

4 สิงหาคม 2569

เรียน กรรมการและผู้จัดการ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

กรรมการผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน

ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล

ผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์นายหน้าซื้อขายหน่วยลงทุน

ผู้ให้บริการระบบเสนอขายโทเคนดิจิทัล

ผู้ให้บริการระบบครวด์ฟนдинг

นายกสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

นายกสมาคมบริษัทจัดการลงทุน

ที่ ก.ล.ต.ท.(ว) 43/2569 เรื่อง นำส่งกรอบการกำกับดูแลการใช้งานปัญญาประดิษฐ์
ในภาคตลาดทุน ฉบับปรับปรุงครั้งที่ 1

ด้วยสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (“สำนักงาน ก.ล.ต.”) ได้เผยแพร่กรอบการกำกับดูแลการใช้งานปัญญาประดิษฐ์ (Artificial Intelligence: AI) และการเรียนรู้ของเครื่อง (Machine Learning: ML) ในตลาดทุน (“กรอบการกำกับดูแล AI/ML”) เมื่อเดือนธันวาคม 2566 เพื่อให้ผู้ประกอบธุรกิจในภาคตลาดทุนใช้เป็นแนวทางในการนำ AI/ML มาใช้ในการประกอบธุรกิจ เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพและประสิทธิผลในการดำเนินงานขององค์กร โดยคำนึงถึงความเสี่ยงและแนวทางการนำ AI/ML มาใช้งานได้อย่างเหมาะสม โดยสำนักงาน ก.ล.ต. ให้ความสำคัญต่อการสร้างความเชื่อมั่นในภาคตลาดทุน (Trust and Confidence) และสนับสนุนให้ผู้ประกอบธุรกิจสามารถนำเทคโนโลยีมาใช้ในการประกอบธุรกิจได้อย่างมีความรับผิดชอบ คำนึงถึงการคุ้มครองผู้ลงทุน ความมั่นคงปลอดภัยของระบบงาน ความเป็นธรรม ความโปร่งใส และความน่าเชื่อถือของตลาดทุน นั้น

ปัจจุบันการใช้งาน AI ในภาคตลาดทุนมีพัฒนาการอย่างต่อเนื่อง ทั้งในมิติด้านการเพิ่มประสิทธิภาพการดำเนินงาน การให้บริการลูกค้า การบริหารความเสี่ยง และการสนับสนุนกระบวนการตัดสินใจ ขณะเดียวกันอาจก่อให้เกิดความเสี่ยงที่ควรได้รับการกำกับดูแลอย่างเหมาะสม เช่น การกำกับดูแลภายในองค์กร การพึ่งพาบุคคลที่สามหรือผู้ให้บริการภายนอก การเปิดเผยข้อมูลต่อผู้ใช้บริการและผู้มีส่วนได้เสีย การจัดเก็บบันทึกและหลักฐาน การรายงานเหตุการณ์ และการติดตามการใช้งาน AI อย่างต่อเนื่อง สำนักงาน ก.ล.ต. จึงได้นำกรอบการกำกับดูแล AI/ML ฉบับดังกล่าว

มาปรับปรุงเพิ่มเติมเป็นกรอบการกำกับดูแลการใช้งานปัญญาประดิษฐ์ในภาคตลาดทุน ฉบับปรับปรุงครั้งที่ 1 (“กรอบการกำกับดูแล AI ฉบับปรับปรุง”) โดยศึกษาและเทียบเคียงแนวทาง มาตรฐาน และกรอบการกำกับดูแลที่เกี่ยวข้องในระดับสากล และนำมาปรับให้เหมาะสมกับบริบทของภาคตลาดทุนไทย เพื่อสนับสนุนให้ผู้ประกอบธุรกิจสามารถรับมือกับผลกระทบที่อาจเกิดขึ้นจากการใช้งาน AI ทั้งต่อการดำเนินธุรกิจและผู้ลงทุน โดยสามารถออกแบบโครงสร้างการกำกับดูแลและมาตรการควบคุมที่เหมาะสม สอดคล้องกับลักษณะและระดับความเสี่ยงของแต่ละกรณีการใช้งาน (use case) โดยเฉพาะกรณีที่มีความซับซ้อนสูง มีการพึ่งพาบุคคลที่สามหรือผู้ให้บริการภายนอก หรืออาจส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน การตัดสินใจลงทุน สภาพคล่องของตลาด หรือเสถียรภาพของระบบโดยรวม

สำนักงาน ก.ล.ต. จึงขอส่งกรอบการกำกับดูแล AI ฉบับปรับปรุง (สิ่งที่ส่งมาด้วย) มายังหน่วยงานท่าน เพื่อโปรดทราบและพิจารณานำไปใช้ประโยชน์ในการกำกับดูแลและบริหารจัดการความเสี่ยงจากการใช้งาน AI ภายในองค์กรตามความเหมาะสม ทั้งนี้ กรอบการกำกับดูแล AI ฉบับปรับปรุงนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อเป็นแนวทางสนับสนุนให้ผู้ประกอบธุรกิจสามารถนำ AI มาใช้ได้อย่างรับผิดชอบเหมาะสม และสอดคล้องกับแนวปฏิบัติที่ดี โดยสามารถปรับใช้ตามบริบท ลักษณะการใช้งาน ระดับความเสี่ยง และหลักความได้สัดส่วน มิได้มีลักษณะเป็นการกำหนดหลักเกณฑ์บังคับเพิ่มเติมจากหลักเกณฑ์ที่มีผลใช้บังคับอยู่ในปัจจุบัน โดยท่านสามารถดาวน์โหลดกรอบการกำกับดูแลได้ในเว็บไซต์ของสำนักงาน ก.ล.ต. (<https://www.sec.or.th/TH/Pages/CYBERRESILIENCE-REGULATIONS.aspx>) ในการนี้ สำนักงาน ก.ล.ต. ขอเสนอช่องทางการติดต่อสอบถามฝ่ายกำกับและตรวจสอบความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ เพิ่มเติมทางอีเมล cyberteam@sec.or.th และรายชื่อเจ้าหน้าที่ผู้รับผิดชอบ คือ นายพชร พลายพิชิต เจ้าหน้าที่บริหาร โทรศัพท์ 0-2263-6228 อีเมล phatchara@sec.or.th นางสาวณัชชา จารุณศ เจ้าหน้าที่บริหาร โทรศัพท์ 0-2033-9985 อีเมล natchac@sec.or.th และนายกฤตยช อรรถจิตร เจ้าหน้าที่บริหาร โทรศัพท์ 0-2033-9906 อีเมล krittayod@sec.or.th

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ



(นางพรอนงค์ บุษราตระกูล)

เลขาธิการ

สิ่งที่ส่งมาด้วย กรอบการกำกับดูแลการใช้งานปัญญาประดิษฐ์ในภาคตลาดทุน ฉบับปรับปรุงครั้งที่ 1

ฝ่ายกำกับและตรวจสอบความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ

โทรศัพท์/โทรสาร 0-2263-6228, 0-2033-9985, 0-2033-9906