

แผนปฏิบัติการประจำปีงบประมาณ 2564

แผนงาน	เป้าหมายเชิงยุทธศาสตร์	ขั้นตอนการดำเนินการ	เป้าหมาย	ตัวชี้วัด	งบประมาณ ค่าใช้จ่าย (บาท)	ระยะเวลาการดำเนินงาน				ผู้รับผิดชอบ	
						ไตรมาสที่ 1	ไตรมาสที่ 2	ไตรมาสที่ 3	ไตรมาสที่ 4		
						ต.ค.พ.ยธ.ค.ม.	ก.ก.พมี.ค.ม.	ยพ.คมี.ย.ก.ค.	ส.ค.ก.ย		
<b>ยุทธศาสตร์ที่ 1 การบริหารจัดการการลงทุนเพื่อรองรับความท้าทายในอนาคตอย่างมีประสิทธิภาพ</b>											
1.1 จัดทำนโยบายและกรอบการลงทุนประจำปี 2565 ที่เหมาะสมกับภาวะเศรษฐกิจและสภาพตลาดตราสารหนี้ รวมถึงกลยุทธ์และแผนการลงทุนสำหรับ LB21DA ที่เอื้อต่อการสร้างผลตอบแทนที่ไม่ต่ำกว่าตัวชี้วัดที่กำหนด	ชำระคืนเงินต้นให้แก่กระทรวงการคลังครบถ้วน และทันตามกำหนด รวมทั้งสร้างผลตอบแทนจากการลงทุนเพื่อลดภาระหนี้ของประเทศ	<ol style="list-style-type: none"> <li>ศึกษากฎหมาย ระเบียบ ข้อบังคับที่เกี่ยวข้องกับการบริหารจัดการการลงทุนของ กปฟ.</li> <li>วิเคราะห์สภาวะเศรษฐกิจในปัจจุบันและแนวโน้มในอนาคต รวมถึงสภาพตลาดตราสารหนี้ทั้งในและต่างประเทศ</li> <li>จัดทำร่างนโยบายและกรอบการลงทุนประจำปี 2565</li> <li>เสนอร่างนโยบายและกรอบการลงทุนประจำปี 2565 ต่อคณะกรรมการด้านการลงทุน และเสนอต่อคณะกรรมการกองทุนฯ เพื่อพิจารณาให้ความเห็นชอบ</li> <li>เมื่อมีนโยบายและกรอบการลงทุนผ่านความเห็นชอบจากคณะกรรมการกองทุนฯ แล้ว แจ้งให้ผู้บริหารสินทรัพย์ทราบก่อนเริ่มการลงทุนเพื่อจัดทำกลยุทธ์และแผนการลงทุน</li> <li>จัดทำร่างกลยุทธ์และแผนการลงทุนสำหรับ LB21DA เสนอคณะกรรมการด้านการลงทุนและคณะกรรมการกองทุน</li> <li>กำหนดตัวเทียบวัดที่สอดคล้องกับนโยบายกรอบการลงทุนและระยะเวลาการลงทุนสำหรับ LB21DA</li> <li>บริหารจัดการการลงทุนตามกลยุทธ์ที่กำหนด</li> </ol>	จัดทำนโยบายและกรอบการลงทุนประจำปี 2565 แล้วเสร็จ และได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการภายในเดือนกันยายน 2564 โดยมีผลตอบแทนจากการลงทุนสำหรับLB21DA เท่ากับหรือสูงกว่าตัวชี้วัด	ระดับความสำเร็จในการจัดทำนโยบายและกรอบการลงทุนประจำปี 2565 โดยการลงทุนสำหรับ LB21DA ได้รับผลตอบแทนไม่ต่ำกว่า 80%ZRR+(20%ZRR+AA A Corp Spread)	847,100						คณะทำงาน/ คณะอนุกรรมการ การด้านการ ลงทุน/ คณะกรรมการ กองทุน

แผนปฏิบัติการประจำปีงบประมาณ 2564

แผนงาน	เป้าหมายเชิงยุทธศาสตร์	ขั้นตอนการดำเนินการ	เป้าหมาย	ตัวชี้วัด	งบประมาณ ค่าใช้จ่าย (บาท)	ระยะเวลาการดำเนินงาน								ผู้รับผิดชอบ		
						ไตรมาสที่ 1	ไตรมาสที่ 2	ไตรมาสที่ 3	ไตรมาสที่ 4							
						ค.ค.พ.ยธ.ค.ม.	ค.ก.พ.มี.ค.ม.	ค.พ.ค.มิ.ย.	ค.มิ.ย.ก.ค.ก.ย.							
<b>ยุทธศาสตร์ที่ 1 การบริหารจัดการการลงทุนเพื่อรองรับความท้าทายในอนาคตอย่างมีประสิทธิภาพ</b>																
1.2 กำกับติดตามการลงทุนและประเมินผลการลงทุนสำหรับ LB21DA ให้เป็นไปตามนโยบายและกรอบการลงทุน กรอบการบริหารความเสี่ยง และกฎระเบียบที่เกี่ยวข้อง	สามารถรองรับความเสี่ยงจากการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานะเศรษฐกิจและสภาพตลาดตราสารหนี้ได้ในหลากหลายมิติ	<ol style="list-style-type: none"> <li>ชี้แจงนโยบายและกรอบการลงทุนประจำปีงบประมาณ 2564 ต่อผู้บริหารสินทรัพย์และผู้รับฝากทรัพย์สิน</li> <li>กำหนดมาตรการ/บทลงโทษในกรณีที่ผู้บริหารสินทรัพย์ไม่สามารถดำเนินงานได้ตามที่กำหนด</li> <li>ผู้รับฝากทรัพย์สินและผู้บริหารสินทรัพย์รายงานผลสัดส่วนการลงทุนและการบริหารความเสี่ยงต่อ กฟพ. เป็นรายวันและรายเดือน</li> <li>คณะอนุกรรมการด้านการลงทุนพิจารณาผลการลงทุนสำหรับ LB21DA เพื่อกำหนดวงเงินที่จะมอบให้ผู้บริหารสินทรัพย์แต่ละรายบริหารจัดการในรอบการลงทุนถัดไป</li> </ol>	กำกับ ติดตาม และตรวจสอบความถูกต้องของการลงทุนให้เป็นไปตามนโยบายและกรอบการลงทุน กรอบการบริหารความเสี่ยง และกฎระเบียบที่เกี่ยวข้อง	ระดับความสำเร็จในการกำกับติดตามการลงทุนและประเมินผลการลงทุนของผู้บริหารสินทรัพย์ภายนอกสำหรับ LB21DA	576,580											คณะทำงาน/ ผู้จัดการ กองทุน/ คณะกรรมการ กองทุน
1.3 จัดทำรายงานผลการดำเนินงานรายเดือนและรายไตรมาส รวมถึงการจัดทำบัญชีและงบการเงินให้ถูกต้องตามมาตรฐานบัญชีและรูปแบบที่ สตง. กำหนด เพื่อให้การติดตามการดำเนินงานและการลงทุนมีความถูกต้อง โปร่งใส และตรวจสอบได้	สามารถรองรับความเสี่ยงจากการลงทุนที่เหมาะสมกับสถานะเศรษฐกิจและสภาพตลาดตราสารหนี้ได้ในหลากหลายมิติ	<ol style="list-style-type: none"> <li>รวบรวมผลการดำเนินงานและผลการเบิกจ่ายเงินรายเดือนและเสนอผู้จัดการกองทุนเพื่อทราบ</li> <li>รวบรวมและจัดทำรายงานผลการดำเนินงาน ผลการเบิกจ่ายและฐานะการเงินรายไตรมาสรายไตรมาสเสนอต่อกรรมการกองทุน เพื่อรายงานต่อรัฐมนตรีว่าการกระทรวงการคลังเพื่อทราบ</li> <li>รวบรวมข้อมูลการเบิกจ่าย สถานะการเงิน ทั้งด้านการดำเนินงานและการลงทุนเพื่อรายงานต่อ สตง.</li> </ol>	<ul style="list-style-type: none"> <li>จัดทำรายงานรายเดือนเสนอผู้จัดการกองทุนภายใน 10 วันทำการของเดือนถัดไป</li> <li>จัดทำรายงานรายไตรมาสเสนอรัฐมนตรีว่าการกระทรวงการคลังภายใน 45 วันนับแต่สิ้นสุดไตรมาส</li> <li>จัดทำงบการเงินส่ง สตง. ภายใน 60 วันหลังสิ้นสุดปีงบประมาณ</li> </ul>	ระยะเวลาในการจัดทำรายงานผลการดำเนินงานรายเดือนและรายไตรมาส รวมถึงการจัดทำบัญชีและงบการเงินที่มีความถูกต้องและครบถ้วน	576,580											คณะทำงาน

แผนปฏิบัติการประจำปีงบประมาณ 2564

แผนงาน	เป้าหมายเชิงยุทธศาสตร์	ขั้นตอนการดำเนินการ	เป้าหมาย	ตัวชี้วัด	งบประมาณ ค่าใช้จ่าย (บาท)	ระยะเวลาการดำเนินงาน												ผู้รับผิดชอบ				
						ไตรมาสที่ 1	ไตรมาสที่ 2	ไตรมาสที่ 3	ไตรมาสที่ 4													
						ต.ค.พ.ย.ธ.ค.ม.ค.ก.พ.	มี.ค.เม.ย.พ.ค.มิ.ย.ก.ค.ส.ค.ก.ย.															
<b>ยุทธศาสตร์ที่ 2 การสร้างความเชื่อมั่นในศักยภาพของประเทศในการบริหารหนี้สาธารณะและพัฒนาตลาดตราสารหนี้ให้เติบโตอย่างยั่งยืน</b>																						
2.1 กำหนดแผนการลงทุนที่สามารถป้องกันความเสี่ยงในการปรับโครงสร้างหนี้สาธารณะ	สร้างความเชื่อมั่นให้สาธารณชนทั้งในและต่างประเทศในการบริหารหนี้สาธารณะของประเทศ	<ol style="list-style-type: none"> <li>ประสานงานกับกระทรวงการคลังเกี่ยวกับประมาณการระยะเวลาและวงเงินที่จะกู้เงินเพื่อ Pre-Funding</li> <li>ศึกษาและวิเคราะห์ตลาดตราสารหนี้ในประเทศ</li> <li>จัดทำแผนการลงทุนเพื่อรองรับเงินกู้เพื่อ Pre-Funding เพื่อให้กระทรวงการคลังสามารถวางแผนการออก Benchmark Bond เพื่อสร้างอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงในตลาดได้ตามความจำเป็น</li> </ol>	<p>กปฟ. มีแผนการลงทุนเพื่อรองรับการ Pre-Funding ที่เกิดจากการออก Benchmark Bond ขนาดใหญ่ของกระทรวงการคลัง โดยในปีงบประมาณ 2564 กปฟ. จะได้รับเงิน Pre-Funding จาก LB21DA ประมาณ 120,000 ลบ. โดยแผนดังกล่าวดำเนินการแล้วเสร็จก่อนเริ่มการลงทุน</p>	ระดับความสำเร็จในการจัดทำแผนการลงทุน	412,500	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	คณะกรรมการดำเนินงาน/คณะกรรมการการดำเนินงาน/คณะกรรมการกองทุน
2.2 ศึกษาแนวทางการบริหารจัดการลงทุนด้วยระบบปัญญาประดิษฐ์ (Artificial Intelligence: AI)	เป็นเครื่องมือสนับสนุนการออกพันธบัตรรัฐบาลเพื่อสร้างอัตราดอกเบี้ยอ้างอิงและการพัฒนาตลาดตราสารหนี้ในประเทศ	<ol style="list-style-type: none"> <li>รวบรวมข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการบริหารจัดการลงทุนด้วยระบบปัญญาประดิษฐ์ (Artificial Intelligence: AI)</li> <li>ศึกษากฎหมาย ระเบียบ ข้อบังคับ ประกาศ และข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับการบริหารจัดการการลงทุนของ กปฟ.</li> <li>วิเคราะห์รูปแบบการบริหารจัดการลงทุนด้วยระบบปัญญาประดิษฐ์ (Artificial Intelligence: AI) เพื่อให้สามารถวิเคราะห์ข้อมูลเชิงลึกได้เป็นจำนวนมากและปรับการวิเคราะห์ข้อมูลได้หลายมุมมอง</li> <li>จัดทำผลการศึกษา</li> <li>นำเสนอผลต่อคณะกรรมการกองทุน</li> </ol>	<p>สามารถดำเนินการแล้วเสร็จตามแผนการปฏิบัติงานคิดเป็นร้อยละ 100 และเสนอคณะกรรมการกองทุนภายในเดือนกันยายน 2564</p>	ระดับความสำเร็จในการศึกษาแนวทางการบริหารจัดการลงทุนด้วยระบบปัญญาประดิษฐ์ (Artificial Intelligence: AI)	997,300	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■	คณะกรรมการกองทุน	

แผนปฏิบัติการประจำปีงบประมาณ 2564

แผนงาน	เป้าหมายเชิงยุทธศาสตร์	ขั้นตอนการดำเนินการ	เป้าหมาย	ตัวชี้วัด	งบประมาณ ค่าใช้จ่าย (บาท)	ระยะเวลาการดำเนินงาน				ผู้รับผิดชอบ	
						ไตรมาสที่ 1 ต.ค.พ.ยธ.ค.	ไตรมาสที่ 2 ม.ค.ก.พมี.ค.	ไตรมาสที่ 3 เม.ยพ.คมี.ย.	ไตรมาสที่ 4 ก.ค.ค.ก.ย		
ยุทธศาสตร์ที่ 2 การสร้างความเชื่อมั่นในศักยภาพของประเทศในการบริหารหนี้สาธารณะและพัฒนาตลาดตราสารหนี้ให้เติบโตอย่างยั่งยืน											
2.3 จัดทำแผนประชาสัมพันธ์ และให้ความรู้สาธารณชนถึงความสำคัญของ กปพ. ที่มีต่อความน่าเชื่อถือของประเทศ และการเติบโตของตลาดตราสารหนี้ รวมถึงจัดทำผลงานทางวิชาการเผยแพร่ผ่านช่องทางที่มีประสิทธิภาพและประสิทธิผล	สร้างความเชื่อมั่นให้สาธารณชนทั้งในและต่างประเทศในการบริหารหนี้สาธารณะของประเทศ	<ol style="list-style-type: none"> <li>วางแผนการจัดกิจกรรมเพื่อประชาสัมพันธ์องค์กร</li> <li>จัดทำ Facebook Page เพื่อเพิ่มช่องทางการประชาสัมพันธ์</li> <li>ประสานงานกับกระทรวงการคลังเพื่อขอร่วมออกบูธในงาน Money Expo 2021</li> <li>ประสานงานกับกรมบัญชีกลางเพื่อขอร่วมออกบูธในงานมอบรางวัลทุนหมุนเวียนดีเด่น ประจำปี 2564</li> <li>จัดกิจกรรมประชาสัมพันธ์ที่บูธและ Facebook Page โดยมีการมอบของรางวัลเพื่อจูงใจ</li> <li>เผยแพร่ผลงานทางวิชาการบนเว็บไซต์ของ กปพ.</li> </ol>	สามารถดำเนินการแล้วเสร็จตามแผนการปฏิบัติงานคิดเป็นร้อยละ 100	ระดับความสำเร็จของการจัดทำและดำเนินการตามแผนประชาสัมพันธ์	0						คณะทำงาน

แผนปฏิบัติการประจำปีงบประมาณ 2564

แผนงาน	เป้าหมายเชิงยุทธศาสตร์	ขั้นตอนการดำเนินการ	เป้าหมาย	ตัวชี้วัด	งบประมาณ ค่าใช้จ่าย (บาท)	ระยะเวลาการดำเนินงาน										ผู้รับผิดชอบ	
						ไตรมาสที่ 1		ไตรมาสที่ 2		ไตรมาสที่ 3		ไตรมาสที่ 4					
						ต.ค.พ.	ย.ธ.ค.ม.	ค.ก.พ.	มี.ค.	ม.ย.พ.	ค.มิ.ย.	ก.ค.ก.	ส.ค.ก.ย.				
<b>ยุทธศาสตร์ที่ 3 การสร้างความเข้มแข็งภายในองค์กรเพื่อรองรับความท้าทายอย่างต่อเนื่อง</b>																	
3.1 ทบทวนแผนยุทธศาสตร์ระยะยาวและคู่มือการบริหารความเสี่ยงที่ชัดเจน ทันสมัยและเข้าใจง่ายเป็นประจำทุกปี	องค์กรมีการบริหารจัดการที่ดีตามหลักธรรมาภิบาล (Good Governance) และมีแผนยุทธศาสตร์ที่ตอบสนองพันธกิจและสนับสนุนการดำเนินงานของกองทุน	1. สํารวจความคิดเห็นของผู้ใช้บริการหลักและผู้มีส่วนได้ส่วนเสียทั้งทางตรงและทางอ้อม 2. วิเคราะห์ข้อคิดเห็นของผู้มีส่วนได้ส่วนเสียเพื่อนำมาใช้ประกอบการทบทวนและกำหนดวิสัยทัศน์ กลยุทธ์ เป้าหมาย และแผนยุทธศาสตร์ รวมถึงแผนปฏิบัติการประจำปี 2564 3. ระบุความเสี่ยงระดับองค์กรโดยมีเกณฑ์การพิจารณากระบวนการควบคุมภายในที่เพียงพอ และวิเคราะห์ความเสี่ยงที่ยังคงเหลืออยู่ในปีงบประมาณที่ผ่านมา 4. ทบทวนคู่มือการบริหารความเสี่ยง และแผนการบริหารความเสี่ยงประจำปี 2565 ที่สอดคล้องกับแผนยุทธศาสตร์ และแผนปฏิบัติการประจำปี 2565	- แผนยุทธศาสตร์ระยะยาวและแผนปฏิบัติการประจำปี 2565 ได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการภายในเดือน ก.ค. 64 - คู่มือการบริหารความเสี่ยงและแผนการบริหารความเสี่ยงและควบคุมภายในประจำปี 2565 ได้รับความเห็นชอบจากคณะกรรมการและมีการเผยแพร่ให้ผู้บริหารและพนักงานภายในเดือน ก.ย. 64	- ระดับความสำเร็จในการทบทวนแผนยุทธศาสตร์ระยะยาว และการจัดทำแผนปฏิบัติการประจำปี 2565 - ระดับความสำเร็จในการทบทวนคู่มือการบริหารความเสี่ยง และการจัดทำแผนการบริหารความเสี่ยงและควบคุมภายในประจำปี 2565	86,800												คณะกรรมการ/คณะกรรมการกองทุน
3.2 ทบทวนแผนยุทธศาสตร์การบริหารทรัพยากรบุคคล และจัดทำแผนพัฒนาบุคลากรประจำปี 2565 เพื่อให้บุคลากรมีความรู้ความสามารถด้านการบริหารจัดการลงทุนและการพัฒนาตลาดตราสารหนี้	บุคลากรมีศักยภาพและความพร้อมสามารถขับเคลื่อนการดำเนินงานตามยุทธศาสตร์ได้อย่างมีประสิทธิภาพ	1. สํารวจความต้องการเพิ่มศักยภาพในการทำงานของบุคลากร 2. วิเคราะห์หลักสูตรที่เหมาะสมกับการพัฒนาศักยภาพและความต้องการของบุคลากร 3. เสนอโครงการเพื่อขออนุมัติจัดอบรมเพิ่มศักยภาพบุคลากร 4. บุคลากรเข้ารับการศึกษาอบรม 5. จัดทำรายงานและประเมินผลการฝึกอบรม	ดำเนินการตามแผนได้ร้อยละ 100 โดยมีผลการดำเนินงานดีกว่าเป้าหมายทุกแผนงาน และมีการจัดทำรายงานปัจจัยสำเร็จ ปัญหา อุปสรรคและข้อเสนอแนะ	ระดับความสำเร็จในการจัดทำแผนยุทธศาสตร์การบริหารทรัพยากรบุคคล และจัดทำแผนพัฒนาบุคลากรประจำปี 2565	150,000												คณะกรรมการ

แผนปฏิบัติการประจำปีงบประมาณ 2564

แผนงาน	เป้าหมายเชิงยุทธศาสตร์	ขั้นตอนการดำเนินการ	เป้าหมาย	ตัวชี้วัด	งบประมาณ ค่าใช้จ่าย (บาท)	ระยะเวลาการดำเนินงาน				ผู้รับผิดชอบ	
						ไตรมาสที่ 1 ต.ค.พ.ยธ.ค.	ไตรมาสที่ 2 ม.ค.ก.พมี.ค.	ไตรมาสที่ 3 เม.ยพ.คมิ.ยก.	ไตรมาสที่ 4 ก.ค.ค.ก.ย.		
<b>ยุทธศาสตร์ที่ 3 การสร้างความเข้มแข็งภายในองค์กรเพื่อรองรับความท้าทายอย่างต่อเนื่อง</b>											
3.3 พัฒนาและปรับปรุงโครงสร้างพื้นฐานด้านเทคโนโลยีสารสนเทศในการกำกับติดตามผลการลงทุนเพื่อสนับสนุนภารกิจหลักของกองทุน	ระบบเทคโนโลยีสารสนเทศ สนับสนุนการปฏิบัติงานของบุคลากร และการกำหนดนโยบายของผู้บริหาร	1. ศึกษาแนวทางการพัฒนาและปรับปรุงโครงสร้างพื้นฐานด้านเทคโนโลยีสารสนเทศในด้านการกำกับติดตามผลการลงทุน 2. วิเคราะห์ระบบการกำกับติดตามผลการลงทุนในปัจจุบัน 3. วางแผนการพัฒนาระบบสารสนเทศในด้านการกำกับติดตามผลการลงทุนที่เหมาะสมกับ กปฟ. 4. ดำเนินการตามแผนพัฒนาระบบสารสนเทศในด้านการกำกับติดตามผลการลงทุน 5. ประเมินผลการดำเนินงาน	มีระบบสารสนเทศในด้านการกำกับติดตามผลการลงทุนให้เป็นไปตามกฎระเบียบที่เกี่ยวข้อง	ระดับความสำเร็จของการจัดทำแผนพัฒนาและปรับปรุงโครงสร้างพื้นฐานด้านเทคโนโลยีสารสนเทศในด้านการกำกับติดตามผลการลงทุน	0					คณะทำงาน	