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