

[แนบท้ายประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติม

โดยประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๓๒/๒๕๖๗ (ฉบับที่ ๔)]

### เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ผู้ประกอบการธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลมีหน้าที่ยื่นรายงานต่อสำนักงาน

เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดใน ส่วนที่ ๑ ให้ใช้คำศัพท์ตาม ส่วนที่ ๒ ประกอบการพิจารณาการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังกล่าวด้วย

### ส่วนที่ ๑ กรณีที่ผู้ประกอบการธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลมีหน้าที่ยื่นรายงานชี้แจงสาเหตุต่อสำนักงาน (early warning)

ในกรณีที่ผู้ประกอบการธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลมีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเมื่อสิ้นวันใดไม่เกินระดับ early warning ตามตารางด้านล่าง ให้ยื่นรายงานตามข้อ ๗ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบการและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ลงวันที่ ๙ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓

ตารางระดับ early warning		
สำหรับผู้ประกอบการธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลทุกประเภท (ไม่รวมผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัล)		
กรณี	เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้องดำรงตามตารางการดำรงเงินกองทุน	ระดับ early warning
๑.	กรณีที่ต้องดำรงไม่น้อยกว่าผลรวมดังนี้ (๑) เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (๒) เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้าและมูลค่าซื้อขาย	เมื่อดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ไม่เกินผลรวมดังนี้ (๑) ๑.๕ เท่าของเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (๒) ๑.๕ เท่าของเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้าและมูลค่าซื้อขายในส่วนที่ไม่เกิน ๑๐๐ ล้านบาทแรก (๓) ๑.๒ เท่าของเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้าและมูลค่าซื้อขายในส่วนที่เกินกว่า ๑๐๐ ล้านบาท

ตารางระดับ early warning		
สำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลทุกประเภท (ไม่รวมผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัล)		
กรณี	เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้อง ดำรงตามตารางการดำรง เงินกองทุน	ระดับ early warning
๒.	กรณีที่ต้องดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิไม่น้อยกว่าเงินกองทุนขั้นต่ำคงที่	เมื่อดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ไม่เกินผลรวมดังนี้ (๑) ๑.๕ เท่าของเงินกองทุนขั้นต่ำคงที่ (ไม่รวมมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกิน) (๒) ๑.๕ เท่าของมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกินในส่วนที่ไม่เกิน ๑๐๐ ล้านบาทแรก (๓) ๑.๒ เท่าของมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกินในส่วนที่เกินกว่า ๑๐๐ ล้านบาท
ระดับ early warning สำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลประเภท ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัล		
๓.	เมื่อดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ไม่เกิน ๑.๕ เท่าของเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้องดำรงตามที่กำหนดในตารางการดำรงเงินกองทุน	

## ส่วนที่ ๒ คำอธิบายศัพท์

ให้ใช้คำอธิบายศัพท์ดังต่อไปนี้เพื่อประกอบการอธิบายคำย่อและความหมายของคำย่อที่ปรากฏในส่วนที่ ๑

(๑) “ตารางการดำรงเงินกองทุน” หมายความว่า ตารางการดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ แนบท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ

(๒) “เงินกองทุนขั้นต่ำคงที่” หมายความว่า เงินกองทุนขั้นต่ำคงที่ที่ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลต้องดำรงตามที่กำหนดในตารางการดำรงเงินกองทุน

(๓) “สินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกิน” หมายความว่า เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่คำนวณจากสินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกิน (ถ้ามี) ซึ่งผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลต้องดำรงตามที่กำหนดในตารางการดำรงเงินกองทุน

(๔) “เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน” หมายความว่า เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลต้องดำรงตามที่กำหนดในตารางการดำรงเงินกองทุน โดยคำนวณจากมูลค่าหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (ถ้ามี)

(๕) “เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้าและมูลค่าซื้อขาย” หมายความว่า เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลต้องดำรงตามที่กำหนดในตารางการดำรงเงินกองทุน โดยคำนวณจากมูลค่าทรัพย์สินของลูกค้าที่ผู้ประกอบธุรกิจจัดเก็บ (custody risk) และมูลค่าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล (trading service risk)