

การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

- ร่วมกับหน่วยงานและสมาชิกที่เกี่ยวข้องในการดำเนินโครงการ Digital Infrastructure for Capital Market (DIF) โดยโครงการได้ Go-Live เมื่อวันที่ 24 เมษายน 2566 และมีการประชาสัมพันธ์อย่างต่อเนื่อง รวมถึงได้จัดกิจกรรมแถลงข่าวไปเมื่อ 29 มิถุนายน 2566 ทั้งนี้ โครงการมีแผนที่จะหารือถึง Phase ถัดไปในปีนี้
- ร่วมกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (สำนักงาน ก.ล.ต.) หารือเกี่ยวกับการทบทวนและปรับปรุงหลักเกณฑ์เพื่อป้องกันเหตุการณ์ทำนองเดียวกับการซื้อขายหุ้น MORE และแนวทางการพัฒนา ศูนย์ข้อมูล Securities Bureau อย่างต่อเนื่อง
- ต้อนรับคณะผู้แทนจาก สปป.ลาว ประกอบด้วย สำนักงาน ก.ล.ต. ตลาดหลักทรัพย์ Bank of the Lao P.D.R และผู้บริหารระดับสูง จากบริษัทหลักทรัพย์ลาว จำนวน 3 บริษัท โดยมีวัตถุประสงค์ เพื่อเรียนรู้การจัดตั้งสมาคมในธุรกิจตลาดทุน รวมถึงระบบจัดอบรม Professional License เพื่อนำไปพิจารณาดำเนินการใน สปป.ลาว
- ร่วมกับผู้แทนกรรมการปกครอง ผู้แทนสำนักงาน ก.ล.ต. และ ผู้แทนตลาดหลักทรัพย์ฯ หารือประเด็นการใช้บริการ ThaiID (D.DOPA) ในการพิสูจน์และยืนยันตัวตนเพื่อการเปิดบัญชีลงทุนในตลาดทุน
- ดำเนินการเรื่องต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับสำนักงาน ก.ล.ต. ดังนี้
 - ติดตามความคืบหน้าโครงการ Regulatory Guillotine ที่สมาคมฯ เคยรวบรวมข้อเสนอจากสมาชิกรับส่งให้เมื่อปี 2565 รวมถึงเรื่องอื่นๆ ที่เคยเสนอพิจารณาในช่วงที่ผ่านมา โดยสำนักงาน ก.ล.ต. ได้จัดให้มีการประชุมเพื่อชี้แจงข้อมูลความคืบหน้าแล้ว
 - ผลักดันให้สำนักงาน ก.ล.ต. ชี้แจงแนวทางการกำกับดูแลกรณีผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์ประสงค์จะประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล
 - ร่วมกับคณะทำงานหารือประเด็นที่เสนออนุญาตเพิ่มกลุ่มผู้ลงทุนที่รับความเสี่ยงได้สูง เช่น QI, HNWI ให้ทำธุรกรรม OTC Derivatives ในประเทศได้
 - ร่วมกับคณะทำงานเข้าร่วมประชุม Focus Group การปรับเกณฑ์ NC โดยได้ให้ความเห็นและข้อมูลที่เป็นประโยชน์เพิ่มเติม ซึ่งสมาคมฯ ได้ติดตามประเด็นดังกล่าวและประสานงานให้มีการหารือเพิ่มเติมกับสำนักงาน ก.ล.ต.
 - เข้าร่วม Public Consultation โครงการ Landscape of Thai securities businesses after Covid-19 and under digital disruption โดย World Bank

- ดำเนินการเรื่องต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์ฯ ดังนี้
 - คณะกรรมการสมาคมร่วมหารือกับตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้ความเห็นในประเด็นที่สำคัญต่างๆ เช่น แผนงานเกี่ยวกับ LIVEx, Digital Asset, แนวทางการกำกับดูแลการซื้อขาย High Frequency Trading (HFT), กิจกรรม SET สัญจร และ SET in the City เป็นต้น
 - ร่วมกับสมาชิกหารือเกี่ยวกับการอนุมัติการเริ่มใช้ระบบซื้อขายใหม่ (Go / No go) ในวันที่ 8 พฤษภาคม 2566 สำหรับโครงการ New Trading System
 - ร่วมกับตลาดหลักทรัพย์ฯ หารือโครงการ Common Infrastructure for Brokers Back Office รวมถึงจัดให้มีการประชุม Workshop เพื่อหารือเกี่ยวกับ Project Management กับผู้พัฒนาระบบและตัวแทนสมาชิก
- ประชุมคณะทำงานพิจารณาประเด็นปัญหา (Pain Point) ที่เป็นอุปสรรคต่อการประกอบธุรกิจในระดับอุตสาหกรรมของธุรกิจตลาดทุนที่รวบรวมจากสมาชิก และเสนอสถาบันวิจัยเพื่อการพัฒนาประเทศไทย (TDRI) ตามโครงการ Regulatory Guillotine ของ FETCO
- ประชุมคณะทำงานพิจารณาร่างแนวทางการปฏิบัติงานสำหรับการขายหลักทรัพย์โดยที่บริษัทหลักทรัพย์ (บล.) ยังไม่มีหลักทรัพย์ในครอบครองและการขายหลักทรัพย์ที่ต้องยืมหลักทรัพย์มาเพื่อการส่งมอบ กรณีลูกค้าเป็นนักลงทุนสถาบัน รวมถึงตัวอย่างข้อความแจ้งลูกค้า ก่อนเสนอสำนักงาน ก.ล.ต. พิจารณาต่อไป
- ประชุมคณะทำงานให้ความเห็นเกี่ยวกับ (1) ค่าแปลมาตรฐาน The Common Reporting Standard (CRS) และ (2) ประเด็นปัญหาอุปสรรคด้าน CRS และข้อเสนอแนะที่รวบรวมจากสมาชิก โดยได้เข้าร่วมหารือกับสมาคมที่เกี่ยวข้อง ได้แก่ สมาคมธนาคารไทย สมาคมธนาคารนานาชาติ สมาคมบริษัทจัดการลงทุน และสมาคมประกันชีวิตไทย เพื่อให้สมาคมธนาคารไทยนำเสนอความเห็นที่ผ่านการพิจารณาจากสมาคมที่เกี่ยวข้องไปยังกรมสรรพากร
- หารือแนวทางเกี่ยวกับการจัดตั้ง Blockchain for Thai Capital Market
- ร่วมประชุม The 36th ICSA Annual General Meeting 2023 ซึ่งจัดขึ้นระหว่างวันที่ 18 - 20 มิถุนายน 2566 ณ กรุงโซล ประเทศเกาหลีใต้


INVESTMENT BANKING CLUB

ชมรมวาณิชธนกิจ สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

ชมรมวาณิชธนกิจ

การเสนอความคิดเห็น / หารือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง
สำนักงาน ก.ล.ต.
 เสนอความคิดเห็นในเรื่องต่างๆ ดังนี้



การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

- การพิจารณาคุณสมบัติของผู้ลงทุนรายใหญ่พิเศษและผู้ลงทุนรายใหญ่ โดยการผ่านแบบทดสอบความรู้ความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุนในหลักทรัพย์
- หลักการปรับปรุงหลักเกณฑ์เพื่อสนับสนุนการออกตราสารหนี้กลุ่มความยั่งยืน และการปรับปรุงข้อมูลในแบบ factsheet
- ร่างประกาศเกี่ยวกับการปรับปรุงหลักเกณฑ์การอนุญาตให้เสนอขายหลักทรัพย์ในเรื่องลักษณะการประกอบธุรกิจของบริษัทต้องไม่เป็น investment company
- หรือเรื่อง “แนวทางการชำระราคา DW ที่อ้างอิงหุ้น STARK” ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- หรือเรื่อง “แนวทางการแก้ไขปัญหาการจองโควต้า DW”
- หรือเรื่อง “การปรับปรุงหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการรับหุ้นสามัญเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนสำหรับบริษัทที่ประกอบธุรกิจในอุตสาหกรรมที่กำหนด (Market Capitalization Test)” สำนักงาน ป.ป.ง.
- ส่งผู้แทนเข้าร่วมโครงการบูรณาการการปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยการป้องกันและปราบปรามการฟอกเงินร่วมกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้องที่จังหวัดปราจีนบุรี
- สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- หรือเรื่อง “Director Pool Project” และประชาสัมพันธ์ไปยังบริษัทสมาชิกชมรมฯ
- การจัดอบรม / สัมมนา
- จัดอบรมหลักสูตรที่ปรึกษาทางการเงิน และการทดสอบความรู้สำหรับผู้ปฏิบัติงานในสายงานที่ปรึกษาทางการเงิน ครั้งที่ 1/2566
- จัดสัมมนาออนไลน์หัวข้อต่างๆ ดังนี้
 - Alternative methods of Capital Fundraising : Digital Tokens and Venture Capital
 - โครงสร้างกิจการที่ดีเพื่อ IPO
- จัดอบรมเรื่อง “Internal Control : IPO & Digital Assets Relating Activities” ผ่านระบบ e-Learning
- กิจกรรมอื่นๆ
- ร่วมกับ บ.ฟินน์คอร์ป แอดไวเซอร์ จก. เตรียมความพร้อมสำหรับโครงการการแข่งขันกรณีศึกษาด้านพาณิชย์เพื่อตลาดทุน (Capital Market Case Competition in Investment Bankint : CMCC) ตามที่ได้รับทุนสนับสนุนจากกองทุนส่งเสริมการพัฒนาดตลาดทุน (CMDF)
- จัดประชุมคณะกรรมการโครงการ CMCC ครั้งที่ 1 - 2/2566



ชมรมผู้ประกอบการสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
Futures Industry Club

ชมรมผู้ประกอบการสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

การเสนอความคิดเห็น / หรือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง
 สำนักงาน ก.ล.ต.

- ประชาสัมพันธ์การรับฟังความคิดเห็นในหลักเกณฑ์ของสำนักงาน ก.ล.ต. ได้แก่

- แนวทางการปฏิบัติงานและระบบงานที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการ SSF Block Trade
- หลักการจัดทำกฎหมายลำดับรองด้านผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (อนป.23/2566)
- หลักการกำกับดูแลสมาคมกำกับผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (อนป.22/2566)
- การจัดทำกฎหมายลำดับรองของศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและสำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับการออกกฎเกณฑ์ใช้บังคับเป็นการชั่วคราวตามมาตรา 66 และมาตรา 89 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 [อกต.19/2566]
- การประเมินผลสัมฤทธิ์ของพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 [อกต. 20/2566]
- การจัดทำกฎหมายลำดับรองของศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและสำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับการให้ความเห็นชอบการประกอบธุรกิจอื่นตามมาตรา 74 และมาตรา 89 แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 [อกต. 24/2566]
- นำส่งความเห็นของชมรมฯ ให้สำนักงาน ก.ล.ต. ได้แก่
 - หลักการกำกับดูแลสมาคมกำกับผู้ประกอบการธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (อนป.22/2566)
 - การประเมินผลสัมฤทธิ์ของพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 [อกต. 20/2566]
- หรือเรื่อง “การปรับปรุงแนวทางการปฏิบัติงานและระบบงานที่เกี่ยวข้องกับการให้บริการ SSF Block Trade” หน่วยงานอื่น
- ร่วมประชุมกับผู้แทนของกรมสรรพากรเพื่อเตรียมความพร้อมสำหรับการรายงานข้อมูลบัญชีทางการเงินตามมาตรฐานการรายงานทั่วไป (Common Reporting Standard : CRS)
- กิจกรรมอื่นๆ
- ทบทวนรายชื่อผู้มีอำนาจในการทำความตกลงซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแบบ Block Trade แจ้งให้บริษัทสมาชิกตรวจสอบความถูกต้องของรายชื่อเป็นประจำทุก 6 เดือน



ชมรมผู้ดูแลการปฏิบัติงานด้านหลักทรัพย์

การเสนอความคิดเห็น / หรือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง
 สำนักงาน ก.ล.ต.

- เสนอข้อหารือเกี่ยวกับมาตรการลงโทษทางแพ่งต่อบุคคลโดยห้ามซื้อขายหลักทรัพย์ หรือเข้าผูกพันตามสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ฯลฯ
- ร่วมอบรม Compliance Meeting ครั้งที่ 2/2566 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- เสนอความคิดเห็นเกี่ยวกับหลักการการมอบอำนาจส่งคำสั่งซื้อขายผ่านช่องทางออนไลน์



การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

- ร่วมประชุมหารือเพื่อพิจารณาการจัดกิจกรรม Compliance สัมพันธ์สำนักงาน ปปง.
- รายงานผลการดำเนินงานตามแผนปฏิบัติการด้านการป้องกันและปราบปรามการฟอกเงินและการต่อต้านการสนับสนุนทางการเงินแก่การก่อการร้าย (AML/CFT) ประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2566 รอบไตรมาสที่ 1 - 2
- ร่วมประชุมเพื่อซักซ้อมความเข้าใจเกี่ยวกับการจัดการทรัพย์สินตามคำสั่งอายัดทรัพย์สินที่ 195/2565 และ 196/2565
- ส่งผู้แทนเข้าร่วมโครงการบูรณาการการปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยการป้องกันและปราบปรามการฟอกเงินร่วมกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้องที่จังหวัดปราจีนบุรี
- ร่วมประชุมหารือข้อสรุปแนวทางการปฏิบัติตามกฎหมายว่าด้วยการป้องกันและปราบปรามการฟอกเงิน และกฎหมายว่าด้วยการป้องกันและปราบปรามการสนับสนุนทางการเงินแก่การก่อการร้ายและการแพร่ขยายอาวุธที่มีอานุภาพทำลายล้างสูง หน่วยงานอื่น
- ร่วมประชุมเพื่อเตรียมความพร้อมสำหรับการรายงานข้อมูลบัญชีทางการเงินตามมาตรฐานการรายงานทั่วไป (Common Reporting Standard : CRS) จัดโดย กรมสรรพากร
- ร่วมประชุมเพื่อพิจารณาให้ความเห็นคำแปลมาตรฐาน CRS ร่วมกับกรมสรรพากร และสมาคมที่เกี่ยวข้อง
- ร่วมประชุมหารือร่วมกับชมรมปฏิบัติการหลักทรัพย์ และชมรมเทคโนโลยีสารสนเทศ เพื่อร่วมกลั่นกรองและกำหนดประเด็นและข้อเสนอแนะด้าน CRS ที่จะเสนอไปยังกรมสรรพากร
- ร่วมประชุมรับฟังความคิดเห็นตามมาตรา 77 ของรัฐธรรมนูญแห่งราชอาณาจักรไทยต่อร่างกฎกระทรวงออกตามความในพระราชกำหนดการแลกเปลี่ยนข้อมูลเพื่อปฏิบัติตามความตกลงระหว่างประเทศเกี่ยวกับภาษีอากร พ.ศ. 2566 จัดโดย กรมสรรพากร
- ร่วมประชุมกับผู้แทนของกรมสรรพากรเพื่อเตรียมความพร้อมสำหรับการรายงานข้อมูลบัญชีทางการเงินตามมาตรฐานการรายงานทั่วไป (Common Reporting Standard : CRS) และร่วมหารือกับผู้แทนของกรมสรรพากรและชมรมปฏิบัติการหลักทรัพย์เรื่องพิจารณาให้ความเห็นคำแปลมาตรฐาน Common Reporting Standard : CRS
- ร่วมประชุมระดมความคิดเห็น “โครงการสำรวจความเชื่อมั่นต่อการปฏิบัติงานของสำนักงาน ปปง. ประจำปีงบประมาณ พ.ศ. 2566” จัดโดย ศูนย์บริการวิชาการแห่งจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
- ร่วมประชุมคณะทำงาน Regulatory Guillotine เพื่อกลั่นกรองประเด็นเสนอแก้ไขปรับปรุงกฎหมายหรือกฎเกณฑ์เพื่อลดอุปสรรคและต้นทุนจากการปฏิบัติตามกฎหมายที่ไม่จำเป็น รวมถึงเพิ่มความสามารถในการแข่งขันของอุตสาหกรรม
- เสนอความเห็นต่อร่างประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุนว่าด้วยการจัดรายการส่งเสริมการขายหน่วยของกองทุนรวมกิจกรรมอื่นๆ
- ร่วมรับฟังการนำเสนอระบบการเชื่อมต่อ TDX ในลักษณะ Broker Model จากบริษัท Satang Technology
- ร่วมรับฟังการแนะนำบริการใหม่ของ NDID จัดโดย บริษัท เนชั่นแนลดีเจิทัลโอดี จำกัด



ชมรมปฏิบัติการหลักทรัพย์

การเสนอความคิดเห็น / หารือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง

- ร่วมหารือกับผู้แทนของสำนักงาน ก.ล.ต. เรื่องการจัดทำบัญชีทศรองจ่ายทรัพย์สินแทนลูกค้า (กฎหมายลำดับรองที่อยู่ระหว่างการ hearing)
- ร่วมหารือผู้แทนของตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อขอปรับปรุงแบบฟอร์ม DRx ร่วมประชุมกับผู้แทนของกรมสรรพากรเพื่อเตรียมความพร้อมสำหรับการรายงานข้อมูลบัญชีทางการเงินตามมาตรฐานการรายงานทั่วไป (Common Reporting Standard : CRS) และร่วมหารือกับผู้แทนของกรมสรรพากรและชมรมผู้ดูแลการปฏิบัติงานด้านหลักทรัพย์ เรื่องพิจารณาให้ความเห็นคำแปลมาตรฐาน Common Reporting Standard : CRS
- ร่วมประชุมคณะทำงาน Regulatory Guillotine เพื่อกลั่นกรองประเด็นเสนอแก้ไขปรับปรุงกฎหมายหรือกฎเกณฑ์เพื่อลดอุปสรรคและต้นทุนจากการปฏิบัติตามกฎหมายที่ไม่จำเป็น รวมถึงเพิ่มความสามารถในการแข่งขันของอุตสาหกรรม
- ร่วมประชุมหารือเกี่ยวกับปัญหาอุปสรรคของและแนวทางดำเนินโครงการ Common Back Office ร่วมกับผู้แทนสมาชิก และผู้แทนจาก KGISL



ชมรมเทคโนโลยีสารสนเทศ

การเสนอความคิดเห็น / หารือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง

- ผลักดันและนำเสนอแนวคิด Blockchain for Thai Capital Market ต่อคณะกรรมการชมรมปฏิบัติการหลักทรัพย์เพื่อสนับสนุนให้มีการจัดทำ Blockchain ของภาคธุรกิจหลักทรัพย์
 - ร่วมประชุมหารือกับคณะทำงานกลุ่มย่อยในการยกระดับศูนย์ประสานการรักษาความมั่นคงปลอดภัยระบบคอมพิวเตอร์ภาคตลาดทุน (TCM CERT) เพื่อเป็น Sectorial CERT ภาคตลาดทุน
 - ร่วมประชุมคณะทำงาน Regulatory Guillotine เพื่อกลั่นกรองประเด็นเสนอแก้ไขปรับปรุงกฎหมายหรือกฎเกณฑ์เพื่อลดอุปสรรคและต้นทุนจากการปฏิบัติตามกฎหมายที่ไม่จำเป็น รวมถึงเพิ่มความสามารถในการแข่งขันของอุตสาหกรรม
- การจัดอบรม / สัมมนา**
- จัดบรรยายทางออนไลน์เรื่องการประเมินความปลอดภัยด้าน Internet, Email และด้าน Cyber Resilience โดยบริษัท Cisco

การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

Security Assessment

- จัดบรรยายทางออนไลน์เรื่องการนำเสนอระบบการเชื่อมต่อ TDX ในลักษณะ Broker Model โดยบริษัท Satang Technology
- จัดบรรยายทางออนไลน์เรื่อง 10X your volumes with trading view และการให้บริการ Trading view โดยบริษัท Trading View ซึ่งเป็นผู้ให้บริการระบบข้อมูลและการวิเคราะห์สำหรับการลงทุน
- จัดทำโครงการ CMX2023 โดยมีการดำเนินการที่สำคัญได้แก่
 - จัดประชุมพิจารณารายละเอียดแผนงานและตัวอย่างการโจมตีที่ต้องการให้ผู้ให้บริการนำมาฝึกซ้อมจากผู้พัฒนาระบบ 3 บริษัท
 - จัดประชุมคณะทำงานเพื่อพิจารณาคัดเลือกผู้พัฒนาระบบในการจัดกิจกรรม CMX2023
 - ติดตามข้อมูลใบเสนอราคาและเอกสารข้อมูลแผนงานในการจัดกิจกรรม CMX2023 เพื่อประกอบการพิจารณาให้คณะทำงาน
 - จัดทำ Google Form เพื่อใช้ในการลงคะแนนคัดเลือกผู้พัฒนาระบบในการจัดกิจกรรม CMX2023
 - จัดประชุมคณะทำงานเพื่อ Kick off การจัดกิจกรรม CMX2023 โดยมีบริษัท เอซี อินโฟเทค จำกัด เป็นผู้นำเสนอ
 - กำหนดวันจัดกิจกรรม CMX2023 โดยในปีนี้ได้แก่วันที่ 17 และ 18 ตุลาคม 2566

กิจกรรมอื่นๆ

- จัดทำแบบสำรวจข้อมูล URL ของบริษัทสมาชิกแต่ละแห่ง โดยขอให้บริษัทสมาชิกอัปเดตข้อมูลทุกๆ 6 เดือน และรวบรวมเผยแพร่ URL ทั้งหมดให้บริษัทสมาชิกได้รับทราบและนำไปปรับปรุงการ Block Web การใช้งานบริษัทสมาชิก



ชมรมบริหารทรัพยากรบุคคลบริษัทหลักทรัพย์

การเสนอความคิดเห็น /หารือกับหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง

- ผู้แทนชมรมฯ เข้าร่วมการประชุมเชิงปฏิบัติการเพื่อระดมความเห็นจากหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ด้านมาตรฐานทักษะวิชาชีพ ด้านการพัฒนากำลังคน ด้านแรงงาน (กทผ.) กับสำนักงานคณะกรรมการดิจิทัลเพื่อเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ (สดช.)
 - ร่วมหารือกับศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน (TSI) ตลาดหลักทรัพย์ฯ และสถาบันฝึกอบรม สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (ATI) เรื่องการจัดอบรมให้ความรู้แก่พนักงาน HR ประจำปี 2566
 - ร่วมหารือกับกองทุนส่งเสริมการพัฒนาตลาดทุน (CMDF) เรื่องการคาดการณ์และเตรียมการบุคลากรสำหรับอุตสาหกรรมในอนาคต
- ### กิจกรรมอื่นๆ
- เริ่มโครงการสำรวจข้อมูลเงินเดือนและสวัสดิการ ปี 2023 (Salary Survey 2023) โดยคณะกรรมการชมรมฯ ได้คัดเลือกให้บริษัท วิลลิส ทาวเวอร์ส วู้ตสัน (ประเทศไทย) จำกัด (WTV) เป็นผู้ดำเนินโครงการในปี
 - สอบถามความเห็นบริษัทสมาชิก เรื่อง “แนวทางการพัฒนาบุคลากรในธุรกิจหลักทรัพย์ในอนาคต” ซึ่งจัดทำโดยสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

- ให้ความร่วมมือกับหน่วยงานต่างๆ ดังนี้

- ตลาดหลักทรัพย์ฯ ในการประชาสัมพันธ์หลักสูตร Balance Your Life with Timeboxing รุ่นที่ 2 และในการประชาสัมพันธ์การปรับปรุง / เพิ่มเติมเนื้อหาหลักสูตรผู้แนะนำการลงทุน (IC)
- สำนักงานปลัดกระทรวงแรงงาน โดยกองเศรษฐกิจแรงงาน ศูนย์วิจัยและนวัตกรรมแรงงาน ในการประชาสัมพันธ์เรื่องขอความอนุเคราะห์ตอบแบบสอบถามความคิดเห็นเกี่ยวกับการกำหนดอัตราค่าจ้างรายชั่วโมง

การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของสถาบันฝึกอบรม ATI

การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของสถาบันฝึกอบรม ATI

สถาบันฝึกอบรม สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (ATI) ดำเนินธุรกิจด้านการพัฒนาและเผยแพร่ความรู้เกี่ยวกับการลงทุนในหลักทรัพย์ การวางแผนการลงทุนและการเงิน การดำเนินงานของธุรกิจหลักทรัพย์ และความรู้ที่เกี่ยวข้องกับตลาดทุนไทย

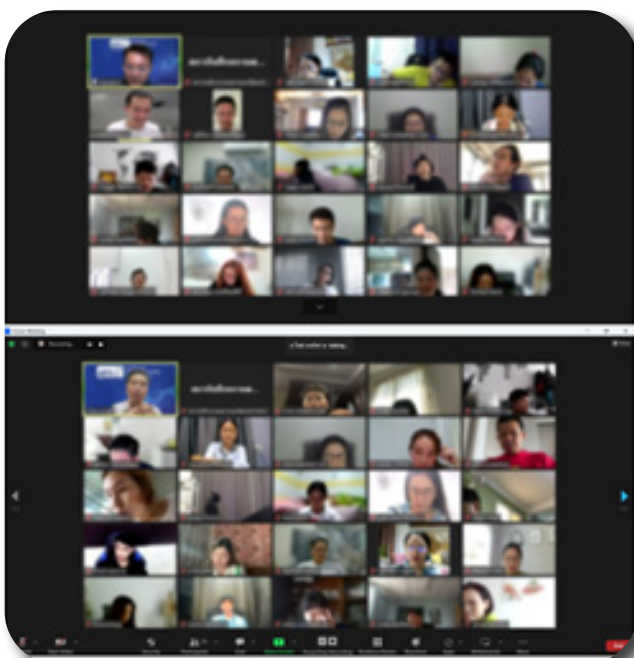
- จัดอบรม “หลักสูตรต่ออายุใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุน (IC Plain, IC Complex 1, 2, 3) ผู้วางแผนการลงทุน (IP) นักวิเคราะห์การลงทุน (IA) และผู้แนะนำลูกค้า (IBA)” ซึ่งเหมาะสำหรับผู้ที่มีใบอนุญาตที่เกี่ยวข้อง ที่ต้องการต่ออายุใบอนุญาต และเพิ่มพูนความรู้ความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุนในตลาดทุน แบ่งเป็น 2 รูปแบบ ดังนี้

- 1) ผ่านระบบ E-Learning มีระยะเวลาในการเรียน 60 วัน
- 2) ผ่านระบบ ZOOM Meeting วันที่ 24 - 25 มิถุนายน 2566



- จัดอบรม หลักสูตรการวางแผนการเงิน CFP (CFP Module 1 - 6) อบรมผ่านโปรแกรม ZOOM Meeting สำหรับผู้ที่ต้องการ Upgrade ใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุน (IC License) เพื่อให้ได้คุณสมบัติ CFP บุคคลทั่วไปที่ต้องการเพิ่มเติมความรู้เกี่ยวกับการลงทุน

- Module 1 วันที่ 10 - 11, 17 - 18 มิถุนายน 2566 จำนวน 1 รุ่น



- ดำเนินงานตามโครงการที่ได้รับทุนสนับสนุนจากกองทุนส่งเสริมการตลาด (CMDF) จำนวน 4 โครงการ ดังนี้

1) **โครงการอบรมเพื่อยกระดับผู้แนะนำการลงทุน (IC)** เป็นการ จัดอบรมและทดสอบในหลักสูตร IC Complex P2 และ P3 และหลักสูตร CFP ตั้งแต่ Module ที่ 1 ถึง 6 ระหว่างปี 2564 - 2567 สำหรับ IC ที่สังกัดบริษัทหลักทรัพย์ (บล.) และที่สังกัดบริษัทหลักทรัพย์จัดการ กองทุน (บลจ.) รวมถึงนักศึกษาและอาจารย์จากมหาวิทยาลัยต่างๆ โดยตั้งแต่ปี 2564 จนถึงปัจจุบัน มี IC เข้าร่วมโครงการแล้วทั้งหมด 3,599 คน นักศึกษาจากมหาวิทยาลัยต่างๆ จำนวน 662 คน และมีอาจารย์มหาวิทยาลัย เข้าร่วมโครงการจำนวน 14 คน

2) **โครงการอบรมผู้ได้รับทุนจ้างงานจาก CMDF** เป็นการ จัดอบรม สำหรับผู้ที่ได้รับทุนจ้างงานจาก CMDF ในปี 2563 และบุคลากรใหม่ ที่ บล. (รวมถึงบริษัทผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและบริษัท ที่ปรึกษาทางการเงิน) ที่ได้เริ่มทำการว่าจ้างตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2563 จนถึง 31 พฤษภาคม 2566 ให้กับผู้ที่สนใจเข้าร่วมโครงการ เพื่อเพิ่ม ความรู้ในเรื่องการทำธุรกิจของ บล. และกฎระเบียบที่เกี่ยวข้อง ปัจจุบัน ได้ครบกำหนดสิ้นสุดโครงการแล้ว เมื่อวันที่ 30 มิถุนายน 2566 ที่ผ่านมามีบริษัทเข้าร่วม 35 แห่ง และมีผู้เข้าร่วมอบรมในโครงการ ทั้งหมด 692 คน

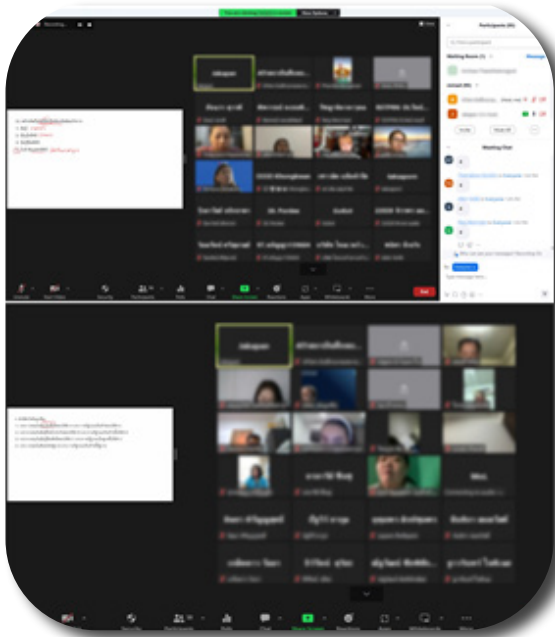
3) **โครงการ Upskill & Reskill ด้าน Digital ให้บุคลากร ในบริษัทหลักทรัพย์ (Phase 2)** ทางสมาคมฯ ได้พิจารณาและคัดเลือก หลักสูตรอบรมให้กับบุคลากรใน บล. โดยสอดคล้องกับการเปลี่ยนแปลง แนวทางการทำธุรกิจในยุค Digital และเพื่อให้มีศักยภาพที่จะปฏิบัติงาน ในยุค Digital จำนวน 18 หลักสูตร คาดว่ามีผู้เข้าร่วมโครงการทั้งหมด ไม่ต่ำกว่า 4,000 คน (นับไม่ซ้ำ) อบรมเฉลี่ยคนละ 6 หลักสูตร ระยะเวลา โครงการตั้งแต่กันยายน 2565 ถึงมีนาคม 2567 โดยตั้งแต่เดือนกันยายน 2565 จนถึงปัจจุบัน มีผู้เข้าและผ่านอบรมในหลักสูตรต่างๆ สะสมรวม 11,081 คน (นับไม่ซ้ำ 3,402 คน อบรมเฉลี่ยคนละ 3 - 4 หลักสูตร)

4) **โครงการสนับสนุนทุนการสอบใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุน สำหรับนักศึกษาในมหาวิทยาลัย** ทางสมาคมฯ ได้ตระหนักเห็น ความสำคัญและความจำเป็นในการสรรหาและสร้างบุคลากรด้าน ผู้แนะนำการลงทุนรุ่นใหม่ที่จะเพิ่มเติม เพื่อทดแทนบุคลากรที่มีโอกาสจะ เกษียณอายุและออกจากธุรกิจ โดยให้ทุนสนับสนุนค่าใช้จ่ายการทดสอบ ใบอนุญาตผู้แนะนำการลงทุนตราสารทั่วไป (IC Plain : P1) สำหรับนักศึกษา ในมหาวิทยาลัยทั่วประเทศที่เรียนวิชามีการนำเอาผลการสอบใบอนุญาต IC Plain (P1) มาเป็นส่วนหนึ่งในการวัดผลการศึกษา โดยตั้งแต่กันยายน 2565 - มิถุนายน 2566 มีนักศึกษาเข้าร่วมโครงการ 876 คน สอบ IC Plain ผ่านแล้ว 412 คน

- จัด Campaign พิเศษ สำหรับผู้ที่ต้องการถือ License IC และเพื่อสนับสนุนการพัฒนา และสร้างบุคลากรให้ตลาดทุน ในโครงการ “Super Deal ถือ IC” คอร์สถือ IC Plain (P1) รวมสอบ 1 ครั้งผ่านระบบ E-Learning และบรรยายสดผ่าน ZOOM จำนวน 4 รอบ (เดือนละ 2 รอบ) ดังนี้

- วันที่ 20 - 21 พฤษภาคม 2566
 - วันที่ 23 - 24 พฤษภาคม 2566
 - วันที่ 10 - 11 มิถุนายน 2566
 - วันที่ 20 - 21 มิถุนายน 2566

การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญ ของสถาบันฝึกอบรม ATI

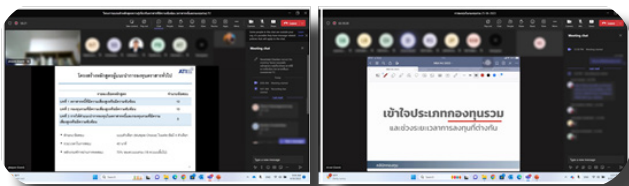


โดยจัดบรรยายสดเดือนละ 2 รอบ

- วันเสาร์ที่ 8 - วันอาทิตย์ที่ 9 และวันพุธที่ 12 - วันพฤหัสบดีที่ 13 กรกฎาคม 2566
- วันพุธที่ 16 - วันพฤหัสบดีที่ 17 และวันเสาร์ที่ 19 - วันอาทิตย์ที่ 20 สิงหาคม 2566
- วันพุธที่ 13 - วันพฤหัสบดีที่ 14 และวันเสาร์ที่ 16 - วันอาทิตย์ที่ 17 กันยายน 2566

*** รอบอบรมเดือนตุลาคม 2566 - มีนาคม 2567 โปรดรอ Update อีกครั้ง ***

- ศูนย์ทดสอบ ATI ดำเนินจัดอบรมใน โครงการ “เส้นทางสู่การเงินมืออาชีพ” ให้กับนิสิต นักศึกษา โดยมีมหาวิทยาลัย เพื่อเตรียมตัวสอบเป็น IC Plain ทั้งหมด 2 แห่ง และมีหัวข้อดังนี้
 - มหาวิทยาลัยศรีนครินทรวิโรฒ ในหัวข้อ “ตัวหลักสูตรความรู้เกี่ยวกับตราสารที่มีความซับซ้อน (ตราสารหนี้และกองทุนรวม)” เมื่อวันที่ 30 เมษายน 2566
 - มหาวิทยาลัยนเรศวร ในหัวข้อ “บริหารความมั่งคั่งด้วยกองทุนรวม” เมื่อวันที่ 25 มิถุนายน 2566



ข่าวประชาสัมพันธ์

- 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 ***

 - วันเสาร์ที่ 2 - วันอาทิตย์ที่ 3 กันยายน 2566 (ผ่านโปรแกรม ZOOM Meeting)
 - วันเสาร์ที่ 7 - วันอาทิตย์ที่ 8 ตุลาคม 2566 (ผ่านโปรแกรม ZOOM Meeting)
 - วันเสาร์ที่ 11 - วันอาทิตย์ที่ 12 พฤศจิกายน 2566 (ผ่านโปรแกรม ZOOM Meeting)
- เปิดอบรม “Super Deal ตัว IC” คอร์สตัว IC Plain (P1) รวมสอบ 1 ครั้ง (บรรยายสดผ่านโปรแกรม Zoom Meeting / ผ่านระบบ E-Learning)

- เปิดอบรม หลักสูตรการวางแผนทางการเงิน CFP (ชุดวิชาที่ 1 - 6) บรรยายสดผ่านโปรแกรม Zoom Meeting

- ชุดวิชาที่ 1 พื้นฐานการวางแผนการเงิน ภาษี และจรรยาบรรณ (Foundation of Financial & Tax Planning)
- ชุดวิชาที่ 2 การวางแผนการลงทุน (Investment Planning)
- ชุดวิชาที่ 3 การวางแผนการประกันภัย (Insurance Planning)
- ชุดวิชาที่ 4 การวางแผนเพื่อวัยเกษียณ (Retirement Planning)
- ชุดวิชาที่ 5 การวางแผนภาษีและมรดก (Tax and Estate Planning)
- ชุดวิชาที่ 6 การจัดทำแผนการเงิน (Financial Plan Construction)

- เปิดรับสมัครอบรม E-Learning

หลักสูตรเตรียมสอบ IC

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

หลักสูตรต่ออายุใบอนุญาตฯ (IC, IP, IA)

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

หลักสูตรผู้แนะนำลูกค้า (IBA)

- หลักสูตรผู้แนะนำลูกค้า (IBA)
- หลักสูตรต่ออายุฯ ผู้แนะนำลูกค้า (IBA)
- หลักสูตรสอบซ่อมผู้แนะนำลูกค้า (IBA)

หลักสูตรอื่นๆ

- หลักสูตรแนวทางปฏิบัติที่เกี่ยวข้องกับตราสารอนุพันธ์ (DRG)
- 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 เปิดรอบทดสอบใบอนุญาตในเขตกรุงเทพและเขตภูมิภาค

เขตกรุงเทพฯ

- วันจันทร์ - วันพฤหัสบดี เปิดสอบ 2 รอบ คือ 09.30 - 12.00, 13.30 - 16.00 น.

การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญ ของสถาบันฝึกอบรม ATI

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

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

■ เขตภูมิภาค

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



การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของงานกำกับดูแลสมาชิก

ในไตรมาสที่ 2 สายงานกำกับดูแลสมาชิกมีการดำเนินงานสำคัญ ดังต่อไปนี้

- **ทบทวนมาตรการและกฎเกณฑ์เพื่อป้องกันเหตุการณ์ทำนองเดียวกับการซื้อขายหุ้น MORE** โดยศึกษาข้อมูลและความเป็นไปได้ทั้งทางด้านกฎหมายและการปฏิบัติงาน เพื่อเสนอแนวทางการดำเนินงานที่เหมาะสมดังนี้

- **แนวทางเกี่ยวกับข้อมูลเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการป้องกันความเสี่ยงและการกำกับดูแล**

- การจัดตั้ง Securities Bureau เพื่อให้สามารถตรวจสอบข้อมูลวงเงินเพื่อการซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้าในระดับอุตสาหกรรมได้ ซึ่งปัจจุบันตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างศึกษารายละเอียดในการดำเนินการ

- การเปิดเผยข้อมูล Net Settlement เป็นรายหลักทรัพย์และเป็นรายวัน เพื่อให้สามารถพิจารณา Volume การซื้อขายและความเสี่ยงของหลักทรัพย์ได้ ซึ่งตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างพิจารณาแก้ไขการรายงานข้อมูลของสมาชิกและอาจมีการหารือกับสมาชิกอีกครั้ง

- การเปิดเผยข้อมูลการโอนหลักทรัพย์ในภาพรวมทั้งในระบบ Scrip / Scripless / บัญชี 600 เพื่อให้ บล. รับทราบข้อมูลโอนหลักทรัพย์ที่เข้าข่ายผิดปกติ ปัจจุบันตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างพิจารณาแนวทางโดยอาจเปิดเผยผ่านสำนักงาน ก.ล.ต.

- การเปิดเผยข้อมูลของหน่วยงานกำกับดูแลเกี่ยวกับบุคคลหรือกลุ่มบุคคลที่อยู่ระหว่างการตรวจสอบ เช่น ลูกค้าที่มีพฤติกรรมเข้าข่ายการสร้างราคา ซึ่งตลาดหลักทรัพย์ฯ รับดำเนินการโดยจัดทำฐานข้อมูลเพื่อเผยแพร่ให้ บล. ต่อไป

- การจัดส่งข้อมูลของ บล. ให้หน่วยงานกำกับดูแลในรูปแบบ Standard Form เพื่อให้หน่วยงานกำกับดูแลมีข้อมูลเพียงพอในการคัดกรองการกระทำผิดได้ทันทีทั้งที่ ปัจจุบันตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างกำหนดชุดข้อมูลและ Standard Format เพื่อหารือกับคณะทำงาน

- **แนวทางเกี่ยวกับการป้องกันการซื้อขายที่อาจมีเจตนาให้เกิดการซื้อขายผิดปกติหรือทุจริตฉ้อโกง**

- การกำหนดแนวทาง Auto Halt การซื้อขายหลักทรัพย์เมื่อมีคำสั่งซื้อขายที่เข้าข่ายผิดปกติตามที่กำหนด เช่น แนวปฏิบัติของตลาดหลักทรัพย์ฯ และ บล. เมื่อเกิด Auto Halt และ Parameter ที่ทำให้เกิดการ Halt โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างศึกษาข้อมูลเพื่อพัฒนาระบบ

- การทบทวนเงื่อนไขหลักทรัพย์ที่เข้าข่ายมาตรการการกำกับดูแล โดยเพิ่มปัจจัยการพิจารณาหลักทรัพย์ที่เข้าข่าย Trading Alert / Turnover List โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างทบทวนแนวทาง

- การปรับปรุงระบบการรับส่งคำสั่งซื้อขาย เพื่อให้ บล. สามารถคัดกรองคำสั่งก่อน Match ได้ เพื่อวัตถุประสงค์การตรวจสอบการซื้อขาย โดยจัดทำตัวอย่างคำสั่ง / เงื่อนไขเพื่อการคัดกรองคำสั่ง ปัจจุบันตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างศึกษาความเป็นไปได้ของการพัฒนาระบบ

- การปรับปรุงระบบคัดกรองคำสั่ง (Pre-trade) โดยเพิ่ม Parameter ในการคัดกรองคำสั่งที่อาจมีความผิดปกติและแจ้ง บล. ทราบโดยเร็ว

- **แนวทางเกี่ยวกับหลักเกณฑ์เพื่อจำกัดและบรรเทาความเสียหายจากการซื้อขายผิดปกติหรือทุจริตฉ้อโกง**

- การกำหนดหลักการการ Haircut หลักทรัพย์ที่ลูกค้านำมาวางเป็นหลักประกันในการคำนวณอำนาจซื้อในบัญชีเงินสด โดยคำนึงถึงความเสี่ยงและคุณภาพของหลักทรัพย์ซึ่งสำนักงาน ก.ล.ต. และตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างพิจารณาแนวทางการแก้ไขหลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง

- การทบทวนหลักเกณฑ์การซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยเงินสดในส่วนของการชำระราคา เพื่อให้ บล. มีความยืดหยุ่นมากขึ้นในการชำระค่าขายหลักทรัพย์ โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ ปรับปรุงหลักเกณฑ์แล้ว และอยู่ระหว่างเสนอสำนักงาน ก.ล.ต. เพื่อพิจารณา

- การกำหนดให้ NVDR ซื้อขายได้เฉพาะนักลงทุนต่างชาติ โดยสำนักงาน ก.ล.ต. อยู่ระหว่างปรับปรุงหลักเกณฑ์ ซึ่ง บล. อาจต้องปรับปรุงระบบการรับคำสั่งให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ต่อไป

- การทบทวนหลักเกณฑ์ NC/NCR เพิ่มความยืดหยุ่นให้การดำรงเงินกองทุนและการคำนวณ NCR ในเหตุการณ์ที่ไม่ปกติ เช่น ต้องมีการ Hold หลักทรัพย์ตามคำสั่งศาล ซึ่งสำนักงาน ก.ล.ต. ปรับปรุงหลักเกณฑ์แล้ว และอยู่ระหว่างเสนอคณะกรรมการ ก.ล.ต. เพื่อพิจารณา

- ปรับปรุงแนวปฏิบัติของสมาคมเรื่องการพิจารณากำหนดวงเงินซื้อขายหลักทรัพย์ของลูกค้า โดยขยายความให้พิจารณากำหนดวงเงินลูกค้าแต่ละรายเทียบกับขนาดเงินกองทุนของสมาชิก และให้นำปัจจัยด้านคุณภาพของหลักทรัพย์ที่ลูกค้านำมาแสดง รวมถึงพฤติกรรมลูกค้ามาพิจารณาปรับลด (Haircut) ในการกำหนดวงเงินด้วย เป็นต้น โดยเปิดรับฟังความเห็นจากสมาชิก แล้วเมื่อวันที่ 18 พฤษภาคม - 2 มิถุนายน 2566 ปัจจุบันสมาคมได้นำส่งร่างฉบับแก้ไขให้สำนักงาน ก.ล.ต. พิจารณาแล้ว และอยู่ระหว่างการหารือเพื่อปรับปรุงร่าง แนวทางปฏิบัติงานตามความเห็นของสำนักงาน ก.ล.ต.

- การจัดทำหลักการการค้ำเงินอัตโนมัติของระบบ SETTRADE โดย บล. สามารถพิจารณาไม่ค้ำเงินได้หากเห็นว่ามีความเสี่ยงการชำระราคา และสามารถปรับเพิ่มวงเงินได้ระหว่างวันหลังทราบผลการชำระราคาแล้ว

- **สนับสนุนการดำเนินงานของสมาชิกเกี่ยวกับการจัดการทรัพย์สินที่ถูกอายัดตามคำสั่งศาลในกรณีการซื้อขายหุ้น MORE** โดยหารือกับสำนักงาน ป.ป.ง. สำนักงาน ก.ล.ต. และที่ปรึกษากฎหมายเพื่อให้เกิดความชัดเจนในทางปฏิบัติและถูกต้องตามกฎหมายและกฎเกณฑ์ของหน่วยงานกำกับดูแลทั้งหมดเพื่อป้องกันความเสี่ยงด้านกฎหมายและลดภาระการดำเนินการตามกฎหมายที่เกินความจำเป็นของ บล. ในประเด็นที่เกี่ยวกับการบันทึกบัญชี การดำรงเงินกองทุน NC การคำนวณ NCR การแยกบัญชีทรัพย์สินของลูกค้า และการดำเนินการเกี่ยวกับสิทธิของผู้ถือหุ้น เป็นต้น



การดำเนินงานและกิจกรรมที่สำคัญของงานกำกับดูแลสมาชิก

- **เตรียมความพร้อมสมาชิกเพื่อรองรับการปฏิบัติให้เป็นไปตามกฎหมาย FATCA และ CRS**
 - ติดตามความคืบหน้ากฎหมายและการจัดประชุมชี้แจงของกรมสรรพากร กรมสรรพากรอยู่ระหว่างร่างกฎกระทรวงกำหนดวิธีการตรวจสอบบัญชี และระยะเวลาในการรายงานข้อมูลเป็นต้น ซึ่งได้เปิดรับฟังความเห็นระหว่างวันที่ 6 - 12 มิถุนายน 2566 โดยสมาคมมีความเห็นให้มี Grace Period สำหรับบัญชีใหม่ที่ต้องจัดให้ลูกค้าแจ้งและยืนยันข้อมูลถิ่นที่อยู่ทางภาษีเพื่อให้ บล. มีเวลาเตรียมระบบงานอย่างเหมาะสม นอกจากนี้สมาคมร่วมกับสมาคมผู้ประกอบการอื่นได้นำส่งประเด็นปัญหาและอุปสรรคในการปฏิบัติตามกฎหมายให้กรมสรรพากรพิจารณาแล้ว ทั้งนี้ คาดว่ากฎกระทรวงจะประกาศใช้ภายในเดือนกรกฎาคม โดยมีการกำหนดรายงานข้อมูลครั้งแรกภายในเดือนสิงหาคม 2566 นี้
 - แจ้งการเปิดระบบ IDES ของสรรพากรสหรัฐเพื่อทดลองรับส่งข้อมูลสำหรับการรายงานข้อมูลตามกฎหมาย FATCA เพื่อให้ บล. เตรียมความพร้อมในการลงทะเบียนและเข้าร่วมทดลองรับส่งข้อมูลในระหว่างวันที่ 5 - 30 มิถุนายน 2566
- **ส่งเสริมการทบทวนปรับปรุงหลักเกณฑ์ในโครงการ Regulatory Guillotine ของสภาธุรกิจตลาดทุน (“FETCO”) ซึ่งครอบคลุมหลักเกณฑ์การประกอบธุรกิจของหน่วยงานกำกับดูแลต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจในตลาดทุนทั้งหมด โดยรวบรวมและจัดทำสรุปประเด็น Pain Point ของอุตสาหกรรมในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจในตลาดทุนทั้งหมด โดยรวบรวมและจัดทำสรุปประเด็น Pain Point ของอุตสาหกรรมในส่วนที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจนายหน้า เช่น การขอ License / นิยามผู้ลงทุนสถาบัน / การจับบัญชีและการพิสูจน์ตัวตนลูกค้า / การจดจำนำและการบังคับหลักประกัน เป็นต้น และได้นำส่งให้สถาบันวิจัยเพื่อการพัฒนาระบบ (“TDRI”) เพื่อพิจารณาวิเคราะห์ผลกระทบและต้นทุนประกอบการปรับปรุงกฎหมายแล้ว ปัจจุบันสมาคมอยู่ระหว่างจัดทำประเด็น Pain Point เพื่อนำส่งให้ TDRI เพิ่มเติม โดยมีกำหนดระยะเวลาดำเนินโครงการถึงเดือนมีนาคม 2568**
- **ทบทวนปรับปรุงหลักเกณฑ์ของสมาคม**
 - **ปรับปรุงหลักเกณฑ์ผู้แนะนำลูกค้า (IBA)** เพื่อเพิ่มความยืดหยุ่นและคล่องตัวในการประกอบธุรกิจ และลดภาระต้นทุนที่เกินความจำเป็นของสมาชิกในการติดตามตรวจสอบคุณสมบัติ IBA โดยยกเลิกการขึ้นทะเบียนและกำหนดให้สมาชิกสามารถแต่งตั้งบุคคลธรรมดาที่มี IC License หรือผ่านการอบรมหลักสูตรของ ATI เป็น IBA ได้ และเพิ่มอัตรา Retaining Fee สำหรับ IBA บุคคลธรรมดาและนิติบุคคลทั่วไปเป็น 10% ตั้งแต่ปีแรกเป็นต้นไป เป็นต้น ซึ่งได้ประกาศและมีผลบังคับใช้แล้วเมื่อวันที่ 1 พฤษภาคม 2566 เป็นต้นไป
 - **ชักชวนความเข้าใจเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ของพนักงานและกรรมการ บล.** เพื่อให้สมาชิกมีความเข้าใจในขั้นตอนการปฏิบัติที่ตรงกันและเป็นไปตามกฎหมายคุ้มครองข้อมูลส่วนบุคคล เช่น สมาชิกในฐานะบริษัทต้นสังกัดของพนักงานต้องให้พนักงานของตนเปิดเผยการมีบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ของพนักงานและบุคคลที่เกี่ยวข้องทั้งหมดก่อนเริ่มปฏิบัติงานใหม่ และสมาชิกในฐานะที่มีพนักงานของผู้ประกอบธุรกิจอื่นมาเปิดบัญชี ต้องมีช่องทางในการขอใช้สิทธิเข้าถึงและขอรับสำเนา เป็นต้น ซึ่งผ่าน

การพิจารณาของสำนักงาน ก.ล.ต. แล้วและแจ้งชักชวนสมาชิกแล้วเมื่อวันที่ 17 เมษายน 2566

- **ร่วมหารือเพื่อกำหนดความชัดเจนเกี่ยวกับการระบุและพิสูจน์ทราบตัวตนของลูกค้า** เพื่อให้ บล. ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ของสำนักงาน ป.ง. อย่างถูกต้อง โดยปัจจุบันอยู่ระหว่างร่างสรุปข้อหารือเพื่อนำส่งสำนักงาน ป.ง. ก่อนเผยแพร่ให้สมาชิกรับทราบและปฏิบัติต่อไป โดยมีสรุปสาระสำคัญ อาทิ
 - **การทบทวน KYC/CDD กรณีลูกค้า Active ให้ บล. ตรวจสอบข้อมูลลูกค้ากับกรมการปกครองผ่านช่องทางออนไลน์ได้ / ให้ลูกค้าทบทวนยืนยัน หรือแก้ไขข้อมูลผ่านช่องทาง Electronic หรือส่งจดหมายโทรศัพท์ หรือ Email ไปยังลูกค้าได้ / กรณีลูกค้า In-active และลูกค้าที่ไม่สามารถติดต่อได้ ให้ บล. อาจมีมาตรการภายใน เช่น ระวังการซื้อขาย โดยต้องมีการกำหนดนโยบายที่ชัดเจน เป็นต้น**
 - **การทำ KYC/CDD กรณี Non Face to Face บล.** สามารถดำเนินการอย่างใดอย่างหนึ่ง ดังนี้ กรณีเป็นลูกค้า บล. อื่น ซึ่งผ่านการทำ KYC เพื่อยืนยันตัวตนมาแล้ว และมีข้อตกลงร่วมกันหรือแนวปฏิบัติของสมาคมที่ระบุให้ส่งเอกสารตามหลักการการพึ่งพาบุคคลที่สามเมื่อสำนักงาน ป.ง. ร้องขอ ให้ถือว่าผ่านการทำ KYC/CDD ตามหลักเกณฑ์แล้ว / ใช้บริการ NDID หรือ ThaiID โดยมีการจัดเก็บรูปถ่ายสำเนาบัตรประชาชน เป็นต้น
 - **การทำ KYC/CDD กรณีลูกค้าต่างชาติแบบ Face to Face** ซึ่งใช้บริการผลิตภัณฑ์ความเชื่อระดับปานกลางให้สามารถดำเนินการตามแนวทางปฏิบัติเรื่อง CDD ได้โดยใช้หนังสือเดินทางประกอบกับเอกสารสำคัญอื่นของลูกค้าทดแทนการนำข้อมูลจากระบบ NFC มาตรวจสอบกับข้อมูลบนหนังสือเดินทาง
- **ร่วมหารือถึงความเป็นไปได้ในการใช้ ThaiID เพื่อพิสูจน์และยืนยันตัวตนลูกค้า** ร่วมกับสำนักงาน ก.ล.ต. และกรมการปกครอง โดยระบบ ThaiID มีระดับความน่าเชื่อถือ (Identity Assurance Level : IAL) ที่ 2.3 และระดับความน่าเชื่อถือของการยืนยันตัวตน (Authentication Assurance Level : AAL) ที่ 2.0 ดังนั้นหาก บล. ใช้ ThaiID เพื่อการพิสูจน์และยืนยันตัวตนลูกค้าแล้ว สำนักงาน ก.ล.ต. ควรพิจารณาว่า บล. ได้ปฏิบัติตามหลักเกณฑ์การทำความเข้าใจลูกค้าและการพิสูจน์และยืนยันตัวตนลูกค้าแล้วตามหลักเกณฑ์ของสำนักงาน ก.ล.ต. แล้ว ซึ่งสมาคมได้นำส่งสรุปข้อหารือดังกล่าวให้สำนักงาน ก.ล.ต. พิจารณาแล้ว โดยสำนักงาน ก.ล.ต. อาจพิจารณาปรับปรุงหลักเกณฑ์ในส่วนที่เกี่ยวข้องต่อไป
- **ร่วมหารือและให้ความเห็นเกี่ยวกับการจัดทำ Check List การตรวจสอบการปฏิบัติงานของ บล.** ร่วมกับผู้แทนชมรม Compliance และสำนักงาน ก.ล.ต. ซึ่งประกอบด้วยตรวจสอบการทำ KYC/CDD การดูแลทรัพย์สินและข้อมูลลูกค้า การดำรง NC และการป้องกันความขัดแย้งทางผลประโยชน์โดยสมาคมได้แจ้งประเด็นการอ้างอิงฐานกฎหมายเพื่อให้ บล. ดำเนินการเกี่ยวกับข้อมูลส่วนบุคคลของลูกค้าอย่างถูกต้องให้สำนักงาน ก.ล.ต. รับทราบประเด็นแล้ว โดยที่ประชุมมีข้อสรุปให้สมาคมเป็นผู้ออก Checklist ดังกล่าว ซึ่งปัจจุบันอยู่ระหว่างปรับปรุงร่าง Checklist เพื่อเสนอให้สำนักงาน ก.ล.ต. พิจารณาก่อนเผยแพร่ให้สมาชิกรับทราบต่อไป

Capital Markets Note

Climate Change กับแนวทางการแก้ไขปัญหาผ่านตลาดทุนไทย

Highlight

- ในปี 2564 ไทยเข้าร่วมการประชุมสมัชชาประเทศภาคีอนุสัญญาสหประชาชาติว่าด้วยการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ ครั้งที่ 26 (COP26) โดยไทยมีเป้าหมายการปล่อยก๊าซคาร์บอนสุทธิเป็นศูนย์ภายในปี พ.ศ. 2593 และปล่อยก๊าซเรือนกระจกสุทธิเป็นศูนย์ภายในปี พ.ศ. 2608
- กลไกที่จะช่วยลดปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจกสามารถทำได้ผ่านกิจกรรมต่างๆ ที่นำไปคำนวณคาร์บอนเครดิต (Carbon Credit) ประเทศไทยมีการดำเนินการซื้อขายคาร์บอนเครดิตผ่านโครงการชดเชยคาร์บอน (T-COP) แบบภาคสมัครใจตามมาตรฐานของประเทศไทย (T-VER) ซึ่งความต้องการซื้อคาร์บอนเครดิตชดเชยมีแนวโน้มเพิ่มขึ้น
- หน่วยงานต่างๆ ในตลาดทุนส่งเสริมและให้ความสำคัญต่อการแก้ไขปัญหาทางสภาพภูมิอากาศ ผ่านเครื่องมือและเกณฑ์ต่างๆ เช่น ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมีการจัดทำรายชื่อยั่งยืน ทางตัวกลางในตลาดทุนนำปัจจัยด้านสิ่งแวดล้อมมาประกอบการตัดสินใจลงทุน ทางสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยเองก็ได้ดำเนินกิจกรรมที่สนับสนุนให้บริษัทสมาชิกเห็นความสำคัญต่อ Climate Change ผ่านแนวคิด ESG อย่างต่อเนื่อง เป็นต้น

ปัญหาของการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ (Climate Change) ได้ทำให้ภาคส่วนต่างๆ ที่เกี่ยวข้องตระหนักและเห็นความสำคัญในการสร้างสมดุลให้ชั้นบรรยากาศของโลก และกลายเป็นจุดเปลี่ยนที่สำคัญต่อแนวคิดในการดำเนินธุรกิจ การค้า การลงทุน ในปัจจุบันและในอนาคต ทั้งนี้ในปี 2537 ได้เกิดความร่วมมือครั้งสำคัญในเวทีระดับโลกจากการที่สหประชาชาติพยายามแก้ไขปัญหามภาวะโลกร้อนโดยประกาศข้อตกลงว่าด้วยการเปลี่ยนแปลงภูมิอากาศโลกของสหประชาชาติ (United National Framework Convention on Climate Change, UNCCC) ซึ่งได้มีการเจรจากันครั้งแรกที่เมืองเกียวโต ประเทศญี่ปุ่น ในเดือนธันวาคม 2540 ซึ่งเรียกกันว่า **พิธีสารเกียวโต (Kyoto Protocol)**¹ โดยมี 191 รัฐลงนามและให้สัตยาบันพิธีสารเกียวโต แต่ด้วยสภาวะการณ์ที่เปลี่ยนแปลงไปอย่างรวดเร็วทำให้รัฐภาคีกรอบอนุสัญญาสหประชาชาติว่าด้วยการเปลี่ยนแปลงสภาพภูมิอากาศ (Conference of Parties of COP) จำเป็นต้องเจรจากับความตกลงด้าน Climate Change ฉบับใหม่ในการประชุมรัฐภาคีกรอบอนุสัญญาฯ ครั้งที่ 21 (COP21) ซึ่งจัดขึ้นระหว่างเดือนพฤศจิกายน - ธันวาคม 2558 ที่กรุงปารีส ประเทศฝรั่งเศส จนเกิดเป็น **ความตกลงปารีส (Paris Agreement)**²

อย่างไรก็ตามจากความตกลงปารีสที่บังคับใช้ 197 ประเทศภาคีสมาชิกดำเนินการยังไม่เพียงพอที่จะควบคุมอุณหภูมิเฉลี่ยของโลกให้เป็นไปตามเป้าหมายได้ ในการประชุมรัฐภาคีกรอบอนุสัญญาฯ ครั้งที่ 26 (COP26) ได้บรรลุข้อตกลงด้านสภาพภูมิอากาศกลาสโกว (Glasgow Climate Pact) โดยจะยกเลิกการให้เงินอุดหนุนเชื้อเพลิงฟอสซิลที่ไม่มีประสิทธิภาพ และลดการใช้พลังงานถ่านหินแบบไม่มี การควบคุมการปล่อยก๊าซคาร์บอนไดออกไซด์ (CO₂) ที่เพียงพอ (Unabated Coal) เพื่อเปลี่ยนไปสู่ระบบพลังงานแบบคาร์บอนต่ำ และสำหรับปี 2565 ที่ผ่านมาในการประชุมรัฐภาคีกรอบอนุสัญญาฯ ครั้งที่ 27 (COP27) ได้มุ่งประเด็นข้อตกลงเกี่ยวกับการจัดตั้ง กองทุนเพื่อชดเชย “ความสูญเสียและเสียหาย” (Loss and Damage)

ที่ได้รับผลกระทบจากภาวะโลกร้อนและภัยพิบัติที่เกิดจาก Climate Change ที่ทวีความรุนแรงขึ้น

ขณะที่ในช่วงหลายปีที่ผ่านมา ประเทศไทยได้เข้ามามีบทบาทในเวทีระดับประเทศที่เกี่ยวข้องกับ Climate Change หลายเวทีด้วยกัน ได้แก่

- ปี 2545 - เข้าร่วมให้สัตยาบันในพิธีสารเกียวโต ในสนธิสัญญาการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจก (Greenhouse Gases : GHGs)³ ซึ่งประเทศไทยจัดอยู่ในกลุ่มประเทศที่กำลังพัฒนา จะไม่ถูกบังคับให้มีส่วนร่วมในการลดปริมาณการปล่อย GHGs
 - ปี 2559 - เข้าร่วมให้สัตยาบันในความตกลงปารีส (Paris Agreement)
 - ปี 2564 - เข้าร่วมการประชุมสมัชชาประเทศภาคีอนุสัญญาฯ ครั้งที่ 26 (COP26) โดยประเทศไทยมีเป้าหมายการเข้าสู่ **ความเป็นกลางทางคาร์บอน (Carbon Neutrality)**⁴ ภายในปี 2593 และ **ปล่อยก๊าซเรือนกระจกสุทธิเป็นศูนย์ (Net zero emissions)**⁵ ภายในปี 2608
 - ปี 2565 - เข้าร่วมการประชุมสมัชชาประเทศภาคีอนุสัญญาฯ ครั้งที่ 27 (COP27) โดยแสดงเจตจำนงของประเทศในการมีส่วนร่วม กับประชาคมโลกในการรับมือกับ Climate Change ต่อเป้าหมายการปล่อยก๊าซเรือนกระจกสุทธิเป็นศูนย์ภายในปี 2608 เพิ่มสัดส่วนของพลังงานทดแทนในการผลิตกระแสไฟฟ้า ภายในปี 2593 ฯลฯ
- ทั้งนี้ประเทศไทยได้มีการจัดตั้งองค์การบริหารจัดการก๊าซเรือนกระจก (องค์การมหาชน) หรือ อบก. ขึ้นในปี 2550 เพื่อให้บริการ ดูแล และกำหนดมาตรฐานที่เกี่ยวข้องกับการวัด การรายงาน และการทวนสอบ และให้การรับรองปริมาณการปล่อย การลด และการชดเชย GHGs รวมทั้งส่งเสริมการพัฒนาโครงการและการตลาดซื้อขายปริมาณ GHGs ที่ได้รับการรับรอง เป็นศูนย์กลางข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับสถานการณ์ดำเนินงานด้าน GHGs ส่งเสริมและพัฒนาศักยภาพ ตลอดจนให้คำแนะนำแก่หน่วยงานภาครัฐและภาคเอกชนเกี่ยวกับการบริหารจัดการ GHGs

¹ พิธีสารเกียวโตได้กำหนดข้อผูกพันทางกฎหมาย ไว้ในการดำเนินงานตามพันธกิจโดยมาตรา 3 ได้กำหนดพันธกิจในการลดปริมาณการปล่อย GHGs ของประเทศภาคีในภาคผนวกที่ 1 ซึ่งประกอบด้วย 41 ประเทศพัฒนาแล้ว (Industrialised Countries) และประเทศที่อยู่ในระหว่างการเปลี่ยนแปลงสภาพเศรษฐกิจ (Countries with Economies in Transition) โดยรวมแล้วไม่น้อยกว่าร้อยละ 5 จากระดับการปล่อยโดยรวมของภูมิภาคในปี พ.ศ. 2533 ภายในช่วง พ.ศ. 2551 - 2555 โดยที่ปริมาณการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกจะแตกต่างกันไปในแต่ละประเทศ

² ความตกลงปารีส (Paris Agreement) มีเป้าหมายในการลดการปล่อย GHGs เพื่อควบคุมอุณหภูมิเฉลี่ยของโลกไม่ให้เพิ่มขึ้นเกิน 2 องศาเซลเซียส เมื่อเทียบกับระดับก่อนการปฏิวัติอุตสาหกรรม และพยายามควบคุมการเพิ่มขึ้นของอุณหภูมิเฉลี่ยของโลกไม่ให้เกิน 1.5 องศาเซลเซียส ความตกลงปารีสได้แจ้งว่าการปล่อย GHGs ลงจนถึงระดับที่ต่ำที่สุด และมหาสมุทร สามารถดูดซับก๊าซได้จนถึงช่วง พ.ศ. 2593 - 2643 และให้ประเทศที่พัฒนาแล้วช่วยเหลือทางการเงินแก่ประเทศกำลังพัฒนาในการต่อสู้โลกร้อน โดยประเทศภาคีแต่ละประเทศมีการกำหนดเป้าหมายในการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจกของตน และทุก 5 ปี จะต้องมีการรายงานข้อเสนอดำเนินการที่เรียกว่า Nationally Determined Contribution (NDC) ของประเทศ

³ เป็นพิธีที่มีคุณสมบัติในการดูดซับก๊าซเรือนกระจกสุทธิเป็นศูนย์ (CO₂) มีเทน (CH₄) ไนตรัสออกไซด์ (N₂O) ก๊าซไฮโดรฟลูออโรคาร์บอน (HFCs) ก๊าซเพอร์ฟลูออโรคาร์บอน (PFCs) ก๊าซซัลเฟอร์เฮกซะฟลูออไรด์ (SF₆) ก๊าซไนโตรเจนไตรฟลูออไรด์ (NF₃) เป็นต้น

⁴ ความเป็นกลางทางคาร์บอน (Carbon Neutrality) คือ ปริมาณการปล่อย GHGs ที่ขึ้นบรรยาหักเท่ากับปริมาณ GHGs ที่ถูกดูดซับคืนมา โดยผ่าน 3 กลไก ได้แก่ (1) “ลด” การปล่อย GHGs เช่น การใช้พลังงานหมุนเวียนแทนการใช้เชื้อเพลิงฟอสซิล (Fossil Fuel) (2) “ชดเชย” GHGs จากชั้นบรรยากาศ เช่น การปลูกป่าเพื่อเพิ่มแหล่งสะสมก๊าซ CO₂ ตามธรรมชาติ (Carbon Sink) การใช้เทคโนโลยีในการดักจับก๊าซ CO₂ และนำกลับมาใช้ใหม่ได้ทันที หรือใช้ในอุตสาหกรรมอื่นๆ และ (3) “ชดเชย” การปล่อย GHGs ด้วยการซื้อคาร์บอนเครดิต (Carbon Credit Offset) ยกตัวอย่างให้เห็นภาพ เช่น หากเราปล่อย GHGs เท่ากับ 100 ล้าน tCO₂e และมีความสามารถในการดูดซับ GHGs ได้เพียง 80 ล้าน tCO₂e เราสามารถชดเชยการปล่อย GHGs ที่เหลืออีก 20 ล้าน tCO₂e ด้วยการซื้อคาร์บอนเครดิต (Carbon Credit)

⁵ การปล่อยก๊าซเรือนกระจกสุทธิเป็นศูนย์ (Net Zero Emissions) จะเกิดขึ้นได้เมื่อ GHGs ที่เกิดขึ้นจากกิจกรรมต่างๆ ของมนุษย์มีการสมดุลกับการดูดซับ GHGs กล่าวคือ หากเราปล่อย GHGs เท่ากับ 100 ล้าน tCO₂e ก็จะต้องมีการดูดซับหรือชดเชย GHGs เท่ากับ 100 ล้าน tCO₂e เช่นกัน ไม่สามารถชดเชยการปล่อย GHGs ด้วยการซื้อคาร์บอนเครดิตได้



Capital Markets Note

กลไกที่จะช่วยลดปริมาณการปล่อย GHGs สามารถทำได้ผ่านกิจกรรมต่างๆที่นำไปคำนวณคาร์บอนเครดิต (Carbon Credit) ประเทศไทยมีการดำเนินการซื้อขายคาร์บอนเครดิตผ่านโครงการชดเชยคาร์บอน (T-COP) แบบภาคสมัครใจตามมาตรฐานของประเทศไทย (T-VER)

โดยในปัจจุบันกลไกในการช่วยลดปริมาณการปล่อย GHGs สามารถทำได้ผ่านโครงการที่ป้องกันหรือลดปริมาณ GHGs ได้แก่ โครงการผลิตพลังงานสะอาด การปลูกต้นไม้ เป็นต้น ทั้งนี้กิจกรรมเหล่านี้สามารถนำไปคำนวณคาร์บอนเครดิต (Carbon Credit)⁶ ซึ่งมีหน่วยเป็นตันคาร์บอนไดออกไซด์เทียบเท่า (tCO₂e) และมีจุดเริ่มต้นมาจากพิธีสารเกียวโต (Kyoto Protocol) โดยประเทศที่สามารถลดปริมาณ GHGs จะได้รับคาร์บอนเครดิตที่สามารถขายให้กับประเทศอื่นที่ปล่อย GHGs โดยผู้ซื้อคาร์บอนเครดิตจะเป็นกลุ่มประเทศพัฒนาแล้วที่เป็นภาคีสมาชิก จำนวน 41 ประเทศ ในขณะที่ผู้ขายคาร์บอนเครดิตเป็นประเทศกำลังพัฒนาที่เป็นภาคีสมาชิกจำนวน 150 ประเทศ การซื้อขายคาร์บอนเครดิตจะดำเนินการผ่านตลาดคาร์บอน (Carbon Market) ดังนั้น การซื้อขายคาร์บอนเครดิตจึงเป็นหนึ่งในเครื่องมือที่ใช้บรรเทาผลกระทบจากภาวะโลกรวนที่สามารถช่วยให้การลด GHGs สู่ขีดลดลงด้วยต้นทุนการลดที่ต่ำที่สุดและยังช่วยแก้ปัญหาผลกระทบภายนอกเชิงลบ (Negative Externality) โดยทำให้ผู้ที่ก่อมลพิษ หรือปล่อย GHGs มีต้นทุนในการปล่อย GHGs หรือต้องบรรเทา หรือชดเชยผลกระทบที่จะเกิดขึ้นกับโลก และผู้ที่ได้รับผลกระทบจากภาวะโลกรวน ด้วยการทำให้การปล่อย หรือ การลด GHGs มีราคา ซึ่งกลไกตลาดจะทำให้เกิดจุดดุลยภาพ (equilibrium) ทำให้การลด GHGs สู่ขีดลดลงด้วยต้นทุนการลดที่ต่ำที่สุดในท้ายที่สุด (ที่มา : อบก.)

ทั้งนี้ ตลาดคาร์บอนสามารถแบ่งออกได้ 2 ประเภท ได้แก่

1) ตลาดคาร์บอนภาคบังคับ (Mandatory carbon market) จัดตั้งขึ้นสืบเนื่องจากผลบังคับในการลดการปล่อย GHGs ตามกฎหมายซึ่งต้องมีรัฐบาลเข้ามาเกี่ยวข้องกับในฐานะผู้ออกกฎหมาย และเป็นผู้กำกับดูแลปริมาณการปล่อย GHGs โดยผู้ที่เข้าร่วมในตลาดจะต้องมีเป้าหมายการลดการปล่อย GHGs ที่มีผลผูกพันตามกฎหมาย (Legally binding target) อย่างไรก็ตามผู้ที่ไม่สามารถปฏิบัติตามเป้าหมายที่ตั้งไว้จะถูกลงโทษ และ/หรือ ผู้ที่สามารถปฏิบัติตามเป้าหมายที่ตั้งไว้จะสามารถได้รับสิทธิประโยชน์ต่างๆ หรือไม่ได้ขึ้นอยู่กับการบัญญัติกฎหมาย กลุ่มประเทศที่ใช้ตลาดคาร์บอนภาคบังคับ เช่น สหภาพยุโรป EU Emissions Trading System (EU-ETS) หรือ Australian Carbon Pollution Reduction Scheme ของประเทศออสเตรเลีย และ Regional Greenhouse GAS Initiative ของสหรัฐอเมริกา เป็นต้น

2) ตลาดคาร์บอนแบบภาคสมัครใจ (Voluntary carbon market) คือ ตลาดคาร์บอนที่ถูกสร้างขึ้นโดยไม่ได้มีกฎหมายที่เกี่ยวข้องกับการควบคุม GHGs มาบังคับ การจัดตั้งตลาดเกิดขึ้นจาก

ความร่วมมือกันของผู้ประกอบการหรือองค์กร เพื่อเข้าร่วมซื้อขายคาร์บอนเครดิตในตลาด โดยอาจจะมีการตั้งเป้าหมายในการลดการปล่อย GHGs ของตนเองโดยสมัครใจ (Voluntary) แต่ไม่ได้มีผลผูกพันตามกฎหมาย (Non-legally binding target) เช่น กรณี Thailand Voluntary Emission Reduction (T-VER) ของประเทศไทย

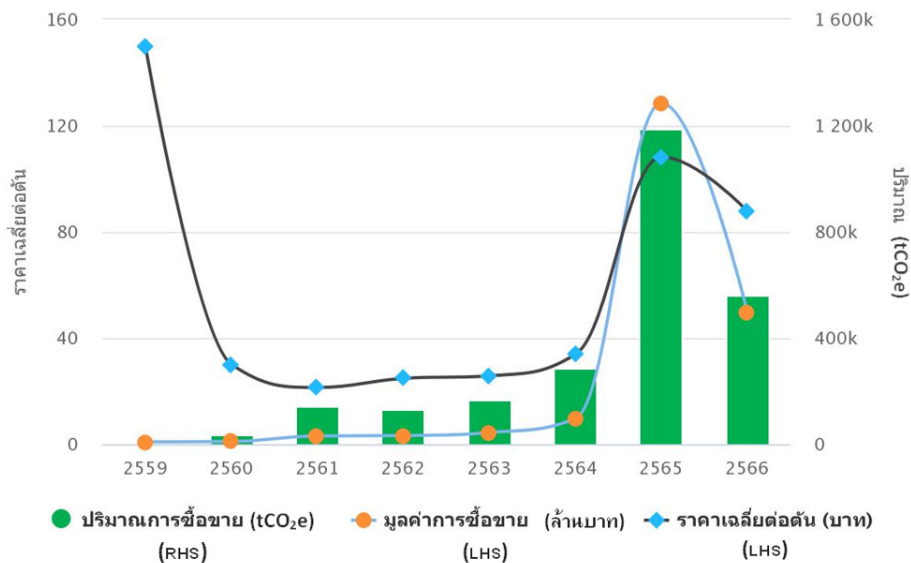
การซื้อขายคาร์บอนเครดิต สามารถดำเนินการได้ 2 รูปแบบ ได้แก่ 1) การซื้อขายผ่านแพลตฟอร์มตลาดซื้อขาย (Trading Platform) หรือศูนย์ซื้อขายคาร์บอนเครดิตที่ตั้งขึ้นอย่างเป็นทางการ 2) ซื้อขายในระบบบววิภาค (Over-the-counter : OTC) ซึ่งเป็นการตกลงกันระหว่างผู้ต้องการซื้อและผู้ขายโดยตรง ซึ่งเป็นผู้พัฒนาโครงการที่ต้องการขายคาร์บอนเครดิตของตนโดยไม่ผ่านตลาด

ปัจจุบันการซื้อขายคาร์บอนเครดิตในประเทศไทยมีการดำเนินการผ่านโครงการชดเชยคาร์บอน หรือ Thailand Carbon Offsetting Programme (T-COP) ซึ่งพัฒนาโดย อบก. โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อส่งเสริมให้ภาครัฐ ภาคเอกชน และภาคอุตสาหกรรมทำกิจกรรมชดเชยการปล่อย GHGs เพื่อเป็นการแสดงความรับผิดชอบต่อสังคมเพื่อสร้างอุปสงค์คาร์บอนเครดิตจากโครงการลด GHGs ภาคสมัครใจตามมาตรฐานของประเทศไทย โดยซื้อขายได้ทั้งแบบ OTC และแบบ Trading Platform หรือแพลตฟอร์ม FTIX ซึ่งผู้พัฒนาโครงการ หรือผู้ประสงค์จะซื้อขายคาร์บอนเครดิต (TVERs) จะต้องเปิดบัญชี T-VER Credit กับ อบก. ก่อนทำการซื้อขายคาร์บอนเครดิต

ขณะที่ อบก. เปิดเผยมูลค่าการซื้อขายของคาร์บอนเครดิตในประเทศไทยภายใต้โครงการ T-VER มีมูลค่าการซื้อขายเพิ่มขึ้นทุกปี (ภาพที่ 1) สะท้อนถึงการตระหนักถึงความสำคัญของการแก้ไขปัญหา Climate Change โดยในปี 2559 ซึ่งเป็นปีแรกเริ่มโครงการ มีมูลค่าการซื้อขายเพียง 846,000 บาท เพิ่มขึ้นเป็น 128 ล้านบาท ในปี 2565 ขณะที่ในช่วง 6 เดือนแรกของปี 2566 มูลค่าการซื้อขายคาร์บอนเครดิต 49 ล้านบาท ส่วนราคาคาร์บอนเฉลี่ยต่อตัน มีราคาเฉลี่ยสูงสุดประมาณ 150 บาทต่อตัน ในช่วงเปิดตลาดซื้อขายในปีแรก ขณะที่ล่าสุดราคาเฉลี่ยอยู่ที่ 88 บาทต่อตัน

⁶ คาร์บอนเครดิต หมายถึง ปริมาณ GHGs ที่ลดหรือกักเก็บได้จากการดำเนินโครงการลด GHGs ผ่านกลไกต่างๆ เช่น การปลูกป่า การเพิ่มพื้นที่สีเขียว การดักจับและกักเก็บก๊าซคาร์บอน เป็นต้น โดยแหล่งสร้างคาร์บอนเครดิตที่สำคัญคือ แหล่งดูดซับก๊าซ CO₂ ที่เรียกว่าคาร์บอนซิงค์ (Carbon Sink) อันได้แก่ ป่าไม้ธรรมชาติได้ขุดแล้วที่ป่าสมบูรณ์ 1 เฮกตาร์ หรือประมาณ 2.5 ไร่ จะสามารถกักเก็บก๊าซ CO₂ ได้ประมาณ 2 ตัน (Mercher, 2009) นอกจากนี้กิจกรรมที่เกี่ยวข้องกับการใช้พลังงานทดแทนจะสามารถเทียบคาร์บอนเครดิตได้ โดยการใช้พลังงานแสงอาทิตย์แทนน้ำมัน 1 หน่วย (กิโลวัตต์/ชั่วโมง) จะได้รับคาร์บอนเครดิตประมาณ 0.6 กิโลกรัม (UNFCCC, 2010) เป็นต้น (ที่มา : วารสารปัญญาภิวัฒน์)

ภาพที่ 1 : ปริมาณและมูลค่าการซื้อขายคาร์บอนเครดิตจากโครงการ T-VER



ที่มา : อบก.

งานวิจัยของ McKinsey คาดว่าในปี 2573 ความต้องการคาร์บอนเครดิตโลกในตลาดซื้อขายคาร์บอนภาคสมัครใจจะเติบโตถึง 15 เท่า จากปี 2563 จนแตะระดับ 1.5 - 2 กิกะตันของคาร์บอนไดออกไซด์เทียบเท่า (GtCO₂) ต่อปี และเติบโตมากถึง 100 เท่า จนมาอยู่ที่ราว 7 - 13 GtCO₂ ต่อปี ในปี 2593 ตามลำดับ

ขณะที่ อบก. คาดการณ์ความต้องการคาร์บอนเครดิตในประเทศไทยมีแนวโน้มเพิ่มขึ้นอย่างมาก จากกระแสความตื่นตัวและความมุ่งมั่นทั้งในระดับประเทศและระดับองค์กรที่มีการตั้งเป้าหมายที่จะเป็น Carbon Neutrality และ Net Zero Emissions โดย อบก. ได้รวบรวมข้อมูลจากรายงานประจำปีขององค์กรที่มีการเปิดเผยข้อมูลการปล่อย GHGs ปี 2563 (ที่เปิดเผยผ่านตลาดหลักทรัพย์แห่ง

ประเทศไทย) พบว่า เมืองคาร์บอน จำนวน 81 เมือง มีปริมาณการปล่อย GHGs รวม 162 ล้าน tCO_2e ต่อปี (/y) นอกจากนี้ทาง อบก. คาดว่า ความต้องการคาร์บอนเครดิตจากกิจกรรมชดเชยคาร์บอนประเภทต่างๆ จะมีประมาณ 182 - 197 ล้าน tCO_2e/y หรือมีความต้องการรวมถึง ปี 2573 ที่ 1,823 - 1,973 ล้าน tCO_2e/y แบ่งเป็นจากกิจกรรม ชดเชยคาร์บอน 5 ประเภท ได้แก่ 1) การชดเชยและลดปริมาณ การปล่อยก๊าซคาร์บอนไดออกไซด์ภาคการบินระหว่างประเทศ (CORSIA) 2) การตั้งเป้าหมายการชดเชยและลดปริมาณการปล่อย ก๊าซ CO_2 ขององค์กรตาม **SBT**⁷ (Organization Offset-SBT) 3) การจัดงานอีเว้นท์ (Event Offset) 4) การบริการท่องเที่ยว (Tourism Offset) 5) การปล่อย GHGs ส่วนบุคคล (Personal Offset) (ภาพที่ 2)

ภาพที่ 2 : คาดการณ์ความต้องการการคาร์บอนเครดิตในประเทศจากกิจกรรมขุดเซเชคาร์บอนประเภทต่างๆ

โครงการ	การชดเชยและลดปริมาณการปล่อยก๊าซคาร์บอนไดออกไซด์ภาคการบินระหว่างประเทศ	การตั้งเป้าหมายขององค์กรตาม SBT	การจัดงานอีเว้นท์	ภาคบริการท่องเที่ยว	ส่วนบุคคล
Quantity (MtCO ₂ e/year)	25 - 40	156.23	0.95	0.00103	0.054
Total Quantity (MtCO ₂ e@2030)	250 - 400	1,563	9.5	0.0103	0.54
Total Demand per year 182.23 – 197.23 MtCO ₂ e					
Total Demand unit 2030 1,823 – 1,973 MtCO ₂ e					

ที่มา : อบก. และรวบรวมโดยสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย

⁹ Science-based Targets (SBT) คือ การกำหนดเป้าหมายการลด GHGs ที่สอดคล้องกับเป้าหมายของข้อตกลงปารีส บนพื้นฐานทาง Climate Science ซึ่งมีเป้าหมายในการจำกัดอุณหภูมิเฉลี่ยโลกให้ไม่เกิน 2 องศาเซลเซียส และมุ่งสู่การจำกัดอุณหภูมิไม่ให้เกิน 1.5 องศาเซลเซียส สำหรับความถี่ของการคำนวณคาร์บอนไดออกไซด์ในประเภทภาคที่ 81 หรือ วิธีการประเมินจะถูกดำเนินการโดย GNA ผ่านกลไกการจัดทำทรัพย์สินและหนี้สิน โดย คำนวณจากปีฐานเป็นต้นมา ตั้งแต่ ปี 1. ก่อนที่องค์กรจะมีการยื่นรายงาน SBT ที่ระดับ 2 องศา 2. กำหนดให้องค์กรสามารถลด GHGs ตามเป้าหมาย SBT 2 องศาได้ 3. กำหนดให้ทุกองค์กร มีการปล่อยก๊าซเรือนกระจกสุทธิ ผลการดำเนินงาน บริษัทภาคีหรือพันธมิตรภายใต้ Carbon Neutral Organization จะมีการเปิดเผยต่อการจัดอันดับเครดิตของบริษัท 1,562 ราย ในปีที่ 1. 2563 - 2573

Capital Markets Note

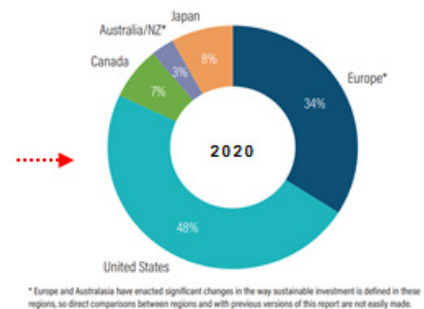
ภาคเอกชนได้มีการตระหนักถึงการปล่อย GHGs ในการผลิตมากขึ้น นอกจากขดเชยการปล่อย GHGs ด้วยการซื้อคาร์บอนเครดิตแล้ว ผู้ประกอบการในภาคการผลิต ตลอดจนห่วงโซ่อุปทานได้เริ่มปรับเปลี่ยนกระบวนการผลิตให้เป็นมิตรต่อสิ่งแวดล้อมมากขึ้น

ในปัจจุบัน ภาคเอกชนได้มีการตระหนักถึงการปล่อย GHGs ในภาคการผลิตที่เป็นสาเหตุของภาวะโลกร้อนมากขึ้น นอกจากขดเชยการปล่อย GHGs ด้วยการซื้อคาร์บอนเครดิตแล้ว ผู้ประกอบการในภาคการผลิต ตลอดจนห่วงโซ่อุปทานได้เริ่มปรับเปลี่ยนกระบวนการผลิตให้เป็นมิตรต่อสิ่งแวดล้อมมากขึ้น ในต่างประเทศได้มีการผลักดันในเรื่องนี้โดยนำมาตราการภาษีมาใช้เพื่อกระตุ้นให้ภาคเอกชนตระหนักถึงความสำคัญของการลดมลพิษทางอากาศ ตัวอย่างเช่น นโยบายแผนปฏิรูปสีเขียวของสหภาพยุโรป หรือ การปรับภาษีคาร์บอนก่อนเข้าพรมแดนของสหภาพยุโรป (Carbon Border Adjustment Mechanism : CBAM)⁸ ซึ่งมีผลบังคับใช้แบบเต็มรูปแบบในวันที่ 1 ตุลาคม 2566 นอกจากนี้ยังมีประเทศสหรัฐอเมริกา ซึ่งอยู่ระหว่างการพิจารณา ร่างกฎหมายการเก็บภาษีคาร์บอน (Clean Competition Act : CCA) เพื่อกำหนดราคาคาร์บอนจากสินค้าที่ก่อให้เกิด GHGs เพิ่มขึ้นที่ผลิตในประเทศและการนำเข้า CBAM ซึ่งจะมีผลบังคับใช้ในวันที่ 1 มกราคม 2569 นอกจากนี้ยังมีประเทศอื่นๆ ที่มีแนวโน้มจะบังคับใช้ CBAM ในอนาคต เช่น จีน ญี่ปุ่น สิงคโปร์ และเกาหลีใต้ เป็นต้น

ในด้านการเงินการลงทุน องค์กรต่างๆ รวมถึงนักลงทุนทั่วโลกให้ความสำคัญในเรื่องแนวคิดด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และ ธรรมาภิบาล (Environmental, Social, Governance : ESG) นอกจากพิจารณาปัจจัยด้านผลตอบแทน โดยจะเห็นได้ว่าความรับผิดชอบต่อปัจจัยด้าน ESG ของบริษัท ถูกนำมาใช้เป็นส่วนหนึ่งขององค์ประกอบการพิจารณาสินทรัพย์เพื่อการลงทุน ผ่านการลงทุนอย่างยั่งยืน (Sustainable Investment) โดยจากรายงานประจำปี Global Sustainable Investment Alliance 2022 หรือ GSIA ระบุขนาดสินทรัพย์ภายใต้การบริหารจัดการ (AUM) ของการลงทุนในหุ้นยั่งยืน (Sustainable Investing) ทั่วโลกรวมกันมีการปรับตัวเพิ่มขึ้นจาก 22,839 พันล้านดอลลาร์สหรัฐฯ ในปี 2559 สู่มูลค่า 35,301 พันล้านดอลลาร์สหรัฐฯ ในปี 2563 (ภาพที่ 3)

ภาพที่ 3 : global assets under management 2016 - 2020 (USD billions)

REGIONS	2016	2018	2020
Total AUM of regions	81,948	91,828	98,416
Total sustainable investments only AUM	22,872	30,683	35,301
% Sustainable investments	27.9%	33.4%	35.9%
Increase of % sustainable investments (compared to prior period)		5.5%	2.5%



หมายเหตุ : * According to the source, "Europe and Australasia have enacted significant changes in the way sustainable investment is defined in these regions, so direct comparisons between regions and with previous versions of this report are not easily made."

ที่มา : The Global Sustainable Investment Alliance (GSIA)

⁸ EU เป็นกลุ่มประเทศแรกที่มีการจัดตั้งภาษีคาร์บอนตามมาตรการ CBAM ที่จะเริ่มบังคับใช้ในวันที่ 1 ตุลาคม 2566 นี้ กับ 7 กลุ่มสินค้า ได้แก่ เหล็กและเหล็กกล้า, อะลูมิเนียม, ซีเมนต์, ปูน, ไฟฟ้า, ไฮโดรเจน, และสินค้าปลายทางรายการ เช่น นิตและสกรูที่ทำจากเหล็กและเหล็กกล้า โดยในช่วง 3 ปีแรก คือ ปี 2566 - 2568 เป็นช่วงเปลี่ยนผ่านสินค้าทั้ง 7 กลุ่มที่จะส่งเข้าไปยัง EU จะต้องซื้อ CBAM Certificates โดยยังไม่มีมีการกำหนดค่าธรรมเนียม และนับตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2026 เป็นต้นไป จะมีการบังคับใช้มาตรการ CBAM อย่างเต็มรูปแบบ

Capital Markets Note

ด้านตลาดทุนมีการใช้เครื่องมือต่างๆ ในการประเมินและสนับสนุนการแก้ไขปัญหาของ Climate Change ผ่านแนวคิด ESG อย่างต่อเนื่อง

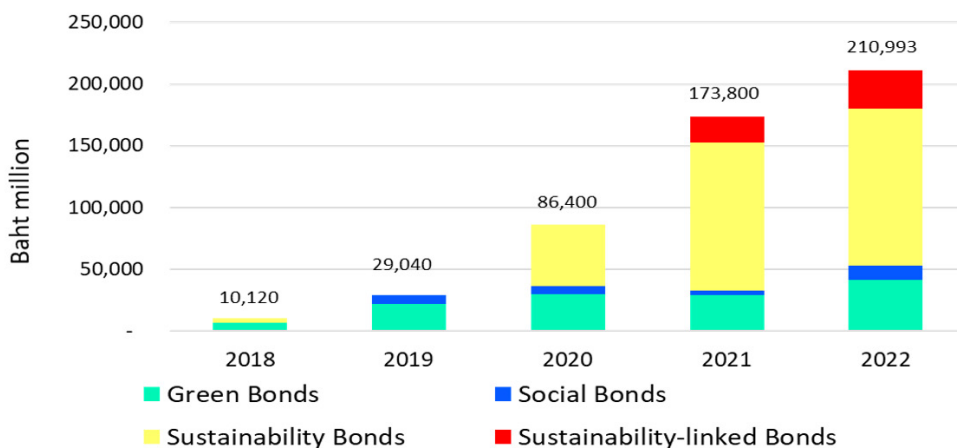
สำหรับในประเทศไทยนั้น ภาคส่วนต่างๆ ในตลาดทุนได้ตระหนักถึงปัญหา Climate Change เพิ่มขึ้น มีการดำเนินการเพื่อสนับสนุนการแก้ไขอย่างต่อเนื่อง ตัวอย่างเช่น

- **สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (กลต.)** ได้มีการจัดทำเกณฑ์ในการจัดตั้งกองทุนคาร์บอนในประเทศไทย^{*} เพื่อเป็นเครื่องมือสำหรับบริษัทที่ดำเนินการโครงการลดการปล่อย GHGs ในการเข้าถึงแหล่งทุน และตลาดคาร์บอนเครดิต รวมถึงสนับสนุนมาตรฐานการเปิดเผยข้อมูลทางการเงินที่เกี่ยวข้องกับสภาพภูมิอากาศ (Task Force on Climate-Related Financial Disclosures : TCFD) เช่น การยกระดับการเปิดเผยข้อมูล ESG ของบริษัทจดทะเบียน (บจ.) ในการเปิดเผยข้อมูลในรูปแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี (แบบ 56-1 One Report) เป็นต้น และเมื่อวันที่ 26 พฤษภาคม 2565 ได้มีการจัดพิธีลงนามบันทึกข้อตกลงความร่วมมือ (MoU) ว่าด้วยการส่งเสริมและผลักดันการดำเนินงานของภาคธุรกิจ ร่วมกับสำนักงานนโยบายและแผนทรัพยากรธรรมชาติและสิ่งแวดล้อม (สผ.) เพื่อลดการปล่อย GHGs เพื่อตอบโจทย์ทิศทางการพัฒนาของประเทศไทยในการบรรลุเป้าหมายความเป็นกลางทางคาร์บอน (Carbon Neutrality) การปล่อยก๊าซเรือนกระจกสุทธิเป็นศูนย์ (Net Zero)
- **ในมุมมองผู้ระดมทุน** มีการระดมทุนเพื่อใช้ในโครงการที่เป็นมิตรกับสิ่งแวดล้อม หรือ ส่งเสริมการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม อาทิ ตราสารหนี้เพื่ออนุรักษ์สิ่งแวดล้อม (Green Bond) ตราสารหนี้เพื่อความยั่งยืน (Sustainability Bond) ที่มีส่วนผสมระหว่าง Green Bond และ Social Bond ซึ่งมุ่งหวังทั้งการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมและพัฒนา

สังคมควบคู่กันไป รวมไปถึงตราสารหนี้ส่งเสริมความยั่งยืน (Sustainability-Linked Bond) ที่มุ่งเน้นให้เกิดผลกระทบเชิงบวกต่อสิ่งแวดล้อมและสังคมซึ่งในประเทศไทยมีมูลค่าการออก ESG Bond เพิ่มขึ้นต่อเนื่องทุกปี จาก 10,120 ล้านบาท ในปี 2561 เพิ่มขึ้นมาที่ 210,993 ล้านบาท ณ สิ้นปี 2565 (ภาพที่ 4)

- **ด้านตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET)** มีการพัฒนาเครื่องมือหรือสนับสนุนให้มีการใช้เครื่องมือในการประเมิน หรือให้มีการเปิดเผยข้อมูลต่างๆ ที่สะท้อนปัจจัยการเปลี่ยนแปลงด้านสิ่งแวดล้อมผ่านการประเมินถึงแนวคิด ESG ในการส่งเสริมภาคธุรกิจต่อการให้ความสำคัญในการดำเนินธุรกิจตามแนวทางการพัฒนาอย่างยั่งยืน เช่น การจัดทำรายชื่อนหุ้นยั่งยืน หรือ THSI โดยในปี 2565 ที่ผ่านมามีบริษัท 168 บริษัท ที่ถูกจัดอยู่ในกลุ่มหุ้นยั่งยืนซึ่งเพิ่มขึ้นจาก 144 บริษัทในปีที่ผ่านมา สะท้อนว่าบริษัทจดทะเบียนไทยให้ความสำคัญในการพัฒนาองค์กรเพื่อการเติบโตอย่างมั่นคงต่อเนื่อง และพร้อมรับมือกับปัจจัยการเปลี่ยนแปลงด้านสิ่งแวดล้อมและสังคม นอกจากนี้ยังมีการจัดทำดัชนี SETTHSI ขึ้น เพื่อเป็นดัชนีที่สะท้อนการเคลื่อนไหวราคาของกลุ่มหลักทรัพย์ ของบริษัทที่มีการดำเนินธุรกิจอย่างยั่งยืน การเผยแพร่ ESG Ratings ของบริษัทจดทะเบียนไทย เพื่อส่งเสริมการลงทุนอย่างยั่งยืน รวมทั้งมีการพัฒนา ESG Data Platform เพื่อรวบรวมและจัดเก็บข้อมูล ESG จากการรายงานของ บจ. เพื่อให้ผู้ลงทุนและนักวิเคราะห์การลงทุนใช้ในการประกอบการตัดสินใจลงทุน เป็นต้น

ภาพที่ 4 : Thailand's ESG bonds (Environmental, Social and Governance) outstanding



ที่มา : ThaiBMA

^{*} โดยสามารถศึกษาเพิ่มเติมจากประกาศ ก.ล.ต. ที่ พ.น. 42/2555, พ.น. 43/2555, พ.น. 44/2555 และประกาศ กลต. ที่ ส.น. 21/2555, ส.น. 22/2555

Capital Markets Note

- **ทางด้านผู้ประกอบการธุรกิจในตลาดทุน** ตัวอย่างเช่น บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน (บลจ.) มีการออกกองทุนที่ให้ความสำคัญกับ ESG (โดยทางสมาคมบริษัทจัดการลงทุน เผยข้อมูลกองทุนรวมในชุด ESG Fund ณ 30 มิถุนายน 2566 มีจำนวน 69 กองทุน คิดเป็นมูลค่าทรัพย์สินสุทธิอยู่ที่ 29,912 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 3.5% จากปี 2565) นอกจากนี้ประเทศไทยได้มีกองทุนคาร์บอนเครดิตกองแรก ได้แก่ กองทุนเปิดแอสเซทพลัส โกลบอล คาร์บอนเครดิต (ห้ามขายผู้ลงทุนรายย่อย) ประกอบกับ บลจ. รวมทั้งบริษัทหลักทรัพย์ มีแนวปฏิบัติที่ดีภาคสมัครใจในการบริหารจัดการ และเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับ TCFD สำหรับผู้ประกอบการจัดการลงทุน ในการพิจารณาเรื่องความรับผิดชอบต่อปัจจัยด้าน ESG และความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับ ESG ของบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์ที่กองทุนลงทุน (investee companies) ในส่วนของบริษัทจัดอันดับกองทุน เช่น Morningstar ได้นำ Carbon Risk Score มาประเมินว่าบริษัทมีความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงสู่ low-carbon economy มากน้อยเพียงใด โดยหากกองทุนลงทุนในธุรกิจเหล่านั้น ก็จะสะท้อนไปที่ความเสี่ยงกองทุนรวมเช่นกัน
- **ทางสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย** ในช่วงที่ผ่านมาได้ดำเนินกิจกรรมที่สนับสนุนให้บริษัทสมาชิกเห็นความสำคัญของ ESG เช่น ประชาสัมพันธ์ และเชิญชวนบริษัทหลักทรัพย์ในการประกาศตนว่าจะดำเนินธุรกิจด้วยความรับผิดชอบต่อตาม Sustainable Development Goals (SDGs) การจัดทำหนังสือขอความร่วมมือบริษัทสมาชิกร่วมสร้างความรู้ความเข้าใจ และการมีส่วนร่วมของพนักงานใช้ทรัพยากรอย่างเหมาะสม การผลักดันหลักสูตร ESG เป็นหลักสูตรภาคบังคับต่ออายุ IC IP และนักวิเคราะห์ รวมถึงสนับสนุนการปรับปรุงหลักเกณฑ์บทวิเคราะห์ที่มีคุณภาพของสมาคมนักวิเคราะห์หลักทรัพย์ ให้มีความเหมาะสมยิ่งขึ้น โดยเพิ่มเติมในเรื่องควรรีกรวิเคราะห์ ESG เป็นต้น

Market & Securities Industry Statistics

Market & Securities Industry Statistics in Q2-2023

- ณ สิ้นไตรมาส 2/2566 ดัชนี SET ปิดที่ 1,503.10 จุด ลดลง 9.92% จากปี 2565 ส่วนดัชนี mai ปิดที่ 459.78 จุด ลดลง 21.29% จากปี 2565 โดยปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันของ SET และ mai รวมกัน ณ ไตรมาสที่ 2 ปี 2566 อยู่ที่ 49,964 ล้านบาท ลดลง 34.92% จากปี 2565
- มูลค่าคงค้างตลาดตราสารหนี้ ณ สิ้นไตรมาส 2/2566 อยู่ที่ 16.22 ล้านล้านบาท เติบโต 3.99% จากสิ้นปี 2565 โดยคาดว่าจะการออกหุ้นกู้ภาคเอกชนที่อยู่ในระดับ Investment Grade ยังคงมีแนวโน้มได้รับความนิยมได้รับความสนใจ ในขณะที่หุ้นกู้ Non-Investment Grade อาจเผชิญกับแรงกดดันหลังกรณี STARK
- ณ สิ้นไตรมาส 2/2566 บล.มีจำนวนสาขาทั้งสิ้น 399 แห่ง ลดลง 12 แห่ง จากปี 2565 และมีจำนวนการขึ้นทะเบียนและปฏิบัติหน้าที่ Investment Planer (IP) และ Investment Consultant (IC) มีจำนวนรวมกัน 8,354 ใบอนุญาต ลดลง 67 ใบอนุญาตจากปี 2565 โดยในส่วน IC ตามโครงสร้างเดิม มีจำนวน 256 ใบอนุญาต ลดลง 6 ใบอนุญาต และ IC ตามโครงสร้างใหม่ รวมทุกประเภทลดลง 84 ใบอนุญาตจากปี 2565 ขณะที่ในส่วน IP เพิ่มขึ้น 23 ใบอนุญาต ส่วน Analyst (ไม่รวม Technical) มี 415 ใบอนุญาต เพิ่มขึ้น 7 ใบอนุญาต จากปี 2565

%Change

Equity Market -SET & mai	2022	Q4-2022	Q1-2023	Q2-2023	QoQ	YTD
SET Index *	1,668.66	1,668.66	1,609.17	1,503.10	-6.59%	-9.92%
mai Index*	584.16	584.16	538.10	459.78	-14.55%	-21.29%
Market Capitalization (mil.Bt)*	20,976,310	20,976,310	20,266,652	18,888,223	-6.80%	-9.95%
Total Turnover (mil. Bt)	18,502,257	3,693,619	4,201,092	2,897,919	-31.02%	
Avg. Daily Turnover (mil. Bt)	76,773	61,560	66,684	49,964	-25.07%	-34.92%
Derivatives Market	2022	Q4-2022	Q1-2023	Q2-2023	QoQ	YTD
Total Trading Volume (contracts)	136,316,012	34,119,159	37,622,255	29,964,161	-20.36%	
Avg. Daily Turnover (contracts)	565,627	568,653	597,179	516,623	-13.49%	-8.66%
Open Interest (contracts)*	3,983,852	3,983,852	3,148,999	2,946,977	-6.42%	-26.03%
Bond Market – ThaiBMA	2022	Q4-2022	Q1-2023	Q2-2023	QoQ	YoY
Outright Trading Value (mil.Bt)	14,078,137	3,408,352	4,270,766	4,003,112	-6.27%	
Outright Daily Average (mil.Bt)	58,416	56,806	67,790	69,019	1.81%	18.15%
Outstanding Value of domestic bond (mil.Bt)*	15,602,395	15,602,395	15,913,253	16,224,527	1.96%	3.99%

%Change

License Holder (unit: company)*	2022	Q4-2022	Q1-2023	Q2-2023	QoQ	YTD
Brokerage License	45	45	45	44	-1	-1
Dealer License	36	36	36	35	-1	-1
Derivatives Agent	45	45	45	45	0	0
Financial Advisory License	73	73	73	71	-2	-2
Underwriting License	41	41	41	40	-1	-1
SBL License	29	29	29	28	-1	-1
Number of Branch (unit: branch)*	2022	Q4-2022	Q1-2023	Q2-2023	QoQ	YTD
Bangkok and Surrounding Area**	190	190	184	187	3	-3
Other Provincial Area	221	221	211	212	1	-9
Number of IP/Analyst/IC (unit: license)*	2022	Q4-2022	Q1-2023	Q2-2023	QoQ	YTD
Analysts	Capital Market	71	71	72	7	8
	Securities Market	306	306	304	3	1
	Derivatives Market	31	31	30	-1	-2
	Technical	82	82	81	1	0
Investment Consultants	Investment Planners	937	937	948	12	23
	Capital Market	0	0	0	0	0
	Securities Market	177	177	174	0	-3
	Derivatives Market	85	85	82	-3	-3
	(New) Complex 1	5,012	5,012	4,996	-30	-46
	(New) Complex 2	1,630	1,630	1,627	-29	-32
	(New) Complex 3	206	206	208	-2	0
	(New) IC Plain	374	374	386	-18	-6
Number of Investors – Equity*	2022	Q4-2022	Q1-2023	Q2-2023	QoQ	YTD
No. of Investors Accounts (unit: accounts)*	5,848,429	5,848,429	5,270,555	5,386,341	115,786	-462,088****
No. of Investors (unit: clients)*	3,401,106	3,401,106	3,459,392	3,534,065	74,673	132,959
Active Investors *** (unit: accounts)	608,760	518,337	552,026	471,762	-80,264	-136,998
Number of Accounts – Derivatives*	2022	Q4-2022	Q1-2023	Q2-2023	QoQ	YTD
Total Accounts*	290,628	290,628	297,504	303,524	6,020	12,896

* data at end of each period ** Nonthaburi, Pathum Thani and Samut Prakan province *** Average data calculated from monthly data of number of active investors **** Subject to SET (Awaiting member to update their information)

Source : SET, TFEX, ThaiBMA, SEC

Disclaimer: เอกสารนี้จัดทำขึ้นเพื่อเผยแพร่ข้อมูลและเพื่อการศึกษาค้นคว้า ซึ่งจัดทำขึ้นจากแหล่งข้อมูลต่างๆ ที่นำเสนอ โดยข้อมูลดังกล่าวเป็นเพียงข้อมูล ณ วันที่ประกาศในเอกสารเท่านั้น ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังวันดังกล่าว หรือเมื่อข้อมูลที่เกี่ยวข้องมีการเปลี่ยนแปลง ทั้งนี้ สมาคมได้ยืนยัน ตรวจสอบ หรือรับรองความสมบูรณ์ ความถูกต้องครบถ้วน ทันกาลทันเวลา ของข้อมูลดังกล่าวแล้วแต่อย่างไรก็ตาม สมาคมไม่รับผิดชอบต่อบุคคลใดๆ จากการเชื่อถือหรือใดๆ ไม่ว่าในทางสัญญาในการที่จะมีผลรวมถึงความเสียหาย หรือเหตุอื่นใด ที่เกิดจากการตัดสินใจ หรือการกระทำใดๆ ที่เกิดจากความเชื่อใจในเอกสารดังกล่าว หรือในความเสียหาย ความสูญเสีย ค่าสินไหมทดแทน หรือความรับผิดชอบใดๆ รวมถึงการสูญเสียของข้อมูลหรือผลประโยชน์อื่นใดแม้ว่าสมาคมจะได้รับแจ้งว่าจะเกิดความเสียหายดังกล่าวขึ้นก็ตาม

กิจกรรมที่สำคัญของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย



สมาคมต้อนรับคณะผู้แทนจาก สป.ลาว ประกอบด้วย สำนักงาน ก.ล.ต. ตลาดหลักทรัพย์ฯ Bank of Laos และ CEO บริษัทหลักทรัพย์ 3 บริษัท มาเยือนสมาคม เพื่อเรียนรู้ในการจัดตั้งสมาคมในธุรกิจตลาดทุน รวมถึงระบบจัดอบรม Professional License ระหว่างวันที่ 9 - 10 พฤษภาคม 2566



การประชุม Workshop เพื่อหารือเกี่ยวกับ Project Management โครงการ Common Infrastructure for Brokers Back Office กับผู้พัฒนาระบบและตัวแทนสมาชิก เมื่อวันที่ 8 มิถุนายน 2566



โครงการสำรวจข้อมูลเงินเดือนและสวัสดิการ (Salary Survey 2023) เมื่อวันที่ 7 มิถุนายน 2566



การประชุม The 36th ICSA Annual General Meeting 2023 ซึ่งจัดขึ้นระหว่างวันที่ 18 - 20 มิถุนายน 2566 ณ กรุงโซล ประเทศเกาหลีใต้



งานแถลงข่าวโครงการพัฒนาโครงสร้างพื้นฐานดิจิทัลตลาดทุน โดย Main Operator ประกอบด้วย สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ตลาดหลักทรัพย์ฯ และสมาคมธนาคารไทย ร่วมกับ สำนักงาน ก.ล.ต. และ CMDP และสมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย ให้บริการ Digital Infrastructure of Capital Market เริ่มจากระบบ Web Portal ในโครงการระยะนำร่องของสำนักงาน ก.ล.ต. รองรับการเสนอขายตราสารหนี้ภาคเอกชนในตลาดแรกด้วยดิจิทัลทั้งกระบวนการครั้งแรกในไทย เมื่อวันที่ 29 มิถุนายน 2566

