

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
ที่ สช. 10/2543

เรื่อง ข้อกำหนดเกี่ยวกับระบบการควบคุมภายในและหลักเกณฑ์
ในการรายงานข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่ง

อาศัยอำนาจตามความในข้อ 5(5) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 21/2540 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการค้าหลักทรัพย์ ลงวันที่ 17 พฤษภาคม พ.ศ. 2540 ประกอบกับข้อ 5/1 แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 21/2540 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการค้าหลักทรัพย์ ลงวันที่ 17 พฤษภาคม พ.ศ. 2540 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 7/2543 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการค้าหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 3) ลงวันที่ 31 มกราคม พ.ศ. 2543 สำนักงานออกข้อกำหนดไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ 1 ในประกาศนี้

“บริษัทหลักทรัพย์” หมายความว่า ผู้ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการค้าหลักทรัพย์

“สำนักงาน” หมายความว่า สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ข้อ 2 บริษัทหลักทรัพย์ต้องมีระเบียบวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับระบบการควบคุมภายใน โดยระเบียบดังกล่าวต้องมีข้อกำหนดให้ผู้รับผิดชอบในการปฏิบัติการเกี่ยวกับการค้าหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่ง (front office) รายงานผลการค้าหลักทรัพย์นั้นแก่หน่วยงานที่ปฏิบัติงานหลังการซื้อขายหลักทรัพย์ (back office) ภายในระยะเวลาอันควร

ข้อ 3 ในการค้าหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่ง ให้บริษัทหลักทรัพย์รายงานข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่งแก่ศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย

รายงานตามวรรคหนึ่ง ต้องเป็นไปตามแบบและวิธีการที่ศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย กำหนดด้วยความเห็นชอบของสำนักงานและต้องมีข้อความอย่างน้อยดังต่อไปนี้

- (1) ชื่อหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนี้
- (2) เป็นรายการซื้อหรือขาย
- (3) ราคาซื้อขายและอัตราผลตอบแทน (yield)
- (4) ปริมาณการซื้อขาย
- (5) เวลาที่ซื้อขาย
- (6) ประเภทของคู่ค้า
- (7) วันส่งมอบหลักทรัพย์
- (8) เป็นการทำธุรกรรมซื้อหรือขายตามปกติ (outright transaction) หรือเป็นการซื้อหรือขายโดยมีสัญญาขายหรือซื้อคืน (repurchase agreement)

ข้อ 4 ให้บริษัทหลักทรัพย์รายงานข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนี้ แก่ศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทยภายในกำหนดเวลาดังต่อไปนี้

- (1) รายการซื้อขายที่เกิดขึ้นระหว่างเวลา 9.00 - 12.00 น. ให้รายงานภายในเวลา 12.30 น. ของวันที่ทำการซื้อขาย
- (2) รายการซื้อขายที่เกิดขึ้นระหว่างเวลา 12.01 - 15.30 น. ให้รายงานภายในเวลา 16.00 น. ของวันที่ทำการซื้อขาย
- (3) รายการซื้อขายที่เกิดขึ้นภายหลังเวลา 15.30 น. ให้รายงานภายในเวลา 9.00 น. ของวันทำการถัดไป

ข้อ 5 ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 3 เมษายน พ.ศ. 2543 เป็นต้นไป เว้นแต่ ความในข้อ 2 ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 2 พฤษภาคม พ.ศ. 2543 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 14 มีนาคม พ.ศ. 2543

(นายประสาร ไตรรัตน์วรกุล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์