

ประกาศ MR 05/2568

เรื่อง จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit)

ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อ้างถึง คำสั่งบริษัท ที่ 59/2558 เรื่อง มาตรการในการดูแลเรื่องการกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ถูกค่าของบริษัทถือครอง (Position Concentration) และ นโยบายบริหารความเสี่ยงและวิธีปฏิบัติในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในบัญชีประเภท DERIVATIVES ACCOUNT และการทำธุรกรรม SSF BLOCK TRADE

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

1. ยกเลิกประกาศ MR 04/2568 ของวันที่ 27 กุมภาพันธ์ 2568
2. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนเมษายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	32,446

3. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Currency Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนเมษายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	USD/THB Exchange Rate	USD Futures	5,544
2	EUR/USD Exchange Rate	EURUSD	280
3	USD/JPY Exchange Rate	USDJPY	1,059
4	EUR/THB Exchange Rate	EUR	10,000
5	JPY/THB Exchange Rate	JPY	10,000

NB

4. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 96.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนเมษายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	96.5% pure gold bars	50 Baht Gold Futures (GF50 Futures)	21
2	96.5% pure gold bars	10 Baht Gold Futures (G10 Futures)	798

5. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Online Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 99.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนเมษายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	3,104

6. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Silver Online Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับโลหะเงินที่มีความบริสุทธิ์ 99.9%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนเมษายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with purity of 99.99%	Silver Online Futures	260

7. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold-D เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนเมษายน 2568 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 ของเดือนเมษายน 2568 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 ของเดือนเมษายน 2568 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 ของเดือนเมษายน 2568 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 ของเดือนเมษายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	RSS3D (Physical Delivery) (Natural Rubber Ribbed Smoked Sheet No. 3)	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 ของเดือนเมษายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3)	Japanese Rubber Futures	31

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนเมษายน 2568 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนมีนาคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจากเดือนมีนาคม
1	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL	200	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	BAY	BANK OF AYUDHYA PCL	300	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL	3,300	ไม่เปลี่ยนแปลง
4	BEC	BEC WORLD PCL	200	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	CKP	CK POWER PCL	3,800	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	ICHI	ICHITAN GROUP PCL	2,400	ไม่เปลี่ยนแปลง

NB

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนมีนาคม
8	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
9	M	MK RESTAURANT GROUP PCL	2,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PCL	900	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	RS	RS PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	THAI	THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
14	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
15	TOP	THAI OIL PCL	22,300	ไม่เปลี่ยนแปลง
16	UNIQ	UNIQUE ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
17	VNG	VANACHAI GROUP PCL	100	ไม่เปลี่ยนแปลง

14. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัท
ๆ ของ เดือนเมษายน 2568 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนมีนาคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนมีนาคม
1	AAV	ASIA AVIATION PCL	20,400	1,500
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	14,200	700
3	AMATA	AMATA CORPORATION PCL	7,800	700
4	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	36,400	5,900
5	AP	AP (THAILAND) PCL	20,000	-700
6	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	26,100	4,700
7	BA	BANGKOK AIRWAYS PCL	2,600	300
8	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL	9,800	700
9	BANPU	BANPU PCL	45,800	-7,100
10	BBL	BANGKOK BANK PCL	16,600	100
11	BCP	BANGCHAK CORPORATION PCL	18,200	-1,800
12	BCPG	BCPG PCL	11,400	-400
13	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	44,300	100
14	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PCL	2,600	-400

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนมีนาคม
15	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	38,100	9,300
16	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	17,100	2,000
17	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	4,100	300
18	BJC	BERLI JUCKER PCL	4,700	-200
19	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PCL	1,900	-200
20	BLAND	BANGKOK LAND PCL	5,200	600
21	BPP	BANPU POWER PCL	1,700	600
22	BSRC	BANGCHAK SRIRACHA PCL	1,600	400
23	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	61,400	-11,600
24	CBG	CARABAO GROUP PCL	3,500	-100
25	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL	2,200	500
26	CHG	CHULARAT HOSPITAL PCL	22,800	4,400
27	CK	CH. KARNCHANG PCL	2,000	400
28	COM7	COM7 PCL	10,900	5,500
29	CPALL	CP ALL PCL	44,300	-5,300
30	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	4,900	1,100
31	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	24,400	1,500
32	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	8,900	400
33	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	24,400	1,100
34	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	800	-200
35	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	1,500	300
36	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PCL	1,900	-400
37	ERW	THE ERAWAN GROUP PCL	15,100	3,200
38	GFPT	GFPT PCL	3,000	900
39	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	9,100	1,900
40	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	10,800	300
41	GULF	GULF DEVELOPMENT PCL	5,200	มีผลวันที่ 3 เมษายน 2568
42	GULFI	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	23,400	-2,200
43	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PCL	8,200	1,100

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนมีนาคม
44	HANA	HANA MICROELECTRONICS PCL	5,600	1,000
45	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PCL	30,800	4,900
46	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PCL	20,700	-3,800
47	IRPC	IRPC PCL	30,100	8,600
48	IVL	INDORAMA VENTURES PCL	29,300	3,500
49	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PCL	19,700	-1,100
50	JMT	JMT NETWORK SERVICES PCL	8,000	900
51	KBANK	KASIKORN BANK PCL	22,500	1,800
52	KCE	KCE ELECTRONICS PCL	8,900	-2,000
53	KEX	KERRY EXPRESS (THAILAND) PCL	9,000	8,200
54	KKP	KIATNAKIN BANK PCL	4,700	-100
55	KTB	KRUNG THAI BANK PCL	109,500	500
56	KTC	KRUNGTHAI CARD PCL	9,300	1,400
57	LH	LAND AND HOUSES PCL	69,600	2,900
58	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PCL	2,600	1,000
59	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	1,100	-200
60	MBK	MBK PCL	1,500	-200
61	MINT	MINOR INTERNATIONAL PCL	19,200	-2,200
62	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PCL	3,300	400
63	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PCL	18,000	2,400
64	ORI	ORIGIN PROPERTY PCL	8,400	2,000
65	OSP	OSOTSPA PCL	8,100	-500
66	PLANB	PLAN B MEDIA PCL	11,700	1,400
67	PRM	PRIMA MARINE PCL	8,500	-600
68	PSH	PRUKSA HOLDING PCL	2,100	900
69	PSL	PRECIOUS SHIPPING PCL	5,100	1,500
70	PTG	PTG ENERGY PCL	1,400	200
71	PTT	PTT PCL	74,100	25,300
72	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	13,400	900
73	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	45,100	12,100

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนมีนาคม
74	QH	QUALITY HOUSES PCL	20,600	2,500
75	RATCH	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL	4,800	300
76	S	SINGHA ESTATE PCL	1,000	100
77	SAMART	SAMART CORPORATION PCL	1,600	200
78	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PCL	7,300	2,100
79	SCB	SCBX PCL	16,400	-900
80	SCC	THE SIAM CEMENT PCL	6,700	2,200
81	SCGP	SCG PACKAGING PCL	18,900	2,400
82	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL	100	100
83	SIRI	SANSIRI PCL	46,200	2,800
84	SPALI	SUPALAI PCL	6,700	200
85	SPCG	SPCG PCL	400	200
86	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PCL	13,300	-1,400
87	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL	6,100	-900
88	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	5,900	3,900
89	STECON	STECON GROUP PCL	5,900	3,900
90	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PCL	2,400	-200
91	STPI	STP&I PCL	1,100	300
92	TASCO	TIPCO ASPHALT PCL	4,000	-1,000
93	TCAP	THANACHART CAPITAL PCL	1,800	200
94	THANI	RATCHTHANI LEASING PCL	11,300	2,700
95	THCOM	THAICOM PCL	1,900	-800
96	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	7,700	1,500
97	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL	1,100	-200
98	TTB	TMBTHANACHART BANK PCL	635,600	-44,700
99	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PCL	2,000	400
100	TPIPL	TPI POLENE PCL	6,300	1,700
101	TPIPP	TPI POLENE POWER PCL	2,400	800
102	TQM	TQM CORPORATION PCL	900	100
103	TRUE	TRUE CORPORATION PCL	92,500	7,500

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนมีนาคม
104	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PCL	4,900	-1,100
105	TTCL	TTCL PCL	200	100
106	TTW	TTW PCL	2,000	100
107	TU	THAI UNION GROUP PCL	19,600	-7,600
108	TVO	THAI VEGETABLE OIL PCL	300	100
109	VGI	VGI GLOBAL MEDIA PCL	62,700	-7,200
110	WHA	WHA CORPORATION PCL	75,300	11,800
111	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PCL	4,500	-1,300

15. การระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures เทียบกับเงินกองทุนของบริษัท (คำนวณล่าสุด โดย ฝ่ายบัญชีการเงิน) ที่ยอมรับได้ อยู่ที่ 498 ล้านบาท
16. การระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures รวมกับสถานะเงินให้กู้ยืมเงิน (Margin Loan) ที่มีหุ้นสามัญนั้นรองรับอยู่ ที่ยอมรับได้ 5 เท่า ของ room (room อิงตาม Class ของหุ้น บน Volume 60/20)

ประกาศนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2568 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 มีนาคม พ.ศ. 2568



(นายณัฐชัย บุญยะประสงค์)

รองกรรมการผู้อำนวยการ