

แบบแสดงข้อมูลประกอบการจัดตั้งกองทุนรวมคริปโทอีทีเอฟ

ส่วนที่ 1: ความพร้อมด้านบุคลากร ระบบงาน และแนวทางการบริหารจัดการลงทุนในคริปโทเคอร์เรนซี

ทำเครื่องหมาย ☒ ในทุกข้อที่บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน (“บลจ.”) มีแนวทางหรือกระบวนการรองรับ

การส่งคำสั่งซื้อขาย

- ☐ บลจ. มีแนวทางการรับและโอนสินทรัพย์ดิจิทัล (“DA”) เข้าและออกจากกระเป๋าสินทรัพย์ดิจิทัล (“DA wallet”) ของกองทุน รวมถึงได้ตกลงแนวทางดังกล่าวร่วมกับผู้ค้าหน่วยลงทุนร่วม (“participant dealer”) และผู้ที่เกี่ยวข้องแล้ว เพื่อรองรับกระบวนการเพิ่ม (creation) หรือไถ่ถอน (redemption) หน่วยลงทุน ตลอดจนมีแนวทางรองรับกรณีที่ participant dealer ไม่สามารถดำเนินธุรกรรมได้
- ☐ บลจ. ได้กำหนดช่องทางที่ใช้สำหรับการซื้อ ขาย หรือแลกเปลี่ยน DA (เช่น ผ่านศูนย์ซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล หรือนายหน้าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล เป็นต้น) รวมถึงกำหนด workflow การส่งคำสั่งซื้อขายและการโอนย้าย DA ของกองทุน ร่วมกับผู้ดูแลผลประโยชน์ และ/หรือตัวแทนเก็บรักษาทรัพย์สินของกองทุน ตลอดจนมีแนวทางรองรับกรณีที่ช่องทางดังกล่าวไม่สามารถเปิดให้บริการซื้อขายได้ตามปกติ
- ☐ บลจ. มีแนวทางดำเนินการกรณีกองทุนได้รับสิทธิหรือสินทรัพย์ที่เกิดขึ้นโดยอัตโนมัติจากการถือครองคริปโทเคอร์เรนซี เช่น ได้รับดอกผลจากกระบวนการปรับปรุงบล็อกเชน (hard fork หรือ soft fork) หรือจากการแจกสินทรัพย์ดิจิทัล (airdrop) เป็นต้น

กรณีไม่มีแนวทางหรือกระบวนการรองรับในเรื่องใด โปรดระบุเหตุผลและแนวทางดำเนินการเพิ่มเติม (ถ้ามี)

.....

.....

.....

.....

.....

.....

การบริหารจัดการ DA wallet ของกองทุน

- ☐ บลจ. มีการกำหนดและจำกัดสิทธิของบุคลากรที่เกี่ยวข้องในการเข้าถึงบัญชีหรือ DA wallet ที่ใช้เก็บรักษาเงินหรือ DA ของกองทุนกับผู้ให้บริการซื้อขาย หรือแลกเปลี่ยนสินทรัพย์ดิจิทัล เพียงเท่าที่จำเป็นเพื่อวัตถุประสงค์ในการส่งคำสั่งซื้อขาย DA รวมถึงมีมาตรการรักษาความปลอดภัยในการเข้าถึงและดำเนินการเกี่ยวกับบัญชีหรือ DA wallet ดังกล่าว
- ☐ บลจ. มีนโยบายภายใน (internal policy) กำหนดสัดส่วนสูงสุดของเงินหรือ DA ที่สามารถคงไว้ในบัญชีหรือ DA wallet ที่เปิดไว้กับผู้ให้บริการซื้อขาย หรือแลกเปลี่ยนสินทรัพย์ดิจิทัล เพื่อรองรับการดำเนินงานหรือการทำธุรกรรมของกองทุน
- ☐ บลจ. มีกระบวนการติดตาม และรายงานธุรกรรมการซื้อขาย DA แก่ผู้ดูแลผลประโยชน์ และ/หรือตัวแทนเก็บรักษาทรัพย์สินของกองทุน

กรณีไม่มีแนวทางหรือกระบวนการรองรับในเรื่องใด โปรดระบุเหตุผลและแนวทางดำเนินการเพิ่มเติม (ถ้ามี)

.....

.....

.....

.....

.....

.....

การคำนวณมูลค่าทรัพย์สินสุทธิ (NAV)

- ☐ บลจ. และผู้ดูแลผลประโยชน์ได้มีการตกลงร่วมกันเกี่ยวกับแหล่งราคาดัชนีและเวลาที่ใช้ในการคำนวณมูลค่ายุติธรรมของเงินลงทุนใน DA โดยเป็นไปตามแนวทางที่กำหนดในประกาศสมาคมบริษัทจัดการลงทุนที่ สจก. 1/2568 เรื่อง หลักเกณฑ์และวิธีการกำหนดมูลค่ายุติธรรมของเงินลงทุนเพื่อใช้ในการคำนวณมูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุนรวม กองทุนส่วนบุคคล และกองทุนสำรองเลี้ยงชีพ ในกรณีที่ลงทุนในสินทรัพย์ดิจิทัล ลงวันที่ 6 สิงหาคม พ.ศ. 2568
- ☐ บลจ. มีแนวทางรองรับกรณีราคาดัชนีที่ใช้ในการคำนวณมูลค่ายุติธรรมผันผวนสูง หรือมีเหตุที่ควรเชื่อได้ว่าดัชนีดังกล่าวไม่ได้สะท้อนราคาได้อย่างเหมาะสม หรือไม่สามารถแสดงราคาได้อย่างเหมาะสม

กรณีไม่มีแนวทางหรือกระบวนการรองรับในเรื่องใด โปรดระบุเหตุผลและแนวทางดำเนินการเพิ่มเติม (ถ้ามี)

.....

.....

.....

.....

.....

ส่วนที่ 2: รายชื่อผู้ให้บริการที่เกี่ยวข้องและจำเป็นต่อการจัดการกองทุนรวมคริปโทอีทีเอฟ

ที่	ประเภทผู้ให้บริการ	รายชื่อผู้ให้บริการ
1	ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัล (DA custodian)	
2	ผู้ดูแลสภาพคล่อง (market maker)	
3	ผู้ค้าหน่วยลงทุนร่วม (participant dealer)	
4	ผู้ให้บริการซื้อ ขาย หรือแลกเปลี่ยนสินทรัพย์ดิจิทัล / ช่องทางที่จะใช้สำหรับการซื้อ ขาย หรือแลกเปลี่ยนสินทรัพย์ดิจิทัล	
5	ผู้จัดการเงินทุนสินทรัพย์ดิจิทัล (Digital Asset Fund Manager) (ถ้ามี)	
6	ที่ปรึกษาสินทรัพย์ดิจิทัล (Digital Asset Advisory Service) (ถ้ามี)	
7	บุคคลอื่นที่ให้บริการในด้านต่าง ๆ ที่จำเป็นต่อการลงทุนในคริปโทเคอร์เรนซี (ถ้ามี)	

ผู้จัดทำ (maker) :(ระบุชื่อ).....

ผู้สอบทาน (checker) :(ระบุชื่อ).....

วันที่ :