

Factsheet

บริษัทหลักทรัพย์ โกลเบล็ก จำกัด

ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์



สถานะการเป็นบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (List) : • เป็น ไม่เป็น
เสนอขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงระยะสั้นประเภท Single Knock-in Knock-Out (KIKO) ที่มีการไถ่ถอนโดยการส่งมอบหลักทรัพย์
อ้างอิง และ/หรือเงิน ตั้งแต่วันที่ 12 มกราคม 2567 ถึงวันที่ 17 พฤศจิกายน 2567

ลักษณะตราสาร

| | |
|---------------------------------|---|
| อายุ * | [●] วัน |
| อัตราดอกเบี้ย* | คงที่ร้อยละ [●] ต่อปี |
| งวดการชำระดอกเบี้ย | ชำระดอกเบี้ยในวันกำหนดชำระดอกเบี้ยในแต่ละ งวดและชำระดอกเบี้ยงวดสุดท้ายในวันไถ่ ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงตามที่กำหนดไว้ใน ข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคา |
| การไถ่ถอนก่อนกำหนด (ถ้ามี) | ไม่มี |
| มูลค่าการเสนอขายรวม * | [●] |
| หลักประกัน/ผู้ค้ำประกัน (ถ้ามี) | ไม่มี |
| ผู้แทนผู้ถือหุ้นกู้ (ถ้ามี) | ไม่มี |
| วัตถุประสงค์การใช้เงิน | เพื่อใช้ประโยชน์ในการดำเนินธุรกิจของบริษัท รวมถึงการนำเงินส่วนหนึ่งไปใช้ในการป้องกัน ความเสี่ยงเกี่ยวกับความผันผวนของราคา หลักทรัพย์อ้างอิงตามนโยบายบริหารความเสี่ยง ของของบริษัท |
| ปัจจัยอ้างอิง * | หุ้นสามัญของ [●] / หน่วยลงทุนของ [●] โดย [●] |
| รูปแบบการไถ่ถอน | Physical และ/หรือ Cash |
| วันกำหนดค่าหลักทรัพย์ * | [●] |

อันดับความน่าเชื่อถือ

ไม่มี

รายละเอียดสำคัญอื่น

| | |
|---|---|
| วันที่ออกตราสาร * | [●] |
| วันที่ครบกำหนดอายุ * | [●] |
| ประเภทการเสนอขาย | PP (II&HNW) |
| ผู้จัดจำหน่าย/ผู้ค้ำ | บริษัทหลักทรัพย์ โกลเบล็ก จำกัด |
| นายทะเบียนหุ้นกู้ | บริษัทหลักทรัพย์ โกลเบล็ก จำกัด |
| อัตราผลตอบแทนสูงสุด/ต่ำสุด*อัตราผลตอบแทนสูงสุดร้อยละ[●] ต่ออายุตรา สาร / ขาดทุนสูงสุดร้อยละ[●] ต่ออายุตราสาร | ทั้งนี้ผลตอบแทนขึ้นอยู่กับราคาและความผัน ผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง ราคาที่ตกลงไว้ ล่วงหน้าสำหรับการซื้อขาย เงินชดเชยคุ้มครอง เงินต้นและอายุของตราสาร |
| การคุ้มครองเงินต้น | ไม่มี |
| ณ วันครบกำหนดอายุ | |
| * รายละเอียดเป็นไปตามใบเสนอราคาและข้อกำหนดสิทธิส่วนเพิ่มเกี่ยวกับราคา | |
| อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญของผู้ออก | |

| อัตราส่วนทางการเงิน (เท่า) | ค่าเฉลี่ย อุตสาหกรรม (ล่าสุด) | ปี 2566 | ปี 2565 | ปี 2564 |
|--|-------------------------------------|------------|------------|------------|
| เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิต่อหนี้สินทั่วไปและ ทรัพย์สินที่ต่อวางเป็นประกัน (NCR) ¹ (ร้อยละ) | ไม่มีข้อมูล | 80.87 | 93.41 | 71.22 |
| อัตราส่วนสภาพคล่อง (Current ratio) ⁴ (เท่า) | ไม่มีข้อมูล | 1.04 | 1.07 | 1.16 |
| อัตราส่วนความสามารถในการชำระดอกเบี้ย (ICR) ⁴ (เท่า) | ไม่มีข้อมูล | 2.65 | 5.18 | 9.50 |
| หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อกำไรก่อนดอกเบี้ยจ่าย ภาษีเงินได้ ค่าเสื่อมราคา และค่าตัดจำหน่าย (Interest bearing debt to EBITDA ratio) ⁴ (เท่า) | ไม่มีข้อมูล | 7.17 | 2.99 | 2.09 |
| อัตราส่วนความสามารถในการชำระภาระผูกพัน (DSCR) ⁴ (เท่า) | ไม่มีข้อมูล | 0.14 | 0.33 | 0.48 |
| อัตราส่วนหนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยต่อส่วนผู้ถือหุ้นรวม (Interest bearing debt to equity :IBD/E ratio) ⁴ (เท่า) | ไม่มีข้อมูล | 0.61 | 0.32 | 0.43 |
| หนี้สินรวมต่อส่วนของผู้ถือหุ้นรวม (Debt to equity : D/E ratio) ² (เท่า) | ไม่มีข้อมูล | 1.16 | 0.98 | 1.45 |
| อัตราผลตอบแทนจากสินทรัพย์ (ROA) ³ (ร้อยละ) | ไม่มีข้อมูล | 3.78 | 4.60 | 8.81 |

¹ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงฐานะความมั่นคงทางการเงินมาก

²ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงหนี้สินที่สูง

³ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการทำกำไรสูง

⁴ยิ่งสูงยิ่งแสดงถึงความสามารถในการชำระหนี้ที่สูง

ระดับความเสี่ยง

(พิจารณาจากอายุตราสารและอันดับความน่าเชื่อถือ)



การชำระเงินต้นและดอกเบี้ยขึ้นอยู่กับปัจจัยอ้างอิง

ผลตอบแทนของตราสารรุ่นอื่นในตลาด (YTM)

ไม่มีข้อมูล

ความเสี่ยงของผู้ออก

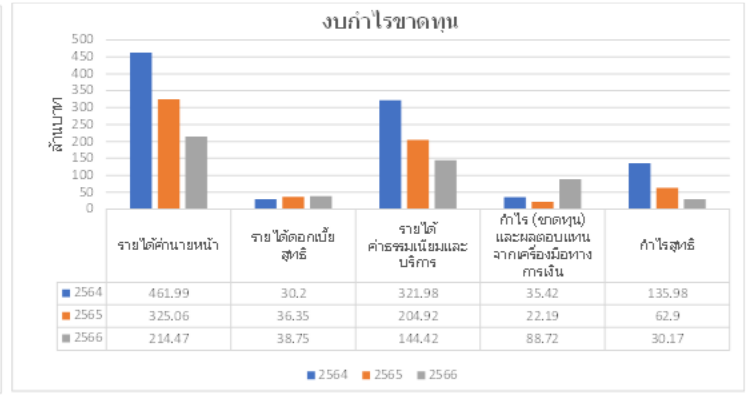
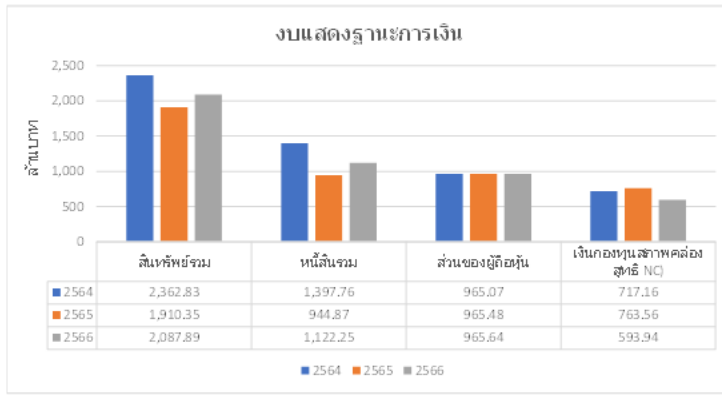
- ความเสี่ยงด้านความผันผวนของตลาดหลักทรัพย์และภาวะเศรษฐกิจโดยรวม
บริษัทมีรายได้หลักจากการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และ
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งขึ้นอยู่กับ ภาวะเศรษฐกิจ ตลาดเงิน และ
ตลาดทุน จนอาจส่งผลกระทบต่อมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์และ
ตราสารอนุพันธ์ทำให้รายได้ของบริษัทมีความผันผวน
- ความเสี่ยงด้านบุคลากร
บริษัทมีความเสี่ยงต่อการโยกย้ายของบุคลากรทางด้านการตลาด อัน
จะส่งผลกระทบต่อผลการดำเนินงานธุรกิจ
- ความเสี่ยงจากการผันผวนของราคาหุ้นกู้
จากสถานะตลาดหลักทรัพย์ในปีที่ผ่านมา ดัชนีตลาดหลักทรัพย์มี
การเปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นหรือลดลงส่งผลต่อปริมาณการซื้อขาย
หลักทรัพย์ของบริษัทหลักทรัพย์ฯ เช่นกัน และอาจประสบปัญหาบาง
ช่วงเวลาในเรื่องของการชำระเงินล่าช้า
- ความเสี่ยงด้านเครดิตของบริษัทในฐานะผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง
นักลงทุนที่ลงทุนในหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอาจมีความเสี่ยงด้านเครดิต
จากการที่บริษัทในฐานะผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไม่สามารถชำระ
คืนเงินต้นพร้อมทั้งอัตราดอกเบี้ยได้เต็มจำนวน และ/หรือไถ่ถอนตาม
กำหนดเวลา หรือไม่สามารถส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงได้ในจำนวนที่
ไถ่ถอนได้ หรือไม่สามารถปฏิบัติตามข้อกำหนดสิทธิ และ/หรือ
ข้อกำหนดเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

ทั้งนี้ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดเกี่ยวกับความเสี่ยงซึ่งประกอบด้วย
ความเสี่ยงของผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและความเสี่ยงของ หุ้นกู้ที่มี
อนุพันธ์แฝงเพิ่มเติมได้ใน ข้อ 2 หน้าที่ 4 ของส่วนที่ 3 ของหนังสือชี้ชวน

ข้อกำหนดในการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

ไม่มีข้อกำหนดเรื่องการดำรงอัตราส่วนทางการเงิน

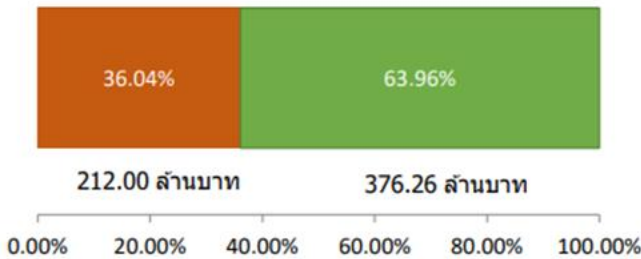
สรุปฐานะการเงินและผลการดำเนินงานตามงบการเงินรวมย้อนหลัง 2 ปีและตั้งแต่ไตรมาส 1 ถึงไตรมาสล่าสุดหรือเท่าที่มีผลการดำเนินงานจริง



สัดส่วนหนี้ที่มีภาระดอกเบี้ยของผู้ถือหุ้น

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2566

■ เงินกู้ยืมสถาบันการเงิน ■ หนี้กู้ ■ อื่นๆ



ลำดับการได้รับชำระหนี้

เมื่อผู้ออกถูกพิทักษ์ทรัพย์ ถูกศาลพิพากษาให้ล้มละลาย หรือมีการชำระบัญชีเพื่อการเลิกบริษัท



ลักษณะพิเศษและความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเพียงครั้งเดียวในวันครบกำหนดหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงหรือวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนด (Knock-out Event Settlement Date) ทั้งนี้ ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะไถ่ถอนโดยชำระตามเงื่อนไขที่กำหนดในข้อ 39

1. กรณีที่เกิดเหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดอายุ (Knock-out Event)

ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระราคาด้วยเงินให้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดอายุ (Knock-out Event Settlement Date) ดังนี้

- จำนวนร้อยละหนึ่งร้อย (100) ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ
- ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงสำหรับงวดที่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดอายุ เป็นจำนวนเท่ากับจำนวนที่คำนวณได้จากหลักเกณฑ์การคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 26 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้

2. กรณีที่ไม่เกิดเหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดอายุ (No Knock-out Event) จนถึงวันกำหนดค่าหลักทรัพย์

2.1 กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Knock-in Event) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระราคาด้วยเงินให้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนี้

- จำนวนร้อยละหนึ่งร้อย (100) ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง และ
- ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้าย เป็นจำนวนเท่ากับจำนวนที่คำนวณได้จากหลักเกณฑ์การคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 26 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้

2.2 กรณีที่เกิดเหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event)

- ก. หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price) **มากกว่าหรือเท่ากับราคาใช้สิทธิ (Strike Price)** ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยชำระราคาด้วยเงินให้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนี้
- (1) จำนวนร้อยละหนึ่งร้อย (100) ของมูลค่าที่ตราไว้ของหุ้นกู้ที่มี อนุพันธ์แฝง และ
 - (2) ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้าย เป็นจำนวนเท่ากับจำนวนที่คำนวณได้จากหลักเกณฑ์การคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 26 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้
- ข. หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price) **ต่ำกว่าราคาใช้สิทธิ (Strike Price)** ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงให้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนี้
- (1) ส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงตามจำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่จะส่งมอบ และ
 - (2) ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้าย เป็นจำนวนเท่ากับจำนวนที่คำนวณได้จากหลักเกณฑ์การคำนวณที่กำหนดไว้ในข้อ 26 ของข้อกำหนดสิทธิเพิ่มเติมเกี่ยวกับราคาของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงนี้ และเงินสดส่วนที่เหลือเพื่อการชำระราคา(ถ้ามี)

ตัวอย่าง

| | |
|---|--|
| หลักทรัพย์อ้างอิง | หุ้นสามัญของบริษัท ABC |
| ราคาปัจจุบันหลักทรัพย์อ้างอิง | 100.00 บาท |
| ราคาใช้สิทธิ | 98.00 บาท [(98%) ของราคาปัจจุบันหลักทรัพย์อ้างอิง] |
| ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนก่อนครบกำหนด (Knock-out Price) | 102.00 บาท [(102%) ของราคาปัจจุบันหลักทรัพย์อ้างอิง] |
| ราคาเพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอน (Knock-in Price) | 80.00 บาท [(80%) ของราคาปัจจุบันหลักทรัพย์อ้างอิง] |
| อายุของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง | 180 วัน |
| มูลค่าที่ตราไว้ | 10,000,000 บาท |
| ราคาเสนอขาย | ร้อยละ 100.00 ของมูลค่าที่ตราไว้ |
| จำนวนเงินที่ต้องชำระ | 10,000,000 บาท |
| จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่จะส่งมอบ | 101,900 หุ้น [$10,000,000 / (98 \times (1 + 0.0011449))$] [มูลค่าที่ตราไว้ / (ราคาใช้สิทธิ \times (1+ อัตราดอกเบี้ยจ่ายในการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง*(ถ้ามี)))] |
| เงินสดส่วนที่เหลือเพื่อการชำระราคา(ถ้ามี) | 2,366.80 บาท [$10,000,000 - (98 \times 101,900) - ((98 \times 101,900) \times 0.0011449)$] [มูลค่าที่ตราไว้ - (จำนวนหลักทรัพย์อ้างอิงที่จะส่งมอบ \times ราคาใช้สิทธิ) - ค่าใช้จ่ายในการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิง(ถ้ามี)] |
| อัตราดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนภาษี | คงที่ร้อยละ 8.00 ต่อปี |
| ดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง | จ่ายดอกเบี้ยงวด 65,753.42 บาท จำนวน 6 งวด (สมมติให้ 1 งวดมี 30 วัน) [$10,000,000 \times 8\% \times 30/365$] |

* อัตราดอกเบี้ยจ่ายในการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงรวมภาษีมูลค่าเพิ่มตามประกาศของบริษัท

ผู้จองซื้อหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงชำระค่าหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นเงิน 10,000,000 บาท โดยใช้ราคาปัจจุบันหลักทรัพย์อ้างอิงที่ราคา 100 บาท เพื่อกำหนดราคาใช้สิทธิเท่ากับ 98 บาท [ราคาใช้สิทธิ (98%) ของราคาปัจจุบันหลักทรัพย์อ้างอิง] ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนก่อนครบกำหนด(Knock-out Price) เท่ากับ 102 บาท [(102%) ของราคาปัจจุบันหลักทรัพย์อ้างอิง] และราคาเพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอน (Knock-in Price) เท่ากับ 80 บาท[(80%) ของราคาปัจจุบันหลักทรัพย์อ้างอิง]

1. กรณีที่เกิดเหตุการณ์ไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดอายุ (Knock-out Event)

กรณีที่ ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนกำหนด (Knock-out Event Observation Date) ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงมีราคา**มากกว่าหรือเท่ากับ**ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนก่อนครบกำหนด (Knock-out Price) เช่น ในวันที่ Knock-out Event Observation Date ของงวดที่ 1 ราคาหุ้น ABC มากกว่าหรือเท่ากับ Knock-out Price ที่กำหนดไว้ 102 บาท ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระราคาด้วยเงินจำนวน 10,000,000 บาท และดอกเบี้ยงวดที่ 1 จำนวน 65,753.42 บาท ให้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนกำหนด (Knock-out Event Settlement Date) ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับผลตอบแทนร้อยละ 0.66 ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง 30 วัน $[(65,753.42)/10,000,000]$

2. กรณีที่ไม่เกิดเหตุแห่งการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนครบกำหนดอายุ (No Knock-out Event) จนถึงวันกำหนดค่าหลักทรัพย์

กรณีที่ ณ วันที่เตรียมไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงก่อนกำหนด (Knock-out Event Observation Date) ใด ๆ ราคาหลักทรัพย์อ้างอิงมีราคา**น้อยกว่า**ราคาเพื่อเตรียมไถ่ถอนก่อนครบกำหนด (Knock-out Price) ซึ่งสามารถแบ่งได้ 2 กรณีดังนี้

2.1 กรณีที่**ไม่เกิด**เหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (No Knock-in Event) กล่าวคือ กรณีที่ ณ วันประเมินมูลค่าหลักทรัพย์เพื่อกำหนดวิธีไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event Observation Date) ใด ๆ ราคาหลักทรัพย์อ้างอิง**มากกว่าหรือเท่ากับ**ราคาเพื่อกำหนดวิธีการไถ่ถอน (Knock-in Price) เช่น ในวันที่ Knock-in Event Observation Date ใด ๆ ราคาหุ้น ABC มากกว่าหรือเท่ากับ Knock-in Price ที่กำหนดไว้ 80 บาท ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง โดยการชำระราคาด้วยเงินจำนวน 10,000,000 บาทและดอกเบี้ยทั้งหมด 6 จำนวน 394,520.52 บาท ให้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับผลตอบแทนร้อยละ 3.95 ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง 180 วัน $[(394,520.52)/10,000,000]$

2.2 กรณีที่**เกิด**เหตุแห่งการเปลี่ยนแปลงวิธีการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (Knock-in Event) กล่าวคือ กรณีที่ ณ วัน Knock-in Event Observation Date ใด ๆ เคยเกิดเหตุการณ์ที่ ราคาหุ้น ABC น้อยกว่า Knock-in Price ที่กำหนดไว้ 80 บาท ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนี้

ก. หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price) ปิดที่ราคา 100 บาทซึ่ง**มากกว่าหรือเท่ากับราคาใช้สิทธิ** (Strike Price) ที่กำหนดไว้ 98 บาท ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้าย โดยชำระราคาด้วยเงินจำนวน 10,065,753.42 บาท $[10,000,000 + 65,753.42]$ ให้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นเมื่อรวมดอกเบี้ยที่ได้รับตลอดอายุตราสารและมูลค่ารวมที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ทำการไถ่ถอนในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับผลตอบแทนร้อยละ 3.95 ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง 180 วัน $[(394,520.52)/10,000,000]$

ข. หากราคาหลักทรัพย์อ้างอิงสุดท้าย (Final Security Price) ปิดที่ 95 บาท **ซึ่งต่ำกว่าราคาใช้สิทธิ** (Strike Price) ที่กำหนดไว้ 98 บาท ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะทำการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงโดยการส่งมอบหลักทรัพย์อ้างอิงจำนวน 101,900 หุ้นและเงินสดส่วนที่เหลือเพื่อการชำระราคาจำนวน 2,366.80 บาท และชำระเงินค่าดอกเบี้ยหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงงวดสุดท้ายจำนวน 65,753.42 บาท คิดเป็นมูลค่ารวม 9,748,620.22 บาท $[(101,900 \times 95) + 2,366.80 + 65,753.42]$ ให้กับผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ดังนั้นเมื่อรวมดอกเบี้ยที่ได้รับตลอดอายุตราสารและมูลค่ารวมที่ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้ทำการไถ่ถอนในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงได้รับผลตอบแทนร้อยละ 0.77 ต่ออายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

$[(65,753.42 + 65,753.42 + 65,753.42 + 65,753.42 + 65,753.42 + 9,748,620.22 - 10,000,000)/10,000,000]$

การเป็นบุคคลภายใน

- ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่เป็นบุคคลภายในของบริษัทที่ออกหุ้นอ้างอิง

ความเสี่ยงสำคัญของตราสาร

1. หุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีสภาพคล่องต่ำ และมีตลาดรองจำกัด ทำให้ผู้ลงทุนอาจซื้อขายได้ไม่สะดวก
2. ผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนทั้งหมด หรือบางส่วน หากหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงไม่มีการคุ้มครองเงินต้น หรือคุ้มครองเงินต้นต่ำกว่า 100% ของเงินลงทุน
3. หุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงเป็นตราสารที่มีความซับซ้อนมากกว่าหุ้นหรือตราสารหนี้ทั่วไป เนื่องจากมีส่วนที่เป็นตราสารอนุพันธ์ (derivatives) ซึ่งจะมีความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องหลายด้าน เช่น ความเสี่ยงของปัจจัยอ้างอิง ความเสี่ยงด้านเครดิตของผู้ออกตราสาร เป็นต้น ซึ่งผู้ลงทุนจะต้องศึกษาและทำความเข้าใจรายละเอียดอย่างถี่ถ้วนก่อนตัดสินใจลงทุน
4. การลงทุนในตราสารหนี้ไม่ใช่การฝากเงิน ผู้ลงทุนต้องพิจารณาความสามารถในการชำระคืนของผู้ออกอย่างรอบคอบ
5. เงื่อนไขการจ่ายผลตอบแทนและเงินต้นอ้างอิงกับปัจจัยต่าง ๆ และผู้ลงทุนมีความเสี่ยงที่จะสูญเสียเงินลงทุนหากไม่มีการคุ้มครองเงินต้น
6. ความเสี่ยงจากการนำเงินไปลงทุนต่อ (Reinvestment Risk) เกิดขึ้นในกรณีที่นักลงทุนได้รับเงินต้นหรือผลตอบแทนแล้วนำไปลงทุนต่อได้ผลตอบแทนต่ำลง เนื่องจากหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงในแต่ละรุ่น ให้ผลตอบแทนที่แตกต่างกันซึ่งอาจเกิดจากประเภทหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง หลักทรัพย์อ้างอิงอิง ความผันผวนของหลักทรัพย์อ้างอิง อายุคงเหลือของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง ดอกเบี้ย เป็นต้น ทำให้นักลงทุนเกิดความเสี่ยงในการนำเงินไปลงทุนต่อในผลตอบแทนที่ลดลง
7. บริษัทหลักทรัพย์ โกลเบล็ก จำกัด จะทำหน้าที่เป็นตัวแทนคำนวณเงิน (Calculation Agent) ซึ่งจะมีดุลยพินิจอันเด็ดขาดแต่เพียงผู้เดียวในการ (1) พิจารณาว่ามีเหตุการณ์ตามที่ระบุไว้ในข้อกำหนดสิทธิเกิดขึ้นหรือไม่ และ (2) พิจารณาดำเนินการปรับเปลี่ยนและ/หรือ ทำการคำนวณใด ๆ ที่เป็นผลจากเหตุการณ์เหล่านั้นตามที่กำหนดไว้ในข้อกำหนดสิทธิ ผู้ประสงค์ที่จะลงทุนควรตระหนักว่า การพิจารณาและดำเนินการใด ๆ โดยตัวแทนคำนวณเงิน (Calculation Agent) นั้นอาจมีผลกระทบต่อมูลค่าและผลตอบแทนทางการเงินของหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝง
8. ผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงอาจจะเสนอขายหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงหลายชุด ซึ่งหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงแต่ละชุดจะมีอายุแตกต่างกันและมีความเสี่ยงไม่เท่ากัน ซึ่งโดยทั่วไปหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงที่มีอายุมากกว่าจะมีความเสี่ยงสูงกว่า

ผู้ลงทุนสามารถศึกษารายละเอียดเกี่ยวกับความเสี่ยงเพิ่มเติมได้ที่ส่วนที่ 3 ข้อมูลเกี่ยวกับผู้ออกหุ้นที่มีอนุพันธ์แฝงในแบบ Filing หัวข้อที่ 2

คำเตือนและข้อมูลแจ้งเดือนอื่น

- การอนุมัติจากสำนักงาน ก.ล.ด. ไม่ได้หมายความว่าแนะนำให้ลงทุน ประกันการชำระหนี้ ผลตอบแทน เงินต้น หรือรับรองความถูกต้องของข้อมูล
- ข้อมูลสรุปนี้เป็นส่วนหนึ่งของหนังสือชี้ชวน (filing) ซึ่งเป็นเพียงข้อมูลสรุปเกี่ยวกับการเสนอขาย ลักษณะและความเสี่ยงของหลักทรัพย์และบริษัท ที่ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ ดังนั้น ผู้ลงทุนต้องวิเคราะห์ความเสี่ยงและศึกษาข้อมูลจากหนังสือชี้ชวน (filing)

ประวัติการผิดนัดชำระหนี้

ไม่มี มี การผิดนัดชำระหนี้ดอกเบี้ยหรือเงินต้นของตราสารหนี้ หรือผิดนัดการชำระหนี้เงินกู้ยืมจากธนาคารพาณิชย์ บริษัทเงินทุน บริษัทเครดิตฟองซิเอร์ หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นโดยดูประวัติย้อนหลัง 3 ปี จากบริษัทข้อมูลเครดิตแห่งชาติและงบการเงินที่ตรวจสอบโดยผู้สอบบัญชีรับอนุญาต

ความขัดแย้งทางผลประโยชน์

- บริษัทหลักทรัพย์ โกลเบล็ก จำกัด ทำหน้าที่เป็นผู้จัดจำหน่ายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงและตัวแทนค่านวนเงิน