

วันที่ 16 สิงหาคม 2553

เรียน สมาชิกสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

เรื่อง ชักซ้อมความเข้าใจเกี่ยวกับแนวทางกำกับดูแลการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้

ตามที่สำนักงาน ก.ล.ต.กำหนดให้บริษัทหลักทรัพย์ (สถาบันการเงินที่มีใบอนุญาตค้าหลักทรัพย์อันเป็นตราสารหนี้) ต้องรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้มายังสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ภายใน 30 นาทีหลังการซื้อขาย ซึ่ง ThaiBMA ได้รับความร่วมมือด้วยดีจากสมาชิกในการรายงานข้อมูลตามเกณฑ์ดังกล่าว อย่างไรก็ตามในช่วงที่ผ่านมาพบว่าสมาชิกบางรายยังมีการรายงานข้อมูลไม่ครบถ้วนหรือไม่ถูกต้องตามข้อมูลธุรกรรมที่เกิดขึ้นจริง ซึ่งจะมีผลกระทบต่อความน่าเชื่อถือของข้อมูล ThaiBMA นำออกเผยแพร่สู่ตลาด

ดังนั้น เพื่อให้การกำกับดูแลการรายงานฯ ของสมาชิกเป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพมากขึ้น ThaiBMA จึงขอชักซ้อมความเข้าใจ และเสนอแนะแนวทางในการกำกับดูแลการรายงานฯ ให้ถูกต้องครบถ้วน ดังนี้

1. สมาชิกควรจัดให้มีระบบตรวจสอบความถูกต้องของข้อมูลก่อนการรายงานมายัง ThaiBMA อาทิ จัดให้มีระบบคัดกรองข้อมูลธุรกรรมในตลาดแรกที่ไม่เข้าข่ายต้องรายงาน
2. สมาชิกควรสอบทานความครบถ้วนถูกต้องของรายการซื้อขายที่ได้รายงานมายัง ThaiBMA ผ่านทาง ThaiBMA Website ในหน้า "List Today's" ทุกสิ้นวัน โดยเปรียบเทียบกับข้อมูลซื้อขายของสมาชิกที่เกิดขึ้นจริง เพื่อให้แน่ใจว่าครบถ้วนและถูกต้องตรงกัน
3. กรณีที่ต้องการเช็คสอบข้อมูลการรายงานย้อนหลัง สามารถเช็คสอบผ่าน ThaiBMA Website ในหน้า "Historical Transaction" ซึ่งสามารถเช็คสอบข้อมูลการซื้อขายที่รายงานมาย้อนหลังได้
4. การเข้าถึงข้อมูลหน้า List Today's หรือ Historical Transaction นั้น สมาชิกจะต้องมี Username และ Password ซึ่งใช้สำหรับการรายงานฯ และการเช็คสอบรายการซื้อขายด้วยเช่นกัน ดังนั้น จึงควรมีการกำหนดผู้ที่จะเข้าเช็คสอบรายการทุกสิ้นวันอย่างเหมาะสม และมีการควบคุมการใช้ Username และ Password อย่างรัดกุมเพียงพอ

จึงเรียนมาเพื่อขอความร่วมมือจากสมาชิก ในการกำกับดูแลการรายงานฯ ให้เป็นไปตามกฎเกณฑ์ที่กำหนด

ขอแสดงความนับถือ



(นายนิวัฒน์ กาญจนภูมิินทร์)

กรรมการผู้จัดการ

สิ่งที่ส่งมาด้วย ตัวอย่างหน้าจอ "List Today" และ "Historical Transaction"

ฝ่ายกฎระเบียบและตรวจสอบ

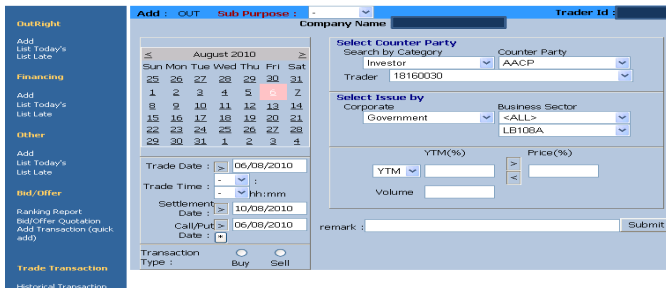
โทร. 02-252-3336 ต่อ 341, 311, 316

ตัวอย่างหน้าจอ “List Today’s” และ “Historical Transaction”

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



2. หลังจากใส่ Username & Password แล้ว จะปรากฏ Menu “List Today’s” “Historical Transaction” ด้านซ้ายมือ



3. เมื่อเลือกเมนู list today จะปรากฏรายการที่สมาชิกได้รายงานเข้ามา

Del	Edit	Sub Purpose	Side	Issue Symbol	Yield Indicate (%)	Price	Volume Trade Unit Date	Settlement Date	Trade Time	Counter party	Status	remark
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	OUT	S	CB10007A	1.48 YTM	99.765374	06/08/2010	10/08/2010	2:05 PM		standby	*
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	OUT	S	CB10007C	1.48 YTM	99.765374	06/08/2010	10/08/2010	2:08 PM		standby	*
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	OUT	S	CB10823A	1.37 YTM	99.947480	06/08/2010	09/08/2010	2:04 PM		standby	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	OUT	B	CB10816D	1.39 YTM	99.973350	06/08/2010	09/08/2010	2:03 PM		standby	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	OUT	S	LB145B	2.96 YTM	108.058536	06/08/2010	10/08/2010	1:49 PM		confirm	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	OUT	B	CB10817A	1.39 YTM	99.969544	06/08/2010	09/08/2010	1:35 PM		standby	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	OUT	S	CB10930B	1.45 YTM	99.793851	06/08/2010	09/08/2010	1:26 PM		standby	
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	OUT	B	CB11804A	2.015 YTM	98.056638	06/08/2010	10/08/2010	11:58 AM		standby	

สมาชิกสามารถยกเลิกและแก้ไขรายการได้เองก่อนเวลา 16.00 น. โดยถ้าต้องการลบรายการให้เลือกที่กรอบสีแดง จากนั้นกดปุ่ม Del แต่ถ้าต้องการแก้ไขรายการให้กดที่เครื่องหมาย \geq จะปรากฏหน้าจอข้อมูลรายการนั้นขึ้นมา เมื่อทำการแก้ไขข้อมูลแล้วจึงกดปุ่ม submit

4. เมื่อต้องการตรวจสอบดูรายการที่ได้รายงานเข้ามาแล้วย้อนหลัง ให้เลือกเมนู Historical Transaction

Sub Purpose	Side (B/S)	Issue Symbol	Purpose	Yield (%)	Indicate	Price	Volume Unit	Trade Date	Settlement Date	Trade Time	Report Date	Report Time	Counter party	Status	remark
OUT	B	CB10107A	out	1.220000	YTM	99.491205		05/08/2009	07/08/2009	14:43	05/08/2009	14:50:00		confirm	
OUT	G	CB10107A	out	1.150000	YTM	99.532741		05/00/2009	11/00/2009	14:01	05/00/2009	14:05:00		standby	*
OUT	S	CB09817A	out	0.990000	YTM	99.970173		05/08/2009	06/08/2009	12:15	05/08/2009	12:16:48		standby	
OUT	S	TB09902A	out	0.990000	YTM	99.926451		05/08/2009	06/08/2009	12:15	05/08/2009	12:16:07		standby	
OUT	S	TB09826C	out	0.990000	YTM	99.945783		05/08/2009	06/08/2009	12:11	05/08/2009	12:15:29		standby	
OUT	B	SCC12NA	out	3.250000	YTM	106.398092		05/08/2009	10/08/2009	11:41	05/08/2009	11:42:32		confirm	
OUT	B	CB09903B	out	1.000000	YTM	99.923346		05/08/2009	06/08/2009	10:55	05/08/2009	10:56:21		standby	
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	B	CB09903B	out	1.000000	YTM	99.923346		05/08/2009	06/08/2009	10:43	05/08/2009	10:43:33		confirm	
OUT	B	CB09903B	out	0.990000	YTM	99.924112		05/08/2009	06/08/2009	10:32	05/08/2009	10:40:00		confirm	*
OUT	B	CB09903B	out	1.002500	YTM	99.923155		05/08/2009	06/08/2009	10:10	05/08/2009	10:15:00		confirm	*
OUT	S	CB09903B	out	1.002500	YTM	99.923954		05/08/2009	06/08/2009	09:50	05/08/2009	09:52:27		confirm	*
OUT	S	TB09021A	out	1.005000	YTM	99.703919		05/08/2009	07/08/2009	08:41	05/08/2009	08:42:08		standby	
OUT	B	BOTS119A	out	2.000000	YTM	104.562457		05/08/2009	07/08/2009	08:00	05/08/2009	08:02:21		standby	
OUT	S	CB09905B	out	1.060000	YTM	99.736423		04/08/2009	06/08/2009	16:19	04/08/2009	16:20:00		standby	*
OUT	B	CB09903B	out	1.000000	YTM	99.923346		04/08/2009	06/08/2009	16:16	04/08/2009	16:16:30		confirm	
OUT	S	CB10815A	out	1.405000	YTM	98.618210		04/08/2009	06/08/2009	16:13	04/08/2009	16:15:51		confirm	