

สรุปข้อมูลสำคัญของตราสารนี้เป็นส่วนหนึ่งของแบบแสดงรายการข้อมูลและหนังสือชี้ชวน
ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลโดยสรุปเกี่ยวกับลักษณะและความเสี่ยงที่สำคัญของตราสารที่เสนอขาย
ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในหนังสือชี้ชวนโดยละเอียดก่อนการตัดสินใจลงทุน

สรุปข้อมูลสำคัญของตราสาร (Factsheet)

ส่วนที่ 1 สารสำคัญของตราสาร	
ชื่อตราสาร :	ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในดัชนีราคา SET50 Index ออกโดย บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) ซื้อขายสุดท้ายเดือนธันวาคม 2565 ประเภทสิทธิในการซื้อ รุ่น D(SET5024C2212D) DERIVATIVE CALL WARRANTS ON SET50 INDEX ISSUED BY FINANSIA SYRUS SECURITIES PUBLIC COMPANY LIMITED LAST TRADING IN DECEMBER 2022 # D(SET5024C2212D)
ดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง	ดัชนีราคา SET50 index ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ผู้จัดทำดัชนี ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ข้อมูลดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง	ข้อมูลราคาดัชนี https://marketdata.set.or.th/mkt/sectorquotation.do?sector=SET50 ข้อมูลหุ้นองค์ประกอบในดัชนี https://marketdata.set.or.th/mkt/sectorquotation.do?sector=SET50
ลักษณะการเสนอขาย	Direct Listing
ประเภทใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	สิทธิในการซื้อ (Call Warrant) อายุ 91 วัน ใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ (แบบยุโรป)
ตัวคูณดัชนี	0.08333 บาท (THB) ต่อจุดดัชนี
ราคาใช้สิทธิ	1,050.00 จุด
ลักษณะการใช้สิทธิ	ได้รับชำระเงินตามส่วนต่างของดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง (Cash Settlement) เป็นไทยบาท
จำนวนหน่วยที่ได้รับอนุญาตให้ออกและเสนอขาย	: ครั้งนี้ 60,000,000 หน่วย : ทั้งหมด (รวมครั้งนี้) 60,000,000 หน่วย
วันที่ออกตราสาร (ครั้งแรก)	6 ตุลาคม 2565
วันซื้อขายสุดท้าย	29 ธันวาคม 2565
วันที่ครบกำหนดอายุ	4 มกราคม 2566
ดัชนีหลักทรัพย์ที่ใช้ชำระราคา	ราคาสำหรับการส่งมอบหรือใช้อ้างอิงเพื่อคำนวณส่วนต่างของราคาเพื่อใช้ในการชำระหนี้ในวันซื้อขายวันสุดท้าย (Final Settlement Price) ของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า SET50 Index Futures Index Futures Series ID S50Z22 ที่ประกาศโดยบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)
วิธีคำนวณเงินสดส่วนต่าง	มูลค่าเงินสดส่วนต่างของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ประเภทสิทธิในการซื้อ (Call Warrant) ต่อหนึ่งหน่วยจะเท่ากับ ค่าที่มากกว่าระหว่างศูนย์กับดัชนีที่ใช้ชำระราคาหักด้วยราคาใช้สิทธิคูณด้วยตัวคูณดัชนี
ค่าความผันผวนในอดีต (Historical Volatility)	11.0% (ข้อมูลย้อนหลัง 90 วัน คำนวณ ณ วันที่ 03/10/2565)
สูตรและปัจจัยที่ใช้ในการคำนวณราคา	เป็นไปตามแนวทางที่ชมรมวณิชยกรกำหนด http://www.asco.or.th/uploads/upfiles/files/Assumption_27_09_2018(2).pdf
ส่วนที่ 2 ข้อมูลผู้ออก	
ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)
ความน่าเชื่อถือของผู้ออก	อันดับเครดิต BBB+(tha) ผู้จัดอันดับความน่าเชื่อถือ บริษัท พีทซ์ เรตติ้งส์ (ประเทศไทย) จำกัด วันที่จัดอันดับ 13/01/2565
Website ของผู้ออก	www.fnsyrus.com
ส่วนที่ 3 ข้อมูลผู้ที่เกี่ยวข้อง	
ผู้ค้าประกันการชำระหนี้	-
ผู้ดูแลสภาพคล่อง	บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน)

การทำหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง (*)	: ผู้ดูแลสภาพคล่องจะทำการเสนอซื้อและเสนอขาย โดยมีช่วงห่างระหว่างราคาเสนอซื้อและเสนอขาย (spread) ไม่เกินกว่า 10 ช่วงการซื้อขาย : มีจำนวนเสนอซื้อและเสนอขาย (Volume) ไม่ต่ำกว่า 20000 หน่วย : ทำหน้าที่ไม่น้อยกว่า 80.0 % ของระยะเวลาซื้อขายตลาดหลักทรัพย์ฯ : ไม่ทำการเสนอซื้อเสนอขาย เมื่อ DW ต่ำกว่า 0.05 บาท * มีข้อยกเว้น ตามที่ระบุในส่วนที่ 2 ของข้อกำหนดด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกและผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
-------------------------------------	---

ส่วนที่ 4 ความเสี่ยงและลักษณะพิเศษของตราสาร

4.1 ความเสี่ยงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (DW)

ความเสี่ยงจากราคาและอายุจำกัดของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

การเปลี่ยนแปลงราคาของ DW ขึ้นกับปัจจัยหลายประการ เช่น ราคา หรือ ความผันผวนของหุ้นอ้างอิง/ดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง ความต้องการซื้อขายของผู้ลงทุนใน DW (demand/supply) ดังนั้น หากราคาของหุ้นอ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงมีความผันผวนมากขึ้น จะส่งผลให้ราคา DW มีความผันผวนสูงขึ้นตามไปด้วย

นอกจากนี้ DW เป็นตราสารที่มีอายุจำกัดและมีมูลค่าเวลา โดยหากอายุคงเหลือของ DW ลดลง จะส่งผล ให้อัตราการลดลงของมูลค่าเวลา (Time Decay) มีแนวโน้มเพิ่มขึ้น ดังนั้น DW ที่ใกล้วันครบกำหนดอายุ มูลค่าเวลาของ DW จะมีแนวโน้มลดลงอย่างรวดเร็ว ในกรณีที่ผู้ลงทุนถือ DW จนถึงวันครบกำหนดอายุ และ DW มีสถานะเป็น Out of The Money (OTM) ราคาของ DW จะมีมูลค่าเป็น 0 (ศูนย์)

ความเสี่ยงจาก Leverage

การลงทุนใน DW เป็นการลงทุนที่ผู้ลงทุนใช้เงินลงทุนจำนวนน้อยกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง (Leverage) เมื่อคำนวณเป็นผลตอบแทนจากเงินลงทุน ทำให้มีโอกาสจะได้รับผลตอบแทนหรือขาดทุนในอัตราที่สูงกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง หาก DW มีสถานะเป็น Out of The Money (OTM) ผู้ลงทุนมีโอกาสสูญเสียเงินลงทุนทั้งจำนวน

Effective gearing เป็นค่าที่แสดงอัตราการเปลี่ยนแปลงราคาของ DW เทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงราคาของหลักทรัพย์อ้างอิง โดย Effective Gearing จะแสดงค่าเป็นจำนวนเท่า เช่น ถ้า Effective Gearing เท่ากับ 4 เท่า หมายถึง เมื่อราคาของหลักทรัพย์อ้างอิงเปลี่ยนไป 1 % ราคาของ DW จะเปลี่ยนแปลงไปประมาณ 4 % ทำให้ผู้ลงทุนมีโอกาสได้ผลตอบแทน หรือขาดทุนในอัตราที่สูงกว่าการลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงโดยตรง

ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ในกรณีที่ผู้ออก DW ไม่สามารถชำระเงินสดส่วนต่างจากการใช้สิทธิ หรือไม่ปฏิบัติตามสัญญาหรือเงื่อนไขที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ การลงทุนใน DW มีความเสี่ยงที่จะไม่ได้รับการชำระเงินตามสัญญาหรือเงื่อนไขในข้อกำหนดสิทธิ ดังนั้น ผู้ลงทุนควรต้องพิจารณาเครดิตของผู้ออก DW ประกอบการลงทุนด้วย ทั้งนี้ ผู้ออกหลักทรัพย์อ้างอิง ไม่มีส่วนในการรับผิดชอบใด ๆ ด้วย

ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

ผู้ลงทุนควรพิจารณาสภาพคล่องของ DW แต่ละรุ่น ก่อนซื้อขาย โดยสภาพคล่องของ DW ขึ้นอยู่กับอุปสงค์หรืออุปทานของผู้ลงทุนใน DW และความสามารถในการทำหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง ผู้ลงทุนควรศึกษารายละเอียดการปฏิบัติหน้าที่และการยกเว้นการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องตามที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ และในกรณีที่ DW มีหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นหุ้น/ดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศ ผู้ดูแลสภาพคล่องอาจมีข้อจำกัดในการดูแลสภาพคล่องในช่วงที่หลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงไม่มีการซื้อขาย

4.2 ลักษณะพิเศษของ DW

ภาระภาษีในการลงทุน DW

กำไร/ขาดทุนจากการขาย DW ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย จะมีภาระภาษีเหมือนกับการซื้อขายหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยบุคคลธรรมดาจะได้รับการยกเว้นภาษีเงินได้สำหรับกำไรที่ได้ จากการซื้อขาย อย่างไรก็ดี หากผู้ลงทุนถือ DW จนถึงวันครบกำหนดอายุ และได้รับเงินสดส่วนต่างจากการใช้สิทธิ ผู้ลงทุนมีภาระภาษีที่เกี่ยวข้อง โดยต้องนำเงินสดส่วนต่างที่ได้รับจากการใช้สิทธิไปรวมคำนวณเป็นรายได้เพื่อเสียภาษีประจำปี

ขาดสิทธิในการออกเสียง

ผู้ลงทุนไม่มีสิทธิออกเสียงในหลักทรัพย์อ้างอิงไทยและหลักทรัพย์อ้างอิงต่างประเทศได้

ลักษณะพิเศษเฉพาะรุ่น (ถ้ามี)

ทั้งนี้ ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลในข้อกำหนดสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกและผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์