

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สจ. 17/2553

เรื่อง ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือใบสำคัญ

แสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

(ฉบับประมวล)

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

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“ข้อกำหนดสิทธิ” หมายความว่า ข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือใบสำคัญ
แสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

ข้อ 2 ร่างข้อกำหนดสิทธิของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะต้องมีความชัดเจนและ
ไม่มีข้อกำหนดที่เป็นการเอาเปรียบคู่สัญญาอย่างไม่เป็นธรรม โดยต้องมีรายละเอียดของรายการทั่วไป
ตามข้อ 3 และรายละเอียดของรายการเฉพาะกรณีตามข้อ 4

ข้อ 3 ร่างข้อกำหนดสิทธิต้องมีรายละเอียดของรายการทั่วไปอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) รายละเอียดเกี่ยวกับผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
- (2) วันเริ่มและวันสิ้นสุดการมีผลใช้บังคับของข้อกำหนดสิทธิ
- (3) กฎหมายที่ใช้บังคับกับข้อกำหนดสิทธิซึ่งกำหนดให้ใช้กฎหมายไทย
- (4) ลักษณะสำคัญของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
- (5) สิทธิและเงื่อนไขตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
- (6) วิธีการใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ซึ่งรวมถึงกำหนดเวลาการใช้สิทธิ

การปรับอัตราและราคาการใช้สิทธิ

(7) วิธีการจัดทำทะเบียนผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และการลงทะเบียนการโอน
ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

(8) หน้าที่ของบริษัทที่ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์

(9) เหตุผิคนัด และผลของการผิดข้อกำหนดหรือเงื่อนไขในข้อกำหนดสิทธิ

- (10) การแก้ไขเปลี่ยนแปลงข้อกำหนดสิทธิ
- (11) การประชุมผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
- (12) ตัวอย่างตราสารกำกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีรายการตามข้อ 5

ข้อ 4 ร่างข้อกำหนดสิทธิต้องมีรายละเอียดของรายการเฉพาะกรณีอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) ในกรณีเป็นการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีทรัพย์สินเป็นประกัน ไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน
 - (ก) รายละเอียดเกี่ยวกับทรัพย์สิน
 - (ข) รายละเอียดของหลักทรัพย์อ้างอิงที่โอนให้กับทรัพย์สิน ซึ่งต้องระบุถึงประเภท และจำนวนของหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าว
 - (ค) ขั้นตอน ระยะเวลา และเงื่อนไขในการโอนและถอนการโอนหลักทรัพย์อ้างอิง
 - (ง) อำนาจ หน้าที่ และความรับผิดชอบของทรัพย์สิน
 - (จ) การแต่งตั้งหรือการเปลี่ยนแปลงทรัพย์สิน
- (2) ในกรณีเป็นการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีผู้ค้ำประกันการชำระหนี้ หรือการระงับผูกพันตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
 - (ก) รายละเอียดเกี่ยวกับผู้ค้ำประกัน
 - (ข) เงื่อนไขของการค้ำประกัน
- (3) ในกรณีใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่เสนอขายเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ ให้ระบุรายละเอียดเกี่ยวกับการใช้สิทธิ หน้าที่ และเงื่อนไขอันเนื่องมาจากกรณีที่มีการเพิกถอนใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ออกจากความเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน
- (4)¹² ในกรณีเป็นการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่มีหลักทรัพย์อ้างอิงเป็นหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟ ให้ระบุเกี่ยวกับการพิจารณาการใช้สิทธิ โดยให้ใช้ราคาใช้สิทธิตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าวเทียบกับมูลค่าหน่วยลงทุน ณ สิ้นวันทำการซื้อขายสุดท้ายของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นั้น เมื่อปรากฏว่าราคาปิดของหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอิตีเอฟที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ ณ สิ้นวันทำการซื้อขายสุดท้ายของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าว

¹ ถูกเพิ่มโดยประกาศสำนักงาน ที่ สจ. 19/2556 เรื่อง ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (ฉบับที่ 2) ลงวันที่ 12 กรกฎาคม พ.ศ. 2556 มีผลใช้บังคับวันที่ 1 สิงหาคม 2556

² ถูกแก้ไขโดยประกาศสำนักงาน ที่ สจ. 36/2557 เรื่อง ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 11 พฤศจิกายน พ.ศ. 2557 มีผลใช้บังคับวันที่ 16 ธันวาคม 2557

มีความแตกต่างจากมูลค่าของหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ ณ สิ้นวันเดียวกันนั้นอย่างมีนัยสำคัญ ทั้งนี้ แนวทางการพิจารณาความแตกต่างอย่างมีนัยสำคัญดังกล่าวให้เป็นไปตามที่บริษัทหลักทรัพย์ไทยกำหนด

ข้อ 5 ตราสารกำกับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ต้องมีรายการอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) ชื่อเฉพาะของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
- (2) ลักษณะของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
- (3) ชื่อของหลักทรัพย์อ้างอิงหรือดัชนีหลักทรัพย์อ้างอิง
- (4) ชื่อผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
- (5) จำนวนหน่วยตามสิทธิของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
- (6) ชื่อผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
- (7) เลขที่อ้างอิงของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ตามทะเบียนผู้ถือใบสำคัญ

แสดงสิทธิอนุพันธ์

- (8) วัน เดือน ปีที่ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และวัน เดือน ปีที่สิ้นสุดอายุของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์
- (9) ชื่อทรัสต์ (ถ้ามี)
- (10) ชื่อผู้รับประกันการชำระหนี้ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่เสนอขาย (ถ้ามี)
- (11) การชำระหนี้ของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์เมื่อมีการใช้สิทธิ

ตามใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ซึ่งต้องระบุอย่างชัดเจนว่าจะชำระหนี้โดยการส่งมอบเงินสดหรือหลักทรัพย์อ้างอิง

(12) มีข้อความที่ระบุว่าใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์นี้ออกตามข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ซึ่งผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้จัดทำขึ้นและถือเป็นข้อผูกพันระหว่างผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์กับผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ โดยผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์สามารถขอตรวจดูข้อกำหนดสิทธิดังกล่าวได้ในสถานที่ที่กำหนด

(13) ลายมือชื่อผู้มีอำนาจลงนามผูกพันของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์หรือนายทะเบียนหลักทรัพย์

ข้อ 6 ร่างข้อกำหนดสิทธิที่ยื่นมาพร้อมกับคำขออนุญาตเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ออกใหม่ จะไม่ระบุข้อมูลที่เกี่ยวกับตราสารและข้อมูลเฉพาะสำหรับการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในครั้งนั้นก็ได้ แต่ต้องยื่นข้อมูลดังกล่าวก่อนวันที่แบบแสดงรายการข้อมูลมีผลใช้บังคับ

ข้อ 7 ในกรณีที่ผู้ยื่นคำขออนุญาตเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ได้แสดงความประสงค์ที่จะใช้ข้อกำหนดสิทธิที่มีรายการและข้อมูลไม่ต่างจากร่างข้อกำหนดสิทธิมาตรฐานที่สำนักงานยอมรับ ให้ถือว่าผู้ยื่นคำขออนุญาตได้ยื่นร่างข้อกำหนดสิทธิมาพร้อมกับการยื่นคำขออนุญาตเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์แล้ว และให้ถือว่าร่างข้อกำหนดสิทธิดังกล่าวผ่านการพิจารณาของสำนักงานแล้ว

ข้อ 8 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 16 พฤษภาคม พ.ศ. 2553 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 13 พฤษภาคม พ.ศ. 2553

(นายธีระชัย ภูวนาถนรานุบาล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

หมายเหตุ : เหตุผลในการออกประกาศฉบับนี้ คือ เพื่อกำหนดรายการและสาระสำคัญอย่างน้อยที่ผู้ยื่นคำขออนุญาตเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์จะต้องจัดให้มีในร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ จึงจำเป็นต้องออกประกาศนี้

สารบัญเชิงอรรถ

ลำดับ	ประกาศ ณ วันที่	เลขที่ประกาศ	ชื่อเรื่อง	เนื้อหา	สถานะ
	13 พ.ค. 53	สจ. 17/2553	ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิ อนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์		ใช้งาน (มีผลใช้บังคับตั้งแต่ 16 พ.ค. 53 เป็นต้นไป)
1	12 ก.ค. 56	สจ. 19/2556	ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิ อนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (ฉบับที่ 2)	แก้ไขประกาศ สจ. 17/2553 โดยเพิ่มข้อ 4(4)	ใช้งาน (มีผลใช้บังคับตั้งแต่ 1 ส.ค. 56 เป็นต้นไป)
2	11 พ.ย. 57	สจ. 36/2557	ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกไปสำคัญแสดงสิทธิ อนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (ฉบับที่ 3)	แก้ไขข้อ 4(4) ผู้กำหนดนัยสำคัญ เป็นสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย	ใช้งาน (มีผลใช้บังคับตั้งแต่ 16 ธ.ค. 57 เป็นต้นไป)