

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
“ลูกค้ำ”	หมายความว่า	ลูกค้ำที่ทำการซื้อขายตราสารหนี้กับสมาชิก
“คู่ค้ำ”	หมายความว่า	สถาบันการเงินที่ได้รับใบอนุญาตค้าหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่งและทำการซื้อขายตราสารหนี้กับสมาชิก

ข้อ 2 ในการซื้อขายตราสารหนี้ สมาชิกต้องจัดให้มีการจัดทำและจัดเก็บเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- เอกสารหลักฐานเกี่ยวกับการซื้อขายตราสารหนี้แต่ละรายการ ซึ่งต้องมีข้อมูล ดังต่อไปนี้
 - วันและเวลาที่ตกลงซื้อขาย
 - ชื่อ จำนวนและมูลค่าของตราสารหนี้ที่ซื้อขาย
 - ราคา และ/หรือ อัตราผลตอบแทนของการซื้อขาย
 - วันชำระราคาและส่งมอบ
 - ชื่อหรือเลขประจำตัวของผู้ค้าตราสารหนี้ที่ทำรายการ
 - ชื่อลูกค้ำ / คู่ค้ำ
 - วัตถุประสงค์ของการซื้อขายว่าเป็นการซื้อขายตามปกติ (Outright) หรือ การซื้อขายโดยมีสัญญาซื้อคืน (Repo) หรือ การซื้อขายเพื่อวัตถุประสงค์อื่น
 - อัตราดอกเบี้ยและระยะเวลากู้ยืม (ถ้ามี)
 - สัญญาซื้อคืน (ถ้ามี)
 - วิธีการซื้อขาย เช่น โทรศัพท์ ระบบซื้อขายอิเล็กทรอนิกส์ Inter-dealer Broker หรืออื่นๆ
- เอกสารหลักฐานเกี่ยวกับการเปลี่ยนแปลง แก่ไข หรือยกเลิกรายการซื้อขาย ซึ่งต้องมีข้อมูลดังต่อไปนี้
 - วันและเวลาที่เปลี่ยนแปลงแก้ไข หรือยกเลิกรายการซื้อขาย
 - รายละเอียดและสาเหตุของการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือยกเลิกรายการซื้อขาย
 - ระบุว่า การเปลี่ยนแปลงนั้นเกิดขึ้นเนื่องจากคำสั่งของลูกค้ำ / คู่ค้ำ หรือจากสมาชิก
- สำเนาใบยืนยันการซื้อขายตราสารหนี้แต่ละรายการซึ่งได้ส่งให้กับลูกค้ำ / คู่ค้ำ
- เอกสารหรือข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับลูกค้ำ / คู่ค้ำ

- (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 สมาชิกต้องจัดให้มีการบันทึกพฤติกรรมการติดต่อสื่อสาร 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 ให้คณะกรรมการมีอำนาจในการกำหนดแนวทางปฏิบัติเพิ่มเติมยกเล็ก หรือเปลี่ยนแปลงแนวทางปฏิบัติ เพื่อประโยชน์ในการกำกับดูแลตนเองสำหรับการซื้อขายตราสารหนี้

ข้อ 7 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 ธันวาคม พ.ศ. 2548 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 10 พฤศจิกายน พ.ศ. 2548



(นายสมหมาย ภาษี)

ประธานกรรมการ
สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย