

ประกาศ MR 16/2567

เรื่อง จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit)

ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อ้างถึง 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 14/2567 วันที่ 26 กันยายน 2567 และ MR 15/2567 วันที่ 29 ตุลาคม 2567
- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนพฤศจิกายน 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานะรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	21,230

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	USD/THB Exchange Rate	USD Futures	5,137
2	EUR/USD Exchange Rate	EURUSD	183
3	USD/JPY Exchange Rate	USDJPY	1,078
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 ของเดือนพฤศจิกายน 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)	962

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	3,278

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with purity of 99.99%	Silver Online Futures	335

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3)	Japanese Rubber Futures	37

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนพฤศจิกายน 2567 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนตุลาคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนตุลาคม
1	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL	400	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	BANPU	BANPU PCL	100,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	BBL	BANGKOK BANK PCL	20,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
4	BCP	BANGCHAK CORPORATION PCL	20,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	IVL	INDORAMA VENTURES PCL	56,100	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	KBANK	KASIKORNBANK PCL	23,700	ไม่เปลี่ยนแปลง
9	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PCL	900	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	M	MK RESTAURANT GROUP PCL	1,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PCL	900	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	RS	RS PCL	1,300	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PCL	4,500	ไม่เปลี่ยนแปลง
14	THAI	THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
15	TTW	TTW PCL	2,400	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 เดือนพฤศจิกายน 2567 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนตุลาคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนตุลาคม
1	AAV	ASIA AVIATION PCL	40,500	16,800
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	13,400	500
3	AMATA	AMATA CORPORATION PCL	7,500	500
4	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	19,900	-800
5	AP	AP (THAILAND) PCL	23,900	-800
6	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	56,700	-16,100
7	BA	BANGKOK AIRWAYS PCL	3,000	800
8	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL	9,300	1,100
9	BAY	BANK OF AYUDHYA PCL	900	-100

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนตุลาคม
10	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL	9,900	1,600
11	BCPG	BCPG PCL	7,100	700
12	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	57,200	3,400
13	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PCL	5,400	-400
14	BEC	BEC WORLD PCL	1,100	700
15	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	48,600	2,100
16	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	21,300	1,100
17	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	3,000	-300
18	BJC	BERLI JUCKER PCL	14,300	-900
19	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PCL	5,700	2,000
20	BLAND	BANGKOK LAND PCL	4,900	-1,200
21	BPP	BANPU POWER PCL	700	200
22	BSRC	BANGCHAK SRIRACHA PCL	2,000	-800
23	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	93,400	-22,000
24	CBG	CARABAO GROUP PCL	4,000	300
25	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL	1,700	100
26	CHG	CHULARAT HOSPITAL PCL	26,900	3,200
27	CK	CH. KARNCHANG PCL	2,200	-400
28	CKP	CK POWER PCL	10,900	1,900
29	COM7	COM7 PCL	6,300	-600
30	CPALL	CP ALL PCL	31,300	300
31	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	6,100	100
32	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	43,500	3,100
33	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	8,200	500
34	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	13,900	-1,800
35	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	1,100	-100

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนตุลาคม
36	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	2,400	200
37	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PCL	5,200	200
38	ERW	THE ERAWAN GROUP PCL	9,800	1,100
39	GFPT	GFPT PCL	3,200	-300
40	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	4,800	300
41	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	12,200	-1,900
42	GULF	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	27,000	6,000
43	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PCL	11,400	-1,800
44	HANA	HANA MICROELECTRONICS PCL	6,000	900
45	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PCL	47,900	-2,000
46	ICHI	ICHITAN GROUP PCL	4,200	-200
47	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PCL	24,200	4,400
48	IRPC	IRPC PCL	46,300	-2,300
49	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PCL	66,000	18,500
50	JMT	JMT NETWORK SERVICES PCL	18,400	2,300
51	KCE	KCE ELECTRONICS PCL	8,200	-1,600
52	KEX	KERRY EXPRESS (THAILAND) PCL	1,500	-500
53	KKP	KIATNAKIN BANK PCL	5,800	-100
54	KTB	KRUNG THAI BANK PCL	139,800	31,100
55	KTC	KRUNGTHAI CARD PCL	10,500	-400
56	LH	LAND AND HOUSES PCL	110,500	-5,600
57	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	2,800	200
58	MBK	MBK PCL	3,700	1,600
59	MINT	MINOR INTERNATIONAL PCL	16,100	-1,100
60	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PCL	4,300	100
61	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PCL	15,200	700

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนตุลาคม
62	ORI	ORIGIN PROPERTY PCL	16,400	500
63	OSP	OSOTSPA PCL	6,600	-200
64	PLANB	PLAN B MEDIA PCL	12,200	1,400
65	PRM	PRIMA MARINE PCL	12,100	1,400
66	PSH	PRUKSA HOLDING PCL	800	100
67	PSL	PRECIOUS SHIPPING PCL	11,200	-1,100
68	PTG	PTG ENERGY PCL	2,700	-300
69	PTT	PTT PCL	52,700	-6,700
70	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	20,200	6,000
71	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	35,900	7,500
72	QH	QUALITY HOUSES PCL	35,100	-1,000
73	RATCH	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL	7,400	700
74	S	SINGHA ESTATE PCL	3,100	-400
75	SAMART	SAMART CORPORATION PCL	600	-100
76	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PCL	7,800	-1,100
77	SCB	SCBX PCL	23,600	1,400
78	SCC	THE SIAM CEMENT PCL	4,000	700
79	SCGP	SCG PACKAGING PCL	12,900	900
80	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL	100	-100
81	SIRI	SANSIRI PCL	108,600	10,100
82	SPALI	SUPALAI PCL	6,100	300
83	SPCG	SPCG PCL	800	-100
84	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PCL	22,800	-1,000
85	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL	16,100	1,400
86	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PUBLIC CO.,LTD.	2,500	-400
87	STECON	STECON GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	2,500	-400

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนตุลาคม
88	STPI	STP&I PCL	2,800	700
89	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PCL	25,900	-9,000
90	TASCO	TIPCO ASPHALT PCL	6,100	1,200
91	TCAP	THANACHART CAPITAL PCL	1,800	100
92	THANI	RATCHTHANI LEASING PCL	15,100	-3,300
93	THCOM	THAICOM PCL	10,800	4,900
94	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL	0	-300
95	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	7,600	-1,400
96	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL	4,200	1,200
97	TTB	TMBTHANACHART BANK PCL	736,500	30,200
98	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PCL	600	-100
99	TOP	THAI OIL PCL	21,600	1,800
100	TPIPL	TPI POLENE PCL	11,300	-2,400
101	TPIPP	TPI POLENE POWER PCL	2,500	-500
102	TQM	TQM CORPORATION PCL	1,500	1,000
103	TRUE	TRUE CORPORATION PCL	76,600	3,400
104	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PCL	8,200	-400
105	TTCL	TTCL PCL	700	-100
106	TU	THAI UNION GROUP PCL	26,100	200
107	TVO	THAI VEGETABLE OIL PCL	500	100
108	VGI	VGI GLOBAL MEDIA PCL	99,300	13,800
109	WHA	WHA CORPORATION PCL	34,200	8,800
110	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PCL	9,800	2,900

15. การระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures เทียบกับเงินกองทุนของบริษัท (คำนวณล่าสุด โดย ฝ่ายบัญชีการเงิน) ที่ยอมรับได้ อยู่ที่ 487 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 พฤศจิกายน 2567 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 30 ตุลาคม พ.ศ. 2567



(นายณัฐชัย บุณยะประภัสร์)

รองกรรมการผู้อำนวยการ