

ส่วนที่ 2

ผู้ค้าประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และผู้ที่เป็นคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงของบริษัทที่ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้จัดให้ผู้ค้าประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และจัดให้มีการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อป้องกันความเสี่ยงในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ดังนี้

1. ผู้ค้าประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

1.1 ข้อมูลทั่วไป

| | | |
|------------------------|---|--|
| ชื่อผู้ค้าประกัน | : | ธนาคารเจพีมอร์แกน เซส JPMorgan Chase Bank, National Association |
| ประเภทธุรกิจ | : | การธนาคารและบริการทางการเงินอื่น ๆ |
| เลขทะเบียนบริษัท | : | FC 004891 |
| ที่ตั้งสำนักงาน | : | เลขที่ 383 เมดิสัน อเวนิว นิวยอร์ก เอ็นวาย 10179 ประเทศ สหรัฐอเมริกา |
| Homepage | : | www.jpmorganchase.com |
| โทรศัพท์ | : | +1 212 270 6000 |
| โทรสาร | : | - |
| ข้อมูลการติดต่อ | | |
| ที่อยู่ | : | ธนาคารเจพีมอร์แกน เซส เลขที่ 4 เมโทรเทคเซ็นเตอร์ ชั้น 15 บรูคลิน นิวยอร์ก 11245 |
| ชื่อผู้ติดต่อ | : | Peter W Smith, JPMorgan Interentity Analysis Group (IAG) |
| โทรสาร | : | +1 917 746 2267 |

1.2 ลักษณะการประกอบธุรกิจโดยย่อ

1.2.1 ประวัติ การพัฒนา และ โครงสร้างองค์กร

ผู้ค้าประกันเป็นธนาคารซึ่งเป็นบริษัทย่อยที่หุ้นทั้งหมดถือโดย JPMorgan Chase & Co. (“เจพีมอร์แกนเชส”) ซึ่งเป็นบริษัทที่เป็นผู้นำการให้บริการทางการเงินรายใหญ่ระดับโลก และเป็นหนึ่งในสถาบันการเงินที่ใหญ่ที่สุดในประเทศสหรัฐอเมริกา ที่มีการประกอบธุรกิจอยู่ทั่วโลก ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 ผู้ค้าประกันมีสำนักงานหลักอยู่ที่เมืองโคลัมบัส รัฐโอไฮโอ และมีสาขาใน 38 รัฐ และในกรุงวอชิงตัน ดี.ซี. ทั้งนี้ เจพีมอร์แกนเชส (รวมถึงผู้ค้าประกันและบริษัทย่อยอื่นๆ) รวมเรียกว่า “องค์กร”) ผู้ค้าประกันประกอบธุรกิจในประเทศสหรัฐอเมริกา รวมถึงผ่านทางสาขาและบริษัทย่อยอื่นที่ไม่ใช่สัญชาติสหรัฐอเมริกา รวมทั้งผ่านทางสำนักงานผู้แทน โดยหนึ่งในบริษัทย่อยหลักนั้นตั้งอยู่นอกประเทศสหรัฐอเมริกา คือ เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตีส์ พีแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) ซึ่งเป็นบริษัทย่อยที่ตั้งอยู่ในสหราชอาณาจักร โดย เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตีส์ พีแอลซี จะทำหน้าที่เป็นคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงสำหรับการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในครั้งนี้ (โปรดดูรายละเอียดเพิ่มเติมตามที่ระบุในหัวข้อที่ 2. ด้านล่างนี้)

ผู้ค้าประกัน (ทั้งโดยการดำเนินงานโดยตรงหรือผ่านทาง สำนักงานสาขา บริษัทย่อย และสำนักงาน) ได้มีการให้บริการทางการเงินแก่ทั้งลูกค้าในประเทศสหรัฐอเมริกา และนอกประเทศสหรัฐอเมริกา รวมถึงการให้บริการธนาคารเพื่อการลงทุน การให้บริการทางการเงินแก่ลูกค้าและธุรกิจขนาดเล็ก การธนาคารเพื่อการพัฒนา กระบวนการการทำธุรกรรมทางการเงิน และการจัดการสินทรัพย์ ทั้งนี้ ภายใต้ชื่อทางการค้าของเจพีมอร์แกนเชสนั้น ผู้ค้าประกันมีการให้บริการแก่ลูกค้าเป็นจำนวนหลายล้านรายในประเทศสหรัฐอเมริกาและทั่วโลก และลูกค้าที่มีชื่อเสียงระดับโลก ทั้งบริษัท สถาบันและรัฐบาล

ผู้ค้าประกันเป็นสมาคมการธนาคารแห่งชาติที่จัดตั้งขึ้นภายใต้กฎหมายสหพันธรัฐของประเทศสหรัฐอเมริกา ผู้ค้าประกันนั้น เดิมจัดตั้งขึ้นเป็นธนาคารในรัฐนิวยอร์กเมื่อวันที่ 26 พฤศจิกายน 2511 และได้เปลี่ยนสถานะเป็นสมาคมการธนาคารแห่งชาติเมื่อวันที่ 13 พฤศจิกายน 2547 ผู้ค้าประกันเป็นธนาคารที่ได้รับใบอนุญาตและธุรกิจของธนาคารอยู่ภายใต้การตรวจสอบและกฎเกณฑ์ของสำนักงานผู้ควบคุมเงินตรา (Office of the Comptroller of the Currency) (“OCC”) ซึ่งเป็นสำนักงานของกรมธนารักษ์ ประเทศสหรัฐอเมริกา ผู้ค้าประกันเป็นสมาชิกของระบบธนาคารกลาง (Federal Reserve System) ประเทศสหรัฐอเมริกาและเงินฝากในประเทศสหรัฐอเมริกาได้รับประกันโดยสถาบันประกันเงินฝากของสหรัฐอเมริกา (Federal Deposit Insurance Corporation) (“FDIC”) หมายเลขประจำตัวธนาคารกลางแห่งประเทศสหรัฐอเมริกา (Federal Reserve Bank Identification Number) คือ 852218

อำนาจของผู้ค้าประกันได้รับไว้ภายใต้พระราชบัญญัติธนาคารแห่งชาติ (National Banking Act) ของประเทศสหรัฐอเมริกา โดยรวมถึงอำนาจทั้งหมดที่จำเป็นในการประกอบธุรกิจธนาคาร การขายลดตั๋วสัญญาใช้เงินที่เปลี่ยนมือได้ คราฟท์ ตั๋วแลกเงิน และหลักฐานแห่งหนี้อื่นๆ การรับฝากเงิน การซื้อขายและการแลกเปลี่ยนเงินตรา เหรียญ และทองคำแท่ง การให้กู้ยืมเงินโดยมีหลักประกัน และจัดหา ออก และหมุนเวียนธนบัตร

สำนักงานจดทะเบียนของผู้ค้าประกัน ตั้งอยู่ที่ เลขที่ 1111 โพลาริส พาร์คเวย์ โคโลัมเบีย โอไฮโอ 43240 ประเทศสหรัฐอเมริกา สถานที่ประกอบธุรกิจหลักของผู้ค้าประกัน ตั้งอยู่ที่ เลขที่ 383 เมดิสัน อเวนิว นิวยอร์ก เอ็นวาย 10179 ประเทศสหรัฐอเมริกา หมายเลขโทรศัพท์ +1 212 270 6000

1.2.2 กิจกรรมหลักและตลาดหลัก

กิจกรรมต่างๆ ของผู้ค้าประกันได้ถูกจัดระเบียบและรวมอยู่ในธุรกิจต่างๆ ของเจพีมอร์แกนเชส ดังนั้นการดำเนินธุรกิจของผู้ค้าประกันจึงขึ้นอยู่กับเจพีมอร์แกนเชส (รวมถึงบริษัทย่อยต่างๆ ของเจพีมอร์แกนเชส และของผู้ค้าประกัน) โปรดดูคำอธิบายธุรกิจต่างๆ และผลิตภัณฑ์และการบริการที่เจพีมอร์แกนเชส และผู้ค้าประกันมอบให้แก่ลูกค้าของตนแต่ละรายดังที่ได้ระบุไว้ในข้อ 3.1 ของส่วนที่ 1 ของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้

1.2.3 ผู้บริหารและกรรมการ

ผู้บริหาร

บุคคลดังต่อไปนี้เป็นผู้บริหารของผู้ค้าประกัน ณ วันที่ของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ โดยที่อยู่ทางธุรกิจของผู้บริหารแต่ละราย คือ เลขที่ 383 เมดิสัน อเวนิว นิวยอร์ก เอ็นวาย 10179 ประเทศสหรัฐอเมริกา

| ชื่อ | ตำแหน่ง |
|----------------------|--|
| James Dimon | ประธานเจ้าหน้าที่บริหารและกรรมการผู้จัดการใหญ่ |
| Ashley Bacon | ประธานเจ้าหน้าที่ด้านความเสี่ยง |
| Lori A. Beer | ประธานเจ้าหน้าที่ด้านข้อมูล |
| Mary Callahan Erdoes | ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร ฝ่ายการบริหารสินทรัพย์และความมั่งคั่ง |
| Stacey Friedman | ที่ปรึกษาทั่วไป |
| Marianne Lake | ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร การให้สินเชื่อแก่ผู้บริโภค |
| Robin Leopold | หัวหน้าฝ่ายทรัพยากรมนุษย์ |
| Douglas B. Petno | ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร ฝ่ายการธนาคารเพื่อการพาณิชย์ |
| Jennifer A. Piepszak | ประธานเจ้าหน้าที่บริหารด้านการเงิน |
| Daniel E. Pinto | ประธานเจ้าหน้าที่บริหารด้านการจัดการ ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร ฝ่ายการธนาคารเพื่อการลงทุนและองค์กร |
| Peter L. Scher | หัวหน้าฝ่ายความรับผิดชอบต่อสังคม และประธานภูมิภาคแอตแลนติกกลาง |

Gordon A. Smith ประธานเจ้าหน้าที่บริหารด้านการจัดการ ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร ฝ่ายการ
ธนาคารเพื่อลูกค้าและชุมชน

กรรมการ

บุคคลดังต่อไปนี้เป็นผู้เป็นสมาชิกในคณะกรรมการของผู้ถือหุ้น ณ วันที่ของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับ
นี้ โดยที่อยู่ทางธุรกิจของกรรมการแต่ละราย คือ เลขที่ 383 เมดิสัน อเวนิว นิวยอร์ก เอ็นวาย 10179 ประเทศสหรัฐอเมริกา

| ชื่อ | อาชีพหลัก |
|---------------------|--|
| Linda B. Bammann | รองหัวหน้าฝ่ายบริหารความเสี่ยงของเจพีมอร์แกนเชส (เกษียณ) |
| Stephen B. Burke | ประธานกรรมการ ที่ปรึกษาอาวุโสบริษัท Comcast Corporation ของคณะกรรมการที่ไม่ได้เป็นผู้บริหาร |
| Todd A. Combs | เจ้าหน้าที่ด้านการลงทุนบริษัท Berkshire Hathaway Inc. |
| James S. Crown | ประธานและประธานเจ้าหน้าที่บริหารของบริษัท Henry Crown and Company |
| James Dimon | ประธานกรรมการและประธานเจ้าหน้าที่บริหารของเจพีมอร์แกนเชส |
| Timothy P. Flynn | ประธาน (เกษียณ) และประธานเจ้าหน้าที่บริหารของบริษัท KPMG |
| Melody Hobson | ประธานเจ้าหน้าที่บริหารร่วม และประธานบริษัท Ariel Investments, LLC |
| Michael A. Neal | ประธานบริษัท General Electric (เกษียณ) ประธานและประธานเจ้าหน้าที่ บริหาร (เกษียณ) บริษัท GE Capital |
| Phebe N. Novakovic | ประธานและประธานเจ้าหน้าที่บริหาร บริษัท General Dynamics Corporation |
| Virginia M. Rometty | ประธานบริหาร (เกษียณ) ประธานและประธานเจ้าหน้าที่บริหารของบริษัท International Business Machines Corporation |

1.2.4 ข้อมูลทางการเงิน

ผู้ถือหุ้นจัดทำการเงินรวมประจำปีและครึ่งปีตามหลักการบัญชีที่ยอมรับโดยทั่วไปของประเทศ
สหรัฐอเมริกา (“U.S. GAAP”) นอกจากนี้นโยบายการบัญชีและการรายงานทางการเงินของผู้ถือหุ้นเป็นไปตามแนว
ปฏิบัติทางการบัญชีและการรายงานที่กำหนดโดยหน่วยงานกำกับดูแลธนาคารของประเทศสหรัฐอเมริกาในกรณีที่เกี่ยวข้อง
งบการเงินรวมที่ได้รับการตรวจสอบแล้วของผู้ถือหุ้น ณ และสำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 และ 31
ธันวาคม 2562 ซึ่งประกอบด้วยงบดุลรวม ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 และ 2562 และงบกำไรขาดทุนรวม งบแสดงการ

เปลี่ยนแปลงส่วนของผู้อื้อหนี้ งบกำไรขาดทุนเบ็ดเสร็จ และงบกระแสเงินสดสำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 ได้รวมอยู่ในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ นอกจากนี้ งบการเงินรวมประจำปีและครึ่งปีของผู้ถือหุ้นสามารถดูได้จากเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์ลักเซมเบิร์ก (www.bourse.lu) National Storage Mechanism แห่งสหราชอาณาจักร (www.morningstar.co.uk/uk/nsm) และ Euronext Dublin (www.ise.ie) ผู้ถือหุ้นยื่นรายงานสภาพและรายได้รวมประจำปีไตรมาสสำหรับธนาคารที่มีสำนักงานทั้งในและต่างประเทศ (“Call Report”) กับสภาการตรวจสอบสถาบันการเงินแห่งรัฐบาลของประเทศสหรัฐอเมริกา (Federal Financial Institutions Examination Council) (“FFIEC”) โดยข้อมูลส่วนที่ไม่ได้เป็นข้อมูลความลับใน Call Report สามารถดูได้ในเว็บไซต์ของ FFIEC ที่ <https://cdr.ffiec.gov/public/> ทั้งนี้ รายงาน Call Report จัดทำขึ้นตามกฎระเบียบที่ออกโดย FFIEC มิใช่ U.S. GAAP รายงาน Call Report เป็นเอกสารเกี่ยวกับการกำกับดูแลทางกฎหมาย ไม่ใช่เอกสารหลักทางบัญชี ไม่ได้เป็นไปตาม U.S. GAAP และไม่ได้ให้รายละเอียดการเปิดเผยข้อมูลทางการเงินทั้งหมดของผู้ถือหุ้น รายงาน Call Report ไม่ได้ถูกรวมอยู่ในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้โดยการอ้างอิง และไม่ถือเป็นส่วนหนึ่งของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้

1.2.5 การบริหารความเสี่ยง

การบริหารความเสี่ยงเป็นส่วนหนึ่งของการดำเนินธุรกิจของเจพีมอร์แกนเชส เมื่อเจพีมอร์แกนเชสมีการปล่อยสินเชื่อให้แก่ผู้บริโภครหรือธุรกิจขนาดใหญ่ การให้คำแนะนำแก่ลูกค้าในการตัดสินใจลงทุน การทำการตลาดในหลักทรัพย์หรือการเสนอขายผลิตภัณฑ์และการบริการ เจพีมอร์แกนเชสมีการประเมินความเสี่ยงในบางระดับ โดยวัตถุประสงค์โดยทั่วไปของเจพีมอร์แกนเชสนั้นเพื่อการบริหารธุรกิจ และความเสี่ยงที่เกี่ยวข้อง ในลักษณะที่ทำให้มีความสมดุลของส่วนได้เสียของลูกค้า นักลงทุน และปกป้องให้บริการของเจพีมอร์แกนเชสมีความปลอดภัย

เจพีมอร์แกนเชสเชื่อว่าการบริหารความเสี่ยงอย่างมีประสิทธิภาพนั้นจำเป็นต้องรวมถึงสิ่งดังต่อไปนี้ ตัวอย่างเช่น

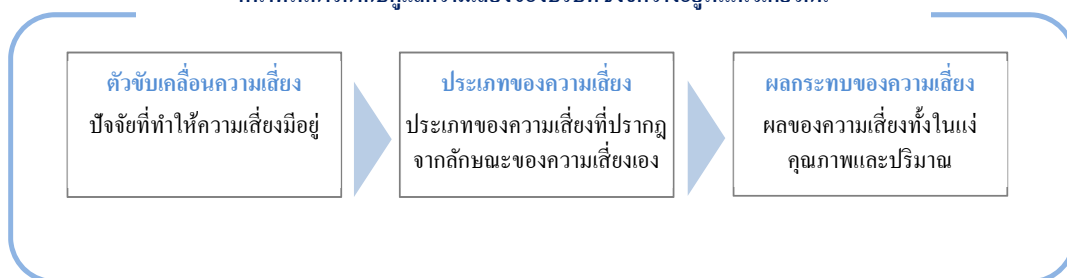
- ขอบรับซึ่งหน้าที่ความรับผิดชอบ รวมถึงการบ่งชี้และการนำเสนอประเด็นความเสี่ยงโดยบุคคลทั้งหมดภายในเจพีมอร์แกนเชส
- ความเป็นผู้รับผิดชอบในการบ่งชี้ความเสี่ยง การประเมิน การจัดการและข้อมูลภายในแต่ละหน่วยธุรกิจ (line of business (“LOB”)) และองค์กร และ
- โครงสร้างทั่วโลกของการจัดการความเสี่ยงที่ดี

เจพีมอร์แกนเชสได้ดำเนินการตามกฎเกณฑ์และกรอบการจ่ายค่าตอบแทนที่มีความสมดุลกับการจัดการที่ดีและเข้มแข็งภายใน ความเป็นอิสระในการตรวจสอบของคณะกรรมการ (“คณะกรรมการ”) ผลกระทบของความเสี่ยงและประเด็นในการควบคุมนั้นจะมีการพิจารณาในการประเมินผลการปฏิบัติงานของเจพีมอร์แกนเชสและกระบวนการในการจ่ายค่าตอบแทนและผลประโยชน์

กรอบการดูแลจัดการและการกำกับความเสี่ยง

การจัดการความเสี่ยงที่ดีของเจพีมอร์แกนเชสและกรอบการกำกับดูแลนั้นเกี่ยวข้องกับการนำไปสู่ความเข้าใจซึ่งความเสี่ยง ประเภทความเสี่ยง และผลกระทบของความเสี่ยง

หน้าที่ในการกำกับดูแลความเสี่ยงของบริษัทซึ่งจัดวางอยู่ในแนวเดียวกัน



ตัวขับเคลื่อนความเสี่ยง

ตัวขับเคลื่อนความเสี่ยงนั้นเป็นปัจจัยที่ทำให้ความเสี่ยงยังคงมีอยู่ โดยตัวขับเคลื่อนความเสี่ยงนั้นรวมถึง สภาพแวดล้อมทางเศรษฐกิจ กฎเกณฑ์และนโยบายของรัฐ คู่แข่งและสภาวะทางการตลาด การตัดสินใจทางธุรกิจ กระบวนการและการตัดสินใจที่ผิดพลาด การกระทำความผิดที่มีการไต่รื้อไต่สวนไว้ก่อน ตลาดที่มีความผิดปกติ และภัยธรรมชาติ

ประเภทความเสี่ยง

ประเภทของความเสี่ยงนั้นถูกจำแนกออกมาตามลักษณะที่แสดงออกของความเสี่ยงนั่นเอง ทั้งนี้ โดยทั่วไปแล้ว สามารถแยกความเสี่ยงออกได้เป็นสี่ประเภทดังนี้

- ความเสี่ยงทางกลยุทธ์ซึ่งเป็นความเสี่ยงด้านรายได้ เงินทุน สภาพคล่อง หรือชื่อเสียงที่เกี่ยวข้องกับการออกแบบแผนธุรกิจที่ผิดพลาดหรือไม่ดีพอ หรือการโต้ตอบต่อความเปลี่ยนแปลงในสภาพแวดล้อมของการประกอบกิจการที่ไม่เพียงพอ
- ความเสี่ยงด้านการลงทุนและเครดิตซึ่งเป็นความเสี่ยงที่มีความเกี่ยวข้องกับการผิดนัดหรือการเปลี่ยนแปลงประวัติทางเครดิตของลูกค้า หรือคู่สัญญา หรือความสูญเสียไปซึ่งเงินลงทุน การลดลงของผลตอบแทนจากเงินลงทุนที่คาดหวัง รวมถึงความเสี่ยงทางเครดิตของผู้บริโภครวม ความเสี่ยงทางเครดิตของธุรกิจขนาดใหญ่ และความเสี่ยงด้านพอร์ตการลงทุน
- ความเสี่ยงด้านการตลาดซึ่งเป็นความเสี่ยงที่มีความเกี่ยวข้องกับการเปลี่ยนแปลงในปัจจัยทางการตลาด เช่น อัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศและดอกเบี้ย ราคาสินค้าอุปโภคบริโภคและเงินลงทุน ความผันผวนของส่วนต่างทางเครดิต มูลค่าของสินทรัพย์และความรับผิดชอบในภาระหนี้และระยะยาว
- ความเสี่ยงด้านการปฏิบัติการซึ่งเป็นความเสี่ยงที่มีความเกี่ยวข้องกับการกระทบในทางลบอันเกิดขึ้นจากความไม่เพียงพอของกระบวนการภายใน หรือระบบ ปัจจัยเกี่ยวกับมนุษย์ หรือเหตุการณ์ภายนอกซึ่ง

ส่งผลกระทบต่อกระบวนการหรือระบบของเจพีมอร์แกนเชส อันรวมถึงการปฏิบัติตามกฎหมาย การปฏิบัติงาน กฎหมาย และความเสี่ยงทางรูปแบบและการประเมิน

ผลกระทบของความเสี่ยง

ผลกระทบของความเสี่ยงนั้นเป็นผลมาจากความเสี่ยง ทั้งในด้านปริมาณและคุณภาพ ผลกระทบหลายประการที่แสดงถึงความเสี่ยง รวมถึงผลกระทบโดยเชิงปริมาณ เช่น การลดลงของรายได้และเงินทุน การขาดสภาพคล่อง และค่าปรับหรือโทษ หรือผลกระทบด้านคุณภาพ เช่น ความเสียหายต่อชื่อเสียง การสูญเสียลูกค้า และการดำเนินการบังคับคดีและการปฏิบัติตามกฎหมาย

กรอบการดูแลและการบริหารจัดการที่เกี่ยวกับความเสี่ยงของเจพีมอร์แกนเชสนั้นมีการบริหารจัดการบนพื้นฐานของระดับองค์กร เจพีมอร์แกนเชสมิมีหน่วยงานที่บริหารความเสี่ยงอย่างเป็นอิสระ (“IRM”) ซึ่งประกอบด้วยหน่วยงานการปฏิบัติตามกฎหมายและการบริหารความเสี่ยง โดยประธานเจ้าหน้าที่บริหาร (Chief Executive Officer (CEO)) ได้แต่งตั้งโดยความเห็นชอบของคณะกรรมการความเสี่ยง (“คณะกรรมการความเสี่ยง”) ตำแหน่ง Chief Risk Office (CRO) ของเจพีมอร์แกนเชสเป็นผู้นำในหน่วยงาน IRM และบริหารโครงสร้างการจัดการความเสี่ยงของเจพีมอร์แกนเชส กรอบหลักเกณฑ์นั้นจะต้องได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการความเสี่ยงในรูปแบบของนโยบายการกำกับดูแลความเสี่ยง (risk governance and oversight policy) CRO ของเจพีมอร์แกนเชสจะกำกับดูแลและมอบหมายอำนาจให้แก่ LBO CROs, Firmwide Risk Executives (“FREs”) และ Chief Compliance Office (“CCO”) ของเจพีมอร์แกนเชส ซึ่งแต่ละหน่วยงานดังกล่าวจะจัดตั้งหน่วยงานในการปฏิบัติตามกฎหมายและการจัดการความเสี่ยงเพื่อกำหนดนโยบายการบริหารจัดการความเสี่ยงและมาตรฐาน รวมทั้งกำหนดและกำกับดูแลการปฏิบัติให้เป็นไปตามการจัดการความเสี่ยงของเจพีมอร์แกนเชส ทั้งนี้ LBO CROs จะรับผิดชอบสำหรับความเสี่ยงที่เกิดขึ้นในหน่วยงาน LOBs ในขณะที่หน่วยงาน FREs นั้นจะกำกับดูแลเกี่ยวกับความเสี่ยงที่ขยายไปถึงตัวบุคคลใน LOBs หน่วยงานต่างๆ และในภูมิภาค

การป้องกันสามลำดับขั้น

เจพีมอร์แกนเชสเชื่อมั่นในแต่ละหน่วยงานของ LOBs และหน่วยงาน Corporate ที่มีผลต่อความเสี่ยงในการดำเนินงานภายในตัวแปรที่ระบุโดยหน่วยงาน IRM และภายในความเสี่ยงที่มีการบ่งชี้และมาตรฐานการควบคุม แต่ละ LOB ฝ่ายการคลังและ CIO รวมถึงหน่วยงานอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องในทางการจัดการการควบคุม เทคโนโลยี การดำเนินงาน ซึ่งเป็นผู้รับผิดชอบลำดับแรกของเจพีมอร์แกนเชส และมีหน้าที่ในการบ่งชี้ความเสี่ยง เช่นเดียวกันกับการออกแบบและการดำเนินการควบคุม ในการจัดการความเสี่ยง ผู้รับผิดชอบในลำดับแรกต้องรับผิดชอบในการปฏิบัติตามกฎหมาย ระเบียบ ข้อบังคับ และเพื่อการดำเนินการตามโครงสร้างการบริหารความเสี่ยง ซึ่งรวมถึงนโยบาย มาตรฐาน ข้อจำกัด สัดส่วน และการควบคุม) ซึ่งจัดให้มีขึ้น โดย IRM

หน่วยงาน IRM นั้น เป็นอิสระในทางธุรกิจและเป็น “ผู้รับผิดชอบในลำดับที่สอง” ของเจพีมอร์แกนเชส หน้าที่ของ IRM นั้น คือ การมีอิสระในการประเมินและการทำทนายต่อผู้รับผิดชอบในลำดับแรก IRM มีหน้าที่รับผิดชอบในการปฏิบัติตามกฎหมาย ระเบียบ ข้อบังคับ และเพื่อการดำเนินการตามโครงสร้างการบริหารความเสี่ยงที่จัดให้มีขึ้น โดย IRM (ซึ่งรวมถึงนโยบาย มาตรฐาน ข้อจำกัด สัดส่วน และการควบคุม) ที่เกี่ยวกับกระบวนการของหน่วยงานของตนเอง

หน่วยงานการตรวจสอบภายในเป็นหน่วยงานอิสระที่มีการประเมินถึงวัตถุประสงค์เกี่ยวกับความพอเพียงและความมีประสิทธิภาพของ กระบวนการ การควบคุม การกำกับดูแลและการบริหารความเสี่ยงซึ่งครอบคลุมทุกสำนักงานของเจพีมอร์แกนเชสในฐานะ “ผู้รับผิดชอบลำดับที่สาม” หน่วยงานการตรวจสอบภายในนี้มี General Auditor เป็นหัวหน้าซึ่งรายงานต่อ Audit Committee และการบริหาร โดย CEO

นอกจากนี้ ยังมีหน่วยงานอื่นๆ ที่มีส่วนช่วยในสภาวะแวดล้อมของการควบคุมองค์กรของทุกสำนักงานของเจพีมอร์แกนเชส แต่ไม่ได้ถือเป็นหนึ่งในหน่วยงานตามลำดับชั้นของการป้องกัน ซึ่งรวมถึง การเงิน ทรัพยากรบุคคล และกฎหมาย

การบ่งชี้ความเสี่ยงและความรับผิดชอบ

แต่ละ LOB และหน่วยงาน Corporate นั้นรับผิดชอบในการบ่งชี้ความเสี่ยงที่มีอยู่ รวมถึงการออกแบบและการกำหนดการควบคุม รวมถึงการควบคุมที่มีการระบุใน IRM เพื่อการจัดการความเสี่ยงต่างๆ ดังกล่าว และเพื่อสนับสนุนการกระทำดังกล่าวนั้น เจพีมอร์แกนเชสมีการระบุความเสี่ยง (Risk Identification Framework) ที่กำหนดขึ้นเพื่ออำนวยความสะดวกให้แก่ผู้รับผิดชอบในการบ่งชี้ความเสี่ยงที่สำคัญที่มีผลต่อเจพีมอร์แกนเชส จัดทำความเสี่ยงให้อยู่ในรูปแบบการรวมศูนย์และทบทวนความเสี่ยงที่มีความสำคัญที่สุดเป็นประจำ โดย IRM นั้นจะต้องทบทวนและทดสอบการบ่งชี้ความเสี่ยงโดย LOB และ Corporate การดำรงไว้ซึ่งการรวมศูนย์ และการจัดให้มีการรวมผลของทั้งองค์กรให้แก่ JPMorgan Chasewide Risk Committee (“FRC”) และ คณะกรรมการจัดการความเสี่ยง

ความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (Risk Appetite)

ความเสี่ยงที่ยอมรับได้ของเจพีมอร์แกนเชสอยู่ภายใต้กรอบของ ความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (Risk Appetite) กรอบหลักเกณฑ์และความเสี่ยงที่ยอมรับได้ของเจพีมอร์แกนเชสกำหนดขึ้น โดย CEO, Chief Finance Officer (“CFO”) และ CRO โดยปัจจัยเกี่ยวกับคุณภาพและตัวชี้วัดปริมาณถูกนำมาใช้ในการติดตามและชี้วัดความสามารถของเจพีมอร์แกนเชสในการรับความเสี่ยงที่สอดคล้องกับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ที่กำหนดไว้ ปัจจัยทางคุณภาพนั้นได้จัดให้มีขึ้นเพื่อประเมินความเสี่ยงด้านการดำเนินงาน และส่งผลกระทบต่อชื่อเสียงของเจพีมอร์แกนเชส ผลกระทบของความเสี่ยงที่ยอมรับได้นั้นมีการรายงานให้แก่คณะกรรมการความเสี่ยง

โครงสร้างการกำกับดูแลและการจัดการความเสี่ยง

สถานะที่เป็นอิสระของหน่วยงาน IRM นั้นได้รับการสนับสนุนจากโครงสร้างการกำกับดูแลซึ่งกำหนดให้มีการเสนอประเด็นความเสี่ยงไปยังผู้บริหารระดับสูง FRC และคณะกรรมการบริษัท ตามที่เหมาะสม

ผังโครงสร้างที่ระบุด้านล่างนี้แสดงให้เห็นถึงความมุ่งมั่นของคณะกรรมการและผู้บริหารระดับสูงหลักที่อยู่ในระดับคณะกรรมการของโครงสร้างการกำกับดูแลความเสี่ยงของเจพีมอร์แกนเชส นอกจากนั้น ยังมีคณะกรรมการอื่นๆ คณะทำงาน และแนวทางในการนำเสนอซึ่งเป็นการสนับสนุนการกำกับดูแลความเสี่ยงอันมิได้ระบุให้เห็นในผังโครงสร้างด้านล่างนี้หรือแสดงให้เห็นในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้

| คณะกรรมการ (Board of Directors) | | | | | | | |
|--|---|---|---|--|---|---|--|
| คณะกรรมการความเสี่ยง (Board Risk Committee) | คณะกรรมการการรับผิดชอบต่อสาธารณะ (Public Responsibility Committee) | คณะกรรมการการพัฒนาการจัดการและค่าตอบแทน (Compensation and Management Development Committee) | คณะกรรมการการแต่งตั้งและการกำกับดูแลกิจการที่ดี (Corporate Governance and Nominating Committee) | คณะกรรมการตรวจสอบ (Audit) | | | |
| | | | | | | | |
| คณะกรรมการบริหาร (Operating Committee) | | | | | | | |
| ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร (Chief Executive Officer) | | | | | | | ผู้สอบบัญชีทั่วไป ^(b) (สมาชิกโดยตำแหน่ง) (General Auditor (ex-officio member)) |
| ประธานเจ้าหน้าที่บริหารความเสี่ยง (Chief Risk Officer) ^(c) | ประธานเจ้าหน้าที่บริหารด้านการเงิน (Chief Financial Officer) | ฝ่ายธุรกิจ, ประธานเจ้าหน้าที่บริหารและหัวหน้าฝ่ายธุรกิจต่างๆ (Line of Business CEOs and Select Business Heads) ^(a) | ที่ปรึกษาทั่วไป (General Counsel) | ประธานเจ้าหน้าที่บริหารด้านข้อมูล (Chief Information Officer) | หัวหน้าฝ่ายความรับผิดชอบต่อสาธารณะและประธานภูมิภาคแอตแลนติกกลาง (Head of Corporate Responsibility and Chairman of the Mid-Atlantic Region) | Head of Human Resources (หัวหน้าฝ่ายทรัพยากรบุคคล) | |
| คณะกรรมการความเสี่ยง (Firmwide Risk Committee) ^(c) | คณะกรรมการความรับผิดชอบและสินทรัพย์ และคณะกรรมการประเมินและการกำกับดูแลกิจการ (Asset and Liability Committee and Firmwide Valuation Governance Forum) | | | | | | การตรวจสอบภายใน (Internal Audit) |
| ฝ่ายธุรกิจ คณะกรรมการความเสี่ยงระดับภูมิภาค และ คณะกรรมการควบคุม (Line of Business, Regional Risk committees and Firmwide Control Committee) | | | | | | | |

- ^(a) รวมถึงประธานเจ้าหน้าที่บริหาร (CEO) ฝ่ายสินเชื่อเพื่อผู้บริโภค ประธานเจ้าหน้าที่บริหารด้านการธนาคารเพื่อผู้บริโภค และหัวหน้าฝ่ายที่ได้รับคัดเลือก ประธานเจ้าหน้าที่บริหารสำหรับ Corporate & Investment Bank และ Consumer & Community Banking ยังดำรงตำแหน่งเป็นประธานร่วมของเจเอ็มอีแอนด์และประธานเจ้าหน้าที่บริหารร่วมด้วย
- ^(b) ผู้สอบบัญชีทั่วไป (General Auditor) รายงานต่อคณะกรรมการตรวจสอบ (Audit Committee) และทำหน้าที่ต่อประธานเจ้าหน้าที่บริหาร
- ^(c) คณะกรรมการความเสี่ยง (The Firmwide Risk Committee) จะนำเสนอประเด็นที่สำคัญต่อคณะกรรมการความเสี่ยง (Board Risk Committee) โดยตรงตามที่สมควร ประธานเจ้าหน้าที่บริหารด้านความเสี่ยงอาจนำเสนอโดยตรงต่อคณะกรรมการความเสี่ยง (Board Risk Committee)

คณะกรรมการการปฏิบัติงาน (Operating Committee) ของเจเอ็มอีแอนด์ประกอบด้วย CEO, CRO, CFO, General Counsel, CEOs ของ LOBs และผู้บริหารระดับสูงของเจเอ็มอีแอนด์ ซึ่งมีหน้าที่รับผิดชอบและอาจเสนอเรื่องไป

ยังคณะกรรมการของเจพีมอร์แกนเซส คณะกรรมการการปฏิบัติงาน (Operating Committee) มีหน้าที่รับผิดชอบในการเสนอเรื่องไปยังคณะกรรมการบริษัทที่จำเป็นในการอำนวยความสะดวกในการปฏิบัติหน้าที่ของคณะกรรมการ

การดูแลของคณะกรรมการ

คณะกรรมการของเจพีมอร์แกนเซสมีการกำกับดูแลความเสี่ยง โดยมีคณะกรรมการความเสี่ยงเป็นคณะกรรมการหลักซึ่งกำกับดูแลเรื่องที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยง คณะกรรมการตรวจสอบ (Audit Committee) กำกับดูแลสถานะแวดล้อมการควบคุม คณะกรรมการการพัฒนาการบริหารและค่าตอบแทน (Compensation & Management Development Committee) กำกับดูแลเรื่องค่าตอบแทนและเรื่องอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องกับการบริหาร โดยแต่ละคณะกรรมการของคณะกรรมการบริษัทนั้นจะกำกับดูแลความเสี่ยงเกี่ยวกับชื่อเสียง และความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการปฏิบัติงานภายในขอบอำนาจหน้าที่ความรับผิดชอบของตน

คณะกรรมการบริษัทของผู้ถือหุ้นนั้นมีหน้าที่รับผิดชอบในการกำกับดูแลการบริหารจัดการของธนาคาร โดยคณะกรรมการบริษัทของผู้ถือหุ้นสามารถกระทำหน้าที่นี้ได้ทั้งโดยตรงและโดยผ่านคณะกรรมการที่มีอยู่ของคณะกรรมการบริษัทของเจพีมอร์แกนเซส การกำกับดูแลและการควบคุมความเสี่ยงในนามของผู้ถือหุ้นนั้นเป็นความรับผิดชอบหลักของคณะกรรมการความเสี่ยงและคณะกรรมการตรวจสอบ ตามลำดับ โดยในส่วนที่เกี่ยวข้องกับค่าตอบแทนและเรื่องอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องกับการบริหารนั้นจะเป็นความรับผิดชอบของคณะกรรมการการพัฒนาการจัดการและค่าตอบแทน (Compensation & Management Development Committee)

คณะกรรมการความเสี่ยงช่วยเหลือคณะกรรมการบริษัทในการตรวจสอบความรับผิดชอบของผู้บริหารในการปฏิบัติให้เป็นไปตามกรอบหลักเกณฑ์การจัดการความเสี่ยงทั่วโลกที่มีการกำหนดตามสมควรในการบ่งชี้ ความรับผิดชอบของคณะกรรมการความเสี่ยงรวมถึงการอนุมัตินโยบายความเสี่ยงหลักที่เกี่ยวข้อง การทบทวนกรอบหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องบางประการ การวิเคราะห์และการรายงานที่กำหนดโดยฝ่ายบริหาร การฝ่าฝืนความเสี่ยงที่ยอมรับได้ และประเด็นเกี่ยวกับตัวแปรต่างๆ ซึ่งอาจส่งผลกระทบในทางลบอย่างมีนัยสำคัญต่อเจพีมอร์แกนเซส รวมถึงประเด็นเกี่ยวกับเงินทุนและสภาพคล่อง และประเด็นสำคัญอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องจะมีการนำเสนอไปยังคณะกรรมการความเสี่ยงตามที่เหมาะสม

คณะกรรมการตรวจสอบ (Audit Committee) ช่วยเหลือคณะกรรมการบริษัทในการกำกับดูแลความรับผิดชอบของฝ่ายบริหารในการทำให้มั่นใจว่ามีระบบการควบคุมที่มีประสิทธิภาพที่ออกแบบมาอย่างเหมาะสมในการปกป้องสินทรัพย์และรายได้ของเจพีมอร์แกนเซส มั่นใจได้ถึงความสมบูรณ์ของงบการเงินของเจพีมอร์แกนเซสและการดำรงไว้ซึ่งการปฏิบัติตามกฎหมายของเจพีมอร์แกนเซส ตามมาตรฐานจริยธรรม นโยบาย แผน และวิธีการ กฎหมายและกฎระเบียบต่างๆ คณะกรรมการตรวจสอบยังช่วยเหลือคณะกรรมการบริษัทในการกำกับดูแลคุณสมบัติของบุคคลที่เป็นผู้จัดทำบัญชีที่มีการขึ้นทะเบียนอย่างเป็นอิสระ ความมีอิสระและผลการปฏิบัติงาน และผลการปฏิบัติงานของหน่วยงานการตรวจสอบภายในของเจพีมอร์แกนเซส

คณะกรรมการการพัฒนาการบริหารและค่าตอบแทน (Compensation & Management Development Committee (“CMDC”)) ช่วยเหลือคณะกรรมการบริษัทในการกำกับดูแลแนวปฏิบัติและหลักเกณฑ์เกี่ยวกับค่าตอบแทนของเจพีมอร์แกนเซส โดย CMDC จะมีการทบทวนและอนุมัติโครงการเกี่ยวกับค่าตอบแทนและผลประโยชน์ที่เป็นไปตามหลักเกณฑ์

ของเจพีมอร์แกนเชส คณะกรรมการดังกล่าวจะทบทวนผลการปฏิบัติงานของสมาชิกของคณะกรรมการการปฏิบัติงานต่อเป้าหมาย และอนุมัติรางวัล นอกจากนี้ รางวัลของประธานเจ้าหน้าที่บริหารนั้นอยู่ภายใต้การให้สัตยาบันของกรรมการอิสระของคณะกรรมการ โดย CMDC จะมีการทบทวนการพัฒนาและการสืบทอดตำแหน่งสำหรับผู้บริหารรายสำคัญๆ และกำกับดูแลวัฒนธรรมของเจพีมอร์แกนเชส รวมถึงการทบทวนสิ่งใหม่ๆ จากการจัดการเกี่ยวกับประเด็นการปฏิบัติงานที่สำคัญ และการกระทำของลูกจ้างที่เกี่ยวข้อง รวมถึงการดำเนินการที่เกี่ยวกับค่าตอบแทน

คณะกรรมการการรับผิดชอบต่อสาธารณะ (Public Responsibility Committee) ช่วยเหลือคณะกรรมการบริษัทในการกำกับดูแลสถานะของเจพีมอร์แกนเชสและเรื่องที่เกี่ยวข้องกับการรับผิดชอบต่อสาธารณะในการลงทุนในชุมชน การให้กู้ยืมเงินที่เป็นธรรม การดำรงไว้ การปฏิบัติต่อผู้บริโภคร และประเด็นนโยบายอื่นเกี่ยวกับสาธารณะซึ่งส่งผลกระทบต่อมูลค่าของเจพีมอร์แกนเชส ลักษณะ และอาจส่งผลกระทบต่อชื่อเสียงของเจพีมอร์แกนเชสระหว่างผู้มีส่วนได้เสียที่เกี่ยวข้อง คณะกรรมการนี้ยังมีการให้คำแนะนำในเรื่องต่างๆ ที่เกี่ยวกับการบริหารจัดการและคณะกรรมการบริษัทตามที่เหมาะสม

คณะกรรมการการแต่งตั้งและการกำกับดูแลที่ดีของกิจการ (Corporate Governance & Nominating Committee) กำกับดูแลทั่วไปเกี่ยวกับการดูแลกิจการที่ดีของคณะกรรมการบริษัท โดยจะมีการตรวจสอบคุณสมบัติของคณะกรรมการบริษัทและมีการเสนอแนะต่อคณะกรรมการบริษัทเพื่อการแต่งตั้งเข้ามาเป็นสมาชิกของคณะกรรมการบริษัท โดยคณะกรรมการนี้จะมีการประเมินและให้คำแนะนำแก่คณะกรรมการบริษัทในด้านแนวทางการจัดการที่ดีของกิจการที่มีผลใช้บังคับต่อเจพีมอร์แกนเชส รวมถึงการประเมินกรอบหลักเกณฑ์สำหรับการประเมินผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการบริษัทและการประเมินตนเอง

การกำกับดูแลของผู้บริหาร

คณะกรรมการของผู้บริหารระดับสูงของเจพีมอร์แกนเชสนั้นจะมีหน้าที่รับผิดชอบหลักเกี่ยวกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงซึ่งรวมถึง

The Firmwide Risk Committee ("FRC") เป็นคณะกรรมการในระดับการบริหารความเสี่ยงที่สูงที่สุด ซึ่งกำกับดูแลความเสี่ยงที่มีต่อธุรกิจของเจพีมอร์แกนเชส และทำหน้าที่ในการหิบบกหัวข้อและประเด็นความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องที่มีการนำเสนอโดยคณะกรรมการที่เกี่ยวข้อง และ/หรือ สมาชิกของ FRC

The Firmwide Control Committee ("FCC") เป็นคณะกรรมการที่จะคอยหิบบกและนำเสนอความเสี่ยงไปยังผู้บริหารอาวุโสเพื่อทบทวนและหารือเกี่ยวกับสภาพแวดล้อมเกี่ยวกับความเสี่ยงในการปฏิบัติภารกิจของ The Firmwide รวมถึงความเสี่ยงที่มีการบ่งชี้ การวัดความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงาน และเหตุการณ์สำคัญที่มีการนำเสนอ

Line of Business and Regional Risk Committee มีความรับผิดชอบในการกำกับดูแลการบริหารจัดการที่ดี ข้อจำกัด และการควบคุมที่มีการกำหนดไว้โดยผ่านขอบเขตของการปฏิบัติงานต่างๆ โดยคณะกรรมการนี้จะมีการทบทวนวิธีการที่ LOB หรือหน่วยงานธุรกิจอื่น มีการใช้ในการทำธุรกิจในภูมิภาคบางภูมิภาคซึ่งอาจส่งผลให้เกิดผลกระทบในทางลบโดยมุ่งเน้นไปยังการระบุ การยอมรับ การนำเสนอ และ/หรือการกำหนดการเยียวยาในเรื่องที่นำไปสู่คณะกรรมการต่างๆ ดังกล่าว

Line of Business and Corporate Function Control Committee กำกับดูแลความเสี่ยงด้านการดำเนินงาน และการควบคุมสถานะแวดล้อมของธุรกิจหรือหน่วยงาน รวมถึงความเสี่ยงด้านการดำเนินงาน ความเสี่ยงด้านการปฏิบัติตามกฎหมาย และความเสี่ยงด้านความประพฤติ โดยส่วนหนึ่งของหน้าที่นั้นจะต้องรับผิดชอบในการทบทวนตัวบ่งชี้ความเสี่ยงที่มีอยู่ในระดับสูงขึ้นหรือความเสี่ยงที่มีการปรากฏออกมา และข้อมูลอื่นๆ ที่อาจส่งผลกระทบต่อระดับของความเสี่ยงด้านการดำเนินงานของธุรกิจหรือหน่วยงาน การแสดงประเด็นความเสี่ยงการปฏิบัติงานที่สำคัญ มุ่งเน้นไปยังกระบวนการเกี่ยวกับความกังวลในเรื่องของการควบคุม การขยายการควบคุม

The Asset and Liability Committee (“ALCO”) รับผิดชอบในการกำกับดูแลสินทรัพย์และการจัดการความรับผิดชอบของเจพีมอร์แกนเชส (“ALM”) การจัดการความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง งบดุล ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ย และความเสี่ยงด้านเงินทุน

The Firmwide Valuation Governance Forum (“VGF”) ประกอบด้วยผู้บริหารทางการเงินและความเสี่ยง โดยมีหน้าที่รับผิดชอบในการกำกับดูแลการบริหารความเสี่ยงมูลค่ายุติธรรม ที่เกิดขึ้นจากกิจกรรมการประเมินมูลค่าที่กระทำทั่วทั้งเจพีมอร์แกนเชส

หน้าที่ในการกำกับดูแลกิจการที่ดีและการกำกับดูแลความเสี่ยง

เจพีมอร์แกนเชสจัดการความเสี่ยงของตนโดยผ่านทางหน่วยงานที่มีหน้าที่ในการกำกับดูแลกิจการที่ดีและการกำกับดูแลความเสี่ยง ขอบเขตของหน่วยงานแต่ละหน่วยงานนั้นอาจรวมถึงผู้ที่ทำหน้าที่ ประเภท และ/หรือผลกระทบต่อความเสี่ยงเพียงจำนวนเดียวหรือมากกว่า ยกตัวอย่างเช่น การจัดการความเสี่ยงของประเทศ (Country Risk Management) กำกับดูแลความเสี่ยงของประเทศซึ่งอาจจะเป็นตัวขับเคลื่อนความเสี่ยงหรือความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้น โดยรวมที่ก่อให้เกิดประเภทของความเสี่ยงจำนวนมาก เช่น ความเสี่ยงด้านเครดิต หรือความเสี่ยงด้านการตลาด

1.2.6 การกำกับดูแลและกฎเกณฑ์

ผู้กำกับดูแลดำเนินการและอยู่ภายใต้กฎเกณฑ์ภายใต้กฎหมายธนาคารของสหพันธรัฐและรัฐ และกฎหมายอื่นๆ ของประเทศสหรัฐอเมริกา รวมถึงพระราชบัญญัติธนาคารแห่งชาติ (National Banking Act) และพระราชบัญญัติการประกันเงินฝาก (Federal Deposit Insurance Act) รวมทั้งกฎหมายที่เกี่ยวข้องของแต่ละประเทศภายนอกสหรัฐอเมริกาที่ผู้กำกับดูแลประกอบธุรกิจ สำหรับข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับการกำกับดูแลและกฎเกณฑ์ของผู้กำกับดูแลและกฎหมายและกฎเกณฑ์ที่สำคัญที่ใช้บังคับกับผู้กำกับดูแล โปรดดู “Supervision and regulation” ในหมายเหตุ 1 ของงบการเงินรวมของผู้กำกับดูแลสำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 ของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้

1.2.7 ข้อมูลทางการเงิน

ข้อมูลทางการเงินบางส่วน

ข้อมูลทางการเงินบางส่วนที่ระบุในตารางด้านล่างนี้ได้คัดลอกมาจากงบการเงินรวมที่ผ่านการตรวจสอบแล้วของผู้กำกับดูแล สำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 ข้อมูลนี้ควรอ่านควบคู่กับหมายเหตุประกอบงบการเงินรวมและรายละเอียดข้อมูลทางการเงินอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องกับผู้กำกับดูแล

| ข้อมูลในงบกำไรขาดทุนบางส่วน (ล้านดอลลาร์สหรัฐ) | ปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม | |
|---|-------------------------------|-----------|
| | 2563 | 2562 |
| รายได้สุทธิรวม | 105,359 | 105,355 |
| สำรองสำหรับความสูญเสียทางเครดิต | 17,483 | 5,593 |
| ค่าใช้จ่ายที่ไม่ใช่ดอกเบี้ยรวม | 60,715 | 60,003 |
| รายได้ก่อนค่าใช้จ่ายภาษีเงินได้ | 27,161 | 39,759 |
| รายได้สุทธิ | 21,032 | 31,339 |
| ข้อมูลในงบดุลบางส่วน (ล้านดอลลาร์สหรัฐ) | ณ วันที่ 31 ธันวาคม | |
| | 2563 | 2562 |
| สินทรัพย์เพื่อการค้า | 297,394 | 222,383 |
| หลักทรัพย์เพื่อการลงทุน | 589,097 | 397,203 |
| เงินกู้สุทธิจากค่าเพื่อความเสี่ยงในเงินกู้ | 982,957 | 982,859 |
| สินทรัพย์รวม | 3,025,285 | 2,337,646 |
| เงินฝาก | 2,253,482 | 1,650,488 |
| หนี้ระยะยาว | 82,443 | 121,719 |
| ส่วนของผู้ถือหุ้นรวม | 270,060 | 246,097 |

ผู้สอบบัญชี

งบการเงินรวมของผู้ค้าประกันสำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 ได้รับการตรวจสอบโดย PricewaterhouseCoopers LLP ซึ่งเป็นผู้สอบบัญชีอิสระ ที่อยู่เลขที่ 300 เมคสันเอเวนิว นิวยอร์ก นิวยอร์ก 10017 ประเทศสหรัฐอเมริกา อย่างไม่มีเงื่อนไข สำเนาของรายงานของผู้สอบบัญชีอยู่ในหน้า 1 ของงบการเงินดังกล่าว

นักลงทุนสามารถศึกษางบการเงินรวมของผู้ค้าประกัน สำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 ตามที่ได้แนบมาพร้อมกับแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวน

1.2.8 ข้อพิพาท

สำหรับสรุปกระบวนการพิจารณาคดีทางกฎหมายที่สำคัญเกี่ยวกับผู้ค้าประกันนั้น สามารถดูได้ที่หมายเหตุ 27 ของงบการเงินรวมของผู้ค้าประกัน สำหรับปีสิ้นสุด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 ซึ่งได้รวมอยู่ในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้

1.2.9 การจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

ณ วันที่ 18 พฤศจิกายน 2563 ธนาคารเจพีเอ็มอร์แกน เชส (JPMorgan Chase Bank, National Association) ในฐานะผู้รับประกันได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือจาก Moody's ในอันดับความน่าเชื่อถือระดับ Aa2 (Stable Outlook)

ทั้งนี้ อันดับความน่าเชื่อถือของผู้รับประกันนั้นเป็นเพียงการประเมินโดย Moody's ซึ่งความสามารถทางการเงินโดยรวมของผู้รับประกันในการชำระหนี้ระยะยาวเท่านั้น

จากข้อมูลบนเว็บไซต์ของ Moody's อันดับความน่าเชื่อถือที่ Aa2 หมายถึง อันดับความน่าเชื่อถือที่สูงที่สุดในสามอันดับแรกจากทั้งหมดสิบอันดับ (ซึ่งรวมตัวเลข 1, 2 และ 3 รวมทั้งอันดับความน่าเชื่อถือย่อย) ที่จัดอันดับโดย Moody's

โปรดดูความหมายของการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของ Moody's ที่ออกโดย Moody's ตามที่ระบุในข้อที่ 4 ของส่วนที่ 1 (ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์)

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะเสนอขายและที่ได้รับการรับประกันโดยผู้รับประกัน จะไม่ได้รับการจัดอันดับ เว้นแต่ได้ระบุเป็นประการอื่นในประกาศการเสนอขายและเอกสารจดทะเบียนเพิ่มเติมเกี่ยวกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าว ตารางด้านล่างนี้ได้แสดงให้เห็นให้ผู้ที่มีความประสงค์จะซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ทราบเพื่อความสะดวกเท่านั้น โดยได้ระบุถึงการจัดอันดับความน่าเชื่อถือสำหรับหนี้ระยะยาวของผู้รับประกัน (ณ วันที่ 18 พฤศจิกายน 2563) การจัดอันดับความน่าเชื่อถือดำเนินการโดยสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือโดยใช้ข้อมูลที่สถาบันเหล่านั้นได้รับจากลูกหนี้ที่เกี่ยวข้องรวมถึงข้อมูลที่สถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือได้รับจากแหล่งข้อมูลอื่น การจัดอันดับความน่าเชื่อถือไม่ใช่คำแนะนำให้ซื้อ ถือครอง หรือขายหลักทรัพย์ใดๆ และอาจเปลี่ยนแปลง ถูกแทนที่ หรือเพิกถอนได้ในเวลาใดๆ โดยสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ผู้ที่จะซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ควรตรวจสอบการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้รับประกันล่าสุด ก่อนซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ใดๆ ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ข้อมูลเกี่ยวกับการจัดอันดับหนี้ของผู้รับประกันล่าสุดนั้น สามารถขอรับได้จากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่เกี่ยวข้องและสามารถดูได้จากหน้านักลงทุนสัมพันธ์ในเว็บไซต์ของเจพีเอ็มอร์แกนเชสที่ <https://jpmorganchaseco.gcs-web.com/financial-information/sec-filings> ทั้งผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้รับประกันไม่มีหน้าที่ปรับปรุงข้อมูลที่ระบุในตารางด้านล่างให้เป็นปัจจุบัน

สถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ

การจัดอันดับความน่าเชื่อถือปัจจุบันของ
หนี้ระยะยาวของผู้รับประกัน (ณ วันที่ 18
พฤศจิกายน 2563)

Moody's Investors Service, Inc.

Aa2 (stable outlook)

ข้อมูลเพิ่มเติม

ข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับผู้รับประกัน รวมถึงรายงานประจำปีตามแบบฟอร์ม 10-K รายงานประจำปีไตรมาสตามแบบฟอร์ม 10-Q และรายงานปัจจุบันตามแบบฟอร์ม 8-K ของเจพีเอ็มอร์แกนเชส เจพีเอ็มอร์แกนเชสได้ยื่นกับคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ประเทศสหรัฐอเมริกา (“รายงานตามระยะเวลา”) โดยสามารถดูได้ในเว็บไซต์ของ

คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ www.sec.gov นอกจากนี้รายงานดังกล่าวและข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับผู้
ค้าประกันสามารถดูได้จากหน้านักลงทุนสัมพันธ์ในเว็บไซต์ของเจพีมอร์แกนเชส ที่ [http://jpmorganchase.co.gcs-
web.com/financial-information/sec-filings](http://jpmorganchase.co.gcs-web.com/financial-information/sec-filings) เว็บไซต์อื่นที่ไม่ได้ระบุหรืออ้างถึงในที่นี้ไม่ถือเป็นส่วนหนึ่ง และไม่ได้รวมอยู่
ในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ โดยการอ้างอิง รายงานตามระยะเวลาไม่ได้รวมหรือถูกรวมโดยการอ้างอิงใน
และไม่ถือเป็นส่วนหนึ่งของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้

1.3 ข้อมูลอื่นที่อาจมีผลกระทบต่อผลการดำเนินงานของผู้ค้าประกันและบริษัทย่อยของผู้ค้าประกัน หรือการตัดสินใจ ลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ในกรณีที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือผู้ค้าประกันคิดชำระหนี้เงินภายใต้สัญญาผู้ค้าประกัน (ใน
จำนวนวงเงินผู้ค้าประกันตามที่อธิบายไว้ด้านล่าง) ผู้ลงทุนอาจจะสูญเสียเงินต้นทั้งจำนวนที่ลงทุนในใบสำคัญแสดงสิทธิ
อนุพันธ์ได้

1.4 สารสำคัญของสัญญาผู้ค้าประกัน

1.4.1 การผู้ค้าประกัน

ภายใต้ข้อกำหนดและเงื่อนไขที่ระบุในสัญญาผู้ค้าประกัน ภาระผูกพันของผู้ค้าประกันภายใต้สัญญาผู้ค้าประกันเป็น
ภาระผูกพันโดยตรง ไม่มีเงื่อนไข ไม่มีประกัน และไม่ด้อยสิทธิ ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถศึกษาข้อมูลเพิ่มเติมได้จากร่างสัญญา
ผู้ค้าประกันที่แนบท้ายแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวน

1.4.2 สถานะของการผู้ค้าประกัน

การผู้ค้าประกันของผู้ค้าประกันสำหรับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น (1) เป็นการผูกพันทั่วไปแบบไม่มีประกัน
และไม่ด้อยสิทธิของผู้ค้าประกันและไม่ใช่ของบริษัทในเครือใดๆ ของผู้ค้าประกัน (2) ไม่ใช่บัญชีออมทรัพย์หรือเงินฝาก
ของผู้ค้าประกันหรือบริษัทย่อยหรือบริษัทในเครือทั้งที่เป็นธนาคารหรือไม่ใช่ธนาคารของผู้ค้าประกัน และ (3) จะมีสิทธิเท่า
เทียมกับหนี้แบบไม่มีประกันและไม่ด้อยสิทธิอื่นๆ ทั้งหมดของผู้ค้าประกัน เว้นแต่ภาระผูกพันต่างๆ ซึ่งรวมถึงเงินฝากใน
ประเทศสหรัฐอเมริกาของผู้ค้าประกันที่มีสิทธิพิเศษหรือบุริมสิทธิตามกฎหมาย การผู้ค้าประกันของผู้ค้าประกันไม่ใช่เงินฝาก
ที่มีการรับประกันโดยสถาบันประกันเงินฝากของสหรัฐอเมริกา (Federal Deposit Insurance Corporation) (“FDIC”) กองทุน
ประกันเงินฝากของสหรัฐอเมริกา (Deposit Insurance Fund) หรือหน่วยงานรัฐอื่นใดหรือส่วนใดส่วนหนึ่งของหน่วยงานรัฐ

ทั้งนี้ กฎหมายสหพันธรัฐของสหรัฐอเมริกาที่นำมาบังคับใช้ในปี 2536 กำหนดให้สิทธิในการรับชำระเงินจากการ
เรียกร้องบางประเภทในการชำระบัญชีหรือการแก้ไขปัญหาอื่นๆ ของสถาบันเงินฝากที่มี FDIC เป็นผู้รับประกัน ซึ่งรวมถึงผู้
ค้าประกันเป็นบุริมสิทธิ กฎหมายดังกล่าวกำหนดให้มีการชำระค่าเรียกร้องตามลำดับดังนี้

- ลำดับแรก ค่าใช้จ่ายในการบริหารของผู้พิทักษ์ทรัพย์
- ลำดับสอง ความรับผิดชอบในเงินฝากใดๆ ของสถาบันเงินฝาก

- ลำดับสาม ความรับผิดชอบทั่วไปหรือไม่คือสิทธิอื่นใดของสถาบันเงินฝากที่ไม่ได้ระบุไว้ด้านล่าง
- ลำดับสี่ ภาระผูกพันใดๆ ที่คือสิทธิกว่าเงินฝากหรือเจ้าหนี้ทั่วไปที่ไม่ได้ระบุไว้ด้านล่าง และ
- ลำดับห้า ภาระผูกพันใดๆ ต่อผู้ถือหุ้นหรือสมาชิก (รวมถึงบริษัทที่ถือหุ้นของสถาบันเงินฝากใดๆ หรือผู้ถือหุ้นหรือเจ้าหนี้ใดๆ ของบริษัทดังกล่าว)

FDIC ได้ตีความความรับผิดชอบในเงินฝากว่ารวมถึงเงินฝากใดๆ ที่ต้องชำระ ณ สำนักงานของสถาบันเงินฝากที่ได้รับการประกันในประเทศสหรัฐอเมริกา และไม่รวมถึงเงินฝากในกิจการวิเทศธนกิจหรือเงินฝากที่ต้องชำระ ณ สำนักงานของสถาบันเงินฝากที่ได้รับการประกันที่อยู่นอกประเทศสหรัฐอเมริกาแต่เพียงผู้เดียว

ผู้ค้าประกันไม่ต้องรับผิดชอบภายใต้สัญญาการรับประกัน (1) สำหรับจำนวนเงินหรือการชำระเงินที่ผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้รับยกเว้นให้ไม่ต้องชำระภายใต้ข้อกำหนดสิทธิฯ หรือกฎหมายที่เกี่ยวข้อง (2) สำหรับจำนวนเงินที่เกินจากจำนวนหนี้ที่ถึงกำหนดชำระที่ผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีหน้าที่ต้องชำระให้แก่ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (3) ในกรณีที่ผู้ค้าประกันตกอยู่ภายใต้ข้อห้าม หรือไม่สามารถชำระหนี้เงินได้ไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน อันเนื่องมาจากภาวะสงคราม การจลาจล สถานการณ์ความขัดแย้งรุนแรง การดำเนินการของรัฐบาล หน่วยราชการ หรือส่วนใดส่วนหนึ่งของรัฐหรือหน่วยงานราชการ (ไม่ว่าโดยนิตินัย หรือพฤตินัย) ข้อจำกัดทางกฎหมาย การก่อการร้าย กบฏ การก่อความไม่สงบ เหตุการณ์ภัยพิบัติ

1.4.3 ข้อจำกัดการรับประกัน

การรับประกันของผู้ค้าประกันสำหรับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นี้จำกัดเฉพาะการชำระเงินของผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และภาระผูกพันอื่นๆ อันเกี่ยวกับผลิตภัณฑ์ดังกล่าว และให้ผู้ค้าประกันสามารถได้รับประโยชน์จากบรรดาการยกเว้น ข้อยกเว้น และการต่อสู้ทั้งหมดที่ผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีภายใต้ข้อกำหนดและเงื่อนไขของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นี้และตามกฎหมาย

นอกจากนี้ในบางกรณี ผู้ค้าประกันไม่ต้องรับผิดชอบภายใต้ข้อกำหนดของการรับประกันในการชดเชยเงินแทนผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือภาระผูกพันอื่นๆ อันเกี่ยวกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แม้ว่าผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ไม่ได้ปฏิบัติตามภาระผูกพันดังกล่าวก็ตาม ตัวอย่างเช่น หากผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ตกอยู่ภายใต้ข้อห้ามหรือไม่สามารถ หรือไม่ชำระเงินไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน หรือปฏิบัติตามภาระผูกพันอื่นใด เนื่องจากหรือเกิดจากภาวะสงคราม การจลาจล สถานการณ์ความขัดแย้งรุนแรง การดำเนินการของรัฐบาล หน่วยราชการ หรือส่วนใดส่วนหนึ่งของรัฐหรือหน่วยงานราชการ (ไม่ว่าโดยนิตินัย หรือพฤตินัย) ข้อจำกัดทางกฎหมาย การก่อการร้าย การก่อความไม่สงบ หรือเหตุการณ์ภัยพิบัติ และผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีหน้าที่ชำระหนี้หรือภาระผูกพันอื่นๆ อันเกี่ยวกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ของผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ค้าประกันจะไม่มีภาระผูกพันภายใต้ข้อกำหนดของการรับประกันของตนในการชดเชยภาระผูกพันที่ผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นผู้ผิดนัด

1.4.4 การบังคับใช้

การค้ำประกันนี้เป็นการที่ผู้ค้ำประกันได้ค้ำประกันการชำระหนี้เงินในจำนวนวงเงินค้ำประกันเท่านั้น ทั้งนี้ ภายใต้ข้อกำหนดและเงื่อนไขของสัญญาค้ำประกัน ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ไม่มีหน้าที่ในการใช้สิทธิหรือดำเนินการอื่นใดกับผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือบุคคลหรือนิติบุคคล หรือหลักประกันอื่นใดเพื่อเป็นเงื่อนไขให้ผู้ค้ำประกันต้องชำระเงินจำนวนใด ๆ ภายใต้จำนวนวงเงินค้ำประกัน ทั้งนี้ ผู้ค้ำประกันสงวนไว้ซึ่งสิทธิในข้อต่อสู้ของคนที่อยู่ภายใต้กฎหมายที่เกี่ยวข้อง บรรดาข้อต่อสู้ทั้งหลาย สิทธิการหักกลบลบหนี้หรือสิทธิการโต้แย้งที่ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีต่อผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อยู่เช่นไร ผู้ค้ำประกันก็จะมีสิทธิในการยกข้อต่อสู้ สิทธิการหักกลบลบหนี้ หรือข้อโต้แย้งเช่นว่านั้นขึ้นอ้างต่อผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้เท่ากับสิทธิที่ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีอยู่ และเท่าที่ผู้ค้ำประกันมีสิทธิยกขึ้นอ้างได้เกี่ยวกับหนี้ของคนภายใต้สัญญาค้ำประกัน ทั้งนี้ ไม่ว่าผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะได้ยกขึ้นอ้างหรือไม่ก็ตาม

1.4.5 การรับช่วงสิทธิ

ผู้ค้ำประกัน (1) มีสิทธิในการเข้าไปซึ่งสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในการชำระเงินแก่ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ รวมถึงสิทธิของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในการแก้ไขเหตุผลใด ๆ โดยหรือที่เกี่ยวข้องกับผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยไม่คำนึงถึงว่าผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะได้รับการแจ้งถึงเหตุผลใดหรือเลิกสัญญาไปยังผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แล้ว และมีสิทธิยกเลิกการแจ้งถึงเหตุผลใดหรือเลิกสัญญาโดยผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์รายนั้น ๆ หรือไม่ และ (2) มีสิทธิเข้ารับช่วงสิทธิซึ่งสิทธิของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีต่อผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในจำนวนเงินที่ผู้ค้ำประกันได้ชำระไปตามข้อตกลงตามที่กำหนดในสัญญาค้ำประกัน โดยมีเงื่อนไขว่า ผู้ค้ำประกันจะไม่มีสิทธิในการบังคับเอาหรือรับจำนวนเงินที่เกิดขึ้นหรือมาจากสิทธิการรับช่วงสิทธิจนกว่าหนี้จำนวนของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ถึงกำหนดชำระต่อผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีอยู่จนถึงการรับช่วงสิทธินั้น ๆ ได้ชำระครบเต็มจำนวนแล้ว

1.4.6 ระยะเวลาการค้ำประกัน

สัญญาค้ำประกันฉบับนี้จะมีผลสมบูรณ์และมีผลใช้บังคับจนกว่าจะมีการชำระเงินในจำนวนวงเงินค้ำประกันเสร็จสิ้นและไม่เป็นใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ได้รับประโยชน์จากการค้ำประกันคงเหลืออยู่ และไม่มีการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เพิ่มเติมโดยผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อีก

1.4.7 กฎหมายที่เกี่ยวข้อง

สัญญาค้ำประกันฉบับนี้ให้อยู่ภายใต้บังคับและการตีความตามกฎหมายมลรัฐนิวยอร์ก ประเทศสหรัฐอเมริกา

1.4.8 ปัจจัยความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับผู้ค้ำประกัน

ปัจจัยความเสี่ยงที่ระบุในส่วนที่ 1 รวมถึงข้อมูลอื่นๆ ที่ระบุในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ และเอกสารที่มีการแก้ไขเพิ่มเติมอาจเป็นข้อมูลสำคัญต่อการประเมินความเสี่ยงทางธุรกิจซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อธุรกิจและผลกำไรของผู้ค้ำประกัน

2. ผู้ที่เป็นคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงเพื่อป้องกันความเสี่ยงทั้งจำนวนของบริษัทที่ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะต้องมีการบริหารความเสี่ยงที่เกิดขึ้นจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น

ในการบริหารความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจดำเนินการบริหารความเสี่ยงด้วยตนเอง และ/หรือทำสัญญาบริหารความเสี่ยงกับคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง โดยการทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีข้อกำหนดและเงื่อนไขให้บริษัทเป็นผู้รับชำระหนี้จากการคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงในจำนวนและระยะเวลาเดียวกันหรือใกล้เคียงกันกับจำนวนและระยะเวลาที่บริษัทจะต้องชำระหนี้ให้ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Back-to-Back Agreement)

ในเบื้องต้น ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ตกลงแต่งตั้ง เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตี้ส์ ฟิแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) เป็นคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง โดยจะมีการบริหารความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

โดยผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Back-to-Back Agreement) ก่อนวันที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะเข้าทำการซื้อขายวันแรกในตลาดหลักทรัพย์

สัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีลักษณะและเงื่อนไขการใช้สิทธิเหมือนกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ แต่เป็นสถานะตรงกันข้ามกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ทั้งนี้ เพื่อเป็นการปิดความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ทั้งหมด

ทั้งนี้ ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะระบุรายละเอียดโดยสรุปของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง และสัญญาบริหารความเสี่ยง ไว้ในส่วนที่ 2 ของแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) ที่ยื่นต่อสำนักงาน ก.ล.ด. เป็นคราว ๆ ไป

ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจเลือกที่จะเข้าทำสัญญาบริหารความเสี่ยงกับคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงรายอื่นนอกเหนือจาก เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตี้ส์ ฟิแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) หรืออาจมีการใช้วิธีการบริหารความเสี่ยงอื่น ๆ ด้วยตนเอง

ซึ่งหากมีการเปลี่ยนแปลงคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง (หรือสัญญาบริหารความเสี่ยง (แล้วแต่กรณี)) หรือวิธีการบริหารความเสี่ยง ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะมีการเปิดเผยข้อมูลแก่ผู้ลงทุน โดยการระบุรายชื่อคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงและวิธีการบริหารความเสี่ยง ในแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short)

ผู้ลงทุนจึงควรศึกษาข้อมูลดังกล่าวให้ครบถ้วนก่อนการลงทุน

2.1 ข้อมูลทั่วไป

คู่สัญญาบริหารความเสี่ยง : เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตี้ส์ ฟิแอลซี

J.P. Morgan Securities plc

| | | |
|-----------------------|---|---|
| ลักษณะการประกอบธุรกิจ | : | การให้บริการธนาคารเพื่อการลงทุนและหลักทรัพย์ |
| เลขทะเบียนบริษัท | : | 02711006 |
| ที่ตั้งสำนักงานใหญ่ | : | 25 แบงก์สตรีท ชั้น 20 แคนารีวาร์ฟ ลอนดอน อี14 5เจพี สหราชอาณาจักร |
| โฮมเพจ | : | www.jpmorganchase.com |
| โทรศัพท์ | : | +44 20 7777 2000 |
| โทรสาร | : | +44 20 7325 9225 |

2.2 ลักษณะการประกอบธุรกิจโดยย่อ

เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตีส์ พีแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) (“**คู่สัญญาบริหารความเสี่ยง**”) เป็นบริษัทมหาชน จำกัดที่จัดตั้งขึ้นและดำรงอยู่ใน สหราชอาณาจักร ซึ่งเป็นบริษัทย่อยโดยอ้อมของผู้ถือหุ้น (โปรดดูรายละเอียดของผู้ถือหุ้น (ในฐานะผู้ถือหุ้น) ตามที่ระบุข้างต้น) และเป็นบริษัทย่อยหลักของผู้ถือหุ้น

คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงเป็นบริษัทย่อยหลักของผู้ถือหุ้น ซึ่งอยู่ในเขตเศรษฐกิจของสหราชอาณาจักรและภูมิภาคยุโรป ตะวันออกกลางและแอฟริกา (Europe, Middle East and Africa (“**EMEA**”)) คู่สัญญาบริหารความเสี่ยง ให้บริการธนาคารเพื่อการลงทุนระหว่างประเทศ รวมถึงการดำเนินกิจกรรมต่างๆ ระหว่างตลาดต่างๆ รวมทั้งการให้บริการแก่ผู้ลงทุนและการธนาคารเพื่อธุรกิจ โดยสำหรับในธุรกิจประเภทนี้ การดำเนินงานของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงรวมถึงการจัดจำหน่ายพันธบัตรของรัฐบาลและบริษัทต่างๆ หลักทรัพย์ประเภททุน และหลักทรัพย์อื่นๆ การจัดจำหน่ายตราสารหนี้และหลักทรัพย์แปลงสภาพให้แก่บุคคลในวงจำกัด การค้าตราสารหนี้ ตราสารทุน สินค้าโภคภัณฑ์ สวอปส์ และอนุพันธ์อื่นๆ การให้บริการการเป็นนายหน้าและสำนักหักบัญชีสำหรับการแลกเปลี่ยนสัญญาออปชันส์และฟิวเจอร์ส การให้กู้ยืม และการให้คำปรึกษาด้านการธนาคารเพื่อการลงทุน โดยคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงเป็นสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ต่างๆ หลายแห่ง และเป็นสมาชิกของสำนักหักบัญชีต่างๆ จำนวนมาก ซึ่งรวมถึง LME Clear Limited, Eurex Clearing AG และ ICE Clear Europe

คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงเป็นธนาคารของสหราชอาณาจักร และเป็นสถาบันการให้สินเชื่อภายใต้ EEA Capital Requirement Directive IV ซึ่งตามกฎหมายแล้วหมายถึง การประกอบธุรกิจในการรับฝากเงินหรือเงินลงทุนที่จ่ายคืนได้ อย่างอื่นจากประชาชน และการให้สินเชื่อเพื่อตนเอง

คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงได้รับใบอนุญาตจาก Prudential Regulation Authority (“**PRA**”) และอยู่ภายใต้การกำกับดูแลของ PRA และ Financial Conduct Authority ในสหราชอาณาจักร

2.3 อันดับความน่าเชื่อถือ

คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงได้รับอันดับความน่าเชื่อถือดังนี้

ณ วันที่ 12 มีนาคม 2564 คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับ Aa3 โดย Moody's จากข้อมูลบนเว็บไซต์ของ Moody's อันดับความน่าเชื่อถือที่ Aa3 สะท้อนถึงอันดับความน่าเชื่อถือที่สูงที่สุดในสี่อันดับแรกจากทั้งหมดสิบอันดับ ที่จัดอันดับโดย Moody's

สำหรับรายละเอียดเพิ่มเติม โปรดศึกษาในเว็บไซต์ของ Moody's ทั้งนี้ แหล่งที่มาของข้อมูลดังกล่าวเป็นข้อมูลที่มีอยู่ ณ ปัจจุบัน ซึ่งอาจมีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงได้ในอนาคต

ทั้งนี้ ข้อมูลใดๆ ที่ปรากฏบนเว็บไซต์ดังกล่าวของ Moody's นั้นไม่ได้เป็นส่วนหนึ่งของแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ และผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ไม่รับผิดชอบต่อความถูกต้องหรือความสมบูรณ์ของข้อมูลที่ปรากฏบนเว็บไซต์ดังกล่าว และไม่อาจรับประกันได้ว่าข้อมูลดังกล่าวจะไม่มี การแก้ไขเพิ่มเติมโดย Moody's ในอนาคต ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ไม่มีความรับผิดชอบที่จะต้องแจ้งให้ผู้ลงทุนทราบถึงการแก้ไขดังกล่าว หากผู้ลงทุนไม่แน่ใจเกี่ยวกับข้อมูลใดๆ ที่ระบุในแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปีฉบับนี้ และ/หรือ ความหมายของการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ผู้ลงทุนควรขอคำแนะนำจากที่ปรึกษาอิสระด้วยตนเอง

2.4 ฐานะทางการเงินและผลการดำเนินงาน

ตามงบการเงินล่าสุดของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงมีรายได้จากการประกอบธุรกิจ เป็นจำนวน 7,345 ล้านดอลลาร์สหรัฐ และมีกำไรสุทธิจากการประกอบธุรกิจเป็นจำนวน 2,041 ล้านดอลลาร์สหรัฐ

นอกจากนี้ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2562 คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงมีสินทรัพย์รวม 658,176 ล้านดอลลาร์สหรัฐ หนี้สินรวม 613,267 ล้านดอลลาร์สหรัฐ และส่วนของผู้ถือหุ้น 44,908 ล้านดอลลาร์สหรัฐ

สำหรับข้อมูลทางการเงินอื่นๆ ของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง ผู้ลงทุนสามารถศึกษาได้จากงบการเงินของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง ซึ่งได้เปิดเผยไว้ ณ <https://beta.companieshouse.gov.uk/company/02711006>

2.5 วิธีการบริหารความเสี่ยง

ในการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจจะมีการบริหารความเสี่ยงโดยการเข้าทำสัญญา Back-to-Back Agreement กับคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง (หรือคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงรายอื่นนอกเหนือไปจาก เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตี้ส์ พีแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) (แล้วแต่กรณี)) โดยคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงมีหน้าที่ในการบริหารความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยการเปิดสถานะการลงทุนตรงกันข้ามกับการสถานะของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ทั้งนี้ สัญญา Back-to-Back Agreement (หรือสัญญาการบริหารความเสี่ยงอื่น) ดังกล่าว มีลักษณะของสัญญาและเงื่อนไขต่าง ๆ เช่น หลักทรัพย์อ้างอิง อายุของสัญญา วันครบกำหนดอายุ เหมือนกันกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

2.6 สรุปสาระสำคัญของสัญญาบริหารความเสี่ยงโดยย่อ

| | |
|------------------------------|---|
| ชื่อคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง | : เจ.พี. มอร์แกน ซีเคียวริตี้ส์ พีแอลซี (J.P. Morgan Securities plc) |
| ลักษณะของสัญญา | : ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ เข้าทำสัญญากับคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงก่อนวันซื้อขายวันแรกในตลาดหลักทรัพย์ของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยสัญญาบริหารความเสี่ยงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น จะมีลักษณะและเงื่อนไขของสัญญา เช่น หลักทรัพย์อ้างอิง อายุสัญญา เป็นต้น เหมือนกันกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ทั้งนี้ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ จะทำสัญญาในทางตรงข้ามกับกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ กับคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง เพื่อเป็นการปิดความเสี่ยงจากการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ |
| การชำระราคาและส่งมอบ | : เมื่อถึงวันชำระราคาและส่งมอบ <ul style="list-style-type: none">- ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ มีสถานะเป็น Out of The Money (OTM) หรือ At The Money (ATM) ณ วันซื้อขายวันสุดท้าย คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงจะไม่มีการชำระราคาใด ๆ แก่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์- ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์มีสถานะเป็น In The Money (ITM) ณ วันซื้อขายวันสุดท้าย คู่สัญญาบริหารความเสี่ยงมีหน้าที่ต้องส่งมอบส่วนต่างเงินสด เป็นจำนวนเท่ากับเงินสดส่วนต่างจากการใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือ ส่งมอบเป็นหลักทรัพย์ หรือ สินค้าอ้างอิงใด ตามข้อตกลงที่ระบุไว้ในสัญญาบริหารความเสี่ยง |
| ภาระผูกพัน | : ภาระผูกพันในการบริหารความเสี่ยงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่นแยกขาดจากกันโดยเด็ดขาด |

ทั้งนี้ ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์อาจมีการพิจารณาเปลี่ยนแปลงหรือยกเลิกคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง และเงื่อนไขในการบริหารความเสี่ยงได้ตามความเหมาะสมโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า

ทั้งนี้ การเปลี่ยนแปลงดังกล่าวผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะคำนึงถึงผลกระทบ (หรืออาจมีผลกระทบ) ต่อผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นสำคัญ เพื่อไม่ให้ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ด้วยสิทธิหรือผลประโยชน์ที่ควรจะได้รับจากการถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น ๆ

โดยรายละเอียดของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แต่ละรุ่น ผู้ลงทุนสามารถศึกษาได้จากแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) ที่ได้ยื่นต่อสำนักงาน ก.ล.ต. และเปิดเผยไว้ใน www.sec.or.th

ข้อมูลเกี่ยวกับคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงที่เปิดเผยไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) ให้ถือว่าเป็นปัจจุบัน และมีผลบังคับใช้แทนที่ข้อมูลของคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงที่เปิดเผยไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Full)

3. การติดตามข้อมูลของผู้ค้าประกันและคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง

ข้อมูลของผู้ค้าประกันและคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง อาจมีการปรับปรุงเปลี่ยนแปลงได้

ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลจากแบบแสดงรายการข้อมูลและร่างหนังสือชี้ชวนการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (แบบ 69-DW-Short) เป็นหลัก ทั้งนี้ หากมีการเปลี่ยนแปลงอื่นใดที่ส่งผลกระทบต่อการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือ ฐานะทางการเงินและผลการดำเนินงานของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือฐานะทางการเงินและผลการดำเนินงานของผู้ค้าประกันและคู่สัญญาบริหารความเสี่ยง ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะมีการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าว ตามรอบระยะเวลาที่กฎหมายหรือประกาศที่เกี่ยวข้องกำหนดไว้

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถอ่านข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับผู้ค้าประกัน และคู่สัญญาบริหารความเสี่ยงได้จาก <https://www.jpmmorganchase.com>

ส่วนที่ 3

รายละเอียดกรณีมีการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีประกันเต็มจำนวนหรือที่มีประกันบางส่วน (ถ้ามี)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2563 ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่บริษัทออกและเสนอขายนี้ เป็นใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ชนิดไม่มีหลักประกัน

เอกสารแนบ 1

ข้อมูลเกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิงและดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง

1. ข้อมูลเกี่ยวกับหลักทรัพย์อ้างอิง

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|--|----------------------------|--------------------------------|--|-------------|--------------------------|---|
| ADVANC | บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) | ADVANCED INFO SERVICE PCL. | เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | อาคารเอไอเอส ทาวเวอร์ 1, 414 ถนนพหลโยธิน แขวงสามเสนใน เขตพญาไท กทม. | 0-2029-5000 | 0-2029-5165 | http://investor.ais.co.th |
| AOT | บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน) | AIRPORTS OF THAILAND PCL. | ขนส่งและโลจิสติกส์ | 333 หมู่ที่ 7 ถนนเชิดวุฒากาศ แขวงสีกัน เขตดอนเมือง กทม. | 0-2535-1111 | 0-2531-5559, 0-2535-4061 | www.airportthai.co.th |
| AWC | บริษัท แอสเสท เวิร์ด คอร์ป จำกัด (มหาชน) | ASSET WORLD CORP PCL. | พัฒนาอสังหาริมทรัพย์ | เลขที่ 1 อาคารเอ็มไพร์ ทาวเวอร์ ชั้นที่ 56 ถนนสาทรใต้ แขวงยานนาวา เขตสาทร กทม. | 0-2180-9999 | 0-2180-9966 | https://www.assetworldcorp-th.com/ |
| BANPU | บริษัท บ้านปู จำกัด (มหาชน) | BANPU PCL. | ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์ | อาคารธณภูมิ ชั้น 26-28, 1550 ถนนเพชรบุรีตัดใหม่ แขวงมักกะสัน เขตราชเทวี กทม. | 0-2694-6600 | 0-2207-0696 | http://www.banpu.com |
| BBL | ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) | BANGKOK BANK PCL. | ธนาคาร | 333 ถนนสีลม เขตบางรัก กทม. | 0-2231-4333 | 0-2231-4890 | www.bangkokbank.com |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|--|---|---------------------------|--|---------------------------------|-------------------------------|--|
| BCH | บริษัท บางกอก เซน ฮอสปิเทล จำกัด (มหาชน) | BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL. | การแพทย์ | 44 หมู่ 4 ตำบลปากเกร็ด อำเภอปากเกร็ด นนทบุรี | 0-2836-9999 | 0-2106-4858 | www.bangkokchainhospital.com |
| BDMS | บริษัท กรุงเทพดุสิตเวช การ จำกัด (มหาชน) | BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL. | การแพทย์ | เลขที่ 2 ซอยศูนย์วิจัย 7 ถนนเพชรบุรีตัดใหม่ แขวง บางกะปิ เขตห้วยขวาง กทม. | 0-2310-3000 | 0-2318-1546 , 0- 2310-3327 | www.bangkokhospital.com |
| BEM | บริษัท ทางด่วนและ รถไฟฟ้ากรุงเทพ จำกัด (มหาชน) | BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL. | ขนส่งและโลจิสติกส์ | 587 ถนนสุทธิสารวินิจฉัย แขวงรัชดาภิเษก เขตดิน แดง กทม. | 0-2641-4611, 0- 2354-2000 | 0-2641-4610, 0- 2354-2040 | www.bemplc.co.th |
| BGRIM | บริษัท บี.กริม เพาเวอร์ จำกัด (มหาชน) | B.GRIMM POWER PCL. | พลังงานและ สาธารณูปโภค | 5 ถนนกรุงเทพกรีฑา แขวงหัวหมาก เขตบาง กะปิ กทม. | 0-2710-3400 | 0-2379-4245 | http://www.bgrimpower.com |
| BH | บริษัท โรงพยาบาลบำรุง ราษฎร์ จำกัด (มหาชน) | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL. | การแพทย์ | 33 ถนนสุขุมวิท ซอย 3 (ซอยนานาเหนือ) แขวง คลองเตยเหนือ เขตวัฒนา กทม. | 0-2667-1000 | 0-2667-2525 | www.bumrungrad.com |
| BJC | บริษัท เบอร์ลี่ ยุคเกอร์ จำกัด (มหาชน) | BERLI JUCKER PCL. | พาณิชย์ | อาคารเบอร์ลี่ ยุคเกอร์ 99 ซอยบุปผีย ถนนสุขุมวิท 42 แขวงพระโขนง เขต คลองเตย กทม. | 0-2367-1111, 0- 2381-4520-39 | 0-2367-1000, 0- 2381-4545 | www.bjc.co.th |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|--|--------------------------|----------------------------|--|--------------------------------|--------------------------|--|
| BTS | บริษัท บีทีเอส กรุ๊ป โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน) | BTS GROUP HOLDINGS PCL. | ขนส่งและโลจิสติกส์ | อาคารทีเอสที ทาวเวอร์, 21 ซอยเฉยพวง ถนนวิภาวดี-รังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กทม. | 0-2273-8511-15, 0-2273-8611-15 | 0-2273-8610, 0-2273-8616 | http://www.btsgroup.co.th |
| CBG | บริษัท คาราบาวกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) | CARABAO GROUP PCL. | อาหารและเครื่องดื่ม | 393 อาคาร 393 สีส้ม ชั้น 7-10 ถนนสีลม แขวงสีลม เขตบางรัก กทม. | 0-2636-6111 | 0-2636-7949 | www.carabaogroup.com |
| CENEL | บริษัท โรงแรมเซ็นทรัลพลาซ่า จำกัด (มหาชน) | CENTRAL PLAZA HOTEL PCL. | การท่องเที่ยวและสนันทนาการ | 1695 ถนนพหลโยธิน แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กทม. | 0-2769-1234 | 0-2769-1235 | www.centarahotelsresorts.com |
| CK | บริษัท ข.การช่าง จำกัด (มหาชน) | CH. KARNCHANG PCL. | บริการรับเหมาก่อสร้าง | อาคารวิริยะถาวร, 587 ถนนสุทธิสารวินิจฉัย แขวงรัชดาภิเษก เขตดินแดง กทม. | 0-2277-0460, 0-2275-0026 | 0-2275-7029 | http://www.ch-karnchang.co.th |
| CKP | บริษัท ซีเค พาวเวอร์ จำกัด (มหาชน) | CK POWER PCL. | พลังงานและสาธารณูปโภค | เลขที่ 587 อาคารวิริยะถาวร ชั้น 19 ถนนสุทธิสารวินิจฉัย แขวงดินแดง เขตดินแดง กทม. | 0-2691-9720-2 | 0-2691-9723 | www.ckpower.co.th |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|--|------------------------------------|--|--|-------------|-------------|---|
| COM7 | บริษัท คอมเซเว่น จำกัด (มหาชน) | COM7 PCL. | พาณิชย์ | 549/1 ถนนสรรพาวุธ แขวงบางนา เขตบางนา กทม. | 0-2017-7777 | - | www.comseven.com |
| CPALL | บริษัท ซีพี ออลล์ จำกัด (มหาชน) | CP ALL PCL. | พาณิชย์ | เลขที่ 313 อาคารซีพี ทาว เวอร์ ชั้น 24 ถนนสีลม แขวงสีลม เขตบางรัก กทม. | 0-2071-9000 | 0-2071-8617 | www.cpall.co.th |
| CPF | บริษัท เจริญโภคภัณฑ์ อาหาร จำกัด (มหาชน) | CHAROEN POKPHAND FOODS PCL. | อาหารและ เครื่องดื่ม | อาคาร ซี.พี. ทาวเวอร์ ชั้น 15, 313 ถนนสีลม แขวง บางรัก เขตบางรัก กทม. | 0-2766-8000 | 0-2638-2942 | www.cpfworldwide.com |
| CPN | บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน) | CENTRAL PATTANA PCL. | พัฒนา อสังหาริมทรัพย์ | อาคารสำนักงานเซ็นทรัล เวิลด์ ชั้น 31-33, 999/9 ถนนพระราม 1 แขวงปทุม วัน เขตปทุมวัน กทม. | 0-2667-5555 | 0-2264-5593 | www.cpn.co.th |
| CRC | บริษัท เซ็นทรัล รีเทล คอร์ ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) | CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL | พาณิชย์ | เลขที่ 22 ซอยสมคิด ถนน เพลินจิต แขวงลุมพินี เขต ปทุมวัน กทม. | 0-2650-3600 | - | https://www.centralretail.com/ |
| DTAC | บริษัท โทเทิล แอ็คเซ็ส คอมมูนิเคชั่น จำกัด (มหาชน) | TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL. | เทคโนโลยี สารสนเทศและการ สื่อสาร | เลขที่ 319 อาคารจัตุรัส จามจุรี ชั้น 41 ถนนพญา ไท แขวงปทุมวัน เขตปทุม | 0-2202-8000 | - | www.dtac.co.th |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|--|--------------------------------|---------------------------|--|---|---------------|---|
| | | | | วัน กทม. | | | |
| EA | บริษัท พลังงานบริสุทธิ์ จำกัด (มหาชน) | ENERGY ABSOLUTE PCL. | พลังงานและ สาธารณูปโภค | บริษัท พลังงานบริสุทธิ์ จำกัด (มหาชน) ที่อยู่ชั้น 16 อาคารเอไอเอ แคปปิตอล เซ็นเตอร์ เลขที่ 89 ถนนรัชดาภิเษก เขต ดินแดง กทม. | 0-2248-2488-92, 0-2002-3667-9 | 0-2248-2493 | http://www.energyabsolute.co.th |
| EGCO | บริษัท ผลิตไฟฟ้า จำกัด (มหาชน) | ELECTRICITY GENERATING PCL. | พลังงานและ สาธารณูปโภค | อาคารเอ็กโก, 222 หมู่ 5 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงทุ่ง สองห้อง เขตหลักสี่ กทม. | 0-2998-5000, 0- 2998-5999 | 0-2955-0956-9 | http://www.egco.com |
| ESSO | บริษัท เอสโซ่ (ประเทศ ไทย) จำกัด (มหาชน) | ESSO (THAILAND) PCL. | พลังงานและ สาธารณูปโภค | เลขที่ 3195/17-29 ถนน พระรามที่ 4 แขวงคลอง ตัน เขตคลองเตย กทม. | 0-2262-4000 | 0-2262-4800 | http://www.esso.co.th |
| GPSC | บริษัท โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี จำกัด (มหาชน) | GLOBAL POWER SYNERGY PCL. | พลังงานและ สาธารณูปโภค | 555/2 ศูนย์เอนเนอร์ยี่ คอมเพล็กซ์ อาคารบี ชั้น 5 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวง จตุจักร เขตจตุจักร กทม. | 0-2140-5318, 0- 2140-4646, 0- 2140-4628 | - | http://www.gpscgroup.com |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|--|----------------------------------|--|---|--------------------------------|-------------------------------|---|
| GULF | บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดี เวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน) | GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL | พลังงานและ สาธารณูปโภค | 87 อาคารเอ็มไทย ทาว เวอร์ ออลซีซั่น เฟส ชั้น 11 ถนนวิทย์ แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กทม. | 0-2080-4499 | 0-2080-4455 | www.gulf.co.th |
| HANA | บริษัท ฮานา ไม โครอิเล็กทรอนิกส์ จำกัด (มหาชน) | HANA MICROELECTRONICS PCL. | ชิ้นส่วน อิเล็กทรอนิกส์ | เลขที่ 65/98 ซอยวิภาวดี- รังสิต 64 แยก 2 แขวง ตลาดบางเขน เขตหลักสี่ กทม. | 0-2551-1297, 0- 2521-4935-9 | 0-2551-1299 , 0- 2552-4906 | www.hanagroup.com |
| HMPRO | บริษัท โฮม โปรดักส์ เซ็น เตอร์ จำกัด (มหาชน) | HOME PRODUCT CENTER PCL. | พาณิชย์ | 31 ถนนประชาชื่นนนทบุรี ตำบลบางเขน อำเภอเมือง นนทบุรี นนทบุรี | 0-2832-1000 | 0-2832-1400 | www.homepro.co.th |
| INTUCH | บริษัท อินทัช โฮลดิ้งส์ จำกัด (มหาชน) | INTOUCH HOLDINGS PCL. | เทคโนโลยี สารสนเทศและการ สื่อสาร | 349 อาคารเอสเจ อินฟินิตี วัน บิซิเนส คอมเพล็กซ์ ชั้นที่ 29 และ 30 ถนน วิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กทม. | 0-2118-6900 | 0-2118-6947 | www.intouchcompany.co m |
| IRPC | บริษัท ไออาร์พีซี จำกัด (มหาชน) | IRPC PCL. | พลังงานและ สาธารณูปโภค | เลขที่ 555/2 ศูนย์เอนเนอร์ ยีคอมเพล็กซ์ อาคาร บี ชั้น 6 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กทม. | 0-2765-7000 | 0-2765-7001 | www.irpc.co.th |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|--|---|--|---|------------------------------|---------------|--|
| IVL | บริษัท อินโดรามา เวน เจอร์ส จำกัด (มหาชน) | INDORAMA VENTURES PCL. | ปิโตรเคมีและ เคมีภัณฑ์ | 75/102 อาคารโอเชียน ทาวเวอร์ 2 ชั้น 37 ซอย สุขุมวิท 19 ถนนอโศก แขวงคลองเตยเหนือ เขต วัฒนา กทม. | 0-2661-6661 | 0-2661-6664-5 | www.indoramaventures.com |
| JAS | บริษัท จัสมิน อินเตอร์เนชั่น แนล จำกัด (มหาชน) | JASMINE INTERNATIONAL PUBLIC COMPANY LIMITED | เทคโนโลยี สารสนเทศและการ สื่อสาร | อาคารจัสมินอินเตอร์เนชั่น แนล ชั้น 29-30, 200 หมู่ 4 ถนนแจ้งวัฒนะ ตำบล ปากเกร็ด อำเภอปากเกร็ด นนทบุรี | 0-2100-3000 | 0-2100-3150-2 | http://www.jasmine.com |
| JMT | บริษัท เจ เอ็ม ที เน็ท เวิร์ค เซอร์วิส จำกัด (มหาชน) | JMT NETWORK SERVICES PCL. | เงินทุนและ หลักทรัพย์ | เลขที่ 187 อาคารเจมาร์ท ชั้น 4-6 ถนนรามคำแหง แขวงราษฎร์พัฒนา เขต สะพานสูง กทม. | 0-2308-9999 | 0-2308-9900 | http://www.jmtnetwork.co.th |
| KBANK | ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) | KASIKORNBANK PCL. | ธนาคาร | เลขที่ 1 ซอยราษฎร์บูรณะ 27/1 ถนนราษฎร์บูรณะ แขวงราษฎร์บูรณะ เขต ราษฎร์บูรณะ กทม. | 0-2222-0000, 0- 2888-8888 | 0-2470-1144 | www.kasikornbank.com |
| KCE | บริษัท เคซีอี อีเลคทรอนิกส์ จำกัด (มหาชน) | KCE ELECTRONICS PCL. | ชิ้นส่วน อิเล็กทรอนิกส์ | เลขที่ 72-72/1-3 ซอย ฉลองกรุง 31 แขวงลำปลา ทิว เขตลาดกระบัง กทม. | 0-2326-0196-9 | 0-2326-0300 | www.kcethai.in.th |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|--|-----------------------------|--------------------------|---|------------------------------|---------------|--|
| KKP | ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน) | KIATNAKIN BANK PCL. | ธนาคาร | อาคารอัมรินทร์ทาวเวอร์ ชั้น 12, 500 ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กทม. | 0-2165-5555 | 0-2256-9933 | http://kiatnakin.co.th |
| KTB | ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) | KRUNG THAI BANK PCL. | ธนาคาร | 35 ถนนสุขุมวิท แขวง คลองเตยเหนือ เขตวัฒนา กทม. | 0-2255-2222 | 0-2255-9391-6 | http://www.ktb.co.th |
| KTC | บริษัท บัตรกรุงไทย จำกัด (มหาชน) | KRUNGTHAI CARD PCL. | เงินทุนและ หลักทรัพย์ | อาคารสมัชชาราวนิช 2 ชั้น 14, 591 แขวงคลองตัน เหนือ เขตวัฒนา กทม. | 0-2123-5000, 0- 2123-5100 | 0-2828-5064 | www.ktc.co.th |
| LH | บริษัท แลนด์แอนด์เฮ้าส์ จำกัด (มหาชน) | LAND AND HOUSES PCL. | พัฒนา อสังหาริมทรัพย์ | อาคารคิวเฮ้าส์ ลุมพินี ชั้น 37-38, 1 ถนนสาทรใต้ แขวงทุ่งมหาเมฆ เขต สาทร กทม. | 0-2343-8900 | 0-2230-8130 | www.lh.co.th |
| MINT | บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์ เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน) | MINOR INTERNATIONAL PCL. | อาหารและ เครื่องดื่ม | อาคารเบอร์ลีย์เคเกอร์ ชั้น 16, 99 ซอยบูรเป็ญ ถนน สุขุมวิท 42 แขวงพระโขนง เขตคลองเตย กทม. | 0-2381-5151 | 0-2381-5777-8 | www.minor.com |
| MTC | บริษัท เมืองไทย แคปปิตอล จำกัด (มหาชน) | MUANGTHAI CAPITAL PCL. | เงินทุนและ หลักทรัพย์ | 32/1 ถนนจรัญสนิทวงศ์ แขวงบางอ้อ เขตบางพลัด กทม. | 0-2880-1033 | 0-2880-1173 | www.muangthaicap.com |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|---|---|---------------------------|---|------------------------------|------------------------------|--|
| OSP | บริษัท โอสออส จำกัด (มหาชน) | OSOTSPA PCL. | อาหารและ เครื่องดื่ม | 348 ถนนรามคำแหง แขวงหัวหมาก เขตบาง กะปิ กทม. | 0-2351-1000 | 0-2351-1125 | www.osotspa.com |
| PTG | บริษัท พีทีจี เอ็นเนอยี จำกัด (มหาชน) | PTG ENERGY PCL. | พลังงานและ สาธารณูปโภค | เลขที่ 90 อาคารซีดับเบิลยู ทาวเวอร์ เอ ชั้นที่ 33 ถนน รัชดาภิเษก แขวงห้วย ขวาง เขตห้วยขวาง กทม. | 0-2168-3377, 0- 2168-3388 | 0-2168-3379, 0- 2168-3389 | www.ptgenergy.co.th |
| PTT | บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน) | PTT PCL. | พลังงานและ สาธารณูปโภค | 555 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กทม. | 0-2537-2000 | 0-2537-3498-9 | http://www.pttplc.com |
| PTTEP | บริษัท ปตท. สำรวจและ ผลิตปิโตรเลียม จำกัด (มหาชน) | PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL. | พลังงานและ สาธารณูปโภค | เลขที่ 90 อาคารซีดับเบิลยู ทาวเวอร์ เอ ชั้นที่ 33 ถนน รัชดาภิเษก แขวงห้วย ขวาง เขตห้วยขวาง กทม. | 0-2168-3377, 0- 2168-3388 | 0-2168-3379, 0- 2168-3389 | www.ptgenergy.co.th |
| PTTGC | บริษัท พีทีที โกลบอล เคมิ คอล จำกัด (มหาชน) | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL. | ปิโตรเคมีและ เคมีภัณฑ์ | เลขที่ 555/1 ศูนย์เอนเนอร์ ยีคอมเพล็กซ์ อาคารเอ ชั้น 14-18 ถนนวิภาวดี รังสิต แขวงจตุจักร เขต จตุจักร กทม. | 0-2265-8400 | 0-2265-8500 | www.pttgcgroup.com |
| RATCH | บริษัท ผลิตไฟฟ้าราชบุรีโฮ ลดิ้ง จำกัด (มหาชน) | RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL. | พลังงานและ สาธารณูปโภค | 72 ถนนงามวงศ์วาน ตำบลบางเขน อำเภอเมือง นนทบุรี นนทบุรี | 0-2794-9999 | 0-2794-9998 | www.ratch.co.th |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|--|-------------------------------------|---------------------------|--|------------------------------|------------------------------|---|
| RS | บริษัท อาร์เอส จำกัด (มหาชน) | RS PCL. | พาณิชย์ | เลขที่ 27 อาคารอาร์เอ สกริป ทาวเวอร์ เอ ถนน ประเสริฐมนูกิจ แขวงเสนา นิคม เขตจตุจักร กทม. | 0-2037-8888 | - | http://www.rs.co.th |
| SAWAD | บริษัท ศรีสวัสดิ์ คอร์ ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) | SRISAWAD CORPORATION PCL. | เงินทุนและ หลักทรัพย์ | 99/392 อาคารศรีสวัสดิ์ ชั้น 4, 6 ซอยแจ้งวัฒนะ 10 แยก 3 ถนนแจ้งวัฒนะ แขวงทุ่งสองห้อง เขตหลัก สี่ กทม. | 0-2693-5555 | 0-2573-1565 | http://www.meebaanmee rod.com |
| SCB | ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) | THE SIAM COMMERCIAL BANK PCL. | ธนาคาร | 9 ถนนรัชดาภิเษก แขวง จตุจักร เขตจตุจักร กทม. | 0-2544-1111, 0- 2777-7777 | 0-2937-7931 | www.scb.co.th |
| SCC | บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด(มหาชน) | THE SIAM CEMENT PCL. | วัสดุก่อสร้าง | 1 ถนนปูนซิเมนต์ไทย แขวงบางซื่อ เขตบางซื่อ กทม. | 0-2586-3333, 0- 2586-4444 | 0-2587-2199, 0- 2587-2201 | www.scg.com |
| SCGP | บริษัท เอสซีจี แพคเกจจิ้ง จำกัด (มหาชน) | SCG PACKAGING PCL. | บรรจุภัณฑ์ | เลขที่ 1 ถนนปูนซิเมนต์ ไทย แขวงบางซื่อ เขตบาง ซื่อ กทม. | 0-2586-2894 | 0-2586-3007 | www.scgpackaging.com |
| SPRC | บริษัท สตาร์ ปิโตรเลียม รี ไฟนิ่ง จำกัด (มหาชน) | STAR PETROLEUM REFINING PCL | พลังงานและ สาธารณูปโภค | เลขที่ 1 ถนนโศ - สามบี ตำบลมาบตาพุด อำเภอ เมืองระยอง ระยอง | 0-3869-9000 | 0-3869-9999 | www.sprc.co.th |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|---|---|----------------------------|---|---------------|---|---|
| STA | บริษัท ศรีตรังแอโกร อินดัสทรี จำกัด (มหาชน) | SRI TRANG AGRO- INDUSTRY PCL. | อาหารและ เครื่องดื่มน้ำ | 10 ซอย 10 ถนนเพชร เกษม ตำบลหาดใหญ่ อำเภอหาดใหญ่ สงขลา | 0-7434-4663 | 0-7434-4676, 0- 7434-4677, 0- 7423-7423 | www.sritranggroup.com |
| STEC | บริษัท ซิโน-ไทย เอ็นจี เนียริงแอนด์คอนสตรัคชั่น จำกัด (มหาชน) | SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL. | บริการรับเหมา ก่อสร้าง | อาคารซิโน-ไทย ทาวเวอร์ ชั้น 29-30, 32/59-60 ถนนอโศก สุขุมวิท 21 แขวงคลองเตยเหนือ เขต วัฒนา กทม. | 0-2260-1321-2 | 0-2260-1339, 0- 2258-3436 | www.stecon.co.th |
| TASCO | บริษัท ทิปปโก้แอสฟัลท์ จำกัด (มหาชน) | TIPCO ASPHALT PCL. | วัสดุก่อสร้าง | 118/1 ถนนพระราม 6 แขวงพญาไท เขตพญาไท กทม. | 0-2273-6000 | 0-2273-6030 | http://www.tipcoasphalt.com |
| THANI | บริษัท ราชนานีลิสซิง จำกัด (มหาชน) | RATCHTHANI LEASING PCL. | เงินทุนและ หลักทรัพย์ | อาคารสินสารทาวเวอร์ ชั้น 11 UP, 77/35-36 ถนนกรุงธนบุรี แขวงคลอง ตันใต้ เขตคลองสาน กทม. | 0-2440-0844 | 0-2440-0848 | www.ratchthani.com |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|---|---------------------------------|--------------------------------|--|--------------------------|-------------|---|
| TISCO | บริษัท ทิสโก้ไฟแนนเชียลกรุ๊ป จำกัด (มหาชน) | TISCO FINANCIAL GROUP PCL. | ธนาคาร | 48/49 อาคารทิสโก้ทาวเวอร์ ชั้น 21 ถนนสาทรเหนือ แขวงสีลม เขตบางรัก กทม. | 0-2633-6888 | 0-2633-6880 | http://www.tisco.co.th |
| TKN | บริษัท แก้วแก่น้อย ฟู๊ด แอนด์มาร์เก็ตติ้ง จำกัด (มหาชน) | TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL. | อาหารและเครื่องดื่ม | 337 ถนนบอนด์สตรีท ตำบลบางพูด อำเภอปากเกร็ด นนทบุรี | 0-2984-0666 | 0-2984-0118 | www.taokaenoi.co.th |
| TMB | ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) | TMB BANK PCL. | ธนาคาร | 3000 ถนนพหลโยธิน แขวงจอมพล เขตจตุจักร กทม. | 0-2299-1111, 0-2617-9111 | 0-2299-2758 | http://www.tmbbank.com |
| TOP | บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน) | THAI OIL PCL. | พลังงานและสาธารณูปโภค | 555/1 ศูนย์เอนเนอร์ยีคอมเพล็กซ์ อาคารเอ ชั้น 11 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจตุจักร เขตจตุจักร กทม. | 0-2797-2999, 0-2299-0000 | 0-2797-2970 | www.thaioilgroup.com |
| TQM | บริษัท ทีคิวเอ็ม คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) | TQM CORPORATION PCL. | ประกันภัยและประกันชีวิต | 123 ถนนลาปลาเตา แขวงจรัลบุรี เขตลาดพร้าว กทม. | 0-2119-8888 | 0-2119-9000 | www.tqmcorp.co.th |
| TRUE | บริษัท TRUE คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) | TRUE CORPORATION PCL. | เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร | อาคารทรูทาวเวอร์, 18 ถนนรัชดาภิเษก เขตห้วยขวาง กทม. | 0-2859-1111 | 0-2859-9134 | http://www.truecorp.co.th |

| หลักทรัพย์ อ้างอิง | ชื่อบริษัท (ภาษาไทย) | ชื่อบริษัท (ภาษาอังกฤษ) | ประเภทธุรกิจ | ที่ตั้งสำนักงาน | โทรศัพท์ | โทรสาร | เว็บไซต์ |
|-----------------------|--|-------------------------------|--------------------------|---|--------------------------------|-------------|--|
| TU | บริษัท ไทยยูเนียน กรุ๊ป จำกัด (มหาชน) | THAI UNION GROUP PCL. | อาหารและ เครื่องดื่ม | อาคารเอส เอ็ม ทาวเวอร์ ชั้น M, 979/12 ถนน พหลโยธิน แขวงพญาไท เขตพญาไท กทม. | 2-298-0024, 0- 2298-0537-41 | 0-2298-0553 | www.thaiunion.com |
| VGI | บริษัท วีจีไอ จำกัด (มหาชน) | VGI PUBLIC COMPANY LIMITED | สื่อและสิ่งพิมพ์ | 21 อาคารทีเอสที ทาว เวอร์ ชั้น 9 ถนนวิภาวดี- รังสิต แขวงจอมพล เขต จตุจักร | 0-2273-8884 | 0-2273-8883 | www.vgi.co.th |
| WHA | บริษัท ดับบลิวเอชเอ คอร์ ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) | WHA CORPORATION PCL. | พัฒนา อสังหาริมทรัพย์ | 1121 หมู่ 3 ถนน เทพารักษ์ ตำบลเทพารักษ์ อำเภอเมือง สมุทรปราการ | 0-2753-3750 | 0-2753-2750 | www.wha.co.th |

2. ข้อมูลเกี่ยวกับดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง กรณีเป็นการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในดัชนีหลักทรัพย์

| | |
|---------------------|--|
| ชื่อดัชนีหลักทรัพย์ | SET50 Index |
| ชื่อภาษาอังกฤษ | SET50 Index |
| ผู้คำนวณ | ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย |
| ที่ตั้งสำนักงาน | เลขที่ 93 ชั้น 17 ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพมหานคร 10400 |
| หมายเลขโทรศัพท์ | 0-2009-9000 |
| Home Page | http://www.set.or.th |

ทั้งนี้ ทางผู้คำนวณดัชนีราคา SET50 Index จะมีการปรับรายการหลักทรัพย์ทุก 6 เดือน ดังต่อไปนี้

- (i) รอบทบทวนเดือนมิถุนายน: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนกรกฎาคม – ธันวาคมปีเดียวกัน
- (ii) รอบทบทวนเดือนธันวาคม: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนมกราคม – มิถุนายนปีถัดไป

โดยในรอบปีที่ผ่านมามีการเปลี่ยนแปลงส่วนประกอบของดัชนีดังกล่าว ดังนี้

SET50 & SET100 INDEX CONSTITUENTS

(Published on Oct 22, 2020)

For calculating the index during Jul 1 - Dec 31, 2020

SET50 INDEX CONSTITUENTS

| No. | Symbol | SET50 Company | Sector | No. | Symbol | SET50 Company | Sector |
|-----|--------|------------------------------------|--|---|--------|------------------------------------|--|
| 1 | ADVANC | ADVANCED INFO SERVICE PCL | Information & Communication Technology | 31 | MINT | MINOR INTERNATIONAL PCL | Food and Beverage |
| 2 | AOT | AIRPORTS OF THAILAND PCL | Transportation & Logistics | 32 | MTC | MUANGTHAI CAPITAL PCL | Finance and Securities |
| 3 | AWC | ASSET WORLD CORP PCL | Property Development | 33 | OSP | OSOTSPA PCL | Food and Beverage |
| 4 | BBL | BANGKOK BANK PCL | Banking | 34 | PTT | PTT PCL | Energy & Utilities |
| 5 | BDMS | BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL | Health Care Services | 35 | PTTEP | PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL | Energy & Utilities |
| 6 | BEM | BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL | Transportation & Logistics | 36 | PTTGC | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL | Petrochemicals & Chemicals |
| 7 | BGRIM | B.GRIMM POWER PCL | Energy & Utilities | 37 | RATCH | RATCH GROUP PCL | Energy & Utilities |
| 8 | BH | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL | Health Care Services | 38 | SAWAD | SRISAWAD CORPORATION PCL | Finance and Securities |
| 9 | B3C | BERLI JUCKER PCL | Commerce | 39 | SCB | THE SIAM COMMERCIAL BANK PCL | Banking |
| 10 | BPP | BANPU POWER PCL | Energy & Utilities | 40 | SCC | THE SIAM CEMENT PCL | Construction Materials |
| 11 | BTS | BTS GROUP HOLDINGS PCL | Transportation & Logistics | 41 | SCGP | SCG PACKAGING PCL | Packaging |
| 12 | CBG | CARABAO GROUP PCL | Food and Beverage | 42 | TISCO | TISCO FINANCIAL GROUP PCL | Banking |
| 13 | CPALL | CP ALL PCL | Commerce | 43 | TMB | TMB BANK PCL | Banking |
| 14 | CPF | CHAROEN POKPHAND FOODS PCL | Food and Beverage | 44 | TOA | TOA PAINT (THAILAND) PCL | Construction Materials |
| 15 | CPN | CENTRAL PATTANA PCL | Property Development | 45 | TOP | THAI OIL PCL | Energy & Utilities |
| 16 | CRC | CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL | Commerce | 46 | TRUE | TRUE CORPORATION PCL | Information & Communication Technology |
| 17 | DTAC | TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL | Information & Communication Technology | 47 | TTW | TTW PCL | Energy & Utilities |
| 18 | EA | ENERGY ABSOLUTE PCL | Energy & Utilities | 48 | TU | THAI UNION GROUP PCL | Food and Beverage |
| 19 | EGCO | ELECTRICITY GENERATING PCL | Energy & Utilities | 49 | VGI | VGI PCL | Media & Publishing |
| 20 | GLOBAL | SIAM GLOBAL HOUSE PCL | Commerce | 50 | WHA | WHA CORPORATION PCL | Property Development |
| 21 | GPSC | GLOBAL POWER SYNERGY PCL | Energy & Utilities | Reserve list of SET50 | | | |
| 22 | GULF | GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL | Energy & Utilities | 1 | BANPU | BANPU PCL | Energy & Utilities |
| 23 | HMPRO | HOME PRODUCT CENTER PCL | Commerce | 2 | BCH | BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL | Health Care Services |
| 24 | INTUCH | INTOUCH HOLDINGS PCL | Information & Communication Technology | 3 | JAS | JASMINE INTERNATIONAL PCL | Information & Communication Technology |
| 25 | IRPC | IRPC PCL | Energy & Utilities | 4 | KKP | KIATNAKIN BANK PCL | Banking |
| 26 | IVL | INDORAMA VENTURES PCL | Petrochemicals & Chemicals | 5 | SPALI | SUPALAI PCL | Property Development |
| 27 | KBANK | KASIKORNBANK PCL | Banking | 6 | TCAP | THANACHART CAPITAL PCL | Banking |
| 28 | KTB | KRUNG THAI BANK PCL | Banking | SET50 Inclusion: SCGP SET50 Exclusion: TCAP | | | |
| 29 | KTC | KRUNGTHAI CARD PCL | Finance and Securities | For more information visit: | | | |
| 30 | LH | LAND AND HOUSES PCL | Property Development | www.set.or.th/set50 | | | |
| | | | | or contact us: IndexTeam@set.or.th +662 009 9573 - 4 | | | |
| | | | | Sales-Information Services: Infoproducts@set.or.th +662 009 9621 | | | |

Disclaimer: The Stock Exchange of Thailand (SET) issues this document for providing general information only. While thorough care has been taken in preparing and updating the data to ensure complete, accurate, and reliable information, SET cannot guarantee the validity of the information found here. SET thus cannot be held responsible, obligated, or liable for any kind of inaccuracies, delays, interruptions, errors, or omissions.



SET50 & SET100 INDEX CONSTITUENTS

(Published on Oct 22, 2020)

For calculating the index during Jul 1 - Dec 31, 2020

SET100 INDEX CONSTITUENTS

Rank by alphabet

| No. | Symbol | SET100 Company | Sector | No. | Symbol | SET100 Company | Sector |
|------------------------|--------|------------------------------------|--|-------------------------------|--------|--|--|
| 1 | AAV | ASIA AVIATION PCL | Transportation & Logistics | 54 | KTC | KRUNGTHAI CARD PCL | Finance and Securities |
| 2 | ACE | ABSOLUTE CLEAN ENERGY PCL | Energy & Utilities | 55 | LH | LAND AND HOUSES PCL | Property Development |
| 3 | ADVANC | ADVANCED INFO SERVICE PCL | Information & Communication Technology | 56 | MAJOR | MAJOR CINEPLEX GROUP PCL | Media & Publishing |
| 4 | AEONTS | AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL | Finance and Securities | 57 | MEGA | MEGA LIFESCIENCES PCL | Commerce |
| 5 | AMATA | AMATA CORPORATION PCL | Property Development | 58 | MINT | MINOR INTERNATIONAL PCL | Food and Beverage |
| 6 | AOT | AIRPORTS OF THAILAND PCL | Transportation & Logistics | 59 | MTC | MUANGTHAI CAPITAL PCL | Finance and Securities |
| 7 | AP | AP (THAILAND) PCL | Property Development | 60 | ORI | ORIGIN PROPERTY PCL | Property Development |
| 8 | AWC | ASSET WORLD CORP PCL | Property Development | 61 | OSP | OSOTSPA PCL | Food and Beverage |
| 9 | BANPU | BANPU PCL | Energy & Utilities | 62 | PLANB | PLAN B MEDIA PCL | Media & Publishing |
| 10 | BBL | BANGKOK BANK PCL | Banking | 63 | PRM | PRIMA MARINE PCL | Transportation & Logistics |
| 11 | BCH | BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL | Health Care Services | 64 | PSH | PRUKSA HOLDING PCL | Property Development |
| 12 | BCP | BANGCHAK CORPORATION PCL | Energy & Utilities | 65 | PTG | PTG ENERGY PCL | Energy & Utilities |
| 13 | BCPG | BCPG PCL | Energy & Utilities | 66 | PTT | PTT PCL | Energy & Utilities |
| 14 | BDMS | BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL | Health Care Services | 67 | PTTEP | PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL | Energy & Utilities |
| 15 | BEC | BEC WORLD PCL | Media & Publishing | 68 | PTTGC | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL | Petrochemicals & Chemicals |
| 16 | BEM | BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL | Transportation & Logistics | 69 | QH | QUALITY HOUSES PCL | Property Development |
| 17 | BGRIM | B.GRIMM POWER PCL | Energy & Utilities | 70 | RATCH | RATCH GROUP PCL | Energy & Utilities |
| 18 | BH | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL | Health Care Services | 71 | RBF | R&B FOOD SUPPLY PCL | Food and Beverage |
| 19 | BJC | BERLI JUCKER PCL | Commerce | 72 | RS | RS PCL | Commerce |
| 20 | BPP | BANPU POWER PCL | Energy & Utilities | 73 | SAWAD | SRISAWAD CORPORATION PCL | Finance and Securities |
| 21 | BTS | BTS GROUP HOLDINGS PCL | Transportation & Logistics | 74 | SCB | THE SIAM COMMERCIAL BANK PCL | Banking |
| 22 | CBG | CARABAO GROUP PCL | Food and Beverage | 75 | SCC | THE SIAM CEMENT PCL | Construction Materials |
| 23 | CENDEL | CENTRAL PLAZA HOTEL PCL | Tourism & Leisure | 76 | SCGP | SCG PACKAGING PCL | Packaging |
| 24 | CHG | CHULARAT HOSPITAL PCL | Health Care Services | 77 | SGP | SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL | Energy & Utilities |
| 25 | CK | CH. KARNCHANG PCL | Construction Services | 78 | SIRI | SANSIRI PCL | Property Development |
| 26 | CKP | CK POWER PCL | Energy & Utilities | 79 | SPALI | SUPALAI PCL | Property Development |
| 27 | COM7 | COM7 PCL | Commerce | 80 | SPRC | STAR PETROLEUM REFINING PCL | Energy & Utilities |
| 28 | CPALL | CP ALL PCL | Commerce | 81 | STA | SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL | Agribusiness |
| 29 | CPF | CHAROEN POKPHAND FOODS PCL | Food and Beverage | 82 | STEC | SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL | Construction Services |
| 30 | CPN | CENTRAL PATTANA PCL | Property Development | 83 | SUPER | SUPER ENERGY CORPORATION PCL | Energy & Utilities |
| 31 | CRC | CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL | Commerce | 84 | TASCO | TIPCO ASPHALT PCL | Construction Materials |
| 32 | DOHOME | DOHOME PCL | Commerce | 85 | TCAP | THANACHART CAPITAL PCL | Banking |
| 33 | DTAC | TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL | Information & Communication Technology | 86 | THANI | RATCHTHANI LEASING PCL | Finance and Securities |
| 34 | EA | ENERGY ABSOLUTE PCL | Energy & Utilities | 87 | TISCO | TISCO FINANCIAL GROUP PCL | Banking |
| 35 | EGCO | ELECTRICITY GENERATING PCL | Energy & Utilities | 88 | TKN | TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL | Food and Beverage |
| 36 | EPG | EASTERN POLYMER GROUP PCL | Construction Materials | 89 | TMB | TMB BANK PCL | Banking |
| 37 | ESSO | ESSO (THAILAND) PCL | Energy & Utilities | 90 | TOA | TOA PAINT (THAILAND) PCL | Construction Materials |
| 38 | GFPT | GFPT PCL | Agribusiness | 91 | TOP | THAI OIL PCL | Energy & Utilities |
| 39 | GLOBAL | SIAM GLOBAL HOUSE PCL | Commerce | 92 | TPIPP | TPI POLYMER POWER PCL | Energy & Utilities |
| 40 | GPSC | GLOBAL POWER SYNERGY PCL | Energy & Utilities | 93 | TQM | TQM CORPORATION PCL | Insurance |
| 41 | GULF | GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL | Energy & Utilities | 94 | TRUE | TRUE CORPORATION PCL | Information & Communication Technology |
| 42 | GUNKUL | GUNKUL ENGINEERING PCL | Energy & Utilities | 95 | TTW | TTW PCL | Energy & Utilities |
| 43 | HANA | HANA MICROELECTRONICS PCL | Electronic Components | 96 | TU | THAI UNION GROUP PCL | Food and Beverage |
| 44 | HMPRO | HOME PRODUCT CENTER PCL | Commerce | 97 | TVO | THAI VEGETABLE OIL PCL | Food and Beverage |
| 45 | INTUCH | INTOUCH HOLDINGS PCL | Information & Communication Technology | 98 | VGI | VGI PCL | Media & Publishing |
| 46 | IRPC | IRPC PCL | Energy & Utilities | 99 | WHA | WHA CORPORATION PCL | Property Development |
| 47 | IVL | INDORAMA VENTURES PCL | Petrochemicals & Chemicals | 100 | WHAUP | WHA UTILITIES AND POWER PCL | Energy & Utilities |
| 48 | JAS | JASMINE INTERNATIONAL PCL | Information & Communication Technology | Reserve list of SET100 | | | |
| 49 | JMT | JMT NETWORK SERVICES PCL | Finance and Securities | 1 | JMART | JAY MART PCL | Information & Communication Technology |
| 50 | KBANK | KASIKORN BANK PCL | Banking | 2 | LPN | L.P.N. DEVELOPMENT PCL | Property Development |
| 51 | KCE | KCE ELECTRONICS PCL | Electronic Components | 3 | PSL | PRECIOUS SHIPPING PCL | Transportation & Logistics |
| 52 | KKP | KIATNAKIN BANK PCL | Banking | 4 | SHR | S HOTELS AND RESORTS PCL | Tourism & Leisure |
| 53 | KTB | KRUNG THAI BANK PCL | Banking | 5 | STPI | STP&I PCL | Construction Services |
| SET100 Inclusion: SCGP | | | SET100 Exclusion: ERW | 6 | ERW | THE ERWAN GROUP PCL | Tourism & Leisure |

Disclaimer: The Stock Exchange of Thailand (SET) issues this document for providing general information only. While thorough care has been taken in preparing and updating the data to ensure complete, accurate, and reliable information, SET cannot guarantee the validity of the information found here. SET thus cannot be held responsible, obligated, or liable for any kind of inaccuracies, delays, interruptions, errors, or omissions.



โดยแหล่งข้อมูลอ้างอิงที่ผู้ลงทุนจะสามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับข้อมูลดัชนีหลักทรัพย์ดังกล่าวได้ที่

<http://www.set.or.th/th/market/constituents.html>

<http://www.set.or.th/set/dwunderlying.do?language+th&country+TH>

3. ข้อมูลเกี่ยวกับดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง กรณีเป็นการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศ

| | |
|---------------------|--|
| ชื่อดัชนีหลักทรัพย์ | Hang Seng Index |
| ชื่อภาษาอังกฤษ | Hang Seng Index |
| ผู้คำนวณ | Hang Seng Indexes Company Limited |
| ที่ตั้งสำนักงาน | 83 Des Voeux Road Central, Hong Kong |
| หมายเลขโทรศัพท์ | (852) 2877 0704 |
| Home Page | www.hsi.com.hk/eng |

ทั้งนี้ ทางผู้คำนวณดัชนีราคา Hang Seng Index จะมีการปรับรายการหลักทรัพย์ทุกไตรมาส ดังต่อไปนี้

- (i) รอบทบทวนเดือนมีนาคม: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนเมษายน – มิถุนายนปีเดียวกัน
- (ii) รอบทบทวนเดือนมิถุนายน: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนกรกฎาคม – กันยายนปีเดียวกัน

(iii) รอบทบทวนเดือนกันยายน: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนตุลาคม – ธันวาคมปีเดียวกัน

(iv) รอบทบทวนเดือนธันวาคม: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนมกราคม – มีนาคมปีถัดไป

โดยในรอบปีที่ผ่านมา มีการเปลี่ยนแปลงส่วนประกอบของดัชนีดังกล่าว ดังนี้



Hang Seng Index

February 2021

The Hang Seng Index ("HSI"), the most widely quoted gauge of the Hong Kong stock market, includes the largest and most liquid stocks listed on the Main Board of the Stock Exchange of Hong Kong.

FEATURES

- The index includes the largest and most liquid stocks listed in Hong Kong
- Stocks are freefloat-adjusted for investability representation
- 10% capping is applied to avoid single stock domination
- Four sector sub-indexes are also available

Sub-indexes: Finance,
Utilities,
Properties,
Commerce &
Industry



Data has been rebased at 100.00. All information for an index prior to its launch date is back-tested, back-tested performance reflects hypothetical historical performance.

INDEX PERFORMANCE

| Index | Index Level | % Change | | | | | | |
|---------|-------------|----------|---------|---------|--------|--------|--------|-------|
| | | 1 - Mth | 3 - Mth | 6 - Mth | 1 - Yr | 3 - Yr | 5 - Yr | YTD |
| HSI | 28,980.21 | +2.46 | +10.02 | +15.11 | +10.91 | -6.04 | +51.63 | +6.42 |
| HSI TRI | 86,649.54 | +2.46 | +10.03 | +15.74 | +14.13 | +3.86 | +81.25 | +6.42 |

INFORMATION

| | |
|---------------------|-------------|
| Launch Date | 24 Nov 1969 |
| Backdated To | 31 Jul 1964 |
| Base Date | 31 Jul 1964 |
| Base Index | 100 |
| Review | Quarterly |
| Dissemination | Every 2 sec |
| Currency | HKD |
| Total Return Index | Available |
| No. of Constituents | 52 |
| HSIDVP | 0.00 |

VENDOR CODES

| | |
|-----------|------|
| Bloomberg | HSI |
| Refinitiv | .HSI |

CONTACT US

| | |
|-------|-----------------|
| Email | info@hsi.com.hk |
|-------|-----------------|

INDEX FUNDAMENTALS

| Index | Dividend Yield (%) | PE Ratio (Times) | Annual Volatility*(%) |
|-------|--------------------|------------------|-----------------------|
| HSI | 2.49 | 15.55 | 23.65 |

*Annual Volatility was calculated based on daily return for the past 12-month period.

CORRELATION

| Index | HSI | HSCEI | H-FIN |
|-------|------|-------|-------|
| HSI | 1.00 | 0.96 | 0.83 |
| HSCEI | - | 1.00 | 0.87 |
| H-FIN | - | - | 1.00 |

INDEX STATISTICS

| Index | Total Market Value (HKD Mn) | Market Value Coverage Ratio^ (%) | Market Turnover Coverage^ (%) |
|-------|-----------------------------|----------------------------------|-------------------------------|
| HSI | 28,705,360 | 53.63 | 45.78 |

^ The universe comprises Main Board primary listings excluding foreign companies

All data as at 26 Feb 2021

HSCEI: Hang Seng China Enterprises Index
H-FIN: Hang Seng China H-Financials Index

Disclaimer
All information contained herein is provided for reference only. Hang Seng Indexes Company Limited ("HSIL") ensures the accuracy and reliability of the above information to the best of its endeavours. However, HSIL makes no warranty or representation as to the accuracy, completeness or reliability of any of the information contained herein and accepts no liability (whether in tort or contract or otherwise) whatsoever to any person for any damage or loss of any nature arising from or as a result of reliance on any of the contents of this document, or any errors or omissions in its contents and such contents may change from time to time without notice. Prospective investors should also note that value of securities and investments can go down as well as up and past performance is not necessarily indicative of future performance.
The information contained in this document is not intended to provide professional advice and should not be relied upon in that regard. Persons intending to use any information obtained from this document are advised to obtain appropriate professional advice.



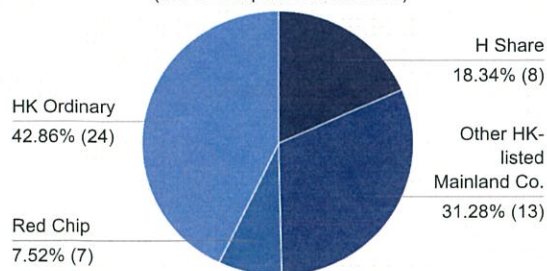
恒生指數

HANG SENG INDEXES

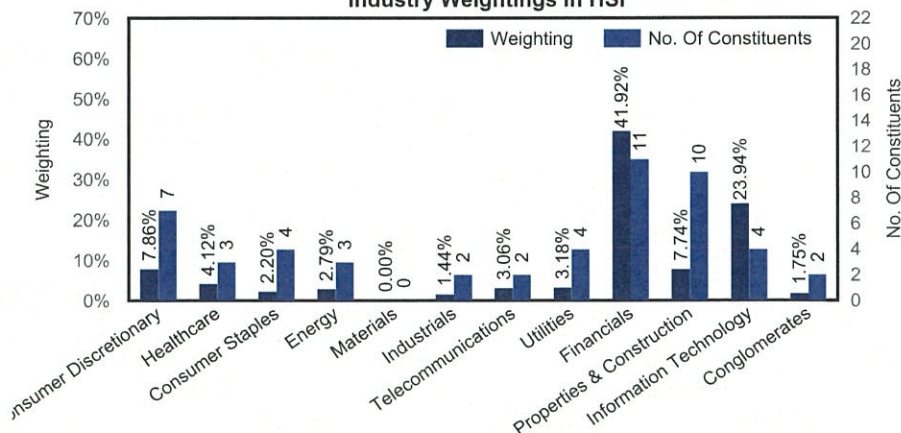
CONSTITUENTS (TOP 50)

| Stock Code | ISIN CODE | Company Name | Industry Classification | Share Type | Weighting (%) |
|------------|---------------|-----------------|---------------------------|------------------------------|---------------|
| 9988 | KYG017191142 | BABA-SW | Information Technology | Other HK-listed Mainland Co. | 4.76 |
| 3988 | CNE1000001Z5 | BANK OF CHINA | Financials | H Share | 1.84 |
| 3690 | KYG596691041 | MEITUAN-W | Information Technology | Other HK-listed Mainland Co. | 5.36 |
| 3328 | CNE100000205 | BANKCOMM | Financials | H Share | 0.33 |
| 2628 | CNE1000002L3 | CHINA LIFE | Financials | H Share | 1.04 |
| 2388 | HK2388011192 | BOC HONG KONG | Financials | HK Ordinary | 0.81 |
| 2382 | KYG8586D1097 | SUNNY OPTICAL | Industrials | Other HK-listed Mainland Co. | 1.18 |
| 2319 | KYG210961051 | MENGNIU DAIRY | Consumer Staples | Red Chip | 1.00 |
| 2318 | CNE1000003X6 | PING AN | Financials | H Share | 4.83 |
| 2313 | KYG8087W1015 | SHENZHOU INTL | Consumer Discretionary | Other HK-listed Mainland Co. | 1.13 |
| 2269 | KYG970081173 | WUXI BIO | Healthcare | HK Ordinary | 2.67 |
| 2020 | KYG040111059 | ANTA SPORTS | Consumer Discretionary | Other HK-listed Mainland Co. | 1.10 |
| 2018 | KYG2953R1149 | AAC TECH | Industrials | Other HK-listed Mainland Co. | 0.26 |
| 2007 | KYG245241032 | COUNTRY GARDEN | Properties & Construction | Other HK-listed Mainland Co. | 0.63 |
| 1997 | KYG9593A1040 | WHARF REIC | Properties & Construction | HK Ordinary | 0.66 |
| 1928 | KYG7800X1079 | SANDS CHINA LTD | Consumer Discretionary | HK Ordinary | 0.88 |
| 1876 | KYG1674K1013 | BUD APAC | Consumer Staples | HK Ordinary | 0.40 |
| 1810 | KYG9830T1067 | XIAOMI-W | Information Technology | Other HK-listed Mainland Co. | 3.38 |
| 1398 | CNE1000003G1 | ICBC | Financials | H Share | 3.18 |
| 1299 | HK0000069689 | AIA | Financials | HK Ordinary | 9.99 |
| 1177 | KYG8167W1380 | SINO BIOPHARM | Healthcare | Other HK-listed Mainland Co. | 0.83 |
| 1113 | KYG2177B1014 | CK ASSET | Properties & Construction | HK Ordinary | 1.00 |
| 1109 | KYG2108Y1052 | CHINA RES LAND | Properties & Construction | Red Chip | 1.01 |
| 1093 | HK1093012172 | CSPC PHARMA | Healthcare | Other HK-listed Mainland Co. | 0.62 |
| 1044 | KYG4402L1510 | HENGAN INT'L | Consumer Staples | Other HK-listed Mainland Co. | 0.33 |
| 1038 | BMG2178K1009 | CKI HOLDINGS | Utilities | HK Ordinary | 0.30 |
| 941 | HK0941009539 | CHINA MOBILE | Telecommunications | Red Chip | 2.81 |
| 939 | CNE1000002H1 | CCB | Financials | H Share | 5.74 |
| 883 | HK0883013259 | CNOOC | Energy | Red Chip | 1.41 |
| 857 | CNE1000003VW8 | PETROCHINA | Energy | H Share | 0.50 |
| 823 | HK0823032773 | LINK REIT | Properties & Construction | HK Ordinary | 1.29 |
| 762 | HK0000049939 | CHINA UNICOM | Telecommunications | Red Chip | 0.26 |
| 700 | KYG875721634 | TENCENT | Information Technology | Other HK-listed Mainland Co. | 10.44 |
| 688 | HK0688002218 | CHINA OVERSEAS | Properties & Construction | Red Chip | 0.64 |
| 669 | HK0669013440 | TECHTRONIC IND | Consumer Discretionary | HK Ordinary | 1.57 |
| 388 | HK0388045442 | HKEX | Financials | HK Ordinary | 4.85 |
| 386 | CNE1000002Q2 | SINOPEC CORP | Energy | H Share | 0.89 |
| 288 | KYG960071028 | WH GROUP | Consumer Staples | HK Ordinary | 0.48 |
| 267 | HK0267001375 | CITIC | Conglomerates | Red Chip | 0.41 |
| 175 | KYG3777B1032 | GEELY AUTO | Consumer Discretionary | Other HK-listed Mainland Co. | 1.26 |
| 101 | HK0101000591 | HANG LUNG PPT | Properties & Construction | HK Ordinary | 0.35 |
| 66 | HK0066009694 | MTR CORPORATION | Consumer Discretionary | HK Ordinary | 0.61 |
| 27 | HK0027032686 | GALAXY ENT | Consumer Discretionary | HK Ordinary | 1.31 |
| 17 | HK0000608585 | NEW WORLD DEV | Properties & Construction | HK Ordinary | 0.51 |
| 16 | HK0016000132 | SHK PPT | Properties & Construction | HK Ordinary | 1.23 |
| 12 | HK0012000102 | HENDERSON LAND | Properties & Construction | HK Ordinary | 0.42 |
| 11 | HK0011000095 | HANG SENG BANK | Financials | HK Ordinary | 0.98 |
| 6 | HK0006000050 | POWER ASSETS | Utilities | HK Ordinary | 0.51 |
| 5 | GB0005405286 | HSBC HOLDINGS | Financials | HK Ordinary | 8.33 |
| 3 | HK0003000038 | HK & CHINA GAS | Utilities | HK Ordinary | 1.06 |

Weightings by Share Type
(No. of companies in brackets)



Industry Weightings in HSI



โดยแหล่งข้อมูลอ้างอิงที่ผู้ลงทุนจะสามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับข้อมูลดัชนีหลักทรัพย์ดังกล่าวได้ที่

<https://www.hsi.com.hk/eng/indexes/all-indexes/hsi>

<http://www.set.or.th/set/dwunderlying.do?language+th&country+TH>

| | |
|---------------------|--|
| ชื่อดัชนีหลักทรัพย์ | Hang Seng China Enterprises Index |
| ชื่อภาษาอังกฤษ | Hang Seng China Enterprises Index |
| ผู้คำนวณ | Hang Seng Indexes Company Limited |
| ที่ตั้งสำนักงาน | 83 Des Voeux Road Central, Hong Kong |
| หมายเลขโทรศัพท์ | (852) 2877 0704 |
| Home Page | www.hsi.com.hk/eng |

ทั้งนี้ ทางผู้คำนวณดัชนีราคา Hang Seng China Enterprises Index จะมีการปรับรายการหลักทรัพย์ทุกไตรมาส ดังต่อไปนี้

- (i) รอบทบทวนเดือนมีนาคม: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนเมษายน – มิถุนายนปีเดียวกัน
- (ii) รอบทบทวนเดือนมิถุนายน: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนกรกฎาคม – กันยายนปีเดียวกัน
- (iii) รอบทบทวนเดือนกันยายน: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนตุลาคม – ธันวาคมปีเดียวกัน
- (iv) รอบทบทวนเดือนธันวาคม: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนมกราคม – มีนาคมปีถัดไป

โดยในรอบปีที่ผ่านมา มีการเปลี่ยนแปลงส่วนประกอบของดัชนีดังกล่าว ดังนี้

Hang Seng China Enterprises Index

Constituent Change (Effective 22 December 2020)

| ADD | | REMOVE | |
|------|--------------|--------|--------------|
| Code | Company Name | Code | Company Name |
| 6618 | JD HEALTH | | |

Constituent List (Assuming the constituent changes had been effective on 8 December 2020)

| Constituent List (Assuming the constituent changes had been effective on 8 December 2020) | | | | |
|---|----------------|---------|-----------------|----------|
| Code | Company Name | FAF (%) | Weighting (%) * | |
| | | | Before | After ** |
| H-shares | | | 36.91 | 36.28 |
| 939 | CCB | 45 | 9.14 | 8.99 |
| 2318 | PING AN | 80 | 8.03 | 7.89 |
| 1398 | ICBC | 85 | 5.08 | 5.00 |
| 3988 | BANK OF CHINA | 95 | 3.04 | 2.99 |
| 3968 | CM BANK | 85 | 2.69 | 2.64 |
| 2628 | CHINA LIFE | 100 | 1.87 | 1.84 |
| 386 | SINOPEC CORP | 95 | 1.19 | 1.17 |
| 2601 | CPIC | 100 | 1.18 | 1.16 |
| 1288 | ABC | 90 | 1.14 | 1.12 |
| 914 | CONCH CEMENT | 95 | 0.86 | 0.84 |
| 788 | CHINA TOWER | 95 | 0.77 | 0.76 |
| 857 | PETROCHINA | 100 | 0.72 | 0.71 |
| 1658 | PSBC | 55 | 0.68 | 0.67 |
| 3328 | BANKCOMM | 25 | 0.52 | 0.51 |
| Red-chips and P-chips | | | 63.09 | 63.72 |
| 700 | TENCENT | 65 | 10.33 | 10.15 |
| 3690 | MEITUAN-W | 65 | 5.09 | 5.00 |
| 9988 | BABA-SW | 65 | 5.13 | 5.05 |
| 1810 | XIAOMI-W | 65 | 5.16 | 5.07 |
| 941 | CHINA MOBILE | 30 | 4.03 | 3.96 |
| 175 | GEELY AUTO | 60 | 1.78 | 1.75 |
| 883 | CNOOC | 40 | 1.78 | 1.75 |
| 6618 | JD HEALTH | 35 | - | 1.71 |
| 2020 | ANTA SPORTS | 40 | 1.68 | 1.65 |
| 2319 | MENGNIU DAIRY | 70 | 1.68 | 1.65 |
| 2382 | SUNNY OPTICAL | 65 | 1.59 | 1.57 |
| 2313 | SHENZHOU INTL | 55 | 1.59 | 1.56 |
| 291 | CHINA RES BEER | 50 | 1.47 | 1.45 |
| 9618 | JD-SW | 40 | 1.46 | 1.43 |
| 1109 | CHINA RES LAND | 45 | 1.44 | 1.41 |
| 241 | ALI HEALTH | 30 | 1.39 | 1.37 |
| 981 | SMIC | 75 | 1.38 | 1.36 |
| 2688 | ENN ENERGY | 70 | 1.17 | 1.15 |
| 1177 | SINO BIOPHARM | 60 | 1.13 | 1.11 |
| 6186 | CHINA FEIHE | 50 | 1.13 | 1.11 |
| 2007 | COUNTRY GARDEN | 35 | 1.10 | 1.08 |
| 960 | LONGFOR GROUP | 30 | 1.10 | 1.08 |
| 1918 | SUNAC | 55 | 1.04 | 1.02 |
| 688 | CHINA OVERSEAS | 35 | 0.99 | 0.97 |
| 1093 | CSPC PHARMA | 75 | 0.98 | 0.97 |
| 384 | CHINA GAS HOLD | 45 | 0.97 | 0.95 |
| 586 | CONCH VENTURE | 95 | 0.89 | 0.88 |
| 6862 | HAIDILAO | 20 | 0.87 | 0.85 |
| 9999 | NTES-S | 15 | 0.63 | 0.62 |
| 267 | CITIC | 25 | 0.60 | 0.59 |
| 3692 | HANSOH PHARMA | 20 | 0.59 | 0.58 |
| 1044 | HENGAN INT'L | 60 | 0.56 | 0.55 |
| 270 | GUANGDONG INV | 45 | 0.52 | 0.51 |
| 1193 | CHINA RES GAS | 40 | 0.51 | 0.50 |
| 813 | SHIMAO GROUP | 40 | 0.49 | 0.48 |
| 3333 | EVERGRANDE | 15 | 0.45 | 0.44 |
| 762 | CHINA UNICOM | 20 | 0.40 | 0.39 |
| Total | | | 100.00 | 100.00 |

Total number of constituents: 51

* Figures may not add up to totals due to rounding.

** An ad-hoc recapping will be performed on 16 December 2020 if the weighting of JD Health is higher than the cap level (i.e. 10%).
Based on the closing price on 8 December 2020, no ad-hoc index recapping is required.

โดยแหล่งข้อมูลอ้างอิงที่ผู้ลงทุนจะสามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับข้อมูลดัชนีหลักทรัพย์ดังกล่าวได้ที่

<https://www.hsi.com.hk/eng/indexes/all-indexes/hscei>

<http://www.set.or.th/set/dwunderlying.do?language+th&country+TH>

| | |
|---------------------|---|
| ชื่อดัชนีหลักทรัพย์ | S&P500 Index |
| ชื่อภาษาอังกฤษ | S&P500 Index |
| ผู้คำนวณ | S&P Global Inc. |
| ที่ตั้งสำนักงาน | 55 Water Street New York, New York |
| หมายเลขโทรศัพท์ | +1 (212) 438-1000 |
| Home Page | https://www.spglobal.com/en/ |

ทั้งนี้ ทางผู้คำนวณดัชนีราคา S&P500 Index จะมีการปรับรายการหลักทรัพย์ทุกไตรมาส ดังต่อไปนี้

- (i) รอบทบทวนเดือนมีนาคม: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนเมษายน – มิถุนายนปีเดียวกัน
- (ii) รอบทบทวนเดือนมิถุนายน: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนกรกฎาคม – กันยายนปีเดียวกัน
- (iii) รอบทบทวนเดือนกันยายน: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนตุลาคม – ธันวาคมปีเดียวกัน
- (iv) รอบทบทวนเดือนธันวาคม: สำหรับข้อมูลที่ใช้ในการคำนวณ ช่วงระหว่างเดือนมกราคม – มีนาคมปีถัดไป

โดยในรอบปีที่ผ่านมามีการเปลี่ยนแปลงส่วนประกอบของดัชนีดังกล่าว ดังนี้

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

Description

The S&P 500® is widely regarded as the best single gauge of large-cap U.S. equities. There is over USD 11.2 trillion indexed or benchmarked to the index, with indexed assets comprising approximately USD 4.6 trillion of this total. The index includes 500 leading companies and covers approximately 80% of available market capitalization.

Index Attributes

Created in 1957, the S&P 500 was the first U.S. market-cap-weighted stock market index. Today, it's the basis of many listed and over-the-counter investment instruments. This world-renowned index includes 500 of the top companies in leading industries of the U.S. economy.

The S&P 500 is part of a series of S&P Dow Jones U.S. equity indices that can be used as mutually exclusive building blocks; the index does not overlap holdings with the S&P MidCap 400® or S&P SmallCap 600®. Together, they constitute the S&P Composite 1500®.

Methodology Construction

Universe. All constituents must be U.S. companies.

Eligibility Market Cap. To be included, companies must have an unadjusted market cap of USD 9.8 billion or greater, and must have a float-adjusted market cap that is at least 50% of the unadjusted minimum market cap threshold.

Public Float. Companies must have an investable weight factor (IWF) of at least 0.10.

Financial Viability. Companies must have positive as-reported earnings over the most recent quarter, as well as over the most recent four quarters (summed together).

Adequate Liquidity and Reasonable Price. Using composite pricing and volume, the ratio of annual dollar value traded (defined as average closing price over the period multiplied by historical volume) to float-adjusted market capitalization should be at least 1.00, and the stock should trade a minimum of 250,000 shares in each of the six months leading up to the evaluation date.

Sector Representation. Sector balance, as measured by a comparison of each GICS® sector's weight in an index with its weight in the S&P Total Market Index, in the relevant market capitalization range, is also considered in the selection of companies for the indices.

Company Type. All eligible U.S. common equities listed on eligible U.S. exchanges can be included. REITs are also eligible for inclusion. Closed-end funds, ETFs, ADRs, ADS, and certain other types of securities are ineligible for inclusion.

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

Quick Facts

| | |
|--------------------------|---|
| WEIGHTING METHOD | Float-adjusted market cap weighted |
| REBALANCING FREQUENCY | Quarterly in March, June, September, and December |
| CALCULATION FREQUENCY | Real time |
| CALCULATION CURRENCIES | USD, AUD, BRL, CAD, CHF, EUR, GBP, HKD, JPY, MXN, SGD |
| LAUNCH DATE | March 4, 1957 |
| FIRST VALUE DATE | January 3, 1928 |
| REGULATORY AUTHORIZATION | European Union |

For more information, including the complete methodology document, please visit:
<https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/equity/sp-500>

All information for an index prior to its Launch Date is hypothetical back-tested, not actual performance, based on the index methodology in effect on the Launch Date. Back-tested performance reflects application of an index methodology and selection of index constituents with the benefit of hindsight and knowledge of factors that may have positively affected its performance, cannot account for all financial risk that may affect results and may be considered to reflect survivor/look ahead bias. Actual returns may differ significantly from, and be lower than, back-tested returns. Past performance is not an indication or guarantee of future results. This back-tested data may have been created using a "Backward Data Assumption". For more information on "Backward Data Assumption" and back-testing in general, please see the Performance Disclosure at the end of this material.

Historical Performance

Depending on index launch date, all charts below may include back-tested data.



S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

Performance

| INDEX LEVEL | RETURNS | | | ANNUALIZED RETURNS | | | |
|------------------|---------|-------|-------|--------------------|--------|--------|--------|
| | 1 MO | 3 MOS | YTD | 1 YR | 3 YRS | 5 YRS | 10 YRS |
| Total Return | | | | | | | |
| 7,892.81 | 2.76% | 5.63% | 1.72% | 31.29% | 14.14% | 16.82% | 13.43% |
| Price Return | | | | | | | |
| 3,811.15 | 2.61% | 5.23% | 1.47% | 29.01% | 11.98% | 14.55% | 11.12% |
| Net Total Return | | | | | | | |
| 6,948.1 | 2.71% | 5.51% | 1.64% | 30.6% | 13.49% | 16.14% | 12.73% |

Calendar Year Performance

| 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 |
|------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| Total Return | | | | | | | | | |
| 18.4% | 31.49% | -4.38% | 21.83% | 11.96% | 1.38% | 13.69% | 32.39% | 16% | 2.11% |
| Price Return | | | | | | | | | |
| 16.26% | 28.88% | -6.24% | 19.42% | 9.54% | -0.73% | 11.39% | 29.6% | 13.41% | 0% |
| Net Total Return | | | | | | | | | |
| 17.75% | 30.7% | -4.94% | 21.1% | 11.23% | 0.75% | 12.99% | 31.55% | 15.22% | 1.47% |

Risk

| ANNUALIZED RISK | | | ANNUALIZED RISK-ADJUSTED RETURNS | | |
|------------------|--------|--------|----------------------------------|-------|--------|
| 3 YRS | 5 YRS | 10 YRS | 3 YRS | 5 YRS | 10 YRS |
| Total Return | | | | | |
| 18.45% | 15.03% | 13.54% | 0.77 | 1.12 | 0.99 |
| Price Return | | | | | |
| 18.44% | 15.01% | 13.54% | 0.65 | 0.97 | 0.82 |
| Net Total Return | | | | | |
| 18.45% | 15.02% | 13.54% | 0.73 | 1.07 | 0.94 |

Risk is defined as standard deviation calculated based on total returns using monthly values.

Fundamentals

| P/E (TRAILING) | P/E (PROJECTED) | P/B | INDICATED DIV YIELD | P/SALES | P/CASH FLOW |
|----------------|-----------------|-----|---------------------|---------|-------------|
| 34.24 | 22.26 | 3.7 | 1.53% | 2.46 | 24.63 |

P/E (Projected) and Dividend Yield are as of February 26, 2021; P/E (Trailing), P/B, P/Sales, and P/Cash Flow are as of September 30, 2020. Fundamentals are updated on approximately the fifth business day of each month.

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

Index Characteristics

| | |
|----------------------------------|--------------|
| NUMBER OF CONSTITUENTS | 505 |
| CONSTITUENT MARKET [USD MILLION] | |
| MEAN TOTAL MARKET CAP | 67,111.49 |
| LARGEST TOTAL MARKET CAP | 2,061,638.63 |
| SMALLEST TOTAL MARKET CAP | 4,127.01 |
| MEDIAN TOTAL MARKET CAP | 27,140.77 |
| WEIGHT LARGEST CONSTITUENT [%] | 6 |
| WEIGHT TOP 10 CONSTITUENTS [%] | 27 |

ESG Carbon Characteristics

| | |
|--|--------|
| CARBON TO VALUE INVESTED (METRIC TONS CO ₂ e/\$1M INVESTED)* | 55.04 |
| CARBON TO REVENUE (METRIC TONS CO ₂ e/\$1M REVENUES)* | 194.35 |
| WEIGHTED AVERAGE CARBON INTENSITY (METRIC TONS CO ₂ e/\$1M REVENUES)* | 180.05 |
| FOSSIL FUEL RESERVE EMISSIONS (METRIC TONS CO ₂ / \$1M INVESTED) | 490.55 |

*Operational and first-tier supply chain greenhouse gas emissions.
For more information, please visit: www.spdji.com/esg-carbon-metrics.

Top 10 Constituents By Index Weight

| CONSTITUENT | SYMBOL | SECTOR* |
|----------------------|--------|------------------------|
| Apple Inc. | AAPL | Information Technology |
| Microsoft Corp | MSFT | Information Technology |
| Amazon.com Inc | AMZN | Consumer Discretionary |
| Facebook Inc A | FB | Communication Services |
| Alphabet Inc A | GOOGL | Communication Services |
| Alphabet Inc C | GOOG | Communication Services |
| Tesla, Inc | TSLA | Consumer Discretionary |
| Berkshire Hathaway B | BRK.B | Financials |
| JP Morgan Chase & Co | JPM | Financials |
| Johnson & Johnson | JNJ | Health Care |

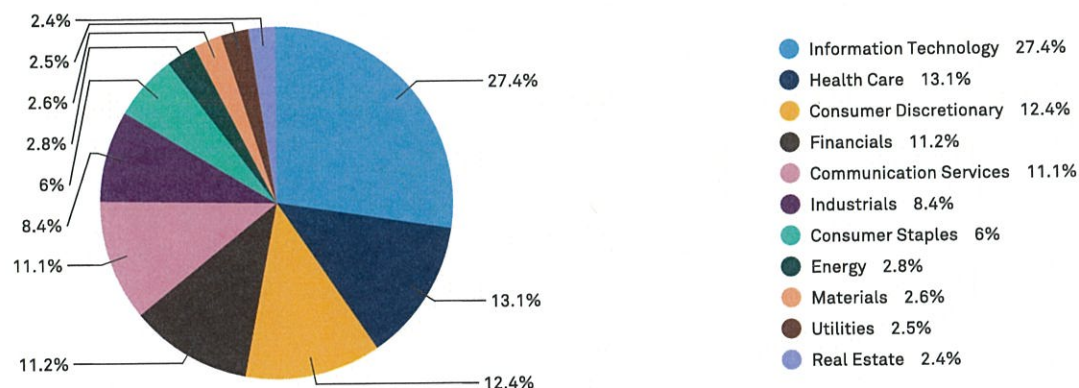
*Based on GICS® sectors

S&P Dow Jones Indices

A Division of S&P Global

Equity
S&P 500®

Sector* Breakdown



*Based on GICS® sectors

The weightings for each sector of the index are rounded to the nearest tenth of a percent; therefore, the aggregate weights for the index may not equal 100%.

Country Breakdown

| COUNTRY | NUMBER OF CONSTITUENTS | TOTAL MARKET CAP [USD MILLION] | INDEX WEIGHT [%] |
|---------------|------------------------|--------------------------------|------------------|
| United States | 505 | 33,891,301.6 | 100 |

Based on index constituents' country of domicile.

Tickers

| | TICKER | REUTERS |
|------------------|----------|---------|
| Price Return | SPX | .SPFIV |
| Total Return | SPXT | .SPXT |
| Net Total Return | SPTR500N | .SPXNTR |

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

Related Products

This list includes investable products traded on certain exchanges currently linked to this selection of indices. While we have tried to include all such products, we do not guarantee the completeness or accuracy of such lists. Please refer to the disclaimers at the end of this document or [here](#) for more information about S&P Dow Jones Indices' relationship to such third party product offerings.

| PRODUCT NAME | PRODUCT TYPE | EXCHANGE | TICKER |
|--|--------------|-------------------------------|--------|
| 1Invest S&P500 Feeder ETF | ETF | JOHANNESBURG STOCK EXCHANGE | ETF500 |
| AllianzIM US Large Cap Buffer10 Apr ETF | ETF | NYSE ARCA | AZAA |
| AllianzIM US Large Cap Buffer10 Jul ETF | ETF | NYSE ARCA | AZAL |
| AllianzIM US Large Cap Buffer10 Oct ETF | ETF | NYSE ARCA | AZAO |
| AllianzIM US Large Cap Buffer20 Apr ETF | ETF | NYSE ARCA | AZBA |
| AllianzIM US Large Cap Buffer20 Jan ETF | ETF | NYSE Arca | AZBJ |
| AllianzIM US Large Cap Buffer20 Jul ETF | ETF | NYSE ARCA | AZBL |
| AllianzIM US Large Cap Buffer20 Oct ETF | ETF | NYSE ARCA | AZBO |
| Amundi ETF PEA S&P 500 Daily Hgd EUR A/I | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | P500H |
| Amundi ETF PEA S&P 500 EUR A/I | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | PE500 |
| Amundi IS S&P 500 ETF C EUR | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | 500 |
| Amundi IS S&P 500 ETF C EUR Hdg | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | 500H |
| Amundi IS S&P 500 ETF C USD | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | 500U |
| ARIRANG S&P500 | ETF | KOREA EXCHANGE (STOCK MARKET) | 269540 |
| BetaPro S&P 500® -2x Daily Bear ETF | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | HSD |
| BetaPro S&P 500® 2x Daily Bull ETF | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | HSU |
| BetaPro S&P 500® Daily Inverse ETF | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | HIU |
| BetaShares Geared US Eq Ccy Hdg ETF | ETF | ASX - ALL MARKETS | GGUS |
| BetaShares S&P 500 Yield Maximiser ETF | ETF | ASX - ALL MARKETS | UMAX |
| BetaShares US Eqs Strong Bear H CcyH ETF | ETF | ASX - ALL MARKETS | BBUS |
| BMO Concentrated US Equity ETF Ser | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | ZCU |
| BMO S&P 500 ETF (CAD) | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | ZSP |
| BMO S&P 500 ETF (USD) | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | ZSP.U |
| BMO S&P 500 Hedged to CAD ETF | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | ZUE |
| BNPP Easy S&P 500 ETF EUR C | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | ESE |
| BNPP Easy S&P 500 ETF EUR H | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | ESEH |
| BNPP Easy S&P 500 ETF USD C | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | ESD |
| BNPP Easy S&P 500 ETF USD C/D | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | ESDD |
| Bosera S&P 500 QDII Fd | ETF | SHANGHAI STOCK EXCHANGE | 513500 |
| Bristol Gate Concentrated US Equity ETF | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | BGU |
| CoreShares S&P 500 ETF | ETF | JOHANNESBURG STOCK EXCHANGE | CSP500 |

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

| PRODUCT NAME | PRODUCT TYPE | EXCHANGE | TICKER |
|--|--------------|--------------------------------------|--------|
| Direxion Daily S&P 500® Bear 1X ETF | ETF | NYSE Arca | SPDN |
| Direxion Daily S&P 500® Bear 3X ETF | ETF | NYSE ARCA | SPXS |
| Direxion Daily S&P 500® Bull 2X ETF | ETF | NYSE ARCA | SPUU |
| Direxion Daily S&P500® Bull 3X ETF | ETF | NYSE ARCA | SPXL |
| Eaton Vance Stock NextShares™ | ETF | NASDAQ | EVSTC |
| FT Cboe Vest US Equity Buffer ETF Aug | ETF | BATS Z-EXCHANGE | FAUG |
| FT Cboe Vest US Equity Buffer ETF Dec | ETF | BATS Z-Exchange | FDEC |
| FT Cboe Vest US Equity Buffer ETF Feb | ETF | BATS Z-EXCHANGE | FFEB |
| FT Cboe Vest US Equity Buffer ETF Jan | ETF | BATS Z-Exchange | FJAN |
| FT Cboe Vest US Equity Buffer ETF Jul | ETF | BATS Z-EXCHANGE | FJUL |
| FT Cboe Vest US Equity Buffer ETF Jun | ETF | BATS Z-EXCHANGE | FJUN |
| FT Cboe Vest US Equity Buffer ETF May | ETF | BATS Z-EXCHANGE | FMAY |
| FT Cboe Vest US Equity Buffer ETF Nov | ETF | BATS Z-EXCHANGE | FNOV |
| FT Cboe Vest US Equity Buffer ETF Oct | ETF | BATS Z-Exchange | FOCT |
| FT Cboe Vest US Equity Buffer ETF Sep | ETF | BATS Z-EXCHANGE | FSEP |
| FT Cboe Vest US Equity Deep Bfrr ETF Feb | ETF | BATS Z-EXCHANGE | DFEB |
| FT Cboe Vest US Equity Deep Bfrr ETF Jul | ETF | BATS Z-EXCHANGE | DJUL |
| FT Cboe Vest US Equity Deep Bfrr ETF May | ETF | BATS Z-EXCHANGE | DMAY |
| FT Cboe Vest US Equity Deep Bfrr ETF Nov | ETF | BATS Z-EXCHANGE | DNOV |
| FT Cboe Vest US Equity Deep Bfrr ETF Oct | ETF | BATS Z-Exchange | DOCT |
| FT Cboe Vest US Equity Deep Bfr ETF Aug | ETF | BATS Z-EXCHANGE | DAUG |
| FT Cboe Vest US Equity Deep Bfr ETF Jun | ETF | BATS Z-EXCHANGE | DJUN |
| FT Cboe Vest US Equity Dp Bfrr ETF Jan | ETF | BATS Z-Exchange | DJAN |
| FT Cboe Vest US Equity Dp Bfrr ETF Sep | ETF | BATS Z-EXCHANGE | DSEP |
| FT Cboe Vest US Equity Dp Bfr ETF Dec | ETF | BATS Z-Exchange | DDEC |
| Global X S&P 500 Daily (-1x) Inverse | ETF | XFMQ--Unlisted Fund Manager Quote | N/A |
| Harel Sal S&P 500 | ETF | | HRLF25 |
| Harel Sal S&P 500 Currency Hedged | ETF | | HRLF50 |
| Horizons S&P 500 CAD Hedged ETF | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | HSH |
| Horizons S&P 500 ETF | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | HXS |
| HSBC S&P 500 ETF | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | HSPD |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BJUN |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF - Aug | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BAUG |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF - September | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BSEP |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF Apr New | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BAPR |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF Dec | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BDEC |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF January | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BJAN |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF July | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BJUL |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF Nov | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BNOV |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF October | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BOCT |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF™ Feb | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BFEB |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF™ March | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BMAR |
| Innovator S&P 500 Buffer ETF™ May | ETF | BATS Z-EXCHANGE | BMAY |
| Innovator S&P 500 Power Bfrr ETF Apr New | ETF | BATS Z-EXCHANGE | PAPR |

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

| PRODUCT NAME | PRODUCT TYPE | EXCHANGE | TICKER |
|--|--------------|------------------------------------|--------|
| Innovator S&P 500 Power Buffer ETF - Aug | ETF | BATS Z-EXCHANGE | PAUG |
| Innovator S&P 500 Power Buffer ETF - Sep | ETF | BATS Z-EXCHANGE | PSEP |
| Innovator S&P 500 Power Buffer ETF Dec | ETF | BATS Z-EXCHANGE | PDEC |
| Innovator S&P 500 Power Buffer ETF Jan | ETF | BATS Z-EXCHANGE | PJAN |
| Innovator S&P 500 Power Buffer ETF July | ETF | BATS Z-EXCHANGE | PJUL |
| Innovator S&P 500 Power Buffer ETF New | ETF | BATS Z-EXCHANGE | PJUN |
| Innovator S&P 500 Power Buffer ETF Nov | ETF | BATS Z-EXCHANGE | PNOV |
| Innovator S&P 500 Power Buffer ETF Oct | ETF | BATS Z-EXCHANGE | POCT |
| Innovator S&P 500 Power Buffer ETF™ Feb | ETF | BATS Z-EXCHANGE | PFEB |
| Innovator S&P 500 Power Buffer ETF™ Mar | ETF | BATS Z-EXCHANGE | PMAR |
| Innovator S&P 500 Power Buffer ETF™ May | ETF | BATS Z-EXCHANGE | PMAY |
| Innovator S&P 500 Ultra Bfrr ETF Apr New | ETF | BATS Z-EXCHANGE | UAPR |
| Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF | ETF | BATS Z-EXCHANGE | UJUN |
| Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF - Aug | ETF | BATS Z-EXCHANGE | UAUG |
| Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF - Sep | ETF | BATS Z-EXCHANGE | USEP |
| Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF Dec | ETF | BATS Z-EXCHANGE | UDEC |
| Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF Jan | ETF | BATS Z-EXCHANGE | UJAN |
| Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF July | ETF | BATS Z-EXCHANGE | UJUL |
| Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF Nov | ETF | BATS Z-EXCHANGE | UNOV |
| Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF Oct | ETF | BATS Z-EXCHANGE | UOCT |
| Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF™ Feb | ETF | BATS Z-EXCHANGE | UFEB |
| Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF™ Mar | ETF | BATS Z-EXCHANGE | UMAR |
| Innovator S&P 500 Ultra Buffer ETF™ May | ETF | BATS Z-EXCHANGE | UMAY |
| Invesco S&P 500 Equal Weight ETF CAD | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | EQL |
| Invesco S&P 500 Equal Weight ETF CAD H | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | EQL.F |
| Invesco S&P 500 Equal Weight ETF USD | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | EQL.U |
| Invesco S&P 500 ETF | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | SPXS |
| Invesco S&P 500 ETF (Dist) | ETF | SIX SWISS EXCHANGE | SPXD |
| Invesco S&P 500 ETF (EUR Hdg) | ETF | XETRA | E500 |
| Invesco S&P 500 ETF (GBP Hdg) | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | N/A |
| Invesco S&P 500 Hi Div Low Vol ETF CAD | ETF | AEQUITAS NEO EXCHANGE | UHD |
| Invesco S&P 500 Hi Div Low Vol ETF CAD H | ETF | AEQUITAS NEO EXCHANGE | UHD.F |
| Invesco S&P 500 Hi Div Low Vol ETFUSD | ETF | AEQUITAS NEO EXCHANGE | UHD.U |
| iShares Core S&P 500 ETF | ETF | NYSE ARCA | IVV |
| iShares Core S&P 500 ETF | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | XUS |
| iShares Core S&P 500 ETF (CAD-Hedged) | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | XSP |
| iShares Core S&P 500 ETF GBPH Dist | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | GSPX |
| iShares Core S&P 500 ETF MXNH Acc | ETF | BATS CHI-X EUROPE -CXE ORDER BOOKS | CSPXX |
| iShares Core S&P 500 ETF USD Acc | ETF | SIX SWISS EXCHANGE | CSSPX |

AS OF FEBRUARY 26, 2021
FOR USE WITH INSTITUTIONS ONLY, NOT FOR USE WITH RETAIL INVESTORS.

www.spglobal.com/spdji | index_services@spglobal.com

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

| PRODUCT NAME | PRODUCT TYPE | EXCHANGE | TICKER |
|---|--------------|--|---------|
| iShares Core S&P 500 ETF USD Dist | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | IDUS |
| iShares S&P 500 AUD Hedged ETF | ETF | ASX - ALL MARKETS | IHVV |
| iShares S&P 500 CHF Hedged ETF Acc | ETF | SIX SWISS EXCHANGE | IUSC |
| iShares S&P 500 ETF | ETF | TOKYO STOCK EXCHANGE | 1655 |
| iShares S&P 500 ETF | ETF | ASX - ALL MARKETS | IVV |
| iShares S&P 500 EUR Hedged ETF Acc | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | IUSE |
| iShares S&P 500 FIC FI IE | ETF | BM&FBOVESPA S.A. - BOLSA DE VALORES, MERCADORIAS E FUTUROS | IVVB11 |
| iShares S&P 500 GBP Hedged ETF Acc | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | IGUS |
| iShares S&P 500 JPY Hedged ETF | ETF | TOKYO STOCK EXCHANGE | 2563 |
| iShares S&P 500 Peso Hedged TRAC | ETF | BOLSA MEXICANA DE VALORES (MEXICAN STOCK EXCHANGE) | IVVPESO |
| iShares S&P 500 Swap ETF USD Acc | ETF | EURONEXT - EURONEXT AMSTERDAM | I500 |
| It Now S&P500® TRN Fund ETF | ETF | BM&FBOVESPA S.A. - BOLSA DE VALORES, MERCADORIAS E FUTUROS | SPXI11 |
| KINDEX S&P500 | ETF | KOREA EXCHANGE (STOCK MARKET) | 360200 |
| KSM ETF Composite Gov Bond (55%) Corp Bond (30%) Equity (15%) Monthly Currency Hedged | ETF | | KSMF141 |
| KSM ETF Composite US Equity Monthly | ETF | | KSMF150 |
| KSM ETF Leveraged S&P 500 x3 Monthly | ETF | | KSMF111 |
| KSM ETF S&P 500 | ETF | | KSMF80 |
| KSM ETF S&P 500 Currency Hedged | ETF | | KSMF82 |
| KSM ETF Short Leveraged S&P 500 x3 Monthly | ETF | | KSMF114 |
| Listed Index Fund US Eq S&P500 Ccy Hdg | ETF | TOKYO STOCK EXCHANGE | 2521 |
| Listed Index Fund US Equity (S&P500) | ETF | TOKYO STOCK EXCHANGE | 1547 |
| Lyxor PEA S&P 500 ETF Capi | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | PSP5 |
| Lyxor PEA S&P 500 ETF Couverte en EUR C | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | PSPH |
| Lyxor S&P 500 ETF C EUR | ETF | EURONEXT - EURONEXT PARIS | SP5C |
| Lyxor S&P 500 ETF D EUR | ETF | XETRA | LYPS |
| Lyxor S&P 500 ETF D USD | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | LSPU |
| Lyxor S&P 500 ETF Daily Hdg to GBP Dist | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | SP5G |
| Lyxor S&P 500 ETF Daily Hedged C CHF | ETF | SIX SWISS EXCHANGE | LYSPH |
| Lyxor S&P 500 ETF Daily Hedged C EUR | ETF | XFMQ--Unlisted | N/A |

AS OF FEBRUARY 26, 2021

FOR USE WITH INSTITUTIONS ONLY, NOT FOR USE WITH RETAIL INVESTORS.

www.spglobal.com/spdji | index_services@spglobal.com

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

| PRODUCT NAME | PRODUCT TYPE | EXCHANGE | TICKER |
|---|--------------|-------------------------------|---------|
| | | Fund Manager Quote | |
| Lyxor S&P 500 ETF Daily Hedged D EUR | ETF | BORSA ITALIANA S.P.A. | SPXH |
| MAXIS S&P500 US Equity ETF | ETF | TOKYO STOCK EXCHANGE | 2558 |
| MAXIS S&P500 US Equity ETF (JPY Hedged) | ETF | Tokyo Stock Exchange | 2630 |
| More Sal S&P 500 | ETF | | MORES1 |
| More Sal S&P 500 Currency Hedged | ETF | | MORES2 |
| MTF SAL(4A) S&P 500 | ETF | | MTFF23 |
| MTF SAL(4A) S&P 500 - Hedged | ETF | | MTFF52 |
| ProShares Short S&P500 | ETF | NYSE ARCA | SH |
| ProShares Ultra S&P500 | ETF | NYSE ARCA | SSO |
| ProShares UltraPro S&P500 | ETF | NYSE ARCA | UPRO |
| ProShares UltraPro Short S&P500 | ETF | NYSE ARCA | SPXU |
| ProShares UltraShort S&P500 | ETF | NYSE ARCA | SDS |
| Psagot ETF (4A) S&P 500 Currency-Hedged | ETF | | PSGF137 |
| Psagot ETF (4D) S&P 500 | ETF | | PSGF65 |
| Satrix S&P 500 ETF | ETF | JOHANNESBURG STOCK EXCHANGE | STX500 |
| Smartshares US 500 | ETF | NEW ZEALAND EXCHANGE LTD | USF |
| SPDR S&P 500 ETF EUR Acc H | ETF | XETRA | SPPE |
| SPDR® Portfolio S&P 500 ETF | ETF | NYSE ARCA | SPLG |
| SPDR® S&P 500 ETF | ETF | ASX - ALL MARKETS | SPY |
| SPDR® S&P 500 ETF | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | SPY5 |
| SPDR® S&P 500 ETF Trust | ETF | NYSE ARCA | SPY |
| Sygnia Itrix S&P 500 ETF | ETF | JOHANNESBURG STOCK EXCHANGE | SYG500 |
| Tachlit Sal Composite Global Equity Currency-Hedged Monthly | ETF | | TCHF105 |
| Tachlit Sal Composite INT. Equity Currency-Hedged Monthly | ETF | | TCHF40 |
| Tachlit Sal Composite Large Cap Developed Currency-Hedged Monthly | ETF | | TCHF48 |
| Tachlit Sal Composite US Equity Monthly | ETF | | TCHF134 |
| Tachlit Sal S&P 500 | ETF | | TCHF76 |
| Tachlit Sal S&P 500 Currency Hedged | ETF | | TCHF11 |
| TIGER S&P500 | ETF | KOREA EXCHANGE (STOCK MARKET) | 360750 |
| TIGER Synth-S&P500 Leverage(H) | ETF | KOREA EXCHANGE (STOCK MARKET) | 225040 |
| UBS ETF S&P 500 A CHF H Acc | ETF | SIX SWISS EXCHANGE | SP500S |
| UBS ETF S&P 500 A EUR H Acc | ETF | SIX SWISS EXCHANGE | SP500E |
| UBS ETF S&P 500 A EUR H Inc | ETF | XETRA | UEQ7 |
| UBS ETF S&P 500 A GBP H Inc | ETF | SIX SWISS EXCHANGE | SP500H |
| UBS ETF S&P 500 USD A dis | ETF | SIX SWISS EXCHANGE | SP5USY |
| UBS FS S&P 500 SF USD A acc | ETF | SIX SWISS EXCHANGE | S5USAS |
| Vanguard S&P 500 ETF | ETF | HONG KONG | 3140 |

AS OF FEBRUARY 26, 2021

FOR USE WITH INSTITUTIONS ONLY, NOT FOR USE WITH RETAIL INVESTORS.

www.spglobal.com/spdji

index_services@spglobal.com

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

| PRODUCT NAME | PRODUCT TYPE | EXCHANGE | TICKER |
|----------------------------------|--------------|-------------------------------|--------|
| | | EXCHANGES AND CLEARING LTD | |
| Vanguard S&P 500 ETF | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | VFV |
| Vanguard S&P 500 ETF | ETF | NYSE ARCA | VOO |
| Vanguard S&P 500 ETF CAD-H | ETF | TORONTO STOCK EXCHANGE | VSP |
| Vanguard S&P 500 ETF USD Acc | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | VUAA |
| Vanguard S&P 500 UCITS ETF | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | VUSD |
| Xtrackers S&P 500 ETF 1C - EUR H | ETF | XETRA | XDPE |
| Xtrackers S&P 500 ETF 1D - EUR H | ETF | XETRA | XDPD |
| Xtrackers S&P 500 ETF 2C - GBP H | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | XDPG |
| Xtrackers S&P 500 ETF 3C - CHF H | ETF | SIX SWISS EXCHANGE | XDPC |
| Xtrackers S&P 500 Swap ETF 1C | ETF | LONDON STOCK EXCHANGE | XSPU |
| Yuanta S&P 500 ETF | ETF | TAIWAN STOCK EXCHANGE | 00646 |

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

PERFORMANCE DISCLOSURE

Source: S&P Dow Jones Indices LLC.

The launch date of the S&P 500 was March 4, 1957.

S&P Dow Jones Indices defines various dates to assist our clients in providing transparency. The First Value Date is the first day for which there is a calculated value (either live or back-tested) for a given index. The Base Date is the date at which the index is set to a fixed value for calculation purposes. The Launch Date designates the date when the values of an index are first considered live: index values provided for any date or time period prior to the index's Launch Date are considered back-tested. S&P Dow Jones Indices defines the Launch Date as the date by which the values of an index are known to have been released to the public, for example via the company's public website or its data feed to external parties. For Dow Jones-branded indices introduced prior to May 31, 2013, the Launch Date (which prior to May 31, 2013, was termed "Date of introduction") is set at a date upon which no further changes were permitted to be made to the index methodology, but that may have been prior to the Index's public release date.

Please refer to the methodology for the Index for more details about the index, including the manner in which it is rebalanced, the timing of such rebalancing, criteria for additions and deletions, as well as all index calculations.

Information presented prior to an index's launch date is hypothetical back-tested performance, not actual performance, and is based on the index methodology in effect on the launch date applied retroactively. However, when creating back-tested history for periods of market anomalies or other periods that do not reflect the general current market environment, index methodology rules may be relaxed to capture a large enough universe of securities to simulate the target market the index is designed to measure or strategy the index is designed to capture. For example, market capitalization and liquidity thresholds may be reduced. Back-tested performance reflects application of an index methodology and selection of index constituents with the benefit of hindsight and knowledge of factors that may have positively affected its performance, cannot account for all financial risk that may affect results and may be considered to reflect survivor/look ahead bias. Actual returns may differ significantly from, and be lower than, back-tested returns. Past performance is not an indication or guarantee of future results.

Typically, when S&P DJI creates back-tested index data, S&P DJI uses actual historical constituent-level data (e.g., historical price, market capitalization, and corporate action data) in its calculations. As ESG investing is still in early stages of development, certain datapoints used to calculate S&P DJI's ESG indices may not be available for the entire desired period of back-tested history. The same data availability issue could be true for other indices as well. In cases when actual data is not available for all relevant historical periods, S&P DJI may employ a process of using "Backward Data Assumption" (or pulling back) of ESG data for the calculation of back-tested historical performance. "Backward Data Assumption" is a process that applies the earliest actual live data point available for an index constituent company to all prior history of index performance. For example, Backward Data Assumption inherently assumes that companies currently not involved in a specific business activity (also known as "product involvement") were never involved historically and similarly also assumes that companies currently involved in a specific business activity were involved historically too. The Backward Data Assumption allows the hypothetical back-test to be extended over more historical years than would be feasible using only actual data. For more information on "Backward Data Assumption", please see <https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/education/faq-spdji-esg-back-testing-backward-data-assumption-overview.pdf>. The methodology and factsheets of any index that employs backward assumption in the back-tested history will explicitly state so. The methodology will include an Appendix with a table setting forth the specific data points and relevant time period for which backward projected data was used.

Index returns shown do not represent the results of actual trading of investable assets/securities. S&P Dow Jones Indices maintains the index and calculates the index levels and performance shown or discussed but does not manage actual assets. Index returns do not reflect payment of any sales charges or fees an investor may pay to purchase the securities underlying the Index or investment funds that are intended to track the performance of the Index. The imposition of these fees and charges would cause actual and back-tested performance of the securities/fund to be lower than the Index performance shown. As a simple example, if an index returned 10% on a US \$100,000 investment for a 12-month period (or US \$10,000) and an actual asset-based fee of 1.5% was imposed at the end of the period on the investment plus accrued interest (or US \$1,650), the net return would be 8.35% (or US \$8,350) for the year. Over a three-year period, an annual 1.5% fee taken at year end with an assumed 10% return per year would result in a cumulative gross return of 33.10%, a total fee of US \$5,375, and a cumulative net return of 27.2% (or US \$27,200).

GENERAL DISCLAIMER

Copyright © 2021 S&P Dow Jones Indices LLC. All rights reserved. Redistribution or reproduction in whole or in part are prohibited without written permission. STANDARD & POOR'S and S&P 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 S&P Dow Jones Indices LLC. S&P Dow Jones Indices LLC, Dow Jones, S&P and their respective affiliates ("S&P Dow Jones Indices") and third party licensors makes no representation or warranty, express or implied, as to the ability of any index to accurately represent the asset class or market sector that it purports to represent and S&P Dow Jones Indices and its third party licensors shall have no liability for any errors, omissions, or interruptions of any index or the data included therein. Past performance of an index is not an indication or guarantee of future results. This document does not constitute an offer of any services. Except for certain custom index calculation services, all information provided by S&P Dow Jones Indices is general in nature and not tailored to the needs of any person, entity or group of persons. S&P Dow Jones Indices receives compensation in connection with licensing its indices to third parties and providing custom calculation services. It is not possible to invest directly in an index. Exposure to an asset class represented by an index may be available through investable instruments offered by third parties that are based on that index. S&P Dow Jones Indices does not sponsor, endorse, sell, promote or manage any investment fund or other investment product or vehicle that seeks to provide an investment return based on the performance of any Index. S&P Dow Jones Indices LLC is not an investment or tax advisor. S&P Dow Jones Indices makes no representation regarding the advisability of investing in any such investment fund or other investment product or vehicle. A tax advisor should be consulted to evaluate the impact of any tax-exempt securities on portfolios and the tax consequences of making any particular investment decision. Credit-related information and other analyses, including ratings, are generally provided by licensors and/or affiliates of S&P Dow Jones Indices. Any credit-related information and other related analyses and statements are opinions as of the date they are expressed and are not statements of fact. S&P Dow Jones Indices LLC is analytically separate and independent from any other analytical department. For more information on any of our indices please visit www.spglobal.com/spdji.

S&P Dow Jones Indices

A Division of **S&P Global**

Equity
S&P 500®

CONTACT US

spdji.com
index_services@spglobal.com

S&P Dow Jones Custom Indices
customindices@spglobal.com

New York
1 212 438 7354
1 877 325 5415

Mexico City
52 (55) 1037 5290

London
44 207 176 8888

Dubai
971 (0)4 371 7131

Mumbai
91-22-2272-5312

Beijing
86.10.6569.2770

Hong Kong
852 2532 8000

Tokyo
81 3 4550 8564

Sydney
61 2 9255 9802

โดยแหล่งข้อมูลอ้างอิงที่ผู้ลงทุนจะสามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับข้อมูลดัชนีหลักทรัพย์ดังกล่าวได้ที่

<https://www.spglobal.com/spdji/en/indices/equity/sp-500/#data>

<http://www.set.or.th/set/dwunderlying.do?language+th&country+TH>