

ประกาศ MR 11/2564

เรื่อง จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit)

ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อ้างอิง คำสั่งบริษัท ที่ 59/2558 เรื่อง มาตรการในการดูแลเรื่องการกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของลูกค้าของบริษัทถือครอง (Position Concentration)

เพื่อให้การปฏิบัติงานเกี่ยวกับการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) สามารถดำเนินการได้อย่างมีประสิทธิภาพ มีกระบวนการควบคุมความเสี่ยงที่ดี โดยอาศัยคำสั่งบริษัท ที่ 59/2558 และเพื่อให้ลูกค้าของบริษัทฯ ทราบและสามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขหรือข้อกำหนดของ บริษัทฯ ได้ตามสัญญาแต่งตั้งตัวแทนซื้อขายล่วงหน้า บริษัทฯ จึงขอแจ้ง “จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ในตลาด สัญญาซื้อขายล่วงหน้า” ดังต่อไปนี้

- ยกเลิกประกาศ MR 10/2564 ของวันที่ 27 สิงหาคม 2564
- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนตุลาคม 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	14,803

- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ USD Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐ) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนตุลาคม 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Baht/USD Exchange Rate	USD Futures	3,489

4. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 96.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนตุลาคม 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	96.5% pure gold bars	50 Baht Gold Futures (GF50 Futures)	47
2	96.5% pure gold bars	10 Baht Gold Futures (G10 Futures)	1,255

5. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Online Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 99.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนตุลาคม 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	2,571

6. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Silver Online Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับโลหะเงินที่มีความบริสุทธิ์ 99.9%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนตุลาคม 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with putiry of 99.99%	Silver Online Futures	286

7. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold-D เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนตุลาคม 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.99% pure gold bars	Gold-D	9

8. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ 5 Year Government Bond Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับพันธบัตรรัฐบาลอายุ 5 ปี) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนตุลาคม 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	5Y Gov Bond	5 Year Government Bond Futures (5Y Gov Bond Futures)	2,000

9. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ 3M BIBOR Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สอ้างอิงกับอัตราดอกเบี้ย BIBOR ประเภท 3 เดือน) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนตุลาคม 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	3M BIBOR	3M BIBOR Futures	400

10. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Sector Index Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหมวดดัชนีธุรกิจ) ได้แก่ BANK (ดัชนีหมวดธุรกิจธนาคาร), ICT (ดัชนีหมวดธุรกิจเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร), ENER (ดัชนีหมวดธุรกิจพลังงาน), FOOD (ดัชนีหมวดธุรกิจอาหารและเครื่องดื่ม), COMM (ดัชนีหมวดธุรกิจพาณิชย์) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนตุลาคม 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Sector Index	จำนวนฐานรวมสุทธิในสัญญา Sector Futures ห้ามเกิน Position Limit ตามเกณฑ์บริษัทฯ	4,000

11. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ RSS3 (ยางแผ่นรมควันชั้น 3) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนตุลาคม 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	RSS3D (Natural Rubber Ribbed Smoked Sheet No. 3) (Physical Delivery)	RSS3D Futures	3
2	RSS3 (Natural Rubber Ribbed Smoked Sheet No. 3)	RSS3 Futures	3

12. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Japanese Rubber Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับยางแผ่นรมควันชั้น 3 ที่ซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเทศญี่ปุ่น) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนตุลาคม 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3)	Japanese Rubber Futures	21

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เภณท์บริษัทฯ ของ เดือน ตุลาคม 2564 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนกันยายน เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน กันยายน
1	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	500	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	BA	BANGKOK AIRWAYS PUBLIC COMPANY LIMITED	1,220	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	BANPU	BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED	20,280	ไม่เปลี่ยนแปลง
4	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	9,960	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	BEC	BEC WORLD PUBLIC COMPANY LIMITED	8,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	CHG	CHULARAT HOSPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	44,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	DTAC	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PUBLIC COMPANY LIMITED	18,960	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PUBLIC COMPANY LIMITED	35,520	ไม่เปลี่ยนแปลง
9	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	8,448	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	KBANK	KASIKORNBANK PUBLIC COMPANY LIMITED	18,960	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	KCE	KCE ELECTRONICS PUBLIC COMPANY LIMITED	16,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	PSL	PRECIOUS SHIPPING PUBLIC COMPANY LIMITED	8,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	PTG	PTG ENERGY PUBLIC COMPANY LIMITED	8,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
14	SIRI	SANSIRI PUBLIC COMPANY LIMITED	23,776	ไม่เปลี่ยนแปลง
15	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	109,400	ไม่เปลี่ยนแปลง
16	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PUBLIC COMPANY LIMITED	3,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
17	VNT	VINYTHAI PUBLIC COMPANY LIMITED	80	ไม่เปลี่ยนแปลง

14. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เภณท์บริษัทฯ ของ เดือน ตุลาคม 2564 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนกันยายน เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน กันยายน
1	AAV	ASIA AVIATION PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	-3,200
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PUBLIC COMPANY LIMITED	9,400	2,700
3	AMATA	AMATA CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	5,200	100
4	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PUBLIC COMPANY LIMITED	23,600	800
5	AP	AP (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	6,250	-600
6	AWC	ASSET WORLD CORP PUBLIC COMPANY LIMITED	11,040	-2,380
7	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	9,300	-350
8	BAY	BANK OF AYUDHYA PUBLIC COMPANY LIMITED	280	80
9	BBL	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	13,000	2,600
10	BCP	BANGCHAK CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	2,400	550
11	BCPG	BCPG PUBLIC COMPANY LIMITED	6,400	-250
12	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PUBLIC COMPANY LIMITED	28,700	-4,000
13	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PUBLIC COMPANY LIMITED	4,560	-256
14	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PUBLIC COMPANY LIMITED	46,400	-1,100
15	BGRIM	B.GRIMM POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	9,900	1,400
16	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	1,700	300
17	BJC	BERLI JUCKER PUBLIC COMPANY LIMITED	5,600	1,100
18	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PUBLIC COMPANY LIMITED	620	-20
19	BLAND	BANGKOK LAND PUBLIC COMPANY LIMITED	5,260	960
20	BPP	BANPU POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	1,120	40
21	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PUBLIC COMPANY LIMITED	42,200	-4,700
22	CBG	CARABAO GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	6,000	-600
23	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PUBLIC COMPANY LIMITED	1,600	-100
24	CK	CH. KARNCHANG PUBLIC COMPANY LIMITED	3,150	-1,800
25	CKP	CK POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	12,850	-100

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน กันยายน
26	COM7	COM7 PUBLIC COMPANY LIMITED	8,300	-500
27	CPALL	CP ALL PUBLIC COMPANY LIMITED	28,700	8,100
28	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	10,600	-1,200
29	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PUBLIC COMPANY LIMITED	29,700	-8,900
30	CPN	CENTRAL PATTANA PUBLIC COMPANY LIMITED	10,800	200
31	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	2,600	1,300
32	EA	ENERGY ABSOLUTE PUBLIC COMPANY LIMITED	14,500	2,200
33	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	560	120
34	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PUBLIC COMPANY LIMITED	1,400	-100
35	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	3,600	-580
36	ERW	THE ERAWAN GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	2,700	-400
37	ESSO	ESSO (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	7,200	-100
38	GFPT	GFPT PUBLIC COMPANY LIMITED	1,440	-40
39	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PUBLIC COMPANY LIMITED	14,000	600
40	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PUBLIC COMPANY LIMITED	15,700	-900
41	GULF	GULF ENERGY DEVELOPMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	44,700	18,000
42	HANA	HANA MICROELECTRONICS PUBLIC COMPANY LIMITED	6,750	-700
43	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC COMPANY LIMITED	23,100	-2,800
44	ICHI	ICHITAN GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	3,700	-800
45	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PUBLIC COMPANY LIMITED	17,600	5,000
46	IRPC	IRPC PUBLIC COMPANY LIMITED	121,700	-24,100
47	IVL	INDORAMA VENTURES PUBLIC COMPANY LIMITED	19,400	-4,800
48	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PUBLIC COMPANY LIMITED	19,050	-10,650
49	JMT	JMT NETWORK SERVICES PUBLIC COMPANY LIMITED	5,200	2,100
50	KEX	KERRY EXPRESS (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	820	-240

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน กันยายน
51	KKP	KIATNAKIN BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	1,500	-150
52	KTB	KRUNG THAI BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	27,500	-700
53	KTC	KRUNGTHAI CARD PUBLIC COMPANY LIMITED	9,400	-2,000
54	LH	LAND AND HOUSES PUBLIC COMPANY LIMITED	37,400	-700
55	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	1,020	-340
56	M	MK RESTAURANT GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	200	-20
57	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	4,250	-550
58	MBK	MBK PUBLIC COMPANY LIMITED	360	-120
59	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PUBLIC COMPANY LIMITED	4,000	-50
60	MINT	MINOR INTERNATIONAL PUBLIC COMPANY LIMITED	14,300	-500
61	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	9,100	-700
62	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PUBLIC COMPANY LIMITED	26,100	-2,700
63	ORI	ORIGIN PROPERTY PUBLIC COMPANY LIMITED	7,250	650
64	OSP	OSOTSPA PUBLIC COMPANY LIMITED	8,500	-200
65	PLANB	PLAN B MEDIA PUBLIC COMPANY LIMITED	7,850	500
66	PRM	PRIMA MARINE PUBLIC COMPANY LIMITED	4,050	-1,050
67	PSH	PRUKSA HOLDING PUBLIC COMPANY LIMITED	200	-100
68	PTT	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED	66,600	1,900
69	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PUBLIC COMPANY LIMITED	8,600	200
70	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PUBLIC COMPANY LIMITED	22,900	-2,400
71	QH	QUALITY HOUSES PUBLIC COMPANY LIMITED	14,300	4,300
72	RATCH	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PUBLIC CO.,LTD.	5,400	-1,900
73	RS	RS PUBLIC COMPANY LIMITED	4,400	-1,150
74	S	SINGHA ESTATE PUBLIC COMPANY LIMITED	1,640	-260
75	SAMART	SAMART CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	620	-540

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน กันยายน
76	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	9,800	200
77	SCB	THE SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	15,700	3,000
78	SCC	THE SIAM CEMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	2,200	100
79	SCGP	SCG PACKAGING PUBLIC COMPANY LIMITED	17,200	2,700
80	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PUBLIC COMPANY LIMITED	760	80
81	SPALI	SUPALAI PUBLIC COMPANY LIMITED	3,100	250
82	SPCG	SPCG PUBLIC COMPANY LIMITED	320	-80
83	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PUBLIC COMPANY LIMITED	14,200	3,550
84	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PUBLIC COMPANY LIMITED	13,700	-2,000
85	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PUBLIC CO.,LTD.	6,050	-350
86	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	17,500	-1,100
87	STPI	STP&I PUBLIC COMPANY LIMITED	1,180	-960
88	TASCO	TIPCO ASPHALT PUBLIC COMPANY LIMITED	4,650	-1,450
89	TCAP	THANACHART CAPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	2,500	400
90	THANI	RATCHTHANI LEASING PUBLIC COMPANY LIMITED	16,250	-3,450
91	THCOM	THAICOM PUBLIC COMPANY LIMITED	3,100	-100
92	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	420	-60
93	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	4,300	-300
94	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PUBLIC COMPANY LIMITED	2,800	-1,000
95	TTB	TMBTHANACHART BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	287,500	-38,800
96	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	440	-140
97	TOP	THAI OIL PUBLIC COMPANY LIMITED	15,500	200
98	TPIPL	TPI POLENE PUBLIC COMPANY LIMITED	4,220	1,880
99	TPIPP	TPI POLENE POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	2,020	-80
100	TQM	TQM CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	350	50

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน กันยายน
101	TRUE	TRUE CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	167,700	95,900
102	TTCL	TTCL PUBLIC COMPANY LIMITED	2,260	860
103	TTW	TTW PUBLIC COMPANY LIMITED	940	160
104	TU	THAI UNION GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	38,160	3,060
105	TVO	THAI VEGETABLE OIL PUBLIC COMPANY LIMITED	1,750	-50
106	UNIQ	UNIQUE ENGINEERING AND CONSTRUCTION PUBLIC COMPANY LIMITED	400	-280
107	VGI	VGI GLOBAL MEDIA PUBLIC COMPANY LIMITED	15,150	3,300
108	VNG	VANACHAI GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	1,480	460
109	WHA	WHA CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	30,550	-2,400
110	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	940	-180

ประกาศนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 ตุลาคม 2564 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 กันยายน พ.ศ. 2564



(นายณัฐชัย บุญยะประสงค์)

ผู้ช่วยกรรมการผู้อำนวยการ