



ที่ สตบท. 07.005/2559

6 มกราคม 2559

เรื่อง ชักซ้อมความเข้าใจเกี่ยวกับการทำธุรกรรมการซื้อขายที่ไม่เหมาะสมและไม่ใช้ราคาตลาด

เรียน สมาชิกสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

สิ่งที่ส่งมาด้วย 1. ประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง มาตรฐานการปฏิบัติงานในตลาดตราสารหนี้
2. ประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง ลักษณะการปฏิบัติที่มีขอบของสมาชิก
3. ข้อบังคับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

เนื่องจากในช่วงที่ผ่านมา สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (สมาคม) ตรวจพบพฤติกรรมกรรมการทำธุรกรรม
การซื้อขายที่ไม่เหมาะสมและไม่ใช้ราคาตลาด และได้มีการชี้แจงทำความเข้าใจเป็นรายกรณีแล้ว นั้น

เพื่อให้การซื้อขายตราสารหนี้เป็นไปตามประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง
มาตรฐานการปฏิบัติงานในตลาดตราสารหนี้ และประกาศคณะกรรมการสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง ลักษณะการ
ปฏิบัติที่มีขอบของสมาชิก สมาคมจึงขอชักซ้อมความเข้าใจดังนี้

1. สมาชิกต้องไม่ทำธุรกรรมการซื้อขายที่ไม่ใช้ราคาตลาด เว้นแต่จะมีเหตุผลอันสมควรรองรับ
การทำธุรกรรมดังกล่าว โดยสมาชิกจะต้องระบุเหตุผลประกอบการซื้อขายนั้นให้ชัดเจนและสามารถตรวจสอบได้
2. สมาชิกต้องไม่รับทำธุรกรรมการซื้อขายกับลูกค้าในลักษณะ Switching Port ที่ไม่ใช้ราคาตลาด
3. สมาชิกต้องไม่ทำการซื้อตราสารหนี้จากลูกค้าในราคาที่ต่ำเกินควร หรือขายตราสารหนี้ให้แก่ลูกค้า
ในราคาที่สูงเกินควร (Excessive Mark Up/ Down) ซึ่งผิดไปจากสถานะตลาดตราสารหนี้ขณะที่ทำธุรกรรม

ในการนี้ สมาคมใคร่ขอความร่วมมือจากหน่วยงานกำกับดูแลของสมาชิกกำชับผู้ค้าตราสารหนี้ให้ปฏิบัติ
ตามข้อบังคับและประกาศของสมาคมอย่างเคร่งครัด ทั้งนี้ หากสมาคมตรวจสอบข้อมูลเพิ่มเติมและพิจารณาแล้วเห็นว่า
พฤติกรรมดังกล่าวเข้าข่ายการซื้อขายที่ไม่เป็นธรรมและเป็นลักษณะการปฏิบัติที่มีขอบในตลาดตราสารหนี้ ซึ่งอาจถือได้ว่า
สมาชิกกระทำผิดข้อบังคับสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย เรื่อง จรรยาบรรณในการประกอบธุรกิจ สมาคมจะนำกรณี
ดังกล่าวเข้าสู่กระบวนการของคณะอนุกรรมการวินัยเพื่อพิจารณาต่อไป

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ

(นายชาดา เพ็ชร์ชาติดา)

กรรมการผู้จัดการ
สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

ฝ่ายกำกับดูแล (นายจิโรจน์ ฤกษ์ศรีมงคล)

โทรศัพท์ 0-2252-3336 ต่อ 310 โทรสาร 0-2252-2760

ไปรษณีย์อิเล็กทรอนิกส์ chiroch@thaibma.or.th