



รายงานการตรวจสอบ

การดำเนินงานของ

บริษัทหลักทรัพย์ ดีบีเอส วิคเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด

เพียงวันที่ 10 มิถุนายน 2562

ข้อมูล ณ วันที่ 16 กันยายน 2563

ผลการตรวจสอบ

ขอบเขตการตรวจสอบ

การตรวจสอบการดำเนินงานของบริษัทหลักทรัพย์ ดีบีเอส วิกเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด (“บริษัท”) ครั้งนี้เป็นการตรวจสอบเฉพาะเรื่อง (cause inspection) ซึ่งตรวจสอบในวันที่ 7 และ 10 มิถุนายน 2562 โดยมีขอบเขตข้อมูลที่ใช้ในการสุ่มตรวจสอบระหว่างวันที่ 22 พฤษภาคม 2562 ถึงวันที่ 10 มิถุนายน 2562

วัตถุประสงค์ของการตรวจสอบ

เพื่อประเมินประสิทธิภาพในการดำเนินงานของบริษัท โดยให้ความสำคัญในระบบงานที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินงาน การควบคุม การบริหารความเสี่ยงของธุรกิจนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ และระบบการป้องกันการขายหลักทรัพย์โดยไม่มีหลักทรัพย์ในครอบครอง

ผลการตรวจสอบ

1. กรณีระบบงานที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินงาน การควบคุม การบริหารความเสี่ยงของบริษัท

จากการตรวจสอบพบประเด็นที่เข้าข่ายปฏิบัติไม่ชอบด้วยกฎหมาย ดังต่อไปนี้

1.1 บริษัทมีการคำนวณและดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (“NC”) ไม่เป็นไปตามที่กฎหมายกำหนด เป็นระยะเวลา 9 วันทำการ และนำส่งรายงานการดำรง NC ต่อสำนักงานไม่ถูกต้องตรงต่อความเป็นจริง เป็นระยะเวลา 4 วันทำการ ซึ่งบริษัทเข้าข่ายมีความผิดตามมาตรา 97 และมาตรา 109 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 (“พ.ร.บ. หลักทรัพย์ฯ”) และมาตรา 49 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 (“พ.ร.บ. สัญญาฯ”)

การดำเนินการของสำนักงาน

สั่งการให้บริษัทควบคุมดูแลให้มีการดำรง NC ให้เป็นไปตามที่กฎหมายกำหนดอย่างเคร่งครัด และให้บริษัทจัดส่งแนวทางดำเนินการเพื่อปรับปรุงแก้ไขการปฏิบัติงานดังกล่าวภายใน 60 วัน นับแต่วันที่ได้รับรายงาน

1.2 ระบบงานที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินงาน การควบคุม และการบริหารความเสี่ยงของธุรกิจนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ของบริษัทยังไม่มีประสิทธิภาพเพียงพอที่จะทำให้บริษัทสามารถดำเนินงานให้เป็นไปตามที่กฎหมายกำหนด ซึ่งเข้าข่ายปฏิบัติไม่เป็นไปตามมาตรา 113 แห่ง พ.ร.บ. หลักทรัพย์ฯ กล่าวคือ บริษัทไม่ได้กำหนดมาตรการและขั้นตอนการปฏิบัติงานที่ชัดเจนและรัดกุมเพื่อให้การปฏิบัติงานเกี่ยวกับการประมาณการ การเตรียมการและดำเนินการที่เกี่ยวข้องกับ NC เป็นไปอย่างมีประสิทธิภาพ

การดำเนินการของสำนักงาน

สั่งการให้บริษัทจัดให้มีระบบงานที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินงาน การควบคุม และการบริหารความเสี่ยงของบริษัทให้รัดกุมและมีประสิทธิภาพ ซึ่งรวมถึงการกำหนดมาตรการและขั้นตอนการปฏิบัติงานที่ชัดเจนและรัดกุม และให้บริษัทจัดส่งแนวทางการดำเนินการดังกล่าวภายใน 60 วัน นับแต่วันที่ได้รับรายงาน

1.3 บริษัทไม่ได้ปฏิบัติตามข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรง NC ได้ ซึ่งเข้าข่ายเป็นการไม่ปฏิบัติตามมาตรา 141 แห่ง พ.ร.บ. หลักทรัพย์ฯ

การดำเนินการของสำนักงาน

สั่งการให้บริษัทปฏิบัติตามที่กฎหมายกำหนดอย่างเคร่งครัด และให้บริษัทกำหนดแนวทางดำเนินการเพื่อมิให้เกิดกรณีดังกล่าวขึ้นอีก พร้อมกับจัดส่งแนวทางดังกล่าวต่อสำนักงานภายใน 60 วัน นับแต่วันที่ได้รับรายงาน

2. ระบบการป้องกันการขายหลักทรัพย์โดยไม่มีหลักทรัพย์ในครอบครอง

ไม่พบประเด็นข้อสังเกต

จากผลการตรวจสอบตามที่กล่าวข้างต้น ส่งผลให้บริษัทมีความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงาน (Operational/ Management Risk) อยู่ในระดับความเสี่ยงค่อนข้างสูง (4)¹

กรณีสำนักงานมีการบังคับใช้กฎหมาย สามารถดูผลได้บนเว็บไซต์สำนักงานหัวข้อ “การบังคับใช้กฎหมาย”
<https://market.sec.or.th/public/idisc/th/Enforce>

¹ Risk มี 5 ระดับ คือ 1 = ต่ำ 2 = ค่อนข้างต่ำ 3 = ปานกลาง 4 = ค่อนข้างสูง 5 = สูง