

**ประกาศคณะกรรมการ
สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
เรื่อง การจัดทำและเก็บบันทึกเอกสารหลักฐาน**

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

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“สมาชิก”	หมายความว่า	สมาชิกของสมาคม
“ตราสารหนี้”	หมายความว่า	ตราสารแห่งหนึ่งที่เป็นหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
“ลูกค้า”	หมายความว่า	ลูกค้าที่ทำการซื้อขายตราสารหนี้กับสมาชิก
“คู่ค้า”	หมายความว่า	สถาบันการเงินที่ได้รับใบอนุญาตค้าหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่ง และทำการซื้อขายตราสารหนี้กับสมาชิก

ข้อ 2 ในการซื้อขายตราสารหนี้ สมาชิกต้องจัดให้มีการจัดทำและจัดเก็บเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขาย อย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) เอกสารหลักฐานเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้แต่ละรายการ ซึ่งต้องมีข้อมูลดังต่อไปนี้
 - 1) วันและเวลาที่ตกลงซื้อขาย
 - 2) ชื่อ จำนวนและมูลค่าของตราสารหนี้ที่ซื้อขาย
 - 3) ราคา และ/หรือ อัตราผลตอบแทนของการซื้อขาย
 - 4) วันชำระราคาและส่งมอบ
 - 5) ชื่อหรือเลขประจำตัวของผู้ค้าตราสารหนี้ที่ทำรายการ
 - 6) ชื่อลูกค้า / คู่ค้า
 - 7) วัตถุประสงค์ของการซื้อขายว่าเป็นการซื้อขายตามปกติ (Outright) หรือการซื้อขายโดยมีสัญญาซื้อคืน (Repo) หรือการซื้อขายเพื่อวัตถุประสงค์อื่น
 - 8) อัตราดอกเบี้ยและระยะเวลากู้ยืม (ถ้ามี)
 - 9) สัญญาซื้อคืน (ถ้ามี)
 - 10) วิธีการซื้อขาย เช่น โทรศัพท์ ระบบซื้อขายอิเล็กทรอนิกส์ Inter-dealer Broker หรืออื่นๆ
- (2) เอกสารหลักฐานเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือยกเลิกรายการซื้อขาย ซึ่งต้องมีข้อมูลดังต่อไปนี้
 - 1) วันและเวลาที่เปลี่ยนแปลงแก้ไข หรือยกเลิกรายการซื้อขาย
 - 2) รายละเอียดและสาเหตุของการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือยกเลิกรายการซื้อขาย
 - 3) ระบุว่า การเปลี่ยนแปลงนั้นเกิดขึ้นเนื่องจากคำสั่งของลูกค้า / คู่ค้า หรือจากสมาชิก

- (3) สำเนาใบยืนยันการซื้อขายตราสารหนี้แต่ละรายการซึ่งได้ส่งให้กับลูกค้า / คู่ค้า
- (4) เอกสารหรือข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับลูกค้า / คู่ค้า
- (5) เอกสารหรือหลักฐานแสดงการรับมอบ ส่งมอบ หรือโอนตราสารหนี้
- (6) เอกสารแสดงการรับ-จ่าย หรือการโอนเงิน ในการซื้อขายตราสารหนี้
- (7) เอกสารแสดงยอดตราสารหนี้คงเหลือของสมาชิก ณ สิ้นวัน
- (8) รายชื่อผู้ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายตราสารหนี้ ได้แก่ ผู้ค้าตราสารหนี้ ผู้รายงานข้อมูลการซื้อขาย ผู้รับผิดชอบการรายงานข้อมูล (ถ้ามี) เจ้าหน้าที่การตลาด

ข้อ 3 การซื้อขายที่มีการเจรจาติดต่อผ่านทางโทรศัพท์ หรือทางสื่ออิเล็กทรอนิกส์ สมาชิกต้องจัดให้มีการบันทึกเทปการติดต่อสื่อสาร หรือสิ่งบันทึกข้อมูลทางอิเล็กทรอนิกส์ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายแต่ละรายการ

ข้อ 4 สมาชิกต้องจัดเก็บเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายตราสารหนี้ตามที่กำหนดไว้เป็นเวลาอย่างน้อย 2 ปี ยกเว้นหลักฐานตามข้อ 3 เป็นเวลาอย่างน้อย 1 เดือน หรือขยายระยะเวลาการจัดเก็บออกไปตามที่สำนักงาน ก.ล.ต. กำหนดในลักษณะที่องค์กรกำกับดูแลและสมาคมสามารถตรวจสอบได้

ข้อ 5 ให้สมาชิกวิสามัญปฏิบัติตามประกาศนี้ด้วยโดยอนุโลม แต่ให้ยกเว้น ข้อ 2 (5) (6) ไม่ต้องปฏิบัติ

ข้อ 6 ให้คณะกรรมการมีอำนาจในการกำหนดแนวทางปฏิบัติเพิ่มเติมยกเลิก หรือเปลี่ยนแปลงแนวทางปฏิบัติเพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลตนเองสำหรับการซื้อขายตราสารหนี้

ข้อ 7 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม พ.ศ. 2548 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 10 พฤศจิกายน พ.ศ. 2548

(ลงนาม) นายสมหมาย ภาษี

(นายสมหมาย ภาษี)

ประธานกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย