

ประกาศ MR 18/2567

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

- ยกเลิกประกาศ MR 16/2567 วันที่ 30 ตุลาคม 2567 และ MR 17/2567 วันที่ 21 พฤศจิกายน 2567
- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนธันวาคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	23,166

- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Currency Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนธันวาคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	USD/THB Exchange Rate	USD Futures	5,213
2	EUR/USD Exchange Rate	EURUSD	202
3	USD/JPY Exchange Rate	USDJPY	1,095
4	EUR/THB Exchange Rate	EUR	10,000
5	JPY/THB Exchange Rate	JPY	10,000

4. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 96.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนธันวาคม 2567 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)	945

5. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Online Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 99.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนธันวาคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	3,398

6. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Silver Online Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับโลหะเงินที่มีความบริสุทธิ์ 99.9%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนธันวาคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with purity of 99.99%	Silver Online Futures	384

7. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold-D เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนธันวาคม 2567 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 ของเดือนธันวาคม 2567 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 ของเดือนธันวาคม 2567 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 ของเดือนธันวาคม 2567 เป็นดังนี้

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

11. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ RSS3 (ยางแผ่นรมควันชั้น 3) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนธันวาคม 2567 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 ของเดือนธันวาคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3)	Japanese Rubber Futures	38

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนธันวาคม 2567 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนพฤศจิกายน 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจากเดือนพฤศจิกายน
1	BCP	BANGCHAK CORPORATION PCL	20,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนพฤศจิกายน
4	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PCL	5,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL	100	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	TCAP	THANACHART CAPITAL PCL	1,800	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	THAI	THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
9	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL	4,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	TPIPP	TPI POLENE POWER PCL	2,500	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 เดือนธันวาคม 2567 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนพฤศจิกายน 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนพฤศจิกายน
1	AAV	ASIA AVIATION PCL	34,900	-5,600
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	14,100	700
3	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL	300	-100
4	AMATA	AMATA CORPORATION PCL	8,500	1,000
5	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	17,700	-2,200
6	AP	AP (THAILAND) PCL	22,500	-1,400
7	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	39,800	-16,900
8	BA	BANGKOK AIRWAYS PCL	2,800	-200
9	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL	10,800	1,500
10	BANPU	BANPU PCL	93,500	-6,700
11	BAY	BANK OF AYUDHYA PCL	600	-300
12	BBL	BANGKOK BANK PCL	17,800	-2,200
13	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL	7,400	-2,500
14	BCPG	BCPG PCL	5,600	-1,500
15	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	53,400	-3,800
16	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PCL	3,700	-1,700
17	BEC	BEC WORLD PCL	700	-400
18	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	36,400	-12,200

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนพฤศจิกายน
19	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	16,400	-4,900
20	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	4,700	1,700
21	BJC	BERLI JUCKER PCL	10,700	-3,600
22	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PCL	5,300	-400
23	BLAND	BANGKOK LAND PCL	3,700	-1,200
24	BPP	BANPU POWER PCL	600	-100
25	BSRC	BANGCHAK SRIRACHA PCL	1,400	-600
26	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	110,000	16,600
27	CBG	CARABAO GROUP PCL	3,500	-500
28	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL	1,500	-200
29	CHG	CHULARAT HOSPITAL PCL	26,300	-600
30	CK	CH. KARNCHANG PCL	1,700	-500
31	CKP	CK POWER PCL	8,600	-2,300
32	COM7	COM7 PCL	5,400	-900
33	CPALL	CP ALL PCL	25,500	-5,800
34	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	4,800	-1,300
35	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	33,600	-9,900
36	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	7,200	-1,000
37	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	900	-200
38	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	1,900	-500
39	ERW	THE ERAWAN GROUP PCL	9,700	-100
40	GFPT	GFPT PCL	2,400	-800
41	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	3,700	-1,100
42	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	9,600	-2,600
43	GULF	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	26,600	-400
44	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PCL	8,700	-2,700
45	HANA	HANA MICROELECTRONICS PCL	6,700	700
46	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PCL	38,100	-9,800
47	ICHI	ICHITAN GROUP PCL	4,000	-200
48	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PCL	22,800	-1,400
49	IRPC	IRPC PCL	36,600	-9,700
50	IVL	INDORAMA VENTURES PCL	51,700	-4,400
51	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PCL	62,200	-3,800

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนพฤศจิกายน
52	JMT	JMT NETWORK SERVICES PCL	15,800	-2,600
53	KBANK	KASIKORNBANK PCL	20,500	-3,200
54	KCE	KCE ELECTRONICS PCL	11,400	3,200
55	KEX	KERRY EXPRESS (THAILAND) PCL	1,100	-400
56	KKP	KIATNAKIN BANK PCL	4,400	-1,400
57	KTB	KRUNG THAI BANK PCL	111,400	-28,400
58	KTC	KRUNGTHAI CARD PCL	9,300	-1,200
59	LH	LAND AND HOUSES PCL	85,200	-25,300
60	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PCL	800	-100
61	M	MK RESTAURANT GROUP PCL	1,000	-200
62	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	2,300	-500
63	MBK	MBK PCL	3,200	-500
64	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PCL	800	-100
65	MINT	MINOR INTERNATIONAL PCL	14,500	-1,600
66	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PCL	3,900	-400
67	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PCL	12,000	-3,200
68	ORI	ORIGIN PROPERTY PCL	12,300	-4,100
69	OSP	OSOTSPA PCL	5,500	-1,100
70	PLANB	PLAN B MEDIA PCL	11,100	-1,100
71	PRM	PRIMA MARINE PCL	18,500	6,400
72	PSH	PRUKSA HOLDING PCL	700	-100
73	PSL	PRECIOUS SHIPPING PCL	9,400	-1,800
74	PTG	PTG ENERGY PCL	2,300	-400
75	PTT	PTT PCL	44,100	-8,600
76	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	18,700	-1,500
77	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	29,800	-6,100
78	QH	QUALITY HOUSES PCL	22,400	-12,700
79	RATCH	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL	6,200	-1,200
80	RS	RS PCL	1,200	-100
81	S	SINGHA ESTATE PCL	2,500	-600
82	SAMART	SAMART CORPORATION PCL	900	300
83	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PCL	6,100	-1,700
84	SCB	SCBX PCL	18,700	-4,900
85	SCC	THE SIAM CEMENT PCL	4,300	300

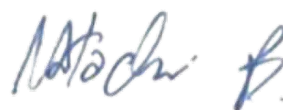
อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนพฤศจิกายน
86	SCGP	SCG PACKAGING PCL	11,700	-1,200
87	SIRI	SANSIRI PCL	80,400	-28,200
88	SPALI	SUPALAI PCL	5,400	-700
89	SPCG	SPCG PCL	500	-300
90	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PCL	20,100	-2,700
91	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL	15,000	-1,100
92	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	2,400	-100
93	STECON	STECON GROUP PCL	2,400	-100
94	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PCL	4,400	-100
95	STPI	STP&I PCL	2,200	-600
96	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PCL	19,200	-6,700
97	TASCO	TIPCO ASPHALT PCL	6,600	500
98	THANI	RATCHTHANI LEASING PCL	12,700	-2,400
99	THCOM	THAICOM PCL	9,400	-1,400
100	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	5,900	-1,700
101	TTB	TMBTHANACHART BANK PCL	562,900	-173,600
102	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PCL	500	-100
103	TOP	THAI OIL PCL	22,300	700
104	TPIPL	TPI POLENE PCL	8,600	-2,700
105	TQM	TQM CORPORATION PCL	1,300	-200
106	TRUE	TRUE CORPORATION PCL	68,600	-8,000
107	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PCL	8,900	700
108	TTCL	TTCL PCL	500	-200
109	TTW	TTW PCL	2,000	-400
110	TU	THAI UNION GROUP PCL	24,600	-1,500
111	TVO	THAI VEGETABLE OIL PCL	400	-100
112	VGI	VGI GLOBAL MEDIA PCL	71,300	-28,000
113	WHA	WHA CORPORATION PCL	38,200	4,000
114	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PCL	9,700	-100

15. การกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures เทียบกับเงินกองทุนของบริษัท (คำนวณล่าสุด โดย ฝ่ายบัญชีการเงิน) ที่ยอมรับได้ อยู่ที่ 490 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 ธันวาคม 2567 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 26 พฤศจิกายน พ.ศ. 2567



(นายณัฐชัย บุณยะประภัสร์)

รองกรรมการผู้อำนวยการ