

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน
ที่ ทจ. 19/2559
เรื่อง การเสนอขายตราสารค้ำยสิทธิเพื่อนับเป็น
เงินกองทุนของธนาคารพาณิชย์
(ฉบับที่ 5)

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 16/6 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 และมาตรา 35 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกความในข้อ 3 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 16/2557 เรื่อง การเสนอขายตราสารค้ำยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนของธนาคารพาณิชย์ ลงวันที่ 16 มิถุนายน พ.ศ. 2557 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 3 ในประกาศนี้

คำว่า “การจัดอันดับความน่าเชื่อถือ” “ผู้ลงทุนสถาบัน” “ผู้ลงทุนรายใหญ่” และ “หุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง” ให้มีความหมายเช่นเดียวกับบทนิยามของคำดังกล่าวที่กำหนดไว้ในประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการกำหนดบทนิยามในประกาศเกี่ยวกับการออกและเสนอขายตราสารหนี้ทุกประเภท

“ตราสารค้ำยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุน” หมายความว่า หุ้นกู้ที่ออกใหม่ประเภทไม่มีประกันที่มีการกำหนดให้สิทธิในการรับชำระหนี้ของผู้ถือหุ้นกู้ค้ำยกว่าสิทธิของเจ้าหนี้สามัญ และมีลักษณะเป็นไปตามหลักเกณฑ์ในการนับเป็นเงินกองทุน โดยเป็นหุ้นกู้ชนิดใดชนิดหนึ่งดังต่อไปนี้

- (1) มีการกำหนดเงื่อนไขให้ผู้ถือหุ้นกู้ปลดหนี้
- (2) เป็นตราสารแปลงสภาพ

“ตราสารแปลงสภาพ” หมายความว่า หุ้นกู้แปลงสภาพชนิดที่มีการกำหนดเงื่อนไขบังคับแปลงสภาพเป็นหุ้นที่ออกใหม่ของผู้ออกหุ้นกู้แปลงสภาพ

“หุ้นรองรับ” หมายความว่า หุ้นออกใหม่ที่จัดไว้เพื่อรองรับการแปลงสภาพ

“เงินกองทุน” หมายความว่า เงินกองทุนสำหรับธนาคารพาณิชย์ตามประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย

“ธนาคารพาณิชย์” หมายความว่า ธนาคารพาณิชย์ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน แต่ไม่รวมถึงสาขาของธนาคารพาณิชย์ต่างประเทศ

“ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย” หมายความว่า ประกาศธนาคารแห่งประเทศไทยว่าด้วยองค์ประกอบของเงินกองทุนสำหรับธนาคารพาณิชย์ที่จดทะเบียนในประเทศ โดยอ้างอิงจากหลักเกณฑ์ BASEL III

“ข้อกำหนดสิทธิ” หมายความว่า ข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออกตราสารและผู้ถือตราสาร

“สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย” หมายความว่า สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยที่ได้รับใบอนุญาตและจดทะเบียนกับสำนักงาน”

ข้อ 2 ให้ยกเลิกความในข้อ 13 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 16/2557 เรื่อง การเสนอขายตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนของธนาคารพาณิชย์ ลงวันที่ 16 มิถุนายน พ.ศ. 2557 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 9/2558 เรื่อง การเสนอขายตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนของธนาคารพาณิชย์ (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 8 เมษายน พ.ศ. 2557 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ 13 ตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนที่ออกโดยธนาคารพาณิชย์จะต้องมีลักษณะดังต่อไปนี้

(1) มีการกำหนดอัตราดอกเบี้ยไว้อย่างแน่นอน หรือเป็นอัตราที่ผันแปรตามอัตราดอกเบี้ยของสถาบันการเงินหรืออัตราดอกเบี้ยอื่น

(2) มีข้อตกลงให้ชำระค่าตราสารเป็นสกุลเงินบาท

(3) ไม่มีลักษณะเป็นหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝง เว้นแต่เป็นตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนที่มีลักษณะลักษณะใดลักษณะหนึ่งดังนี้

(ก) มีการกำหนดเงื่อนไขให้ธนาคารพาณิชย์สามารถไถ่ถอนตราสารดังกล่าวคืนก่อนกำหนดได้ (puttable) โดยมูลค่าผลตอบแทนและต้นเงินที่ไถ่ถอนไม่ได้ขึ้นอยู่กับปัจจัยอ้างอิงที่กำหนดไว้ล่วงหน้า

(ข) มีการกำหนดเงื่อนไขให้สิทธิตามตราสารดังกล่าวมีลักษณะเป็นตราสารแปลงสภาพ

(4) ในกรณีที่เป็ตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนซึ่งเป็นตราสารแปลงสภาพ ต้องมีการกำหนดอัตราและราคาแปลงสภาพไว้อย่างชัดเจนในข้อกำหนดสิทธิ ทั้งนี้ ไม่ว่าจะเป็นการกำหนดอัตราที่แน่นอนหรือกำหนดเป็นสูตรการคำนวณก็ได้

การกำหนดราคาแปลงสภาพตามวรรคหนึ่ง ธนาคารพาณิชย์ต้องไม่กำหนดราคาแปลงสภาพที่ต่ำกว่าร้อยละห้าสิบของราคาหุ้นสามัญของธนาคารพาณิชย์ในช่วงก่อนหรือระหว่างการเสนอขายตามแนวทางที่สมาคมธนาคารไทยกำหนด (floor conversion price) เว้นแต่เป็นกรณีตามข้อ 17”

ข้อ 3 ให้ยกเลิกความในวรรคสองของข้อ 17 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทจ. 16/2557 เรื่อง การเสนอขายตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนของธนาคารพาณิชย์ ลงวันที่ 16 มิถุนายน พ.ศ. 2557 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 9/2558 เรื่อง การเสนอขายตราสารด้อยสิทธิเพื่อนับเป็นเงินกองทุนของธนาคารพาณิชย์ (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 8 เมษายน พ.ศ. 2558 และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“มิให้นำราคาแปลงสภาพที่กำหนดตามข้อ 13(4) วรรคสองมาใช้บังคับกับกรณีที่มีเหตุตามวรรคหนึ่ง ทั้งนี้ ราคาแปลงสภาพที่กำหนดใหม่เนื่องจากเหตุตามวรรคหนึ่ง ต้องไม่ต่ำกว่าร้อยละห้าสิบของราคาหุ้นสามัญของธนาคารพาณิชย์ในช่วงที่มีเหตุดังกล่าวตามแนวทางที่สมาคมธนาคารไทยกำหนด”

ข้อ 4 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 มิถุนายน พ.ศ. 2559 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 4 พฤษภาคม พ.ศ. 2559

(นายรพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน