วันที่ 16 สิงหาคม 2553

เรียน สมาชิกสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

## เรื่อง ซักซ้อมความเข้าใจเกี่ยวกับแนวทางกำกับดูแลการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนึ้

ตามที่สำนักงาน กลต.กำหนดให้บริษัทหลักทรัพย์ (สถาบันการเงินที่มีใบอนุญาตค้าหลักทรัพย์อันเป็นตราสารหนี้) ต้องรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้มายังสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ภายใน 30 นาทีหลังการซื้อขาย ซึ่ง ThaiBMA ได้รับความร่วมมือด้วยดีจากสมาชิกในการรายงานข้อมูลตามเกณฑ์ดังกล่าว อย่างไรก็ดีในช่วงที่ผ่านมาพบว่า สมาชิกบางรายยังมีการรายงานข้อมูลไม่ครบถ้วนหรือไม่ถูกต้องตามข้อมูลธุรกรรมที่เกิดขึ้นจริง ซึ่งจะมีผลกระทบต่อความ น่าเชื่อถือของข้อมูลที่ ThaiBMA นำออกเผยแพร่สู่ตลาด

ดังนั้น เพื่อให้การกำกับดูแลการรายงานฯ ของสมาชิกเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพมากขึ้น ThaiBMA จึงขอซักซ้อม ความเข้าใจ และเสนอแนะแนวทางในการกำกับดูแลการรายงานฯ ให้ถูกต้องครบถ้วน ดังนี้

- สมาชิกควรจัดให้มีระบบตรวจสอบความถูกต้องของข้อมูลก่อนการรายงานมายัง ThaiBMA อาทิ จัดให้มีระบบคัดกรอง ข้อมูลธุรกรรมในตลาดแรกที่ไม่เข้าข่ายต้องรายงาน
- สมาชิกควรสอบทานความครบถ้วนถูกต้องของรายการซื้อขายที่ได้รายงานมายัง ThaiBMA ผ่านทาง ThaiBMA
   Website ในหน้า <u>"List Today's"</u> ทุกสิ้นวัน โดยเปรียบเทียบกับข้อมูลซื้อขายของสมาชิกที่เกิดขึ้นจริง เพื่อให้แน่ใจว่า ครบถ้วนและถูกต้องตรงกัน
- กรณีที่ต้องการเช็คสอบข้อมูลการรายงานย้อนหลัง สามารถเช็คสอบผ่าน ThaiBMA Website ในหน้า "Historical Transaction" ซึ่งสามารถเช็คสอบข้อมูลการซื้อขายที่รายงานมาย้อนหลังได้
- 4. การเข้าถึงข้อมูลหน้า List Today's หรือ Historical Transaction นั้น สมาชิกจะต้องมี Username และ Password ซึ่งใช้ สำหรับการรายงานฯ และการเซ็คสอบรายการซื้อขายด้วย เช่นกัน ดังนั้น จึงควรมีการกำหนดผู้ที่จะเข้าเซ็คสอบรายการ ทุกสิ้นวันอย่างเหมาะสม และมีการควบคุมการใช้ Username และ Password อย่างรัดกุมเพียงพอ

จึงเรียนมาเพื่อขอความร่วมมือจากสมาชิก ในการกำกับดูแลการรายงานฯ ให้เป็นไปตามกฎเกณฑ์ที่กำหนด

ขอแสดงความนับถือ

(นายนิวัฒน์ กาญจนภูมินทร์) กรรมการผู้จัดการ

สิ่งที่ส่งมาด้วย ตัวอย่างหน้าจอ "List Today" และ "Historical Transaction" ฝ่ายกฏระเบียบและตรวจสอบ โทร. 02-252-3336 ต่อ 341, 311, 316

## ตัวอย่างหน้าจอ "List Today's" และ "Historical Transaction"

1. เข้าสู่ www.thaibma.or.th \Submit Report \Internet

	BMA ND MARKET ASSOCIATION					1	et				
Submit Report Mkt. V	Watch Bond Info. Price & Yield	Calculation	News Room	ThaiBMA R	eports	Fact & Figures	iBond	-	_		-
Internet Upload File • Dealer Member	Outright Trading   Outright Tr	Total Trading ading (TTM > 1	Value : 595,863 <u>Y)</u>	3.84 THB Min	5 Au	gust 2010	Gov. Index Corp. Index ZRR Index Government Bond Index				
<ul> <li>Convention</li> </ul>	Outright Trading : 102,991.86	THB MIn.		Financ	ing : 490,830	05-Aug-10	Index 105.90	Chg.			
Product & Service		Buy	Sell	Net	0.1.4	1.0			Gross Price	105.09	-2.07
Bond Tutorial	Asset Mgnt. Companies*	44,957.74	8,319.16	36,638.59	Bilatera	а керо Репо		397,630.00	Total return	201.62	-3.89
Press Release	Foreign Companies	3,844.19	0.00	3,844.19	Others	Kepo	9,594.85		Total	FOF 062 0	24 mln
Foreign Investor Corner	Remark: Data excludes FX Bond / *			Trading	595,902.0	>4 min.					
e FAQ	ThaiBMA Channel			Thai	BMA Activities	value	м	ore>>			
■ Links									Gov. YC	ZYC I	US, Tr.
Contact us     Site Map		Evolucivo Training						e 1g.(bp) -0.29			

 หลังจากใส่ Username & Password แล้ว จะปรากฏ Menu "List Today's " "Historical Transaction" ด้าน ช้ายมือ

	Add : OUT Sub Purpose :	- Y Trader Id :
OutRight	Ca	ompany Name
Add List Today's List Late	≤ August 2010 ≥	Select Counter Party Search by Category Counter Party
	Sun Mon Tue Wed Thu Fri Sat 25 26 27 28 29 30 31	Trader 18160030
Add List Today's	1 2 3 4 5 6 Z 8 9 10 11 12 13 14	Select Issue by Corporate Business Sector
Other	15 16 17 18 19 20 21 22 23 24 25 26 27 28	Government
Add List Today's	29 30 31 1 2 3 4	YTM(%) Price(%)
List Late Bid/Offer	Trade Time : :	Volume
Ranking Report Bid/Offer Quotation	Settlement > 10/08/2010	. Submit
Add Transaction (quick add)	Date : *	remark :
Trade Transaction	Transaction O O Type : Buy Sell	

3. เมื่อเลือกเมนู list today จะปรากฏรายการที่สมาชิกได้รายงานเข้ามา

	Trade													
OutRight Add List Today's	Today's Transaction Trader Id : Company Name : Page : 1													
Financing	Del Edit Sub Purpose	Side (B/S)	Issue Symbol	Yield Indicate (%)	Price	Volume Trade Unit Date	Settlement Date	Trade Time	Counter party	Status	remark			
Add List Today's		S	CB10007A	1.48 YTM	99.765374	06/08/2010	10/08/2010	2:05 PM		standby				
List Late	□ ≥ OUT	S	CB10823A	1.37 YTM	99.947480	06/08/2010	09/08/2010	2:08 PM		standby				
Other Add	□ ≥ OUT □ ≥ OUT	BS	CB10816D LB145B	1.39 YTM 2.96 YTM	99.973350 108.058536	06/08/2010 06/08/2010	09/08/2010 10/08/2010	2:03 PM 1:49 PM		standby confirm				
List Today's List Late	□ ≥ OUT	B	CB10817A	1.39 YTM	99.969544 99.793851	06/08/2010	09/08/2010	1:35 PM		standby				
Bid/Offer		B	CB119046	2.015 YTM	98.056638	06/08/2010	10/08/2010	11:58 AM		standby				

สมาชิกสามารถยกเลิกและแก้ไขรายการได้เองก่อนเวลา 16.00 น. โดยถ้าต้องการลบรายการให้เลือกที่กรอบสี่เหลี่ยม จากนั้นกดปุ่ม Del แต่ถ้าต้องการแก้ไขรายการให้กดที่เครื่องหมาย ≥ จะปรากฏหน้าจอข้อมูลรายการนั้นขึ้นมา เมื่อทำการ แก้ไขข้อมูลแล้วจึงกดปุ่ม submit

4. เมื่อต้องการตรวจสอบดูรายการที่ได้รายงานเข้ามาแล้วย้อนหลัง ให้เลือกเมนู Historical Transaction

OutRight	Report From : 01/08/2009 To : 05/08/2009 (dd/mm/yyyy)																
	Burnard Cathields Charge Other All Go Download																
Add List Today's	Purpose. Codurgin Contracting Other All Contracting																
List Late	Company Name :																
	Statue:											Pane	Page: 1 2 3 4				
Financing	Sub Rumose	Side	Teering	Purnoso	Viold	Indicate	Price	Volume	Trade	Cattlement	Trade	Penort	Penort	Counter	Statue	rema	
odd	Sub r a pose	(0.(=)	Cumbol	raipose	(0())	Thereads	TTICO	Linit	Data	Data	Time	Data	Time	counter	Julius	rema	
List Today's	OUT	(6/5)	CB1010ZA	out	1 220000	VTM	00.401205	CITIC	Date	07/08/2000	14:42	Date	14:50:00	party	contirm		
List Late	001		CB10107A	out	1.220000	11111	99.491203		05/08/2009	07/00/2009	14.45	05/08/2009	14.00.00		commun		
	001	5	CBIDIO/A	out	1.150000	TIM	99.532/41		05/00/2009	11/00/2009	14:01	05/00/2009	14:05:00		standby		
Other	001	5	CB09817A	out	0.990000	YIIVI	99.970173		05/08/2009	06/08/2009	12:15	05/08/2009	12:16:48		standby		
	OUT	S	TB09902A	out	0.995000	YTM	99.926451		05/08/2009	06/08/2009	12:15	05/08/2009	12:16:07		standby		
Add	001	5	TB09826C	out	0.990000	YIM	99.945783		05/08/2009	06/08/2009	12:11	05/08/2009	12:15:29		standby		
List Late	OUT	в	SCC12NA	out	3.250000	YTM	106.398092		05/08/2009	10/08/2009	11:41	05/08/2009	11:42:32		confirm		
	OUT	в	CB09903B	out	1.000000	ΥTM	99.923346		05/08/2009	06/08/2009	10:55	05/08/2009	10:56:21		standby		
Bid/Offer	OUT	S	CB09903B	out	1.000000	YTM	99.923346		05/08/2009	06/08/2009	09:59	05/08/2009	10:55:00		standby		
	OUT	в	CB09903B	out	1.000000	YTM	99.923346		05/08/2009	06/08/2009	10:43	05/08/2009	10:43:33		confirm		
Ranking Report	OUT	в	CB09903B	out	0.990000	YTM	99.924112		05/08/2009	06/08/2009	10:32	05/08/2009	10:40:00		confirm	•	
Bid/Offer Quotation	OUT	в	CB09903B	out	1.002500	YTM	99.923155		05/08/2009	06/08/2009	10:10	05/08/2009	10:15:00		confirm	•	
add)	OUT	s	CB09903B	out	1.005000	YTM	99.922964		05/08/2009	06/08/2009	09:50	05/08/2009	09:52:27		confirm		
,	OUT	S	TB09021A	out	1.005000	YTM	99.793919		05/08/2009	07/08/2009	08:41	05/08/2009	08:42:08		standby		
	OUT	в	BOTS119A	out	2.000000	YTM	104.562457		05/08/2009	07/08/2009	08:00	05/08/2009	08:02:21		standby		
Trade Transaction	OUT	s	CB09N05B	out	1.060000	YTM	99.736423		04/08/2009	06/08/2009	16:19	04/08/2009	16:20:00		standby		
	OUT	в	CB09903B	out	1.000000	YTM	99,923346		04/08/2009	06/08/2009	16:16	04/08/2009	16:16:30		confirm		
Historical Transaction	CULT	c	CHIDDONA	out	1.405000	VIN	09.619210		04/09/2000	06/09/2000	16:12	04/09/2000	16-116-16-1		confirm		