

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน  
ที่ ทจ. 32/2556  
เรื่อง การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์  
(ฉบับที่ 4)

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 16/6 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 และมาตรา 35 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 อันเป็นพระราชบัญญัติที่มีบทบัญญัติบางประการเกี่ยวกับการจำกัดสิทธิและเสรีภาพของบุคคล ซึ่งมาตรา 29 ประกอบกับมาตรา 33 มาตรา 34 มาตรา 41 มาตรา 43 มาตรา 44 และมาตรา 64 ของรัฐธรรมนูญแห่งราชอาณาจักรไทย บัญญัติให้กระทำได้โดยอาศัยอำนาจตามบทบัญญัติแห่งกฎหมาย คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกความในข้อ 8 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 15/2553 เรื่อง การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ลงวันที่ 1 เมษายน พ.ศ. 2553 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 8 หลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ตามประกาศนี้ ต้องเป็นกรณีใดกรณีหนึ่งดังต่อไปนี้

- (1) หุ้นหรือกลุ่มหุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET 50
- (2) หุ้นหรือกลุ่มหุ้นที่เป็นองค์ประกอบของดัชนีหลักทรัพย์ SET 100 โดยหุ้นในลำดับที่ 51 ถึง 100 แต่ละหุ้นต้องมีมูลค่าตลาดเฉลี่ยแต่ละไตรมาสไม่ต่ำกว่าหนึ่งหมื่นล้านบาทรวมติดต่อกันสี่ไตรมาสล่าสุด เว้นแต่เป็นการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เพิ่มเติมที่เป็นประเภทและชนิดเดียวกัน รวมทั้งแทนกันได้กับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่เคยออกไปก่อนหน้านี้และยังไม่ครบกำหนดอายุ ไม่ต้องนำหลักเกณฑ์มูลค่าตลาดเฉลี่ยดังกล่าวมาใช้บังคับ
- (3) ดัชนีหลักทรัพย์ดังต่อไปนี้ซึ่งเป็นดัชนีหลักทรัพย์ของหุ้นในตลาดหลักทรัพย์ที่เผยแพร่โดยตลาดหลักทรัพย์  
(ก) ดัชนีหลักทรัพย์ SET Index ดัชนีหลักทรัพย์ SET 50 หรือดัชนีหลักทรัพย์ SET 100 หรือ

(ข) คำนี้อัตราหลักทรัพย์อื่นที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนดให้ใช้เป็นอัตราอ้างอิงของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้ตามข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยว่าด้วยการรับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน

(4) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีนโยบายสร้างผลตอบแทนตามความเคลื่อนไหวของราคากลุ่มหุ้นตาม (1) หรือ (2) หรือคำนี้อัตราหลักทรัพย์ตาม (3)

กองทุนรวมอีทีเอฟตามวรรคหนึ่ง หมายถึง กองทุนรวมเปิดที่โดยทั่วไปบริษัทจัดการกองทุนรวมจะขายและรับซื้อคืนหน่วยลงทุนกับผู้ลงทุนรายใหญ่ และจัดให้มีตลาดรอง (organized market) สำหรับการซื้อขายหน่วยลงทุนของผู้ลงทุนใด ๆ ทั้งนี้ ตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการจัดตั้งกองทุนรวมและการเข้าทำสัญญาบริหารจัดการกองทุนส่วนบุคคล

(5) หลักทรัพย์หรือกลุ่มหลักทรัพย์อื่นใดตามที่สำนักงานประกาศกำหนด”

ข้อ 2 ให้ยกเลิกความในข้อ 15 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทจ. 15/2553 เรื่อง การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ลงวันที่ 1 เมษายน พ.ศ. 2553 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 15 ในกรณีที่ปรากฏต่อสำนักงานภายหลังการอนุญาตให้เสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ว่าข้อเท็จจริงและพฤติการณ์ที่สำนักงานนำมาพิจารณาเพื่ออนุญาตให้เสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เปลี่ยนแปลงไป ซึ่งหากข้อเท็จจริงและพฤติการณ์ที่เปลี่ยนแปลงไปนั้นปรากฏต่อสำนักงานก่อนการอนุญาต สำนักงานอาจไม่อนุญาตให้เสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น ให้สำนักงานมีอำนาจดังต่อไปนี้

(1) สั่งให้ผู้ได้รับอนุญาต กรรมการ หรือผู้บริหารของผู้ได้รับอนุญาต ชี้แจงหรือเปิดเผยข้อมูลเพิ่มเติมภายในระยะเวลาที่กำหนด และระงับการอนุญาตให้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือให้ผู้ได้รับอนุญาตระงับการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ไว้ก่อนจนกว่าจะได้ชี้แจงหรือแก้ไขให้ถูกต้อง และหากผู้ได้รับอนุญาต กรรมการ หรือผู้บริหารของผู้ได้รับอนุญาต ไม่สามารถชี้แจงหรือดำเนินการแก้ไขให้ถูกต้องได้ภายในระยะเวลาที่กำหนด สำนักงานอาจสั่งเพิกถอนการอนุญาตตาม (2) ได้

(2) สั่งเพิกถอนการอนุญาตให้เสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในส่วนที่ยังมิได้เสนอขายหรือยังไม่มีผู้จองซื้อ

ในการสั่งการตามวรรคหนึ่งให้สำนักงานค่านึงถึงปัจจัยดังต่อไปนี้ประกอบการพิจารณา

- (1) ความร้ายแรงของข้อเท็จจริงหรือพฤติกรรมที่เปลี่ยนแปลงไป
- (2) ผลกระทบต่อผู้ลงทุนที่อาจซื้อใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น”

ข้อ 3 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม พ.ศ. 2556 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 12 กรกฎาคม พ.ศ. 2556

(นายวรพล โสคติยานุรักษ์)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน