แบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี
ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

สิ้นสุดวันที่ 31 มีนาคม 2569

บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด

Macquarie Securities (Thailand) Limited

สารบัญ

ส่วนที่ 1 ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

1. ข้อมูลทั่วไป 1
2. ปัจจัยความเสี่ยง 3
3. ลักษณะการประกอบธุรกิจ 19
4. การจัดอันดับความน่าเชื่อถือ 20
5. การบริหารความเสี่ยง 20
6. ประวัติการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ 23
7. ความขัดแย้งทางผลประโยชน์จากการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ 40
8. โครงสร้างเงินทุน 41
9. โครงสร้างการจัดการ 42
10. ฐานะทางการเงินและผลการดำเนินงาน 45
11. ข้อมูลอื่นที่เกี่ยวข้อง 57

ส่วนที่ 2 ผู้ค้ำประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ที่เป็นคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงของบริษัทที่ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

1. ผู้ค้ำประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ 58
2. ผู้ที่เป็นคู่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อป้องกันความเสี่ยงทั้งจำนวนของบริษัทที่ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ 68
3. การติดตามข้อมูลของผู้ค้ำประกันและคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง 77

ส่วนที่ 3 รายละเอียดกรณีมีการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีประกันเต็มจำนวน หรือที่มีประกันบางส่วน (ถ้ามี) 78

ส่วนที่ 4 การรับรองความถูกต้องของข้อมูล 79

เอกสารแนบ 1

ข้อมูลเกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงและดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง 80

ส่วนที่ 1
ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

1. ข้อมูลทั่วไป

1.1 ข้อมูลที่เกี่ยวกับผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ชื่อบริษัท	:	บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด (“**บริษัท**” หรือ “**ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์**” หรือ “MSTL”)
ประเภทธุรกิจ	:	ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ โดยบริษัทได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจจาก กระทรวงการคลัง และสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“**สำนักงาน ก.ล.ต.**”) ซึ่งประกอบด้วยการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภท 1) การเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ 2) การค้าหลักทรัพย์ 3) การเป็นที่ปรึกษาการลงทุน 4) การจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ นอกจากนี้ บริษัทยังได้รับอนุญาตให้ประกอบธุรกิจเป็นผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
ที่ตั้งสำนักงานใหญ่	:	ชั้น 28 อาคาร ซี อาร์ ซี ออลซีซั่นเพลส 87/2 ถนนวิทยุ แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330
เลขทะเบียนบริษัท	:	0105539119915
เว็บไซต์	:	http://www.macquarie.com http://www.thaidw.com
โทรศัพท์	:	02-694-7999
โทรสาร	:	02-694-7878
ทุนจดทะเบียน (ณ วันที่ 31 มีนาคม 2569)	:	500,000,000 บาท ประกอบด้วยหุ้นสามัญจำนวน 50,000,000 หุ้น มูลค่าหุ้นละ 10 บาท
ทุนชำระแล้ว (ณ วันที่ 31 มีนาคม 2569)	:	500,000,000 บาท ประกอบด้วยหุ้นสามัญจำนวน 50,000,000 หุ้น มูลค่าหุ้นละ 10 บาท

1.2 ข้อมูลของบุคคลอ้างอิง

นายทะเบียนหลักทรัพย์	:	บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด 93 ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพมหานคร 10400 โทรศัพท์ 02-009-9999 โทรสาร 02-009-9991
ผู้สอบบัญชี	:	นางสาววิภาสิริ วิมานรัตน์ ผู้สอบบัญชีอนุญาตทะเบียนเลขที่ 9141 บริษัท ไพรซ์วอเตอร์เฮาส์คูเปอร์ส เอบีเอเอส จำกัด อาคารบางกอกซิตี้ทาวเวอร์ ชั้น 15 179/47-80 ถนนสาทรใต้ แขวงทุ่งมหาเมฆ เขตสาทร กทม. 10120 โทรศัพท์ 02-844-1000 โทรสาร 02-286-5050
ผู้ดูแลสภาพคล่อง	:	Macquarie Capital Securities (Singapore) Pte. Limited 9 Straits View #21-07 Marina One West Tower Singapore 018937 โทรศัพท์ 65-6601-0888

2. ปัจจัยความเสี่ยง

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นสินค้าที่ซับซ้อน และไม่เหมาะกับผู้ลงทุนที่ไม่มีประสบการณ์ ทั้งนี้ผู้ลงทุนควรทราบว่า ราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจมีการเปลี่ยนแปลงอย่างรวดเร็วซึ่งอาจทำให้สูญเสียเงินต้นทั้งหมด ดังนั้น ผู้ลงทุนควรศึกษาและทำความเข้าใจกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และความเสี่ยงต่าง ๆ ในเอกสารนี้ และจำเป็นที่ผู้ลงทุนควรปรึกษาผู้เชี่ยวชาญก่อนการลงทุน อีกทั้งผู้ลงทุนควรมีเงินทุนและสภาพคล่องที่พอเพียงเพื่อรองรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ทั้งนี้ ผู้ลงทุนไม่ควรลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ซึ่งเป็นสินค้าที่มีความซับซ้อน เว้นแต่ผู้ลงทุนมีความชำนาญ หรือ มีผู้เชี่ยวชาญเป็นผู้แนะนำ เพื่อจะได้ประเมินถึงการเคลื่อนไหวทางด้านราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ภายใต้สถานการณ์หรือเงื่อนไขต่าง ๆ รวมถึงผลกระทบต่าง ๆ ต่อราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และผลกระทบจากการลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ต่อพอร์ตการลงทุน

2.1 ความเสี่ยงด้านราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Market Risk)

ราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจมีการเปลี่ยนแปลงเนื่องมาจากปัจจัยที่เกี่ยวข้องหลายประการ และเนื่องจากใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นผลิตภัณฑ์ที่ใช้เงินลงทุนน้อยกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิง (Leverage Product) และมีการเคลื่อนไหวของราคาเปลี่ยนแปลงอย่างรวดเร็ว (High gearing) ดังนั้น ผู้ลงทุนจึงมีความเสี่ยงที่จะขาดทุนสูงสุดเท่ากับจำนวนเงินลงทุนที่ซื้อและถือครองใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น ผู้ลงทุนจึงควรเข้าใจปัจจัยต่าง ๆ ที่มีผลต่อราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ปัจจัยที่มีผลต่อราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ได้แก่

(ก) ราคาซื้อขายของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ราคาซื้อขายของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยปกติจะมีการเปลี่ยนแปลงสอดคล้องกับราคาทฤษฎี ตามสูตรการคำนวณราคาที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นำมาใช้ แต่ทั้งนี้ ราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจเปลี่ยนแปลงตามอุปสงค์และอุปทานของตลาดในขณะนั้น ๆ หรือจากธุรกรรมการซื้อหรือขาย ตามกลยุทธ์การลงทุนของผู้ลงทุน ซึ่งอาจทำให้ราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ปรับตัวสูงขึ้นหรือลดลงอย่างรวดเร็ว

(ข) ปัจจัยที่มีผลต่อการเปลี่ยนแปลงราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ตามทฤษฎี Black & Scholes' Model

เนื่องจากการคำนวณราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ส่วนใหญ่ใช้การคำนวณราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ตามทฤษฎี Black & Scholes' Model ซึ่งมีปัจจัยที่เกี่ยวข้อง ดังนี้

(กำหนดให้ปัจจัยอื่นๆมีค่าคงที่)

1. ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงหรือระดับราคาดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง (หรือระดับราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกี่ยวข้อง)
   - เมื่อราคาหลักทรัพย์อ้างอิงหรือระดับราคาดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง หรือระดับราคาของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกี่ยวข้องนั้น เพิ่มขึ้น:

     ราคา Call Warrant ส่วนใหญ่จะเพิ่มขึ้น ราคา Put Warrant ส่วนใหญ่จะลดลง
   - เมื่อราคาหลักทรัพย์อ้างอิง หรือระดับราคาดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง หรือระดับราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกี่ยวข้องนั้นลดลง:

     ราคา Call Warrant ส่วนใหญ่จะลดลง ราคา Put Warrant ส่วนใหญ่จะเพิ่มขึ้น
2. ราคาใช้สิทธิ
   - เมื่อราคาใช้สิทธิเพิ่มขึ้น: ราคา Call Warrant ส่วนใหญ่จะลดลง ราคา Put Warrant ส่วนใหญ่จะเพิ่มขึ้น

- เมื่อราคาใช้สิทธิลดลง: ราคา Call Warrant ส่วนใหญ่จะเพิ่มขึ้น ราคา Put Warrant ส่วนใหญ่จะลดลง

3. อายุคงเหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

   - เมื่ออายุคงเหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ลดน้อยลง

     ราคา Call Warrant และ Put Warrant ส่วนใหญ่จะปรับตัวลดลง

4. ความผันผวนแฝงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Implied Volatility)

   ความผันผวนแฝงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เป็นค่าความผันผวนที่อ้างอิงจากความผันผวนของราคาหลักทรัพย์อ้างอิงหรือระดับราคาดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ใช้เป็นข้อมูลอ้างอิงเพื่อแสดงถึงค่าความผันผวนของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในอนาคต

   - เมื่อความผันผวนแฝงเพิ่มขึ้น : ราคา Call Warrant และ Put Warrant ส่วนใหญ่จะเพิ่มขึ้น
   - เมื่อความผันผวนแฝงลดลง : ราคา Call Warrant และ Put Warrant ส่วนใหญ่จะลดลง

5. อัตราดอกเบี้ย

   - เมื่ออัตราดอกเบี้ยเพิ่มสูงขึ้น : ราคา Call Warrant ส่วนใหญ่จะสูงขึ้น ราคา Put Warrant ส่วนใหญ่จะลดลง
   - เมื่ออัตราดอกเบี้ยลดลง : ราคา Call Warrant ส่วนใหญ่จะลดลง ราคา Put Warrant ส่วนใหญ่จะสูงขึ้น

6. อัตราเงินปันผลของหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง

   - เมื่ออัตราเงินปันผลของหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงเพิ่มสูงขึ้น :

     ราคา Call Warrant ส่วนใหญ่จะลดลง ราคา Put Warrant ส่วนใหญ่จะเพิ่มขึ้น

   - เมื่ออัตราเงินปันผลของหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงลดลง :

     ราคา Call Warrant ส่วนใหญ่จะเพิ่มขึ้น ราคา Put Warrant ส่วนใหญ่จะลดลง

     อัตราเงินปันผลของหลักทรัพย์อ้างอิง อาจจะไม่ได้มีผลกระทบกับราคา Warrant โดยตรง ซึ่งผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะทำการปรับสิทธิตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (“**ข้อกำหนดสิทธิ**”)

ทั้งนี้ ผลกระทบของปัจจัยต่าง ๆ ดังกล่าวต่อราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจจะแตกต่างกันขึ้นกับเงื่อนไขและประเภทของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ซึ่งผู้ลงทุนควรศึกษาและทำความเข้าใจถึงความเสี่ยงของการเปลี่ยนแปลงปัจจัยต่าง ๆ จากข้อมูลใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น (กล่าวคือ แบบแสดงรายการข้อมูล และร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) เพิ่มเติมก่อนตัดสินใจลงทุน

(ค) การถูกระงับ หรือหยุดการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ซึ่งมีหุ้นเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง

ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อ้างอิงหลักทรัพย์ที่เป็นหลักทรัพย์อ้างอิงไทย มีการถูกระงับซื้อขาย หรือ หยุดส่งคำสั่งซื้อขาย (โดยการขึ้นเครื่องหมาย Suspension (SP) หรือ Halt (H) ของหลักทรัพย์อ้างอิงที่เป็นหลักทรัพย์อ้างอิงไทย) จะทำให้ผู้ลงทุนไม่สามารถซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่อ้างอิงกับหลักทรัพย์อ้างอิงนั้นได้ในช่วงเวลาเดียวกัน

ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อ้างอิงหลักทรัพย์ที่เป็นหลักทรัพย์ต่างประเทศ มีการถูกระงับซื้อขาย หรือ หยุดส่งคำสั่งซื้อขาย จะทำให้ผู้ดูแลสภาพคล่องไม่สามารถปฏิบัติหน้าที่ และส่งคำสั่งเสนอซื้อหรือขายของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่เกี่ยวข้องใน

ช่วงเวลาดังกล่าวได้ และถ้าผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ร้องขอให้พักการซื้อขาย จะส่งผลให้ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่เกี่ยวข้องถูกพักการซื้อขายและจะทำให้ผู้ลงทุนไม่สามารถซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่เกี่ยวข้องได้

ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อ้างอิงดัชนีหลักทรัพย์ การหยุดพักการซื้อขายหลักทรัพย์ที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง หรือ สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อ้างอิงกับดัชนี จะทำให้ผู้ดูแลสภาพคล่องไม่สามารถปฏิบัติหน้าที่ และส่งคำสั่งเสนอซื้อหรือขายของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น ๆ ในช่วงเวลาดังกล่าวได้

(ง) การปรับสิทธิในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ผู้ออกใบสำคัญสิทธิอนุพันธ์จะมีการปรับสิทธิ เมื่อเกิดเหตุการณ์ดังนี้

1) เมื่อบริษัทผู้ออกหุ้นอ้างอิงมีการจัดสรรหุ้นอ้างอิงใหม่ให้แก่ผู้ถือหุ้นเดิมหรือมีการเพิ่มทุน

2) เมื่อมีการจ่ายเงินปันผล และ/หรือหุ้นปันผล

3) เมื่อมีการแยกหรือรวมหุ้น

4) เหตุการณ์อื่นใดตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

กรณีที่เป็นใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในดัชนีหลักทรัพย์ จะไม่มีการปรับสิทธิ เว้นแต่จะมีเหตุการณ์อื่นใดตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิ โดยการปรับสิทธิดังกล่าวอาจส่งผลต่อการเปลี่ยนแปลงราคาใช้สิทธิ และอัตราใช้สิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์รุ่นนั้น ๆ

ทั้งนี้ วิธีการปรับสิทธิในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ให้เป็นไปตามข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ตามข้อมูลที่ระบุไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูล และร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) เพื่อให้มีความเหมาะสมกับสภาพตลาด และสถานการณ์อื่น ๆ ที่เกี่ยวข้อง

(จ) อัตราแลกเปลี่ยน

ในกรณีใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อ้างอิงดัชนีหรือหลักทรัพย์ต่างประเทศ อัตราแลกเปลี่ยนระหว่างสกุลเงินที่ใช้อ้างอิงและเงินบาทที่เปลี่ยนแปลง อาจมีผลกระทบกับราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ดังนี้

- เมื่ออัตราแลกเปลี่ยนระหว่างสกุลเงินที่ใช้อ้างอิงและเงินบาท (ซึ่งแสดงเป็นจำนวนหน่วยของสกุลเงินที่ใช้ชำระราคาต่อจำนวน 1 หน่วยของสกุลเงินที่ใช้อ้างอิง) ปรับตัวเพิ่มขึ้น (หมายถึงเงินบาทอ่อนค่า)

ราคา Call Warrant และ ราคา Put Warrant ส่วนใหญ่จะเพิ่มขึ้น

- เมื่ออัตราแลกเปลี่ยนระหว่างสกุลเงินที่ใช้อ้างอิงและเงินบาท (ซึ่งแสดงเป็นจำนวนหน่วยของสกุลเงินที่ใช้ชำระราคาต่อจำนวน 1 หน่วยของสกุลเงินที่ใช้อ้างอิง) ปรับตัวลดลง (หมายถึงเงินบาทแข็งค่า)

ราคา Call Warrant และ ราคา Put Warrant ส่วนใหญ่จะปรับตัวลดลง

ข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับความเสี่ยงจากสกุลเงินตราต่างประเทศ โปรดอ่านได้ที่ข้อ 2.9.1 ด้านล่างนี้

2.2 **ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง** (Liquidity Risk)

หมายถึง สภาพคล่องของการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจจะไม่เพียงพอ อันเนื่องจากสภาพคล่องที่ไม่พอของหลักทรัพย์อ้างอิงที่ใช้บริหารความเสี่ยง หรือในกรณีที่ผู้ดูแลสภาพคล่องได้รับการยกเว้นในการปฏิบัติหน้าที่ตามข้อยกเว้นและ/หรือเหตุขัดข้อง (เช่น การสั่งพักการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิง หรือเมื่อผู้ดูแลสภาพคล่องไม่มีใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เพียงพอที่จะปฏิบัติตามหน้าที่ เป็นต้น) ตามที่ระบุในแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และร่างหนังสือชี้ชวน และข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ซึ่งอาจส่งผลต่อราคาและการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ดังนั้น ผู้ลงทุนจะต้องศึกษากฎระเบียบ เงื่อนไข และข้อกำหนดของผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market Maker) อย่างละเอียดก่อนลงทุน

2.3 **ความเสี่ยงด้านความสามารถในการส่งมอบหลักทรัพย์ตามภาระผูกพันของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์** (Credit risk)

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นี้เป็นใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ชนิดไม่มีประกัน ความเสี่ยงของผู้ลงทุนที่ลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ จึงขึ้นกับความน่าเชื่อถือของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ค้ำประกันการชำระหนี้ หากผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือผู้ค้ำประกันการชำระหนี้ไม่สามารถชำระหนี้ หรือผิดนัดชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ลงทุนจะมีสถานะเดียวกันกับเจ้าหนี้ไม่มีประกันของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือผู้ค้ำประกันการชำระหนี้ โดยไม่คำนึงถึงผลตอบแทนของหลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะไม่ได้รับเงินคืนไม่ว่าจะเป็นเงินเต็มจำนวนหรือบางส่วนของจำนวนหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้นได้ ผู้ลงทุนไม่มีสิทธิในการเรียกร้องใด ๆ เกี่ยวกับเงื่อนไขของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ จากบริษัทผู้ออกหุ้นอ้างอิงหรือผู้จัดทำดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง

ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อย่างละเอียด เช่น ศึกษาคุณสมบัติของผู้ที่สามารถออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จากหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ฐานะทางการเงินของบริษัท อันดับความน่าเชื่อถือ ความน่าเชื่อถือของผู้ค้ำประกัน และผลการดำเนินงานที่ผ่านมา เพื่อใช้ประกอบการตัดสินใจลงทุน ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้จาก แบบแสดงรายการข้อมูล และร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Full และ แบบ 69-DW-Short) แบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี (แบบ 56-DW) ซึ่งจะปรับปรุงตามรอบระยะเวลาที่ต้องนำส่งเอกสารต่อสำนักงาน ก.ล.ต.

2.4 **ความเสี่ยงด้านการปฏิบัติการ** (Operational Risk)

ผู้ลงทุนอาจมีความเสี่ยงจากขั้นตอนการปฏิบัติงาน การส่งคำสั่งผิดพลาด การเกิดปัญหาขัดข้องของระบบงาน และระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ ซึ่งอาจก่อให้เกิดปัญหาความล่าช้าในการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ การชำระราคา หรือความเสียหายจากการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น

2.5 **ความเสี่ยงที่อาจเกิดเหตุขัดข้องในการชำระราคา และการส่งมอบ**

เหตุการณ์ขัดข้องในการชำระราคา หมายถึง เหตุการณ์ซึ่งทำให้ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ไม่สามารถชำระราคาและ/หรือส่งมอบสินทรัพย์อ้างอิง ให้/รับมอบสินทรัพย์อ้างอิงจากผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ใช้สิทธิได้ โดยเป็นเหตุการณ์ที่อยู่นอกเหนือการควบคุมของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และไม่ได้เกิดจากความผิดของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ซึ่งรวมถึงแต่ไม่จำกัดเฉพาะเหตุการณ์ดังต่อไปนี้ เช่น การเกิดสงครามหรือจลาจลในประเทศหรือต่างประเทศ หรือเหตุอื่นใดที่มีผลทำให้ไม่สามารถซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือหลักทรัพย์อ้างอิงในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยหรือ สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อ้างอิงกับดัชนีได้ตามปกติ หรือตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์อ้างอิง หรือ ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้องสั่งพักการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิง หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อ้างอิงกับดัชนี ไม่ว่าด้วยเหตุใด มีข้อกำหนดตามกฎหมายหรือคำสั่งของหน่วยงานที่เกี่ยวข้องที่มีผลกระทบต่อการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และ/หรือที่มีผลกระทบต่อการซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิง หรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง จนทำให้ไม่สามารถหาราคาอ้างอิง หรือดัชนีที่ใช้ชำระราคาได้

2.6 **ความเสี่ยงที่เกิดจากบริษัทที่ออกหลักทรัพย์อ้างอิง หรือ ดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง**

ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้นอ้างอิงกับหุ้น อาจเกิดเหตุการณ์ หรือการดำเนินการบางอย่าง (Corporate Action) ของบริษัทผู้ออกหุ้นอ้างอิง (“**บริษัทอ้างอิง**”) ที่ส่งผลกระทบต่อราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ วันครบกำหนดอายุ ราคาใช้สิทธิและอัตราใช้สิทธิ และ/หรือเงื่อนไขอื่นที่เกี่ยวข้อง ซึ่งเหตุการณ์ดังกล่าว ได้แก่

1. การจัดสรรหุ้นใหม่ให้แก่ผู้ถือหุ้นเดิมของบริษัทอ้างอิง
2. การจ่ายเงินปันผล
3. การจ่ายหุ้นปันผล
4. การแบ่งหรือรวมหุ้น
5. การควบรวมกิจการ
6. การเพิกถอนหุ้นอ้างอิงออกจากการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์อ้างอิง
7. การถูกระงับหรือหยุดซื้อขายหุ้นอ้างอิง อันเนื่องมาจากเหตุการณ์ที่ไม่ได้คาดการณ์ล่วงหน้า
8. การชำระบัญชีของบริษัทอ้างอิง

เหตุการณ์ในข้อ 1 2 3 4 และ 5 อาจส่งผลให้ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ต้องมีการปรับสิทธิในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยรายละเอียดการปรับสิทธิจะกล่าวไว้ในข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น

เหตุการณ์ในข้อ 6 อาจส่งผลให้เกิดการเพิกถอนหุ้นอ้างอิงออกจากการเป็นหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์อ้างอิงก่อนวันครบกำหนดอายุของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ จะส่งผลให้อายุที่เหลือของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ลดลงอย่างรวดเร็ว และอาจทำให้ราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ลดลงอย่างรวดเร็วเช่นกัน ในกรณีนี้ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจมีการประกาศเลื่อนวันครบกำหนดอายุของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

เหตุการณ์ในข้อ 7 อาจส่งผลให้เกิดการหยุดซื้อขายหลักทรัพย์อ้างอิง ซึ่งจะทำให้ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้นถูกระงับการซื้อขายไปด้วย

เหตุการณ์ในข้อ 8 การชำระบัญชีของบริษัทอ้างอิง หรือการถูกคำสั่งให้เลิกกิจการหรือพิทักษ์ทรัพย์เด็ดขาดจะส่งผลให้ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้นจะถูกยกเลิกไปพร้อมกันทำให้ราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจกลายเป็นศูนย์ในทันที

ผู้ลงทุนควรศึกษาวิธีการดำเนินการของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เมื่อเกิดเหตุการณ์ต่างๆที่เกี่ยวข้องโดยละเอียด โดยรายละเอียดดังกล่าวจะแสดงไว้ในข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น

กรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้นอ้างอิงกับดัชนีหลักทรัพย์ การปรับตัวคูณดัชนี และราคาใช้สิทธิตามที่ระบุไว้ในส่วนที่ 3 ของข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เป็นดังนี้

ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะไม่ทำการปรับตัวคูณดัชนีและราคาใช้สิทธิสำหรับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ซึ่งอ้างอิงกับดัชนีหลักทรัพย์ เว้นแต่หากผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เห็นว่ามีเหตุอันควรซึ่งส่งผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญต่อผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะทำการพิจารณาวิธีการที่เหมาะสมในการปรับตัวคูณดัชนีและ/หรือราคาใช้สิทธิอย่างเป็นธรรม โดยไม่ทำให้สิทธิของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ด้อยไปกว่าเดิม เพื่อลดผลกระทบต่อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จากเหตุการณ์ดังกล่าว หรือเพื่อป้องกันความเสียหายที่อาจเกิดขึ้นกับผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในทันที ตลอดจนการกำหนดวันที่มีการปรับตัวคูณดัชนีและ/หรือราคาใช้สิทธิและวันที่มีผลบังคับใช้

ทั้งนี้ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะแจ้งให้ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ทราบตามระเบียบและวิธีการของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (“**ตลาดหลักทรัพย์**”) และหน่วยงานอื่นที่เกี่ยวข้อง

2.7 ความเสี่ยงจากเหตุการณ์ที่ไม่ได้คาดการณ์ล่วงหน้า

เหตุการณ์ที่ไม่ได้คาดการณ์ล่วงหน้า ได้แก่ สภาวะทางการเมือง การคว่ำบาตร ความขัดข้องของระบบการซื้อขายส่วนกลาง ภัยธรรมชาติ ตลอดจนเหตุการณ์ใด ๆ ที่ก่อให้เกิดผลกระทบต่อการซื้อขาย ทำให้ไม่สามารถส่งคำสั่งซื้อขาย หรือเกิดความล่าช้าในการส่งคำสั่งหรือการชำระราคา ในกรณีของการคว่ำบาตร สถานณะการณ์ดังกล่าวมีการเปลี่ยนแปลงอย่างรวดเร็ว หรือเกิดเหตุการณ์อันเป็นอันตรายต่อบริษัทผู้ออกหุ้นอ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง หรือก่อให้เกิดเหตุขัดข้องอื่นใด อาจมีผลทำให้ผู้ลงทุนขาดทุนจากการลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ได้รับผลกระทบดังกล่าว

เหตุการณ์ใด ๆ ที่ก่อให้เกิดผลกระทบในช่วงวันครบกำหนดอายุ ทำให้ไม่สามารถใช้ราคาอ้างอิง หรือดัชนีที่ใช้ชำระราคา ในวันที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิ ผู้ลงทุนต้องศึกษาเงื่อนไขการกำหนดราคาอ้างอิงจากข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้นอย่างถี่ถ้วน

ในกรณีเกิดเหตุการณ์ขัดข้องในการชำระราคา (ตามที่ระบุในข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์) โดยที่ปรึกษาการเงินอิสระไม่สามารถหา “ราคายุติธรรม” ตามวิธีที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิ ทำให้ไม่สามารถคำนวณเงินสดส่วนต่างสุทธิตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจจะดำเนินการแก้ไขเปลี่ยนแปลงข้อกำหนดสิทธิได้โดยไม่ต้องขอความยินยอมจากที่ประชุมผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยเป็นที่ทราบกันว่า ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ไม่มีเงินสดส่วนต่างสุทธิ การแก้ไขเปลี่ยนแปลงดังกล่าวให้ถือเป็นประโยชน์กับผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และไม่ทำให้สิทธิประโยชน์ของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ด้อยลง

2.8 ความเสี่ยงจากการยกเลิกการคำนวณดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง หรือการเปลี่ยนแปลงวิธีการคำนวณดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงอย่างมีนัยสำคัญ

ในกรณีที่มีการยกเลิกการคำนวณดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง โดยผู้จัดทำดัชนี หรือโดยคำสั่งของตลาดหลักทรัพย์ของดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง หรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง หรือมีการเปลี่ยนแปลงสูตรการคำนวณอย่างมีนัยสำคัญซึ่งไม่เป็นไปตามเกณฑ์คำนวณ หรือการปรับฐานการคำนวณอย่างมีนัยสำคัญ หรือหลักเกณฑ์อื่น ๆ ที่ได้ประกาศไว้ก่อนที่จะมีการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นี้ ซึ่งสามารถส่งผลกระทบกับราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ ส่งผลให้ผู้ลงทุนอาจจะขาดทุนจากการซื้อขายหรือการถือครองจนถึงวันครบกำหนดอายุ ทั้งนี้เหตุการณ์ดังกล่าวสามารถมีผลกระทบอย่างมีนัยสำคัญต่อดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง ทำให้วันครบกำหนดอายุของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจปรับเปลี่ยนตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ยังคงใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิ และผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะต้องปฏิบัติตามข้อกำหนดสิทธิและดำเนินการใด ๆ เพื่อรักษาผลประโยชน์ของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะต้องดำเนินการแจ้งไปยังผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ให้ทราบถึงเหตุและการเลื่อนวันครบกำหนดอายุของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ตามส่วนที่ 3.1 ของข้อกำหนดสิทธิโดยเร็ว และเปิดเผยข้อมูลตามหลักเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์

2.9 ความเสี่ยงเพิ่มเติมในกรณีที่หลักทรัพย์อ้างอิงเป็นหลักทรัพย์ หรือดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศ

2.9.1 ความเสี่ยงจากสกุลเงินตราต่างประเทศ

การคำนวณราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่หลักทรัพย์อ้างอิงเป็นหลักทรัพย์ต่างประเทศ หรือดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศจะมีอัตราแลกเปลี่ยนเงินสกุลเงินตราต่างประเทศเข้ามาเกี่ยวข้อง ซึ่งการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนดังกล่าวอาจจะส่งผลกระทบกับราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ซื้อขายบนตลาดหลักทรัพย์ หรือมูลค่าเงินสดส่วนต่างจากการใช้สิทธิ โดยอัตราแลกเปลี่ยนระหว่างสกุลเงินจะถูกกำหนดโดยอุปสงค์และอุปทานของตลาดอัตราแลกเปลี่ยน ซึ่งได้รับผลกระทบจากปัจจัยต่าง ๆ เช่น ดุลการชำระเงินระหว่าง

ประเทศ เศรษฐกิจ และสถานะทางการเงิน การแทรกแซงตลาดอัตราแลกเปลี่ยน และการเก็งกำไร เนื่องจากความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนระหว่างสกุลเงินที่เกี่ยวข้อง ณ ตอนออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจไม่สามารถนำมาใช้กำหนดหรืออ้างอิงเพื่อคำนวณมูลค่าใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ณ ขณะใดขณะหนึ่ง

2.9.2 ความเสี่ยงจากเวลาที่แตกต่าง (Time zone difference)

เวลาทำการซื้อขายหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์ อาจมีความแตกต่างจากเวลาทำการซื้อขายหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศ ฉะนั้นใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นหลักทรัพย์ต่างประเทศ หรือดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ซื้อขายหรือจดทะเบียนบนตลาดหลักทรัพย์ อาจจะเปิดทำการซื้อขายเมื่อตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์อ้างอิง หรือ ดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงต่างประเทศหรือตลาดหลักทรัพย์ของดัชนีที่ใช้ชำระราคา (ตามความหมายที่ระบุอยู่ในข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อ้างอิงดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศ) ปิดทำการซื้อขายหรือเป็นวันหยุดทำการ โดยเหตุการณ์ดังกล่าวมีผลทำให้ผู้ดูแลสภาพคล่องไม่สามารถปฏิบัติหน้าที่ และจะส่งผลกระทบต่อสภาพคล่องของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ หรือในกรณีตลาดหลักทรัพย์ของหลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงต่างประเทศ หรือตลาดหลักทรัพย์ของดัชนีที่ใช้ชำระราคาเปิดทำการซื้อขาย ในขณะที่ตลาดหลักทรัพย์ปิดทำการซื้อขาย ราคาของหลักทรัพย์อ้างอิงหรือระดับราคาดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงอาจมีความผันผวน ซึ่งอาจส่งผลต่อราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เมื่อตลาดหลักทรัพย์กลับมาเปิดทำการซื้อขายอีกครั้ง

ทั้งนี้ช่วงเวลาในการดูแลสภาพคล่องของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ออกโดยบริษัทอาจแตกต่างจากเวลาเปิดทำการซื้อขายของของตลาดหลักทรัพย์ ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อสภาพคล่องและราคาของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้

2.9.3 ความเสี่ยงจากการเข้าถึง ข้อมูลระดับของดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศหรือราคาหลักทรัพย์ที่ล่าช้า

ผู้ลงทุนอาจจะเข้าดูข้อมูลระดับของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศจากแหล่ง อื่น ๆ ซึ่งอาจเป็นข้อมูลที่ล่าช้า ทำให้ผู้ลงทุนอาจจะไม่ได้ข้อมูลระดับของดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศล่าสุดเพื่อใช้ในการประกอบการตัดสินใจในการลงทุนได้ และจากเหตุดังกล่าวอาจจะส่งผลกระทบกับการลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้

ผู้ลงทุนสามารถเข้าเว็บไซต์ www.hkex.com.hk หรือ แหล่งอื่น ๆ ที่มีการเผยแพร่ราคาหลักทรัพย์จดทะเบียนของฮ่องกงที่ล่าช้า ผู้ลงทุนอาจจะไม่ได้ข้อมูลราคาหลักทรัพย์ล่าสุดเพื่อใช้ในการประกอบการตัดสินใจในการลงทุนได้ และจากเหตุดังกล่าวอาจจะส่งผลกระทบกับการลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้

2.10 ความเสี่ยงจากความขัดแย้ง ภัยพิบัติ หรือเหตุการณ์อันไม่คาดคิดอื่น ๆ

ธุรกิจของทางกลุ่มแมคควอรีมีความเสี่ยงจากเหตุการณ์อันไม่คาดคิด ความขัดแย้ง หรือภัยพิบัติ ซึ่งหลายเหตุการณ์อยู่เหนือการควบคุม โดยรวมถึงภัยพิบัติทางธรรมชาติ สภาพอากาศที่แปรปรวนอย่างรุนแรง การรั่วไหลการปะทุหรือการปล่อยสารอันตราย เพลิงไหม้ อุบัติเหตุทางบก หรือทางน้ำ การก่อการร้าย ความขัดแย้งด้านการทหาร รวมถึงสถานการณ์ความขัดแย้งระหว่างรัสเซียและยูเครน ความขัดแย้งระหว่างอิสราเอลและปาเลสไตน์ ความขัดแย้งระหว่างสหรัฐอเมริกา อิสราเอล และอิหร่าน ตลอดจนความขัดแย้งอื่นๆ ในภูมิภาคตะวันออกกลาง การเพิ่มขึ้นของมาตรการกีดกันทางการค้า และความตึงเครียดระหว่างจีน และไต้หวัน และสหรัฐอเมริกา หรือเหตุการณ์ขัดแย้ง และภัยพิบัติอื่นๆ

การเปลี่ยนแปลงทางด้านสภาพแวดล้อมอย่างมีนัยสำคัญ หรือเหตุการณ์ภายนอก (รวมถึงความถี่และความรุนแรงที่เพิ่มมากขึ้นของ พายุ น้ำท่วม และภัยพิบัติต่าง ๆ เช่น แผ่นดินไหว การเพิ่มขึ้นของพายุหิมะ พายุลูกเห็บ อุณหภูมิโลกร้อน ระดับน้ำทะเล โรคติดต่อ เหตุการณ์ฉุกเฉินด้านการสาธารณะสุข เหตุการณ์ความไม่สงบ เหตุการณ์ผลกระทบต่อภูมิรัฐศาสตร์ การก่อการร้าย) มีโอกาสที่จะส่งผลกระทบกับกิจกรรมทางธุรกิจ ผลกระทบต่อการปฏิบัติการ หรือชื่อเสียง การเพิ่มความเสี่ยงด้านเครดิต ความเสี่ยงทางด้านเครดิต ความเสียหายในสินทรัพย์ และผลกระทบอื่น ๆ ต่อมูลค่าทรัพย์สิน และความสามารถในการเก็บหนี้ที่ค้างชำระ

การเกิดขึ้นของเหตุการณ์ดังกล่าวอาจจะส่งผลกระทบกับการปฏิบัติหน้าที่ภายใต้สัญญาที่มีกับลูกค้า อาจส่งผลกระทบอย่างมากกับผลการดำเนินงานหรือทางด้านการเงิน และอาจส่งผลให้เกิดการดำเนินคดีทางกฎหมาย กฎเกณฑ์ และส่งผลกระทบด้านลบกับชื่อเสียงทางกลุ่มแมคควอรีอาจจะไม่สามารถดำเนินการทำประกันเพื่อครอบคลุมบางความเสี่ยงได้ และประกันที่มีอยู่อาจจะไม่เพียงพอที่จะชดเชยความเสียหาย ด้านความเสี่ยงระยะยาว ผลกระทบกับสิ่งแวดล้อม หรือผลกระทบทางด้านสังคมอาจจะทำให้ทางกลุ่มแมคควอรีต้องออกหรือหยุดประกอบธุรกิจบางประเภท นอกจากนั้นเหตุการณ์ข้างต้นหรือการเปลี่ยนแปลงทางธรรมชาติ (แล้วแต่กรณี) อาจส่งผลอย่างรุนแรงต่อกิจกรรมทางธุรกิจ ลูกค้า และความมั่นใจของนักลงทุน หรือระดับความผันผวนในตลาดการเงิน

ทางกลุ่มแมคควอรีเผชิญกับการตรวจสอบที่เพิ่มมากขึ้นจากสาธารณะ กฎหมาย และกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องกับสภาพแวดล้อม สังคม และ ธรรมาภิบาล (“ESG”) อื่น ๆ ซึ่งรวมถึง ความกังวลเกี่ยวกับการเปิดเผยข้อมูลหรือข้อความที่แสดงความเป็นมิตรต่อสังคมและ/หรือ สิ่งแวดล้อมของธุรกิจที่เกินความเป็นจริง (greenwashing) ซึ่งส่งผลต่อแบรนด์ และชื่อเสียงในกรณีที่ไม่สามารถปฏิบัติในหลาย ๆ ด้านเช่น Diversity and Inclusion การดูแลด้านสิ่งแวดล้อม การเคารพสิทธิของชนพื้นเมือง การสนับสนุนชุมชนท้องถิ่น การกำกับดูแลกิจการและความโปร่งใส และการพิจารณาปัจจัยอื่น ๆ ในเรื่อง ESG ที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินธุรกิจซึ่งรวมถึง กระบวนการลงทุนและการจัดหา นอกจากนี้เรายังเผชิญกับความต้องการจากกลุ่มผู้มีส่วนได้ส่วนเสียที่มีมุมมองแตกต่างกันในปัจจัยที่เกี่ยวข้องกับ ESG จากทั้งหน่วยงานภาครัฐ และเจ้าหน้าที่หน่วยงานกำกับดูแลจากหลากหลายภูมิภาคที่เราดำเนินการและลงทุนอยู่ การพลาดในการจัดการความเสี่ยงเหล่านี้อย่างมีประสิทธิภาพ ซึ่งรวมถึงเรื่องของการบริหารจัดการความคาดหวังเรื่อง ESG จากหลายภาคส่วน อาจส่งผลให้ไม่ปฏิบัติตามภาระผูกพันตามกฎหมาย และกระทบกับชื่อเสียงของกลุ่มแมคควอรี และส่งผลอย่างมีนัยสำคัญกับธุรกิจ ผู้มีโอกาสเป็นคู่ค้า ชื่อเสียง ความสามารถและสภาพทางการเงินได้

2.11 ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับ Digital Disruption และความเสี่ยงด้านไซเบอร์

ความเสี่ยงด้านความปลอดภัยทางไซเบอร์และข้อมูลมีการเพิ่มขึ้นสำหรับสถาบันการเงินในช่วงไม่กี่ปีที่ผ่านมา ส่วนหนึ่งเป็นเพราะการแพร่กระจายของเทคโนโลยีใหม่ๆ และความก้าวหน้าของเทคโนโลยี AI (Artificial Intelligence) โดยทางกลุ่มแมคควอรีได้พยายามป้องกันผ่านระบบมาตรการควบคุมกระบวนการ นโยบายและมาตรการป้องกันอื่นๆ ก็มิอาจรับประกันได้ว่ามาตรการดังกล่าวจะให้ความปลอดภัยอย่างแน่นอน หรือมีความสามารถในการกู้คืนระบบกลับมาได้อย่างแท้จริง เนื่องจากเทคนิคที่ใช้ในการโจมตีทางไซเบอร์มีความซับซ้อน ดำเนินการอย่างรวดเร็ว พัฒนาอย่างต่อเนื่องและส่งผลให้ยากที่จะป้องกัน ตรวจจับและตอบสนอง ทั้งนี้การโจมตีทางไซเบอร์ การทำลายข้อมูลหรือความปลอดภัยของข้อมูล หรือด้านเทคโนโลยี Disruption ของทางกลุ่มแมคควอรี หรือซัพพลายเออร์ภายนอก อาจจะส่งผลเสียต่อความสามารถในการดำเนินธุรกิจ การจัดการความเสี่ยงหรือขยายธุรกิจต่างๆได้

การนำเทคโนโลยีใหม่มาใช้อย่างแพร่หลายและการพัฒนาอย่างรวดเร็ว เช่น ความสามารถด้านการวิเคราะห์ข้อมูลและแพลตฟอร์มการซื้อขายดิจิทัลแบบบริการตนเอง กำลังเปลี่ยนแปลงพฤติกรรมของผู้บริโภคและสภาพแวดล้อมการแข่งขัน เมื่อเทคโนโลยีใหม่เหล่านี้ยังคงพัฒนาและเติบโตอย่างต่อเนื่อง อาจส่งผลกระทบในทางลบต่อธุรกิจและผลการดำเนินงานได้

2.12 ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับเงินเฟ้อ

แม้ว่าอัตราเงินเฟ้อจะปรับลดลงจากระดับสูงที่เคยเกิดขึ้นในช่วงระหว่างปี 2563 ถึง 2566 แต่อัตราเงินเฟ้อในหลายประเทศหรือหลายเขตเศรษฐกิจยังคงอยู่สูงกว่าเป้าหมายของธนาคารกลาง โดยเหตุการณ์ล่าสุดในตะวันออกกลางมีแนวโน้มที่จะผลักดันให้อัตราเงินเฟ้อเพิ่มสูงขึ้นอีกในระยะสั้น อัตราเงินเฟ้อที่อยู่ในระดับสูงอาจส่งผลให้ต้นทุนแรงงานและต้นทุนการดำเนินงานอื่น ๆ เพิ่มขึ้นเร็วกว่าปกติ ซึ่งสร้างแรงกดดันต่อค่าใช้จ่ายของทางกลุ่มได้ การดำเนินการของธนาคารกลางเพื่อรับมือกับภาวะเงินเฟ้อสูงอาจจะชะลอการเติบโตทางเศรษฐกิจ กระตุ้นให้ความผันผวนของตลาดการเงินเพิ่มมากขึ้น และเพิ่มความเสี่ยงต่อการเกิดภาวะเศรษฐกิจถดถอย ปัจจัยดังกล่าว ไม่ว่าจะเกิดขึ้นเพียงปัจจัยเดียวหรือหลายปัจจัยร่วมกัน อาจส่งผลกระทบในทางลบต่อลูกค้า ธุรกิจ และผลการดำเนินงานของทางกลุ่มได้

2.13 ความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับด้านการตลาดของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

บุคคลภายนอกอาจแสดงความเห็นเกี่ยวกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์บนโซเชียลมีเดียหรือแพลตฟอร์มอื่น ๆ เป็นครั้งคราว บุคคลเหล่านี้ไม่ว่าจะได้รับการสนับสนุนจากผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือไม่ก็ตาม ไม่ถือว่าเป็นตัวแทนของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และความคิดเห็นดังกล่าวไม่ได้เป็นคำแนะนำหรือข้อเสนอแนะใด ๆ จากผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในการลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะไม่รับผิดชอบต่อข้อความหรือการแสดงความเห็นใด ๆ ที่ทำโดยบุคคลภายนอกเหล่านี้ นักลงทุนไม่ควรใช้หรือพึ่งพาความเห็นเหล่านั้นแต่เพียงอย่างเดียวในการตัดสินใจลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

2.14 ความเสี่ยงอื่น ๆ

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นหลักทรัพย์ชนิดไม่มีทรัพย์สินเป็นประกัน ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีรายชื่ออยู่ในช่วงที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น ๆ ยังไม่ได้รับการไถ่ถอนจึงจัดเป็นเจ้าหนี้ลำดับเดียวกันกับเจ้าหนี้ของบริษัทผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ประเภทเจ้าหนี้ไม่มีหลักประกัน

การลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ลงทุนจะไม่ได้รับสิทธิประโยชน์เทียบเท่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิง หรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง เช่น สิทธิในการรับเงินปันผลจากบริษัทที่ออกหุ้นอ้างอิง สิทธิในการออกเสียงในที่ประชุมสามัญผู้ถือหุ้นของบริษัทที่ออกหุ้นอ้างอิง เป็นต้น รวมทั้งราคาใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจเคลื่อนไหวไม่สัมพันธ์กับราคาหลักทรัพย์อ้างอิง หรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง

ผู้ลงทุนที่มีความประสงค์จะถือครองใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ควรได้รับคำปรึกษาจากที่ปรึกษาทางกฎหมายเกี่ยวกับภาษีในประเทศไทยและอื่น ๆ ที่เกี่ยวข้องกับการได้มา การเป็นเจ้าของ หรือการจำหน่ายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยเฉพาะผลกระทบจากกฎหมายทางภาษีทั้งในประเทศและต่างประเทศที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ ผู้ลงทุนไม่สามารถสรุปได้ว่า ข้อสรุปทั่วไปในที่นี้ เป็นข้อเท็จจริงหรือแนวทางที่สามารถนำมาใช้กับผู้ซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละบุคคลได้ นอกจากนี้ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และบุคคลอื่นที่เกี่ยวข้องกับการจัดทำเอกสารชุดนี้ ไม่มีภาระผูกพันในการรับผิดชอบต่อผลกระทบทางภาษี หรือ มูลหนี้ที่เป็นผลมาจากการจองซื้อ การซื้อ การถือครอง หรือการจำหน่ายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ทั้งสิ้น

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นผลิตภัณฑ์ทางการเงินที่ซับซ้อนในตลาดทุนไทย ความเสี่ยงต่าง ๆ ที่ระบุไว้ในที่นี้ อาจไม่ครอบคลุมความเสี่ยงทั้งหมดที่อาจเกิดขึ้นได้ รวมทั้ง ความเสี่ยงจากเหตุการณ์ต่าง ๆ ที่อาจเกิดขึ้นนั้น ไม่สามารถคาดการณ์ได้ล่วงหน้า ดังนั้น ผู้ลงทุนควรศึกษาและรับทราบถึงข้อมูลที่เกี่ยวข้องอย่างละเอียด และตระหนักถึงข้อจำกัดต่าง ๆ ในการลงทุน เช่น การมีอายุจำกัดของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ทำให้ผู้ลงทุนต้องใช้เวลาในการพิจารณาช่วงระยะเวลาลงทุนที่เหมาะสมกับพฤติกรรมการลงทุนของตนเอง รวมทั้งค่าธรรมเนียมการซื้อขาย ค่าธรรมเนียมการใช้สิทธิ ค่าใช้จ่ายอื่น ๆ ที่เกี่ยวข้อง ผลกระทบต่อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ตนถือครองหากเกิดเหตุการณ์ต่าง ๆ ขึ้น การดูแลสภาพคล่องของผู้ดูแลสภาพคล่อง ข้อยกเว้นในการดูแลสภาพคล่อง และรวมทั้งนโยบายการบริหารความเสี่ยงของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ด้วย

คำเตือนเกี่ยวกับการใช้ดัชนีตลาดหลักทรัพย์

ดัชนี SET50

ตลาดหลักทรัพย์มิได้รับรองหรือสนับสนุน หรือส่งเสริมการขายหรือเกี่ยวข้องในทางใด ๆ กับบริษัท และ ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ใน ดัชนีตลาดหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ไม่ได้ให้คำรับรอง หรือรับประกันใด ๆ ไม่ว่าโดยชัดแจ้งหรือโดยปริยายในการใช้ ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ เช่น ดัชนีราคา SET50 Index SET100 Index ดัชนีราคากลุ่มอุตสาหกรรมและหมวดธุรกิจ และดัชนีอื่น ๆ ที่คำนวณโดยตลาดหลักทรัพย์ หรือผลลัพธ์จากการคำนวณดัชนีตลาดหลักทรัพย์ในเวลาใด ๆ ซึ่งจัดทำขึ้น และคำนวณโดยตลาดหลักทรัพย์ ตลาดหลักทรัพย์ไม่รับประกันความถูกต้องแม่นยำของดัชนีตลาดหลักทรัพย์ และ/หรือ ข้อมูลใด ๆ ที่เกี่ยวกับ ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์ไม่ต้องรับผิดชอบในความเสียหายไม่ว่าทางตรง ทางอ้อม หรือเป็นผลเกี่ยวเนื่องจากการใช้ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ ที่เกิดขึ้นต่อบุคคลใดไม่ว่ากรณีใด ๆ จากการใช้ ความผิดพลาด หรือกรณีอื่นใด แม้ว่าเป็นกรณีที่ตลาดหลักทรัพย์จงใจ หรือประมาทเลินเล่อก็ตาม ซึ่งความเสียหายรวมถึงความเสียหายจากการขาดประโยชน์จากกำไร ตลาดหลักทรัพย์ไม่มีหน้าที่ความรับผิดชอบใด ๆ ในการบอกกล่าวแนะนำถึงความเสียหายที่อาจเกิดขึ้นนั้น

ทั้งนี้ ดัชนีตลาดหลักทรัพย์เป็นเครื่องหมายการค้าของตลาดหลักทรัพย์แต่เพียงผู้เดียว ซึ่งบริษัทได้รับอนุญาตจากตลาดหลักทรัพย์ให้ใช้ในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในดัชนีตลาดหลักทรัพย์ ซึ่งเป็นผลิตภัณฑ์ทางการเงินของบริษัทได้ ทรัพย์สินทางปัญญาที่เกี่ยวเนื่องกับดัชนีตลาดหลักทรัพย์ที่เป็นของตลาดหลักทรัพย์เป็นสิทธิของตลาดหลักทรัพย์แต่เพียงผู้เดียวและการใช้ไม่ทำให้เกิดการโอนสิทธิให้แก่ผู้ใด ตลาดหลักทรัพย์ไม่มีหน้าที่ความรับผิดชอบเกี่ยวกับการจัดการ การโฆษณา การซื้อขาย และกรณีอื่น ๆ อันเกี่ยวกับผลิตภัณฑ์ทางการเงินของบริษัท

ดัชนี Hang Seng Index

The Hang Seng Index (the "Index(es)") are/is published and compiled by Hang Seng Indexes Company Limited pursuant to a licence from Hang Seng Data Services Limited. The marks and name "Hang Seng Index" are proprietary to Hang Seng Data Services Limited. Hang Seng Indexes Company Limited and Hang Seng Data Services Limited have agreed to the use of, and reference to, the Index(es) by the Issuer in connection with the warrants (the "Product"), BUT NEITHER HANG SENG INDEXES COMPANY LIMITED NOR HANG SENG DATA SERVICES LIMITED WARRANTS OR REPRESENTS OR GUARANTEES TO ANY BROKER OR HOLDER OF THE PRODUCT OR ANY OTHER PERSON (i) THE ACCURACY OR COMPLETENESS OF ANY OF THE INDEX(ES) AND ITS COMPUTATION OR ANY INFORMATION RELATED THERETO; OR (ii) THE FITNESS OR SUITABILITY FOR ANY PURPOSE OF ANY OF THE INDEX(ES) OR ANY COMPONENT OR DATA COMPRISED IN IT; OR (iii) THE RESULTS WHICH MAY BE OBTAINED BY ANY PERSON FROM THE USE OF ANY OF THE INDEX(ES) OR ANY COMPONENT OR DATA COMPRISED IN IT FOR ANY PURPOSE, AND NO WARRANTY OR REPRESENTATION OR GUARANTEE OF ANY KIND WHATSOEVER RELATING TO ANY OF THE INDEX(ES) IS GIVEN OR MAY BE IMPLIED. The process and basis of computation and compilation of any of the Index(es) and any of the related formula or formulae, constituent stocks and factors may at any time be changed or altered by Hang Seng Indexes Company Limited without notice. TO THE EXTENT PERMITTED BY APPLICABLE LAW, NO RESPONSIBILITY OR LIABILITY IS ACCEPTED BY HANG SENG INDEXES COMPANY LIMITED OR HANG SENG DATA SERVICES LIMITED (i) IN RESPECT OF THE USE OF AND/OR REFERENCE TO ANY OF THE INDEX(ES) BY THE ISSUER IN CONNECTION WITH THE PRODUCT; OR (ii) FOR ANY INACCURACIES, OMISSIONS, MISTAKES OR ERRORS OF HANG SENG INDEX(ES) COMPANY LIMITED IN THE COMPUTATION OF ANY OF THE INDEX(ES); OR (iii) FOR ANY INACCURACIES, OMISSIONS, MISTAKES, ERRORS OR INCOMPLETENESS OF ANY INFORMATION USED IN CONNECTION WITH THE COMPUTATION OF ANY OF THE INDEX(ES)

WHICH IS SUPPLIED BY ANY OTHER PERSON; OR (iv) FOR ANY ECONOMIC OR OTHER LOSS WHICH MAY BE DIRECTLY OR INDIRECTLY SUSTAINED BY ANY BROKER OR HOLDER OF THE PRODUCT OR ANY OTHER PERSON DEALING WITH THE PRODUCT AS A RESULT OF ANY OF THE AFORESAID, AND NO CLAIMS, ACTIONS OR LEGAL PROCEEDINGS MAY BE BROUGHT AGAINST HANG SENG INDEX(ES) COMPANY LIMITED AND/OR HANG SENG DATA SERVICES LIMITED in connection with the Product in any manner whatsoever by any broker, holder or other person dealing with the Product. Any broker, holder or other person dealing with the Product does so therefore in full knowledge of this disclaimer and can place no reliance whatsoever on Hang Seng Indexes Company Limited and Hang Seng Data Services Limited. For the avoidance of doubt, this disclaimer does not create any contractual or quasi-contractual relationship between any broker, holder or other person and Hang Seng Indexes Company Limited and/or Hang Seng Data Services Limited and must not be construed to have created such relationship.

ดัชนี Hang Seng TECH Index

The Hang Seng TECH Index (the "Index(es)") is/are published and compiled by Hang Seng Indexes Company Limited pursuant to a licence from Hang Seng Data Services Limited. The mark(s) and name(s) "Hang Seng TECH Index" are proprietary to Hang Seng Data Services Limited. Hang Seng Indexes Company Limited and Hang Seng Data Services Limited have agreed to the use of, and reference to, the Index(es) by the Issuer in connection with the DW (the "Product"), BUT NEITHER HANG SENG INDEXES COMPANY LIMITED NOR HANG SENG DATA SERVICES LIMITED WARRANTS OR REPRESENTS OR GUARANTEES TO ANY BROKER OR HOLDER OF THE PRODUCT OR ANY OTHER PERSON (i) THE ACCURACY OR COMPLETENESS OF ANY OF THE INDEX(ES) AND ITS COMPUTATION OR ANY INFORMATION RELATED THERETO; OR (ii) THE FITNESS OR SUITABILITY FOR ANY PURPOSE OF ANY OF THE INDEX(ES) OR ANY COMPONENT OR DATA COMPRISED IN IT; OR (iii) THE RESULTS WHICH MAY BE OBTAINED BY ANY PERSON FROM THE USE OF ANY OF THE INDEX(ES) OR ANY COMPONENT OR DATA COMPRISED IN IT FOR ANY PURPOSE, AND NO WARRANTY OR REPRESENTATION OR GUARANTEE OF ANY KIND WHATSOEVER RELATING TO ANY OF THE INDEX(ES) IS GIVEN OR MAY BE IMPLIED. The process and basis of computation and compilation of any of the Index(es) and any of the related formula or formulae, constituent stocks and factors may at any time be changed or altered by Hang Seng Indexes Company Limited without notice. TO THE EXTENT PERMITTED BY APPLICABLE LAW, NO RESPONSIBILITY OR LIABILITY IS ACCEPTED BY HANG SENG INDEXES COMPANY LIMITED OR HANG SENG DATA SERVICES LIMITED (i) IN RESPECT OF THE USE OF AND/OR REFERENCE TO ANY OF THE INDEX(ES) BY THE ISSUER IN CONNECTION WITH THE PRODUCT; OR (ii) FOR ANY INACCURACIES, OMISSIONS, MISTAKES OR ERRORS OF HANG SENG INDEXES COMPANY LIMITED IN THE COMPUTATION OF ANY OF THE INDEX(ES); OR (iii) FOR ANY INACCURACIES, OMISSIONS, MISTAKES, ERRORS OR INCOMPLETENESS OF ANY INFORMATION USED IN CONNECTION WITH THE COMPUTATION OF ANY OF THE INDEX(ES) WHICH IS SUPPLIED BY ANY OTHER PERSON; OR (iv) FOR ANY ECONOMIC OR OTHER LOSS WHICH MAY BE DIRECTLY OR INDIRECTLY SUSTAINED BY ANY BROKER OR HOLDER OF THE PRODUCT OR ANY OTHER PERSON DEALING WITH THE PRODUCT AS A RESULT OF ANY OF THE AFORESAID, AND NO CLAIMS, ACTIONS OR LEGAL PROCEEDINGS MAY BE BROUGHT AGAINST HANG SENG INDEXES COMPANY LIMITED AND/OR HANG SENG DATA SERVICES LIMITED in connection with the Product in any manner whatsoever by any broker, holder or other person dealing with the Product. Any broker, holder or other person dealing with the Product does so therefore in full knowledge of this disclaimer and can place no reliance whatsoever on Hang Seng Indexes Company Limited and Hang Seng Data Services Limited. For the avoidance of doubt, this disclaimer does not create any contractual or quasi-contractual relationship between any broker, holder or other

person and Hang Seng Indexes Company Limited and/or Hang Seng Data Services Limited and must not be construed to have created such relationship. Any broker, holder or other person dealing with the Product should be fully aware that Hang Seng Indexes Company Limited and Hang Seng Data Services Limited do not own, create, issue, offer, market, promote, sell, manage or administer the Product, and neither Hang Seng Indexes Company Limited nor Hang Seng Data Services Limited is involved with the Product or carry on the business of the Issuer or act as its agent with regard to the Product. The Issuer solely owns, creates, issues, offers, markets, promotes, sells, manages, administers, and is solely involved with, the Product and is solely responsible for the Product to any broker, holder or other person dealing with the Product and will be solely liable for any claim, loss or damages of any type arising out of or in connection with the Product and the Index.

ดัชนี Hang Seng China Enterprises Index

The Hang Seng China Enterprises Index (the "Index(es)") is/are published and compiled by Hang Seng Indexes Company Limited pursuant to a licence from Hang Seng Data Services Limited. The mark(s) and name(s) “Hang Seng China Enterprises Index” are proprietary to Hang Seng Data Services Limited. Hang Seng Indexes Company Limited and Hang Seng Data Services Limited have agreed to the use of, and reference to, the Index(es) by the Issuer in connection with DW (the "Product"), BUT NEITHER HANG SENG INDEXES COMPANY LIMITED NOR HANG SENG DATA SERVICES LIMITED WARRANTS OR REPRESENTS OR GUARANTEES TO ANY BROKER OR HOLDER OF THE PRODUCT OR ANY OTHER PERSON (i) THE ACCURACY OR COMPLETENESS OF ANY OF THE INDEX(ES) AND ITS COMPUTATION OR AN INFORMATION RELATED THERETO; OR (ii) THE FITNESS OR SUITABILITY FOR ANY PURPOSE OF ANY OF THE INDEX(ES) OR ANY COMPONENT OR DATA COMPRISED IN IT; OR (iii) THE RESULTS WHICH MAY BE OBTAINED BY ANY PERSON FROM THE USE OF ANY OF THE INDEX(ES) OR ANY COMPONENT OR DATA COMPRISED IN IT FOR ANY PURPOSE, AND NO WARRANTY OR REPRESENTATION OR GUARANTEE OF ANY KIND WHATSOEVER RELATING TO ANY OF THE INDEX(ES) IS GIVEN OR MAY BE IMPLIED. The process and basis of computation and compilation of any of the Index(es) and any of the related formula or formulae, constituent stocks and factors may at any time be changed or altered by Hang Seng Indexes Company Limited without notice. TO THE EXTENT PERMITTED BY APPLICABLE LAW, NO RESPONSIBILITY OR LIABILITY IS ACCEPTED BY HANG SENG INDEXES COMPANY LIMITED OR HANG SENG DATA SERVICES LIMITED (i) IN RESPECT OF THE USE OF AND/OR REFERENCE TO ANY OF THE INDEX(ES) BY THE ISSUER IN CONNECTION WITH THE PRODUCT; OR (ii) FOR ANY INACCURACIES, OMISSIONS, MISTAKES OR ERRORS OF HANG SENG INDEXES COMPANY LIMITED IN THE COMPUTATION OF ANY OF THE INDEX(ES); OR (iii) FOR ANY INACCURACIES, OMISSIONS, MISTAKE, ERRORS OR INCOMPLETENESS OF ANY INFORMATION USED IN CONNECTION WITH THE COMPUTATION OF ANY OF THE INDEX(ES) WHICH IS SUPPLIED BY ANY OTHER PERSON; OR (iv) FOR ANY ECONOMIC OR OTHER LOSS WHICH MAY BE DIRECTLY OR INDIRECTLY SUSTAINED BY ANY BROKER OR HOLDER OF THE PRODUCT OR ANY OTHER PERSON DEALING WITH THE PRODUCT AS A RESULT OF ANY OF THE AFORESAID, AND NO CLAIMS, ACTIONS OR LEGAL PROCEEDINGS MAY BE BROUGHT AGAINST HANG SENG INDEXES COMPANY LIMITED AND/OR HANG SENG DATA SERVICES LIMITED in connection with the Product in any manner whatsoever by any broker, holder or other person dealing with the Product. Any broker, holder or other person dealing with the Product does so therefore in full knowledge of

this disclaimer and can place no reliance whatsoever on Hang Seng Indexes Company Limited and Hang Seng Data Services Limited. For the avoidance of doubt, this disclaimer does not create any contractual or quasi-contractual relationship between any broker, holder or other person and Hang Seng Indexes Company Limited and/or Hang Seng Data Services Limited and must not be construed to have created such relationship.

ดัชนี Dow Jones Industrial Average Index

The Dow Jones Industrial Average Index is a product of S&P Dow Jones Indices LLC ("SPDJI"), and has been licensed for use by the DW Issuer. Standard & Poor's®, S&P® and S&P 500® are registered trademarks of Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P"); Dow Jones® is a registered trademark of Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones"); and these trademarks have been licensed for use by SPDJI and sublicensed for certain purposes by the DW Issuer. The DW are not sponsored, endorsed, sold or promoted by SPDJI, Dow Jones, S&P, any of their respective affiliates (collectively, "S&P Dow Jones Indices"). S&P Dow Jones Indices makes no representation or warranty, express or implied, to the owners of the DW or any member of the public regarding the advisability of investing in securities generally or in the DW particularly or the ability of the Dow Jones Industrial Average Index to track general market performance. S&P Dow Jones Indices' only relationship to the DW Issuer with respect to the Dow Jones Industrial Average Index is the licensing of the Index and certain trademarks, service marks and/or trade names of S&P Dow Jones Indices or its licensors. The Dow Jones Industrial Average Index is determined, composed and calculated by S&P Dow Jones Indices without regard to the DW Issuer or the DW. S&P Dow Jones Indices have no obligation to take the needs of the DW Issuer or the owners of the DW into consideration in determining, composing or calculating the Dow Jones Industrial Average Index. S&P Dow Jones Indices is not responsible for and has not participated in the determination of the prices, and amount of the DW or the timing of the issuance or sale of the DW or in the determination or calculation of the equation by which the DW is to be converted into cash, surrendered or redeemed, as the case may be. S&P Dow Jones Indices has no obligation or liability in connection with the administration, marketing or trading of the DW. There is no assurance that investment products based on the Dow Jones Industrial Average Index will accurately track index performance or provide positive investment returns. S&P Dow Jones Indices LLC is not an investment advisor. Inclusion of a security within an index is not a recommendation by S&P Dow Jones Indices to buy, sell, or hold such security, nor is it considered to be investment advice. Notwithstanding the foregoing, CME Group Inc. and its affiliates may independently issue and/or sponsor financial products unrelated to the DW currently being issued by the DW Issuer, but which may be similar to and competitive with the DW. In addition, CME Group Inc. and its affiliates may trade financial products which are linked to the performance of the Dow Jones Industrial Average Index.

S&P DOW JONES INDICES DOES NOT GUARANTEE THE ADEQUACY, ACCURACY, TIMELINESS AND/OR THE COMPLETENESS OF THE DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE INDEX OR ANY DATA RELATED THERETO OR ANY COMMUNICATION, INCLUDING BUT NOT LIMITED TO, ORAL OR WRITTEN COMMUNICATION (INCLUDING ELECTRONIC COMMUNICATIONS) WITH RESPECT THERETO. S&P DOW JONES INDICES SHALL NOT BE SUBJECT TO ANY DAMAGES OR LIABILITY FOR ANY ERRORS, OMISSIONS, OR DELAYS THEREIN. S&P DOW JONES INDICES MAKES NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, AND EXPRESSLY DISCLAIMS ALL WARRANTIES, OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE OR USE OR AS TO RESULTS TO BE OBTAINED BY THE DW ISSUER, OWNERS OF THE DW, OR ANY OTHER PERSON OR ENTITY FROM THE USE OF THE DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE INDEX OR WITH RESPECT

TO ANY DATA RELATED THERETO. WITHOUT LIMITING ANY OF THE FOREGOING, IN NO EVENT WHATSOEVER SHALL S&P DOW JONES INDICES BE LIABLE FOR ANY INDIRECT, SPECIAL, INCIDENTAL, PUNITIVE, OR CONSEQUENTIAL DAMAGES INCLUDING BUT NOT LIMITED TO, LOSS OF PROFITS, TRADING LOSSES, LOST TIME OR GOODWILL, EVEN IF THEY HAVE BEEN ADVISED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES, WHETHER IN CONTRACT, TORT, STRICT LIABILITY, OR OTHERWISE. THERE ARE NO THIRD PARTY BENEFICIARIES OF ANY AGREEMENTS OR ARRANGEMENTS BETWEEN S&P DOW JONES INDICES AND THE DW ISSUER, OTHER THAN THE LICENSORS OF S&P DOW JONES INDICES.

ดัชนี Nasdaq-100 Index

The DW are not sponsored, endorsed, sold or promoted by Nasdaq, Inc. or its affiliates (Nasdaq, Inc., with its affiliates, are referred to as the "Corporations"). The Corporations have not passed on the legality or suitability of, or the accuracy or adequacy of descriptions and disclosures relating to, the DW. The Corporations make no representation or warranty, express or implied to the owners of the DW or any member of the public regarding the advisability of investing in securities generally or in the DW particularly, or the ability of the NASDAQ-100 Index to track general stock market performance. The Corporations' only relationship to the DW Issuer is in the licensing of the Nasdaq®, and certain trade names of the Corporations and the use of the NASDAQ-100 Index which is determined, composed and calculated by Nasdaq, Inc. without regard to the DW Issuer or the DW. Nasdaq, Inc. has no obligation to take the needs of the DW Issuer or the owners of the DW into consideration in determining, composing or calculating the NASDAQ-100 Index. The Corporations are not responsible for and have not participated in the determination of the timing of, prices at, or quantities of the DW to be issued or in the determination or calculation of the equation by which the DW is to be converted into cash. The Corporations have no liability in connection with the administration, marketing or trading of the DW.

THE CORPORATIONS DO NOT GUARANTEE THE ACCURACY AND/OR UNINTERRUPTED CALCULATION OF THE NASDAQ-100 INDEX OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. THE CORPORATIONS MAKE NO WARRANTY, EXPRESS OR IMPLIED, AS TO RESULTS TO BE OBTAINED BY THE DW ISSUER, OWNERS OF THE DW, OR ANY OTHER PERSON OR ENTITY FROM THE USE OF THE NASDAQ-100 INDEX OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. THE CORPORATIONS MAKE NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, AND EXPRESSLY DISCLAIM ALL WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE OR USE WITH RESPECT TO THE NASDAQ-100 INDEX OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. WITHOUT LIMITING ANY OF THE FOREGOING, IN NO EVENT SHALL THE CORPORATIONS HAVE ANY LIABILITY FOR ANY LOST PROFITS OR SPECIAL, INCIDENTAL, PUNITIVE, INDIRECT, OR CONSEQUENTIAL DAMAGES, EVEN IF NOTIFIED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES.

ดัชนี S&P 500 Index

The S&P 500 Index is a product of S&P Dow Jones Indices LLC ("SPDJI"), and has been licensed for use by the DW Issuer. Standard & Poor's®, S&P® and S&P 500® are registered trademarks of Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P"); Dow Jones® is a registered trademark of Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones"); and these trademarks have been licensed for use by SPDJI and sublicensed for certain purposes by the DW Issuer. The DW are not sponsored, endorsed, sold or promoted by SPDJI, Dow Jones, S&P, any of their respective affiliates (collectively, "S&P Dow Jones Indices"). S&P Dow Jones Indices makes no representation or warranty, express or implied, to the owners of the DW or any member of the public regarding the advisability of investing in securities generally or in the DW particularly or the ability of the

S&P 500 Index to track general market performance. S&P Dow Jones Indices' only relationship to the DW Issuer with respect to the S&P 500 Index is the licensing of the Index and certain trademarks, service marks and/or trade names of S&P Dow Jones Indices or its licensors. The S&P 500 Index is determined, composed and calculated by S&P Dow Jones Indices without regard to the DW Issuer or the DW. S&P Dow Jones Indices have no obligation to take the needs of the DW Issuer or the owners of the DW into consideration in determining, composing or calculating the S&P 500 Index. S&P Dow Jones Indices is not responsible for and has not participated in the determination of the prices, and amount of the DW or the timing of the issuance or sale of the DW or in the determination or calculation of the equation by which the DW is to be converted into cash, surrendered or redeemed, as the case may be. S&P Dow Jones Indices has no obligation or liability in connection with the administration, marketing or trading of the DW. There is no assurance that investment products based on the S&P 500 Index will accurately track index performance or provide positive investment returns. S&P Dow Jones Indices LLC is not an investment advisor. Inclusion of a security within an index is not a recommendation by S&P Dow Jones Indices to buy, sell, or hold such security, nor is it considered to be investment advice. Notwithstanding the foregoing, CME Group Inc. and its affiliates may independently issue and/or sponsor financial products unrelated to the DW currently being issued by the DW Issuer, but which may be similar to and competitive with the DW. In addition, CME Group Inc. and its affiliates may trade financial products which are linked to the performance of the S&P 500 Index.

S&P DOW JONES INDICES DOES NOT GUARANTEE THE ADEQUACY, ACCURACY, TIMELINESS AND/OR THE COMPLETENESS OF THE S&P 500 INDEX OR ANY DATA RELATED THERETO OR ANY COMMUNICATION, INCLUDING BUT NOT LIMITED TO, ORAL OR WRITTEN COMMUNICATION (INCLUDING ELECTRONIC COMMUNICATIONS) WITH RESPECT THERETO. S&P DOW JONES INDICES SHALL NOT BE SUBJECT TO ANY DAMAGES OR LIABILITY FOR ANY ERRORS, OMISSIONS, OR DELAYS THEREIN. S&P DOW JONES INDICES MAKES NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, AND EXPRESSLY DISCLAIMS ALL WARRANTIES, OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE OR USE OR AS TO RESULTS TO BE OBTAINED BY THE DW ISSUER, OWNERS OF THE DW, OR ANY OTHER PERSON OR ENTITY FROM THE USE OF THE S&P 500 INDEX OR WITH RESPECT TO ANY DATA RELATED THERETO. WITHOUT LIMITING ANY OF THE FOREGOING, IN NO EVENT WHATSOEVER SHALL S&P DOW JONES INDICES BE LIABLE FOR ANY INDIRECT, SPECIAL, INCIDENTAL, PUNITIVE, OR CONSEQUENTIAL DAMAGES INCLUDING BUT NOT LIMITED TO, LOSS OF PROFITS, TRADING LOSSES, LOST TIME OR GOODWILL, EVEN IF THEY HAVE BEEN ADVISED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES, WHETHER IN CONTRACT, TORT, STRICT LIABILITY, OR OTHERWISE. THERE ARE NO THIRD PARTY BENEFICIARIES OF ANY AGREEMENTS OR ARRANGEMENTS BETWEEN S&P DOW JONES INDICES AND THE DW ISSUER, OTHER THAN THE LICENSORS OF S&P DOW JONES INDICES.

ดัชนี NIKKEI 225

The Nikkei 225 Index ("Index") is an intellectual property of Nikkei Inc. (the "Index Sponsor"), "Nikkei", "Nikkei Stock Average", and "Nikkei 225" are the service marks of the Index Sponsor. The Index Sponsor reserves all the rights, including copyright, to the Index. The DW are not in any way sponsored, endorsed or promoted by the Index Sponsor. The Index Sponsor does not make any warranty or representation whatsoever, express or implied, either as to the results to be obtained as to the use of the Index or the figure at which the Index stands at any particular day or otherwise. The Index is compiled and calculated solely by the Index Sponsor. However, the Index Sponsor shall not be liable to any person for any error in the Index

and the Index Sponsor shall not be under any obligation to advise any person, including a purchaser or vendor of the DW, of any error therein. In addition, the Index Sponsor gives no assurance regarding any modification or change in any methodology used in calculating the Index and is under no obligation to continue the calculation, publication and dissemination of the Index.

ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่อ้างอิงกับดัชนีหลักทรัพย์อื่น ๆ หรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงใหม่ ผู้ลงทุนสามารถอ่านคำเตือนเกี่ยวกับการใช้ดัชนีหลักทรัพย์ (Disclaimer) ที่เกี่ยวข้อง จากข้อกำหนดสิทธิได้

3. ลักษณะการประกอบธุรกิจ

3.1 ประวัติความเป็นมาและพัฒนาการที่สำคัญ

บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด เป็นบริษัทในเครือ Macquarie Group Limited ("MGL") ซึ่งเป็นบริษัทโฮลดิ้งและให้บริการทางการเงิน โดยหุ้นของ MGL มีการซื้อขายอยู่ในตลาดหลักทรัพย์ออสเตรเลีย มีสำนักงานใหญ่อยู่ที่ซิดนีย์ ประเทศออสเตรเลีย และถูกกำกับแบบ Non-Operating Holding Company ("NOHC") โดย Australian Prudential Regulation Authority ("APRA") โดย MGL มีต้นกำเนิดมาจากธนาคาร Hill Samuel Australia Limited ซึ่งก่อตั้งขึ้นในปี 2512 ซึ่งถือหุ้นโดย Hill Samuel & Co. Limited ลอนดอน และได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจการธนาคารในประเทศออสเตรเลีย ภายใต้ชื่อ ธนาคารแมคควอรี จำกัด ("MBL") ตั้งแต่ปี 2528 และ ในปี 2529 MBL ได้จดทะเบียนเข้าซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ออสเตรเลีย (ASX) จากการปรับโครงสร้างการดำเนินงานในปี 2550 MBL กลายมาเป็นบริษัทย่อยที่ถือหุ้นทั้งหมดโดยทางอ้อมของ MGL ซึ่งเป็นบริษัทที่จดทะเบียนใหม่ใน ASX นับตั้งแต่นั้น MGL ได้มีการขยายกิจการตามสายธุรกิจ และตามแต่ละภูมิภาค ผ่านการเติบโตภายในบริษัทเองและการควบรวมกิจการต่างๆ ข้อมูลเกี่ยวกับ MGL เพิ่มเติม สามารถอ่านข้อ 9 จากด้านล่างนี้

บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด (Macquarie Securities (Thailand) Limited หรือ "MSTL") เริ่มดำเนินธุรกิจในประเทศไทยตั้งแต่ปี 2547 โดยให้บริการด้านการซื้อขายหลักทรัพย์แก่ผู้ลงทุนสถาบันเป็นหลัก ต่อมาในปี 2548 MSTL มีการเข้าร่วมทุนกับธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) และเปลี่ยนชื่อบริษัทเป็น บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอ็มบี แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด ต่อมาในปี 2551 บริษัทได้มีการยกเลิกการร่วมทุนกับธนาคารทหารไทย เนื่องจากการปรับโครงสร้างการประกอบธุรกิจของธนาคารทหารไทย และทำให้บริษัทเปลี่ยนชื่อ และดำเนินธุรกิจภายใต้ชื่อ "บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด" ตั้งแต่ วันที่ 3 กันยายน 2551 เป็นต้นมา

ในปี 2555 MSTL ได้เปิดดำเนินธุรกิจการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อ้างอิงหลักทรัพย์ไทย หลังจากได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ต. ให้เป็นผู้ออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้เมื่อวันที่ 22 พฤษภาคม 2555 MSTL ดำเนินการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อ้างอิงกับดัชนี SET50 และดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศ ในเดือนเมษายน ปี 2557 และในเดือนสิงหาคม ปี 2562 ตามลำดับ MSTL ได้เริ่มออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่อ้างอิงหลักทรัพย์ต่างประเทศในเดือนธันวาคม ปี 2564 ปัจจุบันนี้ MSTL ได้ออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อ้างอิง หลักทรัพย์ไทย หลักทรัพย์ต่างประเทศ ดัชนี SET50 และดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศภายในหมายเลขผู้ออกเบอร์ 28

บริษัทในเครือ MGL ทำหน้าที่เป็นผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในตลาดต่างประเทศในภูมิภาคเอเชีย แปซิฟิก ทั้งในตลาดฮ่องกง สิงคโปร์ และมาเลเซีย โดยมีความมุ่งมั่นที่จะให้บริการแก่ลูกค้าอย่างดีที่สุด ไม่ว่าจะเป็นด้านการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือในด้านตราสารอนุพันธ์อื่น ๆ ยิ่งไปกว่านั้น ได้มีการพัฒนาระบบการดูแลสภาพคล่องให้มีความเหมาะสมกับตลาดทุนไทยอีกด้วย

3.2 ภาพรวมการประกอบธุรกิจ

3.2.1 ภาพรวมการประกอบธุรกิจของบริษัท

บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด ได้รับใบอนุญาตในการประกอบธุรกิจจากกระทรวงการคลัง และสำนักงาน ก.ล.ต. โดยครอบคลุมธุรกิจ ดังต่อไปนี้

1. การเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ หมายถึง การเป็นนายหน้าหรือตัวแทนเพื่อซื้อ ขาย หรือแลกเปลี่ยนหลักทรัพย์ให้แก่บุคคลอื่นเป็นทางค้าปกติ โดยได้รับค่านายหน้า ค่าธรรมเนียม หรือค่าตอบแทนอื่น โดยบริษัทให้บริการการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์แก่ผู้ลงทุนสถาบัน

2. การค้าหลักทรัพย์ หมายถึง การซื้อ ขายหรือแลกเปลี่ยนหลักทรัพย์ในนามของตนเองเป็นทางค้าปกติโดยกระทำนอกตลาดหลักทรัพย์หรือศูนย์ซื้อขายหลักทรัพย์

หมายเหตุ ปัจจุบันบริษัทไม่มีการประกอบธุรกรรมการค้าหลักทรัพย์

3. การเป็นที่ปรึกษาการลงทุน หมายถึง การให้คำแนะนำแก่ผู้ลงทุน ไม่ว่าโดยทางตรงหรือทางอ้อม เกี่ยวกับความเหมาะสมในการลงทุนในหลักทรัพย์ใด ๆ ทั้งนี้ บริษัทได้รับค่าธรรมเนียมหรือค่าตอบแทนอื่น แต่ไม่รวมถึงการให้คำแนะนำแก่ผู้ลงทุนในลักษณะที่สำนักงาน ก.ล.ต. ประกาศกำหนด

หมายเหตุ ปัจจุบันบริษัทไม่มีการดำเนินธุรกิจการเป็นที่ปรึกษาการลงทุน

4. การจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ หมายถึง การรับหลักทรัพย์ทั้งหมด หรือบางส่วนจากบริษัท หรือเจ้าของหลักทรัพย์ไปเสนอขายต่อประชาชน โดยได้รับค่าธรรมเนียมหรือค่าตอบแทนอื่น ทั้งนี้ ไม่ว่าจะมีเงื่อนไขอย่างหนึ่งอย่างใดหรือไม่ก็ตาม

นอกจากนี้ บริษัทยังได้ขึ้นทะเบียนเป็นผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับสำนักงาน ก.ล.ต. อีกด้วย

3.2.2 ภาพรวมการประกอบธุรกิจของบริษัทย่อย

ปัจจุบัน บริษัทไม่มีการลงทุนในบริษัทใดที่จะเข้าข่ายเป็นบริษัทย่อยของบริษัท

4. การจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด ยังไม่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือจากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

อย่างไรก็ดี Macquarie Financial Limited (ชื่อเดิมคือ Macquarie Financial Holdings Pty Limited) ("**ผู้ค้ำประกัน**" หรือ "MFL") ค้ำประกันการชำระหนี้ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิแก่ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดย MFL ได้รับการเพิ่มอันดับความน่าเชื่อถือครั้งล่าสุด และประกาศเมื่อวันที่ 1 กันยายน 2568 โดย ฟิทช์ เรทติ้งส์ คงอันดับความน่าเชื่อถือประเภท Long Term Issuer Default Ratings ที่ระดับ "A"

อันดับความน่าเชื่อถือที่ "A" หมายถึง มีระดับความเสี่ยงต่ำ มีความสามารถในการชำระดอกเบี้ย และคืนเงินต้นในเกณฑ์สูง แต่อาจได้รับผลกระทบในทางลบจากความเปลี่ยนแปลงทางธุรกิจและเศรษฐกิจมากกว่าบริษัทที่มีอันดับเครดิตที่สูงกว่า

ทั้งนี้ ข้อมูลอันดับความน่าเชื่อถือ ความหมายของอันดับความน่าเชื่อถือ จะแสดงไว้ในส่วนที่ 3 ของแบบแสดงรายการข้อมูล และร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Full) และหากมีการเปลี่ยนแปลงอันดับความน่าเชื่อถือดังกล่าว บริษัทจะแสดงข้อมูลการเปลี่ยนแปลงนั้น ในแบบแสดงรายการข้อมูล และร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) สำหรับการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น โดยให้ถือเอาข้อมูลในแบบแสดงรายการข้อมูล และร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) ฉบับล่าสุดเป็นหลัก

5. การบริหารความเสี่ยง

5.1 วัตถุประสงค์ในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีวัตถุประสงค์ดังต่อไปนี้

1. เพื่อช่วยพัฒนาตลาดตราสารอนุพันธ์ (Equity Derivative Product Market) ในประเทศไทย
2. เพื่อสร้างรายได้จากการดำเนินธุรกิจใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และธุรกรรมการบริหารความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธอนุพันธ์

5.2 กลยุทธ์ในการป้องกันความเสี่ยงต่าง ๆ ที่อาจเกิดขึ้น (Hedging strategy) และระบบบริหารความเสี่ยงของบริษัท

ในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่อ้างอิงหลักทรัพย์รายตัว หากใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีสถานะเป็น In The Money ตอนหมดอายุ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีหน้าที่ในการชำระเงินสดส่วนต่างสุทธิ หรือส่งมอบหุ้นอ้างอิงให้กับผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (ถ้ามี) ตามเงื่อนไขที่ระบุเอาไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และ ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น

ในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่อ้างอิงดัชนีหลักทรัพย์ หากใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีสถานะเป็น In The Money ตอนหมดอายุ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีหน้าที่ในการชำระเงินสดส่วนต่างสุทธิ ให้กับผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (ถ้ามี) ตามเงื่อนไขที่ระบุเอาไว้ในข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น

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

ในเบื้องต้น ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ตกลงแต่งตั้ง MBL เป็นคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง โดยจะมีการบริหารความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ด้วยวิธีการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Back-to-Back Agreement) ก่อนวันที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะเข้าทำการซื้อขายวันแรกในตลาดหลักทรัพย์ โดยสัญญาซื้อขายล่วงหน้านั้น มีลักษณะและเงื่อนไขการใช้สิทธิเหมือนกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ แต่เป็นสถานะตรงกันข้ามกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ทั้งนี้ เพื่อเป็นการปิดความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ทั้งหมด

ทั้งนี้ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะระบุรายละเอียดโดยสรุปของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง และสัญญาบริหารความเสี่ยงไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูล และร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) ของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ที่ยื่นต่อสำนักงาน ก.ล.ต. เป็นคราว ๆ ไป

ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจมีการทำสัญญาบริหารความเสี่ยงกับคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงอื่นนอกเหนือจาก MBL หรืออาจมีการใช้วิธีการบริหารความเสี่ยงอื่น ๆ ด้วยตนเอง ซึ่งหากมีการเปลี่ยนแปลงคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงหรือวิธีการบริหารความเสี่ยง ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะดำเนินการเปิดเผยข้อมูลแก่ผู้ลงทุนโดยการระบุรายชื่อคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงและวิธีการบริหารความเสี่ยง ในแบบแสดงรายการข้อมูล และร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) ของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์รุ่นนั้น ๆ ผู้ลงทุนจึงควรศึกษาข้อมูลดังกล่าวให้ครบถ้วนก่อนการลงทุน

5.3 บทบาทของผู้บริหารระดับสูงในการกำกับดูแลระบบบริหารความเสี่ยง

ความเสี่ยงถือเป็นส่วนที่สำคัญสำหรับธุรกิจของ MGL โดยความเสี่ยงหลัก ๆ ที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจของ MGL ได้แก่ Market Risk Equity Risk Credit Risk Liquidity Risk Operation Risk และ Legal and Compliance Risk ซึ่งหน้าที่ความรับผิดชอบในการบริหารความเสี่ยงดังกล่าวจะขึ้นอยู่กับหน่วยงานธุรกิจแต่ละหน่วยงานที่ก่อให้เกิดความเสี่ยงดังกล่าว และจะมี Risk Management Group (“**RMG**”) หรือ Group Legal ในกรณีของ Legal Risk ทำหน้าที่ในการควบคุม การประเมิน และการบริหารความเสี่ยงอีกชั้นหนึ่ง

RMG เป็นหน่วยงานอิสระที่แยกออกจากส่วนงานอื่นของ MGL โดย Head of RMG ซึ่งทำหน้าที่ Chief Risk Officer ของ MGL เป็นสมาชิกของคณะกรรมการบริหารของ MGL และ MBL และรายงานโดยตรงกับ Managing Director และ Chief Executive Officer และรายงานต่อ Board Risk Committee ในการตัดสินใจที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงต่าง ๆ จะต้องได้รับความเห็นชอบด้านการบริหารความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องจาก RMG ก่อน โดย RMG จะมีการวิเคราะห์ และประเมินความเสี่ยงที่เกี่ยวข้อง และวางมาตรการป้องกัน ซึ่งมาตรการป้องกันความเสี่ยงเหล่านี้จะต้องได้รับการอนุมัติจาก Executive Committee และคณะกรรมการบริหาร

5.4 การควบคุมดูแลเพื่อมิให้การออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือการซื้อขายตราสารอื่นมีผลให้การดำรงฐานะทางการเงินหรือสภาพคล่องไม่เป็นไปตามเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง

บริษัทมีนโยบายและขั้นตอนการดำเนินงาน ดังนี้

- ปฏิบัติตามข้อกำหนดของสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ด้านทุนจดทะเบียนและเงินกองทุนสภาพคล่อง
- เตรียมพร้อมด้านทรัพยากรที่จะสนับสนุนความต้องการทางธุรกิจและการปฏิบัติงาน
- ดำรงทุนจดทะเบียนและเงินกองทุนสภาพคล่องให้ไม่น้อยกว่าข้อกำหนดของสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ทั้งนี้ นโยบายและขั้นตอนการดำเนินงานจะมีการทบทวนอย่างสม่ำเสมอ เพื่อบรรลุวัตถุประสงค์และเป้าหมายของบริษัท

6. ประวัติการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่บริษัทออกและเสนอขายในระยะเวลา 2 ปีที่ผ่านมา (เมษายน 2567 - มีนาคม 2569 สิ้นสุดวันที่ 31 มีนาคม 2569 ได้แก่

6.1 ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ยังไม่หมดอายุ

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
SET5028C2603A	SET50	880.00	0.01333	12 ก.ย. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
SET5028P2603A	SET50	730.00	0.01515	12 ก.ย. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
BABA28P2603A	9988	130.00	0.00752	19 ก.ย. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
TENCEN28P2604A	0700	570.00	0.00222	30 ก.ย. 68	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
XIAOMI28P2604A	1810	49.00	0.01818	30 ก.ย. 68	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
BABA28C2603A	9988	240.00	0.00667	30 ก.ย. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
XIAOMI28C2604A	1810	67.00	0.01724	6 ต.ค. 68	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
POPMAR28C2604A	9992	320.00	0.00204	20 ต.ค. 68	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
BABA28C2603B	9988	210.00	0.0098	28 ต.ค. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
XIAOMI28C2606A	1810	48.00	0.0303	25 พ.ย. 68	29 มิ.ย. 69	2 ก.ค. 69
MEITUA28C2604A	3690	120.00	0.00952	25 พ.ย. 68	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
BABA28C2606A	9988	195.00	0.00667	25 พ.ย. 68	29 มิ.ย. 69	2 ก.ค. 69
HSI28C2603A	HSI	31,800.00	0.00026	28 พ.ย. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
HSI28P2603A	HSI	18,800.00	0.00026	28 พ.ย. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
HSTECH28C2603A	HSTECH	6,200.00	0.00038	2 ธ.ค. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
HSTECH28P2603A	HSTECH	5,200.00	0.00038	2 ธ.ค. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
HSI28P2603B	HSI	20,800.00	0.00026	9 ธ.ค. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
HSI28C2603B	HSI	29,800.00	0.00026	16 ธ.ค. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
HSI28C2603C	HSI	27,800.00	0.00026	22 ธ.ค. 68	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
POPMAR28C2606A	9992	260.00	0.00351	22 ธ.ค. 68	29 มิ.ย. 69	2 ก.ค. 69
KUAISH28C2606A	1024	77.00	0.01176	22 ธ.ค. 68	29 มิ.ย. 69	2 ก.ค. 69
JD28C2605A	9618	135.00	0.01064	22 ธ.ค. 68	28 พ.ค. 69	4 มิ.ย. 69
HSI28C2604A	HSI	32,400.00	0.00026	9 ม.ค. 69	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
HSI28P2604A	HSI	21,400.00	0.00026	9 ม.ค. 69	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
HSI28P2603C	HSI	24,800.00	0.00026	16 ม.ค. 69	30 มี.ค. 69	2 เม.ย. 69
NIKKEI28C2606A	NIKKEI	50,000.00	0.00091	21 ม.ค. 69	11 มิ.ย. 69	16 มิ.ย. 69
NIKKEI28C2606B	NIKKEI	53,000.00	0.00091	21 ม.ค. 69	11 มิ.ย. 69	16 มิ.ย. 69
NIKKEI28C2606C	NIKKEI	56,000.00	0.00091	21 ม.ค. 69	11 มิ.ย. 69	16 มิ.ย. 69
NIKKEI28C2606D	NIKKEI	59,000.00	0.00091	21 ม.ค. 69	11 มิ.ย. 69	16 มิ.ย. 69

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
NIKKEI28P2606A	NIKKEI	45,000.00	0.00091	21 ม.ค. 69	11 มิ.ย. 69	16 มิ.ย. 69
NIKKEI28P2606B	NIKKEI	51,000.00	0.00091	21 ม.ค. 69	11 มิ.ย. 69	16 มิ.ย. 69
NIKKEI28P2606C	NIKKEI	48,000.00	0.00091	21 ม.ค. 69	11 มิ.ย. 69	16 มิ.ย. 69
NIKKEI28P2606D	NIKKEI	54,000.00	0.00091	21 ม.ค. 69	11 มิ.ย. 69	16 มิ.ย. 69
HSI28P2604B	HSI	23,400.00	0.00026	28 ม.ค. 69	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
NDX28C2606A	NDX	27,500.00	0.00002	28 ม.ค. 69	18 มิ.ย. 69	23 มิ.ย. 69
NDX28P2606A	NDX	22,500.00	0.00002	28 ม.ค. 69	18 มิ.ย. 69	23 มิ.ย. 69
KUAISH28C2607A	1024	99.00	0.01176	28 ม.ค. 69	30 ก.ค. 69	4 ส.ค. 69
MEITUA28C2607A	3690	115.00	0.0125	28 ม.ค. 69	30 ก.ค. 69	4 ส.ค. 69
BABA28C2606B	9988	180.00	0.00833	28 ม.ค. 69	29 มิ.ย. 69	2 ก.ค. 69
HSI28P2604C	HSI	25,400.00	0.00026	30 ม.ค. 69	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
HSI28C2604B	HSI	30,400.00	0.00026	30 ม.ค. 69	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
HSI28C2605A	HSI	31,600.00	0.00026	9 ก.พ. 69	28 พ.ค. 69	4 มิ.ย. 69
HSI28P2605A	HSI	22,600.00	0.00026	9 ก.พ. 69	28 พ.ค. 69	4 มิ.ย. 69
SPX28C2606A	SPX	7,500.00	0.00009	12 ก.พ. 69	18 มิ.ย. 69	23 มิ.ย. 69
SPX28P2606A	SPX	6,400.00	0.00009	12 ก.พ. 69	18 มิ.ย. 69	23 มิ.ย. 69
HSI28C2604C	HSI	28,400.00	0.00026	26 ก.พ. 69	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
HSI28P2605B	HSI	20,600.00	0.00026	26 ก.พ. 69	28 พ.ค. 69	4 มิ.ย. 69
HSTECH28C2606A	HSTECH	5,900.00	0.00038	26 ก.พ. 69	29 มิ.ย. 69	2 ก.ค. 69
HSTECH28P2606A	HSTECH	4,800.00	0.00038	26 ก.พ. 69	29 มิ.ย. 69	2 ก.ค. 69
HSI28C2604D	HSI	27,400.00	0.00026	4 มี.ค. 69	29 เม.ย. 69	6 พ.ค. 69
HSI28C2606A	HSI	32,200.00	0.00033	4 มี.ค. 69	29 มิ.ย. 69	2 ก.ค. 69
HSI28P2606A	HSI	21,200.00	0.00033	4 มี.ค. 69	29 มิ.ย. 69	2 ก.ค. 69
HSI28C2605B	HSI	29,600.00	0.00033	4 มี.ค. 69	28 พ.ค. 69	4 มิ.ย. 69
HSI28C2605C	HSI	27,600.00	0.00033	11 มี.ค. 69	28 พ.ค. 69	4 มิ.ย. 69
XIAOMI28C2609A	1810	40.00	0.04	11 มี.ค. 69	29 ก.ย. 69	2 ต.ค. 69
BABA28C2609A	9988	160.00	0.008	11 มี.ค. 69	29 ก.ย. 69	2 ต.ค. 69
MEITUA28C2609A	3690	95.00	0.01333	11 มี.ค. 69	29 ก.ย. 69	2 ต.ค. 69
SPX28C2606B	SPX	7,000.00	0.00009	23 มี.ค. 69	18 มิ.ย. 69	23 มิ.ย. 69
NDX28C2606B	NDX	25,500.00	0.00002	27 มี.ค. 69	18 มิ.ย. 69	23 มิ.ย. 69
HSI28C2605D	HSI	26,600.00	0.00033	27 มี.ค. 69	28 พ.ค. 69	4 มิ.ย. 69
HSI28C2606B	HSI	28,200.00	0.00033	27 มี.ค. 69	29 มิ.ย. 69	2 ก.ค. 69
HSI28P2605C	HSI	18,600.00	0.00033	27 มี.ค. 69	28 พ.ค. 69	4 มิ.ย. 69

ข้อมูลใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ข้างต้น เป็นข้อมูลจากใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ตามแบบแสดงรายการข้อมูล และร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) ที่ได้ยื่นต่อ สำนักงาน ก.ล.ต. ในการเสนอขายครั้งแรกของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ซึ่งยังไม่รวมถึงการปรับสิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ทั้งนี้ ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่นอาจมีการปรับสิทธิตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ผู้ลงทุนสามารถติดตามข้อมูลการปรับสิทธิได้จากข่าวตลาดหลักทรัพย์ หรือที่ www.set.or.th

6.2 ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่หมดอายุแล้ว

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่หมดอายุก่อนวันที่ 31 มีนาคม 2569

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
HSI28C2405E	HSI	16,400.00	0.00026	2 เม.ย. 67	30 พ.ค. 67	5 มิ.ย. 67
HSI28C2407B	HSI	19,400.00	0.00026	5 เม.ย. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
HSTECH28P2406A	HSTECH	3,450.00	0.00038	5 เม.ย. 67	27 มิ.ย. 67	2 ก.ค. 67
DJI28C2409A	DJI	46,000.00	0.00003	5 เม.ย. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
DJI28P2406C	DJI	36,000.00	0.00003	5 เม.ย. 67	21 มิ.ย. 67	26 มิ.ย. 67
NDX28P2409A	NDX	16,700.00	0.00004	5 เม.ย. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
SPX28C2406C	SPX	5,750.00	0.00023	5 เม.ย. 67	21 มิ.ย. 67	26 มิ.ย. 67
SPX28P2406C	SPX	4,800.00	0.00023	5 เม.ย. 67	21 มิ.ย. 67	26 มิ.ย. 67
SPX28P2409A	SPX	4,450.00	0.00023	5 เม.ย. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
HSI28C2406D	HSI	17,000.00	0.00026	11 เม.ย. 67	27 มิ.ย. 67	2 ก.ค. 67
SET5028C2412A	SET50	1,020.00	0.06667	11 เม.ย. 67	27 ธ.ค. 67	3 ม.ค. 68
SET5028P2412A	SET50	710.00	0.06667	11 เม.ย. 67	27 ธ.ค. 67	3 ม.ค. 68
SUNNY28C2408B	2382	51.00	0.02	11 เม.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
TENCEN28C2406A	0700	370.00	0.00952	11 เม.ย. 67	27 มิ.ย. 67	2 ก.ค. 67
MEITUA28P2407A	3690	67.00	0.04444	11 เม.ย. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
ALIHEA28C2409A	0241	3.33	0.1087	19 เม.ย. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
AIA28C2408B	1299	65.00	0.025	19 เม.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
AIA28P2409A	1299	44.00	0.03333	19 เม.ย. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
SET5028C2412B	SET50	990.00	0.06667	24 เม.ย. 67	27 ธ.ค. 67	3 ม.ค. 68
BABA28C2408A	9988	80.00	0.02381	24 เม.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
HKEX28C2409A	0388	251.00	0.00476	24 เม.ย. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28P2406E	HSI	16,800.00	0.00026	29 เม.ย. 67	27 มิ.ย. 67	2 ก.ค. 67
HSI28C2408A	HSI	21,000.00	0.00026	29 เม.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
HSI28P2408A	HSI	14,000.00	0.00026	29 เม.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
HSCEI28C2406A	HSCEI	6,200.00	0.0005	29 เม.ย. 67	27 มิ.ย. 67	2 ก.ค. 67
HSCEI28P2406A	HSCEI	5,700.00	0.0005	29 เม.ย. 67	27 มิ.ย. 67	2 ก.ค. 67
HSI28P2407B	HSI	15,400.00	0.00026	3 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
HSI28C2407C	HSI	21,400.00	0.00026	3 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
SPX28C2409A	SPX	6,000.00	0.00023	3 พ.ค. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
NDX28C2409A	NDX	19,800.00	0.00003	3 พ.ค. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
DJI28C2409B	DJI	44,000.00	0.00003	3 พ.ค. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
TENCEN28P2410A	0700	275.00	0.00833	3 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
TENCEN28C2409A	0700	400.00	0.00444	3 พ.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
BYDCOM28P2409A	1211	190.00	0.00667	3 พ.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
MEITUA28P2409A	3690	89.00	0.0102	3 พ.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28C2407D	HSI	22,400.00	0.00026	10 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
HSI28C2409A	HSI	21,600.00	0.00026	10 พ.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28P2407C	HSI	16,400.00	0.00026	10 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
HSI28P2409A	HSI	16,200.00	0.00026	10 พ.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28P2407D	HSI	17,400.00	0.00026	10 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
HSI28P2408B	HSI	18,000.00	0.00026	10 พ.ค. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
BABA28P2408A	9988	60.00	0.03333	10 พ.ค. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
AIA28P2408A	1299	49.00	0.06667	10 พ.ค. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
XIAOMI28P2408A	1810	15.00	0.06897	10 พ.ค. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
MEITUA28C2409A	3690	148.00	0.00909	10 พ.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSCEI28C2407A	HSCEI	7,500.00	0.0005	15 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
HSCEI28P2407A	HSCEI	6,200.00	0.0005	15 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
XIAOMI28C2409A	1810	23.00	0.05882	15 พ.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28P2408C	HSI	16,000.00	0.00026	16 พ.ค. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
HSI28P2408D	HSI	17,000.00	0.00026	16 พ.ค. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
HSI28C2408B	HSI	22,000.00	0.00026	16 พ.ค. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
HSI28C2408C	HSI	23,000.00	0.00026	16 พ.ค. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
HSI28C2407E	HSI	23,400.00	0.00026	20 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
HSI28P2410A	HSI	15,600.00	0.00026	20 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
HSI28C2410A	HSI	24,200.00	0.00026	20 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
HSTECH28C2407A	HSTECH	4,300.00	0.00038	20 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
HSTECH28P2407A	HSTECH	3,850.00	0.00038	20 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
DJI28P2409A	DJI	35,000.00	0.00003	20 พ.ค. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
HKEX28C2410A	0388	342.00	0.00345	20 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
KUAISH28C2410A	1024	66.00	0.00769	20 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
JD28C2410A	9618	155.00	0.00556	20 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
SET5028C2407A	SET50	930.00	0.04545	24 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
SET5028P2407A	SET50	800.00	0.04348	24 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
TENCEN28P2410B	0700	337.00	0.00556	24 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
MEITUA28P2410A	3690	106.00	0.00769	24 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
BIDU28P2410A	9888	87.00	0.01515	24 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
BABA28P2410A	9988	72.00	0.02	24 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
BABA28C2410A	9988	98.00	0.01333	24 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
HSI28P2407E	HSI	18,400.00	0.00026	27 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
NDX28P2409B	NDX	15,000.00	0.00004	29 พ.ค. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
XIAOMI28P2409A	1810	15.30	0.08696	29 พ.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28C2407F	HSI	18,000.00	0.00018	31 พ.ค. 67	30 ก.ค. 67	2 ส.ค. 67
HSI28C2410B	HSI	23,200.00	0.00026	31 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
HSI28P2410B	HSI	14,600.00	0.00026	31 พ.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
TENCEN28C2409B	0700	450.00	0.00556	31 พ.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
BIDU28C2409A	9888	110.00	0.01	31 พ.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
SET5028C2409C	SET50	960.00	0.1	7 มิ.ย. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
SET5028P2408A	SET50	770.00	0.02857	7 มิ.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
DJI28P2409B	DJI	32,000.00	0.00003	7 มิ.ย. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
NDX28C2409B	NDX	21,200.00	0.00004	7 มิ.ย. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
HSI28C2408D	HSI	20,000.00	0.00026	12 มิ.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
SET5028C2412C	SET50	1,000.00	0.1	12 มิ.ย. 67	27 ธ.ค. 67	3 ม.ค. 68
CHMOBI28C2411A	0941	89.50	0.03226	12 มิ.ย. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
XIAOMI28C2410A	1810	21.50	0.06452	12 มิ.ย. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
NDX28P2409C	NDX	18,100.00	0.00004	18 มิ.ย. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
SPX28P2409B	SPX	4,850.00	0.00023	18 มิ.ย. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
HSTECH28C2408A	HSTECH	3,900.00	0.00038	20 มิ.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
HSTECH28P2408A	HSTECH	3,550.00	0.00038	20 มิ.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
HSCEI28C2408A	HSCEI	7,100.00	0.0005	20 มิ.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
HSCEI28P2408A	HSCEI	5,900.00	0.0005	20 มิ.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
SPX28C2409B	SPX	5,800.00	0.00023	20 มิ.ย. 67	20 ก.ย. 67	25 ก.ย. 67
HSI28C2408E	HSI	19,000.00	0.00026	25 มิ.ย. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
HSI28P2409B	HSI	15,200.00	0.00026	25 มิ.ย. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28C2409B	HSI	20,600.00	0.00026	25 มิ.ย. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28C2411A	HSI	22,800.00	0.00026	25 มิ.ย. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSI28P2411A	HSI	14,800.00	0.00026	25 มิ.ย. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSI28C2410C	HSI	22,200.00	0.00026	28 มิ.ย. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
SET5028C2410A	SET50	930.00	0.06667	28 มิ.ย. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
GEELY28C2411A	0175	10.10	0.1	28 มิ.ย. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSI28C2408F	HSI	17,000.00	0.00026	4 ก.ค. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
HSI28C2408G	HSI	18,000.00	0.00026	4 ก.ค. 67	29 ส.ค. 67	3 ก.ย. 67
HSI28C2409C	HSI	19,600.00	0.00026	4 ก.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28P2409C	HSI	17,200.00	0.00026	4 ก.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
BIDU28C2411A	9888	93.00	0.01	4 ก.ค. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
AIA28C2411A	1299	60.00	0.025	4 ก.ค. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSI28C2409D	HSI	18,600.00	0.00026	9 ก.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28C2410D	HSI	21,200.00	0.00026	9 ก.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
HSI28C2410E	HSI	20,200.00	0.00026	12 ก.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
BYDCOM28P2501A	1211	210.00	0.00556	12 ก.ค. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28P2412A	HSI	15,400.00	0.00026	17 ก.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28C2412A	HSI	21,400.00	0.00026	17 ก.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28P2410C	HSI	16,600.00	0.00026	17 ก.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
SPX28C2412A	SPX	6,600.00	0.00023	17 ก.ค. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
SPX28P2412A	SPX	4,650.00	0.00023	17 ก.ค. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
NDX28P2412A	NDX	17,400.00	0.00004	17 ก.ค. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
DJI28P2412A	DJI	33,500.00	0.00003	17 ก.ค. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
DJI28C2412A	DJI	45,000.00	0.00003	17 ก.ค. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
NDX28C2412A	NDX	24,200.00	0.00004	24 ก.ค. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
BYDCOM28C2501A	1211	290.00	0.00741	30 ก.ค. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28C2409F	HSI	17,000.00	0.00026	2 ส.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28C2409E	HSI	17,600.00	0.00026	2 ส.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28C2410F	HSI	19,200.00	0.00026	2 ส.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
HSI28C2411B	HSI	20,800.00	0.00026	2 ส.ค. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSTECH28C2412A	HSTECH	4,000.00	0.00045	2 ส.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
SET5028C2409D	SET50	860.00	0.04	2 ส.ค. 67	27 ก.ย. 67	2 ต.ค. 67
HSI28P2411B	HSI	15,800.00	0.00026	7 ส.ค. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
HSI28C2412B	HSI	20,400.00	0.00026	7 ส.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28P2412B	HSI	14,400.00	0.00026	7 ส.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
BABA28C2412A	9988	95.00	0.02	13 ส.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
XIAOMI28C2412A	1810	20.00	0.06667	13 ส.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSTECH28P2412A	HSTECH	3,100.00	0.00038	16 ส.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28C2410G	HSI	18,200.00	0.00026	16 ส.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
HSI28C2411C	HSI	18,800.00	0.00026	16 ส.ค. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
MEITUA28C2501A	3690	125.00	0.00769	21 ส.ค. 67	28 ม.ค. 68	31 ม.ค. 68
HSI28C2410H	HSI	17,200.00	0.00026	26 ส.ค. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
HSI28C2412C	HSI	19,400.00	0.00026	26 ส.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28C2501A	HSI	21,600.00	0.00026	29 ส.ค. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28P2501A	HSI	14,600.00	0.00026	29 ส.ค. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
XIAOMI28P2502A	1810	15.00	0.11111	29 ส.ค. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
HSI28P2410D	HSI	17,600.00	0.00026	3 ก.ย. 67	30 ต.ค. 67	4 พ.ย. 67
HSI28P2412C	HSI	16,400.00	0.00026	3 ก.ย. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
SPX28P2412B	SPX	4,200.00	0.00023	3 ก.ย. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
TENCEN28C2502A	0700	434.00	0.00385	6 ก.ย. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
HSI28P2411C	HSI	16,800.00	0.00026	11 ก.ย. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
NDX28C2412B	NDX	20,500.00	0.00005	11 ก.ย. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
NDX28P2412B	NDX	14,200.00	0.00005	11 ก.ย. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
SPX28C2412B	SPX	6,000.00	0.00023	11 ก.ย. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
NDX28C2412C	NDX	22,200.00	0.00005	17 ก.ย. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
NDX28P2412C	NDX	15,400.00	0.00005	17 ก.ย. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
SPX28C2412C	SPX	6,200.00	0.00023	17 ก.ย. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
BABA28P2503A	9988	72.00	0.02326	20 ก.ย. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
MEITUA28P2503A	3690	109.00	0.0125	20 ก.ย. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28C2503A	HSI	21,800.00	0.00026	25 ก.ย. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28P2503A	HSI	14,800.00	0.00026	25 ก.ย. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28C2411D	HSI	19,800.00	0.00026	25 ก.ย. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSI28P2411D	HSI	17,800.00	0.00026	25 ก.ย. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
SET5028C2503A	SET50	1,080.00	0.02273	25 ก.ย. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28P2411E	HSI	18,800.00	0.00026	26 ก.ย. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSI28P2412D	HSI	17,400.00	0.00026	26 ก.ย. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
DJI28P2412B	DJI	37,500.00	0.00003	30 ก.ย. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
DJI28C2412B	DJI	47,000.00	0.00003	30 ก.ย. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
NDX28P2412D	NDX	18,100.00	0.00005	30 ก.ย. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
MEITUA28C2503A	3690	170.00	0.008	30 ก.ย. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
TENCEN28P2503A	0700	340.00	0.008	30 ก.ย. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28C2411G	HSI	23,800.00	0.00026	3 ต.ค. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSI28P2411G	HSI	20,800.00	0.00026	3 ต.ค. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSI28C2411E	HSI	24,800.00	0.00026	3 ต.ค. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSI28C2411F	HSI	25,800.00	0.00026	3 ต.ค. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSI28C2412D	HSI	25,400.00	0.00026	3 ต.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28P2412E	HSI	18,400.00	0.00026	3 ต.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28P2411F	HSI	19,800.00	0.00026	3 ต.ค. 67	28 พ.ย. 67	3 ธ.ค. 67
HSTECH28C2503A	HSTECH	5,800.00	0.00038	3 ต.ค. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSTECH28P2503A	HSTECH	3,900.00	0.00038	3 ต.ค. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28C2412E	HSI	27,400.00	0.00026	8 ต.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28C2501B	HSI	26,600.00	0.00026	8 ต.ค. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28C2503B	HSI	27,800.00	0.00026	8 ต.ค. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28P2503B	HSI	16,800.00	0.00026	8 ต.ค. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28P2501B	HSI	18,600.00	0.00026	8 ต.ค. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
MEITUA28C2504A	3690	330.00	0.00455	8 ต.ค. 67	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
XIAOMI28C2504A	1810	34.00	0.04762	8 ต.ค. 67	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
BABA28C2503A	9988	150.00	0.0102	8 ต.ค. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
TENCEN28C2503A	0700	620.00	0.00303	8 ต.ค. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
BYDCOM28C2503A	1211	400.00	0.00455	8 ต.ค. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
BYDCOM28P2503A	1211	270.00	0.00455	8 ต.ค. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28C2501C	HSI	29,600.00	0.00026	15 ต.ค. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28C2412F	HSI	31,600.00	0.00026	15 ต.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28C2501D	HSI	23,600.00	0.00026	15 ต.ค. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28C2502A	HSI	23,200.00	0.00026	15 ต.ค. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
HSI28P2501C	HSI	20,600.00	0.00026	15 ต.ค. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28P2502A	HSI	19,200.00	0.00026	15 ต.ค. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
HSI28C2412H	HSI	26,400.00	0.00026	22 ต.ค. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28C2503D	HSI	29,800.00	0.00026	22 ต.ค. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28C2501E	HSI	24,600.00	0.00026	22 ต.ค. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28P2501D	HSI	16,600.00	0.00026	22 ต.ค. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
SPX28P2412C	SPX	4,900.00	0.00023	22 ต.ค. 67	20 ธ.ค. 67	25 ธ.ค. 67
MEITUA28P2504B	3690	145.00	0.00714	22 ต.ค. 67	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28C2502B	HSI	29,200.00	0.00026	29 ต.ค. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
HSI28C2502C	HSI	26,200.00	0.00026	29 ต.ค. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
HSI28P2502B	HSI	17,200.00	0.00026	29 ต.ค. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
DJI28C2503A	DJI	49,000.00	0.00003	29 ต.ค. 67	21 มี.ค. 68	26 มี.ค. 68
DJI28P2503A	DJI	33,000.00	0.00003	29 ต.ค. 67	21 มี.ค. 68	26 มี.ค. 68
NDX28C2503A	NDX	25,000.00	0.00004	29 ต.ค. 67	21 มี.ค. 68	26 มี.ค. 68
NDX28P2503A	NDX	14,600.00	0.00004	29 ต.ค. 67	21 มี.ค. 68	26 มี.ค. 68
SPX28C2503A	SPX	7,000.00	0.00023	29 ต.ค. 67	21 มี.ค. 68	26 มี.ค. 68
SPX28P2503A	SPX	4,500.00	0.00023	29 ต.ค. 67	21 มี.ค. 68	26 มี.ค. 68
HSI28C2501F	HSI	27,600.00	0.00026	1 พ.ย. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28C2412I	HSI	23,400.00	0.00026	1 พ.ย. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28P2412F	HSI	19,400.00	0.00026	1 พ.ย. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28C2412J	HSI	22,400.00	0.00026	6 พ.ย. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28C2412K	HSI	24,400.00	0.00026	6 พ.ย. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
HSI28P2412G	HSI	20,400.00	0.00026	6 พ.ย. 67	30 ธ.ค. 67	6 ม.ค. 68
XIAOMI28P2505A	1810	22.00	0.05	6 พ.ย. 67	29 พ.ค. 68	4 มิ.ย. 68
HSI28P2501E	HSI	17,600.00	0.00026	11 พ.ย. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28C2503E	HSI	30,800.00	0.00026	13 พ.ย. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28C2501G	HSI	28,600.00	0.00026	13 พ.ย. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28C2501H	HSI	25,600.00	0.00026	13 พ.ย. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28C2501I	HSI	22,600.00	0.00026	18 พ.ย. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28C2503F	HSI	24,600.00	0.00026	18 พ.ย. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28C2504A	HSI	26,600.00	0.00026	22 พ.ย. 67	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28P2504A	HSI	15,600.00	0.00026	22 พ.ย. 67	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28C2502D	HSI	21,200.00	0.00026	28 พ.ย. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
HSI28P2502C	HSI	16,200.00	0.00026	28 พ.ย. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
HSI28P2503C	HSI	15,800.00	0.00026	28 พ.ย. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28C2501J	HSI	19,600.00	0.00026	29 พ.ย. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
HSI28C2501K	HSI	20,600.00	0.00026	29 พ.ย. 67	27 ม.ค. 68	30 ม.ค. 68
SPX28C2503B	SPX	6,650.00	0.00023	6 ธ.ค. 67	21 มี.ค. 68	26 มี.ค. 68
BABA28C2506A	9988	115.00	0.02	6 ธ.ค. 67	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
MEITUA28C2507A	3690	250.00	0.00588	12 ธ.ค. 67	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
HSI28P2502D	HSI	18,200.00	0.00026	20 ธ.ค. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
HSI28C2502E	HSI	20,200.00	0.00026	30 ธ.ค. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
HSI28C2502F	HSI	22,200.00	0.00026	30 ธ.ค. 67	27 ก.พ. 68	4 มี.ค. 68
HSI28P2503D	HSI	18,800.00	0.00026	30 ธ.ค. 67	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
DJI28C2503B	DJI	50,500.00	0.00003	30 ธ.ค. 67	21 มี.ค. 68	26 มี.ค. 68
DJI28P2503B	DJI	35,500.00	0.00003	30 ธ.ค. 67	21 มี.ค. 68	26 มี.ค. 68
SPX28P2503B	SPX	5,000.00	0.00023	30 ธ.ค. 67	21 มี.ค. 68	26 มี.ค. 68
BYDCOM28C2508A	1211	360.00	0.005	30 ธ.ค. 67	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28C2504B	HSI	24,400.00	0.00026	15 ม.ค. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28P2504B	HSI	16,400.00	0.00026	15 ม.ค. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28C2505A	HSI	27,600.00	0.00026	15 ม.ค. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
HSI28P2505A	HSI	14,600.00	0.00026	15 ม.ค. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
XIAOMI28C2508A	1810	48.00	0.03333	15 ม.ค. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
TENCEN28C2508A	0700	485.00	0.00323	15 ม.ค. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28C2504C	HSI	22,400.00	0.00026	20 ม.ค. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28C2503G	HSI	20,800.00	0.00026	20 ม.ค. 68	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSTECH28C2506A	HSTECH	5,200.00	0.00038	20 ม.ค. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSTECH28P2506A	HSTECH	3,800.00	0.00038	20 ม.ค. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
NDX28C2506A	NDX	24,800.00	0.00004	20 ม.ค. 68	20 มิ.ย. 68	25 มิ.ย. 68
NDX28P2506A	NDX	16,000.00	0.00004	20 ม.ค. 68	20 มิ.ย. 68	25 มิ.ย. 68
XIAOMI28P2509A	1810	29.50	0.02326	20 ม.ค. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
HSI28C2503H	HSI	22,800.00	0.00026	28 ม.ค. 68	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28P2503E	HSI	17,800.00	0.00026	28 ม.ค. 68	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28C2506A	HSI	28,200.00	0.00026	28 ม.ค. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28P2506A	HSI	15,200.00	0.00026	28 ม.ค. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28C2503I	HSI	19,800.00	0.00026	31 ม.ค. 68	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28P2503F	HSI	19,800.00	0.00026	31 ม.ค. 68	28 มี.ค. 68	2 เม.ย. 68
HSI28P2504C	HSI	17,400.00	0.00026	31 ม.ค. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
SPX28C2506A	SPX	7,100.00	0.00023	31 ม.ค. 68	20 มิ.ย. 68	25 มิ.ย. 68
SPX28P2506A	SPX	4,500.00	0.00023	31 ม.ค. 68	20 มิ.ย. 68	25 มิ.ย. 68
DJI28C2506A	DJI	52,000.00	0.00003	31 ม.ค. 68	20 มิ.ย. 68	25 มิ.ย. 68
DJI28P2506A	DJI	36,000.00	0.00003	31 ม.ค. 68	20 มิ.ย. 68	25 มิ.ย. 68
HSI28P2504D	HSI	18,400.00	0.00026	11 ก.พ. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28P2505B	HSI	16,600.00	0.00026	11 ก.พ. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
BABA28P2509A	9988	87.00	0.00909	11 ก.พ. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
HSI28P2504E	HSI	19,400.00	0.00026	17 ก.พ. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28P2504F	HSI	20,400.00	0.00026	17 ก.พ. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28P2506B	HSI	16,200.00	0.00026	17 ก.พ. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28P2506C	HSI	17,200.00	0.00026	17 ก.พ. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28C2504D	HSI	27,400.00	0.00026	19 ก.พ. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28C2504E	HSI	28,400.00	0.00026	19 ก.พ. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28C2504F	HSI	29,400.00	0.00026	19 ก.พ. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28C2506B	HSI	31,200.00	0.00026	19 ก.พ. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSTECH28C2506B	HSTECH	6,800.00	0.00038	19 ก.พ. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSTECH28P2506B	HSTECH	4,700.00	0.00038	19 ก.พ. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
BABA28C2509A	9988	180.00	0.01	19 ก.พ. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
TENCEN28C2509A	0700	650.00	0.00313	19 ก.พ. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
TENCEN28P2509A	0700	440.00	0.00263	19 ก.พ. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
XIAOMI28C2509A	1810	65.00	0.02703	19 ก.พ. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
NIKKEI28C2506A	NIKKEI	38,000.00	0.00091	21 ก.พ. 68	12 มิ.ย. 68	17 มิ.ย. 68
NIKKEI28C2506B	NIKKEI	40,500.00	0.00091	21 ก.พ. 68	12 มิ.ย. 68	17 มิ.ย. 68
NIKKEI28C2506C	NIKKEI	43,000.00	0.00091	21 ก.พ. 68	12 มิ.ย. 68	17 มิ.ย. 68
NIKKEI28P2506A	NIKKEI	32,000.00	0.00091	21 ก.พ. 68	12 มิ.ย. 68	17 มิ.ย. 68
NIKKEI28P2506B	NIKKEI	34,500.00	0.00091	21 ก.พ. 68	12 มิ.ย. 68	17 มิ.ย. 68
NIKKEI28P2506C	NIKKEI	37,000.00	0.00091	21 ก.พ. 68	12 มิ.ย. 68	17 มิ.ย. 68
HSI28C2505B	HSI	29,600.00	0.00026	26 ก.พ. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
HSI28C2505C	HSI	31,600.00	0.00026	26 ก.พ. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
HSI28P2505C	HSI	19,600.00	0.00026	26 ก.พ. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
HSI28P2504G	HSI	21,400.00	0.00026	26 ก.พ. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28P2504H	HSI	22,400.00	0.00026	26 ก.พ. 68	29 เม.ย. 68	6 พ.ค. 68
HSI28C2507A	HSI	31,800.00	0.00026	5 มี.ค. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28P2507A	HSI	18,800.00	0.00026	5 มี.ค. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28C2505D	HSI	28,600.00	0.00026	10 มี.ค. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
HSI28P2505D	HSI	18,600.00	0.00026	10 มี.ค. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
SPX28C2506B	SPX	6,700.00	0.00023	10 มี.ค. 68	20 มิ.ย. 68	25 มิ.ย. 68
SPX28P2506B	SPX	4,100.00	0.00023	10 มี.ค. 68	20 มิ.ย. 68	25 มิ.ย. 68
BYDCOM28P2510A	1211	310.00	0.00225	10 มี.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28P2505E	HSI	20,600.00	0.00026	14 มี.ค. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
HSI28P2506D	HSI	19,200.00	0.00026	14 มี.ค. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSTECH28P2506C	HSTECH	5,200.00	0.00038	14 มี.ค. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
BYDCOM28C2510A	1211	520.00	0.00385	14 มี.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28C2506C	HSI	29,200.00	0.00026	19 มี.ค. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28P2505F	HSI	21,600.00	0.00026	19 มี.ค. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
NDX28C2506B	NDX	22,100.00	0.00004	19 มี.ค. 68	20 มิ.ย. 68	25 มิ.ย. 68
NDX28C2506C	NDX	23,200.00	0.00004	19 มี.ค. 68	20 มิ.ย. 68	25 มิ.ย. 68
NDX28C2509A	NDX	23,300.00	0.00004	19 มี.ค. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
NDX28P2509A	NDX	14,200.00	0.00004	19 มี.ค. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
SPX28C2506C	SPX	6,400.00	0.00023	19 มี.ค. 68	20 มิ.ย. 68	25 มิ.ย. 68
BABA28C2506B	9988	168.00	0.0125	19 มี.ค. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28P2505G	HSI	22,600.00	0.00026	24 มี.ค. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
HSI28P2506E	HSI	21,200.00	0.00026	24 มี.ค. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28P2506F	HSI	20,200.00	0.00026	24 มี.ค. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28C2505E	HSI	26,400.00	0.00026	27 มี.ค. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
HSI28C2508A	HSI	32,400.00	0.00026	27 มี.ค. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28P2508A	HSI	18,400.00	0.00026	27 มี.ค. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSTECH28C2506C	HSTECH	6,000.00	0.00038	27 มี.ค. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28C2505F	HSI	24,600.00	0.00026	1 เม.ย. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
HSI28C2505G	HSI	25,600.00	0.00026	1 เม.ย. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
DJI28C2509A	DJI	46,500.00	0.00002	1 เม.ย. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
BABA28P2507A	9988	110.00	0.01887	1 เม.ย. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
XIAOMI28P2510A	1810	48.00	0.01818	1 เม.ย. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28C2505H	HSI	23,600.00	0.00026	4 เม.ย. 68	29 พ.ค. 68	5 มิ.ย. 68
HSI28C2508B	HSI	30,400.00	0.00026	4 เม.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28C2506D	HSI	22,200.00	0.00026	10 เม.ย. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28C2506E	HSI	23,200.00	0.00026	10 เม.ย. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28C2506F	HSI	24,200.00	0.00026	10 เม.ย. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28C2507B	HSI	24,800.00	0.00026	10 เม.ย. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28C2507C	HSI	25,800.00	0.00026	10 เม.ย. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28P2507B	HSI	14,800.00	0.00026	10 เม.ย. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28P2508B	HSI	14,400.00	0.00026	10 เม.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
SPX28C2509A	SPX	6,300.00	0.00023	10 เม.ย. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
BABA28C2506C	9988	130.00	0.01724	10 เม.ย. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
NDX28C2509B	NDX	22,000.00	0.00002	17 เม.ย. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
NDX28P2509B	NDX	17,500.00	0.00001	17 เม.ย. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
MEITUA28C2509A	3690	185.00	0.00909	25 เม.ย. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
SPX28C2509B	SPX	5,950.00	0.00008	25 เม.ย. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
SPX28P2509A	SPX	4,800.00	0.00006	25 เม.ย. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
HSI28C2506G	HSI	25,200.00	0.00026	30 เม.ย. 68	27 มิ.ย. 68	2 ก.ค. 68
HSI28C2507D	HSI	26,800.00	0.00026	30 เม.ย. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
DJI28C2509B	DJI	44,500.00	0.00001	30 เม.ย. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
HSI28C2507E	HSI	27,800.00	0.00026	7 พ.ค. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28P2507C	HSI	17,800.00	0.00026	7 พ.ค. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28P2507D	HSI	16,800.00	0.00026	7 พ.ค. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28C2509A	HSI	29,600.00	0.00026	13 พ.ค. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
HSI28P2509A	HSI	17,600.00	0.00026	13 พ.ค. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
HSI28P2508C	HSI	16,400.00	0.00026	13 พ.ค. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28P2507E	HSI	20,800.00	0.00026	21 พ.ค. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
NDX28C2509C	NDX	22,600.00	0.00002	21 พ.ค. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
NDX28P2509C	NDX	20,600.00	0.00001	21 พ.ค. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
SPX28C2509C	SPX	6,150.00	0.00005	21 พ.ค. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
SPX28P2509B	SPX	5,750.00	0.00005	21 พ.ค. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
HSI28P2507F	HSI	21,800.00	0.00026	23 พ.ค. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28P2509B	HSI	19,600.00	0.00026	23 พ.ค. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
HSI28C2507F	HSI	28,800.00	0.00026	23 พ.ค. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28C2509B	HSI	30,600.00	0.00026	28 พ.ค. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
BABA28C2508A	9988	142.00	0.01667	28 พ.ค. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28C2507G	HSI	23,800.00	0.00026	30 พ.ค. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28P2507G	HSI	19,800.00	0.00026	30 พ.ค. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28P2507H	HSI	22,800.00	0.00026	30 พ.ค. 68	30 ก.ค. 68	4 ส.ค. 68
HSI28C2508C	HSI	27,400.00	0.00026	5 มิ.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28P2508D	HSI	20,400.00	0.00026	5 มิ.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSTECH28C2508A	HSTECH	5,700.00	0.00038	5 มิ.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSTECH28P2508A	HSTECH	4,900.00	0.00038	5 มิ.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28P2508E	HSI	21,400.00	0.00026	16 มิ.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28P2509C	HSI	20,600.00	0.00026	16 มิ.ย. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
DJI28P2512A	DJI	40,600.00	0.00001	16 มิ.ย. 68	19 ธ.ค. 68	24 ธ.ค. 68

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
NIKKEI28C2512A	NIKKEI	35,000.00	0.00091	16 มิ.ย. 68	11 ธ.ค. 68	16 ธ.ค. 68
NIKKEI28C2512B	NIKKEI	37,500.00	0.00091	16 มิ.ย. 68	11 ธ.ค. 68	16 ธ.ค. 68
NIKKEI28C2512C	NIKKEI	40,000.00	0.00091	16 มิ.ย. 68	11 ธ.ค. 68	16 ธ.ค. 68
NIKKEI28C2512D	NIKKEI	42,500.00	0.00091	16 มิ.ย. 68	11 ธ.ค. 68	16 ธ.ค. 68
NIKKEI28P2512A	NIKKEI	33,500.00	0.00091	16 มิ.ย. 68	11 ธ.ค. 68	16 ธ.ค. 68
NIKKEI28P2512B	NIKKEI	36,000.00	0.00091	16 มิ.ย. 68	11 ธ.ค. 68	16 ธ.ค. 68
NIKKEI28P2512C	NIKKEI	38,500.00	0.00091	16 มิ.ย. 68	11 ธ.ค. 68	16 ธ.ค. 68
NIKKEI28P2512D	NIKKEI	41,000.00	0.00091	16 มิ.ย. 68	11 ธ.ค. 68	16 ธ.ค. 68
BIDU28C2512A	9888	97.00	0.01961	16 มิ.ย. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
BIDU28P2512A	9888	75.00	0.02326	16 มิ.ย. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
HSI28C2508D	HSI	26,400.00	0.00026	23 มิ.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28C2509C	HSI	27,600.00	0.00026	23 มิ.ย. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
HSI28P2509D	HSI	21,600.00	0.00026	23 มิ.ย. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
HSI28C2510A	HSI	28,200.00	0.00026	25 มิ.ย. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28P2510A	HSI	18,200.00	0.00026	25 มิ.ย. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28C2508E	HSI	24,400.00	0.00026	30 มิ.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28C2508F	HSI	25,400.00	0.00026	30 มิ.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28P2508F	HSI	22,400.00	0.00026	30 มิ.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
HSI28P2508G	HSI	23,400.00	0.00026	30 มิ.ย. 68	28 ส.ค. 68	2 ก.ย. 68
NDX28P2509D	NDX	21,400.00	0.00004	30 มิ.ย. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
BABA28C2509B	9988	130.00	0.00885	30 มิ.ย. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
SPX28C2509D	SPX	6,500.00	0.00006	7 ก.ค. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
SPX28P2509C	SPX	5,900.00	0.00019	7 ก.ค. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
SPX28C2512A	SPX	6,600.00	0.00007	7 ก.ค. 68	19 ธ.ค. 68	24 ธ.ค. 68
SPX28P2512A	SPX	6,000.00	0.00006	7 ก.ค. 68	19 ธ.ค. 68	24 ธ.ค. 68
NDX28C2509D	NDX	23,900.00	0.00002	7 ก.ค. 68	19 ก.ย. 68	24 ก.ย. 68
NDX28C2512A	NDX	24,600.00	0.00002	7 ก.ค. 68	19 ธ.ค. 68	24 ธ.ค. 68
NDX28P2512A	NDX	21,400.00	0.00002	7 ก.ค. 68	19 ธ.ค. 68	24 ธ.ค. 68
HSI28C2509D	HSI	26,600.00	0.00026	14 ก.ค. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
HSI28P2510B	HSI	20,200.00	0.00026	14 ก.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
MEITUA28C2511A	3690	150.00	0.01	14 ก.ค. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68
BABA28C2510A	9988	125.00	0.01471	14 ก.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
BABA28P2511A	9988	95.00	0.01176	14 ก.ค. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68
XIAOMI28C2511A	1810	70.00	0.02	14 ก.ค. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
HSI28P2509E	HSI	22,600.00	0.00026	18 ก.ค. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
HSI28P2509F	HSI	23,600.00	0.00026	22 ก.ค. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
HSI28C2510C	HSI	30,200.00	0.00026	29 ก.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSTECH28C2510A	HSTECH	6,400.00	0.00038	31 ก.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSTECH28P2510A	HSTECH	5,300.00	0.00038	31 ก.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28P2509G	HSI	24,600.00	0.00026	31 ก.ค. 68	29 ก.ย. 68	2 ต.ค. 68
HSI28C2510D	HSI	31,200.00	0.00026	31 ก.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28P2510C	HSI	21,200.00	0.00026	31 ก.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28C2511A	HSI	32,800.00	0.00026	31 ก.ค. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68
HSI28P2511A	HSI	19,800.00	0.00026	31 ก.ค. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68
BABA28P2512A	9988	105.00	0.01176	5 ส.ค. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
TENCEN28P2512A	0700	500.00	0.00286	5 ส.ค. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
HSI28C2510E	HSI	27,200.00	0.00026	8 ส.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28P2510D	HSI	22,200.00	0.00026	8 ส.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28P2510E	HSI	23,200.00	0.00026	8 ส.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28C2511B	HSI	30,800.00	0.00026	19 ส.ค. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68
HSI28P2511B	HSI	21,800.00	0.00026	19 ส.ค. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68
HSI28P2511C	HSI	22,800.00	0.00026	19 ส.ค. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68
HSI28P2510F	HSI	24,200.00	0.00026	19 ส.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
SPX28P2512B	SPX	6,400.00	0.00012	22 ส.ค. 68	19 ธ.ค. 68	24 ธ.ค. 68
NDX28P2512B	NDX	23,200.00	0.00003	22 ส.ค. 68	19 ธ.ค. 68	24 ธ.ค. 68
BABA28C2512A	9988	140.00	0.01	22 ส.ค. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
HSI28C2510F	HSI	26,200.00	0.00026	29 ส.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
HSI28P2510G	HSI	25,200.00	0.00026	29 ส.ค. 68	30 ต.ค. 68	4 พ.ย. 68
POPMAR28C2512A	9992	395.00	0.00286	29 ส.ค. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
DJI28C2512A	DJI	48,800.00	0.00002	5 ก.ย. 68	19 ธ.ค. 68	24 ธ.ค. 68
MEITUA28C2601A	3690	130.00	0.01	5 ก.ย. 68	29 ม.ค. 69	3 ก.พ. 69
TENCEN28C2601A	0700	680.00	0.00247	5 ก.ย. 68	29 ม.ค. 69	3 ก.พ. 69
HSI28C2511C	HSI	29,800.00	0.00026	5 ก.ย. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68
HSI28C2512A	HSI	31,400.00	0.00026	5 ก.ย. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
HSI28P2512A	HSI	21,400.00	0.00026	5 ก.ย. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
BABA28C2601A	9988	160.00	0.00833	12 ก.ย. 68	29 ม.ค. 69	3 ก.พ. 69
NDX28C2512B	NDX	25,200.00	0.00005	12 ก.ย. 68	19 ธ.ค. 68	24 ธ.ค. 68
HSI28P2511D	HSI	23,800.00	0.00026	19 ก.ย. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
HSI28P2512B	HSI	22,400.00	0.00026	19 ก.ย. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
HSI28C2512B	HSI	32,400.00	0.00026	19 ก.ย. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
HSI28C2511D	HSI	27,800.00	0.00026	30 ก.ย. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68
HSI28P2511E	HSI	25,800.00	0.00026	30 ก.ย. 68	27 พ.ย. 68	2 ธ.ค. 68
HSTECH28C2512A	HSTECH	7,000.00	0.00038	6 ต.ค. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
HSTECH28P2512A	HSTECH	5,800.00	0.00038	6 ต.ค. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
HSI28C2601A	HSI	33,600.00	0.00026	14 ต.ค. 68	29 ม.ค. 69	3 ก.พ. 69
HSI28P2601A	HSI	22,600.00	0.00026	14 ต.ค. 68	29 ม.ค. 69	3 ก.พ. 69
HSI28P2512C	HSI	24,400.00	0.00026	14 ต.ค. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
NIKKEI28C2603A	NIKKEI	54,000.00	0.00091	14 ต.ค. 68	12 มี.ค. 69	17 มี.ค. 69
NIKKEI28C2603B	NIKKEI	51,000.00	0.00091	14 ต.ค. 68	12 มี.ค. 69	17 มี.ค. 69
NIKKEI28C2603C	NIKKEI	48,000.00	0.00091	14 ต.ค. 68	12 มี.ค. 69	17 มี.ค. 69
NIKKEI28C2603D	NIKKEI	45,000.00	0.00091	14 ต.ค. 68	12 มี.ค. 69	17 มี.ค. 69
NIKKEI28P2603A	NIKKEI	50,000.00	0.00091	14 ต.ค. 68	12 มี.ค. 69	17 มี.ค. 69
NIKKEI28P2603B	NIKKEI	47,000.00	0.00091	14 ต.ค. 68	12 มี.ค. 69	17 มี.ค. 69
NIKKEI28P2603C	NIKKEI	44,000.00	0.00091	14 ต.ค. 68	12 มี.ค. 69	17 มี.ค. 69
NIKKEI28P2603D	NIKKEI	41,000.00	0.00091	14 ต.ค. 68	12 มี.ค. 69	17 มี.ค. 69
HSI28C2512C	HSI	28,400.00	0.00026	20 ต.ค. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
HSI28P2601C	HSI	20,600.00	0.00026	20 ต.ค. 68	29 ม.ค. 69	3 ก.พ. 69
HSI28C2512D	HSI	30,400.00	0.00026	28 ต.ค. 68	30 ธ.ค. 68	7 ม.ค. 69
HSI28C2602A	HSI	32,200.00	0.00026	5 พ.ย. 68	26 ก.พ. 69	4 มี.ค. 69
HSI28P2602A	HSI	21,200.00	0.00026	5 พ.ย. 68	26 ก.พ. 69	4 มี.ค. 69
HSI28C2601C	HSI	31,600.00	0.00026	5 พ.ย. 68	29 ม.ค. 69	3 ก.พ. 69
HSI28P2601D	HSI	24,600.00	0.00026	5 พ.ย. 68	29 ม.ค. 69	3 ก.พ. 69
SPX28C2603A	SPX	7,300.00	0.00005	5 พ.ย. 68	20 มี.ค. 69	25 มี.ค. 69
SPX28P2603A	SPX	6,700.00	0.00005	5 พ.ย. 68	20 มี.ค. 69	25 มี.ค. 69
NDX28C2603A	NDX	27,000.00	0.00001	5 พ.ย. 68	20 มี.ค. 69	25 มี.ค. 69
NDX28P2603A	NDX	24,200.00	0.00001	5 พ.ย. 68	20 มี.ค. 69	25 มี.ค. 69
HSI28C2601D	HSI	29,600.00	0.00026	10 พ.ย. 68	29 ม.ค. 69	3 ก.พ. 69
HSI28C2602B	HSI	28,200.00	0.00026	10 พ.ย. 68	26 ก.พ. 69	4 มี.ค. 69
DJI28C2603A	DJI	50,000.00	0.00001	10 พ.ย. 68	20 มี.ค. 69	25 มี.ค. 69
DJI28P2603A	DJI	45,000.00	0.00001	10 พ.ย. 68	20 มี.ค. 69	25 มี.ค. 69
HSI28P2601E	HSI	26,600.00	0.00026	19 พ.ย. 68	29 ม.ค. 69	3 ก.พ. 69
HSI28C2601E	HSI	27,600.00	0.00026	25 พ.ย. 68	29 ม.ค. 69	3 ก.พ. 69

ชื่อย่อ DW	หลักทรัพย์อ้างอิง	ราคาใช้สิทธิ	อัตราใช้สิทธิ/ตัวคูณดัชนี	วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	วันทำการซื้อขายสุดท้าย	วันครบกำหนดอายุ
NDX28P2603B	NDX	22,500.00	0.00004	25 พ.ย. 68	20 มี.ค. 69	25 มี.ค. 69
NDX28C2603B	NDX	28,000.00	0.00004	25 พ.ย. 68	20 มี.ค. 69	25 มี.ค. 69
SPX28C2603B	SPX	7,100.00	0.00012	25 พ.ย. 68	20 มี.ค. 69	25 มี.ค. 69
SPX28P2603B	SPX	6,300.00	0.00012	25 พ.ย. 68	20 มี.ค. 69	25 มี.ค. 69
HSI28C2602C	HSI	30,200.00	0.00026	28 พ.ย. 68	26 ก.พ. 69	4 มี.ค. 69
HSI28P2602B	HSI	23,200.00	0.00026	9 ธ.ค. 68	26 ก.พ. 69	4 มี.ค. 69
HSI28P2602C	HSI	25,200.00	0.00026	30 ธ.ค. 68	26 ก.พ. 69	4 มี.ค. 69

ข้อมูลใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ข้างต้น เป็นข้อมูลจากใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ตามแบบแสดงรายการข้อมูล และร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) ที่ได้ยื่นต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ในการเสนอขายครั้งแรกของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ซึ่งยังไม่รวมถึงการปรับสิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ทั้งนี้ ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่นอาจมีการปรับสิทธิตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ผู้ลงทุนสามารถติดตามข้อมูลการปรับสิทธิได้จากข่าวตลาดหลักทรัพย์ หรือที่ www.set.or.th

6.3 ประวัติการผิดนัดชำระการส่งมอบหรือการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

- ไม่มี-

7. ความขัดแย้งทางผลประโยชน์จากการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

บริษัท ในฐานะผู้ออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และเป็นบริษัทในเครือ MGL มีการให้บริการการลงทุนทั้งในด้านการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ ธุรกิจค้าหลักทรัพย์ ธุรกิจการเป็นที่ปรึกษาการลงทุน ธุรกิจการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ และการเป็นผู้ค้าสัญญาซื้อขายล่วงหน้า รวมทั้งการให้บริการด้านงานวิจัยของสายงานวิจัยหลักทรัพย์ ซึ่งครอบคลุมการให้บริการการด้านวิจัยเศรษฐกิจมหภาค และจุลภาค ตลอดจนหลักทรัพย์ของบริษัทที่จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ซึ่งอาจทำให้บริษัทมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์จากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือจากการประกอบธุรกิจหรือการทำหน้าที่อื่นของบริษัทและบริษัทที่เกี่ยวข้อง เช่น การให้บริการแนะนำการลงทุน การลงทุนของบริษัท เป็นต้น บริษัท ในฐานะผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จึงได้มีการดำเนินการ ดังนี้

1. การแยกฝ่ายงานที่ออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ออกจากฝ่ายงานอื่น ๆ โดยฝ่ายงานที่มีหน้าที่ในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เป็นส่วนหนึ่งของ Derivative Business ในสังกัด Equity Derivatives and Trading ซึ่งดูแลด้านการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และ derivatives business อื่น ๆ โดยเฉพาะ เช่น การซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้านอกตลาด (OTC Derivatives) และธุรกรรมอื่นที่เกี่ยวข้อง

2. ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีการให้บริการด้านนายหน้าการซื้อขายหลักทรัพย์แก่ผู้ลงทุนสถาบัน ทั้งในและต่างประเทศ รวมทั้งการทำธุรกรรมเพื่อป้องกันความเสี่ยงจากการลงทุนของบริษัท ซึ่งการทำธุรกรรมดังกล่าวอาจก่อให้เกิดผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์อ้างอิง หรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง และอาจส่งผลกระทบถึงผู้ลงทุนที่เข้าถือครองใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จึงมีการดูแลควบคุมภายในเพื่อใช้ตรวจสอบและใช้เป็นเกณฑ์ในการป้องกันการใช้ข้อมูลภายใน โดยเฉพาะอย่างยิ่งข้อมูลที่มีผลต่อราคาซื้อขายหลักทรัพย์ซึ่งยังไม่ได้เปิดเผยต่อสาธารณชน ซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อราคาซื้อขายหลักทรัพย์ หรือระดับของดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง หรือดัชนีที่ใช้ชำระราคา หรือก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์

3. การปฏิบัติของแต่ละหน่วยงานต่าง ๆ ภายในบริษัท เสมือนลูกค้าของบริษัทหรือผู้ลงทุนทั่วไป โดยการให้ความเท่าเทียมกันในการรับข้อมูลข่าวสารต่าง ๆ รวมถึงรายงานบทวิเคราะห์หลักทรัพย์ของฝ่ายงานวิจัยหลักทรัพย์ด้วย

4. การดูแลตรวจสอบการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ดำเนินการโดยหน่วยงาน Risk Management Group (RMG) ซึ่งมีหน้าที่ในการดูแลและตรวจสอบการดำเนินงานต่าง ๆ ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และบริษัทในเครือ MGL รวมทั้งการทบทวนและกำกับการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เพื่อลดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ และส่งผลกระทบต่อการดำเนินธุรกิจอื่น ๆ น้อยที่สุด

MGL มี RMG ซึ่งเป็นหน่วยงานอิสระ และเป็นศูนย์กลางที่รับผิดชอบเกี่ยวกับการประเมินและตรวจสอบความเสี่ยงต่าง ๆ ของ MGL RMG มีหน้าที่ในการประเมินความเสี่ยง วิเคราะห์ และควบคุมความเสี่ยงของการทำธุรกรรมต่าง ๆ ทั้งนี้ การทำงานของ RMG จะได้รับการตรวจสอบอีกขั้นจาก Internal Audit Division (IAD) เพื่อควบคุมดูแลการบริหารความเสี่ยงให้เป็นไปตามนโยบายของบริษัท และไม่ขัดต่อกฎเกณฑ์ใด ๆ ของหน่วยงานทางการที่เกี่ยวข้อง

8. โครงสร้างเงินทุน

8.1 หลักทรัพย์ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ณ วันที่ 31 มีนาคม 2569 บริษัทมีทุนจดทะเบียน 500,000,000 บาท ทุนเรียกชำระแล้ว 500,000,000 บาท เป็นหุ้นสามัญมูลค่า 500,000,000 บาท มูลค่าที่ตราไว้ หุ้นละ 10 บาท

8.2 ผู้ถือหุ้น

รายชื่อผู้ถือหุ้นสูงสุด 10 รายแรกของบริษัท พร้อมทั้งจำนวนหุ้นที่ถือและสัดส่วนการถือหุ้นล่าสุด มีดังนี้

ลำดับที่	รายชื่อผู้ถือหุ้น	จำนวนที่ถือหุ้น (หุ้น)	สัดส่วนการถือหุ้น (ร้อยละ) (โดย 0.0005 จะถูกปัดขึ้น)
1.	แมคควอรี อินเตอร์เนชั่นแนล โฮลดิ้งส์ ลิมิเต็ด	49,999,997	100
2.	นายวิลเลี่ยม แองกัส เค็นท์	2	0.00
3.	นางเบญจวรรณ พูลสวัสดิ์ แวนไดน์	1	0.00
	รวม	**50,000,000**	**100**

แมคควอรี อินเตอร์แนชั่นแนล โฮลดิ้งส์ ลิมิเต็ด (Macquarie International Holdings Limited) มีลักษณะเป็นบริษัทที่ประกอบธุรกิจหลักโดยการถือหุ้นในบริษัทอื่น (Holding Company) โดยมีผู้ถือหุ้นที่แท้จริง (Ultimate Shareholder) คือ Macquarie Group Limited