

**ประกาศคณะกรรมการ
สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
เรื่อง มาตรการลงโทษสมาชิกเกี่ยวกับการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้**

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 20 (2) ประกอบกับข้อ 68 แห่งข้อบังคับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ลงวันที่ 21 กันยายน พ.ศ. 2548 คณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง มาตรการลงโทษสมาชิกเกี่ยวกับการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ฉบับลงวันที่ 24 เมษายน พ.ศ. 2555

ข้อ 2 ในประกาศนี้

“สมาคม”	หมายความว่า	สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
“สมาชิก”	หมายความว่า	สมาชิกของสมาคม
“รายการล่าช้า”	หมายความว่า	ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ประเภท Outright Transaction ของสมาชิกที่รายงานไม่เป็นไปตามเวลาที่กำหนดในข้อ 8 แห่งประกาศคณะกรรมการสมาคมฯ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ และได้รายงานภายในวันทำการถัดจากวันที่ทำรายการซื้อขาย แต่ไม่รวมถึงรายการซื้อขายตราสารหนี้อายุไม่เกิน 1 ปี ที่มีการฝากประมูลผ่านสมาชิก
“รายการผิดพลาด”	หมายความว่า	(1) ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีข้อผิดพลาด หรือไม่ถูกต้องที่สมาชิกสามัญและสมาชิกสมทบได้รายงานก่อนเวลา 16.00 น. และสมาชิกมิได้แก้ไขหรือยกเลิกรายการดังกล่าวภายในเวลา 16.00 น. หรือ (2) ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีข้อผิดพลาด หรือไม่ถูกต้องที่สมาชิกวิสามัญได้รายงานและมีได้แก้ไขหรือยกเลิกรายการดังกล่าว
“รายการที่ไม่รายงาน”	หมายความว่า	ข้อมูลการซื้อขายที่สมาคมกำหนดให้สมาชิกต้องรายงาน แต่สมาชิกมิได้รายงานมายังสมาคม หรือรายงานมาล่าช้าเกินกว่า 1 วันทำการนับจากวันที่ทำการซื้อขาย
“การฝากประมูล”	หมายความว่า	การฝากประมูลตราสารหนี้ผ่านสมาชิก
“รายการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีมูลค่าน้อย (Small Lot)”	หมายความว่า	รายการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีมูลค่าการซื้อขายต่อรายการ เป็นไปตามที่สมาคมกำหนด

- ข้อ 3 ภายใต้ประกาศคณะกรรมการสมาคมฉบับนี้ ให้การปฏิบัติที่ไม่ได้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ไม่รวมถึงรายการที่เกิดจากเหตุสุดวิสัยหรือรายการที่มีค่าขอแก้ไขเปลี่ยนแปลง ยกเลิก จากลูกค้าในภายหลัง
- ข้อ 4 กำหนดโทษสำหรับการปฏิบัติที่ไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ โดยการปรับเป็นเงินตามอัตราที่กำหนด ดังนี้
- 4.1 รายการล่าช้า ปรับรายการละ 30 บาท
 - 4.2 รายการล่าช้ามากกว่าร้อยละ 5 ของจำนวนรายการ Outright Transaction ทั้งหมดที่สมาชิกรายนั้นๆ รายงานมายังสมาคมในแต่ละเดือนต่อเนื่องกัน 3 เดือน กำหนดให้ปรับในอัตรา 5,000 บาท ในเดือนที่ 3 ที่มีการล่าช้าต่อเนื่องมากกว่าร้อยละ 5 และปรับเป็น 10,000 บาท ในเดือนที่ 4 ที่มีการล่าช้าต่อเนื่องมากกว่าร้อยละ 5 และปรับเพิ่มอีกทุก 10,000 บาท ในเดือนต่อไปเป็นอัตราก้าวหน้า หากยังคงมีรายการล่าช้ามากกว่าร้อยละ 5 ต่อเนื่องกัน
 - 4.3 รายการผิดพลาด ปรับรายการละ 100 บาท
 - 4.4 รายการที่ไม่รายงาน ปรับรายการละ 100 บาทต่อวันทำการ จนกว่าสมาชิกจะได้ดำเนินการให้ถูกต้อง ทั้งนี้ ปรับสูงสุดไม่เกิน 30 วันทำการ ต่อรายการที่ไม่รายงาน
- โทษปรับสูงสุดในแต่ละข้อให้ปรับได้สูงสุดไม่เกิน 300,000 บาท
- ข้อ 5 มีให้นำโทษตามข้อ 4 มาใช้บังคับกับรายการ ดังต่อไปนี้
- 5.1 รายการล่าช้าที่มีจำนวนไม่เกินกว่าร้อยละ 1 ของจำนวนรายการ Outright Transaction ทั้งหมดที่สมาชิกรายงานมายังสมาคมในแต่ละเดือน
 - 5.2 รายการล่าช้าที่ไม่เกินกว่า 6 รายการ หรือจำนวนรายการล่าช้าเฉลี่ยไม่เกินร้อยละ 1 ในรอบครึ่งปีปฏิทิน
 - 5.3 รายการผิดพลาด ที่ถือว่าไม่มีนัยสำคัญและไม่มีผลกระทบต่อตลาด หรือมีผลกระทบต่อข้อมูลราคาได้แก่
 - 5.3.1 แก้อัตราผลตอบแทน (Yield) ที่น้อยกว่าหรือเท่ากับร้อยละ 0.01 (1 basis point)
 - 5.3.2 แก้อัญลักษณ์ตราสารหนี้ (Symbol) เฉพาะตราสารหนี้ที่มีอายุไม่เกิน 1 ปี ในลำดับรุ่น เช่น จาก A ไป B
 - 5.3.3 แก้ววันชำระราคาและส่งมอบ (Settlement date)
 - 5.3.4 แก้อายุของรายการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีมูลค่าน้อย (Small lot)
- ข้อ 6 ให้ลงโทษปรับกรณีรายการที่ไม่รายงานตามเกณฑ์ข้อ 4.4 แต่สูงสุดไม่เกิน 30,000 บาท สำหรับยอดรวมรายการ ที่มีลักษณะดังนี้
- 6.1 ตราสารหนี้ที่มีมูลค่าน้อยกว่า 1 ล้านบาทต่อรายการ หรือ
 - 6.2 ตราสารหนี้ระยะสั้นที่มีอายุไม่เกินหนึ่งปี ที่ขายให้แก่ลูกค้า/ลูกค้ำ เนื่องจากการฝากจองหรือฝากประมูล
- ทั้งนี้ การคิดค่าปรับให้คิดจากวันรายงานของสมาชิกในรอบทุกๆ 6 เดือนปฏิทิน

- ข้อ 7 สำหรับรายการผิดพลาด และรายการที่ไม่รายงานที่ตรวจพบโดยหน่วยงานตรวจสอบหรือกำกับดูแลของสมาชิกเป็นผู้ตรวจสอบพบ และรายงานให้สมาคมทราบ ให้ลงโทษเพียงกึ่งหนึ่งของโทษที่เกี่ยวข้องกับรายการทั้งหมดและสูงสุดไม่เกิน 100,000 บาท
- ข้อ 8 ในกรณีที่สมาคมมีคำสั่งเป็นหนังสือให้สมาชิกตรวจสอบและรายงานข้อมูลให้ถูกต้อง พร้อมทั้งดำเนินการแก้ไขปรับปรุงและหามาตรการป้องกันมิให้เกิดรายการที่ไม่รายงานอีกในเวลาที่เหมาะสม และสมาชิกได้ดำเนินการตามระยะเวลาที่กำหนดไว้แล้ว ไม่ให้นำค่าปรับตามข้อ 4.4 มาใช้กับรายการที่ได้รายงานมาภายหลังตามคำสั่งของสมาคม
- ข้อ 9 ให้กรรมการผู้จัดการสมาคมเป็นผู้มีอำนาจพิจารณาและออกคำสั่ง ให้สมาชิกตรวจสอบและรายงานข้อมูลให้ถูกต้อง ลงโทษในรายการล่าช้า รายการล่าช้าต่อเนื่อง รายการผิดพลาด หรือรายการที่ไม่รายงาน และให้รายงานผลการลงโทษให้คณะอนุกรรมการวินัยทราบในการประชุมครั้งถัดไปภายหลังจากการออกคำสั่งลงโทษ
- ข้อ 10 กำหนดให้คณะอนุกรรมการวินัยมีอำนาจในการพิจารณาเพิ่มโทษได้นอกเหนือจากการลงโทษตามที่กำหนดไว้ในข้อ 4 แล้ว ในกรณีที่เชื่อได้ว่ามีเจตนาไม่รายงานตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ และมีผลกระทบต่อการซื้อขายหรือการกำหนดราคาของตลาด โดยการเพิ่มโทษให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์วิธีการพิจารณาความผิดและลงโทษของคณะอนุกรรมการวินัย
- ข้อ 11 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 21 มกราคม พ.ศ. 2557 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 21 มกราคม พ.ศ. 2557



(นายบัณฑิต นิจถาวร)

ประธานกรรมการ

สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย