

เอกสารรับฟังความคิดเห็น

เลขที่ อนธ. 15/2563

เรื่อง ร่างประกาศเกี่ยวกับหลักเกณฑ์เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

เผยแพร่เมื่อวันที่ 18 พฤษภาคม 2563

สำนักงานได้จัดทำเอกสารฉบับนี้ขึ้นเพื่อสำรวจความคิดเห็นจากผู้เกี่ยวข้อง
ท่านสามารถ download เอกสารเผยแพร่ฉบับนี้ได้จาก www.sec.or.th

ท่านสามารถส่งความเห็นหรือข้อเสนอแนะให้สำนักงานได้ตามที่ติดต่อด้านล่าง
หรือ e-mail : sawarin@sec.or.th

วันสุดท้ายของการแสดงความคิดเห็นวันที่ 17 มิถุนายน 2563

ท่านสามารถติดต่อสอบถามข้อมูลเพิ่มเติมได้จากเจ้าหน้าที่ของสำนักงาน ดังนี้

- | | |
|---------------------------|----------------------|
| 1. นางสาวสวริน เจือศรีกุล | โทรศัพท์ 0 2033 4662 |
| 2. นายศักดิ์ดา ศรีมุข | โทรศัพท์ 0 2033 9768 |
| 3. นายพีรวัส จันทโรนทัย | โทรศัพท์ 0 2033 9797 |
| 4. นางสาวรัฐยา คชรักษ์ | โทรศัพท์ 0 2033 9535 |

สำนักงานขอขอบคุณทุกท่านที่เข้าร่วมแสดงความคิดเห็น
และให้ข้อเสนอแนะมา ณ โอกาสนี้

สำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์
เลขที่ 333/3 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900
โทรศัพท์ 1207 หรือ 0 2033 9999 โทรสาร: 0 2033 9660 e-mail : info@sec.or.th

I. ที่มา

ตามที่สำนักงานมีแนวคิดในการปรับปรุงหลักเกณฑ์เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (“NC”) ในหลายส่วน เช่น การกำหนดให้ผู้ประกอบธุรกิจที่ไม่สามารถดำรง NC ได้ต้องหยุดประกอบธุรกิจทันที การกำหนดให้ผู้ประกอบธุรกิจใช้วงเงินกู้ด้อยสิทธิเพื่อชดเชยส่วนที่ NC ต่ำได้เป็นการชั่วคราว¹ หรือการปรับปรุงค่าความเสี่ยงสำหรับการถือครองหลักทรัพย์ (position risk) เป็นต้น เพื่อให้การดำรง NC สะท้อนฐานะทางการเงินและธุรกรรมของผู้ประกอบธุรกิจได้อย่างแท้จริง ซึ่งจะช่วยจำกัดความเสี่ยงที่อาจเกิดขึ้นต่อตัวผู้ประกอบธุรกิจเอง ผู้ลงทุน และระบบตลาดทุนโดยรวมได้อีกทางหนึ่ง นอกจากนี้ยังได้กำหนดเพิ่มหลักเกณฑ์การดำรง NC สำหรับธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลเพื่อรองรับการขยายธุรกิจของผู้ประกอบธุรกิจไปยังธุรกรรมประเภทดังกล่าว โดยสำนักงานได้เปิดรับความฟังความคิดเห็นแนวคิดดังกล่าวไว้ในเอกสารรับฟังความคิดเห็นเลขที่ อนุธ. 17/2562 เรื่อง การแก้ไขหลักเกณฑ์เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ระหว่างวันที่ 12 เมษายน 2562 ถึงวันที่ 13 พฤษภาคม 2562 และเอกสารรับฟังความคิดเห็นเลขที่ อนุธ. 31/2562 เรื่อง ร่างประกาศเกี่ยวกับหลักเกณฑ์เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ ระหว่างวันที่ 13 กันยายน 2562 ถึงวันที่ 15 ตุลาคม 2562 นั้น

ต่อมาสมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย (“ASCO”) และตัวแทนของผู้ประกอบธุรกิจได้เข้าหารือต่อสำนักงานเพื่อให้ความเห็นเพิ่มเติมว่า หลักการบางส่วนอาจยังเป็นอุปสรรคต่อการประกอบธุรกิจ (เช่น การกำหนดให้ต้องหยุดธุรกิจทันทีเมื่อดำรง NC ไม่ได้) และบางส่วนขอให้สำนักงานพิจารณากำหนดเพิ่มเติม (เช่น คุณสมบัติของผู้ให้วงเงินกู้ด้อยสิทธิ) สำนักงานจึงได้จัดตั้งคณะทำงานเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (“คณะทำงาน NC”)² โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อช่วยให้การปรับปรุงหลักเกณฑ์ในครั้งนี้มีความเหมาะสมมากยิ่งขึ้น สามารถปฏิบัติงานได้จริง และสอดคล้องกับความเสี่ยงโดยไม่เป็นภาระหรืออุปสรรคต่อผู้ประกอบธุรกิจเกินควร ซึ่งสำนักงานได้ปรับปรุงหลักการตามความเห็นที่ได้รับจากผู้ประกอบธุรกิจและข้อเสนอของคณะทำงาน NC แล้ว สำนักงานจึงได้ดำเนินการยกร่างประกาศที่เกี่ยวข้องและจัดทำเป็นเอกสารเปิดรับฟังความคิดเห็นจากภาคธุรกิจและบุคคลทั่วไป

II. เป้าหมายที่ต้องการบรรลุ (Intended Outcome)

2.1 เพื่อให้การดำรง NC สะท้อนฐานะทางการเงินอย่างแท้จริงและไม่เป็นภาระเกินจำเป็นของผู้ประกอบธุรกิจ

2.2 เพื่อให้การคำนวณ NC มีความสอดคล้องและเท่าทันกับธุรกรรมของผู้ประกอบธุรกิจ

¹ วงเงินกู้ด้อยสิทธิจะถูกคำนวณรวมกับ NC ปัจจุบันโดยอัตโนมัติเมื่อระดับ NC ต่ำกว่าร้อยละ 7 และต้องเกิดจากปริมาณธุรกรรมหลักทรัพย์ หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเพิ่มขึ้นอย่างรวดเร็วในระยะสั้นเท่านั้น โดยจะหยุดคำนวณวงเงินกู้ดังกล่าวเมื่อปริมาณธุรกรรมข้างต้นชำระราคาแล้วเสร็จ

² คณะทำงาน NC ประกอบด้วย ASCO ตัวแทนของผู้ประกอบธุรกิจ และสำนักหักบัญชี (TCH)

III. สรุปสาระสำคัญของร่างประกาศและเอกสารที่เกี่ยวข้อง

สำนักงานได้ยกร่างประกาศและเอกสารที่เกี่ยวข้องทั้งสิ้น 6 รายการ (ตามเอกสารแนบ) ได้แก่

- 1) ร่างประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. /2563 เรื่อง หลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล (ฉบับที่)
- 2) ร่างประกาศคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ กธ. /2563 เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ และตารางแนบท้ายประกาศ
- 3) ร่างประกาศสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ ที่ สธ. /2563 เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้
- 4) ร่างแบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ แบบ บล. 4/1 และร่างคำอธิบายประกอบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
- 5) ร่างแบบรายงานการคำนวณส่วนของผู้ถือหุ้น (แบบ ดจ. 4) และร่างคำอธิบายประกอบการจัดทำรายงานส่วนของผู้ถือหุ้น
- 6) ร่างแบบรายงานประกอบการคำนวณเงินกองทุนสำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล (แบบ ดจ. 5) และร่างคำอธิบายประกอบการจัดทำรายงานประกอบการคำนวณเงินกองทุนสำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล

สำนักงานจึงขอสรุปสาระสำคัญของหลักการทั้งหมด ดังนี้

3.1 การใช้วงเงินกู้ด้วยสิทธิรองรับธุรกรรมที่เพิ่มขึ้นสูงกว่าปกติ

ผู้ประกอบธุรกิจสามารถใช่วงเงินกู้ด้วยสิทธิเพื่อชดเชยส่วนที่ NC ต่ำกว่าเงินกองทุนขั้นต่ำเป็นการชั่วคราวได้ เฉพาะกรณีที่เงินกองทุนขั้นต่ำเพิ่มขึ้นจากธุรกรรมหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างรวดเร็วในระยะสั้น กล่าวคือ เป็นธุรกรรมที่เกิดขึ้นภายในวันและมีผลให้ฐานะความเสี่ยงคงค้างสูงขึ้นมากผิดปกติจนผู้ประกอบธุรกิจไม่สามารถดำรง NC ได้ตามที่กำหนด (เช่น ธุรกรรมซื้อขายหลักทรัพย์รายใหญ่ (Big Lot) ที่เกิดจากผู้ลงทุนสถาบันต้องการปรับสัดส่วนการลงทุนให้สอดคล้องกับดัชนีต่างประเทศ เป็นต้น) โดยให้ถือว่าผู้ประกอบธุรกิจสามารถดำรง NC ได้ตามเกณฑ์ หากมีวงเงินกู้ด้วยสิทธิครอบคลุมส่วนที่ NC ต่ำกว่าเงินกองทุนขั้นต่ำ โดยวงเงินกู้ด้วยสิทธิและหนี้สินด้วยสิทธิรวมต้องมีมูลค่าไม่เกินส่วนของผู้ถือหุ้นของผู้ประกอบธุรกิจ และวงเงินกู้ด้วยสิทธิต้องเป็นไปตามเงื่อนไข ดังต่อไปนี้

3.1.1 ผู้ให้วงเงินกู้ต้องมีคุณสมบัติ ดังนี้

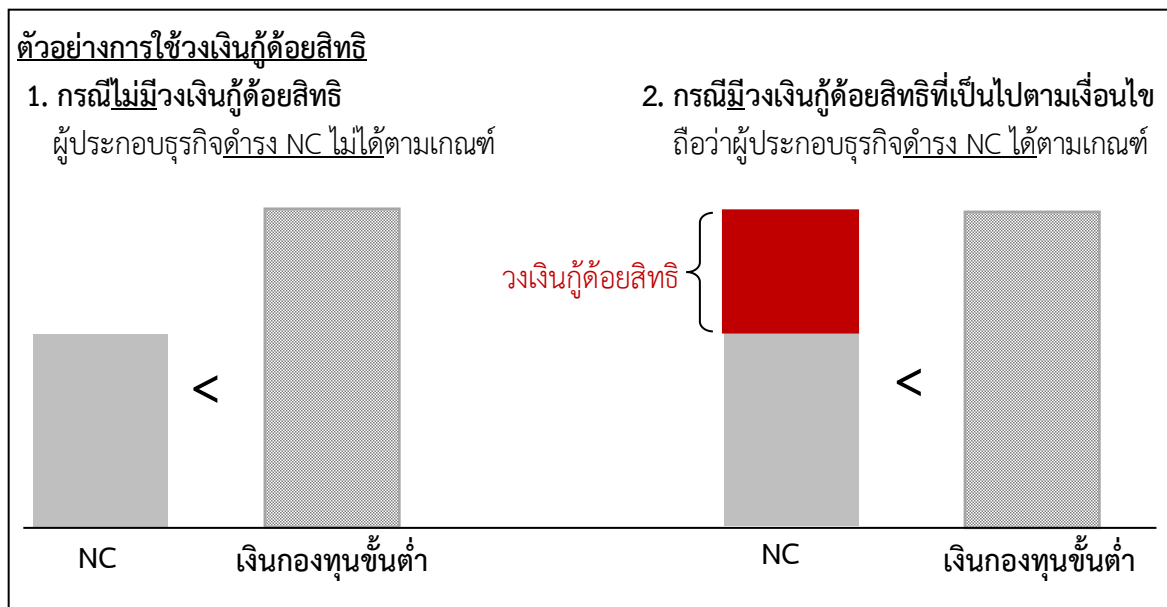
(1) เป็นบริษัทที่มีความสัมพันธ์กับผู้ประกอบธุรกิจ และพร้อมให้ความช่วยเหลือด้านสภาพคล่องทางการเงิน โดยอาจเป็นบริษัทแม่หรือบริษัทในกลุ่มซึ่งมีผู้ถือหุ้นใหญ่รายเดียวกัน โดยไม่รวมบริษัทลูกของผู้ประกอบธุรกิจ

(2) เป็นธนาคารพาณิชย์ตามกฎหมายว่าด้วยธุรกิจสถาบันการเงิน ธนาคารพาณิชย์ตามกฎหมายต่างประเทศ บริษัทหลักทรัพย์ตามกฎหมายว่าด้วยหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือบริษัทหลักทรัพย์ตามกฎหมายต่างประเทศ

3.1.2 ให้ผู้ประกอบธุรกิจสามารถใช่วงเงินกู้ด้วยสิทธิได้ต่อเมื่อได้แจ้งเป็นลายลักษณ์อักษรพร้อมเอกสารหลักฐานที่เกี่ยวข้องให้สำนักงานทราบล่วงหน้าไม่น้อยกว่า 30 วันก่อนที่จะใช้งานวงเงิน

กู้ด้อยสิทธิและสำนักงานไม่หักท้วงภายใน 30 วันนับแต่วันที่ได้รับแจ้ง โดยมีระยะเวลาการใช้งานแต่ละครั้งไม่เกิน 2 ปี ซึ่งสำนักงานจะจัดทำหนังสือชักข้อเกี่ยวกับขั้นตอนการยื่นเอกสารและแนวทางการใช้เงินกู้ด้อยสิทธิต่อไป

ทั้งนี้ ให้สำนักงานมีอำนาจในการพิจารณาตัดสินส่วนการนับวงเงินกู้ด้อยสิทธิหรือยกเลิกการใช้งานวงเงินกู้ด้อยสิทธิได้ หากเห็นว่า ผู้ให้วงเงินกู้มีความเสี่ยงเกี่ยวกับฐานะทางการเงิน หรือผู้ประกอบการใช้งานวงเงินกู้อย่างไม่เหมาะสมสอดคล้องกับลักษณะการประกอบธุรกิจ



- ร่างประกาศและเอกสารเกี่ยวข้องที่ปรับปรุง**
1. ร่างประกาศ กธ. /2563 เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ : ข้อ 5
 2. แบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ แบบ บล. 4/1 : ส่วนสรุป
 3. คำอธิบายประกอบการคำนวณตามแบบ บล. 4/1 : หน้า 3

3.2 การประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล

3.2.1 กำหนดเพิ่มสินทรัพย์ดิจิทัลเป็นหนึ่งในประเภทของสินทรัพย์สภาพคล่องที่สามารถใช้ในการคำนวณ NC ได้ โดยวิธีการนับมูลค่าของสินทรัพย์ดิจิทัลและคำนวณค่าความเสี่ยง ให้เป็นไปตามที่กำหนดในคำอธิบายประกอบการคำนวณตามแบบ บล. 4/1

3.2.2 การดำรง NC ของผู้ประกอบการหลักทรัพย์หรือตัวแทนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลด้วย สามารถแบ่งออกเป็นกรณีได้ดังต่อไปนี้

กรณีที่ 1 ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลแบบเก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้า : ให้ผู้ประกอบการดำรง NC ไม่น้อยกว่า

- 25 ล้านบาท ในกรณีที่เป็นผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์ และสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือ 15 ล้านบาท ในกรณีเป็นผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือเป็นผู้ประกอบธุรกิจที่มีความเสี่ยงต่ำ³ และ
- ไม่น้อยกว่าร้อยละ 7 ของหนี้สินทั่วไปและทรัพย์สินที่ต้อง

วางเป็นประกัน และ

- ไม่น้อยกว่าร้อยละ 1 ของมูลค่าทรัพย์สินลูกค้ำที่ถูกจัดเก็บอยู่ในระบบของผู้ประกอบธุรกิจที่จะเชื่อมต่อกับเครือข่ายเมื่อทำธุรกรรมเท่านั้น (cold wallet) บวกร้อยละ 5 ของมูลค่าทรัพย์สินลูกค้ำที่ถูกจัดเก็บอยู่ในระบบอื่น ๆ ทั้งนี้ มูลค่าทรัพย์สินลูกค้ำข้างต้น สามารถหักด้วยกรรมธรรม์ประกันภัยชดเชยความเสียหายได้

กรณีที่ 2 ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลแบบไม่เก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้ำ หรือเก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้ำแต่ไม่สามารถเข้าถึงหรือโอนทรัพย์สินดังกล่าวออกไปได้ : ให้ผู้ประกอบธุรกิจดำรง NC ตามเดิม และเพิ่มการดำรงส่วนของผู้ถือหุ้น (equity) ตามลักษณะการประกอบธุรกิจในตาราง

การประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล	ส่วนของผู้ถือหุ้น (ลบ.)
1. ศูนย์ซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัลที่ไม่เก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้ำ	5
2. นายหน้าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัลที่ไม่เก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้ำ	0.5
3. นายหน้าซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัลที่เก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้ำ แต่ไม่สามารถเข้าถึงหรือโอนทรัพย์สินลูกค้ำได้	2.5
4. ผู้ค้าสินทรัพย์ดิจิทัล	2.5

ร่างประกาศและเอกสารเกี่ยวข้องที่ปรับปรุง

1. ร่างประกาศ กธ. /2563 เรื่อง การดำรงเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจ : ข้อ 4 และตารางแนบท้ายประกาศ

3.3 การจัดทำแบบรายงาน

ให้ผู้ประกอบธุรกิจจัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนตามหลักเกณฑ์ ดังต่อไปนี้

3.3.1 การจัดทำรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (NC) (แบบ บล. 4/1) ให้เป็นไปตามหลักเกณฑ์ปัจจุบัน

3.3.2 การจัดทำรายงานการคำนวณส่วนของผู้ถือหุ้น (แบบ ดจ. 4) สำหรับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์หรือตัวแทนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลแบบไม่เก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้ำ หรือเก็บรักษาทรัพย์สินลูกค้ำแต่ไม่สามารถเข้าถึงหรือโอนทรัพย์สินดังกล่าวออกไปได้ ซึ่งต้องดำรงส่วนของผู้ถือหุ้น (equity) ตามข้อ 3.2.2 กรณีที่ 2

3.3.3 การจัดทำรายงานประกอบการคำนวณเงินกองทุนสำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล (แบบ ดจ. 5) สำหรับผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์หรือตัวแทนสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลทุกกรณี

³ ผู้ประกอบธุรกิจที่มีลักษณะ ดังนี้ 1) ไม่เก็บทรัพย์สินลูกค้ำ 2) ไม่มีการลงทุนแบบ proprietary trading และ 3) ไม่มีภาระต่อระบบชำระราคา-ส่งมอบ

กำหนดให้ผู้ประกอบธุรกิจจัดทำ แบบ ดจ. 4 และ แบบ ดจ. 5 เป็นรายเดือน ทุกวันทำการสุดท้ายของแต่ละเดือน และยื่นรายงานต่อสำนักงานภายใน 10 วันทำการแรกของเดือนถัดไป ผ่านระบบ OFAR ซึ่งสำนักงานจะปรับปรุงให้รองรับแบบรายงานดังกล่าวต่อไป เว้นแต่กรณีที่ปรากฏเหตุ ที่อาจทำให้ส่วนของผู้ถือหุ้นเปลี่ยนแปลงไปอย่างมีนัยสำคัญ ให้จัดทำรายงานและยื่นรายงานดังกล่าว ต่อสำนักงาน ก.ล.ต. ทันที

ร่างประกาศและเอกสารเกี่ยวข้องที่ปรับปรุง

1. ร่างประกาศ สธ. /2563 เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของ ผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ : ข้อ 4
2. แบบการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ บล. 4/1 : ส่วนสรุป ส่วนที่ 1 ส่วนที่ 2 และส่วนที่ 9
3. คำอธิบายประกอบการคำนวณตามแบบ บล. 4/1 : หน้า 2 หน้า 5 หน้า 15-16 หน้า 18 และหน้า 90
4. แบบรายงานการคำนวณส่วนของผู้ถือหุ้น (แบบ ดจ. 4)
5. คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงานการคำนวณส่วนของผู้ถือหุ้น (แบบ ดจ. 4)
6. แบบรายงานประกอบการคำนวณเงินกองทุนสำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล (แบบ ดจ. 5)
7. คำอธิบายประกอบการจัดทำรายงานประกอบการคำนวณเงินกองทุนสำหรับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ ดิจิทัล (แบบ ดจ. 5)

3.4 การผ่อนผันการจัดทำและยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุน

ในกรณีที่มีเหตุจำเป็นและสมควร ผู้ประกอบธุรกิจสามารถยื่นขอผ่อนผันการจัดส่ง แบบรายงานตามข้อ 3.3 เพื่อให้สำนักงานพิจารณาได้ โดยต้องดำเนินการก่อนสิ้นกำหนดเวลาในการยื่น แบบรายงานที่จะขอผ่อนผัน ซึ่งสำนักงานจะแจ้งผลการพิจารณาผ่อนผันภายใน 7 วันทำการ ทั้งนี้ การยื่น ขอผ่อนผันการจัดส่งแบบรายงาน ให้เป็นไปตามรายละเอียดในคู่มือประชาชนที่สำนักงานจะจัดทำเพิ่มเติม ต่อไป

ร่างประกาศและเอกสารเกี่ยวข้องที่ปรับปรุง

1. ร่างประกาศ สธ. /2563 เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของ ผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ : ข้อ 4

3.5 การดำเนินการกรณี early warning

3.5.1 ปรับปรุงให้ผู้ประกอบธุรกิจที่มี NC ต่ำกว่าระดับ early warning (1.5 เท่าของ เงินกองทุนขั้นต่ำ) ดำเนินการดังต่อไปนี้ภายใน T+1 เพื่อให้สำนักงานสามารถติดตามสถานการณ์ การดำรง NC ของผู้ประกอบธุรกิจได้อย่างใกล้ชิดและทัน่วงที

(1) ยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ (full report) ของวันที่ NC อยู่ในระดับต่ำกว่า early warning จนกว่า NC จะกลับมาสูงกว่าระดับดังกล่าว 2 วันทำการติดต่อกัน ทั้งนี้ ให้ยื่นผ่านระบบ OFAR ตามแบบรายงาน BL41D

(2) ยื่นรายงานชี้แจงสาเหตุที่ NC อยู่ในระดับต่ำกว่า early warning พร้อมแนวทางในการดำเนินการให้ผู้ประกอบธุรกิจกลับมาดำรง NC ได้ตามเดิม โดยให้จัดส่งมาเป็นอีเมล มายัง insec@sec.or.th

3.5.2 ให้ผู้ประกอบธุรกิจที่มีส่วนของผู้ถือหุ้นต่ำกว่าระดับ early warning (1.1 เท่าของส่วนของผู้ถือหุ้นขั้นต่ำ) ดำเนินการดังต่อไปนี้

(1) ยื่นรายงานชี้แจงสาเหตุที่ส่วนของผู้ถือหุ้นลดต่ำกว่าอัตราที่กำหนดข้างต้น และวิเคราะห์แนวโน้มการเปลี่ยนแปลงของส่วนของผู้ถือหุ้นในอนาคต รวมถึงความสามารถในการดำเนินธุรกิจได้อย่างต่อเนื่องในช่วง 1 ปีนับแต่วันที่ยื่นรายงานชี้แจง พร้อมทั้งแจ้งแนวทางการดำเนินการที่ผู้ประกอบธุรกิจจะกลับมาดำรงส่วนของผู้ถือหุ้นได้มากกว่าอัตราดังกล่าว

(2) ดำเนินการตาม (1) ภายใน 2 วันทำการนับแต่วันที่รู้ว่าส่วนของผู้ถือหุ้นลดต่ำกว่าอัตราที่กำหนดข้างต้น และทุกวันสุดท้ายของแต่ละเดือนจนกว่าผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลจะสามารถดำรงส่วนของผู้ถือหุ้นได้ โดยให้จัดส่งมาเป็นอีเมลมายัง insec@sec.or.th เว้นแต่สำนักงานจะกำหนดให้ปฏิบัติเป็นประการอื่น

ร่างประกาศและเอกสารเกี่ยวข้องที่ปรับปรุง

1. ร่างประกาศ สธ. /2563 เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ : ข้อ 5 - 6

3.6 การดำเนินการกรณีดำรงเงินกองทุนไม่ได้

3.6.1 กรณีที่เป็นผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์หรือตัวแทนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ซึ่งไม่ได้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลให้ดำเนินการตามหลักเกณฑ์ปัจจุบัน กล่าวโดยสรุปคือ ผู้ประกอบธุรกิจต้องจัดทำแผนการแก้ไขฐานะเงินกองทุนภายใน 30 วัน และการดำเนินการให้เป็นไปตามแผนให้แล้วเสร็จภายใน 90 วัน พร้อมทั้งห้ามขยายการประกอบธุรกิจและการเพิ่มความเสี่ยงโดยรวม ในระหว่างดำเนินการแก้ไขฐานะเงินกองทุน

3.6.2 กรณีที่เป็นผู้ประกอบธุรกิจหลักทรัพย์หรือตัวแทนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ที่ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลด้วย

ในกรณีที่ผู้ประกอบธุรกิจไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ตามหลักเกณฑ์ของการประกอบธุรกิจหลักทรัพย์หรือตัวแทนสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือสินทรัพย์ดิจิทัลอย่างใดอย่างหนึ่ง ให้ดำเนินการตามหลักเกณฑ์ในส่วนของผู้ธุรกิจหลักทรัพย์และสัญญาซื้อขายล่วงหน้าตาม 3.6.1 และในส่วนของผู้ธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลตามประกาศว่าด้วยหลักเกณฑ์ เงื่อนไข และวิธีการประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลที่ใช้กับผู้ประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลในหมวดที่เกี่ยวข้องกับการดำรงเงินกองทุนไม่ได้ กล่าวคือ ให้ผู้ประกอบธุรกิจดำเนินการ ดังต่อไปนี้

- ระงับการดำเนินธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลทุกประเภทจนกว่าจะสามารถดำรงเงินกองทุนได้ตามหลักเกณฑ์ที่กำหนด และได้รับอนุญาตจากสำนักงานให้ดำเนินธุรกิจได้ตามปกติ
- แจ้งให้ลูกค้าทราบเป็นลายลักษณ์อักษรเกี่ยวกับการระงับการดำเนินธุรกิจโดยไม่ชักช้า
- กระทำการหรืองดเว้นการกระทำอื่นใดตามที่สำนักงานกำหนด

ร่างประกาศและเอกสารเกี่ยวข้องที่ปรับปรุง

1. ร่างประกาศ สธ. /2563 เรื่อง การคำนวณและการรายงานการคำนวณเงินกองทุนของผู้ประกอบธุรกิจและข้อกำหนดในกรณีที่ไม่สามารถดำรงเงินกองทุนได้ : ข้อ 8

3.7 ระยะเวลาที่มีผลใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม พ.ศ. 2563

แบบสำรวจความคิดเห็น

เรื่อง ร่างประกาศเกี่ยวกับหลักเกณฑ์เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ

ข้อมูลทั่วไป

ชื่อผู้ตอบ _____ ตำแหน่ง _____

ชื่อบริษัท _____

โทรศัพท์ _____ โทรสาร _____

อีเมล _____

สถานะของผู้ให้ข้อคิดเห็น (ตอบได้มากกว่า 1 ข้อ)

- บริษัทหลักทรัพย์
- ผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า
- อื่น ๆ (ระบุ) _____

กรุณาส่งแบบสำรวจความคิดเห็นกลับไปที่ ฝ่ายนโยบายธุรกิจตัวกลาง สำนักงาน ก.ล.ต.
เลขที่ 333/3 ถนนวิภาวดีรังสิต แขวงจอมพล เขตจตุจักร กรุงเทพฯ 10900 โทรศัพท์ 1207
หรือ email : sawarin@sec.or.th

*** สำนักงานขอขอบคุณท่านที่ได้ให้ความร่วมมือในการแสดงความคิดเห็นในครั้งนี้ ***

แบบสำรวจความคิดเห็น

ท่านเห็นด้วยหรือไม่ที่สำนักงานจะปรับปรุงร่างประกาศเกี่ยวกับหลักเกณฑ์เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ในประเด็นดังต่อไปนี้

1. การใช้วงเงินกู้ด้วยสิทธิรองรับความเสี่ยงที่เพิ่มขึ้นสูงกว่าปกติ	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
<u>ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม</u>		
2. การประกอบธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
<u>ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม</u>		
3. การจัดทำแบบรายงาน	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
<u>ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม</u>		

แบบสำรวจความคิดเห็น

ท่านเห็นด้วยหรือไม่ที่สำนักงานจะปรับปรุงร่างประกาศเกี่ยวกับหลักเกณฑ์เงินกองทุนสภาพคล่องสุทธิ
ในประเด็นดังต่อไปนี้

4. การผ่อนผันการจัดทำและยื่นรายงานการคำนวณเงินกองทุน	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
<u>ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม</u>		
5. การดำเนินการกรณี early warning	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
<u>ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม</u>		
6. การดำเนินการกรณีดำรงเงินกองทุนไม่ได้	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
<u>ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม</u>		
7. ระยะเวลาที่มีผลใช้บังคับ	เห็นด้วย	ไม่เห็นด้วย
	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
<u>ข้อเสนอแนะ/ข้อสังเกตเพิ่มเติม</u>		