

ข้อมูลจากการตรวจติดตาม (follow up) บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอเชีย เวลท์ จำกัด
ในฐานะผู้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ประเภทการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่ง
เพียงวันที่ 30 พฤศจิกายน 2563

ประเด็นจากการตรวจสอบ	การติดตามแก้ไขของบลจ.	การดำเนินการ/ตั้งการของสำนักงาน
1. การจัดการความเสี่ยงด้านฐานะการเงิน ไม่มีประเด็นข้อสังเกต		
2. งานด้านการเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์อันเป็นตราสารแห่งหนึ่ง 2.1 การวิเคราะห์และคัดเลือกตราสารหนี้ที่จะนำมาเสนอขายแก่ลูกค้า ยังไม้รัดกุมเพียงพอ กล่าวคือ บริษัทคาดการณ์กระแสเงินสดในอนาคต ("cash flow projection") ของผู้ออกตราสาร ("issuer") โดยไม่พบว่า มีเอกสารหลักฐานสนับสนุนและการสอบทานความสมเหตุสมผล ทำให้ มีความเสี่ยงที่ผู้ออกตราสารอาจจะไม่สามารถชำระเงินต้นและดอกเบี้ย ได้เมื่อตราสารครบกำหนดอายุ	บริษัทรับทราบประเด็นและได้แก้ไขโดยมีการบันทึกเหตุผล พร้อมทั้งจัดเก็บเอกสารไว้ให้ตรวจสอบแล้ว	กำชับให้บริษัทจัดให้มีกระบวนการวิเคราะห์ตราสารหนี้ ที่นำมาเสนอขายให้รัดกุม เหมาะสม บันทึกหรือจัดเก็บ เอกสารเพื่อประกอบการพิจารณาให้ครบถ้วน รวมทั้ง ตรวจสอบการปฏิบัติงานดังกล่าวและรายงานให้ คณะกรรมการบริษัททราบด้วย
2.2 การติดตามและสอบทานการออกตราสารหนี้ ยังไม่มี ประสิทธิภาพเพียงพอและไม่เป็นไปตามเกณฑ์ที่บริษัทกำหนด เช่น คณะกรรมการพิจารณาคัดเลือกตราสารหนี้ ("คณะกรรมการ BSC") อนุมัติรับเป็นตัวแทนขายตราสารหนี้ โดยมีข้อมูลหรือหลักฐาน สนับสนุนการพิจารณาและเหตุผลที่สะท้อนความสามารถในการ ชำระหนี้ของ issuer ยังไม่ครบถ้วนเพียงพอ เป็นต้น	บริษัทรับทราบประเด็นและได้แก้ไขโดยมีการบันทึก ความเห็นหรือข้อสอบถามของคณะกรรมการ BSC พร้อมทั้งจัดเก็บเอกสารไว้ให้ตรวจสอบแล้ว	กำชับให้บริษัทมีกระบวนการในการสอบทานคุณภาพ ของผู้ออกตราสารที่มีประสิทธิภาพ ควบคุมดูแล การปฏิบัติงานให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่บริษัทกำหนด จัดทำและจัดเก็บเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องให้ชัดเจน และครบถ้วน รวมทั้งตรวจสอบการปฏิบัติงานดังกล่าว และรายงานให้คณะกรรมการบริษัททราบด้วย