

สรุปผลการรับฟังความคิดเห็น
ตามเอกสารรับฟังความคิดเห็น เลขที่ 1/2569
เรื่อง การปรับปรุงหลักเกณฑ์การรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ และมาตรการลงโทษสมาชิก
เกี่ยวกับการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้

1. **ที่มา** จากการเปิดรับฟังความคิดเห็นต่อการปรับปรุงหลักเกณฑ์การรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้และมาตรการลงโทษสมาชิกเกี่ยวกับการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ได้รับความเห็นและข้อเสนอแนะจากสมาชิก ทั้งผ่านการประชุม Market Dialogue และการเปิดรับฟังความคิดเห็น (Public Hearing) ซึ่งการปรับปรุงหลักเกณฑ์จะช่วยเพิ่มความชัดเจนที่เกี่ยวข้องกับแนวทางการรายงานข้อมูลของสมาชิก และยกระดับความถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลที่มีการเผยแพร่ รวมถึงรองรับรูปแบบธุรกรรมที่มีการนำเทคโนโลยีมาใช้ในตลาดตราสารหนี้ไทย ทั้งนี้ ThaiBMA จะนำความเห็นและข้อเสนอแนะที่ได้รับมาประกอบการพิจารณาปรับปรุงร่างประกาศที่เกี่ยวข้องให้มีความเหมาะสมยิ่งขึ้นก่อนประกาศใช้ต่อไป

2. **วิธีการและระยะเวลาการรับฟังความคิดเห็น** ThaiBMA เปิดรับฟังความคิดเห็นผ่านเว็บไซต์ ThaiBMA <https://www.thaibma.or.th/EN/Rule/Hearing.aspx> และไปรษณีย์อิเล็กทรอนิกส์ regulation@thaibma.or.th ระหว่างวันที่ 8 พฤษภาคม - 7 มิถุนายน 2569

3. **รายชื่อสมาชิกที่ตอบความคิดเห็น** ภายหลังจากสิ้นสุดระยะเวลาการรับฟังความคิดเห็น มีสมาชิกเข้าร่วมแสดงความคิดเห็น จำนวน 33 ราย ดังนี้

1. บริษัทหลักทรัพย์ ไอรา จำกัด (มหาชน) (AIRA)
2. บริษัทหลักทรัพย์ อพอลโล่ เวลธ์ จำกัด (APW)
3. บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด (ASPS)
4. ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) (BAY)
5. ธนาคาร กรุงเทพ จำกัด (มหาชน) (BBL)
6. บริษัทหลักทรัพย์ บัวหลวง จำกัด (มหาชน) (BLS)
7. ธนาคาร แห่งอเมริกาเนชั่นแนลแอสโซซิเอชั่น (BofA)
8. บริษัทหลักทรัพย์ ซีจีเอส อินเตอร์เนชั่นแนล (ประเทศไทย) จำกัด (CGSI)
9. ธนาคาร ซีไอเอ็มบี ไทย จำกัด (มหาชน) (CIMBT)
10. ธนาคารซิตีแบงก์ เอ็น เอ (CITI)
11. บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (DAOLS)
12. บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) (FSS)
13. บริษัทหลักทรัพย์ โกลเบล็ก จำกัด (GBS)

14. ธนาคารออมสิน (GSB)
15. ธนาคารฮ่องกงและเซี่ยงไฮ้แบงกิงคอร์ปอเรชั่น จำกัด (HSBC)
16. ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK)
17. บริษัทหลักทรัพย์ คิงส์ฟอร์ด จำกัด (มหาชน) (KFS)
18. ธนาคารเกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน) (KKP)
19. บริษัทหลักทรัพย์ เกียรตินาคินภัทร จำกัด (มหาชน) (KKPS)
20. บริษัทหลักทรัพย์ เคพีเอ็ม จำกัด (KPM)
21. บริษัทหลักทรัพย์ กสิกรไทย จำกัด (มหาชน) (KS)
22. บริษัทหลักทรัพย์ กรุงศรี จำกัด (มหาชน) (KSS)
23. ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KTB)
24. ธนาคารแลนด์ แอนด์ เฮาส์ จำกัด (มหาชน) (LHBANK)
25. บริษัทหลักทรัพย์ แลนด์ แอนด์ เฮาส์ จำกัด (มหาชน) (LHS)
26. บริษัท หลักทรัพย์ เมย์แบงก์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (MST)
27. บริษัทหลักทรัพย์ ฟิลลิป (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (PST)
28. ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) (SCBB)
29. ธนาคาร ทีสโก้ จำกัด (มหาชน) (TISCO)
30. บริษัทหลักทรัพย์ ตรีเน็ต จำกัด (TRISEC)
31. ธนาคารยูโอบี จำกัด (มหาชน) (UOBT)
32. บริษัทหลักทรัพย์ เว็ลธ์ เมจิก จำกัด (WMG-SEC)
33. บริษัทหลักทรัพย์ หยวนต้า (ประเทศไทย) จำกัด (YUANTA)

ThaiBMA ขอขอบคุณสมาชิกที่ได้ร่วมแสดงความคิดเห็นในครั้งนี้

4. สรุปผลการรับฟังความคิดเห็น

หลักเกณฑ์ที่เสนอ	ความเห็น/ข้อเสนอแนะ	ความเห็น ThaiBMA
1. กำหนดช่วงเวลารายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้ของสมาชิก* มายัง ThaiBMA แบ่งเป็น 3 ช่วงเวลา	- ไม่มี -	- ไม่มี -
2. ให้รายงาน Purpose (วัตถุประสงค์หลัก) และ Subpurpose (วัตถุประสงค์รอง) โดยอ้างอิงตามบัญชีแนบท้ายประกาศคณะกรรมการสมาคม เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการรายงานข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้	- ไม่มี -	- ไม่มี -
3. กำหนดให้รายงานรายละเอียดสำหรับธุรกรรม Private Repo เพิ่มเติม	- ไม่มี -	- ไม่มี -
4. กำหนดให้รายงานรายละเอียดสำหรับธุรกรรม Private Repo ที่อ้างอิงอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงตลาดซื้อคืนพันธบัตรภาคเอกชน (THOR)	<ul style="list-style-type: none"> ○ เสนอปรับปรุงหลักเกณฑ์ให้สอดคล้องกับข้อกำหนดของ ธปท. กรณี ธปท.กำหนดข้อมูลที่ต้องรายงานเพิ่มเติมในอนาคต ○ เสนอให้จัดทำ Template สำหรับการรายงานธุรกรรม Private Repo ที่อ้างอิง THOR และเผยแพร่ตัวอย่าง 	<ul style="list-style-type: none"> ○ ร่างประกาศได้กำหนดถ้อยคำ “ข้อมูลอื่นๆ ตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทยกำหนด” ซึ่งสามารถรองรับกรณีที่ ธปท. กำหนดข้อมูลที่ต้องรายงานเพิ่มเติมในอนาคต ○ ปัจจุบันการรายงานธุรกรรมจะต้องรายงานผ่านระบบ ORS ช่องทาง One by One ได้เพียงช่องทางเดียว โดยสมาชิกสามารถศึกษาวิธีการรายงานได้ในระบบ

หลักเกณฑ์ที่เสนอ	ความเห็น/ข้อเสนอแนะ	ความเห็น ThaiBMA
	ให้สามารถดาวน์โหลดได้ผ่านระบบ ORS เพื่ออำนวยความสะดวกในการรายงานข้อมูลของสมาชิก	ORS ที่เมนู Manual ทั้งนี้ อยู่ระหว่างพิจารณาในการแก้ไขระบบเพื่อให้รายงานธุรกรรมดังกล่าวผ่านช่องทาง Upload file และ API ได้
5. เพิ่มนิยาม Settlement Date	<ul style="list-style-type: none"> ○ เสนอปรับถ้อยคำนิยาม Settlement Date โดยตัดคำว่า “วันที่ส่งมอบตราสารหนี้” กรณีการชำระราคาและการส่งมอบเกิดขึ้นคนละวัน 	<ul style="list-style-type: none"> ○ คงนิยามตามเดิม เพื่อให้เกิดมาตรฐานและความเป็นธรรมต่อผู้ลงทุนในตลาดตราสารหนี้
6. อนุโลมให้ระบุ Reporter ID แทน Trader ID ได้ สำหรับธุรกรรม Private Repo ที่ดำเนินการโดยฝ่าย Treasury	- ไม่มี -	- ไม่มี -
7. เพิ่มนิยาม Switching Portfolio (SWP) และกำหนดวิธีการรายงาน	<ul style="list-style-type: none"> ○ เสนอให้วิธีการรายงานธุรกรรม Switching Portfolio รายงานวัตถุประสงค์รอง (Subpurpose) แบบใดแบบหนึ่ง ดังนี้ แบบที่ 1 : รายงานวัตถุประสงค์รอง (Subpurpose) เป็น OTH และระบุ SWP ในช่อง Remark แบบที่ 2 : เพิ่มวัตถุประสงค์รอง (Subpurpose) เป็น SWP โดยไม่ต้องระบุในช่อง Remark ○ เสนอให้เพิ่มฟังก์ชันช่วยตรวจสอบการรายงานธุรกรรม Switching Portfolio เช่น การกำหนดตัวเลือก (Dropdown) สำหรับ SWP หรือการแจ้งเตือน 	<ul style="list-style-type: none"> ○ ปัจจุบันการกำหนดให้ระบุ “SWP” มีวัตถุประสงค์ในการจำแนกรายการดังกล่าว ออกจากรายการ Outright ปกติ ซึ่งจะมีผลต่อการจัดทำสถิติ และการเผยแพร่ข้อมูลต่อผู้ร่วมตลาดตราสารหนี้ ทั้งนี้ ThaiBMA จะรับข้อเสนอไว้พิจารณาเพื่อปรับปรุงระบบในอนาคต ○ การพิจารณาว่าธุรกรรมใดเข้าข่ายเป็น Switching Portfolio จำเป็นต้องพิจารณาจากข้อเท็จจริงและรายละเอียดของธุรกรรมเป็นรายกรณี ซึ่งอาจไม่

หลักเกณฑ์ที่เสนอ	ความเห็น/ข้อเสนอแนะ	ความเห็น ThaiBMA
	(Pending Alert) เพื่ออำนวยความสะดวกและลดความผิดพลาดในการรายงานข้อมูล	สามารถกำหนดเงื่อนไขให้ระบบตรวจสอบหรือแจ้งเตือนได้อย่างเหมาะสมในทุกสถานการณ์
<p>8. ยกเลิกการผ่อนปรนค่าปรับรายการล่าช้า (Late) < 1% ต่อเดือน โดยใช้หลักการผ่อนปรนค่าปรับสำหรับกรณีดังต่อไปนี้</p> <ul style="list-style-type: none"> - รายการล่าช้า (Late) < 6 รายการ ต่อรอบ 6 เดือน <u>หรือ</u> - รายการล่าช้า (Late) < 1% ต่อรอบ 6 เดือน <p>โดย ThaiBMA จะดำเนินการสรุปรายการในรอบ 6 เดือน</p>	<ul style="list-style-type: none"> ○ ควรให้สมาชิกได้ชี้แจงในกรณีที่ ThaiBMA พบรายการล่าช้า (Late) จากการตรวจสอบ Onsite ก่อนทำการปรับ 	<ul style="list-style-type: none"> ○ การพิจารณารายการล่าช้า (Late) ที่พบจากการตรวจสอบ Onsite จะใช้ข้อมูลและหลักฐานที่ได้รับจากสมาชิก โดยมีการเปิดโอกาสให้สมาชิกชี้แจงก่อนสรุปเป็นค่าปรับอยู่แล้วในปัจจุบัน
<p>9. ระบุให้สมาชิกแก้ไขรายการผิดพลาด (Error) และรายงานรายการที่ไม่รายงาน (Missing) ให้ ThaiBMA แม้ว่าได้ชำระค่าปรับแล้ว</p>	<ul style="list-style-type: none"> ○ เสนอยกเว้นค่าปรับรายการผิดพลาด (Error) สำหรับรายการที่สมาชิกตรวจพบและแก้ไข ณ Trade date ภายหลังเวลา 16.00 น. แต่ไม่เกิน 17.00 น. เนื่องจากสมาชิกอาจมีการซื้อขายใกล้เวลาปิดระบบ และไม่สามารถแก้ไขข้อมูลได้ทัน ทั้งนี้ เพื่อสนับสนุนการรายงานข้อมูลให้เป็นไปตามเวลาที่กำหนดและลดแรงจูงใจในการเลื่อนการรายงานไปยังวันทำการถัดไป 	<ul style="list-style-type: none"> ○ การปรับปรุงหลักเกณฑ์ในครั้งนี้ มีวัตถุประสงค์เพื่อกำหนดหน้าที่ของสมาชิกในการแก้ไขรายการผิดพลาด (Error) ให้ถูกต้อง และรายงานข้อมูลให้ครบถ้วน ภายหลังจากชำระค่าปรับแล้ว ส่วนข้อเสนอแนะการยกเว้นค่าปรับในกรณีดังกล่าว จะนำไปพิจารณาเพื่อทบทวนมาตรการลงโทษสมาชิกในโอกาสต่อไป
<p>10. การพิจารณารายการผิดพลาด (Error) กรณีการแก้ไขข้อมูลในช่อง Remark สำหรับธุรกรรม Switching Portfolio (SWP)</p>	<ul style="list-style-type: none"> ○ เสนอยกเว้นค่าปรับรายการผิดพลาด (Error) กรณีไม่ระบุ “SWP” ในช่อง Remark เนื่องจากอาจเกิด Human Error ในการรายงานข้อมูล 	<ul style="list-style-type: none"> ○ เห็นควรคงหลักการตามร่างประกาศ เนื่องจากการระบุ “SWP” ในช่อง Remark เป็นองค์ประกอบสำคัญของข้อมูลการรายงานที่มีผลต่อการจำแนกประเภทธุรกรรม การจัดทำสถิติ และการเผยแพร่ข้อมูลต่อผู้ร่วมตลาดตราสารหนี้ จึงควรกำหนดให้มีการรายงานอย่างถูกต้องครบถ้วนตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด

หลักเกณฑ์ที่เสนอ	ความเห็น/ข้อเสนอแนะ	ความเห็น ThaiBMA
11. ช่วงเวลาที่คาดว่าจะมีผลบังคับใช้	<ul style="list-style-type: none"> ○ เสนอให้กำหนดระยะเวลาเตรียมความพร้อมก่อนร่างประกาศจะมีผลบังคับใช้ เนื่องจากอาจต้องมีการปรับปรุงระบบงานภายใน 	<ul style="list-style-type: none"> ○ การแก้ไขหลักเกณฑ์ต่างๆ ที่นำเสนอในครั้งนี้จะไม่กระทบต่อวิถีปฏิบัติในการรายงานข้อมูลของสมาชิกที่ทำผ่านระบบต่างๆ ของ ThaiBMA ในปัจจุบัน
12. ข้อเสนอแนะอื่นๆ	<ul style="list-style-type: none"> ○ เสนอให้ ThaiBMA จัดทำแนวปฏิบัติหรือเผยแพร่คำอธิบายเพิ่มเติมเกี่ยวกับการรายงานธุรกรรม Bond Forward ที่อ้างอิงตราสารหนี้ ซึ่งยังไม่ถึงวันออกตราสาร (Issue Date) โดยขอความชัดเจนว่าธุรกรรมดังกล่าวสมาชิกมีหน้าที่ต้องรายงานหรือไม่ และหากต้องรายงาน ขอให้กำหนดแนวทางการรายงานเพิ่มเติม 	<ul style="list-style-type: none"> ○ ThaiBMA จะพิจารณาเผยแพร่แนวทางการรายงานธุรกรรม Bond Forward ให้สมาชิกรับทราบต่อไป