

# บลจ.ไทยพาณิชย์ คงอันดับคุณภาพที่ 'Excellent(tha)' จากฟิทช์ เรตติ้งส์

นายณรงค์ศักดิ์ ปลอดมีชัย ประธานเจ้าหน้าที่บริหาร บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน ไทยพาณิชย์ จำกัด เปิดเผยว่า ในปีนี้ บลจ.ไทยพาณิชย์ ยังคงสามารถรักษาอันดับคุณภาพการจัดการการลงทุนภายในประเทศ (National Investment Management Quality Rating) ที่ 'Excellent(tha)' แนวโน้มอันดับคุณภาพการจัดการการลงทุนมีเสถียรภาพ จากการประกาศของบริษัท ฟิทช์ เรตติ้งส์ (ประเทศไทย) จำกัด เมื่อเร็ว ๆ นี้ สะท้อนถึงการจัดการด้านการปฏิบัติการและการลงทุนที่ฟิทช์มองว่าโดดเด่นกว่ามาตรฐานที่นักลงทุนสถาบันภายในประเทศใช้ในการพิจารณาบริษัทจัดการกองทุน

ทั้งนี้การคงอันดับของบลจ.ไทยพาณิชย์ พิจารณาจากปัจจัย 5 ด้าน ประกอบด้วย กระบวนการการลงทุน บุคลากรในการจัดการลงทุน การบริหารจัดการและการควบคุมความเสี่ยง ผลการดำเนินงานจากการบริหารจัดการลงทุน และบริษัทและการบริการลูกค้า โดยฟิทช์มองว่ามีกระบวนการการลงทุนที่ดีในการบริหารกองทุนที่หลากหลาย มีการวิเคราะห์การลงทุนในเชิงลึกและเลือกลงทุนอย่างมีระบบ มีการติดตามและประเมินหลักทรัพย์ที่ลงทุนเป็นลายลักษณ์อักษร นอกจากนี้บริษัทมีการใช้เครื่องมือเชิงปริมาณ (quantitative tools) และปัจจัยเชิงคุณภาพ (qualitative factors) เพื่อสนับสนุนวัตถุประสงค์การลงทุนและกระบวนการการลงทุน ในช่วงที่ผ่านมาผู้จัดการการลงทุนได้มีการเริ่มใช้ machine learning สำหรับกองทุนตราสารหุ้นต่างประเทศจากเดิมใช้เพียงกองทุนตราสารหุ้นภายในประเทศ

ขณะที่ด้านบุคลากรในการจัดการการลงทุนมีบุคลากรที่มีประสบการณ์ในอุตสาหกรรมในเชิงกว้างและเชิงลึก มีผู้จัดการการลงทุนที่มีประสบการณ์ทำงานผสมผสานกันตามความเหมาะสมในแต่ละประเภทของกองทุน และผู้จัดการการลงทุนอาวุโสส่วนใหญ่มีประสบการณ์การทำงานกับบริษัทเป็นระยะเวลาอันยาวนาน ไม่ได้พึ่งพาบุคลากรคนใดคนหนึ่งมากเกินไป นอกจากนี้ยังมีการแยกความรับผิดชอบการบริหารจัดการการลงทุนอย่างชัดเจนและการแบ่งแยกทีมตามสายงานอย่างชัดเจน ทั้งนี้ระบบงานต่างๆ มีความเชื่อมต่อกันโดยอัตโนมัติ รวมทั้งมีความพร้อมในการปรับปรุงและบำรุงรักษาระบบอย่างสม่ำเสมอ ทำให้สามารถทำงานได้อย่างมีประสิทธิภาพมากและรองรับการลงทุนที่หลากหลายของบริษัท บุคลากรในการจัดการการลงทุนมีแหล่งข้อมูลที่ใช้ในการตัดสินใจลงทุนที่หลากหลาย

ด้านการบริหารจัดการและการควบคุมความเสี่ยง ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) (SCB; 'AA+(tha)'/แนวโน้มอันดับเครดิตมีเสถียรภาพ) ซึ่งเป็นบริษัทแม่ได้มีการกระจายอำนาจการบริหารความเสี่ยงจากจุดศูนย์กลางให้กับบริษัทลูก (decentralise) ซึ่งจะทำให้บลจ.ไทยพาณิชย์ มีความยืดหยุ่นมากขึ้นในการบริหารความเสี่ยงด้านเครดิต ด้านปฏิบัติการ ด้านสภาพคล่อง และด้านความเสี่ยงของตลาด อย่างไรก็ตามแผนกบริหารความเสี่ยงของบลจ.ไทย

พาณิชย์ยังมีความอิสระจากบุคลากรการจัดการการลงทุนแต่ทำงานใกล้ชิดกับผู้จัดการการลงทุนเพื่อการบูรณาการ การบริหารความเสี่ยง ที่มบริหารความเสี่ยงใช้ระบบที่เป็นมาตรฐานสากลสำหรับการประเมินความเสี่ยงและการ ทดสอบภาวะวิกฤต

“พีทซ์มองว่าผลการดำเนินงานของกองทุนภายใต้การบริหารของบลจ.ไทยพาณิชย์ อยู่ในระดับที่ดีเมื่อเทียบกับ บริษัทจัดการกองทุนอื่นๆ ในประเทศไทย ซึ่งวัดจากผลการดำเนินงานของกองทุนเมื่อเทียบกับความเสี่ยงเป็นเกณฑ์ (risk-adjusted performance) ในส่วนของกองทุนตราสารหนี้ ซึ่งเป็นสัดส่วนที่มากที่สุดของสินทรัพย์ภายใต้การ จัดการ มีผลการดำเนินงานของกองทุนเป็นที่น่าพอใจเมื่อเทียบกับกองทุนตราสารหนี้อื่นๆ ในอุตสาหกรรม สำหรับ กองทุนหุ้นและกองทุนประเภทจัดสรรเงินลงทุนไปลงในสินทรัพย์ประเภทต่างๆ (asset allocation funds) ผลการ ดำเนินการโดยรวมสอดคล้องกับกองทุนประเภทเดียวกันที่อยู่ภายใต้การบริหารของบริษัทอื่นๆ” นายณรงค์ศักดิ์ กล่าว

พีทซ์ยังมองว่า บลจ.ไทยพาณิชย์ มีสถานะทางธุรกิจที่แข็งแกร่งในธุรกิจบริหารจัดการกองทุน และมีผลิตภัณฑ์ กองทุนที่มีความหลากหลายในด้านนโยบายการลงทุน โดยมีสินทรัพย์ภายใต้การจัดการ (AUM) มูลค่ารวมอยู่ที่ 1.6 ล้านล้านบาท ณ สิ้นเดือนพฤษภาคม 2562 (ที่มา: AIMC) บริษัทได้เพิ่มความหลากหลายในกองทุนประเภทจัดสรร เงินลงทุนไปลงในสินทรัพย์ประเภทต่างๆ (asset allocation funds) เพื่อให้สถานะทางธุรกิจกองทุนรวมของ บริษัทแข็งแกร่งขึ้น แต่อย่างไรก็ตามกองทุนตลาดเงินและตราสารหนี้ยังคงคิดเป็นสัดส่วนที่สูงกว่า 70% ของ AUM ทั้งหมดของบริษัท บลจ.ไทยพาณิชย์เป็นผู้นำอย่างชัดเจนในธุรกิจกองทุนส่วนบุคคล โดยมีส่วนแบ่งทางการตลาดที่ สูงกว่า 40% ของกองทุนส่วนบุคคลทั้งหมดในอุตสาหกรรม ซึ่งแสดงถึงสถานะทางธุรกิจของบลจ.ไทยพาณิชย์ที่ แข็งแกร่งในธุรกิจกองทุนส่วนบุคคล โดยเฉพาะในแวดวงนักลงทุนสถาบันและผู้ลงทุนรายใหญ่ (high net worth) การนำเสนอข้อมูลต่อนักลงทุนมีความเป็นระบบสูง โดยมักจะมีมาตรฐานเหนือกว่ากฎเกณฑ์และมาตรฐานของ อุตสาหกรรม เห็นได้จากรายงานที่บริษัทได้ส่งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนสำหรับกองทุนรวม กองทุนส่วนบุคคล กองทุน สำรองเลี้ยงชีพ

---

สอบถามรายละเอียดเพิ่มเติม ติดต่อ

บริษัท พีอาร์ดีดี จำกัด

ลัดดา บุษบา 089-488-1777, สุจิรา วิโรจนะ 082-492-4639