

ประกาศคณะกรรมการ
สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
เรื่อง มาตรฐานการปฏิบัติงานในตลาดตราสารหนี้

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

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“สมาชิก”	หมายความว่า	สมาชิกของสมาคม
“การซื้อขาย”	หมายความว่า	การซื้อขายตราสารหนี้
“ราคาซื้อขาย”	หมายความว่า	ราคาหรืออัตราผลตอบแทนจากการซื้อขายตราสารหนี้
“ลูกค้า”	หมายความว่า	ลูกค้าที่ทำการซื้อขายตราสารหนี้กับสมาชิก
“คู่ค้า”	หมายความว่า	สถาบันการเงินที่ได้รับใบอนุญาตค้าหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนี้ และทำการซื้อขายตราสารหนี้กับสมาชิก
“สำนักงาน ก.ล.ต.”	หมายความว่า	สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 2 สมาชิกต้องปฏิบัติตามและดำเนินการควบคุมดูแลให้กรรมการ ผู้บริหาร ผู้ค้าตราสารหนี้ พนักงานหรือบุคคลที่อยู่ภายใต้การควบคุมของสมาชิกไม่ว่าทางตรงหรือทางอ้อม ปฏิบัติตามมาตรฐานการปฏิบัติงานในตลาดตราสารหนี้ตามที่สมาคมกำหนดดังต่อไปนี้

(1) การติดต่อกับลูกค้า / คู่ค้า

(1.1) การกำหนดวงเงินซื้อขายให้กับลูกค้า / คู่ค้า แต่ละราย สมาชิกต้องกำหนดให้มีขั้นตอนและผู้มีอำนาจในการพิจารณากำหนดวงเงินซื้อขายกับลูกค้า / คู่ค้า อย่างเหมาะสมและชัดเจน

(1.2) กรณีมีการมอบอำนาจใดๆ ให้ผู้อื่นกระทำการแทน สมาชิกต้องดำเนินการให้ลูกค้า / คู่ค้า จัดทำหนังสือมอบอำนาจ โดยระบุรายละเอียดเกี่ยวกับการมอบอำนาจนั้นให้ครบถ้วนชัดเจน

(1.3) สมาชิกต้องบันทึกการเปลี่ยนแปลงข้อมูลต่างๆ ของลูกค้า / คู่ค้า ไว้ทุกครั้ง และทบทวนข้อมูลให้เป็นปัจจุบันอยู่เป็นประจำ

(2) การเสนอราคาซื้อขาย

(2.1) ผู้ค้าตราสารหนี้มีหน้าที่รับผิดชอบในการเสนอราคาจะต้องระบุให้ชัดเจนว่าราคาที่เสนอดังกล่าวเป็นราคาที่ต้องการซื้อขายจริง (Firm) หรือเป็นเพียงราคาชี้แนะ (Indicative) เท่านั้น ถ้ามิได้ระบุเป็นอย่างอื่น ให้ถือว่าราคาที่เสนอนั้นเป็นเพียงราคาชี้แนะ (Indicative)

(2.2) ผู้ค้าตราสารหนี้ที่เสนอราคาที่ต้องการซื้อขายจริงให้กับลูกค้า / คู่ค้า ต้องพร้อมที่จะตกลงซื้อขายตามเงื่อนไขที่กำหนดและตามจำนวนมาตรฐาน

(3) การซื้อขายตราสารหนี้

(3.1) สมาชิกต้องจัดให้มีการบันทึกเวลาที่ตกลงซื้อขายในแต่ละรายการอย่างครบถ้วน และเป็นไปตามเวลาที่ตกลงซื้อขายกันจริง

(3.2) กำหนดให้ “เวลาที่ตกลงซื้อขาย” (Trade Time หรือ Time of Execution) หมายถึง ณ เวลาขณะที่สมาชิกได้ตกลงซื้อขายกับลูกค้า / คู่ค้า โดยเป็นที่ยอมรับข้อตกลงการซื้อขายทั้งสองฝ่าย ไม่ว่าโดยวิธีการซื้อขายแบบใด ทั้งนี้ มิให้หมายความถึง ณ เวลาที่สมาชิกและ/หรือลูกค้า / คู่ค้าได้รับแจ้งยืนยันการซื้อขายเป็นลายลักษณ์อักษร

(3.3) กรณีที่มีการกำหนดวงเงินซื้อขายให้กับลูกค้า / คู่ค้าแต่ละราย สมาชิกต้องจัดให้มีระบบตรวจสอบวงเงินของลูกค้า / คู่ค้าแต่ละรายทุกครั้งก่อนดำเนินการซื้อขาย

(4) การซื้อขายที่ไม่ใช่ราคาตลาด

สมาชิกจะต้องไม่ทำธุรกรรมการซื้อขายที่ไม่ใช่ราคาตลาด เว้นแต่จะมีเหตุผลรองรับการทำธุรกรรมดังกล่าว และต้องดำเนินการควบคุมเพื่อป้องกันมิให้เป็นการทำธุรกรรมที่มีวัตถุประสงค์อันขัดต่อกฎหมายและจรรยาบรรณ เช่น การปกปิดกำไรขาดทุน การสร้างราคาที่เป็นอนาจจากราคาตลาด การกลั่นแกล้งลูกค้าหรือลูกค้าด้วยกัน เป็นต้น

การซื้อขายที่ไม่ใช่ราคาตลาดโดยมีเหตุผลอันสมควรรองรับ เช่น การซื้อขายตามภาวะผูกพัน (Option) สมาชิกต้องระบุเหตุผลประกอบการซื้อขายนั้นให้ชัดเจนและจัดให้สามารถตรวจสอบได้

(5) การยืนยันการซื้อขาย

(5.1) หลังจากการตกลงซื้อขาย สมาชิกต้องตรวจสอบความถูกต้องและแจ้งยืนยันการซื้อขายให้ลูกค้า / คู่ค้าทราบเป็นลายลักษณ์อักษรภายในวันที่ซื้อขาย เว้นแต่การซื้อขายที่เกิดหลังจากเวลาทำการปกติให้แจ้งยืนยันภายในเวลา 9.00 น. ของวันทำการถัดไป

(5.2) การยืนยันการซื้อขายจะต้องมีข้อมูลอย่างน้อยดังนี้

- ชื่อลูกค้า / คู่ค้า
- ชื่อผู้ค้าตราสารหนี้
- ชื่อ จำนวนและมูลค่าของตราสารหนี้ที่ซื้อขาย
- ราคา และ/หรือ อัตราผลตอบแทนของการซื้อขาย
- วันและเวลาที่ตกลงซื้อขาย และวันชำระราคาและส่งมอบ

(6) การเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือยกเลิกรายการซื้อขาย

เมื่อมีการตกลงซื้อขายกันแล้วสมาชิกจะต้องดำเนินการตามข้อตกลงนั้น การเปลี่ยนแปลงแก้ไข หรือยกเลิกรายการจะกระทำได้อีกเมื่อทั้งสองฝ่ายตกลงยินยอมเท่านั้น และสมาชิกจะต้องแจ้งสมาคมถึงการเปลี่ยนแปลงแก้ไขหรือยกเลิกรายการดังกล่าว

(7) คำสั่งการชำระราคาและส่งมอบ

(7.1) สมาชิกต้องดำเนินการให้มีการส่งคำสั่งชำระราคาและส่งมอบให้แก่ลูกค้า / คู่ค้าโดยเร็วที่สุด โดยผ่านวิธีการชำระราคาและส่งมอบที่ได้ตกลงกันไว้ล่วงหน้า กรณีที่มีการเปลี่ยนแปลงสมาชิกต้องแจ้งให้ลูกค้า / คู่ค้าทราบทันที

(7.2) มูลค่าการซื้อขายที่ต้องชำระ หรือรับชำระจะต้องเป็นไปตามข้อตกลงในการซื้อขายและสมาชิกจะต้องจัดทำเอกสารเพื่อแสดงรายการรับ - จ่ายเงินจากการซื้อขายตราสารหนี้ให้ครบถ้วน

(8) ความรับผิดชอบในกรณีชำระเงินผิดพลาดหรือล่าช้า

(8.1) เมื่อมีส่วนต่างในการชำระเงินเกิดขึ้นอันเป็นผลจากความผิดพลาดในการชำระเงินสมาชิกไม่ควรได้รับประโยชน์ใดๆ จากการเก็บเงินในส่วนที่ผิดพลาดนั้นไว้ โดยต้องส่งคืนเงินรวมทั้งผลประโยชน์ที่ได้จากเงินนั้นหลังหักค่าใช้จ่ายในการคืนเงินทันทีที่ได้รับการร้องขอ เว้นแต่สมาชิกและคู่ค้าจะตกลงกันเป็นอย่างอื่น

(8.2) เมื่อคู่ค้าได้รับความเสียหายอันเกิดจากการชำระเงินล่าช้า คู่ค้ามีสิทธิเรียกร้องให้ผู้ชำระเงินล่าช้าชดเชยค่าเสียหายที่เกิดขึ้นทั้งหมด

(9) การบันทึกเทปหรือสิ่งบันทึกข้อมูลทางอิเล็กทรอนิกส์ในการตกลงซื้อขาย

(9.1) สมาชิกจะต้องบันทึกเทปหรือสิ่งบันทึกข้อมูลทางอิเล็กทรอนิกส์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายแต่ละรายการไว้เป็นเวลาอย่างน้อย 1 เดือน หรือขยายระยะเวลาการจัดเก็บออกไปตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนด

(9.2) สมาชิกจะต้องบอกกล่าวให้ลูกค้า / คู่ค้าทราบว่ามีการบันทึกเทปหรือสิ่งบันทึกข้อมูลทางอิเล็กทรอนิกส์สำหรับการสนทนานั้น

(9.3) สมาชิกจะต้องเก็บเทปหรือสิ่งบันทึกข้อมูลทางอิเล็กทรอนิกส์ไว้ในที่ปลอดภัยเพื่อป้องกันการนำเทปดังกล่าวไปใช้อย่างผิดวัตถุประสงค์ กรณีที่ไม่ได้มีการบันทึกเทปไว้ อาจทำให้สมาชิกไม่มีหลักฐานไว้ในกรณีที่เกิดข้อพิพาทขึ้น

(10) มาตรฐานการซื้อขาย

ในการซื้อขายตราสารหนี้ให้ใช้มาตรฐานการซื้อขาย เช่น สูตรการคำนวณ ประเภทของราคาที่ใช้ตกลงซื้อขาย ปริมาณมาตรฐานของการซื้อขาย ตามที่สมาคมกำหนด

(11) นโยบาย แผนงาน ระเบียบวิธีปฏิบัติงาน

สมาชิกต้องจัดทำมีนโยบาย แผนงาน ระเบียบวิธีปฏิบัติงาน รวมถึงการควบคุมการปฏิบัติงานเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้ที่เป็นลายลักษณ์อักษร ที่สอดคล้องและเป็นไปตามกฎระเบียบที่เกี่ยวข้องขององค์กรกำกับดูแลและข้อกำหนดของสมาคม โดยต้องทำการปรับปรุงให้เป็นปัจจุบันอยู่เสมอ

ข้อ 3 ในการทำธุรกรรมการค้าตราสารหนี้กับลูกค้ารายย่อย สมาชิกอาจละเว้นจากการปฏิบัติตาม ข้อ 2 (1.1) (1.3) (3.3) ได้โดยอนุโลม ทั้งนี้สมาชิกควรจัดให้มีวิธีการปฏิบัติงานที่เหมาะสมเพื่อช่วยในการป้องกันความขัดแย้ง หรือข้อพิพาทที่อาจเกิดจากการละเว้นจากการปฏิบัติตามวรรคแรก

ข้อ 4 ให้สมาชิกวิสามัญปฏิบัติตามประกาศนี้ด้วยโดยอนุโลม แต่ให้ยกเว้น ข้อ 2 (1.1) (2.1) (3.3) (7.1) (7.2) (8.1) (8.2) และ ข้อ 3 ไม่ต้องปฏิบัติ

ข้อ 5 ให้คณะกรรมการมีอำนาจในการกำหนดแนวทางปฏิบัติเพิ่มเติมยกเลิก หรือเปลี่ยนแปลงแนวทางปฏิบัติ เพื่อประโยชน์โดยรวมของตลาดตราสารหนี้

ข้อ 6 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม พ.ศ. 2548 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 10 พฤศจิกายน พ.ศ. 2548

(ลงนาม) นายสมหมาย ภาษี

(นายสมหมาย ภาษี)

ประธานกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย