**แบบประเมินตนเอง**

**(Self - Assessment Questionnaire หรือ SAQ)**

**ด้านระบบงานสำหรับการลงทุนเพื่อบริษัทหลักทรัพย์**

เรียน ผู้ที่เกี่ยวข้อง

สำนักงานขอให้บริษัทท่านประเมินตนเองตามแบบประเมินนี้ โดยใช้ข้อมูลในวันทำการสุดท้าย

ของเดือนกุมภาพันธ์ 2556 และส่งแบบประเมินให้สำนักงาน**ภายในวันที่ 30 เมษายน 2556**

นอกจากนี้ ขอให้บริษัทท่านทำการประเมินตนเองเป็น**ประจำทุกปี**โดยใช้ข้อมูลสิ้นสุดในวันทำการสุดท้ายของปี และส่งแบบประเมินให้สำนักงาน**ภายในวันที่ 31 มกราคมของปีถัดไป**

**หรือ เมื่อมีการเปลี่ยนแปลงของข้อมูลอย่างมีนัยสำคัญ**

**ระบบงานสำหรับการลงทุนในหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อบริษัทหลักทรัพย์**

บริษัทหลักทรัพย์ .......................................................... ข้อมูลสิ้นสุดวันที่ ...................................................

**ส่วนที่ 1 : โครงสร้างการกำกับดูแล**

* 1. โปรดระบุหน่วยงาน/คณะกรรมการต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้องกับการจัดการการลงทุน การจัดการบริหารความเสี่ยง การควบคุมการปฏิบัติงาน และหน้าที่ความรับผิดชอบของหน่วยงาน/คณะกรรมการดังกล่าว

(โปรดระบุรายชื่อ อำนาจหน้าที่ และความถี่ในการประชุมตามตัวอย่างด้านล่าง)

*ตัวอย่าง:*

*คณะกรรมการบริษัท ประกอบด้วย*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **รายชื่อ** | **ตำแหน่ง/ส่วนงาน**  | **หน้าที่รับผิดชอบ** | **ความถี่ในการประชุม** |
|  |  |  |  |

 *คณะกรรมการการลงทุน ประกอบด้วย*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **รายชื่อ** | **ตำแหน่ง/ส่วนงาน** | **หน้าที่รับผิดชอบ** | **ความถี่ในการประชุม** |
|  |  |  |  |

 *คณะกรรมการบริหารความเสี่ยง ประกอบด้วย*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **รายชื่อ** | **ตำแหน่ง/ส่วนงาน** | **หน้าที่รับผิดชอบ** | **ความถี่ในการประชุม** |
|  |  |  |  |

 *รายชื่อผู้ทำหน้าที่ซื้อขายหลักทรัพย์เพื่อบริษัทหลักทรัพย์*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **รายชื่อ** | **ตำแหน่ง** | **หน้าที่รับผิดชอบ** | ***คุณวุฒิ/license*** |
|  |  |  |  |

 *รายชื่อผู้ทำหน้าที่ฝ่ายงานบริหารความเสี่ยง*

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **รายชื่อ** | **ตำแหน่ง** | **หน้าที่รับผิดชอบ** | ***คุณวุฒิ/license*** |
|  |  |  |  |

* 1. โปรดระบุหน่วยงาน/คณะกรรมการต่าง ๆ ตาม 1.1 ในแผนผังองค์กร (Organization chart)

*ตัวอย่าง:*

* 1. นโยบายและหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนในหลักทรัพย์เพื่อบริษัทหลักทรัพย์
		1. ระบุเป็นลายลักษณ์อักษร □ ใช่ □ ไม่ใช่
		2. ได้รับความเห็นชอบ/อนุมัติจาก

□ คณะกรรมการบริษัท เมื่อวันที่.................. ทบทวนครั้งล่าสุด...............

□ คณะกรรมการการลงทุน เมื่อวันที่.................. ทบทวนครั้งล่าสุด...............

□ อื่น ๆ (โปรดระบุ) เมื่อวันที่.................. ทบทวนครั้งล่าสุด...............

* + 1. นโยบายและหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวกับการลงทุนเพื่อบริษัทหลักทรัพย์ ครอบคลุมถึงหัวข้อดังต่อไปนี้

□ การกำหนดบทบาทหน้าที่ของหน่วยงาน/คณะกรรมการที่เกี่ยวข้อง

□ นโยบายและหลักเกณฑ์การลงทุน

□ การกำหนดวงเงินการลงทุน/การจัดสรรวงเงิน

□ หลักเกณฑ์การคำนวณมูลค่าหลักทรัพย์/ตราสารอนุพันธ์

□ นโยบายการบริหารความเสี่ยงการลงทุน

□ ขั้นตอนและความถี่ในการทบทวนนโยบายและหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง

□ การจ่ายผลตอบแทนแก่ Proprietary trader

□ ระบบการป้องกันการล่วงรู้ข้อมูลอันไม่พึงเปิดเผยระหว่างหน่วยงานและบุคลากรของบริษัท

□ ระบบป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์

□ อื่น ๆ (โปรดระบุ).................................................................................

**ส่วนที่ 2 : ระบบการจัดการการลงทุนเพื่อบริษัทหลักทรัพย์และระบบการคำนวณมูลค่ายุติธรรมโดยอ้างอิง ราคาตลาด (mark to market)**

* 1. นโยบายและหลักเกณฑ์การลงทุนครอบคลุมในเรื่องใดบ้าง โปรดแนบเอกสารเพิ่มเติม

□ ประเภทหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

□ การกำหนดวงเงินในการลงทุน

□ การจัดสรรวงเงินในการลงทุน

□ อื่น ๆ โปรดระบุ ……………

* 1. โปรดอธิบายหลักเกณฑ์ในการคัดเลือกหลักทรัพย์/สัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพื่อการลงทุน

รวมทั้งปัจจัยที่ใช้ในการพิจารณาการคัดเลือกหลักทรัพย์

............................................................................................................................................................

............................................................................................................................................................

* 1. โปรดอธิบายแนวทางการกำหนดวงเงินรวมในการลงทุนเพื่อบริษัทหลักทรัพย์และแสดงวิธีการจัดสรรวงเงินโดยแยกเป็นฝ่ายงาน (หากมีหน่วยงานมากกว่าหนึ่งฝ่ายที่มีการซื้อขายเพื่อบริษัทหลักทรัพย์)
	และแยกเป็นรายบัญชี โดยวงเงินรวมต้องได้รับอนุมัติจากใครหรือฝ่ายงานใดบ้าง

............................................................................................................................................................

............................................................................................................................................................

* 1. บริษัทมีวิธีการอย่างไรในการควบคุมมิให้มีการลงทุนเกินวงเงินที่กำหนด

............................................................................................................................................................

............................................................................................................................................................

* 1. กรณีที่มีการลงทุนเกินวงเงินที่กำหนด บริษัทมีขั้นตอนดำเนินการอย่างไร

............................................................................................................................................................

............................................................................................................................................................

* 1. กำหนดระยะเวลาในการทบทวนวงเงินการลงทุน

□ มี ระบุความถี่ ..................................

□ อื่น ๆ โปรดระบุ .............................

* 1. วงเงินรวมทั้งหมดที่ได้รับอนุมัติให้ลงทุนเพื่อบริษัทหลักทรัพย์ในหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์

(ข้อมูล ณ วันที่..................) หน่วย : ล้านบาท

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **วงเงินรวม** | **วงเงินที่ใช้ไป** | **ฐานะการลงทุน (exposure)[[1]](#footnote-1)** | **เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ****(NC)** | **ส่วน****ผู้ถือหุ้น****(EQ)** | **สัดส่วนวงเงินที่ใช้ไปเมื่อเทียบกับ****(คิดเป็น %)** | **สัดส่วนฐานะการลงทุนเมื่อเทียบกับ****(คิดเป็น %)** |
| **NC** | **EQ** | **NC** | **EQ** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |

* 1. วงเงินที่ได้รับอนุมัติให้ลงทุนแยกตามประเภทตราสาร **(หากมีรายละเอียดแตกต่างไปจากประเภทตราสารด้านล่าง สามารถปรับปรุงแก้ไขได้)**

(ข้อมูล ณ วันที่..................) หน่วย : ล้านบาท

| **ประเภทตราสาร** | **วงเงิน** | **วงเงินที่ใช้ไป** | **ฐานะการลงทุน (exposure)** | **สัดส่วนวงเงินที่ใช้ไปเมื่อเทียบกับ****(คิดเป็น %)** | **สัดส่วนฐานะการลงทุนเมื่อเทียบกับ****(คิดเป็น %)** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **NC** | **EQ** | **NC** | **EQ** |
| **Exchange** |
| ตราสารทุน |  |
| * SET 50/100
 |  |  |  |  |  |  |  |
| * Non SET 50/100
 |  |  |  |  |  |  |  |
| * อื่นๆ (โปรดระบุ)
 |  |  |  |  |  |  |  |
| ตราสารหนี้ |  |  |  |  |  |  |  |
| ตราสารอนุพันธ์ |  |
| * อ้างอิงตราสารทุน
 |  |  |  |  |  |  |  |
| * อ้างอิงตราสารหนี้
 |  |  |  |  |  |  |  |
| * อ้างอิงสินค้าโภคภัณฑ์
 |  |  |  |  |  |  |  |
| * อ้างอิงสกุลเงิน
 |  |  |  |  |  |  |  |
| * อ้างอิงตราสารอื่น

 (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |  |
| **Over-The-Counter (OTC)** |
| ตราสารทุน |  |  |  |  |  |  |  |
| ตราสารหนี้ |  |  |  |  |  |  |  |
| ตราสารอนุพันธ์ |  |  |  |  |  |  |  |
| * อ้างอิงตราสารทุน
 |  |  |  |  |  |  |  |
| * อ้างอิงตราสารหนี้
 |  |  |  |  |  |  |  |
| * อ้างอิงสินค้าโภคภัณฑ์
 |  |  |  |  |  |  |  |
| * อ้างอิงสกุลเงิน
 |  |  |  |  |  |  |  |
| * อ้างอิงตราสารอื่น

 (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |  |

* 1. วงเงินที่ได้รับอนุมัติสำหรับการทำธุรกรรม**ในประเทศ** แยกตามประเภทบัญชี **(หากมีรายละเอียดแตกต่างไปจากประเภทบัญชีด้านล่าง สามารถปรับปรุงแก้ไขได้)**

 (ข้อมูล ณ วันที่..................) หน่วย : ล้านบาท

| **ประเภทบัญชี** | **วงเงิน** | **วงเงินที่ใช้ไป** | **ฐานะการลงทุน** **(exposure)** | **สัดส่วนวงเงินที่ใช้ไปเมื่อเทียบกับ****(คิดเป็น %)** | **สัดส่วนฐานะการลงทุนเมื่อเทียบกับ****(คิดเป็น %)** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **NC** | **EQ** | **NC** | **EQ** |
| **Directional Trading** |
| System Trade |  |  |  |  |  |  |  |
| Day Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Short Term Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Long Term Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |  |
| **Strategic Trading** |
| Options Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Index Arbitrage |  |  |  |  |  |  |  |
| Single Stock Arbitrage |  |  |  |  |  |  |  |
| Pair Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |  |
| **Market Making** |
| DW-MM |  |  |  |  |  |  |  |
| ETF-MM  |  |  |  |  |  |  |  |
| Futures&Options-MM |  |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |  |
| **Product Issuing** |
| DW |  |  |  |  |  |  |  |
| Structured Notes |  |  |  |  |  |  |  |
| Options  |  |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |  |
| **Product Hedging** |
| DW-Hedging |  |  |  |  |  |  |  |
| Structured Notes-Hedging |  |  |  |  |  |  |  |
| Options-Hedging |  |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |  |

* 1. วงเงินที่ได้รับอนุมัติสำหรับการทำธุรกรรม**ต่างประเทศ** แยกตามประเภทบัญชี **(หากมีรายละเอียดแตกต่างไปจากประเภทบัญชีด้านล่าง สามารถปรับปรุงแก้ไขได้)**

 (ข้อมูล ณ วันที่..................) หน่วย : ล้านบาท

| **ประเภทบัญชี** | **วงเงิน** | **วงเงินที่ใช้ไป** | **ฐานะการลงทุน** **(exposure)** | **สัดส่วนวงเงินที่ใช้ไปเมื่อเทียบกับ****(คิดเป็น %)** | **สัดส่วนฐานะการลงทุนเมื่อเทียบกับ****(คิดเป็น %)** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **NC** | **EQ** | **NC** | **EQ** |
| **Directional Trading** |
| System Trade |  |  |  |  |  |  |  |
| Day Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Short Term Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Long Term Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |  |
| **Strategic Trading** |
| Options Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Index Arbitrage |  |  |  |  |  |  |  |
| Single Stock Arbitrage |  |  |  |  |  |  |  |
| Pair Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |  |

* 1. โปรดอธิบายหลักเกณฑ์การคำนวณมูลค่ายุติธรรมโดยอ้างอิงราคาตลาด (mark to market)
	กรณีที่มีการซื้อหรือขายหลักทรัพย์หรือตราสารอนุพันธ์ที่ไม่สามารถทราบหรือคำนวณราคา
	หรือไม่เป็นไปตามราคาตลาด

 ............................................................................................................................................................

............................................................................................................................................................

**ส่วนที่ 3 : ระบบควบคุมการปฏิบัติงาน**

* 1. **ระบบบริหารความเสี่ยงในการลงทุน**

โปรดทำเครื่องหมาย / ในกรณีที่บริษัทมีหลักเกณฑ์หรือข้อกำหนดในเรื่องต่อไปนี้ และโปรดแนบรายละเอียดที่ใช้ในการจัดทำมาด้วย **(หากมีรายละเอียดแตกต่างไปจากรายละเอียดด้านล่าง สามารถปรับปรุงแก้ไขได้)**

* + 1. ความเสี่ยงด้านตลาด (Market Risk)
1. โปรดระบุแนวทางในการบริหารความเสี่ยงด้าน market risk สำหรับการลงทุนในตราสาร

แต่ละประเภท โดยให้ครอบคลุมถึง

1. เครื่องมือที่ใช้ในการบริหารความเสี่ยง รวมถึงสมมติฐานที่ใช้
2. ขั้นตอนการวัดค่าความเสี่ยง รวมถึงความถี่ในการวัดค่า
3. การจำกัด การควบคุม และการติดตาม
4. การใช้ข้อมูลความเสี่ยงในการควบคุมการลงทุน (risk budgeting)

**Equity (EQ)**

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**Fixed Income (FI)** \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**Derivatives** เช่น future, forward, swap, options

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**อื่น ๆ** (โปรดระบุ เช่น FX, Commodities)\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. มีการกำหนด market risk limit สำหรับตราสารแต่ละประเภทหรือไม่
และมีแนวทางการกำหนดอย่างไร

**EQ** (ตัวอย่าง เช่น beta limit, loss control limit, VaR limit, concentration limit เป็นต้น)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**FI** (ตัวอย่าง เช่น dollar duration, loss control limit, VaR limit, concentration limit เป็นต้น)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**Derivatives** (ตัวอย่าง เช่น delta limit, gamma limit, vega limit, VaR limit เป็นต้น)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**อื่น ๆ** (**โปรด**ระบุ)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. การทดสอบความถูกต้อง (Backtesting)
2. มีการจัดทำ Backtesting เพื่อทดสอบความถูกต้องของค่า VaR ที่คำนวณได้จากแบบจำลองหรือไม่

 □ มี □ ไม่มี (โปรดระบุเหตุผล) \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_**\_**\_\_\_\_\_\_

1. ในกรณีที่ตอบว่า “มี” บริษัททำ Backtesting โดยวิธี

######  □ Kupiec’s model

######  □ BIS’s three zones approach

######  □ อื่น ๆ (ระบุ)\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. กระบวนการในการทำ Backtesting

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. หน่วยงานที่รับผิดชอบในการทำ Backtesting \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_
2. ข้อมูลย้อนหลังที่ใช้ในการจัดทำ Backtesting

□ 2 ปี □ 1.5 ปี □ 1 ปี

□ อื่น ๆ \_\_\_\_

1. มีการกำหนด scaling factor ค่า VaR ที่คำนวณได้จากแบบจำลองตามค่า exceptions ที่ได้จากผลของการทำ Backtesting หรือไม่

□ มี (โปรดระบุรายละเอียดแนบ) □ ไม่มี

1. ความถี่ในการจัดทำ backtesting

□ ทุก 6 เดือน □ ทุก 1 ปี □ ทุก 1.5 ปี □ ทุก 2 ปี

□ อื่น ๆ (ระบุ)\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. การกำหนดสถานการณ์และการทดสอบภาวะวิกฤต (Stress test/ Scenario analysis)
2. โปรดระบุวิธีการ ขั้นตอน สมมติฐาน รวมทั้งปัจจัยที่ใช้ในการทำ stress test และกำหนด scenario ต่าง ๆ แยกตามประเภทหลักทรัพย์หรือแยกตามกลยุทธ์การลงทุน

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. มีการนำผล stress test/ scenario analysis ไปใช้ในการพิจารณาประกอบการลงทุนหรือไม่ อย่างไร

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. มีแผนรองรับการดำเนินธุรกิจภายใต้สถานการณ์วิกฤตนั้น ๆ หรือไม่ โปรดระบุ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_
	* 1. ความเสี่ยงด้านเครดิต (Credit Risk)
2. บริษัทมีการพิจารณาอันดับความน่าเชื่อถือ (credit rating) เพื่อคัดเลือกตราสารที่ลงทุนได้ โดยใช้ข้อมูลจาก

□ external credit rating (ระบุแหล่งที่มาข้อมูล)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ internal credit rating

1. บริษัทใช้เครื่องมือและวิธีการใดในการวิเคราะห์ความเสี่ยงด้าน credit risk ทั้งนี้ โปรดระบุปัจจัยหรือข้อมูลที่ใช้ในการพิจารณาด้วย

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. บริษัทมีการทดสอบความถูกต้องของ model ดังกล่าวหรือไม่ อย่างไร

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. บริษัทมีการกำหนดวงเงินลงทุนโดยพิจารณาปัจจัยดังต่อไปนี้หรือไม่ อย่างไร

□ อันดับความน่าเชื่อขั้นต่ำของตราสารที่สามารถลงทุนได้ (Minimum acceptable credit)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ การกระจุกตัวของเงินลงทุนเมื่อพิจารณารวมทุกบัญชี trader

□ การกระจุกตัวในตราสาร ผู้ออกตราสาร หรือคู่สัญญา

□ การกระจุกตัวในอันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร

□ อื่น ๆ (โปรดระบุ)

 \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

 \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ การกระจุกตัวของเงินลงทุนเมื่อพิจารณาแยกบัญชี trader

□ การกระจุกตัวในตราสาร ผู้ออกตราสาร หรือคู่สัญญา

□ การกระจุกตัวในอันดับความน่าเชื่อถือของตราสาร

□ อื่นๆ (โปรดระบุ)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

 \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. กรณีบริษัทมีการทำธุรกรรมตราสารอนุพันธ์นอกตลาด (OTC)

□ มีการประเมินมูลค่าความเสี่ยงด้านเครดิต (credit equivalent amount หรือ potential future credit exposure) ที่เกิดจากการทำธุรกรรมตราสารอนุพันธ์กับคู่สัญญา (counterparty) หรือไม่ ด้วยวิธีการอย่างไร

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ มีการลดความเสี่ยงที่เกิดขึ้นอย่างไร (เช่น มีการกำหนดให้วาง margin)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. บริษัทมีการนำ credit equivalent amount หรือ potential future credit exposure ที่เกิดจาก
การทำธุรกรรมตราสารอนุพันธ์ไปรวมกับวงเงินการลงทุนหรือไม่ อย่างไร

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

* + 1. ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง (Liquidity risk)
1. บริษัทใช้เครื่องมือใดในการวัดค่าและติดตามสภาพคล่องของการลงทุนในหลักทรัพย์

หรือตราสารอนุพันธ์ โปรดระบุรายละเอียด (เช่น turnover ratio, bid-ask spread เป็นต้น)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. บริษัทมีแผนงานเพื่อรองรับหากเกิดปัญหาการขาดสภาพคล่องหรือไม่ อย่างไร

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

* + 1. รายละเอียดโดยย่อของระบบบริหารความเสี่ยงสำหรับการทำธุรกรรม**ในประเทศ**

**(หากมีรายละเอียดแตกต่างไปจากประเภทบัญชีด้านล่าง สามารถปรับปรุงแก้ไขได้)**

| **ประเภทบัญชี** | **Market Risk** | **Credit Risk** | **Liquidity Risk** |
| --- | --- | --- | --- |
| **Directional Trading**  |
| System Trade |  |  |  |
| Day Trading |  |  |  |
| Short Term Trading |  |  |  |
| Long Term Trading |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |
| **Strategic Trading**  |
| Option Trading |  |  |  |
| Index Arbitrage |  |  |  |
| Single Stock Arbitrage |  |  |  |
| Pair Trading |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |
| **Market Making** |
| DW-MM |  |  |  |
| ETF-MM  |  |  |  |
| Futures&Options-MM |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |
| **Product Issuing** |
| DW |  |  |  |
| Structured Notes |  |  |  |
| Options  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |
| **Product Hedging** |
| DW-Hedging |  |  |  |
| Structured Notes-Hedging |  |  |  |
| Options-Hedging |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |

* + 1. รายละเอียดโดยย่อของระบบบริหารความเสี่ยงสำหรับการทำธุรกรรม**ต่างประเทศ**

**(หากมีรายละเอียดแตกต่างไปจากประเภทบัญชีด้านล่าง สามารถปรับปรุงแก้ไขได้)**

| **ประเภทบัญชี** | **Market Risk** | **Credit Risk** | **Liquidity Risk** |
| --- | --- | --- | --- |
| **Directional Trading**  |
| System Trade |  |  |  |
| Day Trading |  |  |  |
| Short Term Trading |  |  |  |
| Long Term Trading |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |
| **Strategic Trading**  |
| Option Trading |  |  |  |
| Index Arbitrage |  |  |  |
| Single Stock Arbitrage |  |  |  |
| Pair Trading |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |

* + 1. วิธีที่บริษัทควบคุมดูแลให้เป็นไปตามเกณฑ์หรือข้อจำกัดการลงทุนที่บริษัทกำหนดและการรายงานผลการตรวจสอบ
1. มีขั้นตอนในการควบคุมดูแลอย่างไรและหน่วยงานใดเป็นผู้รับผิดชอบ รวมถึงความถี่
และการรายงานผลในการตรวจสอบ

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. กรณีที่มีการลงทุนเกินข้อจำกัดที่ควบคุมไว้ ทางบริษัทดำเนินการอย่างไร

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. ในกรณีที่ต้องการมีไว้ซึ่งการลงทุนที่เกินข้อจำกัด บริษัทมีขั้นตอนในการปฏิบัติอย่างไร
และต้องได้รับความเห็นชอบจากผู้ใดหรือไม่

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

* + 1. บริษัทมีการวิเคราะห์เกี่ยวกับอัตราส่วนเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (NC) ในกรณีลงทุน
		เต็มวงเงิน ภายใต้เงื่อนไขและสถานการณ์ของการลงทุนที่แตกต่างกันหรือไม่

□ ใช่ (โปรดระบุเงื่อนไขและสถานการณ์ ผลลัพธ์ที่ได้และแนวทางในการรองรับเหตุการณ์ดังกล่าว)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ ไม่ใช่ (โปรดระบุเหตุผล)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

* 1. **ระบบป้องกันและตรวจสอบการลงทุนเพื่อบริษัทหลักทรัพย์โดยไม่ได้รับอนุญาต (unauthorized proprietary trading)**

บริษัทมีนโยบายและหลักเกณฑ์ในการป้องกันและตรวจสอบการซื้อขายโดยไม่ได้รับอนุญาตอย่างไร

□ มีโครงสร้างของสายการรายงาน (reporting line) และการติดตามตรวจสอบที่ชัดเจนเหมาะสม

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ นโยบายการกำหนดให้หยุดพักผ่อน (mandatory vacation policy)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ มีการตรวจสอบธุรกรรมระหว่างกันที่เกิดจากการซื้อขายของ trader

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ มีการกำหนดลักษณะธุรกรรมสุ่มเสี่ยง (red flags) เพื่อการติดตามตรวจสอบอย่างใกล้ชิด

□ มีการซื้อขายที่เกิน trading limit ที่ได้รับอนุมัติ

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ มีรูปแบบการแก้ไขหรือยกเลิกคำสั่งซื้อขายที่ผิดปกติ

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ ธุรกรรมที่การยืนยันคำสั่งซื้อขายและการชำระราคาไม่เกิดขึ้นตามเวลาที่กำหนด

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ รายงานธุรกรรมคงค้างกระทบยอด (unresolved reconciling items) และรายงานยืนยันคำสั่งซื้อขายที่ยังคงค้าง (outstanding confirmation) ที่มีอายุคงค้างยาวนานผิดปกติ

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ รายงานผลกำไรที่มีลักษณะผิดปกติ (เช่น trader บางคนเคยมีผลกำไรแบบ flat
มาตลอด แต่กลับมีผลตอบแทนที่พุ่งสูงผิดปกติในบางเดือน)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ มีการขอผ่อนผันเกณฑ์การลงทุนและเกณฑ์การควบคุมอย่างต่อเนื่องหรือผิดปกติ

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ มีการส่งคำสั่งซื้อขายในตราสารที่ trader ไม่มีความเชี่ยวชาญ โดยมิได้รับอนุญาต

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ อื่น ๆ (โปรดระบุ)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ การกำหนดและยกเลิกสิทธิ์ในการเข้าถึงระบบ (system access) ในกรณีพนักงานโยกย้าย
ฝ่ายงานและการตรวจสอบการล่วงรู้ข้อมูลการดูแลติดตามความเสี่ยงในกรณีที่พนักงาน
ฝ่ายบริหารความเสี่ยงย้ายฝ่ายงานมาเป็น trader

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

□ อื่น ๆ (โปรดระบุ)

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

* 1. **ระบบควบคุมและตรวจสอบการลงทุนเพื่อบริษัทหลักทรัพย์ ในกรณีที่ใช้ชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์**

**ในการส่งคำสั่งหรือตัดสินใจซื้อขาย (program trading)**

* + 1. โปรดแสดงรายละเอียดของชุดคำสั่งคอมพิวเตอร์ที่บริษัทใช้งาน โดยระบุถึงชื่อชุดคำสั่ง

 วัตถุประสงค์การใช้งาน ลักษณะการทำงานและตัวอย่างการทำงานของชุดคำสั่ง

 (หากมีมากกว่า 1 ชุดคำสั่ง สามารถระบุเพิ่มได้)

**ชื่อชุดคำสั่ง**\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**วัตถุประสงค์**

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

 \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**ลักษณะการทำงาน**

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

 \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**ตัวอย่างการทำงาน**

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

 \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

* + 1. ระบบบริหารความเสี่ยงในการใช้ program trading

□ มีระบบคัดกรองคำสั่งซื้อขายเพื่อป้องกันและตรวจสอบคำสั่งที่อาจส่งผลกระทบ
ต่อสภาพปกติของตลาด (False market)

□ มีระบบป้องกัน/ยกเลิกคำสั่งตามมาตรฐาน Order Screening System
ที่ตลาดหลักทรัพย์กำหนด

□ มีระบบตรวจสอบลักษณะคำสั่งซื้อขายที่อาจไม่เหมาะสม ดังนี้

□ คำสั่งที่ราคา +/- X% จากราคาอ้างอิง (ราคาอ้างอิง เช่น ราคาปิดก่อนหน้า ราคาซื้อขายล่าสุด เป็นต้น)

□ คำสั่งไล่ระดับราคาเปลี่ยนแปลงทุกๆ +/- X% จากราคาอ้างอิง (ราคาอ้างอิง เช่น ราคาของคำสั่งแรก ราคาเสนอซื้อ ราคาเสนอขาย เป็นต้น)

□ คำสั่งซื้อ/ขายหลักทรัพย์หลายรายการในลักษณะเคาะซื้อ/ขาย หรือมีลักษณะกวาด bid/offer เพื่อให้ราคาเปลี่ยนแปลงไปจากสภาพปกติ (เช่น เคาะซื้อหรือกวาด offer X ครั้งและทำให้ราคาเพิ่มขึ้น X% เป็นต้น)

□ คำสั่งที่มีปริมาณมากกว่า X% ของปริมาณการซื้อระหว่างวัน หรือในอดีต

□ คำสั่งที่ซ้ำกันจำนวนมาก เช่น X คำสั่งในช่วงเวลา N วินาที

□ อื่น ๆ โปรดระบุ ............................

□ มีระบบตรวจสอบเพื่อป้องกันความผิดพลาดของระบบ เช่น ความสอดคล้องของหลักทรัพย์ ราคาและปริมาณ การส่งคำสั่งซ้ำ คำสั่งที่มีรูปแบบขัดแย้งกันเอง เป็นต้น

□ มีระบบที่สามารถหยุด/ยกเลิกคำสั่งที่ถูกส่งโดย program trading ทั้งหมด

□ มีบุคลากรที่มีความรู้ความเชี่ยวชาญในด้านการเขียน ปรับปรุงและแก้ไขชุดคำสั่ง
อย่างเพียงพอเพื่อบริหารจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดจากการใช้งานชุดคำสั่ง และเข้าใจ
หลักเกณฑ์ข้อบังคับต่างๆ ที่ออกโดยหน่วยงานกำกับดูแล เช่น ตลาดหลักทรัพย์และ
สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

□ อื่น ๆ โปรดระบุ

 \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

 \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

**ส่วนที่ 4 : การวัดผลการดำเนินงานและการจ่ายผลตอบแทนแก่ trader**

4.1 บริษัทใช้เครื่องมือใดในการวัดประสิทธิภาพและความสามารถของ trader

 □ วัดผลกำไรขาดทุน

 □ วัดผลตอบแทนโดยวิธีปรับค่าความเสี่ยง (risk adjusted return) โดยใช้

 □ Sharpe’s ratio

 □ Treynor’s ratio

 □ Jensen’s alpha

 □ Modigliani risk-adjusted performance (M2)

 □ อื่น ๆ โปรดระบุ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

 □ พิจารณาอัตราส่วนระหว่างจำนวนวันที่มีผลขาดทุนของ trader เทียบกับจำนวนวัน

 ที่หน่วยงานมีผลขาดทุนภายในระยะเวลาที่กำหนด (ระยะเวลาที่ใช้ เช่น 1 ปี )

 □ วิเคราะห์ที่มาความเสี่ยงและผลตอบแทน (risk / return attribution analysis)

1. วิเคราะห์โดยจำแนกตาม

 □ sector allocation □ security allocation

 □ อื่นๆ (โปรดระบุ) \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. Benchmark ที่ใช้

 □ SET Index □ SET 50 Index

 □ อื่นๆ (โปรดระบุ) \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

 □ อื่น ๆ (โปรดระบุ) \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

4.2 หน่วยงานที่ทำหน้าที่วัดผลการดำเนินงาน \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

4.3 ความถี่ในการวัดผล \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

4.4 ผลการดำเนินงานในอดีตสำหรับการทำธุรกรรม**ในประเทศ (หากมีรายละเอียดแตกต่างไปจาก**

 **ประเภทบัญชีด้านล่าง สามารถปรับปรุงแก้ไขได้)**

(หน่วย : ล้านบาท)

| **ประเภท/กำไรขาดทุน** | **ปี 25......** | **ปี 25......** | **ปีล่าสุด (25........)** |
| --- | --- | --- | --- |
| **Q1** | **Q2** | **Q3** | **Q4** |
| **Directional Trading**  |
| System Trade |  |  |  |  |  |  |
| Day Trading |  |  |  |  |  |  |
| Short Term Trading |  |  |  |  |  |  |
| Long Term Trading |  |  |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |
| **Strategic Trading**  |
| Option Trading |  |  |  |  |  |  |
| Index Arbitrage |  |  |  |  |  |  |
| Single Stock Arbitrage |  |  |  |  |  |  |
| Pair Trading |  |  |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |
| **Market Making** |
| DW-MM |  |  |  |  |  |  |
| ETF-MM  |  |  |  |  |  |  |
| Futures&Options-MM |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |
| **Product Issuing** |
| DW |  |  |  |  |  |  |
| Structured Notes |  |  |  |  |  |  |
| Options  |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |
| **Product Hedging** |
| DW-Hedging |  |  |  |  |  |  |
| Structured Notes-Hedging |  |  |  |  |  |  |
| Options-Hedging |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |

4.5 ผลการดำเนินงานในอดีตสำหรับการทำธุรกรรมต่างประเทศ **(หากมีรายละเอียดแตกต่างไปจากประเภทบัญชีด้านล่าง สามารถปรับปรุงแก้ไขได้)**

(หน่วย : ล้านบาท)

| **ประเภท/กำไรขาดทุน** | **ปี 25......** | **ปี 25......** | **ปีล่าสุด (25........)** |
| --- | --- | --- | --- |
| **Q1** | **Q2** | **Q3** | **Q4** |
| **Directional Trading**  |
| System Trade |  |  |  |  |  |  |
| Day Trading |  |  |  |  |  |  |
| Short Term Trading |  |  |  |  |  |  |
| Long Term Trading |  |  |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |
| **Strategic Trading**  |
| Option Trading |  |  |  |  |  |  |
| Index Arbitrage |  |  |  |  |  |  |
| Single Stock Arbitrage |  |  |  |  |  |  |
| Pair Trading |  |  |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |  |  |

4.6 ประเภทการจ่ายผลตอบแทนแก่ trader ที่ทำธุรกรรม**ในประเทศ** **(หากมีรายละเอียดแตกต่างไปจากประเภทบัญชีด้านล่าง สามารถปรับปรุงแก้ไขได้)**

| **ประเภทบัญชี** | **ประเภทการจ่ายผลตอบแทน** |
| --- | --- |
| **Fix salary + Bonus** | **Share profit & loss** | **Share profit only** | **อื่น ๆ (โปรดระบุ)** |
| **Directional Trading** |
| System Trade |  |  |  |  |
| Day Trading |  |  |  |  |
| Short Term Trading |  |  |  |  |
| Long Term Trading |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |
| **Strategic Trading**  |
| Option Trading |  |  |  |  |
| Index Arbitrage |  |  |  |  |
| Single Stock Arbitrage |  |  |  |  |
| Pair Trading |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |
| **Market Making** |
| DW-MM |  |  |  |  |
| ETF-MM  |  |  |  |  |
| Futures&Options-MM |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |
| **Product Hedging** |
| DW-Hedging |  |  |  |  |
| Structured Notes-Hedging |  |  |  |  |
| Options-Hedging |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |

4.7 ประเภทการจ่ายผลตอบแทนแก่ trader ที่ทำธุรกรรม**ต่างประเทศ** **(หากมีรายละเอียดแตกต่างไปจากประเภทบัญชีด้านล่าง สามารถปรับปรุงแก้ไขได้)**

| **ประเภทบัญชี** | **ประเภทการจ่ายผลตอบแทน** |
| --- | --- |
| **Fix salary + Bonus** | **Share profit & loss** | **Share profit only** | **อื่น ๆ (โปรดระบุ)** |
| **Directional Trading** |
| System Trade |  |  |  |  |
| Day Trading |  |  |  |  |
| Short Term Trading |  |  |  |  |
| Long Term Trading |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |
| **Strategic Trading**  |
| Option Trading |  |  |  |  |
| Index Arbitrage |  |  |  |  |
| Single Stock Arbitrage |  |  |  |  |
| Pair Trading |  |  |  |  |
| Commodities |  |  |  |  |
| Corporate Bond Trading |  |  |  |  |
| Government Bond Trading |  |  |  |  |
| อื่น ๆ (โปรดระบุ) |  |  |  |  |

4.8 กรณีที่จ่ายผลตอบแทนแบบ share profit &loss หรือ share profit ให้ตอบข้อมูลต่อไปนี้

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **ประเภทบัญชี** | **% การจ่ายผลตอบแทน (บริษัท : trader)** | **Trader ต้องรับผลขาดทุนสะสม ด้วยหรือไม่** | **รอบเวลาการจ่าย** | **การเรียกหลักประกันเพื่อป้องกันความเสียหาย**  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |

**ส่วนที่ 5 : การป้องกันการล่วงรู้ข้อมูลภายใน (Chinese wall) และการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์ (conflict of interests)**

5.1 โปรดทำเครื่องหมาย (สามารถเขียนอธิบายเพิ่มเติมเกี่ยวกับแนวทางที่บริษัทปฏิบัติในแต่ละเรื่องได้)

| **ใช่** | **ไม่ใช่** | **นโยบาย /หลักเกณฑ์/แนวทางหรือวิธีการปฏิบัติงาน** |
| --- | --- | --- |
|  |  | มีการแบ่งแยกหน่วยงานและบุคลากรที่ซื้อขายเพื่อบริษัทหลักทรัพย์ออกจากหน่วยงานและบุคลากรของหน่วยงานอื่นอย่างชัดเจน (ให้แนบรายชื่อ trader และหัวหน้า trader (ถ้ามี) พร้อมเลขที่บัญชีที่รับผิดชอบ) |
|  |  | คณะกรรมการการลงทุนไม่ได้เป็นผู้ตัดสินใจซื้อขายเพื่อบริษัทหลักทรัพย์ แต่หากมีอำนาจดังกล่าว โครงสร้างคณะกรรมการการลงทุนไม่ได้ประกอบด้วยบุคคลมีอาจก่อให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์ เช่น บุคลากรจากฝ่าย IB ฝ่ายวิเคราะห์หลักทรัพย์ ฝ่ายค้าหลักทรัพย์ที่ดูแลการซื้อขายของลูกค้า |
|  |  | มีการจัดพื้นที่ trade เพื่อบริษัทหลักทรัพย์ ให้อยู่ในพื้นที่เป็นสัดส่วนต่างหากจากหน่วยงานอื่นโดยอยู่ในห้อง trade เฉพาะเพื่อบริษัทหลักทรัพย์ |
|  |  | มีการใช้รหัสในการเข้า-ออกห้องค้าหลักทรัพย์ และห้องค้าอนุพันธ์ |
|  |  | Trader และหัวหน้า trader เพื่อบริษัทหลักทรัพย์ไม่มีสิทธิ์หรือสามารถเข้าถึงข้อมูลการซื้อขายของลูกค้า ข้อมูลงานด้าน IB และข้อมูลการวิเคราะห์หลักทรัพย์ที่ยังไม่เผยแพร่ให้ลูกค้า |
|  |  | มีการขึ้น watch list / restricted list และ research list ซึ่งตรวจสอบดูแลโดยหน่วยงาน compliance  |
|  |  | มีระเบียบ/หลักเกณฑ์กำหนดห้ามนำข้อมูลภายในไปใช้ประโยชน์ และห้ามบัญชีบริษัทเอาเปรียบลูกค้า |
|  |  | มีระเบียบ/หลักเกณฑ์เกี่ยวกับการซื้อขายของพนักงานเกณฑ์ ครอบคลุมถึงบุคคลใดบ้าง โปรดระบุ( ) คู่สมรส และบุตรที่ยังไม่บรรลุนิติภาวะ ( ) กรรมการที่ปฏิบัติงานในลักษณะ day to day ( ) อื่น ๆ ระบุ |

5.2 ในกรณีที่ระบุว่าไม่ใช่ โปรดอธิบายเพิ่มเติมว่าบริษัทท่านมีมาตรการอื่นใดที่ใช้ทดแทน

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

5.3 การควบคุมดูแลการส่งคำสั่งซื้อขายหรือพฤติกรรมที่ไม่เหมาะสมของบัญชีบริษัท

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **ระเบียบ/หลักเกณฑ์ที่บริษัทกำหนด** | **มาตรการป้องกันหรือตรวจสอบดูแลให้เป็นไปตามระเบียบ/เกณฑ์ของบริษัท** | **ความถี่ในการตรวจสอบ** |
| การส่งคำสั่งที่ไม่เหมาะสมที่ SET กำหนด( ) ลัดคิวและปิดบังคำสั่ง( ) ใส่-ถอน( ) จับคู่กันเอง (matching /wash sale)( ) ผลักดันราคา( ) แตกย่อยคำสั่งซื้อขาย |  |  |
| การ front run ลูกค้า |  |  |
| การ churning  |  |  |

**ส่วนที่ 6 : ผลการตรวจสอบของ compliance และ internal audit**

ให้แสดงว่าในรอบ 1 ปีที่ผ่านมามีการตรวจสอบเกี่ยวกับการลงทุนในหลักทรัพย์/อนุพันธ์ในเรื่องใด

และพบประเด็นหรือข้อสังเกตอะไร และบริษัทดำเนินการอย่างไรต่อประเด็นหรือข้อสังเกตที่ตรวจพบ

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. ฐานะการลงทุน (exposure) หมายถึงมูลค่าการลงทุนที่เป็นมูลค่า ณ ปัจจุบันของสินทรัพย์ในกรณีลงทุนโดยตรง (เช่น การซื้อตราสารทุน/หนี้) หรือมูลค่า ณ ปัจจุบันของสินทรัพย์อ้างอิงที่ระบุตามสัญญาในกรณีลงทุนโดยทางอ้อม (เช่น การลงทุนในตราสารอนุพันธ์ที่ผลตอบแทนอ้างอิงกับสินทรัพย์อื่น) ซึ่งบริษัทหลักทรัพย์ถือครองอยู่ [↑](#footnote-ref-1)