

การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

- ประสานงานกับหน่วยงานและสมาชิกที่เกี่ยวข้องในการดำเนินโครงการ Digital Infrastructure for Capital Market (DIF) โดยในเบื้องต้น สำนักงาน ก.ล.ต. จะเปิดรับคำขอรับความเห็นชอบเพื่อเข้าร่วมการทดสอบระบบ Digital Infrastructure บนโครงการ Sandbox ในช่วง Production สำหรับผู้ออกหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจในปี 2566 และคาดว่าจะระบบจะ Go-Live ได้ในเดือนเมษายน 2566
- ดำเนินการเรื่องต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินงาน ก.ล.ต. ดังนี้
 - ร่วมกับสำนักงาน ก.ล.ต. จัดการประชุมรายไตรมาส ครั้งที่ 2/2565 เพื่อแลกเปลี่ยนมุมมองเกี่ยวกับผลกระทบต่อบริษัทหลักทรัพย์จากสถานการณ์เศรษฐกิจในปัจจุบันและ digital transformation แนวทางเพิ่มศักยภาพให้แก่ผู้ลงทุนและผู้ประกอบธุรกิจ รวมถึงเปิดโอกาสให้สมาชิกหารือปัญหาอุปสรรคในการประกอบธุรกิจและเสนอแนะแนวทางการแก้ไขปัญหาร่วมกัน
 - ปรับปรุงเพิ่มเติมแนวทางการปฏิบัติงาน เรื่อง การซื้อขายผลิตภัณฑ์ในตลาดทุนที่เป็นสกุลเงินตราต่างประเทศ แบบ Principle based และสื่อสารให้สมาชิกทราบหลังจากแนวทางการปฏิบัติงานดังกล่าวได้รับความเห็นชอบจากสำนักงาน ก.ล.ต.
 - ร่วมกับสภาธุรกิจตลาดทุนให้ความเห็นและมุมมองในมิติต่างๆ สำหรับเป็นข้อมูลประกอบการศึกษาโครงการ “Landscape of Thai securities businesses after Covid-19 and under digital disruption” ที่สำนักงาน ก.ล.ต. ได้ว่าจ้างธนาคารโลก (World Bank) ศึกษาโครงการ รวมถึงรวบรวมความเห็นจากสมาชิกผ่านแบบสอบถามของโครงการ และนำเสนอข้อมูล “ประเด็นด้าน Competitiveness ของตลาดทุนไทย” ที่สมาคมได้จัดทำขึ้นเพื่อให้ World Bank ใช้ประกอบการศึกษา
 - สืบสวนการดำเนินการในการวิเคราะห์ปัจจัย ESG ในบทวิเคราะห์ของบริษัทสมาชิก เพื่อทราบถึงพัฒนาการด้าน ESG ของธุรกิจหลักทรัพย์ ตลอดจนปัญหาและอุปสรรคในการดำเนินการดังกล่าว
 - นำส่งข้อมูล use case เพื่อเป็นข้อมูลสนับสนุนข้อเสนอแนะในการอนุญาตให้บริษัทหลักทรัพย์ (บล.) ทำธุรกรรม OTC Derivatives สำหรับลูกค้าบุคคลที่รับความเสี่ยงได้สูง เช่น Qualified Investors, High Net Worth เป็นต้น
 - จัดเตรียมข้อมูลเพิ่มเติมเกี่ยวกับข้อเสนอทบทวนอัตราหลักประกันธุรกรรม Margin Loan และ SBL หลังจากสำนักงาน ก.ล.ต. มีความเห็นต่อข้อเสนอแรกทีสมาคมนำเสนอไป

- ดำเนินการเรื่องต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการตลาดหลักทรัพย์ฯ ดังนี้
 - รับฟังความเห็นจากสมาชิกเกี่ยวกับการปรับปรุงแนวทางปฏิบัติของตลาดหลักทรัพย์ฯ เกี่ยวกับการคัดกรองลูกค้าที่ซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ Direct Market Access (DMA) และพิจารณา นำส่งข้อมูลไปยังตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อใช้ประกอบการปรับปรุงแนวทางปฏิบัติดังกล่าว
- ประสานงานกับตลาดหลักทรัพย์ฯ ในประเด็นปัญหาอุปสรรคร่วม ข้อเสนอแนะเกี่ยวกับการใช้งาน สำหรับ DRx, Live Exchange และระบบ Fund Connex ที่ได้รับจากชมรมปฏิบัติการหลักทรัพย์
- ดำเนินการเกี่ยวกับ The Common Reporting Standard (CRS) ดังนี้
 - ร่วมกับ S&P Global จัดการอบรม หัวข้อ “The Common Reporting Standard - All you need to know ahead of Thailand’s upcoming implementation”
 - สืบสวนความพร้อมการดำเนินการของสมาชิก เพื่อทราบถึงสถานะด้านการเตรียมความพร้อมของสมาชิกโดยรวมรวมถึงปัญหาอุปสรรคที่พบ และนำไปพิจารณาแนวทางที่สมาคมจะสามารถสนับสนุนการดำเนินการของสมาชิกต่อไป
- ร่วมกับคณะทำงานให้ความเห็นต่อการปรับปรุงประกาศธนาคารแห่งประเทศไทย เรื่องหลักเกณฑ์การอนุญาตและกำกับดูแลการทำธุรกรรมอนุพันธ์ของธนาคารพาณิชย์ รวมถึงประสานงานให้ผู้ลงทุนให้ความเห็นต่อเรื่องดังกล่าวตามที่ธนาคารแห่งประเทศไทยขอความอนุเคราะห์
- ร่วมกับ FETCO จัดทำข้อมูลแผนงานและกิจกรรมสำหรับแผนพัฒนาตลาดทุนไทย ฉบับที่ 4 (ปี 2565 - 2570)
- ร่วมกับ NDID สืบสวนการใช้บริการพิสูจน์ตัวตนและยืนยันตัวตนผ่าน NDID เพื่อให้สมาชิกแจ้งปัญหาอุปสรรค ข้อเสนอแนะ รวมถึง use case ที่เป็นประโยชน์ต่อบริษัทและอุตสาหกรรม เพื่อที่สมาชิกจะสามารถได้รับการที่ดีขึ้นและตอบสนองการใช้งานได้อย่างมีประสิทธิภาพยิ่งขึ้น


ชมรมวาณิชธนกิจ

- การเสนอความคิดเห็น / หารือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง
 - การประชุมร่วมกับตลาดหลักทรัพย์ฯ เรื่อง “การปรับปรุงหลักเกณฑ์การรับหุ้นสามัญ SET & mai”
 - การประชุมคณะทำงานด้านการออกและเสนอขายหลักทรัพย์ประเภทหนี้ร่วมกับสำนักงาน ก.ล.ต. เพื่อหารือเรื่อง “การพิจารณาคุณสมบัติของผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษและผู้ลงทุนรายใหญ่”

เอกสารฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (สมาคม) เพื่อเผยแพร่ข้อมูลที่เป็นประโยชน์ภายในหน่วยงานสมาชิกของสมาคม และบุคคลภายนอกที่สนใจศึกษาเท่านั้น การนำข้อมูล ข่าวสารที่ปรากฏในเอกสารนี้ไปใช้ ควรใช้ความระมัดระวัง และพิจารณาอย่างรอบคอบถึงความถูกต้องครบถ้วน และความเป็นปัจจุบันของข้อมูลด้วยเป็นเพียงข้อมูล ณ วันที่ปรากฏในเอกสารจึงอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังวันดังกล่าว ทั้งนี้ สมาคมไม่รับผิดชอบ และไม่อาจรับประกันได้ว่า ในกรณีใดๆ ในผลจากการนำข้อมูลข่าวสารไปใช้ รวมถึงไม่สามารถรับผิดชอบผู้เสียหายบุคคลใดๆ จากการเรียกร้องใดๆ ไม่ว่าในทางสัญญา ในการทำละเมิด รวมถึงความประมาท หรือเหตุอื่นใด ที่เกิดจากเนื้อหา หรือจากการใช้ การตัดสินใจ หรือการกระทำใดๆ ที่เกิดจากความเชื่อใจในเนื้อหาดังกล่าวของผู้ใช้ หรือในความเสียหาย ความสูญเสีย ค่าสินไหมทดแทน หรือความรับผิดชอบใดๆ ถึงแม้ว่าสมาคมจะได้รับแจ้งว่าจะเกิดความเสียหายดังกล่าวขึ้นก็ตาม หากท่านได้รับเอกสารฉบับนี้ โดยมิใช่สมาชิกหรือในฐานะตัวแทนของสมาชิกสมาคม โปรดทราบว่ากรมเนยแพร่กระจายหรือคัดลอกเอกสารนี้ ไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วนเป็นสิ่งที่ห้ามโดยเด็ดขาด

การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

● การจัดอบรม / สัมมนา

- การจัดสัมมนาเรื่อง “ESG Bond : What! How?” เมื่อวันที่ 21 กรกฎาคม 2565
- การจัดสัมมนาเรื่อง “Digital Asset และ LiVEx” เมื่อวันที่ 17 สิงหาคม 2565
- การจัดสัมมนาเรื่อง “การเปิดเผยข้อมูล ESG ในแบบ 69-1 สำหรับ FA” เมื่อวันที่ 22 กันยายน 2565
- การจัดอบรมหลักสูตรที่ปรึกษาทางการเงิน ครั้งที่ 2/2565 เมื่อวันที่ 20 - 21, 28 - 29 กันยายน 2565

● เรื่องอื่นๆ

- การปรับปรุงหลักเกณฑ์การอบรม Refresher Course ในส่วนของระยะเวลาการอบรม และการเปิดโอกาสให้หน่วยงานที่เกี่ยวข้องกับตลาดทุนเสนอการอบรมที่เป็นประโยชน์ต่อการปฏิบัติงานของ FA



ชมรมผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

- ปรับปรุงแนวปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขายรายใหญ่ (Block Trade) สำหรับ Single Stock Futures
- จัดทำแนวปฏิบัติในการเปิดบัญชีซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้ารูปแบบออนไลน์ ให้กับบริษัทสมาชิก
- ร่วมหารือกับ TCH เรื่องการปรับปรุงแนวทางการคำนวณ Additional Margin
- ร่วมหารือกับ SETTRADE เรื่องการแสดง Market Status ในระบบซื้อขาย New Trading System (MME)
- สำรวจความคิดเห็นบริษัทสมาชิกด้านโลหะมีค่าเกี่ยวกับระดับขีดความสามารถ CSIRT และระดับความต้องการใช้บริการ TCM-CERT ของบริษัทสมาชิก
- สำรวจความคิดเห็นบริษัทสมาชิกการกำหนดอัตราทดความเสี่ยงและอัตราค่านายหน้าแนะนำของ EUR/USD Futures, USD/JPY Futures, EUR/THB Futures และ JPY/THB Futures



ชมรมผู้ดูแลการปฏิบัติงานด้านหลักทรัพย์

เข้าร่วมหารือและเสนอความคิดเห็นกับหน่วยงานต่างๆ ดังนี้

● สำนักงานป้องกันและปราบปรามการฟอกเงิน

- เข้าร่วมโครงการเผยแพร่ผลการประเมินความเสี่ยงระดับชาติและยุทธศาสตร์ด้านการป้องกันและปราบปรามการฟอกเงิน และการต่อต้านการสนับสนุนทางการเงินแก่การก่อการร้ายและการแพร่ขยายอาวุธที่มีอานุภาพทำลายล้างสูง

- เข้าร่วมประชุมคณะกรรมการขับเคลื่อนยุทธศาสตร์ด้าน AML/CFT ครั้งที่ 2/2565

- รายงานข้อมูลโครงการกิจกรรม และความคืบหน้าการดำเนินการของสมาคมฯ ตามแผนปฏิบัติการด้าน AML/CFT ประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2565 รอบไตรมาสที่ 4/2564

● สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

- เข้าร่วมประชุมและซักซ้อมความเข้าใจในการส่งเอกสารตามระบบ ESUBMISSION และเสนอความเห็นเพิ่มเติมเกี่ยวกับขั้นตอนการลงนามและการลงทะเบียนพิสูจน์และยืนยันตัวตนในการใช้งานระบบ ESUBMISSION

- สำรวจขั้นตอนการตรวจสอบข้อมูลซ้ำกันของลูกค้าและพนักงาน เพื่อประกอบการจัดทำ Check list การตรวจสอบการปฏิบัติงานการทำความรู้จักกับลูกค้า

● หน่วยงานอื่น

- เข้าร่วมประชุมกับคณะทำงานด้านตลาดรองตราสารหนี้เพื่อรับฟังการสื่อความ เรื่องขอบเขตการตรวจสอบและประเมินระบบงานสมาชิก ประจำปี 2565 โดยฝ่ายกฎระเบียบและตรวจสอบสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

- เข้าร่วมประชุมสัมมนาเชิงวิชาการโครงการประเมินผลสัมฤทธิ์ในการบังคับใช้พระราชบัญญัติประกอบรัฐธรรมนูญว่าด้วยการป้องกันและปราบปรามการทุจริต พ.ศ. 2561 จัดโดยสำนักงานป้องกันและปราบปรามการทุจริตแห่งชาติ



ชมรมปฏิบัติการหลักทรัพย์

- เสนอให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ จัดทำข้อกำหนดและเงื่อนไขเพิ่มเติมเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ใน Live Exchange
- ร่วมหารือกับสมาคมบริษัทจัดการลงทุน (AIMC) เรื่องการแจ้งความประสงค์ของลูกค้าในการลดหย่อนภาษีจากการซื้อกองทุน SSF/RMF ผ่านช่องทางตัวแทนขาย เนื่องจากกรมสรรพากรได้ออกประกาศกำหนดให้ บลจ. นำส่งข้อมูลกองทุนลดหย่อนภาษีของผู้ถือหน่วยลงทุนที่ต้องการลดหย่อนภาษีให้กับสรรพากร โดยกรมสรรพากรจะไม่เรียกเอกสารหลักฐานการซื้อขายจากผู้ถือหน่วยลงทุนอีก โดยเริ่มตั้งแต่ปี 2565 เป็นต้นไป
- ร่วมหารือกับ TSD เรื่องการตรวจบัญชีลูกค้าที่จองซื้อหุ้นเพื่อลดปัญหาผู้จองซื้อหุ้นที่ระบุชื่อ บล. หรือ Brokerage account ผิดและ บล. ต้องทำรายการโอนเข้าบัญชีผู้ออกหลักทรัพย์ (บัญชี 600)
- ร่วมหารือกับ TSD เรื่องการใช้สำเนาหนังสือมอบอำนาจและเอกสารประกอบของนิติบุคคลต่างประเทศที่มอบอำนาจให้บริษัทสมาชิกผู้ฝากทำธุรกรรมแทน
- หารือกับกรมสรรพากร เรื่องแนวทางการปฏิบัติด้านภาษีที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการเป็นตัวแทนซื้อขายหน่วยลงทุนของ บล. ที่เป็นอุปสรรค

การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

- กรณีที่เกิดกองทุนรวมมีการจ่ายเงินปันผล ให้กับผู้ถือหุ้นผ่านบัญชีแบบ Omnibus Account ซึ่งทางกองทุนจะจ่ายเงินปันผล ให้กับ บล. โดยไม่หักภาษี ณ ที่จ่าย และ บล. จะเป็นผู้ดำเนินการจ่ายเงินปันผลของกองทุนรวมให้แก่ลูกค้าและดำเนินการหักภาษี ณ ที่จ่าย เพื่อนำส่งให้กรมสรรพากรเอง
- ในกรณีที่กองทุนรวมมีค่าธรรมเนียม (Front-end Fee หรือ Back-end Fee) และภาษีมูลค่าเพิ่มที่ บลจ. เรียกเก็บจากผู้ถือหุ้นผ่านบัญชีแบบ Omnibus Account เอกสารใบกำกับภาษีของค่าธรรมเนียมดังกล่าวจะอยู่ในชื่อ บล. เพื่อลูกค้า ดังนั้น บล. จึงไม่สามารถออกใบเสร็จรับเงิน / ใบกำกับภาษีสำหรับค่าธรรมเนียมให้กับลูกค้าของ บล. ตามที่ลูกค้าร้องขอได้ ซึ่งในขณะเดียวกัน บล. ก็ไม่สามารถใช้สิทธิขอคืนภาษีซื้อจากค่าธรรมเนียมที่ถูกเรียกเก็บจาก บลจ. แจ้งผลการหารือ เรื่องการยื่นแบบภาษีเงินได้บุคคลธรรมดาผ่านระบบ e-Filing กรณีมีรายได้จากเงินปันผลของกองทุนรวมที่ซื้อขายผ่าน บล. ว่าระบบ e-Filing สามารถรองรับการกรอกเลขผู้จ่ายเงินได้ที่เป็นเลขประจำตัวผู้เสียภาษีอากรของ บล. เรียบร้อยแล้วตั้งแต่วันที่ 19 มกราคม 2565 โดยเป็นการแก้ไขแบบถาวร
 - ร่วมกับสถาบันฝึกอบรม สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (ATI) และฝ่ายพัฒนาความรู้ผู้ประกอบการวิชาชีพ ตลาดหลักทรัพย์ฯ จัดโครงการ Strengthening Back Office Operation @Brokers 2022 ให้กับบริษัทสมาชิก ในวันที่ 24 กันยายน และวันที่ 1 ตุลาคม 2565



ชมรมเทคโนโลยีสารสนเทศ

- ยกระดับศูนย์ประสานการรักษาความมั่นคงปลอดภัยระบบคอมพิวเตอร์ ภาคตลาดทุน (TCM CERT) เพื่อทำหน้าที่เป็น Sectorial CERT ภาคตลาดทุน
 - สํารวจระดับขีดความสามารถ CSIRT และระดับความต้องการใช้บริการ TCM-CERT ของบริษัทสมาชิกให้สำนักงาน ก.ล.ต.
 - จัดทำแบบสำรวจความเห็น คุณสมบัตินักให้บริการการดำเนินการกับกรรมการชมรมฯ และได้เชิญผู้ให้บริการ 4 บริษัท ได้แก่ 1) บริษัท UIH Cyber elite 2) บริษัท Accenture 3) บริษัท Securework by EPIT และ 4) บริษัท AIS + Pala Alto เพื่อหารือเกี่ยวกับรายละเอียดของ TOR สำหรับสัญญาการดำเนินการโครงการ Sectorial CERT
 - สํารวจข้อมูลจำนวนอุปกรณ์เพื่อเข้าร่วมโครงการเฝ้าระวังภัย Cyber (Sectorial CERT) เพื่อใช้ประกอบการพิจารณารายละเอียด TOR
- จัดกิจกรรมการฝึกซ้อมรับมือภัยไซเบอร์สำหรับภาคตลาดทุนของประเทศไทย Capital Market Cyber Exercise 2022 ร่วมกับสมาคมบริษัทจัดการลงทุน สมาคมสินทรัพย์ดิจิทัลไทย สำนักงาน ก.ล.ต. ตลาดหลักทรัพย์ฯ และบริษัท เอซี อินโฟเทค จำกัด

ซึ่งมีบริษัทเข้าร่วมกิจกรรม 102 บริษัท โดยมีกิจกรรมดังนี้

- กิจกรรม Pre exercise lab และ Post exercise lab
- การฝึกซ้อมรับมือภัยไซเบอร์ ในวันที่ 26 - 27 กันยายน 2565
- จัดทำแบบสำรวจข้อมูล URL ของแต่ละบริษัทสมาชิก โดยขอให้สมาชิกอัปเดตข้อมูลทุกๆ 6 เดือน และรวบรวมเผยแพร่ URL ทั้งหมดให้สมาชิกได้รับทราบและนำไปปรับปรุงการ Block Web การเข้าใช้งานบริษัทสมาชิก
- ประสานงานตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อแก้ปัญหาในระบบ Settrade SEOS Equity ที่มีการเชื่อมต่อทั้ง Matching และ Clearing เนื่องจากระบบ BackOffice ของทุกบริษัทสมาชิกยังไม่ได้มีการรองรับในส่วนดังกล่าว
- ประชุมร่วมกับสมาคมบริษัทจัดการลงทุน เรื่องการแจ้งความประสงค์ของลูกค้าในการลดหย่อนภาษีผ่านช่องทางตัวแทนขาย เนื่องจากกรมสรรพากรได้ออกกฎหมายกำหนดให้ บลจ. นำส่งข้อมูลกองทุนลดหย่อนภาษีของผู้ถือหุ้นรายละ 100,000 บาท ที่ต้องการลดหย่อนภาษีให้กับสรรพากร โดยกรมสรรพากรจะไม่เรียกเอกสารหลักฐานการซื้อขายจากผู้ถือหุ้นรายละ 100,000 บาท โดยเริ่มตั้งแต่ปี 2565 เป็นต้นไป
- จัดสัมมนา ASCO 2022 Business Solutions Symposium ณ Toscana Valley @ Khao Yai ระหว่างวันที่ 1 - 2 ตุลาคม 2565 โดยมีการเข้าร่วมรับฟังเทคโนโลยีด้านการสื่อสารที่ทันสมัยสำหรับธุรกิจหลักทรัพย์ร่วมกับ บริษัท ซิมโฟนี คอมมูนิเคชั่นส์ จำกัด (มหาชน)
- ประสานงานตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อติดตามความคืบหน้าโครงการ New Back Office



- รวบรวมและสรุปผล เรื่อง “ผลสำรวจข้อมูลบุคลากรของบริษัทสมาชิก” ส่งให้สมาชิกเพื่อประโยชน์ในการวางแผนและพัฒนาบุคลากรของบริษัทสมาชิกต่อไป
- ให้ความร่วมมือกับหน่วยงานต่างๆ ดังนี้
 - กองทุนส่งเสริมการพัฒนาตลาดทุน (CMDF) ในการประชาสัมพันธ์ เรื่องโครงการให้ทุนสนับสนุนการเรียนหลักสูตร Certificate Quantitative Finance (CQF) ครั้งที่ 2
 - สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (ThaiBMA) ในการประชาสัมพันธ์ เรื่อง “หลักสูตรอบรมความรู้ด้านกฎระเบียบในตลาดตราสารหนี้”

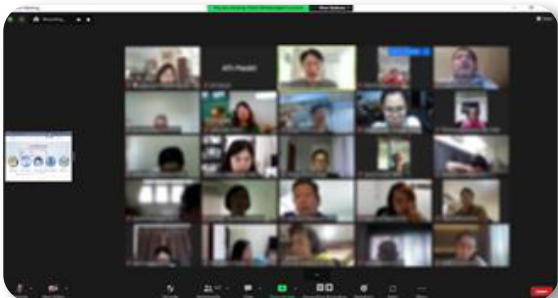
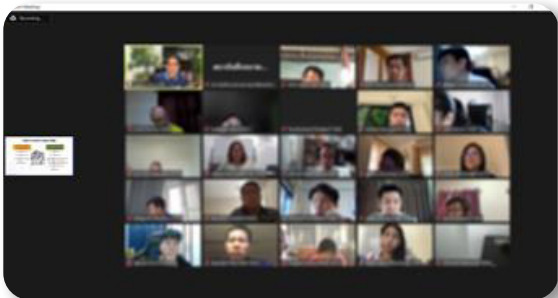
การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญ ของสถาบันฝึกอบรม ATI

การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญ ของสถาบันฝึกอบรม ATI

» จัดอบรม “หลักสูตรต่ออายุใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุน (IC Plain, IC Complex 1, 2, 3) ผู้วางแผนการลงทุน (IP) นักวิเคราะห์การลงทุน (IA) และผู้แนะนำลูกค้า (IBA)” ซึ่งเหมาะสำหรับผู้ที่มีใบอนุญาตที่เกี่ยวข้อง ที่ต้องการต่ออายุใบอนุญาต และเพิ่มพูนความรู้ความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุนในตลาดทุน

แบ่งเป็น 2 รูปแบบ ดังนี้

1. ผ่านระบบ E-Learning ของ ATI มีระยะเวลาในการเรียน 60 วัน
2. ผ่านโปรแกรม ZOOM Meeting ในวันที่ 17 - 18 กันยายน 2565



» ดำเนินงานตามโครงการที่ได้รับทุนสนับสนุนจากกองทุนส่งเสริมการพัฒนาลาดทุน (CMDF) จำนวน 4 โครงการ ดังนี้

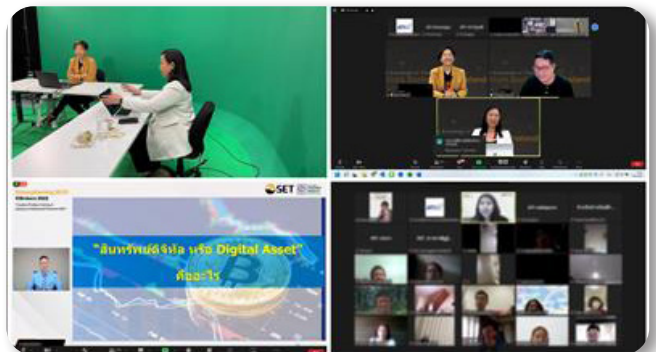
1) โครงการอบรมเพื่อยกระดับผู้แนะนำการลงทุน (IC) เป็นการจัดอบรมและทดสอบในหลักสูตร IC Complex P2 และ P3 และหลักสูตรนักวางแผนการเงิน(CFP) ตั้งแต่ Module ที่ 1 ถึง 6 ระหว่างปี 2564 - 2567 สำหรับผู้แนะนำการลงทุน (IC) ที่สังกัดบริษัทหลักทรัพย์(บล.)และที่สังกัดบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน(บลจ.) รวมถึงนักศึกษาและอาจารย์จากมหาวิทยาลัยต่างๆ โดยตั้งแต่ปี 2564 จนถึงไตรมาสที่ 3 ปี 2565 มี IC เข้าร่วมโครงการแล้วทั้งหมด 2,662 คน นักศึกษาจากมหาวิทยาลัยต่างๆ จำนวน 497 คน และมีอาจารย์มหาวิทยาลัยเข้าร่วมโครงการจำนวน 14 คน

2) โครงการอบรมผู้ได้รับทุนจ้างงานจาก CMDF เป็นการจัดอบรมสำหรับผู้ได้รับทุนจ้างงานจาก CMDF ในปี 2563 และบุคลากรใหม่ของบริษัท (รวมถึงบริษัทผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และบริษัทที่ปรึกษาทางการเงิน) ที่ได้เริ่มทำการว่าจ้างตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2563 จนถึง 31 พฤษภาคม 2566 ซึ่งโครงการได้ขยายระยะเวลาจากสิ้นสุดโครงการเดือนธันวาคม 2564 เป็นถึงเดือนมิถุนายน 2566 ให้กับผู้นสนใจเข้าร่วมโครงการ เพื่อเพิ่มความรู้ในเรื่องการทำธุรกิจของ บล. และกฎระเบียบที่เกี่ยวข้อง ปัจจุบันตั้งแต่เดือนมิถุนายน 2564 - กันยายน 2565 มีบริษัทเข้าร่วมแล้ว 35 แห่ง และมีผู้เข้าร่วมอบรมในโครงการแล้วทั้งหมด 693 คน

3) โครงการ Upskill & Reskill ด้าน Digital ให้บุคลากรในบริษัทหลักทรัพย์ (Phase 2) ทางสมาคมฯ ได้พิจารณาและคัดเลือกหลักสูตรอบรมให้กับบุคลากรใน บล. โดยสอดคล้องกับการเปลี่ยนแปลงแนวทางการทำธุรกิจในยุค Digital และเพื่อให้มีศักยภาพที่จะปฏิบัติงานในยุค Digital จำนวน 18 หลักสูตร คาดว่ามีผู้เข้าร่วมโครงการทั้งหมด 6,700 คน (เข้าขั้นต่ำ 4,000 คน) อบรมเฉลี่ยคนละ 6 หลักสูตร ระยะเวลาโครงการตั้งแต่เดือนกันยายน 2565 - มีนาคม 2567 โดยเริ่มจัดอบรมแล้วในช่วงเดือนกันยายน - ธันวาคม 2565 มีผู้สมัครอบรมแล้วประมาณ 650 คน อบรมเฉลี่ยคนละ 4 - 6 หลักสูตร

4) โครงการสนับสนุนทุนการสอบใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุนสำหรับนักศึกษาในมหาวิทยาลัย ทางสมาคมฯ ได้ตระหนักเห็นความสำคัญและความจำเป็นในการสรรหาและสร้างบุคลากรด้านผู้แนะนำการลงทุนรุ่นใหม่ที่จะเพิ่มเติม เพื่อทดแทนบุคลากรที่มีโอกาสจะเกษียณอายุและออกจากธุรกิจ โดยให้ทุนสนับสนุนค่าใช้จ่ายการทดสอบใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุนตราสารทั่วไป (IC Plain : P1) สำหรับนักศึกษาในมหาวิทยาลัยทั่วประเทศที่เรียนวิชามีการนำเอาผลการสอบใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุนตราสารทั่วไป (IC Plain : P1) มาเป็นส่วนหนึ่งในการวัดผลการศึกษา โดยคาดว่าจะมีนักศึกษาเข้าร่วม 2,500 คน โดยสอบผ่านไม่ต่ำกว่า 1,000 คน ระยะเวลาโครงการตั้งแต่กันยายน 2565 ถึงมิถุนายน 2568 ทั้งนี้ จากการสำรวจมีจำนวนนักศึกษาสนใจเข้าร่วมอบรมในโครงการฯ ในปี 2565 กว่า 800 คน

» ร่วมมือกับศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน (TSI) ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และชมรมปฏิบัติการหลักทรัพย์ Back Office Operation Club (BOO) จัดอบรมในหลักสูตร “Creative Problem Solving & Applying Professional Practices 2022” เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการทำงาน คุณภาพและทักษะการให้บริการของบุคลากรด้าน Back Office โดยจัดอบรม 2 วัน คือในวันเสาร์ที่ 24 กันยายน และ 1 ตุลาคม 2565 รูปแบบการถ่ายทอดสดออนไลน์ ผ่านระบบ ZOOM meeting ซึ่งมีผู้ปฏิบัติการด้านหลักทรัพย์ใน บล. ระดับ Junior และ Senior เข้าร่วมการอบรมจำนวน 488 คน



» จัดกิจกรรม Live สด เตรียมสอบ IC Plain (P1) ผ่านทาง Facebook Page ของ ATI โดยได้รับเกียรติจากวิทยากรผู้ทรงคุณวุฒิประจำสถาบันฯ มาให้เกร็ดความรู้ เผยเคล็ดลับ แนวทาง และเทคนิคดีๆ ในการทำข้อสอบ สำหรับผู้ที่ยังสอบไม่ผ่าน หรือต้องการเตรียมความพร้อมในการสอบ ซึ่งได้จัดกิจกรรมทั้งหมด 3 รอบ และได้รับการตอบรับจากจำนวนยอดการชมรวมถึงยอดการกด Like และ Share เป็นอย่างดี



การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญ ของสถาบันฝึกอบรม ATI

- วันที่ 23 กรกฎาคม 2565 เวลา 13.00 - 16.00 น.
- วันที่ 27 สิงหาคม 2565 เวลา 13.00 - 17.00 น.
- วันที่ 25 กันยายน 2565 เวลา 13.00 - 16.00 น.



» ศูนย์ทดสอบ ATI ดำเนินจัดอบรมโครงการ“เส้นทางสู่การเงินมืออาชีพ”ในหัวข้อ “วิเคราะห์จุดแข็งของหลักสูตรผู้แนะนำการลงทุนตราสารทั่วไป (IC Plain)” เพื่อเตรียมตัวสอบเป็นผู้แนะนำการลงทุน (IC Plain) ให้กับนิสิต นักศึกษา โดยมีมหาวิทยาลัยทั้งหมด 2 แห่ง ดังนี้



- 1) มหาวิทยาลัยวลัยลักษณ์ เมื่อวันที่ 4 - 5 สิงหาคม 2565
- 2) มหาวิทยาลัยอุบลราชธานี เมื่อวันที่ 27 - 28 สิงหาคม 2565

ข่าวประชาสัมพันธ์

สถาบันฝึกอบรม สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (ATI) เป็นสถาบันแห่งการเรียนรู้เรื่องการเงินและการลงทุน

» เปิดอบรม หลักสูตรต่ออายุใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุน (IC) ผู้วางแผนการลงทุน (IP) นักวิเคราะห์การลงทุน (IA) และผู้แนะนำลูกค้า (IBA) 15 ชั่วโมง (บรรยายสดผ่านโปรแกรม Zoom Meeting / ผ่านระบบ E-Learning)

**** สำหรับผู้เข้าอบรมทุกท่าน ต้องติดตั้งและลงทะเบียน Application Prof. Link ก่อนเข้ารับการอบรม เพื่อรองรับการส่งข้อมูลรูปแบบใหม่ เริ่ม 1 เมษายน 2565 เป็นต้นไป ****

รอบสุดท้ายของปี 2565

- วันเสาร์ที่ 12 - วันอาทิตย์ที่ 13 พฤศจิกายน 2565
(ผ่านโปรแกรม ZOOM Meeting)

» เปิดรับสมัครอบรม E-Learning

1) หลักสูตรเตรียมสอบ IC

- หลักสูตรผู้แนะนำการลงทุนตราสารทั่วไป IC Plain (P1)
- หลักสูตรผู้แนะนำการลงทุนด้านตราสารซับซ้อน : ตราสารหนี้และกองทุนรวม (P2)
- หลักสูตรผู้แนะนำการลงทุนด้านตราสารซับซ้อน : สัญญาซื้อขายล่วงหน้า (P3)

2) หลักสูตรต่ออายุใบอนุญาต(IC, IP, IA)

- หลักสูตรความรู้ด้านหลักทรัพย์พื้นฐาน
- หลักสูตรความรู้ด้านหลักทรัพย์เทคนิค
- หลักสูตรความรู้เกี่ยวกับกฎระเบียบที่เกี่ยวข้อง
- หลักสูตรความรู้ด้านสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- หลักสูตรความรู้ด้าน Asset Allocation
- หลักสูตรความรู้ด้าน ESG

3) หลักสูตรผู้แนะนำลูกค้า (IBA)

- หลักสูตรผู้แนะนำลูกค้า (IBA)
- หลักสูตรต่ออายุผู้แนะนำลูกค้า (IBA)
- หลักสูตรสอบซ่อมผู้แนะนำลูกค้า (IBA)

4) หลักสูตรอื่นๆ

- หลักสูตรแนวทางปฏิบัติที่เกี่ยวข้องกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)
- หลักสูตรโอกาสการลงทุนใหม่ในยุค FINTECH
- หลักสูตรรู้วิเคราะห์เทคนิค พิชิตตลาดหุ้น
- หลักสูตรเรียนรู้เรื่องกฎหมายการป้องกันการฟอกเงิน (AML/CFT) สำหรับผู้มีหน้าที่รายงานเพื่อปฏิบัติหน้าที่อย่างมืออาชีพ

สำหรับผู้สนใจหลักสูตรข้างต้น ท่านสามารถสมัครเข้ารับการอบรมออนไลน์ได้ที่ www.ati-asco.org หรือ <https://register.ati-asco.org> และเมื่อท่านทำการชำระค่าธรรมเนียมอบรมเรียบร้อยแล้ว ท่านจะได้รับ User และ Password สำหรับเข้าสู่ระบบ E-Learning

» ศูนย์ทดสอบ ATI เปิดรอบทดสอบใบอนุญาตในเขตกรุงเทพฯ และเขตภูมิภาค (จนถึงวันที่ 28 ธันวาคม 2565)

เขตกรุงเทพฯ

- วันจันทร์ - วันพฤหัสบดี

เปิดสอบ 2 รอบ คือ 09.30 - 12.00 น. และ 13.30 - 16.00 น.

- วันศุกร์ - วันเสาร์ - วันอาทิตย์

เปิดสอบ 3 รอบ คือ 09.30 - 12.00 น., 13.30 - 16.00 น. และ 18.00 - 20.30 น.

เขตภูมิภาค

สำหรับผู้สนใจตรวจสอบวันและที่นั่งว่างได้ที่ปฏิทินการสอบ ทั้งนี้ ท่านสามารถสมัครทดสอบได้ที่ <https://register.ati-asco.org> และติดตามข่าวประชาสัมพันธ์และตารางการสอบได้ที่ www.ati-asco.org หรือสอบถามข้อมูลเพิ่มเติม โทร. 02-096-2955 กด 2 หรือติดต่อได้ที่ Line: @ati-asco (มีเครื่องหมาย @ นำหน้า)



การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของงานกำกับดูแลสมาชิก

ในไตรมาสที่ 3 สายงานกำกับดูแลสมาชิกมีการดำเนินงานสำคัญดังต่อไปนี้

1. จัดทำแนวทางการมอบอำนาจส่งคำสั่งซื้อขายผ่านช่องทางออนไลน์ จากการหารือของสมาชิกที่ปัจจุบันตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนดห้ามไม่ให้บุคคลอื่นบันทึกคำสั่งซื้อขายให้ลูกค้าและได้กำหนดห้ามการมอบอำนาจให้ส่งคำสั่งออนไลน์ ขณะที่การมอบอำนาจให้ส่งคำสั่งในช่องทางอื่นสามารถดำเนินการได้สมาคมจึงได้หารือกับตลาดหลักทรัพย์ฯ ในเบื้องต้นเกี่ยวกับการทบทวนเรื่องดังกล่าว และได้ร่วมกับผู้แทนผู้แทนชมรม Compliance ชมรม Back Office Operation และชมรม Information Technology เพื่อเสนอแนวทางปฏิบัติงานที่เหมาะสมในการดำเนินการเพื่อเสนอให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ พิจารณาต่อไป

2. ส่งเสริมการปฏิบัติงานของสมาชิกให้เป็นไปตามกฎหมายคุ้มครองข้อมูลส่วนบุคคล

- **จัดทำสรุปลักษณะสำคัญแนวทางปฏิบัติ จำนวน 2 ฉบับเผยแพร่สมาชิก** ได้แก่แนวทางการขอความยินยอมจากเจ้าของข้อมูลส่วนบุคคล และการแจ้งวัตถุประสงค์และรายละเอียดในการเก็บรวบรวมข้อมูลส่วนบุคคล ซึ่งเผยแพร่เมื่อวันที่ 7 มิถุนายน 2565 โดยแนวทางทั้งสองเป็นไปตามที่สำนักงานคณะกรรมการคุ้มครองข้อมูลส่วนบุคคลนำเสนอตั้งแต่นั้น

- **เตรียมการจัดอบรมให้สมาชิกเพื่อตรวจสอบความครบถ้วนของสิ่งที่ภาคธุรกิจต้องดำเนินการ** โดยจัดทำร่างหัวข้อการอบรมและสอบถามความเห็นเพิ่มเติมจากผู้แทนชมรม Compliance และ Back Office Operation แล้ว เนื้อหาการอบรมประกอบด้วยความคืบหน้าของกฎหมาย Check List สิ่งที่ต้องดำเนินการและแนวทางดำเนินการที่ถูกต้องเหมาะสม คาดว่าจะจัดให้มีการอบรมในเดือนพฤศจิกายน

- **ทบทวนตัวอย่างข้อมูลที่บริษัทหลักทรัพย์ (บล.) อาจจัดเก็บใช้ และเปิดเผยเพื่อปฏิบัติให้เป็นไปตามเกณฑ์ Principle Based ของสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (สำนักงาน ก.ล.ต.)** เพื่อให้สามารถอ้างอิงกฎหมายในการเก็บรวบรวม ใช้ และเปิดเผยได้ ซึ่งสมาคมเผยแพร่ให้สมาชิกรับทราบแล้ว อย่างไรก็ตามสำนักงาน ก.ล.ต. ได้หารือกับสมาคมเพิ่มเติมเพื่อทบทวนตัวอย่างข้อมูล หลักเกณฑ์ที่อ้างอิง และให้ระบุวัตถุประสงค์การเก็บข้อมูลแต่ละรายการอย่างชัดเจนอีกครั้ง รวมถึงให้สมาคมปรับปรุงข้อความสำหรับสื่อสารกับสมาชิกเพื่อยืนยันว่าการปฏิบัติให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ของสำนักงาน ก.ล.ต. ไม่ได้ต้องการเก็บข้อมูลต่างตัวอย่างเท่านั้น ทั้งนี้ บล. อาจพิจารณาไม่จัดเก็บข้อมูลตามตัวอย่างทั้งหมดหรือบางส่วนได้ หากเก็บข้อมูลอื่นทดแทน และ/หรือเพิ่มเติมนอกเหนือจากตัวอย่าง โดย บล. ยังคงต้องดำเนินการตามกฎหมายและกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง

- **พิจารณาแนวทางการนำส่งข้อมูลระหว่าง บล. และสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย (TBMA)** เพื่อให้ บล. สามารถนำส่งข้อมูลการซื้อขายตราสารหนี้เพื่อการกำกับดูแลและการตรวจสอบของ TBMA ได้โดยเป็นไปตามกฎหมายคุ้มครองข้อมูลส่วนบุคคลและป้องกันไม่ให้เกิดความเสี่ยงในการละเมิดสิทธิของเจ้าของข้อมูล

ส่วนบุคคล ปัจจุบันอยู่ระหว่างยืนยันความเข้าใจในการอ้างอิงกฎหมายกับสำนักงาน ก.ล.ต.

3. เตรียมความพร้อมสมาชิกเพื่อรองรับการปฏิบัติให้เป็นไปตามกฎหมาย FATCA และ CRS

- **ติดตามและเผยแพร่การเปิดรับฟังความเห็นในการร่างพระราชบัญญัติ CRS ครั้งที่ 2** ซึ่งได้ประชาสัมพันธ์ให้สมาชิกเข้าร่วม ซึ่งมีประเด็นสำคัญที่ต้องติดตามรายละเอียด ได้แก่ ผลบังคับใช้ของกฎหมายไทย และ Grace Period เนื่องจากส่งผลให้ บล. ต้องจัดให้ลูกค้าลงนามใน Self-Certification สำหรับทุกบัญชีที่เปิดใหม่ภายหลังกฎหมายมีผลใช้บังคับ ข้อมูลที่ต้องรายงานสำหรับบัญชีที่เปิดก่อนกฎหมายมีผลใช้บังคับ และแนวปฏิบัติกรณีมีการประกาศรายชื่อประเทศคู่สัญญาเพิ่มเติมในภายหลัง เป็นต้น

- **เตรียมการจัดอบรมให้สมาชิกเพื่อเตรียมความพร้อมก่อนกฎหมายมีผลใช้บังคับ** โดยรวบรวมหัวข้อการอบรมประกอบด้วยความคืบหน้าของกฎหมาย สิ่งที่ต้องดำเนินการและวิธีการดำเนินการที่ถูกต้อง (Implementation) ปัจจุบันอยู่ระหว่างประสานงานเพื่อขอวิทยากรจากกรมสรรพากร โดยเบื้องต้นคาดว่าจะจัดอบรมได้ในช่วงต้นเดือนพฤศจิกายน

- **ผลักดันแนวปฏิบัติที่ไม่เป็นอุปสรรคและภาระเกินความจำเป็นต่ออุตสาหกรรม** เพื่อรองรับกฎหมาย CRS โดยอยู่ระหว่างรวบรวมประเด็นที่ต้องหารือกับกรมสรรพากรเพิ่มเติมเพื่อกำหนดแนวทางที่ชัดเจน อาทิ รายละเอียด Local Guideline ของธุรกิจหลักทรัพย์ แนวทางการดำเนินการกรณีลูกค้าไม่ให้ความร่วมมือในการทำ CDD การเปิดบัญชีเพื่อทำธุรกรรมเพิ่มเติมของลูกค้ารายเดิม และการกำหนด Grace Period เป็นต้น

4. ส่งเสริมการปฏิบัติงานของสมาชิกให้เป็นไปตามกฎหมายฟอกเงิน

- **ผลักดันและขอผ่อนผันวิธีการยืนยันตัวตนลูกค้าเพื่อให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ของสำนักงานป้องกันและปราบปรามการฟอกเงิน (สำนักงาน ป.ป.ง.)** เกี่ยวกับข้อกำหนดให้ถ่ายภาพลูกค้าเพื่อยืนยันตัวตน ซึ่งเป็นอุปสรรคสำหรับธุรกรรม IPO/RO/Tender Offer ผ่านช่องทางออนไลน์ โดยเสนอหลักการ ดังนี้ (1) ขอผ่อนผันให้ยืนยันตัวตนลูกค้าภายหลังการทำธุรกรรมได้ และเสนอให้มีการกำกับดูแลเท่าที่จำเป็นตามความเสี่ยงด้านการฟอกเงินของธุรกิจตลาดทุนที่อยู่ในระดับปานกลาง (2) สำหรับลูกค้าของ บล. อื่น ซึ่งผ่านการทำ KYC ยืนยันตัวตนมาแล้ว และมีข้อตกลงการพึ่งพาบุคคลที่สามให้ทำธุรกรรมได้โดยไม่ต้องถ่ายภาพ และ (3) พัฒนาระบบกลางเพื่อการยืนยันตัวตนลูกค้า โดยสมาคมจะนำข้อเสนอ (1) ไปหารือกับสำนักงาน ป.ป.ง. ต่อไป

- **เข้าร่วมสัมมนายุทธศาสตร์ด้าน AML/CFT และผลการประเมินความเสี่ยงระดับชาติ (NRA)**

- **ยุทธศาสตร์ด้าน AML/CFT ประจำปี 2565 - 2570** ซึ่งแบ่งออกเป็น 6 ด้าน มุ่งเน้นการดำเนินงานเชิงรุกให้สอดคล้องกับมาตรฐานสากล ส่งเสริมการกำกับดูแล และพัฒนาองค์ความรู้ด้านนวัตกรรมและผลิตภัณฑ์ใหม่

- **NRA ฉบับที่ 3 ประจำปี 2565** โดยความผิดเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ที่ไม่เป็นธรรมชาติมีความเสี่ยงปานกลาง และธุรกิจ



การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของงานกำกับดูแลสมาชิก

ซื้อขายหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเป็นช่องทางที่มีความเสี่ยงต่ำ ซึ่ง บล. มีหน้าที่ต้องนำผลการประเมิน NRA ไปเป็นปัจจัยส่วนหนึ่งในการบริหารและบรรเทาความเสี่ยงขององค์กร

- **ร่วมประชุมและให้ความเห็นในการประชุมคณะกรรมการขับเคลื่อนยุทธศาสตร์ด้าน AML/CFT** โดยมีวาระที่สำคัญได้แก่ ความคืบหน้าร่างพระราชบัญญัติข้อมูลผู้ได้รับผลประโยชน์ที่แท้จริง และความคืบหน้าร่างพระราชบัญญัติ ปปง. ซึ่งอยู่ระหว่างการพิจารณาของส่วนงานที่เกี่ยวข้อง การกำหนดตัวชี้วัดการดำเนินการตามยุทธศาสตร์ AML/CFT ซึ่งให้วัดความสำเร็จด้านการอบรมความเสี่ยงในระดับผู้มีหน้าที่รายงานในปี 2565 โดยสมาคมได้แจ้งถึงอุปสรรคในการเตรียมข้อมูล สำนักงาน ปปง. จึงกำหนดให้รายงานตัวชี้วัดปี 2565 ในระดับอุตสาหกรรมตามเดิม และพิจารณาจัดทำแบบกรรายงานเพิ่มเติมสำหรับปี 2566 ต่อไป

- **สอบทานและแก้ไขการรายงานผลการดำเนินการตามแผนปฏิบัติการด้าน AML/CFT** ประจำปีงบประมาณ 2565 ของชมรม Compliance เพื่อรายงานต่อสำนักงาน ปปง. สำหรับตัวชี้วัดในการจัดอบรมเกี่ยวกับการประเมินความเสี่ยงด้าน AML/CFT ซึ่งชมรม Compliance ได้จัดให้มีการอบรมอย่างสม่ำเสมอ ส่งผลให้ภาคธุรกิจหลักทรัพย์ดำเนินการเป็นไปตามเป้าหมายตัวชี้วัดโครงการของสำนักงาน ปปง. แล้ว

5. เข้าร่วมหรือและให้ความเห็นต่อการใช้งานระบบ ESUBMISSION Phase II ของสำนักงาน ก.ล.ต. ซึ่งมีข้อเสนอที่สำคัญ ดังนี้ (1) ควรทบทวนผู้มีหน้าที่ลงนามในรายงานให้เหมาะสมตามความจำเป็น (2) ควรทบทวนการกำหนดให้ผู้มีอำนาจลงนามต้องยืนยันตัวตนด้วย OTP สำหรับการรายงานแต่ละฉบับ (3) ควรกำหนดให้มี Company Account มากกว่า 1 บัญชี และ (4) ควรเพิ่มช่องทางการยืนยันตัวตนให้ดำเนินการได้สะดวกขึ้น

6. ให้ความเห็นต่อการกำหนดให้บุคลากรในธุรกิจตลาดทุนเป็นเจ้าพนักงานของรัฐ จากร่างที่จะการกำหนดให้คณะกรรมการและผู้จัดการกองทุนส่งเสริมการพัฒนาตลาดทุน (CMDF) คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ คณะกรรมการกำกับตลาดทุน และเลขาธิการสำนักงาน ก.ล.ต. เป็นเจ้าพนักงานของรัฐ ซึ่งห้ามเข้าไปมีส่วนได้ส่วนเสียในธุรกิจที่อยู่ภายใต้การกำกับดูแล โดยสมาคมมีความเห็นและข้อเสนอแนะว่าบุคคลดังกล่าวไม่ควรรวมอยู่ในเจ้าพนักงานของรัฐ (ยกเว้นเลขาธิการสำนักงาน ก.ล.ต.) เนื่องจากผู้ทำหน้าที่ในตำแหน่งดังกล่าวต้องมีความเชี่ยวชาญและประสบการณ์ในตลาดทุนอย่างมาก ข้อกำหนดดังกล่าวอาจส่งผลให้ผู้ที่อยู่ในตำแหน่งในปัจจุบันต้องลาออก และทำให้การสรรหาผู้ที่มีคุณสมบัติเป็นไปได้ยากขึ้น กฎหมายหลักทรัพย์ได้มีกำหนดกระบวนการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์ที่มีประสิทธิภาพแล้ว และหากจำเป็นต้องกำหนดเพิ่มควรให้หน่วยงานที่เกี่ยวข้องเป็นผู้ดำเนินการ

7. ทหหรือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้องเพื่อกำหนดแนวทางป้องกันการกระทำในลักษณะแอบอ้างหลอกลวงเกี่ยวกับการลงทุน ร่วมกับสำนักงานตำรวจแห่งชาติ (สตช.) สำนักงาน ก.ล.ต. ตลาดหลักทรัพย์ฯ และสภาธุรกิจตลาดทุน และได้ข้อสรุปในการทำความเข้าใจระหว่างภาครัฐและเอกชนเพื่อร่วมมือป้องกัน

การหลอกลวงในอนาคตโดยปัจจุบัน สตช. ได้ร่วมมือกับสมาคมธนาคารไทยกำหนดแนวทางการตรวจสอบบัญชีธนาคารที่มีฉ้อฉลใช้เป็นช่องทางรับเงินทั้งหมดแล้ว

8. เข้าร่วมสัมมนาโครงการประเมินผลสัมฤทธิ์ในการบังคับใช้พระราชบัญญัติว่าด้วยการป้องกันและปราบปรามการทุจริต เพื่อประเมินการบรรลุวัตถุประสงค์ของกฎหมาย ความคุ้มค่ากับภาระแก่รัฐและประชาชน และผลกระทบด้านความไม่เป็นธรรมทั้งในด้านการป้องกัน การปราบปราม การตรวจทรัพย์สิน โดยผลการประเมินระบุว่าด้านการปราบปรามมีคะแนนการประเมินผลสูงที่สุด ส่วนด้านการป้องกันมีคะแนนการประเมินผลน้อยที่สุด ซึ่งปัจจัยที่ส่งผลต่อความสำเร็จ คือ การมีส่วนร่วมของภาคประชาชน และการบูรณาการข่าวสาร

9. ประชาสัมพันธ์และแจ้งเตือนสมาชิกในการดำเนินการตามกฎหมาย

- **กำชับสมาชิกที่ได้รับอนุญาตจากกรมการปกครองให้อ่านข้อมูลจากบัตรประชาชนด้วย Smart Card Reader** ซึ่งกรมการปกครองเน้นย้ำให้ศึกษาทำความเข้าใจหลักเกณฑ์และใช้ประโยชน์จาก Smart Card Reader ตามที่ได้รับอนุญาตเท่านั้น โดยห้ามนำไปใช้เชิงธุรกิจ รวมถึงให้ทำความเข้าใจกฎหมายคุ้มครองข้อมูลส่วนบุคคลและให้ถือปฏิบัติโดยเคร่งครัด

- **ประชาสัมพันธ์ให้สมาชิกให้ความเห็นต่อพระราชบัญญัติหลักประกันทางธุรกิจ** เพื่อประกอบการประเมินผลสัมฤทธิ์ของกฎหมาย และเพื่อให้การทบทวนปรับปรุงกฎหมายเป็นไปอย่าง รอบคอบ

10. สนับสนุนงานและกำหนดขั้นตอนวิธีปฏิบัติในเลือกตั้งกรรมการตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยปี 2565 โดยสมาคม ได้จัดทำแนวทางการเลือกตั้ง รวมถึงจัดการประชุมคณะกรรมการสรรหา ติดตามข้อมูลจากผู้สมัคร หรือตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อเสนอแนวทางการจัดการและแจ้งข้อมูลให้สมาชิกทราบ พร้อม เชิญชวนผู้บริหารระดับสูงของสมาชิกเข้าร่วมการประชุมและสอบถามผู้สมัครเพิ่มเติมในวันเลือกตั้งในวันที่ 21 กรกฎาคม 2565



การสนับสนุน ESG ในตลาดทุนไทย

Highlight

- การดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน โดยคำนึงถึงการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และบรรษัทภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) เป็นหนึ่งในเทรนด์หลักที่ทั่วโลกต่างให้ความสำคัญในช่วงหลายปีที่ผ่านมา
- ในปี 2564 หน่วยงานกำกับดูแลในภาคการเงินได้ร่วมกันจัดตั้งคณะทำงานด้านความยั่งยืนในภาคการเงิน (Working Group on Sustainable Finance) เพื่อร่วมมือกันกำหนดทิศทางการดำเนินการด้านการเงินเพื่อความยั่งยืนในภาคการเงินไทยที่ชัดเจนและสอดคล้องกัน
- หลักทรัพย์ประเภทต่างๆ ที่เกี่ยวกับด้านความยั่งยืนในไทย เริ่มมีความหลากหลายและมีจำนวนเพิ่มมากขึ้นในช่วงที่ผ่านมา ทั้งในส่วนหุ้นยั่งยืน กองทุนยั่งยืน และตราสารหนี้ด้านความยั่งยืน
- ทางด้านของความต้องการลงทุน (Demand) นักลงทุนสถาบันในประเทศให้ความสำคัญกับการลงทุนในกิจการที่ประกอบธุรกิจตามหลักความยั่งยืนมากขึ้น
- ทุกภาคส่วนในตลาดทุนไทยต่างให้ความสำคัญในการสนับสนุนและสร้างการตระหนักรู้ เรื่อง ESG ในส่วนสมาคมฯ เองได้ดำเนินกิจกรรมสนับสนุนต่างๆ อย่างต่อเนื่อง รวมถึงเมื่อเร็วๆ นี้ ได้จัดทำแบบสำรวจการนำปัจจัยด้าน ESG มาประกอบการจัดทำบทวิเคราะห์หลักทรัพย์ เพื่อรวบรวมปัญหา/อุปสรรคสำหรับหาแนวทางสนับสนุนการนำปัจจัย ESG มาประกอบการจัดทำบทวิเคราะห์ในอนาคต

แนวคิดในการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน โดยคำนึงถึงการดำเนินงานด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และ บรรษัทภิบาล (Environmental, Social and Governance: ESG) เป็นหนึ่งในเทรนด์หลักที่ทั่วโลกต่างให้ความสำคัญในช่วงหลายปีที่ผ่านมา โดยในปี 2549 ผู้ลงทุนสถาบันทั่วโลกได้รวมตัวกันลงนาม **Principles for Responsible Investment (PRI Signatory)** ซึ่งเป็นหลักปฏิบัติการลงทุนที่มีความรับผิดชอบต่อในระดับสากลที่ได้รับการสนับสนุนจากองค์การสหประชาชาติ (United Nations) เพื่อผนวกประเด็นเรื่อง ESG เข้าด้วยกัน และนำไปใช้ในกระบวนการตัดสินใจลงทุนตลอดจนการมีส่วนร่วมของผู้ถือหุ้น (Active Ownership) ซึ่งเป็นโครงการภาคสมัครใจโดยผู้ที่ร่วมลงนามตกลงที่จะปฏิบัติตามหลักการลงทุนที่รับผิดชอบต่อ ทั้ง 6 ประการ¹

ทั้งนี้ นับตั้งแต่เริ่มต้นในปี 2549 จนถึงปัจจุบัน จำนวน PRI Signatory และมูลค่าสินทรัพย์ภายใต้การบริหารการจัดการลงทุนอย่างยั่งยืน (AUM) ของกลุ่ม PRI Signatory ปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างต่อเนื่อง โดยข้อมูลจาก PRI Signatory Update (July to September 2022) พบว่า ณ สิ้นเดือนกันยายนที่ผ่านมา มีจำนวน PRI Signatory มากกว่า 5.1 พันราย และมูลค่า AUM รวมกันสูง

ถึง 121 ล้านล้านเหรียญสหรัฐ เมื่อเทียบกับที่เริ่มต้นในปี 2549 ที่มีมูลค่าเพียง 5 ล้านล้านเหรียญสหรัฐ (ประมาณ 170 ล้านล้านบาท) โดยประเทศสหรัฐอเมริกา มีจำนวนมากที่สุด 1,060 ราย รองลงมา ได้แก่ ประเทศอังกฤษและฝรั่งเศสที่ 854 และ 392 ราย ตามลำดับ

สำหรับในประเทศไทย สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (สำนักงาน ก.ล.ต.) ได้ประกาศหลักธรรมาภิบาลการลงทุน (Investment Governance Code: I Code) เพื่อเป็นหลักปฏิบัติสำหรับการบริหารจัดการลงทุนของผู้ลงทุนสถาบันตามแนวทางสากลตั้งแต่ปี 2560 ซึ่งในปัจจุบันมีผู้ลงทุนสถาบัน ที่ประกาศรับ I Code 78 ราย แบ่งเป็นองค์กรของรัฐ 6 ราย/ บริษัทหลักทรัพย์จัดการลงทุน (บลจ.) 30 ราย/ บริษัทหลักทรัพย์ 11 ราย/บริษัทประกัน 14 ราย/ กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ 17 ราย นอกจากนั้น ในปี 2562 สำนักงานก.ล.ต.ร่วมกับองค์กรต่าง ๆ 12 แห่งในตลาดทุนพร้อมใจกันดำเนิน “โครงการเสริมสร้างตลาดทุน ธรรมภิบาลเฉลิมพระเกียรติ เนื่องในโอกาสมหามงคลพระราชพิธีบรมราชาภิเษก” เพื่อเชิญชวนให้ทุกภาคส่วนในตลาดทุนร่วมประกาศตนเป็นองค์กรที่ดำเนินกิจการด้วยความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม ซึ่งสอดคล้องกับเป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน (SDGs) ขององค์การสหประชาชาติ โดยมีระยะเวลาดำเนินโครงการ 3 ปี

¹ หลักปฏิบัติที่ 1: พึงนำประเด็นด้าน ESG มาประกอบการวิเคราะห์และการตัดสินใจลงทุน / หลักปฏิบัติที่ 2: พึงใช้สิทธิในฐานะผู้ถือหุ้นอย่างจริงจัง และนำประเด็นด้าน ESG เป็นส่วนหนึ่งของการกำหนดนโยบาย และหลักปฏิบัติการใช้สิทธิในฐานะผู้ถือหุ้น/ หลักปฏิบัติที่ 3: พึงสนับสนุนให้บริษัทต่างๆ ที่เข้าไปลงทุน เปิดเผยข้อมูลด้าน ESG/ หลักปฏิบัติที่ 4: พึงส่งเสริมประเด็นด้าน ESG ให้เกิดการยอมรับและการปฏิบัติในอุตสาหกรรมการลงทุน/ หลักปฏิบัติที่ 5: พึงให้ความร่วมมือในการนำหลักปฏิบัติการลงทุนที่รับผิดชอบต่อมาใช้ปฏิบัติ/ หลักปฏิบัติที่ 6: พึงรายงานข้อมูลข่าวสารความคืบหน้าในการดำเนินงานตามหลักปฏิบัติการลงทุนที่รับผิดชอบต่อ

Capital Markets Note

ในปี 2564 หน่วยงานกำกับดูแลในภาคการเงินได้ร่วมกันจัดตั้งคณะทำงานด้านความยั่งยืนในภาคการเงิน (Working Group on Sustainable Finance) ซึ่งประกอบด้วย สำนักงานเศรษฐกิจการคลัง ธนาคารแห่งประเทศไทย สำนักงาน ก.ล.ต. สำนักงานคณะกรรมการกำกับและส่งเสริมการประกอบธุรกิจประกันภัย และตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) เพื่อร่วมมือกันกำหนดทิศทางการดำเนินการด้านการเงินเพื่อความยั่งยืนในภาคการเงินไทยที่ชัดเจนและสอดคล้องกัน (Sustainable Finance Initiatives for Thailand) โดยได้ระบุแนวทางขับเคลื่อน 5 ข้อ ดังนี้

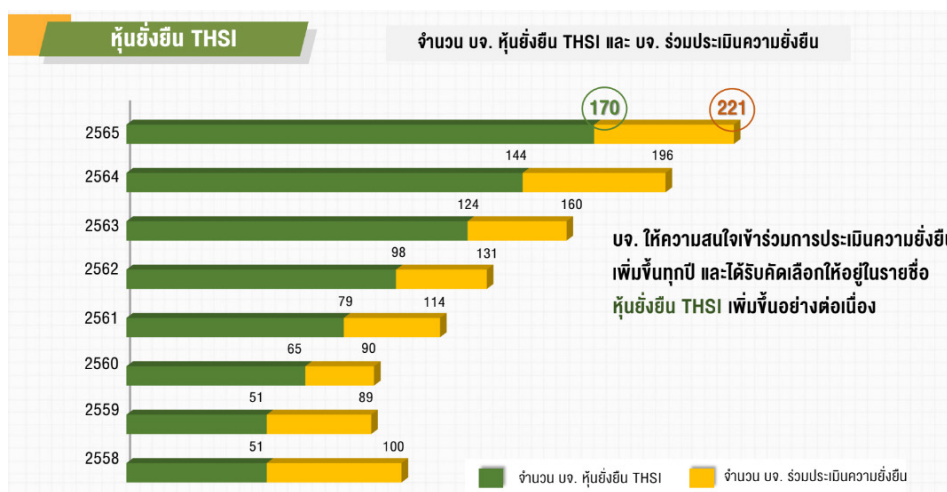
- 1) Developing a Practical Taxonomy: การกำหนดนิยามและจัดหมวดหมู่โครงการหรือกิจกรรมในภาคเศรษฐกิจที่ยั่งยืนและเป็นมาตรฐานเดียวกัน
- 2) Improving the Data Environment: การเปิดเผยข้อมูล ESG ที่มีคุณภาพ สอดคล้องกับมาตรฐานสากล
- 3) Implementing Effective Incentives: การสร้างมาตรการจูงใจ (Incentives) เพื่อกระตุ้นให้เกิดตลาดและการลงทุนในผลิตภัณฑ์การเงินเพื่อความยั่งยืน
- 4) Creating Demand-led Products and Services: การสร้างสภาพแวดล้อมที่เอื้อให้ผู้เล่นใช้ประโยชน์เครื่องมือทางการเงินที่ตอบโจทย์ด้านความยั่งยืน ปรับลดกฎเกณฑ์เพื่อลดภาระการออกผลิตภัณฑ์/บริการใหม่
- 5) Building Human Capital: การสร้างทรัพยากรบุคคลในภาคการเงินที่มีคุณภาพและมียุทธศาสตร์ความรู้ในการผลักดันงานด้านการเงินเพื่อความยั่งยืนให้เห็นผลเป็นรูปธรรม

หลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องด้านความยั่งยืนในไทย มีความหลากหลายและมีจำนวนเพิ่มมากขึ้น ทั้งในส่วนหุ้นยั่งยืน กองทุนยั่งยืน และตราสารหนี้ด้านความยั่งยืน ทางด้านความต้องการลงทุน นักลงทุนสถาบันในประเทศให้ความสำคัญกับการลงทุนในกิจการที่ประกอบธุรกิจตามหลักความยั่งยืนมากขึ้น

ทางด้านของผลิตภัณฑ์ (Supply) หลักทรัพย์ประเภทต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับด้านความยั่งยืนเริ่มมีความหลากหลายและมีจำนวนเพิ่มมากขึ้น สะท้อนถึงการตระหนักถึงความสำคัญในเรื่อง ESG ของกิจการ ในส่วนของตราสารทุน ตลาดหลักทรัพย์ฯ ประกาศรายชื่อหุ้นยั่งยืน THSI (Thailand Sustainability Investment)² โดยนับแต่เริ่มประกาศรายชื่อในปี 2558 มีบริษัทจดทะเบียนสนใจเข้าร่วมการประเมินความยั่งยืนเพิ่มขึ้นทุกปี ในปี 2565 มีบริษัทจดทะเบียน (บจ.) ผ่านการคัดเลือก 170 บริษัท เพิ่มขึ้นจาก 144 บริษัทในปีก่อนหน้า (ดังรายละเอียดตามภาพที่ 1) สะท้อนให้เห็นว่า บจ.ไทยให้ความสำคัญและนำแนวคิด ESG ไปปรับใช้ในกระบวนการทางธุรกิจ

อย่างเข้มข้นมากขึ้น โดยบจ.ในกลุ่มนี้มี Market Cap. ที่ประมาณ 14 ล้านล้านบาท หรือ 72% ของ Market Cap. ทั้งหมดของ SET นอกจากนั้นแล้ว ในระดับสากล บจ.ในตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่ได้รับคัดเลือกให้อยู่ใน Dow Jones Sustainability Emerging Markets Index มีจำนวนถึง 25 บริษัท (ณ ตุลาคม 2565) จากจำนวนทั้งหมด 109 บริษัท โดยมี Market Cap. ประมาณ USD229,684 million คิดเป็นสัดส่วน Index weight ที่ประมาณ 14% และมีจำนวนบริษัทที่ได้รับคัดเลือกเข้าสู่ดัชนี MSCI ESG Universal Index 42 บริษัท และ FTSE4Good Emerging Markets Index 39 บริษัท มากเป็นอันดับที่ 1 ของอาเซียน

ภาพที่ 1: จำนวนบจ.หุ้นยั่งยืน THSI และจำนวนบจ.ที่ร่วมประเมินความยั่งยืน



² หุ้นยั่งยืน เป็นรายชื่อของบริษัทจดทะเบียนที่ดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืนโดยคำนึงถึงสิ่งแวดล้อม สังคม และบรรษัทภิบาล (ESG) คัดเลือกจาก บจ. ที่สมัครใจเข้าร่วมตอบแบบประเมินความยั่งยืน ซึ่งประกอบด้วยตัวชี้วัดทั่วไปสำหรับทุกบริษัทรวม 19 หมวด และตัวชี้วัดตามลักษณะการประกอบธุรกิจตาม 8 กลุ่มอุตสาหกรรม

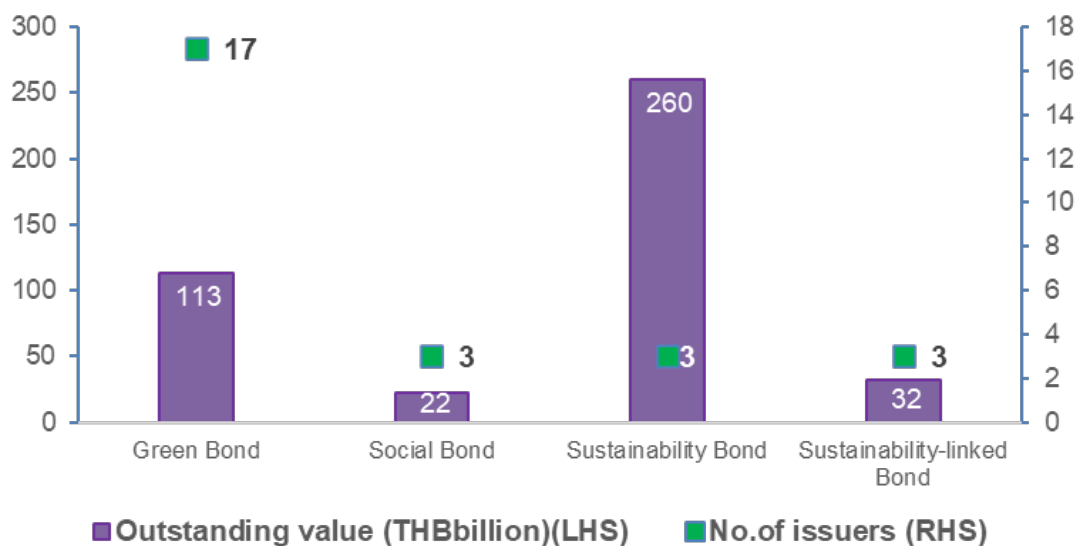
Capital Markets Note

ในส่วนของหน่วยลงทุน ข้อมูลจาก Morningstar พบว่า กองทุนยั่งยืนในไทยมีมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ 5.4 หมื่นล้านบาท (ณ.มิ.ย.65) ทั้งนี้ จำนวนกองทุนรวมที่ได้รับการจัดอันดับ Morningstar Sustainability Rating ที่ระดับสูงสุด (5 ลูกโลก) มีจำนวนเพิ่มขึ้นเรื่อยๆ โดยในปัจจุบันมีจำนวนทั้งสิ้น 139 กอง จาก 66 กองในปี 2563

ในส่วนของตราสารหนี้ การออกตราสารหนี้ด้านความยั่งยืน หรือที่เรียกว่า ESG (Environmental, Social and Governance) Bond ประกอบด้วย ตราสารหนี้กลุ่ม ESG เดิม 3 ประเภท ได้แก่ ตราสารหนี้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond)³ ตราสารหนี้เพื่อพัฒนาสังคม (Social Bond) ตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) และประเภทใหม่ 1 ประเภทที่เรียกว่า

Sustainability-Linked Bond (SLB) หรือ ตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืนซึ่งมีเงื่อนไขให้ผลตอบแทนขึ้นอยู่กับตัวชี้วัดและเป้าหมายโดยรวมของบริษัทที่จะทำให้เกิดความยั่งยืนต่อสิ่งแวดล้อมและสังคม มีการเติบโตอย่างต่อเนื่อง โดยข้อมูลจาก ThaiBMA ณ 21 พ.ย.พบว่า มีมูลค่ายอดคงค้างของ ESG Bond ที่ขึ้นทะเบียนกับ ThaiBMA รวมทั้งสิ้นประมาณ 4.3 แสนล้านบาท (ประมาณ 3% ของยอดคงค้าง ตราสารหนี้ที่ขึ้นทะเบียนทั้งหมด) ประกอบด้วย Green Bond 1.13 แสนล้านบาท Social Bond 2.2 หมื่นล้านบาท Sustainability Bond 2.6 แสนล้านบาท และ Sustainability Bond 3.2 หมื่นล้านบาท ตามลำดับ ซึ่งในจำนวนนี้ Green Bond มีจำนวนผู้ออก 17 ราย ขณะที่ตราสารหนี้อื่นมีผู้ออกอยู่ที่ประเภทละ 3 ราย ดังรายละเอียดตามภาพที่ 2 ด้านล่าง

ภาพที่ 2: Outstanding of ESG Bonds & No. of issuers



Source : ThaiBMA

ขณะที่ทางด้านของความต้องการลงทุน (Demand) นักลงทุนสถาบันในประเทศให้ความสำคัญกับการลงทุนในกิจการที่ประกอบธุรกิจตามหลักความยั่งยืนมากขึ้น โดยในปี 2564 กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ (กบข.) ร่วมกับนักลงทุนสถาบันและภาคธนาคาร รวม 43 ราย ที่มีสินทรัพย์ภายใต้การบริหารรวมกันกว่า 40.18 ล้านล้านบาท ประกาศเจตนารมณ์ “Sustainable Thailand 2021” สนับสนุนการนำหลักการลงทุนอย่างรับผิดชอบ (PRI) และหลักการการธนาคารที่มีความรับผิดชอบต่อสังคม มาใช้เป็นกรอบในการดำเนินงาน ซึ่งจะต้องคำนึงถึงผลกระทบทางสังคมและสิ่งแวดล้อม และต้องส่งเสริมการลงทุนในกิจการที่ยึดถือในหลักธรรมาภิบาลควบคู่ไปด้วย (Doing well while doing good) อันจะนำไปสู่การขับเคลื่อนการลงทุนอย่างรับผิดชอบ ตลอดจนการขยายตัวทางเศรษฐกิจและสังคมอย่างยั่งยืน

³ Green Bond หมายถึง ตราสารหนี้ที่ระดมทุนเพื่อโครงการที่เป็นมิตรกับสิ่งแวดล้อม/ Social Bond หมายถึง ตราสารหนี้ที่ระดมทุนเพื่อนำเงินไปใช้ในการแก้ไขปัญหาและพัฒนาสังคม ให้น่าอยู่/ Sustainability Bond หมายถึง ตราสารหนี้ที่ระดมทุนเพื่อโครงการที่เป็นประโยชน์ต่อสิ่งแวดล้อมและสังคมอย่างยั่งยืน (ที่มา: ThaiBMA)



Capital Markets Note

ทุกภาคส่วนในตลาดทุนไทยต่างให้ความสำคัญในการสนับสนุนและสร้างการตระหนักรู้ในเรื่อง ESG ในส่วนของสมาคมฯเอง ได้ดำเนินกิจกรรมต่างๆ รวมถึงทำแบบสำรวจการนำปัจจัยด้าน ESG มาประกอบการจัดทำบทวิเคราะห์หลักทรัพย์ เพื่อรวบรวมปัญหา/อุปสรรคสำหรับหาแนวทางในการสนับสนุนการนำปัจจัย ESG มาประกอบการจัดทำบทวิเคราะห์ใน อนาคตต่อไป

กล่าวได้ว่าแนวคิดเกี่ยวกับ ESG ได้กลายเป็นกระแสหลักของโลก ทั้งในการดำเนินธุรกิจและการพิจารณาตัดสินใจลงทุน ทุกภาคส่วนในตลาดทุนไทยต่างให้ความสำคัญในการสนับสนุนและสร้างการตระหนักรู้ในเรื่องของ ESG ไม่ว่าจะเป็นหน่วยงานกำกับดูแล และในส่วนของสมาคมฯเอง

● สำนักงาน ก.ล.ต. ได้มีการออกเกณฑ์หลายอย่างที่สนับสนุนด้าน ESG เช่น กำหนดให้ บจ. ไทยมีการเปิดเผยข้อมูลด้านความยั่งยืน ในรายงานผลประกอบการในรูปแบบ 56-1 One Report ตั้งแต่ปี 2565 เป็นต้นไป/การสนับสนุนให้มีการออก ESG Products โดยยกเว้นค่าธรรมเนียมการยื่นคำขออนุญาตและการยื่นแบบแสดงรายการข้อมูลการเสนอขาย (filing) สำหรับการออกเสนอขายตราสารหนี้ หรือหุ้นกู้กลุ่มยั่งยืนจนถึง พฤษภาคม 2568/ การจัดทำมาตรฐานสากลในการเปิดเผยข้อมูลด้าน ESG ของผลิตภัณฑ์การลงทุน (Global ESG Disclosure Standards for Investment Products ฉบับภาษาไทย/ การกำหนดให้หลักสูตร ESG เป็นหลักสูตรภาคบังคับสำหรับการต่ออายุความเห็นขอผู้แนะนำการลงทุน ผู้วางแผนการลงทุน นักวิเคราะห์การลงทุนและผู้จัดการกองทุนตั้งแต่ปี 2565 เป็นต้นไป โดยให้เป็นความรู้ด้าน ESG อย่างน้อย 3 ชั่วโมง เป็นต้น

● ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ได้ดำเนินกิจกรรมสนับสนุน ESG ในด้านต่างๆ เช่น จัดหลักสูตรอบรมสัมมนา คู่มือแนวปฏิบัติ การประเมินผลการดำเนินงานด้าน ESG และการให้คำปรึกษาเชิงลึกในประเด็นต่างๆ เพื่อยกระดับการดำเนินงานด้าน ESG ของบริษัทจดทะเบียน และส่งเสริมการลงทุนที่ยั่งยืน (Sustainable Investment) ในกลุ่มผู้ลงทุนและผู้ประกอบวิชาชีพ เช่น ทำการประเมินและเผยแพร่รายชื่อยั่งยืน จัดทำและเผยแพร่ดัชนีด้านความยั่งยืน SETTHSI จัดทำข้อมูล ESG data platform และเผยแพร่ข้อมูล ESG Rating เพื่อให้ผู้ลงทุนและนักวิเคราะห์นำไปตัดสินใจลงทุน จัดทำหลักสูตรอบรม e-learning ที่เกี่ยวข้องกับการลงทุนอย่างยั่งยืนให้ผู้แนะนำการลงทุนและนักวิเคราะห์การลงทุน เพื่อยกระดับมาตรฐานการให้บริการ เป็นต้น

● ในส่วนของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ได้เข้าร่วมเป็น 1 ใน 12 องค์กรที่ประกาศเจตนารมณ์เข้าร่วมโครงการเสริมสร้างตลาดทุนธรรมาภิบาลเฉลิมพระเกียรติของสำนักงาน ก.ล.ต. ในปี 2562 ซึ่งนับจากนั้นสมาคมฯ ได้มีการวางแผนจัดกิจกรรมต่างๆ ภายใตกรอบ โครงการดังกล่าวเป็นระยะๆ ตัวอย่างเช่น สมาคมฯ โดยสถาบันฝึกอบรม ATI ได้จัดอบรมนักศึกษาในระดับอุดมศึกษา เพื่อปลูกฝัง ความรู้ความเข้าใจด้าน ESG ให้กับเยาวชน มีการส่งหนังสือขอความร่วมมือบริษัทสมาชิกร่วมกันผลักดันให้ธุรกิจหลักทรัพย์ดำเนินการด้านสังคมและสิ่งแวดล้อม ช่วยประชาสัมพันธ์การจัดกิจกรรม ESG ของหน่วยงานอื่นๆ รวมถึงการสนับสนุนเกณฑ์จัดทำบทวิเคราะห์ของสมาคมฯ นักวิเคราะห์หลักทรัพย์ที่กำหนดให้ควรมีการวิเคราะห์ปัจจัย ESG

ทั้งนี้ ในเดือนสิงหาคมที่ผ่านมา สมาคมฯ ได้จัดทำแบบสำรวจการนำปัจจัยด้าน ESG มาประกอบการจัดทำบทวิเคราะห์หลักทรัพย์ของบริษัทสมาชิก ซึ่งปัญหาสำคัญที่พบ ได้แก่

1. ปัญหาด้านข้อมูล เช่น ข้อมูลไม่เพียงพอ ขาดข้อมูลตัวเลขเปรียบเทียบ ขาดข้อมูลย้อนหลัง ข้อมูลค่อนข้างเป็นนามธรรม ประเมินยาก จำนวนบริษัทที่เปิดเผยมูลข้อมูลยังมีไม่มาก เป็นต้น
2. ปัญหาด้านทรัพยากร เช่น ยังไม่มีนักวิเคราะห์ที่มีความเชี่ยวชาญในเรื่องนี้ การวิเคราะห์ใช้เวลามาก
3. ปัญหาด้านมาตรฐานการวิเคราะห์ เช่น Rating Agency แต่ละแห่งมีเกณฑ์การประเมินแตกต่างกัน การให้ข้อมูลของแต่ละบริษัทมีรูปแบบแตกต่างกัน ESG Score อาจไม่สะท้อนความเป็นจริง เป็นต้น
4. ปัญหาอื่นๆ เช่น นักลงทุนรายย่อยให้ความสำคัญเรื่อง ESG Score น้อยกว่านักลงทุนสถาบัน หากปรับลดคำแนะนำอาจกระทบความสัมพันธ์กับบริษัท เป็นต้น สมาคมฯ ทำการได้รวบรวมประเด็นปัญหา/อุปสรรคที่สำคัญดังกล่าวแจ้งให้สำนักงาน ก.ล.ต. และตลาดหลักทรัพย์ฯ รับทราบ⁴ เพื่อร่วมหาแนวทางในการสนับสนุนการนำปัจจัย ESG มาประกอบการจัดทำบทวิเคราะห์ในอนาคตต่อไป

⁴ แจ้งให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ รับทราบในการประชุม CEO Networking 2022 (พ.ย. 2022)

Disclaimer:

เอกสารนี้จัดทำขึ้นโดยสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยเพื่อเผยแพร่ข้อมูลและเพื่อการศึกษาเท่านั้น ซึ่งจัดทำขึ้นจากแหล่งข้อมูลต่างๆ ที่นำเสนอ โดยข้อมูลดังกล่าวเป็นเพียงข้อมูล ณ วันที่ปรากฏในเอกสารนี้เท่านั้น จึงอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังวันดังกล่าว หรือ เมื่อข้อมูลที่เกี่ยวข้องมีการเปลี่ยนแปลง ทั้งนี้ สมาคมฯ ได้ยืนยัน ตรวจสอบ หรือรับรองความสมบูรณ์ ความถูกต้องครบถ้วน ทันกาลทันเวลาของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด สมาคมฯ ไม่รับผิดชอบต่อบุคคลใดๆ จากการเรียกร้องใดๆ ไม่ว่าในทางสัญญา ในการทำละเมิด รวมถึงความประมาท หรือเหตุอื่นใด ที่เกิดจากการตัดสินใจ หรือการกระทำใดๆ ที่เกิดจากความเชื่อถือในเอกสารดังกล่าว หรือในความเสียหาย ความสูญหาย ค่าสินไหมทดแทน หรือความรับผิดชอบใดๆ รวมถึงการสูญเสียของข้อมูลหรือผลประโยชน์ ถึงแม้ว่าสมาคมฯ จะได้รับแจ้งว่าอาจเกิดความเสียหายดังกล่าวขึ้นก็ตาม

Market & Securities Industry Statistics

Market & Securities Industry Statistics in Q3-2022

- ณ สิ้นไตรมาส 3/2565 ดัชนี SET ปิดที่ 1,589.51 จุด ลดลง 4.1% จากสิ้นปี 2564 ส่วนดัชนี mai ปิดที่ 653.29 จุด เพิ่มขึ้น 12.2% โดยปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันของ SET และ mai รวมกัน ณ ไตรมาส 3/2565 อยู่ที่ 71,210 ล้านบาท ลดลง 24.1% จากปี 2564
- มูลค่าคำสั่งตลาดตราสารหนี้ ณ สิ้นไตรมาส 3/2565 เติบโต 5% จากสิ้นปี โดยการออกหุ้นกู้ภาคเอกชนเพิ่มขึ้นอย่างมากและคาดว่าจะทำสถิติออกสูงสุดใหม่ในปี
- ณ สิ้นไตรมาส 3/2565 บล. มีจำนวนสาขาทั้งสิ้น 415 แห่ง ลดลง 9 แห่งเมื่อเทียบกับสิ้นปี 2564 และมีจำนวนการขึ้นทะเบียนและปฏิบัติหน้าที่ Investment Planer (IP) และ Investment Consultant (IC) มีจำนวนรวมกัน 8,479 ใบอนุญาต เพิ่มขึ้น 75 ใบอนุญาตจากสิ้นปี 2564 โดยในส่วนของ IC ตามโครงสร้างเดิม มีจำนวน 264 ใบอนุญาต ลดลง 7 ใบอนุญาต เป็นผลจากการย้ายไปขึ้นทะเบียนเป็น IC ตามโครงสร้างใบอนุญาตใหม่ ขณะที่ในส่วน IP เพิ่มขึ้น 50 ใบอนุญาต และ IC Complex รวมทุกประเภทเพิ่มขึ้น 32 ใบอนุญาตจากสิ้นปี 2564 ส่วน Analyst (ไม่รวม Technical) มี 408 ใบอนุญาต เพิ่มขึ้น 1 ใบอนุญาต

Market Performance					%Change	
Equity Market - SET & mai	2021	Q1-2022	Q2-2022	Q3-2022	QoQ	YTD
SET Index *	1,657.62	1,695.24	1,568.33	1,589.51	1.4%	-4.1%
mai Index*	582.13	662.91	597.65	653.29	9.3%	12.2%
Market Capitalization (mil.Bt)*	20,055,077	20,500,829	19,237,855	19,782,055	2.8%	-1.4%
Total Turnover (mil. Bt)	22,616,799	5,966,853	4,426,818	4,415,057	-0.3%	
Avg. Daily Turnover (mil. Bt)	93,846	96,240	77,663	71,210	-8.3%	-24.1%
Derivatives Market	2021	Q1-2022	Q2-2022	Q3-2022	QoQ	YTD
Total Trading Volume (contracts)	135,117,308	39,145,623	28,841,497	34,209,733	18.6%	
Avg. Daily Turnover (contracts)	560,653	631,381	505,991	551,770	9.0%	-1.6%
Open Interest (contracts)*	3,781,930	3,899,217	3,637,373	3,568,624	-1.9%	-5.6%
Bond Market – ThaiBMA	2021	Q1-2022	Q2-2022	Q3-2022	QoQ	YTD
Outright Trading Value (mil.Bt)	15,933,493	4,271,553	3,290,396	3,107,836	-5.5%	
Outright Daily Average (mil.Bt)	66,114	68,896	57,726	50,126	-13.2%	-24.2%
Outstanding Value of domestic bond (mil.Bt)*	14,732,998	14,980,708	15,060,827	15,468,873	2.7%	5.0%

Securities Industry Statistics					Change		
License Holder (unit: company)*		2021	Q1-2022	Q2-2022	Q3-2022	QoQ	YTD
Brokerage License		43	43	43	44	+1	+1
Dealer License		36	36	36	36	0	0
Derivatives Agent		43	43	43	43	0	0
Financial Advisory License		73	72	71	73	+2	0
Underwriting License		41	41	41	41	0	0
SBL License		30	30	30	30	0	0
Number of Branch (unit: branch)*		2021	Q1-2022	Q2-2022	Q3-2022	QoQ	YTD
Bangkok and Surrounding Area**		193	193	192	192	0	-1
Other Provincial Area		231	228	226	223	-3	-8
Number of IP/Analyst/IC (unit: license)*		2021	Q1-2022	Q2-2022	Q3-2022	QoQ	YTD
Analysts	Capital Market	69	72	69	69	0	0
	Securities Market	307	307	307	307	0	0
	Derivatives Market	31	33	32	32	0	+1
	Technical	87	86	86	86	0	-1
Investment Planners		831	839	855	881	+26	+50
Investment Consultants	Capital Market	0	0	0	0	0	0
	Securities Market	179	179	179	178	-1	-1
	Derivatives Market	92	85	85	86	+1	-6
	(New) Complex 1	5,054	5,070	5,053	5,076	+23	+22
	(New) Complex 2	1,720	1,693	1,681	1,666	-15	-54
	(New) Complex 3	195	203	193	208	+15	+13
	(New) IC Plain	333	353	375	384	+9	+51
Number of Investors – Equity*		2021	Q1-2022	Q2-2022	Q3-2022	QoQ	YTD
No. of Investors Accounts (unit: accounts)*		5,221,119	5,414,020	5,536,637	5,674,367	137,730	453,248
No. of Investors (unit: clients)*		3,101,457	3,198,688	3,254,368	3,326,193	71,825	224,736
Active Investors - 1month ago***		743,990	734,266	625,273	557,164	-68,109	-186,826
Number of Accounts – Derivatives*		2021	Q1-2022	Q2-2022	Q3-2022	QoQ	YTD
total Accounts*		270,494	273,353	279,246	285,368	6,122	14,874

* data at end of each period **Nonthaburi and Samutprakan province ***average data Remark: Q1-2022 data subjected to SEC Revision

Disclaimer: เอกสารนี้จัดทำขึ้นเพื่อเผยแพร่ข้อมูลและเพื่อการศึกษาเท่านั้น ซึ่งจัดทำขึ้นจากแหล่งข้อมูลต่างๆ ที่น่าเชื่อถือ โดยข้อมูลดังกล่าวเป็นเพียงข้อมูล ณ วันที่ปรากฏในเอกสารนี้เท่านั้น จึงอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังวันดังกล่าว หรือเมื่อข้อมูลที่เกี่ยวข้องมีการเปลี่ยนแปลง ทั้งนี้ สมาคมมิได้ยืนยัน ตรวจสอบ หรือรับรองความสมบูรณ์ ความถูกต้องครบถ้วน ทันกาลทันเวลา ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด สมาคมไม่รับผิดชอบต่อบุคคลใดๆ จากการเรียกร้องใดๆ ไม่ว่าในทางสัญญา ในการทำละเมิด รวมถึงความประมาท หรือเหตุอื่นใด ที่เกิดจากการตัดสินใจ หรือการกระทำใดๆ ที่เกิดจากความเชื่อใจในเอกสารดังกล่าว หรือในความเสียหาย ความสูญหาย ค่าสินไหมทดแทน หรือความรับผิดชอบใดๆ รวมถึงการสูญเสียของข้อมูลหรือผลประโยชน์ ถึงแม้ว่าสมาคมจะได้รับแจ้งว่าจะเกิดความเสียหายดังกล่าวขึ้นก็ตาม

Source: SET, TFEX, ThaiBMA, SEC