

# แถลงการณ์ ฉบับที่ 3

ICM Capital Limited - 31 ธันวาคม 2021

## สารบัญ

บทนำ .....	3
ภาพรวมองค์กร .....	3
การกำกับดูแลเชิงธุรกิจ .....	4
การบริหารความเสี่ยง .....	5
ความเหมาะสมของเงินทุนและบทสรุป .....	6
หลักเกณฑ์คำตอบแทน .....	7

## บทนำ

ICM Capital Limited (“ICM” หรือ “Firm”) ซึ่งได้รับอนุญาตในประเทศอังกฤษ (“สหราชอาณาจักร”) โดยหน่วยงานกำกับดูแลทางการเงินภายใต้ FRN 520965 ได้ดำเนินการกระบวนประเมินความเสี่ยงของเงินทุนภายใต้ (ICAAP) ตามข้อกำหนด ของ Basel III ประกาศใช้ภายใต้ข้อกำหนดเงินทุน IV และข้อกำหนดเงินกองทุน (กฎเกณฑ์) ซึ่งมีผลบังคับใช้ในวันที่ 1 มกราคม 2014.

การปฏิบัติตามกฎและกระบวนกรโดยมีสามขั้นตอนหลักดังนี้:

- กฎข้อที่ 1 กำหนดความต้องการเงินทุนขั้นต่ำของบริษัท จะต้องพบกับความเสี่ยงด้านเครดิตของ ตลาดและการดำเนินงาน
- กฎข้อที่ 2 เป็นกระบวนการที่ทางบริษัท ว่าควรมีเงินทุนเพิ่มเติมสำหรับความเสี่ยงที่ไม่ครอบคลุมใน กฎข้อที่ 1 (กำหนดผ่านกระบวนการ ICAAP) และที่ FCA ในการตอบสนองต่อ ICAAP สามารถสั่ง ให้ทางบริษัทถือเงินทุนเพิ่มเติมภายใต้คำแนะนำการลงทูลส่วนบุคคล (ICG)
- กฎข้อที่ 3 เป็นส่วนที่เกี่ยวกับวินัยของตลาดที่กำหนดให้ ทางบริษัทต้องเปิดเผยรายละเอียดความ เสี่ยงเงินทุน รวมถึงการบริหารความเสี่ยงและการปฏิบัติตามประมวลกฎหมายค่าตอบแทน

IFPRU 11 ข้อกำหนดบทบัญญัติเกี่ยวกับการเปิดเผยข้อมูล โดยรายงานกฎข้อที่ 3 นี้มีการเปิดเผยข้อมูลทั้งหมดที่จำเป็นภายใต้ IFPRU 11 ยกเว้นกรณีการเปิดเผยเฉพาะนั้นไม่สามารถใช้งานได้ถือว่าไม่สำคัญหรือเป็นข้อมูลที่เป็นกรรมสิทธิ์หรือเป็นความลับ

## การเปิดเผยด้านสื่อ

ICM จะทำการเปิดเผยข้อมูลในกฎข้อที่ 3 เป็นประจำทุกปี

การเปิดเผยจะอยู่ในเว็บไซต์ ICM Capital - [www.icmcapital.co.uk](http://www.icmcapital.co.uk) และเผยแพร่ให้ตรงกับงบการเงินประจำปี

ICM จะอัปเดตการเปิดเผยกฎข้อที่ 3 บ่อยกว่าทุกปี หากมีการเปลี่ยนแปลงรูปแบบธุรกิจอย่างมีนัยสำคัญซึ่งจะส่งผลกระทบต่อข้อกำหนดด้านเงินกองทุน

## ภาพรวมองค์กร

ICM ก่อตั้งขึ้นในฐานะนายหน้าของการซื้อขาย forex ผู้เชี่ยวชาญที่ช่วยให้ลูกค้ารายย่อยและลูกค้ามืออาชีพสามารถเปิดบัญชีซื้อขายผ่านแพลตฟอร์มของ ICM โดยขอบเขตรูปแบบบริษัท IFPRU €730,000 (ดูรายละเอียดได้ใน IFPRU 1.1.8 ของคู่มือ FCA)

ICM ปฏิบัติตามกรอบบริหารความเสี่ยง ที่มีโครงสร้างโดยผ่านการพิจารณา รวมถึงมีการกำหนดขั้นตอนที่เหมาะสมและปฏิบัติตามวิธีการอย่างเป็นระบบ ซึ่งผู้บริหารระดับสูงได้ดำเนินการนำไปสู่การริเริ่มดูแลการจัดการความเสี่ยง

ผู้บริหารระดับสูงของ ICM เคยมีประสบการณ์การซื้อขาย Forex และ CFD ออนไลน์มาก่อน

ผู้บริหารระดับสูงได้รับทราบถึงความผิดชอบเฉพาะเรื่องความเสี่ยงและอนุมัตินโยบายการจัดการความเสี่ยงที่บริษัทดำเนินการ

โดยเป็นเป้าหมายของนโยบายที่ควรมีระบบและการควบคุมที่เพียงพอ  
ซึ่งมีสัดส่วนและเกี่ยวข้องกับธุรกิจในการระบุจัดการติดตามและรายงานความเสี่ยงที่ธุรกิจอาจต้องเผชิญอย่างเพียงพอ

การเปิดเผยข้อมูล Pillar 3 นี้แสดงให้เห็นว่าทางบริษัทมีเงินทุนเพียงพอสำหรับการปฏิบัติตามข้อกำหนดด้านเงินทุนและความต้องการเงินทุนของบริษัท  
แม้ภายใต้สถานการณ์ที่เน้นว่า ICM ไม่ได้เป็นผู้ปกครองและผู้เปิดเผยข้อมูลภายในต่อรายงานที่จัดทำขึ้นเป็นรายบุคคลนี้

## การกำกับดูแลเชิงธุรกิจ

กรรมการของบริษัทได้กำหนดกลยุทธ์ทางธุรกิจและความเสี่ยงที่ยอมรับได้  
อีกทั้งออกแบบและดำเนินการตามกรอบการบริหารความเสี่ยงที่ตระหนักถึงผลกระทบทางธุรกิจที่เผชิญอยู่  
ทางกรรมการของบริษัทได้กำหนดนโยบายความเสี่ยงเหล่านั้นที่อาจจะบรรเทาและประเมินอย่างต่อเนื่อง รวมถึงควบคุมและขั้นตอนที่จำเป็นในการจัดการความเสี่ยงเหล่านั้น  
กรรมการของ บริษัทและผู้บริหารระดับสูงมีการพบปะกันเป็นประจำ อีกทั้งพิจารณาและคาดการณ์ผลกำไร สภาพคล่อง เงินกองทุน การวางแผนธุรกิจและการจัดการความเสี่ยง

### คณะกรรมการบริษัท

คณะกรรมการบริษัทเป็นผู้รับผิดชอบและดำเนินการดูแลและบริหารความเสี่ยง รวมถึงปฏิบัติตามกฎระเบียบที่สอดคล้องด้านการเงินและอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง

โดยเฉพาะอย่างยิ่งคณะกรรมการได้ดำเนินการตรวจสอบดังนี้:

- ระบบการควบคุมภายในมีความเหมาะสมเพื่อให้อุ่นใจในการจัดการธุรกิจและความเสี่ยงของบริษัท  
อย่างเป็นระเบียบและรอบคอบโดยจัดให้มีการหารืออย่างต่อเนื่องกับหัวหน้าฝ่ายการเงินและหัวหน้าฝ่ายกำกับ  
ดูแลและปฏิบัติตามคำแนะนำของพวกเขา
- ระบบการควบคุมภายในมีความเหมาะสมเพื่อให้อุ่นใจในการจัดการธุรกิจและความเสี่ยงของ บริษัทอย่างเป็นระบบ  
และดูแลโดยมีการหารือและพิจารณาอย่างต่อเนื่องกับหัวหน้าฝ่ายการเงิน และหัวหน้าฝ่ายกำกับดูแล นอกจากนี้ยังปฏิบัติตามคำแนะนำอย่างเข้มงวด

คณะกรรมการยังดำเนินการรับผิดชอบในการกำหนดถึงระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้ของ ICM เพื่อให้อุ่นใจว่ามีการบริหารความเสี่ยงที่เหมาะสมและมีประสิทธิภาพ  
อีกทั้งเพื่อติดตามกระบวนการอย่างต่อเนื่องในการระบุประเมินจัดการและรายงานความเสี่ยงที่สำคัญของบริษัท

### คณะกรรมการความเสี่ยง

วัตถุประสงค์หลักของคณะกรรมการ คือเพื่อช่วยคณะกรรมการในการกำกับดูแลความเสี่ยงภายในบริษัท โดยมุ่งเน้นเฉพาะในระดับความเสี่ยงที่ยอมรับได้  
คณะกรรมการจะดำเนินการพิจารณาต่อสถานะความเสี่ยงในทุกๆเดือน รวมถึงดูแลประสิทธิผลของกรอบการบริหารความเสี่ยงภายในบริษัท

ในการตรวจสอบความเสี่ยง เพื่อให้แน่ใจว่ามีการประเมินจะดำเนินการเชิงกลยุทธ์และการทำธุรกรรมที่สำคัญ รวมถึงยังทำงานร่วมกับคณะกรรมการบริษัท  
เพื่อให้มั่นใจว่าการบริหารความเสี่ยงได้รับการพิจารณาอย่างเหมาะสม

### ฟังก์ชันการเงิน

หัวหน้าฝ่ายทางการเงินร่วมกับคณะกรรมการจัดทำประมาณการทางการเงินที่เกี่ยวข้อง ในอีก 3

ปีข้างหน้าโดยผู้บริหารระดับสูงของบริษัทจะให้ความช่วยเหลือในการกำหนดกลยุทธ์เชิงอนาคต ซึ่งจะกำหนดงบประมาณที่จำเป็น / ความต้องการเงินทุน

โดยการใช้จ่ายเริ่มต้นในงบดุลของบริษัท รวมถึงบัญชีกำไรและขาดทุนหัวหน้าฝ่ายการเงินได้เพิ่มความต้องการเงินทุนสำหรับเสาหลัก 1 และเสา 2

สร้างสถานการณ์พื้นฐานสำหรับอีก 3 ปีข้างหน้า จากนั้นสถานการณ์จำลองหลักจะเน้นไปที่การระบุว่าจะมีเงินทุนเพียงพอที่จะรองรับเหตุการณ์ / สถานการณ์ใดหรือไม่

## การบริหารความเสี่ยง

การบริหารความเสี่ยงมีการควบคุมอยู่ตลอดโดย ICM โดยมีการจัดการความเสี่ยงโดยรวม และมีกลยุทธ์การบริหารความเสี่ยง

ที่ได้รับการอนุมัติจากคณะกรรมการและเผยแพร่ธุรกิจอย่างเหมาะสม บริษัทมีโครงสร้างการกำกับดูแลในรูปแบบองค์กร เพื่อให้มั่นใจว่า

การกำกับดูแลความเสี่ยงและการดำเนินการที่เกี่ยวข้อง ได้รับการจัดการด้วยความถูกต้องในระดับองค์กร ตามระดับความเสี่ยงและผลกระทบของความเสี่ยงที่จะเกิดขึ้น

กรอบการบริหารความเสี่ยงของ ICM ได้ระบุความเสี่ยงด้านต่างๆ ไว้ตามหัวข้อดังต่อไปนี้:

1. ความเสี่ยงด้านตลาด;
2. ความเสี่ยงด้านเครดิต;
3. ความเสี่ยงด้านการดำเนินงาน;
4. ความเสี่ยงด้านธุรกิจ;

ความเสี่ยงด้านอื่นๆ ที่นอกเหนือจากนี้ จะระบุอยู่ใน ICAAP ของบริษัท

ความเสี่ยงแต่ละประเภทจะถูกวิเคราะห์, ประเมินปัจจัยในการบรรเทาและระบุการควบคุมที่มีความเกี่ยวข้องกัน

ความเสี่ยงในแต่ละหมวดหมู่จะได้รับการจัดอันดับตามผลกระทบและความน่าจะเป็นและจัดอันดับความเสี่ยง

การปฏิบัติเหล่านี้จะถูกทำโดยคณะกรรมการเพื่อจัดการความเสี่ยงให้เหมาะสม เพื่อปกป้อง ICM และลูกค้าด้วยประโยชน์สูงสุด

กรอบการบริหารความเสี่ยงจะมีการปรับปรุงอย่างสม่ำเสมอและมีการทบทวนอย่างน้อยปีละ 1 ครั้ง โดยคณะกรรมการ

ซึ่งบริษัทจะให้ความสำคัญกับความเสี่ยงนั้นเป็นพิเศษโดยจัดอันดับในระดับ "สูง" กรอบการบริหารความเสี่ยงถูกใช้เพื่อเป็นการระบุความเสี่ยงที่จะต้องพิจารณาใน ICAAP

### ความเสี่ยงด้านตลาด

ความเสี่ยงด้านตลาดคือ ช่องโหว่ของบริษัทจากการเคลื่อนไหวของมูลค่าเครื่องมือทางการเงินที่ถือโดยตนเองหรือจากลูกค้า ซึ่ง ICM

มีความเสี่ยงในการซื้อขายจากสถานะลูกค้าที่ไม่ได้มีการป้องกันความเสี่ยง หรือเพิ่มความเสี่ยง ทำให้มีผลต้องถูกตรวจสอบและจัดการแบบไดนามิก ดังนั้นเมื่อ ICM

เปิดสถานะป้องกันความเสี่ยง บริษัทจะไม่เผชิญกับความเสี่ยงด้านตลาดเนื่องจากคำสั่งซื้อขายจะถูกจับคู่

### ความเสี่ยงด้านเครดิต

ด้านเครดิตคือ ความเสี่ยงที่ลูกค้าและผู้สัญญาของบริษัทไม่สามารถจ่ายเงินให้กับบริษัทได้

ซึ่งความเสี่ยงนี้เกี่ยวข้องกับความเสี่ยงของคู่สัญญาที่มีความเกี่ยวข้องกับยอดคงเหลือในบริษัท สินทรัพย์ทางการเงิน และลูกหนี้อื่น ๆ ซึ่งจะได้รับการตรวจสอบจากคณะกรรมการบริษัท และมีการรายงานเป็นรายเดือน

### ความเสี่ยงด้านการดำเนินการ

ความเสี่ยงด้านการดำเนินการคือ ความเสี่ยงของการสูญเสียที่เกิดจากกระบวนการภายใน บุคลากร และระบบ หรือจากเหตุการณ์ภายนอกอื่น ๆ ดังนั้นความเสี่ยงด้านการดำเนินการจึงครอบคลุมความเสี่ยงในวงกว้างและความเสี่ยงที่หลากหลายที่อาจเกิดขึ้น รวมไปถึง: การสูญเสียพนักงานคนสำคัญ; ความล้มเหลวของระบบไอที การสูญเสียข้อมูล ความล้มเหลวด้านโทรคมนาคม การสูญเสียพลังงาน ความล้มเหลวหรือการหยุดชะงักของกระบวนการทางธุรกิจที่สำคัญ ภัยพิบัติทางธรรมชาติ หรืออื่น ๆ

ความเสี่ยงด้านการดำเนินการจะได้รับการระบุ บรรเทา และ/หรือการจัดการที่ ICM โดยบุคลากรระดับอาวุโส ผู้ซึ่งเป็นคนแจ้งเตือนถึงความเสี่ยงที่ต้องเผชิญกับในขอบเขตธุรกิจที่พวกเขาต้องรับผิดชอบ เช่น การซื้อขาย การดำเนินการ การเงิน การกำกับดูแล และอื่น ๆ

### ความเสี่ยงด้านธุรกิจ

ICM ดำเนินงานในสภาพแวดล้อมที่มีการแข่งขันที่รุนแรง มีการเปลี่ยนแปลงทางด้านเทคโนโลยีที่รวดเร็ว และกรอบการกำกับดูแลที่มีการพัฒนาอย่างต่อเนื่อง ดังนั้นความล้มเหลวในการปรับธุรกิจให้เข้ากับการเปลี่ยนแปลงของตลาด ความต้องการของลูกค้า หรือวิธีที่ตลาด OTC และผู้เข้าร่วมถูกควบคุมนั้น มีความเสี่ยงในระยะยาวอย่างมีนัยยะสำคัญ

กลยุทธ์หลักของ ICM สำหรับการจัดการและการบรรเทาความเสี่ยงต่าง ๆ นี้ คือ การพัฒนาความสามารถในการเป็นนายหน้าทางอิเล็กทรอนิกส์อย่างต่อเนื่อง การบริหารความสัมพันธ์กับลูกค้าอย่างฉับไว และติดตามการปรับเปลี่ยนกฎระเบียบที่เกี่ยวข้องทั้งหมดที่มีผลต่อการดำเนินงานของตลาด OTC.

## ความเหมาะสมของเงินทุนและบทสรุป

ICM มีภาระหน้าที่ด้านกฎระเบียบเพื่อให้แน่ใจว่า จะรักษาทรัพยากรทางการเงินโดยรวม รวมไปถึงแหล่งเงินทุนและการรักษาสภาพคล่อง ที่ซึ่งต้องเพียงพอทั้งด้านปริมาณและคุณภาพ เพื่อให้มั่นใจว่า จะไม่มีความเสี่ยงที่มีนัยยะสำคัญ ที่ไม่สามารถชำระหนี้สินได้เมื่อถึงกำหนดชำระ

จากรายงาน COREP ของ ICM ในไตรมาสที่ 4 ปี 2021 (แถวที่ 1) และการประเมินความเสี่ยงของที่อยู่แถวที่ 2 ที่อยู่ใน ICAAP ของบริษัท โปรดหาข้อมูลสรุปเกี่ยวกับสถานะเงินทุนของบริษัท ดังต่อไปนี้ :

วันที่ 31 ธันวาคม 2021	£ (ปอนด์)
แหล่งเงินทุน	
ระดับชั้นที่ 1:	
ทุนหุ้นสามัญ	1,099,713
เงินทุนสำรอง	2,176,232
	-----
ระดับชั้นที่ 1 เงินทุน	3,275,945
ระดับชั้นที่ 2 เงินทุน	-
ระดับชั้นที่ 3 เงินทุน	-

หัก จาก ระดับชั้นที่ 1	(12,677)
	-----
เงินทุนคงเหลือทั้งหมด	3,263,268
เงินทุนที่ต้องการ	
ระดับชั้นที่ 1	1,596,578
ระดับชั้นที่ 2	1,277,262
	-----
เงินทุนทั้งหมดที่ต้องการ	2,873,840
	-----
กำไร(ขาดทุน)	389,428
	=====

## หลักเกณฑ์ค่าตอบแทน

ICM อยู่ภายใต้ข้อกำหนดที่ครอบคลุมภายใต้แหล่งที่มาของ IFPRU และด้วยเหตุนี้ทาง ICM จะต้องอยู่ภายใต้หลักเกณฑ์ค่าตอบแทน ("หลักเกณฑ์") ที่รวมอยู่ใน SYSC 19A นอกจากนี้ในฐานะบริษัทการลงทุนของ MIFID ทาง ICM ยังถูกบังคับให้รับค่าตอบแทน MIFID ภายใต้ SYSC 19F ของคู่มือ FCA โดยมีหลักเกณฑ์การใช้งานตามสัดส่วนโดยขึ้นอยู่กับว่าบริษัทที่อยู่ภายใต้ระดับ "สามชั้น" ซึ่ง ICM อยู่ใน 'สัดส่วนระดับชั้นที่สาม'

จรรยาบรรณหลักนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อให้ทางบริษัทมีนโยบายค่าตอบแทนที่เน้นความเสี่ยง

ซึ่งสอดคล้องกับและส่งเสริมการบริหารความเสี่ยงที่มีประสิทธิภาพและไม่เปิดเผยให้พวกเขาที่มีความเสี่ยงมากเกินไป อีกทั้งขยายไปตามข้อกำหนดทั่วไปขององค์กรของ SYSC

4.1.1 หากนโยบายค่าตอบแทนของบริษัท อีกทั้งไม่สอดคล้องกับการบริหารความเสี่ยงที่มีประสิทธิภาพ FCA

เชื่อว่าเป็นไปได้ว่าพนักงานจะมีแรงจูงใจที่จะปฏิบัติในวิธีที่อาจบ่อนทำลายความเสี่ยงที่มีประสิทธิภาพ

MIFID II กำหนดให้ทาง ICM ไม่จ่ายค่าตอบแทนหรือประเมินผลการปฏิบัติงานของพนักงานในลักษณะที่ขัดแย้งกับหน้าที่ การปฏิบัติหน้าที่เพื่อผลประโยชน์สูงสุดของลูกค้า โดยเฉพาะอย่างยิ่งทางบริษัทจะต้องไม่จัดการโดยวิธีตอบแทนเป้าหมายด้านการขายหรืออื่นๆ ที่สามารถสร้างแรงจูงใจให้พนักงาน การแนะนำเครื่องมือทางการเงิน โดยเฉพาะให้กับลูกค้ารายย่อย เมื่อทางบริษัทสามารถนำเสนอเครื่องมือทางการเงินที่แตกต่างกันซึ่งจะดีกว่า ตอบสนองความต้องการของลูกค้า

คำว่า "ค่าตอบแทน" ครอบคลุมรูปแบบของค่าตอบแทนใดๆ รวมถึงเงินเดือนผลประโยชน์บำนาญและผลประโยชน์อื่นๆ

จรรยาบรรณหลักนี้ตั้งอยู่บนหลักการ 12 ข้อ (ซึ่งสามารถพบได้ใน SYSC 19A.3.7R ถึง SYSC 19A.3.51R) แม้ว่า FCA จะใช้วิธีการแบบสัดส่วนในการใช้หลักปฏิบัติ แต่หลักการทั้งหมดนั้นจะไม่เกี่ยวข้องกับ ICM โดยเฉพาะอย่างยิ่งหลักการที่ 7 ('การแทรกแซงของรัฐบาลที่เป็นเอกเทศ') ไม่เกี่ยวข้องกับ ICM หรือบริษัทที่มีการควบคุมส่วนใหญ่ อีกทั้งนอกจากนี้องค์ประกอบบางอย่างของหลักการที่ 12 ('โครงสร้างค่าตอบแทน') จะถูกยกเลิกการใช้งานสำหรับ ICM

ข้อกฎหมายบางข้อมีผลบังคับใช้ทั่วทั้งบริษัท โดยทั่วไปหลักปฏิบัติที่ใช้นี้ใช้กับ 'ค่าตอบแทนพนักงาน' หลังประกอบด้วยหมวดหมู่ของพนักงาน

รวมถึงผู้บริหารระดับสูงผู้รับความเสี่ยงพนักงานมีส่วนร่วมในฟังก์ชันการควบคุมและพนักงานที่ได้รับคำตอบรวมที่จะนำพวกเขาเข้าไปในวงเล็บคำตอบแทนเช่นเดียวกับผู้บริหารระดับสูงและผู้รับความเสี่ยง รวมถึงข้อมูลส่วนบุคคล

ICM ดำเนินการไม่เปิดเผยข้อมูลของพนักงาน หลักเกณฑ์คำตอบและดำเนินการตามขั้นตอนที่เหมาะสมเพื่อให้แน่ใจว่าพนักงานดังกล่าวเข้าใจผลกระทบตาม SYSC 19A.3.5

บริษัททั้งหมดที่อยู่ภายใต้หลักจรรยาบรรณและที่ดูแลเว็บไซต์ โดยอธิบายในเว็บไซต์นี้ว่าสอดคล้องกับหลักเกณฑ์ดังกล่าว (SYSC 19A.3.12A).

### หลักเกณฑ์พนักงาน & คำตอบแทน

จรรยาบรรณพนักงานคือ มีกรรมการจำนวนสามคนและหัวหน้าฝ่ายกำกับดูแล รวมถึงหัวหน้าฝ่ายจัดการและหัวหน้าฝ่ายการเงิน ตารางด้านล่างดังต่อไปนี้แสดงคำตอบรวมต่อปี โดยสิ้นสุดวันที่ 31 ธันวาคม 2021

	รวมทั้งหมด £	รวมจำนวนพนักงานทั้งหมด
รหัสพนักงาน	£688,971	Six