

Factsheet



บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (listed): ☒ เป็น ☐ ไม่เป็น
 เสนอขายหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ชนิดระบุชื่อผู้ถือ ไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน ไม่มีการแปลงสภาพ และไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นที่มี
 อนุพันธ์แฝง ประเภท Bull Equity Linked Note
 ระหว่างวันที่ 21 เมษายน 2568 ถึง 10 เมษายน 2570

ลักษณะตราสาร

อายุ	[●] วัน*
อัตราดอกเบี้ย	ไม่มี เป็นอัตราคิดลดเทียบเท่า ดอกเบี้ยคงที่ [●]% ต่อปี / มี คงที่ [●]% ต่อปี*
งวดการชำระดอกเบี้ย	ไม่มี/ [●]*
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี (เว้นแต่เป็นกรณีเฉพาะที่ ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติม เกี่ยวกับราคาของหุ้นที่มี อนุพันธ์แฝง)*
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท*
มูลค่าที่ตราไว้ต่อหน่วย	[●] บาท*
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้น (ถ้ามี)	ไม่มี
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	วัตถุประสงค์ที่จะนำเงินที่ได้ จากการเสนอขายหุ้นที่มี อนุพันธ์แฝงไปใช้เพื่อการ บริหารสภาพคล่องในการ ดำเนินงานทั่วไปของบริษัท และนำไปใช้ในการป้องกัน ความเสี่ยง
ปัจจัยอ้างอิง	[หุ้นสามัญ (ไทย/ ต่างประเทศ) ของ [●] / ดัชนี หลักทรัพย์ (ไทย/ ต่างประเทศ) [●] / หน่วย ลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] โดย [●]]*
รูปแบบการไถ่ถอน	ชำระคืนด้วยเงินสด และ/หรือ ส่งมอบเป็นหลักทรัพย์

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นที่มี อนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร

ระดับ AA (tha) แนวโน้ม คงที่ (Stable)
 เมื่อวันที่ 14 พฤษภาคม 2567 โดยบริษัท ฟิทช์ เรตติ้ง
 (ประเทศไทย) จำกัด

*ทั้งนี้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดให้มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงโดยสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ด. อย่างต่อเนื่องตลอดอายุ ของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสาร อันดับความน่าเชื่อถือ และการคุ้มครองเงินต้น)



การชำระคืนเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

หมายเหตุ : มีระดับความเสี่ยง 5 หรือ 6 ขึ้นอยู่กับการ คุ้มครองเงินต้นตามที่ระบุในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับ ราคาของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

1. ไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ หรือกรณีก่อหนี้ได้ไม่จำกัด (No Debt Limit Restriction) บริษัทไม่มีข้อจำกัดการ ก่อหนี้ ภายใต้ข้อตกลงใด ๆ ที่บริษัทมีอยู่กับเจ้าหนี้ หรือ คู่สัญญาใด ๆ ดังนั้น บริษัทจึงอาจก่อหนี้เพิ่มได้หากอัตรา ดอกเบี้ยตลาดเอื้ออำนวย ซึ่งจะส่งผลให้บริษัทมีภาระหนี้ เพิ่มขึ้นและอาจส่งผลกระทบต่อความสามารถในการชำระ หนี้

2. ความเสี่ยงด้านเครดิต (Credit Risk) ผู้ถือหุ้นที่มี อนุพันธ์แฝงอาจไม่สามารถชำระคืนเงินต้นหรือผลตอบแทน หรือไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงได้ครบถ้วนตาม ข้อตกลงหรือตรงตามเวลาที่กำหนด รวมถึงการที่ผู้ถือหุ้น หุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่สามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ใน ข้อกำหนดสิทธิหรือข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่ เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถพิจารณา ความเสี่ยงด้าน เครดิตของบริษัทในฐานะผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงได้จาก ผลการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ(credit rating)

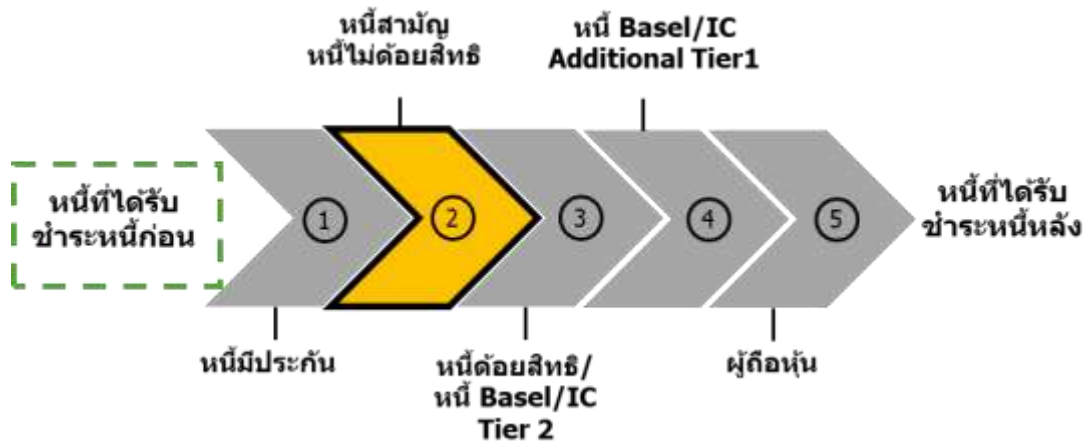
(สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับความเสี่ยงได้ที่ ส่วนที่ 1 ข้อมูลผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง หัวข้อที่ 11 ปัจจัยความเสี่ยงของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง)

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	วันที่ [●] *	อัตราผลตอบแทนสูงสุด	[●]% ต่อปี (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
วันที่ครบกำหนดอายุ	วันที่ [●] *		
วันกำหนดค่าหลักทรัพย์	วันที่ [●] *	อัตราผลตอบแทนต่ำสุด	ขาดทุนไม่เกิน 100% ต่ออายุของตราสาร ขึ้นอยู่กับปัจจัยอ้างอิงที่เกี่ยวข้อง ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า และอายุตราสาร (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)		
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้า	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หรือผู้ที่ได้รับแต่งตั้งโดยชอบให้ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแทน	การคุ้มครองเงินต้น	[มี [●]% ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด] / [ไม่มี]*
นายทะเบียนหุ้นกู้	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)		

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

ลำดับการได้รับชำระหนี้



ลักษณะพิเศษ และความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

การจ่ายเงินต้น และการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

1. กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดไว้ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 2. กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) น้อยกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)
 - 2.1 กรณีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นของหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยหากจำนวนหุ้นของหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบจำนวนดังกล่าวมีหน่วยย่อย (Odd Lot) ที่กำหนดโดยตลาดหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะตัดจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) ดังกล่าวนั้นออก และจะชำระเป็นเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement) ดังกล่าวนั้น ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 - 2.2 กรณีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระเป็นเงิน

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวน ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด ลบด้วย $\{[(\text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)} - \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price)})] \times \text{จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด} \times \text{อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)}\}$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 3. กรณีที่มีการคุ้มครองเงินต้น เมื่อราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) น้อยกว่า ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Protected Price)
 - 3.1 ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้นของหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยหากหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบจำนวนดังกล่าวมีหน่วยย่อย (Odd Lot) ที่กำหนดโดยตลาดหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะตัดจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) ดังกล่าวนั้นออก และจะชำระเป็นเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement) ดังกล่าวนั้น และเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น เป็นจำนวนเงินเท่ากับ $\{[(\text{ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Protected Price)} - \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price)})] \times \text{จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด} \times \text{อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)}\}$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 - 3.2 กรณีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระเป็นเงิน

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวน ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด ลบด้วย $\{[(\text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)} - \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price)})] \times \text{จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด} \times \text{อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)}\}$ และเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น เป็นจำนวนเงินเท่ากับ $\{[(\text{ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Protected Price)} - \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price)})] \times \text{จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด} \times \text{อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)}\}$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- โดยให้ "ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย" (Final Underlying Price) หมายถึง ราคาหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดราคา และเวลากำหนดราคา

หากปัจจัยอ้างอิงเป็นดัชนี: ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) หมายถึง ระดับดัชนีอ้างอิงสุดท้าย (Final Index Level)/ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) หมายถึง ดัชนีที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Strike Index Level)/ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) หมายถึง ดัชนีอ้างอิง (Spot Index Level)/จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Underlying Amount) หมายถึง จำนวนดัชนีอ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Index Amount)

ทั้งนี้รายละเอียดให้เป็นไปตามข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Pricing Supplement)

ตัวอย่างการคำนวณ

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้น AAA
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	100.00 บาท
ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	95.00 บาท (95.00% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง)
ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (ถ้ามี) (Protected Price)	80.00 บาท (80.00% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง)
อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)	1.0000
มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price)	990,000 บาท (99.00% ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด (หุ้น)	10,526.32 หุ้น [มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด หาร (ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย คุณ อัตราแลกเปลี่ยน)]
จำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) (หุ้น)	26.32 หุ้น
จำนวนเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement)	1,973.68 บาท [จำนวนหน่วยย่อย คุณ ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย คุณ อัตราแลกเปลี่ยน]
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่เพื่อการส่งมอบ (หุ้น)	10,500 หุ้น
อายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	30 วัน

- กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 98.00 บาท ซึ่งมากกว่าหรือเท่ากับ 95.00 บาท (Strike Price)
ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 1,000,000 บาท (มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราค่าไถ่ 1.01% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราค่าไถ่ 12.29% ต่อปี
 - กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 90.00 บาท ซึ่งน้อยกว่า 95.00 บาท (Strike Price)
 - กรณีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง
ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้น AAA จำนวน 10,500 หุ้น ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และจะชำระเป็นเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement) เป็นจำนวน 2,368.42 บาท $[90.00 \times 26.32 \times 1.00]$ ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราขาดทุน 4.31% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราขาดทุน 52.39% ต่อปี
 - กรณีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระเป็นเงิน
ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 923,913.00 บาท $\{1,000,000 - [(95.00 - 90.00) \times 10,526.32 \times 1.00]\}$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราขาดทุน 4.31% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราขาดทุน 52.39% ต่อปี
 - กรณีที่มีการคุ้มครองเงินต้น เมื่อราคาปัจจัยอ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 75.00 บาท ซึ่งน้อยกว่า 80.00 บาท (Protected Price)
 - กรณีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบปัจจัยอ้างอิง ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้น AAA จำนวน 10,500 หุ้น ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันที่ตกลงจะส่งมอบปัจจัยอ้างอิง และจะชำระเป็นเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement) เป็นจำนวน 1,973.68 บาท $(75.00 \times 26.32 \times 1.00)$ และจะชำระเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น เป็นจำนวนเท่ากับ 52,631.58 บาท $[(80.00 - 75.00) \times 10,526.32 \times 1.00]$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราขาดทุน 14.94% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราขาดทุน 181.76% ต่อปี
 - กรณีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระเป็นเงิน ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 842,105.26 บาท $\{1,000,000 - [(95.00 - 75.00) \times 10,526.32 \times 1.00] + [(80.00 - 75.00) \times 10,526.32 \times 1.00]\}$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราขาดทุน 14.94% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราขาดทุน 181.76% ต่อปี
- ทั้งนี้การคำนวณยังไม่ได้รวมปัจจัยของค่าธรรมเนียม และภาษีที่เกี่ยวข้อง

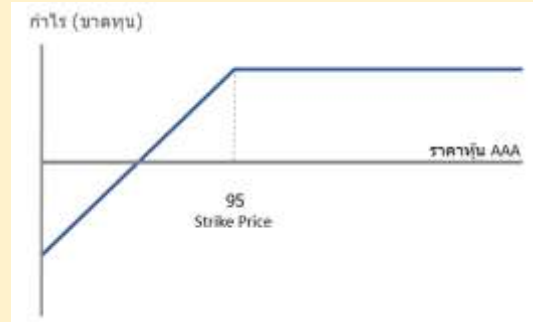
ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร (ต่อ)

ตัวอย่างกราฟแสดงผลตอบแทน

กรณีที่มีการคุ้มครองเงินต้น



กรณีที่ไม่มีการคุ้มครองเงินต้น



กรณีที่ผู้ออกหุ้นกู้มีพันธบัตรเป็นบุคคลภายในของบริษัทที่ออกหุ้นอ้างอิง : ☒ ไม่เป็น ☐ เป็น

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- การลงทุนในหุ้นกู้มีพันธบัตรไม่ใช่การฝากเงิน
- ผู้ลงทุนอาจต้องพร้อมถือหุ้นกู้มีพันธบัตรนี้จนครบกำหนด เนื่องจากการขายก่อนครบกำหนดอาจทำได้ยาก หรือขายได้ต่ำกว่ามูลค่าที่ตราไว้หรือราคาซื้อขาย
- อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีพันธบัตรมีใช้สิ่งชี้แนะการซื้อขาย และไม่ได้เป็นการรับประกันความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกตราสาร
- หุ้นกู้ที่มีพันธบัตรเป็นหุ้นกู้ที่มีลักษณะผสมระหว่างตราสารหนี้ และตราสารอนุพันธ์ (Derivatives) โดยการจ่ายผลตอบแทนและการชำระคืนเงินต้นทั้งหมดหรือบางส่วนที่อ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ ตามที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ ซึ่งจะมีความแตกต่างและมีความซับซ้อนจากหุ้นกู้ทั่วไป และมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีพันธบัตรนั้นไม่มีการคุ้มครองเงินต้นหรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีพันธบัตรอาจไม่มีตลาดรองที่ซื้อขายได้สะดวก ทำให้ผู้ที่ซื้อไปแล้วอาจไม่สามารถซื้อขายได้ ในเวลาที่ต้องการหรือในราคาที่เหมาะสม

คำเตือน และข้อมูลแจ้งเตือนอื่น**คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น****คำเตือน**

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือ รับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูล จากหนังสือชี้ชวน (filing)

ข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

- ประวัติการผิดนัดชำระหนี้ ☒ ไม่เคย ☐ เคย
- บริษัททำหน้าที่เป็นผู้ออก ตัวแทนค่านวณเงิน ผู้จัดการ ผู้จัดการจำหน่าย ผู้สนับสนุนหรือผู้รับประกันการจัดจำหน่ายปัจจัยอ้างอิงที่เป็นหลักทรัพย์ อาจมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์
- ประวัติการใช้จ่ายเงินผิดวัตถุประสงค์
☒ ไม่มี ☐ มี ประวัติการใช้จ่ายเงินผิดวัตถุประสงค์จากที่ได้แจ้งไว้ต่อสำนักงาน หรือที่เปิดเผยไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูล 3 ปีย้อนหลัง

Factsheet

บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (listed): ☒ เป็น ☐ ไม่เป็น

เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ชนิดระบุชื่อผู้ถือ ไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน ไม่มีการแปลงสภาพ และไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ประเภท Bear Equity Linked Note

ระหว่างวันที่ 21 เมษายน 2568 ถึง 10 เมษายน 2570



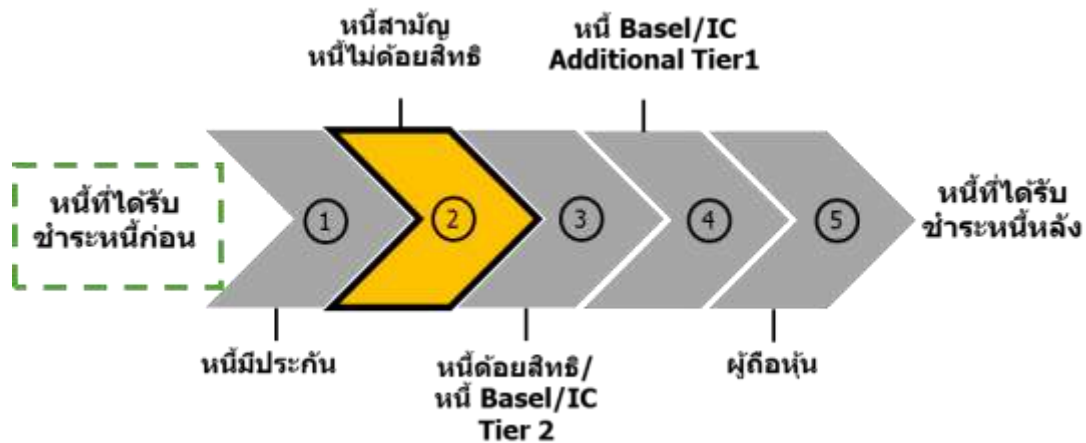
ลักษณะตราสาร		ระดับความเสี่ยง	
อายุ	[●] วัน*	(พิจารณาจากอายุตราสาร อันดับความน่าเชื่อถือ และการคุ้มครองเงินต้น)	
อัตราดอกเบี้ย	ไม่มี เป็นอัตราคิดลดเทียบเท่า ดอกเบี้ยคงที่ [●]% ต่อปี / มี คงที่ [●]% ต่อปี*	ต่ำ 1 2 3 4 5 6 7 8 สูง	
งวดการชำระดอกเบี้ย	ไม่มี/[●]*	การชำระคืนเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง	
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี (เว้นแต่เป็นกรณีเฉพาะที่ ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติม เกี่ยวกับ ราคาของหุ้นกู้ที่มี อนุพันธ์แฝง)	หมายเหตุ : มีระดับความเสี่ยง 5 หรือ 6 ขึ้นอยู่กับการ คุ้มครองเงินต้นตามที่ระบุในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับ ราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท*	ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)	
มูลค่าที่ตราไว้ต่อหน่วย	[●] บาท*		
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี		
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี		
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	วัตถุประสงค์ที่จะนำเงินที่ได้ จากการเสนอขายหุ้นกู้ที่มี อนุพันธ์แฝงไปใช้เพื่อการ บริหารสภาพคล่องในการ ดำเนินงานทั่วไปของบริษัท และ นำไปใช้ในการป้องกัน ความเสี่ยง		
ปัจจัยอ้างอิง	[หุ้นสามัญ (ไทย/ ต่างประเทศ) ของ [●] / ดัชนี หลักทรัพย์ (ไทย/ ต่างประเทศ) [●] / หน่วย ลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] โดย [●]]*	ไม่มีข้อมูล	
รูปแบบการไถ่ถอน	ชำระคืนด้วยเงินสด	ความเสี่ยงของผู้ถือ	
*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มี อนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง		1.ไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ หรือการก่อหนี้ได้ไม่จำกัด (No Debt Limit Restriction) บริษัทไม่มีข้อจำกัดการ ก่อหนี้ ภายใต้ข้อตกลงใด ๆ ที่บริษัทมีอยู่กับเจ้าหนี้ หรือ คู่สัญญาใด ๆ ดังนั้น บริษัทจึงอาจก่อหนี้เพิ่มได้หากอัตรา ดอกเบี้ยตลาดเอื้ออำนวย ซึ่งจะส่งผลให้บริษัทมีภาระหนี้ เพิ่มขึ้นและอาจส่งผลกระทบต่อความสามารถในการชำระ หนี้	
อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ถือตราสาร		2.ความเสี่ยงด้านเครดิต (Credit Risk) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มี อนุพันธ์แฝงอาจไม่สามารถชำระคืนเงินต้นหรือผลตอบแทน หรือไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงได้ครบถ้วนตาม ข้อตกลงหรือตรงตามเวลาที่กำหนด รวมถึงการที่ผู้ถือหุ้น กู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่สามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ใน ข้อกำหนดสิทธิหรือข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถพิจารณา ความเสี่ยงด้าน เครดิตของบริษัทในฐานะผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้จาก ผลการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ(credit rating)	
ระดับ AA (tha)	แนวโน้ม คงที่ (Stable)	(สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับความเสี่ยงได้ที่ ส่วนที่ 1 ข้อมูลผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หัวข้อที่ 11 ปัจจัยความเสี่ยงของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง)	
เมื่อวันที่ 14 พฤษภาคม 2567	โดยบริษัท ฟิทช์ เรตติ้ง (ประเทศไทย) จำกัด		
*ทั้งนี้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดให้มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ของผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ ที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ด. อย่างต่อเนื่องตลอดอายุ ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง			

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนสูงสุด	[●]% ต่อปี (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
วันที่ครบกำหนดอายุ	วันที่ [●]*		
วันกำหนดค่าหลักทรัพย์	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนต่ำสุด	ขาดทุนไม่เกิน 100% ต่ออายุของตราสารขึ้นอยู่กับปัจจัยอ้างอิงที่เกี่ยวข้อง
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)		ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้า	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หรือผู้ที่ได้รับแต่งตั้งโดยชอบให้ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแทน		อายุตราสาร และ ราคาเพื่อคำนวณคุ้มครองเงินต้น (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
นายทะเบียนหุ้นกู้	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	การคุ้มครองเงินต้น	[มี [●]% ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด] / [ไม่มี] *

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

ลำดับการได้รับชำระหนี้



ลักษณะพิเศษ และความสำคัญของตราสาร

การจ่ายเงินต้น และการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

- กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) น้อยกว่าหรือเท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)** ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) มากกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)** ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวนของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด ลบด้วย $\{[\text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price)} - \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)}] \times \text{จำนวนปัจจัยอ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด} \times \text{อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)}\}$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
- กรณีที่มีการคุ้มครองเงินต้น** เมื่อราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) มากกว่า ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Protected Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวนของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด ลบด้วย $\{[\text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price)} - \text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)}] \times \text{จำนวนปัจจัยอ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด} \times \text{อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)}\}$ และเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้นเป็นจำนวนเงินเท่ากับ $\{[\text{ราคาปัจจัยอ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price)} - \text{ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (Protected Price)}] \times \text{จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด} \times \text{อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)}\}$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หากปัจจัยอ้างอิงเป็นดัชนี: ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) หมายถึง ระดับดัชนีอ้างอิงสุดท้าย (Final Index Level)/ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) หมายถึง ดัชนีที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Strike Index Level)/ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) หมายถึง ดัชนีอ้างอิง (Spot Index Level) /จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Underlying Amount) หมายถึง จำนวนดัชนีอ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Index Amount)

ทั้งนี้รายละเอียดให้เป็นไปตามข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Pricing Supplement)

ตัวอย่างการคำนวณ

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้น AAA
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	100.00 บาท
ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)	105.00 บาท (105.00% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง)
ราคาเพื่อคำนวณเงินชดเชยคุ้มครองเงินต้น (ถ้ามี) (Protected Price)	120.00 บาท (120.00% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง)
อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)	1.0000
มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount)	1,000,000 บาท
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงทั้งหมด (หุ้น)	9,523.81 หุ้น [มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด หาร (ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย คูณ อัตราแลกเปลี่ยน)]
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price)	990,000 บาท (99.00% ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด)
อายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	30 วัน

ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร (ต่อ)

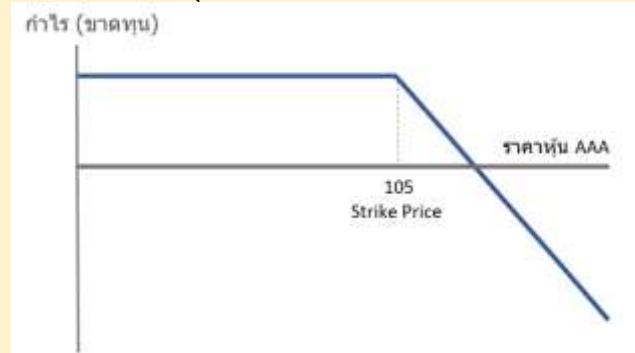
- กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 102.00 บาท ซึ่งน้อยกว่าหรือเท่ากับ 105.00 บาท (Strike Price)
ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 1,000,000 บาท (มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราค่าไถ่ 1.01% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราค่าไถ่ 12.29% ต่อปี
 - กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 110.00 บาท ซึ่งมากกว่า 105.00 บาท (Strike Price)
ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 952,380.95 บาท $\{1,000,000 - [(110.00 - 105.00) \times 9,523.81 \times 1.00]\}$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราขาดทุน 3.80% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราขาดทุน 46.23% ต่อปี
 - กรณีที่มีการคุ้มครองเงินต้น เมื่อราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 125.00 บาท ซึ่งมากกว่า 120.00 บาท (Protected Price)
ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 857,142.86 บาท $\{1,000,000 - [(125.00 - 105.00) \times 9,523.81 \times 1.00] + [(125.00 - 120.00) \times 9,523.81 \times 1.00]\}$ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง คิดเป็นอัตราขาดทุน 13.42% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราขาดทุน 163.287% ต่อปี
- ทั้งนี้การคำนวณยังไม่ได้รวมปัจจัยของค่าธรรมเนียม และภาษีที่เกี่ยวข้อง

ตัวอย่างกราฟแสดงผลตอบแทน

กรณีที่มีการคุ้มครองเงินต้น



กรณีที่ไม่มีการคุ้มครองเงินต้น



กรณีที่ผู้ออกหุ้นกู้มีอนุพันธ์เป็นบุคคลภายในของบริษัทที่ออกหุ้นอ้างอิง : ☒ ไม่เป็น ☐ เป็น

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- การลงทุนในหุ้นกู้มีอนุพันธ์แฝง ไม่ใช่การฝากเงิน
- ผู้ลงทุนอาจต้องพร้อมถือหุ้นกู้มีอนุพันธ์แฝงนี้จนครบกำหนด เนื่องจากการขายก่อนครบกำหนดอาจทำได้ยาก หรือขายได้ต่ำกว่ามูลค่าที่ตราไว้หรือราคาที่ซื้อ
- อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีใช้สิ่งชี้้นำการซื้อขาย และไม่ได้เป็นการรับประกันความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกตราสาร
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหุ้นกู้ที่มีลักษณะผสมระหว่างตราสารหนี้ และตราสารอนุพันธ์ (Derivatives) โดยการจ่ายผลตอบแทนและการชำระคืนเงินต้นทั้งหมดหรือบางส่วนที่อ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ ตามที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ ซึ่งจะมีความแตกต่างและมีความซับซ้อนจากหุ้นทั่วไป และมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจไม่มีตลาดรองที่ซื้อขายได้สะดวก ทำให้ผู้ที่ซื้อไปแล้วอาจไม่สามารถซื้อขายได้ ในเวลาที่ต้องการหรือในราคาที่เหมาะสม

คำเตือน และข้อมูลแจ้งเตือนอื่น**คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น****คำเตือน**

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ต. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือ รับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

- ประวัติการผิดนัดชำระหนี้ ☒ ไม่เคย ☐ เคย
- บริษัททำหน้าที่เป็นผู้ออก ตัวแทนค่านวณเงิน ผู้จัดการ ผู้จัดการจำหน่าย ผู้สนับสนุนหรือผู้รับประกันการจัดจำหน่ายปัจจัยอ้างอิงที่เป็นหลักทรัพย์ อาจมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์
- ประวัติการใช้เงินผิดวัตถุประสงค์
☒ ไม่มี ☐ มี ประวัติการใช้เงินผิดวัตถุประสงค์จากที่ได้แจ้งไว้ต่อสำนักงาน หรือที่เปิดเผยไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูล 3 ปีย้อนหลัง

Factsheet



บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (listed): ☒ เป็น ☐ ไม่เป็น
 เสนอขายหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ชนิดระบุชื่อผู้ถือ ไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน ไม่มีการแปลงสภาพ และไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นที่มี
 อนุพันธ์แฝง ประเภท Basket Knock-in Knock-out (KIKO)
 ระหว่างวันที่ 21 เมษายน 2568 ถึง 10 เมษายน 2570

ลักษณะตราสาร

อายุ	[●] วัน*
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ [●]% ต่อปี*
งวดการชำระดอกเบี้ย	[●]*
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี (เว้นแต่เป็นกรณีเฉพาะที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับ ราคาของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง)
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท*
มูลค่าที่ตราไว้ต่อหน่วย	[●] บาท*
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้น (ถ้ามี)	ไม่มี
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	วัตถุประสงค์ที่จะนำเงินที่ได้จากการเสนอขายหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไปใช้เพื่อการบริหารสภาพคล่องในการดำเนินงานทั่วไปของบริษัท และนำไปใช้ในการป้องกันความเสี่ยง
ปัจจัยอ้างอิง	ปัจจัยอ้างอิงในตะกร้า จำนวน 1 ปัจจัยขึ้นไป แต่ไม่เกิน 3 ปัจจัย ซึ่งประกอบด้วย 1 [หุ้นสามัญของ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] / ดัชนีหลักทรัพย์ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตาลี (ไทย/ต่างประเทศ) [●] โดย [●]] 2 [หุ้นสามัญของ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] / ดัชนีหลักทรัพย์ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตาลี (ไทย/ต่างประเทศ) [●] โดย [●]] 3 [หุ้นสามัญของ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] / ดัชนีหลักทรัพย์ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตาลี (ไทย/ต่างประเทศ) [●] โดย [●]]*
รูปแบบการไถ่ถอน	ชำระคืนด้วยเงินสด และ/หรือส่งมอบเป็นหลักทรัพย์

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

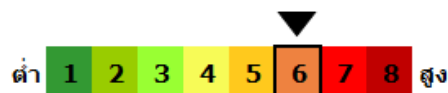
อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร

ระดับ AA (tha)	แนวโน้ม คงที่ (Stable)
เมื่อวันที่ 14 พฤษภาคม 2567	โดยบริษัท ฟิทช์ เรตติ้ง (ประเทศไทย) จำกัด

*ทั้งนี้ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดให้มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงโดยสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ด. อย่างต่อเนื่องตลอดอายุของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสาร อันดับความน่าเชื่อถือ และการคุ้มครองเงินต้น)



การชำระคืนเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

1. ไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ หรือกรณีก่อหนี้ได้ไม่จำกัด (No Debt Limit Restriction) บริษัทไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ ภายใต้ข้อตกลงใด ๆ ที่บริษัทมีอยู่กับเจ้าหนี้ หรือคู่สัญญาใด ๆ ดังนั้น บริษัทจึงอาจก่อหนี้เพิ่มเติมหากอัตราดอกเบี้ยตลาดเอื้ออำนวย ซึ่งจะส่งผลให้บริษัทมีภาระหนี้เพิ่มขึ้นและอาจส่งผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้

2. ความเสี่ยงด้านเครดิต (Credit Risk) ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงอาจไม่สามารถชำระคืนเงินต้นหรือผลตอบแทน หรือไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงได้ครบถ้วนตามข้อตกลงหรือตรงตามเวลาที่กำหนด รวมถึงการที่ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่สามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิหรือข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถพิจารณา ความเสี่ยงด้านเครดิตของบริษัทในฐานะผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงได้จากผลการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (credit rating)

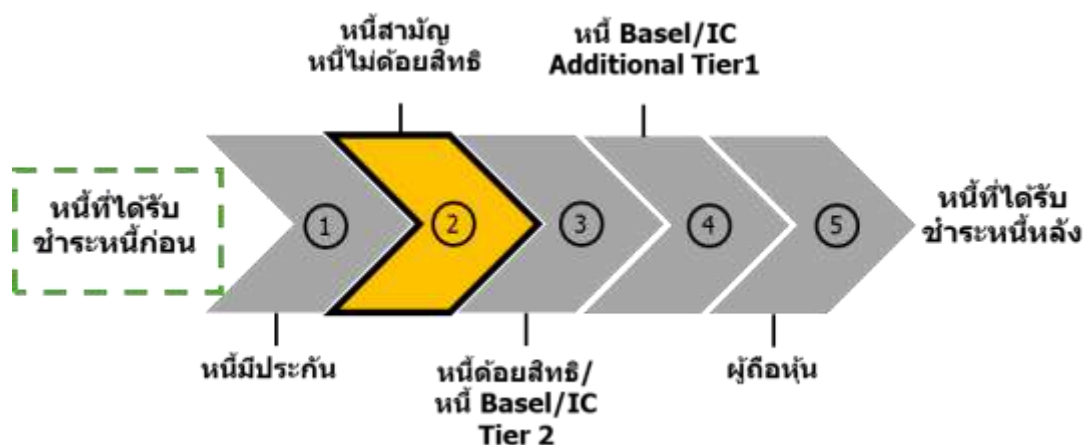
(สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับความเสี่ยงได้ที่ ส่วนที่ 1 ข้อมูลผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง หัวข้อที่ 11 ปัจจัยความเสี่ยงของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง)

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนสูงสุด	[●]% ต่อปี (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
วันที่ครบกำหนดอายุ	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนต่ำสุด	ขาดทุนไม่เกิน 100% ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับปัจจัยอ้างอิงที่เกี่ยวข้อง ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า และอายุตราสาร (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
วันกำหนดค่าหลักทรัพย์	วันที่ [●]*		
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)		
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้า	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หรือผู้ที่ได้รับแต่งตั้งโดยชอบให้ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแทน	การคุ้มครองเงินต้น	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)		

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

ลำดับการได้รับชำระหนี้



ลักษณะพิเศษ และความสำคัญของตราสาร

เงื่อนไขในการจ่ายเงินต้น และผลตอบแทน

1. การจ่ายค่าดอกเบี้ย

หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการไถ่ถอนก่อนกำหนด ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจ่ายดอกเบี้ยเป็นรายงวดตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตราไว้ที่ไม่มีเกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event) เกิดขึ้น ในวันสังเกตการณ์ในแต่ละงวด ทั้งนี้ ในกรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่ได้รับดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับวันกำหนดชำระดอกเบี้ยใด ๆ ภายหลังจากวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

2. การจ่ายเงินต้น และการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการไถ่ถอนก่อนกำหนด

2.1 กรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด และชำระค่าดอกเบี้ย สำหรับงวดดอกเบี้ยที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด

2.2 กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (No Knock-out Event) จนถึงวันกำหนดราคา

(1) กรณีที่ไม่มีเกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Knock-in Event)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด และ ค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(2) กรณีที่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event)

(2.1) กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของ Least Performing Underlying มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) ของ Least Performing Underlying

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด และค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(2.2) กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของ Least Performing Underlying น้อยกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) ของ Least Performing Underlying

(2.2.1) กรณีไถ่ถอนด้วยการส่งมอบเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะส่งมอบหุ้นของ Least Performing Underlying ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ตามจำนวน Least Performing Underlying Amount ที่ตกลงจะส่งมอบ และ ค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยหาก Least Performing Underlying Amount ดังกล่าวนั้นมีหน่วยย่อย (Odd Lot) ที่กำหนดโดยตลาดหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะตัดจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) ดังกล่าวนั้นออก และจะชำระเป็นเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement) ดังกล่าวนั้น ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(2.2.2) กรณีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระเป็นเงิน

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด ลบด้วย $[\text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) ของ Least Performing Underlying} - \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของ Least Performing Underlying}] \times \text{จำนวน Least Performing Underlying Amount} \times \text{อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate) ของ Least Performing Underlying}$ และ ค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

โดยให้ "ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย" (Final Underlying Price) หมายถึง ราคาต่อหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาด หลักทรัพย์ ณ วันกำหนดราคา และเวลากำหนดราคา

ลักษณะพิเศษ และความสำคัญสำคัญของตราสาร(ต่อ)

"Least Performing Underlying" หมายถึง หลักทรัพย์อ้างอิงและ/หรือดัชนีอ้างอิงในตะกร้า ให้คำร้อยละน้อยที่สุด โดยจะคำนวณจากสูตรดังนี้ [ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ลบด้วย ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)]หาร ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) คูณ 100 (หนึ่งร้อย)
หากปัจจัยอ้างอิงเป็นดัชนี: ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) หมายถึง ระดับดัชนีอ้างอิงสุดท้าย (Final Index Level)/ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) หมายถึง ดัชนีที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Strike Index Level)/ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) หมายถึง ดัชนีอ้างอิง (Spot Index Level)/จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Underlying Amount) หมายถึง จำนวนดัชนีอ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Index Amount)
ทั้งนี้รายละเอียดให้เป็นไปตามข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Pricing Supplement)

ตัวอย่างการคำนวณการจ่ายเงินต้น และผลตอบแทน

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้น AAA	หุ้น BBB	หุ้น CCC
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	100.00 บาท	120.00 บาท	140.00 บาท
ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) (90.00% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price))	90.00 บาท	108.00 บาท	126.00 บาท
ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Price) (102.00% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price))	102.00 บาท	122.40 บาท	142.80 บาท
ราคาเพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-in Price) (85.00% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price))	85.00 บาท	102.00 บาท	119.00 บาท
อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)	1.0000		
มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount)	1,000,000 บาท		
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price)	1,000,000 บาท (100.00% ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด)		
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด (หุ้น)	1. หุ้น AAA : 11,111.11หุ้น 2. หุ้น BBB : 9,259.26 หุ้น 3. หุ้น CCC : 7,936.51 หุ้น [มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด หาร (ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย คูณ อัตราแลกเปลี่ยน)]		
จำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) (หุ้น)	1. หุ้น AAA : 11.11 หุ้น 2. หุ้น BBB : 59.26 หุ้น 3. หุ้น CCC : 36.51 หุ้น		
จำนวนเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement)	จำนวนหน่วยย่อย คูณ ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย คูณ อัตราแลกเปลี่ยน		
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่เพื่อการส่งมอบ (หุ้น)	1. หุ้น AAA : 11,100 หุ้น 2. หุ้น BBB : 9,200 หุ้น 3. หุ้น CCC : 7,900 หุ้น		
อายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	180 วัน		
อัตราดอกเบี้ย	ร้อยละ 15.00 ต่อปี หรือ ร้อยละ 1.25 ต่องวด		
ค่าดอกเบี้ย	12,500 บาทต่องวด (1,000,000 x 1.25%) เป็นจำนวน 6 งวด รวม 75,000 บาท		

1. กรณีที่เกิด Knock-out Event คือกรณีที่ ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event Observation Date) หลักทรัพย์อ้างอิงในตะกร้าทุกตัวมีราคามากกว่า Knock-out Price เช่น ในวัน Knock-out Event Observation Date ของงวดที่ 1 หุ้น AAA มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 102.00 บาท (Knock-out Price) หุ้น BBB มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 122.40 บาท (Knock-out Price) และ หุ้น CCC มีค่ามากกว่าหรือเท่ากับ 142.80 บาท (Knock-out Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 1,000,000 บาท (มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด) และ ค่าดอกเบี้ย จำนวน 12,500 บาท สำหรับดอกเบี้ยงวดที่ 1 ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งผลตอบแทนทั้งหมดคิดเป็นอัตราค่าไถ่ 1.25% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราค่าไถ่ 15.00% ต่อปี
2. กรณีที่ไม่เกิด Knock-out Event คือกรณีที่ ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event Observation Date) ใด ๆ ไม่เกิด Knock-out Event ซึ่งสามารถแบ่งได้ 2 กรณีดังนี้

ลักษณะพิเศษ และความสำคัญสำคัญของตราสาร(ต่อ)

- (1) กรณีที่ไม่มีเกิด Knock-in Event คือกรณีที่ ณ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event Observation Date) ใด ๆ ไม่มีเกิด Knock-in Event ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 1,000,000 บาท (มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด) และ ค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย จำนวน 12,500 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งผลตอบแทนทั้งหมดรวมค่าดอกเบี้ย 6 งวด เป็นจำนวน 75,000 บาท คิดเป็นอัตราค่าไร 7.50% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือ 15.00% ต่อปี
- (2) กรณีที่เกิด Knock-in Event คือกรณีที่ ณ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event Observation Date) ใด ๆ เกิด Knock-in Event ที่ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงใด ๆ มีราคาต่ำกว่า Knock-in Price เช่น ราคาหุ้น AAA น้อยกว่า 85.00 บาท (Knock-in Price) ในวัน Knock-in Event Observation Date และ สมมติให้หุ้น AAA เป็น Least Performing Underlying

(2.1) กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA มากกว่าหรือเท่ากับ 90.00 บาท (Strike Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 1,000,000 บาท (มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด) และค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย จำนวน 12,500 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งผลตอบแทนทั้งหมดรวมค่าดอกเบี้ย 6 งวด เป็นจำนวน 75,000 บาท คิดเป็นอัตราค่าไร 7.50% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือ 15.00% ต่อปี

(2.2) กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 80.00 บาท ซึ่งน้อยกว่า 90.00 บาท (Strike Price)

(2.2.1) กรณีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้น AAA จำนวน 11,100 หุ้น ($1,000,000 / (90.00 \times 1.00) = 11,111.11$ หุ้น หักด้วย Odd Lot จำนวน 11.11 หุ้น) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ จะชำระเป็นเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement) เป็นจำนวน 888.89 บาท ($11.11 \times 80.00 \times 1.00$) และค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย จำนวน 12,500 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งผลตอบแทนทั้งหมดรวมค่าดอกเบี้ย 6 งวด เป็นจำนวน 75,000 บาท คิดเป็นอัตราขาดทุน 3.61% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือ 7.22% ต่อปี

(2.2.2) กรณีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระเป็นเงิน ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 888,888.89 บาท $\{1,000,000 - [(90.00 - 80.00) \times 11,111.11 \text{ (จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด)} \times 1.00]\}$ และชำระด้วยเงิน ค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย จำนวน 12,500 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งผลตอบแทนทั้งหมดรวมค่าดอกเบี้ย 6 งวด เป็นจำนวน 75,000 บาท คิดเป็นอัตราขาดทุน 3.61% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือ 7.22% ต่อปี

ทั้งนี้ตัวอย่างการคำนวณยังไม่ได้รวมปัจจัยของค่าธรรมเนียม และภาษีที่เกี่ยวข้อง

ตัวอย่างกราฟแสดงผลตอบแทน

กรณีที่ไม่มีเกิดเหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (No Knock-out Event) และ กรณีที่ไม่มีเกิดเหตุการณ์เปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Knock-in Event)

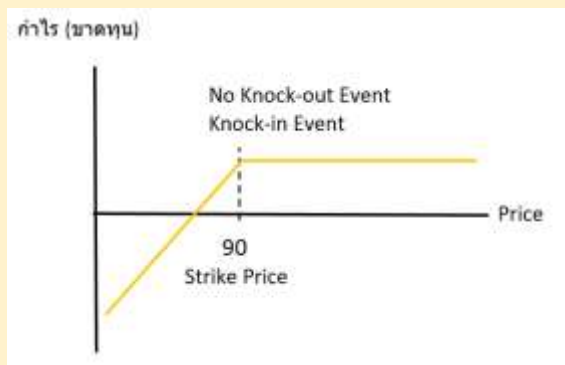


กรณีที่เกิดเหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event)



ลักษณะพิเศษ และความสำคัญของตราสาร(ต่อ)

กรณีที่ไม่มีเกิดเหตุการณ์ใดก่อนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (No Knock-out Event) และกรณีที่เกิดเหตุการณ์เปลี่ยนแปลงวิธีการใดก่อนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event) และ ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของ Least Performing Underlying น้อยกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) ของ Least Performing Underlying



กรณีที่ผู้ออกหุ้นกู้มีอนุพันธ์เป็นบุคคลภายในของบริษัทที่ออกหุ้นอ้างอิง : ☒ ไม่เป็น ☐ เป็น

ความสำคัญสำคัญของตราสาร

- การลงทุนในหุ้นกู้มีอนุพันธ์แฝง ไม่ใช่การฝากเงิน
- ผู้ลงทุนอาจต้องพร้อมถือหุ้นกู้มีอนุพันธ์แฝงนี้จนครบกำหนด เนื่องจากการขายก่อนครบกำหนดอาจทำได้ยาก หรือขายได้ต่ำกว่ามูลค่าที่ตราไว้หรือราคาซื้อขาย
- อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิใช่สิ่งชี้้นำการซื้อขาย และไม่ได้เป็นการรับประกันความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกตราสาร
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหุ้นกู้ที่มีลักษณะผสมระหว่างตราสารหนี้ และตราสารอนุพันธ์ (Derivatives) โดยการจ่ายผลตอบแทนและการชำระคืนเงินต้นทั้งหมดหรือบางส่วนที่อ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ ตามที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ ซึ่งจะมีความแตกต่างและมีความซับซ้อนจากหุ้นทั่วไป และมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นไม่มีการคุ้มครองเงินต้นหรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจไม่มีตลาดรองที่ซื้อขายได้สะดวก ทำให้ผู้ที่ซื้อไปแล้วอาจไม่สามารถซื้อขายได้ ในเวลาที่ต้องการหรือในราคาที่เหมาะสม

คำเตือน และข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือ รับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

- ประวัติการผิดนัดชำระหนี้ ☒ ไม่เคย ☐ เคย
- บริษัททำหน้าที่เป็นผู้ออก ตัวแทนคำนวณเงิน ผู้จัดการ ผู้จัดการจำหน่าย ผู้สนับสนุนหรือผู้รับประกันการจัดจำหน่ายปัจจัยอ้างอิงที่เป็นหลักทรัพย์ อาจมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์
- ประวัติการใช้เงินผิดวัตถุประสงค์
☒ ไม่มี ☐ มี ประวัติการใช้เงินผิดวัตถุประสงค์จากที่ได้แจ้งไว้ต่อสำนักงาน หรือที่เปิดเผยไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูล 3 ปีย้อนหลัง

Factsheet



บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (listed): ☒ เป็น ☐ ไม่เป็น
 เสนอขายหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ชนิดระบุชื่อผู้ถือ ไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน ไม่มีการแปลงสภาพ และไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นที่มี
 อนุพันธ์แฝง ประเภท Single Knock-in Knock-out (KIKO)
 ระหว่างวันที่ 21 เมษายน 2568 ถึง 10 เมษายน 2570

ลักษณะตราสาร

อายุ	[●] วัน*
อัตราดอกเบี้ย	คงที่ [●]% ต่อปี*
งวดการชำระดอกเบี้ย	[●]*
การไถ่ถอนก่อนกำหนด	ไม่มี (เว้นแต่เป็นกรณีเฉพาะที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับ ราคาของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง)
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท*
มูลค่าที่ตราไว้ต่อหน่วย	[●] บาท*
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้น	ไม่มี
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	วัตถุประสงค์ที่จะนำเงินที่ได้จากการเสนอขายหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไปใช้เพื่อการบริหารสภาพคล่องในการดำเนินงานทั่วไปของบริษัท และนำไปใช้ในการป้องกันความเสี่ยง [หุ้นสามัญของ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] / ดัชนีหลักทรัพย์ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] โดย [●]]*
ปัจจัยอ้างอิง	ชำระคืนด้วยเงินสด และ/หรือส่งมอบเป็นหลักทรัพย์
รูปแบบการไถ่ถอน	

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

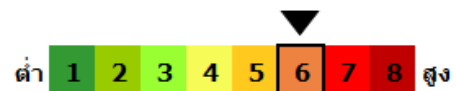
อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร

ระดับ AA (tha)	แนวโน้ม คงที่ (Stable)
เมื่อวันที่ 14 พฤษภาคม 2567	โดยบริษัท ฟิทช์ เรตติ้ง (ประเทศไทย) จำกัด

*ทั้งนี้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดให้มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงโดยสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการยอมรับจากสำนักงาน ก.ล.ด. อย่างต่อเนื่องตลอดอายุของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสาร อันดับความน่าเชื่อถือ และการคุ้มครองเงินต้น)



การชำระคืนเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

1. ไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ หรือกรณีก่อหนี้ได้ไม่จำกัด (No Debt Limit Restriction) บริษัทไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ ภายใต้ข้อตกลงใด ๆ ที่บริษัทมีอยู่กับเจ้าหนี้ หรือคู่สัญญาใด ๆ ดังนั้น บริษัทจึงอาจก่อหนี้เพิ่มเติมหากอัตราดอกเบี้ยตลาดเอื้ออำนวย ซึ่งจะส่งผลให้บริษัทมีภาระหนี้เพิ่มขึ้นและอาจส่งผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้

2. ความเสี่ยงด้านเครดิต (Credit Risk) ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงอาจไม่สามารถชำระคืนเงินต้นหรือผลตอบแทน หรือไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงได้ครบถ้วนตามข้อตกลงหรือตรงตามเวลาที่กำหนด รวมถึงการที่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่สามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิหรือข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถพิจารณาความเสี่ยงด้านเครดิตของบริษัทในฐานะผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงได้จากผลการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (credit rating)

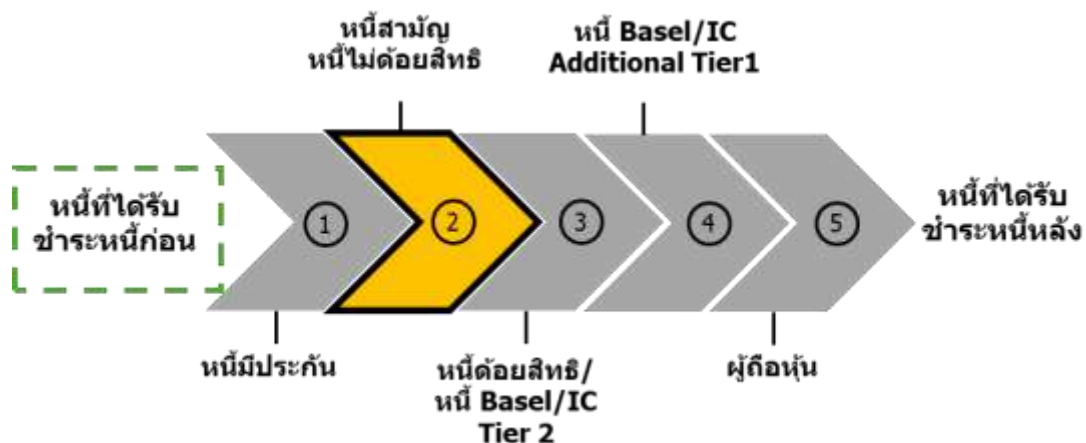
(สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับความเสี่ยงได้ที่ ส่วนที่ 1 ข้อมูลผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง หัวข้อที่ 11 ปัจจัยความเสี่ยงของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง)

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนสูงสุด	[●]% ต่อปี (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
วันที่ครบกำหนดอายุ	วันที่ [●]*		
วันกำหนดค่าหลักทรัพย์	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนต่ำสุด	ขาดทุนไม่เกิน 100% ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับปัจจัยอ้างอิงที่เกี่ยวข้อง ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า และอายุตราสาร(*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)		
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้า	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หรือผู้ที่ได้รับแต่งตั้งโดยชอบให้ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแทน	การคุ้มครองเงินต้น	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)		

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

ลำดับการได้รับชำระหนี้



ลักษณะพิเศษ และความสำคัญสำคัญของตราสาร

เงื่อนไขในการจ่ายเงินต้น และผลตอบแทน

1.การจ่ายค่าดอกเบี้ย

หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการไถ่ถอนก่อนกำหนด ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจ่ายดอกเบี้ยเป็นรายงวดตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตราใบที่ไม่มีเกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event) เกิดขึ้นในวันสังเกตการณ์ในแต่ละงวด หากมีเหตุการณ์ Knock-out Event เกิดขึ้นในวันสังเกตการณ์ใดๆ ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีสิทธิในการรับดอกเบี้ยที่เกิดขึ้นในงวดนั้นแต่จะยังไม่ได้รับชำระจนถึงวันชำระดอกเบี้ยที่สอดคล้องกับวันสังเกตเหตุการณ์ดังกล่าว และจะไม่มีสิทธิรับดอกเบี้ยในงวดใดๆ เพิ่มเติมอีกต่อไป

2.การจ่ายเงินต้น และการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการไถ่ถอนก่อนกำหนด

- 2.1 กรณีที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด และชำระค่าดอกเบี้ย สำหรับงวดดอกเบี้ยที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด
- 2.2 กรณีที่ไม่มีเกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (No Knock-out Event)
 - (1) กรณีที่ไม่มีเกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Knock-in Event)
ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด และ ค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 - (2) กรณีที่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event)
 - (2.1) กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด และค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 - (2.2) กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) น้อยกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)
 - (2.2.1) กรณีไถ่ถอนด้วยการส่งมอบเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะส่งมอบหุ้นของหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ และ ค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยหากหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบจำนวนดังกล่าวมีหน่วยย่อย (Odd Lot) ที่กำหนดโดยตลาดหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะตัดจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) ดังกล่าวนั้นออก และจะชำระเป็นเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement) ดังกล่าวนั้น ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
 - (2.2.2) กรณีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระเป็นเงิน
ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด ลบด้วย $[(\text{ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)} - \text{ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price)}) \times \text{จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ} \times \text{อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)}]$ และ ค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

โดยให้ "ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย" (Final Underlying Price) หมายถึง ราคาต่อหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันกำหนดราคา และเวลากำหนดราคา

หากปัจจัยอ้างอิงเป็นดัชนี: ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) หมายถึง ระดับดัชนีอ้างอิงสุดท้าย (Final Index Level)/ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) หมายถึง ดัชนีที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Strike Index Level)/ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) หมายถึง ดัชนีอ้างอิง (Spot Index Level)/จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Underlying Amount) หมายถึง จำนวนดัชนีอ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Index Amount)

ทั้งนี้รายละเอียดให้เป็นไปตามข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Pricing Supplement)

ลักษณะพิเศษ และความเสี่ยงสำคัญของตราสาร(ต่อ)
ตัวอย่างการคำนวณการจ่ายเงินต้น และผลตอบแทน

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้น AAA
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	100.00 บาท
ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) (90.00% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price))	90.00 บาท
ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Price) (102.00% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง(Spot Price))	102.00 บาท
ราคาเพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-in Price) (85.00% ของราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง(Spot Price))	85.00 บาท
อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)	1.0000
มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Amount)	1,000,000 บาท (100.00% ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด)
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด (หุ้น) (Underlying Amount)	11,111.11 หุ้น [มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมดหาร (ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย คูณ อัตราแลกเปลี่ยน)]
จำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) (หุ้น)	11.11 หุ้น
จำนวนเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement)	888.89 บาท [จำนวนหน่วยย่อย คูณ ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย คูณ อัตราแลกเปลี่ยน]
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่เพื่อการส่งมอบ (หุ้น)	11,100 หุ้น
อายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	180 วัน
อัตราดอกเบี้ย	ร้อยละ 15.00 ต่อปี หรือ ร้อยละ 1.25 ต่องวด
ค่าดอกเบี้ยต่องวด	12,500 บาทต่องวด (1,000,000 x 1.25%) เป็นจำนวน 6 งวด รวม 75,000 บาท

1. กรณีที่เกิด Knock-out Event คือกรณีที่ ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event Observation Date) หลักทรัพย์อ้างอิงมีราคามากกว่า Knock-out Price เช่น ในวัน Knock-out Event Observation Date ของงวดที่ 1 หุ้น AAA มีค่ามากกว่า 102.00 บาท (Knock-out Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 1,000,000 บาท (มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด) และ ค่าดอกเบี้ย จำนวน 12,500 บาท สำหรับงวดดอกเบี้ยที่ 1 ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งผลตอบแทนทั้งหมดคิดเป็น 1.25% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือ 15.00% ต่อปี

2. กรณีที่ไม่เกิด Knock-out Event คือกรณีที่ ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event Observation Date) ใด ๆ ไม่เกิด Knock-out Event ซึ่งสามารถแบ่งได้ 2 กรณีดังนี้

(1) กรณีที่ไม่เกิด Knock-in Event คือกรณีที่ ณ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event Observation Date) ใด ๆ ไม่เกิด Knock-in Event ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 1,000,000 บาท (มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด) และ ค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย จำนวน 12,500 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งผลตอบแทนทั้งหมดรวมค่าดอกเบี้ย 6 งวด เป็นจำนวน 75,000 บาท คิดเป็นอัตราค่าไถ่ 7.50% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราค่าไถ่ 15.00% ต่อปี

(2) กรณีที่เกิด Knock-in Event คือกรณีที่ ณ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event Observation Date) ใด ๆ เกิด Knock-in Event ที่ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงมีราคาน้อยกว่า Knock-in Price เช่น ราคาหุ้น AAA น้อยกว่า 85.00 บาท (Knock-in Price) ในวัน Knock-in Event Observation Date

(2.1) กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA มากกว่าหรือเท่ากับ 90.00 บาท (Strike Price) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 1,000,000 บาท (มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด) และค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย จำนวน 12,500 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งผลตอบแทนทั้งหมดรวมค่าดอกเบี้ย 6 งวด เป็นจำนวน 75,000 บาท คิดเป็นอัตราค่าไถ่ 7.50% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราค่าไถ่ 15.00% ต่อปี

ลักษณะพิเศษ และความเสี่ยงสำคัญของตราสาร(ต่อ)

(2.2) กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 80.00 บาท ซึ่งน้อยกว่า 90.00 บาท (Strike Price)

(2.2.1) กรณีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้น AAA จำนวน 11,100 ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ และจะชำระเป็นเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement) เป็นจำนวน 888.89 บาท ($11.11 \times 80.00 \times 1.00$) และค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย จำนวน 12,500 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งผลตอบแทนทั้งหมดรวมค่าดอกเบี้ย 6 งวด เป็นจำนวน 75,000 บาท คิดเป็นอัตราขาดทุน 3.61% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราขาดทุน 7.22% ต่อปี

(2.2.2) กรณีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระเป็นเงิน ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 888,888.89 บาท $\{1,000,000 - [(90.00 - 80.00) \times 11,111.11 \text{ (จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ)} \times 1.00]\}$ และชำระด้วยเงิน ค่าดอกเบี้ยของงวดสุดท้าย จำนวน 12,500 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งผลตอบแทนทั้งหมดรวมค่าดอกเบี้ย 6 งวด เป็นจำนวน 75,000 บาท คิดเป็นอัตราขาดทุน 3.61% ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราขาดทุน 7.22% ต่อปี

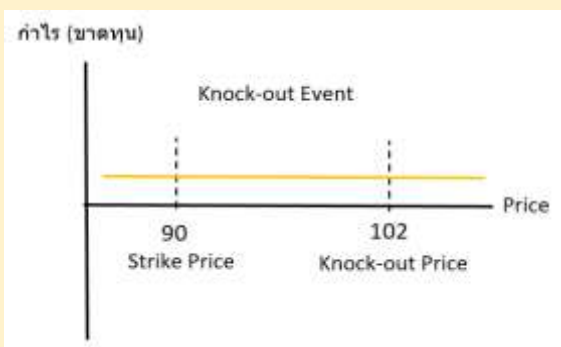
ทั้งนี้การคำนวณยังไม่ได้รวมปัจจัยของค่าธรรมเนียม และภาษีที่เกี่ยวข้อง

ตัวอย่างกราฟแสดงผลตอบแทน

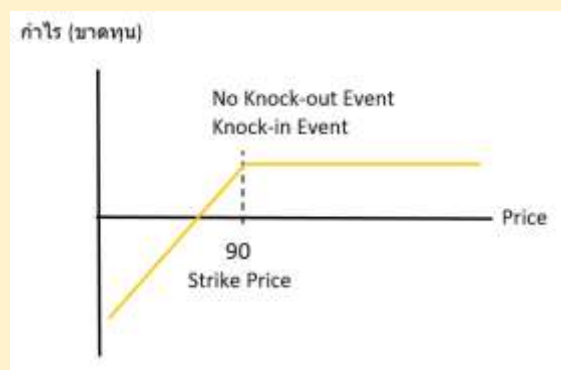
กรณีที่ไม่มีเกิดเหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (No Knock-out Event) และ กรณีที่ไม่มีเกิดเหตุการณ์การเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Knock-in Event)



กรณีที่เกิดเหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event)



กรณีที่ไม่มีเกิดเหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (No Knock-out Event) และกรณีที่เกิดเหตุการณ์การเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event) และ ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) น้อยกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)



กรณีที่ผู้ออกหุ้นกู้มีอนุพันธ์เป็นบุคคลภายในของบริษัทที่ออกหุ้นอ้างอิง : ☒ ไม่เป็น ☐ เป็น

ลักษณะพิเศษ และความเสี่ยงสำคัญของตราสาร(ต่อ)

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- การลงทุนในหุ้นกู้อนุพันธ์แฝง ไม่ใช่การฝากเงิน
- ผู้ลงทุนอาจต้องพร้อมถือหุ้นกู้อนุพันธ์แฝงนี้จนครบกำหนด เนื่องจากการขายก่อนครบกำหนดอาจทำได้ยาก หรือขายได้ต่ำกว่ามูลค่าที่ตราไว้หรือราคาที่ซื้อ
- อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิใช่สิ่งชี้้นำการซื้อขาย และไม่ได้เป็นการรับประกันความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกตราสาร
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหุ้นกู้ที่มีลักษณะผสมระหว่างตราสารหนี้ และตราสารอนุพันธ์ (Derivatives) โดยการจ่ายผลตอบแทนและการชำระคืนเงินต้นทั้งหมดหรือบางส่วนที่อ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ ตามที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ ซึ่งจะมีความแตกต่างและมีความซับซ้อนจากหุ้นกู้ทั่วไป และมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจไม่มีตลาดรองที่ซื้อขายได้สะดวก ทำให้ผู้ที่ซื้อไปแล้วอาจไม่สามารถซื้อขายได้ ในเวลาที่ต้องการหรือในราคาที่เหมาะสม

คำเตือน และข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือ รับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูล จากหนังสือชี้ชวน (filing)

ข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

- ประวัติการผิดนัดชำระหนี้ ☒ ไม่เคย ☐ เคย
- บริษัททำหน้าที่เป็นผู้ออก ตัวแทนคำนวณเงิน ผู้จัดการ ผู้จัดการจำหน่าย ผู้สนับสนุนหรือผู้รับประกันการจัดจำหน่ายปัจจัยอ้างอิงที่เป็นหลักทรัพย์ อาจมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์
- ประวัติการใช้เงินผิดวัตถุประสงค์
☒ ไม่มี ☐ มี ประวัติการใช้เงินผิดวัตถุประสงค์จากที่ได้แจ้งไว้ต่อสำนักงาน หรือที่เปิดเผยไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูล 3 ปี ย้อนหลัง



Factsheet

บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (listed): ☒ เป็น ☐ ไม่เป็น
 เสนอขายหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ชนิดระบุชื่อผู้ถือ ไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน ไม่มีการแปลงสภาพ และไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นที่มี
 อนุพันธ์แฝง ประเภท Shark Fin Bull Note ระหว่างวันที่ 21 เมษายน 2568 ถึง 10 เมษายน 2570

ลักษณะตราสาร

อายุ	[●]วัน*
อัตราดอกเบี้ย (ถ้ามี)	ไม่มี/[●]%*
งวดการชำระดอกเบี้ย	ไม่มี/[●]*
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี (เว้นแต่เป็นกรณีเฉพาะที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับ ราคาของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง)
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท*
มูลค่าที่ตราไว้ต่อหน่วย	[●] บาท*
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี)	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้น (ถ้ามี)	ไม่มี
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	วัตถุประสงค์ที่จะนำเงินที่ได้จากการเสนอขายหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไปใช้เพื่อการบริหารสภาพคล่องในการดำเนินงานทั่วไปของบริษัท และนำไปใช้ในการป้องกันความเสี่ยง [หุ้นสามัญ (ไทย/ต่างประเทศ) ของ [●] / ดัชนีหลักทรัพย์ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] โดย [●]]*
ปัจจัยอ้างอิง	ชำระคืนด้วยเงินสด
รูปแบบการไถ่ถอน	

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

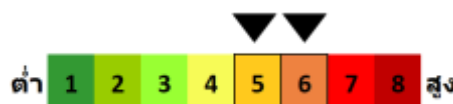
อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร

ระดับ AA (tha)	แนวโน้ม คงที่ (Stable)
เมื่อวันที่ 14 พฤษภาคม 2567	โดยบริษัท ฟิทช์ เรตติ้ง (ประเทศไทย) จำกัด

*ทั้งนี้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดให้มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงโดยสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับการเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ด. อย่างต่อเนื่องตลอดอายุของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสาร อันดับความน่าเชื่อถือ และการคุ้มครองเงินต้น)



การชำระคืนเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

หมายเหตุ : มีระดับความเสี่ยง 5 หรือ 6 ขึ้นอยู่กับการคุ้มครองเงินต้นตามที่ระบุในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ถือ

1. ไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ หรือกรณีก่อหนี้ได้ไม่จำกัด (No Debt Limit Restriction) บริษัทไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ ภายใต้ข้อตกลงใด ๆ ที่บริษัทมีอยู่กับผู้ถือหุ้น หรือคู่สัญญาใด ๆ ดังนั้น บริษัทจึงอาจก่อหนี้เพิ่มได้หากอัตราดอกเบี้ยตลาดเอื้ออำนวย ซึ่งจะส่งผลให้บริษัทมีภาระหนี้เพิ่มขึ้นและอาจส่งผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้

2. ความเสี่ยงด้านเครดิต (Credit Risk) ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงอาจไม่สามารถชำระคืนเงินต้นหรือผลตอบแทน หรือไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงได้ครบถ้วนตามข้อตกลงหรือตรงตามเวลาที่กำหนด รวมถึงการที่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่สามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิหรือข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถพิจารณาความเสี่ยงด้านเครดิตของบริษัทในฐานะผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงได้จากผลการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (credit rating)

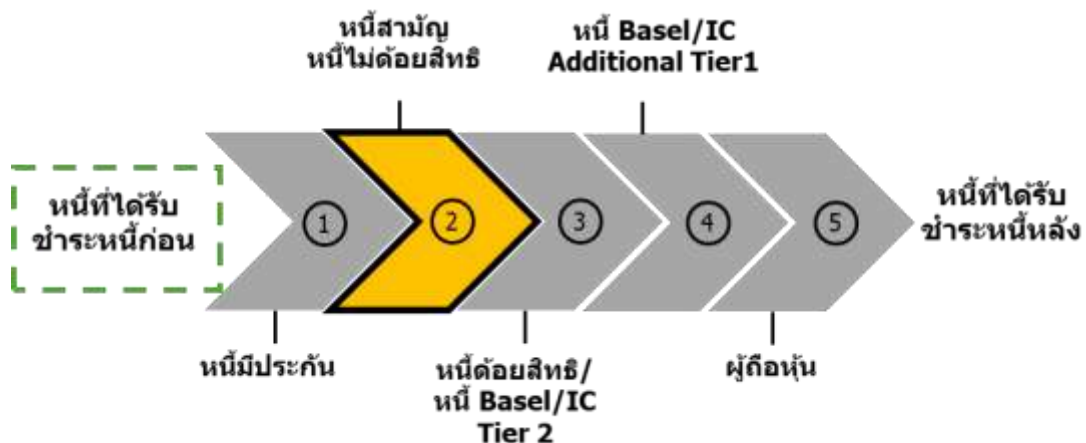
(สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับความเสี่ยงได้ในส่วนที่ 2 ข้อมูลผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง หัวข้อที่ 11 ปัจจัยความเสี่ยงของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง)

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนสูงสุด	[●]% ต่อปี (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
วันที่ครบกำหนดอายุ	วันที่ [●]*		
วันกำหนดค่าหลักทรัพย์	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนต่ำสุด	ขาดทุนไม่เกิน 100% ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับปัจจัยอ้างอิงที่เกี่ยวข้อง ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า และอายุตราสาร (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)		
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้า	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หรือผู้ที่ได้รับแต่งตั้งโดยชอบให้ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่าย		
นายทะเบียนหุ้นกู้	หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแทน บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)	การคุ้มครองเงินต้น	มี [●]% ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด] / [ไม่มี]*

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

ลำดับการได้รับชำระหนี้



ลักษณะพิเศษ และความสำคัญของตราสาร

1. เงื่อนไขในการจ่ายเงินต้น และผลตอบแทน

การจ่ายเงินมูลค่าไถ่ถอน

หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการไถ่ถอนก่อนกำหนด ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่กำหนดไว้ (Maturity Date) เป็นจำนวนเท่ากับ

มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount) คูณ อัตราการไถ่ถอนขั้นต่ำ (Minimum Redemption Rate)

เงื่อนไขการชำระค่าดอกเบี้ยขั้นต่ำ (ถ้ามี)

ค่าดอกเบี้ยขั้นต่ำ เท่ากับ มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount) คูณ อัตราดอกเบี้ยขั้นต่ำ (Minimum Interest Rate) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระค่าดอกเบี้ยขั้นต่ำ (Minimum Interest Amount) ในวันกำหนดชำระผลตอบแทน (Payout Date) ทั้งนี้ ในกรณีที่เกิดการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่ได้รับค่าดอกเบี้ยขั้นต่ำ (Minimum Interest Amount)

เงื่อนไขการชำระค่าผลตอบแทน (ถ้ามี)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระค่าผลตอบแทนในวันกำหนดชำระผลตอบแทน (Payout Date) ตามกรณีดังนี้

1) กรณีที่ไม่มีการเกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Barrier Event)

1.1 กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)

ค่าผลตอบแทน (Payout Amount) จะเท่ากับ ข้อ (ก) หรือ (ข) แล้วแต่มูลค่าใดจะสูงกว่า

(ก) มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount) คูณ อัตราการมีส่วนร่วม (Participation Rate) คูณ [ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ลบ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)] หรือ ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) คูณ อัตราแลกเปลี่ยนสุดท้าย (FX(t)) หรือ อัตราแลกเปลี่ยนปัจจุบัน (FX(0))

หรือ

(ข) มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount) คูณ อัตราผลตอบแทนต่ำสุด (Floor Return Rate) คูณ อัตราแลกเปลี่ยนสุดท้าย (FX(t)) หรือ อัตราแลกเปลี่ยนปัจจุบัน (FX(0))

1.2 กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) น้อยกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)

ค่าผลตอบแทน (Payout Amount) จะเท่ากับ ศูนย์

2) กรณีที่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Barrier Event)

ค่าผลตอบแทน (Payout Amount) จะเท่ากับ มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount) คูณ อัตราริเบต (Rebate Rate) คูณ อัตราแลกเปลี่ยนสุดท้าย (FX(t)) หรือ อัตราแลกเปลี่ยนปัจจุบัน (FX(0))

ทั้งนี้ ในกรณีที่เกิดการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่ได้รับค่าผลตอบแทน (Payout Amount) ในวันกำหนดชำระผลตอบแทนดังกล่าว

เหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Barrier Event) หมายถึง กรณีที่ [ราคาปิด/ราคาสูงสุด/ราคา ณ เวลากำหนดราคา (Valuation Time)/ระดับดัชนีราคาปิด/ระดับดัชนีสูงสุด/ระดับดัชนี ณ เวลากำหนดราคา (Valuation Time)] ณ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Barrier Event Observation Date) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาเพื่อเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Barrier Price)

หากปัจจัยอ้างอิงเป็นดัชนี: ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) หมายถึง ระดับดัชนีอ้างอิงสุดท้าย (Final Index Level)/ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) หมายถึง ดัชนีที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Strike Index Level)/ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) หมายถึง ดัชนีอ้างอิง (Spot Index Level)

ทั้งนี้รายละเอียดให้เป็นไปตามข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Pricing Supplement)

ลักษณะพิเศษ และความสำคัญของการตราสาร(ต่อ)**ตัวอย่างการคำนวณการจ่ายเงินต้น และผลตอบแทน**

ปัจจัยอ้างอิง	หุ้น AAA
ราคาปัจจุบันของปัจจัยอ้างอิง (Spot Price)	100.00 บาท
ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) (100.00% ของราคาปัจจุบันของปัจจัยอ้างอิง (Spot Price))	100.00 บาท
ราคาเพื่อเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Barrier Price) (115.00% ของราคาปัจจุบันของปัจจัยอ้างอิง (Spot Price))	115.00 บาท
อัตราแลกเปลี่ยนเริ่มต้น (Initial FX Rate (FX(0)))	1.0000
อัตราแลกเปลี่ยนสุดท้าย (Final FX Rate (FX(t)))	1.0000
มูลค่าที่ตราไว้ (Total Nominal Amount)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price)	1,000,000 บาท (100.00% ของมูลค่าที่ตราไว้)
อายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Tenor)	2 ปี
อัตรารีเบต (Rebate Rate)	ร้อยละ 2.00
อัตราผลตอบแทนต่ำสุด (Floor Return Rate)	ร้อยละ 0.00
อัตราดอกเบี้ยขั้นต่ำ (Minimum Interest Rate)	ร้อยละ 0.50
อัตราการไถ่ถอนขั้นต่ำ (Minimum Redemption Rate)	ร้อยละ 100.00
อัตราการมีส่วนร่วม (Participation Rate)	ร้อยละ 110.00

มูลค่าไถ่ถอน ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่กำหนดไว้ (Maturity Date) เป็นจำนวนเท่ากับ

1,000,000 บาท (Total Nominal Amount) คูณ ร้อยละ 100 (Minimum Redemption Rate) เท่ากับ 1,000,000 บาท

ค่าดอกเบี้ยขั้นต่ำ (ถ้ามี) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจ่ายค่าดอกเบี้ยขั้นต่ำ (Minimum Interest Amount) เท่ากับ 1,000,000 บาท (Total Nominal Amount) คูณ 0.50% (Minimum Interest Rate) เท่ากับ 5,000 บาท ในวันกำหนดชำระผลตอบแทน (Payout Date)

- กรณีที่ไม่มีเหตุการณ์เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Barrier Event) ณ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Barrier Event Observation Date) ค่าผลตอบแทน (Payout Amount) สามารถแบ่งได้ 2 กรณีดังนี้

- 1.1 กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 110 บาท ซึ่ง มากกว่า หรือ เท่ากับกว่า 100 บาท (Strike Price)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจ่ายค่าผลตอบแทน (Payout Amount) เท่ากับ ข้อ ก. หรือ ข. แล้วแต่มูลค่าใดจะสูงกว่า

(ก) 1,000,000 บาท (Total Nominal Amount) คูณร้อยละ 110 (Participation Rate) คูณ [110 บาท (Final Underlying Price) ลบ 100 บาท (Strike Price)] บวก 100 บาท (Spot Price) คูณ 1.00 (FX(t)) บวก 1.00 (FX(0)) เท่ากับ 110,000 บาท

(ข) 1,000,000 บาท (Total Nominal Amount) คูณร้อยละ 0.00 (Floor Return Rate) คูณ 1.00 (FX(t)) บวก 1.00 (FX(0)) เท่ากับ 0 บาท

เนื่องจากข้อ (ก) มีมูลค่าสูงกว่า ดังนั้นผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจ่ายค่าผลตอบแทนเท่ากับ 110,000 บาท ในวันจ่ายค่าผลตอบแทน (Payout Date)

มูลค่าไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผลตอบแทนรวมจะเท่ากับ 1,000,000 บาท (มูลค่าไถ่ถอน) + 5,000 บาท (ค่าดอกเบี้ยขั้นต่ำ) + 110,000 บาท (ค่าผลตอบแทน) เท่ากับ 1,115,000.00 บาท ซึ่งเป็นอัตรากำไรร้อยละ 11.50 ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือ อัตรากำไรร้อยละ 5.75 ต่อปี

- 1.2 กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 95 บาท ซึ่ง น้อยกว่า 100 บาท (Strike Price)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจ่ายค่าผลตอบแทน เท่ากับ 0 บาท

ลักษณะพิเศษ และความเสี่ยงสำคัญของตราสาร(ต่อ)

มูลค่าไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผลตอบแทนรวมจะเท่ากับ 1,000,000 บาท (มูลค่าไถ่ถอน) + 5,000 บาท (ค่าดอกเบี้ยขั้นต่ำ) เท่ากับ 1,005,000 บาท ซึ่งเป็นอัตรากำไรร้อยละ 0.50 ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือ อัตรากำไรร้อยละ 0.25 ต่อปี

2. กรณีที่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Barrier Event) ณ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Barrier Event Observation Date) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจ่ายค่าผลตอบแทนค่าผลตอบแทน (Payout Amount) เท่ากับ 1,000,000 (Total Nominal Amount) คูณร้อยละ 2.00 (Rebate Rate) คูณ 1.00 (FX(t)) หาร 1.00 (FX(0)) เท่ากับ 20,000 บาท ในวันจ่ายค่าผลตอบแทน (Payout Date)

2.1 กรณีที่อัตราการไถ่ถอนขั้นต่ำ (Minimum Redemption Rate) เท่ากับ ร้อยละ 100

มูลค่าไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผลตอบแทนรวมจะเท่ากับ 1,000,000 บาท (มูลค่าไถ่ถอน) + 5,000 บาท (ค่าดอกเบี้ยขั้นต่ำ) + 20,000 บาท (ค่าผลตอบแทน) เท่ากับ 1,025,000 บาท ซึ่งเป็นอัตรากำไรร้อยละ 2.50 ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือ อัตรากำไรร้อยละ 1.25 ต่อปี

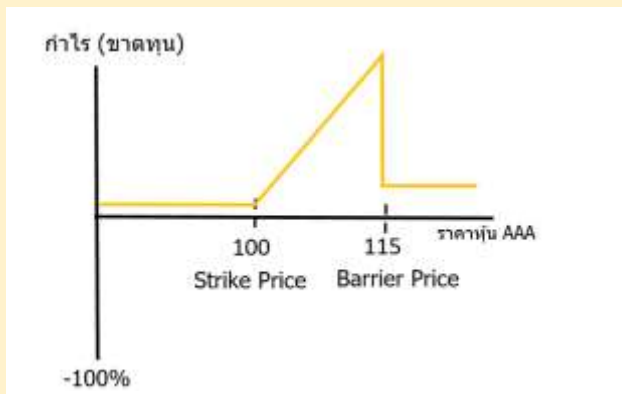
2.2 กรณีที่อัตราการไถ่ถอนขั้นต่ำ (Minimum Redemption Rate) น้อยกว่า ร้อยละ 100 เช่น ร้อยละ 95

มูลค่าไถ่ถอน เป็นจำนวนเท่ากับ 1,000,000 บาท (Total Nominal Amount) คูณ ร้อยละ 95 (Minimum Redemption Rate) เท่ากับ 950,000 บาท ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่กำหนดไว้ (Maturity Date) มูลค่าไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและผลตอบแทนรวมจะเท่ากับ 950,000 บาท (มูลค่าไถ่ถอน) + 5,000 บาท (ค่าดอกเบี้ยขั้นต่ำ) + 20,000 บาท (ค่าผลตอบแทน) = 975,000 บาท ซึ่งเป็นอัตราขาดทุนร้อยละ 2.50 ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หรือ อัตราขาดทุนร้อยละ 1.25 ต่อปี

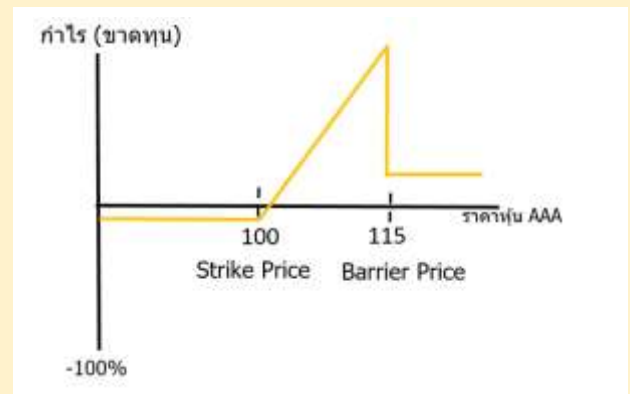
ทั้งนี้การคำนวณยังไม่ได้รวมปัจจัยของค่าธรรมเนียม และภาษีที่เกี่ยวข้อง

ตัวอย่างกราฟแสดงผลตอบแทน

อัตราการคุ้มครองเงินต้นเท่ากับหรือมากกว่า ร้อยละ 100



อัตราการคุ้มครองเงินต้น ต่ำกว่าร้อยละ 100



หมายเหตุ: กราฟแสดงผลตอบแทนนี้อยู่บนสมมติฐานที่ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีการคำนวณราคาไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Barrier Event Observation Date) เป็นวันเดียวกันกับวันกำหนดราคา และ อัตราผลตอบแทนต่ำสุด (Floor Return Rate) เท่ากับศูนย์

กรณีที่ผู้ออกหุ้นกู้มีอนุพันธ์เป็นบุคคลภายในของบริษัทที่ออกหุ้นอ้างอิง : ☒ ไม่เป็น ☐ เป็น

ลักษณะพิเศษ และความสำคัญสำคัญของตราสาร(ต่อ)

ความสำคัญสำคัญของตราสาร

- การลงทุนในหุ้นกู้อนุพันธ์แฝง ไม่ใช่การฝากเงิน
- ผู้ลงทุนอาจต้องพร้อมถือหุ้นกู้อนุพันธ์แฝงนี้จนครบกำหนด เนื่องจากการขายก่อนครบกำหนดอาจทำได้ยาก หรือขายได้ต่ำกว่ามูลค่าที่ตราไว้หรือราคาที่ซื้อ
- อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมิใช่สิ่งชี้แนะการซื้อขาย และไม่ได้เป็นการรับประกันความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกตราสาร
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหุ้นกู้ที่มีลักษณะผสมระหว่างตราสารหนี้ และตราสารอนุพันธ์ (Derivatives) โดยการจ่ายผลตอบแทนและการชำระคืนเงินต้นทั้งหมดหรือบางส่วนที่อ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ ตามที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ ซึ่งจะมีความแตกต่างและมีความซับซ้อนจากหุ้นกู้ทั่วไป และมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจไม่มีตลาดรองที่ซื้อขายได้สะดวก ทำให้ผู้ที่ซื้อไปแล้วอาจไม่สามารถซื้อขายได้ ในเวลาที่ต้องการหรือในราคาที่เหมาะสม

คำเตือน และข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือ รับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

- ประวัติการผิดนัดชำระหนี้ ☒ ไม่เคย ☐ เคย
- บริษัททำหน้าที่เป็นผู้ออก ตัวแทนคำนวณเงิน ผู้จัดการ ผู้จัดการจำหน่าย ผู้สนับสนุนหรือผู้รับประกันการจัดจำหน่ายปัจจัยอ้างอิงที่เป็นหลักทรัพย์ อาจมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์
- ประวัติการใช้เงินผิดวัตถุประสงค์
☒ ไม่มี ☐ มี ประวัติการใช้เงินผิดวัตถุประสงค์จากที่ได้แจ้งไว้ต่อสำนักงาน หรือที่เปิดเผยไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูล 3 ปีย้อนหลัง



Factsheet

บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (listed): ☒ เป็น ☐ ไม่เป็น
เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ชนิดระบุชื่อผู้ถือ ไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน ไม่มีการแปลงสภาพ และไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แฝง ประเภท Bonus Certificate ระหว่างวันที่ 21 เมษายน 2568 ถึง 10 เมษายน 2570

ลักษณะตราสาร

อายุ	[●] วัน*
อัตราดอกเบี้ย	ไม่มี
งวดการชำระดอกเบี้ย	ไม่มี
การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี (เว้นแต่เป็นกรณีเฉพาะที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับ ราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง)
มูลค่าการเสนอขายรวม	[●] บาท*
มูลค่าที่ตราไว้ต่อหน่วย	[●] บาท*
หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน	ไม่มี
ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี)	ไม่มี
วัตถุประสงค์การใช้เงิน	วัตถุประสงค์ที่จะนำเงินที่ได้จากการเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไปใช้เพื่อการบริหารสภาพคล่องในการดำเนินงานทั่วไปของบริษัท และนำไปใช้ในการป้องกันความเสี่ยง [หุ้นสามัญ (ไทย/ต่างประเทศ) ของ [●] / ดัชนีหลักทรัพย์ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] / หน่วยลงทุนของกองทุนรวมที่เอฟ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] โดย [●]]*
ปัจจัยอ้างอิง	
รูปแบบการไถ่ถอน	ชำระคืนด้วยเงินสด และ/หรือส่งมอบเป็นหลักทรัพย์

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

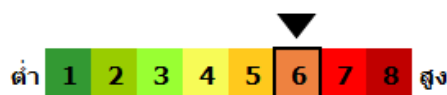
อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร

ระดับ AA (tha)	แนวโน้ม คงที่ (Stable)
เมื่อวันที่ 14 พฤษภาคม 2567	โดยบริษัท ฟิทช์ เรตติ้ง (ประเทศไทย) จำกัด

*ทั้งนี้ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดให้มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือที่ได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ด. อย่างต่อเนื่องตลอดอายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสาร อันดับความน่าเชื่อถือ และการคุ้มครองเงินต้น)



การชำระคืนเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ถือ

1. ไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ หรือกรณีก่อหนี้ได้ไม่จำกัด (No Debt Limit Restriction) บริษัทไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ ภายใต้ข้อตกลงใด ๆ ที่บริษัทมีอยู่กับเจ้าหนี้ หรือคู่สัญญาใด ๆ ดังนั้น บริษัทจึงอาจก่อหนี้เพิ่มเติมหากอัตราดอกเบี้ยตลาดเอื้ออำนวย ซึ่งจะส่งผลให้บริษัทมีภาระหนี้เพิ่มขึ้นและอาจส่งผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้

2. ความเสี่ยงด้านเครดิต (Credit Risk) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจไม่สามารถชำระคืนเงินต้นหรือผลตอบแทน หรือไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงได้ครบถ้วนตามข้อตกลงหรือตรงตามเวลาที่กำหนด รวมถึงการที่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่สามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิหรือข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถพิจารณาความเสี่ยงด้านเครดิตของบริษัทในฐานะผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้จากผลการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (credit rating)

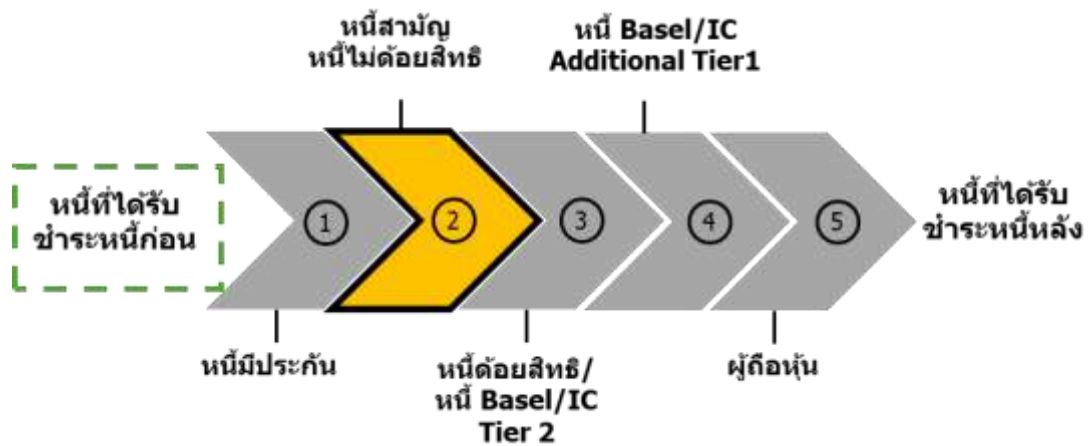
(สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับความเสี่ยงได้ในส่วนที่ 1 ข้อมูลผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง หัวข้อที่ 11 ปัจจัยความเสี่ยงของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง)

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนสูงสุด	[●]% ต่อปี* (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
วันที่ครบกำหนดอายุ	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนต่ำสุด	ขาดทุนไม่เกิน 100% ต่ออายุตราสาร ขึ้นอยู่กับปัจจัยอ้างอิงที่เกี่ยวข้อง
วันที่กำหนดค่าหลักทรัพย์	วันที่ [●]*		ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า และอายุตราสาร (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)		
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้า	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หรือผู้ที่ได้รับแต่งตั้งโดยชอบให้ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่าย	การคุ้มครองเงินต้น	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแทน บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)		

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

ลำดับการได้รับชำระหนี้



ลักษณะพิเศษ และความสำคัญของตราสาร

1. เงื่อนไขในการจ่ายเงินต้น และผลตอบแทน

หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการไถ่ถอนก่อนกำหนด ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงิน และ/หรือหลักทรัพย์ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) ตามกรณีดังนี้

1. กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Knock-in Event)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงชำระด้วยเงินในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) เป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount) รวมกับมูลค่า ข้อ (ก) หรือ (ข) แล้วแต่มูลค่าใดจะสูงกว่า

(ก) มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount) คูณ อัตราการมีส่วนร่วม (Participation Rate) คูณ [ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ลบ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)] หาร ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)

หรือ

(ข) มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount) คูณ อัตราผลตอบแทนพิเศษ (Bonus Rate)

2. กรณีที่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event)

2.1 กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) มากกว่าหรือเท่ากับ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระด้วยเงินในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) เป็นจำนวนเท่ากับ มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount) บวก มูลค่าของ

มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount) คูณ อัตราการมีส่วนร่วม (Participation Rate) คูณ [(ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ลบ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)) หาร ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)]

2.2 กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) น้อยกว่า ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price)

(2.2.1) กรณีไถ่ถอนด้วยการส่งมอบเป็นหลักทรัพย์อ้างอิง

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง ที่ตกลงจะส่งมอบ เป็นจำนวนหุ้นเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Underlying Amount) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยหากหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบจำนวนดังกล่าวมีหน่วยย่อย (Odd Lot) ที่กำหนดโดยตลาดหลักทรัพย์ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะตัดจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) ดังกล่าวนั้นออก และจะชำระเป็นจำนวนเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement) ดังกล่าวนั้น ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date)

ทั้งนี้ หลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบอาจถูกปรับลดลงตามค่าธรรมเนียมและค่าใช้จ่ายใด ๆ ที่เกี่ยวข้องกับการส่งมอบหุ้นของ หลักทรัพย์อ้างอิงนั้น(ถ้ามี)

(2.2.2) กรณีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระเป็นเงิน

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยจะชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ ร้อยละ 100 (หนึ่งร้อย) ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount) ลบ [(ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) ลบ ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price)) คูณ จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Underlying Amount) คูณ อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)] ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date)

เหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event) หมายถึง กรณีที่[ราคาปิด/ราคาต่ำสุด/ราคา ณ เวลากำหนดราคา (Valuation Time) /ระดับดัชนีราคาปิด/ระดับดัชนีต่ำสุด/ระดับดัชนี ณ เวลากำหนดราคา (Valuation Time)]ของหลักทรัพย์อ้างอิง ที่มีการซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event Observation Date) น้อยกว่า ราคาเพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Price)

หากปัจจัยอ้างอิงเป็นดัชนี: ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) หมายถึง ระดับดัชนีอ้างอิงสุดท้าย (Final Index Level)/ ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) หมายถึง ดัชนีที่ตกลงไว้ล่วงหน้า (Strike Index Level)/ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price) หมายถึง ดัชนีอ้างอิง (Spot Index Level) /จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Underlying Amount) หมายถึง จำนวนดัชนีอ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบ (Index Amount)

ทั้งนี้รายละเอียดให้เป็นไปตามข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Pricing Supplement)

ตัวอย่างการคำนวณการจ่ายคืนเงินต้น และผลตอบแทน

ปัจจัยอ้างอิง	หุ้น AAA
ราคาปัจจุบันของปัจจัยอ้างอิง (Spot Price)	110.00 บาท
ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย (Strike Price) (100.00% ของราคาปัจจุบันของปัจจัยอ้างอิง (Spot Price))	110.00 บาท
ราคาเพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Price) (85.00% ของราคาปัจจุบันของปัจจัยอ้างอิง (Spot Price))	93.5 บาท
อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate)	1.0000
มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount)	1,000,000 บาท
ราคาเสนอขายหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price)	1,000,000 บาท (100.00% ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด)
อายุหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง	1 ปี
อัตราผลตอบแทนพิเศษ (Bonus Rate)	ร้อยละ 8.00
อัตราการมีส่วนร่วม (Participation Rate)	ร้อยละ 100.00
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่ตกลงจะส่งมอบทั้งหมด (หุ้น) (Underlying Amount)	9,090.91 หุ้น [มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด หาร (ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย คุณ อัตราแลกเปลี่ยน)]
จำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) (หุ้น)	90.91 หุ้น
จำนวนเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement)	9,272.82 บาท [จำนวนหน่วยย่อย คุณ ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย คุณ อัตราแลกเปลี่ยน]
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่เพื่อการส่งมอบ (หุ้น)	9,000 หุ้น

1. กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (No Knock-in Event) ณ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event Observation Date)ใด ๆ กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 105 บาท ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินในวันครบกำหนดอายุหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (Maturity Date) เป็นจำนวนเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด 1,000,000 บาท (Total Nominal Amount) รวมกับมูลค่า ข้อ (ก) หรือ (ข) แล้วแต่มูลค่าใดจะสูงกว่า

(ก) 1,000,000 บาท (Total Nominal Amount) คุณร้อยละ 100 (Participation Rate) คุณ [105 บาท (Final Underlying Price) ลบ 110 บาท (Strike Price)] หาร 110 บาท (Spot Price) เท่ากับ -45,454.55 บาท

(ข) 1,000,000 (Total Nominal Amount) คุณร้อยละ 8.00 (Bonus Rate) เท่ากับ 80,000.00 บาท

เนื่องจากข้อ (ข) มีมูลค่าสูงกว่าข้อ (ก) ดังนั้นผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะจ่ายค่าไถ่ถอนเป็นจำนวนรวมของ 1,000,000 บาท (Total Nominal Amount) และ 80,000.00 บาท (มูลค่าข้อ (ข)) เท่ากับ 1,080,000 บาท ซึ่งเป็นอัตราค่าไถ่ร้อยละ 8.00 ต่ออายุหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราค่าไถ่ร้อยละ 8.00 ต่อปี

2. กรณีที่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event) ณ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event Observation Date)ใด ๆ ซึ่งสามารถแบ่งได้ 2 กรณีดังนี้

(2.1) กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 112 บาท ซึ่งมากกว่าหรือเท่ากับ 110 บาท (Strike Price) ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ 1,000,000 บาท (Total Nominal Amount) บวก มูลค่าของ 1,000,000 (Total Nominal Amount) คุณ ร้อยละ 100 (Participation Rate) คุณ [112 บาท (Final Underlying Price) ลบ 110 บาท (Strike Price)] หาร 110 บาท (Spot Price) ซึ่งเท่ากับ 1,018,181.82 บาท ซึ่งเป็นอัตราค่าไถ่ร้อยละ 1.82 ต่ออายุหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราค่าไถ่ร้อยละ 1.82 ต่อปี

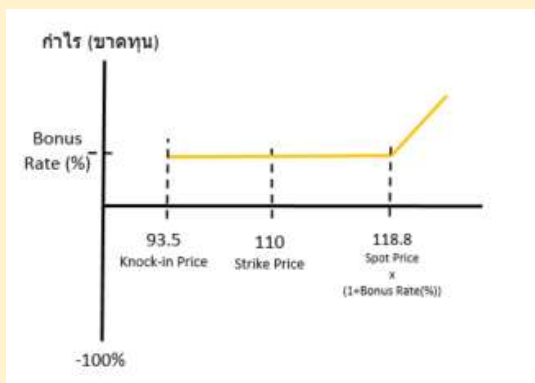
(2.2) กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Underlying Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 102 บาท ซึ่งน้อยกว่า 110 บาท (Strike Price)

(2.2.1) กรณีไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบหุ้น AAA จำนวน 9,000 หุ้น ให้แก่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันที่ตกลงจะส่งมอบหลักทรัพย์ และจะชำระเป็นเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement) เป็นจำนวน 9,272.82 บาท (90.91 x 102.00 x 1.00) ซึ่งเป็นอัตราขาดทุน 7.27 % ต่ออายุหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง หรืออัตราขาดทุน 7.27% ต่อปี

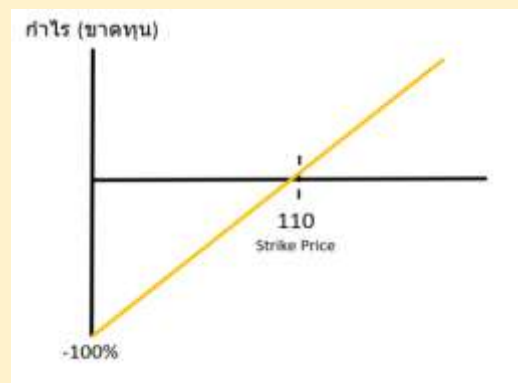
ลักษณะพิเศษ และความเสี่ยงสำคัญของตราสาร(ต่อ)

ตัวอย่างกราฟแสดงผลตอบแทน

กรณีที่ ไม่เกิด Knock-in Event



กรณีที่ เกิด Knock-in Event



กรณีที่ผู้ออกหุ้นกู้อนุพันธ์เป็นบุคคลภายในของบริษัทที่ออกหุ้นอ้างอิง : ☒ ไม่เป็น ☐ เป็น

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- การลงทุนในหุ้นกู้อนุพันธ์แฝง ไม่ใช่การฝากเงิน
- ผู้ลงทุนอาจต้องพร้อมถือหุ้นกู้อนุพันธ์แฝงนี้จนครบกำหนด เนื่องจากการขายก่อนครบกำหนดอาจทำได้ยาก หรือขายได้ต่ำกว่ามูลค่าที่ตราไว้หรือราคาที่ซื้อ
- อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงมีใช้สิ่งชี้้นำการซื้อขาย และไม่ได้เป็นการรับประกันความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกตราสาร
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นหุ้นกู้ที่มีลักษณะผสมระหว่างตราสารหนี้ และตราสารอนุพันธ์ (Derivatives) โดยการจ่ายผลตอบแทนและการชำระคืนเงินต้นทั้งหมดหรือบางส่วนที่อ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ ตามที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ ซึ่งจะมีความแตกต่างและมีความซับซ้อนจากหุ้นกู้ทั่วไป และมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนั้นไม่มีการคุ้มครองเงินต้นหรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจไม่มีตลาดรองที่ซื้อขายได้สะดวก ทำให้ผู้ที่ซื้อไปแล้วอาจไม่สามารถซื้อขายได้ ในเวลาที่ต้องการหรือในราคาที่เหมาะสม

คำเตือน และข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือ รับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

- ประวัติการผิดนัดชำระหนี้ ☒ ไม่เคย ☐ เคย
- บริษัททำหน้าที่เป็นผู้ออก ตัวแทนคำนวณเงิน ผู้จัดการ ผู้จัดการจำหน่าย ผู้สนับสนุนหรือผู้รับประกันการจัดจำหน่ายปัจจัยอ้างอิงที่เป็นหลักทรัพย์ อาจมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์
- ประวัติการใช้จ่ายเงินผิดวัตถุประสงค์
☒ ไม่มี ☐ มี ประวัติการใช้จ่ายเงินผิดวัตถุประสงค์จากที่ได้แจ้งไว้ต่อสำนักงาน หรือที่เปิดเผยไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูล 3 ปีย้อนหลัง

Factsheet



บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์

สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (listed): ☒ เป็น ☐ ไม่เป็น
 เสนอขายหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ชนิดระบุชื่อผู้ถือ ไม่ด้อยสิทธิ ไม่มีประกัน ไม่มีการแปลงสภาพ และไม่มีผู้แทนผู้ถือหุ้นที่มี
 อนุพันธ์แฝง ประเภท Participation Note
 ระหว่างวันที่ 21 เมษายน 2568 ถึง 10 เมษายน 2570

ลักษณะตราสาร

อายุ อัตราดอกเบี้ย	[●] วัน* คงที่/ ลอยตัว/ เงินปันผลหรือการจ่าย ผลประโยชน์อื่น ๆ/ ไม่มี
งวดการชำระดอกเบี้ย การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี)	ไม่มี/ [●]* ไม่มี (เว้นแต่เป็นกรณีเฉพาะที่ ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติม เกี่ยวกับ ราคาของหุ้นที่มี อนุพันธ์แฝง)
มูลค่าการเสนอขายรวม มูลค่าที่ตราไว้ต่อหน่วย หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี) ผู้แทนผู้ถือหุ้น (ถ้ามี) วัตถุประสงค์การใช้เงิน	[●] บาท* [●] บาท* ไม่มี ไม่มี วัตถุประสงค์ที่จะนำเงินที่ได้ จากการเสนอขายหุ้นที่มี อนุพันธ์แฝงไปใช้เพื่อการ บริหารสภาพคล่องในการ ดำเนินงานทั่วไปของบริษัท และ นำไปใช้ในการป้องกัน ความเสี่ยง
ปัจจัยอ้างอิง	[หุ้นสามัญ (ไทย/ ต่างประเทศ) ของ [●] / ดัชนี หลักทรัพย์ (ไทย/ ต่างประเทศ) [●] / หน่วย ลงทุนของกองทุนรวมอิตาลีเอฟ (ไทย/ต่างประเทศ) [●] โดย [●]]*
รูปแบบการไถ่ถอน	ชำระคืนด้วยเงินสด และ/หรือ ส่งมอบเป็นหลักทรัพย์

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นที่มี
อนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

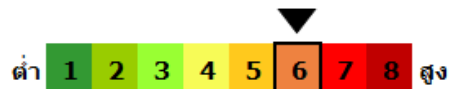
อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกตราสาร

ระดับ AA (tha) แนวโน้ม คงที่ (Stable)
เมื่อวันที่ 14 พฤษภาคม 2567 โดยบริษัท ฟิทช์ เรตติ้ง
(ประเทศไทย) จำกัด

*ทั้งนี้ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงจะจัดให้มีการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ
ของผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงโดยสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือ
ที่ได้รับการเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ด. อย่างต่อเนื่องตลอดอายุ
ของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสาร อันดับความน่าเชื่อถือ
และการคุ้มครองเงินต้น)



การชำระคืนเงินต้นหรือดอกเบี้ยขึ้นกับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ถือ

1. ไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ หรือกรณีก่อหนี้ได้ไม่จำกัด (No Debt Limit Restriction) บริษัทไม่มีข้อจำกัดการก่อหนี้ ภายใต้ข้อตกลงใด ๆ ที่บริษัทมีอยู่กับเจ้าหนี้ หรือคู่สัญญาใด ๆ ดังนั้น บริษัทจึงอาจก่อหนี้เพิ่มได้หากอัตราดอกเบี้ยตลาดเอื้ออำนวย ซึ่งจะส่งผลให้บริษัทมีภาระหนี้เพิ่มขึ้นและอาจส่งผลกระทบต่อความสามารถในการชำระหนี้

2. ความเสี่ยงด้านเครดิต (Credit Risk) ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงอาจไม่สามารถชำระคืนเงินต้นหรือผลตอบแทน หรือไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงได้ครบถ้วนตามข้อตกลงหรือตรงตามเวลาที่กำหนด รวมถึงการที่ผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่สามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิหรือข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาที่เกี่ยวข้อง ทั้งนี้ ผู้ลงทุนสามารถพิจารณา ความเสี่ยงด้านเครดิตของบริษัทในฐานะผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงได้จากผลการจัดอันดับความน่าเชื่อถือ (credit rating)

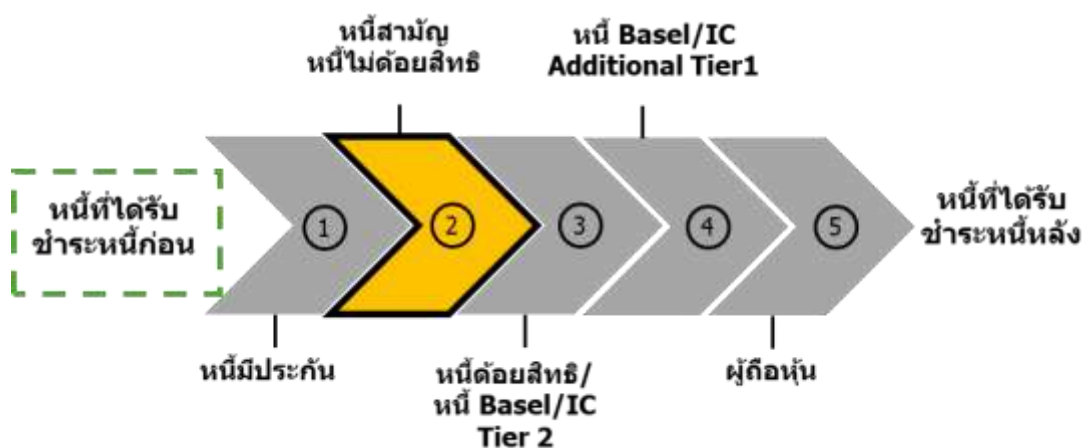
(สามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับความเสี่ยงได้ที่ ส่วนที่ 1 ข้อมูลผู้ถือหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง หัวข้อที่ 11 ปัจจัยความเสี่ยงของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง)

รายละเอียดสำคัญอื่น

วันที่ออกตราสาร	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนสูงสุด	[●]% ต่อปี (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
วันที่ครบกำหนดอายุ	วันที่ [●]*		
วันกำหนดค่าหลักทรัพย์	วันที่ [●]*	อัตราผลตอบแทนต่ำสุด	ขาดทุนไม่เกิน 100% ต่ออายุของตราสาร ขึ้นอยู่กับปัจจัยอ้างอิงที่เกี่ยวข้อง
ประเภทการเสนอขาย	PP (II&HNW)		ราคาที่ตกลงไว้ล่วงหน้า และอายุตราสาร (*อ้างอิงจากตัวอย่างการคำนวณ)
ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้า	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) หรือผู้ที่ได้รับแต่งตั้งโดยชอบให้ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงแทน	การคุ้มครองเงินต้น	ไม่มี
นายทะเบียนหุ้นกู้	บริษัทหลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)		

*เป็นไปตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่เกี่ยวข้อง

ลำดับการได้รับชำระหนี้



ลักษณะพิเศษ และความสำคัญสำคัญของตราสาร

เงื่อนไขในการจ่ายเงิน และผลตอบแทน

1. การจ่ายค่าดอกเบี้ย

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะจ่ายดอกเบี้ย เท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Amount) ที่ยังไม่ได้ใช้สิทธิคูณด้วย อัตราดอกเบี้ย (Interest Rate) คูณด้วย อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate) ที่เกี่ยวข้อง ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เพื่อความชัดเจน ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่ได้รับดอกเบี้ยจากส่วนของจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Amount) ที่ได้มีการใช้สิทธิ์แล้ว หรือในกรณีที่มีการไถ่ถอนก่อนกำหนดของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

2. การจ่ายเงิน และการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงยังไม่ได้รับการไถ่ถอนทั้งหมด

2.1 กรณีที่ปัจจัยอ้างอิงไม่ใช่ดัชนี

2.1.1 กรณีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Security)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการส่งมอบจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Amount) ที่ยังไม่ได้ใช้สิทธิให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยหากจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Amount) ที่ยังไม่ได้ใช้สิทธิจำนวนดังกล่าวมีหน่วยย่อย (Odd Lot) ที่กำหนดโดยตลาดหลักทรัพย์ฯ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะตัดจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot) ดังกล่าวนั้นออก และจะชำระเป็นจำนวนเงินที่มีมูลค่าเท่ากับจำนวนหน่วยย่อย (Odd Lot Settlement) ดังกล่าวนั้น ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่กำหนดไว้ (Maturity Date)

2.1.2 กรณีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการชำระเป็นเงิน

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Amount) ที่ยังไม่ได้ใช้สิทธิ คูณด้วย ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Securities Price) คูณด้วย อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate) ที่เกี่ยวข้อง ลบด้วย ค่าธรรมเนียมการออก (Exit Fee) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่กำหนดไว้ (Maturity Date)

2.2 กรณีที่ปัจจัยอ้างอิงเป็นดัชนี

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนเท่ากับ ตัวคูณดัชนี (Multiplier) ที่ยังไม่ได้ใช้สิทธิ คูณด้วย ระดับดัชนีอ้างอิงสุดท้าย (Final Index Level) คูณด้วย อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate) ที่เกี่ยวข้อง ลบด้วย ค่าธรรมเนียมการออก (Exit Fee) ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่กำหนดไว้ (Maturity Date)

ทั้งนี้รายละเอียดให้เป็นไปตามข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Pricing Supplement)

ตัวอย่างการคำนวณ**กรณีไม่มีเหตุการณ์การใช้สิทธิจนถึงวันกำหนดราคา (Valuation Date) ที่กำหนดไว้**

หลักทรัพย์อ้างอิง	หุ้น AAA
จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Amount)	10,000 หุ้น
ราคาปัจจุบันของหลักทรัพย์อ้างอิง (Spot Price)	100.00 บาท
มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount)	1,000,000 บาท เท่ากับ 10,000 หุ้น คูณด้วย 100.00 บาท คูณด้วย FX(0) ที่เป็น 1.0000
ราคาเสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Issue Price)	1,000,000 บาท (100.00% ของมูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด)
ค่าธรรมเนียมการขาย (Sales Charge)	15,000 บาท เท่ากับ 1.50% ของ 1,000,000 บาท มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount)
ค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee)	2,500 บาท เท่ากับ 0.25% ของ 1,000,000 บาท มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (Total Nominal Amount)
ค่าธรรมเนียมการออก (Exit Fee)	2,750 บาท เท่ากับ 0.25% ของ 1,100,000 บาท จำนวนไถ่ถอน (Redemption Amount)
อายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง	365 วัน
เงินปันผลต่อหุ้นของหุ้น AAA	5.00 บาท ต่อหุ้น
อัตราดอกเบี้ย (Interest Rate)	4.50 บาท ต่อหุ้น เท่ากับ 90% คูณด้วย 5.00 บาท ต่อหุ้น
ค่าดอกเบี้ย (Interest Amount)	45,000 บาท เท่ากับ 10,000 หุ้น คูณด้วย 4.50 บาท ต่อหุ้น คูณด้วย FX (t) ที่เป็น 1.0000
วันกำหนดชำระดอกเบี้ย (Interest Payment Date)	5 วัน หลังจากวันจ่ายเงินปันผลของหุ้น AAA
อัตราแลกเปลี่ยนเริ่มต้น (Initial FX Rate) (FX(0))	1.0000
อัตราแลกเปลี่ยน (FX Rate) (FX(t))	1.0000
หลักเกณฑ์การไถ่ถอน	การไถ่ถอนโดยการชำระเป็นเงิน

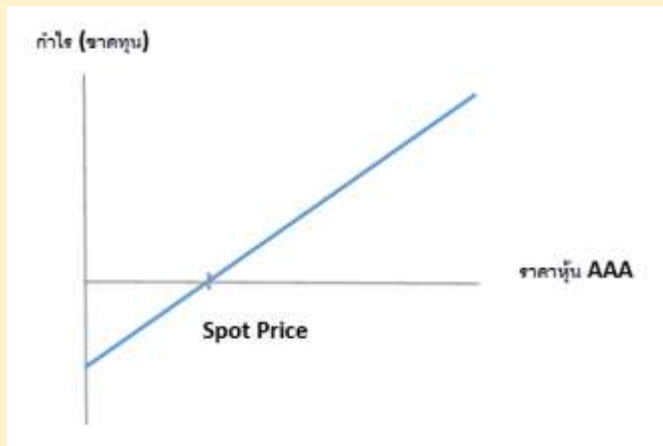
หากหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงไม่ได้ถูกไถ่ถอนทั้งหมดและผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ชำระจำนวนเงินเป็นจำนวนทั้งหมด 1,017,500 บาท อย่างครบถ้วนในวันชำระเงินจองซื้อ (Subscription Payment Date) เป็นจำนวน 1,000,000 บาท รวมกับค่าธรรมเนียมการขาย (Sales Charge) เท่ากับ 15,000 บาท รวมกับค่าธรรมเนียมการจัดการ (Management Fee) เท่ากับ 2,500 บาท

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระให้ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นค่าดอกเบี้ย (Interest Amount) เท่ากับ 45,000 บาท ในวันกำหนดชำระดอกเบี้ย (Interest Payment Date)

กรณีราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Securities Price) ของหุ้น AAA เท่ากับ 110.00 บาท ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระด้วยเงินเป็นจำนวนไถ่ถอน (Redemption Amount) 1,100,000 บาท (เท่ากับจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิง (Underlying Amount) 10,000 หุ้น คูณด้วยราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Securities Price) 110.00 บาท คูณด้วยอัตราแลกเปลี่ยน (FX (t)) 1.0000 ที่เกี่ยวข้อง) ลบด้วยค่าธรรมเนียมการออก (Exit Fee) 2,750 บาท ดังนั้น จำนวนไถ่ถอนเป็นเงินสุทธิที่ 1,097,500 บาท ให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่กำหนดไว้ (Maturity Date)

ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร (ต่อ)

ตัวอย่างกราฟแสดงผลตอบแทน



กรณีที่ผู้ออกหุ้นกู้ธนพาณิชย์เป็นบุคคลภายในของบริษัทที่ออกหุ้นอ้างอิง : ☒ ไม่เป็น ☐ เป็น

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

- การลงทุนในหุ้นกู้ธนพาณิชย์แปลง ไม่ใช่การฝากเงิน
- ผู้ลงทุนอาจต้องพร้อมถือหุ้นกู้ธนพาณิชย์แปลงนี้จนครบกำหนด เนื่องจากการขายก่อนครบกำหนดอาจทำได้ยาก หรือขายได้ต่ำกว่ามูลค่าที่ตราไว้หรือราคาซื้อขาย
- อันดับความน่าเชื่อถือของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีธนพาณิชย์แปลงมีใช้สิ่งชี้้นำการซื้อขาย และไม่ได้เป็นการรับประกันความสามารถในการชำระหนี้ของผู้ออกตราสาร
- หุ้นกู้ที่มีธนพาณิชย์แปลงเป็นหุ้นกู้ที่มีลักษณะผสมระหว่างตราสารหนี้ และตราสารอนุพันธ์ (Derivatives) โดยการจ่ายผลตอบแทนและการชำระคืนเงินต้นทั้งหมดหรือบางส่วนที่อ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ ตามที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ ซึ่งจะมีความแตกต่างและมีความซับซ้อนจากหุ้นกู้ทั่วไป และมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร
- ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นกู้ที่มีธนพาณิชย์แปลงนั้นไม่มีการคุ้มครองเงินต้นหรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
- หุ้นกู้ที่มีธนพาณิชย์แปลงอาจไม่มีตลาดรองที่ซื้อขายได้สะดวก ทำให้ผู้ที่ซื้อไปแล้วอาจไม่สามารถซื้อขายได้ ในเวลาที่ต้องการหรือในราคาที่เหมาะสม

คำเตือน และข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

คำเตือน

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือ รับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัทที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูล จากหนังสือชี้ชวน (filing)

ข้อมูลแจ้งเตือนอื่น

- ประวัติการผิดนัดชำระหนี้ ☒ ไม่เคย ☐ เคย
- บริษัททำหน้าที่เป็นผู้ออก ตัวแทนคำนวณเงิน ผู้จัดการ ผู้จัดการจำหน่าย ผู้สนับสนุนหรือผู้รับประกันการจัดจำหน่ายปัจจัยอ้างอิงที่เป็นหลักทรัพย์ อาจมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์
- ประวัติการใช้เงินผิดวัตถุประสงค์ ☒ ไม่มี ☐ มี ประวัติการใช้เงินผิดวัตถุประสงค์จากที่ได้แจ้งไว้ต่อสำนักงาน หรือที่เปิดเผยไว้ในแบบแสดงรายการข้อมูล 3 ปี ย้อนหลัง