

**กฎบัตรคณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง
(Risk Management Committee Charter)**

สารบัญ

1. วัตถุประสงค์	หน้า 3
2. คำจำกัดความ	หน้า 3
3. องค์ประกอบและวาระการดำรงตำแหน่ง	หน้า 4
4. การประชุม	หน้า 5
5. หน้าที่และความรับผิดชอบ	หน้า 6
6. การประเมินผลการปฏิบัติหน้าที่ของตนเอง	หน้า 7
7. การทบทวนกฎบัตร	หน้า 7
8. การรายงาน	หน้า 7

1. วัตถุประสงค์

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ) จัดตั้ง คณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง เพื่อทำหน้าที่ในการกำกับดูแลงานด้านการบริหารความเสี่ยงของ กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ในเรื่องดังต่อไปนี้

- 1.1 กลั่นกรองและให้ความเห็นแก่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ และฝ่ายบริหารเพื่อให้ มีการกำหนดนโยบายการบริหารความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ เช่น นโยบายการบริหารความเสี่ยงองค์กร (ERM Policy) นโยบายความปลอดภัย เทคโนโลยีสารสนเทศ (IT Security Policy) และนโยบายการบริหารความเสี่ยงด้าน เทคโนโลยีสารสนเทศ (IT Risk Management Policy) เป็นต้น เพื่อให้มั่นใจว่า หน่วยงานต่าง ๆ ภายในกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ สามารถดำเนินการบริหารความเสี่ยง ได้อย่างมีประสิทธิภาพ และครอบคลุมความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินธุรกิจของ องค์กร อาทิ ความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ ความมั่นคงปลอดภัยทางไซเบอร์ ความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงาน และความเสี่ยงทางการเงินและการลงทุน
- 1.2 ให้คำปรึกษาและข้อเสนอแนะแก่ฝ่ายบริหารความเสี่ยงในเรื่องเกี่ยวกับการบริหาร ความเสี่ยงทุกประเภท
- 1.3 พิจารณาความเหมาะสมของการประเมินและมาตรการจัดการความเสี่ยง เพื่อให้มั่นใจได้ ว่าความเสี่ยงที่สำคัญได้รับการดูแลและจัดการอย่างเหมาะสม

2. คำจำกัดความ

- “กฎบัตร” หมายถึง กฎบัตรคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง
- “ตลาดหลักทรัพย์ฯ” หมายถึง ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- “บริษัทย่อย” หมายถึง บริษัทหรือนิติบุคคลที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยถือหุ้นเกิน กว่าร้อยละ 50 ไม่ว่าจะถือโดยตรงหรือโดยอ้อม
- “กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ” หมายถึง ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและบริษัทย่อย
- “คณะอนุกรรมการ” หมายถึง คณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง
- “ฝ่ายจัดการ” หมายถึง ผู้บริหารที่ดำรงตำแหน่งในระดับผู้อำนวยการฝ่ายหรือเทียบเท่า ขึ้นไป

3. องค์ประกอบ และวาระการดำรงตำแหน่ง

- 3.1 คณะกรรมการ และประธานกรรมการได้รับการแต่งตั้งโดยคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ
- 3.2 คณะกรรมการ ประกอบด้วยกรรมการจำนวนไม่น้อยกว่า 5 ท่าน แต่ไม่เกิน 9 ท่าน โดยมีองค์ประกอบ ดังนี้
 - (1) กรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ไม่น้อยกว่า 2 ท่าน
 - (2) กรรมการและผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ และ
 - (3) ผู้เชี่ยวชาญด้านการเงิน บัญชี การบริหารความเสี่ยง หรือเทคโนโลยีสารสนเทศ ไม่น้อยกว่า 2 ท่าน โดยอย่างน้อย 1 ท่านต้องเป็นผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ และ 1 ท่าน ต้องเป็นผู้มีความรู้ความเชี่ยวชาญด้านการบริหารความเสี่ยง
- 3.3 อนุกรรมการมีวาระการดำรงตำแหน่ง ดังต่อไปนี้
 - (1) อนุกรรมการที่เป็นกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ หรือกรรมการและผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ จะขึ้นไปตามวาระการดำรงตำแหน่งของกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ หรือกรรมการและผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ แล้วแต่กรณี
 - (2) อนุกรรมการที่เป็นบุคคลภายนอก ซึ่งมีได้เป็นกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้มีวาระการดำรงตำแหน่งคราวละ 3 ปี และเมื่อพ้นจากตำแหน่งแล้ว อาจได้รับแต่งตั้งอีกได้ แต่จะแต่งตั้งให้ดำรงตำแหน่งติดต่อกันเกิน 2 วาระมิได้ เว้นแต่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ จะพิจารณาแล้วเห็นว่ามีความจำเป็นที่จะต้องดำรงตำแหน่งเกินกว่านั้น อาจให้ดำรงตำแหน่งต่อได้อีก 1 วาระ แต่อย่างไรก็ดี วาระการดำรงตำแหน่งต่อเนื่องจะต้องไม่เกิน 9 ปี และเมื่อครบวาระการดำรงตำแหน่งดังกล่าวแล้ว จะต้องเว้นวาระการดำรงตำแหน่งอย่างน้อย 1 ปี จึงจะสามารถได้รับการแต่งตั้งให้ดำรงตำแหน่งอีกได้
- 3.4 เมื่ออนุกรรมการครบวาระการดำรงตำแหน่ง หรือมีเหตุใดที่ทำให้ไม่สามารถอยู่ได้จนครบวาระ คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ อาจพิจารณาแต่งตั้งอนุกรรมการท่านใหม่แทนได้ตามที่เห็นสมควร เพื่อให้เกิดความต่อเนื่องในการดำเนินงาน เว้นแต่วาระของอนุกรรมการจะเหลือน้อยกว่าสองเดือน ให้อนุกรรมการที่เหลืออยู่ปฏิบัติหน้าที่ต่อไปได้ โดยยังไม่ต้องแต่งตั้งอนุกรรมการทดแทน ทั้งนี้ บุคคลที่ได้รับการแต่งตั้งให้ดำรงตำแหน่งแทนจะอยู่ในตำแหน่งได้เพียงเท่าวาระที่ยังเหลืออยู่ของอนุกรรมการที่ตนแทน
- 3.5 ให้หัวหน้าสายงานที่ดูแลงานด้านบริหารความเสี่ยงเป็นเลขานุการคณะกรรมการ

- 3.6 ทุกครั้งที่มีการแต่งตั้งอนุกรรมการใหม่ ให้เลขานุการคณะกรรมการจัดให้มีเอกสารและข้อมูลที่เป็นประโยชน์ต่อการปฏิบัติหน้าที่ของอนุกรรมการใหม่ รวมถึงการแนะนำลักษณะและแนวทางการดำเนินงานในเรื่องที่เกี่ยวข้องกับบทบาทหน้าที่ของคณะกรรมการ (Orientation) ให้แก่อนุกรรมการใหม่ด้วย

4. การประชุม

- 4.1 คณะอนุกรรมการประชุมอย่างน้อยไตรมาสละ 1 ครั้ง หรืออย่างน้อยปีละ 4 ครั้ง ทั้งนี้ ประธานอนุกรรมการอาจเรียกประชุมเพิ่มเติมเป็นการพิเศษได้ตามที่เห็นสมควร หรือมีการร้องขอจากอนุกรรมการเป็นจำนวนไม่น้อยกว่ากึ่งหนึ่ง
- 4.2 การประชุมคณะอนุกรรมการได้กำหนดวันและเวลาไว้ล่วงหน้าตลอดทั้งปี เพื่อให้คณะอนุกรรมการสามารถจัดสรรเวลาเข้าประชุมได้ทุกครั้ง
- 4.3 องค์ประชุมประกอบด้วยอนุกรรมการไม่น้อยกว่ากึ่งหนึ่งของจำนวนอนุกรรมการทั้งหมด จึงจะถือเป็นองค์ประชุม
- 4.4 ในกรณีที่ประธานอนุกรรมการไม่ได้เข้าร่วมประชุม ให้อนุกรรมการที่เข้าประชุมเลือกอนุกรรมการท่านใดท่านหนึ่งเป็นประธานในที่ประชุม
- 4.5 คณะอนุกรรมการอาจเชิญผู้ที่เกี่ยวข้องหรือผู้ที่เห็นสมควรเข้าร่วมประชุม หรือขอให้ชี้แจงในเรื่องที่เกี่ยวข้องได้
- 4.6 คณะอนุกรรมการอาจเชิญบุคคลภายนอกที่มีความรู้ความเชี่ยวชาญเป็นที่ปรึกษา และเข้าร่วมประชุมได้ด้วยค่าใช้จ่ายของตลาดหลักทรัพย์ฯ
- 4.7 คณะอนุกรรมการมีการประชุมร่วมกับคณะกรรมการตรวจสอบ เป็นประจำทุกปี
- 4.8 เลขานุการคณะกรรมการมีหน้าที่นัดหมายการประชุม จัดเตรียมวาระการประชุม นำส่งเอกสารประกอบการประชุม และบันทึกการรายงานการประชุม ทั้งนี้ หนังสือเชิญประชุม และเอกสารประกอบการประชุมให้นำส่งล่วงหน้า 7 วันก่อนการประชุม เว้นแต่ในกรณีจำเป็นรีบด่วน เลขานุการจะแจ้งการประชุมโดยวิธีอื่นและอาจนำส่งเอกสารประกอบการประชุมล่วงหน้าน้อยกว่า 7 วันก่อนการประชุม
- 4.9 ในกรณีที่ต้องมีการลงมติออกเสียง ให้ใช้เสียงข้างมาก กรณีที่มีคะแนนเสียงเท่ากัน ให้ประธานอนุกรรมการมีสิทธิลงคะแนน อีกเสียงหนึ่งเป็นเสียงชี้ขาด
- 4.10 อนุกรรมการผู้ใดมีส่วนได้เสียในเรื่องที่พิจารณา ให้แจ้งการมีส่วนได้เสียนั้นและห้ามมิให้เข้าร่วมพิจารณาในเรื่องนั้น

5. หน้าที่ และความรับผิดชอบ

คณะกรรมการมีหน้าที่และความรับผิดชอบที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ในเรื่องต่าง ๆ ดังต่อไปนี้

- 5.1 พิจารณาและให้ความเห็นต่อนโยบายบริหารความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ เช่น นโยบายการบริหารความเสี่ยงองค์กร (ERM Policy) นโยบายความปลอดภัยเทคโนโลยีสารสนเทศ (IT Security Policy) และนโยบายการบริหารความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ (IT Risk Management Policy) เป็นต้น เพื่อนำเสนอต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ พิจารณาให้ความเห็นและอนุมัติ
- 5.2 พิจารณาและให้ความเห็นในการกำหนดระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (Risk Appetite) และความเปราะบางของระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ขององค์กร (Risk Tolerance) ของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อนำเสนอต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ พิจารณาให้ความเห็นและอนุมัติเพื่อใช้เป็นกรอบในการจัดทำ Risk Appetite และ Risk Tolerance ของบริษัทย่อยต่อไป
- 5.3 รับทราบ พิจารณา และให้ความเห็นในผลการประเมินความเสี่ยง แนวทาง และมาตรการจัดการความเสี่ยง และแผนปฏิบัติการเพื่อจัดการความเสี่ยงให้อยู่ในระดับที่ยอมรับได้ ครอบคลุมความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ ความมั่นคงปลอดภัยทางไซเบอร์ ความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงาน ความเสี่ยงทางการเงินและการลงทุน ความเสี่ยงด้าน ESG (Environment, Social and Governance) และ Emerging risk ของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ
- 5.4 ติดตามแผนการดำเนินงานเพื่อบริหารจัดการความเสี่ยงอย่างต่อเนื่อง
- 5.5 ให้คำแนะนำ ในเรื่องการบริหารความเสี่ยงระดับองค์กร รวมถึงส่งเสริมและสนับสนุนให้มีการปรับปรุง และพัฒนาระบบการบริหารความเสี่ยงภายในองค์กรอย่างต่อเนื่อง
- 5.6 รายงานสถานะความเสี่ยงที่สำคัญ รวมถึงการดำเนินการด้านการบริหารความเสี่ยงต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อรับทราบเป็นประจำ
- 5.7 พิจารณาให้ความเห็นการทบทวนการจัดทำประกันภัยกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ
- 5.8 ปฏิบัติหน้าที่อื่นใดตามที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ มอบหมายภายใต้ขอบเขตของงานที่เกี่ยวข้อง

6. การประเมินผลการปฏิบัติหน้าที่ของตนเอง

คณะกรรมการประเมินผลการปฏิบัติหน้าที่ของตนเอง (Self-assessment) และรายงานคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อทราบปีละครั้ง

7. การทบทวนกฎบัตร

คณะอนุกรรมการจะสอบทานและประเมินความเพียงพอและทบทวนความเหมาะสมของกฎบัตรของคณะอนุกรรมการเป็นประจำทุกปี และนำเสนอคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อพิจารณาให้ความเห็นชอบต่อไป

8. การรายงาน

- 8.1 ให้มีการรายงานการดำเนินงานของคณะอนุกรรมการ ต่อที่ประชุมคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นประจำ
- 8.2 ให้จัดทำรายงานผลการปฏิบัติงานของคณะอนุกรรมการ ซึ่งลงนามโดยประธานอนุกรรมการ เพื่อเปิดเผยในรายงานประจำปี ตามหลักการการกำกับดูแลกิจการที่ดี

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

อนุมัติในวันที่ 22 มกราคม 2567