

ใบแจ้งการเกิดเหตุการณ์ของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง / Knock-Out Notification

เรียน     

หมายเลขโทรศัพท์ 02-3199600-2

อีเมล anothai@thespi.com

หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้

| | | |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| สัญลักษณ์ของตราสาร | : | KKP21715U |
| ชื่อตราสาร | : | หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งเปลี่ยนมือไม่ได้และมีการไถ่ถอนอ้างอิงกับ SPY ที่ออกโดยธนาคารเกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน) ชุดที่ 105/2564 อายุ 31 วัน ครบกำหนดไถ่ถอนปี พ.ศ. 2564 |
| ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง | : | ธนาคารเกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน) |
| หลักทรัพย์อ้างอิง | : | SPY |
| วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง | : | 11 มิถุนายน 2564 |
| วันออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง | : | 14 มิถุนายน 2564 |
| ช่วงวันกำหนดค่าปัจจัยอ้างอิง (Observation Period) | : | 14 มิถุนายน 2564 ถึง 12 กรกฎาคม 2564 |
| วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง | : | 15 กรกฎาคม 2564 |
| วันที่เกิดเหตุการณ์ Knock-Out | : | 8 กรกฎาคม 2564 |
| มูลค่าที่ตราไว้ (บาท: 1 หน่วย) * | : | 1,000,000.00 |
| มูลค่าที่ตราไว้ทั้งหมด (บาท) | : | 5,000,000.00 |
| ราคาปัจจัยอ้างอิง ณ วันตกลงทำธุรกรรม (Initial Price) | : | 400 USD |
| ราคาใช้สิทธิ (Strike Price) | : | 400 USD |
| ราคาหลักทรัพย์เพื่อเตรียมไถ่ถอน (Barrier Price) | : | 460.00 USD |
| Knock-Out Price | : | 500.00 USD |
| ระดับการคุ้มครองเงินต้น | : | 100.00 % |
| อัตราการใช้สิทธิ (Participation Rate) | : | 50.00 % |
| อัตราผลตอบแทนเงินคืน (Rebate) | : | 0.0000 % |
| อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง | : | 32.00 THB/USD |
| อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันกำหนดค่าหลักทรัพย์วันสุดท้าย | : | 0.00 THB/USD |
| หลักเกณฑ์การไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง | : | ภายในวันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระเงินต้นและผลตอบแทนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง (ถ้ามี) เป็นเงินบาทให้แก่ผู้ถือหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง ซึ่งผลตอบแทนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงที่ผู้ถือจะได้รับสามารถแบ่งเป็น 2 กรณี ดังนี้ |
| กรณีที่ 1 ณ สิ้นวันทำการวันใดวันหนึ่งตั้งแต่วันกำหนดราคาปัจจัยอ้างอิงวันแรกถึงวันกำหนดราคาปัจจัยอ้างอิงวันสุดท้าย ราคาปัจจัยอ้างอิงสูงกว่าราคาปัจจัยอ้างอิงเพื่อเตรียมไถ่ถอน (Barrier Price) ณ เวลากำหนดราคาปัจจัยอ้างอิง (เกิดเหตุการณ์ Knock-Out) ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระคืน | | |
| (ก) เงินต้นเท่ากับ มูลค่าที่ตราไว้ x ระดับการคุ้มครองเงินต้น และ | | |
| (ข) ผลตอบแทนเท่ากับ มูลค่าที่ตราไว้ x Rebate x (อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันกำหนดค่าปัจจัยอ้างอิงวันสุดท้าย / อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันตกลงซื้อขาย) | | |
| กรณีที่ 2 หากไม่มีเหตุการณ์ Knock-Out การชำระคืนเงินต้นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะเป็น ดังนี้ | | |
| (2.1) หากค่าปัจจัยอ้างอิง ณ วันกำหนดค่าปัจจัยอ้างอิงวันสุดท้าย สูงกว่า Strike Price ผู้ออกหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงจะชำระคืน | | |
| (ก) เงินต้นเท่ากับมูลค่าที่ตราไว้ x ระดับการคุ้มครองเงินต้น และ | | |
| (ข) ผลตอบแทนเท่ากับ [มูลค่าที่ตราไว้ x อัตราการมีส่วนร่วมในผลตอบแทน x ((ค่าปัจจัยอ้างอิง ณ วันกำหนดค่าปัจจัยอ้างอิงวันสุดท้าย - ราคาใช้สิทธิ) / ราคาปัจจัยอ้างอิง ณ วันตกลงทำธุรกรรม) x (อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันกำหนดค่าปัจจัยอ้างอิงวันสุดท้าย / อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่ทำการตกลงซื้อขายหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง)] | | |

หมายเหตุ:

(ก) ราคาทั้งหมดจะกำหนดตามเงื่อนไขสองตำแหน่ง (ถ้าตำแหน่งที่สามมีค่ามากกว่าหรือเท่ากับห้า ให้ทำการปัดเศษนิยมตำแหน่งที่สองขึ้นหนึ่งตำแหน่ง)

(ข) หากพบข้อผิดพลาด มีข้อสงสัย หรือข้อเสนอนะ กรุณาติดต่อผู้ออกหุ้นกู้มีอนุพันธ์ หมายเลขโทรศัพท์ (662) 495-1679

* มูลค่าที่ตราไว้ใหม่มูลค่าที่ใช้ในการไถ่ถอนหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง แต่มีไว้เพื่อใช้ในการคำนวณผลประโยชน์ที่ได้รับ ณ วันครบกำหนดอายุหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง / วันชำระราคาหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง

(ค) ธนาคารจะแจ้งรายละเอียดยืนยันการไถ่ถอนให้ผู้ลงทุนทราบอีกครั้งเมื่อได้ทำการกำหนดอัตราแลกเปลี่ยน ณ วันกำหนดค่าปัจจัยอ้างอิงวันสุดท้าย เพื่อใช้ในการคำนวณการชำระเงิน

ลงชื่อ

(นางจารุณี เกียรติสุระยานนท์)

ในฐานะผู้รับมอบอำนาจ/ผู้มีอำนาจลงนามแทนของ

ธนาคารเกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน)