

ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน  
ที่ ทจ. /2561  
เรื่อง การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์  
(ฉบับที่ )

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา 16/6 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 4) พ.ศ. 2551 และมาตรา 35 มาตรา 67 และมาตรา 69 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 คณะกรรมการกำกับตลาดทุนออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็น (3/1) และ (3/2) ของข้อ 8 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 15/2553 เรื่อง การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ลงวันที่ 1 เมษายน พ.ศ. 2553 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 32/2556 เรื่อง การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (ฉบับที่ 4) ลงวันที่ 12 กรกฎาคม พ.ศ. 2556

“(3/1) หุ่นที่ออกโดยบริษัทต่างประเทศที่มีคุณสมบัติครบถ้วนดังนี้

(ก) มีมูลค่าตลาดเฉลี่ยแต่ละไตรมาสไม่ต่ำกว่าหนึ่งหมื่นล้านบาท  
รวมติดต่อกันไม่น้อยกว่าสี่ไตรมาส

(ข) จัดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศ โดยตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศนั้นต้องมีลักษณะใดลักษณะหนึ่งดังนี้

1. อยู่ภายใต้การกำกับดูแลของหน่วยงานที่เป็นสมาชิกสามัญของ International Organization of Securities Commissions (IOSCO)
2. เป็นสมาชิกของ World Federation of Exchanges (WFE)
3. ตั้งอยู่ในประเทศกลุ่มอนุภูมิภาคแม่น้ำโขง (Greater Mekong Subregion: GMS)

(ค) มีสภาพคล่องอย่างเพียงพอ

(ง) มีข้อมูลของหุ้นซึ่งผู้ลงทุนในประเทศไทยสามารถเข้าถึงได้

(3/2) ดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศที่มีคุณสมบัติครบถ้วนดังนี้

(ก) เป็นดัชนีที่ได้รับการยอมรับอย่างแพร่หลายและพัฒนาโดยสถาบันที่มีความน่าเชื่อถือซึ่งทำหน้าที่ได้อย่างอิสระจากผู้อนุญาต ทั้งนี้ หากปรากฏว่าสถาบันดังกล่าวเป็นบริษัทในเครือของผู้อนุญาต ผู้อนุญาตนั้นต้องจัดให้มีมาตรการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์อย่างมีประสิทธิภาพด้วย

(ข) มีองค์ประกอบของดัชนีเป็นหุ้นที่ออกโดยบริษัทต่างประเทศซึ่งมีคุณสมบัติเป็นไปตาม (3/1) (ข)

(ค) มีการกำหนดวิธีการคำนวณดัชนีไว้อย่างชัดเจน และมีการระบุถึงแหล่งข้อมูลของหุ้นอ้างอิงที่นำมาใช้ในการคำนวณ รวมถึงมีการคำนวณดัชนีให้เป็นปัจจุบันตามความเหมาะสมของหุ้นอ้างอิงซึ่งเป็นองค์ประกอบของดัชนี ทั้งนี้ หุ้นอ้างอิงดังกล่าวต้องมีการเคลื่อนไหวตามสถานะตลาดอย่างเป็นอิสระด้วย

(ง) มีการแสดงดัชนีนั้น ๆ อย่างต่อเนื่องเป็นประจำทุกวันทำการผ่านสื่อที่มีการเสนอข้อมูลอย่างทันเหตุการณ์”

ข้อ 2 ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ 22/1 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทจ. 15/2553 เรื่อง การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ลงวันที่ 1 เมษายน พ.ศ. 2553

“ข้อ 22/1 ผู้ได้รับอนุญาตต้องจัดให้มีการเปิดเผยข้อมูลเปรียบเทียบค่าความผันผวนแฝง (implied volatility) กับค่าความผันผวนในอดีต (historical volatility) ของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ได้รับอนุญาตไว้บนเว็บไซต์ของผู้ได้รับอนุญาตเป็นรายวันอย่างต่อเนื่องตลอดอายุของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ทั้งนี้ วิธีการเปิดเผยข้อมูลดังกล่าวให้เป็นไปตามแนวทางที่กำหนดไว้บนเว็บไซต์ของสำนักงาน”

ข้อ 3 ให้ยกเลิกความในข้อ 39 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนที่ ทจ. 15/2553 เรื่อง การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ลงวันที่ 1 เมษายน พ.ศ. 2553 และให้ใช้ความต่อไปนี้เป็นแทน

“ข้อ 39 ให้นำข้อกำหนดตามข้อ 22/1 ข้อ 23 ข้อ 24 และข้อ 25 มาใช้บังคับกับการเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ออกใหม่ตามหมวดนี้ด้วย”

ข้อ 4 ให้ยกเลิกแบบ 69-DW-full และแบบ 69-DW-short ที่ายประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 15/2553 เรื่อง การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ ลงวันที่ 1 เมษายน พ.ศ. 2553 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 36/2556 เรื่อง การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (ฉบับที่ 5) ลงวันที่ 27 กันยายน พ.ศ. 2556 และให้ใช้แบบ 69-DW-full และแบบ 69-DW-short ที่ายประกาศนี้แทน

ข้อ 5 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่

เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่

(นายรพี สุจริตกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ประธานกรรมการ

คณะกรรมการกำกับตลาดทุน