

เกณฑ์รับหลักทรัพย์

สรุปเกณฑ์สำคัญ

1. คุณสมบัติของผู้ออก DW

- ได้รับอนุญาตจากสำนักงาน ก.ล.ต.

2. คุณสมบัติของ DW

- ระบุชื่อผู้ถือ และไม่มีข้อจำกัดการโอน
- มีสินทรัพย์อ้างอิงซึ่งมีคุณสมบัติตามเกณฑ์กำหนด

สินทรัพย์อ้างอิง	คุณสมบัติของสินทรัพย์อ้างอิง
หุ้นสามัญ	1. หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET50 2. หุ้นสามัญที่เป็นองค์ประกอบของดัชนี SET100 ลำดับที่ 51-100 ที่มี Market Capitalization เฉลี่ยแต่ละไตรมาสไม่ต่ำกว่า 10,000 ล้านบาท ติดต่อกันไม่น้อยกว่า 4 ไตรมาส
ดัชนีหลักทรัพย์	ดัชนี SET50, SET100, SETHD หรือดัชนีราคากลุ่มอุตสาหกรรมและหมวดธุรกิจ
หุ้นสามัญต่างประเทศ	1. มีคุณสมบัติครบตามประกาศ ก.ล.ต. ▪ Market capitalization เฉลี่ยแต่ละไตรมาสไม่ต่ำกว่า 10,000 ล้านบาท ติดต่อกันไม่น้อยกว่า 4 ไตรมาส ▪ จดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ที่มีลักษณะใดลักษณะหนึ่ง ดังนี้ ○ อยู่ภายใต้การกำกับของสมาชิกสามัญของ IOSCO ○ เป็นสมาชิกของ WFE ○ ตั้งอยู่ในประเทศกลุ่ม GMS ▪ มีสภาพคล่องเพียงพอ ▪ มีข้อมูลที่เข้าถึงได้ 2. มี Market capitalization ไตรมาสล่าสุดไม่ต่ำกว่า 200,000 ล้านบาท
ดัชนีหลักทรัพย์ต่างประเทศ	1. มีคุณสมบัติครบตามประกาศ ก.ล.ต. ▪ ดัชนีได้รับการยอมรับอย่างแพร่หลาย ▪ มีองค์ประกอบของดัชนีเป็นหุ้นเป็นหุ้นที่ออกโดยบริษัทต่างประเทศซึ่งจดทะเบียนซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ที่มีลักษณะใดลักษณะหนึ่ง ดังนี้ ○ อยู่ภายใต้การกำกับของสมาชิกสามัญของ IOSCO ○ เป็นสมาชิกของ WFE ○ ตั้งอยู่ในประเทศกลุ่ม GMS ▪ มีการกำหนดวิธีการคำนวณดัชนีไว้ชัดเจน ▪ มีการแสดงดัชนีต่อเนื่องเป็นประจำ 2. มีองค์ประกอบของดัชนีเป็นหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศซึ่งมีลักษณะใดลักษณะหนึ่ง ดังนี้ ▪ อยู่ในกลุ่มประเทศ CLMV ▪ อยู่ในประเทศที่สำนักงาน ก.ล.ต. ยอมรับ ▪ มี Market capitalization สูงสุด 30 อันดับแรก 3. มีแหล่งข้อมูลที่เข้าถึงและติดตามระหว่างวันได้สม่ำเสมอ 4. มีรายชื่อเป็นไปตามที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

หน่วยลงทุนของกองทุน รวมอีทีเอฟ	มีคุณสมบัติตามประกาศ ก.ล.ต.
-----------------------------------	-----------------------------

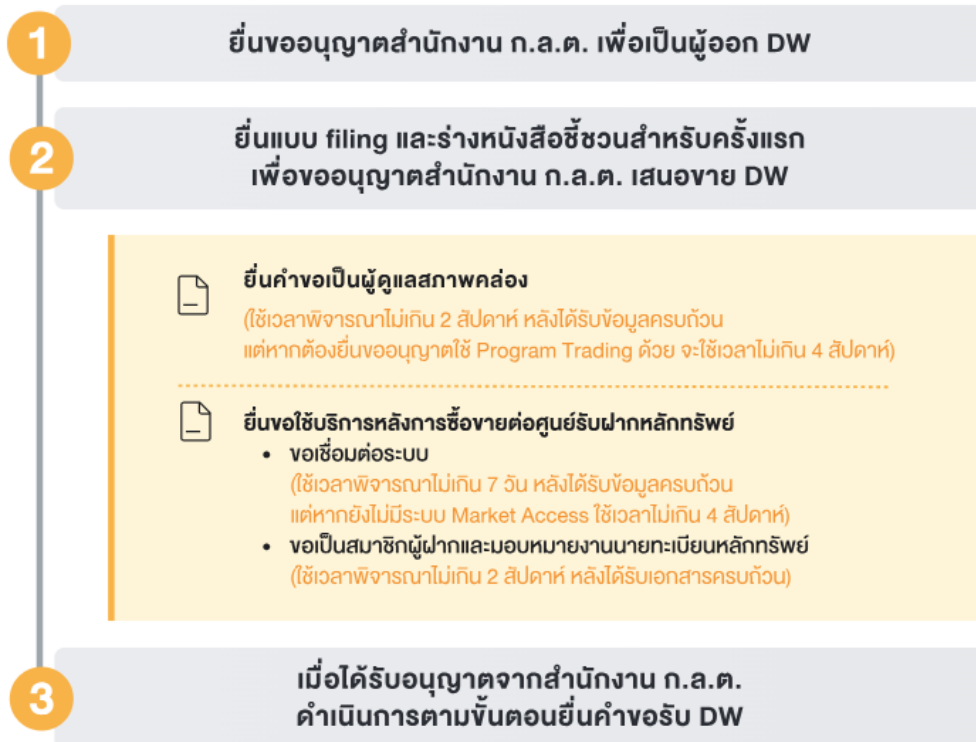
- มีอายุระหว่าง 2 เดือน - 2 ปี
- มูลค่าที่ยื่นคำขอไม่น้อยกว่า 20 ล้านบาท
- ราคา DW ไม่น้อยกว่า 1 บาท ณ วันยื่นคำขอ
- มีผู้ดูแลสภาพคล่อง และดำรงการมีผู้ดูแลสภาพคล่องตลอดเวลาที่มี DW เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน
- มอบหมายให้ตลาดหลักทรัพย์ ทำหน้าที่เป็นนายทะเบียนหลักทรัพย์จดทะเบียน

3. คุณสมบัติเพิ่มเติมของ DW กรณี Further Issue

- ต้องกระจายการถือ DW ไม่น้อยกว่า 20 ล้านบาท หรือไม่น้อยกว่า 50% ของ DW ที่ยื่นคำขอ (ไม่รับรวมที่ถือโดยผู้ออกและผู้ดูแลสภาพคล่อง)

ขั้นตอน

ขั้นตอนการยื่นคำขออนุญาตเป็นผู้ออกและเสนอขาย DW



เกณฑ์และแบบฟอร์มที่เกี่ยวข้อง

เกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์

- [\(บจ/ร 38-00\) ข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง การรับ การเปิดเผยสารสนเทศ และการเปิดเผย](#)
[ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ พ.ศ. 2562](#)
- [ประกาศคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เรื่อง อัตราค่าธรรมเนียมในการรับหน่วยลงทุนของกองทุนรวมอที่เอฟ](#)
[หน่วยของอที่เอฟต่างประเทศ ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ และตราสารแสดงสิทธิในหลักทรัพย์ต่างประเทศ เป็น](#)
[หลักทรัพย์จดทะเบียน พ.ศ. 2564](#)

เกณฑ์ของสำนักงาน ก.ล.ต.

- [ประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทจ. 15/2553 เรื่อง การออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์](#)
[\(ฉบับประมวล\)](#)
- [ประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สจ. 8/2553 เรื่องข้อกำหนดเพิ่มเติมที่เกี่ยวข้องกับการเสนอขาย](#)
[ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ที่ออกใหม่ \(ฉบับประมวล\)](#)
- [ประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สจ. 17/2553 เรื่อง ร่างข้อกำหนดว่าด้วยสิทธิและหน้าที่ของผู้ออก](#)
[ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์และผู้ถือใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ \(ฉบับประมวล\)](#)
- [ประกาศสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. ที่ สจ.55/2564 เรื่อง ประเทศที่มีการกำกับดูแลตลาดทุนเป็นที่ยอมรับ](#)
[ของสำนักงาน](#)
- [สรุปหลักเกณฑ์การยื่นคำขออนุญาตและเอกสารหลักฐาน หรือรายงานที่เกี่ยวข้องสำหรับการเสนอขาย DW](#)

เกณฑ์เปิดเผยข้อมูล

สรุปเกณฑ์สำคัญ

การเปิดเผยข้อมูลตามรอบระยะเวลา

1. ข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินงานและฐานะการเงินของผู้ออก DW

ข้อมูลที่ต้องเปิดเผย	กำหนดส่ง
งบการเงินประจำปี (ตรวจสอบ)	ภายในระยะเวลาเดียวกับที่ส่งให้หน่วยงานทางการที่เป็นผู้กับดูแล ประกอบธุรกิจโดยตรง หรือกระทรวงพาณิชย์ แล้วแต่ระยะเวลาใดจะถึง ก่อน
งบการเงินประจำงวด 6 เดือน (ตรวจสอบ)	
งบการเงินรายไตรมาส (สอบทาน)	
แบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี (56-DW)	พร้อมกับการส่งงบการเงินประจำปี

หมายเหตุ: 1. กรณีวันครบกำหนดส่งเป็นวันหยุดให้เลื่อนเป็นวันทำการถัดไป

2. กรณีผู้ออก DW เป็นบริษัทจดทะเบียนให้นำส่งตามเกณฑ์ของบริษัทจดทะเบียน

2. ข้อมูลสำคัญอื่นๆ

ข้อมูลที่ต้องเปิดเผย/นำส่ง	กำหนดการเปิดเผย/นำส่ง
DW Outstanding Units รายสัปดาห์	ทุกสัปดาห์
รายงานการกระจายการถือ DW	ภายใน 3 เดือนนับจากวันซื้อขายวันแรก
ผลการปฏิบัติงานของผู้ดูแลสภาพคล่องรายเดือน	ภายใน 3 วันทำการนับแต่วันสุดท้ายของแต่ละเดือน

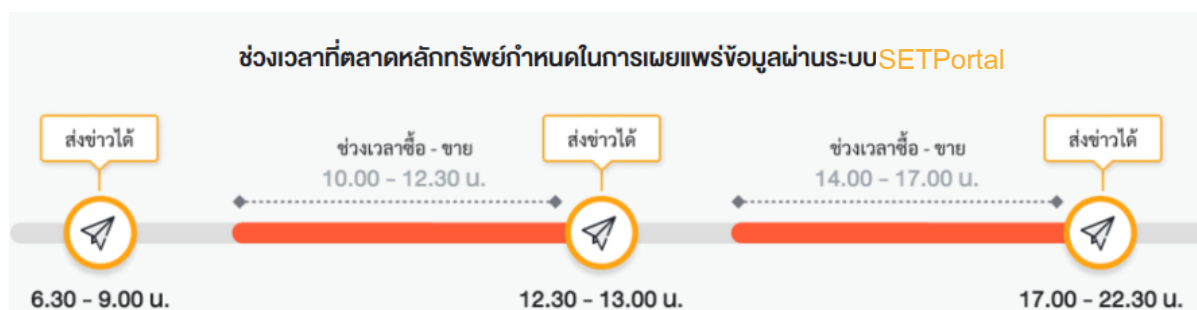
การเปิดเผยข้อมูลตามเหตุการณ์

ตัวอย่างข้อมูลที่ต้องเปิดเผย มีดังนี้

ข้อมูลที่ต้องเปิดเผย	ระยะเวลาเปิดเผย
○ บริษัทผู้ออก DW ประสบความเสียหายอย่างร้ายแรง, หยุดประกอบกิจการบางส่วนหรือทั้งหมด ○ ปรับอัตราและราคาใช้สิทธิ ○ มีการเปลี่ยนแปลงระยะเวลาการใช้สิทธิครั้งสุดท้าย ○ กำหนดวันประชุมผู้ถือ DW ○ กำหนดวันปิดสมุดทะเบียน (Book Closing : BC) หรือวันกำหนดรายชื่อ (Record date : RD) เพื่อสิทธิใดๆ* ○ แก้ไขข้อกำหนดสิทธิฉบับใหม่ ○ เปลี่ยนแปลงผู้ดูแลสภาพคล่อง นายทะเบียน หรือผู้รับฝากทรัพย์สิน ○ มีเหตุการณ์ที่กระทบต่อความสามารถในการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง ○ กรณีใด ๆ ที่กระทบต่อสิทธิประโยชน์ของผู้ถือ DW หรือส่งผลกระทบต่อความตั้งใจในการลงทุน	ทันที
ราคาอ้างอิงและเงินสดส่วนต่าง	ไม่เกินวันทำการถัดไปจากวันที่ทราบ
รายงานผลการใช้สิทธิ	ภายในวันทำการถัดจากวันที่มีการใช้สิทธิ
การเปิดเผยวัน BC หรือ RD เพื่อให้สิทธิใดๆ	≥ 5 วันทำการก่อนวัน BC หรือ RD
กรณีเปลี่ยนแปลงวัน BC หรือ RD	≥ 5 วันทำการก่อนวัน BC หรือ RD ที่เคยเปิดเผย
รายงานการประชุมผู้ถือ DW	ภายใน 14 วันนับจากวันประชุม

วิธีการเปิดเผยและนำส่งข้อมูล

- จัดทำผ่านระบบ SETPortal ทั้งภาษาไทยและภาษาอังกฤษ
- กรณีเป็นข้อมูลที่สำคัญต้องรายงานโดยทันที ให้รายงานโดยไม่ชักช้าในวันที่มีเหตุการณ์เกิดขึ้นหรืออย่างช้าก่อนเวลาซื้อหรือขายหลักทรัพย์ในรอบแรกของวันทำการถัดไป



หมายเหตุ: DW ที่มีสินทรัพย์อ้างอิงต่างประเทศไม่สามารถส่งข่าวในช่วง 12.30-13.00 น. ได้ เนื่องจากตลาดหลักทรัพย์เปิดให้ซื้อขายหลักทรัพย์ในช่วงเวลาดังกล่าวด้วย (Non-intermission)

เกณฑ์เพิกถอน

DW จะถูกเพิกถอนและสิ้นสภาพจากการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน เมื่อเกิดกรณีใดกรณีหนึ่ง ดังต่อไปนี้

- ครบอายุตามที่กำหนดในข้อกำหนดสิทธิ
- สิทธิพลีย่างอิงถูกเพิกถอน
- สิทธิพลีย่างอิงที่เป็นดัชนีถูกยกเลิกการคำนวณดัชนี

DW อาจเข้าข่าย ถูกเพิกถอนและสิ้นสภาพจากการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน เมื่อเกิดกรณีใดกรณีหนึ่ง ดังต่อไปนี้

- ผู้ออกร้องขอ
- หุ่นอ้างอิงถูกห้ามซื้อหรือขายต่อเนื่อง 20 วันทำการขึ้นไป
- หน่วยงานภาครัฐหรือหน่วยงานที่กำกับดูแลออกกฎหมายหรือนโยบายที่ส่งผลให้ผู้ออกหรือผู้ดูแลสภาพคล่องมีแนวโน้มปฏิบัติหน้าที่ไม่ได้เป็นระยะเวลานาน
- มีเหตุการณ์ที่อาจทำให้มีข้อมูลหุ้นหรือดัชนีต่างประเทศไม่เพียงพอต่อการตัดสินใจลงทุน หรือ เหตุการณ์ที่ทำให้ผู้ถือหุ้นมีแนวโน้มเข้าถึงข้อมูลไม่ได้เป็นระยะเวลานาน
- ข้อมูลที่ปรากฏในหนังสือชี้ชวนหรือในการยื่นคำขอจดทะเบียนไม่ถูกต้อง
- ผู้ออกมีการดำเนินการในลักษณะที่อาจก่อให้เกิดความเสียหายร้ายแรง