(ร่าง) ประกาศคณะกรรมการ
สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
เรื่อง มาตรการลงโทษสมาชิกเกี่ยวกับการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 20 (2) ประกอบกับข้อ 68 แห่งข้อบังคับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ลงวันที่ 21 กันยายน พ.ศ. 2548 (และที่แก้ไขเพิ่มเติม) คณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยออกข้อกำหนด ไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง มาตรการลงโทษสมาชิกเกี่ยวกับการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ฉบับลงวันที่ 21 มกราคม พ.ศ. 2557

ข้อ 2 ในประกาศนี้

"สมาคม"	หมายความว่า	สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
"สมาชิก"	หมายความว่า	สมาชิกของสมาคม
"การซื้อขายตราสารหนี้"	หมายความว่า	การซื้อขายตราสารหนี้ประเภท Outright Transaction
"รายการล่าช้า"	หมายความว่า	ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ของสมาชิกที่รายงานไม่เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนดไว้ในประกาศคณะกรรมการสมาคม เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ แต่สมาชิกได้รายงานภายในวันทำการถัดจากวันที่ทำรายการซื้อขาย ทั้งนี้ ไม่รวมถึงรายการซื้อขายตราสารหนี้อายุไม่เกิน 1 ปี ซึ่งมีการฝากประมูลผ่านสมาชิก
"รายการผิดพลาด"	หมายความว่า	(1) ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีข้อผิดพลาด หรือไม่ถูกต้องที่สมาชิกสามัญและสมาชิกสมทบได้รายงานก่อนเวลา16.00 น. และสมาชิกมิได้แก้ไขหรือยกเลิกรายการดังกล่าวภายในเวลา 16.00 น. หรือ (2) ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่ มีข้อผิดพลาด หรือไม่ถูกต้องที่สมาชิกวิสามัญได้รายงานและมิได้แก้ไขหรือยกเลิกรายการดังกล่าว
"รายการที่ไม่รายงาน"	หมายความว่า	ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ที่สมาคมกำหนดให้สมาชิกมีหน้าที่รายงานต่อสมาคม แต่สมาชิกมิได้รายงานข้อมูลดังกล่าว หรือรายงานมาล่าช้าเกินกว่า 1 วันทำการนับแต่วันที่ทำการซื้อขาย
"การฝากประมูล"	หมายความว่า	การฝากประมูลตราสารหนี้ผ่านสมาชิก
"รายการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีมูลค่าน้อย (Small Lot)"	หมายความว่า	รายการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีมูลค่าการซื้อขายต่อรายการเป็นไปตามหลักเกณฑ์และมูลค่าที่สมาคมกำหนด

คำว่า "การซื้อขายในลักษณะ Switching Portfolio" ให้มีความหมายเช่นเดียวกับบทนิยามของคำดังกล่าวในประกาศคณะกรรมการสมาคม เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้

ข้อ 3 ภายใต้ประกาศคณะกรรมการสมาคมฉบับนี้ การปฏิบัติที่ไม่ได้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ไม่รวมถึงกรณีรายการที่เกิดจากเหตุสุดวิสัย หรือรายการที่มีคำขอจากลูกค้าให้แก้ไขเปลี่ยนแปลง หรือยกเลิกรายการ ภายหลังจากการรายงานข้อมูลแล้ว

ข้อ 4 กำหนดโทษสำหรับการปฏิบัติที่ไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ โดยให้ปรับเป็นเงินตามอัตราที่กำหนด ดังนี้

4.1 รายการล่าช้า ปรับรายการละ 30 บาท

4.2 รายการล่าช้ามากกว่าร้อยละ 5 ของจำนวนรายการการซื้อขายตราสารหนี้ทั้งหมดที่สมาชิกนั้นรายงานต่อสมาคมในแต่ละเดือน ต่อเนื่องกันเป็นระยะเวลา 3 เดือน กำหนดให้ปรับเป็นเงินจำนวน 5,000 บาท ในเดือนที่ 3 ที่มีรายการล่าช้าต่อเนื่องมากกว่าร้อยละ 5 และปรับเป็นเงินจำนวน 10,000 บาท ในเดือนที่ 4 ที่มีรายการล่าช้าต่อเนื่องมากกว่าร้อยละ 5 ทั้งนี้ หากในเดือนถัด ๆไป ยังคงมีรายการล่าช้า มากกว่าร้อยละ 5 ต่อเนื่องกันอีก ให้ปรับเพิ่มขึ้นเดือนละ 10,000 บาท ในลักษณะอัตราก้าวหน้า

4.3 รายการผิดพลาด ปรับรายการละ 100 บาท

4.4 รายการที่ไม่รายงาน ปรับรายการละ 100 บาทต่อวันทำการ โดยให้นับตั้งแต่วันที่พ้นกำหนดระยะเวลารายงาน จนกว่าสมาชิกจะดำเนินการรายงานให้ถูกต้อง แต่ให้ปรับสูงสุดไม่เกิน 30 วันทำการ ต่อรายการที่ไม่รายงาน

ทั้งนี้ โทษปรับสูงสุดสำหรับความผิดในแต่ละข้อ ให้ปรับได้สูงสุดได้ไม่เกิน 300,000 บาท และการกำหนดโทษปรับดังกล่าว ไม่เป็นเหตุให้สมาชิกพ้นจากหน้าที่ในการแก้ไขรายการผิดพลาด หรือรายงานข้อมูลสำหรับรายการที่ยังมิได้รายงานต่อสมาคม ให้ครบถ้วนตามประกาศนี้

ข้อ 5 มิให้นำโทษตามข้อ 4 มาใช้บังคับกับรายการ ดังต่อไปนี้

5.1 รายการล่าช้าที่มีจำนวนไม่เกิน 6 รายการ หรือจำนวนรายการล่าช้าเฉลี่ยไม่เกินร้อยละ 1 ของจำนวนรายการการซื้อขายตราสารหนี้ทั้งหมด ในรอบครึ่งปีปฏิทิน

ทั้งนี้ จำนวนรายการล่าช้าที่สมาคมตรวจพบจากการตรวจสอบสมาชิกจะไม่นำมารวมคำนวณเพื่อพิจารณาสิทธิในการยกเว้นโทษตามข้อนี้

5.2 รายการผิดพลาด ที่ถือว่าไม่มีนัยสำคัญและไม่มีผลกระทบต่อตลาด หรือมีผลกระทบต่อข้อมูลราคาในระดับน้อยมาก ได้แก่

5.2.1 การแก้ไขอัตราผลตอบแทน (Yield) ที่คลาดเคลื่อนไม่เกินร้อยละ 0.01 (1 basis point)

5.2.2 การแก้ไขสัญลักษณ์ตราสารหนี้ (Symbol) เฉพาะตราสารหนี้ที่มีอายุไม่เกิน 1 ปี และเป็นการแก้ไขเฉพาะลำดับรุ่น เช่น จาก A ไป B

5.2.3 การแก้ไขวันชำระราคาและส่งมอบตราสารหนี้ (Settlement date)

5.2.4 การแก้ไขข้อมูลของรายการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีมูลค่าน้อย (Small lot)

5.2.5 การแก้ไขข้อความในช่องหมายเหตุที่ไม่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมการซื้อขายในลักษณะ Switching Portfolio

ข้อ 6 ให้ลงโทษปรับกรณีไม่รายงานรายการซื้อขายตามเกณฑ์ข้อ 4.4 โดยคิดค่าปรับจากยอดรวมของรายการที่ไม่รายงานในแต่ละรอบระยะเวลา 6 เดือนปฏิทิน ทั้งนี้ โทษปรับรวมสูงสุดไม่เกิน 30,000 บาท สำหรับรายการที่มีลักษณะดังนี้

6.1 รายการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีมูลค่าน้อยกว่า 1 ล้านบาทต่อรายการ หรือ

6.2 รายการซื้อขายตราสารหนี้ระยะสั้นที่มีอายุไม่เกินหนึ่งปี ซึ่งขายให้แก่คู่ค้า/ลูกค้า เนื่องจากการฝากจองหรือฝากประมูล

ข้อ 7 กรณีรายการผิดพลาด หรือรายการที่ไม่รายงาน ซึ่งหน่วยงานตรวจสอบหรือกำกับดูแลของสมาชิกเป็นผู้ตรวจพบ และรายงานให้สมาคมทราบ ให้ลงโทษปรับในอัตรากึ่งหนึ่งของโทษปรับที่กำหนดสำหรับรายการดังกล่าว ทั้งนี้ โทษปรับรวมสูงสุดต้องไม่เกิน 100,000 บาท

ข้อ 8 ในกรณีที่สมาคมมีคำสั่งเป็นหนังสือให้สมาชิกตรวจสอบและรายงานข้อมูลให้ถูกต้อง รวมทั้งให้ดำเนินการแก้ไขปรับปรุงและกำหนดมาตรการป้องกันเพื่อมิให้เกิดกรณีไม่รายงานรายการซื้อขายอีกภายในระยะเวลาที่สมาคมกำหนด และสมาชิกได้ดำเนินการแล้วเสร็จภายในระยะเวลาดังกล่าว ให้ยกเว้นการนำโทษปรับตามข้อ 4.4 มาใช้บังคับกับรายการที่ได้รายงานเพิ่มเติมภายหลังตามคำสั่งของสมาคม

ข้อ 9 กรรมการผู้จัดการสมาคมมีอำนาจพิจารณาและออกคำสั่งให้สมาชิกดำเนินการตรวจสอบและรายงานข้อมูลให้ถูกต้อง รวมทั้งมีอำนาจลงโทษสำหรับกรณีรายการล่าช้า รายการล่าช้าต่อเนื่อง รายการผิดพลาด หรือรายการที่ไม่รายงาน ทั้งนี้ ให้รายงานผลการลงโทษดังกล่าวต่อคณะอนุกรรมการวินัยทราบในการประชุมครั้งถัดไปภายหลังการออกคำสั่งลงโทษ

ข้อ 10 คณะอนุกรรมการวินัยมีอำนาจพิจารณาเพิ่มโทษนอกเหนือจากการลงโทษตามที่กำหนดไว้ในข้อ 4 ได้ในกรณีที่มีเหตุอันควรเชื่อได้ว่า มีเจตนาไม่ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้และการกระทำดังกล่าวก่อให้เกิดผลกระทบต่อการซื้อขายหรือการกำหนดราคาของตลาด ทั้งนี้ การพิจารณาเพิ่มโทษให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์วิธีการพิจารณาความผิดและลงโทษของคณะอนุกรรมการวินัย

ข้อ 11 ความในข้อ 5.1 วรรคสอง ที่กำหนดมิให้นำจำนวนรายการล่าช้าที่สมาคมตรวจพบจากการตรวจสอบสมาชิกมารวมคำนวณเพื่อพิจารณาสิทธิในการยกเว้นโทษนั้น ให้เริ่มใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2570 เป็นต้นไป

ข้อ 12 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ ..... เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ .....

(.....)

ประธานกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย