

ประกาศคณะกรรมการ
สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
เรื่อง การจัดทำและเก็บบันทึกเอกสารหลักฐาน

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 20 (2) แห่งข้อบังคับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ลงวันที่ 21 กันยายน พ.ศ. 2548 คณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยออกข้อกำหนดไว้ ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

| | | |
|--------------|-------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|
| "สมาชิก" | หมายความว่า | สมาชิกของสมาคม |
| "ตราสารหนี้" | หมายความว่า | ตราสารแห่งหนึ่งที่เป็นหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ |
| "ลูกค้า" | หมายความว่า | ลูกค้าที่ทำการซื้อขายตราสารหนี้กับสมาชิก |
| "คู่ค้า" | หมายความว่า | สถาบันการเงินที่ได้รับใบอนุญาตค้าหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่งและทำการซื้อขายตราสารหนี้กับสมาชิก |

ข้อ 2 ในการซื้อขายตราสารหนี้ สมาชิกต้องจัดให้มีการจัดทำและจัดเก็บเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายอย่างน้อยดังต่อไปนี้

(1) เอกสารหลักฐานเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้แต่ละรายการ ซึ่งต้องมีข้อมูล ดังต่อไปนี้

- 1) วันและเวลาที่ตกลงซื้อขาย
- 2) ชื่อ จำนวนและมูลค่าของตราสารหนี้ที่ซื้อขาย
- 3) ราคา และ/หรือ อัตราผลตอบแทนของการซื้อขาย
- 4) วันชำระราคาและส่งมอบ
- 5) ชื่อหรือเลขประจำตัวของผู้ค้าตราสารหนี้ที่ทำรายการ
- 6) ชื่อลูกค้า/ คู่ค้า
- 7) วัตถุประสงค์ของการซื้อขายว่าเป็นการซื้อขายตามปกติ (Outright) หรือ การซื้อขายโดยมีสัญญาซื้อคืน (Repo) หรือ การซื้อขายเพื่อวัตถุประสงค์อื่น
- 8) อัตราดอกเบี้ยและระยะเวลากู้ยืม (ถ้ามี)
- 9) สัญญาซื้อคืน (ถ้ามี)
- 10) วิธีการซื้อขาย เช่น โทรศัพท์ ระบบซื้อขายอิเล็กทรอนิกส์ Inter-dealer Broker หรืออื่นๆ

(2) เอกสารหลักฐานเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือยกเลิกการขายตราสารหนี้ ซึ่งต้องมีข้อมูลดังต่อไปนี้

- 1) วันและเวลาที่เปลี่ยนแปลงแก้ไข หรือยกเลิกการขายตราสารหนี้
- 2) รายละเอียดและสาเหตุของการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือยกเลิกการขายตราสารหนี้

- 3) ระบุว่า การเปลี่ยนแปลงนั้นเกิดขึ้นเนื่องจากคำสั่งของลูกค้า / คู่ค้า หรือจากสมาชิก
- (3) สำเนาใบยืนยันการซื้อขายตราสารหนี้แต่ละรายการซึ่งได้ส่งให้กับลูกค้า / คู่ค้า
 - (4) เอกสารหรือข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับลูกค้า / คู่ค้า
 - (5) เอกสารหรือหลักฐานแสดงการรับมอบ ส่งมอบ หรือโอนตราสารหนี้
 - (6) เอกสารแสดงการรับ-จ่าย หรือการโอนเงิน ในการซื้อขายตราสารหนี้
 - (7) เอกสารแสดงยอดตราสารหนี้คงเหลือของสมาชิก ณ สิ้นวัน
 - (8) รายชื่อผู้ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายตราสารหนี้ ได้แก่ ผู้ค้าตราสารหนี้ ผู้รายงานข้อมูลการซื้อขาย ผู้รับผิดชอบการรายงานข้อมูล (ถ้ามี) เจ้าหน้าที่การตลาด

ข้อ 3 การซื้อขายที่มีการเจรจาติดต่อผ่านทางโทรศัพท์ หรือทางสื่ออิเล็กทรอนิกส์ สมาชิกต้องจัดให้มีการบันทึกเทปการติดต่อสื่อสาร หรือสิ่งบันทึกข้อมูลทางอิเล็กทรอนิกส์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายแต่ละรายการ

ข้อ 4 สมาชิกต้องจัดเก็บเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายตราสารหนี้ตามที่กำหนดไว้เป็นเวลาอย่างน้อย 2 ปี ยกเว้นหลักฐานตามข้อ 3 เป็นเวลาอย่างน้อย 1 เดือน หรือขยายระยะเวลาการจัดเก็บออกไปตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนดในลักษณะที่องค์กรกำกับดูแลและสมาคมสามารถตรวจสอบได้

ข้อ 5 ให้สมาชิกวิสามนัญปฏิบัติตามประกาศนี้ด้วยโดยอนุโลม แต่ให้ยกเว้น ข้อ 2 (5) (6) ไม่ต้องปฏิบัติ

ข้อ 6 ให้คณะกรรมการมีอำนาจในการกำหนดแนวทางปฏิบัติเพิ่มเติม ยกเลิก หรือเปลี่ยนแปลงแนวทางปฏิบัติเพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลตนเองสำหรับการซื้อขายตราสารหนี้

ข้อ 7 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม พ.ศ. 2548 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 10 พฤศจิกายน พ.ศ. 2548

(ลงนาม) นายสมหมาย ภาษี

(นายสมหมาย ภาษี)

ประธานกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย