(ร่าง) 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 1 กันยายน 2565

ข้อ 2 ในประกาศนี้

"เจ้าหน้าที่บริหาร" (Executive Officer) หมายความว่า ผู้บริหารของสมาชิกที่ได้รับการแต่งตั้งให้เป็นผู้แทนของสมาชิก

"ผู้ค้าตราสารหนี้" (Trader) หมายความว่า เจ้าหน้าที่ของสมาชิกที่ได้รับการแต่งตั้งให้เป็นผู้กระทำการแทน ในการซื้อขายตราสารหนี้และขึ้นทะเบียนกับสมาคม

"การซื้อขายตราสารหนี้" หมายความว่า การซื้อขายตราสารหนี้ตามปกติ (Outright Transaction) และให้ครอบคลุมถึงการทำธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้เพื่อหาเงินทุน (Financing Transaction) การทำอนุพันธ์ทางการเงินด้านตราสารหนี้ (Derivatives Transaction) รวมถึงการซื้อขายตราสารหนี้เพื่อวัตถุประสงค์อื่น (Other Transaction)

"เวลาที่ตกลงซื้อขาย" (Trade Time หรือ Time of Execution) หมายความว่า ณ เวลาขณะที่สมาชิกได้ตกลงซื้อขายกับลูกค้า / คู่ค้า โดยเป็นที่ยอมรับข้อตกลงการซื้อขายทั้งสองฝ่าย ไม่ว่าโดยวิธีการซื้อขายแบบใด ทั้งนี้ มิให้หมายความถึง ณ เวลาที่สมาชิกและ/หรือลูกค้า / คู่ค้าได้รับแจ้งยืนยันการซื้อขายเป็นลายลักษณ์อักษร

"วันชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้" (Settlement Date) หมายความว่า วันที่มีการชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้ตามรายการซื้อขาย ทั้งนี้ ในกรณีที่การชำระราคาและการส่งมอบมิได้เกิดขึ้นในวันเดียวกัน ให้ถือเอาวันที่ส่งมอบตราสารหนี้ ซึ่งเป็นวันที่ใช้ในการคำนวณราคา (Settlement Price) เป็นวันชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้

"การซื้อขายในลักษณะ Switching Portfolio" หมายความว่า การซื้อขายตราสารหนี้ ในลักษณะที่สมาชิกทำหน้าที่เป็นตัวกลางในการจับคู่การซื้อขายระหว่างลูกค้าหรือคู่ค้า โดยมิได้เป็นคู่สัญญาในฐานะผู้ถือครองตราสารนั้น ซึ่งรวมถึงแต่ไม่จำกัดเฉพาะกรณีดังต่อไปนี้

(ก) การย้ายการลงทุนระหว่างกองทุน หรือระหว่างนิติบุคคล เช่น บริษัทประกันภัย

(ข) การเป็นตัวกลางในกรณีที่คู่ค้าทั้งสองฝ่ายมีข้อจำกัดด้านวงเงินสินเชื่อ (Credit Line) ระหว่างกัน

(ค) การซื้อขายระหว่างกองทุนที่อยู่ภายใต้การบริหารจัดการของบริษัทเดียวกัน (Cross Trade)

ส่วนที่ 1
บททั่วไป

ข้อ 3 สมาคมจะจัดให้มีระบบสารสนเทศสำหรับการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ผ่านเครือข่ายคอมพิวเตอร์หรือสื่ออิเล็กทรอนิกส์อื่นตามหลักเกณฑ์ วิธีการ และรูปแบบที่สมาคมกำหนด

ข้อ 4 สมาคมสงวนสิทธิ์ในการใช้ข้อมูลต่างๆที่สมาคมทำการเผยแพร่

ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่สมาชิกรายงานเข้ามายังสมาคมตามประกาศนี้ ให้ถือเป็นข้อมูลที่อยู่ภายใต้การบริหารจัดการของสมาคม โดยสมาคมมีสิทธิรวบรวม จัดเก็บ ปรับปรุง วิเคราะห์ ประมวลผล และเผยแพร่ข้อมูลดังกล่าวได้ตามวัตถุประสงค์ของสมาคม

การนำข้อมูลดังกล่าวไปใช้ ทำซ้ำ ดัดแปลง หรือเผยแพร่ ไม่ว่าในรูปแบบใดๆ เพื่อประโยชน์ในทางการค้าต้องได้รับอนุญาตเป็นหนังสือจากสมาคม

ส่วนที่ 2
การรายงานข้อมูล

ข้อ 5 ให้สมาชิกรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ต่อสมาคม ตามแบบรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่ทางสมาคมกำหนด

ข้อ 6 ในการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ให้ดำเนินการผ่านระบบอิเล็กทรอนิกส์สำหรับการรายงานข้อมูล หรือผ่านระบบหรือช่องทางอื่นใดตามที่สมาคมกำหนด

การแก้ไขหรือยกเลิกข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่เกี่ยวข้องกับการเผยแพร่รายงานการซื้อขายประจำวัน (ThaiBMA Daily Report) ภายหลังเวลา 16.00 น. หรือเวลาอื่นใดตามที่สมาคมกำหนดให้เป็นเวลาตัดรอบการรายงานข้อมูล (Cut-off Time) ให้สมาชิกแจ้งสมาคมโดยทันทีและแจ้งเป็นลายลักษณ์อักษรภายในวันทำการถัดไป ทั้งนี้ ตามหลักเกณฑ์ รูปแบบและวิธีการที่สมาคมกำหนด

ข้อ 7 ให้สมาชิกแต่งตั้งผู้มีหน้าที่รับผิดชอบการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ซึ่งอาจเป็นผู้ค้าตราสารหนี้ (Trader) เจ้าหน้าที่บริหาร (Executive Officer) หรือ ผู้ที่ได้รับมอบหมายเป็นลายลักษณ์อักษรให้มีหน้าที่ในการรายงานข้อมูล (Reporter)

ในกรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงบุคคลตามวรรคแรก ให้สมาชิกแจ้งเป็นหนังสือต่อสมาคมภายใน 5 วันทำการนับแต่วันที่มีการเปลี่ยนแปลง

ข้อ 8 การรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ตามประกาศนี้ ให้สมาชิกรายงานภายในกำหนดเวลา ดังต่อไปนี้

(1) สมาชิกสามัญและสมาชิกสมทบ

(1.1) รายการซื้อขายที่เกิดขึ้นตั้งแต่เวลา 00.00 นาฬิกา ถึงก่อนเวลา 9.00 นาฬิกา ให้รายงานภายในเวลา 9.30 นาฬิกา ของวันที่เกิดรายการซื้อขาย

(1.2) รายการซื้อขายที่เกิดขึ้นตั้งแต่เวลา 9.00 นาฬิกา ถึงเวลา 15.30 นาฬิกา ให้รายงานภายใน 30 นาที นับแต่เวลาที่ตกลงซื้อขาย

(1.3) รายการซื้อขายที่เกิดขึ้นหลังเวลา 15.30 นาฬิกา ถึงเวลา 24.00 นาฬิกา ให้รายงานภายในเวลา 9.30 นาฬิกา ของวันถัดจากวันที่เกิดรายการซื้อขาย

ในกรณีที่วันที่ครบกำหนดรายงาน ไม่ใช่วันทำการ ให้เลื่อนกำหนดเวลาการรายงานเป็นภายในเวลา 9.30 นาฬิกา ของวันทำการถัดไป

(2) สมาชิกวิสามัญ

รายงานการซื้อขายที่เกิดขึ้นหลังเวลา 15.30 นาฬิกา ของวันทำการก่อนหน้า ถึงเวลา 15.30 นาฬิกา ของวันทำการปัจจุบัน ให้รายงานภายในเวลา 17.00 นาฬิกา ของวันทำการปัจจุบัน

ข้อ 9 ข้อมูลที่สมาชิกต้องรายงาน ให้ประกอบด้วยข้อมูลดังต่อไปนี้

(1) วันที่ทำรายการซื้อขาย (Trade Date)

(2) สัญลักษณ์ตราสารหนี้ (Symbol)

(3) ประเภทของรายการว่าเป็นรายการซื้อหรือขาย (Buy or Sell)

(4) วัตถุประสงค์หลัก (Purpose) และวัตถุประสงค์รอง (Subpurpose) ของการซื้อขาย 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 เป็นร้อยละของ Current Par

(6) ปริมาณการซื้อขาย (Volume) ที่มีหน่วยเป็น Unit

(7) เวลาที่ตกลงซื้อขาย (Trade Time / Time of Execution)

(8) วันชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้ (Settlement Date)

(9) เลขประจำตัวผู้ค้าตราสารหนี้ (Trader ID) ทั้งนี้ การรายงานธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้เพื่อหาเงินทุนประเภทการกู้ยืมภาคเอกชน (Private Repo) ผู้รายงานสามารถใช้เลขประจำตัวผู้รายงานข้อมูล (Reporter ID) แทนเลขประจำตัวผู้ค้าตราสารหนี้ (Trader ID) ได้

(10) คู่ค้า / ลูกค้า (Counterparty) ให้ระบุเป็นชื่อย่อตามที่สมาคมกำหนดไว้ในบัญชีแนบท้ายประกาศนี้

(11) สำหรับการทำธุรกรรมที่เกี่ยวข้องกับตราสารหนี้เพื่อหาเงินทุน (Financing Transaction) ให้รายงานธุรกรรมเฉพาะรายการในขาแรกเท่านั้น โดยให้ระบุข้อมูลเพิ่มเติม ดังนี้

(11.1) ระยะเวลาของการกู้ยืม (Financing / Repo Term) ให้ระบุเป็นจำนวนวัน โดยให้นับรวมวันหยุดทำการด้วย

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

(11.3) จำนวนเงินที่ให้กู้ยืม (Purchase Amount) ให้รายงานเฉพาะธุรกรรมการกู้ยืมที่เป็นสกุลเงินบาทเท่านั้น

(11.4) กรณีธุรกรรมอ้างอิงอัตราดอกเบี้ยลอยตัว (Floating Rate) ประเภท Thai Overnight Repurchase Rate (THOR) ให้ระบุข้อมูลเพิ่มเติม ได้แก่ ส่วนต่างอัตราดอกเบี้ย (Spread) ประเภทดอกเบี้ย (Fin Type: Fixed หรือ THOR) รูปแบบการคำนวณ (Rate Convention: Plain, Lookback, Backward-shift, Lockout, Payment Delay) และจำนวนวันสำหรับคำนวณดอกเบี้ย (No. of Days for Rate Convention) หรือข้อมูลอื่นใดตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด

(12) ในกรณีที่เป็นธุรกรรมการซื้อขายในลักษณะ Switching Portfolio ให้ระบุ “SWP” ไว้ในช่องหมายเหตุ

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

ข้อ 11 ให้สมาชิกให้ความร่วมมือในการชี้แจงข้อเท็จจริง และจัดส่งข้อมูลหรือเอกสารเพิ่มเติมต่อสมาคมตามที่สมาคมร้องขอภายในระยะเวลาที่กำหนด เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแล ตรวจสอบความถูกต้องและความครบถ้วนของข้อมูล หรือเป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาระบบข้อมูลของสมาคม

ข้อ 12 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ ..... เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ .....

(.....)

ประธานกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย