

ประกาศ MR 21/2567

เรื่อง จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit)

ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อ้างอิง คำสั่งบริษัท ที่ 59/2558 เรื่อง มาตรการในการดูแลเรื่องการกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ถูกค้ำของบริษัถือครอง (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

- ยกเลิกประกาศ MR 18/2567 วันที่ 26 พฤศจิกายน 2567, MR 19/2567 วันที่ 28 พฤศจิกายน 2567, MR 20/2567 วันที่ 12 ธันวาคม 2567
- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมกราคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานะรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	26,525

- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Currency Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมกราคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	USD/THB Exchange Rate	USD Futures	5,330
2	EUR/USD Exchange Rate	EURUSD	231
3	USD/JPY Exchange Rate	USDJPY	1,100
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 ของเดือนมกราคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	96.5% pure gold bars	50 Baht Gold Futures (GF50 Futures)	26
2	96.5% pure gold bars	10 Baht Gold Futures (G10 Futures)	949

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	3,279

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with purity of 99.99%	Silver Online Futures	414

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3)	Japanese Rubber Futures	39

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนมกราคม 2568 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนธันวาคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจากเดือนธันวาคม
1	BCP	BANGCHAK CORPORATION PCL	20,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
4	PSH	PRUKSA HOLDING PCL	700	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	2,400	ไม่เปลี่ยนแปลง

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนธันวาคม
6	STECON	STECON GROUP PCL	2,400	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	TASCO	TIPCO ASPHALT PCL	6,600	ไม่เปลี่ยนแปลง
9	THAI	THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	TOP	THAI OIL PCL	22,300	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	UNIQ	UNIQUE ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	VNG	VANACHAI GROUP PCL	100	ไม่เปลี่ยนแปลง

14. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัท ๆ ของ เดือนมกราคม 2568 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนธันวาคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนธันวาคม
1	AAV	ASIA AVIATION PCL	29,500	-5,400
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	12,900	-1,200
3	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL	200	-100
4	AMATA	AMATA CORPORATION PCL	7,300	-1,200
5	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	15,200	-2,500
6	AP	AP (THAILAND) PCL	19,400	-3,100
7	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	21,900	-17,900
8	BA	BANGKOK AIRWAYS PCL	2,300	-500
9	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL	9,000	-1,800
10	BANPU	BANPU PCL	62,700	-30,800
11	BAY	BANK OF AYUDHYA PCL	300	-300
12	BBL	BANGKOK BANK PCL	12,800	-5,000
13	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL	5,300	-2,100
14	BCPG	BCPG PCL	4,200	-1,400

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนธันวาคม
15	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	62,100	8,700
16	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PCL	2,500	-1,200
17	BEC	BEC WORLD PCL	500	-200
18	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	39,400	3,000
19	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	12,800	-3,600
20	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	5,200	500
21	BJC	BERLI JUCKER PCL	6,600	-4,100
22	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PCL	3,900	-1,400
23	BLAND	BANGKOK LAND PCL	3,000	-700
24	BPP	BANPU POWER PCL	500	-100
25	BSRC	BANGCHAK SRIRACHA PCL	600	-800
26	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	94,000	-16,000
27	CBG	CARABAO GROUP PCL	3,200	-300
28	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL	1,300	-200
29	CHG	CHULARAT HOSPITAL PCL	26,500	200
30	CK	CH. KARNCHANG PCL	1,800	100
31	CKP	CK POWER PCL	6,500	-2,100
32	COM7	COM7 PCL	4,100	-1,300
33	CPALL	CP ALL PCL	31,600	6,100
34	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	5,000	200
35	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	27,800	-5,800
36	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	6,800	-400
37	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	15,900	1,100
38	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	700	-200
39	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	1,500	-400
40	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PCL	3,600	-1,600

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนธันวาคม
41	ERW	THE ERAWAN GROUP PCL	9,400	-300
42	GFPT	GFPT PCL	2,100	-300
43	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	3,500	-200
44	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	6,800	-2,800
45	GULF	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	26,700	100
46	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PCL	6,700	-2,000
47	HANA	HANA MICROELECTRONICS PCL	6,600	-100
48	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PCL	29,200	-8,900
49	ICHI	ICHITAN GROUP PCL	2,900	-1,100
50	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PCL	24,100	1,300
51	IRPC	IRPC PCL	22,000	-14,600
52	IVL	INDORAMA VENTURES PCL	33,100	-18,600
53	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PCL	57,400	-4,800
54	JMT	JMT NETWORK SERVICES PCL	11,600	-4,200
55	KBANK	KASIKORNBANK PCL	17,800	-2,700
56	KCE	KCE ELECTRONICS PCL	12,800	1,400
57	KEX	KERRY EXPRESS (THAILAND) PCL	900	-200
58	KKP	KIATNAKIN BANK PCL	3,200	-1,200
59	KTB	KRUNG THAI BANK PCL	84,500	-26,900
60	KTC	KRUNGTHAI CARD PCL	6,400	-2,900
61	LH	LAND AND HOUSES PCL	67,700	-17,500
62	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PCL	700	-100
63	M	MK RESTAURANT GROUP PCL	800	-200
64	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	2,700	400
65	MBK	MBK PCL	2,700	-500
66	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PCL	1,100	300

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนธันวาคม
67	MINT	MINOR INTERNATIONAL PCL	13,800	-700
68	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PCL	3,000	-900
69	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PCL	10,500	-1,500
70	ORI	ORIGIN PROPERTY PCL	7,800	-4,500
71	OSP	OSOTSPA PCL	4,100	-1,400
72	PLANB	PLAN B MEDIA PCL	9,100	-2,000
73	PRM	PRIMA MARINE PCL	19,500	1,000
74	PSL	PRECIOUS SHIPPING PCL	5,300	-4,100
75	PTG	PTG ENERGY PCL	1,500	-800
76	PTT	PTT PCL	37,400	-6,700
77	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	14,400	-4,300
78	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	26,600	-3,200
79	QH	QUALITY HOUSES PCL	16,600	-5,800
80	RATCH	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL	5,100	-1,100
81	RS	RS PCL	900	-300
82	S	SINGHA ESTATE PCL	1,200	-1,300
83	SAMART	SAMART CORPORATION PCL	1,100	200
84	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PCL	5,000	-1,100
85	SCB	SCBX PCL	15,800	-2,900
86	SCC	THE SIAM CEMENT PCL	5,100	800
87	SCGP	SCG PACKAGING PCL	17,500	5,800
88	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL	0	-100
89	SIRI	SANSIRI PCL	56,300	-24,100
90	SPALI	SUPALAI PCL	5,300	-100
91	SPCG	SPCG PCL	300	-200
92	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PCL	15,100	-5,000

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนธันวาคม
93	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL	11,100	-3,900
94	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PCL	3,300	-1,100
95	STPI	STP&I PCL	1,600	-600
96	TCAP	THANACHART CAPITAL PCL	1,600	-200
97	THANI	RATCHTHANI LEASING PCL	6,900	-5,800
98	THCOM	THAICOM PCL	7,300	-2,100
99	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	5,100	-800
100	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL	2,900	-1,300
101	TTB	TMBTHANACHART BANK PCL	392,600	-170,300
102	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PCL	1,000	500
103	TPIPL	TPI POLENE PCL	4,700	-3,900
104	TPIPP	TPI POLENE POWER PCL	2,000	-500
105	TQM	TQM CORPORATION PCL	1,200	-100
106	TRUE	TRUE CORPORATION PCL	76,200	7,600
107	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PCL	10,300	1,400
108	TTCL	TTCL PCL	200	-300
109	TTW	TTW PCL	1,700	-300
110	TU	THAI UNION GROUP PCL	25,700	1,100
111	TVO	THAI VEGETABLE OIL PCL	300	-100
112	VGI	VGI GLOBAL MEDIA PCL	70,400	-900
113	WHA	WHA CORPORATION PCL	29,900	-8,300
114	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PCL	6,900	-2,800

15. การระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures เทียบกับเงินกองทุนของบริษัท (คำนวณล่าสุด โดย ฝ่ายบัญชีการเงิน) ที่ยอมรับได้ อยู่ที่ 491 ล้านบาท

16. การระงับตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures ร่วมกับสถานะเงินให้กู้ยืมเงิน (Margin Loan) ที่มีหุ้นสามัญนั้นรองรับอยู่ ที่ยอมรับได้ 5 เท่า ของ room (room อิงตาม Class ของหุ้น บน Volume 60/20)

ประกาศนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2568 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 ธันวาคม พ.ศ. 2567



(นายณัฐชัย บุณยะประภัสร์)

รองกรรมการผู้อำนวยการ