

23 ธันวาคม 2556

เรียน ผู้จัดการ

บริษัทหลักทรัพย์ทุกแห่ง

ที่ กสท.กธ.(ว) 4๖ /2556 เรื่อง จัดส่งแบบประเมินตนเองด้านระบบงาน
สำหรับการลงทุนเพื่อบริษัทหลักทรัพย์

ตามที่สำนักงาน ได้มีหนังสือเวียนที่ กสท.กธ.(ว) 15/2556 เรื่อง จัดส่งแบบประเมินตนเองด้านระบบงานสำหรับการลงทุนเพื่อบริษัทหลักทรัพย์ ลงวันที่ 18 มีนาคม 2556 เพื่อขอให้บริษัทหลักทรัพย์ทำการประเมินความเสี่ยงในการลงทุนของบริษัทเป็นประจำทุกปีโดยใช้แบบประเมินตนเองด้านระบบงานสำหรับการลงทุนเพื่อบริษัทหลักทรัพย์ (Self-Assessment Questionnaire – “SAQ”) และส่งแบบประเมินดังกล่าวให้สำนักงานภายในวันที่ 31 มกราคมของปีถัดไป นั้น

สำนักงาน ได้พิจารณาข้อมูลที่ได้จาก SAQ ตามรอบปี 2555 แล้วพบว่า มีปัญหาความไม่ถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลอันเกิดจากความเข้าใจผิดหรือความไม่เข้าใจในคำถามตามที่ปรากฏใน SAQ ของผู้กรอก เนื่องจากปริมาณคำถามมีค่อนข้างมาก และอ้างอิงจากระบบงานของธุรกิจจัดการลงทุนเป็นส่วนใหญ่ โดยเฉพาะในส่วนของระบบการลงทุนและเครื่องมือที่ใช้ในการบริหารความเสี่ยงจากการลงทุน ซึ่งลักษณะการจัดการลงทุนและบริหารความเสี่ยงของบริษัทหลักทรัพย์มีความแตกต่างกันในรายละเอียด นอกจากนี้สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (“สมาคมฯ”) ได้ปรับปรุงประกาศสมาคมฯ เกี่ยวกับหลักเกณฑ์ และวิธีการเกี่ยวกับการลงทุนในหลักทรัพย์เพื่อบริษัท (proprietary trading) (“ประกาศ prop trade”) โดยเพิ่มหลักเกณฑ์การควบคุมการลงทุนในบัญชีประเภท day trade ซึ่งมีผลใช้บังคับเมื่อวันที่ 1 พฤศจิกายน 2556 แต่เนื้อหาคำถามใน SAQ ดังกล่าว ยังไม่ครอบคลุมในประเด็นสำคัญโดยเฉพาะที่เกี่ยวข้องกับบัญชีประเภท day trade

สำนักงานจึงได้ปรับปรุง SAQ โดยลดความซับซ้อนของคำถามให้ง่ายต่อการกรอกข้อมูล และสอดคล้องกับลักษณะการจัดการลงทุนและบริหารความเสี่ยงของบริษัทหลักทรัพย์ รวมทั้งให้ครอบคลุมเนื้อหาและหลักการตามประกาศ prop trade เพื่อให้บริษัทหลักทรัพย์สามารถใช้ในการประเมินระบบงานเพื่อควบคุมดูแลการจัดการลงทุนและการบริหารความเสี่ยงได้อย่างเหมาะสมยิ่งขึ้น สำนักงานจึงขอยกเลิก SAQ ตามหนังสือเวียนที่ กสท.กธ.(ว) 15/2556 และขอให้บริษัทหลักทรัพย์ใช้ SAQ ฉบับปรับปรุงตามที่แนบมาพร้อมนี้ ทำการประเมินตนเองเป็นประจำทุกปีโดยใช้ข้อมูลสิ้นสุดในวันทำการสุดท้ายของ

เดือนธันวาคม และส่งแบบประเมินดังกล่าวให้สำนักงานภายในวันที่ 31 มกราคมของปีถัดไป
หรือเมื่อมีการเปลี่ยนแปลงของข้อมูลอย่างมีนัยสำคัญ โดยเริ่มตั้งแต่การประเมินตนเองประจำปี 2556 เป็นต้นไป

ในการนี้ สำนักงานขอเสนอชื่อเจ้าหน้าที่สำหรับการติดต่อสอบถาม คือ นายเก่งกาจ
อัมสัมฤทธิ์ โทรศัพท์ 0-2695-9929

จึงเรียนมาเพื่อ โปรดทราบและดำเนินการต่อไป

ขอแสดงความนับถือ



(นายวรพล โสคติยานุรักษ์)

เลขาธิการ

สิ่งที่ส่งมาด้วย แบบประเมินตนเอง (Self – Assessment Questionnaire หรือ SAQ) ด้านระบบงาน
สำหรับการลงทุนเพื่อบริษัทหลักทรัพย์

ฝ่ายกำกับและพัฒนารูรกิจหลักทรัพย์

โทรศัพท์ 0-2695-9929

โทรสาร 0-2695-9930