

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. ๓ ๒ /๒๕๖๗

เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุน

ของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณี

ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้

(ฉบับที่ ๕)

อาศัยอำนาจตามมาตรา ๑๔ วรรคสอง (๒) และมาตรา ๑๙ แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. ๒๕๔๖ และข้อ ๖ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. ๒๖/๒๕๖๓ เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ ลงวันที่ ๘ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓ และข้อ ๙ ข้อ ๙/๑ และข้อ ๙/๒ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. ๒๖/๒๕๖๓ เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ ลงวันที่ ๘ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. ๓ ๐ /๒๕๖๗ เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ (ฉบับที่ ๕) ลงวันที่ ๒๕ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๗ และข้อ ๑ (๓) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๕๙/๒๕๕๒ เรื่อง หลักเกณฑ์และกำหนดเวลาในการยื่นรายงานของบริษัทหลักทรัพย์ ลงวันที่ ๓ สิงหาคม พ.ศ. ๒๕๕๒ สำนักงานออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ให้ยกเลิก (๒) ของบทนิยามคำว่า “รายงานการคำนวณเงินกองทุน” ในข้อ ๓ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ลงวันที่ ๙ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓

ข้อ ๒ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นข้อ ๓/๑ ก่อนหมวด ๑ การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุน แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ลงวันที่ ๙ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓

“ข้อ ๓/๑ ประกาศนี้กำหนดหลักเกณฑ์ในเรื่องดังต่อไปนี้

(๑) การคำนวณและรายงานการคำนวณเงินกองทุน ให้เป็นไปตามหมวด ๑

(๒) ข้อกำหนดในกรณีผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ให้เป็นไปตามหมวด ๒

(๓) ข้อกำหนดในกรณีที่ผู้ประกอบการธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ให้เป็นไปตามหมวด ๓”

ข้อ ๓ ให้ยกเลิกความใน (๑/๑) ของวรรคหนึ่งในข้อ ๕ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ลงวันที่ ๙ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๒๔/๒๕๖๕ เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ (ฉบับที่ ๒) ลงวันที่ ๒ กันยายน พ.ศ. ๒๕๖๕ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“(๑/๑) กรณีเป็นผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล ให้ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิรายวันตาม (๑) ต่อสำนักงานภายในวันทำการถัดจากวันที่จัดทำรายงานดังกล่าว”

ข้อ ๔ ให้ยกเลิก (๓) ในวรรคหนึ่งของข้อ ๕ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ลงวันที่ ๙ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓

ข้อ ๕ ให้ยกเลิกความในข้อ ๖ และข้อ ๗ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ลงวันที่ ๙ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ข้อ ๖ เมื่อปรากฏว่าผู้ประกอบการธุรกิจหลักทรัพย์หรือผู้ประกอบการสัญญาซื้อขายล่วงหน้ารายใดมีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเมื่อสิ้นวันเท่ากับหรือน้อยกว่า ๑.๕ เท่าของเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ผู้ประกอบการต้องดำรงไว้ ให้ผู้ประกอบการรายนั้นดำเนินการดังต่อไปนี้ เว้นแต่สำนักงานจะกำหนดให้ปฏิบัติเป็นประการอื่น

(๑) ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของวันที่เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของผู้ประกอบธุรกิจเท่ากับหรือน้อยกว่าอัตราดังกล่าวและของทุกวันทำการถัดไปต่อสำนักงานภายในวันทำการถัดจากวันที่เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเท่ากับหรือน้อยกว่าอัตราดังกล่าว จนกว่าผู้ประกอบธุรกิจจะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้มากกว่าอัตราดังกล่าวเป็นเวลาไม่น้อยกว่า ๒ วันทำการติดต่อกัน และผู้ประกอบธุรกิจได้ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิของ ๒ วันทำการนั้นต่อสำนักงานแล้ว

(๒) ยื่นรายงานชี้แจงสาเหตุที่เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิลดลงจนถึงอัตราดังกล่าว พร้อมทั้งแจ้งแนวทางการดำเนินการที่ผู้ประกอบธุรกิจจะกลับมาดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้มากกว่าอัตราดังกล่าวต่อสำนักงานภายในวันทำการถัดจากวันที่เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเท่ากับหรือน้อยกว่าอัตราดังกล่าว

ความในวรรคหนึ่งไม่ใช่บังคับกับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์หรือผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่เป็นผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลด้วย โดยให้ผู้ประกอบธุรกิจดังกล่าวดำเนินการตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในข้อ ๗

ข้อ ๗ ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลมีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเมื่อสิ้นวันใดเท่ากับหรือน้อยกว่าระดับเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่กำหนดในภาคผนวกเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลมีหน้าที่ยื่นรายงานต่อสำนักงานท้ายประกาศนี้ ให้ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลยื่นรายงานชี้แจงสาเหตุต่อสำนักงานภายในวันทำการถัดไป

ในการยื่นรายงานตามวรรคหนึ่ง ให้ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลแจ้งแนวทางการดำเนินการเพื่อให้มีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิมากกว่าจำนวนดังกล่าวด้วย”

ข้อ ๖ ให้ยกเลิกชื่อหมวด ๒ ข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ลงวันที่ ๙ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“หมวด ๒

ข้อกำหนดในกรณีผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์และผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้

_____”

ข้อ ๗ ให้เพิ่มความต่อไปนี้เป็นหมวด ๓ ข้อกำหนดในกรณีและผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ข้อ ๑๘ ข้อ ๑๙ ข้อ ๒๐ และข้อ ๒๑ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ลงวันที่ ๙ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓

“หมวด ๓

ข้อกำหนดในกรณีและผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้

ข้อ ๑๘ ความในหมวดนี้มีวัตถุประสงค์ในการกำหนดหลักเกณฑ์เกี่ยวกับการดำเนินการในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ เพื่อประโยชน์ในการแก้ไขฐานะการดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล การคุ้มครองลูกค้า และการป้องกันความเสี่ยงในตลาดสินทรัพย์ดิจิทัล

ข้อ ๑๙ ในระหว่างที่ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลประเภทศูนย์ซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล นายหน้าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล หรือผู้ค้าสินทรัพย์ดิจิทัล ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้หรืออยู่ในระหว่างดำเนินการตามแผนการแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนที่ได้แจ้งต่อสำนักงานตามข้อ ๙/๑ แห่งประกาศการดำรงเงินกองทุน ห้ามมิให้ดำเนินการในส่วนที่เกี่ยวกับการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลดังต่อไปนี้ จนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนได้และได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ประกอบธุรกิจได้ตามปกติ

(๑) ให้บริการหรือเปิดบัญชีเพื่อการให้บริการแก่ลูกค้ารายใหม่

(๒) เพิ่มวงเงินซื้อขายให้แก่ลูกค้า

(๓) ลงทุนเพื่อเป็นทรัพย์สินของผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลเพิ่มเติม เว้นแต่เป็นการกระทำเพื่อประโยชน์ในการดำรงเงินกองทุนหรือเพื่อให้บริการธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลตามลักษณะการให้บริการตามปกติ

(๔) กระทำอื่นใดที่มีลักษณะเป็นการเพิ่มความเสี่ยงต่อฐานะการเงิน การดำเนินงาน หรือการปฏิบัติตามข้อตกลงกับลูกค้าตามที่สำนักงานกำหนด

ข้อ ๒๐ ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลประเภทศูนย์ซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล นายหน้าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล หรือผู้ค้าสินทรัพย์ดิจิทัล ไม่จัดส่งแผนหรือแนวทางการแก้ไขหรือไม่สามารถแก้ไขปัญหาการดำรงเงินกองทุนได้ตามระยะเวลาที่กำหนด หรือมีเงินกองทุนต่ำกว่าที่กำหนด ตามข้อ ๘/๒ แห่งประกาศการดำรงเงินกองทุน ให้ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลดังกล่าวดำเนินการ ดังต่อไปนี้

(๑) ระวังการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลทุกประเภทจนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนได้ และได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ดำเนินธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลได้ตามปกติ

(๒) แจ้งให้ลูกค้าทราบเป็นลายลักษณ์อักษรเกี่ยวกับการระงับการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลทุกประเภทตาม (๑) โดยไม่ชักช้า

(๓) กระทำการหรืองดเว้นการกระทำอื่นใดตามที่สำนักงานกำหนด

ข้อ ๒๑ ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลประเภทผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัล ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ให้ผู้ประกอบธุรกิจดังกล่าวดำเนินการตามที่กำหนดในข้อ ๒๐ (๑) (๒) และ (๓)”

ข้อ ๘ ให้เพิ่มภาคผนวกเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลมีหน้าที่ ยื่นรายงานต่อสำนักงานท้ายประกาศนี้ เป็นภาคผนวกเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลมีหน้าที่ยื่นรายงานต่อสำนักงาน ท้ายประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และ ตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ลงวันที่ ๙ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓

ข้อ ๙ ก่อนวันที่ ๑ พฤษภาคม พ.ศ. ๒๕๖๘ หากผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลรายใด ที่มีหน้าที่ต้องดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิตามข้อ ๖ วรรคสองแห่งประกาศคณะกรรมการกำกับ หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. ๓๐ /๒๕๖๗ เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ (ฉบับที่ ๔) ลงวันที่ ๒๔ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๗ มีเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิเมื่อสิ้นวันเท่ากับหรือน้อยกว่า ๑.๕ เท่าของเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิที่ต้องดำรง ให้ผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล รายดังกล่าวยื่นรายงานชี้แจงสาเหตุต่อสำนักงานภายในวันทำการถัดไป พร้อมทั้งแจ้งแนวทางการดำเนินการที่จะสามารถดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิได้มากกว่าอัตราดังกล่าว

เมื่อผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลได้ดำเนินการตามวรรคหนึ่งแล้ว ให้ผู้ประกอบธุรกิจดังกล่าว ได้รับยกเว้นไม่ต้องปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในข้อ ๗ แห่งประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับ หลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. ๖๔/๒๕๖๓ เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณ

เงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ลงวันที่ ๙ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศฉบับนี้

ข้อ ๑๐ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ ๑ พฤศจิกายน พ.ศ. ๒๕๖๗ เป็นต้นไป
ประกาศ ณ วันที่ ๒๔ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๗



(นางพรอนงค์ บุชราตระกูล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์