



สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สจ. 19 /2556

เรื่อง ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือใบสำคัญ

แสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

(ฉบับที่ 2)

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 11 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน
ที่ ทจ. 15/2553 เรื่อง การออกและการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ลงวันที่ 1 เมษายน
พ.ศ. 2553 สำนักงานออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น (4) ของข้อ 4 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการ
กำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สจ. 17/2553 เรื่อง ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของ
ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ลงวันที่ 13 พฤษภาคม พ.ศ. 2553

“(4) ในกรณีเป็นการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีหลักทรัพย์อ้างอิง
เป็นหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ ให้ระบุเกี่ยวกับการพิจารณาการใช้สิทธิ โดยให้ใช้ราคาใช้สิทธิ
ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าวเทียบกับมูลค่าหน่วยลงทุน ณ สิ้นวันทำการซื้อขายสุดท้าย
ของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น เมื่อปรากฏว่าราคาปิดของหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ
ที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ สิ้นวันทำการซื้อขายสุดท้ายของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าว
มีความแตกต่างจากมูลค่าของหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ ณ สิ้นวันเดียวกันนั้นอย่างมีนัยสำคัญ
ทั้งนี้ แนวทางการพิจารณาความแตกต่างอย่างมีนัยสำคัญดังกล่าวให้เป็นไปตามที่สมาคมกำหนด

คำว่า “สมาคม” ตามวรรคหนึ่งให้หมายความถึง สมาคมที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจ
หลักทรัพย์ที่ได้รับอนุญาตให้จัดตั้งและจดทะเบียนกับสำนักงาน โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อทำการส่งเสริม
และพัฒนาธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทที่เกี่ยวกับการจัดการลงทุน”

ข้อ 2 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 สิงหาคม พ.ศ. 2556

เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 12 กรกฎาคม พ.ศ. 2556

(นายวรพล โสคติยานุรักษ์)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์