

[แนบท้ายประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติม

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

เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ผู้ประกอบการธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลมีหน้าที่ยื่นรายงานต่อสำนักงาน

เพื่อประโยชน์ในการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในส่วนที่ ๑ ให้ใช้คำศัพท์ตามส่วนที่ 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.	กรณีที่ต้องดำรงเงินกองทุน สภาพคล่องสุทธิไม่น้อยกว่า เงินกองทุนขั้นต่ำคงที่	เมื่อดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ไม่เกินผลรวม ดังนี้ (๑) ๑.๕ เท่าของเงินกองทุนขั้นต่ำคงที่ (ไม่รวมมูลค่า สินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกิน) (๒) ๑.๕ เท่าของมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกินในส่วน ที่ไม่เกิน ๑๐๐ ล้านบาทแรก (๓) ๑.๒ เท่าของมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกินในส่วน ที่เกินกว่า ๑๐๐ ล้านบาท
ระดับ early warning สำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลประเภท ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัล		
๓.	เมื่อดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้ไม่เกิน ๑.๕ เท่าของเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้อง ดำรงตามที่กำหนดในตารางการดำรงเงินกองทุน	

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)