



ที่ กก. 005 / 2555

16 กุมภาพันธ์ 2555

เรียน ผู้แทนเจ้าหน้าที่บริหาร  
สมาชิกผู้ค้าตราสารหนี้  
เรื่อง การรายงานข้อมูลการซื้อขายให้เป็นไปตามลำดับรายการที่ถูกต้อง

ตามที่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ได้ออกประกาศคณะกรรมการสมาคมฯ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ โดยมีผลบังคับใช้ตั้งแต่เดือนเมษายน 2551 ที่ผ่านมา ซึ่งกำหนดให้สมาชิก รายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่เกิดขึ้นมายัง ThaiBMA โดยระบุถึงข้อมูลที่กำหนดให้สมาชิกรายงาน อันได้แก่ เวลาที่เกิดรายการซื้อขายตราสารหนี้ (Trade Time) นั้น เนื่องจากปัจจุบันพบว่ากรรายงาน Trade Time จำนวนหนึ่งมีความไม่ถูกต้องซึ่งมีผลให้ลำดับข้อมูลการซื้อขายที่รายงานมายัง ThaiBMA ผิดพลาดซึ่งมีผลต่อการจัดทำราคาปิดของตราสารหนี้ได้

ดังนั้น เพื่อให้การนำข้อมูลออกเผยแพร่มีความถูกต้อง จึงขอให้สมาชิกรายงานวันเวลาการซื้อขายเป็นไปตามลำดับรายการที่เกิดขึ้นจริงและระบุเวลาซื้อขาย (Trade time) ให้ถูกต้องโดยเฉพาะอย่างยิ่งกรณีที่มีรายการซื้อ และรายการขายตราสารหนี้เดียวกันในวันเดียวกัน โดยขอให้สมาชิกกำชับให้ผู้ค้าตราสารหนี้หรือผู้ที่ได้รับมอบหมายให้ทำหน้าที่ รายงาน ตรวจสอบความถูกต้องของลำดับเวลา Trade time ในการรายงานข้อมูลและลำดับให้ถูกต้องทุกครั้งก่อนการ รายงาน รวมถึงการตรวจสอบและปรับปรุงระบบการรายงานให้ถูกต้อง(ถ้ามี)ด้วย ทั้งนี้ การรายงานข้อมูลไม่ถูกต้องเป็นการกระทำผิดต่อประกาศคณะกรรมการตลาดทุนที่ ทด.67/2552 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไขและวิธีการในการค้าหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่งที่กำหนดให้บริษัทหลักทรัพย์ต้องรายงานข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์แก่สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ตามหลักเกณฑ์ที่ประกาศกำหนด

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบและพิจารณาดำเนินการ

ขอแสดงความนับถือ

(นายนิวัฒน์ กาญจนภูมิินทร์)

กรรมการผู้จัดการ

สำเนาเรียน: ผู้แทนกำกับดูแล

ฝ่ายกำกับดูแล

โทร. 02-252-3336 ต่อ 310, 312, 315