

การดำเนินการกรณีผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลไม่สามารถดำรงเงินกองทุนโดยวิธี NC-4

[แนบท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 19/2561 ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติม

โดยประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. 27/2565 (ฉบับที่ 18)]

การดำเนินการกรณีผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลไม่สามารถดำรงเงินกองทุนโดยวิธี NC-4

ในกรณีที่ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลที่มีหน้าที่ต้องดำรงเงินกองทุนโดยวิธี NC-4¹ ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนดังกล่าว ให้ดำเนินการตามหลักเกณฑ์ในตารางดังนี้

ประเภทของผู้ประกอบธุรกิจ		วิธีการดำรงเงินกองทุน	การดำเนินการกรณีไม่สามารถดำรงเงินกองทุน
(1)	ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลที่ไม่ได้เป็นผู้ประกอบธุรกิจประเภท (2) (3) หรือ (4)	ดำรงเงินกองทุนไม่น้อยกว่ามูลค่าสูงสุดระหว่างเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 1) กับเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 2)	ให้ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลดำเนินการตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดเกี่ยวกับกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนโดยวิธี NC-1 ตามข้อ 16/1 โดยอนุโลม

¹ หลักเกณฑ์การดำรงเงินกองทุนโดยวิธี NC-4 ของภาคผนวก 1 การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ

ประเภท 1 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ \geq 25 ล้านบาท

ประเภท 2 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (% ของมูลค่าทรัพย์สินของลูกค้า) \geq 100% ของทรัพย์สินที่จัดเก็บในระบบของผู้ประกอบธุรกิจที่ไม่ได้เชื่อมต่อกับเครือข่ายเมื่อทำธุรกรรมเท่านั้น (hot wallet) และ \geq 2% ของทรัพย์สินที่จัดเก็บในระบบของผู้ประกอบธุรกิจที่เชื่อมต่อกับเครือข่ายเมื่อทำธุรกรรมเท่านั้น (cold wallet)

ประเภท 3 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (รองรับความต่อเนื่องของธุรกิจ) \geq มูลค่าของค่าใช้จ่ายที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจโดยเฉลี่ยในรอบ 3 เดือนต่อปี

ประเภท 4 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (รองรับความรับผิดชอบจากการปฏิบัติงาน) \geq 0.01% ของ NAV

ประเภท 5 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (รองรับความรับผิดชอบจากการปฏิบัติงาน) \geq 12% ของรายได้ที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจโดยเฉลี่ยต่อปี

ประเภท 6 เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ \geq มูลค่า 10% ของรายได้ต่อปีเฉลี่ยในรอบ 3 ปีล่าสุด แต่ไม่เกิน 5 ล้านบาท ทั้งนี้ เฉพาะรายได้ที่เกี่ยวข้องกับการประกอบธุรกิจ

ประเภทของผู้ประกอบธุรกิจ	วิธีการดำรงเงินกองทุน	การดำเนินการกรณีไม่สามารถดำรงเงินกองทุน
(2) ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลและเป็นผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลและเป็นบริษัทหลักทรัพย์หรือผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งมีหน้าที่ต้องดำรงเงินกองทุนตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจการจัดการกองทุนรวม การจัดการกองทุนส่วนบุคคล การเป็นนายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์และการค้าหลักทรัพย์และการจัดจำหน่ายหลักทรัพย์ที่เป็นหน่วยลงทุน และการเป็นผู้จัดการเงินทุนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า	1. กรณีเป็นบริษัทจัดการ ให้ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 4) หรือกรณีเป็นผู้ประกอบธุรกิจอื่นที่มีใช้บริษัทจัดการ ให้ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 5)	- ²
	2. ดำรงเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 2)	ให้ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลดำเนินการตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดเกี่ยวกับกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนโดยวิธี NC-1 ตามข้อ 16/1 โดยอนุโลม ทั้งนี้ เฉพาะในส่วนที่เป็นการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล
	3. ดำรงเงินกองทุนไม่น้อยกว่ามูลค่าสูงสุดระหว่างเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 1) กับเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 3)	- ²
(3) ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลและเป็นบริษัทหลักทรัพย์หรือผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งมีหน้าที่ต้องดำรงเงินกองทุนตามประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงเงินกองทุน	<p>ดำรงเงินกองทุนไม่น้อยกว่ามูลค่าสูงสุดระหว่าง</p> <p>1. จำนวนไม่น้อยกว่ามูลค่าสูงสุดระหว่างเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 1) กับ เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 3) กับ</p> <p>2. เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 2) ซึ่งรวมกับเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 6)</p>	ให้ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลดำเนินการตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดเกี่ยวกับกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนโดยวิธี NC-1 ตามข้อ 16/1 โดยอนุโลม ทั้งนี้ เฉพาะในส่วนที่เป็นการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล

² การดำเนินการกรณีไม่สามารถดำรงเงินกองทุนโดยวิธี NC-4 ในส่วนที่เป็นการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์หรือการประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ให้บริษัทหลักทรัพย์หรือผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าดำเนินการตามประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการคำนวณและการจัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุน

ประเภทของผู้ประกอบธุรกิจ		วิธีการดำรงเงินกองทุน	การดำเนินการกรณีไม่สามารถดำรงเงินกองทุน
	ของผู้ประกอบธุรกิจการเป็นที่ปรึกษาการลงทุนและที่ปรึกษาสัญญาซื้อขายล่วงหน้า		
(4)	ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลและเป็นศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ ³	ดำรงเงินกองทุนไม่น้อยกว่ามูลค่าสูงสุดระหว่างเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 1) กับ เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (ประเภท 2)	ให้ผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลดำเนินการตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดเกี่ยวกับกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนโดยวิธี NC-1 ตามข้อ 16/1 โดยอนุโลม ทั้งนี้ เฉพาะในส่วนที่เป็นการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล

³ วิธีการดำรงเงินกองทุนของผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัลที่เป็นศูนย์รับฝากหลักทรัพย์เป็นวิธีการดำรงเงินกองทุนสำหรับการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลเท่านั้น ทั้งนี้ ในส่วนของการประกอบกิจการเป็นศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ให้ศูนย์รับฝากหลักทรัพย์ดำเนินการตามประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุนว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการในการประกอบกิจการเป็นสำนักหักบัญชีหลักทรัพย์และศูนย์รับฝากหลักทรัพย์