับสภาพการประกอบธุรกิจที่มีการเปลี่ยนแปลงเพื่อให้องค์กรเติบโตอย่างยั่งยืน รวมถึงพิจารณากลั่นกรองและมีอำนาจอนุมัติเรื่องต่างๆ ตามระเบียบที่บริษัทฯ กำหนดไว้และตามที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการบริษัทฯ และ/หรือ คณะกรรมการชุดย่อย นอกจากนี้ ประธานเจ้าหน้าที่บริหารเป็นผู้รับผิดชอบสำคัญด้านการสร้างวัฒนธรรมองค์กร

บทบาทหน้าที่ของคณะกรรมการบริษัทฯ

คณะกรรมการบริษัทฯ มุ่งที่จะปฏิบัติหน้าที่โดยใช้มาตรฐานจริยธรรมที่สูงที่สุด โดยมีอำนาจ หน้าที่ และความรับผิดชอบในการจัดการบริษัทฯ ให้เป็นไปตามที่ได้กำหนดไว้โดยกฎหมาย วัตถุประสงค์ข้อบังคับของบริษัทฯ มติคณะกรรมการ และมติที่ประชุมผู้ถือหุ้นรวมถึงการดูแลให้บริษัทฯ มีกลไกในการควบคุม กำกับ และตรวจสอบที่มีประสิทธิผล รวมทั้งติดตามดูแลการดำเนินงานของบริษัทฯ อย่างต่อเนื่อง เพื่อให้บริษัทฯ ดำเนินธุรกิจอย่างเป็นธรรม โปร่งใส มีความรับผิดชอบต่อผู้มีส่วนได้เสียทุกฝ่ายภายใต้หลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี ซึ่งรวมถึงการกำหนดวิสัยทัศน์ พันธกิจ นโยบาย กลยุทธ์ ตลอดจนเป้าหมายธุรกิจ ที่ได้กำหนดให้มีการพิจารณาและทบทวนเรื่องต่าง ๆ ดังกล่าวเป็นประจำทุกปี และกำกับดูแลให้ฝ่ายบริหารดำเนินการให้เป็นไปตามนโยบาย กลยุทธ์และเป้าหมายทางการเงิน โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อเพิ่มมูลค่าทางเศรษฐกิจในระยะยาวให้แก่ผู้ถือหุ้น ด้วยการคำนึงถึงผู้มีส่วนได้เสียทุกฝ่ายที่เกี่ยวข้อง นอกจากนี้คณะกรรมการยังมีความรับผิดชอบในการพิจารณาทบทวนแผนการสืบทอดตำแหน่งของประธานเจ้าหน้าที่บริหาร การวางโครงสร้างและกำหนดกระบวนการเพื่อให้มีระบบการบริหารความเสี่ยง การกำกับและตรวจสอบ และการควบคุมภายในที่เหมาะสม ซึ่งรวมถึงการพิจารณาทบทวนโครงสร้างและกระบวนการดังกล่าวอย่างสม่ำเสมอ

บทบาทและหน้าที่ของคณะกรรมการบริหารและกำกับความเสี่ยง

คณะกรรมการบริหารฯ ประกอบด้วยกรรมการบริษัทฯ จำนวนหนึ่งและอาจประกอบด้วยบุคคลอื่น ซึ่งเป็นผู้บริหารของบริษัทฯ โดยบุคคลที่จะดำรงตำแหน่งประธานกรรมการบริหารต้องเป็นกรรมการบริษัทฯ และให้ประธานเจ้าหน้าที่บริหารเป็นกรรมการบริหารโดยตำแหน่ง

คณะกรรมการบริหารฯ มีหน้าที่และบทบาทที่สำคัญในการขับเคลื่อนบริษัทฯ ให้เป็นไปตามกลยุทธ์ นโยบาย และระเบียบต่าง ๆ ของบริษัทฯ รวมถึงควบคุมดูแลกิจการของบริษัทฯ อีกทั้งยังหน้าที่และความรับผิดชอบในการให้คำแนะนำ คณะกรรมการบริษัทฯ เกี่ยวกับกรอบการกำกับดูแลความเสี่ยงของบริษัทฯ ทบทวนและสอบทานความเพียงพอและประสิทธิผลของนโยบายและกลยุทธ์การบริหารความเสี่ยงโดยรวม รวมถึงระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้อย่างน้อยปีละครั้ง หรือเมื่อมีการเปลี่ยนแปลงที่มีนัยสำคัญ เพื่อประเมินว่านโยบายและกลยุทธ์การบริหารความเสี่ยงของบริษัทฯ ครอบคลุมความเสี่ยงทุกประเภท รวมถึงความเสี่ยงที่เกิดขึ้นใหม่ และมีการดำเนินการตามนโยบายและกลยุทธ์ดังกล่าวอย่างมีประสิทธิภาพและประสิทธิผล พิจารณาและประเมินความเสี่ยงตาม Significant activity (SA) ที่อาจจะเกิดขึ้น ซึ่งสะท้อนความเสี่ยงตาม business model ของบริษัทฯ รวมทั้งกำหนดมาตรการควบคุมดูแลความเสี่ยงได้อย่างมีประสิทธิภาพ ตลอดจนรายงานต่อคณะกรรมการบริษัทฯ ถึงฐานะความเสี่ยง ประสิทธิภาพการบริหารความเสี่ยง และสถานะการปฏิบัติตามวัฒนธรรมองค์กรที่คำนึงถึงความเสี่ยง ตลอดจนปัจจัยและปัญหาที่มีนัยสำคัญ และสิ่งที่ต้องปรับปรุงแก้ไข เพื่อให้สอดคล้องกับนโยบายและกลยุทธ์ในการบริหารความเสี่ยง ตลอดจนให้คำแนะนำคณะกรรมการบริษัทฯ ในการปลูกฝัง Risk Culture ทั่วทั้งองค์กร และกำกับให้มีการปฏิบัติตามวัฒนธรรมองค์กร ดูแลให้ผู้บริหารระดับสูงรวมถึงหัวหน้าหน่วยงานบริหารความเสี่ยงปฏิบัติตามนโยบายและกลยุทธ์การบริหารความเสี่ยง รวมถึงระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ รวมทั้งมีความเห็นหรือมีส่วนร่วมในการประเมินประสิทธิภาพและประสิทธิผลในการปฏิบัติงาน

ของ Chief Risk Officer หรือตำแหน่งที่เทียบเท่า ตลอดจนดำเนินการต่าง ๆ ตามที่คณะกรรมการบริษัทมอบหมาย เพื่อให้บรรลุ ซึ่งวิสัยทัศน์ พันธกิจ และค่านิยมหลักของบริษัทฯ

บทบาทและหน้าที่ของคณะกรรมการตรวจสอบ

คณะกรรมการตรวจสอบมีหน้าที่และความรับผิดชอบในการสอบทานให้บริษัทฯ มีการรายงานทางการเงินอย่างถูกต้อง และเพียงพอ มีระบบควบคุมภายในที่มีประสิทธิภาพ มีการปฏิบัติตามกฎหมายและกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องและติดตามผลการแก้ไข การไม่ปฏิบัติตามกฎหมายและกฎเกณฑ์ (ถ้ามี) สอบทานกระบวนการปฏิบัติงานและการกำกับดูแลรายการที่เกี่ยวข้องกันหรือ รายการที่อาจมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์ การปฏิบัติตามนโยบายต่อต้านคอร์รัปชันและสินบน นอกจากนี้ คณะกรรมการ ตรวจสอบมีหน้าที่พิจารณาคัดเลือก เสนอแต่งตั้ง เลิกจ้าง รวมทั้ง พิจารณาค่าตอบแทนผู้สอบบัญชีเป็นประจำทุกปี

บทบาทและหน้าที่ของคณะกรรมการสรรหา ค่าตอบแทน บริษัทภิบาลและการพัฒนาอย่างยั่งยืน

คณะกรรมการสรรหา ค่าตอบแทน บริษัทภิบาลและการพัฒนาอย่างยั่งยืนมีหน้าที่รับผิดชอบหลักใน 4 เรื่อง ได้แก่ 1) ด้านสรรหา: สรรหาผู้มีคุณสมบัติเหมาะสมเพื่อดำรงตำแหน่งกรรมการบริษัทฯ และสรรหาผู้บริหารระดับสูง 2) ด้านค่าตอบแทน: เสนอแนะค่าตอบแทนที่เหมาะสมของคณะกรรมการบริษัทฯ และคณะกรรมการชุดย่อยต่อคณะกรรมการบริษัทฯ เพื่อให้ความเห็นชอบก่อนเสนอต่อที่ประชุมผู้ถือหุ้นเพื่อพิจารณาอนุมัติ และดูแลให้ผู้บริหารระดับสูงได้รับผลตอบแทนที่เหมาะสมกับหน้าที่และความรับผิดชอบ 3) ด้านนโยบายทรัพยากรบุคคลและวัฒนธรรมองค์กร: พิจารณาและให้ความเห็นเกี่ยวกับนโยบายด้านทรัพยากรบุคคลเพื่อให้สอดคล้องกับยุทธศาสตร์ขององค์กร กำหนดนโยบายและกำกับให้มีการจัดทำแผนสืบทอดตำแหน่งสำหรับตำแหน่ง ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร และผู้บริหารระดับสูง และ 4) ด้านการกำกับดูแลกิจการ: การกำหนดนโยบายและกำกับดูแลงานด้านการกำกับดูแลกิจการของบริษัทฯ เพื่อให้เป็นไปตามหลักบรรษัทภิบาลของหน่วยงานที่มีอำนาจกำกับดูแลตามกฎหมายและแนวปฏิบัติที่ดีอื่น ๆ โดยมีรายละเอียดตามที่กำหนดไว้ในกฎบัตรคณะกรรมการสรรหา ค่าตอบแทน บริษัทภิบาล และการพัฒนาอย่างยั่งยืน

บทบาทและหน้าที่ของคณะกรรมการเทคโนโลยี

คณะกรรมการเทคโนโลยีมีหน้าที่และความรับผิดชอบในการกำกับดูแลด้านกลยุทธ์ และทิศทางของเทคโนโลยี เพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์ของบริษัทฯ ทั้งนี้ เพื่อให้มีการพัฒนาศักยภาพความสามารถด้านเทคโนโลยีรวมถึงด้านข้อมูลและความเสี่ยงด้านเทคโนโลยี คณะกรรมการเทคโนโลยีจัดให้มีความร่วมมือกับคณะกรรมการอื่น ๆ ตามความจำเป็น เช่น ร่วมกับคณะกรรมการบริหารและกำกับความเสี่ยง สำหรับความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีบริษัทฯ กำหนดให้คณะกรรมการเทคโนโลยี ประกอบด้วยกรรมการ ซึ่งเป็นกรรมการบริษัทฯ และ/หรือผู้บริหารของบริษัทฯ โดยกรรมการส่วนใหญ่ต้องมีความรู้ความชำนาญ และความเข้าใจเกี่ยวกับด้านเทคโนโลยีโดยรวมเป็นหลัก และควรมีความรู้ความชำนาญด้านธุรกิจและด้านความเสี่ยง

7.3. ผู้บริหาร

ณ วันที่ 11 ตุลาคม 2566 บริษัทฯ มีผู้บริหารระดับสูงรวม 25 คน ดังนี้

รายชื่อผู้บริหารของ บริษัทฯ

ลำดับ	รายชื่อ	ตำแหน่ง
1	นาย ชวงชัย นวงศ์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร
2	นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการผู้อำนวยการ
3	นางสาว กัญญารัตน์ ประพัฒน์วิชัย	กรรมการบริหาร
4	นางสาว ช่อเพชร เรียมดี ¹	ประธานเจ้าหน้าที่การเงิน
5	นางสาว สุพิน สุระวิชัย ¹	ประธานเจ้าหน้าที่กำกับกิจการและความเสี่ยงองค์กร
6	นางสาว กรรณทิพย์ งามรุ่งนรินทร์	ประธานเจ้าหน้าที่ปฏิบัติการ
7	นาย โฆษิต ธรรมธาดา	ประธานเจ้าหน้าที่เทคโนโลยีสารสนเทศร่วม
8	นาง นิตา ทรัพย์สมบูรณ์	ประธานเจ้าหน้าที่เทคโนโลยีสารสนเทศร่วม
9	นาย วิษณุ ศรีเจริญ	ประธานเจ้าหน้าที่ดิจิทัลทรานส์ฟอร์มเมชัน
10	นาย เมธี จันทวิมล	ประธานเจ้าหน้าที่ผลิตภัณฑ์
11	นาย ปัญญวัฒน์ พันธุ์บุตร	กรรมการบริหาร ฝ่ายบริหารสินทรัพย์ลงทุนลูกค้า
12	นาง นุสรุา รุ่งเจริญ	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจการตลาดดิจิทัล
13	นาย สมชาย แก้วเจริญไพศาล	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ลูกค้าทั่วไป
14	นาย กัณฐรา ลดาวัลย์ ณ อยุธยา	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ 1
15	นาย ฉัตรชัย ชุ่มศิริ	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ 2
16	นาย นิธิวัชร ธรรมพิรสิงห์	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ 3
17	นาย พศินทร์ จารุงศ์วัฒนา	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ 4
18	นางสาว อุบลรัตน์ ศรีปัญญาวิชัย	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ 7
19	นางสาว กนกนภัส สิทธิวารภรณ์	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ 8
20	นาย ปิณณทัต สมมติศักดิ์ดา	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ 10
21	นาย สมยศ กิตติสุขเจริญ	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ 15
22	นางสาว รวีวรรณ ชัยกิจ	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ 16
23	นาย อนุวัฒน์ แซ่ตั้ง	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ 18
24	นาง วิไลลักษณ์ อรุณานนท์ชัย	กรรมการบริหาร สายงานธุรกิจค้าหลักทรัพย์ 19
25	นาง มานิดา สิทธิเสรี	กรรมการบริหาร ฝ่ายค้าหลักทรัพย์สถาบันในประเทศ

หมายเหตุ: /1 ผู้บริหารที่ Outsource มาจาก FSX

8. การควบคุมภายใน

ประชุมคณะกรรมการบริษัท ครั้งที่ 1/2566 เมื่อวันที่ 17 มกราคม 2566 คณะกรรมการตรวจสอบของ บริษัทฯ ทั้ง 3 ท่าน ได้ประเมินการควบคุมภายในและการบริหารจัดการความเสี่ยงโดยการซักถามข้อมูลจาก ฝ่ายบริหารและจากฝ่ายตรวจสอบภายใน ทั้งนี้ คณะกรรมการตรวจสอบของ บริษัทฯ ได้มีการทบทวนระบบการควบคุมภายในและการบริหารจัดการความเสี่ยง โดยพิจารณาจากรายงานผลการตรวจสอบของฝ่ายตรวจสอบภายในของ บริษัทฯ ที่รายงานเป็นรายเดือนและมีการสรุปผลการ

ตรวจสอบที่เกิดขึ้นทั้งหมดเป็นรายปี เพื่อให้คณะกรรมการตรวจสอบได้พิจารณาในภาพรวมอีกครั้งหนึ่งว่า มีระบบการควบคุม
ใดบ้างที่ บริษัทฯ ต้องให้ความสำคัญเป็นพิเศษ รวมทั้งคณะกรรมการตรวจสอบได้ให้คำแนะนำแก่ฝ่ายตรวจสอบถึงวิธีการปรับปรุง
ขั้นตอนและระบบการควบคุมภายใน โดยเน้นในเรื่องการแบ่งแยกอำนาจหน้าที่ อำนาจในการสั่งการที่ชัดเจน และติดตามให้มีการ
ปรับปรุงแก้ไขข้อบกพร่องที่พบจากการตรวจสอบอย่างต่อเนื่อง รวมถึงการแก้ไขปัญหาที่เกิดขึ้นได้อย่างถูกต้องและทันเหตุการณ์
เพื่อป้องกันมิให้เกิดความผิดพลาดต่อบริษัทฯ และ ชัดต่อกฎหมาย ข้อบังคับ และกฎระเบียบที่เกี่ยวข้อง

ภายใต้สภาวะเศรษฐกิจที่เปลี่ยนแปลงอย่างรวดเร็วในปัจจุบัน ส่งผลให้บริษัทหลักทรัพย์ต้องเผชิญกับความท้าทายในการ
ดำเนินธุรกิจหลายด้าน บริษัทฯ ได้ตระหนักถึงความสำคัญของระบบการกำกับดูแล การบริหารความเสี่ยง การกำกับดูแลการ
ปฏิบัติงาน และการควบคุมภายใน ที่มีประสิทธิภาพและประสิทธิผลสอดคล้องตามมาตรฐานสากลทั้งการปฏิบัติงานและระบบ
เทคโนโลยีสารสนเทศ ซึ่ง บริษัทฯ มีคณะกรรมการตรวจสอบทำหน้าที่รับผิดชอบเกี่ยวกับการควบคุมดูแลการดำเนินงานของ
บริษัทฯ ให้เป็นไปตามนโยบายและการควบคุมภายในที่ดี โดยกลุ่มงานตรวจสอบภายในทำหน้าที่ตรวจสอบการควบคุมภายใน
อย่างสม่ำเสมอ ซึ่งผลการตรวจสอบจะถูกรายงานแก่คณะกรรมการตรวจสอบและคณะกรรมการบริษัทของ บริษัทฯ โดยกลุ่มงาน
ตรวจสอบภายในภายใต้การกำกับดูแลโดยคณะกรรมการตรวจสอบ มีหน้าที่ประเมินความเพียงพอของระบบการควบคุมภายใน
ของ บริษัทฯ ตามแบบประเมินของสำนักงาน ก.ล.ต. และนำเสนอต่อคณะกรรมการตรวจสอบเพื่อพิจารณาให้ความเห็นชอบก่อน
อนุมัติโดยคณะกรรมการบริษัท ทั้งนี้ การปฏิบัติด้านการควบคุมภายใน กำหนดองค์ประกอบหลักที่จำเป็นในการควบคุมภายในไว้
5 ด้าน ได้แก่ (1) การควบคุมภายในองค์กร (2) การประเมินความเสี่ยง (3) การควบคุมการปฏิบัติงาน (4) ระบบสารสนเทศและ
การสื่อสารข้อมูล และ (5) ระบบการติดตาม

9. ฐานะการเงินและผลการดำเนินงาน

ข้อมูลทางการเงินรวมที่สำคัญบริษัทฯ สามารถสรุปได้ดังต่อไปนี้

9.1. ผู้สอบบัญชีสำหรับงบการเงินรวมของบริษัทฯ

ผู้สอบบัญชีสำหรับงบการเงินรวมของบริษัทฯ

งบการเงิน	ชื่อผู้สอบบัญชีรับ อนุญาต	เลขที่ผู้สอบบัญชี รับอนุญาต	บริษัทผู้สอบบัญชี
งบการเงินรวมสำหรับปีสิ้นสุด วันที่ 31 ธันวาคม 2563	นางสาว รัตนา จาละ	3734	บริษัท สำนักงาน อีวาย จำกัด
งบการเงินรวมสำหรับปีสิ้นสุด วันที่ 31 ธันวาคม 2564	นางสาว รัตนา จาละ	3734	บริษัท สำนักงาน อีวาย จำกัด
งบการเงินรวมสำหรับปีสิ้นสุด วันที่ 31 ธันวาคม 2565	นางสาว รัตนา จาละ	3734	บริษัท สำนักงาน อีวาย จำกัด
งบการเงินรวมระหว่างกาล สำหรับงวดสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566	นางสาววรรณวิไล เพชรสร้าง	5315	บริษัท สำนักงาน อีวาย จำกัด

9.2. สรุปรายงานการสอบบัญชี/รายงานการสอบทานงบการเงินรวมของบริษัทฯ

สรุปรายงานการสอบบัญชี/รายงานการสอบทานงบการเงินรวมของบริษัทฯ

สรุปรายงาน	ความเห็น/ ข้อสรุปของผู้สอบบัญชี
งบการเงินรวมสำหรับปี สิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2563	ผู้สอบบัญชีได้แสดงความเห็นอย่างไม่มีเงื่อนไขไว้ในรายงานของผู้สอบบัญชีว่า งบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะบริษัท ได้แสดงฐานะการเงิน ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 ผลการดำเนินงาน และกระแสเงินสดสำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกันของ บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) และบริษัทย่อย และเฉพาะของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) โดยถูกต้องตามควรในสาระสำคัญตามมาตรฐานการรายงานทางการเงิน
งบการเงินรวมสำหรับปี สิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2564	ผู้สอบบัญชีได้แสดงความเห็นอย่างไม่มีเงื่อนไขไว้ในรายงานของผู้สอบบัญชีว่า งบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะบริษัท ได้แสดงฐานะการเงิน ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2564 ผลการดำเนินงาน และกระแสเงินสดสำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกันของ บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) และบริษัทย่อย และเฉพาะของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) โดยถูกต้องตามควรในสาระสำคัญตามมาตรฐานการรายงานทางการเงิน
งบการเงินรวมสำหรับปี สิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2565	ผู้สอบบัญชีได้แสดงความเห็นอย่างไม่มีเงื่อนไขไว้ในรายงานของผู้สอบบัญชีว่า งบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะบริษัท ได้แสดงฐานะการเงิน ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565 ผลการดำเนินงาน และกระแสเงินสดสำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกันของ บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) และบริษัทย่อย และเฉพาะของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) โดยถูกต้องตามควรในสาระสำคัญตามมาตรฐานการรายงานทางการเงิน
งบการเงินรวมระหว่างกาล สำหรับงวดสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566	ผู้สอบบัญชีได้แสดงข้อสรุปไว้ในรายงานการสอบทานข้อมูลทางการเงินระหว่างกาลของผู้สอบบัญชีว่า ผู้สอบบัญชีไม่พบสิ่งที่เป็นเหตุให้เชื่อว่าข้อมูลทางการเงินระหว่างกาลของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) และบริษัทย่อย และข้อมูลทางการเงินเฉพาะของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ไม่ได้จัดทำขึ้นตามมาตรฐานการบัญชี ฉบับที่ 34 เรื่อง การรายงานทางการเงินระหว่างกาลในสาระสำคัญจากการสอบทาน

9.3. ตารางสรุปงบการเงินรวมของบริษัทฯ

งบการเงินรวมของบริษัทฯ สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2563 - 2564 (ก่อนการเข้าซื้อหุ้น FSL ในสัดส่วนประมาณร้อยละ 100.00 และก่อนการเข้าซื้อหุ้น FSSIA ในสัดส่วนร้อยละ 3.75) และ สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2565 และสำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566 สามารถสรุปได้ดังต่อไปนี้

1) งบแสดงฐานะทางการเงินรวมของบริษัทฯ

งบแสดงฐานะทางการเงินรวมของบริษัทฯ

งบแสดงฐานะทางการเงินรวม (หน่วย : ล้านบาท)	ณ วันที่ 31 ธันวาคม			ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566
	2563	2564	2565	
สินทรัพย์				
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด	221.57	185.99	461.16	481.34

งบแสดงฐานะทางการเงินรวม (หน่วย : ล้านบาท)	ณ วันที่ 31 ธันวาคม			ณ วันที่ 30
	2563	2564	2565	มิถุนายน 2566
ลูกหนี้สำนักหักบัญชีและบริษัทหลักทรัพย์	282.42	872.00	1,044.35	1,555.90
ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	3,759.48	4,339.92	4,392.88	3,314.61
รายได้ค่าธรรมเนียมและบริการค้างรับ	11.73	3.60	33.61	11.24
สินทรัพย์อนุพันธ์	0.69	5.75	0.33	-
เงินลงทุน	707.62	714.11	561.30	324.71
เงินให้กู้ยืมแก่พนักงาน	0.64	6.37	2.89	2.51
เงินลงทุนในบริษัทร่วม	121.19	135.12	141.96	146.68
อาคารและอุปกรณ์ - สุทธิ	99.57	98.03	485.71	476.34
สินทรัพย์สิทธิการใช้ - สุทธิ	279.36	249.45	200.89	173.59
สินทรัพย์ไม่มีตัวตน - สุทธิ	214.67	185.43	212.44	209.45
สินทรัพย์ภาษีเงินได้รอตัดบัญชี	37.43	30.73	47.44	43.83
สินทรัพย์อื่น - สุทธิ	210.58	220.71	431.59	457.15
รวมสินทรัพย์	5,946.95	7,047.21	8,016.55	7,197.35
หนี้สิน				
เงินกู้ยืมจากสถาบันการเงิน	350.00	-	-	-
เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีและบริษัทหลักทรัพย์	303.18	16.17	1,051.95	20.27
เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	1,928.43	3,022.98	2,242.57	2,912.49
หนี้สินอนุพันธ์	23.38	18.57	51.01	1.46
ตราสารหนี้ที่ออก	278.98	505.60	971.00	971.00
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	-	36.21	26.40	0.14
ประมาณการหนี้สิน	32.58	34.22	47.53	57.28
สำรองผลประโยชน์ระยะยาวของพนักงาน	73.31	90.42	132.01	140.01
หนี้สินตามสัญญาเช่า	180.22	160.00	121.60	97.61
หนี้สินอื่น	345.69	471.48	524.46	184.48
รวมหนี้สิน	3,515.77	4,355.64	5,168.53	4,384.73
ส่วนของผู้ถือหุ้น				
ทุนจดทะเบียน				
หุ้นสามัญ 581,403,025 หุ้น มูลค่าหุ้นละ 1.60 บาท	930.25	930.25	930.25	930.25
ทุนที่ออกและชำระแล้ว	930.25	930.25	930.25	930.25
ส่วนเกินมูลค่าหุ้น	620.89	620.89	620.89	620.89
สำรองส่วนทุนจากการจ่ายโดยใช้หุ้นเป็นเกณฑ์	0.32	0.32	0.32	0.32

งบแสดงฐานะทางการเงินรวม (หน่วย : ล้านบาท)	ณ วันที่ 31 ธันวาคม			ณ วันที่ 30
	2563	2564	2565	มิถุนายน 2566
ส่วนต่ำกว่าทุนจากการเปลี่ยนแปลงสัดส่วนการถือหุ้นในบริษัทย่อย	(0.25)	(0.25)	(0.05)	(0.05)
กำไร (ขาดทุน) สะสม				
กำไรสะสม - จัดสรรแล้ว				
สำรองตามกฎหมาย	83.02	93.02	93.02	93.02
กำไร (ขาดทุน) สะสม - ยังไม่ได้จัดสรร	803.46	1,045.08	1,200.01	1,161.57
องค์ประกอบอื่นของส่วนของผู้ถือหุ้น	(6.91)	1.77	3.58	6.62
รวมส่วนของผู้ถือหุ้นของบริษัทใหญ่	2,430.78	2,691.08	2,848.02	2,812.62
ส่วนได้เสียที่ไม่มีอำนาจควบคุม	0.40	0.49	-	-
รวมส่วนของผู้ถือหุ้น	2,431.17	2,691.57	2,848.02	2,812.62
รวมหนี้สินและส่วนของผู้ถือหุ้น	5,946.95	7,047.21	8,016.55	7,197.35

2) งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จรวมของบริษัทฯ

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จรวมของบริษัทฯ

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จรวม (หน่วย : ล้านบาท)	สำหรับปีสิ้นสุด 31 ธันวาคม			สำหรับงวด 6 เดือน สิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน	
	2563	2564	2565	2565	2566
รายได้					
รายได้ค่านายหน้า	1,314.75	1,930.02	1,563.70	374.95	225.59
รายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ	122.79	113.99	486.12	24.96	108.52
รายได้ดอกเบี้ย	84.77	130.22	185.64	42.21	60.60
กำไรและผลตอบแทนจากเครื่องมือทางการเงิน	168.83	165.61	97.00	18.24	17.92
ส่วนแบ่งกำไรจากเงินลงทุนในบริษัทร่วม	5.26	3.08	4.10	0.40	0.63
รายได้อื่น	50.70	53.63	63.83	22.95	9.72
รวมรายได้	1,747.10	2,396.55	2,400.39	483.71	422.97
ค่าใช้จ่าย					
ค่าใช้จ่ายผลประโยชน์พนักงาน	(942.79)	(1,243.18)	(1,254.16)	(249.64)	(241.17)
ค่าธรรมเนียมและบริการจ่าย	(231.92)	(277.96)	(272.87)	(66.61)	(43.65)
ค่าใช้จ่ายดอกเบี้ย	(34.72)	(47.60)	(61.80)	(15.24)	(15.76)
ผลขาดทุนด้านเครดิตที่คาดว่าจะเกิดขึ้น (โอนกลับ)	(10.89)	(3.36)	2.52	(0.23)	0.22
ค่าใช้จ่ายอื่น	(422.50)	(448.46)	(548.95)	(134.06)	(121.45)

งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จรวม (หน่วย : ล้านบาท)	สำหรับปีสิ้นสุด 31 ธันวาคม			สำหรับงวด 6 เดือน สิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน	
	2563	2564	2565	2565	2566
รวมค่าใช้จ่าย	(1,642.82)	(2,020.56)	(2,135.26)	(465.79)	(421.81)
กำไรก่อนภาษีเงินได้	104.28	375.99	265.13	17.92	1.16
ภาษีเงินได้	(22.23)	(75.82)	(57.67)	(2.38)	(2.82)
กำไรสุทธิสำหรับงวด	82.05	300.17	207.46	15.53	(1.67)
กำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จอื่น					
รายการที่จะถูกบันทึกในส่วนของกำไรหรือขาดทุน ในภายหลัง:					
ผลต่างของอัตราแลกเปลี่ยนจากการแปลงค่างบ การเงินที่เป็นเงินตราต่างประเทศ - สุทธิจากภาษี เงินได้	(0.39)	8.68	2.19	5.20	4.05
รายการที่จะไม่ถูกบันทึกในส่วนของกำไรหรือ ขาดทุนในภายหลัง:					
กำไร (ขาดทุน) จากการประมาณการตามหลัก คณิตศาสตร์ประกันภัยสำหรับโครงการ ผลประโยชน์พนักงาน - สุทธิจากภาษีเงินได้	-	(13.57)	5.60	-	-
กำไร (ขาดทุน) จากการวัดมูลค่าเงินลงทุนในตรา สารทุนด้วยมูลค่ายุติธรรมผ่านกำไรขาดทุน เบ็ดเสร็จอื่น - สุทธิจากภาษีเงินได้	0.25	-	(0.38)	(0.06)	0.15
กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จอื่นสำหรับงวด	(0.14)	(4.89)	7.41	5.14	4.20
กำไร (ขาดทุน) เบ็ดเสร็จรวมสำหรับงวด	81.91	295.28	214.87	20.67	2.53

3) งบกระแสเงินสดรวมของบริษัทฯ

งบกระแสเงินสดรวมของบริษัทฯ

งบกระแสเงินสดรวม (หน่วย : ล้านบาท)	สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม			สำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุด วันที่ 30 มิถุนายน	
	2563	2564	2565	2565	2566
กระแสเงินสดจากกิจกรรมดำเนินงาน					
กำไรก่อนภาษีเงินได้	104.28	375.99	265.13	125.03	8.12
รายการปรับกระทบยอดกำไรก่อนภาษีเงินได้เป็น เงินสดรับ (จ่าย) จากกิจกรรมดำเนินงาน:					
ค่าเสื่อมราคาและรายการจ่ายตัดบัญชี	142.57	144.93	147.66	71.79	72.72
ผลขาดทุนด้านเครดิตที่คาดว่าจะเกิดขึ้น (โอน กลับ)	10.89	3.36	(2.52)	0.47	0.02

งบกระแสเงินสดรวม (หน่วย : ล้านบาท)	สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม			สำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุด วันที่ 30 มิถุนายน	
	2563	2564	2565	2565	2566
(กำไร) ขาดทุนจากการจำหน่ายและตัดจำหน่าย อุปกรณ์ / สินทรัพย์ไม่มีตัวตน / สินทรัพย์สิทธิ การใช้	4.07	(2.22)	0.07	(0.30)	(1.15)
(กำไร) ขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้นจากการปรับมูลค่า หลักทรัพย์เพื่อค้า	81.99	(91.98)	(6.61)	8.77	14.76
(กำไร) ขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้นจากการวัดมูลค่า ตราสารอนุพันธ์	(12.40)	32.69	31.31	(13.90)	(49.07)
กำไรจากแปลงค่าเงินตราต่างประเทศ	-	(3.64)	(0.07)	(1.50)	(2.34)
ส่วนแบ่งกำไรจากเงินลงทุนในบริษัทร่วม	(5.26)	(3.08)	(4.10)	(0.94)	(1.14)
สำรองผลประโยชน์ระยะยาวของพนักงาน	12.68	11.20	15.77	7.52	8.99
รายได้ดอกเบี้ย	(84.77)	(130.22)	(185.64)	(84.05)	(116.04)
เงินปันผลรับ	(12.88)	(15.82)	(13.78)	(9.51)	(20.88)
ค่าใช้จ่ายดอกเบี้ย	34.72	47.60	61.80	28.02	31.41
กำไรจากการดำเนินงานก่อนการเปลี่ยนแปลงใน สินทรัพย์และหนี้สินดำเนินงาน	275.89	368.81	309.02	131.40	(54.59)
สินทรัพย์ดำเนินงาน (เพิ่มขึ้น) ลดลง					
ลูกหนี้สำนักหักบัญชีและบริษัทหลักทรัพย์	(125.34)	(619.74)	(164.59)	599.54	(496.11)
ลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้า	(1,209.81)	(576.73)	(51.49)	617.36	1,076.83
สินทรัพย์อนุพันธ์	(0.65)	(3.79)	3.68	1.71	0.76
เงินลงทุน	(9.07)	87.54	280.69	322.41	219.33
เงินให้กู้ยืมแก่พนักงาน	(0.37)	(5.73)	3.48	3.33	0.38
สินทรัพย์อื่น	(23.13)	(5.84)	(210.24)	15.01	5.70
หนี้สินดำเนินงาน เพิ่มขึ้น (ลดลง)					
เจ้าหนี้สำนักหักบัญชีและบริษัทหลักทรัพย์	(359.40)	(287.01)	1,035.78	19.99	1,031.68)
เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้า	989.19	1,092.51	(782.10)	(1,187.90)	672.62
หนี้สินอนุพันธ์	1.54	(4.97)	(4.82)	(6.89)	(14.01)
ผลประโยชน์ระยะยาวของพนักงานจ่าย	(3.86)	(11.06)	(7.74)	(6.77)	(1.00)
หนี้สินดำเนินงานอื่น	143.19	130.52	43.92	(203.88)	(327.31)
ส่วนได้เสียที่ไม่มีอำนาจควบคุมของบริษัทย่อย	-	-	(0.49)	(0.49)	-
เงินสดรับ (จ่าย) จากการดำเนินงาน	(321.81)	164.51	455.10	304.84	50.90
เงินสดรับดอกเบี้ย	82.33	129.30	182.19	69.71	112.92

งบกระแสเงินสดรวม (หน่วย : ล้านบาท)	สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม			สำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุด วันที่ 30 มิถุนายน	
	2563	2564	2565	2565	2566
เงินสดรับเงินปันผล	12.86	15.92	13.77	9.51	20.89
เงินสดจ่ายดอกเบี้ย	(24.37)	(19.36)	(52.57)	(19.41)	(29.23)
เงินสดจ่ายภาษีเงินได้	(4.69)	(31.70)	(83.64)	(40.96)	(34.28)
เงินสดสุทธิได้มาจาก (ใช้ไปใน) กิจกรรมดำเนินงาน	(255.68)	258.67	514.85	323.68	121.20
เงินสดสุทธิจากกิจกรรมลงทุน					
เงินสดจ่ายซื้อเงินลงทุนในบริษัทย่อย - สุทธิจากเงินสดที่ได้มา	-	-	(479.63)	(479.63)	-
เงินสดรับจากการขายอุปกรณ์	0.09	3.09	0.45	0.26	0.02
เงินสดจ่ายซื้ออุปกรณ์	(45.88)	(41.72)	(42.86)	(9.63)	(13.97)
เงินสดจ่ายซื้อสินทรัพย์ไม่มีตัวตน	(7.98)	(9.69)	(60.74)	(20.26)	(15.24)
เงินสดสุทธิได้มาจาก (ใช้ไปใน) กิจกรรมลงทุน	(53.77)	(48.32)	(582.78)	(509.25)	(29.20)
เงินสดสุทธิจากกิจกรรมจัดหาเงิน					
เงินสดรับ (จ่าย) เงินกู้ยืมจากสถาบันการเงิน	300.00	(350.00)	-	-	-
เงินสดรับ (จ่าย) จากตราสารหนี้ที่ออก	275.19	209.66	465.40	465.40	-
เงินสดจ่ายชำระหนี้สินตามสัญญาเช่า	(145.68)	(70.71)	(64.19)	(31.50)	(31.80)
เงินปันผลจ่าย	-	(34.88)	(58.12)	(58.12)	(40.01)
เงินสดสุทธิได้มาจาก (ใช้ไปใน) กิจกรรมจัดหาเงิน	429.51	(245.93)	343.09	375.78	(71.81)
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด เพิ่มขึ้น (ลดลง) สุทธิ	120.06	(35.58)	275.17	190.21	20.19
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด ต้นงวด	101.51	221.57	185.99	185.99	461.15
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด สิ้นงวด	221.57	185.99	461.16	376.20	481.34

9.4. ข้อมูลทางการเงินอื่นๆ ของบริษัทฯ

ข้อมูลทางการเงินอื่นๆ ของบริษัทฯ สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2563 - 2564 (ก่อนการเข้าซื้อหุ้น FSL ในสัดส่วนประมาณร้อยละ 100.00 และก่อนการเข้าซื้อหุ้น FSSIA ในสัดส่วนร้อยละ 3.75) และ สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2565 และสำหรับงวด 3 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566 สามารถสรุปได้ดังต่อไปนี้

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของบริษัทฯ

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญ	ปี 2563	ปี 2564	ปี 2565	งวด 6 เดือน	
				ปี 2565	ปี 2566
อัตราส่วนแสดงความสามารถในการทำกำไร					
อัตรากำไรขั้นต้น (ร้อยละ)	84.12	86.28	86.06	83.69	84.18

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญ	ปี 2563	ปี 2564	ปี 2565	งวด 6 เดือน	
				ปี 2565	ปี 2566
อัตรากำไรสุทธิ (ร้อยละ)	4.70	12.53	8.64	8.92	0.17
อัตราผลตอบแทนผู้ถือหุ้น (ร้อยละ) ¹	3.43	11.72	7.28	9.33	3.92
อัตราผลตอบแทนจากการลงทุน (ร้อยละ) ¹	22.68	23.30	14.38	18.35	15.50
อัตราส่วนแสดงประสิทธิภาพในการดำเนินงาน					
อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ร้อยละ) ¹	1.61	4.62	2.59	3.72	1.62
อัตรากำไรสุทธิของสินทรัพย์ (เท่า)	0.34	0.37	0.30	0.17	0.14
อัตราส่วนวิเคราะห์นโยบายทางการเงิน					
อัตราส่วนสภาพคล่อง (current ratio) (เท่า)	1.93	1.72	1.97	2.63	1.94
อัตราส่วนสินทรัพย์สภาพคล่องต่อเงินกู้ (เท่า)	1.48	1.77	0.47	0.39	0.50
อัตราส่วนสินทรัพย์ก่อรายได้ต่อเงินกู้ (เท่า)	7.34	9.96	6.69	5.04	5.86
อัตราส่วนสินทรัพย์คล่องตัวต่อสินทรัพย์รวม (ร้อยละ)	15.62	12.77	12.75	14.04	11.20
อัตราส่วนสินทรัพย์ก่อรายได้ต่อสินทรัพย์รวม (ร้อยละ)	73.93	71.63	81.00	78.82	79.03
อัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนผู้ถือหุ้น (เท่า)	1.45	1.62	1.81	1.27	1.56
อัตรากำไรจ่ายปันผล (จากงบการเงินเฉพาะกิจการ) (ร้อยละ)	39.84	19.61	18.66	N.A.	N.A.
อัตราส่วนความสามารถชำระดอกเบี้ย (interest coverage ratio : ICR) (เท่า)	8.11	11.94	7.68	8.02	3.57
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่ายภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย (Interest bearing debt to EBITDA Ratio) (เท่า)	2.23	0.89	2.05	4.32	8.65
หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (interest bearing debt to equity : IBD/E ratio) (เท่า)	0.26	0.19	0.34	0.35	0.35
อัตราส่วนความสามารถชำระภาระผูกพัน (debt service coverage ratio : DSCR) (เท่า) ¹	0.45	N.A.	0.94	N.A.	0.37
อัตราส่วนคุณภาพทรัพย์สิน					
อัตราส่วนค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญต่อสินเชื่อไม่ก่อให้เกิดรายได้ (ร้อยละ)	90.50	101.57	97.53	117.77	120.45
อัตราส่วนค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญต่อสินเชื่อรวม (ร้อยละ)	1.30	0.81	0.79	0.92	0.95

อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญ	ปี 2563	ปี 2564	ปี 2565	งวด 6 เดือน	
				ปี 2565	ปี 2566
อัตราส่วนเงินให้สินเชื่อที่หยุดรับรู้รายได้ต่อสินเชื่อรวม (ร้อยละ)	1.44	0.80	0.81	0.78	0.79
อัตราส่วนอื่นๆ					
อัตราส่วนเงินลงทุนในหลักทรัพย์ต่อสินทรัพย์ (ร้อยละ)	11.90	10.13	8.77	10.26	6.55
เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ร้อยละ)	41.31	36.86	26.48	36.82	29.64

หมายเหตุ: /1 ข้อมูลแสดงแบบ Annualized

การวิเคราะห์และคำอธิบายของฝ่ายจัดการเกี่ยวกับฐานะทางการเงินรวมและผลการดำเนินงานรวมของบริษัทฯ สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2563 - 2564 ซึ่งเป็นฐานะทางการเงินรวมและผลการดำเนินงานรวมก่อนการเข้าซื้อหุ้น FSL ในสัดส่วนร้อยละ 100.00 และก่อนการเข้าซื้อหุ้น FSSIA ในสัดส่วนร้อยละ 3.75 และปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2565 และสำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566 ซึ่งเป็นฐานะทางการเงินรวมและผลการดำเนินงานรวมภายหลังการเข้าซื้อหุ้นของ FSL ในสัดส่วนร้อยละ 100.00 และ FSSIA เพิ่มเติมอีกร้อยละ 3.75 สามารถสรุปได้ดังต่อไปนี้

1) ผลการดำเนินงาน: รายได้รวม

บริษัทฯ เป็นบริษัทหลักทรัพย์ที่ให้บริการทางการเงินที่ครบวงจรโดยรายได้ของบริษัทฯ สามารถจำแนกได้เป็น 6 ประเภท ประกอบด้วย (1) ค่านายหน้า (2) ค่าธรรมเนียมและบริการ (3) ดอกเบี้ย (4) กำไรและผลตอบแทนจากเครื่องมือทางการเงิน (5) ส่วนแบ่งกำไร (ขาดทุน) จากเงินลงทุนในบริษัทร่วม และ (6) รายได้อื่น ทั้งนี้ รายได้หลักมาจากค่านายหน้าและค่าธรรมเนียมและบริการ คิดเป็นสัดส่วนประมาณร้อยละ 79.82 – 85.40 ของรายได้รวม

สำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566 บริษัทฯ มีรายได้รวม 922.35 ล้านบาท ลดลงร้อยละ 17.90 เมื่อเทียบกับงวดเดียวกันของปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การลดลงของรายได้ค่านายหน้า 352.87 ล้านบาท เนื่องจากปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวันของบริษัทฯ ลดลงจาก 9,017 ล้านบาท เป็น 5,138 ล้านบาท หรือลดลงร้อยละ 43.0 โดยบริษัทฯ มีส่วนแบ่งการตลาดลดลงจากร้อยละ 5.60 เป็นร้อยละ 4.71 และ (2) การลดลงของกำไรและผลตอบแทนจากเครื่องมือทางการเงิน 15.42 ล้านบาท เนื่องจากการลดลงของกำไรจากตราสารอนุพันธ์เป็นหลัก

ในปี 2565 บริษัทฯ มีรายได้รวม 2,400.39 ล้านบาท เพิ่มขึ้นร้อยละ 0.16 จากปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของรายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ 372.13 ล้านบาท เนื่องจากการรวมธุรกิจจากการซื้อเงินลงทุนใน FSL ทำให้บริษัทฯ มีรายได้จากการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์และมีรายได้ที่ปรึกษาทางการเงินเพิ่มขึ้น และ (2) การเพิ่มขึ้นของรายได้ดอกเบี้ย 55.42 ล้านบาท เนื่องจากการปรับขึ้นของอัตราดอกเบี้ยของตลาดเงิน อย่างไรก็ตามรายได้ค่านายหน้าลดลง 366.32 ล้านบาท เนื่องจากปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวันของบริษัทฯ ลดลงจาก 9,490 ล้านบาท เป็น 7,549 ล้านบาท หรือ ลดลงร้อยละ 20.45 ส่วนแบ่งการตลาดลดลงจากร้อยละ 5.58 เป็นร้อยละ 5.34

ในปี 2564 บริษัทฯ มีรายได้รวม 2,396.55 ล้านบาท เพิ่มขึ้นร้อยละ 37.17 จากปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของรายได้ค่านายหน้า 615.27 ล้านบาท เนื่องจากปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวันซึ่งเพิ่มขึ้นจาก 7,433 ล้านบาท

เป็น 9,490 ล้านบาท หรือเพิ่มขึ้นร้อยละ 28 แม้ว่าบริษัทฯ จะมีส่วนแบ่งการตลาดลดลงจากร้อยละ 6.06 เป็น ร้อยละ 5.58 และ (2) การเพิ่มขึ้นของรายได้ดอกเบี้ย 45.45 ล้านบาท เนื่องจากมูลค่าเงินให้กู้ยืมเพื่อซื้อหลักทรัพย์ในปี 2564 ที่เพิ่มขึ้นร้อยละ 69.3 จากปี 2563 ตามปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์ที่เพิ่มมากขึ้น

ในปี 2563 บริษัทฯ มีรายได้รวม 1,747.10 ล้านบาท เพิ่มขึ้นร้อยละ 34.88 จากปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของรายได้ค่านายหน้า 400.59 ล้านบาท เนื่องจากปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวัน ซึ่งเพิ่มขึ้นจาก 6,701 ล้านบาทเป็น 7,433 ล้านบาท หรือเพิ่มขึ้นร้อยละ 10.92 และส่วนแบ่งการตลาดลดลงจากร้อยละ 6.15 เป็นร้อยละ 6.06 และ (2) การเพิ่มขึ้นของรายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ 41.40 ล้านบาท เนื่องจากการเพิ่มขึ้นของรายได้จากการวิเคราะห์หลักทรัพย์ รายได้จากการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์และการเป็นที่ปรึกษาทางการเงิน และรายได้ค่าธรรมเนียมจากการซื้อขายหน่วยลงทุน

2) ผลการดำเนินงาน: กำไรสุทธิ

สำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566 บริษัทฯ มีกำไรสุทธิ 1.56 ล้านบาท ลดลง 98.69 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 98.44 เมื่อเทียบกับงวดเดียวกันของปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจากการลดลงของรายได้ 2 ส่วนคือ รายได้ค่านายหน้าและกำไรและผลตอบแทนจากเครื่องมือทางการเงินที่ลดลง ในขณะที่รายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ และรายได้ดอกเบี้ยเพิ่มขึ้น

ในปี 2565 บริษัทฯ มีกำไรสุทธิ 207.46 ล้านบาท ลดลง 92.71 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 30.89 จากปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจากการเพิ่มขึ้นของค่าใช้จ่ายอื่น เช่น ค่าใช้จ่ายเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลงผู้ถือหุ้นและการปรับโครงสร้างของบริษัทฯ ค่าขาดผลเสียหายจากการส่งคำสั่งผิดพลาด สำรองผลเสียหายจากคดีความที่อาจเกิดขึ้น ค่าบริการข้อมูลและค่าบริการเชื่อมต่อตลาดหลักทรัพย์ฯ และค่าใช้จ่ายในการส่งเสริมการตลาด ในขณะที่รายได้เพิ่มขึ้นในอัตราที่น้อยกว่าอัตราการเพิ่มขึ้นของค่าใช้จ่ายข้างต้น

ในปี 2564 บริษัทฯ มีกำไรสุทธิ 300.17 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 218.12 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 265.84 จากปีก่อน ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจากการเพิ่มขึ้นของรายได้ 2 ส่วนคือ รายได้ค่านายหน้าและรายได้ดอกเบี้ย ทำให้ครอบคลุมค่าใช้จ่ายคงที่และค่าใช้จ่ายผันแปรของบริษัทฯ และมีผลกำไรดังกล่าว

ในปี 2563 บริษัทฯ มีกำไรสุทธิ 82.05 ล้านบาท ขณะที่ปี 2562 มีผลขาดทุนสุทธิ ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจากการเพิ่มขึ้นของรายได้ 2 ส่วนคือ รายได้ค่านายหน้าและรายได้ค่าธรรมเนียมและบริการ ซึ่งครอบคลุมค่าใช้จ่ายคงที่และค่าใช้จ่ายผันแปรของบริษัทฯ และมีผลกำไรเท่าที่ขยอดดังกล่าว

3) ฐานะทางการเงิน: สินทรัพย์รวม

สำหรับงวด 6 เดือนสิ้นสุดวันที่ 30 มิถุนายน 2566 บริษัทฯ มีสินทรัพย์รวม 7,197.35 ล้านบาท ลดลง 819.20 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 10.22 เมื่อเทียบกับ ณ สิ้นปี 2565 ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การลดลงของลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า 1,078.27 ล้านบาท (2) การเพิ่มขึ้นของลูกหนี้สำนักหักบัญชีและบริษัทหลักทรัพย์ 511.55 ล้านบาท โดย (1) และ (2) เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงของปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี ซึ่งการเพิ่มขึ้นหรือลดลงของรายการดังกล่าวถือเป็นการดำเนินธุรกิจตามปกติของบริษัทฯ ซึ่งเป็นการเปลี่ยนแปลงที่ไม่ได้มีผลกระทบต่ออย่างมีนัยสำคัญต่อการประกอบธุรกิจของบริษัทฯ และ (3) การลดลงของเงินลงทุน 236.59 ล้านบาท เนื่องจากการลดลงของมูลค่ายุติธรรมของเงินลงทุนและเงินลงทุนที่วัดมูลค่าด้วยราคาทุนตัดจำหน่าย

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565 บริษัทฯ มีสินทรัพย์รวม 8,016.55 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 969.34 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 13.75 เมื่อเทียบกับ ณ สิ้นปี 2564 ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของอาคารและอุปกรณ์ - สุทธิ 387.68 ล้านบาท เนื่องจากการซื้อ FSL มาเป็นบริษัทย่อยของ FSSIA ทำให้ได้มาซึ่งอาคารและอุปกรณ์อันเป็นที่ตั้งของสำนักงานใหญ่ของ FSL (2) การเพิ่มขึ้นของเงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด 275.17 ล้านบาท และ (3) สินทรัพย์อื่น - สุทธิ 210.88 ล้านบาท เนื่องจากการเพิ่มขึ้นของรายการเงินฝากธนาคารเพื่อลูกค้าภายใต้ยึดตามคำสั่งสำนักงานป้องกันและปราบปรามการฟอกเงินและรายการเงินสมทบกองทุนทดแทนความเสียหายในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2564 บริษัทฯ มีสินทรัพย์รวม 7,047.21 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 1,100.26 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 18.50 เมื่อเทียบกับ ณ สิ้นปี 2563 ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า 580.44 ล้านบาท และ (2) การเพิ่มขึ้นของลูกหนี้สำนักหักบัญชีและบริษัทหลักทรัพย์ 589.58 ล้านบาท โดย (1) และ (2) เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงของปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี ซึ่งการเพิ่มขึ้นหรือลดลงของรายการดังกล่าวถือเป็นการดำเนินธุรกิจตามปกติของบริษัทฯ ซึ่งเป็นการเปลี่ยนแปลงที่ได้มีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญต่อการประกอบธุรกิจของบริษัทฯ

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 บริษัทฯ มีสินทรัพย์รวม 5,946.95 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 1,670.00 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 39.05 เมื่อเทียบกับ ณ สิ้นปี 2562 ซึ่งมีสาเหตุหลักมาจาก (1) การเพิ่มขึ้นของลูกหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า 1,200.96 ล้านบาท และ (2) การเพิ่มขึ้นของลูกหนี้สำนักหักบัญชีและบริษัทหลักทรัพย์ 140.19 ล้านบาท โดย (1) และ (2) เนื่องจากการเปลี่ยนแปลงของปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี ซึ่งการเพิ่มขึ้นหรือลดลงของรายการดังกล่าวถือเป็นการดำเนินธุรกิจตามปกติของบริษัทฯ ซึ่งเป็นการเปลี่ยนแปลงที่ได้มีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญต่อการประกอบธุรกิจของบริษัทฯ

4) ฐานะทางการเงิน: หนี้สินและส่วนของผู้ถือหุ้น

ณ วันที่ 30 มิถุนายน 2566 บริษัทฯ มีหนี้สิน 4,384.73 ล้านบาท และส่วนของผู้ถือหุ้น 2,812.62 ล้านบาท โดยเป็นอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเท่ากับ 1.56 เท่า ทั้งนี้ รายการหลักของหนี้สิน คือ (1) เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งรายการดังกล่าวจะเปลี่ยนแปลงไปตามปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี และ (2) หนี้กู้ยืมที่เสนอขายต่อนักลงทุนสถาบันและนักลงทุนรายใหญ่ในระหว่างปี 2564 - 2565 ขณะที่รายการหลักของส่วนของผู้ถือหุ้นคือ ทุนที่ออกและชำระแล้ว และส่วนเกินมูลค่าหุ้น รวมถึงกำไรสะสม ซึ่งเพิ่มขึ้นตามกำไรสุทธิของบริษัทฯ ดังนั้น หากพิจารณาอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นโดยไม่รวมรายการเจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแล้ว บริษัทฯ จะมีอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเพียง 0.52 เท่า

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2565 บริษัทฯ มีหนี้สิน 5,168.53 ล้านบาท และส่วนของผู้ถือหุ้น 2,848.02 ล้านบาท โดยเป็นอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเท่ากับ 1.81 เท่า ทั้งนี้ รายการหลักของหนี้สินคือ (1) เจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งรายการดังกล่าวจะเปลี่ยนแปลงไปตามปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี และ (2) หนี้กู้ยืมที่เสนอขายต่อนักลงทุนสถาบันและนักลงทุนรายใหญ่ ขณะที่รายการหลักของส่วนของผู้ถือหุ้นคือ ทุนที่ออกและชำระแล้ว และส่วนเกินมูลค่าหุ้น รวมถึงกำไรสะสม ซึ่งเพิ่มขึ้นตามกำไรสุทธิของบริษัทฯ ดังนั้น หากพิจารณาอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้น

เจ้าของโดยที่ไม่รวมรายการเจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแล้ว บริษัทฯ จะมีอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเพียง 1.03 เท่า

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2564 บริษัทฯ มีหนี้สิน 4,355.66 ล้านบาท และส่วนของผู้ถือหุ้น 2,691.06 ล้านบาท โดยคิดเป็นอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเท่ากับ 1.62 เท่า ทั้งนี้ รายการหลักของหนี้สิน คือเจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งรายการดังกล่าวดังกล่าวจะเปลี่ยนแปลงไปตามปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี ขณะที่รายการหลักของส่วนของผู้ถือหุ้นคือทุนที่ออกและชำระแล้ว และส่วนเกินมูลค่าหุ้นรวมถึงกำไรสะสม ซึ่งเพิ่มขึ้นตามกำไรสุทธิของบริษัทฯ ดังนั้น หากพิจารณาอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นโดยที่ไม่รวมรายการดังกล่าวแล้ว บริษัทฯ จะมีอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเพียง 0.50 เท่า

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 บริษัทฯ มีหนี้สิน 3,515.77 ล้านบาท และส่วนของผู้ถือหุ้น 2,430.79 ล้านบาท โดยคิดเป็นอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเท่ากับ 1.45 เท่า ทั้งนี้ รายการหลักของหนี้สิน คือเจ้าหนี้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งรายการดังกล่าวจะเปลี่ยนแปลงไปตามปริมาณมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ในสองวันทำการสุดท้ายของแต่ละงวดบัญชี ขณะที่รายการหลักของส่วนของผู้ถือหุ้นคือทุนที่ออกและชำระแล้ว และส่วนเกินมูลค่าหุ้น รวมถึงกำไรสะสม ซึ่งเพิ่มขึ้นตามกำไรสุทธิของบริษัทฯ ดังนั้น หากพิจารณาอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นโดยที่ไม่รวมรายการดังกล่าวแล้ว บริษัทฯ จะมีอัตราส่วนหนี้สินต่อส่วนของผู้ถือหุ้นเพียง 0.65 เท่า

10. รายละเอียดโครงการของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่จะเสนอขาย

10.1. ชนิดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และมูลค่าที่ตราไว้

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงชนิดระบุชื่อผู้ถือ ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน ไม่มีการแปลงสภาพ และไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรุ่นจะมีอายุ มูลค่าเงินต้นที่ตราไว้ทั้งหมดจำนวนหน่วย และรายละเอียดอื่น ๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรุ่นที่ออกภายใต้โครงการ ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้และข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรุ่นนั้น ๆ ทั้งนี้ หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ไม่ได้ได้รับความคุ้มครองจากสถาบันคุ้มครองเงินฝากตามพระราชบัญญัติสถาบันคุ้มครองเงินฝากแต่อย่างใด

ผู้ลงทุนสามารถดูรายละเอียดได้ที่ ข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ("ข้อกำหนดสิทธิ") ซึ่งกำหนดหลักเกณฑ์และเงื่อนไขทั่วไปที่ใช้บังคับกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

ทั้งนี้ หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะออกเป็นรุ่น โดยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกในแต่ละรุ่นจะมีการระบุข้อกำหนดและเงื่อนไขเพิ่มเติมอื่น ๆ ที่เกี่ยวข้องกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรุ่นไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคา ทั้งนี้ ให้ถือว่าข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาเป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ ในกรณีที่มีข้อขัดแย้งกัน ระหว่างข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคากับข้อกำหนดสิทธิ ให้ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องมีผลใช้บังคับแทนที่ในส่วนที่ขัดแย้งกัน

10.2. ข้อจำกัดการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

เนื่องจากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ครั้งที่ 1/2566 ของ บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) นี้ เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขายต่อผู้ลงทุนสถาบัน และ/หรือ ผู้ลงทุนรายใหญ่ ตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 16/2565 การขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อบุคคลในวงจำกัด และ การเสนอขายหุ้นกู้แปลงสภาพต่อบุคคลที่มีลักษณะเฉพาะ ฉบับลงวันที่ 23 กันยายน พ.ศ. 2565 (รวมทั้งที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่) ดังนั้น ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องไม่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใด ๆ ให้แก่บุคคลที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่ ตามประเภทและลักษณะที่นิยามไว้ใน ประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ที่ กจ. 39/2564 เรื่อง การกำหนดบทนิยามผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และผู้ลงทุนรายใหญ่ ฉบับลงวันที่ 24 ธันวาคม พ.ศ. 2564 (รวมทั้งที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจึงสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าในทอดใด ๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนทางมรดกหรือตามคำสั่งของศาล นอกจากนี้ ในกรณีที่ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงรุ่นใด ๆ มีการกำหนดข้อห้ามโอนเปลี่ยนมือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงรุ่นดังกล่าวจะไม่มีสิทธิโอนหรือจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในรุ่นนั้น ๆ ให้แก่บุคคลใด ๆ และไม่ว่าในกรณีใด ๆ เว้นแต่เป็นการโอนทางมรดกหรือตามคำสั่งของศาล

ส่วนที่ 4

ข้อมูลเกี่ยวกับการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น

บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) (“บริษัทฯ” หรือ “ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง”) มีความประสงค์จะออกและเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น (“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) (“โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง”) และเป็นไปตามข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ตามเอกสารแนบ ซึ่งอาจมีการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือเพิ่มเติมโดยข้อกำหนดเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด ทั้งนี้ หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีลักษณะที่สำคัญตามที่ระบุไว้ดังนี้

1. รายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย

1.1 ลักษณะสำคัญของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	บริษัทฯ ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือหรือเครดิตภายในประเทศ (National Rating) ระยะยาวที่ระดับ “BBB+ (tha)” โดยบริษัท ฟิทช์เรตติ้งส์ จำกัด (ข้อมูล ณ วันที่ 29 ธันวาคม 2565) โดยมีแนวโน้มอันดับเครดิตที่ “Stable” หรือ “มีเสถียรภาพ” ในขณะเดียวกัน ฟิทช์เรตติ้งส์ ประกาศคงอันดับเครดิตในประเทศระยะสั้นที่ “F2(thu)”
โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566	:	โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัดซึ่งมีมูลค่าเสนอขายรวมทั้งสิ้นไม่เกิน 300 ล้านบาทและบริษัทฯฯ มีวงเงินคงเหลือที่เพียงพอสำหรับการออกและเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตามที่ได้รับอนุญาตให้ออกและเสนอขายจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“สำนักงาน ก.ล.ต.”)
ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น
ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ชนิดระบุชื่อผู้ถือ ไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน ไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง อายุไม่เกิน 270 วัน นับแต่วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละประเภทหรือแต่ละชุดที่เกี่ยวข้อง ซึ่งมีรายละเอียดเป็นไปตามข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
ราคาที่คาดว่าจะขายต่อหน่วย	:	ตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย	:	หมายถึง ดัชนีหลักทรัพย์ SET Index, SET50 Index, SET100 Index รวมถึงดัชนีหลักทรัพย์อื่นๆ ที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเป็นผู้คำนวณและจัดทำ
ผลตอบแทนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	ตามที่ระบุในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
หลักทรัพย์อ้างอิง	:	หลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งต้องเป็นกรณีใดกรณีหนึ่งดังต่อไปนี้

	(1) หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 หรือ
	(2) ตะกร้าหลักทรัพย์ (Basket Securities) ซึ่งประกอบด้วยหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET 100 หรือ
	(3) ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย หรือ
	(4) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ (Exchange Traded Fund) ที่จดทะเบียนและซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
	ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
ผู้จัดทำนายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง :	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง :	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) หรือบุคคลอื่นที่ได้รับการแต่งตั้งให้ทำหน้าที่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิ (ถ้ามี)
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง :	ไม่มี
มูลค่าเสนอขายรวมทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในครั้ง	ไม่เกิน 300 ล้านบาท
นี้	

1.2 สรุปสาระสำคัญของข้อกำหนดด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ข้อกำหนดสิทธิ :	ข้อกำหนดด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคา :	ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งลงนามโดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ระบุข้อกำหนดและรายละเอียดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด ดังมีสาระสำคัญตามแบบที่ระบุไว้ในเอกสารแนบท้าย 3 ของข้อกำหนดสิทธิ ซึ่งถือเป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ
ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง :	1. หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทที่ไม่มีดอกเบี้ย ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่ได้รับดอกเบี้ยภายใต้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง 2. หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทที่มีดอกเบี้ย ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะได้รับดอกเบี้ยในอัตราต่อปี เท่ากับดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตามวิธีการและเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง :	หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะได้รับการไถ่ถอนโดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือในวันที่เกิดเหตุการณ์ที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสามารถไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนกำหนดได้ ไม่ว่าทั้งหมดหรือแต่เพียงบางส่วน โดยการชำระหนี้เป็นเงินตามมูลค่าที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง หรือการส่งมอบหลักทรัพย์ หรือทยอยส่งมอบหลักทรัพย์ (ถ้ามี) ที่ตกลงจะส่งมอบให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตามวิธีการและเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง (ตามแต่กรณี) ทั้งนี้ ให้ใช้วิธีการชำระหนี้ตามที่กำหนดไว้ในข้อ 8.2 ของข้อกำหนดสิทธิกับการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับการชำระหนี้ด้วยเงินและให้ใช้วิธีการส่งมอบทรัพย์สินตามที่

กำหนดไว้ในข้อ 8.3 ของข้อกำหนดสิทธิกับการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ

ทั้งนี้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสามารถศึกษารายละเอียดเพิ่มเติมได้จากข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละประเภทหรือแต่ละชุด

เหตุผิดนัด

: ถ้าเกิดเหตุการณ์ใดๆ ดังต่อไปนี้ให้ถือเป็นเหตุผิดนัด (“เหตุผิดนัด”) ภายใต้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ก) เมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ชำระเงิน และ/หรือดอกเบี้ย (ถ้ามี) หรือไม่ส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ และ/หรือดอกเบี้ย (ถ้ามี) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วนตามเงื่อนไขในข้อกำหนดสิทธิ ทั้งนี้ จะไม่ถือว่าเกิดเหตุผิดนัดกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หาก

- (1) การไม่ชำระเงินดังกล่าวมีสาเหตุจากความล่าช้าในระบบการโอนเงินหรือเหตุสุดวิสัยในการจัดส่งเช็ค หรือ
- (2) การไม่ส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบดังกล่าวมีสาเหตุจากความล่าช้าในระบบการโอนหลักทรัพย์ หรือความล่าช้าของนายทะเบียนหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้อง หรือเหตุสุดวิสัยอื่นๆ ในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบดังกล่าว และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ทำการแก้ไขโดยชำระเงินหรือมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบดังกล่าวภายใน 7 (เจ็ด) วันทำการ นับจากวันที่เหตุขัดข้องดังกล่าวได้ผ่านพ้นไป

(ข) เมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ปฏิบัติตามข้อตกลง เงื่อนไข หรือภาระหน้าที่ ไม่ว่าข้อใดข้อหนึ่งตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิ โดยเหตุการณ์ดังกล่าวเป็นเหตุการณ์ที่สามารถแก้ไขได้ แต่ไม่ได้รับการแก้ไขภายในระยะเวลา 30 (สามสิบ) วัน ภายหลังจากวันที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับหนังสือแจ้งให้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแก้ไขการกระทำผิดข้อตกลงดังกล่าวแล้ว โดยผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่ารายเดียวหรือหลายรายรวมกัน) ซึ่งถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงรวมกันไม่น้อยกว่าร้อยละ 25 (ยี่สิบห้า) ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ยังมีได้ทำการไถ่ถอนทั้งหมด

(ค) ศาลมีคำสั่งพิทักษ์ทรัพย์ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในคดีล้มละลายหรือศาลมีคำสั่งฟื้นฟูกิจการของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามกฎหมายล้มละลาย หรือผู้ถือหุ้นของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีมติให้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเลิกกิจการ หรือ ชำระบัญชี

ผลของการผิดนัด

: เมื่อมีการผิดนัดกรณีใดกรณีหนึ่งเกิดขึ้นและยังคงอยู่ หาก

(ก) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่ารายเดียวหรือหลายราย) ซึ่งถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่น้อยกว่าร้อยละ 50 (ห้าสิบ) ของจำนวนหนี้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ยังมีได้ไถ่ถอนทั้งหมด มีหนังสือแจ้งผิดนัดไปยังผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง/ผู้ค้าประกันโครงการหุ้นกู้ โดยระบุถึงเหตุผิดนัดที่ทำให้มีการเร่งรัดชำระหนี้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือ

(ข) ที่ประชุมผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีมติเห็นชอบให้หนี้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดถึงกำหนดชำระโดยพลัน และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับแจ้งเป็นลายลักษณ์อักษรถึงมติ

ดังกล่าวแล้ว ให้ถือว่าหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงถึงกำหนดชำระโดยพลัน และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
แฝงจะต้องชำระหนี้ดังกล่าวให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทันทีนับแต่วันที่ได้รับแจ้งดังกล่าว
ข้างต้น

กฎหมายที่บังคับใช้ : ข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
จะใช้บังคับและตีความตามกฎหมายไทย

2. ข้อจำกัดการโอนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบัน และ/หรือ ผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดก หรือตามคำสั่งศาล

3. ตลาดรองของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

- ไม่มี -

4. การจอง การจำหน่าย และการจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิในการเปลี่ยนแปลงรายละเอียดวิธีการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและวิธีการจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามที่ระบุไว้ในหนังสือชี้ชวนนี้ตามความเหมาะสม ในกรณีที่เกิดปัญหา อุปสรรค หรือข้อจำกัดในการดำเนินการ ทั้งนี้ เพื่ออำนวยความสะดวกให้แก่นักลงทุนอย่างเป็นธรรมและเพื่อให้การเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงครั้งนี้ประสบความสำเร็จสูงสุด

4.1 วิธีการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

การเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในครั้งนี้เป็นการเสนอขายในวงจำกัดแก่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ ตามนิยามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กจ. 39/2564 เรื่อง การกำหนดบทนิยามผู้ลงทุนสถาบัน ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ และผู้ลงทุนรายใหญ่ ฉบับลงวันที่ 24 ธันวาคม พ.ศ. 2564 (รวมทั้งที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่) และเป็นการออกภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทจ.16/2565 ฉบับลงวันที่ 23 กันยายน พ.ศ.2565 เรื่อง การขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อบุคคลในวงจำกัด และการเสนอขายหุ้นกู้แปลงสภาพต่อบุคคลที่มีลักษณะเฉพาะ (รวมถึงที่มีการแก้ไขเปลี่ยนแปลง)

การเสนอขาย จัดจำหน่าย และจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการก.ล.ต. หรือคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ประกาศกำหนด ซึ่งรวมถึงหลักเกณฑ์ที่กำหนดไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทธ. 35/2556 เรื่อง มาตรฐานการประกอบธุรกิจ โครงสร้างการบริหารงาน ระบบงาน และการให้บริการของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ฉบับลงวันที่ 6 กันยายน พ.ศ.2556 (รวมทั้งที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่) ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 41/2557 เรื่อง การจำหน่ายตราสารหนี้และใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ออกใหม่ของบริษัทที่ออกหลักทรัพย์ ฉบับลงวันที่ 7 พฤศจิกายน พ.ศ. 2557 (รวมทั้งที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่) และประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทธ. 27/2559 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ ฉบับลงวันที่ 8 กรกฎาคม 2559 (รวมทั้งที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่) รวมทั้งแนวทาง (guideline) การปฏิบัติในรายละเอียดของข้อกำหนดตามประกาศดังกล่าวข้างต้น

- เพื่อประโยชน์ตามข้อนี้ ผู้ลงทุนสถาบัน หมายถึงผู้ลงทุนสถาบันตามประเภทและลักษณะที่ระบุไว้ ดังนี้
 - (1) ธนาคารแห่งประเทศไทย
 - (2) ธนาคารพาณิชย์
 - (3) ธนาคารที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น
 - (4) บริษัทเงินทุน
 - (5) บริษัทเครดิตฟองซิเอร์

- (6) บริษัทหลักทรัพย์
- (7) บริษัทประกันวินาศภัย
- (8) บริษัทประกันชีวิต
- (9) กองทุนรวม
- (10) กองทุนส่วนบุคคลซึ่งบริษัทหลักทรัพย์บริหารจัดการเงินทุนของผู้ลงทุนดังนี้
 - (ก) ผู้ลงทุนตาม (1) ถึง (9) หรือ (11) ถึง (24) หรือ (26)
 - (ข) ผู้ลงทุนตาม (25) ทั้งนี้ เฉพาะในธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์ที่ออกโดยบริษัทดังกล่าว
 - (ค) ผู้ลงทุนที่มีคุณสมบัติด้านฐานะการเงินเทียบเท่าผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษหรือผู้ลงทุนรายใหญ่
- (11) กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ
- (12) กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ
- (13) กองทุนประกันสังคม
- (14) กองทุนการออมแห่งชาติ
- (15) กองทุนเพื่อการฟื้นฟูและพัฒนาาระบบสถาบันการเงิน
- (16) ผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามกฎหมายว่าด้วยสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- (17) สถาบันการเงินระหว่างประเทศ
- (18) สถาบันคุ้มครองเงินฝาก
- (19) ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- (20) นิติบุคคลประเภทบริษัท
- (21) นิติบุคคลซึ่งมีผู้ลงทุนตาม (1) ถึง (20) ถือหุ้นรวมกันเกินกว่าร้อยละ 75 ของจำนวนหุ้นที่มีสิทธิออกเสียงทั้งหมด
- (22) ผู้ลงทุนต่างประเทศซึ่งมีลักษณะทำนองเดียวกับผู้ลงทุนตาม (1) ถึง (21) หรือ (23) หรือ (26)
- (23) ผู้ที่มีประสบการณ์และความเชี่ยวชาญในการลงทุน ได้แก่
 - (ก) ผู้จัดการกองทุน หรือผู้จัดการลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์เกี่ยวกับบุคลากรในธุรกิจตลาดทุน
 - (ข) นักวิเคราะห์การลงทุนที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน
 - (ค) ผู้ลงทุนที่มีลักษณะเฉพาะ (angel investor) ดังนี้ ทั้งนี้ เฉพาะในธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์ที่ออกตามประกาศเกี่ยวกับการเสนอขายหลักทรัพย์โดยวิสาหกิจขนาดกลางและขนาดย่อม (SME) หรือวิสาหกิจเริ่มต้น (startup) หรือหลักทรัพย์ที่เสนอขายผ่านผู้ให้บริการระบบคราวด์ฟันดิง (crowdfunding portal) ที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน
 1. ที่ปรึกษาทางการเงินที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน
 2. ผู้ให้บริการระบบคราวด์ฟันดิง (crowdfunding portal) ที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน
 3. ผู้ลงทุนที่มีคุณสมบัติด้านความรู้หรือประสบการณ์ และคุณสมบัติด้านฐานะการเงิน อย่างครบถ้วน
- (24) กิจการที่ประกอบธุรกิจในลักษณะเงินร่วมลงทุน ได้แก่ นิติบุคคลร่วมลงทุน และกิจการเงินร่วมลงทุน
- (25) บุคคลที่มีความสัมพันธ์กับบริษัทในลักษณะใดลักษณะหนึ่งดังนี้ ทั้งนี้ เฉพาะในธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์ที่ออกโดยบริษัทดังกล่าว
 - (ก) กรรมการ ผู้บริหาร หรือพนักงาน
 - (ข) ผู้ถือหุ้นรายใหญ่

(ค) บริษัทย่อย หรือบริษัทร่วม

(26) ผู้ลงทุนอื่นใดตามที่สำนักงานประกาศกำหนด

- ผู้ลงทุนรายใหญ่ หมายถึงผู้ลงทุนตามประเภทและลักษณะที่ระบุไว้ ดังนี้

คุณสมบัติของผู้ลงทุนรายใหญ่

กรณี ที่	ความรู้หรือประสบการณ์ และ ประเภทผู้ลงทุน	ความรู้หรือประสบการณ์	ฐานะการเงิน (อย่างใดอย่างหนึ่ง)			
			สินทรัพย์สุทธิ	ส่วนของผู้ถือหุ้น	รายได้ต่อปี	เงินลงทุน ⁷
1	ผู้ลงทุนรายใหญ่ (บุคคลธรรมดาซึ่งนับรวมกับคู่สมรส)	มีลักษณะใดลักษณะหนึ่ง ดังนี้ - มีประสบการณ์การลงทุนย้อนหลัง ในสินทรัพย์เสี่ยงเป็นประจำและต่อเนื่อง - มีประสบการณ์การทำงานด้าน การบริหารการเงินและการลงทุน - มีความรู้ความเข้าใจในหลักทรัพย์ ที่ลงทุนอย่างเพียงพอ	ไม่น้อยกว่า 30 ล้านบาท ⁸	-	ไม่น้อยกว่า 3 ล้านบาท	ไม่น้อยกว่า 8 ล้านบาท หรือ ไม่น้อยกว่า 15 ล้านบาท (ในกรณีที่นับรวม เงินฝาก)
2	ผู้ลงทุนรายใหญ่ (นิติบุคคล)	- เป็นผู้แนะนำการลงทุนหรือผู้วางแผน การลงทุนที่ได้รับความเห็นชอบจาก สำนักงาน - ได้รับวุฒิบัตรหลักสูตรใดหลักสูตรหนึ่ง ดังนี้ * Chartered Financial Analyst (CFA) * Certified Investment and Securities Analyst (CISA) * Chartered Alternative Investment Analyst (CAIA) * Certified Financial Planner (CFP) * หลักสูตรที่สำนักงานประกาศกำหนด ตามข้อ 7 วรรคสอง	-	ไม่น้อยกว่า 75 ล้านบาท	-	ไม่น้อยกว่า 15 ล้านบาท หรือ ไม่น้อยกว่า 30 ล้านบาท (ในกรณีที่นับรวม เงินฝาก)

⁷ เงินลงทุน หมายถึง เงินลงทุนโดยตรงในหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

⁸ สินทรัพย์ดังกล่าวไม่นับรวมมูลค่าอสังหาริมทรัพย์ซึ่งใช้เป็นที่พักอาศัยประจำของบุคคลนั้น

⁹ ผู้ลงทุนที่เป็นนิติบุคคล พิจารณาคุณสมบัติด้านประสบการณ์หรือความรู้จากบุคคลธรรมดาที่มีส่วนร่วมในการตัดสินใจลงทุนของนิติบุคคลนั้น และคุณสมบัติด้านฐานะการเงินจากงบการเงินประจำงวดบัญชีล่าสุดที่ผู้สอบบัญชีตรวจสอบแล้ว

- ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ หมายถึงผู้ลงทุนตามประเภทและลักษณะที่ระบุไว้ ดังนี้

คุณสมบัติของผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ

กรณี ที่	ความรู้หรือประสบการณ์ และ ประเภทผู้ลงทุน	ความรู้หรือประสบการณ์	ฐานะการเงิน (อย่างใดอย่างหนึ่ง)			
			สินทรัพย์สุทธิ	ส่วนของผู้ถือหุ้น	รายได้ต่อปี	เงินลงทุน ⁴
1	ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ (บุคคลธรรมดาซึ่งนับรวมกับคู่สมรส)	มีลักษณะใดลักษณะหนึ่ง ดังนี้ - มีประสบการณ์การลงทุนย้อนหลัง ในสินทรัพย์เสี่ยงเป็นประจำและต่อเนื่อง - มีประสบการณ์การทำงานด้าน การบริหารการเงินและการลงทุน - มีความรู้ความเข้าใจในหลักทรัพย์ ที่ลงทุนอย่างเพียงพอ	ไม่น้อยกว่า 60 ล้านบาท ⁵	-	ไม่น้อยกว่า 6 ล้านบาท	ไม่น้อยกว่า 15 ล้านบาท หรือ ไม่น้อยกว่า 30 ล้านบาท (ในกรณีที่นับรวม เงินฝาก)
2	ผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษ (นิติบุคคล)	- เป็นผู้แนะนำการลงทุนหรือผู้วางแผน การลงทุนที่ได้รับความเห็นชอบจาก สำนักงาน - ได้รับวุฒิบัตรหลักสูตรใดหลักสูตรหนึ่ง ดังนี้ * Chartered Financial Analyst (CFA) * Certified Investment and Securities Analyst (CISA) * Chartered Alternative Investment Analyst (CAIA) * Certified Financial Planner (CFP) * หลักสูตรที่สำนักงานประกาศกำหนด ตามข้อ 6 วรรคสอง	-	ไม่น้อยกว่า 150 ล้านบาท	-	ไม่น้อยกว่า 30 ล้านบาท หรือ ไม่น้อยกว่า 60 ล้านบาท (ในกรณีที่นับรวม เงินฝาก)

⁴ เงินลงทุน หมายถึง เงินลงทุนโดยตรงในหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

⁵ สินทรัพย์ดังกล่าวไม่นับรวมมูลค่าอสังหาริมทรัพย์ซึ่งใช้เป็นที่พักอาศัยประจำของบุคคลนั้น

⁶ ผู้ลงทุนที่เป็นนิติบุคคล พิจารณาคุณสมบัติด้านประสบการณ์หรือความรู้จากบุคคลธรรมดาที่มีส่วนร่วมในการตัดสินใจลงทุนของนิติบุคคลนั้น และคุณสมบัติด้านฐานะการเงินจากงบการเงินประจำงวดบัญชีล่าสุดที่ผู้สอบบัญชีตรวจสอบแล้ว

4.2 ผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
 ชั้น 18 อาคาร ดี ออฟฟิศเคส แอท เซ็นทรัลเวิลด์ 999/9
 ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330
 โทร 02 658 9500 โทรสาร 02 658 9110

4.3 เงื่อนไขและคำตอบแทนในการจัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

เนื่องจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเอง จึงไม่มีคำตอบแทนในการจัดจำหน่าย

4.4 ค่าใช้จ่ายในการเสนอขาย

ประมาณการค่าใช้จ่ายในการออกและเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่รวมภาษี) มีดังนี้

รายการ	จ่ายแก่	จำนวนเงิน
1. ค่าธรรมเนียมการยื่นแบบแสดงรายการข้อมูลการออกและเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	สำนักงาน ก.ล.ต.	50,000 บาท
2. ค่าใช้จ่ายอื่นๆ (ค่าใช้จ่ายในการจัดทำร่างหนังสือชี้ชวน หนังสือชี้ชวน ใบจองซื้อ ค่าใช้จ่ายในการโฆษณา และอื่นๆ)	-	200,000 บาท
รวม		250,000 บาท

4.5 วิธีการขอรับหนังสือชี้ชวนและใบจองซื้อ

ผู้จองซื้อสามารถแจ้งขอรับหนังสือชี้ชวนและใบจองซื้อได้ที่สำนักงานของผู้จัดจำหน่าย ตามที่ระบุไว้ในข้อ 4.2 ภายในวันและเวลาทำการของผู้จัดจำหน่าย นับตั้งแต่วันที่หนังสือชี้ชวนมีผลใช้บังคับจนถึงวันสิ้นสุดการเสนอขาย หรือขอคัดสำเนาหนังสือชี้ชวนซึ่งมีข้อมูลไม่แตกต่างจากหนังสือชี้ชวนที่ยื่นต่อสำนักงาน ก.ล.ต. เพื่อศึกษารายละเอียดเกี่ยวกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่จะออกภายใต้โครงการได้ ก่อนทำการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ได้ที่ สำนักงาน ก.ล.ต.เลขที่ 333 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพมหานคร ในเวลาทำการของสำนักงาน ก.ล.ต.

ทั้งนี้ ผู้จองซื้อสามารถดาวน์โหลดหนังสือชี้ชวนเพื่อศึกษาข้อมูลก่อนการลงทุนได้ทาง www.sec.or.th

4.6 วัน วิธีการจอง และการชำระเงินค่าจองซื้อ

ผู้จองซื้อจะต้องจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามจำนวนการจองซื้อขั้นต่ำที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง เว้นแต่จะกำหนดไว้เป็นอย่างอื่นในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องปฏิบัติดังนี้

4.6.1 เอกสารประกอบการจองซื้อ

ผู้ลงทุนรายใหญ่

ผู้จองซื้อจะต้องกรอกรายละเอียดการจองซื้อในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้ถูกต้องครบถ้วนและชัดเจน พร้อมลงลายมือชื่อ หากผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นนิติบุคคล จะต้องลงนามโดยผู้มีอำนาจลงนามของนิติบุคคลนั้น พร้อมประทับตราสำคัญของบริษัท (ถ้ามี)

โดยผู้จองซื้อจะต้องแนบเอกสารการจองซื้อ ดังต่อไปนี้

- (ก) ผู้จองซื้อประเภทบุคคลธรรมดาสัญชาติไทย : สำเนาบัตรประจำตัวประชาชน พร้อมลงนามรับรองสำเนาถูกต้อง หรือ ในกรณีที่ไม่มีบัตรประจำตัวประชาชน ให้แนบสำเนาทะเบียนบ้านที่มีเลขประจำตัวประชาชน 13 หลัก หรือ สำเนาเอกสารทางราชการอื่นที่มีเลขประจำตัวประชาชน 13 หลัก พร้อมทั้งลงนามรับรองสำเนาถูกต้อง
- (ข) ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทบุคคลธรรมดาซึ่งไม่มีสัญชาติไทย : สำเนาใบต่างด้าวที่ยังไม่หมดอายุ หรือ สำเนาหนังสือเดินทางพร้อมลงนามรับรองสำเนาถูกต้อง
- (ค) ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทนิติบุคคลตามกฎหมายไทยหรือที่จดทะเบียนในประเทศไทย : สำเนาหนังสือรับรองที่ออกโดยกระทรวงพาณิชย์ที่ออกไม่เกิน 3 เดือน ก่อนวันจองซื้อพร้อมลงนามรับรองสำเนาถูกต้อง โดยผู้มีอำนาจลงนามของนิติบุคคลและประทับตราบริษัท (ถ้ามี) พร้อมแนบสำเนาบัตรประจำตัวประชาชน สำเนาใบต่างด้าวหรือสำเนาหนังสือเดินทางที่ยังไม่หมดอายุ (แล้วแต่กรณี) ของผู้มีอำนาจลงนามของนิติบุคคลดังกล่าว พร้อมลงนามรับรองสำเนาถูกต้อง
- (ง) ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภทนิติบุคคลตามกฎหมายต่างประเทศหรือที่จดทะเบียนในต่างประเทศ : สำเนาหนังสือสำคัญการจัดตั้งบริษัท (Certificate of Incorporation) หรือหนังสือแสดงความเป็นนิติบุคคล (Affidavit) หนังสือบริคณห์สนธิ ข้อบังคับ และหนังสือรับรอง พร้อมลงนามรับรองสำเนาถูกต้องโดยผู้มีอำนาจลงนามของนิติบุคคลนั้น และประทับตราสำคัญของนิติบุคคล (ถ้ามี) พร้อมแนบสำเนาใบต่างด้าวหรือสำเนาหนังสือเดินทางที่ยังไม่หมดอายุ (แล้วแต่กรณี) ของผู้มีอำนาจลงนามของนิติบุคคลดังกล่าว พร้อมลงนามรับรองสำเนาถูกต้อง

ผู้ลงทุนสถาบัน

ผู้จองซื้อจะต้องกรอกรายละเอียดการจองซื้อในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้ถูกต้องครบถ้วนและชัดเจน พร้อมลงลายมือชื่อ หากผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นนิติบุคคล จะต้องลงนามโดยผู้มีอำนาจลงนามของนิติบุคคลนั้น พร้อมประทับตราสำคัญของบริษัท (ถ้ามี)

โดยผู้จองซื้อจะต้องแนบเอกสารการจองซื้อ ดังต่อไปนี้

- (ก) ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทนิติบุคคลตามกฎหมายไทย หรือที่จดทะเบียนในประเทศไทย : สำเนาหนังสือรับรองที่ออกโดยกระทรวงพาณิชย์ที่ออกไม่เกิน 3 เดือน พร้อมลงนามรับรองสำเนาถูกต้องโดยผู้มีอำนาจลงนามของนิติบุคคลและประทับตราสำคัญของนิติบุคคล (ถ้ามี) พร้อมแนบสำเนาบัตรประจำตัวประชาชน สำเนาใบต่างด้าวหรือสำเนาหนังสือเดินทางที่ยังไม่หมดอายุ (แล้วแต่กรณี) ของผู้มีอำนาจลงนามนิติบุคคลดังกล่าว พร้อมลงนามรับรองสำเนาถูกต้อง
- (ข) ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทนิติบุคคลตามกฎหมายต่างประเทศหรือที่จดทะเบียนในต่างประเทศ : สำเนาหนังสือสำคัญการจัดตั้งบริษัท (Certificate of Incorporation) หรือหนังสือแสดงความเป็นนิติบุคคล (Affidavit) หนังสือบริคณห์สนธิ ข้อบังคับ และหนังสือรับรองพร้อมลงนามรับรองสำเนาถูกต้อง โดยผู้มีอำนาจลงนามของนิติ

บุคคลนั้น และประทับตราสำคัญของนิติบุคคล (ถ้ามี) พร้อมแนบสำเนาใบต่างด้าวหรือสำเนาหนังสือเดินทางที่ยังไม่หมดอายุ (แล้วแต่กรณี) ของผู้มีอำนาจลงนามของนิติบุคคลดังกล่าว พร้อมลงนามรับรองสำเนาถูกต้อง

นอกจากนี้ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์จะต้องยื่นเอกสารประกอบการรับรองการเป็นผู้ลงทุนสถาบันหรือผู้ลงทุนรายใหญ่ อาทิ สำเนาสมุดบัญชี หรือ Bank Statement หรือสำเนางบการเงินล่าสุดที่ผู้ตรวจสอบบัญชีรับรองแล้ว (แล้วแต่กรณี) ทั้งนี้ หากผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์เคยยื่นเอกสารประกอบการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์อาจผ่อนผันให้ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์สามารถส่งใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์โดยไม่ต้องยื่นเอกสารประกอบการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์โดยอัตโนมัติ

- 4.6.2 ทั้งนี้ หากผู้จองซื้อเป็นผู้ที่มีบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์กับผู้จัดการจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ และได้ผ่านขั้นตอนการรู้จักลูกค้าและตรวจสอบเพื่อทราบข้อเท็จจริงเกี่ยวกับลูกค้า (KYC/CDD) และดำเนินการจัดทำแบบประเมินความเหมาะสมในการลงทุนหรือการทำธุรกรรม (Suitability Test) กับผู้จัดการจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ ก่อนการจองซื้อแล้ว สามารถจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ผ่านผู้แนะนำการลงทุน โดยยืนยันการจองซื้อผ่านโทรศัพท์บันทึกเทปได้ และไม่ต้องยื่นเอกสารประกอบการจองซื้อ
- 4.6.3 ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์สามารถจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ได้ที่สำนักงานของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ ตามที่ระบุไว้ข้างต้นตามวันและเวลาที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ที่เกี่ยวข้อง
- 4.6.4 ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์จะต้องชำระเงินค่าซื้อครั้งเดียวเต็มจำนวนที่จองซื้อภายในวันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ โดยผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์จะต้องชำระเป็น (ก) เช็ค ดราฟต์ หรือแคชเชียร์เช็ค (หรือที่เรียกว่า “เช็คธนาคาร”) เพียงฉบับเดียว และต้องสามารถเรียกเก็บเงินได้จากสำนักหักบัญชีเดียวกันในเขตกรุงเทพมหานคร ภายในวันที่ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ หรือ (ข) การโอนเงินผ่านระบบการโอนเงินอัตโนมัติ (Automatic Transfer System หรือ ATS) (ค) การโอนเงิน (รวมทั้งการโอนเงินผ่านระบบ Baht net) หรือ (ง) ชำระโดยให้หักเงินจากบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ที่ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์เปิดไว้กับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ ทั้งนี้ ตามรายละเอียดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ หรือตามขั้นตอนและกระบวนการการชำระเงินอื่นใดที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์จะได้มีการแจ้งให้ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ทราบในลำดับต่อไป
- 4.6.5 ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์จะต้องนำใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ที่กรอกข้อมูลรายละเอียดและลงนามเรียบร้อยแล้ว พร้อมเอกสารประกอบการจองซื้อตามข้อ 4.6.1 พร้อมเงินค่าจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์หรือหลักฐานที่แสดงว่ามีการโอนเงินค่าจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ตามข้อ 4.6.3 ส่งไปยังผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์จะออกใบยืนยันการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ (Confirmation Note) เพื่อเป็นหลักฐานในการรับจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แก่ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
- 4.6.6 ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ที่แสดงความจำนงในการจองซื้อและได้ดำเนินการตามข้อ 4.6.4 แล้ว จะขอยกเลิกการจองซื้อและขอเงินคืนไม่ได้ ทั้งนี้ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์มีสิทธิปฏิเสธหรือยกเลิกการจองซื้อของผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ที่ดำเนินการไม่ครบถ้วนตามข้อ 4.6.1 - 4.6.4 ได้

ทั้งนี้ บริษัทอาจมีประกาศเปลี่ยนแปลงวิธีการจองซื้อ สถานที่จองซื้อ หรือช่องทางการจองซื้อ รวมถึงรายการเอกสารประกอบการจองซื้อซึ่งผู้จองซื้อสามารถตรวจสอบได้ ณ ที่ทำการของผู้จัดจำหน่าย

4.7 วิธีการจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์

(ให้ระบุหลักการจัดสรร โดยระบุกลุ่มบุคคล และสัดส่วน หรือจำนวนหุ้นกู้ที่จะได้รับจัดสรรอย่างชัดเจน หากมีการแบ่งจำนวนหุ้นกู้ และเสนอขายต่อ ผู้ลงทุน ตปท. ให้ระบุด้วย)

การออกและเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในครั้งนี้เป็นการออกและเสนอขายให้ผู้ลงทุนในวงจำกัดแก่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ ตามนิยามในประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กจ. 5/2552 และ ที่ กจ. 39/2564 (รวมทั้งที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่)

ผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิในการใช้ดุลยพินิจในการจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้ผู้มีอุปการะคุณของบริษัทฯ ผู้ที่เป็นลูกค้า เคยเป็นลูกค้า หรือคาดว่าจะ被客户ของบริษัทฯ ในอนาคต หรือผู้มีความสัมพันธ์กับบริษัทฯ ในเชิงธุรกิจก่อน จึงจัดสรรให้บุคคลอื่น ๆ ต่อไป โดยจะจัดสรรให้บุคคลใด ในจำนวนมายน้อยเท่าใดก็ได้ หรือจะปฏิเสธการจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้กับบุคคลใดก็ได้ ทั้งนี้ ผู้ลงทุนต้องเป็นผู้ลงทุนสถาบัน และผู้ลงทุนรายใหญ่ ตามนิยามในประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กจ. 5/2552 และ ที่ กจ. 39/2564 (รวมทั้งที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่) และต้องมีจำนวนขั้นต่ำตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

การเสนอขาย จัดจำหน่าย และจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่คณะกรรมการก.ล.ต. หรือคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ประกาศกำหนด ซึ่งรวมถึงหลักเกณฑ์ที่กำหนดไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทธ. 35/2556 เรื่อง มาตรฐานการประกอบธุรกิจ โครงสร้างการบริหารงาน ระบบงาน และการให้บริการของผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ฉบับลงวันที่ 6 กันยายน พ.ศ.2556 (รวมทั้งที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่) ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 41/2557 เรื่อง การจำหน่ายตราสารหนี้และใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ออกใหม่ของบริษัทที่ออกหลักทรัพย์ ฉบับลงวันที่ 7 พฤศจิกายน พ.ศ. 2557 (รวมทั้งที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่) และประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทธ. 27/2559 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ ฉบับลงวันที่ 8 กรกฎาคม 2559 (รวมทั้งที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมหรือใช้แทนที่) รวมทั้งแนวทาง (guideline) การปฏิบัติในรายละเอียดของข้อกำหนดตามประกาศดังกล่าวข้างต้น

หากยอดจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของบริษัทฯ ครบตามจำนวนที่กำหนดแล้ว ผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิในการปิดรับจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดระยะเวลาการเสนอขาย

ทั้งนี้ ผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิในการเปลี่ยนแปลงจำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่จัดสรรให้แก่ผู้ลงทุนตามความเหมาะสม

4.8 การจัดสรรในกรณีที่มีผู้จองซื้อเกินกว่าจำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย

ในกรณีที่มีการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกินกว่าจำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย ให้การจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวอยู่ในดุลยพินิจของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่จะดำเนินการจัดสรรตามหลักเกณฑ์และวิธีการในการจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ระบุไว้ในข้อ 4.7 ทั้งนี้ ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ไม่ได้รับการจัดสรรหรือได้รับการจัดสรรน้อยกว่าจำนวนที่จองซื้อ จะได้รับค่าจองซื้อคืนตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในข้อ 4.10

4.9 การยกเลิกการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

4.9.1 การยกเลิกการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีสิทธิปฏิเสธหรือยกเลิกการจองซื้อของผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ดำเนินการไม่ครบถ้วนตามข้อ 4.6.1-4.6.4 ได้

4.9.2 การยกเลิกการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

- (1) ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ยื่นความจำเป็นในการจองซื้อและได้ดำเนินการตามข้อ 4.6.4 แล้วจะขอยกเลิกการจองซื้อและขอเงินคืนไม่ได้
- (2) ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสามารถยกเลิกการจองซื้อได้ ถ้าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต้องระงับหรือหยุดเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์ที่เสนอขายได้ ทั้งนี้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะคืนเงินค่าจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้จองซื้อที่ยกเลิกการจองซื้อตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในข้อ 4.10

4.10 วิธีการคืนเงินค่าจองซื้อ

4.10.1 กรณีผู้จองซื้อไม่ได้รับการจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือได้รับจัดสรรไม่เต็มจำนวนที่จองซื้อ

ผู้จัดจำหน่ายจะดำเนินการคืนเงินค่าจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยไม่มีดอกเบี้ย หรือค่าเสียหายใดๆ ให้แก่ผู้จองซื้อที่ไม่ได้รับการจัดสรรโดยการโอนเงินอัตโนมัติเข้าบัญชีในชื่อผู้จองซื้อ หรือจ่ายเป็นเช็คขีดคร่อม ส่งจ่ายผู้จองซื้อตามที่ระบุไว้ในใบจองซื้อ ภายในระยะเวลาและวิธีการที่สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยกำหนดโดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ต. ทั้งนี้ไม่เกิน 10 (สิบ) วันทำการนับจากปิดการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุดที่เกี่ยวข้อง โดยผู้จองซื้อจะเป็นผู้รับผิดชอบค่าธรรมเนียมในการโอนเงิน (ถ้ามี) หรือส่งทางไปรษณีย์ลงทะเบียนตามที่ระบุไว้ในใบจองซื้อ

ทั้งนี้ ในกรณีที่ไม่สามารถคืนเงินค่าจองซื้อได้ภายในเวลา 10 วันนับจากวันที่สิ้นสุดระยะเวลาการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุดที่เกี่ยวข้อง ผู้จัดจำหน่ายมีหน้าที่รับผิดชอบในการส่งเงินคืนดังกล่าวจะต้องชำระดอกเบี้ยให้แก่ผู้จองซื้อในอัตราร้อยละ 7.5 (เจ็ดจุดห้า) ต่อปี โดยคำนวณจากจำนวนเงินค่าจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ไม่ได้รับการจัดสรร นับจากวันที่พ้นกำหนดเวลา 10 (สิบ) วันดังกล่าว จนถึงวันที่ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับคืนเงินค่าจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแล้ว อย่างไรก็ตาม ไม่ว่าในกรณีใดๆ หากได้มีการส่งเช็คคืนเงินค่าจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทางไปรษณีย์ลงทะเบียนตามที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหรือได้มีการโอนเงินผ่านระบบการโอนเงินอัตโนมัติ (ATS) เข้าบัญชีธนาคารของผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยถูกต้องแล้ว ให้ถือว่าผู้จองซื้อได้รับคืนเงินค่าจองซื้อแล้วโดยชอบ และผู้จองซื้อจะไม่มีสิทธิเรียกร้องดอกเบี้ย และ/หรือค่าเสียหายใดๆ อีกต่อไป

4.10.2 กรณีที่ผู้จองซื้อไม่ได้รับการจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เนื่องจากกรณีที่ไม่สามารถเรียกเก็บเงินค่าจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามเช็คที่จ่ายค่าจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือเนื่องจากการปฏิบัติผิดเงื่อนไขการจองซื้อ

ผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการคืนเงินค่าจองซื้อสำหรับการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้จองซื้อซึ่งไม่ได้รับการจัดสรรอันเนื่องมาจากการปฏิบัติผิดเงื่อนไขในการจองซื้อ โดยผู้จองซื้อดังกล่าวสามารถติดต่อขอรับเงินค่าจองซื้อคืนจากผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการโอนเงินอัตโนมัติเข้าบัญชีในชื่อผู้จองซื้อ หรือจ่ายเป็นเช็คขีดคร่อม ส่งจ่ายผู้จองซื้อตามที่ระบุไว้ในใบจองซื้อ ภายในระยะเวลาและวิธีการที่สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยกำหนดโดยได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ต. ทั้งนี้ไม่เกิน 10 (สิบ) วันทำการนับจากวันปิดการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

4.11 วิธีการส่งมอบ

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง จะบันทึกชื่อผู้ที่ได้รับจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในสมุดบัญชีหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทางระบบอิเล็กทรอนิกส์ (Scriptless) ในวันที่ออกหุ้นกู้ที่หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เว้นแต่ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มี

อนุพันธ์แฝงจะแสดงความประสงค์ว่าต้องการรับใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในกรณีนี้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง จะจัดทำและส่งมอบใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามจำนวนที่ได้รับการจัดสรร ภายในระยะเวลา 15 (สิบห้า) วันทำการนับแต่วันที่ผู้จองซื้อได้รับการยืนยันจากผู้จำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงถึงสิทธิการได้รับจัดสรรหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยมีการจัดส่งให้ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงถึงมือโดยตรงโดยผ่านทางพนักงานส่งเอกสาร หรือจัดส่งทางไปรษณีย์ลงทะเบียนหรือวิธีการอื่นใดที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นผู้กำหนดหรือตกลงไว้เป็นคราวๆไปกับผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

5. เหตุขัดข้อง

กรณีที่มีเหตุการณ์ที่มีได้คาดการณ์ล่วงหน้า หรือ เหตุขัดข้องที่ทำให้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่สามารถชำระราคาหรือส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นได้ เช่น

- (1) เกิดสงครามหรือจลาจลในประเทศหรือต่างประเทศ หรือเหตุอื่นใดที่มีผลทำให้ไม่สามารถซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ตามปกติ
- (2) ตลาดหลักทรัพย์ฯ สั่งพักการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงไม่ว่าด้วยเหตุใดๆ
- (3) มีข้อกำหนดตามกฎหมาย หรือคำสั่งของหน่วยงานที่เกี่ยวข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงจนทำให้ไม่สามารถหาราคาอ้างอิงได้
- (4) เหตุการณ์อื่นๆ ที่อาจเกิดขึ้นที่ไม่ได้กล่าวถึงในที่นี้ ที่มีผลทำให้ไม่สามารถหาราคาอ้างอิงของหลักทรัพย์อ้างอิงได้ในวันกำหนดราคาหลักทรัพย์

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในส่วนของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ลงทุนจึงควรศึกษาข้อมูลทั้งหมดให้ครบถ้วนก่อนการลงทุน

6. ภาวะภาษีที่เกี่ยวข้อง

ข้อมูลในส่วนนี้เป็นเพียงแนวทางเกี่ยวกับภาษีตามกฎหมายไทยในปัจจุบันในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเท่านั้นไม่ใช่คำแนะนำเกี่ยวกับภาษีและไม่ได้มีความมุ่งหมายที่จะให้เป็นข้อมูลครบถ้วนสมบูรณ์ถึงภาวะภาษีอากรที่เกี่ยวข้องกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด ผู้ที่ประสงค์จะลงทุนควรหารือกับที่ปรึกษาของตนเกี่ยวกับภาวะทางภาษีที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อเสียภาษีเงินได้ของตน รวมถึง (แต่ไม่จำกัดเฉพาะ) ผลทางกฎหมายในเรื่องภาษีท้องถิ่นหรือภาษีต่างประเทศใดๆ

ข้อมูลในส่วนนี้ทำขึ้นบนพื้นฐานกฎหมายภาษีของประเทศไทยโดยทั่วไปที่ใช้บังคับอยู่ ณ วันที่มีการจัดทำเอกสารนี้ ซึ่งอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้

ภาวะภาษีของผู้ที่ประสงค์จะลงทุนและอัตราภาษีที่เกี่ยวข้องขึ้นอยู่กับองค์ประกอบหลายประการ เช่น ผู้ลงทุนเป็นนิติบุคคลที่ไม่มีหน้าที่ต้องเสียภาษีเงินได้หรือไม่ ผู้ลงทุนเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ภายในประเทศที่ได้ลงนามในอนุสัญญาว่าด้วยภาษีซ้อนกับประเทศไทยหรือไม่

ข้อมูลในส่วนนี้มิได้มีวัตถุประสงค์ให้มีรายละเอียดครอบคลุมถึงประเด็นต่างๆ เกี่ยวข้องกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด

6.1 ภาษีเงินได้

6.1.1 กรณีที่ผู้ลงทุนเป็นผู้มีถิ่นที่อยู่ในประเทศไทย

กรณีผู้ลงทุนเป็นบุคคลธรรมดา

(1) ดอกเบี้ย

ดอกเบี้ยซึ่งผู้ลงทุนได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 15 (สิบห้า)

(2) ผลประโยชน์ที่ได้รับ (คือ เงินคืนเฉพาะส่วนที่เป็นผลกำไรที่ผู้ลงทุนได้รับเมื่อครบอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือมูลค่าของหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเฉพาะส่วนที่เป็นผลกำไรเมื่อเทียบกับเงินลงทุนที่ผู้ลงทุนได้รับเมื่อครบอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง)

ผลประโยชน์ที่ได้รับจะถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 15 (สิบห้า) อย่างไรก็ตาม ในกรณีที่ผู้ลงทุนได้รับผลขาดทุนเมื่อครบกำหนดอายุ ผู้ลงทุนไม่มีหน้าที่ต้องเสียภาษีเงินได้แต่อย่างใด

(3) ผลประโยชน์จากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ผลประโยชน์ที่ได้จากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเฉพาะส่วนที่ตีราคาเป็นเงินได้เกินกว่าที่ลงทุนจะถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 15 (สิบห้า)

อย่างไรก็ตาม ผู้ลงทุนมีสิทธิที่จะเลือกเสียภาษีในอัตราดังกล่าวที่ถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายไว้ตาม (1), (2) หรือ (3) ข้างต้น โดยไม่ต้องนำดอกเบี้ยหรือผลประโยชน์ที่ได้รับหรือผลประโยชน์ที่ได้รับจากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ไปรวมกับเงินได้อื่นเพื่อคำนวณภาษีเงินได้บุคคลธรรมดาซึ่งมีอัตราก้าวหน้าสูงสุดไม่เกินร้อยละ 35 (สามสิบห้า) โดยหากผู้ลงทุนเลือกที่จะนำดอกเบี้ยหรือผลประโยชน์ที่ได้รับหรือผลประโยชน์จากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว ไปรวมกับเงินได้อื่นเพื่อคำนวณภาษีเงินได้บุคคลธรรมดานั้น ผู้ลงทุนสามารถนำภาษีหัก ณ ที่จ่ายข้างต้นมาเป็นเครดิตในการคำนวณภาษีเงินได้บุคคลธรรมดาได้

กรณีผู้ลงทุนเป็นบริษัทหรือห้างหุ้นส่วนนิติบุคคล

ในกรณีที่ผู้ลงทุนเป็นบริษัทหรือห้างหุ้นส่วนนิติบุคคลซึ่งจดทะเบียนจัดตั้งขึ้นตามกฎหมายไทยหรือเป็นบริษัทห้างหุ้นส่วนนิติบุคคลที่จดทะเบียนจัดตั้งขึ้นตามกฎหมายต่างประเทศ แต่ประกอบกิจการในประเทศไทย หรือเป็นมูลนิธิหรือสมาคมที่ประกอบกิจการซึ่งมีรายได้ แต่ไม่รวมถึงมูลนิธิหรือสมาคมที่กระทรวงการคลังประกาศกำหนดให้เป็นองค์กร หรือสถานสาธารณกุศลตามมาตรา 47 (7) (ข) แห่งประมวลรัษฎากร ผู้ลงทุนจะมีภาระภาษีดังต่อไปนี้

(1) ดอกเบี้ย

ดอกเบี้ยที่ผู้ลงทุนประเภทบริษัทหรือห้างหุ้นส่วนนิติบุคคล แต่ไม่รวมถึง ธนาคาร บริษัทเงินทุน บริษัทหลักทรัพย์ หรือบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ได้รับจะต้องถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 1 (หนึ่ง) และผู้ลงทุนจะต้องนำดอกเบี้ยจากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวไปรวมกับรายได้อื่นของผู้ลงทุนเพื่อคำนวณภาษีเงินได้นิติบุคคล โดยสามารถนำภาษีหัก ณ ที่จ่าย ข้างต้นมาเป็นเครดิตในการคำนวณภาษีเงินได้นิติบุคคล

ดอกเบี้ยที่ผู้ลงทุนประเภทมูลนิธิหรือสมาคมที่ไม่ใช่องค์กรหรือสถานสาธารณกุศลตามมาตรา 47 (7) (ข) แห่งประมวลรัษฎากร ได้รับจะต้องถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 10 (สิบ) ดอกเบี้ยที่ผู้ลงทุนประเภทธนาคาร บริษัทเงินทุน บริษัทหลักทรัพย์ หรือบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ได้รับไม่ต้องถูกหักภาษี ณ ที่จ่าย แต่ผู้ลงทุนจะต้องนำดอกเบี้ยจากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวไปรวมกับรายได้อื่นของผู้ลงทุนเพื่อคำนวณภาษีเงินได้นิติบุคคล

- (2) ผลประโยชน์ที่ได้รับ (คือ เงินคืนเฉพาะส่วนที่เป็นผลกำไรที่ผู้ลงทุนได้รับเมื่อครบอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือมูลค่าของหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเฉพาะส่วนที่เป็นผลกำไรเมื่อเทียบกับเงินลงทุนที่ผู้ลงทุนได้รับเมื่อครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง)

ผลประโยชน์ที่ได้รับโดยผู้ลงทุนประเภทบริษัทหรือห้างหุ้นส่วนนิติบุคคล แต่ไม่รวมถึงธนาคาร บริษัทเงินทุน บริษัทหลักทรัพย์ หรือบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ได้รับจะต้องถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 1 (หนึ่ง) และผู้ลงทุนจะต้องนำผลประโยชน์ที่ได้รับดังกล่าวไปรวมกับรายได้อื่นของผู้ลงทุนเพื่อคำนวณเป็นรายได้อื่นของผู้ลงทุนเพื่อคำนวณเป็นรายได้เพื่อเสียภาษีเงินได้นิติบุคคล โดยสามารถนำภาษีหัก ณ ที่จ่ายข้างต้นมาเป็นเครดิตในการคำนวณภาษีเงินได้นิติบุคคล

ผลประโยชน์ที่ได้รับโดยผู้ลงทุนประเภทมูลนิธิหรือสมาคมที่ไม่ใช่องค์กรหรือสถานสาธารณกุศลได้รับจะต้องถูกหัก ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 10 (สิบ)

ผลประโยชน์ที่ได้รับโดยเป็นผู้ลงทุนประเภทธนาคาร บริษัทเงินทุน บริษัทหลักทรัพย์ หรือบริษัทเครดิตฟองซิเอร์ ได้รับไม่ต้องถูกหักภาษี ณ ที่จ่าย แต่ผู้ลงทุนจะต้องนำผลประโยชน์ที่ได้รับจากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวไปรวมกับรายได้อื่นของผู้ลงทุนเพื่อคำนวณภาษีเงินได้นิติบุคคล

- (3) ผลประโยชน์จากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ผลประโยชน์จากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ลงทุนได้รับเฉพาะส่วนที่ตีราคาเป็นเงินได้เกินกว่าที่ลงทุนไม่ต้องถูกหักภาษี ณ ที่จ่าย แต่ผู้ลงทุนจะต้องนำผลประโยชน์จากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวไปรวมกับรายได้อื่นของผู้ลงทุนเพื่อคำนวณภาษีเงินได้นิติบุคคล

6.1.2 กรณีที่ผู้ลงทุนเป็นผู้ไม่มีถิ่นที่อยู่ในประเทศไทย

กรณีผู้ลงทุนเป็นบุคคลธรรมดา

- (1) ดอกเบี้ย

เว้นแต่ข้อกำหนดและเงื่อนไขในอนุสัญญาภาษีซ้อนที่ทำขึ้นระหว่างประเทศไทยกับประเทศที่ผู้ลงทุนมีถิ่นที่อยู่จะกำหนดไว้เป็นอย่างอื่น ดอกเบี้ยซึ่งผู้ลงทุนได้รับจะถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 15 (สิบห้า)

- (2) ผลประโยชน์ที่ได้รับ (คือ เงินคืนเฉพาะส่วนที่เป็นผลกำไรที่ผู้ลงทุนได้รับเมื่อครบอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือมูลค่าของหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเฉพาะส่วนที่เป็นผลกำไรเมื่อเทียบกับเงินลงทุนที่ผู้ลงทุนได้รับเมื่อครบอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง)

เว้นแต่ข้อกำหนดและเงื่อนไขในอนุสัญญาภาษีซ้อนที่ทำขึ้นระหว่างประเทศไทยกับประเทศที่ผู้ลงทุนมีถิ่นที่อยู่จะกำหนดไว้เป็นอย่างอื่น ผลประโยชน์ที่ได้รับจะถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 15 (สิบห้า)

อย่างไรก็ตาม ในกรณีที่ผู้ลงทุนได้รับผลขาดทุนเมื่อครบกำหนดอายุ ผู้ลงทุนไม่มีหน้าที่ต้องเสียภาษีเงินได้แต่อย่างใด

(3) ผลประโยชน์จากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

เว้นแต่ข้อกำหนดและเงื่อนไขในอนุสัญญาภาษีซ้อนที่ทำขึ้นระหว่างประเทศไทยกับประเทศที่ผู้ลงทุนมีถิ่นที่อยู่จะกำหนดไว้เป็นอย่างอื่น ผลประโยชน์จากการโอนหุ้นกู้เฉพาะส่วนที่ตราค่าเงินได้เกินกว่าที่ลงทุน จะถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 15 (สิบห้า)

กรณีผู้ลงทุนเป็นบริษัทหรือห้างหุ้นส่วนนิติบุคคล

กรณีที่ผู้ลงทุนเป็นบริษัทหรือห้างหุ้นส่วนนิติบุคคลซึ่งจดทะเบียนจัดตั้งขึ้นตามกฎหมายของต่างประเทศและมีได้ประกอบกิจการหรือถือว่าประกอบกิจการในประเทศไทย แต่ได้รับดอกเบี้ยผลประโยชน์ที่ได้รับ หรือผลประโยชน์จากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งจ่ายจากหรือในประเทศไทย ผู้ลงทุนจะมีภาระภาษีดังนี้

(1) ดอกเบี้ย

เว้นแต่ข้อกำหนดและเงื่อนไขในอนุสัญญาภาษีซ้อนที่ทำขึ้นระหว่างประเทศไทยกับประเทศที่ผู้ลงทุนมีถิ่นที่อยู่จะกำหนดไว้เป็นอย่างอื่น ดอกเบี้ยที่ผู้ลงทุนได้รับจะต้องถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 15 (สิบห้า)

(2) ผลประโยชน์ที่ได้รับ (คือ เงินคืนเฉพาะส่วนที่เป็นผลกำไรที่ผู้ลงทุนได้รับเมื่อครบอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือมูลค่าของหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเฉพาะส่วนที่เป็นผลกำไรเมื่อเทียบกับเงินลงทุนที่ผู้ลงทุนได้รับเมื่อครบอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง)

เว้นแต่ข้อกำหนดและเงื่อนไขในอนุสัญญาภาษีซ้อนที่ทำขึ้นระหว่างประเทศไทยกับประเทศที่ผู้ลงทุนมีถิ่นที่อยู่จะกำหนดไว้เป็นอย่างอื่น ผลประโยชน์ที่ได้รับจะถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 15 (สิบห้า)

(3) ผลประโยชน์จากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

เว้นแต่ข้อกำหนดและเงื่อนไขในอนุสัญญาภาษีซ้อนที่ทำขึ้นระหว่างประเทศไทยกับประเทศที่ผู้ลงทุนมีถิ่นที่อยู่จะกำหนดไว้เป็นอย่างอื่น ผลประโยชน์จากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเฉพาะส่วนที่ตราค่าเป็นเงินได้เกินกว่าที่ลงทุนจะต้องถูกหักภาษี ณ ที่จ่ายในอัตราร้อยละ 15 (สิบห้า)

6.2 ภาษีธุรกิจเฉพาะ

ผู้ลงทุนอาจต้องเสียภาษีธุรกิจเฉพาะในอัตราร้อยละ 3.3 (สามจุดสาม) (บวกด้วยภาษีบำรุงท้องที่ในอัตราร้อยละ 10 (สิบ) ของภาษีธุรกิจเฉพาะดังกล่าว) จากยอดดอกเบี้ยรับจากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือกำไรก่อนหักภาษี ณ ที่จ่ายใดๆ จากผลประโยชน์ที่ได้รับ หากดอกเบี้ยหรือกำไรดังกล่าวที่ได้รับถือเป็นรายรับจากการประกอบธุรกิจโดยปกติเยี่ยงธนาคารตามกฎหมาย

ว่าด้วยการธนาคารพาณิชย์หรือกฎหมายเฉพาะการประกอบกิจการธุรกิจเงินทุน ธุรกิจหลักทรัพย์ ธุรกิจเครดิตฟองซิเอร์ ตามกฎหมายว่าด้วยการประกอบธุรกิจเงินทุน ธุรกิจหลักทรัพย์ และธุรกิจเครดิตฟองซิเอร์ และการประกอบกิจการโดยปกติเยี่ยงธนาคารพาณิชย์ของผู้ลงทุนในประเทศไทย โดยอาจมีสิทธิได้รับการลดหย่อนอัตราภาษีธุรกิจเฉพาะลงเหลือร้อยละ 0.11(ศูนย์จุดหนึ่งหนึ่ง) ตามข้อกำหนดและเงื่อนไขของพระราชกฤษฎีกา ฉบับที่ 469/2551

6.3 อาการแสดมภ์

การออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ทรงตราสารต้องชำระค่าอาการแสดมภ์ 5 บาท การโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับยกเว้นอาการแสดมภ์

ทั้งนี้ หลักการเกี่ยวกับภาษีดังกล่าวข้างต้นอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงแก้ไขกฎหมาย

7. วิธีการ เวลา และสถานที่สำหรับการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะได้รับการไถ่ถอน โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นอนุพันธ์แฝงแต่ละฉบับ หรือวันอื่นใดหากเป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทที่มีเงื่อนไขให้ไถ่ถอนก่อนวันครบกำหนดได้ โดยสามารถไถ่ถอนโดยการชำระด้วยเงิน หรือการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบให้แก่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงตามข้อกำหนดและเงื่อนไขที่ระบุในข้อกำหนดสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง รวมถึงข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละฉบับ ในวันและเวลาทำการของบริษัท และสถานที่ที่ตกลงกันระหว่างผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

8. ตัวแทนการชำระเงิน (Paying Agent)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นผู้ทำหน้าที่ดังกล่าว

เอกสารแนบ 1

**ข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
สำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น**

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

มูลค่าเสนอขายรวมไม่เกิน 300 ล้านบาท

วันที่ [●]

ข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้ (“ข้อกำหนดสิทธิ”) กำหนดหลักเกณฑ์และเงื่อนไขทั่วไปที่ใช้บังคับกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) (“ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง”) ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะออกเป็นรุ่น (ตามที่นิยามไว้ข้างท้ายนี้) โดยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกในแต่ละรุ่นจะมีการระบุข้อกำหนดและเงื่อนไขเพิ่มเติมอื่นๆที่เกี่ยวข้องกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรุ่นไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคา (ตามที่นิยามไว้ข้างท้ายนี้) สำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงรุ่นนั้นๆ โดยให้ถือว่าข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาเป็นข้อกำหนดและเงื่อนไขเพิ่มเติมของข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้ ในกรณีที่มีข้อความขัดแย้งกันระหว่างข้อความใดๆ ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคากับข้อความใดๆ ในข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้ ให้ใช้ข้อความในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาเป็นหลัก ทั้งนี้ หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรุ่นจะได้รับสิทธิและประโยชน์จากสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ตามที่นิยามไว้ข้างท้ายนี้) อีกด้วย

การออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ได้รับอนุมัติจากมติของที่ประชุมสามัญผู้ถือหุ้นประจำปี 2564 ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) เมื่อวันที่ 30 เมษายน 2564 และมติที่ประชุมคณะกรรมการของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 9/2566 เมื่อวันที่ 19 กันยายน 2564

สิทธิในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องผูกพันตามข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องทุกประการ และให้ถือว่าผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับทราบและเข้าใจข้อกำหนดต่างๆในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องเป็นอย่างดีแล้ว ทั้งนี้ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดให้มีการเก็บรักษาสำเนาข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องไว้ ณ สำนักงานใหญ่ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เพื่อให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอตรวจสอบสำเนาเอกสารต่างๆ ดังกล่าวได้ในวันและเวลาทำการของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

1. คำจำกัดความ

1.1 ในข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้

กฎหมาย	:	หมายถึง รัฐธรรมนูญ กฎหมาย (รวมถึงกฎหมายจารีตประเพณี) สนธิสัญญา ระเบียบข้อบังคับ ประกาศ คำสั่ง คำสั่งคุ้มครองชั่วคราว หมายศาล คำสั่งศาล คำพิพากษาศาล หรือคำชี้ขาดของหน่วยงานราชการใดๆ รวมถึงกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาด
--------	---	---

		หลักทรัพย์ ประกาศของคณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศของคณะกรรมการกำกับตลาดทุน หรือประกาศของสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต.
กองทุนรวมอีทีเอฟ (Exchange Traded Fund)	:	หมายถึง กองทุนรวมเปิดที่โดยทั่วไปบริษัทจัดการกองทุนรวมจะขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนกับผู้ลงทุนรายใหญ่ และจัดให้มีตลาดรอง (Organized Market) สำหรับการซื้อขายหน่วยลงทุนของผู้ลงทุนใดๆ ทั้งนี้ ตามประกาศของสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการจัดตั้งกองทุนรวมและการเข้าทำสัญญารับจัดการกองทุนส่วนบุคคล
ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคา	:	หมายถึง ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่ใช้บังคับกับหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรุ่น ซึ่งถือเป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงและอยู่ในรูปแบบและสาระสำคัญที่กำหนดไว้ในเอกสารแนบท้าย 3 ของข้อกำหนดสิทธิ ซึ่งถือว่าเป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้
ข้อกำหนดสิทธิ	:	หมายถึง ข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้
คณะกรรมการ ก.ล.ต.	:	หมายถึง คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
โครงการหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง โครงการหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566
นายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) หรือผู้ได้รับแต่งตั้งโดยชอบให้ทำหน้าที่เป็นนายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงแทน (ถ้ามี) ทั้งนี้ ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย	:	หมายถึง ดัชนีหลักทรัพย์ SET Index, SET50 Index, SET100 Index รวมถึงดัชนีอื่นๆ ที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเป็นผู้คำนวณและจัดทำ
ดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง	:	หมายถึง ดัชนีหลักทรัพย์ที่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงกำหนดให้ใช้ระดับของดัชนีนั้น เป็นฐานในการคำนวณจำนวนเงินที่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงมีสิทธิจะได้รับ
บาท	:	หมายถึง เงินบาทไทยซึ่งเป็นสกุลเงินตามกฎหมายของราชอาณาจักรไทย
ใบหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง ใบหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกโดยนายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (ตามรูปแบบและสาระสำคัญที่กำหนดไว้ในเอกสารแนบท้าย 1 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้) เพื่อแสดงสิทธิในหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรายและจำนวนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงรายนั้นๆ ถืออยู่
บุคคล	:	หมายถึง บุคคลธรรมดา บริษัท ห้างหุ้นส่วน กิจการร่วมค้า สมาคม บริษัทร่วมหุ้น กองมรดก บริษัทจำกัด องค์กรที่มีได้ก่อตั้งในรูปแบบของบริษัท หรือนิติบุคคลอื่นใด
ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 16/2565	:	หมายถึง ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ.16/2565 เรื่อง การขออนุญาตและการอนุญาตให้เสนอขายตราสารหนี้ที่ออกใหม่ต่อบุคคลในวงจำกัด และการเสนอขายหุ้นกู้แปลงสภาพต่อบุคคลที่มีลักษณะเฉพาะ (รวมทั้งที่มีการแก้ไข เปลี่ยนแปลงเพิ่มเติม หรือแทนที่เป็นครั้งคราว)
ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง ผู้ทรงสิทธิในหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงตามข้อ 3.3 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้
ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง	:	หมายถึง ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง
ระยะเวลาที่ยังไม่มีการเปลี่ยนแปลงสิทธิในทางทะเบียน	:	หมายถึง ระยะเวลาที่ผู้ทรงสิทธิเดิมในหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งได้ออนสิทธิในหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไปยังผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้องแล้ว แต่ยังคงมีชื่ออยู่ในสมุดทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ในฐานะผู้ทรงสิทธิในหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงและในบรรดาสิทธิเรียกร้องทั้งหลายซึ่งเป็นส่วนหนึ่งของจำนวนทรัพย์สิน (Asset Amount) อยู่

วันครบกำหนดไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง วันที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องว่าเป็นวันครบกำหนดไถ่ถอนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง (เว้นแต่ได้มีการไถ่ถอน หรือซื้อคืนหรือยกเลิกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแล้วก่อนวันครบกำหนดไถ่ถอนดังกล่าว)
วันชำระคืนเงินต้น	:	หมายถึง วันแต่ละวันที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องว่าเป็นวันชำระคืนเงินต้น
วันชำระเงิน	:	หมายถึง วันครบกำหนดไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง วันชำระคืนเงินต้น และ/หรือวันชำระคืนเงินจำนวนใดๆ ที่ถูกกำหนดให้ต้องชำระในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
วันทำการ	:	หมายถึง วันทำการในประเทศไทย และ/หรือ วันที่ธนาคารพาณิชย์และตลาดสำหรับการปริวรรตเงินตราต่างประเทศโดยทั่วไปเปิดทำการในประเทศที่เป็นศูนย์กลางเกี่ยวกับธุรกรรมทางการเงิน (Additional Business Centre) ซึ่งมีใช้วันเสาร์หรืออาทิตย์ และ/หรือ วันทำการอื่นใดตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง (ตามแต่กรณี)
วันทำการในประเทศไทย	:	หมายถึง วันที่ธนาคารพาณิชย์โดยทั่วไปเปิดทำการในกรุงเทพมหานคร ประเทศไทยซึ่งมิใช่วันเสาร์หรืออาทิตย์ หรือมิใช่วันที่ธนาคารแห่งประเทศไทยประกาศกำหนดเป็นวันหยุด
วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง วันที่ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
สถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ	:	หมายถึง สถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. และตามที่ได้กำหนดไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
สมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง สมุดทะเบียนหรือแหล่งข้อมูลทางทะเบียนซึ่งบันทึกรายละเอียดและที่อยู่ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตลอดจนรายละเอียดเกี่ยวกับการโอน การจำนำ การอายัด การออกใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงใหม่ และรายการอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ประกาศของคณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศของคณะกรรมการกำกับตลาดทุน หรือ ประกาศของสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่เกี่ยวข้อง
สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ทำขึ้น หรือที่จะได้ทำระหว่างผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงกับนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตามที่ระบุในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต.	:	หมายถึง สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
สิทธิในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง สิทธิทั้งปวงในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง รวมถึง (แต่ไม่จำกัดเพียง) สิทธิในการได้รับชำระคืนเงินต้นและดอกเบี้ย (ถ้ามี) และสิทธิในการเข้าประชุมและออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
หลักทรัพย์อ้างอิง	:	หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งต้องเป็นกรณีใดกรณีหนึ่งดังต่อไปนี้ <ol style="list-style-type: none"> (1) หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 หรือ (2) ตะกร้าหลักทรัพย์ (Basket Securities) ซึ่งประกอบด้วยหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET 100 หรือ (3) ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย หรือ (4) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ ที่จดทะเบียนและซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง

		ทั้งนี้ ข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับปัจจัยอ้างอิง เช่น ผลการดำเนินงานย้อนหลังของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง ผู้ลงทุนสามารถดูได้ที่ www.set.or.th หรือ สอบถามได้จากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
หน่วยงานราชการ	:	หมายถึง ศาล คณะกรรมการ หน่วยงาน องค์กร สำนักงาน กระทรวง ทบวง กรม กอง ต่างๆของทางราชการทั้งที่มีอยู่แล้วในปัจจุบันและที่จะมีขึ้นในอนาคต
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Structured Note)	:	หมายถึง หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรุ่นที่ออกโดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งมีรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
เหตุผิดนัด	:	ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อ 10
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทมีอัตราดอกเบี้ย	:	หมายถึง หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกโดยมีดอกเบี้ยหรือผลตอบแทน ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทไม่มีอัตราดอกเบี้ย	:	หมายถึง หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่อาจออกโดยมีส่วนลดหรือไม่มีดอกเบี้ย ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
อัตราดอกเบี้ยผิดนัด	:	หมายถึง อัตราดอกเบี้ยผิดนัดในกรณีที่ลูกค้าไม่ชำระราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามเวลาที่กำหนดตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
เอกสารหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	:	หมายถึง <ul style="list-style-type: none"> (ก) สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ข) ใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ค) ข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ (ง) ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคา และ (จ) เอกสารอื่นใดที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะกำหนดให้เป็นเอกสารหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

1.2 การตีความ

- (ก) เว้นแต่จะระบุไว้เป็นอย่างอื่น ในกรณีที่ข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้หรือเอกสารหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีการตีความดังต่อไปนี้
- 1) การอ้างอิงถึงเอกสารหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับใดๆ ให้หมายความรวมถึงเอกสารหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับแก้ไขเพิ่มเติม หรือปรับปรุงใดๆ ซึ่งจะได้จัดทำขึ้นเป็นครั้งคราว และมีผลบังคับใช้ตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้
 - 2) การอ้างอิงถึงคำนิยามใดๆ ให้คำนิยามนั้นมีมีความหมายตามคำจำกัดความที่ได้กำหนดไว้ในเอกสารหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้
 - 3) อ้างถึงบุคคลใดบุคคลหนึ่งให้หมายความรวมถึง (ก) ผู้สืบทอด และ (ข) ผู้รับโอนของบุคคลดังกล่าวตามที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ และ
- (ข) เว้นแต่จะระบุไว้เป็นอย่างอื่น ข้อความที่กล่าวถึง “เวลา” หมายถึง เวลาในกรุงเทพฯ
- (ค) เว้นแต่จะระบุไว้เป็นอย่างอื่น การอ้างอิงถึงข้อกำหนดข้อใดข้อหนึ่ง หรือเอกสารแนบท้ายฉบับใดฉบับหนึ่ง ให้หมายถึงข้อกำหนดข้อใดข้อหนึ่งในข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ หรือเอกสารแนบท้ายฉบับใดฉบับหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ ทั้งนี้ เอกสารแนบท้ายใดๆ ถือเป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้
- (ง) เว้นแต่จะระบุไว้เป็นอย่างอื่น ข้อความที่กล่าวถึง “เดือน” หมายถึง “เดือนปฏิทิน”
- (จ) หัวข้อของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้มีไว้เพื่อประโยชน์ในการอ้างอิงเท่านั้น

2. ชนิดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

- (ก) หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ชนิดระบุชื่อผู้ถือ ประเภทไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีหลักประกัน และไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ และมีรายละเอียดต่างๆ ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้และข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคา
- (ข) อายุ มูลค่าเงินต้นรวม จำนวนหน่วย และรายละเอียดอื่น ๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้เป็นไปตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงชุดนั้นๆ

3. ใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง สมุดทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และผู้ทรงสิทธิในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

3.1 ใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หากผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประสงค์ที่จะรับใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการให้นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงออกและส่งมอบใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไปให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทุกราย ตามข้อบังคับต่างๆ ที่เกี่ยวข้องภายใน 15 (สิบห้า) วันทำการ นับแต่วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการจัดส่งทางไปรษณีย์ลงทะเบียน หรือวิธีการอื่นใดที่กำหนดโดยผู้ออก หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

3.2 สมุดทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและการปิดสมุดทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

- (ก) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต้องดำเนินการให้นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีหน้าที่ตามสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่จะต้องจัดทำและเก็บรักษาสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไว้จนกว่าหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดได้รับการไถ่ถอนครบถ้วนตามข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้และข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง
- (ข) สมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะปิดในเวลาเที่ยงวันของวันที่ 14 (สิบสี่) ก่อนหน้าวันชำระดอกเบี้ย วันครบกำหนดไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง วันชำระคืนเงินต้น วันที่กำหนดสำหรับการประชุมผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือวันอื่นเพื่อวัตถุประสงค์อื่นใดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและตามผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแจ้งต่อนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ตามแต่กรณี) ทั้งนี้ วันแรกของระยะเวลาการปิดสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวให้เรียกว่า “วันปิดสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง” หากวันปิดสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตรงกับวันทำการที่มีวันหยุดราชการในประเทศไทย สมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะปิดในวันทำการในประเทศไทยถัดไป และในกรณีดังกล่าวจะทำให้ระยะเวลาระหว่างวันปิดสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และวันชำระดอกเบี้ย วันครบกำหนดไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง วันชำระคืนเงินต้น วันที่กำหนดสำหรับการประชุมผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือวันอื่นเพื่อวัตถุประสงค์อื่นใดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ตามแต่กรณี) เหลือน้อยกว่า 14 (สิบสี่) วัน โดยนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่จำเป็นต้องลงทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในระหว่างระยะเวลาที่ปิดสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสงวนสิทธิที่จะเปลี่ยนแปลงวันและเวลาปิดสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยไม่จำเป็นต้องได้รับความยินยอมจากผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือจากที่ประชุมผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง แต่การเปลี่ยนแปลงดังกล่าวต้องเป็นไปตามกฎระเบียบและข้อบังคับของหน่วยงานต่างๆที่เกี่ยวข้อง และไม่ผิดกฎหมายอย่างร้ายแรงต่อสิทธิและผลประโยชน์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการแจ้งให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทราบหากมีการเปลี่ยนแปลงดังกล่าว

3.3 ผู้ทรงสิทธิในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

สิทธิในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะตกแก่บุคคลที่ปรากฏชื่อเป็นเจ้าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจำนวนดังกล่าวตามที่ระบุอยู่ในสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ณ เวลาเที่ยงวันของวันปิดสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เว้นแต่จะมีการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งสามารถยืนยันกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ตามข้อ 4.1 (ก) - (ค) เกิดขึ้นแล้วก่อนหน้าวันปิดสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งสิทธิในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในกรณีดังกล่าวย่อมตกแก่ผู้รับโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

4. การโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

4.1 การโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

- (ก) การโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะสมบูรณ์เมื่อผู้โอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งเป็นผู้ที่สมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระบุชื่อว่าเป็นเจ้าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจำนวนที่จะทำการโอน หรือผู้รับโอนคนสุดท้าย โดยมีการสลักหลังแสดงการโอนต่อเบื้องหน้าจากผู้ที่ปรากฏชื่อดังกล่าวตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ (แล้วแต่กรณี) ได้ส่งมอบใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้รับโอน โดยลงลายมือชื่อสลักหลังแสดงการโอนให้ไว้ด้วย
- (ข) การโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะยืนยันกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ก็ต่อเมื่อนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงรับคำขอลงทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงพร้อมทั้งใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้รับโอนได้ลงลายมือชื่อเป็นผู้รับโอนในด้านหลังของใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นครบถ้วนแล้ว

- (ค) การโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงใช้ยันกับบุคคลภายนอกได้ก็ต่อเมื่อได้มีการลงทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเรียบร้อยแล้ว
- (ง) การลงทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องกระทำ ณ สำนักงานใหญ่ของนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันและเวลาทำการของนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และจะต้องทำตามแบบและวิธีการที่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงกำหนด โดยผู้ลงทะเบียนจะต้องส่งมอบเอกสารดังต่อไปนี้ให้แก่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 - 1) คำขอลงทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง พร้อมกับใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ลงลายมือชื่อและสลักหลังแสดงการโอนครบถ้วนตามหลักเกณฑ์ในข้อ 4.1 (ก) และ 4.1 (ข)
 - 2) หลักฐานอื่น ๆ ที่ยืนยันถึงความถูกต้องและความสมบูรณ์ของการโอนและการรับโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามที่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงกำหนด
- (จ) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการให้นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงลงทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใน 7 (เจ็ด) วันทำการในประเทศไทย หลังจากวันที่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับเอกสารตามที่ระบุไว้ในข้อ 4.1 (ง) ครบถ้วนเรียบร้อยแล้ว
- (ด) นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของสวสนสิทธิที่จะปฏิเสธการลงทะเบียนโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงใดๆ ซึ่งมีได้เป็นไปตามข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ หรือบทบัญญัติแห่งกฎหมาย

4.2 ค่าธรรมเนียมการโอน

ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีภาระที่จะต้องชำระค่าธรรมเนียม หรือค่าใช้จ่ายใดๆ ในการดำเนินการจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามขั้นตอนที่ระบุข้างต้น อย่างไรก็ตาม ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีหน้าที่ชำระค่าภาษีอากรแสมตบ หรือค่าธรรมเนียมอื่นๆ ที่ทางราชการอาจกำหนดเรียกเก็บจากการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น หรือนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจกำหนดให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้คำยืนยันว่าจะชดใช้ค่าภาษี อากรแสมตบ หรือค่าธรรมเนียมราชการดังกล่าวที่อาจเกิดขึ้นให้แก่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในภายหลังได้

4.3 ข้อบังคับเกี่ยวกับการโอน

การโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและการลงรายการต่างๆ ในสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทุกครั้ง จะต้องปฏิบัติตามขั้นตอนวิธีการที่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงกำหนด รวมถึงกฎหมายที่เกี่ยวข้องทั้งปวง นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดส่งสำเนาของขั้นตอน วิธีการในการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตลอดจนกฎหมายดังกล่าวให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยทางไปรษณีย์หรือวิธีปฏิบัติอื่นเมื่อได้รับการร้องขอโดยไม่คิดค่าบริการแต่อย่างใด

4.4 ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือข้อจำกัดการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ระยะสั้น เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปลี่ยนมือไม่ได้หรือโอนเปลี่ยนมือได้โดยจำกัด ทั้งนี้ ตามรายละเอียดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง

5. สถานะทางกฎหมายของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ภายใต้ข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ และข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหนี้โดยตรงของผู้ออกหุ้นกู้ ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ปราศจากเงื่อนไข ไม่ด้อยสิทธิ และไม่มีประกัน ตลอดอายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทุกรายมีสถานะเป็นเจ้าของในลำดับเดียวกันและเป็นเจ้าหนี้ในลำดับเดียวกับเจ้าหนี้ไม่มีประกันและไม่ด้อยสิทธิรายอื่นๆ ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งที่มีอยู่ในปัจจุบันและที่จะมีขึ้นในอนาคต เว้นแต่บรรดาหนี้ที่มีบุริมสิทธิโดยผลของกฎหมาย

6. หน้าที่ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

6.1 ข้อปฏิบัติของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ตลอดระยะเวลาที่ยังคงมีภาระผูกพันภายใต้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการดังต่อไปนี้

6.1.1 การจัดเตรียมเอกสารแก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดส่งเอกสารให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเมื่อมีเหตุการณ์ดังต่อไปนี้เกิดขึ้น

- (ก) หากมีเหตุผิดนัดใดๆ (ตามที่กำหนดในข้อ 10.1) หรือเหตุการณ์ที่อาจกลายเป็นเหตุผิดนัด (หมายถึง เหตุการณ์ที่จะกลายเป็นเหตุผิดนัด หากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่สามารถแก้ไขเหตุการณ์ที่เกิดขึ้นได้ภายในระยะเวลาที่กำหนดไว้ในข้อ 10.1 (ก) หรือ 10.1 (ข) (ตามแต่กรณี)) หรือกรณีที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงถูกฟ้องเป็นจำเลยในศาล หรือถูกกล่าวหาให้ต้องเป็นฝ่ายรับผิดชอบตามสัญญาใดๆ ที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นคู่สัญญาในกรณีที่อยู่ภายใต้ตุลาการ จะต้องวินิจฉัย ซึ่งหากศาลมีคำพิพากษาเสร็จเด็ดขาดและถึงที่สุด หรืออนุญาโตตุลาการมีคำชี้ขาดถึงที่สุด จะก่อให้เกิดผลกระทบอย่างร้ายแรงต่อความสามารถในการชำระหนี้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องแจ้งให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงทราบโดยไม่ชักช้า นับแต่วันที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ทราบถึงเหตุการณ์ดังกล่าว รวมทั้งแจ้งถึงการกระทำใดๆ ที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ดำเนินการหรือเสนอที่จะดำเนินการเพื่อแก้ไขเหตุการณ์ดังกล่าวด้วย
- (ข) เมื่อที่ประชุมผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีมติร้องขอต่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องส่งมอบเอกสารซึ่งลงนามโดยกรรมการผู้มีอำนาจลงนาม (หรือบุคคลผู้ได้รับมอบอำนาจจากกรรมการผู้มีอำนาจ) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ระบุถึงเหตุผิดนัดหรือเหตุการณ์ที่อาจกลายเป็นเหตุผิดนัดที่เกิดขึ้น และ/หรือ มีคดีความหรือการพิจารณาอนุญาโตตุลาการที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นจำเลยหรือผู้ถูกกล่าวหาที่มีลักษณะตามข้อ 6.1.1 (ก) (ยกเว้นกรณีที่ได้แจ้งให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงทราบแล้ว (ถ้ามี))

6.1.2 การแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงหรือตัวแทนคำนวณเงินหรือตัวแทนชำระเงินรายใหม่ (ถ้ามี)

หากมีความจำเป็นที่จะต้องแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงหรือตัวแทนชำระเงินรายใหม่ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงจะต้องจัดหาและแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟง หรือตัวแทนชำระเงินรายใหม่ (ตามแต่กรณี) โดยเร็วที่สุดเท่าที่จะสามารถกระทำได้ ทั้งนี้ต้องไม่เกิน 30 (สามสิบ) วัน นับแต่วันที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงทราบหรือควรจะทราบว่าจะต้องมีการแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟง หรือตัวแทนชำระเงินรายใหม่ (ตามแต่กรณี)

6.1.3 การจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟง

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงจะจัดให้มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงจากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟง และจะจัดให้มีการทบทวนผลการจัดอันดับความน่าเชื่อถือสำหรับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงอย่างน้อยปีละ 1 (หนึ่ง) ครั้ง หรือเมื่อมีเหตุการณ์อย่างหนึ่งอย่างใดเกิดขึ้นอันอาจมีผลกระทบต่อการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ หรือทบทวนผลการจัดอันดับความน่าเชื่อถือตามที่สถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือดังกล่าวเห็นสมควร ซึ่งผลการทบทวนการดังกล่าวอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟง

6.1.4 การขึ้นทะเบียนในสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

ในกรณีที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงออกและเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงที่มีไ้ระยะสั้น ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงอาจจัดให้มีการขึ้นทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงกับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ภายใน 30 (สามสิบ) วัน นับตั้งแต่วันที่ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟง แต่ทั้งนี้ในกรณีที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงเห็นสมควร ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงจะจัดให้มีการขึ้นทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงในเวลาใดๆ กับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยก็ได้

7. ดอกเบี้ย

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงประเภทไม่มีดอกเบี้ย ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงจะไม่ได้รับดอกเบี้ย แต่จะได้รับผลตอบแทนในรูปแบบอื่นตามที่ได้ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงประเภทมีดอกเบี้ย ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงจะได้รับดอกเบี้ยในอัตราต่อปีเท่ากับอัตราดอกเบี้ยของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟง ตามวิธีการและเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง

8. การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟง

8.1 หลักเกณฑ์ทั่วไป

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงจะได้รับการไถ่ถอนโดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟง หรือในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟงก่อนครบกำหนด (ตามแต่กรณี) โดยการชำระหนี้เป็นเงินตามมูลค่าที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง หรือการส่งมอบหลักทรัพย์หรือทยอยส่งมอบหลักทรัพย์ (ถ้ามี) ที่ตกลงจะส่งมอบให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฟง ตามวิธีการและเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง (ตามแต่กรณี) ทั้งนี้ ให้ใช้วิธีการชำระหนี้ตามที่กำหนดไว้ในข้อ 8.2 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้กับการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่

มีอนุพันธ์สำหรับการชำระหนี้ด้วยเงิน และให้ใช้วิธีการส่งมอบทรัพย์สินตามที่กำหนดไว้ในข้อ 8.3 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้กับการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ชำระหนี้เป็นการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ

8.2 การชำระหนี้ด้วยเงิน

8.2.1 หลักเกณฑ์ทั่วไป

ภายใต้ข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้และข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง การชำระเงินจะทำการชำระในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (ตามแต่กรณี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรายที่มีชื่อปรากฏในสมุดทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันกำหนดสิทธิ (“วันชำระหนี้”) หากวันชำระหนี้ไม่ใช่วันทำการ ให้เลื่อนวันชำระหนี้ไปเป็นวันทำการถัดไป ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่มีสิทธิได้รับการสะสมดอกเบี้ยบนจำนวนเงินที่ครบกำหนดหรือผลตอบแทนเพิ่มเติมใดๆ หากเกิดกรณีการเลื่อนวันชำระหนี้ดังกล่าว

8.2.2 วัน สถานที่และวิธีการชำระเงิน

8.2.2.1 เว้นแต่จะกำหนดไว้เป็นอย่างอื่น โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระเงินในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย โดยวิธีการอย่างใดอย่างหนึ่งดังต่อไปนี้

- (ก) การโอนเงินเข้าบัญชีธนาคารของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง สำหรับกรณีที่มีผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประสงค์ที่จะรับชำระด้วยวิธีการในข้อ 8.2.2.1 (ก) ตามรายละเอียดที่กำหนดไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้แจ้งให้แก่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทราบเป็นลายลักษณ์อักษรล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 15 (สิบห้า) วันทำการ ก่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (ตามแต่กรณี) หรือ
- (ข) การออกเช็คขีดคร่อมเข้าบัญชีเฉพาะ หรือเช็คธนาคาร หรือ แคชเชียร์เช็ค (Cashier Cheque) สำหรับกรณีที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประสงค์ที่จะรับชำระหนี้ด้วยวิธีการในข้อ 8.2.2.1 (ข) ตามรายละเอียดที่กำหนดไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้แจ้งให้แก่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทราบเป็นลายลักษณ์อักษรล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 15 (สิบห้า) วันทำการ ก่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (ตามแต่กรณี) โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดส่งเช็คขีดคร่อมเข้าบัญชีเฉพาะ หรือเช็คธนาคาร หรือแคชเชียร์เช็คทางไปรษณีย์ลงทะเบียนไปยังที่อยู่ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามที่ปรากฏอยู่ในสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ณ วันปิดสมุดทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องเป็นผู้รับความเสี่ยงในกรณีที่เช็คเข้าบัญชีเฉพาะ หรือเช็คธนาคาร หรือ แคชเชียร์เช็ค เกิดสูญหายหรือเกิดความเสียหายระหว่างทาง และหากผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประสงค์จะให้นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจัดส่งเช็คเข้าบัญชีเฉพาะหรือเช็คธนาคารหรือแคชเชียร์เช็คให้แก่ตนโดยวิธีอื่นที่ไม่ใช่การจัดส่งทางไปรษณีย์ธรรมดาแบบไม่รับประกัน ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องรับผิดชอบต่อค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการจัดส่งดังกล่าวเอง
- (ค) การโอนเงินผ่านระบบการโอนเงินอัตโนมัติ (Automatic Transfer System หรือ ATS)
- (ง) การโอนเงินเข้าบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามประเภทบัญชีที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงกำหนดที่เปิดไว้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (จ) การชำระเงินโดยวิธีการอื่นใดตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง

8.2.2.2 การชำระเงินในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามวิธีที่กำหนดไว้ในข้อ 8.2.2.1 ของข้อกำหนดสิทธิข้างต้นนั้น จะกระทำเมื่อได้มีการแสดงใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเวเนคืนใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง ณ สำนักงานใหญ่ของนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

8.3 การส่งมอบทรัพย์สิน (Physical Settlement)

8.3.1 ขั้นตอนการดำเนินการส่งมอบ

ในกรณีที่การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต้องกระทำด้วยวิธีการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการโอนจำนวนสินทรัพย์ (Asset Amount) (ตามที่ระบุในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยโอนจำนวนทรัพย์สินผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับความเสี่ยงทั้งหลายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบจำนวนทรัพย์สินเองตามขั้นตอนที่ระบุไว้ข้างต้นภายใน

วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (วันดังกล่าวอาจมีการเปลี่ยนแปลงตามเงื่อนไขในข้อนี้หรือตามดุลยพินิจของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และให้เรียกวันดังกล่าวว่า “วันที่ส่งมอบจำนวนทรัพย์สิน (Delivery Date)”))

8.3.2 ค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ

- (ก) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้ชำระค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบจำนวนทรัพย์สินทั้งหมด
- (ข) ในกรณีที่ทรัพย์สินที่ส่งมอบเป็นหลักทรัพยประเภทที่ฝากไว้กับ บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด (หรือบุคคลอื่นที่ดำเนินกิจการรับฝากหลักทรัพย์ในประเทศไทยได้ตามกฎหมาย ซึ่งเข้ารับหน้าที่แทน) หลังจากผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ทำการโอนหลักทรัพย์ดังกล่าวให้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแล้ว ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีหน้าที่ในการดำเนินการขอออกใบหุ้น (หรือหลักฐานการแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ดังกล่าว) ให้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องรับผิดชอบต่อค่าใช้จ่ายต่างๆ ที่เกิดขึ้นจากการออกใบหุ้น (หรือหลักฐานการแสดงสิทธิ) ดังกล่าวเอง

8.3.3 ความรับผิดชอบของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและบุคคลอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง

- (ก) ตลอดระยะเวลาหลังจากที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบจำนวนทรัพย์สินให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือระยะเวลาที่ยังไม่มีการเปลี่ยนแปลงสิทธิในทางทะเบียน (Intervening Period) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือบุคคลอื่นใดที่เกี่ยวข้อง (ก) ไม่มีหน้าที่จัดส่งหรือจัดให้มีการส่ง จดหมาย หนังสือรับรอง คำบอกกล่าว หนังสือเวียน เอกสาร หรือเงินชำระอื่นใดที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์ หรือสิทธิเรียกร้องที่บุคคลดังกล่าวได้รับมาจากผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เว้นแต่กรณีที่กำหนดไว้อย่างชัดเจนในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง หรือ (ข) ไม่มีหน้าที่ใช้หรือจัดให้มีการใช้สิทธิใดๆ ทั้งปวงที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์หรือสิทธิเรียกร้องดังกล่าว หรือ (ค) ไม่มี ความรับผิดชอบโดยประการใดต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในบรรดาความเสียหายหรือความสูญเสียใดๆ ที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจได้รับไม่ว่าโดยตรงหรือโดยอ้อม เนื่องจากการที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือบุคคลที่เกี่ยวข้องดังกล่าวเป็นบุคคลที่มีชื่อในทางทะเบียนว่าเป็นผู้มีสิทธิตามกฎหมายในหลักทรัพย์หรือสิทธิเรียกร้องดังกล่าวในระหว่างระยะเวลาที่ยังไม่มีการเปลี่ยนแปลงสิทธินั้น
- (ข) เพื่อวัตถุประสงค์ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ (1) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีหน้าที่จดทะเบียนหรือดำเนินการเพื่อให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือบุคคลอื่นใดได้รับการจดทะเบียนเป็นผู้ถือหลักทรัพย์ในสมุดทะเบียนหลักทรัพย์ของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง (2) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีหน้าที่ต้องรับผิดชอบในสิทธิและผลประโยชน์ใดๆ ที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือบุคคลอื่นใดดังกล่าวพึงได้รับจากหลักทรัพย์อ้างอิง ซึ่งถือเป็นส่วนหนึ่งของจำนวนทรัพย์สินตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หากปรากฏว่าวันเริ่มซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวในตลาดหลักทรัพย์เป็นวันแรกของการทำการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ และวันที่สิทธิและผลประโยชน์ใดๆ ที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือบุคคลอื่นใดดังกล่าวพึงได้รับจากหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นวันหรือวันก่อนวันที่ส่งมอบจำนวนทรัพย์สิน และ (3) ดอกเบี้ย ปันผล หรือเงินตอบแทนใด ๆ ของหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (ถ้ามี) จะชำระให้แก่บุคคลที่มีสิทธิจะได้รับดอกเบี้ย ปันผล หรือเงินตอบแทนใด ๆ ตามจำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบดังกล่าวตามหลักเกณฑ์ที่ใช้อยู่ในปัจจุบันในตลาดที่มีการจำหน่ายหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์และให้ส่งมอบตามวิธีการที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงกำหนด ซึ่งจะได้อ้างให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทราบล่วงหน้าก่อนหรือภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ดังกล่าว

8.3.4 เหตุขัดข้องในการส่งมอบ (Settlement Disruption Event)

หากเหตุขัดข้องในการส่งมอบเกิดขึ้นและยังมิผลอยู่ก่อนการส่งมอบจำนวนทรัพย์สินตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ ให้วันที่ส่งมอบจำนวนทรัพย์สินในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวเลื่อนออกไปจนกว่าจะถึงวันที่เหตุขัดข้องในการส่งมอบสิ้นสุดลงและให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงส่งหนังสือบอกกล่าวไปยังผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้องตามขั้นตอนและวิธีการที่ระบุในข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ ข้อ 14 ในกรณีดังกล่าวผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีสิทธิเรียกร้องขอรับเงินจำนวนใดๆ ไม่ว่าจะ เป็นดอกเบี้ยหรือเงินจำนวนอื่นจากผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกิดขึ้นอันเนื่องมาจากความล่าช้าในการส่งมอบจำนวนทรัพย์สินตามข้อนี้ ในกรณีที่มีการเลื่อนวันที่ส่งมอบจำนวนทรัพย์สินให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเนื่องจากเหตุตามที่ระบุในวรรคนี้ไม่ให้ถือว่าผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงกระทำความผิดข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้และข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง และผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีความรับผิดชอบใดๆ ที่เกิดขึ้นเนื่องจากเหตุดังกล่าวประการใดต่อกรณีดังกล่าว

ในระหว่างที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงยังไม่สามารถส่งมอบจำนวนทรัพย์สินได้เนื่องจากเกิดเหตุขัดข้องในการส่งมอบ ทั้งนี้ โดยไม่คำนึงถึงข้อกำหนดอื่นใดในข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ผู้เดียวอาจเลือกที่จะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระราคาด้วยเงินแทนการชำระโดยการส่งมอบจำนวนทรัพย์สิน โดยชำระเงินในจำนวนเท่ากับราคาการชำระด้วยเงินในกรณีที่เกิดเหตุขัดข้อง (Disruption Cash Settlement Price) ภายในกำหนดไม่เกินวันทำการวันที่ 3 (สาม) นับจากวันที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงส่งคำบอกกล่าวให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อแจ้งการชำระราคาเป็นเงินแทนการชำระราคาด้วยทรัพย์สิน (โดยให้เรียกค่าบอก

กล่าวดังกล่าวว่า “คำบอกกล่าวเพื่อแจ้งการเลือกวิธีชำระราคาไถ่ถอน” (Election Notice) ตามวิธีการและขั้นตอนที่ระบุในข้อ 14 ทั้งนี้ การแจ้งการชำระราคาด้วยเงินในกรณีที่เกิดเหตุขัดข้องนั้นจะเป็นไปตามขั้นตอนที่ระบุในข้อ 14 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้

เพื่อประโยชน์ของข้อ 8.3 นี้ **เหตุขัดข้องในการส่งมอบ** หมายถึง เหตุการณ์ที่เกิดขึ้นโดยที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่สามารถควบคุมได้หรือที่มีได้เกิดจากความผิดของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือที่เกิดขึ้นเนื่องจากบทบัญญัติของกฎหมาย และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวเป็นอุปสรรคขัดขวางมิให้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสามารถส่งมอบจำนวนทรัพย์สินให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ และ/หรือ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องได้ ทั้งนี้ เพื่อไม่ให้เป็นที่สงสัย เหตุขัดข้องในการส่งมอบดังกล่าวให้หมายความรวมถึง (แต่ไม่จำกัดเฉพาะ) กรณีเมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ เป็นการชั่วคราว หรือเมื่อเกิดเหตุการณ์กับหรือที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิงหรือผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงหรือระบบหรือขั้นตอนในการส่งมอบหลักทรัพย์ขัดข้อง

8.4 การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Early Redemption)

(ก) กรณีที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีหน้าที่ต้องไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

ในกรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event) ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ และข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้อง ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดโดยการชำระหนี้ด้วยเงินตามวิธีการชำระหนี้เงินตามระบุไว้ในข้อ 8.2 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระหนี้เพื่อการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามจำนวนเงินที่คำนวณได้จากหลักเกณฑ์การคำนวณที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้อง ในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event Settlement Date) ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้อง หรือส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงตามระบุไว้ในข้อ 8.3 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงตามจำนวนที่คำนวณได้จากหลักเกณฑ์การคำนวณที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้อง ในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event Settlement Date) ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้อง

8.5 คำนิยามศัพท์ที่เกี่ยวข้องกับการส่งมอบทรัพย์สิน

เพื่อวัตถุประสงค์ของข้อ 8.3 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ ให้คำต่างๆดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้ (เว้นแต่จะระบุไว้เป็นอย่างอื่นในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง)

“**จำนวนทรัพย์สิน**” (Asset Amount) หมายถึง ทรัพย์สินตามจำนวนที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง

“**ค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ**” (Delivery Expenses) หมายถึง ค่าธรรมเนียม ค่าภาษี ค่าอากร และ/หรือ ค่าใช้จ่ายอื่นใดที่ทั้งปวงรวมทั้ง ค่าอากรแสตมป์ เงินสำรองค่าภาษีอากรแสตมป์ และ/หรือ ค่าธรรมเนียม ค่าอากร หรือค่าภาษีทั้งปวงที่เกิดขึ้นเนื่องจากการส่งมอบจำนวนทรัพย์สิน

“**ราคาชำระด้วยเงินในกรณีที่เกิดเหตุขัดข้อง**” (Disruption Cash Settlement Price) หมายถึง ราคาชำระที่เท่ากับมูลค่าตลาดที่เป็นธรรมของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง ตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ ณ วันใดวันหนึ่ง ซึ่งผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงกำหนด ซึ่งเป็นไปตามวิธีปฏิบัติทางการค้าที่เหมาะสม ทั้งนี้ วันดังกล่าวจะต้องไม่เกิน 15 (สิบห้า) วัน นับจากวันที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งคำบอกกล่าวเพื่อแจ้งการเลือกวิธีชำระราคาไถ่ถอนแก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นผู้กำหนดราคาชำระหนี้ (ซึ่งเป็นไปตามวิธีปฏิบัติทางการค้าที่เหมาะสม) ทั้งนี้ ราคาชำระด้วยเงินในกรณีที่เกิดเหตุขัดข้องอาจมีการปรับเพิ่มหรือลด ตามที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเห็นว่าเหมาะสม

“**ระยะเวลาที่ยังไม่มีการเปลี่ยนแปลงสิทธิในทางทะเบียน (Intervening Period)**” หมายถึง ระยะเวลาที่บุคคลใดๆ ซึ่งไม่ใช่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้องยังคงมีสิทธิในทางทะเบียน ในฐานะที่เป็นเจ้าของหลักทรัพย์อ้างอิงตามกฎหมาย หรือต่อสิทธิเรียกร้องในจำนวนทรัพย์สิน

8.6 เหตุแห่งการปรับราคา (Potential Adjustment Event)

ในกรณีที่เกิดเหตุที่อาจมีการปรับราคา (ตามที่ได้นิยามไว้ข้างล่างนี้) และเหตุดังกล่าวจะส่งผลกระทบต่ออย่างมีนัยสำคัญต่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือต่อสิทธิของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการพิจารณาวิธีการที่เหมาะสมที่จะใช้ในการปรับราคา (ถ้ามี) หรือเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เพื่อลดผลกระทบต่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจากเหตุการณ์ดังกล่าว หรือเพื่อป้องกันความเสียหายที่อาจเกิดกับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในทันที ตลอดจนกำหนดวันที่การปรับราคาดังกล่าวจะมีผลบังคับใช้ อย่างไรก็ตาม ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจพิจารณาไม่ปรับราคา ทั้งนี้ขึ้นอยู่กับดุลยพินิจของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเอง หรือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงบางรุ่น อาจมีการระบุโดยชัดแจ้งในข้อกำหนดสิทธิที่เกี่ยวข้องว่าจะไม่มีการปรับราคา ซึ่งผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่ปรับราคาหรือเงื่อนไขใด ๆ ถึงแม้ว่าจะเกิดเหตุ ตามข้อ 8.6 นี้

เพื่อประโยชน์ของข้อ 8.6 นี้ **เหตุที่อาจมีการปรับราคา** หมายถึง เหตุอย่างใดอย่างหนึ่งในส่วนของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง ดังนี้

- (1) การที่ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงแบ่งแยกหรือรวมหลักทรัพย์อ้างอิงที่เกี่ยวข้อง โดยไม่เกิดจากเหตุแห่งการควบรวมกิจการ (ตามที่ได้นิยามไว้ข้างล่างนี้) หรือจัดสรรผลประโยชน์หรือเงินปันผลตามหลักทรัพย์อ้างอิงโดยการให้เป็นผลตอบแทนพิเศษ การให้เป็นหลักทรัพย์ที่ออกใหม่ หรือการออกหลักทรัพย์ในลักษณะที่คล้ายคลึงกันให้แก่ผู้ถือหลักทรัพย์อ้างอิงเดิมโดยไม่คิดมูลค่า
- (2) การที่ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงจ่ายเงินปันผลให้แก่ผู้ถือหลักทรัพย์อ้างอิงเดิมของหลักทรัพย์อ้างอิง หรือจัดสรรออตราสารหรือทรัพย์สินใดๆ ดังต่อไปนี้ (ก) หลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง หรือ (ข) ทุนเรือนหุ้นหรือหลักทรัพย์อื่นของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงที่สิทธิแก่ผู้ถือหลักทรัพย์อ้างอิงเดิมในการได้รับเงินปันผล และ/หรือ รายได้จากชำระบัญชีของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นจำนวนเท่ากับหรือตามสัดส่วนจำนวนเงินที่จะจ่ายให้แก่ผู้ถือหลักทรัพย์อ้างอิงเดิม หรือ (ค) หลักทรัพย์สิทธิใบสำคัญแสดงสิทธิในการซื้อหลักทรัพย์ หรือทรัพย์สินอื่นใด โดยคิดค่าตอบแทนเป็นเงินหรือค่าตอบแทนในลักษณะอื่นที่มีอัตราต่ำกว่าราคาตลาดตามที่กำหนด
- (3) การที่ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงจ่ายเงินปันผลนอกเหนือจากเงินปันผลที่จ่ายเป็นกรณีปกติ หรือ
- (4) ในกรณีที่เกี่ยวกับผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง เหตุการณ์ใดๆ ที่ทำให้เกิดการจัดสรรหรือ แบ่งแยกสิทธิของผู้ถือหุ้นสามัญหรือหุ้นประเภทอื่นที่เป็นส่วนหนึ่งของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงใหม่ ตามเงื่อนไขในแผนหรือข้อตกลงเกี่ยวกับสิทธิของผู้ถือหุ้นเพื่อป้องกันการครอบงำกิจการของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงซึ่งกำหนดให้ต้องมีการจัดสรรหุ้นบุริมสิทธิ ใบสำคัญแสดงสิทธิซื้อหลักทรัพย์ ตราสารหนี้ หรือสิทธิซื้อหุ้นให้แก่ผู้ถือหุ้นในราคาที่สูงกว่าราคาตลาด เมื่อเกิดเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งขึ้น ทั้งนี้หากมีการปรับราคาเนื่องจากเหตุดังกล่าวจะต้องมีการปรับเปลี่ยนราคาอีกครั้งหนึ่งภายหลังที่สิทธิดังกล่าวได้ถูกซื้อคืนแล้ว หรือ
- (5) เหตุการณ์อื่นใดที่มีความเห็นว่าจะส่งผลกระทบต่ออย่างมีนัยสำคัญต่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือต่อสิทธิของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เมื่อมีเหตุแห่งการปรับราคาเกิดขึ้นจะต้องแจ้งแก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทราบในรายละเอียดของเหตุแห่งการปรับราคาดังกล่าวและขั้นตอนต่างๆ ที่จะดำเนินการเกี่ยวกับเรื่องนั้นๆ ตามขั้นตอนและ วิธีการที่กำหนดในข้อ 14 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้

8.7 เหตุการณ์พิเศษ (Extraordinary Event)

8.7.1 ในกรณีที่มิเหตุการณ์ใดเหตุการณ์หนึ่งดังต่อไปนี้ เกิดขึ้นกับหรือเกี่ยวข้องกับผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง (แต่ละเหตุการณ์เรียกว่า “เหตุการณ์พิเศษ (Extraordinary Event)”) ก่อนหรือในวันกำหนดค่าหลักทรัพย์

- (ก) มีเหตุแห่งการควบรวมกิจการ (Merge Event) เกิดขึ้น
- (ข) มีการทำคำขอเสนอซื้อ (Tender Offer) เกิดขึ้น
- (ค) เกิดการที่ทรัพย์สินตกเป็นของรัฐ (Nationalization) เกิดขึ้น
- (ง) มีการล้มละลาย (Insolvency) เกิดขึ้น
- (จ) มีการเพิกถอนหลักทรัพย์อ้างอิงจากการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน (De-listing) เกิดขึ้น หรือ
- (ฉ) มีเหตุการณ์ใดเหตุการณ์หนึ่งที่ระบุว่าเป็นเหตุขัดข้องเพิ่มเติม (Additional Disruption Events) เกิดขึ้น

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีสิทธิที่จะ (ก) ทำการพิจารณาโดยสุจริตซึ่งจะเป็นไปตามวิธีปฏิบัติทางการค้าที่เหมาะสมในการปรับราคา การแก้ไขหรือการเปลี่ยนแปลงเงื่อนไขใดๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ เพื่อให้สอดคล้องกับเหตุการณ์พิเศษที่เกิดขึ้น ตลอดจนกำหนดวันที่การปรับราคา การแก้ไข หรือ การเปลี่ยนแปลงเงื่อนไขดังกล่าวจะมีผลบังคับใช้ หรือ (ข) ถัดจากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมด ในราคาตามมูลค่าตลาดที่เป็นธรรมตามดุลยพินิจของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงกำหนดแต่เพียงผู้เดียว โดยจะต้องบอกกล่าวให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทราบไม่เกิน 30 (สามสิบ) วันและไม่น้อยกว่า 3 (สาม) วัน

8.7.2 เมื่อมีเหตุการณ์พิเศษเกิดขึ้น ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องบอกกล่าวให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับ รายละเอียดของเหตุการณ์ดังกล่าวและขั้นตอนต่างๆ ที่จะดำเนินการเกี่ยวกับเรื่องนั้นๆ ตามขั้นตอน และวิธีการที่กำหนดในข้อ 14 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้

8.8 คำนิยามศัพท์

เพื่อวัตถุประสงค์ของข้อ 8.1 ข้อ 8.5 และข้อ 8.6 แห่งข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

เหตุขัดข้องเพิ่มเติม (Additional Disruption Events) หมายถึง เหตุการณ์ต่างๆ ที่ระบุในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องว่าเป็นเหตุขัดข้องเพิ่มเติม

เหตุที่อาจมีการปรับราคา (Potential Adjustment Event) หมายถึง (เว้นแต่จะระบุไว้เป็นอย่างอื่นใน ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง) เหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งที่ระบุไว้ในข้อ 8.5 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้

การทำคำขอเสนอซื้อ (Tender Offer) หมายถึง การทำคำเสนอซื้อเพื่อครอบงำกิจการ คำขอเสนอซื้อกิจการ คำขอเสนอแลกเปลี่ยนหุ้น หรือคำขอเสนอหรือข้อเสนออื่นใดที่จัดทำโดยนิติบุคคลหรือบุคคลใดๆ รวมถึง เหตุอื่นใดที่เกิดขึ้น ซึ่งมีผลให้นิติบุคคลหรือบุคคลดังกล่าว มีสิทธิซื้อ หรือได้รับ หรือมีสิทธิได้รับหุ้นของผู้ออกหลักทรัพย์ เป็นจำนวนตั้งแต่ร้อยละ 10 (สิบ) ขึ้นไปและไม่เกินร้อยละ 100 (ร้อย) ของหุ้นที่ออกจำหน่าย และมีสิทธิออกเสียงทั้งหมดของผู้ออกหลักทรัพย์ ในกรณีนี้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์จะพิจารณาจากเอกสารคำขอนี้ นิติบุคคลหรือบุคคลดังกล่าวยื่นต่อหน่วยงานราชการ หรือหน่วยงานที่มีอำนาจกำกับดูแล หรืออาจพิจารณาจากข้อมูลอื่นใดที่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์เห็นว่าเป็นเรื่องเกี่ยวข้อง

การที่ทรัพย์สินตกเป็นของรัฐ (Nationalization) หมายถึง การที่หลักทรัพย์อ้างอิงทั้งหมดของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงหรือทรัพย์สินทั้งหมดหรือบางส่วนที่สำคัญของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงต้องตกเป็นของรัฐบาล ถูกเวนคืน หรือต้องโอนให้แก่หน่วยงานราชการ หน่วยงานที่มีอำนาจเกี่ยวข้อง นิติบุคคล หรือ องค์การอื่นใดของรัฐ

การเป็นผู้ล้มละลาย (Insolvency) หมายถึง การที่ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงดำเนินการชำระบัญชีเพื่อเลิกกิจการ เป็นบุคคลล้มละลาย เป็นบุคคลผู้มีหนี้สินล้นพ้นตัว เลิกกิจการ ยุติกิจการ มีการแต่งตั้ง (หรือยื่นคำขอเพื่อแต่งตั้ง) เจ้าพนักงานพิทักษ์ทรัพย์ หรือดำเนินการใดๆ ในทำนองเดียวกันนั้นไม่ว่าโดยสมัครใจหรือไม่ก็ตาม ซึ่งการดำเนินการดังกล่าวมีผลให้ (ก) ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงต้องโอนหลักทรัพย์อ้างอิงทั้งหมดให้แก่เจ้าพนักงานพิทักษ์ทรัพย์ ผู้ทำแผน ผู้บริหารแผน หรือเจ้าพนักงานที่เกี่ยวข้องตามกฎหมายล้มละลาย (แล้วแต่กรณี) หรือ (ข) บุคคลที่ถือหลักทรัพย์อ้างอิงของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวจะไม่สามารถโอนหลักทรัพย์อ้างอิงของตนให้แก่บุคคลอื่นได้ตามกฎหมาย

การเพิกถอนหลักทรัพย์ออกจากตลาดหลักทรัพย์จดทะเบียน (De-listing) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง การที่ตลาดหลักทรัพย์มีประกาศตามกฎหมายของตลาดหลักทรัพย์ให้หลักทรัพย์อ้างอิงต้องหรือจะต้องถูกเพิกถอนจากการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน ยุติการซื้อขาย หรือยุติการเสนอราคาซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงใดๆ ในตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าวไม่ว่าด้วยเหตุประการใดๆ (นอกเหนือจากเหตุแห่งการควบรวมกิจการ หรือการทำคำขอเสนอซื้อ) และไม่ได้ได้รับอนุญาตให้เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน ซื้อ ขาย หรือเสนอราคาซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวอีกทั้งในตลาดหลักทรัพย์หรือระบบการกำหนดราคาหลักทรัพย์

วันควบรวมกิจการ (Merger Date) หมายถึง วันที่เหตุแห่งการควบรวมกิจการมีผล หรือในกรณีที่ไม่สามารถกำหนดวันมีผลของการควบรวมกิจการตามบทบัญญัติของกฎหมายที่บังคับใช้ได้ ให้วันควบรวมกิจการ หมายถึง วันอื่นใดที่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์กำหนด

เหตุแห่งการควบรวมกิจการ (Merger Event) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิงที่เกี่ยวข้องใดๆ หมายถึง (ก) การเปลี่ยนแปลงประเภทของหลักทรัพย์อ้างอิง หรือการเปลี่ยนแปลงใดๆ เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงที่มีผลให้ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงต้องโอนหรือมีความผูกพันที่เพิกถอนไม่ได้ที่จะต้องโอนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ค้างค้างทั้งจำนวนให้แก่บุคคลหรือนิติบุคคลอื่น หรือ (ข) การรวมกิจการ การควบรวมกิจการ หรือการควบรวมกิจการเข้ากับนิติบุคคลหรือบุคคลอื่น หรือควบรวมกิจการมาเป็นนิติบุคคลใหม่ หรือการมีข้อผูกพันที่จะต้องแลกเปลี่ยนหุ้นของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงกับหุ้นของนิติบุคคลหรือบุคคลอื่น (แต่ไม่รวมถึงการรวมกิจการ การควบกิจการ การควบรวมกิจการ หรือการมีข้อผูกพันที่จะต้องเปลี่ยนหุ้นที่ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นนิติบุคคลที่ยังดำรงอยู่ และไม่มีผลทำให้เกิดการเปลี่ยนแปลงประเภทหรือการเปลี่ยนแปลงใดๆ ในหลักทรัพย์อ้างอิงที่ค้างค้างทั้งหมดดังกล่าว) หรือ (ค) การที่บุคคลหรือนิติบุคคลใดๆ ทำคำเสนอซื้อเพื่อครอบงำกิจการ คำขอเสนอซื้อกิจการ คำขอเสนอแลกเปลี่ยนหุ้น หรือคำขอและข้อเสนออื่นใดเพื่อซื้อหรือเข้าครอบครองหลักทรัพย์อ้างอิงที่ค้างค้างทั้งหมดของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง ซึ่งมีผลให้ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงต้องโอนหรือมีความผูกพันที่เพิกถอน

ไม่ได้ที่จะต้องโอนหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวที่คงค้างทั้งจำนวนให้แก่บุคคลหรือนิติบุคคลนั้น (ยกเว้นหลักทรัพย์อ้างอิงที่บุคคลหรือนิติบุคคลดังกล่าวเป็นผู้ถือกรรมสิทธิ์ หรือมีอำนาจควบคุมอยู่แล้ว) หรือ (ง) การรวมกิจการ การควบรวมกิจการ หรือการควบรวมกิจการเข้ากับนิติบุคคลหรือบุคคลอื่น หรือควบรวมกิจการมาเป็นนิติบุคคลใหม่ หรือการมีข้อผูกพันที่จะต้องแลกเปลี่ยนหุ้นของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง หรือบริษัทในเครือของผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงกับหุ้นของนิติบุคคลอื่นในลักษณะที่ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นนิติบุคคลที่ดำรงอยู่ และไม่มีผลทำให้เกิดการเปลี่ยนแปลงประเภท หรือการเปลี่ยนแปลงใดๆ ในหลักทรัพย์อ้างอิงที่คงค้างทั้งหมด (โดยไม่รวมจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ถือโดย หรืออยู่ภายใต้การควบคุมของนิติบุคคลอื่นนั้น) แต่มีผลทำให้หลักทรัพย์อ้างอิงที่คงค้างมีจำนวนน้อยกว่าร้อยละ 50 (ห้าสิบ) ของหลักทรัพย์อ้างอิงทั้งหมดทันทีหลังจากเกิดเหตุการณ์ดังกล่าว (ซึ่งเหตุการณ์นี้จะเรียกว่าการควบรวมกิจการกลับ (Reverse Merger)) โดยวันควบรวมกิจการสำหรับเหตุการณ์การควบรวมกิจการทุกกรณีจะต้องเกิดขึ้นในวัน หรือก่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ หรือในกรณีที่มีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง วันควบรวมกิจการดังกล่าวจะต้องเกิดขึ้นในวันหรือก่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Security) หมายถึง หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบตามที่ระบุไว้ใน ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง

ตลาดหลักทรัพย์ (Exchange) ในความหมายที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง ตลาดหลักทรัพย์หรือระบบการกำหนดราคาหลักทรัพย์ (Quotation System) ตามที่กำหนดสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง รวมถึงตลาดหลักทรัพย์หรือระบบการกำหนดราคาหลักทรัพย์ที่ดำเนินการแทน หรือตลาดหลักทรัพย์หรือระบบการกำหนดราคาหลักทรัพย์สำรองซึ่งมีการย้ายการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงไปเป็นการชั่วคราว (โดยที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้พิจารณาแล้วเห็นว่าการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์หรือระบบการกำหนดราคาหลักทรัพย์สำรองชั่วคราวนี้ จะมีสภาพคล่องในระดับเดียวกับการซื้อขายหลักทรัพย์หลัก)

วันทำการของตลาดหลักทรัพย์ (Exchange Business Day) หมายถึง วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ แม้ว่าตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าวจะปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติหรือไม่ก็ตาม

8.9 การซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจากผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือแหล่งอื่นๆได้ไม่ว่าในเวลาใดๆ โดยเป็นไปตามเงื่อนไขที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะกำหนด

8.10 การยกเลิกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งปวงที่ได้รับการไถ่ถอนหรือซื้อคืนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะยกเลิกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว และจะนำหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวมาเสนอขายต่อไปอีกมิได้ โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องแจ้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทราบเพื่อยกเลิกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ได้รับการไถ่ถอนหรือซื้อคืนมา รวมทั้งแจ้งเรื่องการไถ่ถอนหรือการซื้อคืนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ทราบ ตามประกาศและกฎหมายที่เกี่ยวข้องกำหนดไว้

8.11 เงื่อนไขที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงรับทราบและตกลงว่าคู่สัญญาอีกฝ่ายหนึ่ง (ก) อาจดำเนินการทางการเงินใดๆ ที่เกี่ยวข้องกับผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง หรือ (ข) อาจดำเนินการใดๆ ที่เกี่ยวข้องกับราคาหลักทรัพย์ที่ใช้ในการคำนวณผลตอบแทนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกภายใต้ข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้เป็นไปตาม (ก) การค้าปกติของคู่สัญญานั้นๆ トラบที่การกระทำดังกล่าวไม่ขัดต่อกฎหมายใดๆ ที่เกี่ยวข้อง (รวมถึงแต่ไม่จำกัดเพียงการวิเคราะห์และการเผยแพร่การวิเคราะห์หลักทรัพย์อ้างอิง) และ (ข) การเป็นตัวแทนหรือผู้จัดการการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ การเป็นนายหน้าค้าหลักทรัพย์ และ/หรือ การเป็นที่ปรึกษาการลงทุน ซึ่งการกระทำดังกล่าวอาจมีผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์ที่ใช้อ้างอิงได้

9. ภาษีอากร

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบต่อภาษีอากร หรือค่าธรรมเนียมของรัฐไม่ว่าประเภทใดที่กำหนดเรียก เก็บ หรือ หัก ณ ที่จ่าย หรือประเมินโดยผู้มีอำนาจกระทำการในนามของประเทศไทยหรือหน่วยย่อยทางการเมืองหรือเจ้าหน้าที่ใดๆ ของหรือในหน่วยงานย่อยดังกล่าว นั้น ซึ่งมีอำนาจเรียกเก็บภาษีที่เกี่ยวกับการชำระเงิน เงินต้น ดอกเบี้ย หรือการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหลายในส่วนของ หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เว้นแต่จะเป็นภาษีอากร หรือค่าธรรมเนียมรัฐที่กำหนดให้เรียกเก็บกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

10. การผิณฑและผลของการผิณฑ

10.1 ถ้าเกิดเหตุการณ์ใดๆ ดังต่อไปนี้ให้ถือเป็นเหตุผิณฑ (“เหตุผิณฑ”) ภายใต้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

- (ก) เมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ชำระเงิน หรือไม่ส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วนตามเงื่อนไขข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้และข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ จะไม่ถือว่าเกิดเหตุผิณฑกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หาก
 - 1) การไม่ชำระเงินดังกล่าวมีสาเหตุจากความล่าช้าในระบบการโอนเงินหรือเหตุสุดวิสัยในการจัดส่งเช็ค หรือ
 - 2) การไม่ส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบดังกล่าวมีสาเหตุจากความล่าช้าในระบบการโอนหลักทรัพย์ หรือความล่าช้าของนายทะเบียนหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้อง หรือเหตุสุดวิสัยอื่นๆ ในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบดังกล่าว และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ทำการแก้ไขโดยชำระเงินหรือมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบดังกล่าวภายใน 7 (เจ็ด) วันทำการ นับจากวันที่เหตุขัดข้องดังกล่าวได้ผ่านพ้นไป
- (ข) เมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ปฏิบัติตามข้อตกลง เงื่อนไข หรือภาระหน้าที่ ไม่ว่าจะข้อใดข้อหนึ่งตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิ (เว้นแต่กรณีการไม่ชำระเงิน หรือไม่ส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบตามที่กำหนดไว้ในข้อ 10.1 (ก) ข้างต้น) โดยเหตุการณ์ดังกล่าวเป็นเหตุการณ์ที่สามารถแก้ไขได้ แต่ไม่ได้รับการแก้ไขภายในระยะเวลา 30 (สามสิบ) วัน ภายหลังจากวันที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับหนังสือแจ้งให้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแก้ไขการกระทำผิดข้อตกลงดังกล่าวแล้ว โดยผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่ารายเดี่ยวหรือหลายรายรวมกัน) ซึ่งถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงรวมกันไม่น้อยกว่าร้อยละ 25 (ยี่สิบห้า) ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ยังมิได้ทำการไถ่ถอนทั้งหมด
- (ค) หากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต้องคำพิพากษาเสร็จเด็ดขาดหรือคำชี้ขาดของอนุญาโตตุลาการให้ชำระเงินครั้งเดียวหรือหลายครั้งรวมกันเกินกว่า 300,000,000 (สามร้อยล้าน) บาท หรือเงินสกุลอื่นที่มีจำนวนเทียบเท่า และคำพิพากษาเสร็จเด็ดขาดหรือคำชี้ขาดของอนุญาโตตุลาการนั้นจะส่งผลกระทบต่อความสามารถในการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้ข้อกำหนดสิทธิ หรือ
- (ง) ศาลมีคำสั่งพิทักษ์ทรัพย์ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในคดีล้มละลายหรือศาลมีคำสั่งฟื้นฟูกิจการผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตามกฎหมายล้มละลายหรือผู้ถือหุ้นของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีมติให้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเลิกกิจการหรือชำระบัญชี

10.2 เมื่อมีการผิณฑกรณีใดกรณีหนึ่งเกิดขึ้นและยังคงอยู่ หาก

- (ก) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่ารายเดี่ยวหรือหลายราย) ซึ่งถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่น้อยกว่าร้อยละ 50 (ห้าสิบ) ของจำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ยังมิได้ไถ่ถอนทั้งหมดมีหนังสือแจ้งการผิณฑไปยังผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยระบุถึงเหตุผิณฑซึ่งทำให้มีการเร่งรัดชำระหนี้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือ
- (ข) ที่ประชุมผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีมติเห็นชอบให้หนี้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดถึงกำหนดชำระโดยพลัน และ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับแจ้งเป็นลายลักษณ์อักษรถึงมติดังกล่าวแล้ว

ให้ถือว่าหนี้หุ้นกู้ถึงกำหนดชำระโดยพลัน และผู้ออกหุ้นกู้จะต้องชำระหนี้ดังกล่าวให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทันทีนับแต่วันที่ได้รับแจ้งดังกล่าวข้างต้น

11. การประชุมผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

11.1 ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีสิทธิเรียกประชุมผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ไม่ว่าในเวลาใดๆ แต่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องเรียกประชุมผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใน 30 (สามสิบ) วัน นับแต่วันที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่ารายเดี่ยวหรือหลายรายรวมกัน) ซึ่งถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่น้อยกว่าร้อยละ 25 (ยี่สิบห้า) ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ยังมิได้ไถ่ถอนทั้งหมด มีคำขอเป็นหนังสือให้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเรียกประชุมผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือนับแต่วันที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทราบว่ามีกรณีใดกรณีหนึ่งดังต่อไปนี้

- (ก) หากเกิดเหตุผิณฑกรณีใดกรณีหนึ่งตามที่กำหนดไว้ในข้อ 10.1 และในขณะที่นั้นยังมิได้มีการส่งหนังสือแจ้งใดๆ มายังผู้ออกหุ้นกู้ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในข้อ 10.2 (ก)

- (ข) หากมีการเสนอขอแก้ไขเปลี่ยนแปลงข้อกำหนดสิทธิ และ/หรือ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องในสาระสำคัญตามที่กำหนดไว้ในข้อ 12 หรือ
- (ค) หากมีกรณีที่ต้องแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์รายใหม่แทนนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์รายเดิม
- 11.2 มติโดยชอบของที่ประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่เรียกประชุมและดำเนินการประชุมโดยชอบมีผลใช้บังคับและผูกพันผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงทุกรายไม่ว่าจะได้เข้าร่วมประชุมหรือไม่ก็ตาม ส่วนหลักเกณฑ์ในการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นจะเป็นไปตามเอกสารแนบท้าย 2 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้
- 11.3 ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงอาจใช้วิธีการลงมติเป็นลายลักษณ์อักษรแทนการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงก็ได้ โดยมีมติในลักษณะดังกล่าวจะต้องปรากฏว่าผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงมีมติและลงลายมือชื่อในมติดังกล่าวและส่งมอบให้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นผู้เก็บรักษาไว้ภายในระยะเวลาตามสมควรที่กำหนดโดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องเก็บรักษามติซึ่งลงลายมือชื่อโดยผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยถือเป็นรายงานการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ เพื่อวัตถุประสงค์ของข้อ 11.3 นี้ คณะเสียงที่จะต้องได้รับเพื่อการอนุมัติในแต่ละเรื่องนั้นให้เป็นไปตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในข้อ 6 ของเอกสารแนบท้าย 2 ของข้อกำหนดสิทธิ ฉบับนี้ เพียงแต่เปลี่ยนจากการนับคะแนนเสียงจากจำนวนเสียงทั้งหมดของผู้เข้าร่วมประชุมและออกเสียงลงคะแนนเป็นการนับคะแนนเสียงจากจำนวนเสียงทั้งหมดของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง
- 11.4 ในกรณีที่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเพียงหนึ่งรายให้ถือว่ามติที่เป็นลายลักษณ์อักษรและลงนามโดยผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวเป็นมติโดยชอบของที่ประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงโดยมิต้องจัดให้มีการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง
- 11.5 การประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้ข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ (ซึ่งรวมถึงกรณีการลงมติเป็นลายลักษณ์อักษรแทนการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์ตามที่ระบุไว้ในข้อ 11.3 ข้างต้นด้วย) จะเป็นการประชุม (หรือลงมติเป็นลายลักษณ์อักษร) ร่วมกันของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดทุกชุดที่ยังคงค้างชำระอยู่ (Outstanding) ที่ออกภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น (โดยการันรองประชุมและมติของที่ประชุมจะคำนวณจากผลรวมของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดดังกล่าว) แต่ทั้งนี้ ในกรณีที่ (1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเห็นว่าเรื่องใดเรื่องหนึ่ง (ในกรณีเป็นการประชุมซึ่งต้องพิจารณาหลายวาระ) ที่จะต้องประชุมเพื่อลงมตินั้น เป็นเรื่องที่น่าจะมีผลกระทบต่อผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงชุดใดๆ โดยเฉพาะเจาะจงเท่านั้น ซึ่งในกรณีดังกล่าวให้ันบองค์ประชุมและคะแนนเสียงเฉพาะจากผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงชุดที่เกี่ยวข้องนั้นๆ เท่านั้น หรือ (2) ในกรณีที่เรื่องที่พิจารณาทั้งหมดอาจมีผลกระทบต่อผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงชุดใดๆ โดยเฉพาะ ก็ให้เรียกประชุมเฉพาะผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงชุดที่มีส่วนได้เสียดังกล่าวเท่านั้น
- 11.6 ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการจัดประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงตามข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้

12. การแก้ไขเพิ่มเติมข้อกำหนดสิทธิ

- 12.1 ห้ามมิให้มีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงข้อกำหนดสิทธิ และ/หรือ ข้อกำหนดสิทธิเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องในลักษณะที่อาจขัดต่อพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 (รวมถึงที่มีการแก้ไขเพิ่มเติม) รวมถึง ประกาศที่ ทจ.16/2565 (รวมถึงที่มีการแก้ไขเพิ่มเติม)
- 12.2 เว้นแต่จะได้มีการกำหนดไว้เป็นอย่างอื่นในข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ การแก้ไขเปลี่ยนแปลงข้อกำหนดสิทธิ และ/หรือ ข้อกำหนดสิทธิเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องในส่วนที่มีสาระสำคัญจะต้องได้รับความเห็นชอบจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและที่ประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงตามเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในเอกสารแนบท้าย 2
- 12.3 ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีหน้าที่ต้องส่งข้อกำหนดสิทธิ และ/หรือ ข้อกำหนดสิทธิเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องที่ได้มีการแก้ไขดังกล่าวให้สำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ทราบภายใน 15 (สิบห้า) วัน นับจากวันที่การแก้ไขเพิ่มเติมดังกล่าว และส่งข้อกำหนดสิทธิ และ/หรือ ข้อกำหนดสิทธิเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้องดังกล่าวให้แก่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงหากมีการร้องขอ
- 12.4 ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจแก้ไขเปลี่ยนแปลงข้อกำหนดสิทธิ และ/หรือ ข้อกำหนดสิทธิเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง โดยไม่ต้องขอมติจากที่ประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงก่อน หากการแก้ไขเปลี่ยนแปลงดังกล่าวไม่กระทบต่อสิทธิอันเป็นสาระสำคัญของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงหรือเป็นประโยชน์ต่อผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงอย่างชัดเจน

13. การขอกู้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับใหม่

หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับเก่าสูญหาย ฉีกขาด หรือชำรุดด้วยประการใดๆ ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่ปรากฏชื่อในสมุดทะเบียนผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงมีสิทธิยื่นคำขอให้นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงออกใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับใหม่ โดยจะต้องชำระค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายตามสมควรตามที่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงกำหนด ในการนี้นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องออกใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับใหม่ให้แก่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงภายใน 30 (สามสิบ) วัน นับแต่วันที่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับคำขอให้ออกใบ

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับใหม่ และเอกสารอื่นๆ ตามที่นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงกำหนด และนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องลงบันทึกในสมุดทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงว่ามีการยกเลิกใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับเก่าด้วย

14. คำบอกกล่าว

14.1 คำบอกกล่าวถึงผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

คำบอกกล่าวถึงผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถือว่าได้ส่งโดยชอบหากได้ส่งทางไปรษณีย์ลงทะเบียน (หรือการส่งโดยวิธีที่เทียบเคียงกัน) หรือทางไปรษณีย์อากาศ (หากส่งไปยังที่อยู่ในต่างประเทศ) ไปยังที่อยู่ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามที่ระบุในสมุดทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งจะถือได้ว่าเป็นการส่งโดยชอบแล้วในวันที่ 3 (สาม) นับจากวันที่ได้ส่งทางไปรษณีย์ หรือในวันที่ 7 (เจ็ด) นับจากวันที่ส่ง หากเป็นการส่งจากประเทศอื่นนอกจากประเทศของผู้รับ หรือทางจดหมายอิเล็กทรอนิกส์ตามที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้แจ้งไว้ หรือแจ้งไปยังหมายเลขโทรศัพท์ที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้แจ้งไว้ในฐานข้อมูลบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ที่ไว้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงยินยอมให้ถือว่าการบอกกล่าวหรือแจ้งให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชอบแล้ว ทั้งนี้ โดยไม่คำนึงว่าผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะได้รับแจ้งด้วยตนเองหรือมีผู้อื่นรับไว้แทนโดยชอบ

กรณีมิได้ส่งคำบอกกล่าวหรือมีความบกพร่องใดๆ ในคำบอกกล่าวที่ส่งไปให้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงรายใดรายหนึ่งโดยเฉพาะจะไม่มีผลต่อความสมบูรณ์ของคำบอกกล่าวใดๆ อันเกี่ยวเนื่องกับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงรายอื่น

14.2 คำบอกกล่าวถึงผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

- (ก) คำบอกกล่าวถึงนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถือว่าได้ส่งโดยชอบ หากได้ส่งไปยังที่อยู่หรือ หมายเลขโทรสารของนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามที่ระบุไว้ในสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ และตัวแทนชำระเงิน (ถ้ามี)
- (ข) คำบอกกล่าวถึงผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถือว่าได้ส่งโดยชอบ หากได้ส่งไปยังที่อยู่หรือหมายเลขโทรสารของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามที่ระบุไว้ข้างท้ายนี้ (หรือตามที่แจ้งให้นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทราบเป็นครั้งคราว)

บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

สำนักงานเลขที่ 999/9 อาคาร ดิ ออฟฟิศเอส แอท เซ็นทรัลเวิลด์ ชั้น 18

ถนนพระราม 1 แขวงปทุมวัน เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330

โทรศัพท์ 02 658 9000 และ 02658 9500

โทรสาร 02 658 9110

14.3 คำบอกกล่าวอาจจัดส่งทางไปรษณีย์ลงทะเบียนหรือทางโทรสารก็ได้ ทั้งนี้ การติดต่อสื่อสารใดๆระหว่างบุคคลหนึ่งไปยังอีกบุคคลหนึ่งภายใต้ข้อกำหนดสิทธิจะมีผลก็ต่อเมื่อ

- (ก) หากเป็นการส่งโดยโทรสาร เมื่อได้รับในรูปแบบที่อ่านได้ หรือ
- (ข) หากเป็นการส่งโดยจดหมาย เมื่อครบสามวันทำการหลังจากวันส่งหรือเมื่อได้รับจดหมาย แล้วแต่วันใดจะเกิดขึ้นก่อน

15. ผลใช้บังคับของข้อกำหนดสิทธิและกฎหมายที่ใช้บังคับ

ข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้จะมีผลใช้บังคับเริ่มในวันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไปจนถึงวันที่มีการชำระหนี้ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงครบถ้วนเรียบร้อยแล้ว

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ช่วงชัย นະวงค์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

เอกสารแนบท้าย 1
แบบใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แบบไม่มีหลักประกัน
และไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
Unsubordinated and Unsecured Structured Notes without a Noteholders'
Representative, In the Name-Registered Certificate



บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
Finansia Syrus Securities Public Company Limited

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แบบระยะสั้น [●]

Structured Note [●]

ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ [●]

Issued under Structured Notes Programme of Finansia Syrus Securities Public Company Limited No. [●]

วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ [●]	วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ [●]	อายุ [●] วัน	มูลค่าที่ตราไว้ [●]	บาท/หน่วย [●]	จำนวนที่ออก [●]	หน่วย	มูลค่ารวม [●]	บาท
Issue Date	Maturity Date	Term	Nominal Amount	Baht/Unit	Offering Amount	Units	Total Amount	Baht
[หลักทรัพย์/ ดัชนีหลักทรัพย์] อ้างอิง [●]		การส่งมอบทรัพย์สินเมื่อครบกำหนดอายุ		: ส่งมอบเป็นเงินสดหรือหลักทรัพย์				
Underlying [Shares/ Index]		Type of Settlement		: Cash or Securities				
ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ [●]		จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ [●]	หน่วย		วันที่ออกใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ [●]			
Name of Noteholder [●]		Number of Structured Notes	Units		Issue Date of Certificate			
เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ [●]		จำนวนเงินต้น [●]	บาท		อัตราดอกเบี้ย [●] ต่อปี			
Noteholder Registration No.		Total Principal Amount	Baht		Fixed Rate per annum			

ใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์นี้อยู่ภายใต้ข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ฉบับวันที่ [●] (ตามที่อาจมีการแก้ไขเพิ่มเติม และ/หรือ ใช้แทนที่ โดยข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง) ตามที่ได้ยื่นไว้กับสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ต่อไปนี้เรียกว่า “ข้อกำหนดสิทธิ”)

This Certificate is subject to the Terms and Conditions of the Structured Notes dated [●] (as amended and/or supplemented by the relevant Pricing Supplement) Submitted to the Office of the Securities and Exchange Commission (hereinafter referred to as “Terms and Conditions”)

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์นี้เป็นหนี้ประเภทไม่ด้อยสิทธิและไม่มีหลักประกัน โดยมีสถานะทางกฎหมายเท่าเทียมกันทุกหน่วย ทั้งนี้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์จะมีสิทธิได้รับชำระหนี้หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ไม่ด้อยกว่าสิทธิในการได้รับชำระหนี้ของเจ้าหนี้สามัญที่ไม่มีหลักประกันและไม่ด้อยสิทธิทั้งในปัจจุบันและในอนาคตของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ เว้นแต่บรรดาหนี้ที่มีกฎหมายคุ้มครองโดยชัดเจนหรือโดยทั่วไปที่ได้รับชำระหนี้ก่อน

The Structured Notes constitute unsecured and unsubordinated claim on the Issuer which will rank pari passu for all units and the Noteholders are entitled to receive payment not less favourable than the unsecured and unsubordinated creditors in general of the Issuer at all times, save for such obligation as may be preferred by provisions of law that are both mandatory and of general application.

เว้นแต่จะได้มีการกำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการออกอนุพันธ์ระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ [●] เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ดังกล่าว ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์และนายทะเบียน หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ของสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ไม่ว่าในทศใด ๆ ให้แก่บุคคลอื่น เว้นแต่เป็นการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์โดยทางมรดก

Except as otherwise specified in the applicable pricing supplement, the Structured Notes Programme of Finansia Syrus Securities Public Public Company Limited No.[●] is non-transferrable throughout the term of the Structured Note. Therefore, the issuer and/or the register hereby reserve the rights not to register the transfer of the Structured Notes to any person other than the transfer by heritage purpose.]

* ทั้งนี้ มูลค่าที่ตราไว้มิใช่มูลค่าที่ใช้ในการไถ่ถอนหุ้นกู้ก่อนครบกำหนด แต่มีไว้เพื่อใช้ในการคำนวณผลประโยชน์ที่ได้รับ ณ วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ก่อนครบกำหนด

Nominal amount is not the redemption amount of the Structured Notes, but it has been given for the purpose of calculation of maturity repayment amount on the maturity date.

เลขทะเบียนบริษัท 0107547000079
Company Registration No.
จดทะเบียนเมื่อวันที่ 11 กุมภาพันธ์ 2547
Registered on 11 February 2004
เลขที่ใบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ [●]
Certificate No.

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ / นายทะเบียน
Note Issuer / Registrar

เว้นแต่จะได้นิยามไว้เป็นอย่างอื่นในใบหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง คำนิยามที่ใช้ในใบหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้ ให้ความหมายเช่นเดียวกับที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดสิทธิ

Unless otherwise specified in this Certificate, the defined terms used in this Certificate shall have the same meaning given to them in the Terms and Conditions

สรุปสาระสำคัญของข้อกำหนดและเงื่อนไขของข้อกำหนดสิทธิ

Summary of the Terms and Conditions of the Structured Notes

หน้าที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงชนิดระบุชื่อผู้ถือ ประเภที่มีอัตราดอกเบี้ยคงที่ หรือ ไม่มีดอกเบี้ย ไม่โดยสิทธิ ไม่มีประกันและไม่มีผู้แทนผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง

The Structured Notes are fixed rate notes or zero coupon notes in registered form, unsubordinated, unsecured, without Noteholders' Representative.

ดอกเบี้ยสำหรับหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงประเภทมีอัตราดอกเบี้ยคงที่จะมีอัตราดอกเบี้ยคงที่ซึ่งจะคิดคำนวณบนมูลค่าที่ตราไว้ของหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงในอัตราต่อปีเท่ากับอัตราดอกเบี้ยตามที่ระบุไว้ ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง โดยจะมีการชำระเพียงงวดเดียว พร้อมกับการชำระคืนเงินต้นหรือการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (แล้วแต่กรณี) ในวันครบกำหนดอายุหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงตามวิธีการที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง

The Structured Notes issued in form of a Fixed Rate Note shall bear fixed interest on its nominal amount at the rate per annum as specified in the applicable Pricing Supplement. Such Interest will be payable at once with the principal amount or the delivery of Settlement Securities (as the case may be) on the Maturity Date of the Structured Notes by the method in accordance with the Terms and Conditions and the applicable Pricing Supplement.

ในกรณีที่อยู่อกหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงได้ซื้อคืนหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงจากผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง และได้ชำระราคาซื้อคืนด้วยเงินจำนวนดังกล่าวให้แก่ผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงแล้ว ให้อธิบายสิทธิเรียกร้องตามหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้ เป็นอันสิ้นสุดลงทันที มิเช่นนั้น หน้าที่มีอนุพันธ์แฝงจะได้รับชำระโดยผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง ตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ ตามวิธีการชำระหนี้ด้วยเงินตามที่กำหนดในข้อ 8.2 หรือด้วยการส่งมอบหลักทรัพย์ตามที่กำหนดในข้อ 8.3 ของข้อกำหนดสิทธิ (แล้วแต่กรณี) และข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ เมื่อผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงได้ดำเนินการดังกล่าวแล้ว ให้อธิบายสิทธิเรียกร้องตามหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้ เป็นอันสิ้นสุดลงทันที ทั้งนี้ ผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องนำใบหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงไปให้ผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง เว้นแต่ในกรณีที่มีข้อสงสัยผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงหรือนายทะเบียนหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงสามารถใช้ดุลยพินิจเรียกให้ผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงรายใด ๆ นำใบหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงหรือใบรับเพื่อไปแทนใบหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงมาจนครบถ้วน

In case the issuer already bought back the Structured Notes from the Noteholders and the issuer completely made the payment, the rights and obligations of the Structured Notes contained herein shall be deemed fulfilled, else the Structured Note shall be redeemed by the Issuer on the Maturity Date in accordance with the conditions specified in the applicable Pricing Supplement. The payment methods in Clause 8.2 shall be applied if the Structured Notes shall be redeemed in cash and the physical settlement methods in Clause 8.3 shall be applied if the Structured Notes shall be redeemed by delivery of the Settlement Shares to the Noteholders (as the case may be) and the applicable Pricing Supplement. Upon completion of the above conditions by the issuer, the rights and obligations of the Structured Notes contained herein shall be deemed fulfilled. The Structured Notes Holders are not required to surrender certificates of the Structured Notes to the Registrar, except where there is any doubt relating there to, the Registrar or the Issuer may request the Structured Notes Holder for their certificates to be inspected and surrendered.

การปิดสมุดทะเบียนผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง / The Closure of the Register Book

ผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง จะดำเนินการให้นายทะเบียนหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงปิดสมุดทะเบียนผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นเวลา 1 (หนึ่ง) วัน ซึ่งเป็นวันที่ 14 (สิบสี่) ก่อนหน้า วันครบกำหนดอายุหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง วันประชุมผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง หรือวันอื่นใดเพื่อประโยชน์ตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิ เพื่อพักการโอนหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงในการกำหนดสิทธิของผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง ในกรณีที่วันปิดสมุดทะเบียนผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวไม่ตรงกับวันทำการ ก็ให้เลื่อนเป็นวันทำการถัดไป

The issuer shall cause the Registrar to close the Register Book for one day on the 14 day prior to the Maturity Date or the meeting date of the Noteholders or any other day for any other purpose as specified in the Terms and Conditions in order to suspend the transfer of the Structured Notes for the purpose of determining the right of the Noteholders. If on the closure date, the Register Book is not a Business Day, the Register Book shall be closed on the following business day.

ข้อกำหนดอื่นๆ เป็นไปตามข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง

Other conditions shall be accordance with the Terms and Conditions and the applicable Pricing Supplement.

โปรดอ่าน Please Read

(1) ให้ผู้ขอลงทะเบียนรับโอนหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงทำแบบคำขอลงทะเบียนรับโอนหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงทุกครั้งที่ยื่นโอนหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงต่อนายทะเบียนพร้อมใบหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้ที่ได้มีการสลักหลังแล้วโดยชอบ

Applicant for the registration of Structured Notes transfer must complete the debenture transfer registration form every time upon submission to the Registrar together with the Structured Notes Certificate which has been duly endorsed.

(2) เฉพาะผู้รับโอนหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงแรกจากผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงที่ปรากฏชื่อที่ด้านหน้าของใบหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงให้แนบภาพถ่ายบัตรประจำตัวประชาชนที่ได้รับรองสำเนาถูกต้องไปพร้อมกับใบหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง ฉบับนี้ กรณีที่เป็นนิติบุคคลให้แนบสำเนาหนังสือรับรองของกระทรวงพาณิชย์ที่ได้ออกให้ไม่เกิน 1 เดือนที่ได้รับรองสำเนาถูกต้องพร้อมกับภาพถ่ายบัตรประจำตัวประชาชนของผู้มีอำนาจที่ได้รับรองสำเนาถูกต้องไปพร้อมกับใบหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้ด้วย

For the first transferee of the Structured Notes from the Structured Notes Holder whose name appears on the front of the Structured Notes Certificate, a certified true copy of the I.D. card must be submitted together with this Structured Notes Certificate. In case of juristic person, a certified copy of the affidavit issued by the Ministry of Commerce which is not more than one month old and (a) certified copy (ies) of the I.D. card of the authorized person(s) must be submitted with this Structured Notes Certificate.

(3) เมื่อผู้รับโอนหน้าที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการโอนหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง จะต้องลงลายมือชื่อเช่นเดียวกับลายมือชื่อที่เคยลงไว้เมื่อรับโอนหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง กรณีเป็นนิติบุคคลและเปลี่ยนผู้ลงลายมือชื่อ ให้แสดงหลักฐานประกอบการโอนเช่นเดียวกับข้อ (2)

When a transferee wishes to transfer the Structured Notes, he/she must sign exactly the same signature as when he/she acquired the transfer of such Structured Notes. In case of a juristic person, any change of authorized signatory (ies) must be substantiated by the documents referred to in number (2).

<p>ลงลายมือชื่อผู้โอน Signature of transferor</p>	<p>ลงลายมือชื่อผู้รับโอน (ผู้ที่ต้องการลงทะเบียนเป็นผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง) ทะเบียนผู้ถือหน้าที่มีอนุพันธ์แฝง)</p> <p>ชื่อ - สกุล ของผู้รับโอน (ตัวบรรจง) Full name of transferee in block letters</p>	<p>ลงลายมือชื่อผู้มีอำนาจ พร้อมประทับตรานายทะเบียน / บริษัท Authorized signature with the Seal of The Registrar / Company</p>
<p>1. ลงลายมือชื่อผู้โอน Signature of transferor</p>	<p>ลงลายมือชื่อผู้รับโอน (Signature of transferee) ตัวบรรจง (Block letters)</p>	
<p>2. ลงลายมือชื่อผู้โอน Signature of transferor</p>	<p>ลงลายมือชื่อผู้รับโอน (Signature of transferee) ตัวบรรจง (Block letters)</p>	
<p>3. ลงลายมือชื่อผู้โอน Signature of transferor</p>	<p>ลงลายมือชื่อผู้รับโอน (Signature of transferee) ตัวบรรจง (Block letters)</p>	

เอกสารแนบท้าย 2

หลักเกณฑ์ในการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

1. การเรียกประชุม

ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง หรือผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่ารายเดียวหรือหลายรายรวมกัน) ซึ่งถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่น้อยกว่าร้อยละ 25 (ยี่สิบห้า) ของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่ยังมิได้ไถ่ถอนทั้งหมด ซึ่งประสงค์จะเรียกประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (แล้วแต่กรณี) จะต้องดำเนินการให้นายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจัดส่งหนังสือเรียกประชุม (ตามวิธีการที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงฉบับนี้) ถึงผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (ในกรณีที่ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ได้เป็นผู้ประสงค์เรียกประชุม) และผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงภายใน 30 (สามสิบ) วันนับตั้งแต่วันที่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว (ไม่ว่ารายเดียวหรือหลายรายรวมกัน) มีคำขอเป็นหนังสือให้นายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเรียกประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยนายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจัดให้มีการประชุมภายในระยะเวลาไม่น้อยกว่า 7 (เจ็ด) วัน แต่ไม่เกิน 14 (สิบสี่) วันนับตั้งแต่วันที่นายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจัดส่งหนังสือเรียกประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ในการนี้ หนังสือเรียกประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องระบุวัน เวลา สถานที่สำหรับการประชุม วาระการประชุม และผู้ที่จะให้เรียกประชุม ทั้งนี้ นายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดส่งหนังสือเรียกประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงทุกรายตามรายชื่อและที่อยู่ซึ่งปรากฏในสมุดทะเบียนผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

2. ผู้มีสิทธิเข้าร่วมประชุม

ผู้มีสิทธิเข้าร่วมประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง จะประกอบด้วยบุคคลต่างๆ ดังนี้

1. ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง
2. ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงอาจแต่งตั้งให้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงรายอื่นหรือบุคคลใดๆ (“ผู้รับมอบฉันทะ”) เข้าร่วมประชุมและออกเสียงลงคะแนนแทนตนได้ โดยลงนามในหนังสือมอบฉันทะ (ตามแบบที่นายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงกำหนดและจัดส่งให้แก่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงพร้อมทั้งหนังสือนัดประชุม) ให้แก่นายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่น้อยกว่า 24 (ยี่สิบสี่) ชั่วโมงก่อนเวลานัดประชุม
3. ที่ปรึกษาทางการเงิน ที่ปรึกษากฎหมาย หรือบุคคลซึ่งมีส่วนเกี่ยวข้องกับเรื่องที่ประชุมจะพิจารณา ซึ่งได้รับการร้องขอจากผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงให้เข้าร่วมประชุมเพื่อทำการชี้แจงและแสดงความคิดเห็นต่อที่ประชุม
4. บุคคลใดๆ ที่ประธานในที่ประชุมอนุญาตให้เข้าร่วมประชุมในฐานะผู้สังเกตการณ์

3. องค์กรประชุม

- 3.1. ในการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อพิจารณาและลงมติในเรื่องต่างๆ (นอกจากที่กำหนดไว้ในข้อ 6.3 และข้อ 6.4 ของเอกสารแนบท้าย 2 นี้) จะต้องมีผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงตั้งแต่ 2 (สอง) รายขึ้นไป ซึ่งถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นจำนวนรวมไม่น้อยกว่าร้อยละ 25 (ยี่สิบห้า) ของจำนวนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่ยังมิได้ไถ่ถอนทั้งหมดเข้าร่วมประชุม จึงจะครบเป็นองค์กรประชุม ในกรณีที่การประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นการประชุมครั้งใหม่ที่เลื่อนมาจากการประชุมครั้งก่อนซึ่งไม่สามารถประชุมได้เนื่องจากขาดองค์ประชุมตามข้อ 3.1 นี้ องค์กรประชุมสำหรับการประชุมครั้งใหญ่ที่เลื่อนมานี้ต้องประกอบด้วยผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงตั้งแต่ 2 (สอง) รายขึ้นไป ไม่ว่าถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นจำนวนเท่าใดก็ตามเข้าร่วมประชุม
- 3.2. การประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อพิจารณาและลงมติในเรื่องต่างๆ ตามที่กำหนดไว้ในข้อ 6.3 ของเอกสารแนบท้าย 2 นี้ จะต้องมีผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงตั้งแต่ 2 (สอง) รายขึ้นไป ซึ่งถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นจำนวนรวมกันไม่น้อยกว่าร้อยละ 50 (ห้าสิบ) ของจำนวนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่ยังมิได้ไถ่ถอนทั้งหมดเข้าร่วมประชุมจึงจะครบเป็นองค์กรประชุม ในกรณีที่การประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นการประชุมที่เลื่อนมาจากการประชุมครั้งก่อน ซึ่งไม่สามารถประชุมได้เนื่องจากขาดองค์ประชุมตามข้อ 3.2 นี้ องค์กรประชุม

สำหรับการประชุมที่เลื่อนมาจะต้องประกอบด้วยผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์ตั้งแต่ 2 (สอง) รายขึ้นไป ซึ่งถือหุ้นที่มีอนุพันธ์เป็นจำนวนรวมกันไม่น้อยกว่าร้อยละ 25 (ยี่สิบห้า) ของหุ้นที่มีอนุพันธ์ที่ยังไม่ได้ไถ่ถอนทั้งหมดเข้าร่วมประชุม

- 3.3. การประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์เพื่อพิจารณาและลงมติในเรื่องต่างๆ ตามที่กำหนดไว้ในข้อ 6.4 ของเอกสารแนบท้าย 2 (สอง) รายขึ้นไป ซึ่งถือหุ้นที่มีอนุพันธ์เป็นจำนวนรวมกันไม่น้อยกว่าร้อยละ 66 (หกสิบหก) ของจำนวนหุ้นที่มีอนุพันธ์ที่ยังไม่ได้ไถ่ถอนทั้งหมดเข้าร่วมประชุม จึงจะครบเป็นองค์ประชุม ในกรณีที่การประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์เป็นการประชุมที่เลื่อนมาจากการประชุมครั้งก่อนซึ่งไม่สามารถประชุมได้เนื่องจากขาดองค์ประชุมตามข้อ 3.3 นี้ องค์ประชุมสำหรับการประชุมที่เลื่อนมาจะต้องประกอบด้วยผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์ตั้งแต่ 2 (สอง) รายขึ้นไป ซึ่งถือหุ้นที่มีอนุพันธ์เป็นจำนวนรวมกันไม่น้อยกว่าร้อยละ 33 (สามสิบสาม) ของหุ้นที่มีอนุพันธ์ที่ยังไม่ได้ไถ่ถอนทั้งหมดเข้าร่วมประชุม

4. ประธานในที่ประชุม

ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์หรือบุคคลที่ได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์จะทำหน้าที่เป็นประธานในที่ประชุม ในกรณีที่ผู้ที่จะทำหน้าที่ประธานในที่ประชุมยังไม่มาประชุมเมื่อล่วงเวลานัดไปแล้วถึง 45 (สี่สิบห้า) นาที ให้ที่ประชุมลงมติเลือกผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์รายหนึ่งขึ้นทำหน้าที่เป็นประธานในที่ประชุมครั้งนั้น

5. เลื่อนการประชุม

- 5.1. ในการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์ไม่ว่าครั้งใด หากปรากฏว่าเมื่อล่วงเวลานัดไปแล้วถึง 45 (สี่สิบห้า) นาที ยังมีผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์เข้าร่วมประชุมไม่ครบเป็นองค์ประชุม ประธานในที่ประชุมจะต้องสั่งเลิกประชุม โดย

5.1.1. กรณีที่ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์เป็นผู้เรียกเข้าประชุม ให้ประธานในที่ประชุมเลื่อนการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์ไปประชุมในวัน เวลา และสถานที่ซึ่งประธานกำหนด โดยวันนัดประชุมใหม่จะต้องอยู่ภายในระยะเวลาไม่น้อยกว่า 7 (เจ็ด) วัน แต่ไม่เกิน 14 (สิบสี่) วัน นับตั้งแต่วันนัดประชุมเดิม ทั้งนี้ เว้นแต่ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์มีความเห็นให้ไม่มีการเรียกประชุมใหม่นอกจากนี้ เรื่องที่พิจารณาและลงมติในที่ประชุมครั้งใหม่จะต้องเป็นเรื่องเดิมที่ค้างพิจารณาจากการประชุมครั้งก่อนเท่านั้น

5.1.2. ในกรณีที่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์เป็นผู้ร้องขอให้เรียกประชุม จะไม่มีการเรียกประชุมใหม่

5.1.3. ในกรณีที่การประชุมนี้ เป็นการประชุมที่ได้ถูกเรียกประชุมเนื่องจากการประชุมในครั้งก่อนขาดองค์ประชุมจะไม่มีการเรียกประชุมใหม่อีก

5.1.4. หากปรากฏว่าเมื่อล่วงเวลานัดประชุมไปแล้วถึงสามสิบ (30) นาทีสำหรับกรณีที่มีการนัดเรียกประชุมโดยผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์ และยังมีผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์เข้าร่วมไม่ครบเป็นองค์ประชุม ให้ยกเลิกการประชุมดังกล่าวโดยไม่มีการเลื่อนประชุมอีก

- 5.2. นายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์จะต้องจัดส่งหนังสือเรียกประชุมสำหรับการประชุมครั้งใหม่ที่จะจัดขึ้นเนื่องจากการประชุมครั้งก่อนมีผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์เข้าร่วมประชุมไม่ครบเป็นองค์ประชุมให้แก่ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์และผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์ตามรายชื่อและที่อยู่ ซึ่งได้เคยจัดส่งหนังสือเรียกประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์ไว้ในครั้งที่ไม่ครบองค์ประชุมนั้นทุกรายภายในระยะเวลาไม่น้อยกว่า 3 (สาม) วันก่อนวันนัดประชุมครั้งใหม่ (โดยไม่นับวันที่ส่งหนังสือเรียกประชุมและวันประชุม) ทั้งนี้ หนังสือเรียกประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์ครั้งใหม่นี้จะต้องระบุวัน เวลา สถานที่สำหรับการประชุม วาระการประชุม และองค์ประชุมที่ต้องการสำหรับการประชุมครั้งใหม่ที่ถูกลื่อนมา

6. มติของที่ประชุม

- 6.1. การลงมติในเรื่องต่างๆ ของที่ประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ให้ตัดสินโดยการชুমือหรือลงคะแนนเสียงตามที่ประธานในที่ประชุมกำหนด ซึ่งผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงหรือผู้รับมอบฉันทะแต่ละรายจะมีคะแนนเสียงเท่ากับจำนวนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่ตนถืออยู่ โดยถือว่ามีหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง 1 (หนึ่ง) หน่วยมี 1 (หนึ่ง) เสียง ในกรณีที่คะแนนเสียงเท่ากัน ให้ประธานในที่ประชุมมีคะแนนเสียงชี้ขาด (ทั้งกรณีการลงมติโดยการชুমือและลงคะแนนลับ) เพิ่มจากคะแนนเสียงที่ประธานในที่ประชุมอาจมีอยู่แล้วในฐานะที่ตนเป็นผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงหรือผู้รับมอบฉันทะ
- 6.2. มติของที่ประชุมมติของที่ประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงในเรื่องต่างๆ (นอกจากที่กำหนดไว้ในข้อ 6.3 และ 6.4 ของเอกสารแนบท้าย 2 นี้) จะต้องเป็นมติโดยคะแนนเสียงข้างมากไม่น้อยกว่าร้อยละ 50 (ห้าสิบ) ของจำนวนเสียงทั้งหมดของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งเข้าร่วมประชุมและออกเสียงลงคะแนน
- 6.3. มติของที่ประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงในเรื่องการแก้ไขเปลี่ยนแปลงข้อกำหนดสิทธิหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งไม่เกี่ยวข้องกับเรื่องต่างๆ ที่กำหนดไว้ในข้อ 6.4 ของเอกสารแนบท้าย 2 นี้ จะต้องเป็นมติโดยคะแนนเสียงข้างมากไม่น้อยกว่าร้อยละ 66 (หกสิบหก) ของจำนวนเสียงทั้งหมดของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งเข้าร่วมประชุมและออกเสียงลงคะแนน
- 6.4. มติที่ประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงในเรื่องต่างๆ ต่อไปนี้จะต้องเป็นมติโดยคะแนนเสียงข้างมากไม่น้อยกว่าร้อยละ 75 (เจ็ดสิบห้า) ของจำนวนเสียงทั้งหมดของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งเข้าร่วมประชุมและออกเสียงลงคะแนน
 - 6.4.1. การชำระหนี้ตามหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงด้วยการแปลงสภาพหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหุ้น หุ้นกู้อื่น หรือทรัพย์สินอื่นของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงหรือบุคคลใดๆ
 - 6.4.2. การแก้ไขวันชำระเงินหรือหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบใดๆ
 - 6.4.3. การลด ยกเลิก หรือเปลี่ยนแปลงแก้ไขจำนวนเงินต้น ดอกเบี้ย หรือเงินจำนวนอื่นใดที่ถึงกำหนดชำระหรือ ที่จะต้องชำระตามหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง
 - 6.4.4. การเปลี่ยนแปลงสกุลเงินตราของเงินไม่ว่าจำนวนใดๆ ที่จะต้องชำระตามหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง
 - 6.4.5. การแก้ไขเปลี่ยนแปลงหลักเกณฑ์ในการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่เกี่ยวกับองค์ประชุม (ข้อ 3) และมติของที่ประชุม (ข้อ 6)
 - 6.4.6. การแก้ไขเปลี่ยนแปลงข้อกำหนดสิทธิหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้สามารถดำเนินการในเรื่องใดเรื่องหนึ่ง ตามข้อ 6.4.1 ถึงข้อ 6.4.5 ข้างต้น
- 6.5. ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงรายใดมีส่วนได้เสียเป็นพิเศษในเรื่องใดที่จะพิจารณาในที่ประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง จะไม่มีสิทธิออกเสียงลงคะแนนในเรื่องนั้นๆ

7. รายงานการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจัดให้มีรายงานการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (หรือจัดการให้นายทะเบียนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นผู้จัดทำ) และดำเนินการให้ประธานในที่ประชุมครั้งนั้นลงนามรับรองภายใน 14 (สิบสี่) วันนับตั้งแต่วันประชุม และเก็บรักษาต้นฉบับของรายงานการประชุมนั้นไว้ รวมทั้งจัดให้มีสำเนาของรายงานการประชุมผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าวไว้ ณ สำนักงานใหญ่ของผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงและ/หรือ นายทะเบียนผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง เพื่อให้มีผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงตรวจสอบในวันและเวลาทำการของผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงและ/หรือ นายทะเบียนผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (ตามแต่กรณี)

เอกสารแนบท้าย 3

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Equity-Linked Note แบบมีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ.[•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับผิดชอบในผลการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระเงินใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนในลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้) อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรองดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้โดยเป็นอิสระและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจําเป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่การรับรองหรือการรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้มีอนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issuer) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Type of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภท Equity-Linked Note แบบมีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Noteholder) : [•]
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Noteholder Registration No.) : [•]
6. มูลค่าที่ตราไว้ (Nominal Amount) : [•] บาท
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) : หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]/หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) : [•] บาท
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : [•] บาท
15. ราคาเพื่อค้ำหนุนเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price) : [•] บาท

16. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
(Yield Payment)
17. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ : หลักทรัพย์อ้างอิง จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(Settlement Securities Amount) * อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม
18. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ $[(\text{มูลค่าที่ตราไว้} / \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย}) - \text{จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ}] \times \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย}$
(Cash Settlement)
19. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มี : [•]
อนุพันธ์แฝง (Trade Date)
20. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Issue Date)
21. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่า
(Final Security Price) หลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลาดำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
22. เวลาดำหนดค่าหลักทรัพย์ : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
(Valuation Time)
23. ตลาดหลักทรัพย์ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
(Exchange)
24. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ : [•]
(Valuation Date)

ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

- 1) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลาที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ
 - (1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว
 - (1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปนี้ในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ
- 2) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

25. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) : [•]
26. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ (Securities Settlement Date) : [•]
27. สกุลเงินที่กำหนด (Settlement Currency) : สกุลเงินบาท
28. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Restriction on Transfer) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล

29. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และ
ขั้นต่ำ (Minimum Subscription) จะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

30. ลักษณะการไถ่ถอน : ไถ่ถอนเมื่อครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเท่านั้น
(Type of Redemption)
31. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) : **กรณีไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือเงิน**
- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 - (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) แต่มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price: K2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบและชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 - (ค) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) น้อยกว่าราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price: K2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบและชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และจะชำระเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นเงินเท่ากับ [(ราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น - ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย) x จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ] ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

กรณีไถ่ถอนเป็นเงิน

- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) น้อยกว่าราคา
ที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) แต่มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price: K2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ลบออก

ด้วย [(ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย - ราคาหลักทรัพย์อ้างอิง) x จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ] ให้แก่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

- (ค) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) น้อยกว่าราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Guarantee Price: K2) ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ลบออกด้วย [(ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย - ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น) x จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ] ให้แก่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบต่อหนี้ใดๆ ต่อผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

32. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
33. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษีอากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง

34. ตัวแทนคำนวณเงิน : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Calculation Agent)
35. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Registrar)
36. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
อนุพันธ์และตัวแทนคำนวณเงิน แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]
(ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any)

ข้อกำหนดอื่นๆ

37. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อ : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account)
38. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) : [•]
(Other Conditions) (If any)

ผู้ออกหุ้นกุดตกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้
ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ช่างชัย นະวงค์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Equity-Linked Note แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์
อ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] /
ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับผิดชอบในผลการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระเงินใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีพอที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้) อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issuer) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Type of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภท Equity-Linked Note แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Noteholder) : [•]
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Noteholder Registration No.) : [•]
6. มูลค่าที่ตราไว้ (Nominal Amount) : [•] บาท
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) : หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) : [•] บาท
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : [•] บาท
15. ราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price) : ไม่มี

16. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
(Yield Payment)
17. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ : หลักทรัพย์อ้างอิง จำนวนเท่ากับ [มูลค่าที่ตราไว้ / ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับ
(Settlement Securities Amount) การซื้อขาย] โดยปิดให้เป็นทศนิยม 4 (สี่) ตำแหน่ง
18. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา : ไม่มี
(Cash Settlement)
19. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มี : [•]
อนุพันธ์แฝง (Trade Date)
20. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Issue Date)
21. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่า
(Final Security Price) หลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
22. เวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
(Valuation Time)
23. ตลาดหลักทรัพย์ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
(Exchange)
24. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ : [•]
(Valuation Date)

ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) วันหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) วันหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆ ในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

- 1) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลาที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ
 - (1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว
 - (1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปนี้ในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ
- 2) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

25. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) : [•]
26. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ (Securities Settlement Date) : [•]
27. สกุลเงินที่กำหนด (Settlement Currency) : สกุลเงินบาท
28. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Restriction on Transfer) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล

29. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และ
ขั้นต่ำ (Minimum Subscription) จะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

30. ลักษณะการไถ่ถอน : ไถ่ถอนเมื่อครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเท่านั้น
(Redemption Type)
31. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) : **กรณีไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือเงิน**
- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยเงินสดส่วนต่างคำนวณจากมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หักด้วยราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย หักออกด้วยจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ คูณด้วยราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย

กรณีไถ่ถอนเป็นเงิน

- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ลบออกด้วย [(ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย - ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย) x จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ] ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ออกหุ้นกู้ที่มี

- อนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบหนี้ใดๆต่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
32. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
33. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษีอากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง

34. ตัวแทนคำนวณเงิน : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Calculation Agent)
35. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Registrar)
36. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
อนุพันธ์และตัวแทนคำนวณเงิน แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]
(ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any)

ข้อกำหนดอื่นๆ

37. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อ : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account)
38. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) : [•]
(Other Conditions) (If any)

ผู้ออกหุ้นกุดกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้
ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ช่างชัย นະวงค์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Basket ELN แบบมีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / หน่วยลงทุนของ กองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับผิดชอบในผลการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระเงินใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีพอที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้) อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ว่าเป็นอิสระและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issuer) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Type of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Basket ELN แบบมีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•]/ หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Noteholder) : [•]
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Noteholder Registration No.) : [•]
6. มูลค่าที่ตราไว้ (Nominal Amount) : [•] บาท
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) : หลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ซึ่งประกอบด้วย
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) : ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์

- (1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
15. ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price) : ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
16. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี (Yield Payment) : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
17. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities Amount) : หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
** อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม*
18. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (Cash Settlement) : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ $[(\text{มูลค่าที่ตราไว้} / \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย}) - \text{จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ}] \times \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย}$
19. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trade Date) : [•]
20. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Date) : [•]
21. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price) : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
22. เวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time) : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
23. ตลาดหลักทรัพย์ (Exchange) : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
24. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) : [•]
- ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิม

ให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆ ในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

- 1) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในกรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ
 - (1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว
 - (1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปนี้ในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ
- 2) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

25. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) : [•]

26. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ : [•]
(Securities Settlement Date)
27. สกุลเงินที่กำหนด : สกุลเงินบาท
(Settlement Currency)
28. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล
29. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขั้นต่ำ (Minimum Subscription) : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และจะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

30. ลักษณะการไถ่ถอน : ไถ่ถอนเมื่อครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเท่านั้น
(Redemption Type)
31. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) : **กรณีไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือเงิน**
- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SLT) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SLT) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL1) แต่มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นของ Least Performing Security (Guarantee Price: KL2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least Performing Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยเงินสดส่วนต่างคำนวณจากมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หักด้วยราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย หักออกด้วยจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ คุณด้วย ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security
- (ค) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Least Performing Security Price: SLT) น้อยกว่าราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นของ Least Performing

Security (Guarantee Price: KL2) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least Performing Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และจะชำระเงินสดชดเชยคุ้มครองเงินต้นให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นเงินเท่ากับ [(ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น - ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย) x จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบของ Least Performing Security] ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

“Least Performing Security” หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีอัตราร้อยละที่เปลี่ยนแปลงไปของราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายต่ำที่สุดจากราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย โดยจะคำนวณจาก [(ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ลบด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ)หารด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ] หากมีหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้ผลการคำนวณเท่ากันสองหลักทรัพย์หรือมากกว่า ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะใช้ดุลยพินิจในการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เป็น Least Performing Security สำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หากหลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้ามีเพียงหนึ่งหลักทรัพย์ ให้ Least Performing Security หมายถึงหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดชอบในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินสดดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบหนี้ใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

32. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
33. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาวะที่เกิเกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นที่เกี่ยวข้อง

34. ตัวแทนคำนวณเงิน : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Calculation Agent)
35. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Registrar)
36. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและตัวแทนคำนวณเงิน (ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any) : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]

ข้อกำหนดอื่นๆ

37. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account) : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
38. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) : [•]
(Other Conditions) (If any)

ผู้ออกหุ้นกู้ตกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ช่างชัย นะวงศ์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Basket ELN แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับผิดชอบในผลการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระคืนใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีพอที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้) อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issuer) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Type of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง Basket ELN แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Noteholder) : [•]
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Noteholder Registration No.) : [•]
6. มูลค่าที่ตราไว้ (Nominal Amount) : [•] บาท
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) : หลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ซึ่งประกอบด้วย
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) : ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์

- (1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
15. ราคาเพื่อคำนวณผลตอบแทนส่วนเพิ่ม (ถ้ามี) (Guarantee Price) : ไม่มี
16. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี (Yield Payment) : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
17. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities Amount) : หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้า หลักทรัพย์
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
** อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม*
18. ผลตอบแทนเงินสด (Cash Settlement) : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ $[(\text{มูลค่าที่ตราไว้} / \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย}) - \text{จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ}] \times \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย}$
19. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trade Date) : [•]
20. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Date) : [•]
21. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Finali Security Price) : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลายกหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
22. เวลายกหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time) : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
23. ตลาดหลักทรัพย์ (Exchange) : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
24. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) : [•]
- ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันที่หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันที่หลังจากวันกำหนดค่า

หลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆ ในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

- 1) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลาที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ
 - (1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว
 - (1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปนี้) ข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ
- 2) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

25. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มี : [•]
 อนุพันธ์แฝง (Maturity Date)
26. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ : [•]
 (Securities Settlement Date)

27. สกุลเงินที่กำหนด : สกุลเงินบาท
(Settlement Currency)
28. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล
29. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
ขั้นต่ำ (Minimum Subscription)

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

30. ลักษณะการไถ่ถอน : ไถ่ถอนเมื่อครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเท่านั้น
(Redemption Type)
31. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) :
- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SLT) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 - (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SLT) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least Performing Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยเงินสดส่วนต่างคำนวณจากมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หักด้วยราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย หักออกด้วยจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ คูณด้วยราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ของ Least Performing Security

“Least Performing Security” หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีอัตราร้อยละที่เปลี่ยนแปลงไปของราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายต่ำที่สุดจากราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย โดยจะคำนวณจาก [(ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ลบด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ) หักด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ] หากมีหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้ผลการคำนวณเท่ากันสองหลักทรัพย์หรือมากกว่า ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะใช้ดุลยพินิจในการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เป็น Least Performing Security สำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หากหลักทรัพย์อ้างอิงใน

ตะกร้ามีเพียงหนึ่งหลักทรัพย์ ให้ Least Performing Security หมายถึงหลักทรัพย์
อ้างอิงนั้นๆ

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดในการส่งมอบหลักทรัพย์
ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบ
หลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์
ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ออกหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงิสดังกล่าว
(ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดต่อหนี้ใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่
มีอนุพันธ์แฝง

32. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
33. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษี
อากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง

34. ตัวแทนคำนวณเงิน (Calculation Agent) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
35. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Registrar) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
36. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้
อนุพันธ์และตัวแทนคำนวณเงิน
(ถ้ามี) (Registrar and Paying
Agency Agreement) (If any) : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]

ข้อกำหนดอื่นๆ

37. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อ
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information
on Subscription Account) : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
38. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) (Other Conditions) (If any) : [•]

ผู้ออกหุ้นกู้ตกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้
ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีพันธบัตร
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ชวงชัย นวงศ์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Reverse Equity Linked Note (RELN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์และ/หรือเงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100

[•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับประกันผลตอบแทนจากการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระคืนใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีพอที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้) อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่จำเป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Issuer)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภท Reverse Equity Linked Note (RELN) แบบไม่มีการ
(Type of Structured Notes) ค้ำครองเงินสด ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์และ/หรือเงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็น
(Name of Structured Notes) องค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วย
ลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์
ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดได้
ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Name of Noteholder)
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Noteholder Registration No.)
6. มูลค่าที่ตราไว้ : [•] บาท
(Nominal Amount)
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอ : [•] หน่วย
ขาย (Number of Structured
Notes offered and sold)
8. จำนวนเงินต้น : [•] บาท
(Total Principal Amount)
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
(Issue Price)
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•] บาท
(Issue Amount)
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ : [•] บาท
(Settlement Amount)
12. หลักทรัพย์อ้างอิง : หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]
(Underlying Securities)
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง : [•] บาท
(Spot Price)
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการ : [•] บาท
ซื้อขาย (Strike Price)
15. ราคาเพื่อค้ำนวนเงินชดเชยค้ำครอง : ไม่มี
เงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price)
16. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน

- (Yield Payment)
17. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities Amount) : หลักทรัพย์อ้างอิง จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
* อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม
18. ผลตอบแทนเงินสด (Cash Settlement) : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ [มูลค่าจองซื้อที่ชำระ x อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี x อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง / 365]
19. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ อนุพันธ์ (Trade Date) : [•]
20. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Date) : [•]
21. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price) : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลาดำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
22. เวลาดำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time) : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
23. ตลาดหลักทรัพย์ (Exchange) : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
24. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) : [•]

ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันที่หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันที่หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

- 1) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ
 - (1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว
 - (1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปนี้ในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ
- 2) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

- | | | |
|---|---|---|
| 25. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แฝง (Maturity Date) | : | [•] |
| 26. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์
(Securities Settlement Date) | : | [•] |
| 27. สกุลเงินที่กำหนด
(Settlement Currency) | : | สกุลเงินบาท |
| 28. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
(Restriction on Transfer) | : | หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล |

29. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และขั้นต่ำ (Minimum Subscription) จะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

30. ลักษณะการไถ่ถอน : ไถ่ถอนเมื่อครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเท่านั้น (Redemption Type)
31. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) :
- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) น้อยกว่า หรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเป็นหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ และชำระดอกเบี้ย ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 - (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) มากกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยชำระเป็นเงินเท่ากับ [หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ x ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price: K1)] และชำระดอกเบี้ย ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบหนี้ใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

32. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด : ร้อยละ [•] ต่อปี (Default Rate)
33. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษีอากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นที่เกี่ยวข้อง

34. ตัวแทนคำนวณเงิน : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Calculation Agent)
35. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Registrar)
36. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
อนุพันธ์และตัวแทนคำนวณเงิน (ถ้ามี) แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]
(Registrar and Paying Agency Agreement) (If any)

ข้อกำหนดอื่นๆ

37. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อ : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account)
38. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) : [•]
(Other Conditions) (If any)

ผู้ออกหุ้นกุดกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้
ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ช่างชัย นະวงค์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Callable Fixed Coupon Note (FCN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์

SET100 [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟทีอ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับผิดชอบในผลการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระคืนใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีพอที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้) อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจําเป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Issuer)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Callable Fixed Coupon Note (FCN) แบบไม่มีการ
(Type of Structured Notes) ค้ำครองเงินสด ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็น
(Name of Structured Notes) องค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•] ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Name of Noteholder)
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Noteholder Registration No.)
6. มูลค่าที่ตราไว้ : [•] บาท
(Nominal Amount)
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) : หลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ซึ่งประกอบด้วย
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) : ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์

- (1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
15. ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด
(Callable Price) : ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
16. ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครอง
เงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price) : ไม่มี
17. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี
(Yield Payment) : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
18. ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
(Interest rate) : มี ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติม
19. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ
(Settlement Securities Amount) : หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
** อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม*
20. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา
(Cash Settlement) : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ $[(\text{มูลค่าที่ตราไว้} / \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย}) - \text{จำนวนหลักทรัพย์ตามที่ตกลงจะส่งมอบ}] \times \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย}$
21. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แฝง (Trade Date) : [•]
22. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
(Issue Date) : [•]
23. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย
(Final Security Price) : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง แต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายใน
ตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลากำหนดค่า
หลักทรัพย์ (Valuation Time)
24. เวลากำหนดค่า
หลักทรัพย์(Valuation Time) : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
25. ตลาดหลักทรัพย์
(Exchange) : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
26. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
(Valuation Date) : [•]
- ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือ
แต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading
Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่
ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย
(Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุ

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิม ให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆ ในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

- 1) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่ละกรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ
 - (1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว
 - (1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ
- 2) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

- อนุพันธ์แฝง (Maturity Date)
28. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ : [•]
(Securities Settlement Date)
29. สกุลเงินที่กำหนด : สกุลเงินบาท
(Settlement Currency)
30. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิ์ที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล
31. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขั้นต่ำ (Minimum Subscription) : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และจะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

32. ประเภทดอกเบี้ย : อัตราดอกเบี้ยคงที่
(Type of Interest)
33. อัตราดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ร้อยละ [•] ต่อปี หรือ [•] ต่องวด
(Interest Payment Date)
34. วันกำหนดชำระดอกเบี้ย (Interest Payment Date) : ชำระเป็นงวด ในวันกำหนดชำระดอกเบี้ยในแต่ละงวด
35. วิธีคำนวณดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest Calculation Method) : จำนวนดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องชำระให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย ในแต่ละวันกำหนดชำระดอกเบี้ย จะคำนวณจากมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรายถืออยู่ คูณด้วยอัตราดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต่องวด
ทั้งนี้ ในกรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่ได้รับดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยใดๆ ภายหลังจากวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด
36. ราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนกำหนด (Early Redemption Price) : ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย ตามจำนวนที่ระบุไว้ดังต่อไปนี้
(1) ชำระเป็นเงินคาราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในจำนวนที่คำนวณโดยอ้างอิงจากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event Observation Date) ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 39 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมนี้ บวกด้วย เงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่มีเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดเกิดขึ้นในจำนวนที่คำนวณได้จากหลักเกณฑ์การคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 35 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมนี้
37. ลักษณะการไถ่ถอน : มีโอกาสไถ่ถอนได้ก่อนครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(Redemption Type)

38. เหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
แผงก่อนครบกำหนด (Auto Call
Event) :
- กรณีที่ราคาปิดของ [หลักทรัพย์อ้างอิงทุกหลักทรัพย์ / หลักทรัพย์อ้างอิงหลักทรัพย์
ใดหลักทรัพย์หนึ่ง] ในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันที่
เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงก่อนครบกำหนดมากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อ
เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ ทั้งนี้
เพื่อมิให้มีข้อสงสัย มิให้ถือว่าเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงก่อนครบ
กำหนดในวันกำหนดค่าหลักทรัพย์
- เมื่อมีเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงก่อนครบกำหนดตามที่ระบุไว้ในข้างต้น
เกิดขึ้น ให้ถือว่าหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงทั้งหมดที่ออกภายใต้ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติม
ฉบับนี้ เป็นอันต้องถึงกำหนดไถ่ถอนก่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผง
และผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงจะต้องไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงทั้งหมดดังกล่าว
ก่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผง ตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขที่ระบุไว้ใน
ข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงและข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมฉบับนี้
39. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แผง (Manner of
Repayment on Maturity Date) :
- กรณีที่ 1: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงก่อนครบกำหนด
(Auto Call Event Occurs)**
- ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงจะดำเนินการชำระหนี้เพื่อไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผง
ทั้งหมดที่ออกภายใต้ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้องให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
แผง โดยการชำระเงินค่าไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100
(หนึ่งร้อย) ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
แผงถืออยู่ และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่เกิด
เหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงก่อนครบกำหนดในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แผงก่อนครบกำหนด
- กรณีที่ 2: กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงก่อนครบกำหนด
(No Auto Call Event)**
- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final
Least Performing Security Price: SLT) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้
ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price:
KL1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงโดยชำระด้วย
เงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผง
และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แผงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final
Least Performing Security Price: SLT) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า
สำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL1) ผู้
ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผงโดยการส่งมอบ
หลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least
Performing Settlement Security) และชำระเงินสัดส่วนต่างเพื่อการชำระ

ราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระด้วยเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

“Least Performing Security” หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีอัตราร้อยละที่เปลี่ยนแปลงไปของราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายต่ำที่สุดจากราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย โดยจะคำนวณจาก [(ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ลบด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ)หารด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ] หากมีหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้ผลการคำนวณเท่ากันสองหลักทรัพย์หรือมากกว่า ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะใช้ดุลยพินิจในการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เป็น Least Performing Security สำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หากหลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้ามีเพียงหนึ่งหลักทรัพย์ ให้ Least Performing Security หมายถึงหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดชอบในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบนี้ใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

40. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
41. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษีอากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นที่เกี่ยวข้อง

42. ตัวแทนคำนวณเงิน : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Calculation Agent)
43. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Registrar)
44. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
อนุพันธ์และตัวแทนคำนวณเงิน (ถ้ามี) แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]
(Registrar and Paying Agency Agreement) (If any)

ข้อกำหนดอื่นๆ

45. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อ : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account)
46. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) : [•]
(Other Conditions)(If any)

ผู้ออกหุ้นกุดกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้
ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ช่างชัย นະวงค์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Callable Fixed Coupon Note (FCN) แบบมีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็น
หลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์

SET100 [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟทีอ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไป
ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่
ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แฝง”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคา
ฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความ
เสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับผิดชอบในผลการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้
มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระคืนใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับ
สภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบใน
การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและ
ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การ
ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์
ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีพอที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนใน
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะ
ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้
พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนในลงทุนเอง
พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของ
หนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้)อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้
คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใด
ให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำ
รับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่จำเป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Issuer)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงประเภท Callable Fixed Coupon Note (FCN) แบบมีการ
(Type of Structured Notes) ค้ำครองเงินสด ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็น
(Name of Structured Notes) องค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอน ปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Name of Noteholder)
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Noteholder Registration No.)
6. มูลค่าที่ตราไว้ : [•] บาท
(Nominal Amount)
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย : [•] หน่วย
(Number of Structured Notes offered and sold)
8. จำนวนเงินต้น : [•] บาท
(Total Principal Amount)
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
(Issue Price)
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•] บาท
(Issue Amount)
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ : [•] บาท
(Settlement Amount)
12. หลักทรัพย์อ้างอิง : หลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ซึ่งประกอบด้วย
(Underlying Securities) (1) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง : ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
(Spot Price) (1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท

14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
15. ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Callable Price) : ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
16. ราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price) : ราคาเพื่อค้ำประกันเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
17. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี (Yield Payment) : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
18. ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest Rate) : มี ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติม
19. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities Amount) : หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
** อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม*
20. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (Cash Settlement) : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ $[(\text{มูลค่าที่ตราไว้} / \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย}) - \text{จำนวนหลักทรัพย์ตามที่ตกลงจะส่งมอบ}] \times \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย}$
21. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trade Date) : [•]
22. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Date) : [•]
23. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price) : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
24. เวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time) : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
25. ตลาดหลักทรัพย์ (Exchange) : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
26. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) : [•]

ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิม ให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆ ในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันซึ่งควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

1) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันซึ่งกำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่ละกรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ

(1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

- (1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ
- 2) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ
27. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) : [•]
28. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ (Securities Settlement Date) : [•]
29. สกุลเงินที่กำหนด (Settlement Currency) : สกุลเงินบาท
30. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Restriction on Transfer) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล
31. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขั้นต่ำ (Minimum Subscription) : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และจะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

32. ประเภทดอกเบี้ย (Type of Interest) : อัตราดอกเบี้ยคงที่
33. อัตราดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี หรือ [•] ต่องวด
34. วันกำหนดชำระดอกเบี้ย (Interest Payment Date) : ชำระเป็นงวด ในวันกำหนดชำระดอกเบี้ยในแต่ละงวด
35. วิธีคำนวณดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest Calculation Method) : จำนวนดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องชำระให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย ในแต่ละวันกำหนดชำระดอกเบี้ย จะคำนวณจากมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรายถืออยู่ คูณด้วยอัตราดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต่องวด
ทั้งนี้ ในกรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่ได้รับดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยใดๆ ภายหลังจากวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด
36. ราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนกำหนด (Early Redemption Price) : ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย ตามจำนวนที่ระบุไว้ดังต่อไปนี้

ชำระเป็นเงินค่าราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในจำนวนที่คำนวณโดยอ้างอิงจากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event Observation Date) ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 39 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมนี้ บวกด้วย เงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่มีเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดเกิดขึ้นในจำนวนที่คำนวณได้จากหลักเกณฑ์การคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 35 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมนี้

37. ลักษณะการไถ่ถอน (Redemption Type) : มีโอกาสไถ่ถอนได้ก่อนครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
38. เหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event) : กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิงทุกหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Auto Call Price: KP) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ
39. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) : **กรณีที่ 1: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event Occurs)**
ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการชำระหนี้เพื่อไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดที่ออกภายใต้ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้องให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระเงินค่าไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 (หนึ่งร้อย) ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงถืออยู่และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด
- กรณีที่ 2: กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (No Auto Call Event)**
- (ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SLT) มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL1) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SLT) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของ Least Performing Security (Strike Price: KL1) แต่มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นของ Least Performing Security (Guarantee Price : KL2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

จะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least Performing Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระด้วยเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

- (ค) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SLT) น้อยกว่าราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นของ Least Performing Security (Guarantee Price: KL2) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ (Least Performing Settlement Security) และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระด้วยเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และจะชำระเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นเงินเท่ากับ [(ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นของ Least Performing Security – ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security) x จำนวนหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ] ในวันเดียวกัน

“Least Performing Security” หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีอัตราร้อยละที่เปลี่ยนแปลงไปของราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายต่ำที่สุดจากราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย โดยจะคำนวณจาก [(ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ลบด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ)หารด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ] หากมีหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้ผลการคำนวณเท่ากับสองหลักทรัพย์หรือมากกว่า ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะใช้ดุลยพินิจในการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เป็น Least Performing Security สำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หากหลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้ามีเพียงหนึ่งหลักทรัพย์ ให้ Least Performing Security หมายถึงหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดชอบในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์

ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบหนี้ใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

40. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
41. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาวะอาการที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง

42. ตัวแทนคำนวณเงิน (Calculation Agent) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
43. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Registrar) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
44. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและตัวแทนคำนวณเงิน (ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any) : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]

ข้อกำหนดอื่นๆ

45. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account) : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
46. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) (Other Conditions) (If any) : [•]

ผู้ถือหุ้นกู้ออกจะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ ลงชื่อในนามของผู้ถือหุ้นกู้ :

ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ชวงชัย นวงศ์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Accumulator แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับผิดชอบในผลการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระคืนใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้) อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Issuer)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Accumulator แบบไม่มีการค้ำครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน
(Type of Structured Notes)
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
(Name of Structured Notes)
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Name of Noteholder)
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Noteholder registration No.)
6. มูลค่าที่ตราไว้ : [•] บาท
(Nominal Amount)
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย : [•] หน่วย
(Number of Structured Notes offered and sold)
8. จำนวนเงินต้น : [•] บาท
(Total Principal Amount)
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
(Issue Price)
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•] บาท
(Issue Amount)
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ : [•] บาท
(Settlement Amount)
12. หลักทรัพย์อ้างอิง : หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]
(Underlying Securities)
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง : [•] บาท
(Spot Price)
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย : [•] บาท
(Strike Price)
15. ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Price) : [•] บาท

16. ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครอง : ไม่มี
เงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price)
17. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
(Yield Payment)
18. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ : ส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ เป็นจำนวนเท่ากับ
(Settlement Securities Amount) จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบในแต่ละวัน
** อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม*
19. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ [(มูลค่าที่ตราไว้ / ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย) –
(Cash Settlement) จำนวนหลักทรัพย์ตามทีตกลงจะส่งมอบ) x ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย]
20. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มี : [•]
อนุพันธ์แฝง (Trade Date)
21. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Issue Date)
22. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่า
(Final Security Price) หลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลาดำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
23. เวลาดำหนดค่า : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
หลักทรัพย์ (Valuation Time)
24. ตลาดหลักทรัพย์ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
(Exchange)
25. วันกำหนดค่า : [•]
หลักทรัพย์ (Valuation Date)

ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันที่หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันที่หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้ค่าต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

- 1) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลาที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ
 - (1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว
 - (1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ
- 2) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

26. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) : [•]
27. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ (Securities Settlement Date) : [•]
28. สกุลเงินที่กำหนด (Settlement Currency) : สกุลเงินบาท
29. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Restriction on Transfer) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่า

ทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล

30. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และขั้นต่ำ (Minimum Subscription) จะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

31. ลักษณะการไถ่ถอน : ไถ่ถอนเมื่อเกิด Trigger Event หรือเมื่อครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Redemption Type)
32. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) : **กรณีที่ 1: กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Trigger/Auto Call Event)**

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทยอยชำระหนี้เพื่อไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ เป็นจำนวนเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบในแต่ละวัน คุณด้วย จำนวนวันในแต่ละรอบชำระราคา โดยหากจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต้องส่งมอบให้แก่ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง มีหน่วยย่อย (Odd Lot) ของ 1 (หนึ่ง) หน่วยการซื้อขายที่กำหนดโดยตลาดหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะตัดจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) ดังกล่าวนั้นออก และจะชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง แทนการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงที่เป็นหน่วยย่อยนั้น

กรณีที่ 2: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trigger/Auto Call Event Occurs)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด โดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นจำนวนเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบในแต่ละวัน คุณด้วย จำนวนวันตั้งแต่วันเริ่มต้นของรอบชำระราคานั้น จนถึง (แต่ไม่นับรวม) วันที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด และชำระเงินสดส่วนต่าง (ถ้ามี) และชำระเงินเป็นจำนวนเท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย คุณด้วย จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบในแต่ละวัน คุณด้วย จำนวนวันตั้งแต่ (และรวมถึง) วันที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดจนถึง (และรวมถึง) วันกำหนดค่าหลักทรัพย์

“เหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trigger Event)” หมายถึง กรณีที่ [ราคาปิด/ราคาต่ำสุด] ของหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Trigger Event Observation Date(s)) น้อยกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดชอบในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มี

การส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบ
หลักทรัพย์ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้
ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและ
ชำระเงินดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบ
ใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

33. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
34. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษี
อากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นที่เกี่ยวข้อง

35. ตัวแทนคำนวณเงิน (Calculation Agent) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
36. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Registrar) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
37. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้
อนุพันธ์และตัวแทนคำนวณเงิน (ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any) : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]

ข้อกำหนดอื่นๆ

38. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account) (If any) : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
39. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) (Other Conditions) (If any) : [•]

ผู้ถือหุ้นกู้ตกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้
ลงชื่อในนามของผู้ถือหุ้นกู้ :

ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ชวงชัย นวงค์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Decumulator แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / หน่วย

ลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับผิดชอบในผลการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระคืนใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนในลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้)อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆ กับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issuer) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Type of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Decumulator แบบไม่มีการค้ำครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Noteholder) : [•]
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Noteholder registration No.) : [•]
6. มูลค่าที่ตราไว้ (Nominal Amount) : [•] บาท
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) : หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) : [•] บาท
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : [•] บาท
15. ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Price) : [•] บาท

16. ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครอง : ไม่มี
เงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price)
17. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
(Yield Payment)
18. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ : ส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง ในวันที่เกิด Trigger Event เป็นจำนวนเท่ากับ จำนวน
(Settlement Securities Amount) หลักทรัพย์คงเหลือที่ตกลงจะส่งมอบในแต่ละวันไปจนถึงวันไถ่ถอน
** อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม*
19. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ [หลักทรัพย์ที่จะส่งมอบแต่ละวัน x จำนวนวันทำการก่อนเกิด
(Cash Settlement) Trigger Event x ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย]
20. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มี : [•]
อนุพันธ์แฝง (Trade Date)
21. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Issue Date)
22. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่า
(Final Security Price) หลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
23. เวลากำหนดค่า : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
หลักทรัพย์(Valuation Time)
24. ตลาดหลักทรัพย์ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
(Exchange)
25. วันกำหนดค่า : [•]
หลักทรัพย์(Valuation Date)

ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้ค่าต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

3) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ

(1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

(1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ

4) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

26. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แฝง (Maturity Date) : [•]

27. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์
(Securities Settlement Date) : [•]

28. สกุลเงินที่กำหนด
(Settlement Currency) : สกุลเงินบาท

29. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
(Restriction on Transfer) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่า

ทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล

30. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และขั้นต่ำ (Minimum Subscription) จะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

31. ลักษณะการไถ่ถอน : ไถ่ถอนเมื่อเกิด Trigger Event หรือเมื่อครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Redemption Type)
32. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) : **กรณีที่ 1: กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Trigger/Auto Call Event)**

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทยอยชำระหนี้เพื่อการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระเงินค่าราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันที่ตกลงจะชำระมูลค่าหลักทรัพย์ เป็นจำนวนเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะจำหน่ายในแต่ละวัน คุณด้วย จำนวนวันในแต่ละรอบชำระราคา คุณด้วย ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย หลังหักค่าใช้จ่ายในการส่งมอบหลักทรัพย์ (ถ้ามี)

กรณีที่ 2: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trigger/Auto Call Event Occurs)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด โดยการชำระเงินค่าราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นจำนวนเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะจำหน่ายในแต่ละวัน คุณด้วย จำนวนวันตั้งแต่ (และรวมถึง) วันเริ่มต้นของรอบชำระราคานั้น จนถึง (แต่ไม่นับรวม) วันที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด คุณด้วย ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย และส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นจำนวนเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะจำหน่ายในแต่ละวัน คุณด้วย จำนวนวันตั้งแต่ (และรวมถึง) วันที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด จนถึง (และรวมถึง) วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และชำระเงินสดส่วนต่าง (ถ้ามี)

“เหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trigger Event)” หมายถึง กรณีที่ [ราคาปิด/ราคาต่ำสุด] ของหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Trigger Event Observation Date(s)) น้อยกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

33. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
34. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษีอากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง

35. ตัวแทนคำนวณเงิน (Calculation Agent) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
36. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Registrar) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
37. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ อนุพันธ์และตัวแทนคำนวณเงิน (ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any) : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]

ข้อกำหนดอื่นๆ

38. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account) (If any) : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
39. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) (Other Conditions) (If any) : [•]

ผู้ออกหุ้นกู้ออกจะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ช่างชัย นະวงค์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Basket Knock-In Knock-Out Fixed Coupon Note (Basket KIKO FCN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพยอ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย SET100 [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับผิดชอบในผลการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระเงินใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้) อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจําเป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issuer) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Type of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Basket Knock-In Knock-Out Fixed Coupon Note (Basket KIKO FCN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์ อ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Noteholder) : [•]
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Noteholder Registration No.) : [•]
6. มูลค่าที่ตราไว้ (Nominal Amount) : [•] บาท
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) : หลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ซึ่งประกอบด้วย
 - (1) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
 - (2) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
 - (3) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) : ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
 - (1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
 - (2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
 - (3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท

14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
15. ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Price) : ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
16. ราคาเพื่อกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Price) : ราคาเพื่อกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี [•] บาท
17. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี (Yield Payment) : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
18. ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest Rate) : มี ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติม
19. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities Amount) : หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบของหลักทรัพย์อ้างอิงแต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์
(1) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(2) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(3) หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•] จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
** อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม*
20. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (Cash Settlement) : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ $[(\text{มูลค่าที่ตราไว้} / \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย}) - \text{จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ}] \times \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย}$
21. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trade Date) : [•]
22. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Date) : [•]
23. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Securities Price) : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง แต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลา กำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
24. เวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time) : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
25. ตลาดหลักทรัพย์ (Exchange) : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]

26. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
(Valuation Date)

: [•]

ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีกหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีกหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆ ในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

- 1) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลาที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ

(1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะ

เกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์
ดังกล่าว

(1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปใน
ข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็น
อุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาด
หลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของ
การซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ

2) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

27. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มี : [•]
อนุพันธ์แฝง (Maturity Date)
28. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ : [•]
(Securities Settlement Date)
29. สกุลเงินที่กำหนด : สกุลเงินบาท
(Settlement Currency)
30. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น
(Restriction on Transfer) ครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้
ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้น
กู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่า
ทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการ
โอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล
31. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และ
ขั้นต่ำ (Minimum Subscription) จะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

32. ประเภทดอกเบี้ย : อัตราดอกเบี้ยคงที่
(Type of Interest)
33. อัตราดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ร้อยละ [•] ต่อปี หรือ [•] ต่องวด
(Interest Rate)
34. วันกำหนดชำระดอกเบี้ย : ชำระเป็นงวด ในวันกำหนดชำระดอกเบี้ยในแต่ละงวด
(Interest Payment Date)
35. วิธีคำนวณดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มี : จำนวนดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องชำระให้แก่ผู้
อนุพันธ์แฝง (Interest Calculation Method) ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย ในแต่ละวันกำหนดชำระดอกเบี้ย จะคำนวณจาก
มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย
ถืออยู่ คูณด้วยอัตราดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต่องวด
ทั้งนี้ ในกรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด ผู้ถือหุ้น
กู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่ได้รับดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยใดๆ
ภายหลังจากวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

36. ราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ก่อนกำหนด (Early Redemption Price) : ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย ตามจำนวนที่ระบุไว้ดังต่อไปนี้
(1) ชำระเป็นเงินค่าราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในจำนวนที่คำนวณโดยอ้างอิงจากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event Observation Date) ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 40 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมนี้ บวกด้วย เงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่มีเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดเกิดขึ้นในจำนวนที่คำนวณได้จากหลักเกณฑ์การคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 35 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมนี้
37. ลักษณะการไถ่ถอน (Redemption Type) : มีโอกาสไถ่ถอนได้ก่อนครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
38. เหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event) : กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิงทุกหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันที่กำหนดเหตุการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-out Price) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

เมื่อมีเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดตามที่ระบุไว้ในข้างต้นเกิดขึ้น ให้ถือว่าหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดที่ออกภายใต้ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมฉบับนี้ เป็นอันต้องถึงกำหนดไถ่ถอนก่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดดังกล่าวก่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมฉบับนี้
39. เหตุแห่งการกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Event) : กรณีที่วันใดวันหนึ่งหากราคาปิดของหลักทรัพย์ตัวใดตัวหนึ่งในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ น้อยกว่าราคาเพื่อกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Price) ณ วันไถ่ถอนหลักทรัพย์ จะพิจารณาราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายที่ต่ำที่สุด หากต่ำกว่าราคาราคาใช้สิทธิ จะไถ่ถอนโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ แต่ถ้าหาก ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายที่ต่ำที่สุด มากกว่าหรือเท่ากับราคาใช้สิทธิ จะชำระมูลค่ารวมและดอกเบี้ยงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
40. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) : **กรณีที่ 1: เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event Occurs)**
หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security (Final Least Performing Security Price: SLT) มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอน (Knock-Out Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเท่ากับ ร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง พร้อมผลตอบแทน ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

กรณีที่ 2: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out และไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-In

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเท่ากับ ร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง พร้อมผลตอบแทน ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

กรณีที่ 3: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out และเกิดเหตุการณ์ Knock-In

กรณีที่ราคาปิดของหลักทรัพย์ตัวใดตัวหนึ่งในตะกร้า ณ วันกำหนดเหตุการณ์ Knock-In ต่ำกว่าราคา Knock-In ของหลักทรัพย์ตัวนั้น จะถือว่ามีเหตุการณ์ Knock-In เกิดขึ้น จะต้องพิจารณาว่าหลักทรัพย์ตัวใดมี Performance น้อยสุด ณ วันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ จึงจะถือเป็น Least Performing Underlying

(ก) กรณีราคาอ้างอิงของ Least Performing Underlying ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ สูงกว่าหรือเท่ากับ ราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระมูลค่ารวมและดอกเบี้ยงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ข) กรณีราคาอ้างอิงของ Least Performing Underlying ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ต่ำกว่า ราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระด้วยเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) และชำระเงินค่าผลตอบแทนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

“Least Performing Security” หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีอัตราร้อยละที่เปลี่ยนแปลงไปของราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายน้อยที่สุด โดยจะคำนวณจาก [(ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ลบด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิง)หารด้วย ราคาที่ตกลงกันไว้ล่วงหน้า สำหรับการซื้อขายของหลักทรัพย์อ้างอิง] หากมีหลักทรัพย์อ้างอิงที่ได้ผลการคำนวณเท่ากันสองหลักทรัพย์หรือมากกว่า ตัวแทนคำนวณเงินจะใช้ดุลยพินิจในการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เป็น Least Performing Security สำหรับหุ้นกู้อนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ หากหลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้ามีเพียงหนึ่งหลักทรัพย์ ให้ Least Performing Security หมายถึงหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดชอบในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินดังกล่าว

(ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบต่อหนี้ใดๆต่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

41. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
42. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษีอากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง

43. ตัวแทนคำนวณเงิน (Calculation Agent) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
44. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Registrar) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
45. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและตัวแทนคำนวณเงิน (ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any) : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]

ข้อกำหนดอื่นๆ

46. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account) : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
47. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) (Other Conditions) (If any) : [•]

ผู้ออกหุ้นกู้ตกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ช่างชัย นະวงค์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Single Stock Callable Fixed Coupon Note (FCN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้นที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพยอ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี

หลักทรัพย์ SET100 [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับประกันผลตอบแทนจากการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระคืนใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้) อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issuer) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Type of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Single Stock Callable Fixed Coupon Note (FCN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพยอ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย SET100 [•]/ หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Noteholder) : [•]
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Noteholder Registration No.) : [•]
6. มูลค่าที่ตราไว้ (Nominal Amount) : [•] บาท
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพยอ้างอิง (Underlying Securities) : หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพยอ้างอิง (Spot Price) : [•] บาท
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : [•] บาท
15. ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Callable Price) : [•] บาท

16. ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครอง : ไม่มี
เงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price)
17. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
(Yield Payment)
18. ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : มี ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติม
(Interest Rate)
19. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ : หลักทรัพย์อ้างอิง จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(Settlement Securities Amount) * อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม
20. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ $[(\text{มูลค่าที่ตราไว้} / \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย}) - \text{จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ}] \times \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย}$
(Cash Settlement)
21. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มี : [•]
อนุพันธ์แฝง (Trade Date)
22. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Issue Date)
23. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง แต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขาย
(Final Securities Price) ในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลา
กำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
24. เวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
(Valuation Time)
25. ตลาดหลักทรัพย์ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
(Exchange)
26. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ : [•]
(Valuation Date)
- ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิม ให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทีหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน
- เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆ ในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

- 1) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ
 - (1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว
 - (1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ
- 2) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

27. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มี
 อนุพันธ์แฝง (Maturity Date) : [•]
28. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์
 (Securities Settlement Date) : [•]
29. สกุลเงินที่กำหนด
 (Settlement Currency) : สกุลเงินบาท

30. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Restriction on Transfer) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์ระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล
31. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขั้นต่ำ (Minimum subscription) : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และจะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

32. ประเภทดอกเบี้ย (Type of Interest) : อัตราดอกเบี้ยคงที่
33. อัตราดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี หรือ [•] ต่องวด
34. วันกำหนดชำระดอกเบี้ย (Interest Payment Date) : ชำระเป็นงวด ในวันกำหนดชำระดอกเบี้ยในแต่ละงวด
35. วิธีคำนวณดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest Calculation Method) : จำนวนดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องชำระให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย ในแต่ละวันกำหนดชำระดอกเบี้ย จะคำนวณจากมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรายถืออยู่ คูณด้วยอัตราดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต่องวด
- ทั้งนี้ ในกรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่ได้รับดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยใดๆ ภายหลังจากวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด
36. ราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนกำหนด (Early Redemption Price) : ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย ตามจำนวนที่ระบุไว้ดังต่อไปนี้
- (1) ชำระเป็นเงินค่าราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในจำนวนที่คำนวณโดยอ้างอิงจากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event Observation Date) ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 39 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมนี้ บวกด้วย เงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่มีเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดเกิดขึ้นในจำนวนที่คำนวณได้จากหลักเกณฑ์การคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 35 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมนี้
37. ลักษณะการไถ่ถอน (Redemption Type) : มีโอกาสไถ่ถอนได้ก่อนครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
38. เหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event) : กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิงทุกหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Observation Date(s))

มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Auto Call Price) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

เมื่อมีเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดตามที่ระบุไว้ในข้างต้นเกิดขึ้น ให้ถือว่าหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดที่ออกภายใต้ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมฉบับนี้ เป็นอันต้องถึงกำหนดไถ่ถอนก่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดดังกล่าว ก่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมฉบับนี้

39. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment
on Maturity Date)

กรณีที่ 1: กรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Auto Call Event Occurs)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะดำเนินการชำระหนี้เพื่อไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงทั้งหมดที่ออกภายใต้ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้องให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระเงินค่าไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 (หนึ่งร้อย) ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงถืออยู่ และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

กรณีที่ 2: กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (No Auto Call Event)

(ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย มากกว่าหรือเท่ากับราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ ที่ตกลงจะส่งมอบ และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระด้วยเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่

มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบ
กำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดในการส่งมอบหลักทรัพย์
ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบ
หลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์
ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ออกหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินดังกล่าว
(ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบต่อหนี้ใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่
มีอนุพันธ์แฝง

40. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
41. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษีอากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง

42. ตัวแทนคำนวณเงิน (Calculation Agent) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
43. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Registrar) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
44. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและตัวแทนคำนวณเงิน (ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any) : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]

ข้อกำหนดอื่นๆ

45. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อ : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information
on Subscription Account)
46. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) : [•]
(Other Conditions) (If any)

ผู้ออกหุ้นกู้ตกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้
ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ช่างชัย นະวงค์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Single Stock Knock-In Knock-Out Fixed Coupon Note (Single Stock KIKO FCN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] /

หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับประกันผลตอบแทนการลงทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระคืนใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีพอที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้) อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issuer) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Type of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Single Stock Knock-In Knock-Out Fixed Coupon Note (Single Stock KIKO FCN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Noteholder) : [•]
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Noteholder Registration No.) : [•]
6. มูลค่าที่ตราไว้ (Nominal Amount) : [•] บาท
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) : หุ้นสามัญ/หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) : [•] บาท
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : [•] บาท
15. ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Price) : [•] บาท

16. ราคาเพื่อกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Price) : [•] บาท
17. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี (Yield Payment) : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
18. ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest Rate) : มี ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมนี้
19. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities Amount) : หลักทรัพย์อ้างอิง จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
* อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม
20. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (Cash Settlement) : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ $[(\text{มูลค่าที่ตราไว้} / \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย}) - \text{จำนวนหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ}] \times \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย}$
21. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trade Date) : [•]
22. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Date) : [•]
23. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Securities Price) : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง แต่ละหลักทรัพย์ในตะกร้าหลักทรัพย์ ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลา กำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
24. เวลา กำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time) : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
25. ตลาดหลักทรัพย์ (Exchange) : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
26. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) : [•]
- ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันที่หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันที่หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆ ในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

1) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลาที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ

(1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

(1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ

2) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

27. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มี

อนุพันธ์แฝง (Maturity Date)

: [•]

28. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์

(Securities Settlement Date)

: [•]

29. สกุลเงินที่กำหนด

(Settlement Currency)

: สกุลเงินบาท

30. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Restriction on Transfer) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล
31. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขั้นต่ำ (Minimum Subscription) : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และจะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

32. ประเภทดอกเบี้ย (Type of Interest) : อัตราดอกเบี้ยคงที่
33. อัตราดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี หรือ [•] ต่องวด
34. วันกำหนดชำระดอกเบี้ย (Interest Payment Date) : ชำระเป็นงวด ในวันกำหนดชำระดอกเบี้ยในแต่ละงวด
35. วิธีคำนวณดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Interest Calculation Method) : จำนวนดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องชำระให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย ในแต่ละวันกำหนดชำระดอกเบี้ย จะคำนวณจากมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละรายถืออยู่ คูณด้วยอัตราดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงต่องวด
- ทั้งนี้ ในกรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่ได้รับดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยใดๆ ภายหลังจากวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด
36. ราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนกำหนด (Early Redemption Price) : ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละราย ตามจำนวนที่ระบุไว้ดังต่อไปนี้
- (1) ชำระเป็นเงินค่าราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในจำนวนที่คำนวณโดยอ้างอิงจากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event Observation Date) ตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 40 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมนี้ บวกด้วย เงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดดอกเบี้ยที่มีเหตุแห่งการไถ่ถอน หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดเกิดขึ้นในจำนวนที่คำนวณได้จากหลักเกณฑ์การคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 35 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมนี้
37. ลักษณะการไถ่ถอน (Redemption Type) : มีโอกาสไถ่ถอนได้ก่อนครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
38. เหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event) : กรณีที่ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-out Price) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนี้ๆ

39. เหตุแห่งการกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Event) : กรณีที่วันใดวันหนึ่งหากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ น้อยกว่าราคาเพื่อกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-In Price) ณ วันไถ่ถอนหลักทรัพย์ จะพิจารณาราคาหลักทรัพย์อ้างอิง หากต่ำกว่าราคา ราคาใช้สิทธิ จะไถ่ถอนโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ แต่ถ้าหาก ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย มากกว่าหรือเท่ากับราคาใช้สิทธิ จะชำระมูลค่ารวมและดอกเบี้ยงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
40. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) : **กรณีที่ 1: เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event Occurs)**
หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอน (Knock-Out Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเท่ากับ ร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง พร้อมผลตอบแทน ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- กรณีที่ 2: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out และเกิดเหตุการณ์ Knock-In**
กรณีที่ราคาปิดของหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดเหตุการณ์ Knock-In ต่ำกว่าราคา Knock-In จะถือว่าไม่มีเหตุการณ์ Knock-In เกิดขึ้น จะต้องพิจารณาดังนี้
- (ก) กรณีราคาอ้างอิงของหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ สูงกว่าหรือเท่ากับ ราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระมูลค่ารวมและดอกเบี้ยงวดสุดท้าย ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- (ข) กรณีราคาอ้างอิงของหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ต่ำกว่า ราคาใช้สิทธิ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (ถ้ามี) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเลือกชำระหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (Odd Lot) (ถ้ามี) เป็นการชำระด้วยเงินซึ่งคำนวณจากราคาปิด ณ วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) และชำระเงินค่าผลตอบแทนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- กรณีที่ 3: ไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out และไม่เกิดเหตุการณ์ Knock-In**
ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระด้วยเงินเท่ากับ ร้อยละ 100 ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง พร้อมผลตอบแทน ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดชอบในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบ

หลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบหนี้ใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

41. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
42. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษีอากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง

43. ตัวแทนคำนวณเงิน (Calculation Agent) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
44. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Registrar) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
45. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและตัวแทนคำนวณเงิน (ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any) : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]

ข้อกำหนดอื่นๆ

46. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account) : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
47. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) (Other Conditions) (If any) : [•]

ผู้ถือหุ้นกู้ตกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ ลงชื่อในนามของผู้ถือหุ้นกู้ :

ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ช่างชัย นະวงค์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	

นาย สมภพ กีระสุนทรพงษ์

กรรมการ

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Knock-out Equity Linked Notes (KO-ELN) แบบมีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ.[•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับผิดชอบในผลการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระคืนใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีพอที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้อีกด้วย)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆ กับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issuer) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Type of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Knock-out Equity Linked Notes (KO-ELN) แบบมีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Noteholder) : [•]
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Noteholder Registration No.) : [•]
6. มูลค่าที่ตราไว้ (Nominal Amount) : [•] บาท
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) : หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) : [•] บาท
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : [•] บาท
15. ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Price) : [•] บาท

16. ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครอง : [•] บาท
เงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price)
17. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
(Yield Payment)
18. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ : หลักทรัพย์อ้างอิง จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(Settlement Securities Amount) * อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม
19. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ $[(\text{มูลค่าที่ตราไว้} / \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย}) - \text{จำนวนหลักทรัพย์ตามทีตกลงจะส่งมอบ}] \times \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย}$
(Cash Settlement)
20. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มี : [•]
อนุพันธ์แฝง (Trade Date)
21. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Issue Date)
22. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่า
(Final Security Price) หลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
23. เวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
(Valuation Time)
24. ตลาดหลักทรัพย์ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
(Exchange)
25. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ : [•]
(Valuation Date)

ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันที่หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันที่หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

3) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลาที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ

(1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

(1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ

4) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

26. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มี : [•]

อนุพันธ์แฝง (Maturity Date)

27. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ : [•]

(Securities Settlement Date)

28. สกุลเงินที่กำหนด : สกุลเงินบาท

(Settlement Currency)

29. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้

(Restriction on Transfer)

ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล

30. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และขั้นต่ำ (Minimum Subscription) จะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

31. ลักษณะการไถ่ถอน : ไถ่ถอนเมื่อครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเท่านั้น
(Type of Redemption)

32. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) : **กรณีไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือเงิน**

กรณีที่ 1: กรณีเกิด Knock-out Event

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง จะชำระเงินในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด เป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

กรณีที่ 2: กรณีไม่เกิด Knock-out Event

(ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง จะชำระเงินในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) น้อยกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย แต่มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น

กรณีไถ่ถอนโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา แทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (ถ้ามี) ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ค) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) น้อยกว่า ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น

กรณีไถ่ถอนโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา และจะชำระเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นเงินเท่ากับ [(ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นของ Least Performing Security – ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายของ Least Performing Security) x จำนวนหลักทรัพย์ Least Performing Security ที่ตกลงจะส่งมอบ] ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

“เหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event)” หมายถึง กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือ

เท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-out Price) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบหนี้ใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

33. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด (Default Rate) : ร้อยละ [•] ต่อปี
34. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors) : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษีอากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- รายละเอียดของบุคคลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง**
35. ตัวแทนคำนวณเงิน (Calculation Agent) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
36. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Registrar) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
37. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ อนุพันธ์และตัวแทนคำนวณเงิน (ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any) : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]

ข้อกำหนดอื่นๆ

38. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account) : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
39. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) (Other Conditions) (If any) : [•]

ผู้ออกหุ้นกู้ตกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ชวงชัย นวงศ์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Knock-out Equity Linked Notes (KO-ELN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ.[•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับประกันผลตอบแทนการลงทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระคืนใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีพอที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้อีกด้วย)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรอง ดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่คำรับรองหรือคำรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issuer) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Type of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Knock-out Equity Linked Notes (KO-ELN) แบบไม่มีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือ เงิน
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Noteholder) : [•]
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Noteholder Registration No.) : [•]
6. มูลค่าที่ตราไว้ (Nominal Amount) : [•] บาท
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) : หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) : [•] บาท
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : [•] บาท
15. ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Price) : [•] บาท

16. ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครอง : ไม่มี
เงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price)
17. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
(Yield Payment)
18. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ : หลักทรัพย์อ้างอิง จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
(Settlement Securities Amount) * อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม
19. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ $[(\text{มูลค่าที่ตราไว้} / \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย}) - \text{จำนวนหลักทรัพย์ตามทีตกลงจะส่งมอบ}] \times \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย}$
(Cash Settlement)
20. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มี : [•]
อนุพันธ์แฝง (Trade Date)
21. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : [•]
(Issue Date)
22. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่า
(Final Security Price) หลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
23. เวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
(Valuation Time)
24. ตลาดหลักทรัพย์ : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
(Exchange)
25. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ : [•]
(Valuation Date)

ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

5) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ

(1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

(1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ

6) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

26. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) : [•]
27. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ (Securities Settlement Date) : [•]
28. สกุลเงินที่กำหนด (Settlement Currency) : สกุลเงินบาท
29. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Restriction on Transfer) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล

30. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และ
ขั้นต่ำ (Minimum Subscription) จะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

31. ลักษณะการไถ่ถอน : ไถ่ถอนเมื่อครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเท่านั้น
(Type of Redemption)

32. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) : **กรณีไถ่ถอนเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง และ/หรือเงิน**

(1) กรณีเกิด Knock-out Event

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง จะชำระเงินในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด เป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(2) กรณีไม่เกิด Knock-out Event

(ก) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระเงินในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ข) หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price: ST) น้อยกว่าราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย แต่มากกว่าหรือเท่ากับราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น

กรณีไถ่ถอนโดยการส่งมอบหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ และชำระเงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา แทนการส่งมอบหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยย่อย (ถ้ามี) ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

“เหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-Out Event)” หมายถึง กรณีที่หากราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดเหตุการณ์ (Observation Date(s)) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-out Price) ก่อนครบกำหนดของหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นๆ

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดในการส่งมอบหลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบหลักทรัพย์ตามจำนวนหลักทรัพย์ดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและชำระเงินดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบต่อหนี้ใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

33. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด : ร้อยละ [•] ต่อปี
(Default Rate)

34. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษี
ให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note
to Investors) อากาศที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

รายละเอียดของบุคคลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง

35. ตัวแทนคำนวณเงิน : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Calculation Agent)

36. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Registrar)

37. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
อนุพันธ์และตัวแทนคำนวณเงิน : แฝง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]
(ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any)

ข้อกำหนดอื่นๆ

38. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อ : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Information on Subscription Account)

39. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) : [•]
(Other Conditions) (If any)

ผู้ออกหุ้นกุดังกล่าวจะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้
ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ชวงชัย นะวงศ์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	

ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ฉบับลงวันที่ [•]

สำหรับการออกและเสนอขาย

“หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท [•] Bull Principal Protection Note แบบมีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีการไถ่ถอนเป็นเงินเท่านั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•])

ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ครั้งที่ [•] ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ.[•]

ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566”

หนังสือฉบับนี้เป็นข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาสำหรับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงซึ่งรายละเอียดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกจะเป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ โดยคำนิยามที่ใช้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ให้มีความหมายตามที่ได้นิยามไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (“ข้อกำหนดสิทธิ”) ภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ครั้งที่ 1/2566 ทั้งนี้ ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้ จะต้องอ่านประกอบกับข้อกำหนดสิทธิ และให้ถือว่าข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้เป็นส่วนหนึ่งของข้อกำหนดสิทธิ

ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงสูงในการซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้ เนื่องจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงมาก และผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่รับประกันผลตอบแทนจากการขาดทุนใดๆ ที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง นอกจากนี้มูลค่าของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจถูกกระทบโดยสภาพตลาดการเงิน เนื่องจากการชำระคืนใดๆ ตามหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะอ้างอิงกับสภาพตลาดการเงิน ความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนในตลาดการเงิน ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงควรใช้วิจารณญาณอย่างรอบคอบในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ ในการตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้น ผู้ลงทุนมีความเข้าใจว่าสภาพตลาดการเงินและความผันผวนของราคาหรืออัตราแลกเปลี่ยนอาจมีผลกระทบต่อจำนวนเงินหรือผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับชำระคืน ด้วยเหตุนี้ การลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้เหมาะสมเฉพาะผู้ลงทุนที่มีความรู้และประสบการณ์ทางการเงินและธุรกิจเป็นอย่างดีที่จะทำให้ผู้ลงทุนสามารถประเมินความเสี่ยงและผลประโยชน์ตอบแทนที่จะเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ ดังนั้นก่อนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ ผู้สนใจลงทุนจะต้องมั่นใจก่อนว่าตนมีความเข้าใจในลักษณะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ประสงค์จะซื้อและขอบเขตความเสี่ยงเกี่ยวกับการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงดังกล่าว โดยผู้สนใจลงทุนได้พิจารณาอย่างรอบคอบแล้ว ถึงปัจจัยแวดล้อมทางการเงิน สถานะทางการเงิน และวัตถุประสงค์ในการลงทุนของผู้สนใจลงทุนเอง พร้อมทั้งตรวจสอบข้อมูลทั้งหมดในหนังสือชี้ชวน (รวมถึงข้อมูลในหัวข้อความเสี่ยงที่เกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวนและเอกสารฉบับนี้) อย่างละเอียดรอบคอบ)

นอกจากข้อมูลที่ระบุไว้อย่างชัดเจนในเอกสารฉบับนี้แล้ว ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้ให้หรือมอบหมายให้บุคคลใดให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองอื่นใดเกี่ยวกับหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมหรือที่เป็นการขัดกับข้อมูลหรือคำรับรองที่ได้ให้ไว้ในเอกสารฉบับนี้อีกหากบุคคลใดให้ข้อมูลหรือคำรับรองดังกล่าวแก่ผู้ลงทุน ไม่ถือว่าบุคคลผู้นั้นได้รับมอบหมายจากผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพื่อให้ข้อมูลหรือให้คำรับรองนั้นโดยเด็ดขาด

ในการลงทุนซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกเสนอขายในโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้ ผู้ลงทุนแต่ละรายขอให้คำรับรองดังนี้

- (1) ผู้ลงทุนมิได้ยึดถือในคำแนะนำของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหลัก ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้อย่างเป็นทางการและกระทำการด้วยตนเองเพื่อประโยชน์ของตนเอง ผู้ลงทุนได้ใช้ดุลยพินิจของตนเองในการวิเคราะห์ว่าการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงของโครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นนี้มีความเหมาะสมกับตนหรือไม่เพียงใด โดยได้ขอรับคำแนะนำที่เป็นจําเป็นจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญตามที่ผู้ลงทุนเห็นสมควร ผู้ลงทุนมิได้ถือเอาการติดต่อสื่อสารใดๆกับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจาว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจในการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ทั้งนี้ข้อมูลและคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเกี่ยวกับข้อกำหนดและเงื่อนไขต่างๆ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ถือว่าเป็นคำแนะนำหรือคำชี้แนะเพื่อให้ผู้ลงทุนตัดสินใจลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และการให้ข้อมูลหรือคำอธิบายของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ไม่ว่าที่เป็นลายลักษณ์อักษรหรือด้วยวาจา มิใช่การรับรองหรือการรับประกันเกี่ยวกับผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนจะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่อย่างใด
- (2) การประเมินค่าและความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน ผู้ลงทุนมีความรู้ความสามารถในการประเมินผลประโยชน์ที่จะได้รับจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ไม่ว่าจะด้วยตนเองหรือโดยได้รับคำแนะนำจากที่ปรึกษาผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญ) และมีความเข้าใจในข้อกำหนดและเงื่อนไขของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตลอดจนความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผู้ลงทุนสามารถรับความเสี่ยงที่เกิดจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้
- (3) สถานะทางกฎหมายของคู่สัญญา ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิได้กระทำการในฐานะผู้ดูแลผลประโยชน์หรือที่ปรึกษาของผู้ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายครั้งนี้

หมายเหตุ: ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ขึ้นอยู่กับลักษณะเฉพาะของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุด

รายละเอียดทั่วไปของหุ้นกู้อนุพันธ์ภายใต้โครงการออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นของบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566

1. ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issuer) : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
2. ประเภทของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Type of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Bull Principal Protection Note แบบมีการคุ้มครองเงินต้น ที่มีกำไรไถ่ถอนเป็นเงินเท่านั้น
3. ชื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Structured Notes) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้น ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ (หุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET100 [•] / ดัชนีกลุ่มหลักทรัพย์ไทย [•] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์ [•]) ที่ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ครั้งที่ 1/2566 ชุดที่ [•] อายุ [•] วันครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. [•]
4. ชื่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Name of Noteholder) : [•]
5. เลขทะเบียนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Noteholder Registration No.) : [•]
6. มูลค่าที่ตราไว้ (Nominal Amount) : [•] บาท
7. จำนวนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เสนอขาย (Number of Structured Notes offered and sold) : [•] หน่วย
8. จำนวนเงินต้น (Total Principal Amount) : [•] บาท
9. ราคาที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price) : ร้อยละ [•] ของจำนวนเงินต้น
10. มูลค่าที่เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount) : [•] บาท
11. มูลค่าจองซื้อที่ชำระ (Settlement Amount) : [•] บาท
12. หลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Securities) : หุ้นสามัญ/ดัชนี ของ [•]
13. ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) : [•] บาท
14. ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) : [•] บาท
15. ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (ถ้ามี) (Guarantee Price) : [•] บาท

16. อัตราการมีส่วนร่วม (Participation rate) [•] %
17. อัตราผลตอบแทนก่อนหักภาษี (Yield Payment) : ร้อยละ [•] ต่อปี โดยให้ 1 ปี มี 365 วัน
18. หลักทรัพย์ที่ตกลงจะส่งมอบ (Settlement Securities Amount) : หลักทรัพย์อ้างอิง จำนวนเท่ากับ [•] หุ้น
* อาจมีค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการส่งมอบ รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม
19. เงินสดส่วนต่างเพื่อการชำระราคา (Cash Settlement) : [•] บาท ซึ่งเท่ากับ $[(\text{มูลค่าที่ตราไว้} / \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย}) - \text{จำนวนหลักทรัพย์ตามที่ตกลงจะส่งมอบ}] \times \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย}$
20. วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Trade Date) : [•]
21. วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Date) : [•]
22. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price) : ราคาปิดของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) และเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time)
23. เวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Time) : เวลาปิดทำการปกติของตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์
24. ตลาดหลักทรัพย์ (Exchange) : ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย / หรือ [•]
25. วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ (Valuation Date) : [•]

ทั้งนี้ในกรณีที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด (Market Disruption Event) ในวันหรือแต่ละวันดังกล่าว หรือหากไม่ตรงกับวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ (Scheduled Trading Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิงให้เลื่อนวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ไปเป็นวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติในวันถัดไป และให้วันกำหนดค่าหลักทรัพย์นั้นเป็นวันงดซื้อขาย (Disrupted Day) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง ทั้งนี้ให้เลื่อนวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ หากภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาดดำเนินติดต่อกันเป็นเวลาสอง (2) วันหรือมากกว่านั้นหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมให้วันทำการในวันที่สอง (2) ของตลาดหลักทรัพย์หลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์เดิมเป็นวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ และวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะถูกเลื่อนเป็นวันทำการของตลาดหลักทรัพย์วันที่สอง (2) ทันทหลังจากวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ใหม่ ซึ่งจะกำหนดราคาสำหรับหลักทรัพย์อ้างอิงตามที่พิจารณาเห็นสมควรตามดุลยพินิจของตน

เพื่อประโยชน์ของวันกำหนดค่าหลักทรัพย์ ให้คำต่างๆ ดังต่อไปนี้มีความหมายตามที่ระบุไว้ดังนี้

“วันงดซื้อขาย” (Disrupted Day) หมายถึง วันที่ควรจะเป็นวันซื้อขายปกติที่ตลาดหลักทรัพย์ไม่ดำเนินการซื้อขายในระหว่างเวลาซื้อขายปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว หรือหมายถึงวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติที่เกิดภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด

“วันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ” (Schedule Trading Day) หมายถึง วันที่ตลาดหลักทรัพย์เปิดรับซื้อขายธุรกรรมต่างๆในช่วงเวลาซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“เวลาปิดทำการปกติ” (Scheduled Closing Time) ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์และวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติ หมายถึง เวลาปิดทำการปกติในวันจันทร์ – ศุกร์ของตลาดหลักทรัพย์ในวันที่ควรเป็นวันซื้อขายปกติโดยไม่นับรวมเวลาหลังเลิกทำการหรือการทำธุรกรรมซื้อขายอื่นใดนอกเวลาเปิดทำการซื้อขายตามปกติของตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

“ภาวะวิกฤตการณ์ทางตลาด” (Market Disruption Event) ในความหมายที่เกี่ยวข้องกับหลักทรัพย์อ้างอิง หมายถึง

7) การเกิดขึ้นหรือการมีอยู่ของเหตุการณ์อย่างใดอย่างหนึ่งตามที่ระบุข้างล่างนี้ในวันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์ก่อนเวลากำหนดค่าหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องซึ่งในแต่กรณีจะมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญ

(1.1) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ประกาศหยุดพักหรือจำกัดการซื้อขายใดๆ ชั่วคราว ทั้งนี้ไม่ว่าการจำกัดการซื้อขายหรือการหยุดพักการซื้อขายชั่วคราวจะเกิดขึ้นเพราะเหตุที่มีการเคลื่อนไหวราคาเกินอัตราที่ตลาดหลักทรัพย์ดังกล่าว

(1.2) เมื่อเกิดเหตุการณ์อื่นใด (นอกเหนือจากเหตุการณ์ที่จะกล่าวถึงต่อไปในข้อ (2) ข้างล่างนี้) ซึ่งพิจารณาแล้วเห็นว่าเหตุการณ์ดังกล่าวจะเป็นอุปสรรคหรือมีผลกระทบต่อความสามารถของนักลงทุนทั่วไปในตลาดหลักทรัพย์ ในการทำธุรกรรมซื้อขาย หรือต่อการกำหนดมูลค่าตลาดของการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์ หรือ

8) เมื่อตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการก่อนเวลาปิดทำการปกติในวันทำการ

26. วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) : [•]
27. วันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ (Securities Settlement Date) : [•]
28. สกุลเงินที่กำหนด (Settlement Currency) : สกุลเงินบาท
29. ข้อห้ามการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Restriction on Transfer) : หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ออกและเสนอขายภายใต้โครงการหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นครั้งที่ 1/2566 เป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ห้ามโอนเปลี่ยนมือหรือเปลี่ยนมือไม่ได้ตลอดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงขอสงวนสิทธิที่จะไม่รับจดทะเบียนการโอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ว่าทอดใดๆ ให้แก่บุคคลอื่นที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ เว้นแต่เป็นการโอนตามกฎหมายทางมรดกหรือตามคำสั่งศาล

30. จำนวนจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะต้องจองซื้อขั้นต่ำจำนวน [•] หน่วย หรือ [•] บาท และขั้นต่ำ (Minimum Subscription) จะต้องเพิ่มเป็นทวีคูณครั้งละ [•] หน่วย หรือ [•] บาท

ข้อกำหนดเกี่ยวกับการชำระดอกเบี้ยและการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

31. ลักษณะการไถ่ถอน : ไถ่ถอนเมื่อครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเท่านั้น
(Type of Redemption)
32. หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Manner of Repayment on Maturity Date) : การชำระคืนเงินต้นและดอกเบี้ย: ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะได้รับการไถ่ถอนคืนเป็นเงินสด โดยเมื่อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงครบกำหนดอายุ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะได้รับชำระผลตอบแทนขึ้นอยู่กับราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายดังนี้

กรณีที่ 1 ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้ายมากกว่าหรือเท่ากับราคาใช้สิทธิ

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระราคาด้วยเงินจำนวน (มูลค่าเงินหลักประกัน + ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง(ถ้ามี) + ผลตอบแทนพิเศษ) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยผลตอบแทนพิเศษ จะคำนวณจาก มูลค่าที่ตราไว้ \times {(ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย-ราคาใช้สิทธิ)/ ราคาใช้สิทธิ} \times อัตราการมีส่วนร่วม

กรณีที่ 2 ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย ต่ำกว่าราคาใช้สิทธิ

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระราคาด้วยเงินจำนวน (มูลค่าเงินหลักประกัน + ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง(ถ้ามี)) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ทั้งนี้ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหลุดพ้นความรับผิดชอบในการส่งมอบเงินที่ตกลงจะส่งมอบเมื่อผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ส่งมอบหรือจัดให้มีการส่งมอบเงินตามจำนวนดังกล่าว ภายในวันที่ตกลงจะส่งมอบผ่านบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เปิดไว้กับผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และเมื่อได้ส่งมอบหรือดำเนินการให้มีการส่งมอบและ/หรือชำระเงินดังกล่าว (ถ้ามี) แล้ว ให้ถือว่าผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ต้องรับผิดชอบหนี้ใดๆต่อผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

33. อัตราดอกเบี้ยผิดนัด : ร้อยละ [•] ต่อปี
(Default Rate)
34. การส่งมอบหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : ส่งมอบโดยไม่มีค่าใช้จ่าย ทั้งนี้ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็นผู้รับผิดชอบต่อภาษี
ให้แก่ผู้ลงทุน (Delivery of the Note to Investors)
อากรที่เกิดขึ้นจากการลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- รายละเอียดของบุคคลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง**
35. ตัวแทนคำนวณเงิน : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
(Calculation Agent)
36. นายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง : บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

(Registrar)

37. สัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ : [ใส่ชื่อสัญญา วันที่ และชื่อคู่สัญญาของสัญญาแต่งตั้งนายทะเบียนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์
อนุพันธ์และตัวแทนคำนวณเงิน แผลง และเอกสารอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี)]
(ถ้ามี) (Registrar and Paying Agency Agreement) (If any)

ข้อกำหนดอื่นๆ

38. รายละเอียดของบัญชีเพื่อการจองซื้อ : ตามรายละเอียดที่ระบุไว้ในใบจองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผลงที่เกี่ยวข้อง
หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผลง (Information on Subscription Account)
39. ระบุข้อกำหนดอื่นๆ (ถ้ามี) : [•]
(Other Conditions) (If any)

ผู้ออกหุ้นกู้ตกลงที่จะปฏิบัติตามข้อกำหนดที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิและข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาฉบับนี้
ลงชื่อในนามของผู้ออกหุ้นกู้ :

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แผลง
บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

ชื่อ	ตำแหน่ง	ลายมือชื่อ
นาย ช่างชัย นະวงค์	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร	
นาย สมภพ กิระสุนทรพงษ์	กรรมการ	