

ข้อมูลจากการตรวจติดตามบริษัทหลักทรัพย์ เคทีบีเอสที จำกัด (มหาชน)
 ในฐานะผู้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนส่วนบุคคล
 เพียงวันที่ 31 ตุลาคม 2564

ประเด็นจากการตรวจสอบ	การติดตามแก้ไขของบลจ.	การดำเนินการ/สั่งการของสำนักงาน
<p>1. การจัดการความเสี่ยงด้านการจัดการลงทุน</p> <p>1.1 บริษัทมีการกำหนดเพดานความเสี่ยง (“risk limit”) กรณี Var limit และ Maximum drawdown limit ที่ระดับเดียวกันในทุกนโยบายการลงทุน โดยบริษัทไม่ได้พิจารณาสัดส่วนการลงทุนจริง (“actual port”) ของแต่ละนโยบายการลงทุน ทำให้มีความเสี่ยงที่ risk limit ดังกล่าวอาจไม่ใช่ตัวชี้วัดค่าความเสี่ยงที่เหมาะสมสำหรับแต่ละนโยบายการลงทุน</p>	<p>บริษัทจะปรับปรุงการกำหนด risk limit โดยจะนำข้อมูล actual port ของแต่ละนโยบายการลงทุนมากำหนด risk limit โดยคาดว่าจะปรับปรุงแล้วเสร็จภายในเดือนสิงหาคม 2565</p>	<p>กำกับให้บริษัทดำเนินการตามแนวทางแก้ไขปรับปรุงที่เสนอสำนักงานอย่างเคร่งครัด และรายงานผลการปรับปรุงให้สำนักงานทราบเมื่อบริษัทดำเนินการแล้วเสร็จด้วย</p>
<p>1.2 กรณีที่มีการลงทุนเกิน risk limit บริษัทไม่ได้ขออนุมัติจากคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง (Risk Management Committee : “RMC”) ซึ่งเป็นผู้กำหนด risk limit แต่ขออนุมัติจากคณะกรรมการลงทุน ทำให้การบริหารความเสี่ยงไม่เป็นอิสระจากหน่วยงานด้านการลงทุน</p>	<p>บริษัทได้ปรับปรุงนโยบายและหลักปฏิบัติการบริหารความเสี่ยง โดยกำหนดให้เมื่อเกิดกรณีการลงทุนเกิน risk limit จะต้องรายงาน RMC เพื่อพิจารณาและขออนุมัติการดำเนินการจาก RMC แล้ว เมื่อวันที่ 28 มีนาคม 2565</p>	<p>กำกับให้บริษัทดำเนินการตามแนวทางแก้ไขปรับปรุงที่เสนอสำนักงานอย่างเคร่งครัด</p>
<p>2. การจัดการความเสี่ยงด้านลูกค้าสัมพันธ์ (Customer Relationship Risk)</p> <p>บริษัทยังไม่ดำเนินการให้ได้มาซึ่งเอกสารหลักฐาน แหล่งที่มาของรายได้และฐานะทางการเงินของลูกค้ากองทุนส่วนบุคคล ซึ่งมีข้อมูลที่ไม่สอดคล้องกับมูลค่าเงินลงทุนตามประเด็นการตรวจสอบครั้งก่อน</p>	<p>บริษัทได้เน้นย้ำให้ผู้ปฏิบัติงานที่เกี่ยวข้อง ต้องจัดให้มีเอกสารหลักฐานแสดงฐานะทางการเงินประกอบการเปิดบัญชีของลูกค้าทุกราย และให้ปฏิเสธการเปิดบัญชีแก่ลูกค้าที่ไม่นำเสนอเอกสารดังกล่าว โดยได้ปรับปรุงหลักเกณฑ์การเปิดบัญชีให้สอดคล้องกับการดำเนินการข้างต้นแล้ว สำหรับกรณีลูกค้า</p>	<p>กำกับให้บริษัทดำเนินการตามแนวทางแก้ไขปรับปรุงที่เสนอสำนักงานอย่างเคร่งครัด</p>

ประเด็นจากการตรวจสอบ	การติดตามแก้ไขของบลจ.	การดำเนินการ/สั่งการของสำนักงาน
	ซึ่งยังคงไม่นำส่งเอกสารดังกล่าว บริษัทได้ดำเนินการปิดบัญชีแล้ว เมื่อวันที่ 12 เมษายน 2565	
3. การจัดการความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงาน ไม่มีประเด็นข้อสังเกต		

ข้อมูล ณ วันที่ 23 มิถุนายน 2565