

**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 5
6. การประเมินผลการปฏิบัติหน้าที่ของตนเอง	หน้า 6
7. การทบทวนกฎบัตร	หน้า 6
8. การรายงาน	หน้า 7

## 1. วัตถุประสงค์

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ) จัดตั้ง คณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง เพื่อทำหน้าที่ดังต่อไปนี้

- 1.1 กลั่นกรองและให้ความเห็นแก่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ และฝ่ายบริหารเพื่อให้มีการกำหนดนโยบายและกรอบการบริหารความเสี่ยงอย่างเหมาะสม ครอบคลุมถึงนโยบายการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบสารสนเทศและความมั่นคงปลอดภัยทางไซเบอร์ (IT Security and Cyber Security) และเพื่อให้มั่นใจว่าหน่วยงานต่าง ๆ สามารถดำเนินการบริหารความเสี่ยงได้อย่างมีประสิทธิภาพ และครอบคลุมความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินธุรกิจขององค์กร อาทิ ความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ ความมั่นคงปลอดภัยทางไซเบอร์ ความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงาน และความเสี่ยงทางการเงินและการลงทุน
- 1.2 ให้คำปรึกษาและข้อเสนอแนะแก่ฝ่ายบริหารความเสี่ยงในเรื่องเกี่ยวกับการบริหารความเสี่ยงทุกประเภท
- 1.3 พิจารณาความเหมาะสมของการประเมินและมาตรการจัดการความเสี่ยง เพื่อให้มั่นใจได้ว่าความเสี่ยงที่สำคัญได้รับการดูแลและจัดการอย่างเหมาะสม

## 2. คำจำกัดความ

- “กฎบัตร” หมายถึง กฎบัตรคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง
- “ตลาดหลักทรัพย์ฯ” หมายถึง ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- “บริษัทย่อย” หมายถึง บริษัทหรือนิติบุคคลที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยถือหุ้นเกินกว่าร้อยละ 50 ไม่ว่าจะถือโดยตรงหรือโดยอ้อม
- “กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ” หมายถึง ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและบริษัทย่อย
- “คณะอนุกรรมการ” หมายถึง คณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง
- “ฝ่ายจัดการ” หมายถึง ผู้บริหารที่ดำรงตำแหน่งในระดับผู้อำนวยการฝ่ายหรือเทียบเท่าขึ้นไป

### 3. องค์ประกอบ และวาระการดำรงตำแหน่ง

- 3.1 คณะอนุกรรมการ และประธานอนุกรรมการได้รับการแต่งตั้งโดยคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ
- 3.2 คณะอนุกรรมการ ประกอบด้วยอนุกรรมการจำนวนไม่น้อยกว่า 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 อาจให้ดำรงตำแหน่งต่อได้อีกคราวละ 1 ปี แต่อย่างไรก็ดี วาระการดำรงตำแหน่งต่อเนื่องจะต้องไม่เกิน 9 ปี
- 3.4 เมื่ออนุกรรมการครบวาระการดำรงตำแหน่ง หรือมีเหตุใดที่ทำให้ไม่สามารถอยู่ได้จนครบวาระ คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ อาจพิจารณาแต่งตั้งอนุกรรมการท่านใหม่แทนได้ตามที่เห็นสมควร เพื่อให้เกิดความต่อเนื่องในการดำเนินงาน เว้นแต่วาระของอนุกรรมการจะเหลือน้อยกว่าสองเดือน ให้อนุกรรมการที่เหลืออยู่ปฏิบัติหน้าที่ต่อไปได้ โดยยังไม่ต้องแต่งตั้งอนุกรรมการทดแทน ทั้งนี้ บุคคลที่ได้รับการแต่งตั้งให้ดำรงตำแหน่งแทนจะอยู่ในตำแหน่งได้เพียงเท่าวาระที่ยังเหลืออยู่ของอนุกรรมการที่ตนแทน
- 3.5 คณะอนุกรรมการเป็นผู้พิจารณาแต่งตั้งเลขานุการคณะอนุกรรมการ
- 3.6 ทุกครั้งที่มีการแต่งตั้งอนุกรรมการใหม่ ให้เลขานุการคณะอนุกรรมการจัดให้มีเอกสารและข้อมูลที่เป็นประโยชน์ต่อการปฏิบัติหน้าที่ของอนุกรรมการใหม่ รวมถึงการจัดแนะนำลักษณะและแนวทางการดำเนินงานในเรื่องที่เกี่ยวข้องกับบทบาทหน้าที่ของคณะอนุกรรมการ (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 คณะอนุกรรมการอาจเชิญผู้ที่เกี่ยวข้องหรือผู้ที่เกี่ยวข้องเข้าร่วมประชุม หรือขอให้ชี้แจงในเรื่องที่เกี่ยวข้องได้
- 4.6 คณะอนุกรรมการอาจเชิญบุคคลภายนอกที่มีความรู้ความเชี่ยวชาญเป็นที่ปรึกษา และเข้าร่วมประชุมได้ด้วยค่าใช้จ่ายของตลาดหลักทรัพย์ฯ
- 4.7 คณะอนุกรรมการมีการประชุมร่วมกับคณะอนุกรรมการตรวจสอบ เป็นประจำทุกปี
- 4.8 เลขานุการคณะอนุกรรมการมีหน้าที่นัดหมายการประชุม จัดเตรียมวาระการประชุม นำส่งเอกสารประกอบการประชุม และบันทึกรายงานการประชุม ทั้งนี้ หนังสือเชิญประชุม และเอกสารประกอบการประชุมให้นำส่งล่วงหน้า 7 วันก่อนการประชุม เว้นแต่ในกรณีจำเป็นรีบด่วน เลขานุการจะแจ้งการประชุมโดยวิธีอื่นและอาจนำส่งเอกสารประกอบการประชุมล่วงหน้าน้อยกว่า 7 วันก่อนการประชุม
- 4.9 ในกรณีที่ต้องมีการลงมติออกเสียง ให้ใช้เสียงข้างมาก กรณีที่มีคะแนนเสียงเท่ากัน ให้ประธานอนุกรรมการมีสิทธิลงคะแนน อีกเสียงหนึ่งเป็นเสียงชี้ขาด
- 4.10 อนุกรรมการผู้ใดมีส่วนได้เสียในเรื่องที่พิจารณา ให้แจ้งการมีส่วนได้เสียนั้นและห้ามมิให้เข้าร่วมพิจารณาในเรื่องนั้น

#### 5. หน้าที่ และความรับผิดชอบ

คณะอนุกรรมการมีหน้าที่และความรับผิดชอบที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ในเรื่องต่าง ๆ ดังต่อไปนี้

- 5.1 พิจารณาและให้ความเห็นต่อนโยบายและกรอบการบริหารความเสี่ยงองค์กร (Risk Management Policy and Framework) ของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ รวมถึงนโยบายการรักษาความมั่นคงปลอดภัยของระบบสารสนเทศและความมั่นคงปลอดภัยทางไซเบอร์ (IT

- Security and Cyber Security Policies) เพื่อนำเสนอต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ พิจารณาให้ความเห็นและอนุมัติ
- 5.2 พิจารณาและให้ความเห็นในการกำหนดระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (Risk Appetite) และความเบี่ยงเบนของระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ขององค์กร (Risk Tolerance) เพื่อนำเสนอต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ พิจารณาให้ความเห็นและอนุมัติ
  - 5.3 รับทราบ พิจารณา และให้ความเห็นในผลการประเมินความเสี่ยง แนวทาง และมาตรการจัดการความเสี่ยง และแผนปฏิบัติการเพื่อจัดการความเสี่ยงให้อยู่ในระดับที่ยอมรับได้ ครอบคลุมความเสี่ยงด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ ความมั่นคงปลอดภัยทางไซเบอร์ ความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงาน และความเสี่ยงทางการเงินและการลงทุน
  - 5.4 ติดตามแผนการดำเนินงานเพื่อบริหารจัดการความเสี่ยงอย่างต่อเนื่อง
  - 5.5 ให้คำแนะนำ ในเรื่องการบริหารความเสี่ยงระดับองค์กร รวมถึงส่งเสริมและสนับสนุนให้มีการปรับปรุง และพัฒนาระบบการบริหารความเสี่ยงภายในองค์กรอย่างต่อเนื่อง
  - 5.6 รายงานสถานะความเสี่ยงที่สำคัญขององค์กร รวมถึงการดำเนินการด้านการบริหารความเสี่ยงต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อรับทราบเป็นประจำ
  - 5.7 ให้ความเห็นและข้อเสนอแนะในการใช้บริการจากบุคคลภายนอกเพื่อให้คำปรึกษาแนะนำที่เป็นอิสระเกี่ยวกับการบริหารจัดการความเสี่ยงให้แก่ฝ่ายบริหารความเสี่ยง
  - 5.8 พิจารณากลับกรองเบื้องต้น ในการแต่งตั้งผู้เชี่ยวชาญด้านการบริหารความเสี่ยง กรณีที่ไม่มีคณะกรรมการที่เกี่ยวข้อง ก่อนนำเสนอต่อที่ประชุมคณะกรรมการสรรหาและพิจารณาค่าตอบแทน (NRC) เพื่อพิจารณาให้ความเห็นชอบ
  - 5.9 ปฏิบัติหน้าที่อื่นใดตามที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ มอบหมายภายใต้ขอบเขตของงานที่เกี่ยวข้อง

## 6. การประเมินผลการปฏิบัติหน้าที่ของตนเอง

คณะกรรมการประเมินผลการปฏิบัติหน้าที่ของตนเอง (Self-assessment) และรายงานคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อทราบปีละครั้ง

## 7. การทบทวนกฎบัตร

คณะกรรมการจะสอบทานและประเมินความเพียงพอและทบทวนความเหมาะสมของกฎบัตรของคณะกรรมการเป็นประจำทุกปี และนำเสนอคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อพิจารณาให้ความเห็นชอบต่อไป

**8. การรายงาน**

- 8.1 ให้มีการรายงานการดำเนินงานของคณะกรรมการ ต่อที่ประชุมคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นประจำ
- 8.2 ให้จัดทำรายงานผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการ ซึ่งลงนามโดยประธานคณะกรรมการ เพื่อเปิดเผยในรายงานประจำปี ตามหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี

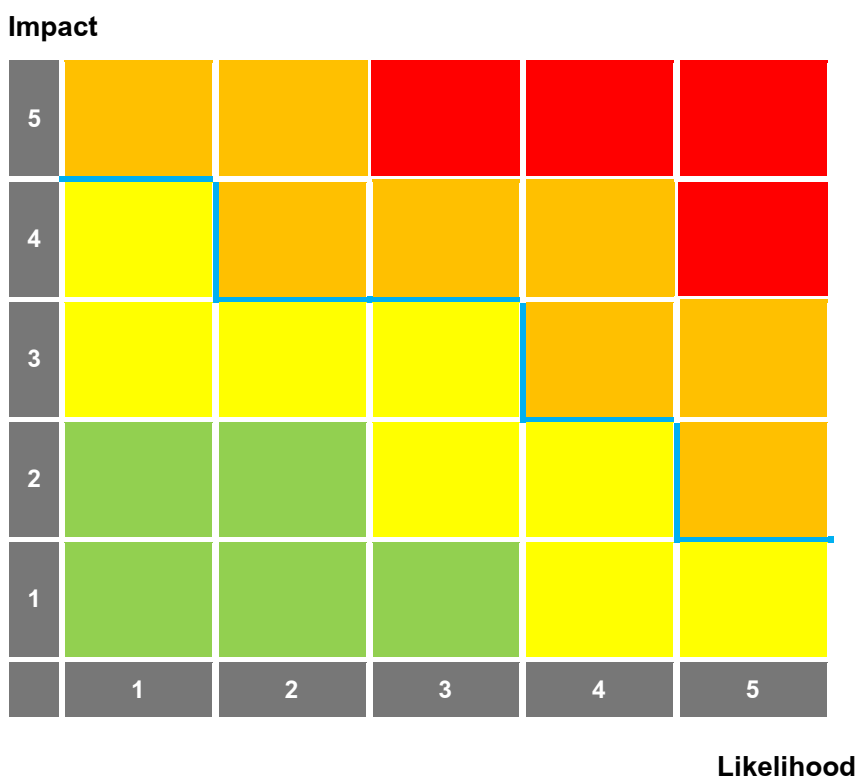
---

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

อนุมัติเมื่อวันที่ 19 กุมภาพันธ์ 2563

เอกสารแนบ

กรอบในการพิจารณา Acceptance Zone และ Rejection Zone ของความเสี่ยงขององค์กร



**ระดับความเสี่ยงในระดับที่ยอมรับได้ (Risk Appetite)** คือ ระดับความเสี่ยงที่ ตลท. ยอมรับได้ เมื่อเกิดเหตุการณ์ ความเสี่ยงขึ้นแล้ว ซึ่งเป็นปัจจัยที่สำคัญในการประเมินทางเลือกในการดำเนินธุรกิจและกำหนดกลยุทธ์ของ ตลท. ที่จะ ยังสามารถดำเนินธุรกิจ เพื่อบรรลุเป้าหมายหรือวัตถุประสงค์ที่วางไว้ โดยเป็นระดับความเสี่ยงตั้งแต่โซนสีเหลืองลงมา หรือเทียบเคียงกับ Corporate KPI Level 3 ตามที่ได้รับอนุมัติจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์

**ช่วงเบี่ยงเบนของความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (Risk Tolerance)** เป็นช่วงของค่าของความเสี่ยงที่กำหนดขึ้นจากระดับ ความเสี่ยงที่ยอมรับได้ของ ตลท. เพื่อประกอบการพิจารณาว่า ตลท. สามารถยอมรับความเสี่ยงในด้านต่าง ๆ ได้ใน ระดับใด และตัดสินใจในการตอบสนองต่อความเสี่ยง โดยเทียบเคียงกับ Corporate KPI Level 1 ตามที่ได้รับอนุมัติจาก คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์