

ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrant – DW)

การนำเข้าจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์

สรุปเกณฑ์สำคัญ

เรื่อง	รายละเอียด
นิยาม	ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือ Derivative Warrant (DW) หมายถึง - ตราสารที่ผู้ออกให้สิทธิแก่ผู้ถือในการที่จะซื้อ (Call Warrant) สิทธิอ้างอิง ณ เวลาใดเวลาหนึ่งหรือช่วงเวลาใดเวลาหนึ่งที่กำหนดไว้ ตามเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในตราสาร - ตราสารที่ผู้ออกให้สิทธิแก่ผู้ถือในการที่จะขาย (Put Warrant) สิทธิอ้างอิง ณ เวลาใดเวลาหนึ่งหรือช่วงเวลาใดเวลาหนึ่งที่กำหนดไว้ ตามเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในตราสาร - ตราสารที่ผู้ออกให้สิทธิแก่ผู้ถือสิทธิที่จะซื้อ (Call Warrant) ในการที่จะได้รับชำระเงิน ณ เวลาใดเวลาหนึ่งหรือช่วงเวลาใดเวลาหนึ่งที่กำหนดไว้ในจำนวนที่คำนวณได้จากส่วนต่างของราคาหรือค่าของสิทธิอ้างอิงกับราคาหรือค่าของสิทธิอ้างอิงที่กำหนดในตราสารเมื่อราคาหรือค่าของสิทธิอ้างอิงสูงกว่าราคาหรือค่าที่กำหนดในตราสาร ตามเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในตราสาร หรือ - ตราสารที่ผู้ออกให้สิทธิแก่ผู้ถือสิทธิที่จะขาย (Put Warrant) ในการที่จะได้รับชำระเงิน ณ เวลาใดเวลาหนึ่งหรือช่วงเวลาใดเวลาหนึ่งที่กำหนดไว้ในจำนวนที่คำนวณได้จากส่วนต่างของราคาหรือค่าของสิทธิอ้างอิงกับราคาหรือค่าของสิทธิอ้างอิงที่กำหนดในตราสารเมื่อราคาหรือค่าของสิทธิอ้างอิงต่ำกว่าราคาหรือค่าที่กำหนดในตราสาร ตามเงื่อนไขที่กำหนดไว้ในตราสาร
คุณสมบัติผู้ยื่นคำขอ	ผู้ยื่นคำขอจดทะเบียน DW ต่อตลาดหลักทรัพย์ต้องมีคุณสมบัติตามประกาศ ก.ล.ด.
คุณสมบัติ DW	- ได้รับอนุญาตจากสำนักงาน ก.ล.ด. ให้เสนอขายต่อประชาชนเป็นการทั่วไป ระบุชื่อผู้ถือ - ไม่มีข้อจำกัดในการโอน DW - มีสิทธิอ้างอิงอย่างใดอย่างหนึ่ง ดังนี้ - หุ้นสามัญหรือกลุ่มหุ้นสามัญที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน ซึ่งไม่ได้ออกโดยบริษัทจดทะเบียนที่อยู่ระหว่างถูกห้ามซื้อหรือขายหลักทรัพย์เป็นการชั่วคราว อันเนื่องมาจากมีเหตุที่ทำให้หุ้นสามัญของบริษัทเข้าข่ายอาจถูกเพิกถอน หรืออยู่ระหว่างฟื้นฟูกิจการตามกฎหมายล้มละลาย หรือสาเหตุอื่นที่มีผลกระทบต่อสิทธิประโยชน์ของผู้ถือหุ้นอย่างร้ายแรง - หุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศ ซึ่งไม่เป็นหุ้นที่มีเหตุเข้าข่ายอาจถูกเพิกถอน หรือมีเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งที่มีลักษณะคล้ายกัน หรือมีสาเหตุอื่นที่มีผลกระทบต่อสิทธิประโยชน์ของผู้ถือหุ้นอย่างร้ายแรง - ดัชนีหลักทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์ - ดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศ - หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟ - สิทธิอ้างอิงอื่นใดตามที่คณะกรรมการกำหนด DW ที่จัดให้มีการฝากทรัพย์สินบางส่วนหรือไม่มีการจัดให้มีการฝากทรัพย์สิน จะต้องมีคุณสมบัติเพิ่มเติมดังนี้ - มีสิทธิอ้างอิงประเภทใดประเภทหนึ่งดังต่อไปนี้ ณ วันยื่นคำขอ - หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET50 หรือดัชนี SET100 โดยหุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 ในลำดับที่ 51 -100 แต่ละหุ้นต้องมีคุณสมบัติในเรื่องมูลค่าหุ้นสามัญตามราคาตลาด (Market Capitalization) ตามที่ประกาศ ก.ล.ด. กำหนด และมีรายชื่อตามประกาศรายชื่อหลักทรัพย์ที่เป็นสิทธิอ้างอิงของ DW ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด - หุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศที่มีคุณสมบัติดังนี้ - มีคุณสมบัติครบถ้วนตามประกาศ ก.ล.ด. - มี Market Capitalization ตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด - ดัชนี SET ดัชนี SET50 ดัชนี SET100 ดัชนี SET High Dividend 30 หรือดัชนีราคากลุ่มอุตสาหกรรมและหมวดธุรกิจ - ดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศที่มีคุณสมบัติดังนี้

	• มีคุณสมบัติครบถ้วนตามประกาศ ก.ล.ด. • มีองค์ประกอบทั้งหมดของดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศเป็นหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศในกลุ่ม CLMV หรือที่สำนักงาน ก.ล.ด. ยอมรับ หรือเป็นหุ้นในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศที่มี Market Capitalization สูงสุด 30 อันดับแรกตามตลาดหลักทรัพย์กำหนด • มีแหล่งข้อมูลของดัชนีที่ผู้ลงทุนสามารถเข้าถึงและติดตามข้อมูลระหว่างวันได้อย่างสม่ำเสมอ • มีรายชื่อดัชนีตามตลาดหลักทรัพย์กำหนด จ) หน่วยลงทุนของกองทุนรวมอีทีเอฟที่มีคุณสมบัติตามประกาศ ก.ล.ด. 2. มีกำหนดเวลาไม่น้อยกว่า 2 เดือน และไม่เกิน 2 ปีนับแต่วันออก 3. เป็น DW ตามคำนิยามของ DW ในข้อ 3. หรือ 4. ข้างต้นซึ่งระบุวันใช้สิทธิตาม DW เมื่อถึงวันที่ผู้ยื่นคำขอกำหนด (European Style) 4. มูลค่ายื่นขอจดทะเบียนในแต่ละรุ่นไม่น้อยกว่า 20 ล้านบาท และราคาของ DW ที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ (Issue Price) ต้องไม่น้อยกว่า 1 บาท ในวันที่ยื่นคำขอ 5. จำนวน DW ที่อ้างอิงหุ้นสามัญหรือกลุ่มหุ้นสามัญที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนทั้งที่ออกแล้วและที่อยู่ระหว่างการยื่นคำขอของผู้ยื่นคำขอตลอดทุกวาระ ณ เวลาใดเวลาหนึ่งรวมกันทุกประเภทการเสนอขายต้องใช้หุ้นอ้างอิงดังกล่าวเพื่อรองรับการใช้สิทธิตามข้อกำหนดสิทธิในจำนวนไม่เกินกว่าร้อยละ 50 ของจำนวนหุ้นที่จำหน่ายได้แล้วทั้งหมดของหุ้นอ้างอิงนั้น ในกรณีอ้างอิงหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศต้องใช้หุ้นอ้างอิงไม่เกินกว่าร้อยละ 15 ของจำนวนหุ้นอ้างอิงที่มีการจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศ 6. ผู้ยื่นคำขอต้องกระจายการถือ DW จำนวนรวมไม่น้อยกว่า 20 ล้านบาทหรือไม่น้อยกว่าร้อยละ 50 ของจำนวน DW ที่ยื่นคำขอ โดยไม่นับรวมจำนวน DW ที่ถือโดยผู้ยื่นคำขอและผู้ดูแลสภาพคล่อง ภายในระยะเวลา 3 เดือนหรืออายุของ DW นับแต่วันที่ส่งรับเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน แล้วแต่ระยะเวลาใดจะถึงก่อน 7. มีผู้ดูแลสภาพคล่องซึ่งมีคุณสมบัติและหน้าที่ตามข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์และดำรงการมีผู้ดูแลสภาพคล่องตลอดเวลาที่มี DW เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน
การยื่นคำขอ	• ผู้ยื่นคำขอต้องได้รับการยืนยันการจัดสรรหุ้นสามัญที่ใช้เป็นสินทรัพย์อ้างอิงจากตลาดหลักทรัพย์ (กรณีที่ออก DW โดยสินทรัพย์อ้างอิงเป็นหุ้นสามัญหรือกลุ่มหุ้นสามัญ หรือหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศ) และต้องเริ่มดำเนินการเสนอขาย DW ดังกล่าวภายในระยะเวลาที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด • ยื่นคำขอจดทะเบียน DW ที่ได้รับอนุญาตจากสำนักงาน ก.ล.ด. แล้วทั้งจำนวน • ต้องจัดให้มีที่ปรึกษาทางการเงินตามหลักเกณฑ์ที่ประกาศ ก.ล.ด. กำหนด ยกเว้นผู้ยื่นคำขอที่เป็นที่ปรึกษาทางการเงิน • มอบหมายให้ตลาดหลักทรัพย์หรือบุคคลภายนอกที่ตลาดหลักทรัพย์ให้ความเห็นชอบทำหน้าที่เป็นนายทะเบียนหลักทรัพย์จดทะเบียน ทั้งนี้ การยื่นคำขอให้รับ DW ส่วนเพิ่ม ผู้ยื่นคำขอต้องกระจายการถือ DW ได้ตามหลักเกณฑ์และเงื่อนไขที่กำหนด กล่าวคือกระจายการถือ DW จำนวนรวมไม่น้อยกว่า 20 ล้านบาทหรือไม่น้อยกว่าร้อยละ 50 ของจำนวน DW ที่ยื่นคำขอ ตลาดหลักทรัพย์ได้พัฒนาระบบ DW One-Stop Service เพื่ออำนวยความสะดวกให้กับผู้ออกในการยื่นขออนุมัติและจดทะเบียน DW โดยสามารถศึกษารายละเอียดได้ที่ www.set.or.th --> สินค้า/บริการ --> ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (DW)
ค่าธรรมเนียมการรับ DW	อัตราค่าธรรมเนียมการรับ DW เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน 68,000 บาทต่อรุ่น