

ประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 15 (3) และข้อ 20 (2) แห่งข้อบังคับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ลงวันที่ 21 กันยายน พ.ศ. 2548 (และที่แก้ไขเพิ่มเติม) คณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ลงวันที่ 9 มกราคม 2551

ข้อ 2 ในประกาศนี้

“เจ้าหน้าที่บริหาร” หมายความว่า ผู้บริหารของสมาชิกที่ได้รับการแต่งตั้งให้เป็นผู้แทนของสมาชิก

“ผู้ค้าตราสารหนี้” หมายความว่า เจ้าหน้าที่ของสมาชิกที่ได้รับการแต่งตั้งให้เป็นผู้กระทำการแทน

ในการซื้อขายตราสารหนี้และขึ้นทะเบียนกับสมาคม

“การซื้อขายตราสารหนี้” หมายความว่า การซื้อขายตราสารหนี้ตามปกติ (Outright Transaction) และให้ครอบคลุมถึงการทำธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้เพื่อหาเงินทุน (Financing Transaction) การทำอนุพันธ์ทางการเงินด้านตราสารหนี้ (Derivatives Transaction) รวมถึง การซื้อขายตราสารหนี้เพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Other Transaction)

ส่วนที่ 1

บททั่วไป

ข้อ 3 สมาคมจะจัดทำระบบสารสนเทศที่เกี่ยวกับการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้โดยผ่านทางเครือข่ายคอมพิวเตอร์หรือสื่ออื่นตามรูปแบบที่สมาคมกำหนด

ข้อ 4 สมาคมสงวนสิทธิ์ในการใช้ข้อมูลต่างๆที่สมาคมทำการเผยแพร่

ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่สมาชิกรายงานเข้ามายังสมาคมตามประกาศนี้ สมาคมสามารถรวบรวม ปรับปรุง วิเคราะห์ ประมวลผล พัฒนา และนำออกเผยแพร่ได้

การนำข้อมูลไปทำซ้ำ ดัดแปลง หรือเผยแพร่ ไม่ว่าในรูปแบบใดๆ เพื่อประโยชน์ในทางการค้า ต้องได้รับอนุญาตจากสมาคมเป็นหนังสือ

ส่วนที่ 2

การรายงานข้อมูล

ข้อ 5 ให้สมาชิกรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ต่อสมาคมตามแบบรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่ทางสมาคมกำหนด

ข้อ 6 ในการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ให้กระทำผ่านระบบการรายงานข้อมูลทางคอมพิวเตอร์ ยกเว้นแต่สมาคมจะประกาศกำหนดให้เป็นอย่างอื่น

การแก้ไขหรือยกเลิกข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่เกี่ยวข้องกับการออกรายงานแสดงราคาปิดประจำวัน (ThaiBMA Daily Report) หลังเวลาที่ระบบรายงานการซื้อขายโดยคอมพิวเตอร์ของสมาคมปิดทำการ ให้สมาชิกแจ้งให้สมาคมทราบในทันที และแจ้งเป็นลายลักษณ์อักษรภายในวันทำการถัดไป

ข้อ 7 ให้สมาชิกแต่งตั้งผู้มีหน้าที่รับผิดชอบการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ซึ่งอาจเป็นผู้ค้าตราสารหนี้ เจ้าหน้าที่บริหาร หรือ ผู้ที่ได้รับมอบหมายเป็นลายลักษณ์อักษรให้มีหน้าที่ในการรายงานข้อมูล

กรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงบุคคลตามวรรคแรก ให้สมาชิกมีหนังสือแจ้งให้สมาคมทราบภายใน 5 วันทำการ นับแต่วันที่เปลี่ยนแปลง

ข้อ 8 การรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ตามประกาศนี้ ให้สมาชิกรายงานภายในกำหนดเวลา ดังต่อไปนี้

(1) สมาชิกสามัญและสมาชิกสมทบ

(1.1) รายการซื้อขายที่เกิดขึ้นระหว่างเวลา 9:00 – 15:30 น. ให้รายงานภายใน 30 นาทีนับแต่เวลาที่มีการซื้อขาย (Trade Time)

(1.2) รายการซื้อขายที่เกิดขึ้นภายหลังเวลา 15:30 น. ให้รายงานภายในเวลา 9:30 น. ของวันทำการถัดไป

(2) สมาชิกวิสามัญ

ให้รายงานการซื้อขายที่เกิดขึ้นภายหลังเวลา 15:30 น. ของวันทำการก่อนหน้าจนถึงเวลา 15:30 น. ของวันทำการปัจจุบัน ภายในเวลา 17:00 น.

ข้อ 9 ข้อมูลที่สมาชิกต้องรายงาน ให้ประกอบด้วยข้อมูลดังต่อไปนี้

(1) วันที่ทำรายการซื้อขาย (Trade Date)

(2) ชื่อตราสารหนี้ (Issue)

(3) ประเภทของรายการว่าเป็นรายการซื้อหรือขาย (Buy or Sell)

(4) วัตถุประสงค์ของการซื้อขาย (Purpose) ว่าเป็นการซื้อขายปกติ (Outright Transaction) การทำธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้เพื่อหาเงินทุน (Financing Transaction) การทำอนุพันธ์ทางการเงินด้านตราสารหนี้ (Derivatives Transaction) หรือ เป็นการซื้อขายเพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Other Transaction) ทั้งนี้ โดยให้ระบุชื่อย่อตามบัญชีแนบท้ายประกาศนี้

(5) อัตราผลตอบแทนและราคาซื้อขาย (Yield and Price)

(5.1) ในกรณีที่ทำการซื้อขายตราสารหนี้ประเภทที่ตกลงด้วยอัตราผลตอบแทน (Yield) ให้รายงาน Yield เป็นอัตราร้อยละ 6 ตำแหน่ง และราคาซื้อขายแบบ Clean Price เป็นร้อยละของ Current Par

(5.2) ในกรณีที่ทำการซื้อขายตราสารหนี้ประเภทที่ตกลงกันด้วยราคา (Trade by Price) ให้รายงานราคาซื้อขายแบบ Gross Price เป็นร้อยละของ Current Par โดยไม่ต้องรายงานอัตราผลตอบแทน (Yield)

(5.3) ในกรณีที่ทำการซื้อขายตราสารหนี้ประเภทอัตราดอกเบี้ยลอยตัว (Floating Rate Notes – FRN)

ให้รายงาน Yield แบบ DM (Discounted Margin) เป็นอัตราร้อยละ 6 ตำแหน่ง และราคาซื้อขายแบบ Clean Price เป็น ร้อยละของ Current Par

- (6) ปริมาณการซื้อขาย (Volume) ที่มีหน่วยเป็น Unit
- (7) เวลาที่เกิดรายการซื้อขาย (Trade Time)
- (8) วันส่งมอบหลักทรัพย์ (Settlement Date)
- (9) เลขประจำตัวผู้ค้าตราสารหนี้ (Trader ID)
- (10) คู่ค้า / ลูกค้า (Counterparty) ให้ระบุเป็นชื่อย่อตามที่สมาคมกำหนดไว้ในบัญชีแนบท้ายประกาศนี้
- (11) สำหรับการทำธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้เพื่อหาเงินทุน (Financing Transaction) ให้ระบุข้อมูล

เพิ่มเติม ดังนี้

(11.1) ระยะเวลาของการกู้ยืม (Financing / Repo Term)

(11.2) อัตราผลตอบแทนของการกู้ยืม (Financing / Repo Rate) เป็นอัตราร้อยละ 6 ตำแหน่ง

ข้อ 10 ให้สมาชิกวิสามัญรายงานข้อมูลอย่างน้อยตาม ข้อ 9 (1) (2) (5) (6) และ (7)

ข้อ 11 สมาชิกต้องให้ความร่วมมือในการชี้แจงและจัดส่งข้อมูลเพิ่มเติมแก่สมาคมภายในเวลาที่กำหนด เพื่อประโยชน์ในการตรวจสอบความถูกต้องและครบถ้วนของข้อมูล หรือเป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาระบบข้อมูล

ข้อ 12 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กันยายน 2565 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 1 กันยายน พ.ศ. 2565

(ลงนาม) นายสมหมาย ภาษี

(นายสมหมาย ภาษี)

ประธานกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย