

**กฎบัตรคณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง
(Risk Management Committee Charter)**

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

1 วัตถุประสงค์

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ จัดตั้งคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงเพื่อทำหน้าที่ดังต่อไปนี้

- 1.1 กลั่นกรองและให้ความเห็นแก่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ และฝ่ายบริหารเพื่อให้มีการกำหนดนโยบายและกรอบการบริหารความเสี่ยงอย่างเหมาะสม และเพื่อให้มั่นใจว่าหน่วยงานต่าง ๆ สามารถดำเนินการบริหารความเสี่ยงได้อย่างมีประสิทธิภาพ และครอบคลุมความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินธุรกิจขององค์กรอย่างครบถ้วน
- 1.2 ให้คำปรึกษาและข้อเสนอแนะแก่ฝ่ายบริหารความเสี่ยงในเรื่องเกี่ยวกับการบริหารความเสี่ยงทุกประเภท
- 1.3 พิจารณาความเหมาะสมของการประเมินความเสี่ยง เพื่อให้มั่นใจได้ว่าความเสี่ยงที่สำคัญได้รับการดูแลและจัดการอย่างเหมาะสม

2 คำจำกัดความ

- “กฎบัตร” หมายถึง กฎบัตรคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง
- “ตลาดหลักทรัพย์ฯ” หมายถึง ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และบริษัทย่อย
- “คณะกรรมการ” หมายถึง คณะกรรมการบริหารความเสี่ยง
- “ผู้บริหารระดับสูง” หมายถึง ผู้บริหารที่ดำรงตำแหน่งในระดับรองผู้จัดการ และผู้ช่วยผู้จัดการของตลาดหลักทรัพย์ฯ

3 องค์กรประกอบ และวาระการดำรงตำแหน่ง

- 3.1 คณะกรรมการบริหารความเสี่ยง และประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง ได้รับการแต่งตั้งโดยคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ
- 3.2 คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงประกอบด้วยกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ 4 ท่าน (รวมกรรมการและผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ) และผู้เชี่ยวชาญด้านการเงิน บัญชี หรือการบริหารความเสี่ยง อย่างน้อย 2 ท่าน
- 3.3 อนุกรรมการบริหารความเสี่ยงมีวาระการดำรงตำแหน่ง 1 ปี

- 3.4 เมื่อคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงครบวาระการดำรงตำแหน่ง หรือมีเหตุใดที่ทำให้ไม่สามารถอยู่ได้จนครบวาระ คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ ย่อมเห็นเป็นการสมควรที่จะพิจารณาแต่งตั้งคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงท่านใหม่ให้ครบถ้วนในทันที หรืออย่างช้าภายใน 3 เดือน นับแต่วันที่จำนวนสมาชิกไม่ครบถ้วน เพื่อให้เกิดความต่อเนื่องในการดำเนินงาน ทั้งนี้ บุคคลที่ได้รับการแต่งตั้งให้ดำรงตำแหน่งแทน อยู่ในตำแหน่งได้เพียงเท่าวาระที่ยังเหลืออยู่ของคณะกรรมการที่ตนแทน
- 3.5 คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงเป็นผู้พิจารณาแต่งตั้งเลขานุการคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง

4. การประชุม

- 4.1 คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงประชุมอย่างน้อยไตรมาสละ 1 ครั้ง หรือปีละ 4 ครั้ง โดยคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงสามารถเชิญบุคคลใดๆ ที่ไม่ใช่คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงเข้าร่วมการประชุมก็ได้
- 4.2 องค์กรประชุมประกอบด้วยกรรมการไม่น้อยกว่ากึ่งหนึ่งของจำนวนกรรมการทั้งหมด จึงถือเป็นองค์ประชุม
- 4.3 ในกรณีที่ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงไม่ได้เข้าร่วมประชุมและไม่ได้มีการแต่งตั้งรักษาการประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง อนุกรรมการบริหารความเสี่ยงที่เข้าร่วมประชุมในครั้งนั้นจะเลือกกรรมการท่านใดท่านหนึ่งเป็นประธานในที่ประชุม
- 4.4 ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงอาจเรียกประชุมคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงได้เป็นกรณีพิเศษ หากมีการร้องขอจากอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง เพื่อพิจารณาประเด็นความเสี่ยงองค์กรที่สำคัญเพิ่มเติมที่จำเป็นต้องหารือร่วมกัน
- 4.5 คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงอาจเชิญบุคคลที่รับผิดชอบหรือเกี่ยวข้องกับเรื่องที่อยู่ในวาระการประชุมเข้าร่วมประชุม หรือนำเสนอข้อมูลได้
- 4.6 คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงมีการประชุมร่วมกับคณะกรรมการตรวจสอบ เป็นประจำทุกปี
- 4.7 การประชุมคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงได้กำหนดวันและเวลาไว้ล่วงหน้าตลอดทั้งปี เพื่อให้กรรมการสามารถจัดสรรเวลาเข้าประชุมได้ทุกครั้ง โดยประธานอนุกรรมการอาจเรียกประชุมวาระพิเศษเพิ่มเติมได้ตามความจำเป็น
- 4.8 เลขานุการคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงมีหน้าที่นัดหมายการประชุม จัดเตรียมวาระการประชุม นำส่งเอกสารประกอบการประชุม และบันทึกรายงานการประชุม ทั้งนี้ หนังสือเชิญประชุม และเอกสารประกอบการประชุมให้นำส่งล่วงหน้า 7 วันก่อนการประชุม

- 4.9 ในกรณีที่ต้องมีการลงมติออกเสียง ให้ใช้เสียงข้างมาก และเลขานุการคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงไม่มีสิทธิออกเสียง กรณีที่มีคะแนนเสียงเท่ากัน ให้ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงมีสิทธิลงคะแนน อีกเสียงหนึ่งเป็นเสียงชี้ขาด
- 4.10 อนุกรรมการผู้ใดมีส่วนได้เสียในเรื่องที่พิจารณา ให้แจ้งการมีส่วนได้เสียนั้นและห้ามมิให้เข้าร่วมพิจารณาในเรื่องนั้น

5. หน้าที่ และความรับผิดชอบ

- 5.1 พิจารณาและให้ความเห็นต่อนโยบาย และกรอบการบริหารความเสี่ยงองค์กร เพื่อนำเสนอต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ พิจารณาให้ความเห็นและอนุมัติ
- 5.2 พิจารณาและให้ความเห็นในการกำหนดระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (Risk Appetite) และความเบี่ยงเบนของระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ขององค์กร (Risk Tolerance) เพื่อนำเสนอต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ พิจารณาให้ความเห็นและอนุมัติ
- 5.3 รับทราบ พิจารณา และให้ความเห็นในผลการประเมินความเสี่ยง แนวทาง และมาตรการจัดการความเสี่ยง และแผนปฏิบัติการเพื่อจัดการความเสี่ยงให้อยู่ในระดับที่ยอมรับได้
- 5.4 ติดตามแผนการดำเนินงานเพื่อบริหารจัดการความเสี่ยงอย่างต่อเนื่อง
- 5.5 ให้คำแนะนำ ในเรื่องการบริหารความเสี่ยงระดับองค์กร รวมถึงส่งเสริมและสนับสนุนให้มีการปรับปรุง และพัฒนาระบบการบริหารความเสี่ยงภายในองค์กรอย่างต่อเนื่อง
- 5.6 รายงานสถานะความเสี่ยงที่สำคัญขององค์กร รวมถึงการดำเนินการด้านการบริหารความเสี่ยงต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อรับทราบเป็นประจำ
- 5.7 ให้ความเห็นและขอเสนอแนะในการใช้บริการจากบุคคลภายนอกเพื่อให้คำปรึกษาแนะนำที่เป็นอิสระเกี่ยวกับการบริหารจัดการความเสี่ยงให้แก่ฝ่ายบริหารความเสี่ยง หรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง
- 5.8 พิจารณากลับกรองเบื้องต้น ในการแต่งตั้งผู้เชี่ยวชาญด้านการบริหารความเสี่ยง กรณีที่ไม่มีคณะกรรมการที่เกี่ยวข้อง ก่อนนำเสนอต่อที่ประชุมคณะกรรมการสรรหาและพิจารณาคำตอบแทน (NRC) เพื่อพิจารณาให้ความเห็นชอบ

6. การประเมินผลการปฏิบัติงานของตนเอง (Self-Assessment)

คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงประเมินผลการปฏิบัติงานของตนเอง (Self-assessment) และรายงานให้คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ทราบปีละครั้ง

7. การพัฒนาตนเอง (Self-Development)

- 7.1 คณะกรรมการควรพัฒนาตนเองอย่างต่อเนื่องเพื่อให้พร้อมต่อการปฏิบัติหน้าที่ โดยอาจดำเนินการในรูปแบบต่างๆ เช่น การสัมมนา ฝึกอบรม การบรรยาย การศึกษาด้วยตนเอง การนำไปปฏิบัติ รวมถึงกรณีที่ฝ่ายจัดการจะนำเสนอเรื่องการดูงานองค์กรอื่น ให้คณะกรรมการพิจารณา เป็นต้น
- 7.2 ทุกครั้งที่มีการแต่งตั้งอนุกรรมการใหม่ ให้เลขานุการคณะกรรมการจัดให้มีเอกสารและข้อมูลที่เป็นประโยชน์ต่อการปฏิบัติหน้าที่ของอนุกรรมการใหม่ด้วย

8. การทบทวนกฎบัตร

คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงจะสอบทานและประเมินความเพียงพอและทบทวนความเหมาะสมของกฎบัตรเป็นประจำทุกปี และหากมีการปรับปรุงอย่างมีนัยสำคัญจะต้องได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

9. การรายงาน

- 9.1 ประธานอนุกรรมการบริหารความเสี่ยงเป็นผู้รายงานการดำเนินงานของคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงต่อที่ประชุมคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นประจำ
- 9.2 จัดทำรายงานผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการ ซึ่งลงนามโดยประธานอนุกรรมการ เพื่อเปิดเผยในรายงานประจำปี ตามหลักการการกำกับดูแลกิจการที่ดี

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

อนุมัติเมื่อวันที่ 21 กุมภาพันธ์ 2561

ทบทวนทุกปี ครั้งล่าสุด เมื่อวันที่ 21 กุมภาพันธ์ 2561

เอกสารแนบ

กรอบในการพิจารณา Acceptance Zone และ Rejection Zone ของความเสี่ยงขององค์กร

Impact

5					
4					
3					
2					
1					
	1	2	3	4	5

Likelihood

ระดับความเสี่ยงในระดับที่ยอมรับได้ (Risk Appetite) คือ ระดับความเสี่ยงที่ ตลท. ยอมรับได้ เมื่อเกิดเหตุการณ์ความเสียหายขึ้นแล้ว ซึ่งเป็นปัจจัยที่สำคัญในการประเมินทางเลือกในการดำเนินธุรกิจและกำหนดกลยุทธ์ของ ตลท. ที่ยังสามารถดำเนินธุรกิจ เพื่อบรรลุเป้าหมายหรือวัตถุประสงค์ที่วางไว้ โดยเป็นระดับความเสี่ยงตั้งแต่โซนสีเหลืองลงมา หรือเทียบเคียงกับ Corporate KPI Level 3 ตามที่ได้รับอนุมัติจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

ช่วงเบี่ยงเบนของความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (Risk Tolerance) เป็นช่วงของค่าของความเสี่ยงที่กำหนดขึ้นจากระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ของ ตลท. เพื่อประกอบการพิจารณาว่า ตลท. สามารถยอมรับความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ได้ในระดับใด และตัดสินใจในการตอบสนองต่อความเสี่ยง โดยเทียบเคียงกับ Corporate KPI Level 1 ตามที่ได้รับอนุมัติจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ