

รายงานของ คณะกรรมการบริหารความเสี่ยง



นายอรรถพล ฤกษ์พิบูลย์
ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง

เรียน ท่านผู้ถือหุ้น

เพื่อสนับสนุนคณะกรรมการ บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน) ในการกำกับดูแลการบริหารจัดการความเสี่ยงขององค์กรให้สามารถบรรลุเป้าหมายทางธุรกิจที่ตั้งไว้ สร้างความมั่นใจและความน่าเชื่อถือให้กับผู้ลงทุนและผู้มีส่วนได้เสียในการดำเนินธุรกิจของบริษัทฯ คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงได้ปฏิบัติหน้าที่อย่างเต็มความสามารถ โดยคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงชุดปัจจุบันประกอบด้วยกรรมการผู้มีความรู้ ความสามารถและประสบการณ์ ตลอดจนมีความเข้าใจในการดำเนินธุรกิจ จำนวน 4 คน ดังนี้

- | | |
|--------------------------------|----------------------------------|
| 1. นายอรรถพล ฤกษ์พิบูลย์ | ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง |
| 2. นายหนวด ปิ่นสุภา | กรรมการบริหารความเสี่ยง |
| 3. นางสาวพรรณนลิน มหาวงศ์ธิกุล | กรรมการบริหารความเสี่ยง |
| 4. นายอติคม เดิบศิริ | กรรมการบริหารความเสี่ยง |

ผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง ในปี 2561

คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงได้ทำหน้าที่กำหนดและทบทวนกรอบการบริหารความเสี่ยงขององค์กร นโยบายและกระบวนการบริหารความเสี่ยงตามบทบาทหน้าที่ในกฎบัตรคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง และเสนอแนะแนวทางในการบริหารจัดการความเสี่ยงให้เหมาะสมกับการดำเนินธุรกิจอย่างมีประสิทธิภาพ สอดคล้องกับทิศทางกลยุทธ์การดำเนินงานและแผนธุรกิจ รวมทั้งสนับสนุนและพัฒนาการบริหารความเสี่ยงในทุกระดับทั่วทั้งองค์กรอย่างต่อเนื่องและมีประสิทธิภาพตามมาตรฐานสากล เพื่อให้เกิดเป็นวัฒนธรรมองค์กร สำหรับในปี 2561 คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงได้มีการประชุมรวมทั้งสิ้น 7 ครั้ง โดยสรุปสาระสำคัญของการประชุมได้ดังนี้

1. พิจารณาให้ความเห็นชอบกรอบความเสี่ยงที่ยอมรับได้ (Risk Appetite) ความเสี่ยงองค์กร มาตรการป้องกันและรองรับความเสี่ยง ดัชนีชี้วัดประสิทธิผลการบริหารความเสี่ยง ตลอดจนทบทวนแผนงานบริหารความเสี่ยงขององค์กร
2. พิจารณาให้ความเห็นชอบกรอบการบริหารความเสี่ยงราคาน้ำมันดิบและผลิตภัณฑ์ และราคาเป้าหมาย ก่อนนำเสนอคณะกรรมการบริษัทฯ เพื่อพิจารณาอนุมัติ

3. พิจารณาและให้ความเห็นชอบแผนบริหารความเสี่ยงของโครงการสำคัญต่างๆ ก่อนนำเสนอคณะกรรมการบริษัทฯ ได้แก่
 - 3.1 แผนบริหารความเสี่ยงการดำเนินโครงการพลังงานสะอาด (Clean Fuel Project : CFP)
 - 3.2 แผนบริหารความเสี่ยงการออกและเสนอขายหุ้นกู้สกุลเงินดอลลาร์สหรัฐฯ เพื่อสนับสนุนการก่อสร้างโครงการ CFP ผ่านบริษัท ไทยออยล์ ศูนย์บริหารเงิน จำกัด
 - 3.3 แผนบริหารความเสี่ยงการจัดหาผู้ลงทุนหน่วยผลิตไฟฟ้า (Energy Recovery Unit : ERU)
 - 3.4 กรอบการบริหารหนี้สิน (Liability Management) ภายใต้โปรแกรม Global Medium Term Note (GMTN)
 - 3.5 การบริหารแนวการลงทุนโครงการ Helium ของบริษัท โกลบอล เพาเวอร์ ซินเนอร์ยี จำกัด (มหาชน) และแนวทางให้บริษัทฯ และบริษัท ไทยออยล์เพาเวอร์ จำกัด เห็นชอบการสนับสนุนการลงทุนในโครงการ Helium
 - 3.6 แผนบริหารความเสี่ยงโครงการ Corporate Venture Capital (CVC) ของบริษัทฯ
 - 3.7 แผนบริหารความเสี่ยงแนวทางดำเนินการเพื่อปรับโครงสร้างกลุ่มธุรกิจเอทานอล ระยะที่ 2 (Project Diet)
4. พิจารณาและให้ความเห็นชอบการแต่งตั้งเลขานุการคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง
5. ติดตามและให้คำแนะนำผลการบริหารความเสี่ยงขององค์กรประจำไตรมาสที่ 1/2561 - ไตรมาสที่ 4/2561
6. ติดตามและให้คำแนะนำผลการบริหารความเสี่ยงด้านราคา (Oil Hedging) ประจำไตรมาสที่ 4/2560 ประจำเดือนมกราคม - กุมภาพันธ์ 2561 และประจำไตรมาสที่ 1/2561 - ไตรมาสที่ 4/2561
7. ติดตามความเสี่ยงของโครงการต่างๆ ที่อยู่ระหว่างดำเนินงานและให้ข้อเสนอแนะในประเด็นต่างๆ ได้แก่ ความคืบหน้าการบริหารความเสี่ยงโครงการขยายท่าเรือ หมายเลข 7 และ

หมายเลข 8 โครงการกลุ่มอาคารโรงกลั่นศรีราชา โครงการก่อสร้างถังน้ำมันดิบเพื่อความมั่นคงด้านการกลั่น และโครงการพัฒนาโครงสร้างพื้นฐานบริเวณอาคารสำนักงานโรงกลั่น

8. รับทราบผลการปฏิบัติงานของคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงประจำปี 2561

โดยสรุป คณะกรรมการบริหารความเสี่ยงมีความเห็นว่า ในรอบปี 2561 ที่ผ่านมา บริษัทฯ ได้พัฒนาระบบบริหารความเสี่ยงขององค์กรให้ครอบคลุมปัจจัยเสี่ยงทุกด้าน มีการบริหารความเสี่ยงอย่างต่อเนื่องและสอดคล้องกับสถานการณ์ที่เปลี่ยนแปลงไป โดยมีการประชุมของคณะกรรมการบริหารความเสี่ยงเป็นประจำ เพื่อพิจารณาความเสี่ยงที่สำคัญและเร่งด่วนอย่างทันทั่วทั้งที่ซึ่งทำให้เกิดประสิทธิผลในการบริหารความเสี่ยงของกลุ่มไทยออยล์ โดยบริษัทฯ ได้มีการบริหารจัดการความเสี่ยงที่สำคัญระดับองค์กรอย่างมีประสิทธิภาพ เหมาะสม และควบคุมให้อยู่ในระดับที่ยอมรับได้

วันที่ 16 พฤศจิกายน 2561

ในนามคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง



(นายอรรถพล ฤกษ์พิบูลย์)

ประธานคณะกรรมการบริหารความเสี่ยง
บริษัท ไทยออยล์ จำกัด (มหาชน)