

|   |
|---|
| สรุปข้อมูลสำคัญของตราสารนี้เป็นส่วนหนึ่งของแบบแสดงรายการข้อมูลและหนังสือชี้ชวนซึ่งเป็นเพียงข้อมูลโดยสรุปเกี่ยวกับลักษณะและความเสี่ยงที่สำคัญของตราสารที่เสนอขายผู้ลงทุนควรถือศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนโดยละเอียดก่อนการตัดสินใจลงทุน |
| สรุปข้อมูลสำคัญของตราสาร (Fact Sheet)   |
| ชื่อบริษัท.....<br>ชื่อตราสาร.....  |

| ส่วนที่ 1 ข้อมูลผู้ออกตราสาร  |   |                             |                 |                 |  |  |  |                             |              |                 |  |  |  |
|---|---|-----------------------------|-----------------|-----------------|--|--|--|-----------------------------|--------------|-----------------|--|--|--|
| ชื่อบริษัท (ไทย) : .....<br>ชื่อบริษัท (อังกฤษ) : .....<br>ที่ตั้ง : .....<br>โทรศัพท์ : .....<br>โทรสาร : .....<br>Website : .....<br>เลขทะเบียนบริษัท : .....<br>ทุนจดทะเบียน : <input type="text"/><br>ทุนชำระแล้ว : <input type="text"/>  | อันดับความน่าเชื่อถือ :<br><table border="1"> <tr> <td>ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ</td> <td>อันดับเครดิต</td> <td>วันที่จัดอันดับ</td> </tr> <tr> <td> </td> <td> </td> <td> </td> </tr> </table> ประเภทธุรกิจ : .....<br>แบบแสดงรายการข้อมูล : .....<br>ประจำปี (URL)<br>งบการเงินงวดล่าสุด : .....<br>(URL) | ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ | อันดับเครดิต    | วันที่จัดอันดับ |  |  |  |                             |              |                 |  |  |  |
| ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ   | อันดับเครดิต  | วันที่จัดอันดับ             |                 |                 |  |  |  |                             |              |                 |  |  |  |
|   |   |                             |                 |                 |  |  |  |                             |              |                 |  |  |  |
| <b>ผู้รับประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์</b><br>ชื่อบริษัท (ไทย) : .....<br>ชื่อบริษัท (อังกฤษ) : .....<br>ที่ตั้ง : .....<br>โทรศัพท์ : .....<br>โทรสาร : .....<br>Website : .....<br>เลขทะเบียนบริษัท : .....<br>ทุนจดทะเบียน : <input type="text"/><br>ทุนชำระแล้ว : <input type="text"/> | <b>คู่สัญญาบริหารความเสี่ยง</b><br>ชื่อบริษัท (ไทย) : .....<br>ชื่อบริษัท (อังกฤษ) : .....<br>ที่ตั้ง : .....<br>โทรศัพท์ : .....<br>โทรสาร : .....<br>Website : .....<br>เลขทะเบียนบริษัท : .....<br>ทุนจดทะเบียน : <input type="text"/><br>ทุนชำระแล้ว : <input type="text"/>                               |                             |                 |                 |  |  |  |                             |              |                 |  |  |  |
| อันดับความน่าเชื่อถือ :<br><table border="1"> <tr> <td>ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ</td> <td>อันดับเครดิต</td> <td>วันที่จัดอันดับ</td> </tr> <tr> <td> </td> <td> </td> <td> </td> </tr> </table> หมายเหตุ :  | ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ   | อันดับเครดิต                | วันที่จัดอันดับ |                 |  |  | อันดับความน่าเชื่อถือ (ถ้ามี) :<br><table border="1"> <tr> <td>ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ</td> <td>อันดับเครดิต</td> <td>วันที่จัดอันดับ</td> </tr> <tr> <td> </td> <td> </td> <td> </td> </tr> </table> หมายเหตุ : | ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ | อันดับเครดิต | วันที่จัดอันดับ |  |  |  |
| ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ   | อันดับเครดิต  | วันที่จัดอันดับ             |                 |                 |  |  |  |                             |              |                 |  |  |  |
|   |   |                             |                 |                 |  |  |  |                             |              |                 |  |  |  |
| ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ   | อันดับเครดิต  | วันที่จัดอันดับ             |                 |                 |  |  |  |                             |              |                 |  |  |  |
|   |   |                             |                 |                 |  |  |  |                             |              |                 |  |  |  |
| นายทะเบียน  | ผู้ดูแลสภาพคล่อง  |                             |                 |                 |  |  |  |                             |              |                 |  |  |  |

|                             |                             |
|-----------------------------|-----------------------------|
| ชื่อบริษัท (ไทย) : .....    | ชื่อบริษัท (ไทย) : .....    |
| ชื่อบริษัท (อังกฤษ) : ..... | ชื่อบริษัท (อังกฤษ) : ..... |
| ที่ตั้ง : .....             | ที่ตั้ง : .....             |
| โทรศัพท์ : .....            | โทรศัพท์ : .....            |
| โทรสาร : .....              | โทรสาร : .....              |

วัตถุประสงค์ในการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ :

.....

.....

|   |  |                             |              |                 |       |  |  |
|---|--|-----------------------------|--------------|-----------------|-------|--|--|
| <b>ส่วนที่ 2 สารสำคัญของตราสาร</b>  |  |                             |              |                 |       |  |  |
| <b>บริษัท Underlying</b><br>ชื่อบริษัท (ไทย) : .....  | อันดับความน่าเชื่อถือ :<br><table border="1"> <tr> <td>ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ</td> <td>อันดับเครดิต</td> <td>วันที่จัดอันดับ</td> </tr> <tr> <td colspan="3">.....</td> </tr> </table>  | ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ | อันดับเครดิต | วันที่จัดอันดับ | ..... |  |  |
| ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ   | อันดับเครดิต   | วันที่จัดอันดับ             |              |                 |       |  |  |
| .....   |  |                             |              |                 |       |  |  |
| ชื่อบริษัท (อังกฤษ) : .....   | ประเภทธุรกิจ : .....   |                             |              |                 |       |  |  |
| ที่ตั้ง : .....   | แบบแสดงรายการข้อมูล : .....  |                             |              |                 |       |  |  |
| โทรศัพท์ : .....  | ประจำปี (URL) : .....  |                             |              |                 |       |  |  |
| โทรสาร : .....  | งบการเงินงวดล่าสุด (URL) : .....   |                             |              |                 |       |  |  |
| Website : .....   |  |                             |              |                 |       |  |  |
| เลขทะเบียนบริษัท : .....  |  |                             |              |                 |       |  |  |
| ทุนจดทะเบียน : <input type="text"/>   |  |                             |              |                 |       |  |  |
| ทุนชำระแล้ว : <input type="text"/>  |  |                             |              |                 |       |  |  |
| ประเภทใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ : <input type="radio"/> ประเภทสิทธิในการซื้อ (Call warrant)<br><br><input type="radio"/> ประเภทสิทธิในการขาย (Put warrant) | ประเภทหลักทรัพย์ : .....   |                             |              |                 |       |  |  |
|   | อังอิง<br>หลักทรัพย์อ้างอิง : .....  |                             |              |                 |       |  |  |
|   | ค่าความผันผวนในอดีต : ..... (ข้อมูลย้อนหลัง 90 วัน)<br>(historical volatility) ..... (ข้อมูลย้อนหลัง 120 วัน)<br>อย่างน้อย 1 ค่า โดยใช้ ..... (ข้อมูลย้อนหลัง 180 วัน)<br>ข้อมูลย้อนหลัง 90 วัน ..... (ข้อมูลย้อนหลัง 250 วัน)<br>[ทั้งนี้ ในการคำนวณ historical volatility ให้ lag ข้อมูล<br>ได้ไม่เกิน 5 วันทำการ ก่อนวันที่ขึ้นแบบแสดงรายการ<br>ข้อมูล] |                             |              |                 |       |  |  |
| ราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ : <input type="radio"/> direct listing<br><br><input type="radio"/> ..... บาท  | สูตรและปัจจัยที่ใช้ : .....  |                             |              |                 |       |  |  |
|   | [ทั้งนี้ สูตรการคำนวณราคาและปัจจัยที่ใช้ในการ<br>คำนวณเป็นไปตามแนวทางที่กำหนดโดย<br>ชมรมวาณิชธนกิจ]  |                             |              |                 |       |  |  |
|   | ในการคำนวณราคา<br>ใบสำคัญแสดงสิทธิ<br>อนุพันธ์   |                             |              |                 |       |  |  |

|  |   |
|--|---|
| ราคาใช้สิทธิ : .....   | อัตราการใช้สิทธิต่อหน่วย/ตัวคุณดัชนี : .....  |
| จำนวนหน่วยที่ : ครั้งแรก ..... หน่วย<br>บริษัทได้รับ (ครั้งนี้)<br>อนุญาตให้เสนอ รวม ..... หน่วย<br>ขาย (รวม<br>จำนวนหน่วย<br>ส่วนเพิ่ม ถ้ามี)   | วันที่ออกตราสาร/วันที่ : <input type="text"/> <input type="text"/><br>เข้าซื้อขายในตลาด<br>หลักทรัพย์ครั้งนี้ |
| ลักษณะการเสนอขาย : .....   | วันที่ออกตราสาร/วันที่ : .....  |
| อายุตราสาร : ครั้งแรก ..... หรือ .....<br>นับแต่วันที่ (ครั้งนี้)<br>ออกตราสาร/<br>วันที่เข้าซื้อ<br>ขายในตลาด<br>หลักทรัพย์<br>ครั้งนี้   | วันที่ครบกำหนดอายุ : .....  |
| วิธีการใช้สิทธิ : การใช้สิทธิได้ครั้งเดียว ณ วันหมดอายุ<br>(แบบยุโรป)  | ลักษณะการใช้สิทธิ : ได้รับชำระเงินตามส่วนต่างของราคา<br>หลักทรัพย์อ้างอิง (Cash Settlement)                   |
| ราคาอ้างอิง : <input type="radio"/> .....  | ค่าใช้จ่ายในการใช้สิทธิที่ : .....บาท<br>เรียกเก็บจากผู้ถือ   |
| ดัชนีที่ใช้ชำระราคา : <input type="radio"/> ราคาปิดของดัชนีหลักทรัพย์<br>อ้างอิง ณ วันทำการซื้อขาย<br>สุดท้าย<br><input type="radio"/> ราคาสำหรับการส่งมอบหรือ<br>ใช้อ้างอิงเพื่อคำนวณส่วนต่าง<br>ของราคาเพื่อใช้ในการชำระ<br>หนี้ในวันซื้อขายวันสุดท้าย<br>(Final Settlement Price) ของ<br>สัญญาซื้อขายล่วงหน้า Series<br>ID - ที่ประกาศโดยบริษัท<br>ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า<br>(ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)<br><input type="radio"/> ค่าเฉลี่ยของราคาปิดของดัชนี<br>หลักทรัพย์อ้างอิง 5 วันทำการ | ชื่อยกเว้นการปรับสิทธิ : .....  |

|  |  |
|--|--|
| <p>สุดท้ายจนถึง (นับรวม) วันทำการซื้อขายสุดท้าย</p>  |  |
| <p>วิธีการคำนวณเงินสด : มูลค่าเงินสดส่วนต่างต่อหน่วยของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ประเภทสิทธิในการซื้อ(Call DW) ที่คำนวณโดยผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เป็นดังนี้</p> <p>- กรณีราคาอ้างอิงสูงกว่าราคาใช้สิทธิเงินสดส่วนต่างมีมูลค่าเท่ากับส่วนต่างระหว่างราคาอ้างอิงและราคาใช้สิทธิคูณด้วยอัตราการใช้สิทธิต่อหน่วยที่บังคับใช้ในขณะนั้น กรณีอื่นๆ ให้ถือว่าเงินสดส่วนต่างมีมูลค่าเท่ากับ 0 บาท</p> | <p>ภาษีที่เกี่ยวข้อง : ผู้ใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ มีภาระภาษีที่เกิดขึ้นจากการใช้สิทธิ โดยต้องนำเงินสดส่วนต่างตามจำนวนใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ฯ ที่ใช้สิทธิไปรวมเป็นเงินได้เพื่อยื่นเสียภาษีเงินได้ตามภาระทางภาษีของผู้ใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละราย</p> <p>อัตราดอกเบี้ยคิดนัด : .....</p> <p>ข้อจำกัดการโอน : .....</p> |
| <p>กฎหมายที่ใช้บังคับ : กฎหมายไทย</p>  | <p>ลักษณะอื่น ๆ : .....</p>  |

### ส่วนที่ 3 ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ให้อธิบายลักษณะพิเศษและความเสี่ยงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่เสนอขายอย่างน้อย ดังนี้

#### 3.1 ลักษณะพิเศษของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

- กรณีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ อธิบายให้เห็นว่า ผู้ออกจะเสนอขายในตลาดหลักทรัพย์ เป็นอย่างไร เช่น การกำหนดราคา การทยอยเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โอกาสในการเพิ่มจำนวนหรือปริมาณของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และผลกระทบของการทยอยเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าว เป็นต้น และเปรียบเทียบผลที่อาจเกิดขึ้นต่อผู้ลงทุนระหว่างการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในตลาดหลักทรัพย์ ก่อนที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ครบอายุและการถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้จนครบอายุ ภาระภาษีที่อาจเกิดขึ้น และวิธีการรับชำระเงิน (cash settlement) กรณีที่ผู้ลงทุนถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จนครบอายุ
  - อธิบายให้เห็นอย่างชัดเจนเกี่ยวกับผลตอบแทน (กำไรและขาดทุน) ที่อาจจะได้รับจากการลงทุน และจำนวนเงินลงทุนสูงสุดที่มีโอกาสที่จะไม่ได้รับคืน หากผู้ลงทุนถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จนครบอายุ โดยยกตัวอย่างประกอบการคำนวณและแสดงเป็นรูปภาพ (diagram)
  - กรณีใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีทรัพย์สินเป็นประกัน อธิบายให้เห็นว่า ทรัพย์สินหน้าทีในการดูแลหลักทรัพย์อ้างอิงอย่างไร
  - อธิบายถึงเหตุแห่งการปรับสิทธิ และกรณียกเว้นการปรับสิทธิ เป็นต้น ทั้งนี้ อาจเรียงลำดับปัจจัยความเสี่ยงหรือค่าเตือนที่สำคัญมากเป็นลำดับแรก

### 3.2 ความเสี่ยงสำคัญของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

- ความเสี่ยงอันเนื่องมาจากใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีอายุจำกัด อธิบายให้เห็นว่า อายุคงเหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีผลต่อราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อย่างไร โดยเฉพาะในช่วงเวลาที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ใกล้หมดอายุ และเหตุการณ์ใดบ้างที่ผู้ลงทุนจะมีโอกาสสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หากผู้ลงทุนถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ไว้โดยมิได้จำหน่ายหรือใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ก่อนสิ้นอายุ
- ความเสี่ยงด้านราคา อธิบายถึงปัจจัยหลัก ๆ ที่มีผลกระทบต่อราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ รวมถึงอธิบายการเปลี่ยนแปลงของหลักทรัพย์อ้างอิงที่มีผลกระทบต่อราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ รวมถึงผลกระทบจากการทยอยเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ การออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์บนหลักทรัพย์อ้างอิงเดียวกันเพิ่มเติม ทั้งจากผู้ออกเดิม (further issue) หรือผู้ออกรายอื่นซึ่งอยู่ภายใต้ข้อกำหนดใดบ้าง
- ความเสี่ยงด้าน leverage อธิบายให้เห็นว่า การลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ใช้เงินลงทุนที่น้อยกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง แต่การลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจมีความผันผวนกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าว ซึ่งผู้ลงทุนมีโอกาสที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมดได้
- ความเสี่ยงที่ผู้ออกไม่จ่ายชำระคืนเงินต้น อธิบายให้เห็นว่า ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เป็นเจ้าหนี้ไม่มีประกันของผู้ออก ผู้ลงทุนจึงควรพิจารณาความน่าเชื่อถือของผู้ออกและผู้ค้ำประกันการชำระหนี้ (ถ้ามี) เป็นสำคัญ หากผู้ออกไม่จ่ายชำระคืนให้แก่ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เมื่อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ครบอายุ ผู้ลงทุนไม่มีสิทธิเรียกร้องใด ๆ ต่อผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง
- ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง อธิบายให้เห็นว่า ตลาดดังกล่าวมีตลาดรองที่รองรับการซื้อขาย เปลี่ยนมือของตลาดดังกล่าวหรือไม่ ตลอดจนความยากง่ายที่ผู้ถือตราสารจะจำหน่ายตราสารดังกล่าวก่อนครบกำหนดอายุ
- ความเสี่ยงด้านอื่น ๆ อธิบายเพิ่มเติมจากปัจจัยเสี่ยงที่เปิดเผยไว้แล้วในแบบ 69-DW-full / 56-DW / 69-DW-short เช่น ความเสี่ยงเกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง ความเสี่ยงเกี่ยวกับความเสี่ยงการปรับสิทธิ / การไม่ปรับสิทธิ เป็นต้น
- ผู้ออกเสนอขายแบบ public offering อธิบายให้เห็นว่า ในกรณีที่มีการเข้าจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ผู้จองซื้ออาจมีความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในช่วงก่อนการเข้าจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์