



กฎบัตรคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง

ของ

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

ได้รับอนุมัติจากที่ประชุมคณะกรรมการบริษัท ครั้งที่ 10/2564 เมื่อวันที่ 15 ธันวาคม 2564
ทบทวนครั้งที่

วันที่มีผลใช้บังคับ 15 ธันวาคม 2564

A handwritten signature in blue ink, appearing to be 'ดร. ณรงค์ชัย อัครเศรณี', is written inside a rectangular box.

(ดร. ณรงค์ชัย อัครเศรณี)

ประธานกรรมการ

สารบัญ

	หน้า
1. คำนิยาม	3
2. วัตถุประสงค์	3
3. องค์ประกอบ คุณสมบัติ และการแต่งตั้ง	3
4. วาระการดำรงตำแหน่ง และการพ้นจากตำแหน่ง	4
5. บทบาท หน้าที่ และความรับผิดชอบ	5
6. อำนาจดำเนินการ	5
7. การประชุม	5
8. การรายงาน	7
9. การประเมินผลการปฏิบัติงาน	7
10. การทบทวนกฎบัตร	7
บันทึกการแก้ไขปรับปรุง	8

กฎบัตรคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง
(Risk Management Committee Charter)

1. คำนิยาม

“บริษัท”	หมายถึง	บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)
“กรรมการ”	หมายถึง	กรรมการบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)
“คณะกรรมการ”	หมายถึง	คณะกรรมการบริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน)

2. วัตถุประสงค์

กฎบัตรคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงจัดทำขึ้นเพื่อใช้เป็นกรอบและแนวทางในการปฏิบัติงานด้านการบริหารความเสี่ยงของบริษัท เพื่อให้สอดคล้องกับหลักการกำกับดูแลกิจกรรมที่ดี หลักการบริหารความเสี่ยงที่เป็นสากล และเชื่อมโยงกับวิสัยทัศน์ ภารกิจ และแผนธุรกิจขององค์กร โดยคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงมีหน้าที่หลักในการจัดทำนโยบายการบริหารความเสี่ยงให้สอดคล้องกับธุรกิจและครอบคลุมความเสี่ยงด้านต่าง ๆ ที่มีนัยสำคัญต่อการดำเนินงานของบริษัท กำหนดแนวทางและเครื่องมือในการบริหารความเสี่ยงให้มีประสิทธิภาพและเหมาะสม บริหารจัดการความเสี่ยงได้อย่างเป็นระบบ รวมทั้งประเมินและกำกับดูแลให้ความเสี่ยงอยู่ในกรอบที่กำหนด และรายงานผลการปฏิบัติงานต่อคณะกรรมการอย่างสม่ำเสมอ ทั้งนี้ เพื่อให้บริษัทมีการบริหารงานที่มีประสิทธิภาพ และสามารถสร้างความเชื่อมั่นให้แก่ผู้มีส่วนได้เสียกลุ่มต่าง ๆ ของบริษัทว่าการดำเนินงานของบริษัทจะบรรลุเป้าหมายได้อย่างมีประสิทธิภาพและประสิทธิผล

3. องค์ประกอบ คุณสมบัติ และการแต่งตั้ง

3.1 ให้คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงประกอบด้วยบุคคลที่มีความรู้ ความสามารถ และประสบการณ์ในสาขาต่าง ๆ ที่เป็นประโยชน์ต่อการบริหารความเสี่ยงด้านต่าง ๆ ที่เกี่ยวข้องกับการดำเนินธุรกิจของบริษัท และมีอย่างน้อย 1 คน มีความรู้หรือประสบการณ์ด้านบัญชี การเงิน หรือการบริหารความเสี่ยง

3.2 ให้คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงประกอบด้วยสมาชิกไม่น้อยกว่า 3 คน โดยให้ประกอบด้วย

- (1) กรรมการที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการอย่างน้อย 1 คน และให้คณะกรรมการแต่งตั้งกรรมการที่ได้รับมอบหมาย 1 คน เป็นประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง

- (2) กรรมการผู้จัดการ หรือบุคคลที่คณะกรรมการมอบหมายให้รักษาการในตำแหน่งกรรมการผู้จัดการ
- (3) ผู้บริหารสูงสุดของฝ่ายบริหารความเสี่ยง โดยให้ทำหน้าที่เลขานุการคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงด้วย

3.3 คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงมีอำนาจในการแต่งตั้งผู้บริหารของบริษัทให้เป็นสมาชิกคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง ตามความจำเป็นและเหมาะสมภายใต้นโยบายการบริหารความเสี่ยงที่ได้รับอนุมัติจากคณะกรรมการ

4. วาระการดำรงตำแหน่ง และการพ้นจากตำแหน่ง

4.1 สมาชิกคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงมีวาระการดำรงตำแหน่งดังนี้

(1) สมาชิกซึ่งเป็นกรรมการที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการตามข้อ 3.2 (1) ให้มีวาระการดำรงตำแหน่งคราวละไม่เกิน 3 ปี โดยให้สอดคล้องกับวาระของการเป็นกรรมการ และเมื่อครบวาระแล้ว หากที่ประชุมผู้ถือหุ้นยังไม่ได้มีมติแต่งตั้งกรรมการใหม่แทนกรรมการที่ครบกำหนดออกตามวาระ ให้กรรมการที่ได้รับมอบหมายท่านเดิมปฏิบัติหน้าที่ต่อไป เว้นแต่คณะกรรมการจะมีมติเป็นอย่างอื่น ทั้งนี้ สมาชิกซึ่งพ้นจากตำแหน่งตามวาระอาจได้รับการแต่งตั้งใหม่อีกก็ได้

ในกรณีที่มิเหตุให้กรรมการที่ได้รับมอบหมายพ้นจากตำแหน่งโดยมิใช่การครบกำหนดออกตามวาระ คณะกรรมการจะต้องแต่งตั้งกรรมการท่านอื่นเป็นกรรมการบริหารความเสี่ยงท่านใหม่ อย่างช้าภายใน 3 เดือนนับแต่วันที่มิจำนวนสมาชิกไม่ครบถ้วน

(2) สมาชิกซึ่งเป็นกรรมการผู้จัดการตามข้อ 3.2 (2) และสมาชิกซึ่งเป็นผู้บริหารสูงสุดของฝ่ายบริหารความเสี่ยงตามข้อ 3.2 (3) ให้มีวาระการดำรงตำแหน่งตามวาระของการเป็นผู้บริหารในตำแหน่งดังกล่าว

4.2 สมาชิกคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงพ้นจากตำแหน่งเมื่อ

- ครบกำหนดตามวาระ
- พ้นจากตำแหน่งกรรมการหรือพ้นจากการเป็นพนักงานของบริษัท
- ลาออก
- ถึงแก่กรรม
- คณะกรรมการมีมติให้พ้นจากตำแหน่ง
- คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงมีมติให้สมาชิกที่ได้รับแต่งตั้งตามข้อ 3.3 พ้นจากตำแหน่ง

4.3 สมาชิกคนใดจะลาออกจากตำแหน่ง ให้ยื่นหนังสือลาออกต่อบริษัท พร้อมระบุเหตุผล การลาออกมีผลนับแต่วันที่บริษัทได้รับหนังสือลาออก

5. บทบาท หน้าที่ และความรับผิดชอบ

5.1 พิจารณาเห็นชอบนโยบายการบริหารความเสี่ยงของบริษัท และให้นำเสนอคณะกรรมการเพื่ออนุมัติ โดยครอบคลุมความเสี่ยงด้านกลยุทธ์ การลงทุน การปฏิบัติงาน การเงิน การปฏิบัติตามกฎเกณฑ์ การปฏิบัติต่อ สังคมและสิ่งแวดล้อม ความเสี่ยงที่เกิดขึ้นใหม่ (Emerging Risk) หรือความเสี่ยงอื่น ๆ ที่มีนัยสำคัญต่อการ ดำเนินงานของบริษัท

5.2 พิจารณาเห็นชอบกลยุทธ์ แผนงาน และทรัพยากรที่ใช้ในการบริหารความเสี่ยงให้สอดคล้องกับนโยบาย การบริหารความเสี่ยงของบริษัท โดยสามารถวิเคราะห์ ประเมิน วัดผล และติดตามกระบวนการบริหารความเสี่ยงได้ อย่างมีประสิทธิภาพ

5.3 พิจารณาอนุมัตินโยบาย แนวทาง และเครื่องมือในการบริหารความเสี่ยงของกองทุนและการ ปฏิบัติงาน ให้มีประสิทธิภาพ เหมาะสมกับลักษณะและขนาดความเสี่ยงแต่ละด้านของธุรกรรมที่บริษัทดำเนินการ ตลอดจนติดตามและจัดการประเด็นความเสี่ยง

5.4 พิจารณาอนุมัติการกำหนดเพดานความเสี่ยง (Risk Limits) ของกองทุน และมาตรการในการ ดำเนินการกรณีที่ไม่เป็นไปตามเพดานความเสี่ยงที่กำหนด (Corrective Measures)

5.5 ติดตามการประเมินความเสี่ยงให้อยู่ในกรอบที่กำหนด รวมทั้งประเมินความเพียงพอและประสิทธิภาพ ของระบบการบริหารความเสี่ยง

5.6 วิเคราะห์ผลกระทบของความเสี่ยงที่จะเกิดขึ้นใหม่ (Emerging Risk) และจัดทำแผนบริหารความเสี่ยง รองรับความเสี่ยงที่จะเกิดขึ้นใหม่

6. อำนาจดำเนินการ

6.1 มีอำนาจเชิญ ผู้บริหาร ฝ่ายจัดการหรือพนักงานของบริษัทที่เกี่ยวข้องมาชี้แจง ให้ความเห็น ร่วม ประชุม หรือส่งเอกสารตามความเห็นที่เกี่ยวข้องจำเป็น

6.2 มีอำนาจในการให้ฝ่ายงานต่าง ๆ ของบริษัท ดำเนินการหรือปฏิบัติการอย่างหนึ่งอย่างใดเท่าที่จำเป็น เพื่อให้คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงสามารถปฏิบัติหน้าที่ได้ตามที่กำหนดในกฎบัตรนี้

6.3 ปรึกษาผู้เชี่ยวชาญ หรือที่ปรึกษาของบริษัท (ถ้ามี) หรือจ้างที่ปรึกษา หรือผู้เชี่ยวชาญภายนอกในกรณี จำเป็น ด้วยค่าใช้จ่ายของบริษัท

7. การประชุม

7.1 วาระการประชุม

(1) มีการกำหนดวัน เวลา สถานที่ และวาระการประชุมไว้ล่วงหน้าอย่างชัดเจน และนำส่งเอกสารประกอบการประชุมให้คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงและผู้เข้าร่วมประชุมเป็นการล่วงหน้า เพื่อให้คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงมีเวลาพอสมควรในการพิจารณาเรื่องต่าง ๆ หรือเรียกขอข้อมูลประกอบการพิจารณาเพิ่มเติม

(2) ในกรณีที่การประชุมคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงคราวใดเป็นการประชุมผ่านสื่ออิเล็กทรอนิกส์ การจัดส่งเอกสารประกอบการประชุมสามารถดำเนินการโดยจดหมายอิเล็กทรอนิกส์ก็ได้

7.2 จำนวนครั้งการประชุม

(1) คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงต้องประชุมกันอย่างน้อยไตรมาสละ 1 ครั้ง หรือมากกว่านั้นเมื่อมีความจำเป็น

(2) ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงอาจเรียกประชุมคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงเป็นกรณีพิเศษได้ หากมีการร้องขอจากกรรมการบริหารความเสี่ยงหรือประธานกรรมการให้พิจารณาประเด็นความเสี่ยงที่จำเป็นต้องหารือร่วมกันหรือแก้ไขเป็นการเร่งด่วน

7.3 องค์กรประชุม

(1) สมาชิกคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงทุกท่านควรเข้าร่วมประชุมคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงทุกครั้ง และในการประชุมคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง ไม่ว่าจะเป็นการประชุมในที่แห่งเดียวกันหรือเป็นการประชุมผ่านสื่ออิเล็กทรอนิกส์ ต้องมีสมาชิกมาเข้าร่วมประชุมด้วยตนเองไม่น้อยกว่ากึ่งหนึ่งของจำนวนสมาชิกทั้งหมด จึงจะครบเป็นองค์ประชุม และถือว่าการประชุมผ่านสื่ออิเล็กทรอนิกส์มีผลเช่นเดียวกับการประชุมในที่ประชุมแห่งเดียวกัน

(2) ในการประชุมคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงแต่ละครั้ง ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงหรือผู้ซึ่งได้รับมอบหมายอาจกำหนดให้ดำเนินการประชุมผ่านสื่ออิเล็กทรอนิกส์ได้ตามความจำเป็นและเหมาะสม

(3) ในกรณีที่ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงไม่อยู่ในที่ประชุมหรือไม่สามารถปฏิบัติหน้าที่ได้ หรือไม่สามารถร่วมการประชุมผ่านสื่ออิเล็กทรอนิกส์ได้ ให้สมาชิกซึ่งเข้าประชุมเลือกสมาชิกคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงคนหนึ่งเป็นประธานในที่ประชุม

(4) คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงอาจเชิญผู้บริหาร ฝ่ายจัดการ หรือผู้ที่เกี่ยวข้องเข้าร่วมประชุมเพื่อให้ข้อคิดเห็น หรือตอบข้อซักถามในเรื่องที่เกี่ยวกับวาระการประชุม

7.4 การลงคะแนนเสียง

ไม่ว่าจะเป็นการประชุมในที่แห่งเดียวกัน หรือเป็นการประชุมผ่านสื่ออิเล็กทรอนิกส์ การลงมติของที่ประชุมคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงให้ถือเสียงข้างมากของสมาชิกที่เข้าร่วมประชุม สมาชิกคนหนึ่งมีเสียงหนึ่ง

เสี่ยงในการลงคะแนน เว้นแต่สมาชิกมีส่วนได้เสียในเรื่องใด ไม่มีสิทธิออกเสียงลงคะแนนในเรื่องนั้น ถ้าคะแนนเสียงเท่ากันให้ประธานในที่ประชุมออกเสียงเพิ่มขึ้นอีกหนึ่งเสียงเป็นเสียงชี้ขาด

7.5 รายงานการประชุม

ให้เลขานุการคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงหรือผู้ที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง เป็นผู้บันทึกรายงานการประชุม ซึ่งจะต้องนำส่งคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงเพื่อรับรองรายงานการประชุมในการประชุมคราวถัดไป

8. การรายงาน

8.1 รายงานผลการปฏิบัติหน้าที่ของคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงให้คณะกรรมการทราบอย่างน้อยปีละ 2 ครั้ง หรือรายงานทันทีหากมีประเด็นที่สำคัญ

8.2 ให้บริษัทเปิดเผยผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงที่ทำระหว่างปีตามหน้าที่และความรับผิดชอบที่ได้รับมอบหมายจากคณะกรรมการ ไว้ในรายงานประจำปีของบริษัท

9. การประเมินผลการปฏิบัติงาน

ในการประเมินผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงอาจใช้วิธีประเมินผลการทำงานของตนเอง (Self-Assessment) โดยประเมินผลทั้งในภาพรวมเป็นรายคณะ และรายบุคคล และรายงานผลการประเมินต่อคณะกรรมการเป็นประจำทุกปี

10. การทบทวนกฎบัตร

คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงจะสอบทานและทบทวนความเหมาะสมของกฎบัตรอย่างสม่ำเสมอเป็นประจำทุกปี เพื่อให้มั่นใจว่าเนื้อหาในกฎบัตรสอดคล้องกับกฎหมายที่เกี่ยวข้อง หลักการกำกับดูแลกิจการที่ดี และนโยบายของบริษัท ในกรณีที่มีการแก้ไขปรับปรุงกฎบัตรจะต้องได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการ เว้นแต่เป็นการแก้ไขเล็กน้อยที่ไม่มีนัยสำคัญให้คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงมีอำนาจในการแก้ไขได้

บันทึกการแก้ไขปรับปรุง
กฎบัตรคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง

ครั้งที่	วันที่อนุมัติ	รายละเอียด	ที่มา/เหตุผล
0	15 ธันวาคม 2564	จัดทำใหม่ทั้งฉบับ	เพื่อให้เป็นไปตามหลักการกำกับดูแล กิจการที่ดี รวมทั้งทบทวนขอบเขตอำนาจ หน้าที่ให้เป็นปัจจุบันและสอดคล้องกับ หลักเกณฑ์ที่เกี่ยวข้อง