

ข้อกำหนดด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์"  
- กรณีการใช้ดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศอ้างอิง ("ข้อกำหนดสิทธิ")

ส่วนที่ 1 สารสำคัญของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

|                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์                               | :บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด<br>สำนักงานตั้งอยู่ที่ 87/2 ชั้น 28 อาคาร ซีอาร์ซี ทาวเวอร์ ออลซีชั้นเพลส ถ.วิทยุ<br>แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพมหานคร 10330                                                                                                                                                                                                                   |
| การจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ | :บริษัทยังไม่เคยได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือจากสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือใดๆ ทั้งนี้ บริษัทได้รับการค้ำประกันการชำระหนี้จากผู้ค้ำประกันการชำระหนี้ ตามรายละเอียดในข้อกำหนดสิทธินี้                                                                                                                                                                                                    |
| ชื่อของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์                              | :ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในดัชนีราคา Hang Seng Index ออกโดยบริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด ชื่อขายสุดท้ายเดือนเมษายน 2566 ประเภทสิทธิในการขาย รุ่น C<br>ชื่อย่อ HSI28P2304C (รวมถึงใบสำคัญแสดงสิทธิส่วนเพิ่ม (หากมี))<br>("ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์")                                                                                                                              |
| ลักษณะการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์                     | :เสนอขายผ่านระบบการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ (Direct Listing)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| ลักษณะการใช้สิทธิ                                            | :ได้รับชำระเงินตามส่วนต่างตามดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง (Cash Settlement)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| รูปแบบการใช้สิทธิ                                            | :แบบยุโรป                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| การฝากทรัพย์สินเป็นประกัน                                    | :ไม่มี                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| ผู้ค้ำประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์           | :มี บริษัท แมคควอรี ไฟแนนเชียล โฮลดิ้งส์ พีทีวาย ลิมิเต็ด สำนักงานตั้งอยู่ที่ LEVEL 6, 50 MARTIN PLACE, SYDNEY, NSW 2000                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ค้ำประกันการชำระหนี้              | :A โดย FITCH RATINGS INC                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| ประเภทของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์                            | :ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง<br>ประเภท สิทธิในการขาย (Put Warrant)                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| จำนวนที่เสนอขาย                                              | :150,000,000 หน่วย                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| มูลค่าที่ตราไว้ของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์                   | :0.00 บาท                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| ราคาเสนอขายต่อหน่วย                                          | :บริษัทจะเสนอขายตามราคาใดที่เป็นไปตามกลไกการเสนอซื้อและเสนอขาย (bid/offer) ของระบบซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| มูลค่ารวมที่เสนอขาย                                          | :150,000,000.00 บาท<br>(มาจากจำนวนที่เสนอขายคูณด้วยราคา 1.00 บาท ซึ่งคำนวณจากสูตร Black & Scholes' Model โดยการใช้ราคาปิดของดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง ณ วันที่ 19 มกราคม 2566 และอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่ 19 มกราคม 2566)                                                                                                                                                                         |
| ตัวคูณดัชนี                                                  | :0.00026 ดอลลาร์ฮ่องกง (HKD) ต่อจุดดัชนี                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| สกุลเงินที่ใช้ชำระราคาเงินสดส่วนต่าง (Settlement Currency)   | :ไทยบาท (THB)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| สกุลเงินที่ใช้อ้างอิง (Reference Currency)                   | :ดอลลาร์ฮ่องกง (HKD)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| อัตราแลกเปลี่ยน                                              | :อัตราแลกเปลี่ยนที่สามารถแลกเปลี่ยนได้ตามปกติ (prevailing rate of exchange) ระหว่างดอลลาร์ฮ่องกง และไทยบาท (ซึ่งแสดงเป็นจำนวนหน่วยของสกุลเงินที่ใช้ชำระราคาต่อจำนวน 1 หน่วยของสกุลเงินที่ใช้อ้างอิง) ในวันใดวันหนึ่งภายในสาม (3) วันทำการของประเทศไทยก่อนวันครบกำหนดอายุตามอัตราแลกเปลี่ยนซึ่งกำหนดไว้โดยสถาบันการเงินที่เกี่ยวข้องหรือแหล่งอื่นใดตามที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์กำหนดไว้ |

|                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ราคาใช้สิทธิ                                         | :20,000.00 จุด                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์                       | :26 มกราคม 2566 (วันที่เริ่มการซื้อขายวันแรกในตลาดหลักทรัพย์ฯ)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| วันทำการซื้อขายสุดท้าย                               | :27 เมษายน 2566                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| วันครบกำหนดอายุ                                      | :3 พฤษภาคม 2566                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| วันทำการของประเทศไทย                                 | :หมายถึงวันที่ธนาคารพาณิชย์ และตลาดหลักทรัพย์ฯ เปิดทำการตามปกติในกรุงเทพมหานคร ซึ่งไม่ใช่วันเสาร์ หรือวันอาทิตย์ หรือวันอื่นใดที่ธนาคารแห่งประเทศไทยประกาศให้เป็นวันหยุดของธนาคารพาณิชย์                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| วันทำการของตลาดหลักทรัพย์ของดัชนีที่ใช้ชำระราคา      | :วันทำการของตลาดหลักทรัพย์ของดัชนีที่ใช้ชำระราคา ซึ่งเปิดให้ทำการซื้อขาย                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| วันเริ่มมีผลบังคับใช้ของข้อกำหนดสิทธิ                | :วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| วันสิ้นสุดการมีผลบังคับใช้ของข้อกำหนดสิทธิ           | :วันที่ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ชำระภาระผูกพันตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ทั้งหมดแล้ว                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| อายุของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์                      | :นับอายุตั้งแต่วันออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ จนถึงวันครบกำหนดอายุ                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| วันใช้สิทธิอัตโนมัติ                                 | :วันครบกำหนดอายุ                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| ระยะเวลาการใช้สิทธิ                                  | :การใช้สิทธิครั้งเดียว ณ วันครบกำหนดอายุ (แบบยุโรป)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| ดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง                               | :ดัชนี Hang Seng Index (HSI) ผู้จัดทำดัชนี Hang Seng Indexes Company Limited                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| ดัชนีที่ใช้ชำระราคา                                  | :ราคาสำหรับการส่งมอบหรือใช้อ้างอิงเพื่อคำนวณส่วนต่างของราคาเพื่อใช้ในการชำระหนี้ในวันซื้อขายวันสุดท้าย (Final Settlement Price) ของสัญญาซื้อขายล่วงหน้า HSI Index Futures Series ID HSI Futures April 2023 ที่ประกาศโดย ตลาดหลักทรัพย์ของดัชนีที่ใช้ชำระราคา                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| ตลาดหลักทรัพย์ของดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง              | :The Stock Exchange of Hong Kong Limited (ชื่อย่อ "HKEX")                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| ตลาดหลักทรัพย์ของดัชนีที่ใช้ชำระราคา                 | :Hong Kong Futures Exchange Limited                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| ข้อจำกัดการโอนใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์               | :ไม่มี                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| การจดทะเบียนใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในตลาดหลักทรัพย์ | :เป็นใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ประเภทเสนอขายผ่านระบบการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ (Direct Listing)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| ผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market Maker)                      | :มี บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอร์ แคปิตอล (สิงคโปร์) พีทีอี จำกัด สำนักงานตั้งอยู่ที่ 9 Straits View #21-07 Marina One, West Tower, Singapore 018937                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| ข้อกำหนดในการดูแลสภาพคล่อง                           | :มี<br>ในกรณีที่ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้รับการจดทะเบียนเป็นหลักทรัพย์ จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ ผู้ดูแลสภาพคล่องจะทำการเสนอซื้อและเสนอขาย โดยมีช่วงห่างระหว่างราคาเสนอซื้อและเสนอขายไม่เกิน 10 ช่วงการซื้อขายขั้นต่ำ มีจำนวนเสนอซื้อและเสนอขายขั้นต่ำเท่ากับ 20,000 หน่วย เป็นเวลาไม่น้อยกว่า ร้อยละ 80.0 ของเวลาเปิดทำการซื้อขายของทั้งตลาดหลักทรัพย์ของดัชนีที่ใช้ชำระราคา และตลาดหลักทรัพย์ฯ<br>โดยผู้ดูแลสภาพคล่องจะไม่ทำการเสนอซื้อเสนอขายเมื่อราคา ของ DW ต่ำกว่า 0.05 บาท หรือตามที่กำหนดไว้ในข้อ 10 ส่วนที่ 2 ของข้อกำหนดสิทธิฉบับนี้ |
| นายทะเบียน                                           | :บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด<br>สำนักงานตั้งอยู่ที่ อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย 93 ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพมหานคร 10400 โทรศัพท์ 0 2009 9000                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

|                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| การส่งมอบใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์                                                            | :ส่งมอบในระบบไร้ใบหลักทรัพย์ (Scripless)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| ค่าใช้จ่ายในการใช้สิทธิ                                                                      | :ไม่มี แต่ค่าใช้จ่ายในการใช้สิทธิในส่วนนี้ ไม่รวมถึง<br>ค่าใช้จ่ายอื่นใดที่นายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์<br>จะเรียกเก็บจากผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (ถ้ามี)                                                                                                                                                                                                                                      |
| วิธีการคำนวณเงินส่วนต่าง                                                                     | :ประเภทสิทธิในการขาย (Put DW)<br>กรณีราคาใช้สิทธิสูงกว่าดัชนีที่ใช้ชำระ ราคา:<br>เงินส่วนต่างมีมูลค่าเท่ากับ ส่วนต่างระหว่างราคาใช้สิทธิและดัชนีที่<br>ใช้ชำระราคาคูณด้วยตัวคูณดัชนีและคูณด้วย<br>อัตราแลกเปลี่ยนที่กำหนด<br><br>กรณีราคาใช้สิทธิเท่ากับหรือต่ำกว่าดัชนีที่ใช้ชำระราคา: เงินส่วน<br>ต่างมีมูลค่าเท่ากับ 0 บาท<br>เงินส่วนต่าง = Max [0, (ราคาใช้สิทธิ – ดัชนีที่ใช้ ชำระราคา) * ตัวคูณดัชนี *<br>อัตราแลกเปลี่ยน] |
| เงินส่วนต่างสุทธิ                                                                            | :เงินส่วนต่างตามจำนวนใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์<br>ที่ใช้สิทธิหลังจากหักค่าใช้จ่ายในการใช้สิทธิ                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| ภาษีที่เกี่ยวข้อง                                                                            | :ผู้ใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ มีภาระภาษี ที่เกิดขึ้นจากการใช้สิทธิ<br>โดยต้องนำเงินส่วนต่างตามจำนวนใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์<br>ที่ใช้สิทธิไปรวมเป็นเงินได้เพื่อยื่นเสียภาษีเงินได้ประจำปีของผู้ใช้สิทธิเอง                                                                                                                                                                                                              |
| อัตราดอกเบี้ยคิณฑ์                                                                           | :5.0% ต่อปี                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| กฎหมายที่ใช้บังคับกับข้อกำหนดสิทธิ                                                           | :กฎหมายไทย                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| อื่นๆ                                                                                        | :ไม่มี                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| การออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ส่วนเพิ่ม<br>(Further Issue)                                   | :อาจมีการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ส่วนเพิ่มในอนาคต                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| การออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์<br>ในครั้งนี้เป็น การออกใบสำคัญแสดงสิทธิ<br>อนุพันธ์ส่วนเพิ่ม | :ไม่ใช่                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| ลักษณะการเสนอขายใบสำคัญ<br>แสดงสิทธิอนุพันธ์ส่วนเพิ่ม                                        | :เสนอขายผ่านระบบการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ (Direct Listing)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

บริษัทหลักทรัพย์ แมคควอรี (ประเทศไทย) จำกัด

ลงชื่อ .....

นายณพดล ดวงทิพย์เนตร  
กรรมการ

ลงชื่อ .....

นางเบญจวรรณ พูลสวัสดิ์ แวนไดน์  
กรรมการ

## **Disclaimer ของ ดัชนีราคา Hang Seng Index**

The Hang Seng Index (the “Index(es)”) is/are published and compiled by Hang Seng Indexes Company Limited pursuant to a licence from Hang Seng Data Services Limited. The mark(s) and name(s) “Hang Seng Index” are proprietary to Hang Seng Data Services Limited. Hang Seng Indexes Company Limited and Hang Seng Data Services Limited have agreed to the use of, and reference to, the Index(es) by the Issuer in connection with the DW (the “Product”), but neither Hang Seng Indexes Company Limited nor Hang Seng Data Services Limited warrants or represents or guarantees to any broker or holder of the product or any other person (i) the accuracy or completeness of any of the index(es) and its computation or any information related thereto; or (ii) the fitness or suitability for any purpose of any of the index(es) or any component or data comprised in it; or (iii) the results which may be obtained by any person from the use of any of the index(es) or any component or data comprised in it for any purpose, and no warranty or representation or guarantee of any kind whatsoever relating to any of the index(es) is given or may be implied. The process and basis of computation and compilation of any of the Index(es) and any of the related formula or formulae, constituent stocks and factors may at any time be changed or altered by Hang Seng Indexes Company Limited without notice. to the extent permitted by applicable law, no responsibility or liability is accepted by Hang Seng Indexes Company Limited or Hang Seng Data Services Limited (i) in respect of the use of and/or reference to any of the index(es) by the issuer in connection with the product; or (ii) for any inaccuracies, omissions, mistakes or errors of Hang Seng Indexes Company Limited in the computation of any of the index(es); or (iii) for any inaccuracies, omissions, mistakes, errors or incompleteness of any information used in connection with the computation of any of the index(es) which is supplied by any other person; or (iv) for any economic or other loss which may be directly or indirectly sustained by any broker or holder of the product or any other person dealing with the product as a result of any of the aforesaid, and no claims, actions or legal proceedings may be brought against Hang Seng Indexes Company Limited and/or Hang Seng Data Services Limited in connection with the Product in any manner whatsoever by any broker, holder or other person dealing with the Product. Any broker, holder or other person dealing with the Product does so therefore in full knowledge of this disclaimer and can place no reliance whatsoever on Hang Seng Indexes Company Limited and Hang Seng Data Services Limited. For the avoidance of doubt, this disclaimer does not create any contractual or quasi-contractual relationship between any broker, holder or other person and Hang Seng Indexes Company Limited and/or Hang Seng Data Services Limited and must not be construed to have created such relationship.

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

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ("ตลาดหลักทรัพย์ฯ") ไม่ได้รับรอง สนับสนุน ส่งเสริมการขาย หรือมีส่วนเกี่ยวข้องกับใดๆ กับการออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นี้ และตลาดหลักทรัพย์ฯ ไม่ให้คำรับรองหรือคำรับประกันถึงความถูกต้องสมบูรณ์ของดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศที่เป็นสินทรัพย์อ้างอิงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นี้ ตลอดจนความครบถ้วน ถูกต้องเหมาะสม ความเป็นปัจจุบัน หรือความน่าเชื่อถือของเนื้อหาและข้อมูลในข้อกำหนดสิทธินี้แต่อย่างใด ผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ฯ ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ฯ และ/หรือบุคคลอื่นใดที่เกี่ยวข้องกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ฯ รับทราบว่า ตลาดหลักทรัพย์ฯ ไม่เป็นผู้รับประกันการปฏิบัติตามภาระผูกพันตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธินี้ รวมทั้งตลาดหลักทรัพย์ฯ ไม่มีส่วนเกี่ยวข้องตลอดจนไม่มีหน้าที่หรือความรับผิดชอบใดๆ ต่อความเสียหายที่เกิดขึ้นต่อบุคคลใดไม่ว่าในกรณีใดๆ จากการใช้ดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศ ดังกล่าว