

ประกาศสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย
เรื่อง การกำกับดูแลการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants: DW)
(ฉบับที่ 3)

เพื่อให้การประกาศกำหนดรายชื่อบุสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants: DW) ที่บริษัทสมาชิกต้องดำเนินการให้ลูกค้าที่เปิดบัญชีซื้อขายกับบริษัทสมาชิก วางหลักประกันเป็นเงินสดเต็มจำนวนก่อนซื้อ (Cash Balance) เป็นไปโดยคล่องตัวและเหมาะสม สมาคมฯ จึงขอให้บริษัทสมาชิกปฏิบัติตามประกาศสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย เรื่องการกำกับดูแลการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants: DW) (ฉบับที่ 3) แทนประกาศสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ เรื่องการกำกับดูแลการซื้อขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants: DW) ฉบับที่ 2 ลงวันที่ 18 พฤศจิกายน 2554 ดังนี้

1. ให้บริษัทสมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าที่เปิดบัญชีซื้อขายกับบริษัทสมาชิก วางหลักประกันเป็นเงินสดเต็มจำนวนก่อนซื้อ (Cash Balance) สำหรับหลักทรัพย์ DW ที่เข้าเกณฑ์การคำนวณดังต่อไปนี้
 - 1) จำนวนหน่วยของหลักทรัพย์ DW ที่ซื้อขาย 5 วันทำการย้อนหลังสะสมรวมกัน
 $\geq 200\%$ ของจำนวนหน่วยของหลักทรัพย์ DW ที่อนุญาตให้ซื้อขาย และ
 - 2) อัตราความผันผวน (Implied Volatility) ของหลักทรัพย์ DW เฉลี่ยจากราคาปิด 5 วันทำการย้อนหลัง $\geq 100\%$
2. ให้บริษัทหลักทรัพย์ซึ่งเป็นผู้ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ DW (Issuer) นำส่งรายชื่อหลักทรัพย์ DW ที่ตนเองเป็นผู้ออกและเสนอขาย พร้อมผลคำนวณตามข้อ 1 มายังสมาคมฯ ภายในเวลา 12.00 น. ของทุกวันทำการสุดท้ายของสัปดาห์
3. สมาคมฯ จะประกาศกำหนดรายชื่อบุสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ DW ที่เข้าเงื่อนไขการคำนวณตามข้อ 1 ตามที่บริษัทหลักทรัพย์ซึ่งเป็นผู้ออกและเสนอขายหลักทรัพย์ DW นำส่งให้สมาคมฯ ทุกสิ้นวันทำการสุดท้ายของสัปดาห์ โดยเปิดเผยบนเว็บไซต์ของสมาคมฯ (www.asco.or.th)
4. ให้บริษัทสมาชิกดำเนินการให้ลูกค้าที่จะซื้อหลักทรัพย์ DW ตามรายชื่อที่สมาคมฯ ประกาศกำหนดต้องวางเงินสดเต็มจำนวนก่อนซื้อในวันทำการถัดจากวันที่สมาคมฯ ประกาศกำหนดรายชื่อบุสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ DW ไปจนถึงวันทำการสุดท้ายของสัปดาห์

ประกาศนี้ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 22 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2556 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 13 กุมภาพันธ์ 2556

(ภัทธีรา ดิลกรุ่งธีระภพ)
นายกสมาคม