

ประกาศ MR 12/2564

เรื่อง จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit)

ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

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

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

- ยกเลิกประกาศ MR 11/2564 ของวันที่ 27 กันยายน 2562
- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนพฤศจิกายน 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	13,955

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Baht/USD Exchange Rate	USD Futures	3,654

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	96.5% pure gold bars	50 Baht Gold Futures (GF50 Futures)	43
2	96.5% pure gold bars	10 Baht Gold Futures (G10 Futures)	1,424

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	2,447

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with purity of 99.99%	Silver Online Futures	222

7. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold-D เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนพฤศจิกายน 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 ของเดือนพฤศจิกายน 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 ของเดือนพฤศจิกายน 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), ENERG (ดัชนีหมวดธุรกิจพลังงาน), FOOD (ดัชนีหมวดธุรกิจอาหารและเครื่องดื่ม), COMM (ดัชนีหมวดธุรกิจพาณิชย์) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนพฤศจิกายน 2564 เป็นดังนี้

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

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

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

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

12. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Japanese Rubber Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับยางแผ่นรมควันชั้น 3 ที่ซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเทศไทย) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนพฤศจิกายน 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 เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนพฤศจิกายน 2564 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนตุลาคม เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไป จากเดือนตุลาคม
1	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	9,960	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	BEC	BEC WORLD PUBLIC COMPANY LIMITED	8,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	CHG	CHULARAT HOSPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	44,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
4	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PUBLIC COMPANY LIMITED	1,400	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PUBLIC COMPANY LIMITED	35,520	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	8,448	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	KBANK	KASIKORNBANK PUBLIC COMPANY LIMITED	18,960	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	KCE	KCE ELECTRONICS PUBLIC COMPANY LIMITED	16,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
9	PSL	PRECIOUS SHIPPING PUBLIC COMPANY LIMITED	8,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	PTG	PTG ENERGY PUBLIC COMPANY LIMITED	8,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	SIRI	SANSIRI PUBLIC COMPANY LIMITED	23,776	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	SPCG	SPCG PUBLIC COMPANY LIMITED	320	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	109,400	ไม่เปลี่ยนแปลง
14	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PUBLIC COMPANY LIMITED	3,200	ไม่เปลี่ยนแปลง

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไป จากเดือนตุลาคม
15	VNT	VINYTHAI PUBLIC COMPANY LIMITED	80	ไม่เปลี่ยนแปลง

14. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์
บริษัทฯ ของ เดือนพฤศจิกายน 2564 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนตุลาคม เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน ตุลาคม
1	AAV	ASIA AVIATION PUBLIC COMPANY LIMITED	19,400	3,200
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PUBLIC COMPANY LIMITED	8,000	-1,400
3	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	450	-50
4	AMATA	AMATA CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	6,600	1,400
5	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PUBLIC COMPANY LIMITED	29,400	5,800
6	AP	AP (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	7,150	900
7	AWC	ASSET WORLD CORP PUBLIC COMPANY LIMITED	10,640	-400
8	BA	BANGKOK AIRWAYS PUBLIC COMPANY LIMITED	940	-280
9	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	9,200	-100
10	BANPU	BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED	27,080	6,800
11	BAY	BANK OF AYUDHYA PUBLIC COMPANY LIMITED	360	80
12	BBL	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	15,200	2,200
13	BCP	BANGCHAK CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	2,800	400
14	BCPG	BCPG PUBLIC COMPANY LIMITED	4,550	-1,850
15	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PUBLIC COMPANY LIMITED	28,300	-400
16	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PUBLIC COMPANY LIMITED	4,816	256
17	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PUBLIC COMPANY LIMITED	44,500	-1,900
18	BGRIM	B.GRIMM POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	8,900	-1,000
19	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	1,900	200

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน ตุลาคม
20	BJC	BERLI JUCKER PUBLIC COMPANY LIMITED	6,400	800
21	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PUBLIC COMPANY LIMITED	760	140
22	BLAND	BANGKOK LAND PUBLIC COMPANY LIMITED	6,360	1,100
23	BPP	BANPU POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	920	-200
24	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PUBLIC COMPANY LIMITED	38,100	-4,100
25	CBG	CARABAO GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	5,900	-100
26	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PUBLIC COMPANY LIMITED	1,500	-100
27	CK	CH. KARNCHANG PUBLIC COMPANY LIMITED	3,550	400
28	CKP	CK POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	11,550	-1,300
29	COM7	COM7 PUBLIC COMPANY LIMITED	7,700	-600
30	CPALL	CP ALL PUBLIC COMPANY LIMITED	27,300	-1,400
31	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	10,900	300
32	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PUBLIC COMPANY LIMITED	24,400	-5,300
33	CPN	CENTRAL PATTANA PUBLIC COMPANY LIMITED	11,100	300
34	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	2,400	-200
35	DTAC	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PUBLIC COMPANY LIMITED	18,900	-60
36	EA	ENERGY ABSOLUTE PUBLIC COMPANY LIMITED	12,000	-2,500
37	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	520	-40
38	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	3,100	-500
39	ERW	THE ERAWAN GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	3,740	1,040
40	ESSO	ESSO (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	9,400	2,200
41	GFPT	GFPT PUBLIC COMPANY LIMITED	1,100	-340
42	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PUBLIC COMPANY LIMITED	13,900	-100
43	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PUBLIC COMPANY LIMITED	11,600	-4,100
44	GULF	GULF ENERGY DEVELOPMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	42,900	-1,800

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน ตุลาคม
45	HANA	HANA MICROELECTRONICS PUBLIC COMPANY LIMITED	5,900	-850
46	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC COMPANY LIMITED	25,100	2,000
47	ICHI	ICHITAN GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	2,350	-1,350
48	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PUBLIC COMPANY LIMITED	14,700	-2,900
49	IRPC	IRPC PUBLIC COMPANY LIMITED	163,440	41,740
50	IVL	INDORAMA VENTURES PUBLIC COMPANY LIMITED	19,500	100
51	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PUBLIC COMPANY LIMITED	34,360	15,310
52	JMT	JMT NETWORK SERVICES PUBLIC COMPANY LIMITED	4,400	-800
53	KEX	KERRY EXPRESS (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	640	-180
54	KKP	KIATNAKIN BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	1,600	100
55	KTB	KRUNG THAI BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	37,100	9,600
56	KTC	KRUNGTHAI CARD PUBLIC COMPANY LIMITED	9,600	200
57	LH	LAND AND HOUSES PUBLIC COMPANY LIMITED	41,800	4,400
58	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	1,200	180
59	M	MK RESTAURANT GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	180	-20
60	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	3,950	-300
61	MBK	MBK PUBLIC COMPANY LIMITED	400	40
62	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PUBLIC COMPANY LIMITED	3,950	-50
63	MINT	MINOR INTERNATIONAL PUBLIC COMPANY LIMITED	16,000	1,700
64	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	8,500	-600
65	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PUBLIC COMPANY LIMITED	25,900	-200
66	ORI	ORIGIN PROPERTY PUBLIC COMPANY LIMITED	7,050	-200
67	OSP	OSOTSPA PUBLIC COMPANY LIMITED	8,400	-100
68	PLANB	PLAN B MEDIA PUBLIC COMPANY LIMITED	9,050	1,200
69	PRM	PRIMA MARINE PUBLIC COMPANY LIMITED	3,150	-900

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน ตุลาคม
70	PSH	PRUKSA HOLDING PUBLIC COMPANY LIMITED	320	120
71	PTT	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED	62,900	-3,700
72	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PUBLIC COMPANY LIMITED	10,900	2,300
73	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PUBLIC COMPANY LIMITED	21,400	-1,500
74	QH	QUALITY HOUSES PUBLIC COMPANY LIMITED	16,500	2,200
75	RATCH	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PUBLIC CO.,LTD.	4,600	-800
76	RS	RS PUBLIC COMPANY LIMITED	3,350	-1,050
77	S	SINGHA ESTATE PUBLIC COMPANY LIMITED	1,800	160
78	SAMART	SAMART CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	360	-260
79	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	9,600	-200
80	SCB	THE SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	18,700	3,000
81	SCC	THE SIAM CEMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	2,800	600
82	SCGP	SCG PACKAGING PUBLIC COMPANY LIMITED	16,800	-400
83	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PUBLIC COMPANY LIMITED	940	180
84	SPALI	SUPALAI PUBLIC COMPANY LIMITED	4,600	1,500
85	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PUBLIC COMPANY LIMITED	16,200	2,000
86	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PUBLIC COMPANY LIMITED	11,700	-2,000
87	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PUBLIC CO.,LTD.	7,000	950
88	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	17,300	-200
89	STPI	STP&I PUBLIC COMPANY LIMITED	420	-760
90	TASCO	TIPCO ASPHALT PUBLIC COMPANY LIMITED	4,600	-50
91	TCAP	THANACHART CAPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	2,650	150
92	THANI	RATCHTHANI LEASING PUBLIC COMPANY LIMITED	13,600	-2,650
93	THCOM	THAICOM PUBLIC COMPANY LIMITED	2,360	-740
94	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	220	-200

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน ตุลาคม
95	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	3,800	-500
96	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PUBLIC COMPANY LIMITED	3,400	600
97	TTB	TMBTHANACHART BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	314,800	27,300
98	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	360	-80
99	TOP	THAI OIL PUBLIC COMPANY LIMITED	16,320	820
100	TPIPL	TPI POLENE PUBLIC COMPANY LIMITED	4,000	-220
101	TPIPP	TPI POLENE POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	1,680	-340
102	TQM	TQM CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	300	-50
103	TRUE	TRUE CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	266,960	99,260
104	TTCL	TTCL PUBLIC COMPANY LIMITED	1,720	-540
105	TTW	TTW PUBLIC COMPANY LIMITED	960	20
106	TU	THAI UNION GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	34,300	-3,860
107	TVO	THAI VEGETABLE OIL PUBLIC COMPANY LIMITED	1,550	-200
108	UNIQ	UNIQUE ENGINEERING AND CONSTRUCTION PUBLIC COMPANY LIMITED	520	120
109	VGI	VGI GLOBAL MEDIA PUBLIC COMPANY LIMITED	15,650	500
110	VNG	VANACHAI GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	1,420	-60
111	WHA	WHA CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	50,450	19,900
112	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	880	-60

ประกาศนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 พฤศจิกายน 2564 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 26 ตุลาคม พ.ศ. 2564



(นายณัฐชัย บุนนยะประภัศร)

ผู้ช่วยกรรมการผู้อำนวยการ