

รายงานของคณะกรรมาธิการบริหารความเสี่ยง



นายณัฐชาติ จารุจินดา
ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง
บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน)

เรียน ท่านผู้ถือหุ้น

ปี 2558 เป็นปีที่ท้าทายสำหรับธุรกิจการกลั่น เนื่องจากสถานการณ์ราคาน้ำมันในตลาดโลกยังคงผันผวน ซึ่งส่งผลกระทบต่อโดยตรงต่อผลประกอบการของธุรกิจ คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงจึงมีความจำเป็นต้องจัดการประชุมมากกว่าที่กำหนดเพื่อติดตามและบริหารความเสี่ยงดังกล่าวให้สอดคล้องกับสถานการณ์ที่เปลี่ยนแปลงไป และการสนับสนุนคณะกรรมการบริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน) ในการกำกับดูแลการบริหารจัดการความเสี่ยงขององค์กร ให้สามารถบรรลุเป้าหมายทางธุรกิจที่ตั้งไว้ สร้างความมั่นใจและความน่าเชื่อถือให้กับผู้ลงทุนและผู้มีส่วนได้เสียในการดำเนินธุรกิจของบริษัทฯ โดยคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงชุดปัจจุบัน ซึ่งประกอบด้วยกรรมการผู้มีความรู้ ความสามารถและประสบการณ์ ตลอดจนมีความรู้ ความเข้าใจในการดำเนินธุรกิจ จำนวน 4 ท่าน ดังนี้

1. นายณัฐชาติ จารุจินดา ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง
2. นายธรรมยศ ศรีช่วย กรรมการบริหารความเสี่ยง
3. นายนพดล ปิ่นสุภา กรรมการบริหารความเสี่ยง
4. นายอดิคม เดิบศิริ กรรมการบริหารความเสี่ยง

ผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมาธิการบริหารความเสี่ยงในปี 2558

คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงได้ทำหน้าที่กำหนดและทบทวนกรอบการบริหารความเสี่ยงองค์กร นโยบายและกระบวนการบริหารความเสี่ยง ตามบทบาทหน้าที่ในกฎบัตรคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง และให้ข้อเสนอแนะแนวทางในการบริหารจัดการความเสี่ยงให้เหมาะสมกับการดำเนินธุรกิจอย่างมีประสิทธิภาพ สอดคล้องต่อทิศทางกลยุทธ์การดำเนินงานและแผนธุรกิจ รวมทั้งการสนับสนุนและพัฒนาการบริหารความเสี่ยงในทุกระดับทั่วทั้งองค์กรอย่างต่อเนื่องและมีประสิทธิภาพตามมาตรฐานสากล เพื่อให้เกิดเป็นวัฒนธรรมองค์กร สำหรับในปี 2558 คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงได้มีการประชุมรวมทั้งสิ้น 7 ครั้ง สรุปสาระสำคัญของการประชุมได้ดังนี้

1. รับทราบและเห็นชอบ ก่อนนำเสนอคณะกรรมการบริษัทฯ ในประเด็นผลกระทบและการบริหารความเสี่ยงด้านราคาน้ำมันดิบและผลิตภัณฑ์ ไตรมาสที่ 4 ประจำปี 2557 และไตรมาสที่ 1, 3 และ 4 ประจำปี 2558 และปี 2558 และในประเด็นผลกระทบและการบริหารความเสี่ยงด้านราคาน้ำมันดิบคงคลังเดือนธันวาคม 2558 (Inventory Risk Hedging) ตลอดจนการพิจารณาผลกระทบจากการปรับลดสำรองน้ำมันลงตามกฎหมายของรัฐบาล โดยสรุปมาตรการป้องกันความเสี่ยงด้านราคาน้ำมัน (Oil Risk Hedging) ทำให้ลดผลกระทบจากราคาน้ำมันที่ผันผวนเป็นจำนวนเงิน 1,489 ล้านบาท
2. รับทราบในประเด็นผลกระทบและมาตรการบริหารความเสี่ยงอัตราแลกเปลี่ยน และสรุปผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง ประจำปี 2558
3. พิจารณาให้ความเห็นชอบ ก่อนนำเสนอต่อคณะกรรมการบริษัทฯ ดังนี้
 - 3.1 รายงานของคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง ปี 2557

- 3.2 ความเสี่ยงองค์กรของเครือไทยออยล์ และดัชนีวัดประสิทธิผลของมาตรการบริหารความเสี่ยง (KRI) ประจำปี 2558
 - 3.3 การแก้ไขแต่งตั้งเลขานุการคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง
 - 3.4 การบริหารความเสี่ยงในการคัดเลือกเทคโนโลยีโครงการ Clean Fuel Project (CFP) และการออกแบบกระบวนการผลิต (Basic Design Package : BDP) พร้อมงบประมาณที่เกี่ยวข้อง
 - 3.5 ความเสี่ยงองค์กรและดัชนีวัดผลการดำเนินงาน ประจำปี 2559
4. พิจารณาและให้ความเห็นชอบ ก่อนนำเสนอคณะกรรมการบริษัท ในการขายน้ำมันดิบให้ลูกค้าไปจัดเก็บและซื้อคืนกลับมาภายหลังในระยะเวลาที่กำหนด การแก้ไขราคาเป้าหมายการบริหารความเสี่ยงด้านราคาน้ำมันดิบและส่วนต่างราคาระหว่างผลิตภัณฑ์และน้ำมันดิบ สำหรับปี 2558 และการแก้ไขราคาเป้าหมายการบริหารความเสี่ยงด้านราคาน้ำมันดิบคงคลัง (Inventory Hedging) สำหรับปี 2558

โดยสรุป คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงมีความเห็นว่า ในรอบปี 2558 ที่ผ่านมา บริษัทฯ ได้พัฒนาระบบบริหารความเสี่ยงขององค์กรให้ครอบคลุมปัจจัยเสี่ยงทุกด้าน มีการบริหารความเสี่ยงอย่างต่อเนื่องและสอดคล้องกับสภาวะการณ์ที่เปลี่ยนแปลงไป โดยมีการประชุมของคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงเป็นประจำ เพื่อพิจารณาความเสี่ยงที่สำคัญและเร่งด่วนอย่างทันท่วงที ซึ่งทำให้เกิดประสิทธิผลของการบริหารความเสี่ยงของเครือไทยออยล์ โดยบริษัทฯ ได้มีการบริหารจัดการความเสี่ยงสำคัญระดับองค์กรอย่างมีประสิทธิภาพ เหมาะสม และควบคุมให้อยู่ในระดับที่ยอมรับได้

วันที่ 18 ธันวาคม 2558

ในนามคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง



(นายณัฐชาติ จารุจินดา)

ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง
บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน)