

ประกาศคณะกรรมการ  
สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย  
เรื่อง มาตรการลงโทษสมาชิกเกี่ยวกับการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 20 (2) ประกอบกับข้อ 68 แห่งข้อบังคับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ลงวันที่ 21 กันยายน พ.ศ. 2548 คณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทยออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ให้ยกเลิกประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง มาตรการลงโทษสมาชิกเกี่ยวกับการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ ฉบับลงวันที่ 10 สิงหาคม พ.ศ. 2554

ข้อ 2 ในประกาศนี้

“สมาคม”	หมายความว่า	สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย
“สมาชิก”	หมายความว่า	สมาชิกของสมาคม
“รายการล่าช้า”	หมายความว่า	ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ประเภท Outright Transaction ของสมาชิกที่รายงานไม่เป็นไปตามเวลาที่กำหนดในข้อ 8 แห่งประกาศคณะกรรมการสมาคมฯ เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ และได้รายงานภายในวันทำการถัดจากวันที่ทำการซื้อขาย แต่ไม่รวมถึงรายการซื้อขายตราสารหนี้อายุไม่เกิน 1 ปี ที่มีการฝากประมูลผ่านสมาชิก
“รายการผิดพลาด”	หมายความว่า	(1) ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีข้อผิดพลาด หรือไม่ถูกต้องที่สมาชิกสามัญและสมาชิกสมทบได้รายงานก่อนเวลา 16.00 น. และสมาชิกมิได้แก้ไขหรือยกเลิกรายการดังกล่าวภายในเวลา 16.00 น. หรือ (2) ข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ที่มีข้อผิดพลาด หรือไม่ถูกต้องที่สมาชิกวิสามัญได้รายงานและมีได้แก้ไขหรือยกเลิกรายการดังกล่าว
“รายการที่ไม่รายงาน”	หมายความว่า	ข้อมูลการซื้อขายที่สมาคมกำหนดให้สมาชิกต้องรายงาน แต่สมาชิกมิได้รายงานมายังสมาคม หรือรายงานมาล่าช้าเกินกว่า 1 วันทำการ นับจากวันที่ทำการซื้อขาย
“การฝากประมูล”	หมายความว่า	การฝากประมูลตราสารหนี้ผ่านสมาชิก

- ข้อ 3** กำหนดโทษสำหรับการปฏิบัติที่ไม่เป็นไปตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ โดยการปรับเป็นเงินตามอัตราที่กำหนด ดังนี้
- 3.1 รายการล่าช้า ปรับรายการละ 30 บาท
  - 3.2 รายการล่าช้ามากกว่าร้อยละ 5 ของจำนวนรายการ Outright Transaction ทั้งหมดที่สมาชิกรายนั้นๆ รายงานมายังสมาคมในแต่ละเดือนต่อเนื่องกัน 3 เดือน กำหนดให้ปรับในอัตรา 5,000 บาท ในเดือนที่ 3 ที่มีการล่าช้าต่อเนื่องมากกว่าร้อยละ 5 และปรับเป็น 10,000 บาท ในเดือนที่ 4 ที่มีการล่าช้าต่อเนื่องมากกว่าร้อยละ 5 และปรับเพิ่มอีกทุก 10,000 บาท ในเดือนต่อไป เป็นอัตราก้าวหน้าหากยังคงมีรายการล่าช้ามากกว่าร้อยละ 5 ต่อเนื่องกัน
  - 3.3 รายการผิดพลาด ปรับรายการละ 100 บาท
  - 3.4 รายการที่ไม่รายงาน ปรับรายการละ 100 บาทต่อวัน จนกว่าสมาชิกจะได้ดำเนินการให้ถูกต้อง
- โทษปรับสูงสุดในแต่ละข้อให้ปรับได้สูงสุดไม่เกิน 300,000 บาท
- ข้อ 4** มิให้นำโทษตามข้อ 3.1 มาใช้บังคับกับรายการล่าช้า ดังต่อไปนี้
- 4.1 รายการล่าช้าที่มีจำนวนไม่เกินกว่าร้อยละ 1 ของจำนวนรายการ Outright Transaction ทั้งหมดที่สมาชิก รายงานมายังสมาคมในแต่ละเดือน
  - 4.2 รายการล่าช้าที่ไม่เกินกว่า 6 รายการ หรือจำนวนรายการล่าช้าเฉลี่ยไม่เกินร้อยละ 1 ในรอบครึ่งปีปฏิทิน
- ข้อ 5** ให้ลงโทษปรับกรณีรายการที่ไม่รายงานตามเกณฑ์ข้อ 3.4 แต่สูงสุดไม่เกิน 30,000 บาท สำหรับยอดรวมรายการที่มีลักษณะดังนี้
- 5.1 ตราสารหนี้ที่มีมูลค่าน้อยกว่า 1 ล้านบาทต่อรายการ หรือ
  - 5.2 ตราสารหนี้ระยะสั้นที่มีอายุไม่เกินหนึ่งปี ที่ขายให้แก่ลูกค้า/ลูกค้า เนื่องจากการฝากจองหรือฝากประมูล
- ทั้งนี้ การคิดค่าปรับให้คิดจากวันรายงานของสมาชิกในรอบทุกๆ 6 เดือนปฏิทิน
- ข้อ 6** สำหรับรายการผิดพลาด และรายการที่ไม่รายงานที่ตรวจพบโดยหน่วยงานตรวจสอบหรือกำกับดูแลของสมาชิก เป็นผู้ตรวจสอบพบ และรายงานให้สมาคมทราบ ให้ลงโทษเพียงกึ่งหนึ่งของโทษที่เกี่ยวข้องกับรายการทั้งหมด และสูงสุดไม่เกิน 100,000 บาท
- ข้อ 7** ในกรณีที่สมาคมมีคำสั่งเป็นหนังสือให้สมาชิกตรวจสอบและรายงานข้อมูลให้ถูกต้อง พร้อมทั้งดำเนินการแก้ไข ปรับปรุงและหามาตรการป้องกันมิให้เกิดการรายงานผิดพลาดอีกในเวลาที่เหมาะสม และสมาชิกได้ดำเนินการตามระยะเวลาที่กำหนดไว้แล้ว มิให้นำค่าปรับตามข้อ 3.4 มาใช้กับรายการที่ได้รายงานมาภายหลังตามคำสั่งของสมาคม

- ข้อ 8 ให้กรรมการผู้จัดการสมาคมเป็นผู้มีอำนาจพิจารณาและออกคำสั่ง ให้สมาชิกตรวจสอบและรายงานข้อมูลให้ถูกต้อง ลงโทษในรายการล่าช้า รายการล่าช้าต่อเนื่อง รายการผิดพลาด หรือรายการที่ไม่รายงาน และให้รายงานผลการลงโทษให้คณะกรรมการวินัยทราบในการประชุมครั้งถัดไปภายหลังการออกคำสั่งลงโทษ
- ข้อ 9 กำหนดให้คณะกรรมการวินัยมีอำนาจในการพิจารณาเพิ่มโทษได้นอกเหนือจากการลงโทษตามที่กำหนดไว้ในข้อ 3 แล้ว ในกรณีที่เชื่อได้ว่ามีเจตนาไม่รายงานตามหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ และมีผลกระทบต่อการซื้อขายหรือการกำหนดราคาของตลาด โดยการเพิ่มโทษให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์วิธีการพิจารณาความผิดและลงโทษของคณะกรรมการวินัย
- ข้อ 10 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 24 เมษายน พ.ศ. 2555 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 24 เมษายน พ.ศ. 2555



(นายบัณฑิต นิจถาวร)

ประธานกรรมการ

สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

หมายเหตุ เพื่อกำกับดูแลให้สมาชิกมีการรายงานข้อมูลให้ถูกต้องและครบถ้วน ดังนั้น จึงมีความจำเป็นที่จะต้องปรับปรุงหลักเกณฑ์การลงโทษและลดหย่อนโทษให้เหมาะสม

สรุปการแก้ไขประกาศฯ เรื่อง มาตรการลงโทษสมาชิกเกี่ยวกับการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้

เดิม	แก้ไขเป็น	เหตุผลในการแก้ไข
ไม่มี	(เพิ่ม) ข้อ 5 ให้ลงโทษปรับกรณีรายการที่ไม่รายงานตามเกณฑ์ข้อ 3.4 แต่สูงสุดไม่เกิน 30,000 บาท สำหรับยอดรวมรายการ ที่มีลักษณะดังนี้ 5.1 ตราสารหนี้ที่มีมูลค่าน้อยกว่า 1 ล้านบาทต่อรายการ หรือ 5.2 ตราสารหนี้ระยะสั้นที่มีอายุไม่เกิน 1 ปี  ทั้งนี้ การคิดค่าปรับให้คิดจากวันรายงานของสมาชิกในรอบทุกๆ 6 เดือนปฏิทิน	เพื่อให้การลงโทษสมาชิกมีความเหมาะสมมากขึ้น โดยการลดหย่อนโทษปรับสำหรับรายการที่ไม่รายงานที่ไม่มีผลกระทบต่อตลาดซึ่งได้แก่ รายการที่เป็น Small Lot หรือตราสารหนี้ระยะสั้นที่มีอายุไม่เกิน 1 ปี
ไม่มี	(เพิ่ม) ข้อ 6 สำหรับการรายงานทั้งหมดที่ตรวจพบโดยหน่วยงานตรวจสอบหรือกำกับดูแลของสมาชิกเป็นผู้ตรวจสอบพบและ รายงานให้สมาคมทราบให้ลงโทษเพียงกึ่งหนึ่งของโทษที่เกี่ยวข้องกับรายการทั้งหมด และสูงสุดไม่เกิน 100,000 บาท	เพื่อเป็นมูลเหตุจูงใจให้มีการรายงานผลการตรวจสอบกับสมาคมอย่างครบถ้วน
ข้อ 6 ให้กรรมการผู้จัดการเป็นผู้มีอำนาจพิจารณาและออกคำสั่ง	ข้อ 8 ให้กรรมการผู้จัดการสมาคมเป็นผู้มีอำนาจพิจารณาและออกคำสั่ง	เพื่อความชัดเจนของตำแหน่งกรรมการผู้จัดการสมาคม
ไม่มี	ข้อ 9 กำหนดให้คณะอนุกรรมการวินัยมีอำนาจในการพิจารณาเพิ่มโทษได้นอกจากการลงโทษตามที่กำหนดไว้ ในข้อ 3 แล้ว ในกรณี que เชื่อได้ว่ามีเจตนาไม่รายงานตามหลักเกณฑ์เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ และมีผลกระทบต่อการซื้อขายหรือการกำหนดราคาของตลาด โดยการเพิ่มโทษให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์วิธีการพิจารณาความผิดและลงโทษของคณะอนุกรรมการวินัย	เพื่อให้เกิดความชัดเจนในอำนาจของคณะอนุกรรมการวินัยในการพิจารณาและลงโทษสมาชิกตามที่กำหนด