

ประเด็นที่น่าสนใจจากการตรวจสอบของสำนักงาน ก.ล.ต.

SSF Block Trade



**บรรยาย ASCO
วันที่ 13 กันยายน 2564**

หัวข้อ

1. การทำธุรกรรม **SSF Block Trade**
2. การบริหารความเสี่ยงในธุรกรรม **SSF Block Trade**
3. ข้อสังเกตที่พบ

1. การทำธุรกรรม SSF Block Trade



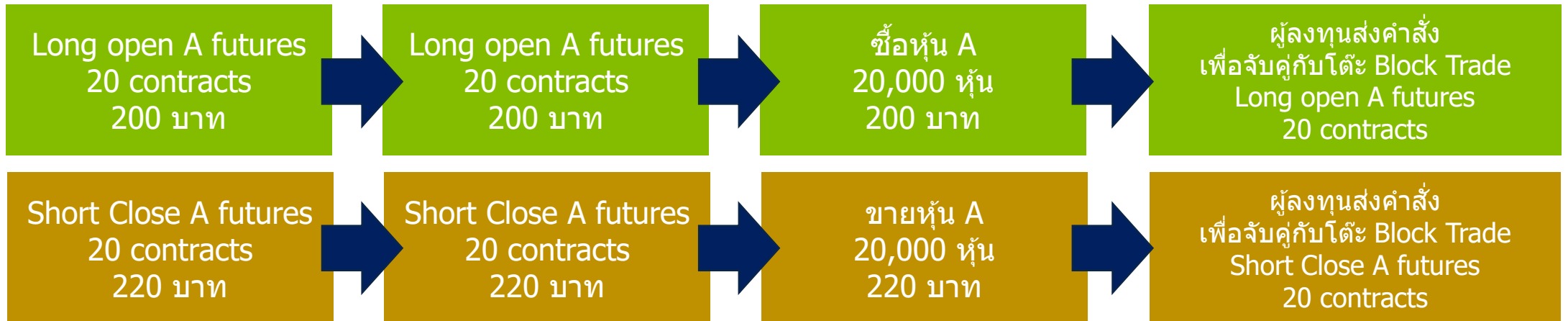
ผู้ลงทุน



ผู้แนะนำ



โต๊ะ Block Trade



2. การบริหารความเสี่ยงในธุรกรรม SSF Block Trade



ผู้ลงทุน

- การกำหนดวงเงินลูกค้า
- การ call/force บัญชี TFEX

ระบบงานของบริษัท

- การคัดเลือก underlying ของ SSF
- การกำหนดวงเงินในบัญชี SSF Block Trade
- การ Hedging และการควบคุมความเสี่ยง
- การใช้บัญชีลงทุนของบริษัทผิดไปจากวัตถุประสงค์



3. ข้อสังเกตที่พบ



ผู้ลงทุน

- ความรู้ความเข้าใจของผู้ลงทุน
- การสื่อสารขั้นตอนและเงื่อนไขในการลงทุน

ระบบงานของบริษัท

- การทำความรู้จักลูกค้า (KYC/CDD)
- การให้คำแนะนำและการรับคำสั่ง
- การบริหารความเสี่ยง
- การกำกับดูแลและควบคุมภายใน (การสุ่มฟังเทป ลูกค้าตอบรับรายการ)

