

-ร่าง-

ประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

ที่ สธ. /๒๕๖๘

เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุน

ของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณี

ที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้

(ฉบับที่)

อาศัยอำนาจตามมาตรา ๑๔๑ วรรคสอง แห่งพระราชบัญญัติหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ พ.ศ. ๒๕๓๕ และมาตรา ๑๔ วรรคสอง (๒) มาตรา ๑๙ และมาตรา ๕๐ แห่งพระราชบัญญัติสัญญาซื้อขายล่วงหน้า พ.ศ. ๒๕๔๖ และข้อ ๖ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. ๒๖/๒๕๖๓ เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ ลงวันที่ ๘ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓ และข้อ ๙/๑ และข้อ ๙/๒ แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. ๒๖/๒๕๖๓ เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ ลงวันที่ ๘ ตุลาคม พ.ศ. ๒๕๖๓ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติมโดยประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ [กธ. /๒๕๖๘] เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ (ฉบับที่) [ลงวันที่ พ.ศ. ๒๕๖๘] และข้อ ๒ วรรคหนึ่ง (๓) แห่งประกาศคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ ทธ. ๒๙/๒๕๖๗ เรื่อง หลักเกณฑ์และกำหนดเวลาในการยื่นรายงานของบริษัทหลักทรัพย์ ลงวันที่ ๖ กันยายน พ.ศ. ๒๕๖๗ สำนักงานออกประกาศไว้ดังต่อไปนี้

ข้อ ๑ ให้ยกเลิกภาคผนวก ๑ การจัดทำและยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ ท้ายประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ [สธ. /๒๕๖๘] เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ (ฉบับที่) [ลงวันที่ พ.ศ. ๒๕๖๘] และให้ใช้ภาคผนวก ๑ การจัดทำและยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ ท้ายประกาศนี้แทน

ข้อ ๒ ให้ยกเลิกความในส่วนที่ ๓ หลักเกณฑ์สำหรับธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล ของภาคผนวก ๒ การดำเนินการในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ ท้ายประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับตลาดทุน ที่ [สธ. /๒๕๖๘] เรื่อง การคำนวณและการรายงานการ

คำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ (ฉบับที่)
[ลงวันที่ พ.ศ. ๒๕๖๘] และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“ส่วนที่ ๓ หลักเกณฑ์สำหรับธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล

กรณีเป็นผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล ให้ผู้ประกอบธุรกิจที่ไม่สามารถดำรง NC ได้
ดำเนินการในส่วนที่เกี่ยวกับการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล ดังนี้

ข้อ	สาเหตุ	หลักเกณฑ์เกี่ยวกับการดำเนินการในกรณีที่ดำรง NC ไม่ได้	หลักเกณฑ์เพิ่มเติม
๑.	เมื่อผู้ประกอบธุรกิจ (๑) ไม่สามารถดำรง NC ได้ (๒) อยู่ระหว่างจัดทำแผนการแก้ไข หรือ (๓) อยู่ระหว่างดำเนินการตามแผนการแก้ไข	ห้ามดำเนินการดังนี้ จนกว่าจะสามารถดำรง NC และได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ประกอบธุรกิจได้ตามปกติ ๑. เพิ่มวงเงินซื้อขายให้แก่ลูกค้า	-
		๒. ให้บริการหรือเปิดบัญชีซื้อขายแก่ลูกค้ารายใหม่	-
		๓. เพิ่มเงินลงทุนของบริษัท (portfolio) เว้นแต่เป็นการกระทำเพื่อประโยชน์ในการดำรง NC หรือเพื่อให้บริการธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลตามลักษณะการให้บริการตามปกติ	-
		๔. กระทำอื่นใดที่มีลักษณะเป็นการเพิ่มความเสี่ยงต่อฐานะการเงิน การดำเนินงาน หรือการปฏิบัติตามข้อตกลงกับลูกค้า ทั้งนี้ ตามที่สำนักงานกำหนด	-
๒.	เมื่อผู้ประกอบธุรกิจไม่สามารถดำรง NC ได้ และปรากฏเหตุอย่างใดอย่างหนึ่งดังนี้ (๑) ไม่สามารถยื่นแผนการแก้ไขต่อสำนักงานภายใน ๑๕ วัน นับแต่วันแรกที่ผู้ประกอบธุรกิจไม่สามารถดำรง NC ได้ เว้นแต่ก่อน	๑. ระงับการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลทุกประเภทจนกว่าจะสามารถดำรง NC ได้ และได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ดำเนินธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลได้ตามปกติ	ให้ผู้ประกอบธุรกิจแจ้งการระงับการประกอบธุรกิจให้ลูกค้าทุกรายทราบเป็นลายลักษณ์อักษรถึงการดำเนินการดังกล่าวโดยไม่ชักช้า

ข้อ	สาเหตุ	หลักเกณฑ์เกี่ยวกับการดำเนินการในกรณีที่ดำรง NC ไม่ได้	หลักเกณฑ์เพิ่มเติม
	ครบกำหนดระยะเวลาดังกล่าวสามารถดำรง NC ได้ไม่น้อยกว่า ๗ วันทำการติดต่อกัน (๒) ไม่สามารถแก้ไขปัญหาการดำรง NC ได้ตามแผนการแก้ไขหรือภายในระยะเวลาที่กำหนดในแผนการแก้ไข ทั้งนี้ระยะเวลาที่กำหนดในแผนดังกล่าวต้องไม่เกิน ๔๕ วันนับแต่วันแรกที่ผู้ประกอบการไม่สามารถดำรง NC ได้ (๓) มี NC ต่ำกว่า ๖๐% ติดต่อกันเกิน ๕ วันทำการ	๒. กระทำการหรืองดเว้นการกระทำอื่นใดเพื่อให้ผู้ประกอบการสามารถกลับมาดำรง NC ได้ตามที่สำนักงานกำหนด	-

ข้อ ๓ ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่
ประกาศ ณ วันที่

เป็นต้นไป

(นางพรอนงค์ บุชราตระกูล)

เลขาธิการ

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์

(แนบท้ายประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. /๒๕๖๘ ซึ่งแก้ไขเพิ่มเติม

โดยประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. /๒๕๖๘ (ฉบับที่))

การจัดทำและยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ

ในการดำเนินการตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดใน ส่วนที่ ๑ และส่วนที่ ๒ ให้ใช้คำอธิบายศัพท์ตามส่วนที่ ๓ เพื่อประกอบการพิจารณาการปฏิบัติตามหลักเกณฑ์ดังกล่าวด้วย

ส่วนที่ ๑ หลักเกณฑ์การจัดทำและยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ*

ให้ผู้ประกอบธุรกิจจัดทำและยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุน พร้อมทั้งรายงานและเอกสารประกอบอื่นที่เกี่ยวข้องตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในส่วนนี้

กรณี	ประเภทผู้ประกอบธุรกิจ	ให้ผู้ประกอบธุรกิจจัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนภายในระยะเวลาดังนี้	ให้ผู้ประกอบธุรกิจยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนภายในระยะเวลาดังนี้	เอกสารที่ต้องยื่นเพิ่มเติมต่อสำนักงาน
๑.	ผปก.หลักทรัพย์ หรือ ผปก.สัญญา <u>ที่ไม่ประกอบธุรกิจ</u> สินทรัพย์ดิจิทัล	จัดทำแบบ บ.ล. ๔/๑ เป็น <u>รายวัน</u> โดยต้องจัดทำให้เสร็จสิ้นภายในวันทำการถัดไป	(๑) <u>กรณีทั่วไป</u> - ยื่นแบบ บ.ล. ๔/๑ (ของวันทำการสุดท้ายของเดือน) โดยให้ยื่นภายใน ๕ วันทำการแรกของเดือนถัดไป	-
			(๒) <u>กรณีที่การคำนวณรายการหนี้สินด้อยสิทธิ หรือสัญญาเช่าที่ไม่ต้องนับรวมไว้ใน การคำนวณหนี้สินรวม หรือมีรายการเงินกู้ยืม หักกู้ หรือภาระผูกพันใดที่สามารถนับรวมไว้ใน การ</u>	<u>สัญญาที่เกี่ยวข้องกับรายการ</u> ดังกล่าวมาโดยให้ยื่นพร้อมกับแบบ บ.ล. ๔/๑ ด้วย

* ให้ผู้ประกอบธุรกิจยื่นรายงานตามส่วนนี้และเอกสารที่เกี่ยวข้อง (ถ้ามี) ต่อสำนักงานในรูปของข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ผ่านระบบรับส่งข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์ โดยดำเนินการให้เป็นไปตามระเบียบวิธีปฏิบัติสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการรับส่งข้อมูลอิเล็กทรอนิกส์

กรณี	ประเภทผู้ประกอบการ	ให้ผู้ประกอบการจัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนภายในระยะเวลาดังนี้	ให้ผู้ประกอบการยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนภายในระยะเวลาดังนี้	เอกสารที่ต้องยื่นเพิ่มเติมต่อสำนักงาน
			<u>คำนวณหนี้สินพิเศษ เป็นครั้งแรกหรือทุกครั้งที่มีการแก้ไขเปลี่ยนแปลงรายการดังกล่าว - ยื่นแบบ บ.ล. ๔/๑</u> (ของวันที่มีการคำนวณหรือแก้ไขเปลี่ยนแปลงรายการดังกล่าว) โดยให้ยื่นภายในวันทำการถัดจากวันที่เกิดรายการนั้น	
			(๓) <u>กรณีที่ผู้ประกอบการมีหนี้สินด้อยสิทธิเกินกว่าส่วนของผู้ถือหุ้น</u> ๓.๑ ยื่นแบบ <u>บ.ล. ๔/๑</u>^๒ (ของวันที่ผู้ประกอบการมีหนี้สินด้อยสิทธิเกินกว่าส่วนของผู้ถือหุ้น) โดยให้ยื่นภายในวันทำการถัดจากวันที่เกินกว่าส่วนของผู้ถือหุ้น ๓.๒ ในกรณีที่หนี้สินด้อยสิทธิกลับมาไม่เกินกว่าส่วนของผู้ถือหุ้นแล้ว ให้ยื่นแบบ <u>บ.ล. ๔/๑</u>^๒ (ของวันแรก que ผู้ประกอบการกลับมามีหนี้สิน	-

^๒ แบบ บ.ล. ๔/๑ ตาม (๓) ต้องมีข้อมูลอย่างน้อยดังนี้

๑. หนี้สินด้อยสิทธิที่ไม่ได้คำนวณเป็นหนี้สินรวม

๒. ส่วนของผู้ถือหุ้น

๓. อัตราส่วนระหว่างหนี้สินด้อยสิทธิที่ไม่ได้คำนวณเป็นหนี้สินรวมต่อส่วนของผู้ถือหุ้น

๔. อัตราส่วนระหว่างผลรวมของหนี้สินด้อยสิทธิและเงินกู้ด้อยสิทธิ ต่อส่วนของผู้ถือหุ้น

กรณี	ประเภทผู้ประกอบการธุรกิจ	ให้ผู้ประกอบการธุรกิจจัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนภายในระยะเวลาดังนี้	ให้ผู้ประกอบการธุรกิจยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนภายในระยะเวลาดังนี้	เอกสารที่ต้องยื่นเพิ่มเติมต่อสำนักงาน
			ด้วยสิทธิไม่เกินส่วนของผู้ถือหุ้น) โดยให้ยื่นภายในวันทำการถัดจากวันที่กลับมาไม่เกินกว่าส่วนของผู้ถือหุ้น (๔) <u>กรณีที่ NC ลดจนถึงระดับเฝ้าระวัง (early warning) ตามส่วนที่ ๒</u> ๔.๑ ยื่นแบบ <u>บ.ล. ๔/๑</u> (ของทุกวันที่ NC เท่ากับหรือน้อยกว่าระดับเฝ้าระวัง (early warning)) โดยให้ยื่นภายในวันทำการถัดไป ๔.๒ ในกรณีที่ NC กลับมามากกว่าระดับเฝ้าระวัง (early warning) แล้ว ให้ยื่นแบบ <u>บ.ล. ๔/๑</u> (ของวันทำการแรกที่ NC กลับมามากกว่าระดับเฝ้าระวัง (early warning) และ	เอกสารที่ต้องยื่นเพิ่มเติมต่อสำนักงาน <u>รายงานชี้แจงสาเหตุ</u>ที่ NC ลดจนถึงระดับเฝ้าระวัง (early warning) พร้อมทั้งแนวทางที่จะทำให้สามารถกลับมาดำรง NC ได้มากกว่าระดับดังกล่าว โดยให้ยื่นพร้อมกับการยื่นแบบ <u>บ.ล. ๔/๑</u> (สำหรับวันแรกที่ NC ลดจนถึงระดับเฝ้าระวัง (early warning))

กรณี	ประเภทผู้ประกอบการ	ให้ผู้ประกอบการจัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนภายในระยะเวลาดังนี้	ให้ผู้ประกอบการยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนภายในระยะเวลาดังนี้	เอกสารที่ต้องยื่นเพิ่มเติมต่อสำนักงาน
			ของวันทำการถัดไป) โดยให้ยื่นภายในวันทำการถัดจากวันที่ NC กลับมามากกว่าระดับดังกล่าว และยื่นภายในวันทำการถัดไปด้วย	
๒.	ผปก.หลักทรัพย์ หรือ ผปก.สัญญา <u>ที่ผู้ประกอบการสินทรัพย์ดิจิทัลด้วย</u>	(๑) <u>แบบ บ.ล. ๔/๑</u> ให้จัดทำเป็นรายวัน โดยต้องจัดทำให้เสร็จสิ้นภายในวันทำการถัดไป	ภายในวันทำการถัดจากวันที่จัดทำรายงานรายวัน	กรณีที่ NC ลดลงจนถึงระดับเฝ้าระวัง (early warning) ตามส่วนที่ ๒ ให้จัดทำรายงานชี้แจงสาเหตุที่ NC ลดลงจนถึงระดับเฝ้าระวัง (early warning) พร้อมทั้งแนวทางที่จะทำให้สามารถกลับมาดำรง NC ได้มากกว่าระดับดังกล่าว โดยให้ยื่นในวันทำการถัดจากวันแรกที่ NC ลดลงจนถึงระดับเฝ้าระวัง (early warning)
		(๒) <u>แบบ ดจ. ๕</u> ให้จัดทำทุกวันทำการสุดท้ายของ <u>แต่ละเดือน</u>	ภายในวันที่ ๕ ของเดือนถัดไป	

หมายเหตุ : ในกรณีมีเหตุจำเป็นและสมควร ผู้ประกอบการที่ไม่สามารถยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนตาม ๑. (๑) - (๓) และ ๒. (๑) - (๒)

ภายในระยะเวลาที่กำหนด อาจขอผ่อนผันโดยยื่นคำขอพร้อมทั้งเอกสารหลักฐานประกอบคำขอตามคู่มือสำหรับประชาชนต่อสำนักงาน

ก่อนครบกำหนดเวลาการยื่นรายงานดังกล่าว ทั้งนี้ ตามขั้นตอนและวิธีการที่ระบุในคู่มือสำหรับประชาชน

ส่วนที่ ๒ ระดับเฝ้าระวัง (early warning)

ระดับเฝ้าระวัง (early warning)	
๑. สำหรับ ผปก.หลักทรัพย์ หรือ ผปก.สัญญา ที่ไม่ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล	
เท่ากับ ๑.๕ เท่าของ NC ที่ผู้ประกอบการต้องดำรงตามที่กำหนดในตารางการดำรงเงินกองทุน	
๒. สำหรับ ผปก.หลักทรัพย์ หรือ ผปก.สัญญา ที่ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล (ไม่รวมผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัล)	
หลักเกณฑ์ในการดำรง NC	ระดับ early warning
๒.๑ กรณีเป็นผู้ประกอบธุรกิจที่ต้องดำรง NC ไม่น้อยกว่าผลรวมของ (๑) NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน และ (๒) NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้าและมูลค่าซื้อขาย	เท่ากับผลรวมของ (๑) ๑.๕ เท่าของ NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (๒) ๑.๕ เท่าของ NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้าและมูลค่าซื้อขายในส่วนที่ไม่เกิน ๑๐๐ ล้านบาทแรก และ (๓) ๑.๒ เท่าของ NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้าและมูลค่าซื้อขายในส่วนที่เกินกว่า ๑๐๐ ล้านบาท

๒. สำหรับ ผปก.หลักทรัพย์ หรือ ผปก.สัญญา ที่ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล (ไม่รวมผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัล)	
หลักเกณฑ์ในการดำรง NC	ระดับ early warning
๒.๒ กรณีเป็นผู้ประกอบธุรกิจที่ต้องดำรง NC ไม่น้อยกว่าเงินกองทุนขั้นต่ำคงที่	เท่ากับผลรวมของ (๑) ๑.๕ เท่าของเงินกองทุนขั้นต่ำคงที่ (ไม่รวมมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกิน) (๒) ๑.๕ เท่าของมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกินในส่วนที่ไม่เกิน ๑๐๐ ล้านบาทแรก และ (๓) ๑.๒ เท่าของมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกินในส่วนที่เกินกว่า ๑๐๐ ล้านบาท
๓. สำหรับ ผปก.หลักทรัพย์ หรือ ผปก.สัญญา ที่ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล ประเภทผู้ให้บริการรับฝากสินทรัพย์ดิจิทัล	
หลักเกณฑ์ในการดำรง NC	ระดับ early warning
๓.๑ กรณีเป็นผู้ประกอบธุรกิจที่ต้องดำรง NC ไม่น้อยกว่าผลรวมของ (๑) NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากหนี้สินทั่วไป และทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน และ (๒) NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้า	เท่ากับผลรวมของ (๑) ๑.๕ เท่าของ NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (๒) ๑.๕ เท่าของ NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้าในส่วนที่ไม่เกิน ๑๐๐ ล้านบาทแรก และ (๓) ๑.๒ เท่าของ NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้าในส่วนที่เกินกว่า ๑๐๐ ล้านบาท
๓.๒ กรณีเป็นผู้ประกอบธุรกิจที่ต้องดำรง NC ไม่น้อยกว่าเงินกองทุนขั้นต่ำคงที่	๑.๕ เท่าของเงินกองทุนขั้นต่ำคงที่

ส่วนที่ ๓ คำอธิบายศัพท์

คำศัพท์

เงินกองทุนชั้นต่ำคงที่

ตารางการดำรงเงินกองทุน

แบบ บ.ล. ๔/๑

แบบ ดจ. ๕

ผปก.หลักทรัพย์

ผปก.สัญญา

ระดับเฝ้าระวัง (early warning)

สินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกิน

คำอธิบาย

หมายถึง เงินกองทุนชั้นต่ำคงที่ที่ผู้ประกอบธุรกิจต้องดำรงตามที่กำหนดในตารางการดำรงเงินกองทุน

หมายถึง ตารางการดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ แนบท้ายประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ว่าด้วยการดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ

หมายถึง รายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ตามแบบและคำอธิบายประกอบการรายงานการคำนวณเงินกองทุนที่จัดไว้บนเว็บไซต์ของสำนักงาน

หมายถึง รายงานประกอบการคำนวณเงินกองทุนสำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล ตามแบบและคำอธิบายประกอบการรายงานการคำนวณเงินกองทุนที่จัดไว้บนเว็บไซต์ของสำนักงาน

หมายถึง ผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์

หมายถึง ผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

หมายถึง ระดับ NC ที่กำหนดไว้สำหรับผู้ประกอบธุรกิจแต่ละประเภทตามหลักเกณฑ์ที่กำหนดในส่วนที่ ๒ ของภาคผนวกนี้

หมายถึง NC ที่คำนวณจากสินทรัพย์ดิจิทัลส่วนเกิน (ถ้ามี) ซึ่งผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลต้องดำรงตามที่กำหนดในตารางการดำรงเงินกองทุน

คำศัพท์

NC

NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน

NC ที่ต้องดำรงโดยคำนวณจากมูลค่าสินทรัพย์ดิจิทัลของลูกค้าและมูลค่าซื้อขาย

คำอธิบาย

หมายถึง เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

หมายถึง NC ที่ต้องดำรงตามที่กำหนดในตารางการดำรงเงินกองทุน โดยคำนวณจากมูลค่าหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้องวางเป็นประกัน (ถ้ามี)

หมายถึง NC ที่ต้องดำรงตามที่กำหนดในตารางการดำรงเงินกองทุน โดยคำนวณจากมูลค่าทรัพย์สินของลูกค้าที่ผู้ประกอบธุรกิจจัดเก็บ (custody risk) และมูลค่าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล (trading service risk)