

ข้อมูลจากการติดตามบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็กซ์สปริง จำกัด

ในฐานะผู้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการจัดการกองทุนรวม กองทุนส่วนบุคคล และการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยลงทุน
เพียงวันที่ 31 ตุลาคม 2565

ประเด็นจากการตรวจสอบ	การติดตามแก้ไขของ บลจ.	การดำเนินการ/สั่งการของสำนักงาน
<p>1. การจัดการความเสี่ยงด้านฐานะการเงิน</p> <p>ไม่มีประเด็นข้อสังเกต</p>		
<p>2. การจัดการความเสี่ยงด้านกองทุนรวมทั่วไป และกองทุนส่วนบุคคล</p> <p>2.1 ด้านการจัดการลงทุน</p> <p>2.1.1 บริษัทมีกระบวนการวิเคราะห์ปัจจัยเชิงคุณภาพ (qualitative) และเชิงปริมาณ (quantitative) ในการคัดเลือก (DAY1) และทบทวนคุณภาพหลักทรัพย์ใน universe ยังไม่รัดกุมเพียงพอ กล่าวคือ</p> <p>(1) กรณีสตราสารทุนในประเทศ บริษัทไม่มีแนวทางการให้คะแนนในปัจจัยเชิงคุณภาพ ทั้งก่อนนำหลักทรัพย์เข้า investment universe และการทบทวนหลักทรัพย์รายไตรมาสใน investment universe รวมถึงไม่มีเกณฑ์การประมวลผลเพื่อใช้ในการพิจารณาระดับที่จะสามารถพิจารณาเสนออนุมัติเข้า investment universe</p> <p>(2) <u>กรณีหน่วยลงทุนในประเทศ</u></p> <p>2.1) บริษัทวิเคราะห์คัดเลือกหลักทรัพย์ก่อนนำเข้า investment universe และทบทวนหลักทรัพย์ในปัจจัยเชิงปริมาณ และเชิงคุณภาพของหน่วยลงทุนในประเทศ และหน่วยลงทุนภายใต้การบริหารจัดการไม่ครบถ้วน เช่น ไม่ได้เปรียบเทียบผลการดำเนินงานกับกองทุนอื่นซึ่งมีนโยบายใกล้เคียงกัน (peer) การวิเคราะห์บริษัทจัดการ เป็นต้น</p> <p>2.2) บริษัทไม่จัดให้มีการบันทึกเหตุผลหรือเกณฑ์การเลือกหน่วยลงทุนมาจัดทำวิเคราะห์ เพื่อนำเข้า investment universe</p>	<p>(1) บริษัทจะดำเนินการปรับปรุงการวิเคราะห์เชิงคุณภาพเพิ่มเติม โดยอ้างอิงจากหลักการ Five Forces Analysis และกำหนดเกณฑ์การให้คะแนน รวมทั้งจัดทำหลักเกณฑ์ในการประเมินคะแนนให้มีความชัดเจนมากยิ่งขึ้น นอกจากนี้ บริษัทจะกำหนดให้มีเกณฑ์การให้คะแนนสำหรับการพิจารณาการผ่านเข้า universe เบื้องต้น พร้อมทั้งเก็บเอกสารหลักฐานการให้คะแนนและการพิจารณาวิเคราะห์ที่สามารถตรวจสอบได้</p> <p>(2) บริษัทได้จัดทำหลักเกณฑ์คัดเลือกหน่วยลงทุนและมีผลบังคับใช้เมื่อวันที่ 10 ส.ค. 2564 ซึ่งผ่านความเห็นชอบของคณะกรรมการการลงทุน (IC) โดยหลักเกณฑ์ดังกล่าวครอบคลุมปัจจัยเชิงคุณภาพที่วิเคราะห์ไม่ครบถ้วนแล้ว นอกจากนี้ บริษัทจะบันทึกเหตุผลและความเห็นเพิ่มเติมในการคัดเลือกกองทุนที่นำเข้า universe ให้ครบถ้วนและมีความรัดกุมมากยิ่งขึ้นและเก็บไว้ให้สำนักงานสามารถตรวจสอบได้</p>	<p>กำกับให้บริษัทมีกระบวนการวิเคราะห์และทบทวนคุณภาพหลักทรัพย์ ทั้งปัจจัยเชิงคุณภาพและเชิงปริมาณให้ครบถ้วน พร้อมทั้งกำหนดแนวทางการวิเคราะห์หรือการให้คะแนนตราสารที่ลงทุนให้รัดกุม ครบถ้วน เหมาะสม และทันต่อเหตุการณ์ พร้อมบันทึกเหตุผลประกอบการวิเคราะห์ ทบทวนหรือการให้คะแนน เป็นไปตามแนวทางที่บริษัทกำหนดและเสนอต่อสำนักงานอย่างเคร่งครัด พร้อมทั้งจัดเก็บเอกสารหลักฐานเพื่อให้สามารถตรวจสอบได้</p>

ประเด็นจากการตรวจสอบ	การติดตามแก้ไขของ บลจ.	การดำเนินการ/สั่งการของสำนักงาน
2.1.2 บริษัทจัดให้มีการรายงานผลการดำเนินงานและค่าความเสี่ยงด้านตลาด (market risk) ของกองทุนให้คณะกรรมการบริษัท (“BOD”) รับทราบ ไม่ครบถ้วนทุกกองทุน	บริษัทจะดำเนินการสรุปและรายงานความเสี่ยงให้ครบถ้วนทุกกองทุนตามรอบการประชุม ต่อ BOD	กำชับให้บริษัทควบคุมดูแลการรายงานค่าความเสี่ยงด้านตลาดให้เป็นไปตามแนวทางที่บริษัทกำหนดและเสนอต่อสำนักงานอย่างเคร่งครัด พร้อมทั้งจัดเก็บเอกสารหลักฐานเพื่อให้สามารถตรวจสอบได้
2.2 ด้านลูกค้าสัมพันธ์ ไม่มีประเด็นข้อสังเกต		
2.3 ด้านการปฏิบัติงาน ไม่มีประเด็นข้อสังเกต		

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

ข้อมูล ณ วันที่ 16 มิถุนายน 2566