



## สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สจ. 36 /2557

เรื่อง ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือใบสำคัญ  
แสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์  
(ฉบับที่ 3 )

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

ข้อ 1 ให้ยกเลิกความใน (4) ของข้อ 4 แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการ  
กำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สจ. 17/2553 เรื่อง ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่  
ของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ลงวันที่ 13 พฤษภาคม  
พ.ศ. 2553 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์  
ที่ สจ. 19/2556 เรื่อง ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และ  
ผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 12 กรกฎาคม พ.ศ. 2556 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“(4) ในกรณีเป็นการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีหลักทรัพย์อ้างอิง  
เป็นหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ ให้ระบุเกี่ยวกับการพิจารณาการใช้สิทธิ โดยให้ใช้ราคาใช้สิทธิ  
ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าวเทียบกับมูลค่าหน่วยลงทุน ณ สิ้นวันทำการซื้อขายสุดท้ายของ  
ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น เมื่อปรากฏว่าราคาปิดของหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่ซื้อขาย  
ในตลาดหลักทรัพย์ ณ สิ้นวันทำการซื้อขายสุดท้ายของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าวมีความแตกต่าง  
จากมูลค่าของหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ ณ สิ้นวันเดียวกันนั้นอย่างมีนัยสำคัญ ทั้งนี้ แนวทาง  
การพิจารณาความแตกต่างอย่างมีนัยสำคัญดังกล่าวให้เป็นไปตามที่สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยกำหนด”

ข้อ 2 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 16 ธันวาคม พ.ศ. 2557 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 11 พฤศจิกายน พ.ศ. 2557

(นายวรพล ไสคติยานุรักษ์)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์