



11 กรกฎาคม 2543

เรียน กรรมการผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์และบริษัทเงินทุนหลักทรัพย์ทุกแห่ง

ที่ กสท.ธ.(ว) 11 /2543 เรื่อง การชักชวนความเข้าใจกรณีบริษัทหลักทรัพย์
ใช้การบริหารความเสี่ยงร่วมกับบริษัทแม่หรือบริษัทในเครือ

โดยที่ปัจจุบันมีบริษัทหลักทรัพย์หลายแห่งซึ่งเป็นบริษัทในเครือของกลุ่มสถาบันการเงินทั้งในและต่างประเทศมีการใช้นโยบายและการดำเนินการในด้านการบริหารและจัดการความเสี่ยงในลักษณะที่ให้บริษัทแม่หรือบริษัทในกลุ่มเข้ามามีส่วนร่วมในการดำเนินการดังกล่าวทั้งในลักษณะที่เป็นการให้ความเห็น กำหนดขอบเขตและหลักเกณฑ์ในการดำเนินธุรกิจ และตรวจสอบการดำเนินธุรกิจให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดสำหรับกลุ่มธุรกิจของตน ทั้งนี้ เพื่อให้กลุ่มธุรกิจสามารถควบคุมและบริหารความเสี่ยงได้อย่างมีประสิทธิภาพ

สำนักงานขอเรียนว่า การที่บริษัทหลักทรัพย์ใช้การบริหารความเสี่ยงร่วมกับบริษัทแม่หรือบริษัทอื่นในกลุ่ม สำนักงานจะไม่ถือว่าการดำเนินการดังกล่าวเป็นการมอบหมายให้บุคคลอื่นมีอำนาจในการจัดการบริษัทหลักทรัพย์ที่ต้องขอความเห็นชอบจากสำนักงานตามมาตรา 104 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 ถ้าการเข้ามามีส่วนร่วมในการบริหารความเสี่ยงจำกัดบทบาทเฉพาะอำนาจในการจำกัดหรือปฏิเสธธุรกรรมที่บริษัทหลักทรัพย์ได้ส่งให้พิจารณา โดยบริษัทแม่หรือบริษัทในเครือจะไม่สามารถริเริ่มการเข้าทำธุรกรรมได้ด้วยตนเอง ทั้งนี้ โดยมีลักษณะในทำนองเดียวกันกับตัวอย่างดังต่อไปนี้

1. การกำหนดนโยบายในการบริหารความเสี่ยง
2. การกำหนดและการแก้ไขปริมาณความเสี่ยงสูงสุดที่บริษัทหลักทรัพย์หรือบริษัทในกลุ่มจะสามารถรองรับได้เพื่อให้ความเสี่ยงของกลุ่มอยู่ภายในเกณฑ์ที่กำหนด
3. การติดตามและควบคุมสถานะความเสี่ยงของบริษัทให้อยู่ภายใต้กรอบที่กำหนด

แก่ลูกค้า

4. การกำหนดหลักเกณฑ์ในการพิจารณารับลูกค้าหรือการพิจารณาอนุมัติวงเงินให้กู้ยืม

5. การกำหนดหลักเกณฑ์ในการพิจารณาลงทุนของบริษัทหลักทรัพย์

6. การทบทวนการประเมินค่าความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นเพื่อรองรับธุรกรรมใหม่ ๆ

7. การกำหนดปัจจัยหรือวิธีการคำนวณมูลค่าความเสี่ยงของราคาและความเสี่ยงของ

คู่สัญญา

จึงเรียนมาเพื่อโปรดทราบ

ขอแสดงความนับถือ



(นายประสาร ไตรรัตน์วรกุล)

เลขาธิการ

ฝ่ายกำกับธุรกิจหลักทรัพย์

โทร. 2523223 ต่อ 1214