



सानโอกาสการลงทุน
เพื่อคุณ เพื่อธุรกิจ

สารบัญ

1	วิสัยทัศน์และพันธกิจ	30	พัฒนาการสำคัญของตลาดหลักทรัพย์ฯ
2	สารจากประธานกรรมการ		ในปี 2555
4	สารจากกรรมการและผู้จัดการ	54	แผนงานของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ปี 2556
6	คณะกรรมการ	58	การปฏิบัติตามหลักการค้ากับดูแลกิจการที่ดี
12	โครงสร้างองค์กร		ของตลาดหลักทรัพย์ฯ
14	คณะผู้บริหาร	86	รายงานคณะอนุกรรมการตรวจสอบ
16	ความเคลื่อนไหวของการซื้อขาย	88	การบริหารความเสี่ยงองค์กร
	ในตลาดหลักทรัพย์ฯ ปี 2555	91	คำอธิบายและการวิเคราะห์ฐานะการเงิน
18	ข้อมูลทางการเงินที่สำคัญ		และผลการดำเนินงาน
	ของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ	97	รายงานความรับผิดชอบของคณะกรรมการ
19	สรุปภาวะการซื้อขายหลักทรัพย์		ต่อรายงานทางการเงิน
	และสถิติสำคัญประจำปี 2555	100	รายงานของผู้สอบบัญชีรับอนุญาต
25	ลักษณะการประกอบธุรกิจ		และงบการเงิน
	ของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ	149	ข้อมูลบริษัทย่อย



วิสัยทัศน์

เพิ่มพลังให้ธุรกิจและผู้ลงทุน ด้วยความโดดเด่นในการตอบสนองโอกาสทางการเงิน

พันธกิจ

ลูกค้าและสถาบันตัวกลาง

ขยายฐานบริษัทจดทะเบียนและผู้ลงทุนด้วยความสามารถในการตอบสนองความต้องการทางการเงิน และสร้างความเข้มแข็งแก่สถาบันตัวกลาง เพื่อให้เติบโตและประสบความสำเร็จไปด้วยกัน

ผลิตภัณฑ์และบริการ

นำเสนอผลิตภัณฑ์และบริการที่หลากหลาย เพื่อสร้างคุณค่าและตอบสนองโอกาสทางการเงินแก่ธุรกิจและผู้ลงทุนกลุ่มต่างๆ

การปฏิบัติการ

ปฏิบัติงานโดยไม่ผิดพลาดตามมาตรฐานสากล เพื่อให้เกิดประสิทธิภาพ ประสิทธิผล ความยืดหยุ่น และความเชื่อมโยงกับตลาดทุนโลก

บุคลากรและวัฒนธรรมองค์กร

ส่งเสริมให้พนักงานทำงานอย่างเต็มศักยภาพ และสร้างวัฒนธรรมองค์กรที่มุ่งสร้างความเป็นเลิศในการตอบสนองโอกาสทางการเงินแก่ธุรกิจและผู้ลงทุน

สารจากประธานกรรมการ



นายสมพล เกียรติไพบูลย์
ประธานกรรมการ

ในปี 2555 ถึงแม้ว่าบรรยากาศการลงทุนในตลาดหุ้นไทย จะได้รับผลกระทบจากปัจจัยภายนอกประเทศ จากความอ่อนแอของเศรษฐกิจโลกในภูมิภาคสำคัญทั้งในสหรัฐอเมริกา และยุโรปก็ตาม แต่บทพิสูจน์การทำงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ สะท้อนว่าปี 2555 เป็นปีที่ตลาดหุ้นไทยประสบความสำเร็จอย่างสูง และสร้างสถิติสูงสุดในหลายด้าน อาทิ การปรับตัวเพิ่มขึ้นของดัชนีราคาหุ้น (SET index) สูงสุดในรอบ 17 ปี และปรับเพิ่มสูงสุดในภูมิภาคอาเซียน เช่นเดียวกับมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยรายวันที่เพิ่มขึ้นสูงเป็นอันดับหนึ่งเป็นครั้งแรก นอกจากนี้ การเพิ่มขนาดของมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด หรือ มาร์เก็ตแคป ก็ได้สร้างสถิติสูงสุดนับตั้งแต่ก่อตั้งตลาดหลักทรัพย์ฯ และเป็นครั้งแรกที่มีมูลค่าสูงกว่า GDP ของประเทศ

นอกจากนี้ ตลาดหุ้นไทยยังได้ประกาศความสำเร็จของการยกระดับในหลายมิติ จากสถาบันระดับโลกในด้านต่างๆ โดยเฉพาะอย่างยิ่งการปรับอันดับของตลาดหุ้นไทยขึ้นเป็น 1 ใน 10 ของกลุ่มตลาดเกิดใหม่ชั้นนำของโลก (Advanced Emerging Market) โดย FTSE Group

และการปรับอันดับด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดี (CG Watch 2012) ของไทย ขึ้นเป็นอันดับ 3 ของเอเชีย ซึ่งเป็นผลจากความมุ่งมั่นทำงาน เพื่อยกระดับการกำกับดูแลกิจการของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ผลเป็นรูปธรรม อีกทั้งยังเป็นตลาดหุ้นที่มีหลักทรัพย์ขนาดใหญ่และมีสภาพคล่องสูงซื้อขายจำนวนมากเป็นอันดับต้นของภูมิภาคเอเชียตะวันออกเฉียงใต้ ถึง 23 หลักทรัพย์ ซึ่งมีมูลค่ามาร์เก็ตแคปไม่ต่ำกว่า 1,000 ล้านเหรียญดอลลาร์สหรัฐ และมีมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันไม่ต่ำกว่า 10 ล้านเหรียญดอลลาร์สหรัฐ ซึ่งตอกย้ำถึงความแข็งแกร่งและความน่าสนใจของตลาดหลักทรัพย์ฯ ในสายตาผู้ลงทุนทั่วโลก

ในปี 2555 ยังมีพัฒนาการที่สำคัญอย่างยิ่งของการทำงานร่วมกับพันธมิตรเพื่อสร้างโอกาสทางธุรกิจ คือ การประกาศเชื่อมโยงกระดานการซื้อขายหลักทรัพย์อาเซียน (ASEAN Trading Link) กับตลาดหลักทรัพย์มาเลเซีย และสิงคโปร์ ได้ขยายประโยชน์การทำธุรกิจให้กับบริษัทหลักทรัพย์ไทยทั้งขนาดเล็กและใหญ่ ให้สามารถซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศได้อย่างสะดวก ซึ่งนับเป็นจุดเริ่มต้นความร่วมมือของตลาดหลักทรัพย์อาเซียนเพื่อสร้างความเข้มแข็ง และดึงดูดผู้ลงทุนทั่วโลกให้สนใจและเลือกลงทุนในภูมิภาคอาเซียน

ขณะเดียวกัน ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังให้ความสำคัญต่อการสร้างความสัมพันธ์อันดีในระดับรัฐบาล และตลาดหลักทรัพย์ประเทศเพื่อนบ้านอย่างต่อเนื่อง เพื่อให้เกิดการพัฒนาตลาดทุนในระดับภูมิภาค โดยสนับสนุนด้านการพัฒนาองค์ความรู้สำหรับผู้ประกอบการวิชาชีพในตลาดทุน รวมทั้งแบ่งปันประสบการณ์และความรู้เกี่ยวกับการดำเนินธุรกิจตลาดหลักทรัพย์ แก่สาธารณรัฐประชาธิปไตยประชาชนลาว สาธารณรัฐสังคมนิยมเวียดนาม และสาธารณรัฐแห่งสหภาพเมียนมาร์ อีกด้วย

สำหรับการพัฒนาตลาดทุนระยะยาวในประเทศ นอกเหนือจากการสร้างผู้ลงทุนคุณภาพที่มีความรู้ความเข้าใจด้านการเงินการลงทุน และการพัฒนาศักยภาพของบุคลากรในธุรกิจหลักทรัพย์ ทั้งด้านมาตรฐานความรู้และจริยธรรม เพื่อให้บริการกับผู้ลงทุนอย่างต่อเนื่องแล้ว ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังได้มุ่งยกระดับมาตรฐานและการปฏิบัติด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดีของบริษัทจดทะเบียนไทยอย่างต่อเนื่อง เพื่อเตรียมพร้อมก้าวสู่การเปิดประชาคมเศรษฐกิจอาเซียน (AEC) ที่จะเกิดขึ้นในปี 2558 โดยในปี 2555 ได้ปรับปรุงหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดีให้ทันสมัย และให้สอดคล้องกับมาตรฐานของ ASEAN CG Scorecard ซึ่งเป็นเกณฑ์การประเมิน และจัดอันดับการกำกับดูแลกิจการของบริษัทจดทะเบียนในประเทศกลุ่มอาเซียน พร้อมไปกับการสร้างความรู้ความเข้าใจด้านความรับผิดชอบต่อสังคมของบริษัทจดทะเบียน โดยจัดทำคู่มือแนวทางความรับผิดชอบต่อสังคมของกิจการ และแนวทางการจัดทำรายงานแห่งความยั่งยืน รวมถึงการจัดอบรมเชิงปฏิบัติการ และการเปิดเวทีแบ่งปันประสบการณ์ให้คำปรึกษาเชิงลึกเป็นรายบริษัทในการเขียนรายงานดังกล่าวให้เป็นที่ยอมรับตามแนวทางสากล

ในขณะเดียวกัน ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เดินหน้าร่นยกระดับการกำกับดูแลกิจการภายในองค์กร เพื่อมุ่งสู่การเป็นต้นแบบองค์กรที่มีการกำกับดูแลกิจการที่ดีอย่างต่อเนื่อง โดยในปี 2555 ได้ปรับปรุงนโยบายและแนวปฏิบัติด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดี (corporate governance policy) ในองค์กร เพื่อมุ่งเน้นการปฏิบัติต่อผู้มีส่วนได้เสียอย่างเป็นธรรม และโปร่งใส รวมถึงมีนโยบายที่สอดคล้องกับหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดีในระดับสากล ทั้งนี้ ในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้รับการประเมินประสิทธิภาพการดำเนินงานด้านการกำกับดูแลกิจการ จากสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย (Thai Institute of Directors Association: IOD) ซึ่งเป็นผู้ประเมินที่เป็นอิสระในระดับประเทศที่สำรวจการกำกับดูแลกิจการของบริษัทจดทะเบียนทุกแห่งในตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยผลการประเมินด้านการกำกับดูแลกิจการของตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ในระดับดีมาก

สำหรับด้านการช่วยเหลือสังคม ตลอดปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ และหน่วยงานในตลาดทุน ยังคงสานต่อการทำงานอย่างต่อเนื่อง เพื่อช่วยเหลือฟื้นฟูโรงเรียนทั่วประเทศที่ได้รับการฟื้นฟูภายใต้โครงการ “คืนโรงเรียนให้ลูกหลาน สานสัมพันธ์ชุมชน” ประกอบไปด้วยโรงเรียนที่ได้รับการสนับสนุนงบประมาณจากกองทุน “ตลาดหุ้นร่วมใจ ช่วยภัยน้ำท่วม” รวม 60 โรงเรียน และ 16 โรงเรียนจากโครงการ “วตท. ร่วมใจ ช่วยภัยน้ำท่วม” ซึ่งจัดตั้งเมื่อปี 2554 ที่ผ่านมา รวม 76 โรงเรียน โดยมุ่งเน้นให้ทุกโรงเรียนในโครงการฯ ได้มีสภาพแวดล้อมที่เหมาะสมกับการเรียนการสอน และยังสามารถใช้เป็นศูนย์กลางการทำกิจกรรมของชุมชนในยามปกติ และเป็นศูนย์พักพิงเมื่อเกิดภัยพิบัติ นับเป็นการแสดงพลังที่แข็งแกร่งของตลาดทุนไทยที่มีต่อสังคมไทยอย่างยั่งยืน

ในนามของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ขอขอบคุณหน่วยงานทั้งภาครัฐและเอกชนที่เกี่ยวข้องทุกฝ่าย บริษัทจดทะเบียน บริษัทสมาชิก และผู้ลงทุน รวมถึงพนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่ได้ร่วมผลักดันให้ตลาดทุนไทยแข็งแกร่ง และสร้างปรากฏการณ์แห่งความสำเร็จอย่างน่าภาคภูมิใจ พร้อมทั้งจะก้าวสู่การแข่งขันในระดับสากลและสร้างประโยชน์ด้านเศรษฐกิจต่อประเทศชาติอย่างเข้มแข็ง

สารจากกรรมการและผู้จัดการ



ปี 2555 นับเป็นปีแห่งความสำเร็จในการยกระดับตลาดหลักทรัพย์ไทย ทั้งด้านการดำเนินงาน และการซื้อขายที่ทำสถิติสูงสุดในประวัติศาสตร์ โดยมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยต่อวันของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยสูงเป็นอันดับหนึ่งในอาเซียนเป็นครั้งแรกประกอบกับมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (market capitalization) รวมตลาดหลักทรัพย์ และตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) ที่สูงถึง 11.96 ล้านล้านบาท ซึ่งสูงกว่า GDP เป็นครั้งแรกที่ระดับ 103% ของ GDP และยังเป็นระดับสูงสุดนับตั้งแต่ก่อตั้งตลาดหลักทรัพย์ฯ ขณะเดียวกัน ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ฯ (SET index) ได้ปรับตัวเพิ่มขึ้นอยู่ระดับสูงสุดในรอบ 17 ปี ที่ 1,397.19 จุด เมื่อวันที่ 27 ธันวาคม 2555 เพิ่มขึ้นถึง 36% จากสิ้นปี 2554 เมื่อคิดตามสกุลเงินบาท

นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังได้รับการยกอันดับจากสถาบันระดับโลกในด้านต่างๆ ได้แก่ การที่ FTSE Group ยกอันดับตลาดหุ้นไทยเข้าไปเป็นตลาดเกิดใหม่ชั้นนำ (Advanced Emerging Market) ขณะที่ CG Watch 2012 จัดอันดับให้ไทยเป็นอันดับ 3 ของเอเชีย ซึ่งเป็นการยกอันดับด้านการกำกับดูแลกิจการของตลาดหุ้นไทยอย่างต่อเนื่องจากอันดับ 8 ในปี 2550 และอันดับ 4 ในปี 2553 ตลอดจนการที่ MSCI เพิ่ม 4 หลักทรัพย์ไทยเข้าไปในการคำนวณดัชนี MSCI Global Standard Indices ซึ่งนับว่าเป็นประเทศที่มีหลักทรัพย์เพิ่มเข้าไปมากที่สุดนอกเอเชียแปซิฟิก

จากความร่วมมือกันของทุกภาคส่วนในการผลักดันให้ตลาดหุ้นไทยพัฒนาและเติบโตอย่างต่อเนื่อง ซึ่งหนึ่งในพัฒนาการสำคัญ คือ การผลักดันให้ตลาดหุ้นเป็นเครื่องมือในการระดมทุนของภาครัฐและเอกชน โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ทำงานร่วมกับสำนักงาน ก.ล.ต. ภาครัฐ และผู้เกี่ยวข้อง ปรับปรุงเกณฑ์รับหลักทรัพย์ประเภทใหม่ๆ เพื่อให้มีการจัดตั้งกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน หรือ infrastructure fund ซึ่งเป็นทางเลือกให้กับผู้ลงทุนและสร้างความน่าสนใจให้ตลาดหุ้นไทย รวมทั้งเป็นการสนับสนุนภาครัฐในการลงทุนในโครงการสาธารณูปโภคขนาดใหญ่ รวมถึงเกณฑ์รับ holding company ที่มีธุรกิจหลักในต่างประเทศ ซึ่งจะสนับสนุนให้ธุรกิจไทยที่ลงทุนในต่างประเทศ โดยเฉพาะในภูมิภาคกลุ่มน้ำโขง (Greater Mekong Subregion: GMS) ซึ่งมีแนวโน้มการขยายตัวสูง ให้สามารถระดมทุนจากตลาดหุ้นไทยไปขยายกิจการให้เติบโตได้ ทั้งนี้ ตลอดปี 2555 การระดมทุนผ่านตลาดหุ้นของบริษัทจดทะเบียนมีมูลค่าสูงสุดเป็นประวัติการณ์เมื่อเทียบกับช่วง 10 ปีที่ผ่านมา โดยมีมูลค่ารวมทั้งสิ้น 258,108 ล้านบาท

ในปี 2555 ยังได้มีการ**พัฒนาผลิตภัณฑ์อย่างต่อเนื่อง** โดยตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้เปิดซื้อขายสัญญาซื้อขายดอลลาร์ล่วงหน้า (USD Futures) และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงดัชนีหมวดธุรกิจในตลาดหลักทรัพย์ (Sector Index Futures) พร้อมทั้งปรับปรุง SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เพื่อให้มีสินค้าที่หลากหลาย ทำให้ผู้ลงทุนสามารถเลือกใช้ในการบริหารพอร์ตลงทุนได้ตามความต้องการ และมีประสิทธิภาพ

และด้วยความร่วมมือของบริษัทสมาชิก และทุกภาคส่วนในตลาดทุนทำให้ตลาดหลักทรัพย์ สามารถยกระดับโครงสร้างพื้นฐานและระบบงาน **ซึ่งจะเป็นรากฐานเพื่อรองรับการเติบโตของธุรกิจในอนาคตได้ในระยะยาว** ที่ช่วยเพิ่มขีดความสามารถในการแข่งขันของตลาดทุนไทยให้เป็นผู้นำในภูมิภาคได้ โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เริ่มใช้**ระบบซื้อขายหลักทรัพย์ใหม่ “SET CONNECT”** ซึ่งมีประสิทธิภาพสามารถรองรับปริมาณซื้อขายเพิ่มขึ้นมากกว่าเดิม 10 เท่า รองรับการทำรายการได้รวดเร็วเทียบเท่าตลาดหลักทรัพย์ชั้นนำ พร้อมได้เริ่มใช้**ระบบงานกำกับซื้อขาย “SET WATCH”** และ**ระบบเผยแพร่ข้อมูลการซื้อขาย “SET FEED”** เพิ่มประสิทธิภาพระบบงานสำคัญหลักของตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้มีมาตรฐานเทียบเคียงระดับสากล พร้อมไปกับการ**เชื่อมโยงกระดานซื้อขายหลักทรัพย์อาเซียน (ASEAN Trading Link)** ระหว่างตลาดหลักทรัพย์ไทย มาเลเซีย และสิงคโปร์ เพื่อกระตุ้นและส่งเสริมให้ตลาดทุนอาเซียนและหลักทรัพย์อาเซียนเป็น asset class ที่ดึงดูดความสนใจจากผู้ลงทุนทั่วโลก โดยมีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดรวมทั้ง 3 ตลาดกว่า 1.4 ล้านล้านเหรียญสหรัฐ ด้วยจำนวนหลักทรัพย์รวม 2,200 หลักทรัพย์

ด้านงานบริการหลังการขายในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดทำแผนแม่บทงานปฏิบัติการ (Operations Master Plan) ปี 2555-2559 โดยมุ่งให้ทุกกระบวนการเป็น Straight Through Processing (STP) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพงานด้านการปฏิบัติการ รองรับธุรกิจและบริการใหม่ๆ รวมทั้งธุรกรรมข้ามประเทศ

ด้านการขยายฐานผู้ลงทุน ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ทำงานร่วมกับบริษัทสมาชิก ธนาคารพาณิชย์ และพันธมิตร ดำเนินกิจกรรมเพื่อส่งเสริมให้ผู้ลงทุนและประชาชนทั่วไปมีความรู้ความเข้าใจเกี่ยวกับการลงทุน และสามารถเข้าถึงข้อมูลเพื่อการลงทุนอย่างต่อเนื่องตลอดทั้งปีมีผู้ร่วมกิจกรรมด้านการตลาดกว่า 200,000 คน และมีธุรกรรมการลงทุนรวมถึง 31,000 รายการ ส่งผลให้ปี 2555 จำนวนบัญชีผู้ลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพิ่มขึ้นกว่า 100,000 บัญชี ซึ่งสูงเป็นประวัติการณ์ และเป็นปีแรกที่มีมูลค่าซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านอินเทอร์เน็ตสูงกว่า 50% ของมูลค่าซื้อขายรวมของผู้ลงทุนบุคคล นอกจากนี้ ยังร่วมมือกับสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ในการสร้างคุณภาพและยกระดับความรู้ทักษะการปฏิบัติงานของผู้ประกอบวิชาชีพธุรกิจหลักทรัพย์ ซึ่งมีบทบาทสำคัญในการให้ข้อมูลแก่ผู้ลงทุนเพื่อการตัดสินใจลงทุนอย่างมีคุณภาพ

ขณะที่ในด้านผู้ลงทุนสถาบันต่างประเทศ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดงาน **Thailand Focus 2012** ซึ่งมีผู้ร่วมงานจากทั่วโลกมากที่สุดเป็นประวัติการณ์ แสดงให้เห็นถึงความสามารถในการดึงดูดผู้ลงทุนสถาบันต่างประเทศโดยมีจำนวน 122 ราย มีบริษัทจดทะเบียนไทย 89 แห่ง และมีการประชุมถึง 1,065 ครั้ง และยังเป็นครั้งแรกที่เชื่อมโยงตลาดทุนอินโดจีนเข้าด้วยกัน โดยเชิญตลาดหลักทรัพย์อินโดจีน 4 แห่ง และบริษัทจดทะเบียนในภูมิภาคอินโดจีนเข้าร่วมงาน

สำหรับการสร้างความแข็งแกร่งภายในองค์กร ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ให้ความสำคัญกับการพัฒนาบุคลากรให้มีความรอบรู้ เชี่ยวชาญ และมีความเป็นมืออาชีพ การปลูกฝังให้พนักงานมี core values เพื่อจะทำหน้าที่เป็นผู้เชื่อมโยงโอกาสแห่งความสำเร็จให้แก่ลูกค้าทั้งที่เป็นธุรกิจและผู้ลงทุน พร้อมไปกับการพัฒนาความเป็นผู้นำแห่งองค์กรอนาคตผ่านโครงการ Leadership Development Program เพื่อเพิ่มขีดความสามารถในการแข่งขัน และตอบสนองต่อการเปลี่ยนแปลงขององค์กรในอนาคตได้

ก้าวต่อไป ในปี 2556 ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะมุ่ง **“สานโอกาสทางการเงิน เพื่อคุณ เพื่อธุรกิจ”** อย่างต่อเนื่อง ด้วยกลยุทธ์การขยายฐานผู้ลงทุนบุคคล การพัฒนาบริษัทจดทะเบียน การส่งเสริมผลิตภัณฑ์ใหม่ พร้อมต่อยอดความร่วมมือในกลุ่มประเทศลุ่มแม่น้ำโขงและอาเซียน รวมถึงไม่หยุดที่จะพัฒนาตลาดทุนไทย ทั้งการยกระดับการกำกับดูแลกิจการที่ดีและความรับผิดชอบต่อสังคมไทยของบริษัทจดทะเบียน บริษัทสมาชิก และผู้มีส่วนได้เสียในตลาดทุนอย่างต่อเนื่องให้เทียบชั้นแนวหน้าในระดับสากล พร้อมไปกับการพัฒนาขีดความสามารถของบุคลากรในธุรกิจหลักทรัพย์ การสร้างความรู้ความเข้าใจในการลงทุนแก่ผู้ลงทุนและประชาชนทั่วไป รวมทั้งการปลูกฝังวัฒนธรรมการออม และการบริหารเงินให้แก่เยาวชนซึ่งเป็นรากฐานสำคัญของประเทศ เพื่อความเติบโตอย่างมั่นคงและยั่งยืนของตลาดทุนและเศรษฐกิจไทย

คณะกรรมการ



1. นายสมพล เกียรติไพบูลย์
ประธานกรรมการ

3. นางไขศรี เนืองสิขหาเพียร
กรรมการ

5. นายไพบูลย์ นลินทรางกูร
กรรมการ

2. นางภัทธีรา ดิลกรุ่งธีระภพ
รองประธานกรรมการ

4. นายชัยภัทร ศรีวิสารวาจา
กรรมการ

6. นายโยธิน เนื่องจำนงค์
กรรมการ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย The Stock Exchange of Thailand



7. นายรพี สุจริตกุล
กรรมการ

8. นางศศิธร พงศธร
กรรมการ

9. นายสุเทพ พืตกานนท์
กรรมการ

10. ดร.สุภัค ศิวะรักษ์
กรรมการ

11. นายจรัมพร โชติกเสถียร
กรรมการและผู้จัดการ



ประวัติคณะกรรมการ

นายสมพล เกียรติไพบูลย์ ประธานกรรมการ	
การศึกษา	
• คุษภักดิ์บัณฑิตศึกษาศาสตร์ สาขาบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเวสเทิร์น	
• M.A. Economics, Fairleigh Dickinson University, ประเทศสหรัฐอเมริกา	
• ปริญญาโท (เกียรตินิยม) พัฒนบริหารศาสตร์ (พัฒนาการเศรษฐกิจ) สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์	
• ปริญญาตรี เศรษฐศาสตร์ (เกียรตินิยม) มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์	
ประวัติการอบรม	
• หลักสูตรการป้องกันราชอาณาจักร (วปอ.) ปี 2531 วิทยาลัยป้องกันราชอาณาจักร	
• ประกาศนียบัตร หลักสูตร Role of the Chairman Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย	
• หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง สถาบันวิทยาการตลาดทุน (หลักสูตร วตท.) รุ่นที่ 5	
ตำแหน่งงานอื่นในปัจจุบัน	
ตั้งแต่ 2554	กรรมการในคณะกรรมการส่งเสริมการลงทุน
ตั้งแต่ 2552	ประธานกรรมการ บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)
ตั้งแต่ 2551	ที่ปรึกษาพิเศษในคณะที่ปรึกษาพิเศษ ศูนย์ศิลปาชีพระหว่างประเทศ
ตั้งแต่ 2551	ที่ปรึกษากิตติมศักดิ์ ประจำคณะกรรมการการต่างประเทศวุฒิสภา
ตั้งแต่ 2544	ประธานกรรมการ บริษัท น้ำมันพืชไทย จำกัด (มหาชน)
ประสบการณ์การทำงาน	
2548	ที่ปรึกษาของนายกรัฐมนตรีและรัฐมนตรีว่าการกระทรวงการคลัง
2547 - 2551	ประธานกรรมการบริหาร ศูนย์ศิลปาชีพระหว่างประเทศ
2546 - 2548	ประธานคณะกรรมการ การเคหะแห่งชาติ
2545 - 2551	กรรมการ และรองประธานกรรมการ (2551-2552) สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
2544 - 2552	ประธานกรรมการ ธนาคารนครหลวงไทย จำกัด (มหาชน)
2539 - 2543	กรรมการ ธนาคารแห่งประเทศไทย
2539 - 2543	สมาชิกวุฒิสภา และประธานคณะกรรมการการเกษตรและสหกรณ์ (วุฒิสภา)
2538 - 2543	ปลัดกระทรวงพาณิชย์

นางกัทธีรา ดิลกรุ่งธีระภพ รองประธานกรรมการ	
การศึกษา	
• ปริญญาโท สาขาวิศวกรรม University of Queensland, Brisbane ประเทศออสเตรเลีย	
• ปริญญาตรี สาขาวิศวกรรมเคมี (เกียรตินิยม) Monash University, Melbourne ประเทศออสเตรเลีย	
ประวัติการอบรม	
• หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง สถาบันวิทยาการตลาดทุน (หลักสูตร วตท.) รุ่นที่ 1	
ตำแหน่งงานอื่นในปัจจุบัน	
ตั้งแต่ 2555	อนุกรรมการพิจารณาผลตอบแทน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ตั้งแต่ 2554	ประธานอนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ตั้งแต่ 2553	นายกสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย
ตั้งแต่ 2553	กรรมการ สมาธุรกิจตลาดทุนไทย
ตั้งแต่ 2553	ประธานอนุกรรมการวินัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ตั้งแต่ 2544	ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร บริษัทหลักทรัพย์ ดีบีเอส วิคเคอร์ส (ประเทศไทย) จำกัด
ประสบการณ์การทำงาน	
2550 - 2554	กรรมการ สมาคมนักวิเคราะห์หลักทรัพย์
2548 - 2552	กรรมการ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
2548 - 2551	กรรมการ บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด
2548 - 2551	กรรมการ บริษัท เซ็ทเทรด ดอท คอม จำกัด
2541 - 2544	กรรมการผู้จัดการ บริษัทหลักทรัพย์ เอสจี สินเอเชีย จำกัด
2541 - 2544	กรรมการ บริษัทเงินทุน สินเอเชีย จำกัด (มหาชน)

นางไฉศรี เนืองสิขงาเพียร กรรมการ	
การศึกษา	
• ปริญญาโทบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์	
• ปริญญาตรีด้านการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์	
ประวัติการอบรม	
• ประกาศนียบัตร หลักสูตร Director Certification Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย	
• หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง สถาบันวิทยาการตลาดทุน (หลักสูตร วตท.) รุ่นที่ 3	
ตำแหน่งงานอื่นในปัจจุบัน	
ตั้งแต่ 2555	ประธานอนุกรรมการพิจารณาผลตอบแทน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ตั้งแต่ 2553	ประธานอนุกรรมการตรวจสอบตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ตั้งแต่ 2553	อนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ตั้งแต่ 2548	อนุกรรมการในคณะกรรมการบัญชีบริหาร สภาวิชาชีพบัญชี ในพระบรมราชูปถัมภ์
ตั้งแต่ 2546	กรรมการผู้จัดการใหญ่ เคพีเอ็มจี ประเทศไทย
ตั้งแต่ 2546	อนุกรรมการในคณะกรรมการระดับสากล เคพีเอ็มจี อินเทอร์เน็ตชั้นนำ
ตั้งแต่ 2528	ผู้สอบบัญชีรับอนุญาตแห่งประเทศไทย
ประสบการณ์การทำงาน	
2544 - 2545	กรรมการผู้จัดการ กลุ่มบริษัท แอนเดอร์เซน ประเทศไทย
2543 - 2546	อนุกรรมการในคณะที่ปรึกษาในระดับสากล กลุ่มบริษัท แอนเดอร์เซน ประเทศไทย
2544 - 2545	หัวหน้าคณะที่ปรึกษาด้านระบบบัญชีการเงิน กลุ่มบริษัท แอนเดอร์เซน ประเทศไทย
2539 - 2545	ที่ปรึกษาเพื่อการฟื้นฟูกิจการ กลุ่มบริษัท แอนเดอร์เซน ประเทศไทย
2526 - 2532	ผู้สอบบัญชีในสังกัด บริษัท สำนักงาน เอสจีวี ณ ถลาง จำกัด

นายชัยภัทร ศรีวิสารวาจา

กรรมการ

การศึกษา

- Lehigh University, วิทยาศาสตร์บัณฑิต (Metallurgy)
- Illinois Benedictine College, บริหารธุรกิจมหาบัณฑิต (การเงิน)

ประวัติการอบรม

- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Director Certification Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Role of The Chairman Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง สถาบันวิทยาการตลาดทุน (หลักสูตร วตท.) รุ่นที่ 15

ตำแหน่งงานอื่นในปัจจุบัน

- 2556 ประธานอนุกรรมการกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)
- ตั้งแต่ 2554 กรรมการอิสระ บริษัท พีรเชิษฐ์ ชิปปิ้ง จำกัด (มหาชน)
- ตั้งแต่ 2552 ประธานกรรมการบริหารและประธานเจ้าหน้าที่บริหาร บริษัทหลักทรัพย์ เคที ซีมิโก้ จำกัด
- ตั้งแต่ 2550 ประธานกรรมการบริหารและกรรมการผู้อำนวยการ บริษัทหลักทรัพย์ ซีเอ็มไอ จำกัด (มหาชน)
- ตั้งแต่ 2542 กรรมการ สมาคมพัฒนาประชากรและชุมชน
- ตั้งแต่ 2538 กรรมการและเลขาธิการ มูลนิธิศรีวิสารวาจา

ประสบการณ์การทำงาน

- 2553 - 2554 กรรมการและประธานคณะกรรมการตรวจสอบ บริษัท ธนารักษ์พัฒนาสินทรัพย์ จำกัด
- 2546 - 2551 ประธานกรรมการ โรงเรียนนานาชาติใหม่แห่งประเทศไทย
- 2544 - 2550 กรรมการอิสระและกรรมการตรวจสอบ ธนาคารธนชาติ จำกัด (มหาชน)
- 2542 กรรมการและกรรมการบริหาร ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)
- 2538 - 2542 กรรมการและหัวหน้าของฝ่ายวาณิชธนกิจ ชาโลมอน สมิทรี บาร์นี
- 2534 - 2538 กรรมการและหัวหน้าของฝ่ายวาณิชธนกิจ สวิส แบงก์ / เอสบีซี วอร์เบิร์ก

นายไพบุสย์ นลินธรากร

กรรมการ

การศึกษา

- ปริญญาโท M.B.A. สาขาการเงิน มหาวิทยาลัยอินเดียนา (เมืองบลูมมิงตัน) ประเทศสหรัฐอเมริกา
- ปริญญาตรี สาขาวิทยาการคอมพิวเตอร์ มหาวิทยาลัยแคลิฟอร์เนีย (เมืองซานตาครูซ) ประเทศสหรัฐอเมริกา

ประวัติการอบรม

- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Chartered Financial Analyst สถาบัน CFA Institute ประเทศสหรัฐอเมริกา
- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Director Certification Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- หลักสูตรผู้บริหารระดับสูงด้านการค้าและการพาณิชย์ (TEPCOT) รุ่น 5 มหาวิทยาลัยหอการค้าไทย
- หลักสูตรวิทยาการประกันภัยระดับสูง (วปส.) รุ่นที่ 2 สถาบันวิทยาการประกันภัยระดับสูง
- หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง สถาบันวิทยาการตลาดทุน (หลักสูตร วตท.) รุ่นที่ 4

ตำแหน่งงานอื่นในปัจจุบัน

- ตั้งแต่ 2554 อนุกรรมการตรวจสอบ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- ตั้งแต่ 2553 ประธานกรรมการ สภาธุรกิจตลาดทุนไทย
- ตั้งแต่ 2552 นายกสมาคม สมาคมนักวิเคราะห์หลักทรัพย์
- ตั้งแต่ 2552 กรรมการบริหาร สมาคมบริษัทหลักทรัพย์
- ตั้งแต่ 2551 ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร บริษัทหลักทรัพย์ ทีเอสไอ จำกัด

ประสบการณ์การทำงาน

- 2553 - 2555 กรรมการ สมาคมนักวางแผนการเงินไทย
- 2552 - 2554 กรรมการ สมาคมตลาดตราสารหนี้ไทย

นายพี สุจริตกุล

กรรมการ

การศึกษา

- ปริญญาโทกฎหมาย มหาวิทยาลัยบริสตอล ประเทศอังกฤษ (ทุนการศึกษาธนาคารแห่งประเทศไทย)
- ปริญญาตรีกฎหมาย (เกียรตินิยมอันดับสอง) มหาวิทยาลัยเอสเซ็กซ์ ประเทศอังกฤษ (ทุนการศึกษาธนาคารแห่งประเทศไทย)

ประวัติการอบรม

- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Role of the Chairman Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Director Certification Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง สถาบันวิทยาการตลาดทุน (หลักสูตร วตท.) รุ่นที่ 1

ตำแหน่งงานอื่นในปัจจุบัน

- ตั้งแต่ 2555 ประธานอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- ตั้งแต่ 2555 ที่ปรึกษาโครงการ สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- ตั้งแต่ 2555 ที่ปรึกษากรรมการผู้จัดการ บริษัท เมืองไทยประกันชีวิต จำกัด
- ตั้งแต่ 2553 กรรมการ สมาคมบริษัทจัดการลงทุน
- ตั้งแต่ 2553 ที่ปรึกษา สาขารัฐกิจตลาดทุนไทย
- ตั้งแต่ 2543 Eisenhower Exchange Fellowships

ประสบการณ์การทำงาน

- 2552 - 2555 กรรมการ สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- 2551 - 2554 ประธานกรรมการบริหาร บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กลีกรไทย จำกัด
- 2550 - 2554 กรรมการ สมาคมนักวางแผนการเงินไทย
- 2548 - 2551 ประธานกรรมการ บริษัทหลักทรัพย์ กลีกรไทย จำกัด (มหาชน)
- 2545 - 2547 ผู้ช่วยเลขานุการอาวุโส สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
- 2535 - 2545 ผู้บริหารระดับสูง สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
- 2528 - 2535 นิติกร ฝ่ายกฎหมาย ธนาคารแห่งประเทศไทย

นายโยธิน เนื่องจำนงค์ กรรมการ

การศึกษา

- ปริญญาโท ศิลปศาสตร์ รัฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยรามคำแหง
- ปริญญาตรี ศิลปศาสตร์ รัฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยรามคำแหง

ประวัติการอบรม

- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Director Certification Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง ด้านการค้าและการพาณิชย์ รุ่นที่ 4 มหาวิทยาลัยหอการค้าไทย
- หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง สถาบันวิทยาการตลาดทุน (หลักสูตร วตท.) รุ่นที่ 7

ตำแหน่งงานอื่นในปัจจุบัน

- ตั้งแต่ 2555 ประธานอนุกรรมการกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- ตั้งแต่ 2555 กรรมการผู้ทรงคุณวุฒิ คณะกรรมการกำกับนโยบายทางด้านรัฐวิสาหกิจ
- ตั้งแต่ 2553 ผู้พิพากษามทบศาลเยาวชนและครอบครัวกลาง
- ตั้งแต่ 2552 กรรมการตรวจสอบ และกรรมการอิสระ(ตั้งแต่ปี 2547) บริษัท เนชั่นมัลติมีเดียกรุ๊ป จำกัด (มหาชน)
- ตั้งแต่ 2551 ประธานกรรมการบริหาร บริษัท พลาสติกและหีบห่อไทย จำกัด (มหาชน)
- ตั้งแต่ 2523 กรรมการบริหาร บริษัท โมเดอร์นฟอรัมกรุ๊ป จำกัด (มหาชน)

ประสบการณ์การทำงาน

- 2554 - 2555 ที่ปรึกษารัฐมนตรีว่าการกระทรวงพาณิชย์
- 2540 - 2554 กรรมการบริหาร บริษัท เอ็ม เอ็ฟ อี ซี จำกัด (มหาชน)
- 2521 - 2522 ผู้จัดการทั่วไป บริษัท ไทยกลัฟ จำกัด
- 2518 - 2521 ผู้จัดการฝ่ายขายและปฏิบัติการ บริษัท โพรโมสต์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด

นางศศิธร พงศ์รส กรรมการ

การศึกษา

- MBA Notre Dame de namur University, California ประเทศสหรัฐอเมริกา
- ปริญญาตรี คณะวิทยาศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

ประวัติการอบรม

- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Director Accreditation Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Director Certification Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Financial Institutions Governance Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง สถาบันวิทยาการตลาดทุน (หลักสูตร วตท.) รุ่นที่ 12

ตำแหน่งงานอื่นในปัจจุบัน

- ตั้งแต่ 2555 อนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- ตั้งแต่ 2552 กรรมการบริหารและกรรมการผู้จัดการ บริษัท แอล เอช ไฟแนนซ์เชียล กรุ๊ป จำกัด (มหาชน)
- ตั้งแต่ 2548 กรรมการบริหารและกรรมการผู้จัดการ ธนาคารแลนด์ แอนด์ เฮาส์ จำกัด (มหาชน)
- ตั้งแต่ 2548 กรรมการอิสระและกรรมการตรวจสอบ บริษัท ปิโก (ไทยแลนด์) จำกัด (มหาชน)

ประสบการณ์การทำงาน

- 2548 รองกรรมการผู้จัดการ บริษัทเงินทุนบุคคลิย์ จำกัด (มหาชน)
- 2547-2548 กรรมการผู้อำนวยการและกรรมการบริษัทหลักทรัพย์ ยูไนเตด จำกัด (มหาชน)
- 2543-2546 ผู้อำนวยการอาวุโส บริษัท ยูไนเตดแอดไวเซอร์ เซอร์วิส จำกัด
- 2541-2542 CFO บริษัท เดอะ โกลเด้นเรชั่น จำกัด (มหาชน)
- 2526-2541 ผู้อำนวยการอาวุโส บริษัทเงินทุนหลักทรัพย์ ธนสยาม จำกัด (มหาชน)

ดร.สุกัญญา ศิวะรักษ์ กรรมการ

การศึกษา

- ปริญญาเอก เศรษฐศาสตร์ University of Pennsylvania ประเทศสหรัฐอเมริกา
- ปริญญาโท ความสัมพันธ์ระหว่างประเทศ Tufts University, Massachusetts ประเทศสหรัฐอเมริกา
- ปริญญาตรี เศรษฐศาสตร์ และวรรณคดีภาษาอังกฤษ Georgetown University ประเทศสหรัฐอเมริกา

ประวัติการอบรม

- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Director Certification Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Director Accreditation Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- หลักสูตรผู้บริหารธนาคารและสถาบันการเงิน (FINEX IV)
- หลักสูตรการป้องกันราชอาณาจักรภาครัฐร่วมเอกชน (ปรอ.) รุ่น 2550 วิทยาลัยป้องกันราชอาณาจักร
- หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง สถาบันวิทยาการตลาดทุน (หลักสูตร วตท.) รุ่นที่ 10

ตำแหน่งงานอื่นในปัจจุบัน

- 1 ก.พ. 2556 ประธานกรรมการและกรรมการ (ผู้มีอำนาจลงนามผูกพัน) บริษัท บริหารสินทรัพย์ สาธร จำกัด
- ตั้งแต่ 2554 อนุกรรมการตรวจสอบตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- ตั้งแต่ 2554 อนุกรรมการสรรหาและพัฒนาบริษัทจดทะเบียน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- ตั้งแต่ 2552 กรรมการผู้จัดการใหญ่ และประธานเจ้าหน้าที่บริหาร ธนาคาร ซีไอเอ็มบีไทย จำกัด (มหาชน)

ประสบการณ์การทำงาน

- 2551 - 2552 กรรมการ กรรมการบริหาร ประธานคณะกรรมการบริหารค่าตอบแทนธนาคารเพื่อการส่งออกและนำเข้าแห่งประเทศไทย
- 2551 - 2552 ประธานกรรมการ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนทหารไทย จำกัด
- 2546 - 2551 กรรมการผู้จัดการใหญ่ และประธานเจ้าหน้าที่บริหาร ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน)
- 2533 - 2546 AVP, FVP, EVP and SEVP ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน)

นายสุเทพ พิศานนท์

กรรมการ

การศึกษา

- ปริญญาโท บริหารธุรกิจ University of Missouri – Kansas City ประเทศสหรัฐอเมริกา
- ปริญญาตรี คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

ประวัติการอบรม

- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Chairman 2000 สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- ประกาศนียบัตร หลักสูตร Director Certification Program สมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย
- หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง สถาบันวิทยาการตลาดทุน (หลักสูตร วตท.) รุ่นที่ 4

ตำแหน่งงานอื่นในปัจจุบัน

- 20 ก.พ. 2556 อนุกรรมการก่อสร้างอาคาร ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- ตั้งแต่ 2555 กรรมการ บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)
- ตั้งแต่ 2555 อนุกรรมการบริหารความเสี่ยง ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- ตั้งแต่ 2555 อนุกรรมการวินัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- ตั้งแต่ 2554 ประธานกรรมการ และประธานกรรมการบริหาร บริษัทหลักทรัพย์ โนมูระ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)

ประสบการณ์การทำงาน

- 2553 – 2554 ประธานกรรมการ รักษาการประธานกรรมการบริหาร และกรรมการบริหาร บริษัทหลักทรัพย์ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)
- 2552 ประธานกิตติมศักดิ์ บริษัทหลักทรัพย์ พัฒนสิน จำกัด (มหาชน)
- 2547 – 2548 ประธานกรรมการ สภาธุรกิจตลาดทุนไทย
- 2546 – 2548 รองประธานกรรมการ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
- 2545 – 2548 นายกสมาคมบริษัทหลักทรัพย์

นายจรัมพร โชติกเสถียร

กรรมการและผู้จัดการ

การศึกษา

- ปริญญาโท บริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัย Harvard ประเทศสหรัฐอเมริกา
- ปริญญาตรี สาขา Electrical Engineering and Computer Science, มหาวิทยาลัย Massachusetts Institute of Technology ประเทศสหรัฐอเมริกา

ประวัติการอบรม

- หลักสูตรการป้องกันราชอาณาจักรร่วมเอกชน (ปรอ.) ปี 2547 วิทยาลัยป้องกันราชอาณาจักร
- หลักสูตรผู้บริหารระดับสูง สถาบันวิทยาการตลาดทุน (หลักสูตร วตท.) รุ่นที่ 11

ตำแหน่งงานอื่นในปัจจุบัน

- 2556 กรรมการ สถาบันธุรกิจเพื่อสังคม
- ตั้งแต่ 2555 กรรมการอำนวยการวิทยาลัยการจัดการมหาวิทยาลัยมหิดล
- ตั้งแต่ 2554 ประธานกรรมการบริหารสำนักงานพัฒนาธุรกรรมทางอิเล็กทรอนิกส์ (องค์การมหาชน)
- ตั้งแต่ 2554 กรรมการผู้ทรงคุณวุฒิ คณะกรรมการนโยบายสถาบันการเงิน (กนส.) ธนาคารแห่งประเทศไทย
- ตั้งแต่ 2553 ประธานกรรมการ บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด
- ตั้งแต่ 2553 ประธานกรรมการ บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด
- ตั้งแต่ 2553 ประธานกรรมการ บริษัท เซ็ทเทรด ดอท คอม จำกัด
- ตั้งแต่ 2553 ประธานกรรมการ บริษัท แฟมมิลี่โนฮาว จำกัด
- ตั้งแต่ 2547 กรรมการ มูลนิธิวิจัยเทคโนโลยีสารสนเทศ

ประสบการณ์การทำงาน

- 2551 – 2553 Chief Information Officer รองผู้จัดการใหญ่ กลุ่มเทคโนโลยี ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)
- 2545 – 2551 ผู้ช่วยผู้จัดการใหญ่ กลุ่ม GTS และธุรกิจตลาดทุน / ผู้ช่วยผู้จัดการใหญ่ กลุ่มบริการบริหารเงินเพื่อธุรกิจ ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)
- 2542 – 2544 ผู้ช่วยผู้จัดการใหญ่ สายงานเทคโนโลยี ผู้ช่วยผู้จัดการใหญ่ สายงานบริหารความเสี่ยง ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน)
- 2538 – 2542 กรรมการผู้จัดการใหญ่ บริษัทหลักทรัพย์ ไทยพาณิชย์ จำกัด
- 2533 – 2537 กรรมการผู้จัดการ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ไทยพาณิชย์ จำกัด

กรรมการและผู้จัดการ

ส่วนบริหารความเสี่ยง
ส่วนกำกับกิจกรรมองค์กร

กลุ่มงานธุรกิจตลาดหลักทรัพย์

สายงานวางแผนกลยุทธ์องค์กรและการเงิน

- ฝ่ายกลยุทธ์องค์กร
- ฝ่ายวิจัย
- ฝ่ายต่างประเทศ
- ฝ่ายการเงินและบัญชี

กลุ่มงานบริหารทรัพย์สิน

สายงานผู้ออกหลักทรัพย์และบริษัทจดทะเบียน

กลุ่มงานผู้ออกหลักทรัพย์และบริษัทจดทะเบียน

- ฝ่ายพัฒนาบริษัทจดทะเบียน
- ฝ่ายสรรหาบริษัทจดทะเบียนในประเทศ
- ฝ่ายสรรหาบริษัทจดทะเบียนต่างประเทศ

สายงานการตลาด

กลุ่มงานพัฒนาธุรกิจและผลิตภัณฑ์

- ฝ่ายพัฒนาธุรกิจตราสารทุน
- ฝ่ายพัฒนาธุรกิจอนุพันธ์
- ฝ่ายพัฒนาธุรกิจตราสารหนี้และอื่นๆ

กลุ่มงานบริการลูกค้าและช่องทาง

- ฝ่ายการตลาดผู้ลงทุนบุคคล
- ฝ่ายการตลาดผู้ลงทุนสถาบัน
- ฝ่ายการตลาดผู้ลงทุนต่างประเทศ
- ฝ่ายบริการสมาชิก
- ฝ่ายสนับสนุนการตลาด

กลุ่มงานการตลาดระบบสารสนเทศ

- ฝ่ายระบบซื้อขายสำหรับบริษัทสมาชิก
- ฝ่ายขายธุรกิจข้อมูล
- ฝ่ายพัฒนาธุรกิจระบบสารสนเทศ

สายงานปฏิบัติการ

- ฝ่ายพัฒนาบริการหลังการขายหลักทรัพย์
- ฝ่ายบริการหลังการขายหลักทรัพย์

กลุ่มงานปฏิบัติการ 1

- ฝ่ายปฏิบัติการซื้อขาย
- ฝ่ายชำระราคา
- ฝ่ายรับฝากหลักทรัพย์

กลุ่มงานปฏิบัติการ 2

- ฝ่ายนายทะเบียนหลักทรัพย์
- ฝ่ายบริการกองทุน

สายงานเทคโนโลยีสารสนเทศ

กลุ่มงานปฏิบัติการเทคโนโลยีสารสนเทศ

- ฝ่ายปฏิบัติการเทคโนโลยีสารสนเทศ
- ส่วนบริหารสถาปัตยกรรมเทคโนโลยีสารสนเทศ
- ฝ่ายบริหารและควบคุมระบบข้อมูลสารสนเทศ

กลุ่มงานพัฒนาระบบงานเทคโนโลยีสารสนเทศ

- ฝ่ายระบบซื้อขายสำหรับสมาชิก
- ฝ่ายระบบงานข้อมูลองค์กร
- ฝ่ายระบบงานซื้อขายหลักทรัพย์-ตราสารทุน
- ฝ่ายระบบงานซื้อขาย-อนุพันธ์
- ฝ่ายระบบงานหลังการขายหลักทรัพย์
- ฝ่ายระบบงานสนับสนุนปฏิบัติการ
- ฝ่ายบริหารโครงการตลาดหลักทรัพย์ฯ

กลุ่มงานบริหารเทคโนโลยีสารสนเทศ

- ส่วนสนับสนุนพัฒนาระบบงานลูกค้าเทคโนโลยีสารสนเทศ
- ฝ่ายบริหารเทคโนโลยีสารสนเทศ
- ฝ่ายความปลอดภัยเทคโนโลยีสารสนเทศ
- ส่วนจัดซื้อเทคโนโลยีสารสนเทศ

คณะกรรมการตรวจสอบ

ฝ่ายตรวจสอบภายใน

กองทุนเพื่อการพัฒนาตลาดทุน

สายงาน กำกับตลาด

- ฝ่ายกำกับบริษัทจดทะเบียน
- ฝ่ายกำกับการซื้อขาย
- ฝ่ายกำกับบริษัทสมาชิก

สายงาน กฎหมาย

- ฝ่ายกฎหมาย
- ฝ่ายวินัยและคดี
- ฝ่ายเลขานุการองค์กร
- ฝ่ายนโยบายกำกับตลาด

สายงาน บริหาร

- ฝ่ายสื่อสารองค์กร
- ฝ่ายบริหารทรัพยากรบุคคล
- ฝ่ายบริการกลาง

ศูนย์ส่งเสริม การพัฒนาความรู้ ตลาดทุน

- ฝ่ายส่งเสริมการพัฒนาผู้นำองค์กร
- ฝ่ายพัฒนาความรู้ผู้ประกอบการวิชาชีพหลักทรัพย์
- ฝ่ายพัฒนาความรู้ผู้ลงทุน
- ฝ่ายศูนย์การเรียนรู้

ศูนย์พัฒนา ธุรกิจตลาดทุน

- ฝ่ายพัฒนาธรรมาภิบาลเพื่อตลาดทุน
- ฝ่ายส่งเสริมวิสาหกิจเพื่อตลาดทุน
- ฝ่ายพัฒนาธุรกิจเพื่อความยั่งยืน

สถาบันวิจัย เพื่อตลาดทุน

คณะผู้บริหาร



1. นายจรัมพร โชติกเสถียร

กรรมการและผู้จัดการ

2. นางเกศรา มัญชุศรี

รองผู้จัดการ หัวหน้าสายงานการตลาด

3. นายชนิตร์ ชาญชัยณรงค์

รองผู้จัดการ หัวหน้าสายงาน

ผู้ออกหลักทรัพย์และบริษัทจดทะเบียน

ผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ

4. นายบดินทร์ อุณากร

รองผู้จัดการ หัวหน้าสายงานบริหาร

รองกรรมการผู้อำนวยการศูนย์พัฒนา

ธุรกิจตลาดทุน

5. ดร.ภากร ปีตธวัชชัย

รองผู้จัดการ หัวหน้าสายงานวางแผน

กลยุทธ์องค์กรและการเงิน

รองกรรมการผู้อำนวยการสถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุน

6. ดร.กฤษฎา เสกตระกูล

ผู้ช่วยกรรมการผู้อำนวยการ

ศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน

7. นายเกียรติ โกสิยเจริญ

ผู้ช่วยผู้จัดการ หัวหน้ากลุ่มงาน

การตลาดระบบสารสนเทศ

8. นางชนิสรา ชุตินัทร์

ผู้ช่วยผู้จัดการ หัวหน้าสายงานปฏิบัติการ

9. นายฉัตรพันธุ์ สรรพกิจ

ผู้ช่วยผู้จัดการ หัวหน้ากลุ่มงานปฏิบัติการ

เทคโนโลยีสารสนเทศ



10. ดร.นารี บุญธีราร

ผู้ช่วยผู้จัดการ หัวหน้ากลุ่มงาน
บริหารทรัพย์สิน

11. นางสาวปวีณา ศรีโพธิ์ทอง

ผู้ช่วยผู้จัดการ หัวหน้ากลุ่มงาน
ผู้ออกหลักทรัพย์และบริษัทจดทะเบียน

12. นางพรรณพร ทรัพย์สมบูรณ์

ผู้ช่วยผู้จัดการ หัวหน้ากลุ่มงาน
พัฒนาระบบงานเทคโนโลยีสารสนเทศ

13. นางสาวยุภาวรรณ ศิริชัยนฤมิตร

ผู้ช่วยผู้จัดการ หัวหน้ากลุ่มงานปฏิบัติการ 2

14. นายศักรินทร์ ร่วมรังษี

ผู้ช่วยผู้จัดการ หัวหน้าสายงานกฎหมาย

15. นายสุภกิจ จิระประดิษฐกุล

ผู้ช่วยผู้จัดการ หัวหน้าสายงานกำกับตลาด

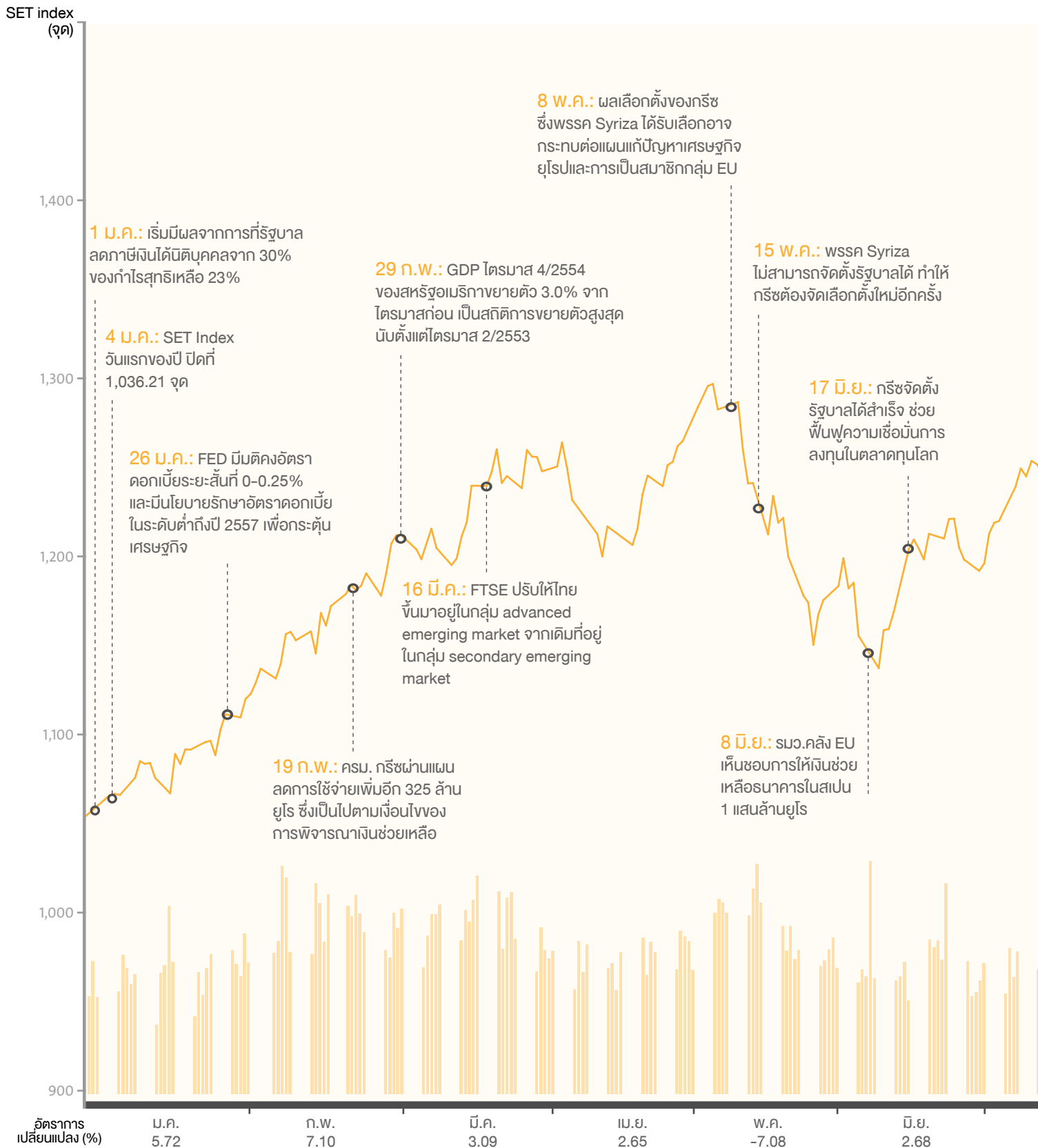
16. นางอุตมวรา เดชสงัจรัส

ผู้ช่วยผู้จัดการ หัวหน้ากลุ่มงานปฏิบัติการ 1

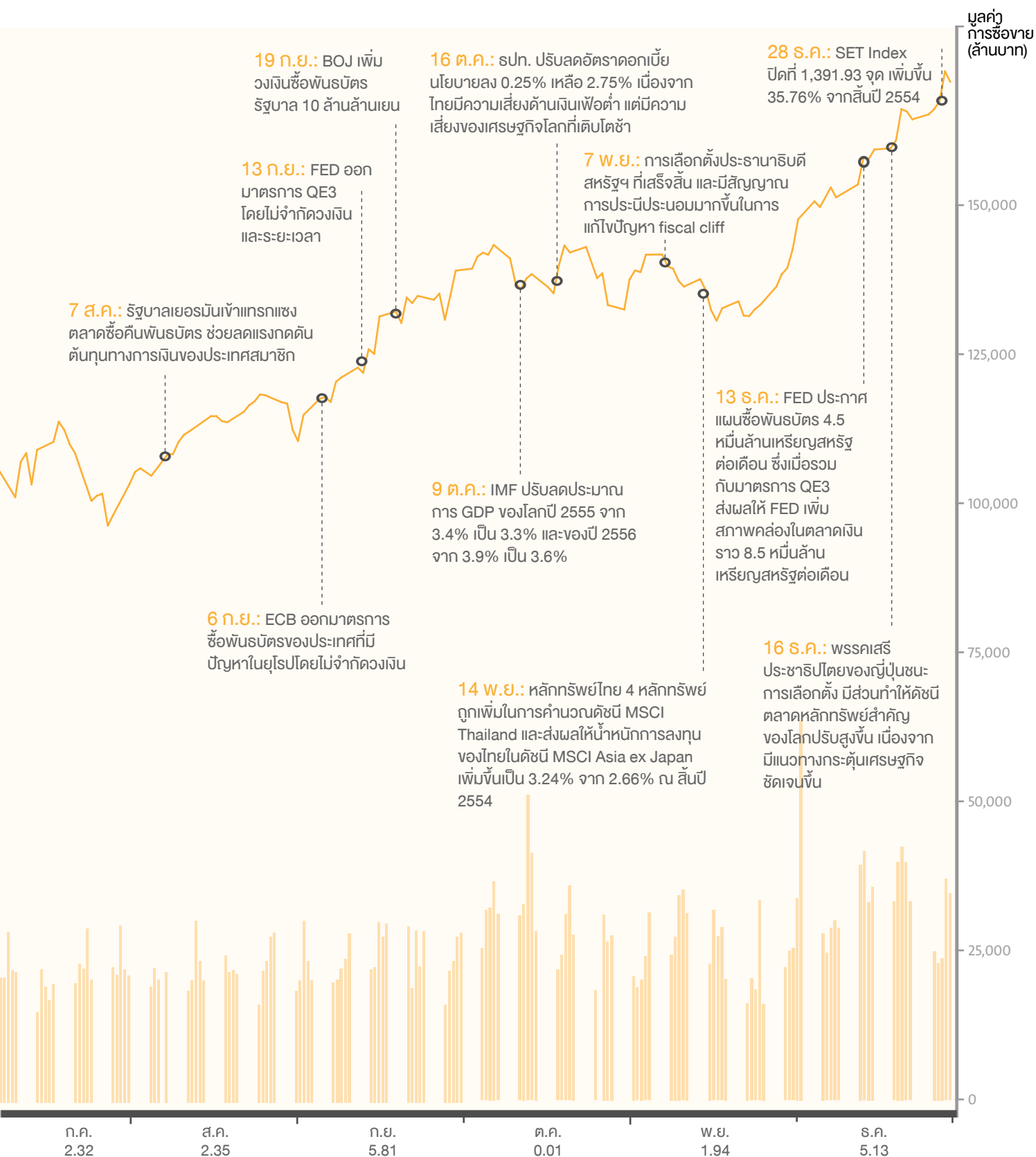


ข้อมูล ณ 26 มกราคม 2556

ความเคลื่อนไหวของการซื้อขาย ในตลาดหลักทรัพย์ฯ ปี 2555



ที่มา: SETSMART



ข้อมูลทางการเงินที่สำคัญของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ

(หน่วย: ล้านบาท)

	2555	2554	2553	2552	2551
งบรายได้และค่าใช้จ่ายรวม					
รายได้รวม	4,499	4,135	4,101	3,209	2,821
รายได้จากการดำเนินงาน	3,365	3,245	2,639	2,112	1,923
รายได้อื่น	1,134	890	1,462	1,097	898
ค่าใช้จ่ายรวม	2,599	2,545	2,482	2,606	2,522
รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่าย - สุทธิ	1,362	1,110	1,128	457	205
งบกระแสเงินสดรวม					
เงินสดสุทธิได้มาจาก (ใช้ไปใน) กิจกรรมดำเนินงาน	621	512	244	(49)	(213)
เงินสดสุทธิได้มาจาก (ใช้ไปใน) กิจกรรมลงทุน	118	(651)	(22)	99	185
งบแสดงฐานะการเงินรวม					
รวมสินทรัพย์หมุนเวียน ¹	16,075	16,502	10,295	8,767	7,792
เงินลงทุนระยะยาว	8,315	5,329	8,296	6,090	4,723
รวมสินทรัพย์	29,935	27,019	23,418	20,692	18,000
รวมหนี้สินหมุนเวียน ¹	8,596	7,494	4,988	3,884	2,820
รวมหนี้สิน	10,451	9,151	6,299	4,928	3,808
รวมเงินกองทุน	19,484	17,868	17,119	15,764	14,192
อัตราส่วนทางการเงินที่สำคัญ					
การเติบโตของรายได้ (ร้อยละ)	8.80	0.83	27.80	13.75	(7.33)
การเติบโตของรายได้จากการดำเนินงาน (ร้อยละ)	3.70	22.96	24.95	9.83	6.18
อัตราค่าใช้จ่ายรวมต่อรายได้รวม (ร้อยละ)	57.77	61.55	60.52	81.21	89.40
อัตรากำไรสุทธิ ² (ร้อยละ)	30.27	26.84	27.51	14.24	7.27
อัตราผลตอบแทนต่อเงินกองทุน (ร้อยละ)	6.99	6.21	6.59	2.90	1.44
อัตราส่วนสภาพคล่อง (เท่า)	1.87	2.20	2.06	2.26	2.76
อัตราหนี้สินรวมต่อเงินกองทุน (เท่า)	0.54	0.51	0.37	0.31	0.27
¹ สินทรัพย์หมุนเวียนและหนี้สินหมุนเวียน รวมทรัพย์สินหลักประกัน และผลประโยชน์ด้วยจำนวนเดียวกัน (เป็นเงินหลักประกันสำหรับ สัญญาซื้อขายตราสารอนุพันธ์ของสำนักหักบัญชี) ทรัพย์สิน / เจ้าหนี้หลักประกันและผลประโยชน์	6,810	6,053	3,612	2,835	1,902
² อัตรากำไรสุทธิ คำนวณจาก รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่าย-สุทธิ ต่อรายได้รวม					

สรุปภาวะการซื้อขายหลักทรัพย์ และสถิติสำคัญประจำปี 2555

ในปี 2555 ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ไทยปรับเพิ่มขึ้นถึง 35.76% จากสิ้นปี 2554 โดยเพิ่มขึ้นสูงสุดในภูมิภาคเอเชียและทำสถิติสูงสุดในรอบ 17 ปี จากสภาพคล่องทางการเงินในตลาดทุนโลกที่เพิ่มขึ้นและการเติบโตของบริษัทยักษ์ใหญ่ไทย สำหรับมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดและมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ทำสถิติสูงสุดนับตั้งแต่ตลาดหลักทรัพย์เปิดทำการ

ภาพรวมตลาดหลักทรัพย์ไทย

ในปี 2555 ตลาดทุนทั่วโลกได้รับผลกระทบจากเศรษฐกิจหลักของโลกทั้งสหรัฐอเมริกา กลุ่มประเทศยุโรป และญี่ปุ่น ซึ่งประสบปัญหาเศรษฐกิจชะลอตัวหรือฟื้นตัวในระดับต่ำ ประกอบกับมีการเปลี่ยนแปลงทางการเมืองในหลายประเทศซึ่งกระทบต่อความต่อเนื่องของนโยบายเศรษฐกิจ อย่างไรก็ตาม ทัศนคติของนักลงทุนแบบมืออาชีพที่ธนาคารกลางหลายประเทศใช้เพื่อสนับสนุนการฟื้นตัวของเศรษฐกิจส่งผลให้ตลาดทุนไทยได้รับอานิสงส์จากสภาพคล่องสูงในตลาดทุนโลก

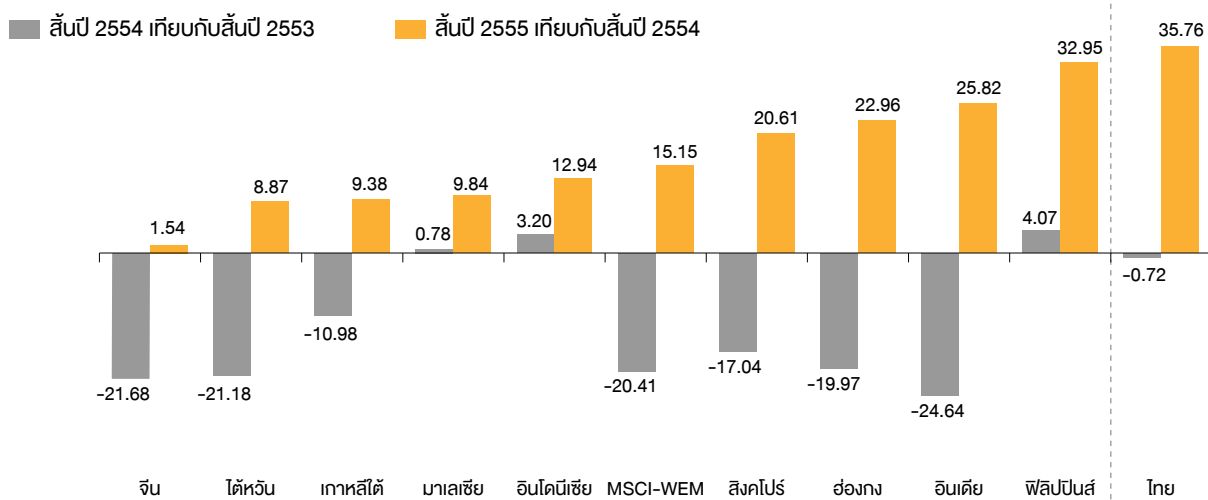
ในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ไทยได้รับการยกระดับมาตรฐานในหลายด้านซึ่งเพิ่มความน่าสนใจในการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ไทยมากขึ้น โดย FTSE Group ยกระดับตลาดทุนไทยเข้าไปในกลุ่มตลาดเกิดใหม่ชั้นนำ (Advanced Emerging Market) ขณะที่ MSCI เพิ่มหลักทรัพย์ไทย 4 หลักทรัพย์ในการคำนวณดัชนี MSCI Global Standard และ 9 หลักทรัพย์ในดัชนี MSCI Small Cap ส่งผลให้ ณ สิ้นปี 2555 มีหลักทรัพย์ไทย 22 หลักทรัพย์ ได้คัดเลือกเพื่อคำนวณดัชนี MSCI All Country Asia (excluding Japan) โดยมีน้ำหนักการลงทุนของไทยเพิ่มขึ้นเป็น 3.24% จาก 2.66% ณ สิ้นปี 2554 และบริษัทจดทะเบียนไทยได้รับการยกอันดับด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดี โดยสถาบัน Asia Corporate Governance Association สูงขึ้นเป็นอันดับ 3 จากประเทศในเอเชียทั้งหมด 11 ประเทศ

นอกจากนี้บริษัทจดทะเบียนไทยยังคงมีความแข็งแกร่ง สามารถฟื้นตัวจากเหตุการณ์น้ำท่วมในช่วงปลายปี 2554 ได้เร็ว และมีผลประกอบการเติบโตดีในปี 2555 ทั้งด้านรายได้และกำไรสุทธิ

ปัจจัยสนับสนุนการลงทุนเหล่านี้ส่งผลให้ ณ สิ้นปี 2555 ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ไทย (SET index) ปิดที่ 1,391.93 จุด เพิ่มขึ้น 35.76% จากสิ้นปี 2554 ซึ่งเป็นการปรับเพิ่มขึ้นสูงสุดในภูมิภาคเอเชีย SET index สูงสุดที่ 1,397.19 จุด (ณ 27 ธ.ค. 2555) ซึ่งเป็นจุดที่ดัชนีสูงสุดในรอบ 17 ปี ในระหว่างปี SET index มีจุดต่ำสุดที่ 1,036.21 จุด (ณ 4 ม.ค. 2555)

ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) ปิดที่ 415.68 จุด เพิ่มขึ้น 57.32% จากสิ้นปี 2554 โดยมีจุดสูงสุดที่ 415.89 จุด (ณ 27 ธ.ค. 2555) และเป็นจุดสูงสุดตั้งแต่ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ เริ่มซื้อขาย ขณะที่จุดต่ำสุดที่ 266.91 จุด (ณ 4 ม.ค. 2555)

การเปลี่ยนแปลงของดัชนีตลาดหลักทรัพย์ที่สำคัญในภูมิภาค (หน่วย: %)



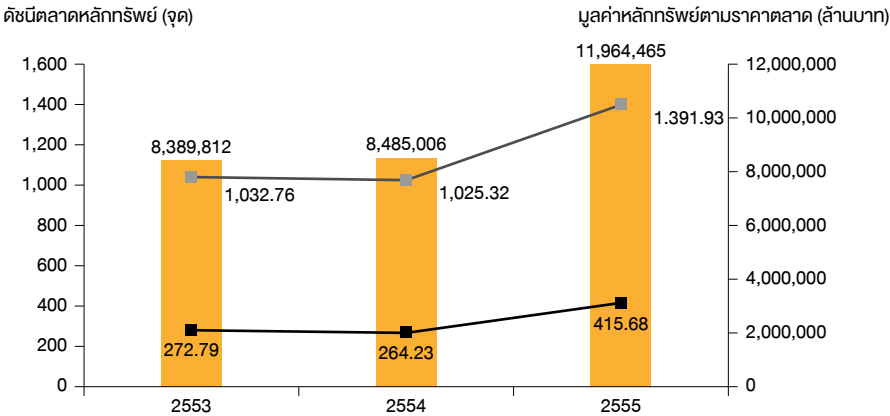
ที่มา: Bloomberg

มูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดของทั้ง SET และ mai ณ สิ้นปี 2555 ปรับเพิ่มขึ้นตามทิศทางของดัชนีตลาดหลักทรัพย์และการระดมทุนของบริษัทจดทะเบียนโดยทำสถิติสูงสุดนับตั้งแต่ตลาดหลักทรัพย์เปิดทำการ มูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดของ SET อยู่ที่ 11,831,448 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 40.72% จากสิ้นปี 2554 และของ mai อยู่ที่ 133,017 ล้านบาท เพิ่มขึ้นถึง 72.06% จากสิ้นปี 2554

ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ และมูลค่าหลักทรัพย์ ตามราคาตลาด (SET & mai)

- มูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด
รวม SET และ mai
- SET index
- mai index

ที่มา: SETSMART



ณ สิ้นปี 2555 ค่า Forward P/E ratio ของไทยปรับสูงขึ้นมากจากสิ้นปีก่อนหน้า โดยของ SET อยู่ที่ 15.46 เท่า เพิ่มขึ้นจาก 12.42 เท่า ณ สิ้นปี 2554 และของ mai อยู่ที่ระดับ 16.58 เท่า เพิ่มขึ้นจาก 9.40 เท่า ณ สิ้นปี 2554

สำหรับอัตราเงินปันผลตอบแทน ณ สิ้นปี 2555 ของ SET สูงเป็นอันดับ 3 ในภูมิภาค รองจากมาเลเซียและไต้หวัน โดยอยู่ที่ 3.19% ขณะที่ของตลาดหลักทรัพย์ mai มีอัตราเงินปันผลตอบแทนที่ 1.72%

ภาวะการซื้อขายหลักทรัพย์

ปริมาณการซื้อขายหลักทรัพย์ในปี 2555 ปรับดีขึ้นจากปีก่อนหน้า โดยมีมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวันรวมของ SET และ mai ทั้งสิ้น 32,304 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 9.61% จากปี 2554 ทำสถิติสูงสุดนับตั้งแต่ตลาดหลักทรัพย์เริ่มซื้อขาย และเป็นปีแรกที่มีมูลค่าการซื้อขายสูงที่สุดในภูมิภาคอาเซียน ขณะที่ตลาดหลักทรัพย์สำคัญอื่นๆ ในภูมิภาคอาเซียนมีปริมาณการซื้อขายลดลง แสดงถึงความสามารถในการดึงดูดความสนใจของผู้ลงทุน ตามแผนการพัฒนาลตลาดทุนในด้านสำคัญๆ ทุกๆ ด้านอย่างต่อเนื่องตลอด 4 ปีที่ผ่านมา

มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของ SET และ mai ในปี 2553 - 2555

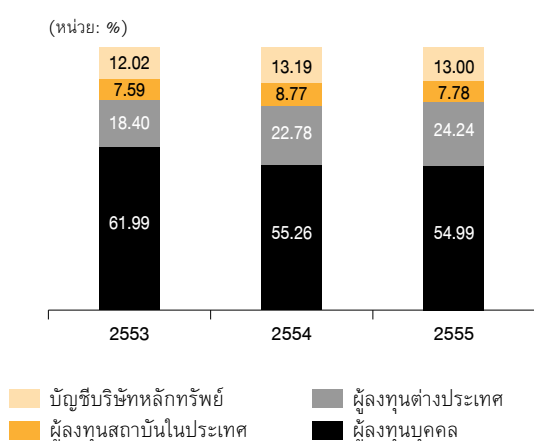
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ (ล้านบาท)	2555	2554	2553
ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET)	7,615,638	7,040,458	6,937,890
ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai)	298,929	151,023	96,058
มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์รวมของ SET และ mai	7,914,567	7,191,481	7,033,947
มูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยรายวันรวมของ SET และ mai	32,304	29,473	29,066
อัตราการเปลี่ยนแปลงจากช่วงเดียวกันในปีก่อนหน้า (%)	9.61	1.40	59.47

ที่มา: SETSMART

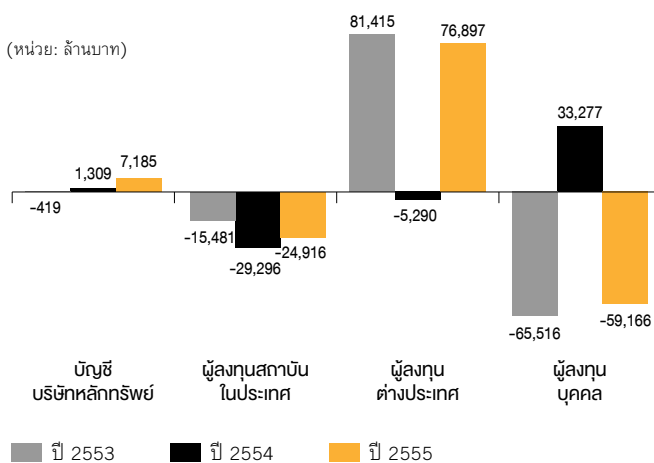
การซื้อขายหลักทรัพย์รวมของ SET และ mai แยกตามประเภทผู้ลงทุนในปี 2555 พบว่าผู้ลงทุนต่างประเทศและบัญชีบริษัทหลักทรัพย์ซื้อสุทธิ โดยผู้ลงทุนต่างประเทศมีสถานะซื้อสุทธิถึง 76,897 ล้านบาท เทียบกับขายสุทธิในปีก่อนหน้าที่ 5,290 ล้านบาท ขณะที่ผู้ลงทุนบุคคลและผู้ลงทุนสถาบันในประเทศขายสุทธิ

ด้านสัดส่วนการซื้อขายของผู้ลงทุนในปี 2555 ผู้ลงทุนต่างประเทศมีสัดส่วนการซื้อขายเพิ่มขึ้นจาก 22.78% ในปีก่อนหน้า มาอยู่ที่ 24.24% ของมูลค่าการซื้อขายรวม อีกทั้งเมื่อพิจารณาร่วมกับมูลค่าการซื้อขายรวมที่เพิ่มขึ้น แสดงถึงความน่าสนใจของบริษัทยจดทะเบียนไทยที่เพิ่มขึ้นในสายตาผู้ลงทุนต่างชาติเมื่อเทียบกับผู้ลงทุนกลุ่มอื่น อย่างไรก็ตาม ผู้ลงทุนบุคคลยังคงมีสัดส่วนการซื้อขายหลักทรัพย์สูงสุดที่ 54.99% ของมูลค่าการซื้อขายรวม ลดลงเล็กน้อยจาก 55.26% ในปีก่อนหน้า

สัดส่วนมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์แยกตามประเภทผู้ลงทุนรวมของ SET และ mai ในปี 2553 - 2555

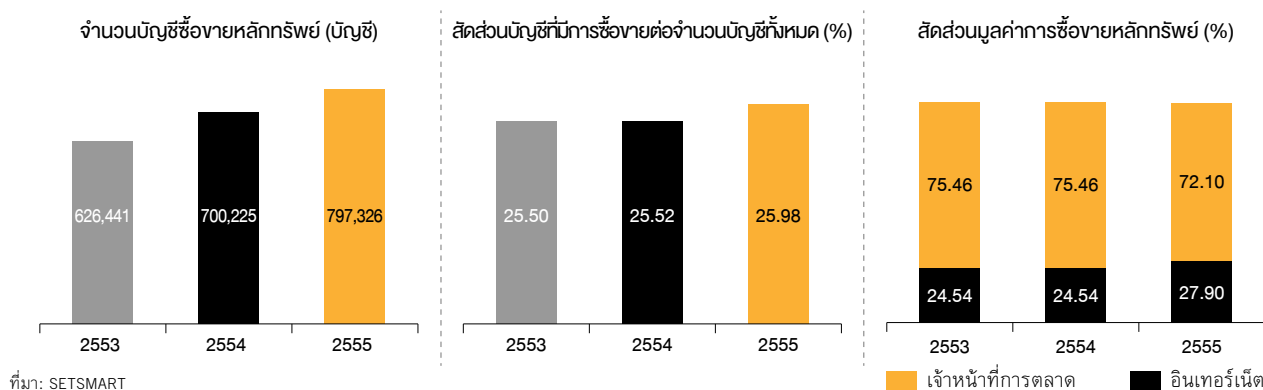


มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์สุทธิแยกตามประเภทผู้ลงทุนรวมของ SET และ mai ในปี 2553 - 2555



สำหรับบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์ ณ สิ้นปี 2555 มีจำนวน 797,326 บัญชี เพิ่มขึ้นถึง 13.87% จากสิ้นปี 2554 และเป็นอัตราขยายตัวที่สูงกว่าในปี 2553-2554 ซึ่งขยายตัวเฉลี่ย 11.68% จากกลยุทธ์ขยายฐานผู้ลงทุนร่วมกับพันธมิตรในธุรกิจธนาคารพาณิชย์และบริษัทหลักทรัพย์อย่างเป็นรูปธรรม โดยมีค่าเฉลี่ยของสัดส่วนจำนวนบัญชีที่มีการซื้อขายเฉลี่ยต่อเดือน (active account) ของปี 2555 อยู่ที่ 25.98% เพิ่มขึ้นจากปี 2554 และผู้ลงทุนให้ความสนใจการซื้อขายหลักทรัพย์ทางอินเทอร์เน็ตเพิ่มขึ้น โดยมีสัดส่วนมูลค่าการซื้อขายทางอินเทอร์เน็ตต่อมูลค่าการซื้อขายรวมในปี 2555 เพิ่มขึ้นเป็น 27.90% โดย ณ สิ้นปี 2555 มีฐานจำนวนบัญชีทางอินเทอร์เน็ต 446,870 บัญชี เพิ่มขึ้น 29.59% จากสิ้นปี 2554

จำนวนบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์รวมของ SET และ mai ในปี 2553 - 2555



ภาวะการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ในปี 2555 ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีปริมาณสัญญาซื้อขายเฉลี่ย 43,823 สัญญาต่อวัน เพิ่มขึ้น 6.51% จากปีก่อน จากการเพิ่มขึ้นอย่างมีนัยสำคัญของ Single Stock Futures และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าทองคำขนาดเล็ก (10 Baht Gold Futures) โดยมีปริมาณสัญญาซื้อขายเฉลี่ย 8,849 สัญญาต่อวัน และ 10,601 สัญญาต่อวัน ตามลำดับ นอกจากนี้ในปี 2555 ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีผลิตภัณฑ์ใหม่คือ สัญญาซื้อขายอัตราแลกเปลี่ยนเงินดอลลาร์สหรัฐล่วงหน้า (USD Futures) และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อ้างอิงดัชนีหมวดธุรกิจ (Sector Index Futures) โดยมีปริมาณสัญญาซื้อขายเฉลี่ย 2,751 สัญญาต่อวัน และ 4 สัญญาต่อวัน ตามลำดับ

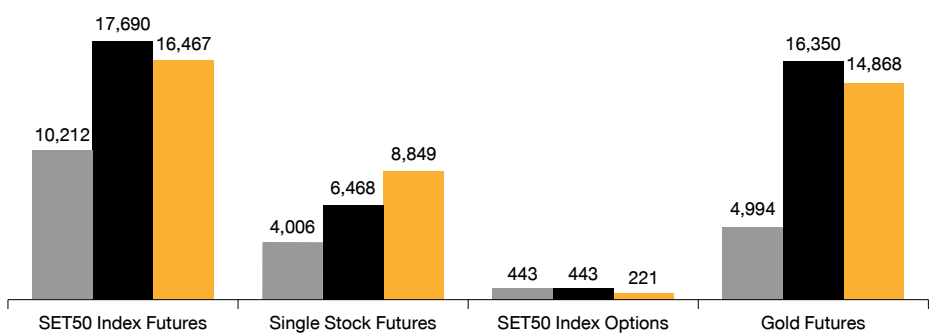
สำหรับการซื้อขายในช่วงเวลากลางคืน (night session) ได้รับความสนใจจากผู้ลงทุนเพิ่มขึ้น โดยในปี 2555 มีการซื้อขายในช่วง night session คิดเป็นสัดส่วน 49.67% ของปริมาณการซื้อขายรวม เพิ่มขึ้นจาก 40.03% ในปี 2554

ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีจำนวนผู้ลงทุนเพิ่มขึ้นอย่างก้าวกระโดด ส่งผลให้ ณ สิ้นปี 2555 มีจำนวนบัญชีรวมทั้งสิ้น 80,893 บัญชี เพิ่มขึ้นถึง 28.64% จากสิ้นปี 2554

ปริมาณสัญญาซื้อขายเฉลี่ยรายวัน ของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

(หน่วย: สัญญา)

- ปี 2553
มีปริมาณสัญญา รวม 18,676 สัญญา
- ปี 2554
มีปริมาณสัญญา รวม 41,145 สัญญา
- ปี 2555
มีปริมาณสัญญา รวม 43,823 สัญญา



หมายเหตุ: 1. ปี 2553 เปิดให้มีการซื้อขายผลิตภัณฑ์ใหม่ 1 รายการ คือ Interest Rate Futures (ต.ค. 2553)
2. ปี 2554 เปิดให้มีการซื้อขายผลิตภัณฑ์ใหม่ 2 รายการ คือ Silver Futures (มี.ย. 2554) และ Oil Futures (ต.ค. 2554)
3. ปี 2555 เปิดให้มีการซื้อขายผลิตภัณฑ์ใหม่ 2 รายการ คือ USD Futures (มี.ย. 2555) และ Sector Index Futures (ต.ค. 2555)

ที่มา: SETSMART

ภาพรวมการระดมทุน

ในปี 2555 การระดมทุนในรูปตราสารทุนของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) มีมูลค่าสูงสุดในช่วง 10 ปีที่ผ่านมา โดยมีมูลค่ารวมทั้งสิ้น 258,108 ล้านบาท เพิ่มขึ้นสองเท่าจากปีก่อน (หรือเพิ่มขึ้น 207.99%) โดยมีบริษัทจดทะเบียนใช้ตลาดหลักทรัพย์เป็นแหล่งระดมทุนจำนวน 157 บริษัท คิดเป็น 28.13% ของจำนวนบริษัทจดทะเบียนทั้งหมด เพิ่มขึ้นจาก 24.44% ในปี 2554

ทั้งนี้ แยกเป็นการระดมทุนในตลาดแรก (initial public offering: IPO) มูลค่า 52,467 ล้านบาท จากบริษัทจดทะเบียนเข้าใหม่ 18 บริษัท (SET 8 บริษัท และ mai 10 บริษัท) รวมถึงกองทุนอสังหาริมทรัพย์ 6 กองทุน และเป็นการระดมทุนในตลาดรอง (secondary equity offering: SEO) มูลค่า 205,641 ล้านบาท

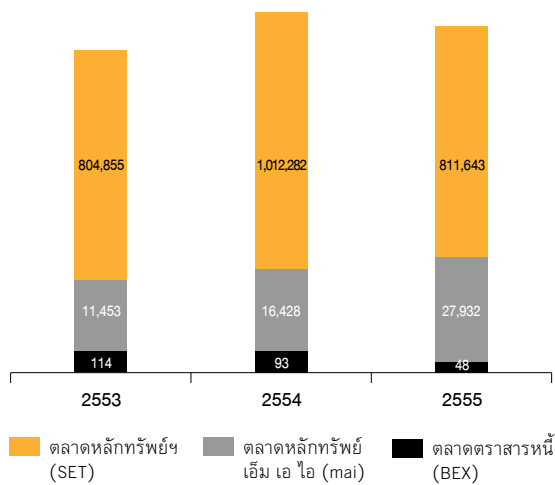
มูลค่าระดมทุนและจำนวนบริษัทจดทะเบียนที่ระดมทุน

	มูลค่าระดมทุน (ล้านบาท)			จำนวนบริษัท (บริษัท)		
	ปี 2555	ปี 2554	ปี 2553	ปี 2555	ปี 2554	ปี 2553
ตลาดแรก	52,467	18,463	12,588	24	16	15
ตลาดรอง	205,641	64,860	77,940	133	117	111
รวม	258,108	83,323	90,528	157	133	126

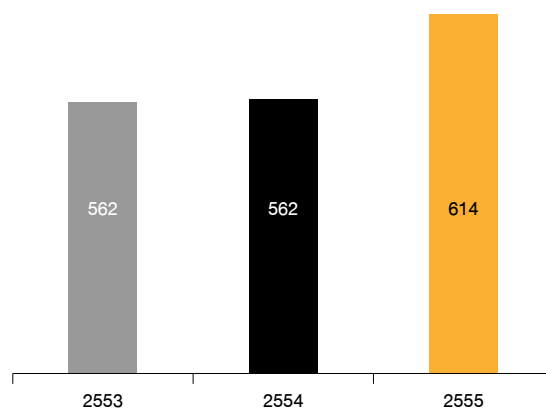
สถิติสำคัญเกี่ยวกับงานหลังการซื้อขายหลักทรัพย์

	2555	2554	2553
งานรับฝากหลักทรัพย์			
จำนวนสมาชิกผู้ฝากหลักทรัพย์ (ราย)	698	667	659
บริษัทหลักทรัพย์	37	37	38
ธนาคารพาณิชย์	34	33	35
บริษัทผู้ออกหลักทรัพย์	592	573	562
อื่นๆ	35	24	24
จำนวนหลักทรัพย์ในระบบรับฝากหลักทรัพย์ (หลักทรัพย์)			
ตราสารทุนและตราสารหนี้ภาคเอกชน	1,804	1,145	1,075
ตราสารหนี้ภาครัฐวิสาหกิจ	510	453	525
งานสำนักหักบัญชี			
จำนวนสมาชิกสำนักหักบัญชี (ราย)			
ตราสารทุนและตราสารหนี้	87	87	89
ตราสารอนุพันธ์	42	42	41
งานนายทะเบียนหลักทรัพย์			
จำนวนบริษัทที่ให้บริการเป็นนายทะเบียน (บริษัท)	667	648	645
จำนวนหลักทรัพย์ที่ให้บริการเป็นนายทะเบียน (หลักทรัพย์)	1,421	1,038	815
งานนายทะเบียนกองทุน			
จำนวนนายจ้าง (ราย)	4,566	4,264	4,591
จำนวนสมาชิกกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ (ราย)	1,052,759	935,404	859,630
การซื้อขายใบแสดงสิทธิ			
ปริมาณ (ล้านหุ้น)	80,629	63,956	71,611
มูลค่า (ล้านบาท)	1,565,214.52	1,402,821.98	1,210,857.91
จำนวนหลักทรัพย์ (หลักทรัพย์)	638	624	610

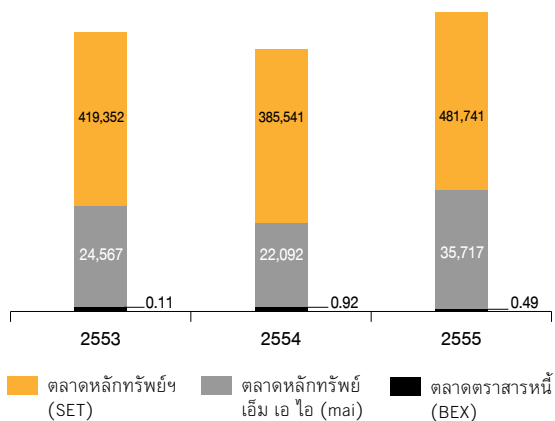
มูลค่าการชำระราคาหลักทรัพย์ (ล้านบาท)



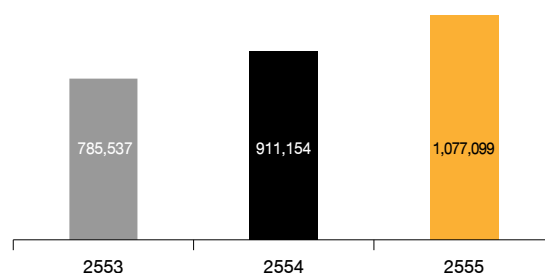
บริษัทที่เข้าร่วมโครงการ Issuer Account (บริษัท)



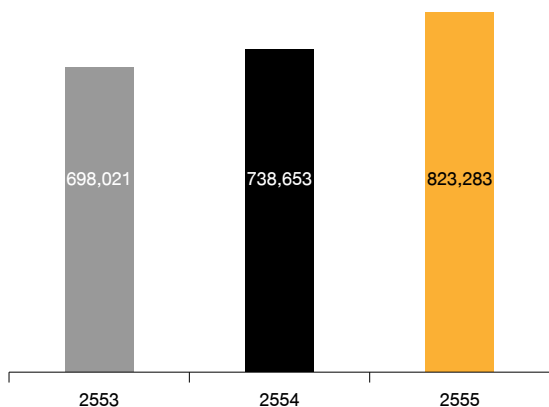
ปริมาณการชำระราคาหลักทรัพย์ (ล้านหุ้น)



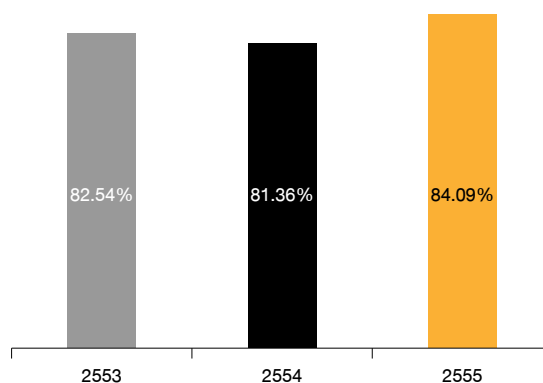
จำนวนผู้ลงทุนในโครงการโอนเงินปันผลเข้าบัญชีธนาคาร (ID)



ปริมาณหลักทรัพย์ในระบบรับฝากหลักทรัพย์ (ล้านหุ้น)



สัดส่วนกำไรต่อหุ้นตามปริมาณหลักทรัพย์ (%)



ลักษณะการประกอบธุรกิจ ของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ

ภาพรวมการประกอบธุรกิจของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ

ผลิตภัณฑ์และบริการ

กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำเนินธุรกิจตลาดหลักทรัพย์เพียงแห่งเดียวในประเทศไทยอย่างครบวงจร โดยประกอบด้วยธุรกิจหลักดังต่อไปนี้

1. ธุรกิจตราสารทุน

กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นศูนย์กลางการซื้อขายตราสารทุนและตราสารหนี้ ที่มุ่งเน้นให้หลักทรัพย์ที่ทำการซื้อขายมีสภาพคล่อง โดยรับจดทะเบียนหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) และตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) เพื่อให้ผู้ประกอบการสามารถระดมทุนจากผู้ลงทุน และผู้ลงทุนมีตลาดรองสำหรับการซื้อขายเปลี่ยนมือหลักทรัพย์ โดย ณ 31 ธันวาคม 2555 มีบริษัทจดทะเบียนใน SET 477 บริษัท และใน mai 81 บริษัท ตลอดจนรับจดทะเบียนตราสารอื่น เช่น ใบสำคัญแสดงสิทธิ (warrants) ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (derivative warrants) กองทุนที่เอฟ (exchange traded fund) และตราสารหนี้

นอกจากนี้ ยังทำหน้าที่กำกับดูแลการซื้อขายของผู้ลงทุนและกำกับดูแลบริษัทสมาชิกให้ตลาดมีความน่าเชื่อถือ โปร่งใส และมีประสิทธิภาพเพื่อสะท้อนราคาที่แท้จริงของหลักทรัพย์ รวมทั้งทำหน้าที่กำกับดูแลการเปิดเผยข้อมูลของหลักทรัพย์จดทะเบียนต่อผู้ลงทุนให้เป็นไปอย่างถูกต้อง โปร่งใส และทันเวลา

รวมทั้งเป็นศูนย์กลางการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์และตลาดตราสารหนี้ โดยทำหน้าที่เป็นสำนักหักบัญชี กล่าวคือ เป็นคู่สัญญาและรับประกันการชำระราคาและส่งมอบ (Central Counterparty: CCP) ในทุกรายการซื้อขายที่เกิดขึ้นในตลาด หากสมาชิกฝ่ายหนึ่งฝ่ายใดไม่ปฏิบัติตามสัญญา สำนักหักบัญชีจะเป็นผู้รับผิดชอบ โดยจ่ายชำระราคาหรือส่งมอบหลักทรัพย์ให้กับคู่สัญญาแทน ซึ่งถือเป็นหนึ่งในกลไกสำคัญที่ทำให้ความเสี่ยงของคู่สัญญา (Counterparty Risk) จากการซื้อขายในตลาดลดลงหนึ่ง สำนักหักบัญชียังให้บริการชำระราคาสำหรับการซื้อขายตราสารหนี้ที่เกิดขึ้นนอกตลาดด้วย (over the counter)

อีกทั้งยังทำหน้าที่เป็นศูนย์กลางรับฝากหลักทรัพย์ไว้ในระบบไว้ใบหลักทรัพย์ ทั้งตราสารทุนและตราสารหนี้ที่ปลอดภัยและมีประสิทธิภาพ โดยให้บริการรับฝากหลักทรัพย์ ถอนหลักทรัพย์ โอนหลักทรัพย์ จำนำ และเพิกถอนจำนำหลักทรัพย์ ซึ่งผู้ลงทุนสามารถทำรายการเหล่านี้ผ่านบริษัทสมาชิกผู้ฝากหลักทรัพย์ รวมทั้งทำหน้าที่ควบคุมสัดส่วนการถือครองหลักทรัพย์ของผู้ลงทุนต่างชาติที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้เป็นไปตามกฎและข้อบังคับของทางการที่เกี่ยวข้อง

2. ธุรกิจตราสารอนุพันธ์

กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ พัฒนาและจัดให้ซื้อขายตราสารอนุพันธ์ที่อ้างอิงหลักทรัพย์และสินค้าโภคภัณฑ์ เช่น ดัชนีหลักทรัพย์ หุ้นสามัญ ทองคำ โลหะเงิน น้ำมัน สกุลเงิน อัตราดอกเบี้ย เป็นต้น โดยทำหน้าที่กำกับดูแลการซื้อขายของผู้ลงทุนและกำกับดูแลบริษัทสมาชิกให้ตลาดมีความน่าเชื่อถือ โปร่งใส และมีประสิทธิภาพ รวมทั้งยังเป็นศูนย์กลางการชำระราคารายการซื้อขายในตลาดอนุพันธ์ด้วย

3. ธุรกิจบริการเทคโนโลยี

นอกจากกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ จะทำหน้าที่เป็นศูนย์กลางซื้อขายหลักทรัพย์และให้บริการที่สำคัญข้างต้นแล้ว ยังให้บริการระบบการส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ (Front Office Service Bureau: FSB) ระบบ internet trading และระบบปฏิบัติการหลังการซื้อขายหลักทรัพย์ (Back Office Service Bureau: BSB) แก่บริษัทเพื่อให้เกิดการประหยัดต่อขนาด (economy of scale) และลดระยะเวลาในการพัฒนาสินค้าและบริการให้แก่บริษัทสมาชิก ในปัจจุบันบริษัทสมาชิกได้เลือกใช้บริการดังกล่าวอย่างน้อย 1 บริการของธุรกิจบริการเทคโนโลยี รวมถึงการเผยแพร่ข้อมูลการซื้อขายที่เกิดขึ้น และข้อมูลหลักทรัพย์จดทะเบียนเพื่อให้ผู้ลงทุนใช้ตัดสินใจลงทุน

4. ธุรกิจบริการงานนายทะเบียน

กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ทำหน้าที่ดูแลและรักษาข้อมูลหลักทรัพย์ และจัดทำทะเบียนผู้ถือหลักทรัพย์ให้มีความถูกต้อง ครบถ้วน เป็นปัจจุบันอยู่เสมอ บริหารข้อมูลสิทธิประโยชน์ของผู้ถือหุ้น เชื่อมโยงกับระบบงานรับฝากหลักทรัพย์ นอกจากนี้ ยังมีระบบการเก็บรักษา รวบรวมและประมวลผลข้อมูลในทะเบียนหลักทรัพย์ มีระบบห้องมั่นคงเพื่อจัดเก็บใบหลักทรัพย์และเอกสารสิทธิให้ปลอดภัย

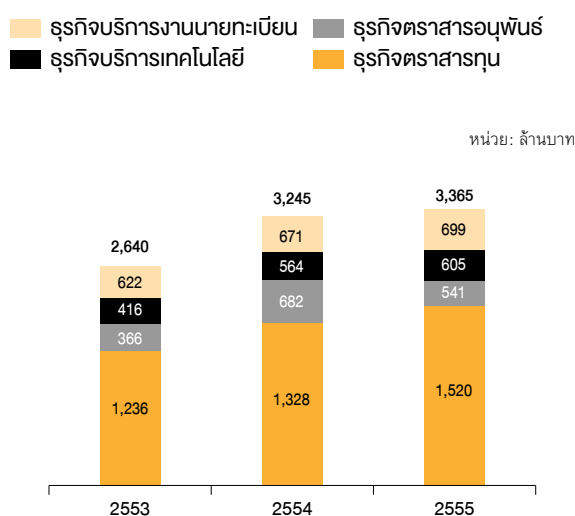
นอกจากนั้น ยังให้บริการนายทะเบียนกองทุนสำรองเลี้ยงชีพสำหรับบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนที่ทำหน้าที่บริหารกองทุน ให้แก่นายจ้างที่จัดตั้งกองทุนสำรองเลี้ยงชีพด้วย

5. งานพัฒนาตลาดทุนระยะยาว

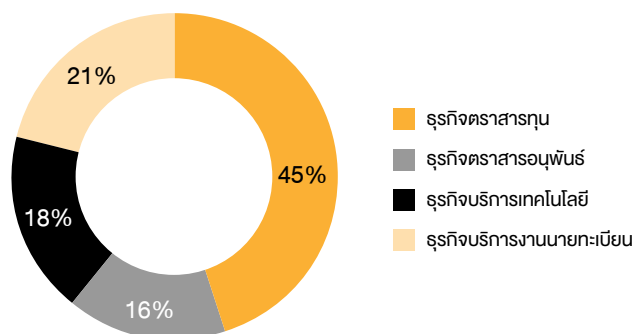
กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้ความสำคัญกับการพัฒนาตลาดทุนในระยะยาว ซึ่งจะส่งผลต่อการยกระดับขีดความสามารถในการแข่งขันของตลาดทุนไทยและธุรกิจไทย ทั้งในด้านการพัฒนาความรู้ผู้ลงทุน ประชาชนทั่วไป ผู้ประกอบการและบุคลากรในตลาดทุน การยกระดับการกำกับดูแลกิจการที่ดีและความสามารถในการปฏิบัติงานด้านนักลงทุนสัมพันธ์ของบริษัทจดทะเบียน ตลอดจนการผลิตผลงานวิจัยและสร้างองค์ความรู้ที่เกี่ยวข้องกับตลาดทุนเพื่อนำไปสู่การนำไปใช้ปฏิบัติจริง

นอกจากนี้ กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังเป็นสมาชิกของสภาธุรกิจตลาดทุนไทย (Federation of Thai Capital Market Organizations: FETCO) ซึ่งเป็นตัวแทนองค์กรในตลาดทุนไทยที่ประสานความร่วมมือกับหน่วยงานภาครัฐ เพื่อผลักดันมาตรการและนโยบายที่จะเป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาตลาดทุนไทยในระยะยาว

โครงสร้างรายได้ กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ มีโครงสร้างรายได้ใน 3 ปีที่ผ่านมา (ปี 2553-2555) ดังนี้



โครงสร้างรายได้ปี 2555



วิสัยทัศน์และพันธกิจของการดำเนินธุรกิจ

กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งเน้นที่จะ “**เพิ่มพลังให้ธุรกิจและผู้ลงทุน ด้วยความโดดเด่นในการตอบสนองโอกาสทางการเงิน**” โดยกำหนดพันธกิจภายใต้วิสัยทัศน์ดังนี้ (1) ขยายฐานบริษัทจดทะเบียนและผู้ลงทุน และสร้างความเข้มแข็งให้แก่สถาบันตัวกลางเพื่อให้เติบโตและประสบความสำเร็จไปด้วยกัน (2) นำเสนอผลิตภัณฑ์และบริการที่หลากหลายเพื่อสร้างคุณค่าและตอบสนองโอกาสทางการเงินแก่ธุรกิจและผู้ลงทุนกลุ่มต่างๆ (3) ปฏิบัติงานโดยไม่ผิดพลาดตามมาตรฐานสากลเพื่อให้เกิดประสิทธิภาพ ประสิทธิผล ความยืดหยุ่น

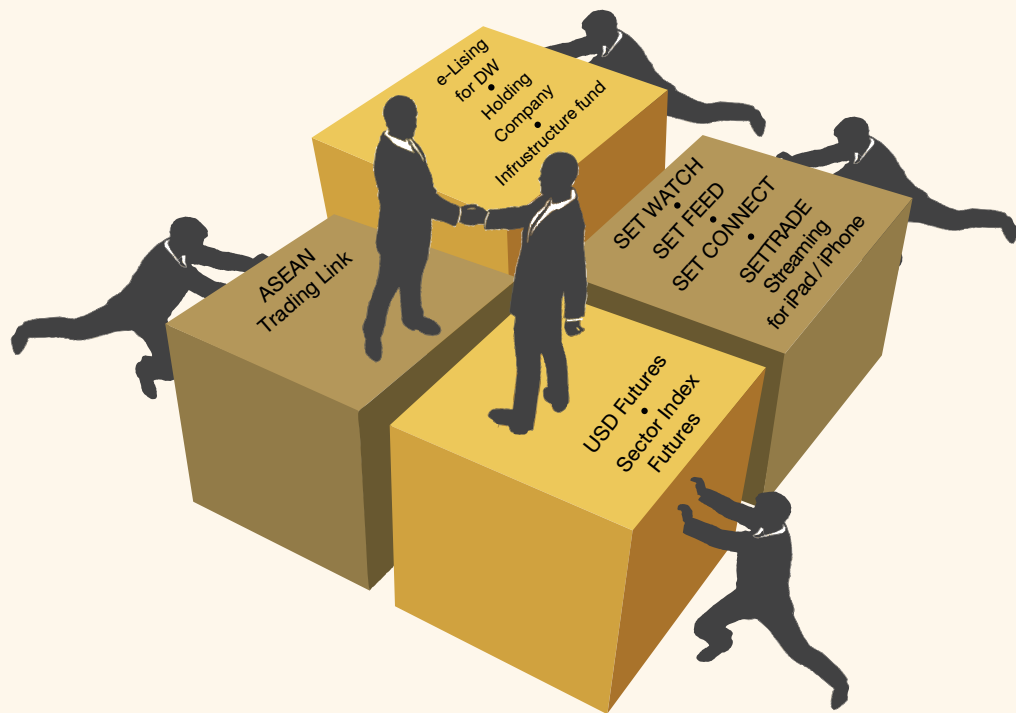
และความเชื่อมโยงกับตลาดทุนโลก และ (4) ส่งเสริมให้พนักงานทำงานอย่างเต็มศักยภาพและสร้างวัฒนธรรมองค์กรที่มุ่งสร้างความเป็นเลิศในการตอบสนองโอกาสทางการเงินแก่ธุรกิจและผู้ลงทุน เพื่อให้คงความเป็นผู้นำด้านการระดมทุนของธุรกิจในประเทศ (domestic champion) เป็นประตูการลงทุนในอนุภูมิภาคแม่น้ำโขง (hub of the Greater Mekong Subregion) เชื่อมโยงกับตลาดหลักทรัพย์ในภูมิภาคอาเซียน (regional linkage) และสร้างเครือข่ายกับตลาดหลักทรัพย์ชั้นนำระดับโลก (global alliance)

คู่แข่งทางธุรกิจ

แม้ว่ากลุ่มตลาดหลักทรัพย์ จะให้บริการตลาดหลักทรัพย์เพียงแห่งเดียวในประเทศไทย แต่การเปิดเสรีทางการเงินและความเชื่อมโยงในตลาดทุนโลกได้ส่งผลให้กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ต้องแข่งกับคู่แข่งทางธุรกิจมาโดยต่อเนื่อง บริษัทจดทะเบียนที่ต้องการระดมทุนสามารถไปจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศได้ ส่วนผู้ลงทุนสามารถเลือกลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศที่ให้ผลตอบแทนการลงทุนที่ดีหรือเพื่อกระจายความเสี่ยง อีกทั้งตลาดหลักทรัพย์คู่แข่งยังสามารถพัฒนาผลิตภัณฑ์ที่ใกล้เคียงหรือทดแทนผลิตภัณฑ์ของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อดึงดูดให้ผู้ลงทุนทั้งในและต่างประเทศไปลงทุนได้ด้วย

ในปัจจุบัน ตลาดหลักทรัพย์ทั่วโลกพัฒนาระบบเทคโนโลยีให้ทันสมัย เพื่อรองรับกับผลิตภัณฑ์และบริการที่เป็นที่ต้องการของผู้ลงทุน สามารถปฏิบัติการโดยปราศจากข้อผิดพลาด (flawless execution) และสามารถปรับขยายเพื่อรองรับกับความต้องการของลูกค้าอย่างไม่จำกัดได้ รวมถึงการสร้างเชื่อมโยงกับระบบเครือข่ายต่างประเทศ และพัฒนาบริการเพื่อรองรับการส่งคำสั่งซื้อขาย (order type) รูปแบบใหม่เพื่อดึงดูดการลงทุนจากต่างประเทศ

นอกจากนี้ แนวโน้มสำคัญของธุรกิจตลาดหลักทรัพย์ที่เกิดขึ้นในต่างประเทศแต่ยังไม่เกิดขึ้นในประเทศไทย คือ การขยายตัวของกระดานซื้อขายหลักทรัพย์ทางเลือก (Alternative Trading System: ATS) และการจับคู่คำสั่งซื้อขายภายในของบริษัทหลักทรัพย์ต่างๆ (order internalization) ซึ่งอาจจะเป็นคู่แข่งของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ในอนาคตหากมีการเปิดเสรีธุรกิจตลาดหลักทรัพย์ในประเทศไทย อีกทั้ง การควบรวมกิจการของตลาดหลักทรัพย์ทั่วโลกที่เกิดขึ้นในช่วง 4-5 ปีที่ผ่านมา อาจส่งผลกระทบต่อความสามารถในการแข่งขันของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ในระยะยาวได้



สานโอกาสทางการเงินอย่างลงตัว ตอบรับทุกความต้องการการลงทุน

เชื่อมโยงโอกาสให้ธุรกิจ
พร้อมตอบสนองความต้องการของผู้ลงทุน
พัฒนาสินค้าและบริการให้หลากหลาย
และยกระดับโครงสร้างพื้นฐาน
สร้างความสำเร็จในทุกๆ ด้านได้อย่างไม่หยุดยั้ง

พัฒนาการสำคัญของตลาดหลักทรัพย์ฯ ในปี 2555

ตลอดปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย มุ่งมั่นทำงานเชิงรุก เพื่อเพิ่มศักยภาพและยกระดับตลาดหลักทรัพย์ไทยในทุกด้านอย่างต่อเนื่อง โดยกำหนดวิสัยทัศน์ใหม่ ซึ่งมุ่งให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นองค์กรเศรษฐกิจที่ **“เพิ่มพลังให้ธุรกิจและผู้ลงทุนด้วยความโดดเด่นในการตอบสนองโอกาสทางการเงิน”** เตรียมพร้อมรับการแข่งขันกับระดับนานาชาติและภาค และการเชื่อมโยงในภูมิภาค นับเป็นการวางรากฐานที่แข็งแกร่ง และเพิ่มความสนใจให้ตลาดทุนไทยในสายตาของผู้ลงทุนจากทุกมุมโลก เพื่อเป้าหมายสำคัญคือ เป็นทางเลือกแรกของธุรกิจไทยใช้เป็นช่องทางระดมทุนเพื่อเพิ่มพลังแก่ธุรกิจ และเป็นทางเลือกหลักของการลงทุนสำหรับผู้มีเงินออม ด้วยสินค้าและบริการที่ตอบสนองความต้องการและสร้างโอกาสทางการเงินที่เหมาะสม

ปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนดกลยุทธ์หลักของการดำเนินงานของกลุ่มงานธุรกิจหลักทรัพย์ 5 ด้านสำคัญ ได้แก่ 1) การเพิ่มพลังแก่ธุรกิจ 2) การเพิ่มพลังแก่ผู้ลงทุน 3) การสร้างโอกาสทางการเงินที่เหมาะสม 4) การเพิ่มขีดความสามารถของตลาดหลักทรัพย์ฯ และ 5) การเสริมสร้างความแข็งแกร่งให้แก่สถาบันตัวกลาง ขณะที่การพัฒนาตลาดทุนระยะยาวนั้น ได้มุ่งเน้นการพัฒนาขีดความสามารถของผู้ร่วมตลาดในทุกกลุ่มอย่างต่อเนื่อง พร้อมไปกับการสร้างผู้ลงทุนคุณภาพ ซึ่งถือเป็นรากฐานที่สำคัญของตลาดทุนไทย

บทพิสูจน์การทำงานภายใต้กลยุทธ์สำคัญ ส่งผลให้ในปี 2555 เป็นปีที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ ประสบความสำเร็จอย่างสูงในหลายๆ ด้าน และนับเป็นปีแห่งการยกระดับตลาดหลักทรัพย์ฯ ในหลายมิติ ถึงแม้ว่าจะมีปัจจัยภายนอกที่ผันผวนสูงมาก จากปัญหาเศรษฐกิจของสหรัฐอเมริกา และยุโรป และส่งผลลบต่อบรรยากาศการลงทุนในตลาดหุ้นไทยก็ตาม โดยสะท้อนผ่านการสร้างสถิติสูงสุดทั้งมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยรายวันที่สูงเป็นอันดับหนึ่งของอาเซียนเป็นครั้งแรก มูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด ทำสถิติสูงสุดนับตั้งแต่ก่อตั้งตลาดหลักทรัพย์ฯ และเป็นครั้งแรกที่สูงกว่า GDP ของประเทศ ในขณะเดียวกันดัชนีตลาดหลักทรัพย์ฯ (SET index) ได้ปรับเพิ่มขึ้นสูงสุดในรอบ 17 ปี ที่ระดับ 1,397.19 จุด เมื่อวันที่ 27 ธันวาคม 2555 ซึ่งเพิ่มขึ้นมากที่สุดเมื่อเทียบกับภูมิภาค

ทั้งนี้ พัฒนาการสำคัญของตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้แก่ การปรับเปลี่ยนประสิทธิภาพระบบการซื้อขายหลักทรัพย์ใหม่ SET CONNECT ทำให้สามารถส่งคำสั่งซื้อขายได้อย่างรวดเร็ว รองรับปริมาณการซื้อขายที่เพิ่มมากขึ้น รวมถึงรองรับการซื้อขายสินค้ารูปแบบใหม่ๆ ในอนาคต พร้อมทั้งประสบความสำเร็จในการพัฒนาระบบการเชื่อมโยงกระดานซื้อขายหลักทรัพย์อาเซียน (ASEAN Trading Link) ระหว่างตลาดหลักทรัพย์ไทย มาเลเซีย และสิงคโปร์ และซื้อขายได้เมื่อกลางเดือนตุลาคม 2555 นับเป็นจุดเริ่มต้นการทำธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์อาเซียนที่สะดวก รวดเร็ว และสร้างความสนใจให้เกิดการลงทุนในภูมิภาคอาเซียนและไทยมากขึ้น

ในขณะเดียวกัน ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มุ่งขยายฐานผู้ลงทุนอย่างต่อเนื่อง ส่งผลให้ปี 2555 มีผู้ร่วมกิจกรรมด้านการตลาด domestic roadshow รวมกว่า 2 แสนคน ส่งผลให้จำนวนบัญชีลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพิ่มสูงเป็นประวัติการณ์กว่า 100,000 บัญชี และเป็นปีแรกที่มีมูลค่าซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านอินเทอร์เน็ตถึง 50.67% จากมูลค่าซื้อขายรวมทั้งตลาด

สำหรับการเพิ่มประสิทธิภาพและความน่าเชื่อถือภายในองค์กร ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ปรับปรุงคุณภาพงานตรวจสอบภายใน โดยมีการตรวจสอบแบบ continuous auditing โดยใช้ audit software เป็นเครื่องมือช่วยในการดำเนินการ ทั้งนี้ ผลจากการดำเนินงานด้วยความมุ่งมั่น ได้ส่งผลให้ได้รับการยกอันดับจากสถาบันระดับโลกในด้านต่างๆ ได้แก่ การยกระดับตลาดทุนไทย เข้าไปในกลุ่มตลาดเกิดใหม่ชั้นนำ (Advanced Emerging Market) โดยฟุตซี กรุ๊ป (FTSE Group) การยกอันดับด้านการกำกับดูแลกิจการของตลาดทุน CG Watch 2012 เป็นอันดับ 3 โดย Asia Corporate Governance Association ที่ประเมินจาก 11 ประเทศทั่วเอเชีย ขณะที่ MSCI ได้เพิ่มหลักทรัพย์ไทยในการคำนวณดัชนีของ MSCI Global Standard Indices ซึ่งเป็นการเพิ่มจำนวนหลักทรัพย์มากที่สุดในเอเชีย

กลุ่มงานธุรกิจตลาดหลักทรัพย์: 5 กลยุทธ์เพื่อสานโอกาสการลงทุนแก่ธุรกิจและผู้ลงทุน

1) การเพิ่มพลังแก่ธุรกิจ: Empowering business

ตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งทำงานเชิงรุกกับหน่วยงานพันธมิตรทั้งภาครัฐและเอกชน เพื่อเป็นแหล่งระดมทุนที่สำคัญของประเทศในการสนับสนุนโอกาสการเติบโตของกลุ่มธุรกิจต่างๆ ซึ่งเป็นรากฐานความแข็งแกร่งของระบบเศรษฐกิจไทย

ผลักดันบริษัทขนาดใหญ่และมีคุณภาพเข้าจดทะเบียน

ปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งเพิ่มจำนวนบริษัทจดทะเบียนขนาดใหญ่และคุณภาพสูง รวมทั้งการปรับปรุงเกณฑ์สำหรับสินค้าและธุรกรรมใหม่ๆ เพื่อผลักดันให้มีการจดทะเบียนหลักทรัพย์รูปแบบใหม่ ได้แก่ กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน (infrastructure fund) กองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (Real Estate Investment Trust: REIT) และ holding company ของไทยที่มีการลงทุนหลักอยู่ในต่างประเทศ

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ปรับปรุงหลักเกณฑ์การรับหลักทรัพย์เข้าจดทะเบียนให้มีความยืดหยุ่น และสอดคล้องกับสภาพแวดล้อมทางธุรกิจ และมีมาตรฐานเทียบเท่าตลาดหลักทรัพย์ในภูมิภาค ได้แก่ การออกเกณฑ์การเข้าจดทะเบียนของธุรกิจโรงไฟฟ้าพลังงานหมุนเวียน และการเข้าจดทะเบียนของบริษัท holding company ไทยที่มีการลงทุนในธุรกิจหลักในต่างประเทศ ซึ่งจะเป็นการสานโอกาสให้ธุรกิจไทยที่ลงทุนในต่างประเทศ สามารถระดมทุนจากตลาดทุนไทยเพื่อไปขยายกิจการให้เติบโตได้ รวมทั้งการออกเกณฑ์รองรับการเข้าจดทะเบียนของกิจการขนาดกลางที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดไม่ต่ำกว่า 5,000 ล้านบาท ด้วยเกณฑ์มูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (market capitalization) เป็นต้น นอกจากนี้ ยังส่งเสริมการควบรวมกิจการเพื่อสร้างความแข็งแกร่งให้ธุรกิจเป็นวาระสำคัญของประเทศ ควบคู่กับการส่งเสริมงานนักลงทุนสัมพันธ์ (Investor Relations) ของบริษัทจดทะเบียนในเชิงรุก เพื่อให้ผู้ลงทุนได้รับข้อมูลที่ครบถ้วน ทันต่อเหตุการณ์ ซึ่งจะส่งผลดีต่อความสามารถในการระดมทุนของบริษัทจดทะเบียน

ในปี 2555 มีบริษัทที่เสนอขายหลักทรัพย์ต่อประชาชนครั้งแรก (IPO) และเข้าจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ (SET) 8 บริษัท ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) 10 บริษัท กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ 6 กองทุน และการเข้าจดทะเบียนทางอ้อม (reverse takeover) 1 บริษัท สามารถเพิ่มขนาดของตลาดหลักทรัพย์ไทยได้ถึง 115,768 ล้านบาท ซึ่งเป็นมูลค่ามาร์เก็ตแคป ณ ราคา IPO ที่สูงสุดในรอบ 3 ปี นับตั้งแต่ปี 2553 ในขณะที่มูลค่าตามราคาตลาด ณ สิ้นปี 2555 เท่ากับ 186,026 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 60.69% จากมูลค่า ณ ราคา IPO

นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังให้ความสำคัญกับการสร้างความสัมพันธ์อันดีในระดับรัฐบาลและตลาดหลักทรัพย์ในประเทศเพื่อนบ้านอย่างต่อเนื่อง เพื่อเสริมสร้างความแข็งแกร่งของตลาดทุน โดยเฉพาะในกลุ่มประเทศอนุภูมิภาคแม่น้ำโขง (Greater Mekong Subregion) ที่มีการเติบโตทางเศรษฐกิจและความต้องการระดมทุนสูง ได้แก่ สาธารณรัฐประชาธิปไตยประชาชนลาว สาธารณรัฐสังคมนิยมเวียดนาม และสาธารณรัฐแห่งสหภาพเมียนมาร์ ซึ่งได้มีการลงนามความร่วมมือเพื่อสนับสนุนด้านความรู้เกี่ยวกับเกณฑ์และกฎหมายที่เกี่ยวข้อง เพื่อสนับสนุนการพัฒนาตลาดหลักทรัพย์ บุคลากรของตลาดหลักทรัพย์ ผู้ประกอบวิชาชีพในธุรกิจหลักทรัพย์ ผู้ลงทุนและผู้ร่วมตลาดอื่นๆ

ผลักดันให้บริษัทจดทะเบียนขนาดใหญ่ ขนาดกลางระดมทุนและใช้เครื่องมือทางการเงิน

ปี 2555 นับเป็นปีที่สะท้อนบทบาทสำคัญของตลาดหลักทรัพย์ฯ ในการมุ่งส่งเสริมธุรกิจที่มีศักยภาพให้สามารถระดมทุนด้วยราคาที่สะท้อนมูลค่าที่เหมาะสม (fair value) และใช้เครื่องมือทางการเงินเพื่อสร้างมูลค่าเพิ่มให้แก่กิจการ รวมถึงผลักดันการลดอุปสรรคและส่งเสริมให้เกิดการควบรวมกิจการ (Merger & Acquisition: M&A) เพื่อเสริมสร้างความแข็งแกร่งให้ธุรกิจ ส่งผลให้ปี 2555 มีมูลค่าระดมทุนในตลาดรองถึง 257,936 ล้านบาท สูงสุดในรอบ 10 ปีที่ผ่านมา และมีการใช้เครื่องมือทางการเงินในตลาดทุนถึง 116 เครื่องมือ สูงสุดในรอบ 5 ปีที่ผ่านมา

ทั้งนี้ เป็นผลจากการดำเนินงาน ทั้งการเข้าพบผู้บริหารเพื่อให้อำเภอนำรายบริษัท การร่วมมือกับชมรมวณิชชกิจ จัดโครงการ Financial Instruments for Directors (FID) โดยจัดสัมมนาให้ความรู้ต่อเนื่อง เพื่อกระตุ้นให้บริษัทตัดสินใจใช้เครื่องมือทางการเงินในตลาดทุนได้อย่างเหมาะสม รวมทั้งตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดทำและเผยแพร่เอกสาร M&A ทางเลือกสู่ความสำเร็จธุรกิจไทย และจัดสัมมนาเพื่อให้ความรู้และส่งเสริมบริษัทจดทะเบียนให้มีการควบรวมกิจการ และใช้ตลาดทุนในการขยายกิจการและสร้างโอกาสในการเติบโตได้อย่างก้าวกระโดด อีกทั้งสนับสนุนให้บริษัทจดทะเบียนสื่อสารข้อมูลกับผู้ลงทุนมากขึ้น เพื่อให้ผู้ลงทุนเข้าใจธุรกิจ กลยุทธ์ และแนวทางในการเติบโตของบริษัทจดทะเบียน ซึ่งเป็นปัจจัยสำคัญในการสะท้อนมูลค่าของบริษัท โดยจัดกิจกรรมบริษัทจดทะเบียนพบผู้ลงทุน (Opportunity Day) เป็นประจำทุกไตรมาส และพัฒนาแอปพลิเคชันในการเข้าชม Opportunity Day ผ่านอุปกรณ์สื่อสารที่ทันสมัย เพื่อตอบสนองไลฟ์สไตล์ของผู้ลงทุนที่ต้องการเข้าถึงข้อมูลของบริษัทจดทะเบียนได้อย่างสะดวกและรวดเร็ว นอกจากนี้ ยังได้จัดทำหนังสือ Stock Focus ที่รวบรวมข้อมูลหลักทรัพย์ที่น่าสนใจในช่วงเวลาต่างๆ เพื่อให้ผู้ลงทุนใช้ประกอบการตัดสินใจลงทุน

ทั้งนี้ เพื่อเป็นการยกย่องเชิดชูบริษัทจดทะเบียน และผู้ประกอบการในตลาดทุนที่มีความโดดเด่นในด้านต่างๆ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดพิธีมอบรางวัล SET Awards 2012 เป็นปีที่ 9 เพื่อสะท้อนความแข็งแกร่ง และความสำเร็จของภาคธุรกิจในตลาดทุนไทย โดยในปี 2555 นี้มีรางวัล SET Award of Honor 11 รางวัล สูงที่สุดตั้งแต่มีการมอบรางวัลประเภทนี้ในปี 2553 ซึ่งว่าบริษัทจดทะเบียนไทยพัฒนาอย่างจริงจังและต่อเนื่อง เพื่อรักษาความเป็นหนึ่งในด้านต่างๆ และให้คงความสามารถในการแข่งขันในระดับสากล



2) การเพิ่มพลังแก่ผู้ลงทุน: Empowering investors

ด้านการขยายฐานผู้ลงทุน ในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มุ่งเน้นไปยังกลุ่มผู้ลงทุนบุคคลรายใหม่ ที่เป็นผู้ออมในระบบธนาคาร ผู้เริ่มลงทุน คนรุ่นใหม่ และกลุ่มผู้นิยมออนไลน์ ด้วยแคมเปญและการบูรณาการสื่อสารครบวงจรตลอดปี 2555 ส่งผลให้จำนวนบัญชีนักลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในปี 2555 เพิ่มขึ้นเป็นประวัติการณ์กว่า 100,000 บัญชี นอกจากนี้ ยังมีการขยายฐานและเพิ่มการลงทุนของผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ อาทิ กองทุนรวม กองทุนส่วนบุคคล กองทุนสำรองเลี้ยงชีพ เป็นต้น และสำหรับผู้ลงทุนกลุ่มบริษัทหรือผู้ประกอบการ (corporate investor) ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ส่งเสริมให้ใช้สินค้าอนุพันธ์ เช่น oil futures และ currency futures เพื่อบริหารความเสี่ยงทางธุรกิจเพิ่มมากขึ้น

กิจกรรมการตลาด: โรดโชว์ให้ความรู้ทั้งกรุงเทพฯ และต่างจังหวัด

ตลอดปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำเนินกิจกรรมการตลาด เพื่อส่งเสริมให้ผู้ลงทุนและประชาชนทั่วไปสามารถเข้าถึงข้อมูลเพื่อการลงทุน การวางแผนลงทุน และผลิตภัณฑ์เพื่อการลงทุนใหม่ๆ อย่างต่อเนื่อง อาทิ งาน Invest Thailand Fair งานมหกรรมการลงทุน SET in the City ที่จัดขึ้นในกรุงเทพฯ และต่างจังหวัด ได้แก่ ภูเก็ต และอุดรธานี สำหรับการจัดงาน “มหกรรมการลงทุนแห่งปี SET in the City กรุงเทพมหานคร 2012” ต่อเนื่องเป็นปีที่ 8 ด้วยแนวคิด “Your Investment Vision : เปิดโลกการลงทุน ที่คุณเข้าถึงได้” เพื่อผู้ลงทุนและผู้มีเงินออมได้เข้าถึงข้อมูลผลิตภัณฑ์



และบริการทางการเงินการลงทุนที่ทันสมัยและครบวงจร นอกจากนี้ ยังได้ร่วมแสดงนิทรรศการส่งเสริมการลงทุนในงาน “มหกรรมการเงิน Money Expo” ภายใต้แนวคิด “SET Investor City@Money Expo” ทั้งในกรุงเทพฯ และต่างจังหวัด ได้แก่ นครราชสีมา สงขลา และเชียงใหม่ อีกทั้งได้พัฒนา mobile application “SET activity” เพื่อให้ผู้ลงทุนสามารถติดตามกิจกรรมการลงทุนที่น่าสนใจจากกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ตลอดทั้งปี ส่งผลให้ในปี 2555 มีผู้ร่วมกิจกรรมด้านการตลาด domestic roadshow รวมกว่า 200,000 คน และมีธุรกรรมการลงทุนรวมถึง 31,000 รายการ

ส่งเสริมการลงทุนออนไลน์: Online Investor Promotion

ปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ร่วมมือกับบริษัทหลักทรัพย์ ทั้ง 27 แห่ง ส่งเสริมการลงทุนออนไลน์ผ่านโครงการ “I’m Online Investor” เพื่อเผยแพร่ความรู้ผ่านสื่อและกิจกรรมการตลาด รวมทั้งพัฒนาแหล่งรวมความรู้เพื่อการลงทุนออนไลน์ผ่านเว็บไซต์ www.set.or.th/onlineinvestor พัฒนาเนื้อหาการลงทุน Trading Academy และคู่มือลงทุนหุ้น-อนุพันธ์ผ่านออนไลน์ ทั้งรูปแบบของ e-book และ CD-Rom รวมทั้งจัดสัมมนา internet trading workshop ประจำทุกไตรมาส

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดโครงการ Click2Win Live ต่อเนื่องเป็นปีที่ 7 โดยร่วมมือกับ 14 บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อส่งเสริมให้ผู้สนใจลงทุน ได้ทดลองซื้อขายออนไลน์ ก่อนลงทุนจริง โดยมีจำนวนผู้สมัครเข้าร่วมโครงการ ทั้งสิ้น 82,371 ราย ซึ่งเป็นปีที่มีผู้สมัครสูงสุดเป็นประวัติการณ์ นอกจากนี้ บริษัทหลักทรัพย์ที่เข้าร่วมโครงการ ยังได้นำโปรแกรม Click2Win Live ไปสาธิตเพื่อให้ความรู้ และจัดแข่งขันชิงรางวัลในกลุ่มลูกค้า รวม 49 leagues และมีผู้ทดลองลงทุนรวม 4,604 ราย



สำหรับการส่งเสริมการลงทุนออนไลน์ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ได้จัดกิจกรรม TFEX Online Investor Fair รวมพลคนเทรดออนไลน์ ซึ่งประสบความสำเร็จอย่างสูง มีผู้เข้าร่วมงานกว่า 6,000 คน โดยเป็นกลุ่มผู้ลงทุนใหม่กว่า 50% และมียอดรวมธุรกรรมการลงทุนรวม 2,577 บัญชี

ทั้งนี้ ณ สิ้นปี 2555 มีผู้เปิดบัญชีลงทุนออนไลน์ทั้งสิ้น 103,982 ราย เพิ่มขึ้น 43% จากปี 2554 และมียอดการซื้อขายผ่านออนไลน์ถึง 50.67% จากมูลค่าการซื้อขายรวมทั้งตลาด นับเป็นปีแรกที่มีมูลค่าซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านอินเทอร์เน็ตของผู้ลงทุนบุคคลสูงกว่า 50%



ขยายฐานผู้ลงทุนรายใหม่ผ่านเจ้าหน้าที่การตลาด

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ดำเนินโครงการ **SET Investment Consultant 2012** และ **TFEX Investment Consultant 2012** เพื่อขยายฐานผู้ลงทุนรายใหม่ โดยมีบริษัทหลักทรัพย์ร่วมโครงการ SET Investment Consultant Star 2012 รวม 20 แห่ง มีผู้แนะนำการลงทุน หรือเจ้าหน้าที่การตลาดร่วมโครงการกว่า 5,000 คน หรือ 80% ของเจ้าหน้าที่การตลาดทั้งระบบ ในขณะที่โครงการ TFEX Investment Consultant 2012 มีบริษัทหลักทรัพย์ และโบรกเกอร์ค้าทอง 19 แห่ง และมีผู้แนะนำการลงทุนร่วมโครงการกว่า 3,700 คน ซึ่งโครงการฯ ได้ออกแบบให้ครอบคลุมกิจกรรมทั้ง 2 ด้าน คือ การสร้างแรงจูงใจผ่านโปรแกรมรางวัลสำหรับผู้ที่สามารถขยายฐานผู้ลงทุน และมีคุณสมบัติเป็นบุคคลต้นแบบในด้านการพัฒนาความรู้ ทักษะการทำงาน จรรยาบรรณในวิชาชีพ และด้านการให้ความรู้ด้านวิชาชีพ การพัฒนาด้านการให้บริการ และคุณภาพของผู้แนะนำการลงทุน ซึ่งผู้แนะนำการลงทุนที่ได้คะแนนสูงสุดจะได้รับรางวัลการศึกษาดูงานด้านการเงินที่ประเทศสหรัฐอเมริกา และอังกฤษ

เจาะกลุ่มผู้ออม ผ่านธนาคารพาณิชย์

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ร่วมมือกับพันธมิตรสถาบันการเงิน 7 ธนาคารพาณิชย์ และ 7 บริษัทหลักทรัพย์ในเครือธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) และ ธนาคารธนาชาติ จำกัด (มหาชน) ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน) และธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) ดำเนินโครงการ Banker to Broker ต่อเนื่องเพื่อสร้างความรู้ความเข้าใจในการบริหารความมั่งคั่ง (wealth management) เชื่อมต่อให้ผู้ออมให้ลงทุนในหลักทรัพย์ พร้อมจัดอบรมให้ความรู้แก่เจ้าหน้าที่ธนาคารผู้ให้บริการ และผู้ลงทุนที่มีศักยภาพทั่วประเทศ และภายใต้โครงการดังกล่าว ยังมีโครงการ One for All ซึ่งมุ่งเน้นผู้ใช้บริการทางการเงินผ่านช่องทางอิเล็กทรอนิกส์ ซึ่งมีเพิ่มมากขึ้น โดยพัฒนาบริการลงทุนที่สะดวกรวดเร็ว เชื่อถือได้ผ่านหน้าจอบริการธนาคาร โดยพัฒนาระบบและเปิดให้บริการผ่านกลุ่มสถาบันการเงินทั้ง 5 แห่ง ได้แก่ ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน) ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) ส่งผลให้มีการเปิดบัญชีหลักทรัพย์ที่มาจากคำแนะนำของเจ้าหน้าที่ธนาคาร และจากบริการทางอินเทอร์เน็ตแบบคึกัก รวมกว่า 19,000 บัญชี เพิ่มขึ้นจากปีก่อน 50% โดยมีบัญชีที่มีการซื้อขาย 4,600 บัญชี คิดเป็น 24% จากบัญชีทั้งหมด

ขยายฐานผู้ลงทุนผ่านกองทุนรวม

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ร่วมมือกับสมาคมบริษัทจัดการลงทุนผ่าน “โครงการให้เงินทำงาน ผ่านกองทุนรวม” ส่งเสริมให้กลุ่มเป้าหมายคนรุ่นใหม่วัยทำงาน เริ่มลงทุนและวางแผนออมเงินระยะยาวในกองทุนรวมประเภทต่างๆ โดยเน้นการลงทุนอย่างมีวินัยสม่ำเสมอทุกเดือนตั้งแต่เริ่มต้นทำงานด้วยแนวคิด “ย้ายเงินฝากเป็นกองทุนรวม” โดยเผยแพร่บทความให้ความรู้ผ่านสื่อต่างๆ และจัดกิจกรรมในเขตกรุงเทพฯ ทั้งกลางเมืองและชานเมือง เพื่อให้ผู้ลงทุนมีโอกาสเข้าถึงแหล่งข้อมูลโดยตรง รวมทั้งจัดเสวนาให้ความรู้จากผู้จัดการกองทุนต่างๆ กว่า 20 ครั้ง ส่งผลให้ตลอดปี 2555 มีมูลค่าเงินลงทุนในกองทุนรวมผ่านกิจกรรมส่งเสริมต่างๆ กว่า 6,000 ล้านบาท



3) การสร้างโอกาสทางการเงินที่เหมาะสม: Matching the right financial opportunities

ตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งเพิ่มสินค้าและบริการใหม่ๆ รวมถึงเพิ่มสภาพคล่องให้แก่สินค้าทั้งในตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พร้อมทั้งขยายธุรกิจบริการหลังการขายให้ครบวงจร เพื่อตอบสนองความต้องการให้แก่ธุรกิจและผู้ลงทุนอย่างเหมาะสม และเพื่อเป็นทางเลือกที่ตอบโจทย์ลูกค้ากลุ่มใหม่ๆ ภายใต้สภาพแวดล้อม และแนวโน้มการลงทุนของเศรษฐกิจโลก

เพิ่มสินค้าและผลิตภัณฑ์ใหม่ๆ

• ตราสารทุน

ปี 2555 การลงทุนในกองทุนรวมอีทีเอฟ (Exchange Traded Fund: ETF) ยังคงเติบโตและได้รับความนิยมจากผู้ลงทุนอย่างต่อเนื่อง โดยในปี 2555 มี ETF จำนวน 3 กองทุน เข้าจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ ประกอบด้วย กองทุนเปิดธนาชาติอีทีเอฟทองคำแท่ง (TGOLDETF) ลงทุนในทองคำแท่งความบริสุทธิ์ไม่น้อยกว่า 99.5% อ้างอิงผลตอบแทนของราคาทองคำ London Gold A.M. Fixing กองทุนเปิดเคแทม ฮั่งกง อีทีเอฟ แทร็กเกอร์ (HK) ลงทุนในหน่วยของกองทุน Tracker Fund of Hong Kong อ้างอิงผลตอบแทนของดัชนีฮั่งเส็ง ผ่านกองทุน Tracker Fund of Hong Kong ในรูปสกุลเงินบาท และกองทุนเปิด KTAM SET Banking ETF Tracker (EBANK) ลงทุนในหุ้นหมวดธุรกิจธนาคาร อ้างอิงผลตอบแทนของดัชนี SET Banking Sector index

ณ สิ้นปี 2555 กองทุนรวม ETF ซื้อขายรวม 11 กองทุน มีมูลค่าทรัพย์สินภายใต้การบริหารรวม 8,425 ล้านบาท เพิ่มขึ้นถึง 49% จากปี 2554

สำหรับใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (derivative warrants: DW) นั้น มีจำนวน DW ใหม่จดทะเบียนในปี 2555 รวม 601 หลักทรัพย์ เพิ่มขึ้นจากปี 2554 ถึง 71% โดยมีจำนวน DW ที่หมดอายุระหว่างปีรวม 42 หลักทรัพย์ ณ สิ้นปี จึงมีจำนวน DW คงเหลือ 345 หลักทรัพย์ และมีจำนวนผู้ออกหลักทรัพย์เพิ่มขึ้น 2 ราย รวมเป็น 9 ราย



• สัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ในปี 2555 ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (TFEX) มีการเติบโตและพัฒนาการในหลายด้าน โดยปริมาณการซื้อขายเพิ่มขึ้นเป็น 10,457,928 สัญญา เฉลี่ย 43,823 สัญญาต่อวัน เพิ่มขึ้นจากปีก่อน 6.5% และมีจำนวนสถานะคงค้าง ทั้งสิ้น 238,981 สัญญา เพิ่มขึ้นจากปี 2554 ถึง 323% ทั้งนี้ ณ สิ้นปี 2555 มีจำนวนบัญชีซื้อขายรวม 80,893 บัญชี เพิ่มขึ้น 28.6% จากปี 2554

ปี 2555 TFEX ได้เพิ่มความหลากหลายของสินค้าเพื่อเป็นเครื่องมือบริหารความเสี่ยงอย่างมีประสิทธิภาพ และสร้างผลตอบแทนแก่ผู้ประกอบการและผู้ลงทุน โดยเริ่มซื้อขายสินค้าใหม่ คือ

1) สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกี่ยวข้องกับเงินดอลลาร์สหรัฐ หรือ ดอลลาร์ล่วงหน้า (USD Futures) ซื้อขายวันแรกเมื่อ 5 มิถุนายน 2555 ซึ่งได้รับการตอบรับจากผู้ลงทุนเกินคาดด้วยวอลุ่มสูงกว่า 3,429 สัญญา การเปิดซื้อขายดอลลาร์ล่วงหน้านับเป็นครั้งแรกของประเทศไทย ที่อนุญาตให้มีการซื้อขายอัตราแลกเปลี่ยนล่วงหน้าได้โดยไม่ต้องคำนึงถึงธุรกรรมอ้างอิง ซึ่งกระทรวงการคลัง ธนาคารแห่งประเทศไทย และสำนักงาน ก.ล.ต. เห็นความจำเป็นและความสำคัญในการเปิดโอกาสให้ผู้ลงทุนและผู้ประกอบการ มีเครื่องมือในการบริหารจัดการกับอัตราแลกเปลี่ยนได้อย่างเสรีมากขึ้น ซึ่งจะเป็นประโยชน์ในระยะยาวต่อประเทศไทยเพื่อรองรับนโยบายการเปิดเสรีทั้งภาคการเงินและภาคอุตสาหกรรมที่มากขึ้น



2) สัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกี่ยวข้องกับดัชนีหมวดธุรกิจของตลาดหลักทรัพย์ (Sector Index Futures) เริ่มซื้อขายครั้งแรกเมื่อ 29 ตุลาคม 2555 โดยมีสัญญาที่เกี่ยวข้องกับ 5 หมวดธุรกิจ ได้แก่ หมวดธนาคาร (BANK) เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร (ICT) พลังงาน (ENERG) อาหารและเครื่องดื่ม (FOOD) และพาณิชย์ (COMM) ซึ่งหมวดธุรกิจเหล่านี้เป็นหมวดธุรกิจอันดับต้นๆ ที่ได้รับความสนใจจากผู้ลงทุนอย่างต่อเนื่อง โดยการเคลื่อนไหวของดัชนีของแต่ละหมวดธุรกิจ เป็นไปตามกลุ่มของหลักทรัพย์ที่มีอยู่ภายใต้หมวดธุรกิจนั้นๆ

นอกจากนี้ ยังได้ปรับปรุงสินค้าปัจจุบัน ซึ่งเป็นผลดีต่อสภาพคล่องการซื้อขาย คือ SET50 Index Futures โดยเพิ่มสัญญารายเดือนระยะสั้นอีก 2 อายุสัญญา จากเดิมที่มีเพียงสัญญารายไตรมาส ทำให้ SET50 Futures จะมีทั้งสิ้น 6 อายุ คือ 1 เดือน 2 เดือน 3 เดือน และอีก 3 ไตรมาส ซึ่งสัญญา SET50 Futures รูปแบบใหม่นี้ จะสามารถตอบรับกับความผันผวนของดัชนีหลักทรัพย์ที่มักเกิดขึ้นในระยะสั้นได้ดียิ่งขึ้น และ Single Stock Futures (SSF) นั้น ได้ขยายขอบเขตหุ้นอ้างอิงให้ครอบคลุมหุ้นที่อยู่ใน SET100 และปรับ position limit ของ SSF เป็นรายหุ้นอ้างอิงเพื่อให้เหมาะสมมากยิ่งขึ้น โดยกำหนด position limit ให้แปรผันตามปริมาณหุ้นที่ออกจำหน่ายแล้วของหุ้นที่นำมาใช้อ้างอิง ทำให้ position limit ที่แต่ละลูกค้าสามารถถือครองได้เปลี่ยนจากอัตราที่เท่ากันที่ 20,000 สัญญาสำหรับทุกๆ หุ้นอ้างอิง เป็นจำนวนสัญญาที่ผันแปรไปตามขนาดของหุ้นอ้างอิงนั้นๆ ระหว่าง 20,000-435,500 สัญญา ผู้ลงทุนจึงสามารถใช้ Stock Futures บริหารพอร์ตลงทุนได้มีประสิทธิภาพมากขึ้น

ปี 2555 ตลาด TFEX ได้เปิดรับสมาชิกประเภทตัวแทนทั่วไป (full license member) เพิ่มขึ้นรวมเป็น 40 ราย ซึ่งมีโบรกเกอร์ทองคำ 5 ราย ได้เปลี่ยนสถานะสมาชิก (upgrade) จากสมาชิกประเภทตัวแทนที่จำกัดเฉพาะประเภทสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เกี่ยวข้องกับโลหะมีค่าเป็นสมาชิกประเภทตัวแทนทั่วไป

เพิ่มฐานผู้ลงทุนสถาบันต่างประเทศ: เพิ่มสภาพคล่องตลาดหุ้นไทย

ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีภารกิจสำคัญในการส่งเสริมให้บริษัทจดทะเบียน มีช่องทางเผยแพร่ข้อมูลเพื่อสะท้อนมูลค่าของบริษัทจดทะเบียน และภาพรวมเศรษฐกิจของประเทศ นับเป็นอีกหนึ่งกลยุทธ์เพื่อตอบสนองความต้องการของผู้ลงทุนในต่างประเทศ ที่จะมีโอกาสลงทุนในตลาดหุ้นไทย

• เพิ่มโอกาสทางธุรกิจให้บริษัทจดทะเบียน สร้างความน่าสนใจให้ตลาดหุ้นไทย

ในไตรมาส 3 ปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดงาน **Thailand Focus 2012** ต่อเนื่องเป็นครั้งที่ 6 ร่วมกับบริษัทหลักทรัพย์ ภัทร จำกัด (มหาชน) และธนาคารแห่งสหรัฐอเมริกาเมอร์ริลลีนช์ (Bank of America Merrill Lynch) ภายใต้แนวคิด **Thailand Focus 2012: Positioning Thailand for the Next Growth Phase** โดยเน้นมุมมอง 2 ด้านหลัก คือ ด้าน Next Growth Phase ซึ่งจะเป็นโอกาสสำคัญของบริษัทจดทะเบียนในอนาคต สืบเนื่องจากภาวะที่เศรษฐกิจในภูมิภาคอื่นมีความไม่แน่นอนสูง ส่งผลให้ตลาดเอเชียได้รับการจับตามองมากขึ้น โดยเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ไทยที่โดดเด่นทั้งด้านสภาพคล่องและบริษัทจดทะเบียน ขณะที่นโยบายสำคัญของภาครัฐ โดยเฉพาะการพัฒนาโครงสร้างพื้นฐาน จะช่วยยกระดับเศรษฐกิจและความสามารถในการทำกำไรของบริษัทจดทะเบียนไทยได้เป็นอย่างดี และอีกด้านหนึ่ง คือ ด้าน positioning หรือที่ตั้งของประเทศไทยที่อยู่ศูนย์กลางภูมิภาคอาเซียนและอินโดจีนที่มีอัตราการขยายตัวสูง โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ จะทำหน้าที่เป็นแหล่งระดมทุนสำหรับบริษัทจดทะเบียนไทยในการขยายธุรกิจภูมิภาค **ซึ่งมีผู้ร่วมงานจากทั่วโลกมากที่สุดเป็นประวัติการณ์ และเป็นครั้งแรกที่เชื่อมโยงตลาดทุนอินโดจีนเข้าด้วยกัน** โดยเชิญตลาดหลักทรัพย์อินโดจีน 4 แห่ง และบริษัทจดทะเบียนในภูมิภาคอินโดจีนเข้าร่วมงาน และมีผู้ลงทุนสถาบันต่างประเทศร่วมงาน 122 ราย บริษัทจดทะเบียนไทย 89 แห่ง โดยมีการประชุมถึง 1,065 ครั้ง



• โรดโชว์ดึงดูดผู้ลงทุนกลุ่มประเทศศูนย์กลางการลงทุนหลักของโลก และเจาะกลุ่มผู้ลงทุนกลุ่มใหม่

ตลอดปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งทำงานเชิงรุกร่วมกับหน่วยงานจากภาครัฐและเอกชน เพื่อขยายฐานผู้ลงทุนต่างประเทศ และส่งเสริมการเพิ่มน้ำหนักการลงทุนของสถาบันการลงทุนต่างประเทศในตลาดหุ้นไทย โดยจัดกิจกรรมโรดโชว์ต่างประเทศรวม 6 ครั้ง พร้อมนำบริษัทจดทะเบียนในกลุ่มธุรกิจที่อยู่ในความสนใจเข้าพบผู้ลงทุนสถาบัน รวมถึงกองทุนเพื่อความมั่งคั่งของประเทศ (sovereign wealth fund) และหน่วยงานกำกับดูแลของประเทศที่เป็นศูนย์กลางทางการเงินของโลก ได้แก่ สิงคโปร์ ฮองกง มาเลเซีย สหรัฐอเมริกา สหราชอาณาจักร ญี่ปุ่น แคนาดา และประเทศที่เป็นกลุ่มเป้าหมายใหม่ อาทิ สาธารณรัฐประชาชนจีน ออสเตรเลีย อินเดีย และประเทศในตะวันออกกลาง เพื่อเน้นการเสนอข้อมูลเกี่ยวกับสถานะเศรษฐกิจและพัฒนาการของตลาดหลักทรัพย์ฯ ตอกย้ำความน่าสนใจของตลาดหุ้นไทยแก่กลุ่มประเทศที่ลงทุนในตลาดหุ้นไทยอยู่แล้ว และนำเสนอไทยเป็นทางเลือกการลงทุนแก่ผู้ลงทุนสถาบันกลุ่มใหม่ๆ โดยผู้ลงทุนให้ความสนใจข้อมูลภาพรวมเศรษฐกิจไทยที่ฟื้นตัวอย่างรวดเร็วหลังอุทกภัยเมื่อปลายปี 2554 และบริษัทจดทะเบียนที่แข็งแกร่ง สะท้อนจากผลประกอบการที่ดีต่อเนื่อง ประกอบกับแนวโน้มการเติบโตทางเศรษฐกิจจากการเชื่อมโยงภายในภูมิภาคที่กำลังจะเกิดขึ้น โดยตลอดทั้งปี มีบริษัทจดทะเบียนเข้าร่วมโรดโชว์เพื่อนำเสนอข้อมูล 27 บริษัท และมีผู้ลงทุนสถาบันต่างประเทศเข้าร่วมรับฟังข้อมูลกว่า 500 ราย

- **ความร่วมมือของตลาดหลักทรัพย์ในภูมิภาคอาเซียน (ASEAN Exchanges) สร้าง asset class ที่ยอมรับจากผู้ลงทุนทั่วโลก**

เมื่อ 15 ตุลาคม 2555 ตลาดหลักทรัพย์ไทยได้ประกาศเชื่อมโยงระบบซื้อขายหลักทรัพย์อาเซียน (ASEAN Trading Link) กับมาเลเซีย และสิงคโปร์ เพื่อดึงดูดผู้ลงทุนทั่วโลก ซึ่งตลาดหลักทรัพย์ทั้ง 3 แห่งมีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดรวมกว่า 1.4 ล้านเหรียญสหรัฐหรือ 70% ของมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดรวมของประเทศอาเซียนทั้ง 7 แห่ง ด้วยจำนวนหลักทรัพย์รวม 2,200 หลักทรัพย์ การพัฒนาระบบ ASEAN Trading Link นับเป็นจุดเริ่มต้นการทำธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์อาเซียนที่สะดวก รวดเร็ว และส่งเสริมให้เกิดการลงทุนในภูมิภาคอาเซียน รวมทั้งไทยมากขึ้น โดยเฉพาะการลงทุนผ่านบริษัทหลักทรัพย์ท้องถิ่นที่มีฐานธุรกิจเฉพาะภายในประเทศ โดยเบื้องต้นมีบริษัทหลักทรัพย์ที่เข้าร่วมโครงการ 9 แห่ง และเพิ่มเป็น 16 แห่ง ในต้นปี 2556



ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ดำเนินกิจกรรมต่างๆ เพื่อสนับสนุนการลงทุนในตลาดหลักทรัพย์อาเซียน อาทิ ประสานกับกรมสรรพากรเพื่อปรับแก้กฎหมายว่าด้วยการยกเว้นภาษีกำไรจากการซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศ เพื่อลดอุปสรรคสำหรับนักลงทุนที่ขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ ASEAN Trading link สร้างความร่วมมือระหว่างตลาดหลักทรัพย์อาเซียน โดยจัดกิจกรรมให้ความรู้ความเข้าใจเกี่ยวกับโครงการ โดยเฉพาะข้อมูลเกี่ยวกับหลักทรัพย์อาเซียนให้แก่ผู้ลงทุน เพื่อกระตุ้นและส่งเสริมให้ตลาดทุนอาเซียนและหลักทรัพย์อาเซียนเป็น asset class ที่ได้รับการยอมรับในสายตาผู้ลงทุนทั่วโลก โดยจะจัดงานโรดโชว์ Invest ASEAN 2013 อย่างต่อเนื่อง นอกจากนี้ ยังได้ร่วมพัฒนาเว็บไซต์ www.aseanexchanges.org เพื่อเตรียมเป็นศูนย์รวมข้อมูลตลาดทุนอาเซียน ทำให้ผู้ลงทุนสามารถเข้าถึงข้อมูลตลาดหลักทรัพย์อาเซียนและหลักทรัพย์อาเซียนได้สะดวกและง่ายยิ่งขึ้น

มุ่งขยายธุรกิจบริการหลังการขายให้ครบวงจร เน้นรวดเร็ว ลดต้นทุน



ตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยบริษัทศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด มุ่งเน้นการพัฒนาและปรับปรุงแนวทางการปฏิบัติงานบริการหลังการขายเพื่อให้ง่ายและสะดวกแก่ผู้ปฏิบัติงานช่วยลดภาระและความเสี่ยงในการปฏิบัติงาน และเดินหน้าแผนงานขยายธุรกิจบริการหลังการขายให้ครบวงจร เพื่อเพิ่มขีดความสามารถการบริการ และตอบสนองความต้องการของสมาชิก รองรับการขายและธุรกรรมทางการเงินใหม่ๆ ของตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่จะเกิดขึ้นในอนาคต และพร้อมรับการเชื่อมโยงการซื้อขายจากทั่วโลก

- **การเปิดรับสมาชิกสำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเภทสมาชิกสามัญ**

จากการเปิดรับสมัครสมาชิกสำนักหักบัญชีสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ประเภทสมาชิกสามัญ (general clearing member) ในปี 2555 ซึ่งสามารถทำการชำระหนี้ได้ทุกสินค้า มีสมาชิกเดิมที่ทำการชำระหนี้เฉพาะสินค้าโลหะมีค่าได้เท่านั้น สมัครเข้าเป็นสมาชิกสามัญ 5 ราย ณ สิ้นปี 2555 บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด มีสมาชิกสามัญที่ให้บริการชำระหนี้สัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้ทุกสินค้า รวม 41 ราย จากเดิม 36 ราย

• การพัฒนางานบริการสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์: *Third Party Clearing*

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้ความสำคัญกับการพัฒนางานบริการสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ในด้านการเพิ่มขีดความสามารถของสมาชิกสำนักหักบัญชีปัจจุบัน ให้สามารถชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์แทนบริษัทหลักทรัพย์อื่นได้ หรือที่เรียกว่างานบริการ **Third Party Clearing (TPC)**

ในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้พัฒนางานบริการ TPC เพื่อรองรับการโอนภาระผูกพันงานชำระราคาหลักทรัพย์ระหว่างบริษัทหลักทรัพย์ (Give-up/Take-up) ซึ่งเป็นการเพิ่มทางเลือกให้แก่ผู้ลงทุนหรือบริษัทหลักทรัพย์ที่ไม่ได้เป็นสมาชิกของสำนักหักบัญชี ในการมอบหมายงานชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ให้แก่สมาชิกสำนักหักบัญชีได้มากกว่า 1 ราย ซึ่งจะช่วยลดความเสี่ยงด้านการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ โดยไม่จำเป็นต้องจำกัดงานดังกล่าวไว้ที่สมาชิกสำนักหักบัญชีเพียงรายใดรายหนึ่ง อีกทั้งยังเป็นการเพิ่มทางเลือกให้กับผู้ลงทุนที่เปิดบัญชีซื้อขายหลักทรัพย์กับบริษัทหลักทรัพย์มากกว่า 1 ราย สามารถรวมศูนย์การทำ clearing & settlement ไว้กับบริษัทหลักทรัพย์เพียงรายใดรายหนึ่งได้ โดยระบบงานนี้พร้อมใช้งานตั้งแต่เดือนตุลาคม 2555 เป็นต้นมา และในปี 2556 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังมีแผนพัฒนางานบริการ TPC อย่างต่อเนื่อง โดยจะพิจารณาปรับปรุงกฎเกณฑ์และระบบงานที่เกี่ยวข้องเพื่อเปิดโอกาสให้ธนาคารพาณิชย์สามารถให้บริการ TPC ได้เช่นเดียวกัน

• การรับฝากหลักทรัพย์สกุลเงินต่างประเทศ

ในปี 2555 ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ฯ ได้ขยายขอบเขตงานบริการหลังการซื้อขายให้ครอบคลุมถึงหลักทรัพย์สกุลเงินต่างประเทศ หลักทรัพย์ที่จะเปิดรับฝากในระยะแรกคือ ตราสารหนี้สกุลเงินต่างประเทศ ที่มีนายทะเบียนอยู่ในประเทศไทย โดยสมาชิกสามารถทำธุรกรรมต่างๆ เช่น การฝาก ถอน โอน การใช้หลักทรัพย์เป็นประกัน และการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่ซื้อขายนอกตลาดสำหรับหลักทรัพย์ประเภทดังกล่าว (OTC clearing & settlement) ผ่านระบบงานบริการหลังการซื้อขายได้ เพื่อลดต้นทุนการออกและถือเป็นใบหลักทรัพย์ เพิ่มความคล่องตัวในการประกอบธุรกรรมงานรับฝากหลักทรัพย์ ตลอดจนเพื่อสนับสนุนและเพิ่มสภาพคล่องสำหรับธุรกรรมการซื้อขายข้ามตลาด (cross-border transaction) ที่มีขึ้นในอนาคต โดยได้เปิดให้บริการสำหรับระยะแรกตั้งแต่วันที่ 1 กันยายน 2555

• ขยายขอบเขตการให้บริการธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์: *securities borrowing and lending*

ในปี 2555 บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด ได้รับอนุญาตจากสำนักงาน ก.ล.ต. ให้ขยายขอบเขตการให้บริการเกี่ยวกับธุรกรรมการยืมและให้ยืมหลักทรัพย์ (securities borrowing and lending : SBL) จากเดิม ให้บริการในฐานะนายหน้า (agent) เพิ่มเติมเป็นให้บริการได้ทั้งในฐานะนายหน้า (agent) และคู่สัญญา (principal) โดยศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ฯ จะจัดให้มีกระดานแสดงหลักทรัพย์ที่มีไว้เพื่อการให้ยืม (lending pool board) และจะเข้าเป็นคู่สัญญากับผู้ยืมและผู้ให้ยืมทันทีที่มีการจับคู่ในระยะแรก โดยจะให้บริการยืม และให้ยืมหลักทรัพย์สำหรับหลักทรัพย์ในกลุ่ม SET50 ก่อน โดยศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ฯ จะเป็นผู้ดูแลรักษาและบริหารหลักประกัน พร้อมทั้งจ่ายผลประโยชน์ที่ได้จากการบริหารหลักประกันให้แก่ผู้ใช้บริการด้วย โดยจะเริ่มให้บริการได้ในปี 2556

• พัฒนาการเผยแพร่ข่าวการจ่ายสิทธิประโยชน์ของบริษัทจดทะเบียนในรูปแบบ *SWIFT message*

ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ฯ ได้พัฒนากระบวนการเผยแพร่ข่าวการจ่ายสิทธิประโยชน์ของบริษัทจดทะเบียน หรือ corporate action news ให้กับสมาชิกในกลุ่มคัสโตเดียน ในรูปแบบ **SWIFT message** เพื่อให้การเผยแพร่ข่าวการจ่ายสิทธิประโยชน์เป็นไปอย่างถูกต้อง รวดเร็ว และทันต่อเวลา ลดความเสี่ยงและข้อผิดพลาดที่อาจเกิดจากความจำเป็นในการบันทึกข้อมูลข่าวสาร (human error) เมื่อปี 2554 และในปี 2555 ได้ขยายการให้บริการให้ครอบคลุมไปยังสมาชิกศูนย์รับฝากหลักทรัพย์กลุ่มอื่นๆ มากยิ่งขึ้น โดยมุ่งเน้นสมาชิกศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ฯ

ที่ไม่ได้เป็นสมาชิกในเครือข่าย SWIFT network ให้สามารถรับข่าวสารการจ่ายสิทธิประโยชน์ในลักษณะ real time ในรูปแบบข้อมูลที่เป็นมาตรฐานได้เช่นเดียวกับสมาชิกกลุ่มคัสโตเดียน โดยพร้อมให้สมาชิกที่สนใจใช้บริการทดสอบได้ตั้งแต่ปี 2556

- **การแต่งตั้งตัวแทนผู้รับฝากทรัพย์สิน: global custodian เพื่อถือครองหลักทรัพย์ต่างประเทศแทนนักลงทุน**

สืบเนื่องจากแผนงานการสรรหาและแต่งตั้งตัวแทนผู้รับฝากทรัพย์สิน (global custodian) เพื่อเป็นตัวแทนศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ในการเก็บรักษาหลักทรัพย์และถือครองหลักทรัพย์ต่างประเทศแทนผู้ลงทุน โดยครอบคลุมตลาดการเงินหลักทั่วโลก ได้แก่ อเมริกา ยุโรป ออสเตรเลีย และเอเชีย รวมทั้งสิ้น 27 ประเทศ ซึ่งการพัฒนาดังกล่าวนับเป็นจุดเริ่มต้นในการสร้างเครือข่ายการเชื่อมโยงงานส่งมอบและชำระราคา (clearing & settlement) กับตลาดต่างประเทศและสามารถรองรับธุรกรรมของสมาชิกศูนย์รับฝากที่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ต่างประเทศในปัจจุบัน รวมถึงรองรับธุรกรรมทางการเงินใหม่ๆ ของตลาดหลักทรัพย์ ที่จะเกิดขึ้นในอนาคต เช่น หลักทรัพย์ประเภท dual listing หรือการเปิดรับฝากหลักทรัพย์สกุลเงินตราต่างประเทศ เป็นต้น

ทั้งนี้ การดำเนินการตามโครงการนี้เป็นการวางโครงสร้างพื้นฐาน (infrastructure) โดยมุ่งเน้นเป็นทางเลือกในการดำเนินธุรกิจลักษณะรวมศูนย์เพื่อช่วยให้สมาชิกมีต้นทุนการดำเนินการต่ำและมีประสิทธิภาพ ซึ่งจะเป็นผลดีต่อ ผู้ลงทุนไทยในระยะยาว โดยในปี 2555 ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ได้จัดจ้างตัวแทนผู้รับฝากทรัพย์สิน (global custodian) ซึ่งพร้อมให้บริการในปี 2556

4) การเพิ่มขีดความสามารถของตลาดหลักทรัพย์: Strengthening SET's capabilities

ตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งมั่นสู่การเป็นตลาดหลักทรัพย์ที่มีระบบการดำเนินงานที่มีประสิทธิภาพสูงเทียบเคียงได้กับตลาดหลักทรัพย์ชั้นนำของโลก และพร้อมรับการเปลี่ยนแปลงสู่ประชาคมอาเซียนในปี 2558 โดยมีแผนงานที่สำคัญ 4 ด้าน คือ 1) การพัฒนาระบบเทคโนโลยีอย่างต่อเนื่อง 2) การพัฒนากระบวนการด้านการปฏิบัติการ (operation) ให้มีคุณภาพสูง ประสิทธิภาพสูง ความผิดพลาดต่ำ ต้นทุนต่ำ และรองรับธุรกรรมข้ามประเทศเพื่อเชื่อมโยงกับตลาดทุนต่างประเทศ โดยจัดทำแผนแม่บทด้านปฏิบัติการ มุ่งทำให้ทุกกระบวนการเป็น straight through processing (STP) 3) การเพิ่มประสิทธิภาพกระบวนการบริหารความเสี่ยงขององค์กร (enterprise risk management) และสำนักกักบัญชีหลักทรัพย์ และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และ 4) การปรับปรุงกฎเกณฑ์และกระบวนการด้านกำกับดูแล ให้เกิดสมดุลระหว่างการกำกับดูแลตลาดกับโอกาสทางธุรกิจ

เพิ่มขีดความสามารถระบบไอที ขับเคลื่อนธุรกิจด้วยเทคโนโลยีทันสมัยระดับมาตรฐานสากล

ตลาดหลักทรัพย์ฯ บริหารงานระบบเทคโนโลยีสารสนเทศตาม “แผนแม่บทเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร” (IT Master Plan) ตามกรอบเวลาดำเนินงาน 5 ปี (ปี 2553-ปี 2557) ซึ่งเป็นแผนงานสำคัญสำหรับโครงสร้างพื้นฐานของระบบซื้อขายและระบบบริการหลังการขาย โดยจัดหาระบบงานที่ได้ระดับมาตรฐานสากล พร้อมด้วยเทคโนโลยีที่ทันสมัย รวดเร็ว ปลอดภัย รองรับการทำงานเชื่อมต่อธุรกรรมระหว่างประเทศและการขยายตัวทางธุรกิจที่มีแนวโน้มสูงขึ้น และยึดถือแนวทางการใช้เทคโนโลยีสารสนเทศให้เกิดประโยชน์สูงสุดด้วยการบริหารจัดการและควบคุมดูแลตามมาตรฐานสากล (IT governance) เพื่อสร้างความน่าเชื่อถือให้กับอุตสาหกรรมตลาดทุนโดยรวม

นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังมุ่งยกระดับการปฏิบัติงานของพนักงานด้าน IT ให้เป็นตามมาตรฐานสากลในระดับ Global Best Practice ทั้งมาตรฐานด้านความปลอดภัยของข้อมูล (ISO 27001) ซึ่งจะช่วยป้องกันระบบข้อมูลสารสนเทศซึ่งมีความสำคัญอย่างยิ่ง ลดความเสี่ยงต่อภัยคุกคามต่างๆ ช่วยให้อุปการะดำเนินไปอย่างต่อเนื่อง และมาตรฐานด้านการบริหารบริการ IT (ISO 20000) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพและปรับปรุงการให้บริการ ลดต้นทุนในการดำเนินงาน และสร้างความพึงพอใจให้กับลูกค้าเพิ่มขึ้น โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ ใช้แนวทางการปฏิบัติงานตามหลักธรรมาภิบาลทางด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ (IT governance) ตามมาตรฐานสากล ทั้งการพัฒนา application การให้บริการ

ระบบงาน **การกำหนด IT Security Policy ในองค์กร** และมีกระบวนการทบทวนและปรับปรุงระบบการทำงานให้เกิดความสมดุลระหว่างการควบคุมและความยืดหยุ่นในการปฏิบัติงาน

- **SET CONNECT: ระบบซื้อขายใหม่ประสิทธิภาพเทียบเท่าตลาดหลักทรัพย์ชั้นนำของโลก**

เมื่อวันที่ 3 กันยายน 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เริ่มใช้ระบบการซื้อขายหลักทรัพย์ใหม่ **“SET CONNECT”** ด้วยความร่วมมือจากบริษัทหลักทรัพย์ และทุกฝ่ายที่เกี่ยวข้องตลอด 14 เดือนในการทดสอบระบบอย่างละเอียดเสมือนจริง โดยมีเจ้าหน้าที่การตลาดของบริษัทหลักทรัพย์กว่า 5,000 คน เข้าร่วมทดสอบส่งคำสั่งซื้อขายจากสำนักงานใหญ่ และสาขารวมกว่า 300 สาขา **“SET CONNECT”** จึงเป็นระบบที่มีประสิทธิภาพเทียบเท่าตลาดหลักทรัพย์ชั้นนำของโลก มีเสถียรภาพ ความปลอดภัย สามารถรองรับปริมาณการซื้อขายได้เพิ่มขึ้นกว่าเดิมมาก รวมทั้งผลิตภัณฑ์ทางการเงินรูปแบบใหม่ๆ ตอบสนองความต้องการของนักลงทุนทั้งจากในประเทศและต่างประเทศ ได้อย่างรวดเร็ว นับเป็นการยกระดับตลาดทุนไทยและเชื่อมโยงกับตลาดหุ้นสากล ที่ผ่านมาระบบสามารถทำงานได้อย่างราบรื่นและเต็มประสิทธิภาพ และจะเดินหน้าพัฒนาอย่างต่อเนื่องเพื่อให้รองรับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในระบบงานเดียวกัน



- **พัฒนาระบบชำระราคา: clearing system เพื่อรองรับธุรกิจของตลาดหลักทรัพย์ฯ**

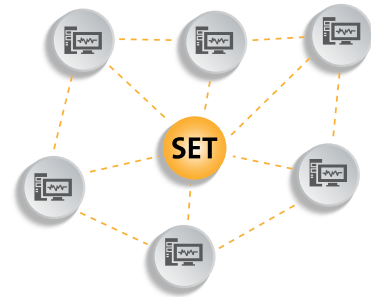
ในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้พัฒนางานบริการหลังการซื้อขายตามแผนแม่บทงานปฏิบัติงาน (Operations Master Plan) ปี 2555-2559 ได้เริ่มพัฒนาระบบชำระราคาใหม่ (new clearing system) สำหรับตราสารทุน ตราสารหนี้ และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยคัดเลือกให้ตลาดหลักทรัพย์เกาหลี (Korea Exchange-KRX) โดยมีบริษัท KOSCOM (บริษัทลูกของ KRX) ผู้เชี่ยวชาญด้านการพัฒนาระบบชำระราคาชั้นนำเป็นผู้ออกแบบและพัฒนาระบบ โดยระบบชำระราคาใหม่จะสามารถรองรับการขยายโอกาสทางธุรกิจ สนับสนุนความคล่องตัวในการออกผลิตภัณฑ์ทางการเงินใหม่ๆ สามารถเชื่อมต่อและทำธุรกรรมกับระบบของสำนักหักบัญชีทั่วโลกได้สะดวกมากขึ้น ส่งผลให้สำนักหักบัญชีของไทย มีความน่าเชื่อถือที่สุดแห่งหนึ่งในภูมิภาค

- **เพิ่มประสิทธิภาพระบบบริหารความเสี่ยงของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า**

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด ได้ปรับปรุงระบบบริหารความเสี่ยงของสำนักหักบัญชีให้คำนวณมูลค่าความเสี่ยงของสมาชิกในระหว่างวัน (intraday risk monitoring) อีกทั้งสามารถดูความเสี่ยงรวม (integrated risk exposure) จากการซื้อขายหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของสมาชิกได้ เพื่อให้สามารถติดตามความเสี่ยงโดยรวมของสมาชิกได้ทันต่อเหตุการณ์และสมาชิกสามารถจัดเตรียมหลักประกันได้ล่วงหน้าในกรณีที่สมาชิกมีค่าความเสี่ยงเกินกว่าระดับที่กำหนด นอกจากนี้ ได้พัฒนาระบบให้สมาชิกสามารถสอบถามยอดหลักประกันที่สมาชิกวางไว้ (collateral services) ทั้งในส่วนของการทำธุรกรรมหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า รวมถึงสามารถทำรายการขอถอนหลักประกันส่วนเกินผ่านระบบได้

- **เพิ่มประสิทธิภาพการส่งคำสั่งซื้อขายของบริษัทสมาชิก ผ่านระบบเครือข่าย SETNET3 ด้วยมาตรฐานสากล และความปลอดภัยสูง**

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ออกแบบและพัฒนาระบบเครือข่าย SETNET3 ซึ่งเป็นศูนย์กลางที่เชื่อมต่อระบบงานระหว่างบริษัทสมาชิกและตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยเพิ่มบริการให้แก่บริษัทสมาชิกเพื่อรองรับปริมาณการซื้อขายที่เพิ่มมากขึ้น ขยายขอบเขตการให้บริการเช่าพื้นที่ (co-location) สำหรับบริษัทสมาชิกที่ต้องการติดตั้งเซิร์ฟเวอร์เพื่อใช้รับ-ส่งคำสั่งซื้อขาย ซึ่งส่งผลให้ทำงานได้อย่างรวดเร็ว มีเสถียรภาพสูง มีระบบควบคุมสถานะแวดล้อม มีการรักษาความปลอดภัยที่ได้มาตรฐานและสมบูรณ์แบบ ซึ่งพร้อมให้บริการได้ภายในเดือนเมษายน 2556



- **ส่งเสริมให้มีบริษัทผู้พัฒนาระบบ (Independent Software Vendor) มีคุณสมบัติผ่านตามเกณฑ์ เพื่อเป็นทางเลือกให้กับบริษัทสมาชิก**

ปัจจุบันมีบริษัทผู้รับจ้างพัฒนาระบบหรือ software (Independent Software Vendor: ISV) ซึ่งผ่านการทดสอบการเชื่อมต่อบริษัทสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ารวมทั้ง 12 บริษัท ได้แก่ DST Worldwide Services (Thailand) Limited, Freewill Solutions Co. Ltd., SunGard, Fedessa, Horizon, IT Element Company Limited บริษัท เซ็ทเทรค ดอท คอม จำกัด และ Flextrade, PAT, RTS, CQG, SERISYS ซึ่งเป็น ISV 5 รายเพิ่มเติมในปี 2555 นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังให้ความสำคัญกับการที่บริษัทผู้พัฒนาระบบงานและบริษัทผู้ให้บริการระบบเครือข่ายทุกรายที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์ฯ บริษัทสมาชิก รวมถึงหน่วยงานในตลาดทุน จะต้องมีการรักษาความปลอดภัยและการควบคุมระบบคอมพิวเตอร์และระบบเครือข่ายเทคโนโลยีสารสนเทศที่มีประสิทธิภาพสูงสุดและครบวงจร เพื่อปกป้องความสำคัญของข้อมูลและป้องกันภัยคุกคามจากหน่วยงานภายนอก

- **พัฒนาระบบการรับหลักทรัพย์ DW ผ่านสื่ออิเล็กทรอนิกส์: e-Listing**

จากแนวโน้มการออกและเสนอขายใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (derivative warrants : DW) ที่เพิ่มมากขึ้นอย่างต่อเนื่อง เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพและความรวดเร็วในการรับ DW เข้าซื้อขาย ตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงได้พัฒนาระบบการยื่นคำขอและการพิจารณาอนุมัติรับหลักทรัพย์ผ่านระบบอิเล็กทรอนิกส์ทั้งหมด (e-Listing) ซึ่งจะช่วยให้ขั้นตอนการอนุมัติการรับ DW เข้าซื้อขายรวดเร็วยิ่งขึ้น และลดภาระของบริษัทหลักทรัพย์ที่เป็นผู้เสนอขาย DW ต่อผู้ลงทุน

ปรับปรุงกฎเกณฑ์เทียบเคียงตลาดหุ้นในภูมิภาค: เพิ่มศักยภาพเพื่อการแข่งขัน

ในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีการปรับปรุงกฎเกณฑ์เพื่อเพิ่มโอกาสการเข้าจดทะเบียนของบริษัทต่างๆ ตอบสนองโอกาสทางการเงินกับผู้ลงทุน และเพิ่มศักยภาพในการแข่งขันของตลาดหลักทรัพย์ฯ กับตลาดหุ้นในภูมิภาค รวมถึงการปรับปรุงกฎเกณฑ์เพิ่มความเข้มแข็งของบริษัทสมาชิกซึ่งเป็นตัวกลางในการซื้อขายให้กับผู้ลงทุน โดยมุ่งสนับสนุนการเพิ่มสินค้าในตลาดหลักทรัพย์ฯ และการปรับโครงสร้างบริษัทจดทะเบียนเพื่อเพิ่มความแข็งแกร่ง และความสามารถการแข่งขัน นอกจากนี้ ยังมุ่งส่งเสริมการกำกับดูแลตนเองของสมาชิก (self regulatory organization-SRO) โดยร่วมกับสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย เพื่อพิจารณาแบ่งขอบเขตงาน

ทั้งนี้ การกำหนดกฎเกณฑ์ต่างๆ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มีการหารือและรับฟังความเห็นจากผู้ที่เกี่ยวข้อง ทั้งบริษัทจดทะเบียน บริษัทสมาชิก ที่ปรึกษาทางการเงิน สมาคมส่งเสริมผู้ลงทุนไทย สมาคมบริษัทจัดการลงทุน เป็นต้น รวมทั้งร่วมฟังความคิดเห็นผ่านเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อให้มั่นใจว่ากฎเกณฑ์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ รักษาความเหมาะสมของการดำเนินธุรกิจและการคุ้มครองผู้ลงทุนรายย่อย

เสริมศักยภาพบุคลากรพร้อมรับการแข่งขัน: พร้อมสานโอกาสแก่ธุรกิจและผู้ลงทุน



การพัฒนาศักยภาพของบุคลากร ถือเป็นสิ่งสำคัญที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำเนินการอย่างต่อเนื่อง เพื่อสร้างบุคลากรที่มีความสามารถ พร้อมรับการเปลี่ยนแปลงทั้งสภาพแวดล้อมทางธุรกิจ และเทคโนโลยี พร้อมเป็นผู้เชื่อมโยงโอกาสทางการเงินที่เหมาะสมให้แก่ธุรกิจและผู้ลงทุน และสามารถตอบสนองความต้องการแก่ผู้เกี่ยวข้องได้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงมุ่งพัฒนาพนักงาน ดังนี้

1. ปลุกฝังความคิดเชิงธุรกิจให้พนักงานทุกระดับเพื่อเตรียมองค์กรให้พร้อมสำหรับอนาคตด้วยธุรกิจที่ต้องแข่งขันสูงและมีการเปลี่ยนแปลงตลอดเวลา เป็นแรงผลักดันให้พนักงานเพิ่มขีดความสามารถในการเรียนรู้ ใฝ่รู้และมองสิ่งที่เปลี่ยนแปลงในโลกให้เกิดประโยชน์ต่อธุรกิจ กล้าคิดสิ่งใหม่ๆ และพร้อมที่จะทำงานกับเทคโนโลยีที่เปลี่ยนแปลงอยู่ตลอดเวลา และทำงานร่วมกับผู้เกี่ยวข้องอย่างรวดเร็ว ทันเวลาและชัดเจน
2. จัดโครงการสร้างผู้นำสำหรับองค์กรแห่งอนาคต **Leadership Development Program** ซึ่งได้ทำการพัฒนาอย่างต่อเนื่องตั้งแต่ปี 2553 เพื่อสร้างเสริมศักยภาพของผู้บริหารแห่งอนาคตโดยใช้การผสมผสานหลากหลายรูปแบบในการพัฒนา เช่น one-on-one coaching โดยผู้เชี่ยวชาญ การเรียนผ่าน e-learning การอบรม สัมมนาทั้งในและต่างประเทศ สำหรับผู้บริหารและพนักงาน
3. จัดกิจกรรมเพื่อปลุกฝังให้พนักงานตระหนักรู้และเข้าใจเรื่อง **core values** และมีบทบาทเป็น “ผู้เชื่อมโยงโอกาส” หรือ “**Opportunity Connector**” เพื่อให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ สามารถสานโอกาสทางการเงินที่ดีที่สุดให้แก่ลูกค้าทั้งธุรกิจและผู้ลงทุน
4. สนับสนุนให้พนักงานได้เพิ่มพูนความรู้ความสามารถ แสวงหาเทคโนโลยีและนวัตกรรมใหม่ๆ โดยให้ทุนการศึกษาในสถาบันการศึกษาชั้นนำทั้งในและต่างประเทศ ในสาขาบริหารธุรกิจ กฎหมายและเทคโนโลยี เพื่อนำความรู้ที่ได้มาพัฒนาองค์กรต่อไป
5. มีการสื่อสารเพื่อสร้างความเข้าใจกับพนักงานทุกระดับเป็นระยะๆ ผ่านช่องทางการสื่อสารภายใน เช่น เสียงตามสาย การพบปะอย่างไม่เป็นทางการระหว่างผู้บริหารและพนักงาน เวทีแลกเปลี่ยนความคิดเห็น ตลอดจนการทำกิจกรรมร่วมกันระหว่างผู้บริหารและพนักงาน อย่างสม่ำเสมอ
6. มีระบบประเมินผลงาน (performance management) ที่มีความชัดเจนและเชื่อมโยงกับเป้าหมายองค์กร โดยกรรมการและผู้จัดการ มี KPI ที่เชื่อมโยงเป้าหมายองค์กรและถ่ายทอดมาสู่ระดับผู้บริหาร และพนักงานรายบุคคลตามลำดับ รวมถึงมีการเชื่อมโยง KPI เข้ากับผลตอบแทนของพนักงานรายบุคคล
7. ปลุกฝังความเป็นมืออาชีพให้กับพนักงาน พร้อมปฏิบัติงานตามมาตรฐานสากลในงานทุกด้าน มีกระบวนการทบทวนและปรับปรุงระบบการทำงาน ปลุกฝังความเป็นมืออาชีพใน DNA ของพนักงาน ให้ตระหนักรู้ถึงความสำคัญของงานที่ทำ และส่งมอบงานคุณภาพให้กับหน่วยธุรกิจ

ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ เชื่อมั่นว่าการเจริญเติบโตขององค์กรขึ้นอยู่กับพนักงานทุกคน ดังนั้น เมื่อพนักงานได้รับโอกาสในการพัฒนาและเสริมสร้างศักยภาพของตนเอง ก็จะทำให้มีความสุขกับการทำงานและสร้างผลงานคุณภาพอย่างต่อเนื่อง เพิ่มขีดความสามารถในการแข่งขันและตอบสนองต่อการเปลี่ยนแปลงขององค์กรในอนาคตได้

5) การเสริมสร้างความแข็งแกร่งให้แก่สถาบันตัวกลาง: Strengthening intermediaries

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ร่วมมือกับสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย บริษัทหลักทรัพย์ และพันธมิตร ในการตอบสนองความต้องการของลูกค้า เพื่อให้เติบโตไปพร้อมกันอย่างยั่งยืน จึงจัดตั้งคณะทำงานร่วมกับบริษัทหลักทรัพย์ และ stakeholder ที่สำคัญอย่างใกล้ชิด เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารช่องทางการขายผลิตภัณฑ์ การวางแผนการตลาด และการส่งเสริมสินค้าให้เหมาะสมกับภาวะตลาดและผู้ลงทุนในแต่ละกลุ่ม อีกทั้งสนับสนุนให้บริษัทหลักทรัพย์ และพันธมิตรทางธุรกิจสามารถสร้างธุรกิจใหม่ได้รวดเร็ว และได้รับการเสริมด้วยต้นทุนที่เหมาะสม

เพิ่มศักยภาพและความแข็งแกร่งระบบงานซื้อขายออนไลน์ให้แก่บริษัทสมาชิก

ตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยบริษัทเซ็ทเทรด ดอท คอม จำกัด ซึ่งเป็นบริษัทในเครือของตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้พัฒนาระบบซื้อขายผ่านทางอินเทอร์เน็ต ให้เป็นทางเลือกแก่สมาชิก เพื่อรองรับความต้องการใช้งานบนเทคโนโลยี Mobile ที่หลากหลายรูปแบบ เพื่อให้บริการแก่สมาชิก ซึ่งประโยชน์ต่อการขยายบริการแก่ลูกค้าอย่างต่อเนื่อง โดยพัฒนาโปรแกรม Settrade Streaming for Android ซึ่งเป็น Web Application สำหรับซื้อขายทั้งหุ้นและอนุพันธ์บน Mobile และ Tablet ระบบปฏิบัติการ Android และเพิ่มขีดความสามารถของ Settrade Streaming for iPad โดยพัฒนาฟังก์ชันเพิ่มเติมสำหรับแต่ละบริษัทสมาชิก นอกจากนี้ ยังได้เพิ่มศักยภาพของระบบให้รองรับการเติบโตของจำนวนผู้ลงทุนออนไลน์อย่างรวดเร็ว ทั้งนี้ ในปี 2555 จำนวนผู้ลงทุนที่ใช้ระบบเซ็ทเทรดพร้อมๆ กัน สูงขึ้นกว่า 30% เป็นกว่า 43,000 คน จาก 33,000 คน ในปี 2554 ที่ผ่านมา



สนับสนุนการทำธุรกิจของบริษัทสมาชิกและคุ้มครองผู้ลงทุนอย่างเป็นรูปธรรม

ในปี 2555 เป็นปีแรกของการเปิดเสรีในการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมหรือค่าเสียหายในการซื้อขายหลักทรัพย์ ซึ่งสมาชิกแต่ละแห่งได้มีการเรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากผู้ลงทุนด้วยความเหมาะสม โดยคำนึงถึงต้นทุนและการให้บริการ รวมทั้งได้ขยายธุรกิจด้านอื่นๆ เพิ่มขึ้น ซึ่งตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มีการติดตามการดำเนินธุรกิจของสมาชิกเป็นระยะ เพื่อให้การสนับสนุนการทำธุรกิจของสมาชิก โดยที่ผ่านมาได้มีการปรับปรุงข้อบังคับ เพื่อให้เกิดความยืดหยุ่นและเหมาะสมกับการดำเนินธุรกิจของสมาชิกเทียบเคียงกับสากล และในปี 2555 นี้ ได้มีการดำเนินงานสำหรับสมาชิกและผู้ลงทุน ดังนี้

• การสนับสนุนให้สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยมีบทบาทหน้าที่ในการกำกับดูแลตนเอง (SRO)

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ร่วมกับสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย พิจารณาการให้สมาชิกกำกับดูแลตนเอง (SRO) โดยกำหนดหรือแบ่งขอบเขตงานการกำกับสมาชิกที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ ดูแลบางส่วนให้สมาชิกผ่านสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยเป็นผู้กำกับดูแล การแบ่งขอบเขตงานดังกล่าว พิจารณาจากความเสี่ยง ผลกระทบที่อาจเกิดขึ้น และประสิทธิภาพของการกำกับ รวมทั้งส่งผลให้เกิดความยืดหยุ่น

และลดอุปสรรคในการทำธุรกิจของสมาชิก โดยเทียบเคียงกับวิธีปฏิบัติของตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศ โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ จะกำกับดูแลเรื่องที่เกี่ยวข้องผลกระทบต่อตลาดหลักทรัพย์ฯโดยรวม และความเชื่อมั่นของผู้ลงทุน และให้สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทยกำกับดูแลเรื่องที่เกี่ยวข้องกับวิธีการหรือแนวทางปฏิบัติสำหรับการดำเนินธุรกิจ (business practice)

• การคุ้มครองทรัพย์สินของผู้ลงทุน

ในปี 2555 ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าและสมาชิก ได้ร่วมกันจัดตั้งกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives Investor Protection Fund: DIPF) จากเดิมที่มีเฉพาะกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์ (Securities Investor Protection Fund: SIPF) ซึ่งจะมีขนาดกองทุนในช่วงเริ่มต้นไม่น้อยกว่า 100 ล้านบาท โดยสมทบจากตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า 50 ล้านบาท และสมาชิกไม่น้อยกว่า 50 ล้านบาท เพื่อคุ้มครองทรัพย์สินของผู้ลงทุนตามหลักเกณฑ์ของข้อบังคับกองทุน โดยให้ความคุ้มครองต่อรายผู้ลงทุนไม่เกินความเสียหายหรือไม่เกิน 1 ล้านบาท ในกรณีสมาชิกกองทุนล้มละลาย หรือสมาชิกกองทุนมีข้อพิพาทกับผู้ลงทุนที่เกี่ยวข้องเนื่องจากการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า และอนุญาตตลาดการได้พิจารณาชี้ขาดให้สมาชิกกองทุนชดเชยเงินหรือทรัพย์สินแก่ผู้ลงทุนแต่สมาชิกกองทุนไม่ปฏิบัติตาม

สำหรับกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์ (SIPF) ได้มีการปรับปรุงหลักเกณฑ์ เพื่อให้กองทุนดังกล่าวขยายการรับสมาชิกใหม่ของตลาดหลักทรัพย์ฯ และปรับปรุงระเบียบการดำเนินงานให้เกิดประโยชน์ในการคุ้มครองผู้ลงทุนได้เหมาะสมยิ่งขึ้น ได้แก่ การปรับการรับสมาชิกใหม่ให้สอดคล้องกับการรับสมาชิกใหม่ของตลาดหลักทรัพย์ฯ การกำหนดหน้าที่ให้องค์กรรมการกองทุนในการสนับสนุนตลาดหลักทรัพย์ฯ ในการสร้างความมั่นใจต่อผู้ลงทุน และการปรับแก้เอกสารที่ใช้ในการยื่นขอรับการชดเชยจากกองทุนไม่ให้เกิดภาระกับผู้ลงทุนจนเกินควร เป็นต้น

งานพัฒนาตลาดทุน: มุ่งยกระดับคุณภาพตลาดทุนระยะยาว

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยมุ่งสานต่อความร่วมมือของตลาดทุนในด้านต่างๆ โดยทำงานร่วมกับหน่วยงานภาครัฐและเอกชน ตลอดจนสมาคมและองค์กรที่เกี่ยวข้องในตลาดทุน เพื่อพัฒนาขีดความสามารถของผู้ร่วมตลาดทุนในทุกกลุ่มอย่างต่อเนื่อง ทั้งบริษัทจดทะเบียน บริษัทหลักทรัพย์ บุคลากร และผู้ประกอบการวิชาชีพในตลาดทุน ตลอดจนผู้ลงทุนและผู้มีเงินออม รวมถึงการปลูกฝังความรู้ด้านการออม และการบริหารเงินให้แก่เยาวชนไทย ซึ่งถือเป็นรากฐานสำคัญของประเทศ ส่งผลให้เกิดการพัฒนาตลาดทุนและเศรษฐกิจที่ยั่งยืนในอนาคต

เพิ่มพลังแก่ธุรกิจ: พัฒนาคุณภาพบริษัทจดทะเบียนเพื่อการเติบโตอย่างยั่งยืน

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้ความสำคัญและมุ่งมั่นส่งเสริมการพัฒนาคุณภาพบริษัทจดทะเบียนอย่างต่อเนื่องใน 3 ด้าน ได้แก่ ด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดี ด้านนักลงทุนสัมพันธ์ และด้านการดำเนินธุรกิจอย่างมีความรับผิดชอบต่อสังคม โดยพัฒนามาตรฐานแนวปฏิบัติการให้ความรู้ และกระตุ้นให้นำมาตรฐานและแนวปฏิบัติไปปฏิบัติจริง โดยเฉพาะอย่างยิ่งการส่งเสริมเพื่อยกระดับมาตรฐานบริษัทจดทะเบียนไปสู่มาตรฐาน ESG (environment, society and governance) ซึ่งดำเนินธุรกิจด้วยความตระหนักต่อด้านสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาล

พัฒนาการกำกับดูแลกิจการที่ดี

พัฒนาการสำคัญในปี 2555 นี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ปรับปรุงหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดีสำหรับบริษัทจดทะเบียน ฉบับปี 2549 ให้สอดคล้องกับ ASEAN CG Scorecard ซึ่งเป็นเกณฑ์การประเมินและจัดอันดับการกำกับดูแลกิจการของบริษัทจดทะเบียนในประเทศกลุ่มอาเซียน เพื่อให้หลักการมีความทันสมัยและสอดคล้องต่อภาวะการเปลี่ยนแปลงในตลาดทุนและสังคม รวมถึงเป็นการยกระดับมาตรฐาน และการปฏิบัติด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดีของบริษัทจดทะเบียนไทยให้สูงขึ้น อีกทั้งยังเป็นการเตรียมความพร้อมเพื่อเข้าสู่การแข่งขันเพื่อเตรียมความพร้อมให้บริษัทจดทะเบียนไทยสู่การแข่งขันในระดับภูมิภาค ก้าวสู่ ASEAN Economic Community (AEC) ที่เกิดขึ้นในปี 2558

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำเนินโครงการ**พัฒนาบริษัทจดทะเบียนด้านการกำกับดูแลกิจการ** ต่อเนื่องเป็นปีที่สาม โดยการสำรวจและวิเคราะห์ความเพียงพอของระบบการบริหารจัดการในด้านการบริหารความเสี่ยง การควบคุมภายใน และการกำกับดูแลกิจการที่ดีของบริษัทจดทะเบียน ตลอดจนการให้คำปรึกษา และแนะนำเพื่อปรับปรุงระบบการบริหารจัดการธุรกิจให้เข้มแข็งและมีศักยภาพ

สำหรับงานพัฒนาด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดี ซึ่งตลาดหลักทรัพย์ฯ จัดทำต่อเนื่องเป็นประจำทุกปีคือ **รายงานวิเคราะห์คำตอบแทนกรรมการและฝ่ายบริหารของบริษัทจดทะเบียน** เพื่อเป็นแนวทางในการกำหนดและเทียบเคียงคำตอบแทนของกรรมการและฝ่ายบริหารให้เหมาะสมกับกิจการอื่นๆ ในภาคอุตสาหกรรมเดียวกัน และการยกย่อง เชิดชูบริษัทจดทะเบียนที่ปฏิบัติดีด้านการกำกับดูแลกิจการ โดยมอบ**รางวัลบริษัทจดทะเบียนด้านการรายงานบรรษัทภิบาล หรือ CG Report Awards** แก่บริษัทจดทะเบียนใน SET และ mai รวมถึงการเข้าพบคณะกรรมการและผู้บริหารของบริษัทจดทะเบียนรายใหม่ของคณะอนุกรรมการศูนย์พัฒนาการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน เพื่อให้คำปรึกษาแนะนำเกี่ยวกับแนวทาง และบทบาทหน้าที่ของคณะกรรมการบริษัท ในการสร้างเสริมธรรมาภิบาลและการกำกับดูแลกิจการที่ดี

พัฒนางานด้านนักลงทุนสัมพันธ์

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้กำหนดกรอบการดำเนินงานพัฒนา investor relations หรือ IR 3 ด้านหลัก ได้แก่

- 1) การให้ความรู้และส่งเสริมให้ปฏิบัติ โดยดำเนิน**โครงการให้คำปรึกษาเชิงลึกด้านนักลงทุนสัมพันธ์ (SET's IR Advising Program)** ต่อเนื่องเป็นปีที่สอง เพื่อแนะนำการพัฒนางานนักลงทุนสัมพันธ์เป็นรายบริษัท และเสริมด้วยการจัดอบรม สัมมนาเชิงปฏิบัติการต่างๆ ซึ่งในปี 2555 นี้ มีบริษัทเข้าร่วมโครงการจำนวน 30 ราย
- 2) การพัฒนามาตรฐานและแนวปฏิบัติที่ดีด้านนักลงทุนสัมพันธ์ เพื่อการประกอบวิชาชีพ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เผยแพร่คู่มือ**“ก้าวแรกสู่แก่นักลงทุนสัมพันธ์”** เพื่อให้แก่นักลงทุนสัมพันธ์ได้นำแนวทางปฏิบัติต่างๆ ไปปรับใช้ให้เหมาะกับองค์กร นอกจากนี้ ยังจัดสัมมนาและอบรมให้ความรู้ที่เป็นประโยชน์ต่อการทำงานนักลงทุนสัมพันธ์หัวข้อต่างๆ ได้แก่ 1) Business Strategy for IR 2) การวางแผนงาน IR ให้เหมาะสมกับองค์กร 3) ทำอย่างไรให้หุ้นอยู่ในใจนักลงทุน และ 4) Understand ASEAN Investors: a first step towards ASEAN trading link เป็นต้น
- 3) การยกย่องส่งเสริมบริษัทจดทะเบียนที่มีความโดดเด่นและดำเนินงานด้านนักลงทุนสัมพันธ์ได้เป็นอย่างดี โดยจัดมอบ**รางวัลบริษัทจดทะเบียนด้านนักลงทุนสัมพันธ์ หรือ Best IR Awards** ซึ่งรางวัลดังกล่าวได้มีการปรับเกณฑ์ในส่วนของการประเมินตนเองให้บริษัทจดทะเบียนสามารถนำไปใช้เป็น check list ในการวางแผนงานนักลงทุนสัมพันธ์ให้ครบถ้วนมากยิ่งขึ้น

พัฒนาด้านความรับผิดชอบต่อสังคม

การพัฒนาความรับผิดชอบต่อสังคมของกิจการหรือ CSR (corporate social responsibilities) นับว่าเป็นเรื่องใหม่สำหรับบริษัทจดทะเบียนหลายๆ แห่ง ดังนั้น ในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงมุ่งสร้างความรู้ความเข้าใจในเรื่องดังกล่าว โดยจัดทำคู่มือ 2 ฉบับ ได้แก่ **แนวทางการรับผิดชอบต่อสังคมของกิจการ และแนวทางการจัดทำรายงานแห่งความยั่งยืน** รวมถึงการจัดอบรมเชิงปฏิบัติการ และการเปิดตัวที่แบ่งปันประสบการณ์ 3 เรื่องได้แก่ 1) การบริหารความรับผิดชอบต่อสังคมเพื่อการพัฒนาที่ยั่งยืน 2) การจัดทำรายงานแห่งความยั่งยืน และ 3) CSR Best Practices ซึ่งในส่วนของการจัดทำรายงานแห่งความยั่งยืน และยังมีอย่างต่อเนื่องไปสู่โครงการให้คำปรึกษาเชิงลึกเป็นรายบริษัท ในการเขียนรายงานดังกล่าวอีกด้วย



ส่วนกิจกรรมที่เปิดโอกาสให้ทั้งบริษัทจดทะเบียนรวมถึงองค์กรอื่นๆ และประชาชนทั่วไปมีส่วนร่วม ได้แก่ การจัดสัมมนา CSRI Forum ในหัวข้อทิศทาง CSR 2555 และบทบาทของ CEO ต่อการสร้างองค์กรที่ยั่งยืน ซึ่งสัมมนา ได้นำไปสู่การจัด CEO Forum กลุ่มย่อยรวม 3 ครั้ง ซึ่งเป็นการพบปะระหว่างประธานกรรมการ และผู้บริหารระดับสูงสุดของบริษัทจดทะเบียนครั้งละ 10-15 ราย ซึ่งได้เน้นการส่งเสริมให้บริษัทที่มีความพร้อมเข้าสู่ดัชนีชี้วัดระดับสากล Dow Jones Sustainability Index

งานพัฒนาด้านความรับผิดชอบต่อสังคมที่ตลาดหลักทรัพย์ จัดทำต่อเนื่องทุกปีคือ การยกย่องเชิดชูบริษัทจดทะเบียนที่ปฏิบัติด้านความรับผิดชอบต่อสังคม โดยจัดมอบรางวัลบริษัทจดทะเบียนด้าน **ความรับผิดชอบต่อสังคมยอดเยี่ยม** หรือ Best Corporate Social Responsibility Awards ซึ่งในปี 2555 สถาบันธุรกิจเพื่อสังคม (CSRI) ภายใต้การดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ ได้จัดพิธีมอบรางวัล CSRI Recognition 2012 เพิ่มเติมจากรางวัล CSR Awards เป็นครั้งแรกประกอบด้วย รางวัล Rising Star มอบให้แก่บริษัทจดทะเบียนขนาดเล็กถึงขนาดกลาง



ดีเด่นด้านความรับผิดชอบต่อสังคม รางวัล Most Improved CSR สำหรับบริษัทจดทะเบียนที่มีพัฒนาการด้านความรับผิดชอบต่อสังคม และรางวัล Most Innovative CSR สำหรับบริษัทจดทะเบียนที่มีนวัตกรรมด้านความรับผิดชอบต่อสังคม เพื่อประกาศเกียรติคุณ ยกย่อง และเป็นกำลังใจแก่บริษัทจดทะเบียนที่มีความมุ่งมั่น ตั้งใจในการพัฒนาและดำเนินธุรกิจอย่างมีความรับผิดชอบต่อสังคมอย่างต่อเนื่อง และเป็นแบบอย่างที่ดีแก่บริษัทจดทะเบียน หน่วยงานอื่นๆ และสาธารณชนทั่วไป

เพิ่มพลังผู้ประกอบการขนาดกลางและย่อม

ตลาดหลักทรัพย์ ให้ความสำคัญสนับสนุนและส่งเสริมศักยภาพของผู้ประกอบการขนาดกลางและขนาดย่อม (SMEs) ให้มีความรู้ความเข้าใจเกี่ยวกับการบริหารการเงินอย่างมีประสิทธิภาพ โดยทำงานร่วมกับพันธมิตรทั้งภาครัฐและเอกชน จัดกิจกรรมสัมมนาและการรับฟังประสบการณ์ มุมมองและแนวคิดในการดำเนินธุรกิจจากผู้บริหารของบริษัทจดทะเบียน เพื่อสร้างความเข้าใจที่ถูกต้องเกี่ยวกับการ



ใช้ประโยชน์จากตลาดทุน รวมถึงการสร้างแรงบันดาลใจและแนวคิดในการพัฒนาธุรกิจให้เติบโตอย่างยั่งยืน ควบคู่ไปกับความแข็งแกร่งทางด้านเงินทุนเพื่อก้าวสู่การเป็นบริษัทจดทะเบียนในอนาคต โดยมีผู้ประกอบการเข้าร่วมกิจกรรมทั้งสิ้น 594 บริษัท

นอกจากนี้ ยังจัดให้มี Platform เพื่อเชื่อมโยงให้ผู้ประกอบการที่มีนวัตกรรมที่น่าสนใจ ได้มีช่องทางในการเข้าถึงผู้ที่มีเงินทุนที่เป็นบริษัทร่วมลงทุนที่เป็นสมาชิก ผ่านเว็บไซต์ www.lnnobizmatching.org ควบคู่ไปกับการจัดกิจกรรมภายใต้ชื่อ Good Business Plan Get More

Money เพื่อเปิดโอกาสให้ผู้ประกอบการที่ต้องการเงินทุน ได้เรียนรู้วิธีการและรูปแบบการนำเสนอแผนธุรกิจต่อบริษัทร่วมลงทุน โดยรับฟังข้อเสนอแนะและมุมมองของผู้ลงทุนมืออาชีพ เพื่อนำไปปรับ business model ให้ตรงกับความต้องการของผู้ลงทุน

เพิ่มพลังแก่ผู้ลงทุน: ยกระดับความรู้ สร้างผู้ลงทุนคุณภาพ

ตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน (Thailand Securities Institute : TSI) มุ่งเป็นศูนย์กลางในการพัฒนาความรู้ด้านการวางแผนการเงินและการลงทุนให้แก่ผู้ลงทุนและผู้มีเงินออม ซึ่งจะนำไปสู่การมีสุขภาพทางการเงินที่ดีในอนาคต และนำไปสู่การขยายฐานผู้ลงทุนคุณภาพในระยะยาว

สร้างผู้ลงทุนคุณภาพ ผ่านช่องทางการเรียนรู้หลากหลาย เข้าถึงทุกกลุ่มเป้าหมายการลงทุน

ตลอดปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ดำเนินการเผยแพร่ความรู้ด้านออมและการลงทุนอย่างเป็นระบบและครอบคลุมทุกกลุ่มเป้าหมายผ่านหลักสูตรอบรม สัมมนา และกิจกรรมต่างๆ อย่างต่อเนื่อง โดยเริ่มจากหลักสูตรเบื้องต้นด้านการวางแผนการเงิน และการลงทุนในผลิตภัณฑ์การลงทุนประเภทต่างๆ รวมทั้งหลักสูตรเชิงลึกที่ฝึกฝนให้ผู้เรียนสามารถวิเคราะห์และตัดสินใจลงทุนด้วยตนเอง โดยในปี 2555 มีผู้เข้าร่วมอบรมสัมมนา จำนวน 35,336 คน พร้อมทั้งมีการเผยแพร่ความรู้ด้านการลงทุนผ่านโครงการและช่องทางการเรียนรู้เพื่อการลงทุนต่างๆ ดังนี้

1) โครงการ “ออมไว้นาน by TSI” มุ่งด้วยหุ้น ลงทุนอย่างคุณภาพ เพื่อกระตุ้นให้เกิดการลงทุนในระยะยาว (long-term investing) สร้างการรับรู้และเปลี่ยนพฤติกรรมให้แก่ผู้มีศักยภาพในการลงทุนหรือผู้มีเงินฝากธนาคารให้เปลี่ยนมาออมไว้นานอย่างต่อเนื่อง พร้อมสร้างผู้ลงทุนคุณภาพในตลาดทุนไทย มีการจัดอบรมและให้ความรู้ผ่านสื่อออนไลน์อย่างต่อเนื่อง โดยมีผู้สมัครเข้าร่วมโครงการ จำนวน 8,680 คน



2) โครงการ “กระตุ้นการลงทุนกลุ่ม inactive investors” ร่วมมือกับบริษัทหลักทรัพย์ จำนวน 14 แห่ง เพื่อถ่ายทอดความรู้ให้แก่ตัวแทนบุคลากรของบริษัทหลักทรัพย์ ให้สามารถถ่ายทอดความรู้ด้านการลงทุนอย่างคุณภาพแก่ผู้ลงทุนกลุ่ม inactive investors เพื่อเพิ่มความมั่นใจในการลงทุน โดยมีผู้สมัครเข้าร่วมโครงการรวม 21,213 คน

3) โครงการ Employee's Choice@Workplaces จัดทำหลักสูตรและอบรมให้แก่คณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ เพื่อถ่ายทอดความรู้ด้านการวางแผนทางการเงินเพื่อการเกษียณ พร้อมแนวทางการเพิ่มพูนเงินออมผ่านการเลือกนโยบายการลงทุน (employee's choice) ที่เหมาะสมแก่สมาชิกกองทุนสำรองเลี้ยงชีพในบริษัท โดยมีคณะกรรมการกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ และสมาชิกกองทุนสำรองเลี้ยงชีพร่วมอบรมจำนวน 7,689 คน

4) พัฒนาช่องทางการเรียนรู้ออนไลน์ เข้าถึงทุกไลฟ์สไตล์การเรียนรู้ โดยพัฒนาการเข้าถึงการเรียนรู้ ด้านการวางแผนการเงินและการลงทุนของ TSI ผ่าน “TSI on Mobile” โดยรวบรวมความรู้ไว้อย่างเป็นระบบ highlight เมนูที่สำคัญ และสะดวกในการใช้งาน พร้อมเรียนรู้ได้ทุกที่ ตลอด 24 ชั่วโมง รวมทั้งกระตุ้นการเรียนรู้ผ่านความรู้ออนไลน์บนเว็บไซต์ www.tsi-thailand.org อย่างต่อเนื่อง โดยปี 2555 มีกลุ่มคนรุ่นใหม่ได้รับความรู้ผ่านสื่อความรู้ออนไลน์สะสมจำนวน 719,451 คน และ TSI Facebook มีสมาชิกเพิ่มขึ้นเป็นจำนวน 33,434 คน



5) พัฒนาสื่อความรู้สู่ความมั่งคั่งให้เข้าถึงผู้ลงทุน จัดทำหนังสืออิเล็กทรอนิกส์ (e-book) ผ่านแอปพลิเคชัน “SET e-book” เพิ่มความสะดวกและขยายช่องทางเข้าถึงความรู้ด้านการวางแผนการเงิน และการลงทุนแก่ผู้ลงทุน และหนังสือแปลชุด “แนวทางการตรวจสอบเทคโนโลยีในระดับสากล” (Global Technology Audit Guide:GTAG) โดยร่วมมือกับสมาคมผู้ตรวจสอบภายในแห่งประเทศไทย เพื่อส่งเสริมความรู้ด้านบริหารจัดการแก่บริษัทจดทะเบียนและผู้สนใจทั่วไป พร้อมจัดสัมมนาให้ความรู้อีกด้วย



6) พัฒนา e-Library@Maruey บริการอ่านหนังสือออนไลน์ของห้องสมุดมารวย ตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อให้ผู้ลงทุนและผู้สนใจทั้งในกรุงเทพฯ และต่างจังหวัดสามารถเข้าถึงความรู้ด้านการเงินและการลงทุนได้ทุกที่ ตลอด 24 ชั่วโมง ตลอดทั้งปี 2555 มีผู้ใช้บริการศึกษาค้นคว้าข้อมูลสารสนเทศด้านการลงทุนและร่วมกิจกรรมส่งเสริมการเรียนรู้ด้านการลงทุนของห้องสมุดมารวย ทั้งที่อาคารตลาดหลักทรัพย์ฯ และชั้น 2 ศูนย์การค้าเอสพลานาด กว่า 426,000 คน

เพิ่มศักยภาพและความแข็งแกร่งแก่สถาบันตัวกลาง: ยกระดับมาตรฐานผู้ประกอบการวิชาชีพธุรกิจหลักทรัพย์

ยกระดับความรู้ทักษะการปฏิบัติงานผู้ประกอบการวิชาชีพธุรกิจหลักทรัพย์

ควบคู่กับการสร้างผู้ลงทุนคุณภาพ ตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยศูนย์ส่งเสริมพัฒนาความรู้ตลาดทุน (Thailand Securities Institute: TSI) ยังมีบทบาทและภารกิจหลักสำคัญในการพัฒนาความรู้ผู้ประกอบการวิชาชีพ ทั้งในด้านการกำหนดทิศทางและแผนพัฒนาความรู้ของบุคลากรของตลาดทุน และการกำหนดมาตรฐานความรู้ ซึ่งเกี่ยวข้องกับการดูแลมาตรฐานศูนย์ทดสอบและการบริหารคลังข้อสอบใบอนุญาตสำหรับผู้ประกอบการวิชาชีพหลักทรัพย์

TSI ให้ความสำคัญอย่างยิ่งต่อการสร้างมาตรฐานความรู้ของผู้ประกอบการวิชาชีพ เพื่อรองรับการขยายตัวของตลาดทุนไทยและแข่งขันในระดับสากล โดยมุ่งพัฒนาความรู้ผู้ประกอบการวิชาชีพในตลาดทุนให้มีความรู้ ทักษะ และจรรยาบรรณในการประกอบอาชีพ โดยยึดหลักความมีจริยธรรมควบคู่กับความเป็นมืออาชีพที่จะให้บริการกับผู้ลงทุน

ในปี 2555 TSI ได้สานต่องานสร้างคุณภาพและยกระดับความรู้ทักษะการปฏิบัติงานของผู้ประกอบการวิชาชีพธุรกิจหลักทรัพย์ โดยร่วมมือกับสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย ดำเนินโครงการและหลักสูตรต่างๆ ซึ่งตลอดปี 2555 มีผู้ได้รับการอบรม รวมทั้งสิ้นกว่า 2,700 คน ประกอบด้วย



- 1) โครงการ “New Investment Consultant (NICs)” เพื่อพัฒนาผู้แนะนำการลงทุนรุ่นใหม่
- 2) โครงการ “Brokers’ Modern Investment Consultant (B-MIC)” เพื่อพัฒนาความรู้และทักษะให้กับผู้แนะนำการลงทุน
- 3) โครงการ “Strengthening Back Office Personnel” ซึ่งได้มีการจัดทำ roadmap การพัฒนาความรู้สำหรับบุคลากรด้าน back office และจัดอบรมความรู้ที่จำเป็นเร่งด่วนให้แก่บุคลากรกลุ่มนี้
- 4) โครงการ “Strengthening Junior Analyst” เพื่อพัฒนานักวิเคราะห์คุณภาพรุ่นใหม่ให้อุตสาหกรรม

ทั้งนี้ TSI ได้พัฒนาหลักสูตรและจัดอบรมในหัวข้อต่างๆ ที่เกี่ยวกับความรู้ด้านผลิตภัณฑ์ การวิเคราะห์และทักษะอื่นๆ ที่จำเป็นในการปฏิบัติงานสำหรับบุคลากรธุรกิจหลักทรัพย์ด้วย

นอกจากนี้ ยังได้พัฒนาและปรับปรุงหลักสูตรทดสอบใบอนุญาตให้สอดคล้องกับโครงสร้างผู้ประกอบการวิชาชีพใหม่ของสำนักงาน ก.ล.ต. ที่มีผลบังคับใช้ตั้งแต่ 1 เมษายน 2555 เป็นต้นมา ซึ่งตามโครงสร้างใบอนุญาตใหม่ได้เพิ่มประเภทของผู้ทำหน้าที่แนะนำการลงทุน จากเดิมที่มี 6 ประเภท ไปเป็น 10 ประเภท ตามขอบเขตผลิตภัณฑ์ที่สามารถให้คำแนะนำที่สำคัญ เช่น เพิ่มประเภทผู้แนะนำการลงทุนด้านกองทุนอนุพันธ์ และได้กำหนดกรอบเนื้อหาความรู้ที่ผู้แนะนำการลงทุนต้องมีออกเป็น 4 ด้าน ได้แก่ 1) ความรู้พื้นฐาน 2) กฎระเบียบที่เกี่ยวข้องและการให้คำแนะนำการลงทุนที่เหมาะสม 3) ความรู้เกี่ยวกับผลิตภัณฑ์การลงทุน และ 4) กฎระเบียบและมาตรฐานการปฏิบัติงานสำหรับผลิตภัณฑ์การลงทุน ดังนั้น TSI จึงมีภารกิจที่ต้องปรับปรุงหลักสูตรทดสอบให้มีความสอดคล้องกับโครงสร้างใบอนุญาตใหม่ และพัฒนาให้มีหลักสูตรทดสอบรวม 20 หลักสูตรเพื่อรองรับความต้องการสอบสำหรับทุกกรณี

ทั้งนี้ ตั้งแต่วันที่ 15 กันยายน 2555 เป็นต้นมา TSI ได้เพิ่มบทบาทหน้าที่ในการรับรองสถาบันฝึกอบรมและการอนุมัติหลักสูตรเพื่อต่ออายุใบอนุญาต (refresher course) โดยได้รับโอนงานจากสำนักงาน ก.ล.ต. มาอยู่ในความดูแล ซึ่งนับเป็นจุดเริ่มต้นบทบาทที่สำคัญในการดูแลงานด้าน “Continuing Professional Education (CPE)” เพื่อการพัฒนาและยกระดับคุณภาพบุคลากรแบบต่อเนื่อง เนื่องจากการดูแลมาตรฐานหลักสูตรและมาตรฐานการดำเนินงานของสถาบันฝึกอบรมถือเป็นกลไกสำคัญที่มีอิทธิพลต่อการยกระดับคุณภาพของผู้ประกอบวิชาชีพในระยะยาว

เพิ่มขีดความสามารถตลาดหลักทรัพย์ฯ: ส่งเสริมคุณภาพงานวิจัย ยกระดับตลาดทุนไทย

สร้างผลงานวิจัยเพื่อพัฒนาตลาดทุน

ในปี 2555 สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุน มุ่งเน้นงานวิจัยที่สนับสนุนการเพิ่มขีดความสามารถในการแข่งขันของผู้ร่วมตลาดที่เกี่ยวข้อง ตลอดจนศึกษาถึงแนวทางการลดอุปสรรคสำคัญต่างๆ ในระบบตลาดทุนไทยให้สามารถแข่งขันในเวทีตลาดทุนโลกได้ดียิ่งขึ้น รวมถึงการผลิตงานศึกษาที่สร้างความตระหนักถึงสถานการณ์และการเตรียมพร้อมในการก้าวเข้าสู่การเป็นสังคมผู้สูงอายุของประชากรไทย โดยจัดทำงานวิจัยที่เป็นประโยชน์ต่อผู้ร่วมตลาดและการพัฒนาตลาดทุนในวงกว้าง อาทิ

1) แนวทางการสร้างความสมดุลของโครงสร้างบริษัทจดทะเบียนในตลาดหุ้นไทย 2) โอกาสการขยายตลาดในต่างจังหวัดและกลยุทธ์ของบริษัทจดทะเบียนไทย 3) คอขวด (bottleneck) ที่จะเป็นอุปสรรคต่อการเติบโตของตลาดทุนไทยในระยะ 5 ปีข้างหน้า 4) การเตรียมความพร้อมสำหรับการวางแผนทางการเงินเพื่อวัยเกษียณอายุของกลุ่มแรงงานในระบบช่วงอายุ 40- 60 ปี และ 5) ทำอย่างไรให้กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการและกองทุนสำรองเลี้ยงชีพตอบโจทย์การออมระยะยาวของคนไทยได้อย่างมีประสิทธิภาพ เป็นต้น



นอกจากนี้ ยังได้จัดให้มี Capital Market Research Forum เป็นประจำทุกเดือนต่อเนื่องเป็นปีที่ 3 เพื่อเป็นเวทีนำเสนอผลงานวิจัย และผลการศึกษาด้านตลาดทุนแก่ผู้มีส่วนร่วมในตลาดทุน ซึ่งได้รับเกียรติจากคณาจารย์จากมหาวิทยาลัยชั้นนำต่างๆ ผู้ทรงคุณวุฒิและผู้เชี่ยวชาญในตลาดทุนไทย และหน่วยงานระหว่างประเทศ ช่วยสนับสนุนการผลิตและการเผยแพร่งานศึกษาที่มีคุณภาพ ซึ่งเป็นโอกาสแลกเปลี่ยนความคิดเห็นที่เป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาตลาดทุนไทย

สนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุนระดับบัณฑิตศึกษา สร้างเครือข่ายภาคการศึกษาและธุรกิจ

ตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งมั่นเป็นผู้นำด้านการสร้างความร่วมมือระหว่างภาคธุรกิจในตลาดทุนไทยและสถาบันการศึกษา โดยสร้างเครือข่ายความเชื่อมโยงระหว่างนักวิชาการและผู้ประกอบธุรกิจในตลาดทุนไทยที่มีความเข้มแข็งมากขึ้นเป็นลำดับ ในปี 2555 นี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้รับความร่วมมือเป็นอย่างดี จาก 14 สถาบันการศึกษาชั้นนำและผู้เกี่ยวข้องในธุรกิจตลาดทุนไทย โดยจัดให้มี **“คลินิกงานวิจัยด้านตลาดทุน”** ในปี 2555 จำนวน 2 ครั้ง ซึ่งได้สร้างเครือข่ายระหว่างนักวิชาการและผู้ประกอบธุรกิจในตลาดทุนไทย ก่อให้เกิดการเชื่อมโยงภาคการศึกษาภาคธุรกิจกับภาคธุรกิจในตลาดทุนไทย และเพื่อยกระดับงานวิจัยด้านตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์ฯ จัดให้มีการแข่งขันชิงรางวัลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน เพื่อสนับสนุนให้เกิดการสร้างองค์ความรู้หรืองานศึกษาที่มีคุณภาพให้เกิดขึ้นกับนักวิจัยในภาคการศึกษาของไทยด้วย



สร้างผู้นำองค์กรคุณภาพ ผ่าน วตท.

สถาบันวิทยาการตลาดทุน (วตท.) ได้จัดการศึกษาหลักสูตรสำหรับผู้บริหารระดับสูง เพื่อสร้างผู้บริหารที่มีความรู้ความสามารถด้านตลาดทุน มีวิสัยทัศน์อันเป็นพลวัต ประกอบด้วยภาวะผู้นำที่สามารถทำให้องค์กรบรรลุเป้าหมาย ทั้งด้านธุรกิจและด้านบทบาทในสังคม ตลอด 8 ปีที่ผ่านมา มีผู้บริหารเข้าร่วมหลักสูตร วตท. แล้ว 15 รุ่น รวม 1,240 ท่าน และได้สร้างผลงานที่สำคัญยิ่งต่อการพัฒนาตลาดทุนไทย โดยการนำเสนอแนวทางการพัฒนาตลาดทุนต่อรัฐบาล ซึ่งได้ต่อยอดเป็นแผน

พัฒนาตลาดทุนไทยฉบับปัจจุบัน นอกจากนี้ ยังมีผลงานด้านวิชาการอีกหลากหลายที่เป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาเศรษฐกิจและสังคมไทย เช่น อุปสรรคและทางออกในการให้เอกชนเข้าร่วมลงทุนด้านโครงสร้างพื้นฐานของประเทศ: กรณีศึกษา พ.ร.บ. ว่าด้วยการให้เอกชนเข้าร่วมงานหรือดำเนินงานกิจการของรัฐ พ.ศ. 2535 แนวทางการเพิ่มบทบาทของนักลงทุนสถาบันในตลาดทุนไทย มุมมองของภาคธุรกิจไทยในการระดมทุนผ่านตลาดหลักทรัพย์ การลงทุนระยะยาวเพื่อเตรียมความพร้อมสู่ AEC: กรณีศึกษาการพัฒนาโครงสร้างพื้นฐานของประเทศไทย และบทบาทตลาดทุนต่อการพัฒนาโครงสร้างพื้นฐานระบบรางในประเทศไทย เป็นต้น



ด้านการดูแลสังคม สถาบันฯ และนักศึกษา วตท. ทุกรุ่น ได้จัดทำโครงการ **“พลัง วตท. ลดความเหลื่อมล้ำในสังคม”** ใน 10 จังหวัด ได้แก่ บุรีรัมย์ หนองคาย แม่ฮ่องสอน สกลนคร สระแก้ว ศรีสะเกษ อำนาจเจริญ นครพนม อุบลราชธานี และเลย

ในปี 2555 สถาบันวิทยาการตลาดทุนและนักศึกษา วตท. 14 และ วตท. 15 ได้จัดทำโครงการ **“พลัง วตท. ลดความเหลื่อมล้ำในสังคม”** และโครงการ **“สนับสนุนอุปกรณ์การศึกษาตามโครงการพระราชดำริสมเด็จพระเทพรัตนราชสุดาฯ”**

เพื่อลดความเหลื่อมล้ำในสังคมใน จังหวัดอุบลราชธานี และจังหวัดเลย พร้อมทั้งมีการจัดทำโครงการสร้างโรงสีข้าวชุมชนบ้านเสียม จังหวัดอุบลราชธานี และโครงการการสร้างศูนย์ข้อมูลนักท่องเที่ยว (visitors center) พร้อมกับการสร้างห้องน้ำสาธารณะให้มีมาตรฐาน สวยงาม และกลมกลืนไปกับสภาพเมืองเชียงคาน จังหวัดเลย



สานโอกาสการลงทุน เพื่อคุณ เพื่อธุรกิจ

เชื่อมโยงทุกโอกาสของผู้ที่ต้องการลงทุน
และผู้ที่ต้องการเงินทุนให้มาพบกัน โดยมุ่งขยายโอกาสใหม่ ๆ
เสริมสร้างความแข็งแกร่ง เติบโตเต็มศักยภาพ
พร้อมวางรากฐานการพัฒนาอย่างยั่งยืน
เพื่อสร้างคุณค่าให้ทุกโอกาสที่ดีที่สุด

แผนงานของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ปี 2556

งานธุรกิจตลาดหลักทรัพย์ฯ

ในปี 2556 ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนดแผนธุรกิจเพื่อตอบสนองวิสัยทัศน์ที่จะ “เพิ่มพลังให้ธุรกิจและผู้ลงทุนด้วยความโดดเด่นในการตอบสนองโอกาสทางการเงิน” ต่อเนื่องจากปี 2555 โดยมี 5 แผนธุรกิจสำคัญ ดังนี้

1. การขยายฐานผู้ลงทุน (Expand investor base)

ตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งขยายฐานผู้ลงทุน โดยเฉพาะผู้ลงทุนบุคคลในประเทศ โดยในปี 2556 มีเป้าหมายเพิ่มจำนวนบัญชีที่ซื้อขายหลักทรัพย์ 96,600 บัญชี จากทั้งหมด 797,326 บัญชีในปัจจุบัน และเพิ่มจำนวนบัญชีที่ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า 22,000 บัญชี จากทั้งหมด 80,893 บัญชีในปัจจุบัน ทั้งนี้ กลุ่มเป้าหมายสำคัญ คือ (1) ผู้ฝากเงิน ผ่านโครงการร่วมกับธนาคารพาณิชย์ เช่น โครงการ Banker-to-Broker (2) ผู้นิยมช่องทางออนไลน์ โดยมุ่งการสื่อสารและให้ความรู้ด้วยช่องทางออนไลน์ เช่น โครงการ Online Investor Generation Campaign และ (3) ผู้มีศักยภาพลงทุนในต่างจังหวัด โดยเฉพาะในจังหวัดที่เป็นหัวเมืองของแต่ละภูมิภาค ผ่านโครงการร่วมกับบริษัทสมาชิกเช่น โครงการ SET-TFEX สัญจรเชื่อมภูมิภาคสู่การลงทุน

นอกจากนี้ จะเน้นขยายฐานและเพิ่มการลงทุนของผู้ลงทุนสถาบันในประเทศ โดยเฉพาะกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ผ่าน employee choice โดยร่วมมือกับบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม ให้ความรู้และทำความเข้าใจกับสมาชิกกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ เพื่อให้สมาชิกเล็งเห็นถึงประโยชน์ของการเพิ่มผลตอบแทนจากการลงทุน และจัดสรรเงินที่สมทบให้ลงทุนในตราสารทุนเพิ่มขึ้น

2. การเพิ่มมูลค่าหลักทรัพย์และบริษัทจดทะเบียน (Grow market capitalization)

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ตั้งเป้าหมายเพิ่มมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (market capitalization) จากหลักทรัพย์เข้าจดทะเบียนใหม่ 120,000 ล้านบาท โดยมาจากการเข้าจดทะเบียนของบริษัทที่มีคุณภาพ เป็นผู้นำอุตสาหกรรมในประเทศ และมีแบรนด์ที่ได้รับการยอมรับจากประชาชนทั่วไป และกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ รวมถึงหลักทรัพย์จดทะเบียนรูปแบบใหม่ ที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ และหน่วยงานทางการที่เกี่ยวข้องได้ร่วมกันผลักดันในช่วงที่ผ่านมา คือ (1) บริษัทโฮลดิ้งของไทยที่มีการลงทุนหลักอยู่ในต่างประเทศ (2) กองทุนโครงสร้างพื้นฐาน (infrastructure fund) และ (3) กองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (Real Estate Investment Trust: REIT)

นอกจากนี้ จะส่งเสริมบริษัทจดทะเบียนให้ใช้เครื่องมือทางการเงินเพื่อสร้างมูลค่าเพิ่มแก่กิจการ เช่น warrant stock dividend และ stock split ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ตั้งเป้าหมายว่าในปี 2556 จะมีมูลค่าการระดมทุนเพิ่มของบริษัทจดทะเบียน 100,000 ล้านบาท

3. การเป็นประตูสู่การลงทุนในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง (Become the gateway to the Greater Mekong Subregion: GMS)

ตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งที่จะเป็นประตูสู่การลงทุนในอนุภูมิภาคลุ่มแม่น้ำโขง ซึ่งมีโอกาสเติบโตทางเศรษฐกิจและมีความต้องการระดมทุนสูง โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ จะทำงานร่วมกับตลาดหลักทรัพย์ในประเทศต่างๆ เพื่อสร้างประโยชน์ร่วมกัน และจะให้ความสำคัญต่อ (1) การจัดให้มีผลิตภัณฑ์ตลาดทุนและบริษัทจดทะเบียนในอนุภูมิภาคฯ ในตลาดหลักทรัพย์ในรูปแบบที่เหมาะสม อาทิ การรับบริษัทโฮลดิ้งของไทยที่มีการลงทุนหลักอยู่ในอนุภูมิภาคฯ เข้าจดทะเบียน (2) การเชื่อมโยงการซื้อขายระหว่างตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดในอนุภูมิภาคฯ ผ่าน ASEAN Trading Link (3) การเชื่อมโยงการชำระราคาและรับฝากหลักทรัพย์ระหว่างตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดในอนุภูมิภาคฯ (4) การส่งเสริมบริษัทหลักทรัพย์ และ custodian bank ของไทยให้ขยายธุรกิจในอนุภูมิภาคฯ และ (5) การเป็นผู้นำด้านการให้ความรู้ด้านตลาดทุน โดยให้ความรู้แก่บุคลากรและหน่วยงานกำกับดูแลในอนุภูมิภาคฯ

4. การพัฒนาผลิตภัณฑ์และบริการ (Develop new products and service platforms)

ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีแผนที่จะส่งเสริมการซื้อขายหลักทรัพย์ด้วยการใช้เครื่องมือทางเทคโนโลยีรูปแบบใหม่ๆ เช่น direct market access (DMA) และ program trading โดยจะปรับปรุงกฎเกณฑ์ กระบวนการ และระบบการบริหารความเสี่ยง รวมถึงให้บริการระบบบริหารจัดการความเร็วของการส่งคำสั่งซื้อขาย (latency management) โดยมีเป้าหมายให้มูลค่าซื้อขายหลักทรัพย์ผ่าน DMA และ/หรือ program trading เพิ่มขึ้นเป็น 10% จาก 7% ของมูลค่าซื้อขายหลักทรัพย์ทั้งหมดในปัจจุบัน

นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะขยายธุรกิจด้านตราสารหนี้ โดยให้บริการนายทะเบียนพันธบัตรออมทรัพย์แก่สำนักงานบริหารหนี้สาธารณะ และพัฒนาธุรกิจการบริหารหลักประกัน (collateral management)

5. การยกระดับระบบการทำงานหลักเพื่อส่งเสริมการเติบโตในระยะยาว (Upgrade infrastructure for growth)

ตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งมั่นสู่การเป็นตลาดหลักทรัพย์ที่มีระบบการดำเนินงานที่มีประสิทธิภาพสูงเทียบเคียงได้กับตลาดหลักทรัพย์ชั้นนำในภูมิภาค โดยจะดำเนินการต่อเนื่องตามแผนแม่บทเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร (IT Master Plan) ที่เปลี่ยนระบบซื้อขายหลักทรัพย์ใหม่แล้วเสร็จในปี 2555 และแผนแม่บทงานปฏิบัติการ (Operations Master Plan) ที่จัดทำแผนแล้วเสร็จในปี 2555 ทั้งนี้ แผนงานสำคัญสำหรับปี 2556 ประกอบด้วย (1) การพัฒนาระบบซื้อขายและระบบชำระราคาตราสารอนุพันธ์ และระบบชำระราคาตราสารทุน รวมถึงการยกระดับระบบซื้อขายทางอินเทอร์เน็ตสำหรับผู้ลงทุนให้มีประสิทธิภาพสูงขึ้น (2) การร่วมมือกับตลาดหลักทรัพย์ในอาเซียน เพื่อพัฒนาการเชื่อมโยงระบบหลังการซื้อขายหลักทรัพย์อาเซียน ต่อจาก ASEAN Trading Link ที่เริ่มให้บริการแล้วเมื่อตุลาคม 2555 และ (3) การเพิ่มประสิทธิภาพกระบวนการบริหารความเสี่ยงขององค์กร (enterprise risk management) และของสำนักหักบัญชี

การพัฒนาตลาดทุนระยะยาว

ในปี 2556 งานด้านพัฒนาตลาดทุนระยะยาวของตลาดหลักทรัพย์ฯ จะมุ่งพัฒนาขีดความสามารถของผู้ร่วมตลาดทุนในทุกกลุ่มอย่างต่อเนื่อง

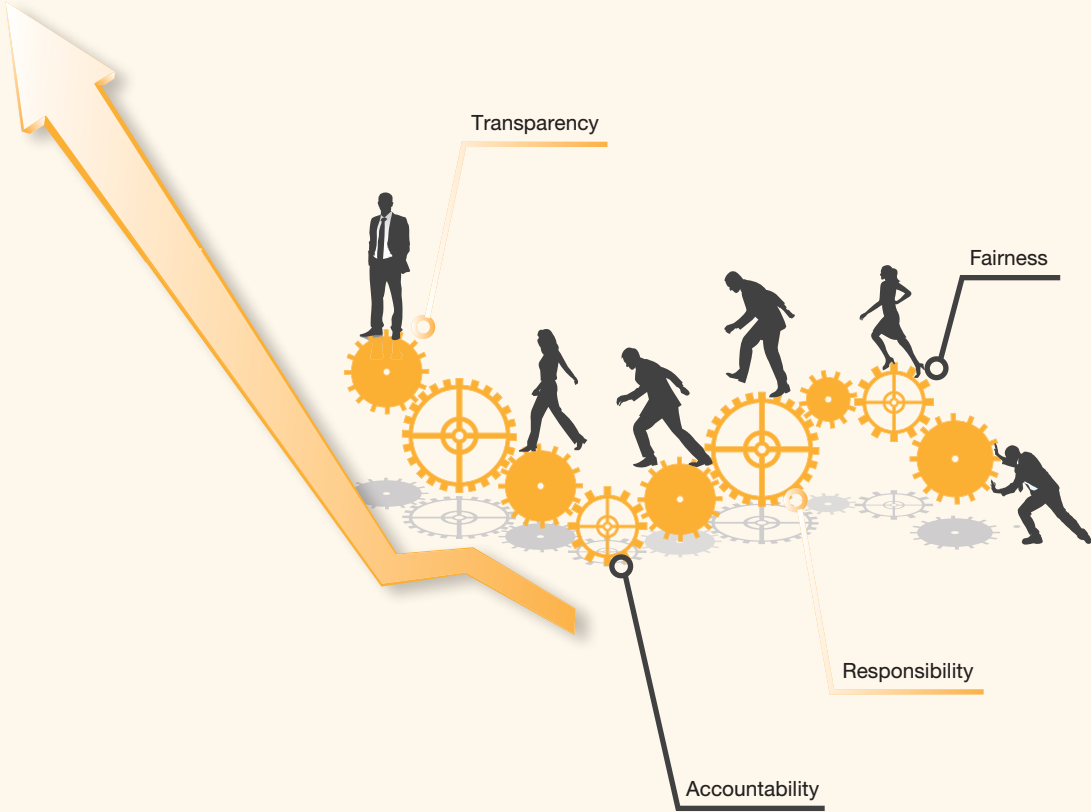
ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะพัฒนาบริษัทจดทะเบียนเพื่อความยั่งยืน โดยเฉพาะ (1) การส่งเสริมให้สถาบันธุรกิจเพื่อสังคม (Corporate Social Responsibility Institute : CSRI) เป็นสถาบันหลักด้าน CSR ของบริษัทจดทะเบียน (2) การเตรียมความพร้อมด้านการเปิดเผยข้อมูล ESG (Environmental, Social, and Governance) ให้แก่บริษัทจดทะเบียนที่อยู่ใน invited list ของ Dow Jones Sustainability Index (DJSI) เพื่อให้สามารถพัฒนาเป็นหลักทรัพย์ใน DJSI (3) การให้ความรู้ด้านการประเมิน ASEAN CG Scorecard แก่บริษัทจดทะเบียนเป้าหมายในกลุ่ม SET100 เพื่อเพิ่มศักยภาพของบริษัทจดทะเบียนไทยให้เป็นหลักทรัพย์ที่นำลงทุนในมุมมองของผู้ลงทุนต่างประเทศ และเตรียมความพร้อมของบริษัทจดทะเบียนไทยสู่ประชาคมเศรษฐกิจอาเซียน และ (4) การพัฒนาความสัมพันธ์ด้านนักลงทุนสัมพันธ์ (investor relations) ให้แก่บริษัทจดทะเบียน

ในด้านการยกระดับความรู้ความสามารถด้านการเงินและการลงทุนให้แก่ประชาชน ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะพัฒนาความรู้ด้านการวางแผนทางการเงินและการลงทุนเพื่อขยายฐานผู้ลงทุนที่มีเงินออมในจังหวัดที่เป็นหัวเมืองในแต่ละภูมิภาค 15,000 คน พัฒนาทักษะการลงทุนเชิงลึกให้แก่ผู้ลงทุน 2,300 คน ตลอดจนพัฒนาความรู้ความเข้าใจพื้นฐานทางการเงินแก่เยาวชนและประชาชนทั่วไปผ่านโครงการสำคัญ เช่น โครงการ Young Financial Star (YFS) 4,000 คน และโครงการเพิ่มศักยภาพครูผู้สอนหลักสูตรการเงินของมีค่า 1,000 คน เป็นต้น

สำหรับผู้ประกอบวิชาชีพในตลาดทุนนั้น ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะยกระดับมาตรฐานความรู้และเนื้อหาหลักสูตรใบอนุญาตผู้ประกอบวิชาชีพ ตลอดจนดูแลมาตรฐานการตรวจสอบและจัดอบรมของผู้ให้บริการ นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะพัฒนาทักษะความรู้ให้แก่บุคลากรที่ปฏิบัติงานในตลาดทุน 3,100 คน

สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุน จะสนับสนุนการขับเคลื่อนแผนพัฒนาตลาดทุนไทย ให้มีความครบถ้วน มีพลวัต สอดคล้องกับสถานการณ์ รวมถึงส่งเสริมให้ผู้ร่วมตลาดและสถาบันการศึกษา ร่วมกันสร้างองค์ความรู้ด้านตลาดทุนที่จะมีผลต่อการพัฒนาตลาดทุนในระยะยาว

Good Corporate
Governance



सानโอกาส สร้างความเชื่อมั่น ด้วยการกำกับดูแลกิจการที่ดี

ปฏิบัติงานด้วยความซื่อสัตย์ โปร่งใส
มีหลักการ พร้อมความเป็นมืออาชีพ
เพื่อยกระดับความน่าเชื่อถือของประเทศ

การปฏิบัติตามหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี ของตลาดหลักทรัพย์ฯ

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้ความสำคัญการดำเนินงานโดยยึดหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดีมาโดยตลอด เพื่อสร้างความเชื่อมั่นและความน่าเชื่อถือในการดำเนินงาน ตลอดจนสร้างความไว้วางใจต่อผู้มีส่วนได้เสียทุกฝ่าย ทั้งนี้ ในปี 2555 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้อนุมัติให้จัดทำ “แผนงานยกระดับการกำกับดูแลกิจการของตลาดหลักทรัพย์ฯ” โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีพัฒนาการด้านการกำกับดูแลกิจการอย่างชัดเจนและเป็นรูปธรรม และกำหนดให้มีการวัดประสิทธิผลการดำเนินการด้านการกำกับดูแลกิจการของตลาดหลักทรัพย์ฯ ผ่านการประเมินโดยสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการไทย (IOD) ซึ่งเป็นหน่วยงานอิสระที่ทำหน้าที่ประเมินรายการการกำกับดูแลกิจการให้กับบริษัทจดทะเบียน ทั้งนี้ ผลการประเมินการกำกับดูแลกิจการของตลาดหลักทรัพย์ฯ พบว่าอยู่ในระดับที่ดีมาก เป็นที่น่าพอใจ

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มุ่งเน้นในเรื่องการรักษามาตรฐานควบคู่กับการพัฒนาการกำกับดูแลกิจการที่ดีให้เป็นไปอย่างต่อเนื่องและยั่งยืน และการสร้างวัฒนธรรมองค์กรด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดี โดยตลอดปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มีการดำเนินการต่างๆ ที่เป็นการส่งเสริมการกำกับดูแลกิจการที่ดี อาทิ

- ปรับปรุง “นโยบายการกำกับดูแลกิจการ” และ “จรรยาบรรณของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ” เพื่อที่จะยกระดับมาตรฐานของการกำกับดูแลกิจการให้ดียิ่งขึ้น และสอดคล้องกับหลักการในระดับสากล โดยได้ผ่านการพิจารณาจากคณะกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการ และนำเสนอขออนุมัติต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ในการประชุมเดือนกรกฎาคม 2555
- สื่อสารสาระสำคัญของนโยบายการกำกับดูแลกิจการ และจรรยาบรรณฯ ให้กับกรรมการ ผู้บริหาร และพนักงานทุกระดับชั้น เพื่อสร้างความรู้ ความเข้าใจในการปฏิบัติตามหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี ผ่านการดำเนินการต่างๆ ได้แก่
 - เผยแพร่นโยบายการกำกับดูแลกิจการ และจรรยาบรรณฯ ผ่านทางระบบเครือข่ายภายใน (Intranet) และเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ
 - จัดประชุมเพื่อชี้แจงสาระสำคัญของนโยบายการกำกับดูแลกิจการ และจรรยาบรรณฯ ให้กับพนักงาน เพื่อสร้างความเข้าใจในการปฏิบัติตามหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดีได้อย่างถูกต้อง
 - จัดทำบทความเพื่อให้ข้อมูล ข่าวสารด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดี ผ่าน Intranet คอลัมน์ “CG Corner” อย่างสม่ำเสมอ
 - จัดงาน CG Day ประจำปี 2555 ภายใต้ชื่อ “จิตสำนึกของ CG เริ่มที่ตัวเอง” โดยเชิญกรรมการและผู้จัดการ และผู้บริหารระดับสูงในสายงานกฎหมาย และสายงานบริหาร มาร่วมเสวนาพิเศษในหัวข้อ “CG Policy in Focus” นอกจากนี้ ยังมีกิจกรรมอื่นเพื่อเสริมสร้างความเข้าใจในการปฏิบัติตามหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี อาทิ แข่งขันตอบคำถาม CG Quiz บอร์ดนิทรรศการ CG ฯลฯ

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เชื่อมั่นเป็นอย่างยิ่งว่าการดำเนินงานด้วยการยึดมั่นรักษามาตรฐานการกำกับดูแลกิจการที่ดีให้อยู่ในระดับสูง จะสนับสนุนให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ เติบโตได้อย่างยั่งยืน

การปฏิบัติตามหลักการกำกับดูแลกิจการในด้านต่างๆ (CG Principles)

1. สิทธิของสมาชิก

ตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นนิติบุคคลเฉพาะที่จัดตั้งตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ จึงมิได้จัดตั้งในรูปบริษัทและไม่มีผู้ถือหุ้น อย่างไรก็ตาม พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ได้กำหนดให้คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ จัดให้มีการประชุมสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อพิจารณาเลือกตั้งกรรมการที่มาจากสมาชิก อนุมัติงบดุลและบัญชีรายได้รายจ่ายประจำปี แต่งตั้งผู้สอบบัญชีรวมทั้งประโยชน์ตอบแทน และอนุมัติค่าตอบแทนกรรมการ ทั้งนี้ คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้กำหนดหลักเกณฑ์และวิธีการเกี่ยวกับการเลือกตั้งกรรมการที่มาจากสมาชิก โดยกำหนดให้สมาชิกเสนอชื่อผู้ที่สมควรจะเป็นกรรมการต่อที่ประชุมสมาชิก และให้สมาชิกออกเสียงเลือกตั้งกรรมการจากผู้ที่ได้รับการเสนอชื่อดังกล่าวได้รายละหนึ่งเสียง

นอกเหนือจากการดูแลสิทธิของสมาชิกตามที่กำหนดไว้ในพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์แล้ว ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังได้จัดกิจกรรมต่างๆ เพื่อส่งเสริมการรักษาสัมพันธ์อันดีระหว่างสมาชิกกับตลาดหลักทรัพย์ฯ รวมถึงองค์กรอื่นที่เกี่ยวข้องในตลาดทุน อาทิ

- **จัดประชุม CEO Networking** โดยเชิญกรรมการผู้จัดการหรือผู้บริหารระดับสูงของบริษัทสมาชิกทุกแห่งมาพบปะสังสรรค์กันเพื่อเสริมสร้างความสัมพันธ์อันดีระหว่างกัน ตลอดจนเปิดโอกาสให้สมาชิกได้ร่วมแลกเปลี่ยนความคิดเห็นในการพัฒนาอุตสาหกรรมธุรกิจหลักทรัพย์
- **จัดประชุม SET&ASCO Executive Luncheon Meeting** อย่างสม่ำเสมอ โดยเป็นการประชุมระหว่างคณะกรรมการบริหารของสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย กับตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อหารือเกี่ยวกับปัญหาและอุปสรรคในการดำเนินธุรกิจหลักทรัพย์ ตลอดจนข้อเสนอแนะในการปรับปรุงระบบการทำงานที่เกี่ยวข้องกับอุตสาหกรรมธุรกิจหลักทรัพย์ รวมถึงผู้ที่เกี่ยวข้องหรือผู้มีส่วนได้เสียให้มีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น
- **จัดทำ Member Newsletter** เป็นรายไตรมาส เพื่อรวบรวมข้อมูลพัฒนาการสำคัญของสินค้าและบริการ และรวมถึงข่าวสารและกิจกรรมต่างๆ ในแวดวงตลาดทุนให้สมาชิกรับทราบ
- **จัดทำ CEO Letter** จากกรรมการและผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ ถึงกรรมการผู้จัดการของบริษัทสมาชิกทุกแห่งเพื่อให้ได้รับทราบข้อมูล ข่าวสาร ความคืบหน้าสำคัญต่างๆ ของตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นประจำทุกต้นเดือน โดยเริ่มจัดทำตั้งแต่เดือนสิงหาคม 2555 ซึ่งกิจกรรมต่างๆ ที่ดำเนินการมาตลอดปี 2555 ได้รับการตอบรับเป็นอย่างดีจากบริษัทสมาชิก โดยมีการจัดประชุม CEO Networking รวม 2 ครั้ง จัดประชุม ASCO Lunch รวม 7 ครั้ง เผยแพร่ Member Newsletter 4 ฉบับ และ CEO Letter รวม 5 ฉบับ

2. การปฏิบัติต่อสมาชิกอย่างเท่าเทียมกัน

ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีนโยบายที่จะปฏิบัติต่อสมาชิกทุกรายอย่างเท่าเทียมกันและเป็นธรรม มีกระบวนการจัดประชุมสมาชิกที่โปร่งใส เปิดโอกาสให้สมาชิกทุกรายมีสิทธิในการแสดงความคิดเห็นอย่างเป็นอิสระ และมีหน่วยงานที่รับผิดชอบโดยตรงในการรับฟังความคิดเห็น ข้อเสนอแนะ และข้อหารือจากสมาชิก เพื่อนำมาพิจารณาดำเนินการปรับปรุงการดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ อันจะเป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาการดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ และสมาชิกโดยรวม

ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนดให้มีการจัดประชุมสามัญสมาชิกปีละหนึ่งครั้ง ภายในสี่เดือนนับแต่วันสิ้นสุดรอบระยะเวลาบัญชี โดยจะส่งหนังสือนัดประชุมพร้อมระเบียบวาระการประชุมแก่สมาชิกล่วงหน้าก่อนวันประชุมไม่น้อยกว่า 7 วัน และเปิดโอกาสให้สมาชิกสามารถแจ้งวาระการประชุมล่วงหน้าได้ คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ อาจเรียกประชุมวิสามัญสมาชิกเมื่อใดก็ได้ตามที่เห็นสมควร นอกจากนี้ หากสมาชิกจำนวนไม่น้อยกว่าหนึ่งในห้าของจำนวนสมาชิกทั้งหมดร้องขอให้เรียกประชุม คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ จะจัดให้มีการประชุมตามที่สมาชิกร้องขอ

ในการประชุมจะกำหนดให้ประธานกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นประธานในที่ประชุม และจะต้องมีสมาชิกเข้าร่วมประชุมไม่น้อยกว่าสามในสี่ของจำนวนสมาชิกทั้งหมดจึงจะเป็นองค์ประชุม ซึ่งการประชุมโดยปกติจะจัดขึ้นที่อาคารตลาดหลักทรัพย์ฯ ถนนรัชดาภิเษก เริ่มตั้งแต่วันที่ 16.00 น. เป็นต้นไป เพื่อให้สมาชิกสามารถเข้าประชุมได้ครบองค์ประชุม

ในปี 2555 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดให้มีการประชุมสามัญสมาชิกในวันที่ 25 เมษายน 2555 โดยมีประธานกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นประธานที่ประชุม และมีกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เข้าร่วมประชุม 7 ท่าน นอกจากนี้ยังจัดให้มีการประชุมวิสามัญสมาชิกจำนวน 4 ครั้ง มีสมาชิกเข้าร่วมประชุมโดยเฉลี่ยร้อยละ 89 โดยสมาชิกได้ใช้สิทธิออกเสียงในการเลือกตั้งกรรมการ การอนุมัติค่าตอบแทนประธานกรรมการและกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ การแต่งตั้งผู้สอบบัญชี พิจารณาเรื่องที่มีผลต่อสมาชิก รวมทั้งรับฟังความเห็นในเรื่องที่เกี่ยวข้องกับสมาชิกทุกราย ได้แก่

- การปรับปรุงเกณฑ์การซื้อขายเพื่อรองรับระบบการซื้อขายตราสารทุนใหม่
- การซื้อขายกองทรัสต์เพื่อการลงทุนในอสังหาริมทรัพย์ (REIT)
- การยกเลิกใบสำคัญแสดงสิทธิระยะสั้น
- การทบทวนข้อกำหนดที่เกี่ยวข้องกับสมาชิกและการซื้อขาย
- การสนับสนุนให้บริษัทสมาชิกกำกับดูแลตนเอง (SRO)

3. บทบาทของผู้มีส่วนได้เสีย และการปฏิบัติต่อผู้มีส่วนได้เสีย

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยึดมั่นดำเนินงานด้วยความรับผิดชอบต่อผู้มีส่วนได้เสีย ปฏิบัติต่อผู้มีส่วนได้เสียทุกกลุ่มอย่างเป็นธรรมและเท่าเทียมกัน ไม่ว่าจะเป็นคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ บริษัทสมาชิก บริษัทจดทะเบียน บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ผู้ลงทุน

และพนักงานของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ รวมถึงลูกค้า ลูกค้า เจ้าหนี้ คู่แข่ง ภาครัฐ ตลอดจนองค์กรอื่นๆ ในสังคม ซึ่งได้มีการกำหนดข้อพึงปฏิบัติไว้อย่างชัดเจนใน “จรรยาบรรณของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ” โดยสรุปสาระสำคัญของการปฏิบัติต่อผู้มีส่วนได้เสีย ดังนี้

3.1 ผู้ลงทุน และประชาชนทั่วไป

- มุ่งมั่นพัฒนาสินค้าและผลิตภัณฑ์ทางการเงินที่หลากหลาย เพื่อตอบสนองความต้องการของผู้ลงทุน ด้วยบริการที่ดีเลิศ ภายใต้เงื่อนไขที่เป็นธรรม และให้ข้อมูลเกี่ยวกับผลิตภัณฑ์และบริการที่ถูกต้องเพียงพอ และทันต่อเหตุการณ์โดยไม่มีการกล่าวเกินความเป็นจริงอันเป็นเหตุให้ผู้ลงทุนและประชาชนทั่วไปเกิดความเข้าใจผิดเกี่ยวกับคุณภาพ ปริมาณ หรือเงื่อนไขใดๆ ของสินค้าหรือบริการ
- มุ่งมั่นสร้างความพึงพอใจให้กับผู้ลงทุนให้ได้รับบริการอย่างมีคุณภาพที่ดีเลิศภายใต้ความปลอดภัยและเทคโนโลยีที่เหมาะสม รวมทั้งยกระดับการบริการให้สูงขึ้นอย่างต่อเนื่อง
- เปิดเผยข้อมูลข่าวสารที่ครบถ้วน ถูกต้อง และทันเหตุการณ์ โดยไม่บิดเบือนข้อเท็จจริง รวมทั้งปรับปรุงคุณภาพการให้บริการข้อมูลอย่างต่อเนื่อง
- จัดระบบการให้บริการรับข้อร้องเรียนจากผู้ลงทุน และประชาชนทั่วไป และดำเนินการตอบสนองความต้องการอย่างรวดเร็ว พร้อมทั้งให้ความสำคัญกับการรักษาข้อมูลความลับ ไม่นำข้อมูลความลับไปใช้เพื่อประโยชน์ของตนเอง และผู้ที่เกี่ยวข้อง
- ดูแลสิทธิประโยชน์ของผู้ลงทุนโดยจัดตั้งกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์ (Securities Investor Protection Fund: SIPF) เมื่อปี 2547 และกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives Investor Protection Fund: DIPF) ตั้งแต่วันที่ 15 พฤศจิกายน 2555
- สร้างความรู้ ความเข้าใจในตลาดทุน และเผยแพร่ข้อมูลที่เป็นประโยชน์แก่ผู้ลงทุนและประชาชนทั่วไป ให้รับทราบข้อมูลการจัดกิจกรรมของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ อย่างทั่วถึง ผ่านช่องทางต่างๆ

3.2 บริษัทสมาชิก / บริษัทจดทะเบียน / บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน

- รับฟังความคิดเห็นจากผู้ที่เกี่ยวข้อง ทั้งในกรณีมีการปรับปรุงหลักเกณฑ์ หรือออกหลักเกณฑ์ใหม่ๆ รวมทั้งสร้างความรู้ความเข้าใจเพื่อการปฏิบัติตามข้อกำหนดต่างๆ ได้อย่างถูกต้อง เป็นมาตรฐานเดียวกัน
- จัดกิจกรรมเพื่อประชาสัมพันธ์ข้อมูลของบริษัทจดทะเบียน บริษัทหลักทรัพย์ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน และหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ให้แก่นักลงทุนและประชาชนทั่วไปได้รับทราบข้อมูลอย่างทั่วถึง และเป็นการสร้างความเชื่อมั่นที่ดีในการลงทุน อาทิ จัดงาน Thailand Focus จัด Roadshow ในต่างประเทศ จัดงาน Opportunity Day และจัดงาน Set in the City เป็นต้น
- พัฒนาระบบการกำกับดูแลกิจการที่ดีของบริษัทจดทะเบียน โดยมี “ศูนย์พัฒนาการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน” (CG Center) ทำหน้าที่ส่งเสริมให้บริษัทจดทะเบียนตระหนักถึงความสำคัญและประโยชน์ของการกำกับดูแลกิจการที่ดีทั้งต่อบริษัทและต่อผู้มีส่วนได้เสีย ตลอดจนผลักดันให้นำหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดีไปปรับใช้และปฏิบัติอย่างจริงจัง (รายละเอียดการดำเนินงานในปี 2555 ระบุอยู่ใน “พัฒนาการสำคัญของตลาดหลักทรัพย์ฯ ในปี 2555”)

สรุปกิจกรรมหรือโครงการสำคัญที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำเนินการในปี 2555 โดยคำนึงถึงการดูแลสิทธิของผู้ลงทุน บริษัทจดทะเบียน บริษัทหลักทรัพย์ ตลอดจนองค์กรอื่นๆ ที่เกี่ยวข้องในตลาดทุน

กิจกรรม / โครงการสำคัญที่ดำเนินการ ในปี 2555	
ผลิตภัณฑ์ทางการเงิน	• เปิดซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงกับดัชนีหมวดธุรกิจ หรือ Sector Index Futures เพื่อให้เป็นเครื่องมือช่วยให้ผู้ลงทุนสามารถบริหารพอร์ตลงทุนได้อย่างมีประสิทธิภาพ • เปิดซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐอเมริกา หรือ ดอลลาร์ล่วงหน้า (USD Futures) เปิดโอกาสให้ผู้ประกอบธุรกิจขนาดกลางและขนาดเล็ก ตลอดจนผู้ลงทุนทั่วไปสามารถบริหารความเสี่ยงจากความผันผวนของอัตราแลกเปลี่ยนระหว่างเงินบาทกับเงินดอลลาร์สหรัฐอเมริกา ซึ่งเป็นเงินสกุลที่สำคัญของโลกที่ใช้ในการสื่อสารและแลกเปลี่ยนสินค้าระหว่างประเทศกันอย่างกว้างขวางได้อย่างมีประสิทธิภาพ

กิจกรรม / โครงการสำคัญที่ดำเนินการ ในปี 2555

การสนับสนุนบริษัท ผู้ออกหลักทรัพย์และ บริษัทจดทะเบียน	- จัดงาน “Thailand Focus 2012-Positioning Thailand For the Next Growth Phase” เพื่อให้ผู้ลงทุนต่างประเทศได้มีโอกาสสอบถามข้อมูลสำคัญโดยตรงกับผู้บริหารระดับสูงทั้งภาครัฐและภาคเอกชน รวมถึงรับทราบข้อมูลผลประกอบการของบริษัทจดทะเบียนชั้นนำ โดยมีผู้ลงทุนสถาบันให้ความสนใจเข้าร่วมงาน 122 ราย บริษัทจดทะเบียนร่วมนำเสนอข้อมูล 89 แห่ง และการประชุม 1,065 ครั้ง นอกจากนี้ ยังเป็นครั้งแรกที่มีผู้บริหารระดับสูงของตลาดหลักทรัพย์อินโดจีน 4 แห่ง และบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์อินโดจีน อีก 4 แห่ง เข้าร่วมงานอีกด้วย เป็นการต่อยอดสถานะของตลาดหลักทรัพย์ไทยในการเป็นประตูสู่การลงทุนในภูมิภาคอินโดจีนได้เด่นชัดยิ่งขึ้น - จัด roadshow เพื่อเผยแพร่ข้อมูลสำคัญของบริษัทจดทะเบียนแก่ผู้ลงทุนต่างประเทศ โดยในปี 2555 มีการจัด roadshow รวม 6 ครั้ง ในประเทศต่างๆ เช่น สิงคโปร์ ชองกง มาเลเซีย ญี่ปุ่น สหราชอาณาจักร สหรัฐอเมริกา และแคนาดา มีบริษัทจดทะเบียนเข้าร่วม Roadshow กับตลาดหลักทรัพย์ฯ กว่า 26 บริษัท
การดูแลสิทธิและ ผลประโยชน์ของผู้ลงทุน	จัดตั้งกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives Investor Protection Fund: DIPF) ตั้งแต่วันที่ 15 พฤศจิกายน 2555 โดยในช่วงเริ่มต้นมีมูลค่ากองทุน 100 ล้านบาท เพื่อคุ้มครองลูกค้าผู้ลงทุนบุคคลและนิติบุคคลในประเทศที่ไม่ใช่ผู้ลงทุนสถาบันที่ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ซื้อขายในตลาดอนุพันธ์ผ่านบริษัทหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกกองทุนเพื่อสร้างความเชื่อมั่นและเป็นหลักประกันความมั่นใจของผู้ลงทุนในการได้รับความคุ้มครอง
สนับสนุนการกำกับดูแล กิจการให้กับบริษัท จดทะเบียน	- ปรับปรุง “หลักการกำกับดูแลกิจการที่ดีสำหรับบริษัทจดทะเบียน” ให้สอดคล้องกับมาตรฐานของ ASEAN CG Scorecard เพื่อยกระดับมาตรฐานและการปฏิบัติตามการกำกับดูแลกิจการที่ดี และเพื่อเตรียมความพร้อมให้บริษัทจดทะเบียนไทยสู่การแข่งขันในระดับภูมิภาค ก้าวสู่ ASEAN Economic Community (AEC) ที่จะเกิดขึ้นในปี 2558 - กำหนดกรอบการพัฒนางานด้านนักลงทุนสัมพันธ์ (IR) 3 ด้านหลัก ด้านแรก ได้แก่ การให้ความรู้และส่งเสริมให้ปฏิบัติ ซึ่งมีโครงการให้คำปรึกษาเชิงลึก (SET's IR Advising Program) เป็นแผนงานหลัก และเสริมด้วยการจัดสัมมนาเชิงปฏิบัติการต่างๆ ด้านที่สองคือการพัฒนามาตรฐานการประกอบวิชาชีพโดยได้จัดทำและเผยแพร่คู่มือ “ก้าวแรกสู่แก่นักลงทุนสัมพันธ์” เพื่อให้แก่นักลงทุนสัมพันธ์ได้นำแนวทางปฏิบัติต่างๆ ไปปรับใช้ให้เหมาะสมกับองค์กร และด้านสุดท้ายคือ การยกย่องส่งเสริมบริษัทจดทะเบียนที่มีความโดดเด่นด้านนักลงทุนสัมพันธ์ด้วยการมอบรางวัล Best IR Awards ซึ่งจะมีการประกาศผลในงาน SET Awards - สถาบันธุรกิจเพื่อสังคม (CSRI) ภายใต้การดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดให้มีการมอบรางวัล CSRI Recognition 2012 เป็นการเพิ่มเติมจากรางวัล CSR Awards เพื่อประกาศเกียรติคุณยกย่อง และเป็นกำลังใจแก่บริษัทจดทะเบียนที่มีความมุ่งมั่นตั้งใจในการพัฒนาและดำเนินธุรกิจอย่างมีความรับผิดชอบต่อสังคมอย่างต่อเนื่อง พร้อมสร้างแรงจูงใจให้บริษัทจดทะเบียนอื่นๆ ได้มีการพัฒนาศักยภาพขององค์กรเพื่อเพิ่มคุณค่าให้องค์กรได้รับความสนใจจากผู้ลงทุนและสาธารณชน

กิจกรรม / โครงการสำคัญที่ดำเนินการ ในปี 2555

การให้ข้อมูลและ ช่องทางการเผยแพร่ ข้อมูลแก่ผู้ลงทุนและ ประชาชนทั่วไป	- จัดงาน SET in the City เพื่อเป็นศูนย์กลางในการพบปะระหว่างผู้ลงทุนและประชาชนทั่วไป กับบริษัทหลักทรัพย์ บริษัทจดทะเบียน บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม และหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง เพื่อให้ข้อมูลความรู้เกี่ยวกับการลงทุนอย่างใกล้ชิดอันจะเป็นการสร้างเชื่อมั่นที่ดีในการลงทุน โดยตลอดทั้งปี 2555 มีการจัดงานรวมทั้งสิ้น 3 ครั้งที่จังหวัดภูเก็ต จังหวัดอุดรธานี และจังหวัดกรุงเทพมหานคร โดยมีผู้เข้าร่วมกิจกรรมทั้งสิ้น 132,500 คน และมีธุรกรรมการลงทุนเกิดขึ้นจำนวน 17,400 รายการ - จัดกิจกรรม Opportunity Day หลังประกาศงบการเงินทุกไตรมาส มีวัตถุประสงค์ให้บริษัทจดทะเบียนได้พบนักวิเคราะห์หลักทรัพย์ นักลงทุน และสื่อมวลชน เพื่อชี้แจงข้อมูลเกี่ยวกับธุรกิจและการดำเนินงานของบริษัท รวมทั้งเปิดโอกาสให้มีการสอบถามข้อมูลโดยตรงจากผู้ประกอบการ ซึ่งจากการจัดกิจกรรมในปี 2555 มีจำนวนผู้เข้าร่วมงานอย่างสูง แบ่งเป็นผู้ลงทุน 13,947 คน นักวิเคราะห์ 2,081 คน และสื่อมวลชน 2,288 คน และยังมีช่องทางการเข้าถึงข้อมูลที่สะดวกและง่ายขึ้นผ่านการถ่ายทอดสดทาง www.set.or.th และ smart phone โดยตลอดปี 2555 มีบริษัทเข้าร่วมและสนใจถ่ายทอดสดรวม 175 บริษัท เพิ่มขึ้น 13% จากปี 2554 โดยมีผู้เข้าชมถ่ายทอดสดและรับชมย้อนหลัง 261,948 ราย จาก 118 ประเทศ นอกจากนี้ ในปี 2555 ได้มีการพัฒนาแอปพลิเคชัน “OppDay” เพิ่มเติมบน iPad เพื่อเป็นการอำนวยความสะดวกให้ผู้ลงทุนในการเข้าถึงข้อมูลบริษัทจดทะเบียน โดยผู้ลงทุนสามารถรับชมกิจกรรม และดาวน์โหลดข้อมูลสำคัญของบริษัทจดทะเบียนทุกบริษัทที่สรุปไว้ในรูปแบบ factsheet - ร่วมออกบูธในงาน Money Expo เพื่อเผยแพร่ข้อมูลสินค้าและบริการของตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดอนุพันธ์ให้กับผู้ลงทุนและประชาชนทั่วไปได้รับทราบอย่างทั่วถึง โดยในปี 2555 มีการเข้าร่วมกิจกรรมทั้งสิ้น 4 ครั้ง ในจังหวัดเชียงใหม่ สงขลา นครราชสีมา และกรุงเทพมหานคร - เมื่อวันที่ 23 มกราคม 2555 เริ่มให้มีการเผยแพร่ข้อมูลรายชื่อหลักทรัพย์ที่มีระดับราคาและปริมาณการซื้อขายที่มีแนวโน้มผิดปกติเมื่อเทียบกับช่วงก่อนหน้า หรือ Trading Alert List บนเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ และระบบข้อมูล SETSMART ทุกวันก่อนเปิดซื้อขาย เพื่อเตือนให้ผู้ลงทุนใช้ความระมัดระวังในการซื้อขายมากขึ้น - เริ่มให้มีการใช้ระบบเปิดเผยข้อมูลบริษัทจดทะเบียนในรูปแบบ Straight Through เมื่อวันที่ 30 มกราคม 2555 เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการเผยแพร่ข่าวบริษัทจดทะเบียนแก่ผู้ลงทุนโดยตรงผ่านเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ และระบบข้อมูล SETSMART ซึ่งเป็นระบบที่อยู่ในมาตรฐานเทียบเท่าตลาดหุ้นชั้นนำของภูมิภาค - พัฒนาเว็บแอปพลิเคชัน “Settrade Streaming for Android” เพิ่มเติมสำหรับซื้อขายหุ้นและอนุพันธ์เรียลไทม์สำหรับผู้ใช้อุปกรณ์ Samsung Galaxy ผ่าน smart phone และ tablet
---	---

3.3 พนักงาน

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ตระหนักดีว่าพนักงานเป็นทรัพยากรที่มีคุณค่าอย่างยิ่ง ตลาดหลักทรัพย์ฯ สรรหาและว่าจ้างบุคลากรที่มีความสามารถและประสบการณ์เข้ามาปฏิบัติงาน สัมพันธ์กับการเจริญเติบโตและความต้องการของตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยจำนวนพนักงาน ณ 31 ธันวาคม 2555 เท่ากับ 723 คน และ Turnover rate ในปี 2555 เท่ากับ 7.8%

การพัฒนาพนักงาน

มุ่งมั่นพัฒนาพนักงานอย่างต่อเนื่องเพื่อเพิ่มพูนความรู้และทักษะที่จำเป็นต่อการเจริญเติบโตในหน้าที่การงาน โดยในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดหลักสูตรอบรมทั้งสิ้น 53 หลักสูตร สำหรับผู้บริหารและพนักงาน ซึ่งได้รวมอบรมทั้งสิ้นรวม 2,111 วัน (man-days) คิดเป็น 80% ของพนักงานทั้งหมด รวมงบประมาณอบรม 6,612,000 บาท โดยมุ่งเน้นเรื่อง leadership / managerial การทำแผนธุรกิจ และการดูแลบริหารจัดการลูกค้า (customer centric) ตลอดจนความรู้เฉพาะเรื่องในการปฏิบัติหน้าที่ของแต่ละหน่วยงาน (functional skills)

- จัดให้มีโครงการ Leadership Development Program โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อพิจารณาคัดเลือก พัฒนา และรักษานักงานที่มีคุณลักษณะ และศักยภาพที่สามารถเติบโตเป็นผู้บริหารเพื่อมาบริหารองค์กรให้แข่งขันได้ในอนาคต ซึ่งเป็นส่วนหนึ่งของแผนพัฒนาและสืบทอดตำแหน่ง ผู้จัดการและผู้บริหารระดับสูง

การบริหารผลตอบแทนและการดูแลสิทธิประโยชน์

- จัดให้มีระบบค่าตอบแทนพนักงานที่สอดคล้องกับสถานะเศรษฐกิจและผลสำเร็จระยะยาวขององค์กร และเทียบเคียงได้กับบริษัทชั้นนำ รวมทั้งปรับปรุงระบบการประเมินผลงานพนักงานให้มีความชัดเจนและอิงตามผลปฏิบัติงานจริง (performance based pay) และความก้าวหน้าของตลาดหลักทรัพย์ฯ
- ดูแลสวัสดิภาพและสวัสดิการของพนักงาน โดยมีการปฏิบัติต่อพนักงานอย่างเป็นธรรม อาทิ
 - มีกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้สวัสดิการค่ารักษาพยาบาล สวัสดิการให้กู้ยืมเงิน รวมทั้งช่วยเหลือด้านเงินกู้กรณีฉุกเฉิน
 - มีสหกรณ์ออมทรัพย์เพื่อส่งเสริมการออม และการช่วยเหลือทางการเงินซึ่งกันและกันระหว่างกลุ่มพนักงานที่เป็นสมาชิกของสหกรณ์
 - มีทุนการศึกษาแก่พนักงานเพื่อศึกษาต่อในระดับปริญญาโททั้งในประเทศและต่างประเทศ ปีละ 5 ทุน โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อพัฒนาความรู้ ความสามารถ และศักยภาพในการปฏิบัติงานเพิ่มขึ้นในสาขาวิชาที่จำเป็นหรือเป็นประโยชน์โดยตรงต่อการปฏิบัติงานและธุรกิจขององค์กร
 - มีสโมสรพนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อเป็นศูนย์รวมให้พนักงานมีส่วนร่วมทำกิจกรรมต่างๆ ที่เป็นประโยชน์ต่อสุขภาพของพนักงาน ครอบครัว และสังคม
 - จัดสิ่งแวดล้อมในการทำงานโดยคำนึงถึงสุขอนามัย และความปลอดภัยในสถานที่ทำงาน รวมถึงการจัดซ่อมหนีไฟประจำปี
 - ส่งเสริมให้พนักงานมีสุขภาพอนามัยที่แข็งแรงและมีความสุข โดยจัดให้มีการตรวจสุขภาพประจำปีแก่พนักงาน และจัดให้มีสถานที่ออกกำลังกาย รวมถึงการประกันชีวิตและสุขภาพ

การส่งเสริมการมีส่วนร่วมของพนักงาน

- จัดให้มีการสื่อสารระหว่างผู้บริหารและพนักงานในเรื่องของเป้าหมาย ทิศทาง แผนกลยุทธ์ และแผนพัฒนาตลาดทุน โดยจัด town hall meeting เพื่อให้กรรมการและผู้จัดการได้สื่อสารนโยบาย แนวทางและทิศทางการดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ แก่พนักงานอย่างเป็นประจำและต่อเนื่อง ตลอดจนรับฟังข้อคิดเห็นและข้อเสนอแนะจากพนักงานทุกระดับอย่างเท่าเทียมและเสมอภาค
- การประชุมระหว่างผู้บริหาร
 - Business Development Committee Meetings เป็นการประชุมระหว่างผู้บริหารในระดับหัวหน้าสายงาน ซึ่งจัดขึ้นอย่างสม่ำเสมอ เดือนละ 2 ครั้ง โดยจะมีการรับฟังความคิดเห็นจากผู้บริหารของแต่ละสายงาน ในเรื่องสำคัญที่มีผลต่อการตัดสินใจดำเนินงานเพื่อให้กรรมการและผู้จัดการได้รับทราบความคิดเห็นที่หลากหลาย และเป็นการเสริมสร้างความมีส่วนร่วมในการผลักดันเชิงธุรกิจ รวมทั้งสนับสนุนการทำงานร่วมกันอย่างมีประสิทธิภาพและประสิทธิผล
 - Senior Management Team Meetings เป็นการประชุมอย่างไม่เป็นทางการระหว่างผู้บริหารในระดับผู้ช่วยผู้จัดการขึ้นไป ซึ่งจัดขึ้นเป็นประจำทุกสัปดาห์ เพื่อเป็นการเสริมสร้างความสัมพันธ์ และร่วมแลกเปลี่ยนความคิดเห็นในงานสำคัญหรือเหตุการณ์ที่เกิดขึ้นในรอบสัปดาห์ที่แต่ละท่านดูแลรับผิดชอบ
 - Management Meetings เป็นการประชุมระหว่างผู้บริหารในระดับผู้อำนวยการฝ่ายขึ้นไป ซึ่งจัดขึ้นเป็นประจำทุกเดือนโดยมีวัตถุประสงค์เพื่อให้ผู้บริหารระดับสูงได้มีการแจ้งนโยบายที่สำคัญขององค์กร หรือความคืบหน้าของการดำเนินงานสำคัญให้แก่ผู้อำนวยการฝ่ายทุกท่านรับทราบและนำไปสื่อสารต่อพนักงานในฝ่ายงานของตน

การส่งเสริมความรู้ความเข้าใจด้านการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อม

- ในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดอบรมเพื่อสร้างความรู้ความเข้าใจด้านการอนุรักษ์สิ่งแวดล้อมในหัวข้อเรื่อง “Save Energy, Save the Earth: ประหยัดพลังงานง่ายๆ ใกล้ตัว” เพื่อให้พนักงานได้ตระหนักถึงการใชัทรัพยากรอย่างเข้าใจและมีความรู้ สามารถนำมาใช้กับตัวเอง และองค์กรได้

3.4 คู่ค้า

- ยึดถือนโยบายในการปฏิบัติต่อพันธมิตรคู่ค้าอย่างยุติธรรมและโปร่งใส ซึ่งตั้งอยู่บนพื้นฐานของการได้รับผลตอบแทนที่เป็นธรรมต่อทั้งสองฝ่าย ไม่ให้ผลประโยชน์ใดๆ ที่ไม่สุจริตกับคู่ค้า และปฏิบัติตามสัญญาหรือเงื่อนไขต่างๆ ที่ตกลงกันไว้อย่างเคร่งครัด กรณีที่ไม่สามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขข้อใดข้อหนึ่ง ต้องรีบแจ้งให้คู่ค้าทราบล่วงหน้า เพื่อร่วมกันพิจารณาหาแนวทางแก้ไข

- กำหนด “นโยบายการต่อต้านการทุจริตและการคอร์รัปชัน” ให้บุคลากรทุกคนในองค์กรปฏิบัติตามกฎหมาย ข้อบังคับ ระเบียบที่เกี่ยวข้องกับการต่อต้านการทุจริตและการคอร์รัปชันอย่างเคร่งครัด เพื่อสร้างความเชื่อมั่นต่อผู้มีส่วนได้เสียว่าตลาดหลักทรัพย์ฯ จะดำเนินธุรกิจด้วยความซื่อสัตย์สุจริตและโปร่งใส รวมทั้งสนับสนุนในการดำเนินกิจกรรมต่อต้านการทุจริตและการคอร์รัปชัน โดยมีการกำหนดแนวปฏิบัติเรื่องดังกล่าวไว้อย่างชัดเจน และสื่อสารให้ผู้บริหาร และพนักงานรับทราบและถือปฏิบัติตามอย่างเคร่งครัด

- กำหนดแนวปฏิบัติในการห้ามพนักงานรับสิ่งของหรือผลประโยชน์อื่นใดจากบุคคลอื่นที่มีหน้าที่หรือธุรกิจเกี่ยวข้องกับองค์กร โดยกำหนดเป็นแนวปฏิบัติอย่างชัดเจนเพื่อไม่ให้เกิดปัญหาความไม่โปร่งใส ไม่เป็นธรรม และเป็นการป้องกันไม่ให้เกิดปัญหาการทุจริตในการดำเนินธุรกิจ

- ในการคัดเลือกบริษัทที่จะมาเป็นคู่ค้ากับตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มีกระบวนการพิจารณาที่ชัดเจน โปร่งใส โดยดำเนินการตามระเบียบและวิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการจัดซื้อจัดจ้าง ซึ่งได้มีการกำหนดไว้อย่างชัดเจน และมีการเผยแพร่ให้ผู้บริหาร และพนักงานทุกคนในองค์กรรับทราบและถือปฏิบัติตามอย่างเคร่งครัด ทั้งนี้ กระบวนการในการพิจารณาคัดเลือกบริษัทที่จะมาเป็นคู่ค้ากับตลาดหลักทรัพย์ฯ สรุปได้ดังนี้

- กำหนดคุณสมบัติของบริษัทที่จะยื่นคำเสนอเข้ามาเป็นคู่ค้ากับตลาดหลักทรัพย์ฯ และเผยแพร่ข้อมูลให้บริษัททุกรายรับทราบอย่างทั่วถึงและเท่าเทียมกัน
- กำหนดหลักเกณฑ์ในการพิจารณาคัดเลือกคู่ค้าไว้อย่างชัดเจน โดยมีคณะทำงานจัดซื้อจัดจ้างซึ่งแต่งตั้งโดยกรรมการและผู้จัดการทำหน้าที่พิจารณาการคัดเลือกบริษัทที่จะมาเป็นคู่ค้ากับตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยพิจารณาถึงผลประโยชน์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นสำคัญ
- มีการจัดทำข้อตกลง หรือสัญญากับคู่ค้าไว้อย่างชัดเจน ไม่มีการกำหนดเงื่อนไขที่ไม่เป็นธรรมกับคู่ค้า
- ในการตรวจรับงานของคู่ค้าจะดำเนินการโดยคณะทำงานตรวจรับ ซึ่งไม่ใช่เป็นชุดเดียวกับคณะทำงานจัดซื้อ เพื่อทำหน้าที่ในการตรวจรับงาน ร่วมกับหน่วยงานที่รับผิดชอบในโครงการจัดซื้อจัดจ้างนั้นๆ ก่อนดำเนินการกระบวนการเบิกจ่ายเงินให้กับคู่ค้าตรงตามระยะเวลาที่กำหนดในสัญญา

3.5 เจ้าหนี้

- ปฏิบัติตามสัญญาหรือข้อตกลงต่างๆ ที่มีต่อเจ้าหนี้อย่างเคร่งครัด กรณีที่ไม่สามารถปฏิบัติตามได้ต้องรีบเจรจากับเจ้าหนี้ล่วงหน้าเพื่อร่วมกันหาแนวทางแก้ไขและป้องกันไม่ให้เกิดความเสียหาย

- บริหารงานเพื่อให้เจ้าหนี้มั่นใจในฐานะทางการเงิน และความสามารถในการชำระหนี้ที่ดี
- เปิดเผยข้อมูลทางการเงินที่ถูกต้อง ครบถ้วน อย่างสม่ำเสมอ

3.6 คู่แข่ง

- ปฏิบัติต่อคู่แข่งทางการค้าอย่างเป็นธรรม ไม่แสวงหาข้อมูลของคู่แข่งทางการค้าอย่างไม่สุจริต ไม่เข้าไปมีส่วนร่วมในกิจกรรมที่ไม่ชอบด้วยกฎหมายหรือลักลอบการกระทำเพื่อให้ได้ข้อมูลของคู่แข่งทางการค้า รวมทั้งไม่เอาเปรียบต่อคู่แข่งด้วยวิธีที่ไม่ชอบด้วยกฎหมาย

3.7 ภาครัฐ

- ตลาดหลักทรัพย์ฯ สนับสนุนการดำเนินงานของภาครัฐ และปฏิบัติตามหลักเกณฑ์และนโยบายของหน่วยงานกำกับ ควบคุมไปกับการส่งเสริมและสนับสนุนให้เกิดความร่วมมือในกิจกรรมต่างๆ ของหน่วยงานภาครัฐ เพื่อร่วมเสริมสร้างความมั่นคงและความเจริญเติบโตให้กับประเทศชาติ

3.8 สังคม ชุมชน และสิ่งแวดล้อม

• ตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งมั่นในการดำเนินงานด้วยความรับผิดชอบต่อสังคมและสิ่งแวดล้อม ตลอดจนสนับสนุนให้พนักงานมีส่วนร่วม และมีความรู้ในการทำกิจกรรมเพื่อสังคมและสิ่งแวดล้อมมาโดยตลอด (รายละเอียดการดำเนินงานในปี 2555 ระบุไว้ใน “รายงานความรับผิดชอบต่อสังคม”)

การรับแจ้งเบาะแส ขอร้องเรียนต่อกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดให้มีช่องทางที่ผู้มีส่วนได้เสียทุกกลุ่มสามารถแจ้งเบาะแส หรือร้องเรียนการกระทำที่ไม่เหมาะสม การกระทำความผิดกฎหมายหรือจรรยาบรรณ รายงานทางการเงินที่ไม่ถูกต้อง หรือระบบควบคุมภายในที่บกพร่องของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้โดยตรงต่อประธานอนุกรรมการตรวจสอบของตลาดหลักทรัพย์ฯ เมื่อประธานอนุกรรมการตรวจสอบได้รับข้อร้องเรียน จะนำเรื่องเข้าสู่การพิจารณาของที่ประชุมคณะอนุกรรมการตรวจสอบเพื่อพิจารณากำหนดกระบวนการในการตรวจสอบข้อเท็จจริง เมื่อพิจารณาแล้วจะรายงานต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อตัดสินใจดำเนินการ ซึ่งกำหนดนโยบายเรื่องดังกล่าวไว้อย่างชัดเจนในนโยบายการกำกับดูแลกิจการของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ รวมทั้งเผยแพร่ผ่านเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ ภายใต้หัวข้อ “การแจ้งเบาะแส” โดยมีการรับแจ้งผ่าน 2 ช่องทาง ได้แก่

- | | |
|--------------------------|---|
| 1. จดหมายอิเล็กทรอนิกส์: | ChairmanOfTheAuditCommittee@set.or.th |
| 2. ส่งไปรษณีย์: | ประธานอนุกรรมการตรวจสอบ
ฝ่ายตรวจสอบภายใน
อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
62 ถนนรัชดาภิเษก เขตคลองเตย กรุงเทพฯ 10110 |

นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังได้กำหนดกระบวนการคุ้มครองผู้แจ้งเบาะแสดังกล่าว โดยผู้ร้องเรียนสามารถเลือกที่จะไม่เปิดเผยตนเองได้ ผู้รับข้อร้องเรียนจะเก็บข้อมูลเป็นความลับและเปิดเผยเท่าที่จำเป็นโดยคำนึงถึงความปลอดภัยและความเสียหายของผู้ร้องเรียน ผู้ร้องเรียนสามารถร้องขอให้คุ้มครองได้ และผู้ที่ได้รับความเดือดร้อนเสียหายจะได้รับการบรรเทาความเสียหายด้วยกระบวนการที่เหมาะสมและเป็นธรรม โดยในปี 2555 ไม่มีการแจ้งเบาะแสหรือข้อร้องเรียนที่เกี่ยวข้องกับการกระทำความผิดกฎหมายหรือจรรยาบรรณ รายงานทางการเงินที่ไม่ถูกต้อง หรือระบบควบคุมภายในที่บกพร่องของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ มายังช่องทางดังกล่าว

การปฏิบัติตามข้อกำหนด และกฎหมายที่เกี่ยวข้อง

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ตระหนักถึงความสำคัญ และยึดถือปฏิบัติตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ฯ และกฎหมายที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจของตลาดหลักทรัพย์ฯ อย่างเคร่งครัด ตลอดจนรับรู้ถึงสิทธิของผู้มีส่วนได้เสียตามที่กฎหมายกำหนด รวมถึงเคารพหลักสิทธิมนุษยชนและการปฏิบัติต่อแรงงานอย่างเป็นธรรม

4. การเปิดเผยข้อมูลและความโปร่งใส

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้ความสำคัญต่อการเปิดเผยข้อมูลการดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยยึดหลักความครบถ้วน ถูกต้อง ทันเวลา และโปร่งใส ทั้งข้อมูลทางการเงินและข้อมูลที่มีใช้ข้อมูลทางการเงิน ข้อมูลเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ ตลอดจนข้อมูลสำคัญที่มีผลกระทบต่อราคาหลักทรัพย์ของบริษัทจดทะเบียน โดยเผยแพร่ผ่านทางเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ ทั้งภาษาไทยและภาษาอังกฤษ อาทิ

• เปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับตลาดหลักทรัพย์ฯ อย่างเพียงพอ และโปร่งใส อาทิ ภาพรวมการดำเนินงาน รายชื่อและประวัติของคณะกรรมการ คณะผู้บริหาร โครงสร้างการดำเนินงานกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ข่าว/กิจกรรมของตลาดหลักทรัพย์ฯ กิจกรรมด้านผู้ออกหลักทรัพย์ รวมถึงข้อมูลด้านการกำกับดูแลกิจการของตลาดหลักทรัพย์ฯ อาทิ นโยบายการกำกับดูแลกิจการและจรรยาบรรณ แนวทางปฏิบัติของกรรมการและพนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ ในการได้มาหรือจำหน่ายไปซึ่งหลักทรัพย์จดทะเบียน นโยบายและช่องทางรับแจ้งเบาะแสหรือข้อร้องเรียน การดำเนินงานของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยในปี 2555 ได้เพิ่มการเปิดเผยข้อมูลนโยบายและกรอบบริหารความเสี่ยงของตลาดหลักทรัพย์ฯ

- เปิดเผยแพร่รายงานประจำปีของตลาดหลักทรัพย์ ซึ่งสามารถดาวน์โหลดฉบับย้อนหลังได้ตั้งแต่ปี 2544 รวมทั้งการเงินประจำปี คำอธิบายและบทวิเคราะห์ทางการเงิน (MD&A) ภายใน 60 วันนับจากวันปิดบัญชี เช่นเดียวกับเกณฑ์การเผยแพร่ทางการเงินของบริษัทจดทะเบียน โดยงบการเงินประจำปี 2555 เผยแพร่เมื่อวันที่ 20 กุมภาพันธ์ 2556 หรือภายใน 51 วันนับจากวันปิดบัญชี ซึ่งเร็วกว่าเกณฑ์ที่กำหนด รวมทั้งคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ ได้จัดทำรายงานความรับผิดชอบของคณะกรรมการต่อรายงานทางการเงิน โดยแสดงคู่กับรายงานของผู้สอบบัญชีในรายงานประจำปีด้วย

- ประชาสัมพันธ์กิจกรรมต่างๆ ของตลาดหลักทรัพย์ และให้ความรู้เกี่ยวกับการลงทุน ทั้งทางเว็บไซต์ สื่อโทรทัศน์ วิทยุ และสื่อสิ่งพิมพ์ต่างๆ

- มีช่องทางให้ผู้ลงทุน บริษัทจดทะเบียน บริษัทหลักทรัพย์ และผู้ที่เกี่ยวข้องทั่วไป สามารถแจ้งข้อข้อมูล ข่าวสาร หรือติดต่อสอบถามผ่านเจ้าหน้าที่ และบริการข้อมูลผ่านระบบโทรศัพท์อัตโนมัติ 24 ชั่วโมง ดังนี้

- **SET Call Center** (ทางโทรศัพท์หมายเลข 0-2229-2222 และ SETCallCenter@set.or.th) ให้บริการข้อมูลการลงทุน สินค้าและบริการ กิจกรรมของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ กิจกรรมของศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน กิจกรรมของ Money Channel และปัญหาการใช้งานระบบของสมาชิก เป็นต้น
- **TSD Call Center** (ทางโทรศัพท์หมายเลข 0-2229-2888 และ TSDCallCenter@set.or.th) ให้บริการสอบถามข้อมูลงานนายทะเบียนหลักทรัพย์และกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ บริการ e-Dividend บริการข้อมูลผู้ถือหุ้นทางอินเทอร์เน็ต บริการโอนหลักทรัพย์ การขอออกเอกสารใหม่แทนฉบับเดิมที่สูญหาย รวมถึงการตรวจสอบยอดเงินสะสมสมทบของกองทุนสำรองเลี้ยงชีพผ่านระบบโทรศัพท์อัตโนมัติ เป็นต้น

ตลอดทั้งปี 2555 มีการให้บริการกับผู้ที่เกี่ยวข้องในตลาดทุน และบุคคลทั่วไป เป็นจำนวน 312,014 รายการ

นอกจากนี้ ในปี 2555 ได้ปรับปรุงเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์ หัวข้อ “ติดต่อเรา” เพื่อให้แสดงรายชื่อ หมายเลขโทรศัพท์ และ e-mail ของหน่วยงานของตลาดหลักทรัพย์ ที่มีหน้าที่ให้บริการข้อมูล เพื่อให้สามารถให้บริการข้อมูลสำคัญให้กับผู้มีส่วนได้เสียทุกกลุ่มได้อย่างครบถ้วน ครอบคลุมทั้งการให้บริการผู้ลงทุน บริษัทจดทะเบียน บริษัทสมาชิกและ custodians บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ตลอดจนการติดต่อเข้าเยี่ยมชมตลาดหลักทรัพย์

5. ความรับผิดชอบของคณะกรรมการ

5.1 โครงสร้างกรรมการ

โครงสร้างของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ เป็นไปตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ดังนี้

- บุคคลที่คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์แต่งตั้งจำนวน 5 ท่าน ซึ่งเป็นผู้ที่มีความรู้และประสบการณ์ในกิจการของตลาดหลักทรัพย์ ธุรกิจหลักทรัพย์ หรือธุรกิจการเงินเป็นอย่างดี และอย่างน้อย 1 ท่าน ต้องเป็นผู้บริหารระดับสูงของบริษัทจดทะเบียน

- บุคคลที่ประชุมสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ เลือกตั้งจำนวน 5 ท่าน โดยเป็นตัวแทนจากผู้บริหารระดับรองผู้จัดการขึ้นไปของสมาชิก จำนวน 4 ท่าน และเป็นบุคคลที่คณะกรรมการสรรหาเสนอชื่อ ซึ่งต้องไม่เป็นกรรมการ ผู้จัดการ พนักงานหรือลูกจ้างของสมาชิก จำนวน 1 ท่าน

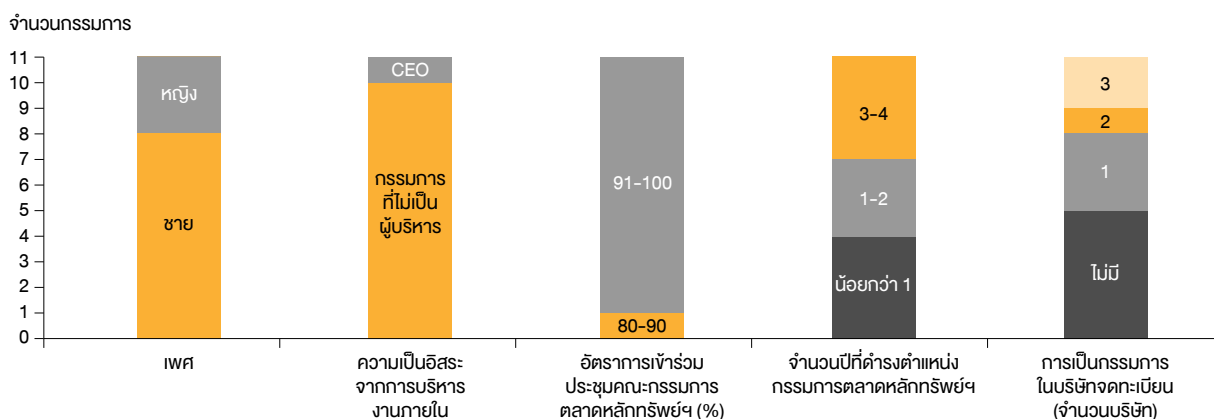
- ผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ เป็นกรรมการโดยตำแหน่ง ซึ่งแต่งตั้งโดยคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์

- คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ เลือกกรรมการคนหนึ่งนอกเหนือจากผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ เป็นประธานกรรมการ ทำให้ประธานกรรมการมีความเป็นอิสระจากฝ่ายบริหาร และแบ่งแยกอำนาจหน้าที่ระหว่างกันอย่างชัดเจน

ปัจจุบัน คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ ประกอบด้วยกรรมการจำนวน 11 ท่าน กรรมการเป็นผู้ทรงคุณวุฒิ มีความรู้ประสบการณ์ทักษะ และความเชี่ยวชาญที่เป็นประโยชน์ต่อการปฏิบัติงานของคณะกรรมการทั้งคณะ

กรรมการที่มีผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ มีวาระการดำรงตำแหน่งคราวละ 2 ปี ทั้งนี้ กรรมการตลาดหลักทรัพย์ ที่พ้นจากตำแหน่งตามวาระ อาจได้รับการแต่งตั้งหรือเลือกตั้งได้อีก แต่จะดำรงตำแหน่งติดต่อกันได้ไม่เกิน 2 วาระ สำหรับผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ มีวาระอยู่ในตำแหน่งคราวละไม่เกิน 4 ปี และอาจได้รับการแต่งตั้งอีกได้

โดยมีผู้ช่วยผู้จัดการ สายงานกฎหมาย เป็นเลขานุการคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ และมีฝ่ายเลขานุการองค์กร สายงานกฎหมาย ทำหน้าที่สนับสนุนการปฏิบัติหน้าที่ของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ โดยให้คำแนะนำด้านกฎหมาย และกฎเกณฑ์ต่างๆ ที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ จะต้องทราบ รับผิดชอบงานประชุมคณะกรรมการฯ รับผิดชอบดูแลกิจกรรมของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ รวมทั้งประสานงานให้มีการปฏิบัติตามมติคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์



5.2 บทบาทหน้าที่ และความรับผิดชอบของคณะกรรมการ

(1) วิสัยทัศน์ และพันธกิจ

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ เป็นผู้กำหนดวิสัยทัศน์ พันธกิจ เป้าหมาย และแผนกลยุทธ์ของตลาดหลักทรัพย์ โดยให้ความเห็นชอบต่อเป้าหมายหรือตัวชี้วัดระดับองค์กร (key corporate KPI) และกำกับดูแลการดำเนินงานให้เป็นไปตามแผนที่วางไว้อย่างมีประสิทธิภาพ และมีประสิทธิภาพ พร้อมทบทวนแผนงานให้รองรับและสอดคล้องกับสถานการณ์ที่เปลี่ยนแปลง โดยฝ่ายจัดการมีกรรายงานสถานะของตัวชี้วัดระดับองค์กร ความคืบหน้าการปฏิบัติงาน ตามแผนกลยุทธ์ และผลประกอบการของตลาดหลักทรัพย์ ต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ เป็นประจำทุกไตรมาส

(2) การมอบหมายและแบ่งแยกหน้าที่ความรับผิดชอบ

• การมอบหมายหน้าที่ความรับผิดชอบให้กับคณะอนุกรรมการ

ในปี 2555 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ ได้แต่งตั้งคณะอนุกรรมการชุดต่างๆ รวมทั้งสิ้น 12 ชุด เพื่อช่วยงานของคณะกรรมการในการปฏิบัติหน้าที่ที่รับผิดชอบ ตลอดจนกลั่นกรองงานด้านการกำกับดูแลกิจการและงานสำคัญที่จำเป็นต้องอาศัยความรู้ความเชี่ยวชาญเฉพาะด้าน อาทิ คณะอนุกรรมการตรวจสอบ คณะอนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการ คณะอนุกรรมการพิจารณาผลตอบแทน และคณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง โดยคณะอนุกรรมการชุดต่างๆ ของตลาดหลักทรัพย์ มีอิสระในการปฏิบัติหน้าที่ภายใต้ขอบเขตหน้าที่และความรับผิดชอบตามที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ ได้มอบหมาย ดังรายละเอียดปรากฏตามหน้า 78

• การแบ่งแยกหน้าที่ความรับผิดชอบระหว่างคณะกรรมการกับผู้จัดการ

ตลาดหลักทรัพย์ มีการแบ่งแยกอำนาจหน้าที่และความรับผิดชอบในการกำหนดนโยบายการกำกับดูแลและการบริหารงานประจำออกจากกันอย่างชัดเจน โดยประธานกรรมการตลาดหลักทรัพย์ เป็นกรรมการที่มีได้เป็นผู้บริหาร ไม่เป็นบุคคลเดียวกันกับผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ และไม่มีความสัมพันธ์ใดๆ กับฝ่ายจัดการ เป็นผู้นำและมีส่วนสำคัญในการตัดสินใจเรื่องนโยบาย ให้การสนับสนุนและคำแนะนำในการดำเนินธุรกิจของฝ่ายจัดการ โดยไม่ก้าวล่วงงานประจำอันเป็นภาระความรับผิดชอบของฝ่ายจัดการ

บทบาทและความรับผิดชอบของคณะกรรมการ	บทบาทและความรับผิดชอบของผู้จัดการ
- กำหนดทิศทาง นโยบาย เป้าหมายเชิงกลยุทธ์ของตลาดหลักทรัพย์ และกำกับดูแลให้ฝ่ายจัดการดำเนินการตามนโยบาย และระเบียบของตลาดหลักทรัพย์ รวมทั้งปฏิบัติตามกฎหมายและข้อกำหนดที่เกี่ยวข้อง - อนุมัติแผนงาน งบประมาณ อัตรากำลังของพนักงานและลูกจ้างของตลาดหลักทรัพย์ - แต่งตั้งผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ และผู้บริหารระดับสูง - กำกับดูแลให้ตลาดหลักทรัพย์ มีระบบบัญชี การรายงานทางการเงิน การควบคุมภายใน การตรวจสอบภายใน การกำกับดูแลกิจการ และการบริหารความเสี่ยงที่มีประสิทธิภาพ เชื่อถือได้ - มอบหมายและกระจายอำนาจดำเนินการให้แก่ ฝ่ายจัดการในระดับที่เหมาะสมให้มีการบริหารงานที่มีประสิทธิภาพและมีระบบการควบคุมที่ดี	- ผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ เป็นผู้ดำรงตำแหน่งทางการบริหารสูงสุดของตลาดหลักทรัพย์ รับผิดชอบในการบริหารกิจการให้เป็นไปตามนโยบาย และเป้าหมายเชิงกลยุทธ์ และระเบียบข้อบังคับที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ กำหนดไว้ - รายงานความคืบหน้าของการปฏิบัติงานตามแผนกลยุทธ์ และผลประกอบการของตลาดหลักทรัพย์ ต่อคณะกรรมการฯ เป็นประจำทุกไตรมาส - ในกิจการที่เกี่ยวกับบุคคลภายนอก ผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ เป็นผู้แทนของตลาดหลักทรัพย์ โดยอาจมอบหมายให้บุคคลใดๆ ปฏิบัติกิจการบางอย่างแทนได้โดยไม่ขัดต่อระเบียบและข้อบังคับที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ กำหนดไว้

เพื่อให้มีการกระจายอำนาจให้ผู้ปฏิบัติงานในตำแหน่งต่างๆ สามารถบริหารงานและตัดสินใจได้อย่างคล่องตัว ภายใต้การควบคุมที่เหมาะสม มีระบบการรายงานที่ชัดเจน คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ ได้อนุมัติคู่มืออำนาจดำเนินการของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ เป็นลายลักษณ์อักษร โดยมีการกระจายอำนาจไปยังฝ่ายจัดการในเรื่องต่างๆ อาทิ

- การใช้งบประมาณสินทรัพย์ถาวร และงบประมาณค่าใช้จ่ายดำเนินงาน ภายในวงเงินที่ได้รับอนุมัติจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ ทั้งนี้ กรณีใช้งบประมาณเกินวงเงินที่ได้รับอนุมัติเกินกว่า 2 ล้านบาทขึ้นไป ต้องขออนุมัติจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์
- การจัดซื้อจัดจ้างสินค้าและบริการ ในวงเงินไม่เกิน 10 ล้านบาท กรณีการซื้อหรือการจ้างเกินกว่า 5 ล้านบาท จะต้องรายงานให้คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ ทราบเป็นรายไตรมาส

(3) แผนพัฒนาและสืบทอดตำแหน่งผู้จัดการและผู้บริหารระดับสูง

ตลาดหลักทรัพย์ ให้ความสำคัญต่อการเตรียมพร้อมบุคลากรที่จะเป็นผู้สืบทอดตำแหน่งผู้จัดการและผู้บริหารระดับสูง โดยจัดทำแผนพัฒนาและสืบทอดตำแหน่งผู้จัดการและผู้บริหารระดับสูง (succession planning) ซึ่งมีกระบวนการสรรหาผู้สืบทอดตำแหน่งในระดับต่างๆ (successor) ที่ชัดเจนและโปร่งใส โดยพิจารณาจากความรู้ ประสบการณ์ ความสามารถ จริยธรรม และความเป็นผู้นำ โดยได้รายงานผลต่อที่ประชุมคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ อย่างสม่ำเสมอ

เนื่องด้วยตลาดหลักทรัพย์ มีผู้บริหารระดับสูง 1 ท่านในสายงานปฏิบัติการ ที่เกษียณอายุในวันที่ 1 มกราคม 2556 ตลาดหลักทรัพย์ จึงได้เตรียมการเพื่อสืบทอดงาน โดยเสนอให้คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ แต่งตั้งให้ผู้บริหารมาเรียนรู้งานในตำแหน่งดังกล่าวตั้งแต่วันที่ 1 พฤษภาคม 2555 เพื่อให้ตลาดหลักทรัพย์ มีบุคลากรที่พร้อมสำหรับตำแหน่งที่มีความสำคัญ และเพื่อให้เกิดความต่อเนื่องในการบริหารงานและการดำเนินการตามโครงการต่างๆ ของตลาดหลักทรัพย์

(4) การกำกับดูแลกิจการ

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ ได้อนุมัตินโยบายการกำกับดูแลกิจการ และจรรยาบรรณของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ เพื่อใช้เป็นมาตรฐานการดำเนินงานของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ และมอบหมายให้คณะอนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการทำหน้าที่ในการสอบทานนโยบายและแนวปฏิบัติที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลกิจการ และรายงานต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ อย่างสม่ำเสมอ

- **นโยบายการกำกับดูแลกิจการ** กำหนดโดยใช้หลักการกำกับดูแลกิจการที่ดีของ The Organization for Economic and Co-operation and Development (OECD) เป็นแนวทางหลัก และใช้หลักการกำกับดูแลกิจการที่ดีสำหรับบริษัทจดทะเบียนเป็นส่วนประกอบ โดยคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ มุ่งหวังให้กรรมการ ผู้บริหารและพนักงานทุกคนในองค์กรปฏิบัติงานโดยยึดนโยบายฯ ฉบับนี้อย่างเคร่งครัด เพื่อให้กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ มีมาตรฐานการกำกับดูแลกิจการที่เป็นที่ยอมรับและเป็นตัวอย่างที่ดีให้องค์กรอื่นๆ ในตลาดทุนไทย

- **จรรยาบรรณกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ** กำหนดขึ้นเพื่อให้กรรมการ อนุกรรมการ ที่ปรึกษา และพนักงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ เข้าใจถึงมาตรฐานด้านจริยธรรมที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ ใช้ในการดำเนินงาน และยึดถือปฏิบัติ ทั้งนี้ กรรมการ ผู้บริหาร และพนักงานทุกคนได้รับเอกสารจรรยาบรรณเมื่อเข้ารับตำแหน่งหรือเข้าทำงานใหม่ และพนักงานเข้าใหม่ทุกคนลงนามตกลงที่จะปฏิบัติตาม

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้กำหนดให้หน่วยงานกำกับกิจกรรมองค์กร ทำหน้าที่เป็นหน่วยงานรับข้อร้องเรียนจากพนักงานในกรณีที่เกิดพฤติกรรมหรือเหตุการณ์ใดๆ ที่อาจเป็นการฝ่าฝืนหรือการไม่ปฏิบัติตามจรรยาบรรณฯ ซึ่งมีการกำหนดกระบวนการดำเนินการเมื่อได้รับข้อร้องเรียน รวมถึงมาตรการคุ้มครองผู้ร้องเรียนหรือผู้ที่ให้ความร่วมมือในการตรวจสอบไว้อย่างชัดเจน เพื่อให้ความเป็นธรรมแก่ผู้ที่เกี่ยวข้องทุกฝ่าย

ตลอดปี 2555 ไม่พบเหตุการณ์ใดๆ หรือการปฏิบัติใดๆ ของกรรมการ ผู้บริหาร และพนักงานของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่ไม่สอดคล้องกับนโยบายการกำกับดูแลกิจการ และจรรยาบรรณฯ ที่กำหนดไว้

- **การรักษาความลับและการใช้ข้อมูลภายใน** คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ตระหนักถึงความสำคัญของการดูแลรักษาความลับของข้อมูลขององค์กร และการดูแลมิให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์จากการนำข้อมูลความลับขององค์กรไปใช้ในทางมิชอบ ทั้งนี้ ได้กำหนดข้อปฏิบัติเรื่องการนำข้อมูลขององค์กรไปใช้ เพื่อให้กรรมการ และพนักงานของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ยึดถือปฏิบัติอย่างเคร่งครัด อาทิ ไม่ใช้ข้อมูลขององค์กรที่ได้รับจากการปฏิบัติหน้าที่เพื่อแสวงหาประโยชน์ให้แก่ตนเองหรือผู้อื่นโดยมิชอบ รักษาความลับขององค์กรโดยดูแลและมีมติระงับมิให้เอกสารหรือข่าวสารอันเป็นความลับขององค์กรรั่วไหลหรือตกไปถึงผู้ที่ไม่เกี่ยวข้องอันอาจเป็นเหตุให้เกิดความเสียหายแก่องค์กร ไม่เปิดเผยข้อมูลที่เป็นความลับขององค์กรแม้พ้นสภาพหรือสิ้นสุดการปฏิบัติงานที่องค์กรไปแล้ว ทั้งนี้ ในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เริ่ม implement ระบบ Data Leak Prevention หรือ DLP ซึ่งเป็นเครื่องมือที่ช่วยในการควบคุมการเผยแพร่ข้อมูลขององค์กร และป้องกันมิให้ข้อมูลความลับขององค์กรรั่วไหล

- **แนวปฏิบัติในการได้มาหรือจำหน่ายไปซึ่งหลักทรัพย์จดทะเบียนของกรรมการและพนักงาน** กำหนดขึ้นเพื่อดำรงรักษาไว้ซึ่งความไว้วางใจของสาธารณชนในการทำหน้าที่เป็นศูนย์กลางในการซื้อขายหลักทรัพย์ และเพื่อป้องกันไม่ให้เกิดการแสวงหาผลประโยชน์จากการล่วงรู้ข้อมูลในระหว่างการปฏิบัติงาน โดยกำหนดให้การได้มาหรือจำหน่ายไปซึ่งหลักทรัพย์ ต้องเป็นการกระทำในลักษณะการลงทุนด้วยความซื่อสัตย์สุจริต ไม่ใช้ข้อมูลหรืออำนาจหน้าที่จากการปฏิบัติงานทำการได้มาหรือจำหน่ายไปซึ่งหลักทรัพย์ กรรมการต้องรายงานการถือหลักทรัพย์ของตนเอง รวมทั้งของคู่สมรส และบุตรที่ยังไม่บรรลุนิติภาวะ ซึ่งการรายงานดังกล่าวให้รายงานโดยลับ สำหรับพนักงานต้องขออนุญาตผู้บังคับบัญชาทุกครั้งก่อนการลงทุนในหลักทรัพย์ นอกจากนี้ ห้ามพนักงานจำหน่ายหลักทรัพย์ที่ถือครองไว้น้อยกว่า 30 วัน

ทั้งนี้ ในปี 2555 ไม่มีการพิจารณาการกระทำที่ขัดต่อข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ฯ และกฎหมายที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ ซึ่งรวมถึงการใช้ข้อมูลภายในหรืออำนาจหน้าที่เพื่อทำการได้มาหรือจำหน่ายไปซึ่งหลักทรัพย์ของกรรมการและพนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ

- **นโยบายและแนวปฏิบัติเพื่อจัดการความขัดแย้งทางผลประโยชน์** เพื่อป้องกันมิให้พนักงานกระทำการที่เป็นการเพื่อเอื้อประโยชน์ให้แก่บุคคลใดไม่ว่าทางตรงหรือทางอ้อม และไม่ทำการใดๆ ที่มีความขัดแย้งกับผลประโยชน์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงได้กำหนดแนวปฏิบัติและตัวอย่างในการจัดการความขัดแย้งทางผลประโยชน์สำหรับกรรมการและผู้จัดการ และพนักงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ ในเรื่องต่างๆ อาทิ

- กำหนดข้อห้ามสำหรับพนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ ในการดำรงตำแหน่งเป็นกรรมการหรือที่ปรึกษาในบริษัทจดทะเบียนหรือบริษัทสมาชิก ซึ่งรวมถึงกรรมการและผู้จัดการด้วย ทั้งนี้ ในการดำรงตำแหน่งเป็นกรรมการ หรือที่ปรึกษาในบริษัทหรือองค์กรอื่นใดของพนักงาน จะต้องได้รับความเห็นชอบจากกรรมการและผู้จัดการ และกรรมการและผู้จัดการจะต้องได้รับความเห็นชอบจากประธานกรรมการ
- กำหนดข้อพึงปฏิบัติกรณีพนักงานหรือผู้เกี่ยวข้องต้องการเป็นคู่ค้ากับตลาดหลักทรัพย์ฯ พนักงานต้องเปิดเผยความสัมพันธ์กับผู้ที่เกี่ยวข้องเป็นลายลักษณ์อักษร และต้องไม่มีส่วนร่วมในการพิจารณาว่าจ้างสินค้าและบริการดังกล่าว

ข้อมูลการดำรงตำแหน่งเป็นกรรมการและอนุกรรมการในบริษัทอื่นของผู้บริหารระดับสูงของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ณ 31 ธันวาคม 2555 เป็นดังนี้

รายชื่อผู้บริหารระดับสูง		การดำรงตำแหน่งในบริษัทอื่น
1. คุณนงราม วงษ์วานิช	รองผู้จัดการ	กรรมการ บริษัทหลักทรัพย์เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์
2. คุณศรกี ปรุณโชติ	ผู้ช่วยผู้จัดการ	กรรมการ ธนาคารออมสิน

• **การลงนามรับรองความเป็นกลาง** คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้กำหนดให้กรรมการ อนุกรรมการ และที่ปรึกษาของตลาดหลักทรัพย์ฯ ลงนามในหนังสือรับรองความเป็นกลาง (letter of independence) ทุกครั้งเมื่อได้รับแต่งตั้งและทุกต้นปี เพื่อรับรองว่าจะปฏิบัติหน้าที่ภายใต้ขอบข่ายบรรษัทภิบาลที่ดี หากมีเรื่องใดที่อาจมีส่วนได้เสียไม่ว่าทางตรงหรือทางอ้อม ต้องเปิดเผยให้ผู้เกี่ยวข้องทราบล่วงหน้า และงดการมีส่วนร่วมในการพิจารณาและออกเสียงในเรื่องนั้นๆ

ในปี 2555 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ในการประชุมเมื่อวันที่ 18 กรกฎาคม 2555 ได้อนุมัติการปรับปรุงนโยบายการกำกับดูแลกิจการ จรรยาบรรณกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ รวมถึงแนวปฏิบัติในการได้มาหรือจำหน่ายไปซึ่งหลักทรัพย์จดทะเบียนของกรรมการและพนักงาน เพื่อให้มีความชัดเจน เหมาะสม และสอดคล้องกับหลักการกำกับดูแลกิจการที่ดีในระดับสากล โดยสรุปดังนี้

สาระสำคัญของการปรับปรุงนโยบายที่เกี่ยวข้องกับการกำกับดูแลกิจการของตลาดหลักทรัพย์ฯ		
นโยบายการกำกับดูแลกิจการและจรรยาบรรณฯ	กำหนดนโยบายเพิ่มเติมให้ครอบคลุมแนวทางปฏิบัติที่ดี โดยมีการปรับปรุงเนื้อหาส่วนใหญ่ในหมวดการปฏิบัติต่อผู้มีส่วนได้เสีย และหมวดความรับผิดชอบของคณะกรรมการ อาทิ	
	การปฏิบัติต่อผู้มีส่วนได้เสีย	ความรับผิดชอบของคณะกรรมการ
	- นโยบายการต่อต้านการทุจริตและการคอร์รัปชัน - นโยบายการไม่ละเมิดสิทธิมนุษยชน - นโยบายการไม่ละเมิดทรัพย์สินทางปัญญา - นโยบายการดำเนินธุรกิจภายใต้มาตรฐานสิ่งแวดล้อม - นโยบายการได้มาหรือการจำหน่ายไปซึ่งหลักทรัพย์จดทะเบียน * - นโยบายและแนวปฏิบัติต่อคู่แข่ง - นโยบายและแนวปฏิบัติต่อเจ้าหน้าที่ - นโยบายและแนวปฏิบัติต่อลูกค้า * - นโยบายการรับหรือให้สิ่งของ *	- นโยบายการดำรงตำแหน่งในบริษัทอื่นของกรรมการ - นโยบายการดำรงตำแหน่งในบริษัทอื่นของผู้จัดการและผู้บริหาร * - การรายงานการมีส่วนได้เสียของกรรมการ
* ปรับปรุงนโยบายเดิมให้สอดคล้องกับแนวปฏิบัติที่ดี		
เกณฑ์ปฏิบัติในการได้มาหรือจำหน่ายไปซึ่งหลักทรัพย์จดทะเบียน ของพนักงาน	ปรับปรุงนิยาม “หลักทรัพย์จดทะเบียน” และเพิ่มเติม “ข้อห้ามปฏิบัติสำหรับหน่วยงานที่ใกล้ชิดข้อมูลภายใน” เพื่อความชัดเจน และรัดกุมยิ่งขึ้น ดังรายละเอียดที่เปิดเผยในเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ หัวข้อ “การกำกับดูแลกิจการที่ดีของตลาดหลักทรัพย์ฯ”	

(5) ระบบการควบคุมภายใน

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้ความสำคัญต่อระบบควบคุมภายในที่ดี โดยสนับสนุนฝ่ายจัดการให้มีการกำหนดระเบียบวิธีปฏิบัติงาน และจัดโครงสร้างการทำงานให้มีการแบ่งแยกหน้าที่ในการปฏิบัติงานให้เกิดการถ่วงดุลและสอบทานระหว่างกัน กำหนดอำนาจดำเนินการที่ชัดเจน เป็นลายลักษณ์อักษร และมีระบบการติดตามผลการปฏิบัติงานที่ชัดเจน โดยมอบหมายให้คณะกรรมการตรวจสอบกำกับดูแลและสอบทานระบบควบคุมภายในให้มีประสิทธิภาพสอดคล้องกับมาตรฐานสากล ทั้งด้านการดำเนินงาน ด้านการรายงานทางการเงิน และด้านการปฏิบัติตามกฎระเบียบ และฝ่ายตรวจสอบภายในเป็นหน่วยงานอิสระขึ้นตรงต่อคณะกรรมการตรวจสอบ ส่วนงานด้านการบริหารให้ขึ้นตรงต่อกรรมการและผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยคณะกรรมการตรวจสอบเป็นผู้พิจารณาให้ความเห็นชอบในการแต่งตั้ง โยกย้าย หรือเลิกจ้าง และประเมินผลปฏิบัติงานหัวหน้าหน่วยงานตรวจสอบภายใน

ฝ่ายตรวจสอบภายใน มีความเป็นอิสระในการเข้าถึงข้อมูลที่เกี่ยวข้องในการตรวจสอบ ดำเนินการตรวจสอบและประเมินความเสี่ยงพหุเหมาะสมและประสิทธิภาพของระบบควบคุมภายในของกระบวนการและระบบงานต่างๆ ตามแผนการตรวจสอบประจำปีที่ทำขึ้นตามแนวความเสี่ยง (risk-based approach) อนุมัติโดยคณะกรรมการตรวจสอบ โดยรายงานผลการตรวจสอบและผลการติดตามความคืบหน้าการดำเนินการของฝ่ายจัดการโดยตรงต่อคณะกรรมการตรวจสอบอย่างสม่ำเสมอ

ในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มีการดำเนินกิจกรรม / โครงการสำคัญที่สนับสนุนต่อการพัฒนาระบบการควบคุมภายใน และการตรวจสอบภายในให้มีประสิทธิภาพยิ่งขึ้น โดยสรุปโครงการสำคัญได้ดังนี้

- ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้พัฒนาระบบซื้อขายหลักทรัพย์ใหม่ให้สามารถทำธุรกรรมได้สะดวกและมีประสิทธิภาพยิ่งขึ้น โดยได้ให้ความสำคัญต่อการพัฒนาระบบให้มีการควบคุมที่ดี มีการทดสอบระบบอย่างเข้มข้นต่อเนื่อง และได้มอบหมายให้ฝ่ายตรวจสอบภายในเข้าไปสอบทานโครงการ (pre-implementation review) เพื่อเพิ่มความมั่นใจก่อนเริ่มใช้งาน และในวันที่ 3 กันยายน 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เริ่มใช้ระบบซื้อขายหลักทรัพย์ใหม่ “SET CONNECT” ได้อย่างประสบผลสำเร็จ โดยระบบทำงานได้อย่างราบรื่น เต็มประสิทธิภาพ

- ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ปรับปรุงนโยบายความปลอดภัยเทคโนโลยีสารสนเทศให้สอดคล้องกับสภาพแวดล้อมการใช้งานด้านเทคโนโลยีและสารสนเทศที่เปลี่ยนแปลงไป และมาตรฐานความปลอดภัยใหม่ๆ เพื่อเป็นแนวทางให้ผู้ที่เกี่ยวข้องทราบและดำเนินงานให้ระบบคอมพิวเตอร์สามารถให้บริการได้อย่างมีประสิทธิภาพและปลอดภัย นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังได้ดำเนินการเพื่อขอรับรองมาตรฐาน ISO/IEC 27001 ซึ่งคาดว่าจะได้รับการรับรองในปี 2556

- ฝ่ายตรวจสอบภายในได้ implement การตรวจสอบแบบ continuous auditing ทำให้สามารถเพิ่มความถี่ในการตรวจสอบจำนวนกลุ่มตัวอย่าง และสามารถตรวจสอบโครงการต่างๆ ได้เพิ่มขึ้น และช่วยสนับสนุนการดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้อย่างมีประสิทธิภาพ

- ฝ่ายตรวจสอบภายในพัฒนาคุณภาพงานตรวจสอบภายในอย่างต่อเนื่อง โดยเข้าฝึกอบรมทักษะการตรวจสอบภายในโดยทั่วไป และทักษะเฉพาะด้านการตรวจสอบระบบคอมพิวเตอร์ เช่น การทำ web application penetration testing เป็นต้น รวมทั้งมีการศึกษาดูงานตรวจสอบภายในที่ตลาดหลักทรัพย์ต่างประเทศ

- ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนดให้มีการประเมินคุณภาพงานตรวจสอบภายใน (Quality Assessment Review : QAR) โดยผู้ประเมินอิสระภายนอกทุก 5 ปี โดยในปี 2555 ฝ่ายตรวจสอบภายในได้ปรับปรุงกระบวนการวางแผนและการปฏิบัติงานตรวจสอบให้ดียิ่งขึ้นตามข้อเสนอแนะจากผลการประเมินคุณภาพงานตรวจสอบภายใน โดยผู้ประเมินอิสระภายนอกในปีที่ผ่านมา

จากการดำเนินกิจกรรมการตรวจสอบภายใน และการดำเนินโครงการสำคัญต่างๆ คณะกรรมการตรวจสอบมีความเห็นว่าระบบควบคุมภายในของตลาดหลักทรัพย์ฯ มีความเพียงพอ เหมาะสม (โดยแสดงรายละเอียดไว้ในหัวข้อรายงานของคณะกรรมการตรวจสอบ)

(6) การบริหารความเสี่ยง

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้ความสำคัญต่อการบริหารความเสี่ยงอย่างเป็นระบบ โดยคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ รับผิดชอบในการกำหนดนโยบาย กรอบการบริหารความเสี่ยง และแนวทางการบริหารความเสี่ยง รวมทั้งแต่งตั้งคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงซึ่งประกอบด้วยผู้ทรงคุณวุฒิที่มีความรู้ความเชี่ยวชาญและประสบการณ์ในการบริหารความเสี่ยงในการให้ความเห็นและข้อเสนอแนะต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ และฝ่ายจัดการ ทั้งนี้ เพื่อให้แน่ใจว่าการบริหารความเสี่ยงของตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำเนินการได้อย่างเหมาะสม

เป็นไปตามนโยบายที่กำหนดและสอดคล้องกับมาตรฐานสากล รวมถึงมั่นใจได้ว่าครอบคลุมความเสี่ยงและประเด็นสำคัญขององค์กรได้อย่างครบถ้วน ซึ่งประกอบด้วย

- ความเสี่ยงด้านกลยุทธ์ (strategic risk)
- ความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงาน (operational risk)
- ความเสี่ยงด้านการเงิน (financial risk) โดยแบ่งเป็นความเสี่ยง 2 ด้าน คือ ความเสี่ยงจากการลงทุน (market risk) และ ความเสี่ยงจากการที่สมาชิกสำนักหักบัญชีไม่ปฏิบัติตามภาระผูกพัน (credit risk หรือ counterparty risk)
- ความเสี่ยงด้านปฏิบัติตามกฎระเบียบ (compliance risk)

ในการดำเนินงานบริหารความเสี่ยงนั้น ฝ่ายจัดการจะเป็นผู้รับผิดชอบและกำหนดนโยบายในการระบุความเสี่ยงและประเมินระดับของความเสี่ยงตามเกณฑ์ที่กำหนดไว้ โดยส่วนบริหารความเสี่ยง (risk management unit) เป็นหน่วยงานประสานงานและสนับสนุนฝ่ายจัดการในการดำเนินการด้านการบริหารความเสี่ยงตามนโยบายที่ได้รับมอบหมาย โดยสามารถสรุปกรอบการดำเนินงานได้ ดังนี้

- ฝ่ายจัดการระบุ ประเมินระดับความรุนแรงและโอกาสที่จะเกิดของความเสี่ยงตามเกณฑ์ที่กำหนด และมีมาตรการในการจัดการความเสี่ยงให้อยู่ในระดับที่ยอมรับได้ รวมถึงติดตามผลและการรายงานสถานะความเสี่ยง โดยครอบคลุมการทบทวนความเพียงพอและความมีประสิทธิภาพของมาตรการจัดการความเสี่ยงที่สำคัญอย่างต่อเนื่อง เพื่อให้มั่นใจว่ากรณีที่เกิดเหตุขึ้นจะสามารถจัดการความเสี่ยงได้ทันทั่วทั้งที่ ทั้งนี้ ครอบคลุมถึงการดำเนินการเกี่ยวกับการบริหารความเสี่ยงของการเริ่มใช้ระบบซื้อขายใหม่ ซึ่งคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ คณะอนุกรรมการตรวจสอบ และคณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง ได้ให้ความเห็นเกี่ยวกับมาตรการจัดการความเสี่ยงดังกล่าว และฝ่ายจัดการก็ได้ดำเนินการตามความเห็นดังกล่าว ก่อนเริ่มใช้ระบบงานใหม่
- จัดให้มีแผนดำเนินธุรกิจต่อเนื่อง (Business Continuity Plan: BCP) รวมทั้งทบทวน และซ้อมการปฏิบัติตามแผนร่วมกับหน่วยงานในตลาดทุนเพื่อเตรียมพร้อมรับมือภาวะวิกฤติต่าง ๆ อย่างจริงจังเป็นประจำทุกปี ทั้งนี้ จากเหตุการณ์ภัยพิบัติต่างๆ ที่เกิดขึ้นอย่างต่อเนื่องในแต่ละปี ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ให้ความสำคัญในการเตรียมความพร้อมของบุคลากร ระบบงาน ทั้งที่อาคารทำการหลักและศูนย์สำรอง และทดสอบการใช้ระบบสำรองร่วมกับบริษัทสมาชิก เพื่อรองรับหากเกิดเหตุการณ์ภัยพิบัติใดๆ ที่ส่งผลกระทบต่ออาคารทำการหลัก เพื่อให้สามารถเปิดซื้อขายหลักทรัพย์ได้อย่างต่อเนื่อง
- ติดตามและรายงานสถานะความเสี่ยงที่สำคัญต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ และคณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยงเป็นประจำเพื่อให้ผู้บริหารได้รับทราบสถานะความเสี่ยงขององค์กร โดยมีการรายงานการดำเนินงานบริหารความเสี่ยงต่อคณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยงอย่างน้อยไตรมาสละครั้ง และรายงานต่อคณะอนุกรรมการตรวจสอบเป็นประจำทุกไตรมาส
- กำหนดบทบาทหน้าที่ของคณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยงของตลาดหลักทรัพย์ฯ เพิ่มเติมในส่วนของการให้ความเห็นด้าน clearing risk เพื่อสนับสนุนการดูแลความเสี่ยงในภาพรวมที่มีอยู่ในปัจจุบัน ในขณะที่คณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยงด้านอนุพันธ์และหลักทรัพย์ของสำนักหักบัญชี ยังคงบทบาทและหน้าที่เช่นเดิม ซึ่งครอบคลุมการกำหนดนโยบายและหลักการที่สำคัญในการบริหารความเสี่ยงของสำนักหักบัญชีอนุพันธ์และหลักทรัพย์
- ดำเนินการตามข้อเสนอแนะของบริษัทที่ปรึกษา Oliver Wyman ที่ให้ข้อเสนอแนะเพิ่มเติมจากการจัดทำ Operation Master Plan ของตลาดหลักทรัพย์ฯ ในส่วนที่เกี่ยวกับการบริหารความเสี่ยง โดยครอบคลุมในเรื่อง risk governance และ clearing risk เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการดำเนินงานด้านการบริหารความเสี่ยง
- สร้างวัฒนธรรมที่สนับสนุนให้ผู้บริหารและพนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ ตระหนักถึงความสำคัญของการบริหารความเสี่ยงอย่างต่อเนื่อง

จากขั้นตอนในการดำเนินงานบริหารความเสี่ยงข้างต้น คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เห็นว่าตลาดหลักทรัพย์ฯ มีการดำเนินการด้านการบริหารความเสี่ยงที่สำคัญที่อาจมีผลกระทบต่อการดำเนินธุรกิจได้อย่างเหมาะสม (รายละเอียดการบริหารความเสี่ยงเปิดเผยไว้ในหัวข้อ “การบริหารความเสี่ยงองค์กร”)

(7) รายงานทางการเงิน

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นผู้รับผิดชอบต่อรายงานทางการเงินของตลาดหลักทรัพย์ฯ และบริษัทในกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ รวมถึงสารสนเทศทางการเงินที่ปรากฏในรายงานประจำปี โดยกำกับดูแลกระบวนการจัดทำและเปิดเผยข้อมูลทางการเงินรวมถึงข้อมูลของรายการที่อาจมีความขัดแย้งทางผลประโยชน์ให้มีความถูกต้อง ครบถ้วน เชื่อถือได้ และสะท้อนผลประกอบการและฐานะทางการเงินที่แท้จริงของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ตามหลักการบัญชีที่รับรองโดยทั่วไป ทั้งนี้ งบการเงินดังกล่าวได้ผ่านการตรวจสอบและให้ความเห็นอย่างไม่มีเงื่อนไขจากผู้สอบบัญชีรับอนุญาต และผ่านความเห็นชอบจากคณะกรรมการตรวจสอบก่อนการนำเสนอต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ เลือกใช้นโยบายบัญชีที่เหมาะสมกับลักษณะโครงสร้างการดำเนินงาน รวมทั้งถือปฏิบัติโดยสม่ำเสมอ ซึ่งถือปฏิบัติเช่นเดียวกับบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ รวมทั้งตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้พิจารณาดำเนินการตามข้อเสนอแนะของผู้สอบบัญชีในประเด็นที่อาจส่งผลกระทบต่อระบบควบคุมภายในและรายงานทางการเงิน โดยพิจารณาถึงผลกระทบและทรัพยากรที่ต้องใช้ ทั้งนี้ เพื่อดำรงไว้ซึ่งระบบควบคุมภายในที่มีประสิทธิภาพ และให้มั่นใจได้ว่าการบันทึกข้อมูลทางการเงินมีความถูกต้อง ครบถ้วน และเพียงพอ (**รายละเอียดความเห็นของคณะกรรมการตรวจสอบ ปรากฏอยู่ในหัวข้อ “รายงานของคณะกรรมการตรวจสอบ”**)

5.3 การประชุมคณะกรรมการ

(1) มีการกำหนดการประชุมประจำทุกเดือนและประชุมประจำทุกไตรมาสไว้เป็นการล่วงหน้าตลอดทั้งปี โดยได้กำหนดวันประชุมคณะกรรมการล่วงหน้าและนำเสนอให้ที่ประชุมคณะกรรมการรับทราบในการประชุมเดือนธันวาคม ทั้งนี้ เพื่อให้กรรมการและผู้บริหารระดับสูงของตลาดหลักทรัพย์ฯ ทุกคนจัดสรรเวลาเพื่อเข้าร่วมการประชุมได้อย่างมีประสิทธิภาพ นอกจากนี้ อาจมีการประชุมเพิ่มเติมกรณีที่มีความจำเป็น

(2) ประธานกรรมการ และกรรมการและผู้จัดการเป็นผู้พิจารณาเห็นชอบวาระการประชุม

(3) จัดส่งหนังสือเชิญประชุมที่ระบุวาระการประชุมอย่างชัดเจน พร้อมเอกสารประกอบการประชุมล่วงหน้า 7 วันก่อนวันประชุม เพื่อให้คณะกรรมการฯ ได้มีเวลาศึกษาข้อมูลอย่างเพียงพอ ยกเว้นกรณีเป็นเรื่องเร่งด่วนอาจนำเสนอเอกสารในภายหลัง พร้อมทั้งจัดบันทึกการประชุมเป็นลายลักษณ์อักษร และเสนอให้มีการรับรองในการประชุมครั้งถัดไป

(4) กรรมการทุกท่านมีข้อมูลที่ครบถ้วน เพียงพอในการพิจารณาตัดสินใจเรื่องต่างๆ นอกจากนั้น สายงานวางแผนกลยุทธ์องค์กรยังได้สรุปข้อมูลภาวะตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้คณะกรรมการฯ รับทราบเป็นประจำทุกเดือน ซึ่งรวมถึงข้อมูลสรุปภาพรวมตลาดหลักทรัพย์ไทยเทียบกับต่างประเทศ ข้อมูลการระดมทุนของบริษัทจดทะเบียน และพัฒนาการสำคัญในตลาดทุนไทยและตลาดทุนโลก

(5) ประธานกรรมการ ดำเนินการประชุมโดยกำหนดเวลาที่เพียงพอสำหรับฝ่ายจัดการในการนำเสนอข้อมูล และสำหรับคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ในการใช้ดุลยพินิจที่รอบคอบ ตลอดจนเปิดโอกาสให้กรรมการได้อภิปราย อย่างเต็มที่และเปิดเผย ซึ่งการประชุมแต่ละครั้งในปี 2555 ใช้เวลาประมาณครึ่งวัน โดยกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ สามารถเสนอวาระการประชุมเพิ่มเติมได้

(6) ในการประชุม คณะกรรมการสนับสนุนให้ผู้จัดการเชิญรองผู้จัดการและผู้ช่วยผู้จัดการเข้าร่วมประชุม เพื่อให้สารสนเทศเพิ่มเติมในฐานที่เกี่ยวข้องโดยตรง รวมทั้งคณะกรรมการจะสามารถถ่ายทอดนโยบายหรือหลักการให้ฝ่ายจัดการนำไปปฏิบัติได้อย่างเหมาะสม ประกอบกับเพื่อให้คณะกรรมการมีโอกาสรู้จักเพื่อประกอบการพิจารณาแผนสืบทอดตำแหน่ง

(7) กรรมการทุกคน ถือเป็นหน้าที่ที่ต้องเข้าประชุมคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ทุกครั้งยกเว้นมีเหตุจำเป็น

ในปี 2555 ได้มีการจัดประชุมคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ รวมทั้งสิ้น 15 ครั้ง โดยมีอัตราการเข้าร่วมประชุมของกรรมการ คิดเป็น 95.15% ตามตารางการประชุมที่แสดงด้านล่างนี้ โดยในปี 2555 ได้มีการประชุมเป็นการเฉพาะระหว่างกรรมการที่ไม่เป็นผู้บริหารจำนวน 1 ครั้ง เพื่อพิจารณาเกี่ยวกับเรื่องการดำเนินงานที่ผ่านมาของฝ่ายจัดการ ซึ่งที่ประชุมมีการแจ้งผลประชุมให้กรรมการและผู้จัดการได้รับทราบด้วย

รายชื่อคณะกรรมการ ตลาดหลักทรัพย์ฯ (กรรมการท่านอื่นที่ไม่ใช่กรรมการและผู้จัดการ เป็นกรรมการที่ไม่เป็นผู้บริหารทั้งหมด)	จำนวนครั้งที่เข้าร่วมประชุม / จำนวนครั้งที่ประชุมทั้งหมด			
	คณะกรรมการ ตลาดหลักทรัพย์ฯ รวม 15 ครั้ง/ปี	คณะอนุกรรมการ ตรวจสอบ รวม 12 ครั้ง/ปี	คณะอนุกรรมการ สรรหาและกำกับ ดูแลกิจการ รวม 13 ครั้ง/ปี	คณะอนุกรรมการ พิจารณา ผลตอบแทน รวม 9 ครั้ง/ปี
กรรมการชุดปัจจุบัน				
1. นายสมพล เกียรติไพบูลย์ ประธาน	15/15			
2. นางภัทธีรา ดิปลกรังษิระภพ รองประธาน	15/15		12/13	8/9
3. นางไขศรี เนื่องสีกาเพียร กรรมการ	14/15	12/12	12/13	9/9
4. นายชัยภัทร ศรีวิสารวาจา กรรมการ ⁽¹⁾	10/10			
5. นายไพบูลย์ นลินทรางกูร กรรมการ	12/15	11/12		
6. นายพี สุจิตกุล กรรมการ	14/15		12/13	8/9
7. นางศศิธร พงศธร กรรมการ ⁽²⁾	8/8		3/4	3/4
8. ดร.สุภัค ศิวะรักษ์ กรรมการ	14/15	12/12		
9. นายสุเทพ พิตกานนท์ กรรมการ ⁽¹⁾	10/10			
10. นายโยธิน เนื่องจางค์ กรรมการ ⁽²⁾	8/8			
11. นายจรัมพร โชติกเสถียร กรรมการและผู้จัดการ	14 ⁽⁵⁾ /15		12/13	8/9
กรรมการที่ครบวาระในระหว่างปี 2555				
1. นายสมเจตน์ หมูศิริเลิศ กรรมการ ⁽³⁾	5/5			1/2
2. นายสุรพล ขวัญไฉญญา กรรมการ ⁽³⁾	5/5			
3. ดร.ชัยพัฒน์ สหสกุล กรรมการ ⁽⁴⁾	7/7			
4. นายอัศวิน คงสิริ กรรมการ ⁽⁴⁾	6/7		7/9	3/5

หมายเหตุ : ⁽¹⁾ นายชัยภัทร ศรีวิสารวาจา และนายสุเทพ พิตกานนท์ เข้าดำรงตำแหน่งเมื่อวันที่ 28 พฤษภาคม 2555

⁽²⁾ นางศศิธร พงศธร และนายโยธิน เนื่องจางค์ เข้าดำรงตำแหน่งเมื่อวันที่ 11 สิงหาคม 2555

⁽³⁾ นายสมเจตน์ หมูศิริเลิศ และนายสุรพล ขวัญไฉญญา ครบวาระการดำรงตำแหน่งเมื่อวันที่ 27 พฤษภาคม 2555

⁽⁴⁾ ดร.ชัยพัฒน์ สหสกุล และนายอัศวิน คงสิริ ครบวาระการดำรงตำแหน่งเมื่อวันที่ 10 สิงหาคม 2555

⁽⁵⁾ เนื่องจากการประชุมโดยไม่มีฝ่ายจัดการ 1 ครั้ง ดังนั้น กรรมการและผู้จัดการจึงไม่ได้เข้าร่วมประชุมในครั้งดังกล่าว

5.4 การประเมินตนเองของคณะกรรมการ

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มีการประเมินผลการปฏิบัติงานอย่างต่อเนื่องเป็นประจำทุกปีอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง เพื่อทบทวนผลการปฏิบัติหน้าที่ ปัญหาและอุปสรรคต่าง ๆ ในระหว่างปีที่ผ่านมาและเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพในการทำงาน รวมทั้งสนับสนุนหลักการทำงานที่ดี โดยในปี 2555 คณะอนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการ ได้พิจารณากระบวนการประเมินผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ และได้มีการปรับปรุงหัวข้อประเมิน โดยเพิ่มเติมหัวข้อการประเมินเกี่ยวกับการกำกับดูแลกิจการที่ดี และแยกการประเมินผลการทำหน้าที่ของประธานกรรมการฯ ออกจากการประเมินผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการทั้งคณะ ซึ่งผลการประเมินการปฏิบัติงานของคณะกรรมการทั้งคณะนั้น คณะอนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการเป็นผู้ทำหน้าที่รวบรวมผลการประเมิน และนำเสนอต่อที่ประชุมคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ส่วนผลการประเมินการทำหน้าที่ของประธานกรรมการนั้น ประธานอนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการเป็นผู้รายงานผลการประเมินโดยตรงต่อประธานกรรมการ

ในการประเมินผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการทั้งคณะ มีหัวข้อประเมินทั้งหมด 8 หมวด ได้แก่

หมวด 1	การกำหนดกลยุทธ์ และการวางแผนธุรกิจ
หมวด 2	การจัดการความเสี่ยงและการควบคุมภายใน
หมวด 3	การดูแลไม่ให้เกิดความขัดแย้งทางผลประโยชน์
หมวด 4	การกำกับดูแลกิจการที่ดี*
หมวด 5	การมอบหมายอำนาจดำเนินการ
หมวด 6	ความพร้อมของคณะกรรมการ
หมวด 7	การประชุม
หมวด 8	การประเมินผลและการเตรียมบุคลากรระดับบริหาร

* ในปี 2555 ได้มีการเพิ่มเติมหัวข้อการประเมินเกี่ยวกับการกำกับดูแลกิจการที่ดี ไว้ในแบบประเมินฯ ด้วย

ในปี 2555 ผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการทั้งคณะ ทั้ง 8 หมวด ได้คะแนนเฉลี่ยของทุกหมวด เท่ากับ 4.53 จากระดับคะแนน 5 หรือคิดเป็นคะแนนเฉลี่ยร้อยละ 90.60 โดยกรรมการส่วนใหญ่เห็นว่าคณะกรรมการมีการติดตามและดูแลการดำเนินการตามแผนธุรกิจตามระยะเวลาที่กำหนด มีระบบการควบคุมภายในที่เพียงพอและเหมาะสม มีการตรวจสอบภายในอย่างสม่ำเสมอและรายงานผลการตรวจสอบภายในต่อคณะกรรมการเป็นประจำ รวมทั้งได้ส่งเสริมให้มีการจัดกิจกรรมเพื่อสื่อสารนโยบายการกำกับดูแลกิจการและจรรยาบรรณให้ผู้บริหารและพนักงานทราบและถือปฏิบัติ

นอกจากนี้ ในปี 2555 ได้จัดให้มีการประเมินผลการทำหน้าที่ของประธานกรรมการฯ แยกออกจากการประเมินผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการทั้งคณะ ซึ่งมีหัวข้อประเมินที่สำคัญ ได้แก่ การเปิดโอกาสและสนับสนุนให้กรรมการแสดงความคิดเห็น ไม่ขึ้นกับความเห็นของที่ประชุม มีการตัดสินใจอย่างเหมาะสม รวมทั้งการสนับสนุนให้กรรมการพิจารณารายงานการประชุมเพื่อให้มีรายละเอียดที่ถูกต้องครบถ้วน ก่อนลงมติรับรองการประชุม โดยประธานอนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการเป็นผู้รายงานผลการประเมินโดยตรงต่อประธานกรรมการ

สำหรับการประเมินผลการปฏิบัติงานของคณะอนุกรรมการของตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้แก่ คณะอนุกรรมการตรวจสอบ คณะอนุกรรมการพิจารณาผลตอบแทน และคณะอนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการนั้น ในปี 2555 ได้มีการดำเนินการประเมินผลการปฏิบัติงานของคณะอนุกรรมการชุดดังกล่าว และได้เสนอผลการประเมินต่อที่ประชุมคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เรียบร้อยแล้ว

5.5 คำตอบแทนกรรมการและผู้บริหารระดับสูง

พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ กำหนดให้ประธานกรรมการ และกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้รับประโยชน์ตอบแทนตามที่ที่ประชุมสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด จึงมั่นใจได้ว่าการจ่ายผลตอบแทนแก่กรรมการทั้งหลายเป็นไปด้วยความโปร่งใส ปราศจากการมีส่วนตัดสินใจในการจ่ายผลตอบแทนให้แก่ตนเอง

โดยคณะอนุกรรมการพิจารณาผลตอบแทน เป็นผู้พิจารณาหลักเกณฑ์การจ่ายค่าตอบแทนสำหรับคณะกรรมการ และนำเสนอคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อพิจารณา ก่อนนำเสนอขออนุมัติจากที่ประชุมสมาชิก ตามพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ มาตรา 177

นอกจากนั้น คณะอนุกรรมการพิจารณาผลตอบแทน ยังเป็นผู้พิจารณาหลักเกณฑ์การจ่ายค่าตอบแทนสำหรับอนุกรรมการ ผู้จัดการและผู้บริหารระดับสูง รวมถึงการกำหนดค่าตอบแทนสำหรับผู้จัดการและผู้บริหารระดับสูงเป็นรายบุคคล เพื่อนำเสนอต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ พิจารณานุมัติ ซึ่งมีหลักเกณฑ์การประเมินผลงานผู้จัดการ และผู้บริหารอย่างชัดเจน ในรูปแบบดัชนีวัดผลการปฏิบัติงาน (KPI) โดยเปรียบเทียบกับ KPI เป้าหมายที่กำหนดกับผลงานที่ทำได้จริง ซึ่งเชื่อมโยงกับอัตราค่าตอบแทนที่ได้รับตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด โดยพิจารณาจากผลการดำเนินงานทางธุรกิจ และการดำเนินงานตามนโยบายที่ได้รับจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ประกอบกับสถานะทางสังคมและเศรษฐกิจโดยรวม และพิจารณาจากข้อมูลในอดีตประกอบการพิจารณากำหนดผลตอบแทน

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้รับคำตอบแทนจากการเป็นกรรมการเป็นรายเดือนตามอัตราที่กำหนดโดยที่ประชุมสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ฯ และกรรมการที่ได้รับแต่งตั้งให้ดำรงตำแหน่งอนุกรรมการ หรือกรรมการบริษัทย่อย ได้รับคำตอบแทนตามอัตราที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด โดยพิจารณาตามความเหมาะสม และสอดคล้องกับภาระหน้าที่และความรับผิดชอบ

คำตอบแทนกรรมการและอนุกรรมการชุดย่อย ในปี 2555 เป็นดังนี้

	คณะกรรมการ		คณะอนุกรรมการตรวจสอบ		คณะอนุกรรมการชุดย่อยอื่น	
	ประธาน	กรรมการ	ประธาน	อนุกรรมการ	ประธาน	อนุกรรมการ
คำตอบแทนรายเดือน (บาท)	117,000	78,000	75,000	50,000		
ค่าเบี้ยประชุม (บาท/ครั้งที่เข้าประชุม)					15,000	10,000

• คำตอบแทนของกรรมการ ในปี 2555

กรรมการ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ชุดปัจจุบัน	คำตอบแทนกรรมการ (บาท)					คำตอบแทน รวมของ กรรมการ
	คณะกรรมการ ตลาดหลัก ทรัพย์ฯ	คณะ อนุกรรมการ ตรวจสอบ	คณะ อนุกรรมการ สรรหาและ กำกับดูแล กิจการ	คณะ อนุกรรมการ พิจารณา ผลตอบแทน	คณะ อนุกรรมการ / คณะทำงาน ชุดอื่น และ คณะกรรมาการ บริษัทย่อย	
1. นายสมพล เกียรติไพบูลย์	5,844,000				225,000	6,069,000*
2. นางภัทธีรา ดิปลกรังษิระภพ	936,000		180,000	100,000	400,000	1,616,000
3. นางไขศรี เนื่องสิริขันธ์	936,000	900,000	120,000	115,000		2,071,000
4. นายชัยภัทร ศรีวิสารวาจา	546,000				70,000	616,000
5. นายไพบูลย์ นลินทรางกูร	936,000	600,000			10,000	1,546,000
6. นายรพี สุจริตกุล	936,000		120,000	80,000	211,000	1,347,000
7. นางศศิธร พงศธร	390,000		30,000	30,000		450,000
8. ดร.สุภัค ศิวะรักษ์	936,000	600,000			30,000	1,566,000
9. นายสุเทพ พิตกานนท์	546,000				120,000	666,000
10. นายโยธิน เนื่องจำนงค์	390,000				75,000	465,000
11. นายจรัมพร โชติกเสถียร	936,000					936,000
กรรมการที่ครบวาระในระหว่างปี 2555						
1. นายสมเจตน์ หมูศิริเลิศ	390,000			10,000		400,000
2. นายสุรพล ขวัญใจธัญญา	390,000				105,000	495,000
3. ดร.ชัยพัฒน์ สหสกุล	546,000				55,000	601,000
4. นายอัศวิน คงสิริ	546,000		70,000	30,000		646,000

หมายเหตุ : * คำตอบแทนของประธานกรรมการฯ รวมถึงคำตอบแทนประจำรายเดือนในอัตราเดือนละ 370,000 บาท ซึ่งผ่านการอนุมัติจากที่ประชุมสมาชิก เพื่อให้สอดคล้องกับภาระหน้าที่ที่คณะกรรมการได้มอบหมายเพิ่มเติม

• คำตอบแทนของผู้บริหาร

ผู้บริหารระดับสูงของตลาดหลักทรัพย์ฯ ประกอบด้วย ผู้จัดการ รองผู้จัดการ 5 ท่าน และผู้ช่วยผู้จัดการ 13 ท่าน รวม 19 ท่าน ได้รับผลประโยชน์ตอบแทนรวมเงินเดือน ค่าครองชีพ บำเหน็จพิเศษ โบนัส และเงินสมทบกองทุนสำรองเลี้ยงชีพจากตลาดหลักทรัพย์ฯ ในรอบปี 2555 เป็นจำนวนรวมทั้งสิ้น 164,103,795 บาท

5.6 การพัฒนากรรมการ

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดให้กรรมการของตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เข้ารับการอบรมความรู้และดูงานที่เกี่ยวข้องกับกิจการของตลาดหลักทรัพย์ฯ อย่างต่อเนื่องทั้งในและต่างประเทศ เพื่อเป็นการพัฒนาความรู้และเสริมสร้างวิสัยทัศน์ให้ก้าวไกลอยู่เสมอ และในกรณีที่มีกรรมการเข้าใหม่

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดให้มีการแนะนำภาพรวมการดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ แผนกลยุทธ์ แผนงานประจำ และภาพรวมการดำเนินงานของบริษัทย่อย รวมทั้งได้ส่งมอบคู่มือกรรมการ ซึ่งจะมีข้อมูลสำคัญที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ พึงทราบ อันจะเป็นประโยชน์ต่อการปฏิบัติหน้าที่ในฐานะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

ในปี 2555 กรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เข้ารับการอบรมและเข้าร่วมสัมมนาเพื่อเสริมสร้างความเข้าใจในบทบาทหน้าที่ ความรับผิดชอบ และส่งเสริมทักษะในการปฏิบัติหน้าที่ในฐานะกรรมการอย่างต่อเนื่อง โดยเข้าอบรมหลักสูตรของสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย (IOD) และเข้าร่วมสัมมนาส่งเสริมทักษะความรู้ความเข้าใจเพื่อประโยชน์ต่อการปฏิบัติหน้าที่ในหัวข้อต่างๆ อาทิ งานสัมมนาเพื่อการพัฒนาตลาดทุนไทยประจำปี 2555 งานสัมมนาคู่ขนาน (side event) งาน World Economic Forum on East Asia 2012 ในหัวข้อ “Redefining Opportunities through the Regions’ Connectivity” งาน CEO Forum: บทบาทของ CEO ต่อการสร้างองค์กรที่ยั่งยืน กิจกรรมการแสดงวิสัยทัศน์ทางเศรษฐกิจครั้งประวัติศาสตร์ “ต่างทัศนะ ร่วมมุมมอง ฟันธงตลาดทุน” เรื่อง การรับมือปัญหาเศรษฐกิจโลก ยุทธศาสตร์การยกระดับความสามารถในการแข่งขันของธุรกิจไทยในเวทีโลก และแนวคิดการใช้ตลาดทุนเป็นกลไกหลักในการพัฒนาเศรษฐกิจของประเทศ เป็นต้น และในปี 2555 กรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ จำนวน 10 ท่านได้เดินทางไปศึกษาดูงานต่างประเทศ เพื่อเยี่ยมชมตลาดหลักทรัพย์ออสเตรเลีย Australian Securities Exchange (ASX) และสถาบันการเงินชั้นนำ ณ ประเทศออสเตรเลีย เพื่อประโยชน์ในการเพิ่มพูนความรู้และสร้างสัมพันธภาพอันดีระหว่างบุคลากรในแวดวงตลาดทุนและหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง

นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดให้อนุกรรมการตรวจสอบ และอนุกรรมการบริหารความเสี่ยงเข้าศึกษาดูงานที่ Singapore Exchange (SGX) ณ ประเทศสิงคโปร์ เพื่อศึกษาดูงานเกี่ยวกับบทบาทของคณะกรรมการตรวจสอบและคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงในการส่งเสริมการกำกับดูแลที่ดีให้ทัดเทียมมาตรฐานสากล

สรุปการเข้าอบรมในหลักสูตรกรรมการที่จัดโดยสมาคมส่งเสริมสถาบันกรรมการบริษัทไทย

รายชื่อกรรมการชุดปัจจุบัน	หลักสูตรของ IOD ที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เข้าร่วมอบรม						
	Director Certification Program (DCP)	Director Accreditation Program (DAP)	The Role of The Chairman Program (RCP)	Chartered Director Class (CDC)	The Executive Director Course (EDC)	Financial Institutions Governance Program (FGP)	Role of the Compensation Committee (RCC)
1. นายสมพล เกียรติไพบูลย์			✓				
2. นางภทธีรา ดิลกรุ่งธีระภพ	✓	✓	✓				
3. นางไขศรี เนื่องลีลาเพียร	✓*		✓ (ปี 2556)				
4. นายชัยภัทร ศรีวิสารวาจา	✓		✓				
5. นายไพบูลย์ นลินทรางกูร	✓	✓					
6. นายโยธิน เนื่องจำนงค์	✓						
7. นายรพี สุจริตกุล	✓*		✓*	✓	✓ (ปี 2555)		✓*
8. นางศศิธร พงศธร	✓	✓				✓	
9. นายสุเทพ พิตกานนท์	✓		✓				
10. ดร.สุภัค ศิวะรักษ์	✓	✓				✓	
11. นายจรัมพร โชติกเสถียร		✓					

* หมายถึง : นางไขศรี เนื่องลีลาเพียร เป็นวิทยากรหลักสูตร DCP ของ IOD
นายรพี สุจริตกุล เป็นวิทยากรหลักสูตร DCP, RCP และ RCC ของ IOD

คณะกรรมการของตลาดหลักทรัพย์ฯ

ข้อมูล ณ 1 มีนาคม 2556

1. คณะอนุกรรมการตรวจสอบ

2. คณะอนุกรรมการพิจารณาผลตอบแทน

3. คณะอนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการ

4. คณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง

5. คณะอนุกรรมการวินัย

6. คณะกรรมการอุทธรณ์

7. คณะอนุกรรมการกฎหมาย
8. คณะอนุกรรมการพิจารณาแนวทางด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ

9. คณะอนุกรรมการก่อสร้างอาคารตลาดหลักทรัพย์ฯ

10. คณะอนุกรรมการสรรหาและพัฒนาบริษัทจดทะเบียน

11. คณะอนุกรรมการกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์

12. คณะอนุกรรมการศูนย์พัฒนาการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน

1. คณะอนุกรรมการตรวจสอบของตลาดหลักทรัพย์ฯ

หน่วยงานที่ดูแล : ฝ่ายตรวจสอบภายใน

องค์ประกอบ : กรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ อย่างน้อย 3 คน ที่ได้รับการแต่งตั้งจากคณะกรรมการ ก.ล.ด. 1 คน เป็นกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ซึ่งเป็นผู้บริหารของสมาชิกและได้รับเลือกตั้งจากสมาชิก 1 คน และอย่างน้อย 1 คน เป็นผู้มีความรู้ ความเข้าใจ หรือมีประสบการณ์ด้านการบัญชี การเงิน หรือการตรวจสอบ

วาระการดำรงตำแหน่ง : มีวาระตามวาระของการเป็นกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

รายชื่อ		ดำรงตำแหน่ง
1. นางไขศรี	เนื่องสิริขะเพียร	ประธานอนุกรรมการ
2. นายไพบุลย์	นลินทรางกูร	อนุกรรมการ
3. ดร.สุภัค	ศิวัชรวิทย์	อนุกรรมการ

คณะกรรมการดังกล่าวมีหน้าที่พิจารณาและดำเนินการดังต่อไปนี้

1. สอบทานรายงานทางการเงินของตลาดหลักทรัพย์ฯ ก่อนนำเสนอต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

2. ให้คำแนะนำเกี่ยวกับการแต่งตั้งและกำหนดค่าตอบแทนของผู้สอบบัญชีของตลาดหลักทรัพย์ฯ ประสานงานกับผู้สอบบัญชีเกี่ยวกับวัตถุประสงค์ในการดำเนินการตรวจสอบ ขอบเขต แนวทาง แผนงาน และปัญหาที่พบบ่อยระหว่างการตรวจสอบ และประเด็นที่ผู้สอบบัญชีเห็นว่ามีความสำคัญ

3. ประสานงานกับฝ่ายตรวจสอบภายในของตลาดหลักทรัพย์ฯ เกี่ยวกับวัตถุประสงค์และการวางแผนการตรวจสอบ การรายงานผลการตรวจสอบ การประเมินประสิทธิภาพของระบบการควบคุมภายในของตลาดหลักทรัพย์ฯ การประเมินความเพียงพอของทรัพยากรที่ใช้ในการควบคุมภายใน รวมถึงปัญหาที่พบบ่อยระหว่างการตรวจสอบ

4. ปรีกษาและพิจารณาบทวนผลการตรวจสอบและข้อเสนอแนะของผู้สอบบัญชีและของฝ่ายตรวจสอบภายใน รวมทั้งติดตามการดำเนินการของฝ่ายจัดการต่อข้อเสนอแนะดังกล่าว เพื่อเสนอคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ทราบ

5. ดูแลให้มีการปฏิบัติตามกฎหมายและข้อกำหนดของหน่วยงานที่กำกับดูแลตลาดหลักทรัพย์ฯ

6. ดูแลให้มีการบริหารความเสี่ยงที่สำคัญของตลาดหลักทรัพย์ฯ

7. รายงานการดำเนินงานของคณะกรรมการให้คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ทราบเป็นระยะๆ อย่างน้อยปีละ 4 ครั้ง

8. หน้าที่อื่นอันเนื่องมาจากการปฏิบัติงานของคณะกรรมการตรวจสอบที่อาจกำหนดเพิ่มเติมโดยคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

2. คณะอนุกรรมการพิจารณาผลตอบแทน

หน่วยงานที่ดูแล : ฝ่ายบริหารทรัพยากรบุคคล

องค์ประกอบ : ประธานอนุกรรมการตรวจสอบ รองประธานกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ กรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ 3 คน และผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ

วาระการดำรงตำแหน่ง : มีวาระตามวาระของการเป็นกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

รายชื่อ		ดำรงตำแหน่ง
1. นางไขศรี	เนืองสิขหาเพียร	ประธานอนุกรรมการ
2. นายจรัมพร	โชติเสถียร	อนุกรรมการ
3. นางภัทธีรา	ดิลงรุ่งธีระภพ	อนุกรรมการ
4. นายรพี	สุจริตกุล	อนุกรรมการ
5. นางศศิธร	พงศธร	อนุกรรมการ

คณะอนุกรรมการดังกล่าว มีหน้าที่ดังนี้

1. พิจารณาระบบการบริหารค่าตอบแทน (compensation) ของ Exchange Function และ Capital Market Development Fund (CMDF) Function รวมถึงการเสนอแนะนโยบายและหลักเกณฑ์การจ่ายค่าตอบแทนให้แก่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ กรรมการและผู้จัดการ ที่ปรึกษา อนุกรรมการที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ และคณะกรรมการบริษัทย่อย แต่งตั้ง และผู้บริหารระดับสูง
2. พิจารณากำหนดค่าตอบแทนประจำปี การปรับอัตราเงินเดือนประจำปี การเปลี่ยนแปลงเงินเดือนและผลตอบแทนทุกประเภทของกรรมการและผู้จัดการ และผู้บริหารระดับสูง เป็นรายบุคคล ตลอดจนพิจารณางบประมาณการปรับอัตราค่าตอบแทนประจำปี และเงินรางวัลประจำปีของผู้บริหารระดับสูง

3. คณะอนุกรรมการสรรหาและกำกับดูแลกิจการ

หน่วยงานที่ดูแล : ฝ่ายบริหารทรัพยากรบุคคล

องค์ประกอบ : รองประธานกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ประธานอนุกรรมการตรวจสอบ กรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ 2 คน และผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ

วาระการดำรงตำแหน่ง : มีวาระตามวาระของการเป็นกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

รายชื่อ		ดำรงตำแหน่ง
1. นางภัทธีรา	ดิลงรุ่งธีระภพ	ประธานอนุกรรมการ
2. นางไขศรี	เนืองสิขหาเพียร	อนุกรรมการ
3. นายจรัมพร	โชติเสถียร	อนุกรรมการ
4. นายรพี	สุจริตกุล	อนุกรรมการ
5. นางศศิธร	พงศธร	อนุกรรมการ

คณะอนุกรรมการดังกล่าว มีหน้าที่ดังนี้

1. พิจารณาสรรหาบุคลากรเข้าดำรงตำแหน่งผู้บริหารระดับสูง เพื่อรองรับการดำเนินงานภายใต้โครงสร้างใหม่ภายหลังจากปรับโครงสร้างองค์กรของตลาดหลักทรัพย์ฯ และบริษัทย่อยแล้ว
2. พิจารณาคณะกรรมการของบริษัทย่อย ที่ปรึกษา คณะอนุกรรมการ และที่ปรึกษา ของตลาดหลักทรัพย์ฯ
3. พิจารณาเรื่องอื่นใดที่เกี่ยวข้องกับการปรับโครงสร้างองค์กร และการจัดการบุคลากรระดับสูงให้เหมาะสมกับภารกิจของ Exchange Function และ CMD Function ในอนาคต
4. กำหนดกรอบการทำงานการกำกับดูแลกิจการที่ดี (CG Framework) หรือนโยบายการกำกับดูแลกิจการให้สอดคล้องกับมาตรฐานสากล
5. ทบทวนแนวปฏิบัติด้านการกำกับดูแลกิจการให้เหมาะสมกับโครงสร้างการดำเนินงานขององค์กร และสอดคล้องกับองค์กรชั้นนำ อาทิ นโยบายการกำกับดูแลกิจการของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ (CG Policy) และจรรยาบรรณกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ (Code of Ethics) เป็นต้น
6. กำหนดแนวทางการจัดทำรายงานการปฏิบัติตามหลักการของการกำกับดูแลกิจการที่ดี (CG Report) ของตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่เปิดเผยในรายงานประจำปี

4. คณะอนุกรรมการบริหารความเสี่ยง

หน่วยงานที่ดูแล : ส่วนงานบริหารความเสี่ยงองค์กร

องค์ประกอบ : กรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ และผู้เชี่ยวชาญด้านการบริหารความเสี่ยง

วาระการดำรงตำแหน่ง : 1 มกราคม 2556 - 31 ธันวาคม 2556

รายชื่อ		ดำรงตำแหน่ง
1. นายรพี	สุจิตกุล	ประธานอนุกรรมการ
2. นางอุษุกร	สิริโยธิน	อนุกรรมการ
3. นายโยธิน	เนื่องจำนงค์	อนุกรรมการ
4. นายสมเกียรติ	ศิริชาติไชย	อนุกรรมการ
5. นายสุเทพ	พิทักษ์นันท	อนุกรรมการ
6. ศ.ดร.อัญญา	ขันธวิทย์	อนุกรรมการ

คณะอนุกรรมการดังกล่าว มีหน้าที่ดังต่อไปนี้

1. ให้คำแนะนำและให้ความเห็นแก่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ และฝ่ายบริหาร เพื่อให้มีการกำหนดนโยบายและกรอบการบริหารความเสี่ยงอย่างเหมาะสม และเพื่อให้มั่นใจว่าหน่วยงานต่างๆ สามารถดำเนินการบริหารความเสี่ยงได้อย่างมีประสิทธิภาพ และครอบคลุมความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินธุรกิจขององค์กรอย่างครบถ้วน
2. ให้คำปรึกษาและข้อเสนอแนะแก่หน่วยงานบริหารความเสี่ยงในเรื่องเกี่ยวกับการบริหารความเสี่ยงทุกประเภท
3. พิจารณาความเหมาะสมของวิธีการประเมินความเสี่ยง เพื่อให้มั่นใจได้ว่าความเสี่ยงที่สำคัญได้รับการดูแลและจัดการอย่างเหมาะสม

5. คณะอนุกรรมการวินัย

หน่วยงานที่ดูแล : ฝ่ายวินัยและคดี

องค์ประกอบ : ประกอบด้วยอนุกรรมการ 5 คน โดยอย่างน้อยต้องเป็นกรรมการตลาดหลักทรัพย์ 1 คน ผู้มีความรู้และประสบการณ์ในกิจการตลาดหลักทรัพย์ ธุรกิจหลักทรัพย์ หรือธุรกิจการเงินเป็นอย่างดี 1 คน ผู้ทรงคุณวุฒิด้านกฎหมาย 1 คน และผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ หรือผู้บริหารที่มีตำแหน่งไม่น้อยกว่าผู้ช่วยผู้จัดการฯ ที่ได้รับมอบหมายจากผู้จัดการฯ 1 คน

วาระการดำรงตำแหน่ง : 1 มกราคม 2556 - 31 ธันวาคม 2557

	รายชื่อ	ดำรงตำแหน่ง
1. นางภัทธีรา	ดิลกรุ่งธีระภพ	ประธานอนุกรรมการ
2. นายรพี	สุจิตกุล	อนุกรรมการ
3. นายสุทธิ	สุขยิ่ง	อนุกรรมการ
4. นายสุเทพ	พิตกานนท์	อนุกรรมการ
5. นายศักรินทร์	ร่วมรังษี	อนุกรรมการ

คณะอนุกรรมการดังกล่าว มีหน้าที่ดังต่อไปนี้

- พิจารณาความผิดและลงโทษบุคคลที่ฝ่าฝืนหรือมีส่วนเกี่ยวข้องในการฝ่าฝืนข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ฯ และรายงานการลงโทษให้คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ทราบ ยกเว้นกรณีความผิดและลงโทษดังต่อไปนี้ ให้คณะอนุกรรมการวินัยพิจารณาและเสนอความเห็นต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อพิจารณาความผิดและลงโทษ
 - การสั่งเพิกถอนหลักทรัพย์จากการเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียน
 - การสั่งห้ามบริษัทสมาชิกรายใดรายหนึ่งเข้าทำการซื้อหรือขายหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นการชั่วคราว
 - การสั่งเพิกถอนสมาชิกภาพของบริษัทสมาชิก
 - กรณีอื่นๆ ตามที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด
- พิจารณาและสั่งการอื่นใดเพื่อให้เป็นไปตามข้อกำหนดว่าด้วยการพิจารณาความผิดและลงโทษทางวินัย ตลอดจนการปฏิบัติอื่นใดที่จำเป็นต่อการกระบวนการพิจารณาความผิดและลงโทษทางวินัย

6. คณะกรรมการอุทธรณ์

หน่วยงานที่ดูแล : ฝ่ายวินัยและคดี

องค์ประกอบ : เป็นบุคคลที่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ แต่งตั้งโดยได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการ ก.ล.ต. โดยคณะกรรมการอุทธรณ์ต้องมีจำนวนไม่น้อยกว่า 3 คน แต่ไม่เกิน 5 คน ซึ่งในจำนวนนี้อย่างน้อยต้องเป็นผู้ทรงคุณวุฒิ และมีประสบการณ์สูงด้านกฎหมาย ด้านการบัญชีและการเงิน และด้านธุรกิจหลักทรัพย์ ด้านละ 1 คน

วาระการดำรงตำแหน่ง : 1 กรกฎาคม 2554 - 30 มิถุนายน 2556

	รายชื่อ	ดำรงตำแหน่ง
1. ศ.ศิริชัย	รดีศรี	ประธานกรรมการ
2. นายโชคชัย	ตั้งพูลสินธนา	กรรมการ
3. ศาสตราจารย์พิเศษประสิทธิ์	โมวิไลกุล	กรรมการ
4. นายมานพ	นาคทัต	กรรมการ
5. ดร.สมจินต์	ศรไพศาล	กรรมการ

คณะกรรมการดังกล่าว มีหน้าที่ดังต่อไปนี้

1. พิจารณาคำขออุทธรณ์คำสั่งลงโทษของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ คณะอนุกรรมการวินัย และผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ ว่าผู้อุทธรณ์มิได้กระทำความผิดอันเป็นการฝ่าฝืนข้อกำหนดของตลาดหลักทรัพย์ จริงตามที่ขออุทธรณ์หรือไม่
2. พิจารณาคำขอทุเลาการบังคับตามคำสั่งลงโทษ (ถ้ามี) โดยอาจกำหนดเงื่อนไขหรือหลักประกันใดๆ ตามที่จำเป็นด้วยก็ได้
3. ทำความเห็นเสนอคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ เพื่อพิจารณาสั่งการให้ลงโทษ ลดโทษหรือไม่ลงโทษ หรือยืนยืนตามคำสั่งลงโทษที่มีการอุทธรณ์ หรือสั่งการอย่างหนึ่งอย่างใดในประเด็นที่ผู้อุทธรณ์ได้อุทธรณ์มา
4. มีคำสั่งให้ยุติและจำหน่ายคำอุทธรณ์ ในกรณีที่ผู้อุทธรณ์ได้ถอนคำอุทธรณ์ไปก่อนหรือระหว่างการพิจารณาและวินิจฉัยของคณะกรรมการอุทธรณ์

7. คณะอนุกรรมการกฎหมาย

หน่วยงานที่ดูแล : ฝ่ายกฎหมาย

องค์ประกอบ : ผู้เชี่ยวชาญด้านกฎหมายและ/หรือด้านตลาดทุน

วาระการดำรงตำแหน่ง : 1 มกราคม 2556 – 31 ธันวาคม 2556

รายชื่อ		ดำรงตำแหน่ง
1. นายดิเรก	สุนทรเกตุ	ประธานอนุกรรมการ
2. นายทรงเดช	ประดิษฐ์สมานนท์	อนุกรรมการ
3. รศ.จิตติพันธุ์	เชื้อบุญชัย	อนุกรรมการ
4. นายเสรี	จินตนาเสรี	อนุกรรมการ
5. นายสุทธิชัย	จิตรวาณิช	อนุกรรมการ

คณะอนุกรรมการดังกล่าว มีหน้าที่ให้คำปรึกษา ความเห็น และข้อเสนอแนะต่างๆ ต่อคณะกรรมการและตลาดหลักทรัพย์ ในเรื่องเกี่ยวกับงานด้านกฎหมายและระเบียบข้อบังคับตลาดหลักทรัพย์

8. คณะอนุกรรมการพิจารณาแนวทางด้านเทคโนโลยีสารสนเทศ

หน่วยงานที่ดูแล : กลุ่มงานปฏิบัติการและเทคโนโลยีสารสนเทศ

องค์ประกอบ : ผู้ทรงคุณวุฒิและมีประสบการณ์สูงด้านเทคโนโลยีและด้านธุรกิจหลักทรัพย์ ผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ และผู้บริหารระดับสูงของตลาดหลักทรัพย์

วาระการดำรงตำแหน่ง : 1 มกราคม 2556 – 31 ธันวาคม 2556

รายชื่อ		ดำรงตำแหน่ง
1. ดร.วัลลภ	วิมลวณิชย์	ประธานอนุกรรมการ
2. นางเกศรา	มัญชุศรี	อนุกรรมการ
3. นายจรัมพร	โชติกเสถียร	อนุกรรมการ
4. นางชนิสรา	ชุติภัทร์	อนุกรรมการ
5. นางภัทธีรา	ดิลกรุ่งธีระภพ	อนุกรรมการ
6. ดร.วิทยา	วัชรวิทยากุล	อนุกรรมการ
7. นายสมคิด	จิรนนตรัตน์	อนุกรรมการ
8. นายสรรเสริญ	นิลรัตน์	อนุกรรมการ

คณะกรรมการดังกล่าว มีหน้าที่ดังต่อไปนี้

1. พิจารณานโยบายการพัฒนาและใช้งานเทคโนโลยีสารสนเทศ เพื่อให้สามารถสนับสนุนการดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ในการเป็นศูนย์กลางตลาดทุนได้อย่างเหมาะสม มีประสิทธิภาพความน่าเชื่อถือ และความปลอดภัย อันจะเป็นประโยชน์ต่อธุรกิจตลาดทุนโดยรวม
2. พิจารณากลับกรอกรูปแบบและแนวทางการพัฒนากระบวนการธุรกรรมที่อาศัยเทคโนโลยีเป็นเครื่องมือในการรองรับการเจริญเติบโตของธุรกิจ โดยสนับสนุนให้เกิดพันธกิจร่วมกันภายในกลุ่มอุตสาหกรรมตลาดทุน และสามารถยกระดับตลาดทุนเทียบชั้นแนวหน้าในภูมิภาค

9. คณะกรรมการก่อสร้างอาคารตลาดหลักทรัพย์

หน่วยงานที่ดูแล : กลุ่มบริหารทรัพย์สิน กองทุนเพื่อพัฒนาตลาดทุน (CMDF)

องค์ประกอบ : ประธานกรรมการตลาดหลักทรัพย์ กรรมการตลาดหลักทรัพย์ ผู้เชี่ยวชาญด้านอสังหาริมทรัพย์ และผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์

วาระการดำรงตำแหน่ง : 1 มกราคม 2556 – 31 ธันวาคม 2556

รายชื่อ		ดำรงตำแหน่ง
1. นายสมพล	เกียรติไพบุลย์	ประธานกรรมการ
2. นายจรัมพร	โชติเสถียร	อนุกรรมการ
3. นายประทีป	ตั้งมดีธรรม	อนุกรรมการ
4. นายโยธิน	เนื่องจำนงค์	อนุกรรมการ
5. นายวิชัย	พูลวรลักษณ์	อนุกรรมการ
6. นายสมเจตน์	หมู่ศิริเลิศ	อนุกรรมการ
7. นายสุเทพ	พืตกานนท์	อนุกรรมการ

คณะกรรมการฯ ดังกล่าวมีหน้าที่พิจารณาและดำเนินการ ดังต่อไปนี้

1. พิจารณาอุปสงค์การใช้งานด้านที่ดิน อาคารและสถานที่ ของตลาดหลักทรัพย์ บริษัทย่อย และหน่วยงานที่เกี่ยวข้อง ทั้งจากการใช้งานจริงในปัจจุบัน และจากแผนยุทธศาสตร์การพัฒนาดังกล่าวในระยะต่างๆ
2. กำหนดนโยบาย แผนแม่บทและแนวความคิด สำหรับการพัฒนาดังกล่าว อาคาร และสถานที่ รวมถึงแนวทางดำเนินการใดๆ เพื่อให้ตลาดหลักทรัพย์ สามารถเข้าใช้ประโยชน์ในที่ดิน เพื่อรองรับอุปสงค์ตามข้อ 1 ทั้งในระยะสั้นและระยะยาว
3. เสนอแนะต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ เพื่อพิจารณาอนุมัติให้เป็นนโยบาย และกรอบการดำเนินการแก่ฝ่ายจัดการ
4. แต่งตั้งและมอบหมายคณะทำงานด้านต่างๆ ตามที่เห็นสมควร เพื่อดำเนินการใดๆ บนที่ดินหรืออาคารและสถานที่ ตามแนวนโยบายที่ได้กำหนดไว้

10. คณะอนุกรรมการสรรหาและพัฒนาบริษัทจดทะเบียน

หน่วยงานที่ดูแล : สายงานผู้ออกหลักทรัพย์และบริษัทจดทะเบียน

องค์ประกอบ : ประธานกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ทำหน้าที่เป็นประธาน กรรมการและผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ - โดยตำแหน่ง ผู้แทนจากสภา สมาคม องค์กรที่เป็นผู้แทนของภาคธุรกิจ ภาครัฐ และเอกชน ผู้ทรงคุณวุฒิ ที่เกี่ยวข้องกับการส่งเสริมและผลักดัน ให้บริษัทเอกชนที่มีศักยภาพเข้าจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ อาทิ สภาหอการค้าไทยและสภาหอการค้าแห่งประเทศไทย สภาอุตสาหกรรมแห่งประเทศไทย สมาคมธนาคารไทย คณะกรรมการส่งเสริมการลงทุน สภาธุรกิจตลาดทุนไทย สำนักงาน คณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

วาระการดำรงตำแหน่ง : 1 มกราคม 2556 - 31 ธันวาคม 2556

รายชื่อ		ดำรงตำแหน่ง
1. นายสมพล	เกียรติไพบูลย์	ประธานอนุกรรมการ
2. นางกอบกาญจน์	วัฒนวรางกูร	อนุกรรมการ
3. นายชาลี	จันทนียังยง	อนุกรรมการ
4. นายนรรัตน์	ลิ่มนรรัตน์	อนุกรรมการ
5. นายประสงค์	พูนธเนศ	อนุกรรมการ
6. นายประเวช	องอาจสิทธิกุล	อนุกรรมการ
7. นายพยุงค์ศักดิ์	ชาติสุทธิผล	อนุกรรมการ
8. นายพงษ์ศักดิ์	อัสสกุล	อนุกรรมการ
9. นายไพบูลย์	นลินทรางกูร	อนุกรรมการ
10. นายโยธิน	เนื่องจำนงค์	อนุกรรมการ
11. นางวัชรวิ	วิมุกตายน	อนุกรรมการ
12. ดร.สมชัย	สัจจพงษ์	อนุกรรมการ
13. นายสมประสงค์	บุญยะชัย	อนุกรรมการ
14. ดร.สุนทร	อรุณานนท์ชัย	อนุกรรมการ
15. ดร.สุภัค	ศิวัธวัช	อนุกรรมการ
16. นายอุดม	วงศ์วิวัฒน์ไชย	อนุกรรมการ
17. ผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ		อนุกรรมการ

คณะอนุกรรมการดังกล่าวมีหน้าที่สรรหาและชักชวนบริษัทที่มีศักยภาพ ทั้งที่ประกอบกิจการในประเทศไทยและต่างประเทศ เข้าระดมทุน ในตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ และสนับสนุนการพัฒนาบริษัทจดทะเบียนให้สามารถใช้ประโยชน์ จากตลาดทุนได้อย่างมีประสิทธิภาพ รวมทั้งผลักดันหรือปรับปรุงแก้ไขกฎระเบียบหรือข้อจำกัดต่างๆ เพื่อให้เป็นประโยชน์ต่อการนำ หลักทรัพย์เข้าจดทะเบียน และการดำรงสถานะบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ

11. คณะอนุกรรมการกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์

หน่วยงานที่ดูแล : ฝ่ายกำกับบริษัทสมาชิก

องค์ประกอบ : กรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ซึ่งได้รับการแต่งตั้งจากคณะกรรมการ ก.ล.ต. เป็นประธาน กรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่ได้รับเลือกตั้งจากสมาชิก สมาชิกของกองทุนที่ได้รับการเลือกตั้ง นายกสมาคมส่งเสริมผู้ลงทุนไทย กรรมการและผู้จัดการตลาด หลักทรัพย์ฯ หรือผู้ที่ได้รับมอบหมาย ผู้ช่วยผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ ดูแลงานกำกับบริษัทสมาชิก เป็นอนุกรรมการและเลขานุการ¹

วาระการดำรงตำแหน่ง : 1 มกราคม 2556 - 31 ธันวาคม 2556

¹ เป็นไปตามระเบียบการเป็นสมาชิกกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์

รายชื่อ		ดำรงตำแหน่ง
1. นายโยธิน	เนืองจันงค์	ประธานอนุกรรมการ
2. นายชัยภัทร	ศรีวิสารวาจา	อนุกรรมการ
3. นางพรพริ้ง	สุขสันติสุวรรณ	อนุกรรมการ
4. นายมงคล	ลีลาธรรม	อนุกรรมการ
5. ผู้อำนวยการสถาบันกองทุนเพื่อพัฒนาตลาดทุน ดูแลงานบริหารทรัพย์สิน		อนุกรรมการ
6. ผู้ช่วยผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์ฯ ดูแลงานกำกับบริษัทสมาชิก		อนุกรรมการและเลขานุการ

คณะอนุกรรมการดังกล่าว มีหน้าที่ดังต่อไปนี้

1. วางนโยบายการลงทุนในทรัพย์สินของกองทุน
2. พิจารณาและเสนอความเห็นในการจ่ายชดเชยทรัพย์สินเพื่อให้ความคุ้มครองแก่ผู้ลงทุนต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์
3. สนับสนุนให้เกิดความมั่นใจแก่นักลงทุนที่ซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์
4. ดำเนินการอื่นใดตามที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์การอนุมัติให้ความคุ้มครองแก่ผู้ลงทุนให้เป็นไปตามมติของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์

12. คณะอนุกรรมการศูนย์พัฒนาการกำกับดูแลกิจการบริษัทจดทะเบียน

หน่วยงานที่ดูแล : ฝ่ายพัฒนาธรรมาภิบาลเพื่อตลาดทุน

องค์ประกอบ : ผู้ทรงคุณวุฒิและมีประสบการณ์ด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดี

วาระการดำรงตำแหน่ง : 1 มกราคม 2556 – 31 ธันวาคม 2556

รายชื่อ		ดำรงตำแหน่ง
1. ศ.ศิริชัย	รติศรี	ประธานอนุกรรมการ
2. นายปรกรณ์	มาลากุล ณ อยุธยา	อนุกรรมการ
3. นางภัทริยา	เบญจพลชัย	อนุกรรมการ
4. นายยุทธ	วรฉัตรธาร	อนุกรรมการ
5. ศ.ดร.วรภัทร	โตชนะเกษม	อนุกรรมการ

คณะอนุกรรมการดังกล่าว มีหน้าที่ดังต่อไปนี้

1. พิจารณากรอบนโยบายและแนวทางการพัฒนาด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดีของบริษัทจดทะเบียน วิสาหกิจ และองค์กรที่เกี่ยวข้องในตลาดทุนให้มีมาตรฐาน ตลอดจนการสร้างระบบและการพัฒนาแนวทางในการนำหลักการด้านการกำกับดูแลกิจการที่ดีไปใช้ในการบริหารจัดการเพื่อสร้างสรรค์มูลค่าเพิ่มในตลาดทุนไทย
2. ให้คำปรึกษาและคำแนะนำ ตลอดจนข้อเสนอแนะที่เป็นประโยชน์แก่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ฝ่ายบริหาร และฝ่ายพัฒนาธรรมาภิบาลเพื่อตลาดทุน ในการพัฒนาการกำกับดูแลกิจการที่ดีในตลาดทุน
3. เผยแพร่หลักการ และสร้างความรู้ความเข้าใจแก่ผู้เกี่ยวข้องในโอกาสต่างๆ โดยการให้คำปรึกษา แนะนำ ด้วยการเข้าพบพูดคุยกับบริษัทเป็นการเฉพาะ ตลอดจนการเป็นวิทยากรให้ความรู้แก่กลุ่มเป้าหมายต่างๆ
4. แต่งตั้งคณะทำงาน เพื่อทำหน้าที่ศึกษาข้อมูลในรายละเอียด หรือเพื่อช่วยดำเนินการใดๆ ตามอำนาจหน้าที่และตามความจำเป็น และให้คณะทำงานนั้น เสนอผลการดำเนินการให้คณะอนุกรรมการพิจารณาภายในระยะเวลาที่กำหนด

รายงานคณะกรรมการตรวจสอบ

คณะกรรมการตรวจสอบของตลาดหลักทรัพย์ฯ ประกอบด้วยกรรมการอิสระที่มีได้เป็นผู้บริหาร จำนวน 3 ท่าน ซึ่งเป็นผู้ที่มีความรู้ ความเชี่ยวชาญ และมีประสบการณ์ที่หลากหลายทั้งด้านการบัญชี การเงิน การบริหารและการตรวจสอบ โดยมี นางไขศรี เนื่องลีลาเพียร ซึ่งเป็นผู้สอบบัญชีรับอนุญาตแห่งประเทศไทย เป็นประธานกรรมการตรวจสอบ นายไพฑูรย์ นลินทรางกูร และ ดร.สุภัค ศิวะรักษ์ เป็นอนุกรรมการตรวจสอบ

ในปี 2555 คณะกรรมการตรวจสอบมีการประชุมรวมทั้งสิ้น 12 ครั้ง เป็นการประชุมร่วมกับผู้บริหารระดับสูงโดยไม่มีหน่วยงานตรวจสอบภายในเข้าร่วมประชุม 1 ครั้ง และประชุมร่วมกับผู้สอบบัญชีรวมทั้งสิ้น 3 ครั้ง เพื่อให้ข้อคิดเห็นต่อแผนการตรวจสอบตลอดจนรับทราบผลการตรวจสอบของผู้สอบบัญชี โดยมีการประชุม 2 ครั้งที่ไม่ใช่ฝ่ายจัดการเข้าร่วมประชุม เพื่อหารือและรับทราบความเห็นที่เป็นอิสระของผู้สอบบัญชี การเข้าร่วมประชุมของอนุกรรมการแต่ละท่านรายงานไว้ในหัวข้อรายงานการกำกับดูแลกิจการที่ดีของตลาดหลักทรัพย์ฯ (รายละเอียดปรากฏตามหน้า 74)

คณะกรรมการตรวจสอบได้ปฏิบัติหน้าที่และแสดงความเห็นอย่างเป็นอิสระ ตามขอบเขตอำนาจ หน้าที่ และความรับผิดชอบที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ดังที่กล่าวไว้ในหน้า 78 และรายงานผลการดำเนินงานต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อทราบเป็นรายไตรมาส โดยสรุปสาระสำคัญของการปฏิบัติหน้าที่ในรอบปี 2555 ดังนี้

- **รายงานทางการเงิน** คณะกรรมการตรวจสอบได้สอบทานรายงานทางการเงินรายไตรมาสโดยพิจารณาร่วมกับฝ่ายจัดการและสอบทานรายงานทางการเงินประจำปี โดยพิจารณาร่วมกับผู้สอบบัญชีโดยไม่มีฝ่ายจัดการเข้าร่วมประชุม เพื่อพิจารณาความครบถ้วน ความถูกต้องของข้อมูลที่แสดงในรายงานทางการเงินของตลาดหลักทรัพย์ฯ และการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับรายการที่เกี่ยวข้องกัน ตลอดจนการควบคุมภายในที่เกี่ยวข้องกับการจัดทำรายงานทางการเงิน ตามมาตรฐานการบัญชีที่รับรองทั่วไป
- **การบริหารความเสี่ยง** คณะกรรมการตรวจสอบได้พิจารณานโยบายการบริหารความเสี่ยงและกระบวนการบริหารความเสี่ยงขององค์กร รวมทั้งประชุมร่วมกับผู้บริหารที่ดูแลงานบริหารความเสี่ยงขององค์กรเป็นประจำทุกไตรมาส และประชุมร่วมกับคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงปีละครั้ง เพื่อให้งานตรวจสอบภายในและงานบริหารความเสี่ยงเป็นไปในทิศทางเดียวกันซึ่งจะช่วยส่งเสริมให้การปฏิบัติงานตรวจสอบภายในสามารถให้บริการตรวจสอบได้สอดคล้องกับความเสี่ยงและเกิดประโยชน์สูงสุดแก่องค์กร คณะกรรมการตรวจสอบได้ให้ความสำคัญกับการบริหารความเสี่ยงด้านเทคโนโลยี โดยพิจารณาให้มีการสอบทานโครงการ (pre-implementation review) ระบบซื้อขายหลักทรัพย์ใหม่ เพื่อเพิ่มความมั่นใจก่อนเริ่มใช้งาน รวมทั้งได้ประชุมหารือร่วมกับผู้บริหารสายงานเทคโนโลยีสารสนเทศ เพื่อให้มั่นใจว่า ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีมาตรการบริหารความเสี่ยงที่เหมาะสมและมีประสิทธิภาพ
- **ระบบควบคุมภายใน** คณะกรรมการตรวจสอบได้พิจารณาผลการประเมินความเพียงพอและความเป็นประสิทธิผลของระบบควบคุมภายใน โดยพิจารณาจากรายงานผลการตรวจสอบที่นำเสนอโดยหน่วยงานตรวจสอบภายใน ความเห็นของผู้สอบบัญชีและติดตามความคืบหน้าการปรับปรุงระบบควบคุมภายใน โดยเชิญฝ่ายจัดการเข้าชี้แจงเกี่ยวกับการดำเนินการแก้ไขและผลการแก้ไข รวมถึงการให้ข้อมูลและความเห็นต่อการดำเนินการที่สำคัญด้วย
- **กำกับดูแลงานตรวจสอบภายใน** คณะกรรมการตรวจสอบอนุมัติแผนการตรวจสอบประจำปี โดยพิจารณาความเพียงพอเหมาะสมของบุคลากรและความเป็นอิสระในการปฏิบัติงานของฝ่ายตรวจสอบภายใน คณะกรรมการตรวจสอบได้สอบทานการปฏิบัติงานของฝ่ายตรวจสอบภายในตามแผนการตรวจสอบประจำปีตามที่ได้รับอนุมัติแล้ว พบว่าได้บรรลุตามเป้าหมายที่กำหนดไว้

คณะกรรมการตรวจสอบได้ให้คำแนะนำในการปฏิบัติงานตรวจสอบให้มีการปรับปรุงให้เกิดประสิทธิภาพยิ่งขึ้นอย่างต่อเนื่อง โดยในปี 2555 ได้สนับสนุนให้มีการปรับปรุงคุณภาพงานตรวจสอบภายในตามข้อเสนอแนะจากผลการประเมินคุณภาพงานตรวจสอบภายใน โดยผู้ประเมินอิสระภายนอกในปี 2554 และสนับสนุนให้มีการตรวจสอบแบบ Continuous Auditing โดยใช้ Audit Software เป็นเครื่องมือช่วยในการดำเนินการ รวมทั้งดูแลให้มีการพัฒนาความรู้ความสามารถของผู้ตรวจสอบภายใน โดยให้ผู้ตรวจสอบไปปฏิบัติงานเพื่อเรียนรู้งานในฝ่ายงานอื่นชั่วคราวและศึกษาดูงานตรวจสอบภายในที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ

ต่างประเทศ เพื่อแลกเปลี่ยนประสบการณ์งานตรวจสอบภายใน

- **การกำกับดูแลกิจการที่ดี** คณะอนุกรรมการตรวจสอบได้ประชุมร่วมกับผู้บริหารที่ดูแลงานกำกับกิจกรรมองค์กรเป็นประจำทุกไตรมาส เพื่อสอบถามเรื่องการกำกับดูแลกิจการของตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้มั่นใจว่ามีการปฏิบัติตามนโยบายการกำกับดูแลกิจการและจรรยาบรรณที่กำหนด รวมทั้งสนับสนุนการกำกับดูแลกิจการที่ดีในด้านอื่นๆ อาทิ จัดให้มีช่องทางที่พนักงานและผู้มีส่วนได้เสียสามารถแจ้งเบาะแสการกระทำที่ไม่เหมาะสมของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้โดยตรงต่อประธานอนุกรรมการตรวจสอบ ซึ่งตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้เปิดเผยช่องทางการแจ้งเบาะแสดังกล่าวไว้ในเว็บไซต์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ ภายใต้หัวข้อ “การแจ้งเบาะแส”
- **การปฏิบัติตามกฎหมาย** คณะอนุกรรมการตรวจสอบได้ประชุมร่วมกับผู้บริหารที่มีหน้าที่รับผิดชอบโดยตรงและหน่วยงานตรวจสอบภายใน เพื่อสอบถาม แลกเปลี่ยนความเห็น ให้มั่นใจว่าการปฏิบัติงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นไปตามกฎหมายข้อกำหนด และกฎเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง
- **การประเมินการปฏิบัติหน้าที่ของอนุกรรมการตรวจสอบ** คณะอนุกรรมการตรวจสอบประเมินผลการปฏิบัติงานของคณะอนุกรรมการตรวจสอบด้วยตนเอง (self-assessment) เป็นประจำทุกปี โดยแบบประเมินผลสอดคล้องกับแนวทางของสำนักงาน ก.ล.ต. และแนวปฏิบัติที่ดีของสากล
- **การเสนอแต่งตั้งผู้สอบบัญชีประจำปี 2556** คณะอนุกรรมการตรวจสอบได้พิจารณาผลการปฏิบัติงานและความเป็นอิสระในการปฏิบัติหน้าที่ของผู้สอบบัญชีภายนอกแล้วเห็นว่า บริษัท ไพรซ์วอเตอร์เฮาส์คูเปอร์ส เอบีเอส จำกัด (PwC) มีความเชี่ยวชาญในวิชาชีพ มีประสบการณ์ที่เหมาะสม และมีความเป็นอิสระ จึงเห็นควรนำเสนอรายชื่อผู้สอบบัญชีจาก PwC เป็นผู้สอบบัญชีของตลาดหลักทรัพย์ฯ และบริษัทย่อย สำหรับงบการเงินประจำปี 2556 และนำเสนอคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อพิจารณาและขออนุมัติแต่งตั้งจากที่ประชุมสมาชิกต่อไป

โดยสรุป คณะอนุกรรมการตรวจสอบเห็นว่า ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดทำรายงานทางการเงินตามมาตรฐานการรายงานทางการเงิน ซึ่งมีความถูกต้องในสาระสำคัญและมีการเปิดเผยข้อมูลที่เพียงพอ มีระบบควบคุมภายในและการบริหารความเสี่ยงที่เพียงพอ เหมาะสม ปฏิบัติตามกฎหมายและข้อกำหนดที่เกี่ยวข้อง ทำให้เชื่อมั่นอย่างสมเหตุสมผลว่าการดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ สามารถบรรลุเป้าหมายที่ตั้งไว้



(นางไขศรี เนืองสิริเพียร)
ประธานอนุกรรมการตรวจสอบ
18 กุมภาพันธ์ 2556

การบริหารความเสี่ยงองค์กร

ตลาดหลักทรัพย์ฯ จัดให้มีการบริหารความเสี่ยงองค์กร โดยครอบคลุมการระบุ ประเมิน ติดตาม และจัดการความเสี่ยงที่สำคัญในภาพรวม เพื่อให้เกิดความมั่นใจว่าสามารถบริหารความเสี่ยงได้อย่างมีประสิทธิภาพ โดยกรอบการบริหารความเสี่ยงครอบคลุมความเสี่ยงที่สำคัญทั้งในด้านกลยุทธ์ ด้านการปฏิบัติงาน ด้านการเงิน ด้านปฏิบัติตามกฎระเบียบ และความเสี่ยงจากการหยุดชะงักของธุรกิจ

นอกจากนั้น ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังให้ความสำคัญกับการพัฒนาการบริหารความเสี่ยงองค์กรอย่างต่อเนื่อง (Continuous Improvement) โดยได้ดำเนินการตามข้อเสนอแนะของบริษัที่ปรึกษาที่ให้ข้อเสนอแนะเพิ่มเติมจากการจัดทำ Operations Master Plan ของตลาดหลักทรัพย์ฯ ในส่วนที่เกี่ยวกับการบริหารความเสี่ยง ซึ่งครอบคลุมเรื่อง risk governance เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพและยกระดับการดำเนินงานด้านการบริหารความเสี่ยงองค์กร และกำหนดให้การยกระดับการดำเนินงานด้านการบริหารความเสี่ยงองค์กรเป็นส่วนหนึ่งของแผนกลยุทธ์องค์กรประจำปี 2556

ความเสี่ยงด้านกลยุทธ์

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้ความสำคัญในการบริหารความเสี่ยงจากการกำหนดแผนกลยุทธ์ซึ่งครอบคลุมการออกผลิตภัณฑ์และบริการใหม่ โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ จัดให้มีกระบวนการในการกำหนดและทบทวนแผนกลยุทธ์ รวมทั้งมีการติดตามผลการดำเนินงานเพื่อบริหารจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้น ทั้งนี้ ในปี 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ให้ความสำคัญกับการบริหารความเสี่ยงของการเริ่มใช้ระบบซื้อขายใหม่ (SET CONNECT) ที่เปิดให้ใช้บริการในเดือนกันยายน โดยได้มีการพิจารณามาตรการจัดการความเสี่ยงที่ครอบคลุมการทดสอบระบบร่วมกันระหว่างหน่วยงานที่เกี่ยวข้องจนผ่านตามเกณฑ์การเริ่มใช้ระบบงานใหม่

ความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงาน

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ดูแลและจัดการความเสี่ยงด้านการปฏิบัติงาน ซึ่งครอบคลุมความเสี่ยงหรือความเสียหายที่อาจเป็นผลมาจากความไม่เพียงพอของมาตรการควบคุมภายใน หรือความผิดพลาดในการดำเนินงานของบุคลากร กระบวนการการทำงานภายใน เทคโนโลยี และปัจจัยภายนอก โดยหน่วยงานเป้าหมายได้มีการประเมินความเสี่ยงและการควบคุมด้วยตนเอง (Risk and Control Self Assessment: RCSA) รวมทั้งได้กำหนดแผนงานเพื่อติดตามผลต่อไป

ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มีการประเมิน ติดตาม และจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นกับระบบคอมพิวเตอร์ที่สำคัญ โดยมีกระบวนการในการรายงานข้อมูลเหตุการณ์ความเสียหายด้านปฏิบัติการ การวิเคราะห์ถึงสาเหตุ และแนวทางการปรับปรุงเพื่อให้การบริการและการพัฒนาเป็นไปอย่างต่อเนื่อง

ความเสี่ยงด้านการเงิน

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้แยกประเภทความเสี่ยงด้านการเงินออกเป็น 2 ประเภท คือ ความเสี่ยงจากการลงทุน และความเสี่ยงจากการที่สมาชิกสำนักหักบัญชีไม่ปฏิบัติตามภาระผูกพัน โดยมีรายละเอียดดังนี้

ความเสี่ยงจากการลงทุน

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำเนินการลงทุนตามนโยบายและสัดส่วนการบริหารเงินลงทุนที่กำหนดโดยคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยมีคณะทำงานบริหารเงินลงทุนควบคุมดูแลการลงทุนให้สอดคล้องกับนโยบายและสัดส่วนที่กำหนด ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะมีการทบทวนนโยบายและสัดส่วนการบริหารเงินลงทุนเป็นประจำทุกไตรมาส

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มีการบริหารจัดการความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นโดยลงทุนในหลักทรัพย์หลากหลายประเภทและกำหนดวงเงินลงทุนในแต่ละสถาบันการเงินหรือบริษัทผู้ออกหลักทรัพย์เพื่อให้มีการกระจายการลงทุนอย่างเหมาะสม เพื่อให้มั่นใจได้ว่ากรณีเกิดความเสียหายขึ้นจะส่งผลกระทบต่อเงินลงทุนในวงจำกัด นอกจากนี้ได้มีการนำเครื่องมือในการวิเคราะห์ความเสี่ยงที่เป็นค่าการคำนวณทางสถิติ คือ Value at Risk (VaR) มาใช้ในการควบคุมเพื่อให้ความเสี่ยงโดยรวมของเงินลงทุนอยู่ภายใต้ขอบเขตที่กำหนด สำหรับในกรณีตราสาร

หนี้จะลงทุนในหลักทรัพย์ประเภทต่างๆ อาทิ พันธบัตร เงินฝาก กองทุนรวมตลาดเงิน และตราสารหนี้เอกชนที่ได้รับการจัดอันดับความน่าเชื่อถือในระดับ A ขึ้นไปหรือเทียบเท่า เป็นต้น

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มีการติดตามสถานะความเสี่ยงจากการลงทุนและรายงานต่อคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ และคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงเป็นประจำทุกเดือน เพื่อให้แน่ใจว่ามูลค่าความเสี่ยงอยู่ภายในระดับที่กำหนดไว้

ความเสี่ยงจากการที่สมาชิกสำนักหักบัญชีไม่ปฏิบัติตามภาระผูกพัน

ด้วยภารกิจของบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด (Thailand Clearing House Company Limited: TCH) ในการเป็นศูนย์กลางการชำระราคา ซึ่งหมายถึงการทำหน้าที่เป็นคู่สัญญา (Central Counterparty: CCP) โดยตรงกับสมาชิกสำนักหักบัญชี (สมาชิก) ทุกรายและรับประกันการชำระราคาและส่งมอบในทุกๆ รายการซื้อขายที่เกิดขึ้นในตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า TCH จะเป็นผู้ซื้อให้กับสมาชิกผู้ขายและเป็นผู้ขายให้กับสมาชิกผู้ซื้อ กลไกนี้เรียกว่ากระบวนการแทนที่คู่สัญญา (Novation Process) การทำหน้าที่ดังกล่าวส่งผลให้ TCH มีความเสี่ยงจากการที่สมาชิกอาจไม่สามารถปฏิบัติตามภาระผูกพันจากการซื้อขายหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าได้ ดังนั้น TCH จึงต้องพัฒนามาตรการในการบริหารจัดการ ติดตามและควบคุมความเสี่ยงของสมาชิกเพื่อประกันความเสียหายที่อาจเกิดขึ้นอย่างพอเพียงและเหมาะสม

ปัจจุบัน TCH มีมาตรการบริหารความเสี่ยงที่สำคัญเพื่อลดความเสี่ยงที่สมาชิกจะไม่ปฏิบัติตามภาระผูกพัน (Counterparty Risk) ได้แก่ การกำหนดเกณฑ์คุณสมบัติของสมาชิกเบื้องต้น เพื่อคัดกรองเฉพาะสมาชิกที่มีความเข้มแข็งทางการเงินที่จะแบกรับความเสี่ยงของลูกค้านักซื้อขายได้ในระดับหนึ่ง โดยผู้ที่เข้าเป็นสมาชิกต้องมีความเข้มแข็งทางการเงินที่พร้อมจะรองรับความเสี่ยงจากการซื้อขายมีนโยบายและมาตรการบริหารความเสี่ยง มีความพร้อมทั้งในระบบการปฏิบัติงาน ผู้บริหารและเจ้าหน้าที่ผู้ปฏิบัติงาน อีกทั้งหลังจากการเข้าเป็นสมาชิก TCH ยังมีการติดตามฐานะและสภาพคล่องทางการเงินของสมาชิก ดูแลพฤติกรรมการซื้อขายและจำกัดธุรกรรมการชำระราคาสะสมในตราสารทุนและตราสารหนี้ให้เหมาะสมกับฐานะทางการเงินของสมาชิก ในกรณีที่สมาชิกมีความเสี่ยงของตราสารทุนและตราสารหนี้เกินกว่าระดับที่กำหนด TCH จะเรียกให้สมาชิกวางหลักประกัน นอกจากนี้ TCH ยังได้ทำการประเมินความเสียหายสูงสุดจากการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าภายใต้เหตุการณ์วิกฤต (stress test) และการกำหนดให้สมาชิกวางหลักประกันที่สอดคล้องกับความเสี่ยงในธุรกรรมสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเนื่องจากการเปลี่ยนแปลงราคาของตราสารทางการเงินแต่ละประเภท รวมทั้ง TCH ได้จัดตั้งกองทุนทดแทนความเสียหาย (Clearing Fund) สำหรับแต่ละตลาด เพื่อใช้เป็นแหล่งเงินทุนในการบรรเทาความเสียหายของระบบชำระหนี้ของสำนักหักบัญชี โดย ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2555 เงินกองทุนสำหรับหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีมูลค่าประมาณ 1,084 ล้านบาท และ 507 ล้านบาท ตามลำดับ อีกทั้งตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้สำรองเงินกองทุน (Reserve Fund) ไว้จำนวน 2,000 ล้านบาท สำหรับธุรกรรมหลักทรัพย์ และจำนวน 300 ล้านบาท สำหรับธุรกรรมสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อเสริมสร้างความมั่นคงในระบบชำระหนี้ของสำนักหักบัญชีในกรณีฉุกเฉินอีกด้วย

นอกจากนี้ เพื่อรองรับความเสี่ยงจากการขาดสภาพคล่อง (liquidity risk) TCH ได้จัดเตรียมวงเงินเสริมสภาพคล่องกับธนาคารพาณิชย์ที่ทำหน้าที่เป็น Settlement Bank โดยมีการทบทวนความเพียงพออย่างต่อเนื่อง ทั้งนี้ ในปี 2555 TCH ได้ขอเพิ่มวงเงินเสริมสภาพคล่องสำหรับการทำธุรกรรมทางด้านหลักทรัพย์จาก Settlement Bank ทั้ง 4 แห่ง รวมเป็นจำนวน 3,000 ล้านบาท เพื่อรองรับธุรกรรมการซื้อขายหลักทรัพย์ที่เพิ่มขึ้นมาก โดยวงเงินเสริมสภาพคล่องสำหรับสัญญาซื้อขายล่วงหน้ายังคงมีจำนวน 400 ล้านบาท

นอกเหนือจากการทบทวนและพัฒนามาตรการบริหารความเสี่ยงอย่างต่อเนื่องเป็นประจำแล้ว ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังได้จ้าง บริษัท Oliver Wyman ซึ่งเป็นบริษัทที่ปรึกษาด้านงานปฏิบัติการชั้นนำ เพื่อวางแผนในการพัฒนากระบวนการปฏิบัติงานด้านการซื้อขายหลักทรัพย์ รวมทั้งงานชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ งานรับฝากหลักทรัพย์ และงานนายทะเบียนหลักทรัพย์ รวมทั้งงานบริหารความเสี่ยงซึ่งถือเป็นงานหลักที่สำคัญของตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยผลการศึกษาในส่วนที่เกี่ยวข้องกับงานบริหารความเสี่ยงของสำนักหักบัญชี พบว่า TCH ดำเนินการบริหารความเสี่ยงโดยรวมได้ตามมาตรฐานสากล ทั้งในเรื่องของการกำหนดมาตรการบริหารความเสี่ยงก่อนการผิพนัดและหลังการผิพนัด

โดยในปีที่ผ่านมา TCH ได้ขยายการให้บริการชำระราคาสำหรับสัญญาซื้อขายดอลลาร์ล่วงหน้า (USD Futures) และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่อ้างอิงดัชนีหมวดธุรกิจในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (Sector Index Futures) TCH ได้มีการกำหนดอัตราหลักประกัน (margin rate) รวมถึงแนวทางการบริหารความเสี่ยงเพื่อรองรับความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นจากการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้างดกล่าว พร้อมทั้งทบทวนอัตราหลักประกันดังกล่าวเป็นประจำ นอกจากนี้ TCH ได้พัฒนาระบบบริหารความเสี่ยงในระหว่างวัน (Intraday Risk Monitoring) ให้รองรับการปรับเปลี่ยนระบบซื้อขายและระบบชำระราคาใหม่ โดยเป็นส่วนหนึ่งในการดำเนินงานตามแผนงานการเพิ่มขีดความสามารถของตลาดหลักทรัพย์

ความเสี่ยงด้านปฏิบัติตามกฎระเบียบ

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ประเมิน ดูแล และจัดการความเสี่ยงด้านปฏิบัติตามกฎระเบียบ ซึ่งครอบคลุมทั้งความเสี่ยงจากการไม่ปฏิบัติตามกฎ/ข้อบังคับที่เกี่ยวข้องของหน่วยงานกำกับดูแล และความเสี่ยงจากการที่กรรมการ ผู้บริหาร และพนักงาน ไม่สามารถปฏิบัติตามนโยบายและวิธีการปฏิบัติงานที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนดขึ้น เพื่อให้การดำเนินงานเป็นไปตามกฎหมายและข้อกำหนดต่างๆ ที่เกี่ยวข้องอย่างเคร่งครัด

ความเสี่ยงจากการหยุดชะงักของธุรกิจ

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดทำแผนดำเนินธุรกิจต่อเนื่อง (Business Continuity Plan: BCP) เพื่อให้มั่นใจว่า ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะสามารถดำเนินธุรกิจได้อย่างต่อเนื่อง แม้เกิดเหตุภัยพิบัติร้ายแรงขึ้นกับองค์กร โดยได้มีการทบทวน และซ้อมการปฏิบัติการตามแผนร่วมกับหน่วยงานในตลาดทุนเพื่อเตรียมความพร้อมในการรับมือกับภาวะวิกฤตต่างๆ อย่างจริงจังเป็นประจำทุกปี ทั้งนี้ จากเหตุการณ์ภัยพิบัติต่างๆ ที่เกิดขึ้นอย่างต่อเนื่องในแต่ละปี ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ให้ความสำคัญในการเตรียมความพร้อมของบุคลากร ระบบงาน ทั้งที่อาคารทำการหลักและสถานที่ทำการสำรอง และทดสอบการใช้ระบบสำรองร่วมกับบริษัทสมาชิก เพื่อรองรับหากเกิดเหตุภัยพิบัติใดๆ ที่ส่งผลกระทบต่ออาคารทำการหลัก เพื่อให้สามารถเปิดการซื้อขายหลักทรัพย์ได้อย่างต่อเนื่อง



คำอธิบายและการวิเคราะห์ฐานะการเงิน และผลการดำเนินงาน

ภาพรวม

ผลการดำเนินงานของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2555 และ 2554 มีดังนี้

(หน่วย: ล้านบาท)	สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม			
	2555	2554	เพิ่ม/(ลด)	
			จำนวน	ร้อยละ
รายได้จากการดำเนินงาน	3,365	3,245	120	3.70
รายได้อื่น	152	137	15	10.95
รายได้จากเงินลงทุน	982	752	230	30.59
ค่าใช้จ่ายจากการดำเนินงาน	(2,599)	(2,545)	54	2.12
เงินบริจาคแก่มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์ฯ	(454)	(359)	95	26.46
ภาษีเงินได้นิติบุคคล	(126)	(158)	(32)	(20.25)
รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่าย	1,362	1,110	252	22.70

รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่ายสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2555 เพิ่มขึ้น จำนวน 252 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 22.70 เมื่อเทียบกับปี 2554 โดยรายได้จากการดำเนินงานเพิ่มขึ้น จำนวน 120 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 3.70 ที่สำคัญจากธุรกิจตราสารทุน โดยมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวัน และมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดของตราสารทุนเพิ่มขึ้น และธุรกิจบริการเทคโนโลยีที่เพิ่มขึ้น ขณะที่รายได้ธุรกิจตราสารอนุพันธ์ลดลง ส่วนรายได้จากเงินลงทุนเพิ่มขึ้น จำนวน 230 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 30.59 ที่สำคัญจากดอกเบี้ยรับเพิ่มขึ้นจากจำนวนเงินลงทุนที่เพิ่มขึ้น สำหรับค่าใช้จ่ายจากการดำเนินงานเพิ่มขึ้น จำนวน 54 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 2.12 โดยเงินอุดหนุนให้แก่สำนักงาน ก.ล.ต. เพิ่มขึ้นตามมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ตราสารทุนที่เพิ่มขึ้น และค่าใช้จ่ายด้านเทคโนโลยีเพิ่มขึ้นจากระบบงานใหม่ที่เริ่มใช้งานในเดือนกันยายน 2555 (ระบบซื้อขายหลักทรัพย์ SET CONNECT ระบบงานเผยแพร่ข้อมูลการซื้อขาย SET FEED และระบบงานกำกับการซื้อขาย SET WATCH) ในขณะที่เงินบริจาคแก่มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์ฯ เพิ่มขึ้นจำนวน 95 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 26.46 โดยจำนวนเงินที่จัดสรร 1/3 ของรายได้สูงกว่าค่าใช้จ่าย เพื่อบริจาคเข้ามูลนิธิตลาดหลักทรัพย์ฯ เพิ่มขึ้นตามกำไรที่เพิ่มขึ้น

1. การวิเคราะห์ผลการดำเนินงาน

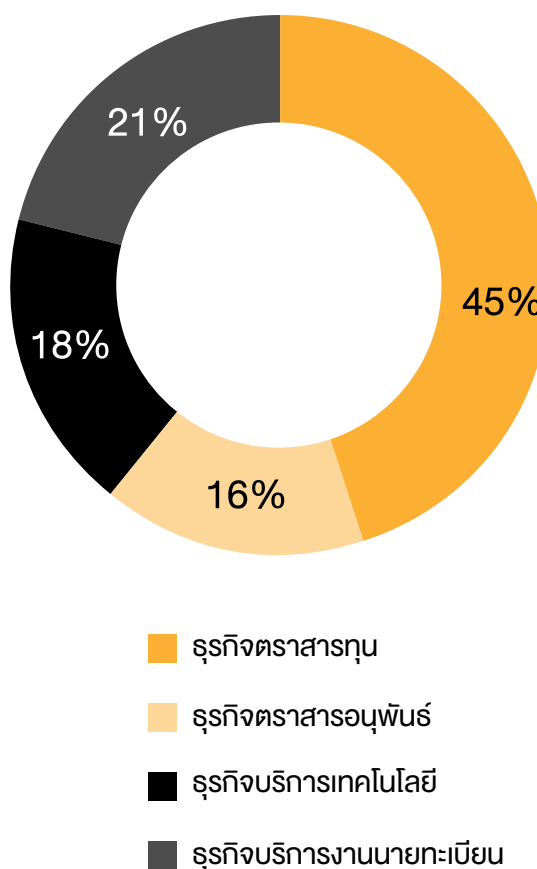
1.1 รายได้จากการดำเนินงาน

รายได้จากการดำเนินงานจำแนกตามส่วนงาน

รายได้จากการดำเนินงานจำแนกตามส่วนงานธุรกิจที่สำคัญ ประกอบด้วย ธุรกิจตราสารทุน ธุรกิจตราสารอนุพันธ์ ธุรกิจบริการเทคโนโลยี และธุรกิจบริการงานนายทะเบียน

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2555 (หน่วย: ล้านบาท)	
ธุรกิจตราสารทุน	
- ค่าธรรมเนียมการซื้อขายหลักทรัพย์	792
- งานชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์	194
- ค่าธรรมเนียมหลักทรัพย์จดทะเบียน	314
- งานรับฝากหลักทรัพย์	189
- ค่าธรรมเนียมสมาชิก	31
รวม	1,520
ธุรกิจตราสารอนุพันธ์	
- ค่าธรรมเนียมการซื้อขายหลักทรัพย์	321
- งานชำระราคา	138
- ค่าธรรมเนียมสมาชิก	82
รวม	541
ธุรกิจบริการเทคโนโลยี	
- การบริการบริษัทหลักทรัพย์	372
- ค่าบริการข้อมูล	184
- ค่าสนับสนุนงานเทคโนโลยีสารสนเทศ	49
รวม	605
ธุรกิจบริการงานนายทะเบียน	
- งานนายทะเบียนหลักทรัพย์	645
- งานนายทะเบียนกองทุน	54
รวม	699
รวมรายได้จากการดำเนินงาน	3,365

รายได้จำแนกตามส่วนงาน



1.1.1 ธุรกิจตราสารทุน

(หน่วย: ล้านบาท)	2555	2554	เพิ่ม/(ลด)	
			จำนวน	ร้อยละ
รายได้ - ธุรกิจตราสารทุน	1,520	1,328	192	14.46
ค่าธรรมเนียมการซื้อขายหลักทรัพย์	792	719	73	10.15
รายได้จากงานชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์	194	161	33	20.50
ค่าธรรมเนียมหลักทรัพย์จดทะเบียน	314	280	34	12.14
รายได้จากงานรับฝากหลักทรัพย์	189	137	52	37.96
รายได้ค่าธรรมเนียมสมาชิก	31	31	-	-
ดัชนีชี้วัดภาวะตลาดตราสารทุน				
ดัชนีตลาดหลักทรัพย์ฯ (จุด)	1,391.93	1,025.32	366.61	35.76
มูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยต่อวัน - ตราสารทุน (ล้านบาท)	32,304	29,473	2,831	9.61
มูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (พันล้านบาท)	11,964	8,490	3,474	40.92
จำนวนหลักทรัพย์จดทะเบียน (หลักทรัพย์)	1,048	848	200	23.58

รายได้จากการดำเนินงานของธุรกิจตราสารทุนเพิ่มขึ้น จำนวน 192 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 14.46 เมื่อเทียบกับปี 2554 ที่สำคัญจากค่าธรรมเนียมการซื้อขายหลักทรัพย์และการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ เพิ่มขึ้นตามมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์เฉลี่ยต่อวันที่เพิ่มขึ้น

ค่าธรรมเนียมหลักทรัพย์จดทะเบียนเพิ่มขึ้น โดยจำนวนใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants: DW) เข้าจดทะเบียนและซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ เพิ่มขึ้นเป็น 345 หลักทรัพย์ จาก 166 หลักทรัพย์ในปี 2554 และมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาด (Market Capitalization) เฉลี่ยที่สูงขึ้น ส่งผลให้รายได้จากงานรับฝากหลักทรัพย์เพิ่มสูงขึ้น

1.1.2 ธุรกิจตราสารอนุพันธ์

(หน่วย: ล้านบาท)	2555	2554	เพิ่ม/(ลด)	
			จำนวน	ร้อยละ
รายได้ - ธุรกิจตราสารอนุพันธ์	541	682	(141)	(20.67)
ค่าธรรมเนียมการซื้อขายหลักทรัพย์	321	415	(94)	(22.65)
รายได้จากงานชำระราคา	138	178	(40)	(22.47)
รายได้ค่าธรรมเนียมสมาชิก	82	89	(7)	(7.87)
ดัชนีชี้วัดภาวะตลาดอนุพันธ์				
ปริมาณการซื้อขายเฉลี่ยต่อวัน - ตราสารอนุพันธ์ (สัญญา)	43,823	41,145	2,678	6.51

รายได้จากการดำเนินงานของธุรกิจตราสารอนุพันธ์ลดลง จำนวน 141 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 20.67 เมื่อเทียบกับปี 2554 ทั้งนี้ แม้ว่าปริมาณการซื้อขายตราสารอนุพันธ์โดยรวมจะเพิ่มขึ้น แต่สินค้า SET 50 Index Futures และ Gold Futures 50 บาท ซึ่งมีอัตราค่าธรรมเนียมที่สูงกว่าสินค้าประเภทอื่น กลับมีปริมาณการซื้อขายที่ลดลง เนื่องจากราคาทองคำในปี 2555 มีการเคลื่อนไหวในกรอบแคบ ทำให้ความน่าสนใจในการลงทุนลดลงเมื่อเทียบกับปี 2554 นอกจากนี้ มีการให้ส่วนลดเพื่อส่งเสริมการขายสินค้าทั้งสองชนิดนี้ด้วย

1.1.3 ธุรกิจบริการเทคโนโลยี

(หน่วย: ล้านบาท)	2555	2554	เพิ่ม/(ลด)	
			จำนวน	ร้อยละ
รายได้ - ธุรกิจบริการเทคโนโลยี	605	564	41	7.27
รายได้จากการบริการบริษัทหลักทรัพย์	372	352	20	5.68
รายได้ค่าบริการข้อมูล	184	172	12	6.98
รายได้สนับสนุนงานเทคโนโลยี	49	40	9	22.50

รายได้จากการดำเนินงานของธุรกิจบริการเทคโนโลยีเพิ่มขึ้น จำนวน 41 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 7.27 เมื่อเทียบกับปี 2554 ที่สำคัญจากรายได้จากการให้บริการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบอินเทอร์เน็ตของบริษัท เซ็ทเทรด ดอท คอม จำกัด ที่เพิ่มขึ้นตามมูลค่าการซื้อขายตราสารทุน และรายได้ค่าบริการข้อมูลเพิ่มขึ้นจากจำนวนผู้ใช้บริการที่เพิ่มขึ้น

1.1.4 ธุรกิจบริการงานนายทะเบียน

(หน่วย: ล้านบาท)	2555	2554	เพิ่ม/(ลด)	
			จำนวน	ร้อยละ
รายได้ - ธุรกิจบริการงานนายทะเบียน	699	671	28	4.17
รายได้จากงานนายทะเบียนหลักทรัพย์	645	621	24	3.86
รายได้จากงานนายทะเบียนกองทุน	54	50	4	8.00

รายได้จากการดำเนินงานของธุรกิจงานนายทะเบียนเพิ่มขึ้น จำนวน 28 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 4.17 เมื่อเทียบกับปี 2554 ที่สำคัญจากจำนวนหลักทรัพย์จดทะเบียนที่เพิ่มขึ้น รวมทั้งการเพิ่มทุนของบริษัทจดทะเบียน

1.2 รายได้อื่น

(หน่วย: ล้านบาท)	2555	2554	เพิ่ม/(ลด)	
			จำนวน	ร้อยละ
รายได้อื่น	152	137	15	10.95
รายได้จากการเผยแพร่ความรู้การลงทุน	32	41	(9)	(21.95)
รายได้จากการจัดกิจกรรมทางการตลาด	26	4	22	550.00
รายได้ค่าธรรมเนียมการบริหารกองทุน	20	14	6	42.86
รายได้อื่น	74	78	(4)	(5.13)

รายได้อื่นเพิ่มขึ้น จำนวน 15 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 10.95 เมื่อเทียบกับปี 2554 ที่สำคัญจากรายได้จากการจัดกิจกรรมทางการตลาดที่เพิ่มขึ้น เช่น SET in the City (ปี 2554 ไม่ได้จัดกิจกรรมเนื่องจากภาวะน้ำท่วม) รายได้ค่าธรรมเนียมการบริหารกองทุนหลักประกันฯ และกองทุนทดแทนความเสียหายของบริษัท สำนักหักบัญชี เพิ่มขึ้น ขณะที่รายได้จากการเผยแพร่ความรู้การลงทุนลดลง จากการปรับบทบาทของศูนย์ส่งเสริมการพัฒนาความรู้ตลาดทุน (Thailand Securities Institute: TSI) ที่จะดูแลงานกำหนดมาตรฐานความรู้ตลาดทุนและโอนงานจัดอบรมและทดสอบใบอนุญาตของผู้ประกอบวิชาชีพธุรกิจหลักทรัพย์ไปยังสมาคมวิชาชีพต่างๆ

1.3 รายได้จากเงินลงทุน

(หน่วย: ล้านบาท)	2555	2554	เพิ่ม/(ลด)	
			จำนวน	ร้อยละ
รายได้จากเงินลงทุน	982	752	230	30.59
ดอกเบี้ยรับ	440	329	111	33.74
เงินปันผลรับ	338	307	31	10.10
กำไรจากการขายเงินลงทุน	181	125	56	44.80
อื่นๆ	23	(9)	32	355.56

รายได้จากเงินลงทุนเพิ่มขึ้น จำนวน 230 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 30.59 ที่สำคัญ ได้แก่ ดอกเบี้ยรับเพิ่มขึ้นจากจำนวนเงินลงทุนที่เพิ่มขึ้นและอัตราผลตอบแทนที่เพิ่มขึ้นจากภาวะตลาดที่มีการออกอัตราดอกเบี้ยพิเศษสูงกว่าปี 2554 รวมทั้งเงินปันผลรับและกำไรจากการขายเงินลงทุนเพิ่มขึ้นตามการปรับตัวของตราสารทุนที่เพิ่มขึ้น นอกจากนี้ มีการกลับรายการด้อยค่าของเงินลงทุนในกองทุน Private Equity และกำไรที่ยังไม่เกิดขึ้นจริงของกองทุนส่วนบุคคลที่เพิ่มขึ้น

1.4 ค่าใช้จ่ายจากการดำเนินงาน

(หน่วย: ล้านบาท)	2555	2554	เพิ่ม/(ลด)	
			จำนวน	ร้อยละ
ค่าใช้จ่ายจากการดำเนินงาน	2,599	2,545	54	2.12
ค่าใช้จ่ายผลประโยชน์ตอบแทนพนักงาน	1,084	1,102	(18)	(1.63)
เงินอุดหนุนให้แก่สำนักงาน ก.ล.ต.	334	301	33	10.96
ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย	185	195	(10)	(5.13)
ค่าใช้จ่ายด้านเทคโนโลยี	149	137	12	8.76
ค่าใช้จ่ายการตลาด	134	104	30	28.85
ค่าธรรมเนียมและค่าตอบแทน	76	57	19	33.33
ค่าใช้จ่ายอื่น	637	649	(12)	(1.85)

กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ มีค่าใช้จ่ายจากการดำเนินงานในปี 2555 จำนวน 2,599 ล้านบาท เพิ่มขึ้นจากปี 2554 ร้อยละ 2.12 ที่สำคัญจากเงินอุดหนุนให้แก่สำนักงาน ก.ล.ต. เพิ่มขึ้นตามมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ตราสารทุนที่เพิ่มขึ้น ค่าใช้จ่ายด้านเทคโนโลยีเพิ่มขึ้นจากระบบงานใหม่ที่เริ่มใช้งานในเดือนกันยายน 2555 (ระบบซื้อขายหลักทรัพย์ SET CONNECT ระบบงานเผยแพร่ข้อมูลการซื้อขาย Market Data System และระบบงานกำกับการซื้อขาย Market Surveillance System) ค่าใช้จ่ายการตลาดเพิ่มขึ้นจากงาน SET in the City (ปี 2554 ไม่ได้จัดกิจกรรมเนื่องจากภาวะน้ำท่วม) ค่าธรรมเนียมและค่าตอบแทนเพิ่มขึ้นจากค่าที่ปรึกษาในการจัดทำแผนแม่บททางด้านปฏิบัติการ (Operations Master Plan) ขณะที่ค่าเสื่อมราคาและตัดจำหน่ายลดลง ที่สำคัญจากการทบทวนอายุการใช้งานของทรัพย์สิน โดยเฉพาะอุปกรณ์และระบบงานคอมพิวเตอร์

2. การวิเคราะห์ฐานะการเงิน

(หน่วย: ล้านบาท)	31 ส.ค. 2555	31 ส.ค. 2554	เพิ่ม/(ลด)	
			จำนวน	ร้อยละ
สินทรัพย์รวม	29,935	27,019	2,916	10.79
หนี้สินรวม	10,451	9,151	1,300	14.21
เงินกองทุน	19,484	17,868	1,616	9.04

รายการเปลี่ยนแปลงที่สำคัญของสินทรัพย์ หนี้สิน และส่วนของเงินกองทุนของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2555 เมื่อเทียบกับยอดคงเหลือ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554 มีดังต่อไปนี้

2.1 การวิเคราะห์สินทรัพย์

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2555 กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ มีสินทรัพย์รวมจำนวน 29,935 ล้านบาท เพิ่มขึ้นจำนวน 2,916 ล้านบาท หรือร้อยละ 10.79 เมื่อเทียบกับยอดคงเหลือ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554 โดยมีรายละเอียดสำคัญดังนี้

2.1.1 เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด เงินฝากธนาคารสำหรับผลประโยชน์ทางการเงินรอจ่ายคืน และเงินลงทุน จำนวน 16,694 ล้านบาท คิดเป็นสัดส่วนร้อยละ 55.77 ของสินทรัพย์รวม เพิ่มขึ้นจำนวน 1,547 ล้านบาท หรือร้อยละ 10.21 แยกตามประเภทเป็นดังนี้

(หน่วย: ล้านบาท)	31 ส.ค. 2555	31 ส.ค. 2554	เพิ่ม/(ลด)	
			จำนวน	ร้อยละ
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด	1,046	365	681	186.58
เงินฝากธนาคารสำหรับผลประโยชน์ทางการเงินรอจ่ายคืน	58	-	58	N/A
พอร์ตเงินลงทุน	15,590	14,782	808	5.47
หลักทรัพย์เพื่อค้า	1,438	1,235	203	16.44
หลักทรัพย์เพื่อขาย	3,356	4,003	(647)	(16.16)
ตราสารหนี้ที่ถือจนครบกำหนด	10,694	9,452	1,242	13.14
เงินลงทุนทั่วไป	102	92	10	10.87
รวม	16,694	15,147	1,547	10.21

ทั้งนี้ กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ มีนโยบายการลงทุนในประเภทการลงทุนที่หลากหลาย ได้แก่ ตราสารหนี้ (อาทิ เงินฝาก พันธบัตรรัฐบาล และหุ้นกู้เอกชน) และตราสารอื่นๆ ผ่านกองทุนรวม เป็นต้น โดยในปี 2555 มีการปรับลดสัดส่วนของหลักทรัพย์เพื่อขาย และเพิ่มสัดส่วนของตราสารหนี้ที่ถือจนครบกำหนด เพื่อลดความเสี่ยงโดยรวมของพอร์ตการลงทุน

2.1.2 ทรัพย์สินหลักประกัน และทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์ จำนวน 8,358 ล้านบาท คิดเป็นสัดส่วนร้อยละ 27.92 ของสินทรัพย์รวม เพิ่มขึ้นจำนวน 934 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 12.58 เป็นเงินหลักประกันและผลประโยชน์ของบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด ซึ่งเพิ่มขึ้นตามการเพิ่มขึ้นของธุรกรรมของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตราสารอนุพันธ์

2.1.3 ที่ดิน อาคารและอุปกรณ์ และสินทรัพย์ไม่มีตัวตน จำนวน 2,769 ล้านบาท คิดเป็นสัดส่วนร้อยละ 9.25 ของสินทรัพย์รวม เพิ่มขึ้นจำนวน 128 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 4.85 ที่สำคัญจากระบบซื้อขายหลักทรัพย์ใหม่ (SET CONNECT) ที่เริ่มใช้งานในปี 2555 และการก่อสร้างอาคารสำนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ แห่งใหม่

2.2 การวิเคราะห์หนี้สิน

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2555 กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ มีหนี้สินรวมจำนวน 10,451 ล้านบาท เพิ่มขึ้นจำนวน 1,300 ล้านบาท หรือร้อยละ 14.21 เมื่อเทียบกับยอดคงเหลือ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554 โดยมีรายละเอียดสำคัญดังนี้

2.2.1 เจ้าหนี้หลักประกัน และเจ้าหนี้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์ จำนวน 8,231 ล้านบาท คิดเป็นสัดส่วนร้อยละ 78.76 ของหนี้สินรวม เพิ่มขึ้นจำนวน 930 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 12.74 ซึ่งเพิ่มขึ้นตามการเพิ่มขึ้นของธุรกรรมของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตราสารอนุพันธ์

2.2.2 เจ้าหนี้และค่าใช้จ่ายค้างจ่าย จำนวน 876 ล้านบาท คิดเป็นสัดส่วนร้อยละ 8.38 ของหนี้สินรวม เพิ่มขึ้นจำนวน 183 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 26.41 ที่สำคัญจากเงินบริจาคให้มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์ฯ ในปี 2555 เพิ่มขึ้นจากปี 2554 จำนวน 95 ล้านบาท และเงินอุดหนุนให้แก่สำนักงาน ก.ล.ต. ค้างจ่ายเพิ่มขึ้น 34 ล้านบาท

2.2.3 หนี้สินหมุนเวียนอื่น จำนวน 670 ล้านบาท คิดเป็นสัดส่วนร้อยละ 6.41 ของหนี้สินรวม เพิ่มขึ้นจำนวน 164 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 32.73 ที่สำคัญจากเงินคืนจากการจองซื้อหุ้นเพิ่มทุนที่ร่อนาส่งผู้ถือหน่วยลงทุน จำนวน 215 ล้านบาท ขณะที่เงินกองทุนตลาดหุ้นร่วมใจช่วยภัยน้ำท่วมและเงินกองทุน วตท.ร่วมใจช่วยภัยน้ำท่วมที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นตัวแทนในการรับบริจาคเพื่อช่วยเหลือผู้ประสบภัยลดลง 85 ล้านบาท (สินทรัพย์หมุนเวียนอื่นลดลงด้วยจำนวนเดียวกัน)

2.3 การวิเคราะห์เงินกองทุน

ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2555 กลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ มีเงินกองทุนรวมจำนวน 19,484 ล้านบาท เพิ่มขึ้นจำนวน 1,616 ล้านบาท หรือร้อยละ 9.04 เมื่อเทียบกับยอดคงเหลือ ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2554 เนื่องจากกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ มีรายได้สูงกว่าค่าใช้จ่ายสุทธิ สำหรับปี 2555 จำนวน 1,362 ล้านบาท รวมทั้งมีการปรับตัวเพิ่มขึ้นของราคาตลาดของเงินลงทุนในหลักทรัพย์เพื่อขายจำนวน 248 ล้านบาท

3. การวิเคราะห์สภาพคล่อง

กระแสเงินสดของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2555 และ 2554 สรุปได้ดังนี้

(หน่วย: ล้านบาท)	2555	2554	เพิ่ม/(ลด)	
			จำนวน	ร้อยละ
กระแสเงินสดจากกิจกรรมดำเนินงาน	621	512	109	21.29
กระแสเงินสดจากกิจกรรมลงทุน	118	(651)	769	118.13
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด ณ วันปลายปี	1,104	365	739	202.47

เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2555 มีจำนวน 1,104 ล้านบาท เพิ่มขึ้นจากปี 2554 จำนวน 739 ล้านบาท หรือคิดเป็นร้อยละ 202.47 ซึ่งมีรายละเอียดของแหล่งที่มาและที่ใช้ไปของเงินดังต่อไปนี้

- เงินสดสุทธิจากกิจกรรมดำเนินงานจำนวน 621 ล้านบาท มาจากเงินสดที่ได้จากการดำเนินงาน จำนวน 675 ล้านบาท และเงินสดใช้ไปสำหรับเงินทุนหมุนเวียน จำนวน 54 ล้านบาท
- เงินสดสุทธิที่ได้มาจากกิจกรรมลงทุนจำนวน 118 ล้านบาท ที่สำคัญจากรายได้จากเงินลงทุนที่มีอัตราผลตอบแทนที่เพิ่มขึ้น

รายงานความรับผิดชอบของคณะกรรมการ ต่อรายงานทางการเงิน

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้พิจารณางบการเงินรวมของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและกิจกรรมย่อย และสารสนเทศทางการเงินที่ปรากฏในรายงานประจำปีแล้ว เห็นว่า งบการเงินดังกล่าวจัดทำขึ้นตามมาตรฐานการบัญชีที่รับรองทั่วไปในประเทศไทย โดยเลือกใช้นโยบายบัญชีที่เหมาะสมและถือปฏิบัติอย่างสม่ำเสมอ ตลอดจนใช้ดุลยพินิจอย่างระมัดระวังและประมาณการที่ดีที่สุดในการจัดทำ รวมทั้งมีการเปิดเผยข้อมูลสำคัญอย่างเพียงพอในหมายเหตุประกอบงบการเงิน

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดให้มีและดำรงรักษาไว้ซึ่งระบบควบคุมภายในที่มีประสิทธิภาพ เพื่อให้มั่นใจได้อย่างมีเหตุผลว่าการบันทึกข้อมูลทางบัญชีมีความถูกต้อง ครบถ้วน และเพียงพอที่จะดำรงรักษาไว้ซึ่งทรัพย์สิน และให้ทราบจุดอ่อนเพื่อป้องกันไม่ให้เกิดการทุจริตหรือการดำเนินการที่ผิดปกติดังมีสาระสำคัญ

ในการนี้ คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้แต่งตั้งคณะอนุกรรมการตรวจสอบ ซึ่งประกอบด้วยกรรมการที่ไม่เป็นผู้บริหาร เป็นผู้ดูแลรับผิดชอบเกี่ยวกับคุณภาพของรายงานทางการเงินและระบบควบคุมภายใน ความเห็นของคณะอนุกรรมการตรวจสอบเกี่ยวกับเรื่องนี้ปรากฏในรายงานของคณะอนุกรรมการตรวจสอบซึ่งแสดงไว้ในรายงานประจำปีแล้ว

คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ มีความเห็นว่า ระบบควบคุมภายในของตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยรวมอยู่ในระดับที่น่าพอใจ และสามารถสร้างความเชื่อมั่นอย่างมีเหตุผลต่อความเชื่อถือได้ของงบการเงินของตลาดหลักทรัพย์ฯ และกิจกรรมย่อย ณ วันที่ 31 ธันวาคม 2555



(นายสมพล เกียรติไพบูรณ์)

ประธานกรรมการ



(นายจรัมพร โชติกเสถียร)

กรรมการและผู้จัดการ



สานโอกาส สร้างความแข็งแกร่ง ทางการเงิน

มุ่งสร้างความมั่นคงทางการเงิน
เปิดเผยข้อมูลอย่างโปร่งใส ตามหลักมาตรฐานสากล
เพิ่มความเชื่อมั่นของตลาดทุนไทย

รายงานของผู้สอบบัญชีรับอนุญาต

เสนอสมาชิกตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ข้าพเจ้าได้ตรวจสอบงบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะกิจการของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และกิจการย่อย และของเฉพาะของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ซึ่งประกอบด้วยงบแสดงฐานะการเงินรวมและงบแสดงฐานะการเงินเฉพาะกิจการ ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จรวมและงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จเฉพาะกิจการ งบแสดงการเปลี่ยนแปลงของเงินกองทุนรวมและงบแสดงการเปลี่ยนแปลงของเงินกองทุนเฉพาะกิจการ และงบกระแสเงินสดรวมและงบกระแสเงินสดเฉพาะกิจการ สำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน รวมถึงหมายเหตุสรุปนโยบายการบัญชีที่สำคัญและหมายเหตุเรื่องอื่นๆ

ความรับผิดชอบของผู้บริหารต่องบการเงิน

ผู้บริหารเป็นผู้รับผิดชอบในการจัดทำและการนำเสนองบการเงินเหล่านี้โดยถูกต้องตามที่ควรตามมาตรฐานการรายงานทางการเงิน และรับผิดชอบเกี่ยวกับการควบคุมภายในที่ผู้บริหารพิจารณาว่าจำเป็นเพื่อให้สามารถจัดทำงบการเงินที่ปราศจากการแสดงข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญไม่ว่าจะเกิดจากการทุจริตหรือข้อผิดพลาด

ความรับผิดชอบของผู้สอบบัญชี

ข้าพเจ้าเป็นผู้รับผิดชอบในการแสดงความเห็นต่องบการเงินดังกล่าวจากผลการตรวจสอบของข้าพเจ้า ข้าพเจ้าได้ปฏิบัติตามตรวจสอบตามมาตรฐานการสอบบัญชี ซึ่งกำหนดให้ข้าพเจ้าปฏิบัติตามข้อกำหนดด้านจรรยาบรรณ รวมถึงวางแผนและปฏิบัติตามตรวจสอบเพื่อให้ได้ความเชื่อมั่นอย่างสมเหตุสมผลว่างบการเงินปราศจากการแสดงข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญหรือไม่

การตรวจสอบรวมถึงการใช้วิธีการตรวจสอบเพื่อให้ได้มาซึ่งหลักฐานการสอบบัญชีเกี่ยวกับจำนวนเงินและการเปิดเผยข้อมูลในงบการเงิน วิธีการตรวจสอบที่เลือกใช้ขึ้นอยู่กับดุลพินิจของผู้สอบบัญชี ซึ่งรวมถึงการประเมินความเสี่ยงจากการแสดงข้อมูลที่ขัดต่อข้อเท็จจริงอันเป็นสาระสำคัญของงบการเงินไม่ว่าจะเกิดจากการทุจริตหรือข้อผิดพลาด ในการประเมินความเสี่ยงดังกล่าว ผู้สอบบัญชีพิจารณาการควบคุมภายในที่เกี่ยวข้องกับการจัดทำและการนำเสนองบการเงินโดยถูกต้องตามที่ควรของกิจการ เพื่อออกแบบวิธีการตรวจสอบที่เหมาะสมกับสถานการณ์ แต่ไม่ใช่เพื่อวัตถุประสงค์ในการแสดงความเห็นต่อประสิทธิภาพของการควบคุมภายในของกิจการ การตรวจสอบรวมถึงการประเมินความเหมาะสมของนโยบายการบัญชีที่ผู้บริหารใช้และความสมเหตุสมผลของประมาณการทางบัญชีที่จัดทำขึ้นโดยผู้บริหาร รวมทั้งการประเมินการนำเสนองบการเงินโดยรวม

ข้าพเจ้าเชื่อว่าหลักฐานการสอบบัญชีที่ข้าพเจ้าได้รับเพียงพอและเหมาะสมเพื่อใช้เป็นเกณฑ์ในการแสดงความเห็นของข้าพเจ้า

ความเห็น

ข้าพเจ้าเห็นว่างบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะกิจการข้างต้นนี้แสดงฐานะการเงินรวมและฐานะการเงินเฉพาะกิจการของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และกิจการย่อย และของเฉพาะของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และผลการดำเนินงานรวมและผลการดำเนินงานเฉพาะกิจการ และกระแสเงินสดรวมและกระแสเงินสดเฉพาะกิจการ สำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน โดยถูกต้องตามที่ควรในสาระสำคัญตามมาตรฐานการรายงานทางการเงิน



ณัฐพร พันธุ์อุดม

ผู้สอบบัญชีรับอนุญาตเลขที่ 3430

บริษัท ไฟร์วอลล์เซอร์วิส เอปียเอส จำกัด

กรุงเทพมหานคร

20 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2556

งบแสดงฐานะการเงิน

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและกิจการย่อย
ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554



(หน่วย : พันบาท)

		งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
		พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
หมายเหตุ					
สินทรัพย์					
สินทรัพย์หมุนเวียน					
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด	7	1,045,674	364,643	769,867	221,981
เงินฝากธนาคารสำหรับผลประโยชน์ทางการเงินรอจ่ายคืน		57,906	-	-	-
ทรัพย์สินหลักประกันและผลประโยชน์	17	6,810,073	6,053,018	-	-
เงินลงทุนชั่วคราว - สุทธิ	8	7,275,683	9,452,678	7,238,663	8,614,168
ลูกหนี้และรายได้ค้างรับ - สุทธิ	6, 9	293,969	214,109	269,162	421,252
ดอกเบี้ยค้างรับ		138,852	101,948	134,565	94,474
สินทรัพย์หมุนเวียนอื่น	6, 10	453,255	316,068	193,712	282,611
รวมสินทรัพย์หมุนเวียน		16,075,412	16,502,464	8,605,969	9,634,486
สินทรัพย์ไม่หมุนเวียน					
เงินลงทุนในกิจการย่อย	11	-	-	597,291	597,291
เงินลงทุนในกิจการที่ควบคุมร่วมกัน - สุทธิ	12	76,359	58,495	25,000	25,000
เงินลงทุนในกิจการร่วม - สุทธิ	13	497,907	495,307	396,605	396,605
เงินลงทุนระยะยาว - สุทธิ	14	8,314,525	5,329,372	8,265,430	5,308,512
ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์	18	1,548,357	1,371,232	127,033	122,862
เงินกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์	22	651,101	617,837	651,101	617,837
ที่ดิน อาคารและอุปกรณ์ - สุทธิ	15	2,450,435	2,417,568	2,447,531	2,411,896
สินทรัพย์ไม่มีตัวตน - สุทธิ	16	318,113	223,104	315,440	218,753
เงินมัดจำ		2,888	3,228	2,878	3,218
รวมสินทรัพย์ไม่หมุนเวียน		13,859,685	10,516,143	12,828,309	9,701,974
รวมสินทรัพย์		29,935,097	27,018,607	21,434,278	19,336,460

งบแสดงฐานะการเงิน (ต่อ)

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและกิจการย่อย
ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554

		งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
หมายเหตุ		พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
หนี้สินและเงินกองทุน					
หนี้สินหมุนเวียน					
เจ้าหนี้หลักประกันและผลประโยชน์	17	6,810,073	6,053,018	-	-
เจ้าหนี้และค่าใช้จ่ายค้างจ่าย	6, 19	875,594	692,509	856,361	678,832
ค่าธรรมเนียมรับล่วงหน้า		234,633	237,124	154,572	169,218
เงินกู้ยืมระยะสั้นจากกิจการย่อย	6	-	-	1,035,400	559,400
สำรองผลประโยชน์พนักงานที่ถึงกำหนดชำระภายในหนึ่งปี	21	6,102	5,630	6,102	5,630
หนี้สินหมุนเวียนอื่น	6, 20	669,675	505,895	273,524	332,769
รวมหนี้สินหมุนเวียน		8,596,077	7,494,176	2,325,959	1,745,849
หนี้สินไม่หมุนเวียน					
เจ้าหนี้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์	18	1,421,324	1,248,370	-	-
เงินสมทบและผลประโยชน์ของเงินกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์	22	244,671	232,172	244,671	232,172
สำรองผลประโยชน์พนักงาน	21	160,340	143,592	160,340	143,592
หนี้สินไม่หมุนเวียนอื่น		28,134	32,381	28,134	32,381
รวมหนี้สินไม่หมุนเวียน		1,854,469	1,656,515	433,145	408,145
รวมหนี้สิน		10,450,546	9,150,691	2,759,104	2,153,994
เงินกองทุน					
เงินกองทุน	22	18,690,780	17,321,865	17,873,467	16,627,845
ผลกำไรที่ยังไม่เกิดขึ้นจริงจากหลักทรัพย์เพื่อขาย		793,769	546,049	801,707	554,621
ส่วนได้เสียที่ไม่มีอำนาจควบคุม	2	2	2	-	-
รวมเงินกองทุน		19,484,551	17,867,916	18,675,174	17,182,466
รวมหนี้สินและเงินกองทุน		29,935,097	27,018,607	21,434,278	19,336,460

งบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและกิจการย่อย
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554

(หน่วย : พันบาท)

		งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	หมายเหตุ	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
รายได้					
รายได้จากการดำเนินงาน	24	3,364,915	3,244,912	1,330,239	1,202,854
รายได้จากเงินลงทุน - สุทธิ	25	982,181	752,252	1,256,113	861,765
รายได้อื่น	26	151,562	137,431	1,489,015	1,489,503
รวมรายได้		4,498,658	4,134,595	4,075,367	3,554,122
ค่าใช้จ่าย					
ค่าใช้จ่ายผลประโยชน์ตอบแทนพนักงาน	27	1,084,261	1,101,598	1,084,325	1,101,641
ค่าตอบแทนกรรมการ		19,610	18,739	18,960	18,089
ค่าใช้จ่ายการตลาด		134,293	103,988	134,170	104,074
ค่าใช้จ่ายในการเผยแพร่ความรู้		195,083	190,083	195,083	190,148
ค่าใช้จ่ายทางตรงงานบริการ		184,743	182,955	-	-
ค่าใช้จ่ายอาคารและสำนักงาน		153,864	138,657	153,288	138,091
ค่าใช้จ่ายด้านเทคโนโลยี		149,125	137,202	143,555	136,277
เงินอุดหนุนให้แก่สำนักงาน ก.ล.ต.	28	333,726	300,851	331,726	298,851
ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย	15, 16	184,670	194,830	180,852	187,227
ค่าใช้จ่ายอื่น	29	159,587	176,305	154,917	167,002
รวมค่าใช้จ่าย		2,598,962	2,545,208	2,396,876	2,341,400
ส่วนแบ่งกำไรจากเงินลงทุนใน					
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน (สุทธิจากภาษีเงินได้)	12	26,432	19,990	-	-
ส่วนแบ่งกำไรจากเงินลงทุนใน					
กิจการร่วม (สุทธิจากภาษีเงินได้)	13	2,010	3,535	-	-
รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่าย		1,928,138	1,612,912	1,678,491	1,212,722
รายการที่ไม่เกี่ยวข้องกับการดำเนินงาน					
รายได้จากเงินกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์ - สุทธิ	23	14,083	13,368	14,083	13,368
เงินบริจาคแก่มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	6	(453,634)	(358,937)	(453,634)	(358,937)
รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่ายก่อนภาษีเงินได้		1,488,587	1,267,343	1,238,940	867,153
ภาษีเงินได้		(126,354)	(157,680)	-	-
รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่าย		1,362,233	1,109,663	1,238,940	867,153
การปันส่วนรายได้สูงกว่าค่าใช้จ่ายสำหรับปี					
ส่วนที่เป็นของกิจการใหญ่		1,362,232	1,109,662	1,238,940	867,153
ส่วนที่เป็นของส่วนได้เสียที่ไม่มีอำนาจควบคุม		1	1	-	-
		1,362,233	1,109,663	1,238,940	867,153

งบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ (ต่อ)

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและกิจการย่อย
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554

		(หน่วย : พันบาท)			
หมายเหตุ		งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
		พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่าย		1,362,233	1,109,663	1,238,940	867,153
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จอื่น:					
สินทรัพย์ทางการเงินเพื่อขาย					
ผลกำไร(ขาดทุน)ที่รับรู้ในส่วนของเงินกองทุน		348,520	(205,400)	348,479	(205,280)
โอนกำไรเนื่องจากขาย		(101,390)	(153,590)	(101,390)	(153,590)
ส่วนแบ่งกำไร(ขาดทุน)เบ็ดเสร็จอื่นในกิจการร่วม	13	590	(391)	-	-
		247,720	(359,381)	247,089	(358,870)
สินทรัพย์ทางการเงินเพื่อขายในกองทุนคุ้มครอง					
ผู้ลงทุนในหลักทรัพย์ - สุทธิ	23	6,682	(1,113)	6,682	(1,113)
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จอื่น		254,402	(360,494)	253,771	(359,983)
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จรวม		1,616,635	749,169	1,492,711	507,170

งบแสดงการเปลี่ยนแปลงส่วนของเงินกองทุน

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและกิจการย่อย
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554

(หน่วย : พันบาท)

หมายเหตุ	งบการเงินรวม										
	เงินกองทุน สำรองเพื่อ การชำระ ราคาและ ส่งมอบ หลักทรัพย์	เงินกองทุน สำรองเพื่อ การชำระหนี้ ในตลาด สัญญาซื้อ ขายล่วงหน้า	เงินกองทุน ชดเชยความ เสียหาย	เงินกองทุน เพื่อก่อสร้าง อาคาร สำนักงาน ตลาด หลักทรัพย์ฯ	เงินกองทุน เพื่อการ สมเคราะห์ ด้าน สวัสดิการ พนักงาน	เงินกองทุน คุ้มครอง ผู้ลงทุนใน หลักทรัพย์	เงินกองทุน ทั่วไป	ผลกำไร (ขาดทุน) ที่ยังไม่เกิด ขึ้นจริงจาก หลักทรัพย์ เมื่อขาย	ส่วน ของ เงินกองทุน	ส่วน ที่มีอำนาจ ควบคุม	รวมส่วน ของ เงินกองทุน
ยอดคงเหลือต้นปี ณ วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2554	2,000,000	300,000	100,000	15,424	96,203	373,410	13,328,278	905,430	17,118,745	2	17,118,747
ปรับปรุงรายการเพื่อก่อสร้าง อาคารสำนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ	-	-	-	(7,315)	-	-	7,315	-	-	-	-
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จรวม	-	-	-	-	1,720	12,255	1,094,575	(359,381)	749,169	-	749,169
ยอดคงเหลือปลายปี ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554	2,000,000	300,000	100,000	8,109	97,923	385,665	14,430,168	546,049	17,867,914	2	17,867,916
ยอดคงเหลือต้นปี ณ วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2555	2,000,000	300,000	100,000	8,109	97,923	385,665	14,430,168	546,049	17,867,914	2	17,867,916
ปรับปรุงรายการเพื่อก่อสร้าง อาคารสำนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ	-	-	-	(340)	-	-	340	-	-	-	-
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จรวม	-	-	-	-	1,990	20,765	1,346,160	247,720	1,616,635	-	1,616,635
ยอดคงเหลือปลายปี ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555	2,000,000	300,000	100,000	7,769	99,913	406,430	15,776,668	793,769	19,484,549	2	19,484,551

(หน่วย : พันบาท)

หมายเหตุ	เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ									
	เงินกองทุน สำรองเพื่อ การชำระ ราคาและ ส่งมอบ หลักทรัพย์	เงินกองทุน สำรองเพื่อ การชำระหนี้ ในตลาด สัญญาซื้อ ขายล่วงหน้า	เงินกองทุน ชดเชยความ เสียหาย	เงินกองทุน เพื่อก่อสร้าง อาคาร สำนักงาน ตลาด หลักทรัพย์ฯ	เงินกองทุน เพื่อการ สมเคราะห์ ด้าน สวัสดิการ พนักงาน	เงินกองทุน คุ้มครอง ผู้ลงทุนใน หลักทรัพย์	เงินกองทุน ทั่วไป	ผลกำไร (ขาดทุน) ที่ยังไม่เกิด ขึ้นจริงจาก หลักทรัพย์ เมื่อขาย	ส่วน ของ เงินกองทุน	รวมส่วน ของ เงินกองทุน
ยอดคงเหลือต้นปี ณ วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2554	2,000,000	300,000	100,000	15,424	96,203	373,410	12,876,768	913,491	16,675,296	
ปรับปรุงรายการเพื่อก่อสร้าง อาคารสำนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ	-	-	-	(7,315)	-	-	7,315	-	-	
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จรวม	-	-	-	-	1,720	12,255	852,065	(358,870)	507,170	
ยอดคงเหลือปลายปี ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554	2,000,000	300,000	100,000	8,109	97,923	385,665	13,736,148	554,621	17,182,466	
ยอดคงเหลือต้นปี ณ วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2555	2,000,000	300,000	100,000	8,109	97,923	385,665	13,736,148	554,621	17,182,466	
ปรับปรุงรายการเพื่อก่อสร้าง อาคารสำนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ	-	-	-	(340)	-	-	340	-	-	
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จรวม	-	-	-	-	1,990	20,765	1,222,867	247,086	1,492,708	
ยอดคงเหลือปลายปี ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555	2,000,000	300,000	100,000	7,769	99,913	406,430	14,959,355	801,707	18,675,174	

งบกระแสเงินสด

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและกิจการย่อย
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554

		งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
หมายเหตุ		พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กระแสเงินสดจากกิจกรรมดำเนินงาน					
รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่ายก่อนภาษีเงินได้		1,488,587	1,267,343	1,238,940	867,153
รายการปรับปรุง					
ค่าเสื่อมราคาและค่าตัดจำหน่าย	15, 16	184,670	194,830	180,852	187,227
รายได้จากเงินลงทุน - สุทธิ	25	(958,488)	(752,252)	(1,233,072)	(861,765)
รายได้จากเงินกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์-สุทธิ	23	(14,083)	(13,368)	(14,083)	(13,368)
(กลับรายการ) ขาดทุนจากการด้อยค่าเงินลงทุน		(17,866)	164	(17,866)	164
(กลับรายการ) หนี้สงสัยจะสูญ		574	(1)	1,066	(1)
สำรองผลประโยชน์พนักงาน		23,003	42,152	23,003	42,152
ปรับปรุงงานระหว่างทำเป็นค่าใช้จ่าย (รายได้)		(2,365)	2,819	(2,337)	2,819
(กำไร)ขาดทุนจากการขายสินทรัพย์		(812)	-	(621)	-
ขาดทุนจากการตัดจำหน่ายสินทรัพย์		-	5,583	-	5,527
ส่วนแบ่งกำไรจากเงินลงทุนใน					
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน (สุทธิจากภาษีเงินได้)	12	(26,432)	(19,990)	-	-
ส่วนแบ่งกำไรจากเงินลงทุนใน					
กิจการร่วม (สุทธิจากภาษีเงินได้)	13	(2,010)	(3,535)	-	-
		674,778	723,745	175,882	229,908
การเปลี่ยนแปลงของสินทรัพย์และหนี้สินดำเนินงาน					
สินทรัพย์ดำเนินงาน (เพิ่มขึ้น) ลดลง					
ทรัพย์สินหลักประกันและผลประโยชน์					
ลูกหนี้และรายได้ค้างรับ		(80,434)	(1,455)	151,024	(175,497)
สินทรัพย์หมุนเวียนอื่น		(130,592)	(61,100)	90,425	(68,296)
ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์		(177,125)	(314,263)	(4,171)	(2,764)
เงินกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์		(32,836)	(18,460)	(32,836)	(18,460)
เงินมัดจำ		340	3,754	340	3,754
เจ้าหนี้หลักประกันและผลประโยชน์		757,055	2,441,003	-	-
เจ้าหนี้และค่าใช้จ่ายค้างจ่าย		163,109	(91,684)	157,553	(93,597)
ค่าธรรมเนียมรับล่วงหน้า		(2,491)	(9,636)	(14,646)	33,306
หนี้สินหมุนเวียนอื่น		185,768	80,664	(59,245)	141,934
เจ้าหนี้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์		172,954	311,499	-	-
เงินสมทบและผลประโยชน์ของเงินกองทุนคุ้มครอง					
ผู้ลงทุนในหลักทรัพย์					
จ่ายผลประโยชน์พนักงาน	21	(5,826)	(13,468)	(5,826)	(13,468)
หนี้สินไม่หมุนเวียนอื่น		(4,247)	(4,530)	(4,247)	(4,530)
เงินสดสุทธิได้มาจากกิจกรรมดำเนินงาน					
จ่ายภาษีเงินได้		(154,843)	(100,257)	-	-
เงินสดสุทธิได้มาจากกิจกรรมดำเนินงาน		621,054	512,182	466,752	39,663

งบกระแสเงินสด (ต่อ)

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและกิจการย่อย
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554

(หน่วย : พันบาท)

หมายเหตุ	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กระแสเงินสดจากกิจกรรมลงทุน				
รับรายได้จากเงินลงทุน	590,171	394,295	553,587	374,965
รับเงินปันผล	336,611	303,650	662,185	448,266
ซื้อเงินลงทุนชั่วคราว	8 (4,751,182)	(6,765,832)	(4,463,450)	(4,739,395)
ขายเงินลงทุนชั่วคราว	8 4,377,279	4,671,474	3,275,047	4,340,541
ซื้อเงินลงทุนระยะยาว	14 (1,769,618)	(1,975,736)	(1,728,418)	(1,975,716)
ขายเงินลงทุนระยะยาว	14 1,600,360	2,883,149	1,600,360	1,588,673
ซื้อที่ดิน อาคารและอุปกรณ์	(132,938)	(85,108)	(132,938)	(85,108)
ขายที่ดิน อาคารและอุปกรณ์	12,299	2,244	11,452	2,244
ซื้อสินทรัพย์ไม่มีตัวตน	(168,754)	(101,560)	(168,754)	(101,560)
เงินสดรับจากส่วนแบ่งกำไรในกิจการที่ควบคุมร่วมกัน	10,000	10,437	-	-
รับผลประโยชน์กองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์	13,655	12,200	13,655	12,200
เงินสดสุทธิได้มาจาก(ใช้ไปใน)กิจกรรมลงทุน	117,883	(650,787)	(377,274)	(134,890)
กระแสเงินสดจากกิจกรรมจัดหาเงิน				
เงินสดรับจากเงินกู้ยืมระยะสั้นจากกิจการย่อย	6 -	-	561,000	29,000
จ่ายชำระคืนเงินกู้ยืมระยะสั้นจากกิจการย่อย	6 -	-	(85,000)	-
จ่ายดอกเบี้ย	-	-	(17,592)	(11,573)
เงินสดสุทธิได้มาจากกิจกรรมจัดหาเงิน	-	-	458,408	17,427
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสดเพิ่มขึ้น(ลดลง)สุทธิ				
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด ณ วันต้นปี	738,937	(138,605)	547,886	(77,800)
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด ณ วันปลายปี	364,643	503,248	221,981	299,781
	1,103,580	364,643	769,867	221,981
ข้อมูลงบกระแสเงินสดเปิดเผยเพิ่มเติม				
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด ประกอบด้วย				
เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด	7 1,045,674	364,643	769,867	221,981
เงินฝากธนาคารสำหรับผลประโยชน์ทางการเงินรอจ่ายคืน	57,906	-	-	-
	1,103,580	364,643	769,867	221,981

งบกระแสเงินสด (ต่อ)

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและกิจการย่อย
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
รายการที่ไม่ใช่เงินสด				
ผลขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้นจริงจากหลักทรัพย์เพื่อขาย	247,720	(359,381)	247,086	(358,870)
ผลกำไร(ขาดทุน)ที่ยังไม่เกิดขึ้นจริงจากหลักทรัพย์				
เพื่อขายในกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์	6,682	(1,113)	6,682	(1,113)
เจ้าหน้าที่อื่นจากการซื้อสินทรัพย์	19,976	30,513	19,976	30,513
สำรองผลประโยชน์พนักงาน	43	-	43	-
ประเภทเงินลงทุนจากระยะยาวเป็นระยะสั้น	310,017	1,022,475	297,007	947,207

หมายเหตุประกอบงบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะกิจการเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินนี้

หมายเหตุประกอบงบการเงินรวม และงบการเงินเฉพาะกิจการ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและกิจการย่อย
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554

1. ข้อมูลทั่วไป

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย “ตลาดหลักทรัพย์ฯ” เป็นนิติบุคคลที่จัดตั้งขึ้นตามพระราชบัญญัติตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย พ.ศ. 2517 โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อทำหน้าที่เป็นตลาดหรือศูนย์กลางการซื้อขายหลักทรัพย์ และให้บริการที่เกี่ยวข้องโดยไม่นำผลกำไรมาแบ่งปันกัน ตลาดหลักทรัพย์ฯ เริ่มการซื้อขายหลักทรัพย์เมื่อวันที่ 30 เมษายน พ.ศ. 2518 ปัจจุบันตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำเนินงานภายใต้พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 และที่อยู่จดทะเบียนตั้งอยู่เลขที่ 62 ถนนรัชดาภิเษก แขวงคลองเตย เขตคลองเตย กรุงเทพมหานคร 10110 ประเทศไทย

เพื่อวัตถุประสงค์ในการรายงาน ตลาดหลักทรัพย์ฯ และกิจการย่อยรวมเรียกว่ากลุ่มกิจการ

ธุรกิจหลักของตลาดหลักทรัพย์ฯ และกิจการย่อย ที่สำคัญสรุปได้ดังนี้

- 1) ธุรกิจด้านตราสารทุน ได้แก่ การรับหลักทรัพย์จดทะเบียน การจัดระบบการซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียน การให้บริการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ การบริหารงานรับฝากหลักทรัพย์ รวมถึงการกำกับดูแลการซื้อขายหลักทรัพย์จดทะเบียน บริษัทจดทะเบียน และบริษัทสมาชิก
- 2) ธุรกิจด้านตราสารอนุพันธ์ ได้แก่ การจัดระบบการซื้อขายและการชำระราคาสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือตราสารอนุพันธ์ทุกประเภท รวมทั้งบริการอื่นที่เกี่ยวข้องกับธุรกรรมการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- 3) การบริการด้านเทคโนโลยี ได้แก่ การให้บริการซื้อขายหลักทรัพย์และตราสารอนุพันธ์ผ่านอินเทอร์เน็ต การให้บริการข้อมูล รวมถึงการให้บริการบริษัทหลักทรัพย์
- 4) การบริการงานนายทะเบียน ได้แก่ งานนายทะเบียนหลักทรัพย์ และนายทะเบียนกองทุน

งบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยนี้ได้รับอนุมัติจากคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ เมื่อวันที่ 20 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2556

รายละเอียดของกิจการย่อย กิจการร่วมและกิจการที่ควบคุมร่วมกัน ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 มีดังนี้

ชื่อกิจการ	ลักษณะธุรกิจ	ประเทศ ที่กิจการจัดตั้ง	สัดส่วนความเป็นเจ้าของ (ร้อยละ)	
			พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กิจการย่อยทางตรง				
บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด	การให้บริการงานรับฝากและงานนายทะเบียนหลักทรัพย์	ไทย	99.99	99.99
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนต่างดาว จำกัด (1)	การบริหารกองทุนรวม	ไทย	99.99	99.99
บริษัท ไทยเอ็นวีดีอาร์ จำกัด	การจัดการการลงทุนในตราสาร NVDR	ไทย	99.99	99.99
บริษัท เซ็ทเทรด ดอท คอม จำกัด	การให้บริการระบบงานด้านคอมพิวเตอร์	ไทย	99.99	99.99
บริษัท สยามดีอาร์ จำกัด (2)	การจัดการการลงทุนในตราสาร DR	ไทย	99.99	99.99
บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (เดิมชื่อ “บริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) ”) (3)	ศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	ไทย	99.99	99.99

ชื่อกิจการ	ลักษณะธุรกิจ	ประเทศ ที่กิจการจัดตั้ง	สัดส่วนความเป็นเจ้าของ (ร้อยละ)	
			พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด	สำนักหักบัญชีและบริการระบบ งานหลังซื้อขายหลักทรัพย์ และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	ไทย	99.99	99.99
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน บริษัท แฟมมิลี โนฮาว จำกัด	การให้บริการและคำปรึกษา การผลิตสื่อความรู้ด้านการเงิน และการลงทุน	ไทย	49.99	49.99
กิจการร่วม กองทุนทดแทนความเสียหายในระบบ	กองทุน	ไทย	16.56	17.71
การชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (4) บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน)	การให้สินเชื่อเพื่อธุรกิจ หลักทรัพย์และกิจการการยืม และให้ยืมหลักทรัพย์	ไทย	24.66	24.66

(1) บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม เพื่อผู้ลงทุนต่างดาว จำกัด

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนต่างดาว จำกัด (“กิจการย่อย”) มีกองทุนรวมที่ออกโดยบริษัท คงเหลือ จำนวน 3 กองทุน (พ.ศ. 2554 : 5 กองทุน) ที่ประชุมคณะกรรมการกิจการย่อย เมื่อวันที่ 30 พฤศจิกายน พ.ศ. 2554 มีมติอนุมัติหลักการในการยกเลิกกองทุนรวมที่ออกโดยกิจการ รวมทั้งการดำเนินการต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการยกเลิกกองทุนรวม นอกจากนี้ ได้มอบหมายให้ฝ่ายบริหารพิจารณาแนวทางดำเนินการเพื่อเลิกกิจการย่อย อย่างไรก็ตาม การดำเนินการต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการยกเลิกกองทุนรวมนั้น ขึ้นอยู่กับปัจจัยต่างๆ เช่น การอนุมัติผ่อนผันเกณฑ์ที่เกี่ยวข้องจากสำนักงาน ก.ล.ต. ดังนั้น บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนต่างดาว จำกัด จึงจัดทำงบการเงิน ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 โดยใช้หลักการดำเนินงานอย่างต่อเนื่อง

(2) บริษัท สยามดีอาร์ จำกัด

ในระหว่างปี พ.ศ. 2554 ได้มีการไถ่ถอน DRs ทั้งหมด เนื่องจากครบเงื่อนไขบังคับไถ่ถอนเป็นหุ้นสามัญ ตามข้อกำหนดสิทธิด้วยสิทธิและหน้าที่ของใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหุ้นสามัญและหุ้นกู้แปลงสภาพ ส่งผลให้บริษัทไม่มีหลักทรัพย์ใดๆ คงเหลือ

เมื่อวันที่ 22 ตุลาคม พ.ศ. 2555 ที่ประชุมคณะกรรมการผู้บริหารของ บริษัท สยามดีอาร์ จำกัด มีมติเห็นชอบในหลักการในการเลิกบริษัท และได้มอบหมายให้ฝ่ายบริหารพิจารณาแนวทางดำเนินการเพื่อเลิกบริษัท อย่างไรก็ตาม การดำเนินการต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการยกเลิกบริษัทนั้น ขึ้นอยู่กับปัจจัยต่างๆ หลายประการ ดังนั้น บริษัท สยามดีอาร์ จึงจัดทำงบการเงิน ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 โดยใช้หลักการดำเนินงานอย่างต่อเนื่อง

(3) บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (เดิมชื่อ “บริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)”)

เมื่อวันที่ 28 ธันวาคม พ.ศ. 2555 บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (“กิจการย่อย”) ได้จดทะเบียนเปลี่ยนชื่อภาษาไทยของบริษัทกับกระทรวงพาณิชย์ จาก “บริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)” เป็น “บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)”

เมื่อวันที่ 4 เมษายน พ.ศ. 2555 คณะกรรมการของกิจการย่อยอนุมัติให้จัดตั้งกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives Investor Protection Fund “DIPF”) โดยมีทุนจำนวน 100 ล้านบาท ซึ่งเป็นเงินทุนประเดิมของกิจการย่อย จำนวน 50 ล้านบาท และเงินสมทบที่ทยอยเรียกเก็บจากสมาชิกกองทุนไม่น้อยกว่า 50 ล้านบาท

กองทุนได้มีการจัดตั้งขึ้นอย่างเป็นทางการ ภายใต้ข้อบังคับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เมื่อวันที่ 15 พฤศจิกายน พ.ศ. 2555 โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อให้ความคุ้มครองผู้ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตามหลักเกณฑ์ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนด โดยผ่านบริษัทที่เป็นสมาชิก ทั้งนี้ ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 บริษัทที่เป็นสมาชิกกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีทั้งสิ้น 37 แห่ง

ทรัพย์สินของกองทุน ประกอบด้วย เงินทุนประเดิมจากกิจการย่อย เงินค่าเข้าเป็นสมาชิก เงินสมทบที่เรียกเก็บจากสมาชิกกองทุน ดอกผล หรือผลประโยชน์ที่ได้จากเงินและทรัพย์สินของกองทุน ภายหลังหักค่าใช้จ่ายเพื่อการดำเนินงานของกองทุน ทั้งนี้เงินทุนประเดิมจากกิจการย่อย และเงินค่าเข้าเป็นสมาชิกจะเริ่มเรียกเก็บ ตั้งแต่ปี พ.ศ. 2556 เป็นต้นไป

(4) กองทุนทดแทนความเสียหายในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ไม่ได้ควบคุมการดำเนินงานแต่มีส่วนร่วมในการตัดสินใจเกี่ยวกับนโยบายทางการเงินและการดำเนินงานในกองทุนทดแทนความเสียหายในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ การดำเนินงานกระทำภายใต้ข้อกำหนดของระเบียบวิธีปฏิบัติเรื่องกองทุนทดแทนความเสียหายในระบบการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ (ฉบับที่ 1) พ.ศ. 2541 ซึ่งกำหนดให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ ลงทุนโดยการจ่ายเงินสมทบครั้งเดียว เป็นจำนวนเงิน 100 ล้านบาท และสัดส่วนการถือครองจะเปลี่ยนแปลงลดลงไปตามสัดส่วนของเงินสมทบเพิ่มเติมที่สมาชิกกองทุนจ่ายเข้ากองทุนฯ ในอนาคต ดังนั้นเงินลงทุนในกองทุนดังกล่าวจึงเป็นเงินลงทุนในกิจการร่วม

2. นโยบายการบัญชี

2.1 เกณฑ์การจัดทำงบการเงิน

งบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดทำขึ้นตามหลักการบัญชีที่รับรองทั่วไปในประเทศไทย ภายใต้พระราชบัญญัติการบัญชี พ.ศ. 2543 ซึ่งหมายความว่า มาตรฐานการรายงานทางการเงินที่ออกภายใต้พระราชบัญญัติวิชาชีพบัญชี พ.ศ. 2547

งบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดทำขึ้นโดยใช้เกณฑ์ราคาทุนเดิมในการวัดมูลค่าองค์ประกอบของงบการเงินยกเว้นเรื่องเงินลงทุนที่อธิบายในนโยบายการบัญชีในลำดับต่อไป

การจัดทำงบการเงินให้สอดคล้องกับหลักการบัญชีที่รับรองทั่วไปในประเทศไทย กำหนดให้ใช้ประมาณการทางบัญชีที่สำคัญและการใช้ดุลยพินิจของผู้บริหารซึ่งจัดทำขึ้นตามกระบวนการในการนำนโยบายการบัญชีของกลุ่มกิจการไปถือปฏิบัติ และต้องเปิดเผยเรื่องการใช้ดุลยพินิจของผู้บริหารหรือความซับซ้อน หรือเกี่ยวกับข้อสมมติฐานและประมาณการที่มีนัยสำคัญต่องบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ ในหมายเหตุประกอบงบการเงินข้อที่ 4

งบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ ฉบับภาษาอังกฤษจัดทำขึ้นจากงบการเงินตามกฎหมายที่เป็นภาษาไทย ในกรณีที่มีเนื้อความขัดแย้งกันหรือมีความแตกต่างในสองภาษาแตกต่างกัน ให้ใช้งบการเงินตามกฎหมายฉบับภาษาไทยเป็นหลัก

2.2 มาตรฐานการบัญชีใหม่ มาตรฐานการรายงานทางการเงินใหม่ การตีความและการปรับปรุง มาตรฐานการบัญชี และมาตรฐานการรายงานทางการเงินใหม่

มาตรฐานการบัญชีใหม่ มาตรฐานการรายงานทางการเงินใหม่ การตีความและการปรับปรุงมาตรฐานการบัญชี และมาตรฐานการรายงานทางการเงินใหม่ ซึ่งยังไม่มีผลบังคับใช้ และกลุ่มกิจการยังไม่ได้นำมาถือปฏิบัติ

มีผลบังคับใช้สำหรับรอบระยะเวลาบัญชีที่เริ่มต้นในหรือหลังวันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2556

มาตรฐานการบัญชีฉบับที่ 12	เรื่อง ภาษีเงินได้
มาตรฐานการบัญชีฉบับที่ 20	เรื่อง การบัญชีสำหรับเงินอุดหนุนจากรัฐบาล และการเปิดเผยข้อมูลเกี่ยวกับความช่วยเหลือจากรัฐบาล
มาตรฐานการบัญชีฉบับที่ 21 (ปรับปรุง 2552)	เรื่อง ผลกระทบจากการเปลี่ยนแปลงของอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ
มาตรฐานการรายงานทางการเงินฉบับที่ 8	เรื่อง ส่วนงานดำเนินงาน
การตีความมาตรฐานการบัญชีฉบับที่ 10	เรื่อง ความช่วยเหลือจากรัฐบาล - กรณีที่ไม่มีความเกี่ยวข้องอย่างเฉพาะเจาะจงกับกิจกรรมดำเนินงาน
การตีความมาตรฐานการบัญชีฉบับที่ 21	เรื่อง ภาษีเงินได้ - การได้รับประโยชน์จากสินทรัพย์ที่ไม่ได้คิดค่าเสื่อมราคาที่ดินราคาใหม่
การตีความมาตรฐานการบัญชีฉบับที่ 25	เรื่อง ภาษีเงินได้ - การเปลี่ยนแปลงสถานภาพทางภาษีของกิจการหรือของผู้ถือหุ้น

มีผลบังคับใช้สำหรับรอบระยะเวลาบัญชีที่เริ่มต้นในหรือหลังวันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2557

การตีความมาตรฐานการรายงานทางการเงินฉบับที่ 4	การประเมินว่าข้อตกลงประกอบด้วยสัญญาเช่าหรือไม่
การตีความมาตรฐานการรายงานทางการเงินฉบับที่ 12	ข้อตกลงสัมปทานบริการ
การตีความมาตรฐานการรายงานทางการเงินฉบับที่ 13	โปรแกรมสิทธิพิเศษแก่ลูกค้า
การตีความมาตรฐานการบัญชีฉบับที่ 29	การเปิดเผยข้อมูลของข้อตกลงสัมปทานบริการ

ผู้บริหารของกลุ่มกิจการ ได้ประเมินและเห็นว่ามาตรฐานการบัญชีใหม่ มาตรฐานการรายงานทางการเงินใหม่ การตีความและการปรับปรุงมาตรฐานการบัญชี และมาตรฐานการรายงานทางการเงินใหม่ดังกล่าวจะไม่มีผลกระทบที่เป็นสาระสำคัญต่อการเงินที่น่าเสนอ ยกเว้นมาตรฐานการบัญชีที่มีสาระสำคัญต่อบริษัทที่นำมาพิจารณา ดังนี้

- มาตรฐานการบัญชีฉบับที่ 8 กำหนดให้กิจการเปิดเผยข้อมูลส่วนงานตามเกณฑ์การเสนอรายงานการเงิน เพื่อให้ผู้บริหารใช้กลุ่มกิจการจะเริ่มนำมาตรฐานการรายงานทางการเงินฉบับนี้มาปฏิบัติตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2556 ผู้บริหารอยู่ในระหว่างการประเมินผลกระทบในรายละเอียด แต่จำนวนของส่วนงานที่รายงานตลอดจนวิธีการรายงานส่วนงานจะเปลี่ยนแปลงไปเพื่อให้สอดคล้องกับวิธีการนำเสนอรายงานภายในต่อผู้มีอำนาจตัดสินใจสูงสุดด้านการดำเนินงาน
- มาตรฐานการบัญชีฉบับที่ 12 เกี่ยวข้องกับภาษีเงินได้ ซึ่งรวมถึงภาษีเงินได้ของงวดปัจจุบัน และภาษีเงินได้รอการตัดบัญชี ค่าใช้จ่ายภาษีเงินได้ของงวดคำนวณจากจำนวนที่ต้องเสียภาษีและจำนวนที่สามารถหักภาษีได้ซึ่งแสดงอยู่ในแบบการคำนวณภาษีเงินได้ในงวดปัจจุบัน สินทรัพย์หรือหนี้สินภาษีเงินได้ของงวดปัจจุบันคำนวณจากจำนวนที่คาดว่าจะต้องจ่ายแก่ หรือได้รับคืนจากหน่วยงานจัดเก็บภาษี โดยใช้อัตราภาษีและกฎหมายภาษีอากรที่บังคับใช้อยู่หรือที่คาดว่าจะมีผลบังคับใช้ภายในวันที่ในงบแสดงฐานะการเงิน การบัญชีสำหรับภาษีเงินได้รอการตัดบัญชีคำนวณจากผลแตกต่างชั่วคราวของฐานภาษีของสินทรัพย์หรือหนี้สิน และมูลค่าตามบัญชีของสินทรัพย์หรือหนี้สินในงบการเงิน

2.3 เงินลงทุนในกิจการย่อย กิจการที่ควบคุมร่วมกันและกิจการร่วม

2.3.1 กิจการย่อย

กิจการย่อย หมายถึงกิจการที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีอำนาจในการควบคุมนโยบายการเงินและการดำเนินงานงบการเงินของกิจการย่อยได้ถูกรวมอยู่ในงบการเงินรวมนับตั้งแต่วันที่มีการควบคุมจนถึงวันที่การควบคุมสิ้นสุดลง

รายการบัญชีและยอดคงเหลือระหว่างตลาดหลักทรัพย์ฯ และกิจการย่อย ตลอดจนกำไรขาดทุนที่ยังไม่ได้เกิดขึ้นได้ถูกตัดออกจากงบการเงินรวมนี้แล้ว

เงินลงทุนในกิจการย่อยที่แสดงในงบการเงินเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ ใช้วิธีราคาทุน โดยรายได้จากเงินลงทุนในกิจการย่อยจะรับรู้เมื่อกิจการย่อยมีการประกาศจ่ายเงินปันผล

2.3.2 กิจการที่ควบคุมร่วมกัน

ส่วนได้เสียในกิจการที่ควบคุมร่วมกันแสดงในงบการเงินรวมโดยใช้วิธีส่วนได้เสีย งบการเงินเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ แสดงโดยวิธีราคาทุน

2.3.3 กิจการร่วม

กิจการร่วมเป็นกิจการที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีอิทธิพลในการตัดสินใจทางการเงินและการดำเนินงานแต่ไม่มีอำนาจควบคุมตลาดหลักทรัพย์ฯ รับรู้เงินลงทุนในกิจการร่วมเริ่มแรกโดยใช้วิธีราคาทุนและรับรู้ในภายหลังโดยใช้วิธีส่วนได้เสียในการแสดงในงบการเงินรวม

ส่วนแบ่งกำไรหรือขาดทุนของตลาดหลักทรัพย์ฯ ในกิจการร่วมที่เกิดขึ้นภายหลังการได้มาจะรวมไว้ในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ ผลสะสมของการเปลี่ยนแปลงภายหลังการได้มาจะปรับปรุงกับราคาตามบัญชีของเงินลงทุน เมื่อส่วนแบ่งขาดทุนของตลาดหลักทรัพย์ฯ ในกิจการร่วมมีมูลค่าเท่ากับหรือเกินกว่ามูลค่าส่วนได้เสียของตลาดหลักทรัพย์ฯ ในกิจการร่วมนั้น ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะไม่รับรู้ส่วนแบ่งขาดทุนอีกต่อไป เว้นแต่ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีภาระผูกพันในหนี้ของกิจการร่วมหรือรับว่าจะจ่ายหนี้แทนกิจการร่วม

รายการกำไรที่ซึ่งยังไม่ได้เกิดขึ้นจริงระหว่างตลาดหลักทรัพย์ฯ กับกิจการร่วมจะตัดบัญชีเท่าที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีส่วนได้เสียในกิจการร่วมนั้น รายการขาดทุนที่ยังไม่ได้เกิดขึ้นจริงก็จะตัดบัญชีในทำนองเดียวกัน เว้นแต่รายการนั้นมีหลักฐานว่าสินทรัพย์ที่โอนระหว่างกันเกิดการด้อยค่า

เงินลงทุนในการร่วมแสดงในงบการเงินเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยวิธีราคาทุน หากมีการด้อยค่า (ถ้ามี) ของเงินลงทุนในการย่อยย การที่ควบคุมร่วมกันและกิจการร่วม ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะบันทึกเป็นค่าเผื่อการปรับมูลค่าเงินลงทุน และแสดงในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ รายชื่อของกิจการย่อยย การที่ควบคุมร่วมกันและกิจการร่วมของตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้แสดงไว้ในหมายเหตุประกอบงบการเงิน ข้อที่ 1

2.4 เงินตราต่างประเทศ

รายการต่างๆ ในงบการเงินของแต่ละกิจการในกลุ่มกิจการวัดมูลค่าโดยใช้สกุลเงินบาท งบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ นำเสนอในสกุลเงินบาท

กลุ่มกิจการแปลงค่ารายการที่เป็นเงินตราต่างประเทศให้เป็นเงินบาทโดยใช้อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่ที่เกิดรายการและแปลงค่าสินทรัพย์และหนี้สินที่เป็นตัวเงินซึ่งเป็นเงินตราต่างประเทศให้เป็นเงินบาทโดยใช้อัตราแลกเปลี่ยน ณ วันที่ในงบแสดงฐานะการเงิน รายการกำไรและรายการขาดทุนที่เกิดจากการรับหรือจ่ายชำระที่เป็นเงินตราต่างประเทศ และที่เกิดจากการแปลงค่าสินทรัพย์และหนี้สินที่เป็นตัวเงินซึ่งเป็นเงินตราต่างประเทศ ได้บันทึกไว้ในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ

ผลต่างจากการแปลงค่าเงินลงทุนในตราสารหนี้และสินทรัพย์ทางการเงินอื่นซึ่งวัดมูลค่าโดยใช้มูลค่ายุติธรรม ให้รวมผลต่างดังกล่าวเป็นรายการกำไรหรือรายการขาดทุนจากอัตราแลกเปลี่ยน ส่วนผลต่างจากการแปลงค่ารายการที่ไม่เป็นตัวเงิน เช่น เงินลงทุนในตราสารทุนที่ถือไว้เพื่อค้า ให้รวมผลต่างดังกล่าวเป็นรายการกำไรหรือรายการขาดทุนของการเปลี่ยนแปลงมูลค่ายุติธรรม นอกจากนี้ผลต่างจากการแปลงค่าเงินลงทุนในตราสารทุนที่ถือไว้เพื่อขายให้รวมไว้ในส่วนเกินทุนจากการตีมูลค่ายุติธรรมซึ่งแสดงอยู่ในส่วนของเงินกองทุน

2.5 หลักทรัพย์อ้างอิง

หลักทรัพย์อ้างอิงที่บริษัท ไทยเอ็นวีดีอาร์ จำกัด และบริษัท สยามดีอาร์ จำกัด (กิจการย่อยย) ถือครองอยู่ ซึ่งถือเป็นสินทรัพย์ทางการเงิน และตราสารประเภทใบแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงหรือตราสารประเภท Non-voting Depository Receipts (NVDRs) หรือ Depository Receipts (DRs) สำหรับหลักทรัพย์ดังกล่าว ซึ่งถือเป็นหนี้สินทางการเงิน กิจการย่อยยได้นำสินทรัพย์ทางการเงินและหนี้สินทางการเงินดังกล่าวมาหักกลบลบกันและแสดงจำนวนสุทธิในงบการเงิน เนื่องจากตามข้อกำหนดและเงื่อนไขในหนังสือชี้ชวนกำหนดให้กิจการย่อยยออก NVDRs หรือ DRs และนำเงินที่ได้จากการขาย NVDRs หรือ DRs ไปลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงไทยที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ในจำนวนและระยะเวลาเดียวกัน (Back to back) นอกจากนี้ผลประโยชน์ทางการเงินที่กิจการย่อยยได้รับในฐานะเป็นผู้ถือหลักทรัพย์ กิจการย่อยยมีภาระที่จะต้องจ่ายคืนสิทธิประโยชน์ทางการเงินดังกล่าวทั้งจำนวนให้กับนักลงทุนใน NVDRs หรือ DRs ตามเงื่อนไขที่กำหนดในหนังสือชี้ชวน กิจการย่อยยจึงมีได้บันทึกผลประโยชน์ที่ได้รับดังกล่าวเป็นรายได้และค่าใช้จ่ายของกิจการ

2.6 เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด

เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสดประกอบด้วย เงินสดในมือ และเงินฝากสถาบันการเงินทุกประเภท (แต่ไม่รวมเงินฝากสถาบันการเงินประเภทที่ต้องจ่ายคืนเมื่อสิ้นระยะเวลาที่กำหนด) เงินลงทุนชั่วคราวอื่นที่มีสภาพคล่องสูงและมีวัตถุประสงค์ในการถือไว้เพื่อเป็นเงินทุนหมุนเวียนและจ่ายชำระภาระผูกพันในระยะสั้น ซึ่งมีอายุไม่เกินสามเดือนนับจากวันที่ได้มา

2.7 เงินลงทุน

กลุ่มบริษัทจัดประเภทเงินลงทุนที่นอกเหนือจากเงินลงทุนในการย่อยยและกิจการร่วม และกิจการที่ควบคุมร่วมกัน เป็น 4 ประเภท คือ 1. เงินลงทุนเพื่อค้า 2. เงินลงทุนที่ถือไว้จนครบกำหนด 3. เงินลงทุนเพื่อขาย และ 4. เงินลงทุนทั่วไป การจัดประเภทขึ้นอยู่กับจุดมุ่งหมายของลงทุน ฝ่ายบริหารจะเป็นผู้กำหนดการจัดประเภทที่เหมาะสมสำหรับเงินลงทุน ณ เวลาลงทุนและทบทวนการจัดประเภทเป็นระยะ

- (1) เงินลงทุนเพื่อค้า คือ เงินลงทุนเพื่อจุดมุ่งหมายหลักในการหากำไรจากการเปลี่ยนแปลงราคาในช่วงเวลาสั้นไม่เกิน 3 เดือน นับแต่เวลาที่ลงทุน และแสดงรวมไว้ในสินทรัพย์หมุนเวียน
- (2) เงินลงทุนที่ถือไว้จนครบกำหนด คือ เงินลงทุนที่มีกำหนดเวลาและผู้บริหารตั้งใจแน่วแน่และมีความสามารถถือไว้จนครบกำหนดได้แสดงรวมไว้ในสินทรัพย์ไม่หมุนเวียน เว้นแต่จะครบกำหนดภายใน 12 เดือนนับแต่วันสิ้นรอบระยะเวลารายงานก็จะแสดงไว้ในสินทรัพย์หมุนเวียน

- (3) เงินลงทุนเผื่อขาย คือ เงินลงทุนที่จะถือไว้โดยไม่ระบุช่วงเวลาและอาจขายเพื่อเสริมสภาพคล่องหรือเมื่ออัตราดอกเบี้ยเปลี่ยนแปลง ได้แสดงรวมไว้ในสินทรัพย์ไม่หมุนเวียน เว้นแต่กรณีที่ฝ่ายบริหารแสดงเจตจำนงที่จะถือไว้ในช่วงเวลาน้อยกว่า 12 เดือนนับแต่วันสิ้นรอบระยะเวลารายงาน ก็จะแสดงรวมไว้ในสินทรัพย์หมุนเวียน หรือเว้นแต่กรณีที่ฝ่ายบริหารมีความจำเป็นต้องขายเพื่อเพิ่มเงินทุนดำเนินงาน จึงจะแสดงรวมไว้ในสินทรัพย์หมุนเวียน

- (4) เงินลงทุนทั่วไป คือ เงินลงทุนในตราสารทุนที่ไม่มีตลาดซื้อขายคล่องรองรับ

เงินลงทุนทั้ง 4 ประเภทรับรู้มูลค่าเริ่มแรกด้วยราคาทุน ซึ่งหมายถึงมูลค่ายุติธรรมของสิ่งตอบแทนที่ให้ไปเพื่อให้ได้มาซึ่งเงินลงทุนนั้นรวมทั้งค่าใช้จ่ายในการทำรายการ

เงินลงทุนเพื่อค้าและเงินลงทุนเผื่อขายวัดมูลค่าในเวลาต่อมาด้วยมูลค่ายุติธรรม มูลค่ายุติธรรมของเงินลงทุนวัดตามราคาเสนอซื้อที่อ้างอิงจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ณ วันทำการสุดท้ายของวันสิ้นรอบระยะเวลารายงาน โดยอ้างอิงราคาเสนอซื้อล่าสุดจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและศูนย์ซื้อขายตราสารหนี้ไทย รายการกำไรและขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้นจริงของเงินลงทุนเพื่อค้ารับรู้ในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ รายการกำไรและขาดทุนที่ยังไม่เกิดขึ้นจริงของเงินลงทุนเผื่อขายรับรู้ในส่วนของเงินกองทุน

เงินลงทุนที่จะถือไว้จนครบกำหนดวัดมูลค่าภายหลังการได้มาด้วยวิธีราคาทุนตัดจำหน่ายตามอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริง หักด้วยค่าเผื่อการด้อยค่า

เงินลงทุนทั่วไป แสดงด้วยราคาทุนหักค่าเผื่อด้อยค่า

บริษัทจะทดสอบค่าเผื่อการด้อยค่าของเงินลงทุนเมื่อมีข้อบ่งชี้ว่าเงินลงทุนนั้นอาจมีการด้อยค่าของมูลค่าเกิดขึ้น หากราคาตามบัญชีของเงินลงทุนสูงกว่ามูลค่าที่คาดว่าจะได้รับคืน กลุ่มกิจการจะบันทึกรายการขาดทุนจากค่าเผื่อการด้อยค่ารวมไว้ในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ

ในการจำหน่ายเงินลงทุน ผลต่างระหว่างมูลค่ายุติธรรมของผลตอบแทนสุทธิที่ได้รับจากการจำหน่ายเมื่อเปรียบเทียบกับราคาตามบัญชีของเงินลงทุนนั้นจะบันทึกรวมอยู่ในกำไรหรือขาดทุน กรณีที่จำหน่ายเงินลงทุนที่ถือไว้ในตราสารหนี้หรือตราสารทุนชนิดเดียวกันออกไปบางส่วน ราคาตามบัญชีของเงินลงทุนที่จำหน่ายจะกำหนดโดยใช้วิธีถ่วงเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักด้วยราคาตามบัญชีจากจำนวนทั้งหมดที่ถือไว้

2.8 ลูกหนี้และรายได้ค้างรับ

ลูกหนี้และรายได้ค้างรับแสดงในราคาตามใบแจ้งหนี้หักด้วยค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญ

ค่าเผื่อหนี้สงสัยจะสูญประเมินโดยการวิเคราะห์ประวัติการชำระหนี้ และการคาดการณ์เกี่ยวกับการชำระหนี้ในอนาคตของลูกหนี้ ประเมินกระแสเงินสดไหลเข้าในอนาคต สถานการณ์ที่อาจทำให้ทราบและระบุได้ถึงการผลิตชำระหนี้ และการพิจารณาแนวโน้มของตลาด ลูกหนี้และรายได้ค้างรับจะถูกจำหน่ายออกจากบัญชีเมื่อทราบว่าเป็นหนี้สูญ และจะบันทึกไว้เป็นส่วนหนึ่งของค่าใช้จ่ายอื่นในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ

2.9 ที่ดิน อาคารและอุปกรณ์

ที่ดินแสดงด้วยราคาทุนหักขาดทุนจากการด้อยค่า อาคารและอุปกรณ์แสดงด้วยราคาทุนหักค่าเสื่อมราคาสะสมและขาดทุนจากการด้อยค่า

ค่าเสื่อมราคابันทิกเป็นค่าใช้จ่ายในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ คำนวณโดยวิธีเส้นตรงตลอดอายุการให้ประโยชน์ที่ประมาณการไว้ของสินทรัพย์แต่ละรายการ ยกเว้นที่ดินซึ่งถือว่าประมาณการอายุการให้ประโยชน์มีไม่จำกัด ดังต่อไปนี้

ส่วนปรับปรุงที่ดิน	5 ปี
อาคาร	10 - 30 ปี
ส่วนปรับปรุงอาคาร	3 - 30 ปี
เครื่องตกแต่งและติดตั้ง	5 - 20 ปี
อุปกรณ์สำนักงาน	5 - 10 ปี
ยานพาหนะ	5 - 7 ปี

ผู้บริหารเป็นผู้ประมาณการอายุการให้ประโยชน์และมูลค่าซากของอาคารและอุปกรณ์ของกลุ่มกิจการ โดยผู้บริหารจะมีการทบทวนมูลค่าซากและอายุการให้ประโยชน์ของสินทรัพย์ และแก้ไขตามความเหมาะสม ณ วันสิ้นงวด หากมูลค่าซากและอายุการให้ประโยชน์ของสินทรัพย์มีความแตกต่างไปจากการประมาณการในงวดก่อน หรือมีการตัดจำหน่ายสินทรัพย์ที่เสื่อมสภาพหรือไม่ได้ใช้งานโดยการขายหรือเลิกใช้

ในกรณีที่ราคาตามบัญชีสูงกว่ามูลค่าที่คาดว่าจะได้รับคืน ราคาตามบัญชีจะถูกปรับลดให้เท่ากับมูลค่าที่คาดว่าจะได้รับคืนทันที

การซ่อมแซมและบำรุงรักษาจะบันทึกในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จในระหว่างงวดบัญชีที่เกิดรายการนั้น ต้นทุนของการปรับปรุงให้ดีขึ้นที่สำคัญจะบันทึกรวมไว้ในราคาตามบัญชีของสินทรัพย์ หากมีความเป็นไปได้ค่อนข้างแน่ว่า การปรับปรุงนั้นจะทำให้กลุ่มกิจการได้ประโยชน์กลับคืนมามากกว่าการใช้ประโยชน์โดยไม่มีการปรับปรุงสินทรัพย์ที่ได้มา การปรับปรุงหลักจะตัดค่าเสื่อมราคาตลอดอายุการให้ประโยชน์ที่เหลืออยู่ของสินทรัพย์ที่เกี่ยวข้อง

รายการกำไรและขาดทุนจากการจำหน่ายคำนวณโดยเปรียบเทียบจากสิ่งตอบแทนที่ได้รับกับราคาตามบัญชีและจะรวมไว้อยู่ในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ

2.10 สินทรัพย์ไม่มีตัวตน

สินทรัพย์ไม่มีตัวตนที่กลุ่มกิจการซื้อและมียอายุการใช้งานจำกัด ได้แก่ โปรแกรมคอมพิวเตอร์ แสดงในราคาทุนหักค่าตัดจำหน่ายสะสมและขาดทุนจากการด้อยค่า สินทรัพย์ไม่มีตัวตนถูกตัดจำหน่ายและบันทึกในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จโดยวิธีเส้นตรงตามเกณฑ์ระยะเวลาที่คาดว่าจะได้รับประโยชน์เชิงเศรษฐกิจนับจากวันที่อยู่ในสภาพพร้อมใช้งาน ระยะเวลาที่คาดว่าจะได้รับประโยชน์เชิงเศรษฐกิจภายใน 5 - 10 ปี

ต้นทุนที่ใช้ในการพัฒนาและบำรุงรักษาโปรแกรมคอมพิวเตอร์ จะบันทึกเป็นค่าใช้จ่ายในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จเมื่อเกิดขึ้น ต้นทุนโดยตรงในการพัฒนาโปรแกรมคอมพิวเตอร์ ซึ่งสามารถระบุได้และเป็นโปรแกรมคอมพิวเตอร์ที่อยู่ภายใต้การควบคุมของกิจการ และคาดว่าจะได้รับประโยชน์เชิงเศรษฐกิจในอนาคตมากกว่า 1 ปี จะบันทึกเป็นสินทรัพย์ไม่มีตัวตน ต้นทุนโดยตรงรวมถึงราคาซื้อ และรายจ่ายอื่นที่เกี่ยวข้องโดยตรงกับการจัดเตรียมสินทรัพย์ให้พร้อมที่จะใช้ประโยชน์ได้ตามวัตถุประสงค์ ค่าใช้จ่ายซึ่งทำให้เพิ่มหรือขยายประสิทธิภาพของโปรแกรมคอมพิวเตอร์เกินกว่าขีดความสามารถเดิมจะบันทึกเป็นสินทรัพย์ไม่มีตัวตน

ผู้บริหารเป็นผู้ประมาณการอายุการให้ประโยชน์ของสินทรัพย์ไม่มีตัวตนของกลุ่มกิจการ โดยผู้บริหารจะมีการทบทวนค่าตัดจำหน่ายเมื่ออายุการให้ประโยชน์มีความแตกต่างไปจากการประมาณการในงวดก่อน หรือมีการตัดจำหน่ายสินทรัพย์ที่เสื่อมสภาพหรือไม่ได้ใช้งานโดยการขายหรือเลิกใช้

2.11 การด้อยค่า

สินทรัพย์ที่มีอายุการให้ประโยชน์ไม่ทราบแน่ชัด (เช่น ค่าความนิยม) ซึ่งไม่มีการตัดจำหน่ายจะถูกทดสอบการด้อยค่าเป็นประจำทุกปี สินทรัพย์อื่นที่มีการตัดจำหน่ายจะมีการทบทวนการด้อยค่า เมื่อมีเหตุการณ์หรือสถานการณ์บ่งชี้ว่าราคาตามบัญชีอาจสูงกว่ามูลค่าที่คาดว่าจะได้รับคืน รายการขาดทุนจากการด้อยค่าจะรับรู้เมื่อราคาตามบัญชีของสินทรัพย์สูงกว่ามูลค่าสุทธิที่คาดว่าจะได้รับคืน ซึ่งหมายถึงจำนวนที่สูงกว่าระหว่างมูลค่าดีดหักต้นทุนในการขายเทียบกับมูลค่าจากการใช้ สินทรัพย์จะถูกจัดเป็นหน่วยที่เล็กที่สุดที่สามารถแยกออกมาได้ เพื่อวัตถุประสงค์ของการประเมินการด้อยค่า สินทรัพย์ที่ไม่ใช้สินทรัพย์ทางการเงินนอกเหนือจากค่าความนิยมซึ่งรับรู้รายการขาดทุนจากการด้อยค่าไปแล้ว จะถูกประเมินความเป็นไปได้ที่จะกลับรายการขาดทุนจากการด้อยค่า ณ วันสิ้นรอบระยะเวลารายงาน

2.12 หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ย

หนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยบันทึกเริ่มแรกในมูลค่ายุติธรรมหักค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการเกิดหนี้สิน ภายหลังจากการบันทึกหนี้สินที่มีภาระดอกเบี้ยจะบันทึกต่อมาโดยวิธีราคาทุนตัดจำหน่าย ผลต่างระหว่างยอดหนี้เริ่มแรกและยอดหนี้เมื่อครบกำหนดไถ่ถอนจะบันทึกในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จตลอดอายุการกู้ยืมโดยใช้วิธีอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริง

2.13 เจ้าหนี้การค้าและเจ้าหนี้อื่น

เจ้าหนี้การค้าและเจ้าหนี้อื่นแสดงในราคาทุน

2.14 ผลประโยชน์พนักงาน

โครงการสมทบเงิน

กลุ่มกิจการได้จัดตั้งกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ โดยใช้แผนการกำหนดอัตราการจ่ายสมทบ โดยที่สินทรัพย์ของกองทุนได้แยกออกจากสินทรัพย์ของตลาดหลักทรัพย์ฯ และบริหารโดยผู้จัดการกองทุน กองทุนสำรองเลี้ยงชีพดังกล่าวได้รับเงินสมทบเข้ากองทุนจากพนักงานและกลุ่มกิจการ เงินจ่ายสมทบเข้ากองทุนสำรองเลี้ยงชีพบันทึกเป็นค่าใช้จ่ายในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จสำหรับรอบระยะเวลาบัญชีที่เกิดรายการนั้น

โครงการผลประโยชน์

กลุ่มกิจการจัดให้มีผลประโยชน์พนักงานเมื่อเกษียณอายุเพื่อจ่ายให้แก่พนักงานตามกฎหมายแรงงานของประเทศไทย ทั้งนี้ ผลประโยชน์พนักงานคำนวณโดยผู้ชำนาญทางสถิติอิสระโดยใช้วิธี Corridor Approach ตามเกณฑ์คณิตศาสตร์ประกันภัย (Actuarial Technique) อันเป็นการประมาณการจากมูลค่าปัจจุบันของกระแสเงินสดที่คาดว่าจะต้องจ่ายในอนาคตและคำนวณคิดลดโดยใช้อัตราดอกเบี้ยของพันธบัตรรัฐบาล ที่มีกำหนดเวลาใกล้เคียงกับระยะเวลาของหนี้สินดังกล่าว โดยประมาณการกระแสเงินสดที่คาดว่าจะต้องจ่ายในอนาคตนั้นประมาณการจากเงินเดือนพนักงาน อัตราการลาออก อัตราการตาย อายุงานและปัจจัยอื่น ถ้าไรหรือขาดทุนจากการเปลี่ยนแปลงประมาณการจะรับรู้เป็นรายได้หรือค่าใช้จ่ายในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จหากมูลค่าสะสมสุทธิของกำไรและขาดทุนจากการประมาณการตามหลักคณิตศาสตร์ประกันภัยที่ยังไม่ได้รับรู้เมื่อวันสิ้นสุดของงวดก่อนเกินกว่าจำนวนที่มากกว่าระหว่างร้อยละ 10 ของมูลค่าปัจจุบันของภาระผูกพันตามโครงการผลประโยชน์ ณ วันนั้น (ก่อนหักสินทรัพย์โครงการ) และร้อยละ 10 ของมูลค่ายุติธรรมของสินทรัพย์โครงการ ณ วันนั้น

ในทุกปีกลุ่มกิจการจะมีการทบทวนอัตราคิดลดที่เหมาะสมซึ่งสะท้อนถึงอัตราดอกเบี้ยที่ควรนำมาใช้ในการคำนวณมูลค่าปัจจุบันสุทธิของกระแสเงินสดจ่ายในอนาคตที่คาดว่าจะต้องจ่ายให้กับพนักงาน

คำตอบแทนการเลิกจ้างก่อนกำหนด

คำตอบแทนการเลิกจ้างก่อนกำหนดคือ หนี้สินที่ต้องจ่ายเมื่อมีการสิ้นสุดการจ้างงานโดยกลุ่มกิจการก่อนวันเกษียณอายุปกติ หรือเมื่อมีการเสนอให้มีการเลิกจ้างงานโดยให้พนักงานออกจากงานอย่างเต็มใจเพื่อแลกกับผลประโยชน์ กลุ่มกิจการจะรับรู้คำตอบแทนการเลิกจ้างก่อนกำหนด เมื่อมีการผูกพันที่จะต้องสิ้นสุดการจ้างงานของพนักงานในปัจจุบันตามแผนที่วางไว้ หรือมีการเสนอให้มีการเลิกจ้างงานโดยให้พนักงานออกจากงานอย่างเต็มใจ

2.15 ประมาณการหนี้สิน

การประมาณการหนี้สินจะรับรู้ก็ต่อเมื่อกลุ่มกิจการมีภาระหนี้สินตามกฎหมายที่เกิดขึ้นในปัจจุบันหรือที่ก่อตัวขึ้นอันเป็นผลมาจากเหตุการณ์ในอดีต และมีความเป็นไปได้ค่อนข้างแน่นอนว่าประโยชน์เชิงเศรษฐกิจจะต้องถูกจ่ายไปเพื่อชำระภาระหนี้สินดังกล่าว และสามารถประมาณจำนวนภาระหนี้สินได้อย่างน่าเชื่อถือ ถ้าผลกระทบดังกล่าวมีจำนวนที่เป็นสาระสำคัญ ประมาณการหนี้สินพิจารณาจากการคิดลดกระแสเงินสดที่จะจ่ายในอนาคตโดยใช้อัตราคิดลดในตลาดปัจจุบันก่อนภาษีเงินได้ เพื่อให้สะท้อนจำนวนที่อาจประเมินได้ในตลาดปัจจุบันซึ่งแปรไปตามเวลาและความเสี่ยงที่มีต่อหนี้สิน เมื่อได้จ่ายชำระประมาณการหนี้สินไปแล้ว หากแน่ใจว่าจะได้รับคืนอย่างแน่นอนให้บันทึกการจ่ายที่จะได้รับคืนเป็นสินทรัพย์แยกต่างหาก

ประมาณการหนี้สินรับรู้ในรอบระยะเวลาบัญชีที่กลุ่มกิจการตกลงที่จะจ่ายชำระตามกฎหมายหรือจากการอนุমান อย่างไรก็ตาม ต้นทุนที่เกี่ยวข้องกับกิจกรรมที่มีอยู่อย่างต่อเนื่องไม่ถือเป็นประมาณการหนี้สิน

2.16 สัญญาเช่าระยะยาว - กรณีที่กลุ่มกิจการเป็นผู้เช่า

สัญญาเช่าสินทรัพย์โดยที่ความเสี่ยงและผลตอบแทนของความเป็นเจ้าของส่วนใหญ่ตกอยู่กับผู้ให้เช่าจะจัดเป็นสัญญาเช่าดำเนินงาน รายจ่ายภายใต้สัญญาเช่าดำเนินงานบันทึกในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จโดยวิธีเส้นตรงตลอดอายุสัญญาเช่า ประโยชน์ที่ได้รับตามสัญญาเช่าจะรับรู้ในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จเป็นส่วนหนึ่งของค่าเช่าทั้งสิ้นตามสัญญา ค่าเช่าที่อาจเกิดขึ้นบันทึกในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จในรอบบัญชีที่มีรายการดังกล่าว

ค่าใช้จ่ายที่เกิดขึ้นจากการยกเลิกสัญญาเช่าดำเนินงานก่อนหมดอายุการเช่า เช่น เบี้ยปรับที่ต้องจ่ายให้แก่ผู้ให้เช่าจะบันทึกเป็นค่าใช้จ่ายในรอบระยะเวลาบัญชีที่การยกเลิกนั้นเกิดขึ้น

2.17 รายได้

รายได้ที่รับรู้ไม่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม

รายได้จากการให้บริการรับรู้เมื่อได้ให้บริการแก่ลูกค้าแล้ว

ในกรณีที่มิใช่ธุรกิจจดทะเบียนค้างชำระค่าธรรมเนียมหลักทรัพย์จดทะเบียนและค่าธรรมเนียมนายทะเบียนหลักทรัพย์เป็นระยะเวลาเกิน 3 เดือน กลุ่มกิจการจะถือว่ามีความไม่แน่นอนในการเรียกเก็บเงิน และจะหยุดรับรู้รายได้ค่าธรรมเนียมจากบริษัทจดทะเบียนที่เกี่ยวข้องนั้นทันที

ค่าธรรมเนียมสมาชิกประกอบด้วย ค่าเข้าเป็นสมาชิกและค่าธรรมเนียมรายปี โดยค่าเข้าเป็นสมาชิกจะทยอยรับรู้รายได้โดยวิธีเส้นตรงเป็นระยะเวลา 5 ปี นับจากวันที่เริ่มให้บริการ ส่วนค่าธรรมเนียมรายปีรับรู้รายได้เมื่อได้ให้บริการแล้ว

รายได้ดอกเบี้ยรับรู้ตามเกณฑ์สัดส่วนของเวลา โดยคำนึงถึงอัตราดอกเบี้ยที่แท้จริงของช่วงเวลาจนถึงวันครบอายุและคำนึงถึงจำนวนเงินต้นที่เป็นยอดคงเหลือในบัญชีสำหรับการบันทึกค้างรับของกลุ่มกิจการ

เงินปันผลรับบันทึกในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จในวันที่กลุ่มกิจการมีสิทธิได้รับเงินปันผล

รายได้อื่นรับรู้เมื่อมีสิทธิในการรับเงิน

2.18 ค่าตอบแทนกรรมการ

ค่าตอบแทนกรรมการประกอบด้วย ผลประโยชน์ที่จ่ายให้แก่คณะกรรมการของตลาดหลักทรัพย์ฯ และของกิจการย่อย รวมทั้งที่ได้รับในฐานะอนุกรรมการในคณะอนุกรรมการชุดอื่นๆ (โดยไม่รวมเงินเดือน โบนัส และผลประโยชน์เกี่ยวข้องที่จ่ายให้กับผู้บริหาร)

2.19 ภาษีเงินได้

กิจการย่อยในกลุ่มกิจการคำนวณภาษีเงินได้ตามเกณฑ์ที่กำหนดไว้ในประมวลรัษฎากรและบันทึกภาษีเงินได้ตามเกณฑ์คงค้าง กิจการย่อยในกลุ่มกิจการมิได้บันทึกภาษีเงินได้รอตัดบัญชีสำหรับผลต่างทางบัญชีกับทางภาษีที่เป็นผลต่างชั่วคราวในอนาคต

3. การจัดการความเสี่ยงทางการเงิน

ปัจจัยความเสี่ยงทางการเงิน

กิจกรรมของกลุ่มกิจการย่อมมีความเสี่ยงทางการเงินที่หลากหลายซึ่งได้แก่ ความเสี่ยงจากตลาด (รวมถึงความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน ความเสี่ยงด้านมูลค่ายุติธรรมอันเกิดจากการเปลี่ยนแปลงในอัตราดอกเบี้ย และด้านกระแสเงินสดอันเกิดจากการเปลี่ยนแปลงในอัตราดอกเบี้ย) ความเสี่ยงด้านการให้สินเชื่อ ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง และความเสี่ยงจากการลงทุนและการฝากเงิน แผนการจัดการความเสี่ยงของกลุ่มกิจการ เน้นการลงทุนตามนโยบายและสัดส่วนการบริหารเงินลงทุน ซึ่งได้รับอนุมัติจากคณะกรรมการของตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยมีคณะทำงานบริหารเงินลงทุนควบคุมดูแลการลงทุนให้สอดคล้องกับนโยบายและสัดส่วนที่กำหนดอย่างเคร่งครัด ทั้งนี้ นโยบายการลงทุนคำนึงถึงความมั่นคงในการดำรงเงินต้น โดยได้รับผลตอบแทนที่เหมาะสม

3.1 ความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

กลุ่มกิจการไม่มีความเสี่ยงอย่างเป็นสาระสำคัญจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ เนื่องจากกลุ่มกิจการมีลูกหนี้และเจ้าหนี้ส่วนใหญ่เป็นสกุลเงินบาท กลุ่มกิจการไม่ได้ใช้สัญญาอัตราแลกเปลี่ยนล่วงหน้าเพื่อป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยนเงินตราต่างประเทศ

3.2 ความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ย

ความเสี่ยงจากอัตราดอกเบี้ยเกิดขึ้นจากความผันผวนของอัตราดอกเบี้ยในตลาด ซึ่งอาจจะส่งผลกระทบต่อผลการดำเนินงานและกระแสเงินสดของกลุ่มกิจการ กลุ่มกิจการไม่มีความเสี่ยงอย่างเป็นสาระสำคัญจากอัตราดอกเบี้ย เนื่องจากอัตราดอกเบี้ยเงินให้กู้ยืมส่วนใหญ่มีอัตราคงที่ ทั้งนี้ ในการกำหนดอัตราดอกเบี้ยมีการพิจารณาอัตราดอกเบี้ยในท้องตลาดขณะนั้น รวมทั้งแนวโน้มอัตราดอกเบี้ยในปีถัดไปด้วย กลุ่มกิจการไม่ได้ใช้อนุพันธ์ด้านอัตราดอกเบี้ย เพื่อบริหารความเสี่ยงที่เกิดจากความผันผวนของอัตราดอกเบี้ยดังกล่าว

3.3 ความเสี่ยงด้านการให้สินเชื่อ

ความเสี่ยงด้านการให้สินเชื่อของกลุ่มกิจการมีการกระจุกตัวอย่างเฉพาะเจาะจง กลุ่มกิจการมีนโยบายที่เหมาะสมเพื่อให้เชื่อมั่นได้ว่าได้ขายสินเชื่อและให้บริการแก่ลูกค้าที่มีประวัติสินเชื่ออยู่ในระดับที่เหมาะสม

3.4 ความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง

กลุ่มกิจการไม่มีความเสี่ยงอย่างเป็นสาระสำคัญจากสภาพคล่อง เนื่องจากกลุ่มกิจการมีการดำรงเงินสดอย่างเพียงพอต่อการดำเนินงาน กลุ่มกิจการมีวัตถุประสงค์ในการดำรงความยืดหยุ่นด้านสภาพคล่องจากการใช้แหล่งเงินทุนภายในกลุ่มกิจการ

3.5 ความเสี่ยงจากการลงทุนและการฝากเงิน

กลุ่มกิจการมีความเสี่ยงต่อราคาตลาด (Market risks) ในฐานะที่เป็นผู้ลงทุนในตราสารทางการเงิน และความเสี่ยงจากฐานะการเงินของผู้ที่ออกตราสารที่ลงทุน อย่างไรก็ตาม กลุ่มกิจการได้มีการกระจายเงินลงทุนและเงินฝากไว้ในสถาบันการเงินที่น่าเชื่อถือตามนโยบายการลงทุนตามมติของคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ

นโยบายและกรอบการลงทุนเกี่ยวกับประเภทและสัดส่วนการลงทุน มีดังนี้

1) การลงทุนในตราสารหนี้

ประเภทการลงทุน	สัดส่วนการลงทุนต่อเงินลงทุนรวม
หลักทรัพย์รัฐบาล หุ้นกู้ หรือพันธบัตรของรัฐวิสาหกิจ หรือนิติบุคคลที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้นที่กระทรวงการคลังกำกับ	ไม่จำกัดจำนวน
เงินฝากประจำ บัตรเงินฝากของธนาคารพาณิชย์ ตั๋วสัญญาใช้เงินของบริษัทเงินทุน หรือสถาบันการเงินที่มีกฎหมายเฉพาะจัดตั้งขึ้น	ไม่เกินร้อยละ 15 ต่อสถาบันการเงิน
หุ้นกู้ หรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้นกู้และตัวแลกเงิน	ไม่เกินร้อยละ 5 ต่อผู้ออกหลักทรัพย์
หน่วยลงทุน หรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารหนี้	ไม่เกินร้อยละ 10 ต่อกองทุนรวม

2) การลงทุนในตราสารทุน

ประเภทการลงทุน	สัดส่วนการลงทุนต่อเงินลงทุนรวม
หน่วยลงทุน หรือใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารทุน	ไม่เกินร้อยละ 10 ต่อกองทุนรวม

3) การลงทุนในกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์

ประเภทการลงทุน	สัดส่วนการลงทุนต่อเงินลงทุนรวม
กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์	ไม่เกินร้อยละ 10 ของมูลค่าโครงการ โดยกำหนดวงเงินไม่เกินร้อยละ 2 ของเงินลงทุนรวม

4) การลงทุนในกองทุนต่างประเทศ

ประเภทการลงทุน	สัดส่วนการลงทุนต่อเงินลงทุนรวม
กองทุนต่างประเทศ	ไม่เกินร้อยละ 3 ของเงินลงทุนรวม

ทั้งนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ สามารถลงทุนผ่านบริษัทจัดการหนึ่งๆ ได้ไม่เกินร้อยละ 40 ของจำนวนเงินลงทุนรวมทั้งหมด

4. ประเมินการทางบัญชีที่สำคัญ ข้อสมมติฐานและการใช้ดุลยพินิจ

การประมาณการ ข้อสมมติฐานและการใช้ดุลยพินิจได้มีการประเมินทบทวนอย่างต่อเนื่อง และอยู่บนพื้นฐานของประสบการณ์ในอดีตและปัจจัยอื่นๆ ซึ่งรวมถึงการคาดการณ์ถึงเหตุการณ์ในอนาคตที่เชื่อว่ามีเหตุผลในสถานการณ์ขณะนั้น

5. การจัดการความเสี่ยงในส่วนของคุณ

วัตถุประสงค์ของกลุ่มกิจการในการบริหารทุนนั้น เพื่อดำรงไว้ซึ่งความสามารถในการดำเนินงานอย่างต่อเนื่องของกิจการย่อยในกลุ่มกิจการ เพื่อสร้างผลตอบแทนต่อผู้ถือหุ้นและเป็นประโยชน์ต่อผู้ที่มีส่วนได้เสียอื่น และเพื่อดำรงไว้ซึ่งโครงสร้างของทุนที่เหมาะสม เพื่อสร้างความเชื่อมั่นให้แก่ผู้ลงทุนและผู้มีส่วนได้เสีย

ในการดำรงไว้หรือปรับโครงสร้างของทุน บริษัทในกลุ่มกิจการอาจปรับนโยบายการจ่ายเงินปันผลให้กับผู้ถือหุ้นตามผลการดำเนินงานของกิจการย่อยในกลุ่มกิจการ

6. รายการกับบุคคลหรือกับกิจการที่เกี่ยวข้องกัน

บุคคลหรือกิจการที่เกี่ยวข้องกัน ได้แก่ บุคคลหรือกิจการต่างๆ ที่มีความเกี่ยวข้องกับกลุ่มกิจการ โดยการเป็นผู้ถือหุ้นหรือมีผู้ถือหุ้นร่วมกัน หรือมีกรรมกรร่วมกัน รายการที่มีขึ้นกับบุคคลหรือกิจการที่เกี่ยวข้องกันได้กำหนดขึ้นโดยใช้ราคาตลาดหรือในราคาที่ตกลงกันตามสัญญา หากไม่มีราคาตลาดรองรับ

นโยบายการกำหนดราคาสำหรับรายการแต่ละประเภทอธิบายได้ดังต่อไปนี้

รายการ	นโยบายการกำหนดราคา
รายได้จากการให้บริการ	ราคาตามที่ตกลงกัน
การซื้อบริการ	ต้นทุนบวกกำไรส่วนเพิ่ม
ดอกเบี้ยจ่าย	อ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ยเงินฝากสถาบันการเงิน

รายการกับบุคคลหรือกิจการที่เกี่ยวข้องกันสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 สรุปได้ดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
รายได้ค่าบริการ				
กิจการย่อย	-	-	1,376,203	1,380,562
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	13,560	13,305	13,542	13,285
กิจการร่วม	1,128	949	-	-
	14,688	14,254	1,389,745	1,393,847
การซื้อบริการ				
กิจการย่อย	-	-	1,881	1,886
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	168,952	168,232	168,952	168,232
	168,952	168,232	170,833	170,118
รายได้ดอกเบี้ยรับ				
กิจการย่อย	-	-	4,491	3,076
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	-	711	-	711
	-	711	4,491	3,787
ดอกเบี้ยจ่าย				
กิจการย่อย	-	-	17,591	11,177

ยอดคงเหลือกับบุคคลหรือกิจการที่เกี่ยวข้องกัน ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 มีดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
ลูกหนี้				
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	352	596	352	596
รายได้ค้างรับ				
กิจการย่อย	-	-	163,563	343,481
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	427	411	427	411
กิจการร่วม	101	-	-	-
	528	411	163,990	343,892
สินทรัพย์หมุนเวียนอื่น				
กิจการย่อย	-	-	133	-
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	96	17	5,969	4,459
	96	17	6,102	4,459
เจ้าหนี้และค่าใช้จ่ายค้างจ่าย				
เจ้าหนี้				
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	275	258	275	258
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย				
กิจการย่อย	-	-	163	158
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	14,764	13,867	14,764	13,867
	14,764	13,867	14,927	14,025
	15,039	14,125	15,202	14,283
หนี้สินหมุนเวียนอื่น				
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	23	39	23	39

เงินกู้ยืมระยะสั้นจากกิจการย่อย

(หน่วย : พันบาท)

	อัตราดอกเบี้ย (ร้อยละต่อปี)		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
เงินกู้ยืมระยะสั้นจากกิจการย่อย	2.50	2.00	1,035,400	559,400

กลุ่มกิจการใช้นโยบายรวมศูนย์การลงทุน โดยให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นศูนย์กลางการบริหารเงินลงทุนเพื่อเพิ่มประสิทธิภาพและผลตอบแทนการลงทุนโดยรวม ทั้งนี้เงินลงทุนที่รับโอนมาจากกิจการย่อยจะเป็นการกู้ยืมระหว่างกันในรูปแบบของตัวสัญญาใช้เงินอายุไม่เกิน 1 ปี และมีอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ยเงินฝากสถาบันการเงิน (อัตราดอกเบี้ยดังกล่าวอาจมีการทบทวนใหม่ตามความเหมาะสม)

รายการเคลื่อนไหวของเงินกู้ยืมระยะสั้นจากกิจการย่อยสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 มีดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กิจการย่อย		
ยอดคงเหลือต้นปี	559,400	530,400
เพิ่มขึ้น	561,000	29,000
ลดลง	(85,000)	-
ยอดคงเหลือปลายปี	1,035,400	559,400

เงินสนับสนุนให้แก่กิจการที่ควบคุมร่วมกัน

ภายใต้สัญญาผู้ถือหุ้นระหว่างตลาดหลักทรัพย์ฯ กับบริษัทแห่งหนึ่ง ตลาดหลักทรัพย์ฯ จะเป็นผู้สนับสนุนหลักรายการทางธุรกิจให้กับกิจการที่ควบคุมร่วมกันแห่งหนึ่ง โดยจำกััดวงเงินในการสนับสนุนไว้ไม่เกิน 214 ล้านบาทต่อปี โดยเริ่มตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2553 เป็นต้นไป เป็นเวลา 3 ปี ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ขายทรัพย์สินสตูดิโอทั้งหมดของตนเองให้แก่กิจการที่ควบคุมร่วมกันดังกล่าว ในราคาเท่ากับมูลค่าสินทรัพย์สุทธิทางบัญชี (Book Value) ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2552 พร้อมทั้งให้เงินกู้แบบผ่อนปรน (Soft Loan) เพื่อชำระค่าทรัพย์สินดังกล่าวเป็นระยะเวลา 2 ปี โดยมีระยะเวลาปลอดการชำระคืนเงินต้น 1 ปี เงินกู้ดังกล่าวคิดอัตราดอกเบี้ยในอัตราเท่ากับดอกเบี้ยเฉลี่ยของเงินฝากประจำ 1 ปี ของ 4 ธนาคารใหญ่ บวกด้วยอัตราร้อยละ 2 โดยเงินต้นใน สัดส่วนร้อยละ 25 และร้อยละ 75 จะครบกำหนดการชำระคืนเมื่อครบปีที่หนึ่งและปีที่สอง นับจากวันที่กิจการที่ควบคุมร่วมกันรับโอนทรัพย์สินสตูดิโอจากตลาดหลักทรัพย์ฯ ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้รับคืนเงินให้กู้ทั้งหมดแล้ว

เงินบริจาคแก่มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ในปี พ.ศ. 2549 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้อนุมัติการจัดตั้งมูลนิธิตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย “มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์” และให้คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำรงตำแหน่งเป็นกรรมการของมูลนิธิตลาดหลักทรัพย์โดยตำแหน่ง พร้อมทั้งอนุมัติจัดสรรเงิน 1 ใน 3 ของรายได้ที่สูงกว่าค่าใช้จ่ายของตลาดหลักทรัพย์ฯ เข้ามูลนิธิตลาดหลักทรัพย์เป็นประจำปีเพื่อใช้ในการดำเนินกิจกรรมเพื่อสังคม

มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์จดทะเบียนจัดตั้งเมื่อวันที่ 9 สิงหาคม พ.ศ. 2549 โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อดำเนินกิจกรรมเพื่อพัฒนาสังคม ชุมชน และสิ่งแวดล้อม โดยมุ่งเน้นพัฒนาสังคมไทยและชุมชนให้เข้มแข็งเพื่อป้องกันและแก้ไขปัญหาอาชญากรรมและอบายมุขให้ห่างไกลจากเยาวชนและสังคมไทย รวมถึงให้การสนับสนุนโครงการและกิจกรรมด้านการศึกษา

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้จัดสรรรายได้ที่สูงกว่าค่าใช้จ่ายแก่มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์เป็นจำนวนเงิน 453.63 ล้านบาท (พ.ศ. 2554 : 358.94 ล้านบาท)

ผลตอบแทนกรรมการ

ผลตอบแทนกรรมการได้แก่ ค่าเบี้ยประชุมและค่าตอบแทนคณะกรรมการของกลุ่มกิจการ รวมทั้งที่ได้รับในฐานะอนุกรรมการในคณะอนุกรรมการชุดอื่นๆ

ผลตอบแทนกรรมการสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 มีจำนวนเงิน 19.61 ล้านบาท (พ.ศ. 2554 : 18.74 ล้านบาท)

7. เงินสดและรายการเทียบเท่าเงินสด

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
เงินสดในมือ	352	562	336	546
เงินฝากประเภทออมทรัพย์และกระแสรายวัน	740,983	318,931	490,294	221,435
เงินฝากประจำ	299,339	45,150	279,237	-
ตัวแลกเงิน	5,000	-	-	-
	1,045,674	364,643	769,867	221,981

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 เงินฝากประเภทออมทรัพย์ มีอัตราดอกเบี้ยระหว่างร้อยละ 0.20 - 2.40 ต่อปี (พ.ศ. 2554 : ระหว่างร้อยละ 0.125 - 1.90 ต่อปี)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 เงินฝากประจำกับธนาคาร ได้แก่ เงินฝากประจำประเภทจ่ายคืนเมื่อทวงถาม มีอัตราดอกเบี้ยร้อยละ 2.50 - 2.75 ต่อปี (พ.ศ. 2554 : ระหว่างร้อยละ 2.50 - 3.20 ต่อปี)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 ตัวแลกเงินกับสถาบันการเงิน ได้แก่ ตัวแลกเงินประเภทจ่ายคืนเมื่อทวงถาม มีอัตราดอกเบี้ยร้อยละ 2.75 ต่อปี (พ.ศ. 2554 : ไม่มี)

8. เงินลงทุนชั่วคราว - สุทธิ

(หน่วย : พันบาท)

หมายเหตุ	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
เงินลงทุนที่บริหารโดยตลาดหลักทรัพย์ฯ				
เงินลงทุนทั่วไป	40,869	48,362	40,869	48,362
หัก ค่าเผื่อการด้อยค่า	(3,602)	(22,423)	(3,602)	(22,423)
	37,267	25,939	37,267	25,939
หลักทรัพย์เพื่อค้า	23	267,924	23	267,924
ตราสารหนี้ที่ถือจนครบกำหนด	4,997,134	6,855,074	4,960,114	6,162,314
	5,034,424	7,148,937	4,997,404	6,456,177
เงินลงทุนที่บริหารโดยกองทุนส่วนบุคคล				
ตราสารหนี้ที่ถือจนครบกำหนด	803,544	1,069,150	803,544	1,031,815
หลักทรัพย์เพื่อค้า	1,437,715	1,234,591	1,437,715	1,126,176
	2,241,259	2,303,741	2,241,259	2,157,991
	7,275,683	9,452,678	7,238,663	8,614,168

รายการเคลื่อนไหวของเงินลงทุนชั่วคราวสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 มีดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
ยอดคงเหลือต้นปี	9,452,678	5,658,172	8,614,168	5,295,976
ลงทุนเพิ่ม	4,751,182	6,765,832	4,463,450	4,739,395
จำหน่ายเงินลงทุน	(4,377,279)	(4,671,474)	(3,275,047)	(4,340,541)
จัดประเภทจากเงินลงทุนระยะยาว	310,017	1,022,475	297,007	947,207
ปรับปรุง	(2,879,736)	677,673	(2,879,736)	1,972,131
หัก ค่าเผื่อการด้อยค่า	18,821	-	18,821	-
ยอดคงเหลือปลายปี	7,275,683	9,452,678	7,238,663	8,614,168

เงินลงทุนที่บริหารโดยตลาดหลักทรัพย์ฯ

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 ไม่มีเงินฝากออมทรัพย์ (พ.ศ. 2554 : อัตราดอกเบี้ยระหว่างร้อยละ 0.25 - 0.87 ต่อปี)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 เงินฝากประจำ ได้แก่ เงินฝากประจำกับธนาคารประเภทไม่เกิน 12 เดือน มีอัตราดอกเบี้ยระหว่างร้อยละ 3.00 - 4.50 ต่อปี (พ.ศ. 2554 : ระหว่างร้อยละ 1.75 - 4.50 ต่อปี)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 ไม่มีตัวแลกเงินของสถาบันการเงินที่มีระยะเวลาครบกำหนดภายใน 1 ปี (พ.ศ. 2554 : อัตราดอกเบี้ยระหว่างร้อยละ 3.00 - 4.60 ต่อปี)

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 หน่วยลงทุนในกองทุนรวมเฉพาะกิจเป็นการร่วมลงทุนในกองทุนเปิดจำนวน 1 กองทุน (หมายเหตุ 14) โดยจะเปิดให้มีการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนแบบอัตโนมัติตั้งแต่ปีที่ 6 เป็นต้นไป (ปี พ.ศ. 2554) หรือเว้นแต่จะได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการลงทุน หากจะรับซื้อคืนหน่วยลงทุนก่อนระยะเวลาที่กำหนด

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 หน่วยลงทุนในกองทุนรวมตลาดเงินเป็นการลงทุนในกองทุนเปิดประเภทรับซื้อคืนหน่วยลงทุนจำนวน 1 กองทุน (พ.ศ. 2554 : 2 กองทุนเปิด) โดยมีนโยบายการลงทุนที่เน้นการลงทุนในตราสารหนี้ระยะสั้น

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย พันธบัตรรัฐวิสาหกิจและหุ้นกู้ มีอัตราดอกเบี้ยหน้าตัวระหว่างร้อยละ 3.05 - 5.50 ต่อปี (พ.ศ. 2554 : ระหว่างร้อยละ 2.59 - 6.10 ต่อปี) และอัตราผลตอบแทนตามราคาดาลาระหว่างร้อยละ 2.78 - 3.36 ต่อปี (พ.ศ. 2554 : ระหว่างร้อยละ 3.12 - 3.49 ต่อปี)

เงินลงทุนที่บริหารโดยกองทุนส่วนบุคคล

กลุ่มกิจการมีเงินลงทุนส่วนหนึ่งในกองทุนส่วนบุคคลซึ่งบริหารโดยบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน 2 แห่ง โดยมีนโยบายการลงทุนของกองทุนส่วนบุคคลตามที่กล่าวไว้ในหมายเหตุประกอบการเงินข้อที่ 3 ทั้งนี้ กลุ่มกิจการได้แสดงเงินลงทุนประเภทต่างๆ ที่กองทุนส่วนบุคคลรวมไว้ในเงินลงทุนชั่วคราว

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 เงินลงทุนที่บริหารโดยกองทุนส่วนบุคคล มีอัตราผลตอบแทนจากการบริหารอยู่ระหว่างร้อยละ 3.88 - 3.91 ต่อปี (พ.ศ. 2554 : ระหว่างร้อยละ 2.28 - 2.96 ต่อปี)

9. ลูกหนี้และรายได้ค้างรับ - สุทธิ

(หน่วย : พันบาท)

หมายเหตุ	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
ลูกหนี้				
กิจการที่เกี่ยวข้องกัน	352	596	352	596
กิจการอื่นๆ	69,872	68,014	41,115	36,118
	70,224	68,610	41,467	36,714
หัก ค่าเผื่อนี้สงสัยจะสูญ	(19,806)	(19,232)	(9,718)	(8,652)
	50,418	49,378	31,749	28,062
รายได้ค้างรับ				
กิจการที่เกี่ยวข้องกัน	528	411	163,990	343,892
กิจการอื่นๆ	243,023	164,320	73,423	49,298
	243,551	164,731	237,413	393,190
	293,969	214,109	269,162	421,252

การวิเคราะห์อายุของลูกค้าที่มีดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

หมายเหตุ	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กิจการที่เกี่ยวข้องกับ				
ยังไม่ครบกำหนดชำระ	205	596	205	596
เกินกำหนดชำระ				
น้อยกว่า 3 เดือน	147	-	147	-
6	352	596	352	596
กิจการอื่นๆ				
ยังไม่ครบกำหนดชำระ	33,566	36,679	17,178	21,703
เกินกำหนดชำระ				
น้อยกว่า 3 เดือน	15,465	9,075	13,289	2,983
3 - 6 เดือน	1,296	2,098	1,155	1,851
6 - 12 เดือน	947	686	859	679
มากกว่า 12 เดือน	18,598	19,476	8,634	8,902
	69,872	68,014	41,115	36,118
<u>หัก</u> ค่าเผื่อนี้สงสัยจะสูญ	(19,806)	(19,232)	(9,718)	(8,652)
	50,066	48,782	31,397	27,466
	50,418	49,378	31,749	28,062

โดยปกติระยะเวลาการให้สินเชื่อแก่ลูกค้าของกลุ่มกิจการมีระยะเวลาดังตั้ง 15 วัน ถึง 30 วัน

10. สินทรัพย์หมุนเวียนอื่น

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
เงินคืนจากการจองซื้อหุ้นเพิ่มทุน	214,871	-	-	-
เงินกองทุนตลาดหุ้นร่วมใจช่วยภัยน้ำท่วม	120,015	179,906	120,015	179,906
เงินให้กู้ยืมแก่พนักงาน	44,220	45,994	44,220	45,994
เงินปันผลรอจ่ายคืนผู้ถือหุ้นรายย่อย	41,080	36,249	-	-
ค่าใช้จ่ายจ่ายล่วงหน้า	14,450	19,138	14,298	18,988
สื่อสิ่งพิมพ์คงเหลือ	3,901	3,766	3,901	3,766
เงินปันผลค้างรับ	51	-	5,925	4,442
เงินกองทุนวตท.ร่วมใจช่วยภัยน้ำท่วม	-	26,222	-	26,222
อื่นๆ	14,667	4,793	5,353	3,293
	453,255	316,068	193,712	282,611

11. เงินลงทุนในกิจการย่อย

เงินลงทุนในกิจการย่อย ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 และรายได้เงินปันผลสำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน มีดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	สัดส่วน ความเป็นเจ้าของ (ร้อยละ)		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ					
			ทุนชำระแล้ว		วิธีราคาทุน		รายได้เงินปันผล	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กิจการย่อย								
บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด	99.99	99.99	200,000	200,000	200,000	200,000	190,000	72,000
บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุนรวม เพื่อผู้ลงทุนต่างด้าว จำกัด	99.99	99.99	100,000	100,000	100,000	100,000	-	-
บริษัท ไทยเอ็นวีดีอาร์ จำกัด	99.99	99.99	10,000	10,000	10,000	10,000	-	-
บริษัท เซ็ทเทรด ดอท คอม จำกัด	99.99	99.99	80,000	80,000	74,591	74,591	58,799	20,400
บริษัท สยามดีอาร์ จำกัด	99.99	99.99	10,000	10,000	10,000	10,000	-	-
บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)								
(เดิมชื่อ “บริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)”)	99.99	99.99	100,000	100,000	100,000	100,000	67,000	20,000
บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด	99.99	99.99	100,000	100,000	102,700	102,700	-	22,000
			600,000	600,000	597,291	597,291	315,799	134,400

12. เงินลงทุนในกิจการที่ควบคุมร่วมกัน - สุทธิ

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน				
ยอดคงเหลือต้นปี	58,495	44,500	25,000	25,000
รับเงินปันผล	(14,442)	(10,437)	-	-
รายได้เงินปันผล	5,874	4,442	-	-
ส่วนแบ่งกำไรสุทธิจากเงินลงทุนตามวิธีส่วนได้เสีย	26,432	19,990	-	-
ยอดคงเหลือปลายปี	76,359	58,495	25,000	25,000

เงินลงทุนในกิจการที่ควบคุมร่วมกัน ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 และรายได้เงินปันผลสำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน มีดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	สัดส่วนความเป็นเจ้าของ (ร้อยละ)		งบการเงินรวม					
			ทุนชำระแล้ว		วิธีส่วนได้เสีย		รายได้เงินปันผล	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน								
บริษัท แฟมมิลี่ โนฮาว จำกัด	49.99	49.99	50,000	50,000	76,359	58,495	5,874	4,442

(หน่วย : พันบาท)

	สัดส่วนความเป็นเจ้าของ (ร้อยละ)		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ					
			ทุนชำระแล้ว		วิธีราคาทุน		รายได้เงินปันผล	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน บริษัท แฟมมิลี โนฮาว จำกัด	49.99	49.99	50,000	50,000	25,000	25,000	15,874	14,879

รายละเอียดเงินลงทุนและสิทธิในการรับเงินปันผลแสดงในหมายเหตุข้อ 31.1

ข้อมูลทางการเงินโดยสรุปของกิจการที่ควบคุมร่วมกัน ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 และสำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน ซึ่งกลุ่มกิจการบันทึกเงินลงทุนในกิจการดังกล่าวตามวิธีส่วนได้เสีย โดยแสดงตามสัดส่วนของกลุ่มกิจการ

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
สินทรัพย์หมุนเวียน	127,727	131,274
สินทรัพย์ไม่หมุนเวียน	58,877	28,163
สินทรัพย์รวม	186,604	159,437
หนี้สินหมุนเวียน	33,673	42,264
หนี้สินไม่หมุนเวียน	6,062	4,620
หนี้สินรวม	39,735	46,884
รายได้รวม	248,349	228,087
ค่าใช้จ่ายรวม	171,563	158,954
กำไรเบ็ดเสร็จรวม	58,758	44,421

13. เงินลงทุนในกิจการร่วม - สุทธิ

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กิจการร่วม				
ยอดคงเหลือต้นปี	495,307	492,327	396,605	396,769
ขาดทุนจากการด้อยค่า	-	(164)	-	(164)
ส่วนแบ่งกำไรสุทธิจากเงินลงทุน - รับรู้ในงบรายได้ และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ	2,010	3,535	-	-
ส่วนแบ่งกำไร(ขาดทุน) สุทธิจากเงินลงทุน - รับรู้ในงบรายได้ และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ	590	(391)	-	-
ยอดคงเหลือปลายปี	497,907	495,307	396,605	396,605

เงินลงทุนในกิจการร่วม ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 และรายได้เงินปันผลสำหรับปีสิ้นสุดวันเดียวกัน มีดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	สัดส่วน ความเป็นเจ้าของ (ร้อยละ)		งบการเงินรวม							
			ทุนชำระแล้ว		วิธีราคาทุน - สุทธิ		วิธีส่วนได้เสีย		รายได้เงินปันผล	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กิจการร่วม										
กองทุนทดแทนความเสียหาย ในระบบชำระราคาและ ส่งมอบหลักทรัพย์ บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อ ธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน)	16.56	17.71	1,050,743	963,045	100,000	100,000	178,586	173,923	-	-
	24.66	24.66	1,016,740	1,016,740	296,605	296,605	319,321	321,384	-	-
					396,605	396,605	497,907	495,307	-	-

(หน่วย : พันบาท)

	สัดส่วน ความเป็นเจ้าของ (ร้อยละ)		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ									
			ทุนชำระแล้ว		วิธีราคาทุน		การด้อยค่า		ราคาทุน - สุทธิ		รายได้เงินปันผล	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กิจการร่วม												
กองทุนทดแทนความเสียหาย ในระบบชำระราคาและ ส่งมอบหลักทรัพย์ บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจ หลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน)	16.56	17.71	1,050,743	963,045	100,000	100,000	-	-	100,000	100,000	-	-
	24.66	24.66	1,016,740	1,016,740	300,000	300,000	-	(3,395)	296,605	296,605	-	-
					400,000	400,000	-	(3,395)	396,605	396,605	-	-

14. เงินลงทุนระยะยาว - สุทธิ

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
หลักทรัพย์เพื่อขาย	3,356,643	3,735,463	3,353,748	3,732,613
ตราสารหนี้ที่ถือจนครบกำหนด	4,893,100	1,527,718	4,846,900	1,509,708
เงินลงทุนทั่วไป	68,187	68,641	68,187	68,641
หัก ค่าเผื่อการด้อยค่า	(3,405)	(2,450)	(3,405)	(2,450)
	8,314,525	5,329,372	8,265,430	5,308,512

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 เงินฝากประจำได้แก่ เงินฝากประจำกับธนาคารประเภท 1 ปีขึ้นไป มีอัตราดอกเบี้ยระหว่างร้อยละ 3.30 - 4.10 ต่อปี (พ.ศ. 2554 : ระหว่างร้อยละ 2.25 - 3.75 ต่อปี)

เงินฝากสถาบันการเงินตามข้อตกลงเป็นเงินฝากธนาคารที่ใช้เป็นหลักทรัพย์ค้ำประกันวงเงินที่ธนาคารให้สินเชื่อเพื่อที่อยู่อาศัยกับพนักงานของกลุ่มกิจการตามข้อตกลง

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 หน่วยลงทุนในกองทุนรวมทั่วไปเป็นการลงทุนในกองทุนเปิดประเภทรับซื้อคืนหน่วยลงทุนที่เน้นการลงทุนในหุ้นของบริษัทย่อยจำนวน 19 กองทุน (พ.ศ. 2554 : 21 กองทุน) และกองทุนรวมตราสารหนี้จำนวน 1 กองทุน (พ.ศ. 2554 : 1 กองทุน)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 หน่วยลงทุนในกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์เป็นการลงทุนในกองทุนรวมปิดประเภทไม่รับซื้อคืนหน่วยลงทุนจำนวน 9 กองทุน (พ.ศ. 2554 : 9 กองทุน) กองทุนดังกล่าวจัดตั้งขึ้นมาเพื่อซื้อหรือเช่าอสังหาริมทรัพย์ รับโอนอสังหาริมทรัพย์ และ/หรือสิทธิการเช่าอสังหาริมทรัพย์และจัดหาผลประโยชน์จากอสังหาริมทรัพย์ดังกล่าว ทั้งนี้หน่วยลงทุนในกองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์ดังกล่าวได้จดทะเบียนเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนและสามารถซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยได้

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 หน่วยลงทุนในกองทุนรวมที่ลงทุนในต่างประเทศเป็นการลงทุนในกองทุนเปิดจำนวน 9 กองทุน (พ.ศ. 2554 : 7 กองทุน) ประเภทกองทุนรวมหน่วยลงทุน (Feeder Fund) ที่เน้นการลงทุนในหน่วยลงทุนของกองทุนรวมตราสารทุนต่างประเทศ

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 พันธบัตรรัฐบาล พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย และหุ้นกู้ที่ถึงกำหนดไถ่ถอนภายในระยะเวลาเกินกว่า 1 ปี ถึง 9 ปี มีอัตราดอกเบี้ยหน้าตัวระหว่างร้อยละ 3.00 - 5.19 ต่อปี (พ.ศ. 2554 : ระหว่างร้อยละ 3.00 - 5.00 ต่อปี) และมีอัตราผลตอบแทนตามราคาตลาดระหว่างร้อยละ 3.02 - 4.93 ต่อปี (พ.ศ. 2554 : ระหว่างร้อยละ 3.09 - 5.08 ต่อปี)

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 หน่วยลงทุนในกองทุนรวมเฉพาะกิจเป็นการร่วมลงทุนในกองทุนเปิดจำนวน 3 กองทุนรวมทุน (พ.ศ. 2554 : 3 กองทุนรวมทุน) โดยหน่วยลงทุนดังกล่าวได้บันทึกมูลค่าการลงทุนในราคาทุน ซึ่งเป็นไปตามหลักการบัญชีที่รับรองทั่วไป เนื่องจากมีข้อผูกพันที่จะไม่ขายคืนภายใน 5 ปีแรก ซึ่งมีรายละเอียดดังนี้

- 1) ปี พ.ศ. 2548 ลงทุนในกองทุนรวมที่รัฐบาลจัดตั้งขึ้นมาเพื่อพัฒนาและฟื้นฟูกิจการที่ได้รับผลกระทบจากภัยพิบัติสึนามิทางภาคใต้ โดยกองทุนจะเน้นการลงทุนในธุรกิจที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจการท่องเที่ยว และได้รับผลกระทบจากเหตุการณ์สึนามิใน 6 จังหวัดภาคใต้ โดยจะเปิดให้มีการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนแบบอัตโนมัติตั้งแต่ปีที่ 6 เป็นต้นไป (ปี พ.ศ. 2554) หรือเว้นแต่จะได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการลงทุน หากจะรับซื้อคืนหน่วยลงทุนก่อนระยะเวลาที่กำหนด ส่วนที่มีกำหนดรับซื้อคืนในปี พ.ศ. 2554 แสดงไว้ในเงินลงทุนชั่วคราว (หมายเหตุ 8)
- 2) ปี พ.ศ. 2550 ลงทุนในกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบัน โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อระดมเงินจากผู้ลงทุนสถาบันที่ต้องการลงทุนส่วนใหญ่ในธุรกิจหรือกิจการที่เกี่ยวข้องกับพลังงาน หรือพลังงานทดแทน หรือธุรกิจหรือกิจการที่มีส่วนในการสนับสนุนนโยบายของภาครัฐด้านพลังงาน โดยกองทุนรวมเฉพาะกิจนี้เป็นกองทุนประเภทรับซื้อคืนหน่วยลงทุน โดยจะเปิดให้มีการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนแบบอัตโนมัติตั้งแต่ปีที่ 6 เป็นต้นไป (ปี พ.ศ. 2556) เมื่อกองทุนขายหลักทรัพย์หรือทรัพย์สินของกองทุน และมีได้นำเงินมาลงทุนต่อ
- 3) ปี พ.ศ. 2551 ลงทุนในกองทุนรวมเพื่อผู้ลงทุนสถาบัน โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อระดมเงินจากผู้ลงทุนสถาบันที่ต้องการลงทุนในธุรกิจและอุตสาหกรรมที่มีแนวโน้มการเจริญเติบโต และเป็นการลงทุนระยะยาวเป็นส่วนใหญ่ โดยจะเปิดให้มีการรับซื้อคืนหน่วยลงทุนแบบอัตโนมัติตั้งแต่ปีที่ 4 เป็นต้นไป (ปี พ.ศ. 2555)

การลงทุนในกองทุนรวมเฉพาะกิจในข้อ 2) และข้อ 3) มีเงื่อนไขผูกพันการจูงใจหากกองทุนมีการเพิ่มหน่วยลงทุนจนกระทั่งสิ้นสุดสัญญา (หมายเหตุ 30)

รายการเคลื่อนไหวของเงินลงทุนระยะยาวสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 มีดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
ยอดคงเหลือต้นปี	5,329,372	8,295,915	5,308,512	8,199,677
ลงทุนเพิ่ม	1,769,618	1,975,736	1,728,418	1,975,716
จำหน่ายเงินลงทุน	(1,600,360)	(2,883,149)	(1,600,360)	(1,588,673)
จัดประเภทเป็นเงินลงทุนระยะชั่วคราว	(310,017)	(1,022,475)	(297,007)	(947,207)
ปรับปรุง	2,879,147	(677,274)	2,879,736	(1,972,131)
กำไร(ขาดทุน)ที่ยังไม่เกิดขึ้นจากหลักทรัพย์เพื่อขาย	247,720	(359,381)	247,086	(358,870)
หัก ค่าเผื่อการด้อยค่า	(955)	-	(955)	-
ยอดคงเหลือปลายปี	8,314,525	5,329,372	8,265,430	5,308,512

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 ตราสารหนี้ที่ถือจนครบกำหนดจำแนกตามระยะเวลาคงเหลือได้ดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม			
	ครบกำหนด			
	ไม่เกิน 1 ปี	1 ถึง 5 ปี	เกิน 5 ปี	รวม
31 ธันวาคม พ.ศ. 2555				
ตราสารหนี้ที่ถือจนครบกำหนด				
พันธบัตรรัฐบาล	-	1,058	-	1,058
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	49,997	100,000	-	149,997
หุ้นกู้	410,010	553,203	211,908	1,175,121
เงินฝากธนาคาร	4,537,127	4,026,931	-	8,564,058
	4,997,134	4,681,192	211,908	9,890,234
31 ธันวาคม พ.ศ. 2554				
ตราสารหนี้ที่ถือจนครบกำหนด				
พันธบัตรรัฐบาล	756,813	-	1,070	757,883
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	30,117	149,924	-	180,041
พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ	50,082	-	-	50,082
หุ้นกู้	110,195	433,561	50,000	593,756
เงินฝากธนาคารและตัวแลกเงิน	5,907,867	893,163	-	6,801,030
	6,855,074	1,476,648	51,070	8,382,792

(หน่วย : พันบาท)

	เฉพาะตลาดหลักทรัพฯ			
	ครบกำหนด			
	ไม่เกิน 1 ปี	1 ถึง 5 ปี	เกิน 5 ปี	รวม
31 ธันวาคม พ.ศ. 2555				
ตราสารหนี้ที่ถือจนครบกำหนด				
พันธบัตรรัฐบาล	-	1,058	-	1,058
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	49,997	100,000	-	149,997
หุ้นกู้	397,010	553,203	211,908	1,162,121
เงินฝากธนาคาร	4,513,107	3,980,731	-	8,493,838
	4,960,114	4,634,992	211,908	9,807,014
31 ธันวาคม พ.ศ. 2554				
ตราสารหนี้ที่ถือจนครบกำหนด				
พันธบัตรรัฐบาล	756,813	-	1,070	757,883
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	30,117	149,924	-	180,041
พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ	50,082	-	-	50,082
หุ้นกู้	110,195	420,561	50,000	580,756
เงินฝากธนาคารและตัวแลกเงิน	5,215,107	888,153	-	6,103,260
	6,162,314	1,458,638	51,070	7,672,022

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 มูลค่ายุติธรรมของตราสารหนี้ที่ถือจนครบกำหนดประกอบด้วย

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม			
	ราคาทุนตัดจำหน่าย - สุทธิ		มูลค่ายุติธรรม	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
พันธบัตรรัฐบาล	1,058	757,883	1,078	770,984
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	149,997	180,041	157,079	187,379
พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ	-	50,082	-	49,833
หุ้นกู้	1,175,121	593,756	1,186,502	597,954
เงินฝากธนาคารและตัวแลกเงิน	8,564,058	6,801,030	8,564,058	6,801,030
	9,890,234	8,382,792	9,908,717	8,407,180
<u>หัก จัดประเภทเป็นเงินลงทุนชั่วคราว</u>	<u>(4,997,134)</u>	<u>(6,855,074)</u>	<u>(4,999,118)</u>	<u>(6,868,488)</u>
	4,893,100	1,527,718	4,909,599	1,538,692

(หน่วย : พันบาท)

	เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ			
	ราคาทุนตัดจำหน่าย - สุทธิ		มูลค่ายุติธรรม	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
พันธบัตรรัฐบาล	1,058	757,883	1,078	770,984
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	149,997	180,041	157,079	187,379
พันธบัตรรัฐวิสาหกิจ	-	50,082	-	49,833
หุ้นกู้	1,162,121	580,756	1,173,425	584,711
เงินฝากธนาคารและตัวแลกเงิน	8,493,838	6,103,260	8,493,838	6,103,260
	9,807,014	7,672,022	9,825,420	7,696,167
<u>หัก จัดประเภทเป็นเงินลงทุนชั่วคราว</u>	<u>(4,960,114)</u>	<u>(6,162,314)</u>	<u>(4,962,020)</u>	<u>(6,175,728)</u>
	4,846,900	1,509,708	4,863,400	1,520,439

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 มูลค่ายุติธรรมของหน่วยลงทุนในกองทุนรวมเฉพาะกิจมีรายละเอียดดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวมและเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ					
	ราคาทุน		มูลค่ายุติธรรม		ค่าเพื่อการด้อยค่า	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
หน่วยลงทุนในกองทุนรวมเฉพาะกิจ	96,720	104,667	91,277	93,641	(7,007)	(24,873)
<u>หัก จัดประเภทเป็นเงินลงทุนชั่วคราว</u>	<u>(40,869)</u>	<u>(48,362)</u>	<u>(38,509)</u>	<u>(43,116)</u>	<u>3,602</u>	<u>22,423</u>
	55,851	56,305	52,768	50,525	(3,405)	(2,450)

15. ที่ดิน อาคารและอุปกรณ์ - สุทธิ

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม					
	ที่ดินและ ส่วนปรับปรุง ที่ดิน	อาคารและ ส่วนปรับปรุง อาคาร	เครื่องตกแต่ง ติดตั้งและ อุปกรณ์ สำนักงาน	ยานพาหนะ	งาน ระหว่างทำ	รวม
ณ วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2554						
ราคาทุน	1,015,585	1,700,914	895,559	3,151	34,129	3,649,338
หัก ค่าเสื่อมราคาสะสม	(455)	(433,617)	(782,410)	(742)	-	(1,217,224)
ราคาตามบัญชี - สุทธิ	1,015,130	1,267,297	113,149	2,409	34,129	2,432,114
สำหรับปีสิ้นสุด วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554						
ราคาตามบัญชีต้นปี - สุทธิ	1,015,130	1,267,297	113,149	2,409	34,129	2,432,114
ซื้อสินทรัพย์	-	20,352	54,961	2,679	33,321	111,313
จำหน่าย/ตัดจำหน่ายสินทรัพย์	-	-	(6,583)	(1,191)	-	(7,774)
โอนสินทรัพย์	-	22,814	17,195	-	(40,566)	(557)
ค่าเสื่อมราคา	(313)	(79,220)	(37,846)	(149)	-	(117,528)
ราคาตามบัญชีปลายปี - สุทธิ	1,014,817	1,231,243	140,876	3,748	26,884	2,417,568
ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554						
ราคาทุน	1,015,585	1,738,753	891,870	4,639	26,884	3,677,731
หัก ค่าเสื่อมราคาสะสม	(768)	(507,510)	(750,994)	(891)	-	(1,260,163)
ราคาตามบัญชี - สุทธิ	1,014,817	1,231,243	140,876	3,748	26,884	2,417,568
สำหรับปีสิ้นสุด วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555						
ราคาตามบัญชีต้นปี - สุทธิ	1,014,817	1,231,243	140,876	3,748	26,884	2,417,568
ซื้อสินทรัพย์	-	3,680	55,437	4,191	85,069	148,377
จำหน่าย/ตัดจำหน่ายสินทรัพย์	(731)	-	(720)	(5,592)	-	(7,043)
โอนสินทรัพย์	-	4,000	1,920	-	(5,920)	-
ค่าเสื่อมราคา	(64)	(71,361)	(39,198)	(199)	-	(110,822)
ปรับปรุงสินทรัพย์	-	2,307	89	(62)	21	2,355
ราคาตามบัญชีปลายปี - สุทธิ	1,014,022	1,169,869	158,404	2,086	106,054	2,450,435
ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555						
ราคาทุน	1,014,022	1,746,413	893,264	3,238	106,054	3,762,991
หัก ค่าเสื่อมราคาสะสม	-	(576,544)	(734,860)	(1,152)	-	(1,312,556)
ราคาตามบัญชี - สุทธิ	1,014,022	1,169,869	158,404	2,086	106,054	2,450,435

15. ที่ดิน อาคารและอุปกรณ์ - สุทธิ (ต่อ)

(หน่วย : พันบาท)

	เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ					
	ที่ดินและ ส่วนปรับปรุง ที่ดิน	อาคารและ ส่วนปรับปรุง อาคาร	เครื่องตกแต่ง ติดตั้งและ อุปกรณ์ สำนักงาน	ยานพาหนะ	งาน ระหว่างทำ	รวม
ณ วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2554						
ราคาทุน	1,015,585	1,699,196	754,977	3,151	34,129	3,507,038
หัก ค่าเสื่อมราคาสะสม	(455)	(432,615)	(650,244)	(742)	-	(1,084,056)
ราคาตามบัญชี - สุทธิ	1,015,130	1,266,581	104,733	2,409	34,129	2,422,982
สำหรับปีสิ้นสุด วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554						
ราคาตามบัญชีต้นปี - สุทธิ	1,015,130	1,266,581	104,733	2,409	34,129	2,422,982
ซื้อสินทรัพย์	-	20,352	54,961	2,679	33,321	111,313
จำหน่าย/ตัดจำหน่ายสินทรัพย์	-	-	(6,527)	(1,191)	-	(7,718)
โอน/ปรับปรุงสินทรัพย์	-	22,814	17,195	-	(40,566)	(557)
ค่าเสื่อมราคา	(313)	(79,048)	(34,614)	(149)	-	(114,124)
ราคาตามบัญชีปลายปี - สุทธิ	1,014,817	1,230,699	135,748	3,748	26,884	2,411,896
ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554						
ราคาทุน	1,015,585	1,737,037	770,139	4,639	26,884	3,554,284
หัก ค่าเสื่อมราคาสะสม	(768)	(506,338)	(634,391)	(891)	-	(1,142,388)
ราคาตามบัญชี - สุทธิ	1,014,817	1,230,699	135,748	3,748	26,884	2,411,896
สำหรับปีสิ้นสุด วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555						
ราคาตามบัญชีต้นปี - สุทธิ	1,014,817	1,230,699	135,748	3,748	26,884	2,411,896
ซื้อสินทรัพย์	-	3,680	55,437	4,191	85,069	148,377
จำหน่าย/ตัดจำหน่ายสินทรัพย์	(731)	-	(64)	(5,592)	-	(6,387)
โอนสินทรัพย์	-	4,000	1,920	-	(5,920)	-
ค่าเสื่อมราคา	(64)	(71,298)	(37,131)	(199)	-	(108,692)
ปรับปรุงสินทรัพย์	-	2,307	71	(62)	21	2,337
ราคาตามบัญชีปลายปี - สุทธิ	1,014,022	1,169,388	155,981	2,086	106,054	2,447,531
ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555						
ราคาทุน	1,014,022	1,744,696	806,770	3,238	106,054	3,674,780
หัก ค่าเสื่อมราคาสะสม	-	(575,308)	(650,789)	(1,152)	-	(1,227,249)
ราคาตามบัญชี - สุทธิ	1,014,022	1,169,388	155,981	2,086	106,054	2,447,531

16. สินทรัพย์ไม่มีตัวตน – สุทธิ

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		
	โปรแกรมคอมพิวเตอร์	งานระหว่างทำ	รวม
ณ วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2554			
ราคาทุน	789,690	16,982	806,672
หัก ค่าตัดจำหน่ายสะสม	(609,819)	-	(609,819)
ราคาตามบัญชี – สุทธิ	179,871	16,982	196,853
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554			
ราคาตามบัญชีต้นปี – สุทธิ	179,871	16,982	196,853
ซื้อสินทรัพย์	31,362	74,506	105,868
จำหน่าย/ตัดจำหน่ายสินทรัพย์	(53)	-	(53)
โอนสินทรัพย์	10,117	(12,379)	(2,262)
ค่าตัดจำหน่าย	(77,302)	-	(77,302)
ราคาตามบัญชีปลายปี – สุทธิ	143,995	79,109	223,104
ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554			
ราคาทุน	823,761	79,109	902,870
หัก ค่าตัดจำหน่ายสะสม	(679,766)	-	(679,766)
ราคาตามบัญชี – สุทธิ	143,995	79,109	223,104
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555			
ราคาตามบัญชีต้นปี – สุทธิ	143,995	79,109	223,104
ซื้อสินทรัพย์	28,957	144,334	173,291
จำหน่าย/ตัดจำหน่ายสินทรัพย์	(4,444)	-	(4,444)
โอนสินทรัพย์	192,223	(192,223)	-
ค่าตัดจำหน่าย	(73,848)	-	(73,848)
ปรับปรุงสินทรัพย์	10	-	10
ราคาตามบัญชีปลายปี – สุทธิ	286,893	31,220	318,113
ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555			
ราคาทุน	1,038,235	31,220	1,069,455
หัก ค่าตัดจำหน่ายสะสม	(751,342)	-	(751,342)
ราคาตามบัญชี – สุทธิ	286,893	31,220	318,113

16. สินทรัพย์ไม่มีตัวตน – สุทธิ (ต่อ)

(หน่วย : พันบาท)

	เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ		
	โปรแกรมคอมพิวเตอร์	งานระหว่างทำ	รวม
ณ วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2554			
ราคาทุน	708,956	16,982	725,938
<u>หัก</u> ค่าตัดจำหน่ายสะสม	(537,635)	-	(537,635)
ราคาตามบัญชี – สุทธิ	171,321	16,982	188,303
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554			
ราคาตามบัญชีต้นปี – สุทธิ	171,321	16,982	188,303
ซื้อสินทรัพย์	31,362	74,506	105,868
จำหน่าย/ตัดจำหน่ายสินทรัพย์	(53)	-	(53)
โอนสินทรัพย์	10,117	(12,379)	(2,262)
ค่าตัดจำหน่าย	(73,103)	-	(73,103)
ราคาตามบัญชีปลายปี – สุทธิ	139,644	79,109	218,753
ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554			
ราคาทุน	743,027	79,109	822,136
<u>หัก</u> ค่าตัดจำหน่ายสะสม	(603,383)	-	(603,383)
ราคาตามบัญชี – สุทธิ	139,644	79,109	218,753
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555			
ราคาตามบัญชีต้นปี – สุทธิ	139,644	79,109	218,753
ซื้อสินทรัพย์	28,957	144,334	173,291
จำหน่าย/ตัดจำหน่ายสินทรัพย์	(4,444)	-	(4,444)
โอนสินทรัพย์	192,223	(192,223)	-
ค่าตัดจำหน่าย	(72,160)	-	(72,160)
ราคาตามบัญชีปลายปี – สุทธิ	284,220	31,220	315,440
ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555			
ราคาทุน	957,501	31,220	988,721
<u>หัก</u> ค่าตัดจำหน่ายสะสม	(673,281)	-	(673,281)
ราคาตามบัญชี – สุทธิ	284,220	31,220	315,440

17. ทรัพย์สินหลักประกันและผลประโยชน์

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด “สำนักหักบัญชี” เป็นสำนักหักบัญชีตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาชิกของสำนักหักบัญชีที่มีฐานะซื้อขายสัญญาล่วงหน้ามีหน้าที่ต้องนำทรัพย์สินมาวางเป็นหลักประกันในการซื้อขายล่วงหน้าตามอัตราหรือมูลค่าที่สำนักหักบัญชีกำหนด ทั้งนี้สำนักหักบัญชีจะนำทรัพย์สินหลักประกันดังกล่าวไปบริหารจัดการเพื่อให้เกิดผลประโยชน์ตามหลักเกณฑ์ วิธีการและเงื่อนไขที่กำหนด ซึ่งผลประโยชน์ที่เกิดขึ้นจากเงินประกันดังกล่าวภายหลังหักค่าบริการจัดการจะจัดสรรให้แก่สมาชิกตามอัตราและวิธีการที่กำหนด

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 รายละเอียดเงินลงทุนของทรัพย์สินที่สมาชิกวางเป็นหลักประกันจำนวนเงิน 6,810.07 ล้านบาท และ 6,053.02 ล้านบาท ตามลำดับ มีดังต่อไปนี้

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
เงินฝากออมทรัพย์และเงินฝากประจำ	6,134,925	5,615,318
เงินฝากออมทรัพย์ที่เป็นเงินตราต่างประเทศ	245,174	-
พันธบัตร	378,408	384,251
ผลประโยชน์ค้างรับ	51,566	53,449
	6,810,073	6,053,018

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 เงินฝากออมทรัพย์ที่เป็นเงินตราต่างประเทศ จำนวน 8,042,262.19 ดอลลาร์สหรัฐ แปลงค่าเป็นเงินบาท โดยใช้อัตราซื้อตัวเฉลี่ยเงินโอนประกาศโดยธนาคารแห่งประเทศไทย ณ วันสิ้นรอบระยะเวลาบัญชี (พ.ศ. 2554 : ไม่มี)

กลุ่มกิจการได้แสดงทรัพย์สินที่สมาชิกวางเป็นหลักประกันเป็นรายการแยกต่างหากในบัญชี “ทรัพย์สินหลักประกันและผลประโยชน์” ภายใต้สินทรัพย์หมุนเวียนในงบแสดงฐานะการเงิน และได้แสดงภาระหนี้สินในจำนวนเงินเดียวกันในบัญชี “เจ้าหนี้หลักประกันและผลประโยชน์” ภายใต้หนี้สินหมุนเวียนในงบแสดงฐานะการเงิน

18. ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์

ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงจัดตั้งขึ้นเพื่อเป็นประกันความเสียหายที่อาจเกิดจากการผิดนัดชำระหนี้หรือความเสียหายอื่นที่อาจเกิดจากการกระทำของสมาชิกในการดำเนินการที่เกี่ยวกับระบบการชำระหนี้ของบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด “สำนักหักบัญชี”

ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงแบ่งได้เป็น 2 ประเภทดังนี้

18.1 หลักทรัพย์เพื่อความมั่นคง (Securities Deposit)

สมาชิกของสำนักหักบัญชีมีหน้าที่วางทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด (ปัจจุบันกำหนดหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงเป็นมูลค่าไม่น้อยกว่า 5 ล้านบาท สำหรับสมาชิกที่ใช้บริการชำระหนี้ทุกสินค้าย่อยหรือไม่น้อยกว่า 4 ล้านบาท สำหรับสมาชิกที่ใช้บริการชำระหนี้เฉพาะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสินค้าย่อยเป็นทองคำ) โดยสำนักหักบัญชีจะนำหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงดังกล่าวไปบริหารจัดการเพื่อให้เกิดผลประโยชน์และจะคืนผลประโยชน์ดังกล่าวภายหลังหักค่าบริการจัดการให้แก่สมาชิกตามอัตราและวิธีการที่กำหนด ทั้งนี้ในส่วนของหลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงจะคืนแก่สมาชิกเมื่อสมาชิกพ้นจากสมาชิกภาพแล้ว

18.2 กองทุนทดแทนความเสียหาย (Clearing fund) ประกอบด้วยการวางหลักทรัพย์สมทบจาก

- (1) ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยเป็นจำนวนเงิน 100 ล้านบาท
- (2) สมาชิกของสำนักหักบัญชีแต่ละรายดังนี้
 - ทรัพย์สินสมทบแรกเข้าเป็นสมาชิกกองทุนในอัตราที่กำหนด (ปัจจุบันกำหนดเงินสมทบแรกเข้าเป็นมูลค่าไม่น้อยกว่า 5 ล้านบาท สำหรับสมาชิกที่ใช้บริการชำระหนี้ทุกสินค้าย่อยหรือไม่น้อยกว่า 1 ล้านบาท สำหรับสมาชิกที่ได้รับอนุญาตจากสำนักหักบัญชีให้ใช้บริการชำระหนี้เฉพาะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่มีสินค้าย่อยเป็นทองคำ)
 - ทรัพย์สินสมทบรายเดือนเป็นมูลค่าไม่น้อยกว่า 1,000 บาท

ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์ถือเป็นกรรมสิทธิ์ของผู้จ่ายเงินสมทบตามสัดส่วนที่สมทบเข้ากองทุน โดยเมื่อสมาชิกพ้นสมาชิกภาพแล้ว สมาชิกจะได้รับคืนทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์ที่เกิดขึ้นจากทรัพย์สินดังกล่าว

18.2 กองทุนทดแทนความเสียหาย (Clearing fund) ประกอบด้วยการวางหลักทรัพย์สมทบจาก

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์ ประกอบด้วย

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม					
	หลักทรัพย์เพื่อความมั่นคง		กองทุนทดแทนความเสียหาย		รวม	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
เงินลงทุนที่บริหารโดยกิจการย่อย	824,030	731,183	-	-	824,030	731,183
เงินลงทุนที่บริหารโดยกองทุนส่วนบุคคล						
เงินฝากออมทรัพย์	972	3,263	2,690	3,867	3,662	7,130
เงินฝากประจำ	60,003	-	147,003	-	207,006	-
ตราสารหนี้อื่น	10,000	79,001	20,000	143,001	30,000	222,002
หลักทรัพย์เพื่อค้า	138,300	125,125	328,416	272,221	466,716	397,346
	1,033,305	938,572	498,109	419,089	1,531,414	1,357,661
ดอกเบี้ยค้างรับ	8,318	6,253	3,294	1,981	11,612	8,234
สินทรัพย์อื่น	89	58	5,242	5,279	5,331	5,337
	1,041,712	944,883	506,645	426,349	1,548,357	1,371,232

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 รายละเอียดของทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์ส่วนของตลาดหลักทรัพย์ฯ จำนวน 127.03 ล้านบาท (พ.ศ. 2554 : 122.86 ล้านบาท) มีดังต่อไปนี้

(หน่วย : พันบาท)

	เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
กองทุนทดแทนความเสียหายและผลประโยชน์		
เงินสมทบ	100,000	100,000
ผลประโยชน์	27,033	22,862
	127,033	122,862

18.2 กองทุนทดแทนความเสียหาย (Clearing fund) ประกอบด้วยการวางหลักทรัพย์สมทบจาก

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 เจ้าหนี้ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์ ประกอบด้วย

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
หลักทรัพย์เพื่อความมั่นคงและผลประโยชน์		
เงินสมทบ	1,024,000	929,000
ผลประโยชน์ (กำหนดจ่ายคืนสมาชิกทุก 6 เดือน)	17,712	15,883
	1,041,712	944,883
กองทุนทดแทนความเสียหายและผลประโยชน์		
เงินสมทบ	330,513	253,184
ผลประโยชน์	49,099	50,303
	379,612	303,487
	1,421,324	1,248,370

19. เจ้าหนี้และค่าใช้จ่ายค้างจ่าย

(หน่วย : พันบาท)

หมายเหตุ	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
เจ้าหนี้				
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	275	258	275	258
กิจการอื่น	57,947	49,365	52,786	47,905
	58,222	49,623	53,061	48,163
ค่าใช้จ่ายค้างจ่าย				
กิจการย่อย	-	-	163	158
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	14,764	13,867	14,764	13,867
	14,764	13,867	14,927	14,025
กิจการอื่น	802,608	629,019	788,373	616,644
	817,372	642,886	803,300	630,669
	875,594	692,509	856,361	678,832

20. หนี้สินหมุนเวียนอื่น

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
เงินคืนจากการจองซื้อหุ้นเพิ่มทุน	214,871	-	-	-
ผลประโยชน์ทางการเงินค้างจ่าย	57,906	56,580	-	-
เงินกองทุนตลาดหุ้นร่วมใจช่วยภัยน้ำท่วม	120,015	179,084	120,015	179,084
ภาษีเงินได้หัก ณ ที่จ่ายค้างจ่าย	114,119	73,331	84,571	68,666
ภาษีเงินได้ค้างจ่าย	45,082	67,070	-	-
เจ้าหนี้เงินปันผลรอจ่ายคืนผู้ถือหุ้น	41,080	36,249	-	-
สำรองเงินผลประโยชน์พนักงานจากสิทธิการลาพักร้อนสะสม	20,903	20,854	20,903	20,854
เงินประกันต่างๆ	18,373	13,663	18,369	13,659
กองทุนเงินทองของมีค่า	11,299	10,426	11,299	10,426
เงินกองทุนวตท.ร่วมใจช่วยภัยน้ำท่วม	-	26,222	-	26,222
อื่นๆ	26,027	22,416	18,367	13,858
	669,675	505,895	273,524	332,769

21. สำรองผลประโยชน์พนักงาน

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
หนี้สินที่บันทึกในงบแสดงฐานะการเงิน				
ผลประโยชน์เกษียณอายุ	137,325	123,342	137,325	123,342
ผลประโยชน์อื่น	29,117	25,880	29,117	25,880
	166,442	149,222	166,442	149,222
รายการที่บันทึกในงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จ				
ผลประโยชน์เกษียณอายุ	19,766	16,272	19,766	16,272
ผลประโยชน์อื่น	3,238	25,880	3,238	25,880
	23,004	42,152	23,004	42,152

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 หนี้สินที่บันทึกในงบแสดงฐานะการเงินประกอบด้วย

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
มูลค่าปัจจุบันของภาระผูกพัน				
ผลประโยชน์เกษียณอายุ	158,732	145,295	158,732	145,295
ผลประโยชน์อื่น	29,117	25,880	29,117	25,880
	187,849	171,175	187,849	171,175
ขาดทุนตามหลักคณิตศาสตร์ประกันภัยที่ยังไม่รับรู้				
ผลประโยชน์เกษียณอายุ	(21,407)	(21,953)	(21,407)	(21,953)
หนี้สินที่บันทึกในงบแสดงฐานะการเงิน	166,442	149,222	166,442	149,222

การเคลื่อนไหวของสำรองผลประโยชน์พนักงาน สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 มีดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
ยอดคงเหลือต้นปี	149,222	120,110	149,222	120,110
ต้นทุนบริการปัจจุบัน	16,087	10,053	16,087	10,053
ต้นทุนดอกเบี้ย	6,370	5,832	6,370	5,832
ต้นทุนบริการในอดีต	-	26,267	-	26,267
กำไรตามหลักคณิตศาสตร์ประกันภัยที่ยังไม่รับรู้	546	-	546	-
รับโอนต้นทุนจากกิจการที่ควบคุมร่วมกัน	43	428	43	428
	172,268	162,690	172,268	162,690
หัก จ่ายผลประโยชน์	(5,826)	(13,468)	(5,826)	(13,468)
ยอดคงเหลือปลายปี	166,442	149,222	166,442	149,222
หัก ส่วนที่ถึงกำหนดชำระภายใน 1 ปี	(6,102)	(5,630)	(6,102)	(5,630)
ยอดคงเหลือที่ถึงกำหนดชำระเกิน 1 ปี	160,340	143,592	160,340	143,592

สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 ข้อสมมติฐานทางสถิติที่สำคัญที่ใช้ในการคำนวณ สรุปได้ดังนี้

	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
อัตราคิดลด ณ วันที่ 31 ธันวาคม	ร้อยละ 3.80	ร้อยละ 3.80
อัตราการขึ้นเงินเดือน - พนักงานประจำ	ร้อยละ 5.00 - 10.00	ร้อยละ 5.00 - 10.00
อัตราการขึ้นเงินเดือน - พนักงานตามสัญญา	ร้อยละ 4.50	ร้อยละ 4.50
อัตราการลาออกเฉลี่ย	ร้อยละ 0.00 - 9.00	ร้อยละ 0.00 - 9.00
อัตราการตายก่อนเกษียณอายุ	ร้อยละ 0.08 - 1.03	ร้อยละ 0.08 - 1.03
เกษียณอายุ	60 ปี	60 ปี

22. เงินกองทุน

รายละเอียดเงินกองทุนประกอบด้วย

เงินกองทุนสำรองเพื่อการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์

ในปี พ.ศ. 2540 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ อนุมัติให้จัดสรรเงินกองทุนทั่วไปเป็นจำนวนเงิน 2,000 ล้านบาท เพื่อจัดตั้งเป็นเงินสำรองเพื่อการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ของสำนักหักบัญชี ซึ่งดำเนินการโดยกิจการย่อยในการรองรับความเสี่ยงจากการขาดสภาพคล่องกรณีที่สมาชิกมีการผิดนัดชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ

เงินกองทุนสำรองเพื่อการชำระหนี้ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ในปี พ.ศ. 2547 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ อนุมัติให้จัดสรรเงินกองทุนทั่วไปเป็นจำนวนเงิน 300 ล้านบาท เพื่อจัดตั้งเป็นเงินกองทุนสำรองเพื่อการชำระหนี้สินตลาดอนุพันธ์ของสำนักหักบัญชีในการรองรับความเสียหายที่อาจเกิดขึ้นจากระบบการซื้อขายและการชำระหนี้ของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากับ บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

เงินกองทุนชดเชยความเสียหาย

ในปี พ.ศ. 2536 และ พ.ศ. 2545 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ อนุมัติให้จัดสรรเงินกองทุนทั่วไปเป็นจำนวนเงินรวม 100 ล้านบาท เพื่อจัดตั้งเป็นเงินกองทุนชดเชยความเสียหาย และเพื่อเป็นการช่วยเหลือและสร้างความมั่นใจให้แก่คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ และผู้ที่ได้รับมอบหมายให้ปฏิบัติหน้าที่แทนคณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ในเรื่องที่เกี่ยวข้องกับการใช้อำนาจพิจารณาและตัดสินใจซึ่งอาจมีผลกระทบและก่อให้เกิดความเสียหายต่อบุคคลภายนอก

เงินกองทุนเพื่อก่อสร้างอาคารสำนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ

ในปี พ.ศ. 2535 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ อนุมัติให้จัดสรรเงินกองทุนทั่วไปเป็นจำนวนเงิน 580 ล้านบาท เพื่อใช้ในการก่อสร้างอาคารสำนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ ทั้งนี้การก่อสร้างอาคารสำนักงานดังกล่าวได้แล้วเสร็จในปี พ.ศ. 2541 เงินกองทุนส่วนที่เหลือเป็นจำนวนเงิน 246.30 ล้านบาท ได้กันไว้สำหรับการก่อสร้างอาคารจอดรถ

ในปี พ.ศ. 2551 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ อนุมัติให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ ดำเนินการก่อสร้างอาคารจอดรถ โดยใช้เงินกองทุนส่วนที่เหลือดังกล่าว ซึ่งรายจ่ายในระหว่างปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 มีจำนวนเงินทั้งสิ้น 0.34 ล้านบาท (พ.ศ. 2554 : 7.32 ล้านบาท)

ทั้งนี้ ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 เงินกองทุนเพื่อก่อสร้างอาคารสำนักงานตลาดหลักทรัพย์ฯ คงเหลือ มีจำนวน 7.77 ล้านบาท (พ.ศ. 2554 : 8.11 ล้านบาท)

เงินกองทุนเพื่อการสงเคราะห์ด้านสวัสดิการพนักงาน

ในปี พ.ศ. 2540 และ พ.ศ. 2547 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ อนุมัติให้จัดสรรเงินกองทุนทั่วไปเป็นจำนวนเงินรวม 75 ล้านบาท เพื่อจัดตั้งเงินกองทุนเพื่อการสงเคราะห์ด้านสวัสดิการพนักงาน ทั้งนี้ผลประโยชน์ที่ได้จากการบริหารเงินกองทุนได้นำเข้ามาสมทบในเงินกองทุนดังกล่าว

เงินกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์

ในปี พ.ศ. 2547 คณะกรรมการตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้อนุมัติการจัดตั้งกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์ (Securities Investor Protection Fund “SIPF”) โดยมีทุนประเดิมที่จัดสรรมาจากค่าธรรมเนียมการเป็นสมาชิกเป็นจำนวนเงิน 300 ล้านบาท

กองทุนนี้ได้มีการจัดตั้งขึ้นอย่างเป็นทางการภายใต้กฎระเบียบของกองทุน SIPF เมื่อวันที่ 1 ตุลาคม พ.ศ. 2547 โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อให้ความคุ้มครองและเป็นการสร้างความมั่นใจให้แก่ผู้ลงทุนที่ซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยผ่านบริษัทหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิก ทั้งนี้ ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 มีบริษัทหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์ทั้งสิ้น 32 แห่ง (พ.ศ. 2554 : 32 แห่ง)

ทรัพย์สินของกองทุนประกอบด้วย

- 1) เงินทุนประเดิมของตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นจำนวนเงิน 300 ล้านบาท จากการจัดสรรค่าธรรมเนียมการเป็นสมาชิก
- 2) เงินค่าเข้าเป็นสมาชิกและค่าธรรมเนียมรายเดือนที่เรียกเก็บจากสมาชิกกองทุน (เริ่มเรียกเก็บตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2548 เป็นต้นไป) ซึ่งจะสะสมจนครบจำนวน 200 ล้านบาท และ
- 3) ผลประโยชน์ที่ได้จากเงินและทรัพย์สินของกองทุนในอนาคต

ทั้งนี้ ในเดือนกรกฎาคม พ.ศ. 2553 เงินสมทบส่วนของสมาชิกมียอดสะสมครบ 200 ล้านบาทแล้วตามที่ตั้งเป้าหมายไว้ตามระเบียบของกองทุน ดังนั้นจึงไม่มีการเรียกเก็บเงินสมทบอีกตั้งแต่เดือนสิงหาคม พ.ศ. 2553

กองทุนจะคุ้มครองทรัพย์สินของผู้ลงทุนที่อยู่ในความดูแลของบริษัทหลักทรัพย์ที่เป็นสมาชิกกองทุน หากผู้ลงทุนไม่ได้รับคืนทรัพย์สินดังกล่าว กองทุนจะชดเชยความเสียหายแก่ผู้ลงทุนตามที่เกิดขึ้นจริง แต่ไม่เกินรายละ 1 ล้านบาท ต่อสมาชิกกองทุน 1 แห่ง ในกรณีใดกรณีหนึ่ง ดังนี้

- 1) ในกรณีที่บริษัทที่เป็นสมาชิกกองทุนถูกศาลสั่งพิทักษ์ทรัพย์เด็ดขาดตามกฎหมายล้มละลาย หรือ
- 2) ในกรณีที่บริษัทที่เป็นสมาชิกกองทุนกับผู้ลงทุนมีข้อพิพาททางแพ่งเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์ฯ และ อนุญาตตุลาการได้มีคำสั่งขาดให้บริษัทที่เป็นสมาชิกกองทุนรายนั้นคืนทรัพย์สินแก่ผู้ลงทุน แต่บริษัทที่เป็นสมาชิก กองทุนรายดังกล่าว ไม่ปฏิบัติตาม

ทั้งนี้ การคุ้มครองจะไม่รวมถึงผลขาดทุนที่เกิดจากการซื้อขายหลักทรัพย์ของผู้ลงทุนไม่ว่าจะเป็นการตัดสินใจลงทุนด้วยตนเองหรือไม่ก็ตาม

งบการเงินของเงินกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์ที่ได้รวมเป็นส่วนหนึ่งของงบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ แยกแสดงได้ดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวมและเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
สินทรัพย์		
สินทรัพย์หมุนเวียนอื่น		
เงินฝากและเงินลงทุนชั่วคราว	401,320	466,644
ดอกเบี้ยค้างรับ	4,611	3,764
รวมสินทรัพย์หมุนเวียน	405,931	470,408
สินทรัพย์ไม่หมุนเวียน		
เงินลงทุนระยะยาว	245,170	147,429
รวมสินทรัพย์	651,101	617,837
หนี้สินและเงินกองทุน		
หนี้สินไม่หมุนเวียน		
เงินสมทบจากสมาชิก	201,315	201,315
ผลประโยชน์ส่วนของสมาชิก	43,356	30,857
รวมหนี้สินไม่หมุนเวียน	244,671	232,172
เงินกองทุน		
ทุนเริ่มแรก	300,000	300,000
เงินกองทุนสะสม	106,430	85,665
รวมเงินกองทุน	406,430	385,665
รวมหนี้สินและเงินกองทุน	651,101	617,837

งบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จของเงินกองทุนคุ้มครองผู้ลงทุนในหลักทรัพย์สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554 ได้แสดงรายละเอียดไว้ในหมายเหตุประกอบงบการเงินข้อ 23 “ผลการดำเนินงานของเงินกองทุน”

23. ผลการดำเนินงานของเงินกองทุน

ผลการดำเนินงานของเงินกองทุนต่างๆ ที่ได้รวมเป็นส่วนหนึ่งของงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จรวม และงบรายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ แยกแสดงได้ดังนี้

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม			
	เงินกองทุน เพื่อการ สงเคราะห์ ด้านสวัสดิการ พนักงาน	เงินกองทุน คุ้มครอง ผู้ลงทุน ในหลักทรัพย์ (ส่วนของตลาด หลักทรัพย์ฯ)	เงินกองทุน ทั่วไป	รวม
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555				
รายได้				
รายได้จากการดำเนินงาน	-	-	3,364,915	3,364,915
รายได้จากเงินลงทุน - สุทธิ	1,990	14,185	980,191	996,366
รายได้อื่น	-	-	180,004	180,004
รวมรายได้	1,990	14,185	4,525,110	4,541,285
ค่าใช้จ่าย				
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงาน	-	102	2,598,962	2,599,064
เงินบริจาคแก่มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	-	-	453,634	453,634
ภาษีเงินได้	-	-	126,354	126,354
รวมค่าใช้จ่าย	-	102	3,178,950	3,179,052
รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่าย	1,990	14,083	1,346,160	1,362,233
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จอื่น - สินทรัพย์ทางการเงินเพื่อขาย	-	6,682	247,720	254,402
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จรวม	1,990	20,765	1,593,880	1,616,635
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554				
รายได้				
รายได้จากการดำเนินงาน	-	-	3,244,912	3,244,912
รายได้จากเงินลงทุน - สุทธิ	1,720	13,484	750,532	765,736
รายได้อื่น	-	-	160,956	160,956
รวมรายได้	1,720	13,484	4,156,400	4,171,604
ค่าใช้จ่าย				
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงาน	-	116	2,545,208	2,545,324
เงินบริจาคแก่มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	-	-	358,937	358,937
ภาษีเงินได้	-	-	157,680	157,680
รวมค่าใช้จ่าย	-	116	3,061,825	3,061,941
รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่าย	1,720	13,368	1,094,575	1,109,663
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จอื่น - สินทรัพย์ทางการเงินเพื่อขาย	-	(1,113)	(359,381)	(360,494)
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จรวม	1,720	12,255	735,194	749,169

(หน่วย : พันบาท)

	เฉพาะตลาดหลักทรัพย์			
	เงินกองทุน เพื่อการ สงเคราะห์ ด้านสวัสดิการ พนักงาน	เงินกองทุน คุ้มครอง ผู้ลงทุน ในหลักทรัพย์ (ส่วนของตลาด หลักทรัพย์ฯ)	เงินกองทุน ทั่วไป	รวม
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555				
รายได้				
รายได้จากการดำเนินงาน	-	-	1,330,239	1,330,239
รายได้จากเงินลงทุน - สุทธิ	1,990	14,185	1,254,123	1,270,298
รายได้อื่น	-	-	1,489,015	1,489,015
รวมรายได้	1,990	14,185	4,073,377	4,089,552
ค่าใช้จ่าย				
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงาน	-	102	2,396,876	2,396,978
เงินบริจาคแก่มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	-	-	453,634	453,634
รวมค่าใช้จ่าย	-	102	2,850,510	2,850,612
รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่าย	1,990	14,083	1,222,867	1,238,940
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จอื่น - สินทรัพย์ทางการเงินเพื่อขาย	-	6,682	247,086	253,768
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จรวม	1,990	20,765	1,469,953	1,492,708
สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2554				
รายได้				
รายได้จากการดำเนินงาน	-	-	1,202,854	1,202,854
รายได้จากเงินลงทุน - สุทธิ	1,720	13,484	860,045	875,249
รายได้อื่น	-	-	1,489,503	1,489,503
รวมรายได้	1,720	13,484	3,552,402	3,567,606
ค่าใช้จ่าย				
ค่าใช้จ่ายในการดำเนินงาน	-	116	2,341,400	2,341,516
เงินบริจาคแก่มูลนิธิตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	-	-	358,937	358,937
รวมค่าใช้จ่าย	-	116	2,700,337	2,700,453
รายได้สูงกว่าค่าใช้จ่าย	1,720	13,368	852,065	867,153
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จอื่น - สินทรัพย์ทางการเงินเพื่อขาย	-	(1,113)	(358,870)	(359,983)
รายได้และค่าใช้จ่ายเบ็ดเสร็จรวม	1,720	12,255	493,195	507,170

24. รายได้จากการดำเนินงาน

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
ค่าธรรมเนียมการซื้อขายหลักทรัพย์	1,113,290	1,134,191	792,468	719,227
รายได้จากงานนายทะเบียนหลักทรัพย์	645,182	620,645	-	-
รายได้จากการบริการบริษัทหลักทรัพย์	371,564	351,905	-	-
รายได้จากงานชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์	331,742	339,398	-	-
ค่าธรรมเนียมหลักทรัพย์จดทะเบียน	313,994	280,094	313,994	280,094
รายได้จากงานรับฝากหลักทรัพย์	188,903	136,691	-	-
ค่าบริการข้อมูล	183,923	172,473	151,603	140,740
ค่าธรรมเนียมสมาชิก	112,549	119,821	22,800	23,200
รายได้จากงานนายทะเบียนกองทุน	54,394	50,101	-	-
ค่าสนับสนุนงานเทคโนโลยีสารสนเทศ	49,374	39,593	49,374	39,593
	3,364,915	3,244,912	1,330,239	1,202,854

25. รายได้จากเงินลงทุน - สุทธิ

(หน่วย : พันบาท)

หมายเหตุ	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
ดอกเบี้ยรับ	687,797	478,508	412,586	304,333
หัก ดอกเบี้ยจ่าย				
เงินกู้ยืมระยะสั้นจากกิจการย่อย	6	-	(17,591)	(11,177)
ทรัพย์สินเพื่อความมั่นคงส่วนของสมาชิก		(248,016)	-	-
อื่นๆ		(395)	-	(395)
ดอกเบี้ยรับ - สุทธิ	439,781	329,423	394,995	292,761
รายได้เงินปันผลจาก				
กองทุนรวม	330,051	301,087	329,827	300,867
กิจการย่อย	11	-	315,799	134,400
กิจการที่ควบคุมร่วมกัน	12	5,874	15,874	14,879
กิจการอื่น		2,168	2,168	1,735
กำไรที่เกิดขึ้นจริงจากเงินลงทุน	180,614	125,073	174,409	122,766
กำไร(ขาดทุน)ที่ยังไม่เกิดขึ้นจริงจากเงินลงทุน	5,827	(9,344)	5,175	(5,479)
กลับรายการ(ขาดทุน)จากการด้อยค่า	17,866	(164)	17,866	(164)
	982,181	752,252	1,256,113	861,765

26. รายได้อื่น

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
รายได้จากการเผยแพร่ความรู้การลงทุน	32,015	41,318	32,015	41,318
รายได้จากการจัดกิจกรรมทางการตลาด	26,082	4,420	26,082	4,420
รายได้ค่าธรรมเนียมบริหารและจัดการกองทุน	20,552	24,385	-	6,266
รายได้ค่าบริการ	14,688	14,254	1,389,745	1,393,847
รายได้ค่าเช่าและสาธารณูปโภค	12,538	11,689	12,538	11,689
รายได้ค่าปรับ	9,962	8,763	5,036	6,903
รายได้อื่น	35,725	32,602	23,599	25,060
	151,562	137,431	1,489,015	1,489,503

27. ค่าใช้จ่ายผลประโยชน์ตอบแทนพนักงาน

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
ผู้บริหารสำคัญ				
เงินเดือนและผลประโยชน์อื่นๆ	151,844	149,122	151,844	149,122
เงินสมทบกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ	12,260	12,000	12,260	12,000
	164,104	161,122	164,104	161,122
พนักงานอื่นๆ				
เงินเดือนและผลประโยชน์อื่นๆ	865,742	886,352	865,806	886,395
เงินสมทบกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ	54,415	54,124	54,415	54,124
	920,157	940,476	920,221	940,519
	1,084,261	1,101,598	1,084,325	1,101,641

กลุ่มกิจการได้จัดตั้งกองทุนสำรองเลี้ยงชีพสำหรับพนักงานของกลุ่มกิจการบนพื้นฐานความสมัครใจของพนักงานในการเป็นสมาชิกของกองทุน โดยพนักงานจ่ายเงินสะสมในอัตราร้อยละ 3.00 ถึงร้อยละ 10.00 ของเงินเดือนทุกเดือน และกลุ่มกิจการจ่ายสมทบในอัตราร้อยละ 10.00 ของเงินเดือนของพนักงานทุกเดือน กองทุนสำรองเลี้ยงชีพนี้ได้จดทะเบียนเป็นกองทุนสำรองเลี้ยงชีพตามข้อกำหนดของกระทรวงการคลังและจัดการกองทุนโดยผู้จัดการกองทุนที่ได้รับอนุญาตแห่งหนึ่ง

28. เงินอุดหนุนให้แก่สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ก.ล.ต.)

พระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. 2535 กำหนดให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ จ่ายเงินอุดหนุนให้แก่สำนักงาน ก.ล.ต. (“สำนักงาน”) ตามอัตราที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. กำหนด

ในปี พ.ศ. 2554 คณะกรรมการ ก.ล.ต. มีมติให้เรียกเก็บเงินอุดหนุนจากตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยมีหลักเกณฑ์การเรียกเก็บสำหรับปี พ.ศ. 2554 ถึงปี พ.ศ. 2556 (ระยะเวลา 3 ปี) ดังนี้

- 1. เรียกเก็บในอัตราร้อยละ 0.002 ของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ของปีที่เรียกเก็บ
 - 2. เรียกเก็บจากส่วนของผู้ถือหุ้นของบริษัทจดทะเบียนที่ไม่เคยขออนุญาตเสนอขายหลักทรัพย์ต่อสำนักงานในอัตราเดียวกับที่สำนักงานเรียกค่าธรรมเนียมจากบริษัทจดทะเบียนที่มีหน้าที่จัดทำและส่งรายงานตามมาตรา 56 แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ โดยอัตราการจัดเก็บค่าธรรมเนียมจากบริษัทจดทะเบียนสำหรับปี พ.ศ. 2554 และ พ.ศ. 2555 เป็นร้อยละ 50 และร้อยละ 70 ของจำนวนค่าธรรมเนียมที่คำนวณได้ ตามลำดับ หลังจากนั้นจึงค่อยเก็บเต็มจำนวนที่คำนวณได้
- อย่างไรก็ตาม หากในช่วงระยะเวลาดังกล่าวมีเหตุการณ์เปลี่ยนแปลงหรือมีปัญหาจากการดำเนินการ อาจมีการทบทวนหลักเกณฑ์และเงื่อนไขข้างต้นได้

นอกจากนี้คณะกรรมการ ก.ล.ต. ยังมีมติให้เรียกเก็บค่าธรรมเนียมจากบริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) (เดิมชื่อ “บริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)”) สำหรับการประกอบกิจการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าโดยกำหนดอัตราค่าธรรมเนียมสำหรับปี พ.ศ. 2554 - พ.ศ. 2556 ในอัตราคงที่ปีละ 2 ล้านบาท

29. ค่าใช้จ่ายอื่น

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
ค่าธรรมเนียมและค่าตอบแทน	75,877	56,721	72,312	54,363
ค่าใช้จ่ายเดินทางและพาหนะ	33,877	36,003	33,877	36,003
เงินสนับสนุนสถาบันที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจหลักทรัพย์	21,421	27,778	21,421	27,875
ค่าธรรมเนียมการเป็นสมาชิกสถาบันต่างๆ	3,599	3,561	2,958	3,192
ค่าใช้จ่ายในการประชุม	3,222	3,940	3,222	3,940
ค่ารับรอง	2,280	3,214	2,280	3,214
ขาดทุนจากการดัดจำหน่ายสินทรัพย์	19	5,583	-	5,527
ค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องเนื่องจากเหตุการณ์น้ำท่วม	-	14,163	-	14,163
ค่าใช้จ่ายอื่น	19,292	25,342	18,847	18,725
	159,587	176,305	154,917	167,002

30. การผูกพันกับบุคคลหรือกิจการที่ไม่เกี่ยวข้องกัน

(หน่วย : พันบาท)

	งบการเงินรวม		เฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ	
	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554	พ.ศ. 2555	พ.ศ. 2554
การผูกพันสำหรับรายจ่ายฝ่ายคุณ				
คอมพิวเตอร์และโปรแกรมคอมพิวเตอร์	174,195	42,325	174,195	42,325
อาคารและสิ่งปลูกสร้างอื่น	16,759	2,712	16,759	2,712
	190,954	45,037	190,954	45,037
การผูกพันตามสัญญาเช่าดำเนินงานที่ยกเลิกไม่ได้				
ภายในหนึ่งปี	11,266	11,715	11,266	11,715
หลังจากหนึ่งปีแต่ไม่เกินห้าปี	22,440	21,263	22,440	21,263
	33,706	32,978	33,706	32,978
การผูกพันตามสัญญาเช่าที่ดิน				
ภายในหนึ่งปี	13,525	13,525	13,525	13,525
หลังจากหนึ่งปีแต่ไม่เกินห้าปี	56,254	54,100	56,254	54,100
เกิน 5 ปี	174,673	190,352	174,673	190,352
	244,452	257,977	244,452	257,977
การผูกพันสำหรับค่าใช้จ่ายในการดูแลระบบงานเทคโนโลยี				
ภายในหนึ่งปี	75,251	25,466	75,251	25,466
หลังจากหนึ่งปีแต่ไม่เกินห้าปี	215,597	58,889	215,597	58,889
เกิน 5 ปี	66,274	-	66,274	-
	357,122	84,355	357,122	84,355

นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีข้อผูกพันจากการเข้าทำสัญญาซื้อหน่วยลงทุนในกองทุนรวมเฉพาะกิจจำนวน 2 กองทุน (หมายเหตุ 14) ได้แก่

1. กองทุนรวมที่เน้นลงทุน โดยตรงในกิจการที่เกี่ยวข้องกับพลังงาน พลังงานทดแทนหรือธุรกิจที่สนับสนุนนโยบายของภาครัฐที่เกี่ยวข้องกับพลังงาน โดยบริษัทจัดการกองทุนอาจมีการเรียกชำระเงินเพิ่มเติมจากตลาดหลักทรัพย์ฯ จำนวน 18.4 ล้านบาท เว้นแต่ได้รับการเรียกชำระครบตามจำนวนเงินผูกพันจองซื้อหรือสิ้นสุดของระยะเวลาของสัญญาที่ 10 ปี (วันที่ 3 สิงหาคม พ.ศ. 2560)
2. กองทุนรวมที่ต้องการลงทุนในธุรกิจและอุตสาหกรรมที่มีแนวโน้มการเจริญเติบโต กำหนดระยะเวลาการลงทุนที่มีข้อผูกพันในการจองซื้อภายใน 4 ปีแรก ซึ่งได้สิ้นสุดลงในวันที่ 11 สิงหาคม พ.ศ. 2555 (พ.ศ. 2554 : ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีข้อผูกพันจำนวน 6.9 ล้านบาท แต่ไม่เกินจำนวน 30.0 ล้านบาท)

31. หนี้สินที่อาจเกิดขึ้นและสินทรัพย์ที่อาจเกิดขึ้น

31.1 สินทรัพย์ที่อาจเกิดขึ้น

31.1.1 ตลาดหลักทรัพย์ฯ

ในระหว่างปี พ.ศ. 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ เป็นโจทก์ฟ้องกลุ่มบริษัทประกันภัย เพื่อเรียกร้องค่าสินไหมทดแทนกรณีผิดสัญญาประกันภัย เป็นจำนวนเงิน 123 ล้านบาท พร้อมดอกเบี้ยร้อยละ 7.50 ต่อปี โดย ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 คดีอยู่ระหว่างการพิจารณาของศาลแพ่ง และผลสุดท้ายของคดียังไม่สามารถประเมินได้อย่างสมเหตุสมผลในปัจจุบัน ดังนั้นตลาดหลักทรัพย์ฯ จึงไม่ได้บันทึกรายได้ดังกล่าวในงบการเงินสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555

31.1.2 กิจการที่ควบคุมร่วมกัน

ในปี พ.ศ. 2552 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้มีการปรับโครงสร้างธุรกิจของบริษัท แฟมมิลี โนวา จำกัด “แฟมมิลี โนวา” โดยการเข้าร่วมทุนกับบริษัทแห่งหนึ่ง ซึ่งจะถือหุ้นในแฟมมิลี โนวา ในอัตราร้อยละ 49.99 ของทุนจดทะเบียน โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ ถือหุ้นบุริมสิทธิจำนวน 2,500,000 หุ้น และบริษัทดังกล่าวถือหุ้นสามัญจำนวน 2,500,000 หุ้น ในช่วงระยะเวลาบัญชีระหว่างวันที่ 1 มกราคม พ.ศ. 2553 ถึงวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 หุ้นบุริมสิทธิจะมีสิทธิได้รับเงินปันผลก่อนหุ้นสามัญจากผลประกอบการของแฟมมิลี โนวา โดยได้รับในอัตราร้อยละ 10 ของกำไรสุทธิของแฟมมิลี โนวาก่อนหักทุนสำรองตามกฎหมาย และได้รับเงินปันผลจากกำไรสุทธิส่วนที่เหลือตามสัดส่วนการถือหุ้นในแฟมมิลี โนวา และเมื่อพ้นระยะเวลาดังกล่าวแล้ว หุ้นทุกหุ้นจะมีสิทธิ หน้าที่ และสถานะเท่าเทียมกันทุกประการ

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้บันทึกรายได้เงินปันผลค้างรับในอัตราร้อยละ 10 ของกำไรสุทธิของแฟมมิลี โนวา สำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 เป็นจำนวนเงิน 5.87 ล้านบาท (พ.ศ. 2554 : 4.44 ล้านบาท)

31.2 หนี้สินที่อาจเกิดขึ้น

31.2.1 ตลาดหลักทรัพย์ฯ

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีภาระเกี่ยวกับหนังสือค้ำประกันกับธนาคารเป็นจำนวนเงินรวม 4.40 ล้านบาท (พ.ศ. 2554 : 4.40 ล้านบาท) เพื่อค้ำประกันการใช้ไฟฟ้าในการดำเนินธุรกิจตามปกติ ซึ่งผู้บริหารคาดว่าจะไม่มีหนี้สินที่มีภาระสำคัญเกิดขึ้น

ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ออกหนังสือรับทราบภาระหนี้สิน (Letter of Comfort) กับธนาคารเกี่ยวกับวงเงินเบิกเกินบัญชีที่ให้กับบริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด “สำนักหักบัญชี” ซึ่งเป็นกิจการย่อยแห่งหนึ่งในวงเงิน 2,400 ล้านบาท (พ.ศ. 2554 : 2,400 ล้านบาท) เพื่อรองรับงานชำระราคาหลักทรัพย์ตราสารทุนและตราสารอนุพันธ์ โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ รับรองว่าจะดำรงสัดส่วนการถือหุ้นในสำนักหักบัญชีในอัตราร้อยละ 99.99 ของทุนจดทะเบียน จนกระทั่งวันสิ้นสุดของระยะเวลาการให้สินเชื่อ นอกจากนี้ ตลาดหลักทรัพย์ฯ ยังต้องให้การสนับสนุนการดำเนินงานของสำนักหักบัญชีเพื่อให้สำนักหักบัญชีมีความสามารถในการชำระหนี้แก่ธนาคาร ทั้งนี้ ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 สำนักหักบัญชียังไม่มีภาระเบิกใช้วงเงินดังกล่าว

31.2.2 กิจการย่อย

ในระหว่างปี พ.ศ. 2552 กิจการย่อยแห่งหนึ่งถูกฟ้องเป็นจำเลยร่วมกับบุคคลและนิติบุคคลอื่นในคดีละเมิดเรียกทรัพย์สินคืนและค่าเสียหายที่เกี่ยวข้องกับการปลอมแปลงใบหุ้นสามัญ โดยถูกเรียกร้องให้ร่วมกันชดเชยค่าเสียหายเป็นจำนวนเงินรวม 223 ล้านบาท โดยในปี พ.ศ. 2554 ศาลแพ่งได้พิจารณาฟ้องจำเลยที่เป็นกิจการย่อย ทั้งนี้ ผลของคดียังไม่สิ้นสุด เนื่องจากฝ่ายโจทก์ได้ยื่นอุทธรณ์คำพิพากษาคดีจึงอยู่ในระหว่างการพิจารณาของศาลอุทธรณ์ ผู้บริหารของกิจการย่อยดังกล่าวได้ประเมินสถานะในปัจจุบันของคดีและคาดว่าจะไม่เกิดผลเสียหายอย่างเป็นสาระสำคัญจากเรื่องดังกล่าว ดังนั้น กิจการย่อยดังกล่าวจึงไม่ได้บันทึกค่าเสียหายดังกล่าวในงบการเงินสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554

กลุ่มกิจการยังมีคดีความตามกฎหมายที่ค้างอยู่กับบุคคลภายนอกจากการดำเนินงานตามปกติของกลุ่มกิจการ ซึ่งตามความเห็นของผู้บริหารประกอบกับข้อเท็จจริงในขณะนี้ คาดว่าผลของคดีความดังกล่าวจะไม่เกิดผลเสียหายอย่างเป็นสาระสำคัญ

32. วิกฤตจากการตัดจำหน่ายสินทรัพย์ที่เสียหายจากเหตุเพลิงไหม้

เมื่อวันที่ 19 พฤษภาคม พ.ศ. 2553 ได้เกิดเหตุเพลิงไหม้ อาคารสำนักงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ อันเป็นผลสืบเนื่องมาจากเหตุการณ์การชุมนุมทางการเมือง และทำให้อาคารสำนักงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ และอุปกรณ์สำนักงานบางส่วนได้รับความเสียหาย

ณ วันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2553 กลุ่มกิจการได้รับรู้มูลค่าความเสียหายของทรัพย์สินตามมูลค่าทางบัญชี จำนวน 22.9 ล้านบาท และ 22.1 ล้านบาท ในงบการเงินรวมและงบการเงินเฉพาะตลาดหลักทรัพย์ฯ ตามลำดับ

กลุ่มกิจการได้ทำประกันความเสี่ยงภัยทรัพย์สินแบบประกันความเสี่ยงภัยทุกชนิด โดยมีความคุ้มครองทรัพย์สินที่เอาประกันภัย ทั้งสิ่งปลูกสร้างและอุปกรณ์สำนักงาน ซึ่งปัจจุบันอยู่ระหว่างการดำเนินการเรียกร้องค่าสินไหมทดแทนกับบริษัทประกันภัย (หมายเหตุ 31.1) โดยกลุ่มกิจการยังไม่ได้รับรู้ค่าชดเชยดังกล่าวในงบการเงินสำหรับปีสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม พ.ศ. 2555 และ พ.ศ. 2554

บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน): TFEX เดิมชื่อ บริษัท ตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) โดยเริ่มใช้ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2556 เป็นต้นไป เพื่อให้สอดคล้องกับชื่อพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 ขณะเดียวกัน ได้ปรับตราสัญลักษณ์ให้สอดคล้องตราสัญลักษณ์ของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เพื่อสะท้อนถึงความเชื่อมโยงกันของกลุ่มตลาดหลักทรัพย์ฯ ในการร่วมกันสานโอกาสการลงทุนอย่างลงตัว เริ่มใช้ตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2556 เช่นเดียวกัน

บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เป็นบริษัทย่อยของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย จัดตั้งขึ้นเมื่อวันที่ 17 พฤษภาคม 2547 เพื่อดำเนินการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตามพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 และได้รับใบอนุญาตการเป็นศูนย์ซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าจากสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ก.ล.ต.) เมื่อวันที่ 11 กุมภาพันธ์ 2548

ลักษณะการดำเนินงาน

บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เป็นศูนย์กลางการซื้อขายอนุพันธ์เกี่ยวกับตราสารทุน ตราสารหนี้ และสินค้าโภคภัณฑ์ประเภทอื่นๆ ภายใต้พระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า โดยมีสำนักงานคณะกรรมการ ก.ล.ต. เป็นหน่วยงานกำกับดูแลสินค้าที่สามารถจัดให้มีการซื้อขายได้ตามที่กำหนดในพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. 2546 คือ ฟิวเจอร์ส (futures) ออปชั่น (options) และออปชั่นบนสัญญาฟิวเจอร์ส (options on futures) ของสินทรัพย์อ้างอิงประเภทต่างๆ ได้แก่

- อ้างอิงกับตราสารทุน ได้แก่ ดัชนีราคาหลักทรัพย์ หลักทรัพย์
- อ้างอิงกับตราสารหนี้ ได้แก่ พันธบัตรรัฐบาล อัตราดอกเบี้ย
- อ้างอิงกับราคาหรือดัชนีราคาอื่นๆ ได้แก่ ทองคำ น้ำมันดิบ อัตราแลกเปลี่ยน หรืออื่นๆ ตามที่คณะกรรมการ ก.ล.ต. ประกาศโดยกำหนดให้บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า มีเป้าหมายหลักในการดำเนินธุรกิจ โดยมุ่งเน้นให้เกิดคุณค่าและประโยชน์แก่ผู้ลงทุนและผู้ที่เกี่ยวข้อง ดังนี้
 - เป็นศูนย์กลางการซื้อขายอนุพันธ์ที่มีมาตรฐานและมีประสิทธิภาพ ทำให้ผู้ลงทุนและผู้ประกอบการในธุรกิจ สามารถใช้เป็นเครื่องมือบริหารความเสี่ยง (hedging instruments) ในการบริหารเงินลงทุนและธุรกิจของตนได้อย่างมีประสิทธิภาพ และมีต้นทุนที่สมเหตุสมผล
 - เป็นทางเลือกของการลงทุน ภายใต้ระบบการซื้อขายที่มีความยุติธรรม โปร่งใส และมีสภาพคล่อง รวมทั้งมั่นใจในระบบการชำระราคาสำหรับทุกธุรกรรมที่เกิดขึ้นในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่จะมีสำนักหักบัญชีที่มีความมั่นคงเป็นคู่สัญญา
 - ให้ผู้ลงทุนมีแหล่งข้อมูลที่สะท้อนความคาดหวังของผู้ที่อยู่ในตลาดที่มีต่อราคาหลักทรัพย์ในอนาคต ส่งผลให้ผู้ลงทุนและผู้ประกอบการสามารถวางแผนการดำเนินงานได้อย่างมีประสิทธิภาพ

ทุนจดทะเบียนและโครงสร้างการถือหุ้น

บริษัท ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) มีทุนจดทะเบียนทั้งสิ้น 100 ล้านบาท โดยมีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เป็นผู้ถือหุ้นร้อยละ 99.99 ของทุนจดทะเบียน

รายนามคณะกรรมการ

นายสมพล	เกียรติไพบูลย์	ประธานกรรมการ
นายจรัมพร	โชติคเสถียร	รองประธานกรรมการ
นางชนิสรา	ชุติภัทร์	กรรมการ
นายชัยภัทร	ศรีวิสารวาจา	กรรมการ
นางภัทธีรา	ดิลกรุ่งธีระภพ	กรรมการ
ดร.ภากร	ปิตรวิชัย	กรรมการ
นายสุเทพ	พิटकานนท์	กรรมการ
นางสาวโสภาวดี	เลิศมนัสชัย	กรรมการ
นางเกศรา	มัญชุศรี	กรรมการผู้จัดการ

บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด

บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด เป็นบริษัทย่อยของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย จัดตั้งขึ้นเมื่อวันที่ 16 พฤศจิกายน 2537 และเปิดดำเนินการเมื่อวันที่ 1 มกราคม 2538 โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อพัฒนาและส่งเสริมการให้บริการที่ต่อเนื่องจากการซื้อขายหลักทรัพย์ของตลาดทุนไทยให้มีประสิทธิภาพสูงสุดและได้มาตรฐานสากล

ลักษณะการดำเนินงาน

บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ฯ เป็นศูนย์กลางในการให้บริการที่ต่อเนื่องจากการซื้อขายหลักทรัพย์อย่างครบวงจร โดยมีบริการ 3 ประเภทหลัก ดังนี้

- ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ เป็นศูนย์กลางในการรับฝากหลักทรัพย์ไว้ในระบบไร้ใบหลักทรัพย์ทั้งตราสารทุน และตราสารหนี้ที่ปลอดภัยและมีประสิทธิภาพ โดยมีบริการรับฝากหลักทรัพย์ ถอนหลักทรัพย์ โอนหลักทรัพย์ จำนำ และเพิกถอนจำนำหลักทรัพย์ ซึ่งผู้ลงทุนสามารถทำการเหล่านี้ผ่านบริษัทสมาชิกผู้ฝากหลักทรัพย์ (participant) รวมทั้งทำหน้าที่ในการควบคุมสัดส่วนการถือครองหลักทรัพย์ของผู้ลงทุนต่างชาติที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์ฯ ให้เป็นไปตามกฎและข้อบังคับที่เกี่ยวข้อง
- นายทะเบียนหลักทรัพย์ ให้บริการนายทะเบียนหลักทรัพย์ ทำหน้าที่ในการดูแลและรักษาข้อมูลหลักทรัพย์ และจัดทำทะเบียนผู้ถือหลักทรัพย์ให้มีความถูกต้อง ครบถ้วน เป็นปัจจุบันอยู่เสมอ โดยใช้ระบบคอมพิวเตอร์ที่ทันสมัยและมีประสิทธิภาพเชื่อมโยงกับระบบงานรับฝากหลักทรัพย์ นอกจากนี้ ยังมีระบบการเก็บรักษา รวบรวมและประมวลผลข้อมูลในทะเบียนหลักทรัพย์ ตลอดจนระบบสำรองกรณีระบบหลักไม่สามารถใช้งานได้ และมีระบบห้องมั่นคงเพื่อจัดเก็บใบหลักทรัพย์และเอกสารสิทธิต่างๆ ให้ปลอดภัย ระบบบริหารข้อมูลสิทธิประโยชน์ของผู้ถือหุ้นและระบบตรวจสอบกิจการภายในเพื่อลดความเสี่ยงด้านต่างๆ
- งานทะเบียนสมาชิกกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ โดยงานทะเบียนสมาชิกกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ให้บริการงานทะเบียนสมาชิกแบบครบวงจร เริ่มตั้งแต่การติดตามนายจ้างเพื่อส่งเงินสะสม และเงินสมทบเข้ากองทุน จัดทำบัญชีทะเบียนรายชื่อสมาชิก การบันทึกจำนวนเงินและจำนวนหน่วยของเงินสะสม เงินสมทบ เงินประเดิม / เงินรับโอน (ถ้ามี) และคำนวณผลประโยชน์ที่เกิดขึ้นจากการลงทุนให้แก่สมาชิกแต่ละราย การจ่ายเงินออกจากกองทุนให้แก่สมาชิก หรือผู้รับผลประโยชน์ กรณีที่สมาชิกสิ้นสมาชิกภาพ พร้อมกับคำนวณภาษีหัก ณ ที่จ่าย (ถ้ามี) เพื่อนำส่งสรรพากร รวมทั้งจัดส่งใบรับรอง / ใบแจ้งยอดเงินสมาชิกกองทุนสำรองเลี้ยงชีพรายบุคคลทุกงวด 6 เดือนของปีปฏิทิน ส่งให้สมาชิกทุกรายผ่านคณะกรรมการกองทุน

ทุนจดทะเบียนและการจัดองค์กร

บริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ฯ มีทุนจดทะเบียนทั้งสิ้น 200 ล้านบาท โดยมีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ถือหุ้นร้อยละ 99.99 ของทุนจดทะเบียน

รายนามคณะกรรมการ

นายจรัมพร	โชติกเสถียร	ประธานกรรมการ
นางเกศรา	มัญชุศรี	กรรมการ
นางชนิสรา	ชุตินันท์	กรรมการ
ดร.ภากร	ปิตธวัชชัย	กรรมการ
นายศักรินทร์	ร่วมรังษี	กรรมการ
นางอุดมวรา	เดชสงจรัส	กรรมการ

บริษัท ไทยเอ็นวีดีอาร์ จำกัด

บริษัท ไทยเอ็นวีดีอาร์ จำกัด จัดตั้งเมื่อวันที่ 4 ตุลาคม 2543 มีทุนจดทะเบียนชำระแล้วทั้งสิ้น 10 ล้านบาท โดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยถือหุ้นร้อยละ 99.99 ของทุนจดทะเบียน บริษัทประกอบธุรกิจโดยการออกไปแสดงสิทธิในผลประโยชน์ที่เกิดจากหลักทรัพย์อ้างอิงไทย (Non-Voting Depositary Receipt: NVDR) เพื่อขายให้แก่ผู้ลงทุน

ลักษณะการดำเนินงาน

บริษัท ไทยเอ็นวีดีอาร์ จำกัด ประกอบธุรกิจโดยการออกตราสารเอ็นวีดีอาร์ ซึ่งเป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์โดยอัตโนมัติเพื่อขายให้แก่ผู้ลงทุน และนำเงินได้จากการขายเอ็นวีดีอาร์ไปลงทุนในหลักทรัพย์อ้างอิงไทยที่เป็นหลักทรัพย์จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ โดยผู้ลงทุนที่ถือเอ็นวีดีอาร์สามารถรับสิทธิประโยชน์ทางการเงิน (financial benefit) ได้เสมือนลงทุนในหุ้นของบริษัทจดทะเบียนทุกประการไม่ว่าจะเป็นเงินปันผล สิทธิในการจองซื้อหุ้นเพิ่มทุนหรือใบสำคัญแสดงสิทธิในการซื้อหุ้นสามัญ (warrants) แต่ไม่มีสิทธิในการออกเสียงในที่ประชุมผู้ถือหุ้น

ทุนจดทะเบียนและการจัดองค์กร

บริษัท ไทยเอ็นวีดีอาร์ จำกัด มีทุนจดทะเบียนทั้งสิ้น 10 ล้านบาท โดยมีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ถือหุ้นร้อยละ 99.99 ของทุนจดทะเบียน

รายนามคณะกรรมการ

นายจรัมพร	โชติคเสถียร	ประธานกรรมการ
นางชนิสรา	ชุติภัทร์	กรรมการ
ดร.ภากร	ปัทมวิชัย	กรรมการ
นายศกรินทร์	ร่วมรังษี	กรรมการ
นางอุทุมมวรา	เดชสงจรัส	กรรมการ

บริษัท เช็ทเทรด ดอก คอม จำกัด

บริษัท เช็ทเทรด ดอก คอม จำกัด จัดตั้งขึ้นโดยตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เมื่อวันที่ 13 ตุลาคม 2543 และเปิดดำเนินการเมื่อวันที่ 3 พฤศจิกายน 2543 มีวัตถุประสงค์เพื่อทำหน้าที่ให้บริการระบบซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านอินเทอร์เน็ต และเทคโนโลยีการลงทุนแก่บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อเพิ่มช่องทางการส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ และอำนวยความสะดวกแก่ผู้ลงทุน

ลักษณะการดำเนินงาน

บริษัท เช็ทเทรด ดอก คอม จำกัด ทำหน้าที่ให้บริการระบบซื้อขายหลักทรัพย์และอนุพันธ์ผ่านอินเทอร์เน็ต รวมถึงเทคโนโลยีการลงทุนแก่บริษัทสมาชิกของตลาดหลักทรัพย์ฯ และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เพื่อเพิ่มช่องทางการส่งคำสั่งซื้อขายและอำนวยความสะดวกแก่ผู้ลงทุน รวมทั้งพัฒนาระบบงานคอมพิวเตอร์ที่เกี่ยวข้องกับธุรกิจหลักทรัพย์

ทุนจดทะเบียนและการจัดองค์กร

บริษัท เช็ทเทรด ดอก คอม จำกัด มีทุนจดทะเบียนทั้งสิ้น 80 ล้านบาท โดยมีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ถือหุ้นร้อยละ 99.99 ของทุนจดทะเบียน

รายนามคณะกรรมการ

นายจรัมพร	โชติคเสถียร	ประธานกรรมการ
นายเกียรติ	โกสิยเจริญ	กรรมการ
นางเกศรา	มัญชุศรี	กรรมการ
ดร.ภากร	ปัทมวิชัย	กรรมการ
นายศกรินทร์	ร่วมรังษี	กรรมการ

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด

บริษัท สำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) จำกัด ปัจจุบันเป็นบริษัทย่อยของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย จัดตั้งขึ้นเมื่อวันที่ 9 สิงหาคม 2547 โดยเริ่มแรกได้ทำหน้าที่ชำระราคาและส่งมอบตราสารที่ซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (TFEX) ต่อมาเมื่อวันที่ 15 กุมภาพันธ์ 2553 ได้มีการโอนย้ายงานของสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์ จากบริษัท ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ (ประเทศไทย) จำกัด มายังบริษัท สำนักหักบัญชี ทำให้ในปัจจุบันบริษัท สำนักหักบัญชี ได้ทำหน้าที่เป็นศูนย์กลางการชำระราคาและส่งมอบหลักทรัพย์ที่ซื้อขายในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) ตลาดตราสารหนี้ (BEX) ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (TFEX) รวมถึงตราสารหนี้ที่ซื้อขายนอกตลาด (OTC markets) อีกด้วย ซึ่งทำให้เกิดการบริหารงานและการจัดการที่ชัดเจน ลดต้นทุนในการบริหารความเสี่ยงและการวางหลักประกันโดยรวมของสมาชิกและสอดคล้องกับมาตรฐานสากล

ลักษณะการดำเนินงาน

บริษัท สำนักหักบัญชี ทำหน้าที่เป็นศูนย์กลางการชำระราคาและส่งมอบตราสารการเงินในตลาดทุนไทย โดยเข้าแทนที่ป็นคู่สัญญา (Central Counterparty: CCP) และรับประกันการชำระราคาและส่งมอบในทุกๆ รายการซื้อขายที่เกิดขึ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET) ตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ (mai) ตลาดตราสารหนี้ (BEX) และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (TFEX) รวมถึงตราสารหนี้ที่ซื้อขายนอกตลาด (OTC markets) ซึ่งถือเป็นการลดความเสี่ยงจากการซื้อขายโดยรวม รวมทั้งเป็นการเสริมสร้างความเชื่อมั่นในการซื้อขายให้แก่ผู้มีส่วนร่วมในตลาดทุกฝ่าย รวมทั้งส่งเสริมการพัฒนาตลาดทุนไทยในระยะยาว

ทุนจดทะเบียนและการจัดองค์กร

บริษัท สำนักหักบัญชี มีทุนจดทะเบียนทั้งสิ้น 100 ล้านบาท โดยมีตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ถือหุ้นร้อยละ 99.99 ของทุนจดทะเบียน

รายนามคณะกรรมการ

นายจรัมพร	โชติทศเสถียร	ประธานกรรมการ
นางเกศรา	มัญชุศรี	กรรมการ
นางชนิสรา	ชุตติภักดิ์	กรรมการ
ดร.ภากร	ปัทมวิชัย	กรรมการ
นายศักรินทร์	ร่วมรังษี	กรรมการ
นางอุดมวรา	เดชสงจรัส	กรรมการ



กลุ่มตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ร่วมดูแลสิ่งแวดล้อม

ด้วยการเลือกใช้กระดาษที่ผ่านกระบวนการผลิตจากต้นไม้สำหรับผลิตกระดาษโดยเฉพาะ

ซึ่งทุกต้นปลูกโดยการบริหารจัดการป่าไม้แบบยั่งยืนและเป็นมิตรกับสิ่งแวดล้อม จึงช่วยลดปริมาณการใช้เยื่อไม้มากกว่ากระดาษปกติถึง 50% และใช้หมึกที่ผลิตจากเมล็ดถั่วเหลือง (Soy Ink) ในกระบวนการพิมพ์ซึ่งช่วยลดปริมาณก๊าซคาร์บอนไดออกไซด์ได้



ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

सानโอกาสการลงทุน
เพื่อคุณ เพื่อธุรกิจ

62 อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ถนนรัชดาภิเษก เขตคลองเตย กรุงเทพฯ 10110
โทร. 0 2229 2000 โทรสาร 0 2654 5649



www.set.or.th