

แนวปฏิบัติในการขายทอดตลาด  
หลักประกันที่เป็นตราสารหนี้

ณ วันที่ 6 มกราคม พ.ศ.2564



## บทนิยาม

ตราสารหนี้	ตราสารหนี้ที่ขึ้นทะเบียนกับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
ผู้ทอดตลาด	บริษัทหลักทรัพย์ หรือนิติบุคคลที่บริษัทหลักทรัพย์มอบหมายให้เป็นผู้ดำเนินการขายทอดตลาดหลักประกันที่เป็นตราสารหนี้
สมาคม	สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
สำนักงาน ก.ล.ต.	สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

### 1. ขอบเขตของแนวปฏิบัติในการขายทอดตลาดหลักประกันที่เป็นตราสารหนี้

ตามที่สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยกำหนดแนวปฏิบัติในการจดจำนำ หรือการรับหลักทรัพย์เป็นประกัน การชำระหนี้ และการขายทอดตลาดหลักประกันที่เป็นตราสารหนี้ สำหรับการให้กู้ยืมเงินเพื่อซื้อหลักทรัพย์ของบริษัทหลักทรัพย์ (“แนวปฏิบัติสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย”)

สมาคมจึงได้กำหนดแนวปฏิบัติในการขายทอดตลาดหลักประกันที่เป็นตราสารหนี้ เพิ่มเติมจากแนวปฏิบัติสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย เพื่อกำหนดขั้นตอน วิธีปฏิบัติในการขายทอดตลาดหลักประกันที่เป็นตราสารหนี้ให้ชัดเจน เป็นมาตรฐานเดียวกัน และเป็นไปตามกรอบกฎหมายปัจจุบัน โดยเนื้อหาดังกล่าวจะครอบคลุมถึง ช่องทางการส่งคำสั่งราคา และรูปแบบการส่งคำสั่งราคา กิริยาตกลงขายทอดตลาด รวมถึงการรายงานข้อมูลการขายทอดตลาดหลักประกันที่เป็นตราสารหนี้

### 2. ช่องทางการส่งคำสั่งราคาและรูปแบบการส่งคำสั่งราคา

ช่องทางการส่งคำสั่งราคาและรูปแบบการส่งคำสั่งราคาในการขายทอดตลาดหลักประกันที่เป็นตราสารหนี้ ให้เป็นไปตามที่สมาคมกำหนด ดังนี้

- 2.1 ช่องทางการส่งคำสั่งราคา ต้องไม่เป็นอุปสรรคต่อผู้ส่งราคาและสามารถบันทึกการส่งคำสั่งราคาและลำดับเวลาได้ เช่น โทรศัพท์, Fax, Email หรือ RM Chat เป็นต้น
- 2.2 รูปแบบการส่งคำสั่งราคา ผู้ทอดตลาดเป็นผู้กำหนดรายละเอียดข้อเสนอซื้อขายหลักประกันที่เป็นตราสารหนี้ เพื่อให้ผู้ส่งราคาเข้าสู่ราคา ดังนี้
  - ชื่อตราสารหนี้ที่จะเสนอซื้อ โดยระบุ ThaiBMA Symbol

- ราคาหรืออัตราผลตอบแทนที่จะเสนอซื้ออย่างใดอย่างหนึ่ง โดยอ้างอิงตามมาตรฐานการคำนวณราคาของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ดังนี้
  - 1) อัตราผลตอบแทน (Yield) เสนอเป็น Yield to maturity เป็นอัตราร้อยละไม่เกิน 6 ตำแหน่ง
  - 2) ราคาต่อหน่วย เป็นอัตราร้อยละไม่เกิน 6 ตำแหน่ง โดยระบุว่าเป็นราคารวมดอกเบี้ยค้างรับ (Gross price) หรือราคาไม่รวมดอกเบี้ยค้างรับ (Clean price)
- จำนวนหน่วย (unit) ที่จะเสนอซื้อ
- วันชำระราคาและส่งมอบหลักประกันที่เป็นตราสารหนี้ (Settlement date) โดยผู้ทอดตลาดเป็นผู้กำหนด

### 3. กิริยาตกลงขายทอดตลาด

กิริยาตกลงขายทอดตลาดจะสมบูรณ์เมื่อระบบของผู้ทอดตลาดแสดงเวลาที่สิ้นสุดการขายทอดตลาด และมีการแสดงผลผู้ชนะการขายทอดตลาดในระบบของผู้ทอดตลาดด้วย

### 4 การรายงานข้อมูลการขายทอดตลาดหลักประกันที่เป็นตราสารหนี้

บริษัทหลักทรัพย์หรือธนาคารพาณิชย์ที่มีใบอนุญาตค้าตราสารหนี้และเป็นสมาชิกของสมาคมต้องรายงานข้อมูลการซื้อขายจากการขายทอดตลาดหลักประกันที่เป็นตราสารหนี้ที่ขึ้นทะเบียนกับสมาคม โดยระบุชื่อย่อวัตถุประสงค์ของการซื้อขาย (Purpose) เป็น OTH ตามบัญชีแนบท้ายของประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่องหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้