

(ร่าง)

## แนวปฏิบัติสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (Code of Conduct) สำหรับการซื้อขายตราสารหนี้เพื่อบัญชีของผู้ค้าตราสารหนี้

### 1. เหตุผลในการออกแนวปฏิบัติ

ตามข้อ 42 และ 64 แห่งข้อบังคับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ลงวันที่ 21 กันยายน พ.ศ. 2548 (และที่แก้ไขเพิ่มเติม) กำหนดให้สมาชิกต้องดำเนินการควบคุมดูแลให้กรรมการ ผู้บริหาร พนักงาน หรือบุคคลที่อยู่ภายใต้การควบคุมของสมาชิกปฏิบัติตามจรรยาบรรณที่เกี่ยวข้องตามที่กำหนดโดยเคร่งครัด และกำหนดให้ผู้บริหารของสมาชิกออกกระเปียบและวิธีปฏิบัติในการซื้อขายตราสารหนี้เพื่อบัญชีของผู้ค้าตราสารหนี้ โดยผู้ค้าตราสารหนี้จะต้องดำเนินการตามแนวทางที่องค์กรกำหนดอย่างเคร่งครัด

เพื่อให้การกำหนดระเบียบและวิธีปฏิบัติของสมาชิกมีมาตรฐานที่สอดคล้องกัน สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยจึงกำหนดแนวปฏิบัติสำหรับการซื้อขายตราสารหนี้เพื่อบัญชีของผู้ค้าตราสารหนี้ สำหรับให้สมาชิกนำไปใช้เป็นแนวทางกำหนดระเบียบและวิธีปฏิบัติขององค์กร เพื่อป้องกันการใช้ข้อมูลภายใน และป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์จากการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ค้าตราสารหนี้

### 2. เนื้อหาของแนวปฏิบัติ

#### 2.1 คำจำกัดความ

“ตราสารหนี้”	หมายความว่า	ตราสารหนี้ที่ขึ้นทะเบียนกับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
“ผู้ค้าตราสารหนี้”	หมายความว่า	เจ้าหน้าที่ของสมาชิกที่ได้รับการแต่งตั้งให้เป็นผู้กระทำการแทนในการซื้อขายตราสารหนี้ และขึ้นทะเบียนกับสมาคม
“สมาชิก”	หมายความว่า	สมาชิกของสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
“สมาคม”	หมายความว่า	สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

#### 2.2 หลักเกณฑ์การควบคุมการซื้อขายตราสารหนี้

สมาชิกต้องจัดให้มีหลักเกณฑ์การควบคุมการซื้อขายตราสารหนี้เพื่อบัญชีส่วนตัวของผู้ค้าตราสารหนี้ โดยครอบคลุมวิธีปฏิบัติในเรื่องต่อไปนี้

##### 2.2.1 การเปิดเผยข้อมูลการลงทุนในตราสารหนี้

กำหนดให้ผู้ค้าตราสารหนี้เปิดเผยข้อมูลการลงทุนในตราสารหนี้ เช่น ข้อมูลการถือครองตราสารหนี้ก่อนเริ่มปฏิบัติงาน รายงานการซื้อขายตราสารหนี้เพื่อบัญชีส่วนตัวภายในเวลาที่เหมาะสม และรายงานการถือครองตราสารหนี้อย่างน้อยปีละครั้ง

## 2.2.2 การอนุมัติการซื้อขายตราสารหนี้

จัดให้มีกระบวนการและขั้นตอนการพิจารณาอนุมัติการซื้อขายตราสารหนี้ของผู้ค้าตราสารหนี้ โดยอาจพิจารณากำหนดวิธีการที่แตกต่างกันสำหรับตราสารหนี้แต่ละประเภทหรือการซื้อขายแต่ละช่องทาง เพื่อให้เหมาะสมกับการปฏิบัติ

## 2.2.3 หลักปฏิบัติในการซื้อขายตราสารหนี้

กำหนดหลักปฏิบัติในการซื้อขายตราสารหนี้เพื่อบัญชีของผู้ค้าตราสารหนี้ เพื่อป้องกันการซื้อขายในลักษณะที่จะก่อให้เกิดความเสียหายต่อลูกค้าหรือองค์กรที่สังกัด โดยครอบคลุมในเรื่องต่อไปนี้

- ก. ไม่ซื้อขายตราสารหนี้ในลักษณะก่อให้เกิดความเสียหายต่อสมาชิกและลูกค้า
- ข. ไม่ซื้อขายตราสารหนี้ในราคาที่ไม่เป็นไปตามสภาวะตลาด
- ค. ไม่ซื้อขายตราสารหนี้เพื่อตนเองหรือผู้อื่นในบัญชีลูกค้า และไม่ซื้อขายเพื่อลูกค้าในบัญชีตนเองหรือผู้อื่น
- ง. ไม่เป็นผู้รับมอบอำนาจสั่งซื้อขายตราสารหนี้ในบัญชีบุคคลอื่น
- จ. ไม่ซื้อขายตราสารหนี้ที่เข้าข่ายเป็นข้อห้ามตามประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

เรื่อง ลักษณะการปฏิบัติที่มีชอบของสมาชิก

## 2.2.4 การกำกับดูแลและตรวจสอบ

จัดให้มีกระบวนการติดตามกำกับดูแลและตรวจสอบ การซื้อขายตราสารหนี้เพื่อบัญชีของผู้ค้าตราสารหนี้ โดยหน่วยงานกำกับดูแลการปฏิบัติงานภายในอย่างสม่ำเสมอ เพื่อให้มั่นใจว่ามีการปฏิบัติที่เป็นไปตามระเบียบปฏิบัติขององค์กร

## 3. วันที่เริ่มต้นประกาศใช้

แนวปฏิบัตินี้ประกาศใช้วันที่..... เป็นต้นไป