

ประกาศ MR 08/2567

เรื่อง จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit)

ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อ้างอิง 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 06/2567 วันที่ 27 พฤษภาคม 2567 และ MR 07/2567 วันที่ 17 มิถุนายน 2567
- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกรกฎาคม 2567 เป็นดังนี้

| อันดับ | สินค้าอ้างอิง | คำอธิบาย | Position Limit (จำนวนสัญญา) |
|--------|---------------|--|-----------------------------|
| 1 | SET50 Index | จำนวนฐานะรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options | 27,502 |

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

| อันดับ | สินค้าอ้างอิง | ชื่อ | Position Limit (จำนวนสัญญา) |
|--------|------------------------|-------------|-----------------------------|
| 1 | Baht/USD Exchange Rate | USD Futures | 5,009 |
| 2 | EUR/USD Exchange Rate | EURUSD | 221 |
| 3 | USD/JPY Exchange Rate | USDJPY | 1,069 |

NB

4. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 96.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกรกฎาคม 2567 เป็นดังนี้

| อันดับ | สินค้าอ้างอิง | คำอธิบาย | Position Limit (จำนวนสัญญา) |
|--------|----------------------|-------------------------------------|-----------------------------|
| 1 | 96.5% pure gold bars | 50 Baht Gold Futures (GF50 Futures) | 29 |
| 2 | 96.5% pure gold bars | 10 Baht Gold Futures (G10 Futures) | 1,348 |

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

| อันดับ | สินค้าอ้างอิง | ชื่อ | Position Limit (จำนวนสัญญา) |
|--------|----------------------|---------------------|-----------------------------|
| 1 | 99.5% pure gold bars | Gold Online Futures | 3,230 |

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

| อันดับ | สินค้าอ้างอิง | ชื่อ | Position Limit (จำนวนสัญญา) |
|--------|------------------------------|-----------------------|-----------------------------|
| 1 | Silver with purity of 99.99% | Silver Online Futures | 286 |

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

| อันดับ | 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 ของเดือนกรกฎาคม 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 ของเดือนกรกฎาคม 2567 เป็นดังนี้

| อันดับ | สินค้าอ้างอิง | ชื่อ | Position Limit (จำนวนสัญญา) |
|--------|--|----------------------------|-----------------------------|
| 1 | JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3) | Japanese Rubber Futures | 35 |

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนกรกฎาคม 2567 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนมิถุนายน 2567 เป็นดังนี้

| อันดับ | หุ้นอ้างอิง | ชื่อบริษัท | Position Limit (จำนวนสัญญา) | เปลี่ยนแปลงไปจากเดือนมิถุนายน |
|--------|-------------|----------------------------------|-----------------------------|-------------------------------|
| 1 | AEONTS | AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL | 300 | ไม่เปลี่ยนแปลง |
| 2 | BAY | BANK OF AYUDHYA PCL | 400 | ไม่เปลี่ยนแปลง |

| อันดับ | หุ้นอ้างอิง | ชื่อบริษัท | Position Limit (จำนวนสัญญา) | เปลี่ยนแปลงไปจากเดือนมิถุนายน |
|--------|-------------|---|-----------------------------|-------------------------------|
| 3 | GLOBAL | SIAM GLOBAL HOUSE PCL | 3,400 | ไม่เปลี่ยนแปลง |
| 4 | ITD | ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL | 0 | ไม่เปลี่ยนแปลง |
| 5 | LH | LAND AND HOUSES PCL | 119,500 | ไม่เปลี่ยนแปลง |
| 6 | LPN | L.P.N. DEVELOPMENT PCL | 1,300 | ไม่เปลี่ยนแปลง |
| 7 | S | SINGHA ESTATE PCL | 1,900 | ไม่เปลี่ยนแปลง |
| 8 | THAI | THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL | 0 | ไม่เปลี่ยนแปลง |
| 9 | TOP | THAI OIL PCL | 22,300 | ไม่เปลี่ยนแปลง |
| 10 | TVO | THAI VEGETABLE OIL PCL | 400 | ไม่เปลี่ยนแปลง |
| 11 | UNIQ | UNIQUE ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL | 0 | ไม่เปลี่ยนแปลง |
| 12 | VNG | VANACHAI GROUP PCL | 200 | ไม่เปลี่ยนแปลง |

14. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัท ๆ ของ เดือนกรกฎาคม 2567 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนมิถุนายน 2567 เป็นดังนี้

| อันดับ | หุ้นอ้างอิง | ชื่อบริษัท | Position Limit (จำนวนสัญญา) | เปลี่ยนแปลงไปจากเดือนมิถุนายน |
|--------|-------------|---|-----------------------------|-------------------------------|
| 1 | AAV | ASIA AVIATION PCL | 13,300 | -4,400 |
| 2 | ADVANC | ADVANCED INFO SERVICE PCL | 9,900 | -500 |
| 3 | AMATA | AMATA CORPORATION PCL | 6,300 | 400 |
| 4 | AOT | AIRPORTS OF THAILAND PCL | 22,400 | 5,600 |
| 5 | AP | AP (THAILAND) PCL | 30,700 | -100 |
| 6 | AWC | ASSET WORLD CORP PCL | 34,600 | 3,200 |
| 7 | BA | BANGKOK AIRWAYS PCL | 3,100 | 1,100 |
| 8 | BAM | BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL | 5,600 | -2,000 |
| 9 | BANPU | BANPU PCL | 86,000 | 9,600 |
| 10 | BBL | BANGKOK BANK PCL | 13,900 | -500 |
| 11 | BCH | BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL | 4,200 | -100 |
| 12 | BCP | BANGCHAK CORPORATION PCL | 7,000 | 100 |
| 13 | BCPG | BCPG PCL | 2,400 | -200 |
| 14 | BDMS | BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL | 37,800 | 1,700 |
| 15 | BEAUTY | BEAUTY COMMUNITY PCL | 7,300 | -3,000 |
| 16 | BEC | BEC WORLD PCL | 1,000 | -100 |
| 17 | BEM | BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL | 47,400 | 11,500 |
| 18 | BGRIM | B.GRIMM POWER PCL | 12,900 | 3,900 |

| อันดับ | หุ้น อ้างอิง | ชื่อบริษัท | Position Limit (จำนวน สัญญา) | เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนมิถุนายน |
|--------|-----------------|--|---------------------------------|-----------------------------------|
| 19 | BH | BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL | 2,500 | -400 |
| 20 | BJC | BERLI JUCKER PCL | 12,000 | -6,700 |
| 21 | BLA | BANGKOK LIFE ASSURANCE PCL | 4,300 | 300 |
| 22 | BLAND | BANGKOK LAND PCL | 9,000 | 5,900 |
| 23 | BPP | BANPU POWER PCL | 600 | -100 |
| 24 | BSRC | BANGCHAK SRIRACHA PCL | 2,700 | 400 |
| 25 | BTS | BTS GROUP HOLDINGS PCL | 131,700 | 68,600 |
| 26 | CBG | CARABAO GROUP PCL | 3,500 | -700 |
| 27 | CENTEL | CENTRAL PLAZA HOTEL PCL | 1,200 | -100 |
| 28 | CHG | CHULARAT HOSPITAL PCL | 22,100 | -2,900 |
| 29 | CK | CH. KARNCHANG PCL | 2,000 | -600 |
| 30 | CKP | CK POWER PCL | 7,900 | -1,000 |
| 31 | COM7 | COM7 PCL | 7,000 | 800 |
| 32 | CPALL | CP ALL PCL | 26,900 | -2,600 |
| 33 | CRC | CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL | 5,700 | -600 |
| 34 | CPF | CHAROEN POKPHAND FOODS PCL | 37,400 | 1,900 |
| 35 | CPN | CENTRAL PATTANA PCL | 7,800 | -500 |
| 36 | DELTA | DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL | 15,500 | 2,000 |
| 37 | EA | ENERGY ABSOLUTE PCL | 30,500 | 11,300 |
| 38 | EASTW | EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL. | 1,000 | 100 |
| 39 | EGCO | ELECTRICITY GENERATING PCL | 2,200 | 200 |
| 40 | EPG | EASTERN POLYMER GROUP PCL | 2,400 | 300 |
| 41 | ERW | THE ERAWAN GROUP PCL | 6,600 | -600 |
| 42 | GFPT | GFPT PCL | 3,600 | 100 |
| 43 | GPSC | GLOBAL POWER SYNERGY PCL | 7,200 | 1,800 |
| 44 | GULF | GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL | 12,800 | 2,200 |
| 45 | GUNKUL | GUNKUL ENGINEERING PCL | 8,000 | -300 |
| 46 | HANA | HANA MICROELECTRONICS PCL | 6,000 | 100 |
| 47 | HMPRO | HOME PRODUCT CENTER PCL | 36,500 | 8,000 |
| 48 | ICHI | ICHITAN GROUP PCL | 4,100 | -300 |
| 49 | INTUCH | INTOUCH HOLDINGS PCL | 9,800 | 4,200 |
| 50 | IRPC | IRPC PCL | 40,400 | 6,000 |
| 51 | IVL | INDORAMA VENTURES PCL | 29,700 | 2,000 |

| อันดับ | หุ้น อ้างอิง | ชื่อบริษัท | Position Limit (จำนวน สัญญา) | เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนมิถุนายน |
|--------|-----------------|---|---------------------------------|-----------------------------------|
| 52 | JAS | JASMINE INTERNATIONAL PCL | 82,900 | 32,400 |
| 53 | JMT | JMT NETWORK SERVICES PCL | 12,000 | 600 |
| 54 | KBANK | KASIKORNBANK PCL | 20,200 | -1,000 |
| 55 | KCE | KCE ELECTRONICS PCL | 8,700 | 600 |
| 56 | KEX | KERRY EXPRESS (THAILAND) PCL | 4,200 | 2,100 |
| 57 | KKP | KIATNAKIN BANK PCL | 2,600 | -700 |
| 58 | KTB | KRUNG THAI BANK PCL | 88,500 | -16,200 |
| 59 | KTC | KRUNGTHAI CARD PCL | 10,500 | 3,300 |
| 60 | M | MK RESTAURANT GROUP PCL | 800 | 100 |
| 61 | MAJOR | MAJOR CINEPLEX GROUP PCL | 4,800 | 1,100 |
| 62 | MBK | MBK PCL | 3,000 | -1,000 |
| 63 | MEGA | MEGA LIFESCIENCES PCL | 1,200 | 100 |
| 64 | MINT | MINOR INTERNATIONAL PCL | 16,800 | 2,500 |
| 65 | MTC | MUANGTHAI CAPITAL PCL | 4,500 | 500 |
| 66 | OR | PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PCL | 15,600 | 2,300 |
| 67 | ORI | ORIGIN PROPERTY PCL | 8,700 | 200 |
| 68 | OSP | OSOTSPA PCL | 7,600 | 400 |
| 69 | PLANB | PLAN B MEDIA PCL | 0 | -7,600 |
| 70 | PRM | PRIMA MARINE PCL | 12,800 | 1,000 |
| 71 | PSH | PRUKSA HOLDING PCL | 800 | 100 |
| 72 | PSL | PRECIOUS SHIPPING PCL | 14,000 | 2,400 |
| 73 | PTG | PTG ENERGY PCL | 3,500 | 500 |
| 74 | PTT | PTT PCL | 53,900 | 5,200 |
| 75 | PTTEP | PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL | 12,000 | -1,600 |
| 76 | PTTGC | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL | 20,700 | 5,400 |
| 77 | QH | QUALITY HOUSES PCL | 36,500 | -100 |
| 78 | RATCH | RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL | 5,600 | 1,000 |
| 79 | RS | RS PCL | 800 | 300 |
| 80 | SAMART | SAMART CORPORATION PCL | 1,500 | -500 |
| 81 | SAWAD | SRISAWAD CORPORATION PCL | 7,100 | 1,100 |
| 82 | SCB | SCBX PCL | 16,300 | -2,900 |
| 83 | SCC | THE SIAM CEMENT PCL | 2,900 | 200 |
| 84 | SCGP | SCG PACKAGING PCL | 8,400 | -500 |
| 85 | SGP | SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL | 300 | 200 |

| อันดับ | หุ้น อ้างอิง | ชื่อบริษัท | Position Limit (จำนวน สัญญา) | เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนมิถุนายน |
|--------|-----------------|--|---------------------------------|-----------------------------------|
| 86 | SIRI | SANSIRI PCL | 79,900 | -15,800 |
| 87 | SPALI | SUPALAI PCL | 6,800 | -100 |
| 88 | SPCG | SPCG PCL | 1,000 | 600 |
| 89 | SPRC | STAR PETROLEUM REFINING PCL | 15,100 | -5,200 |
| 90 | STA | SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL | 19,200 | 7,700 |
| 91 | STEC | SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL | 1,800 | -700 |
| 92 | STGT | SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PCL | 5,100 | 1,000 |
| 93 | STPI | STP&I PCL | 1,000 | 300 |
| 94 | SUPER | SUPER ENERGY CORPORATION PCL | 18,000 | -13,400 |
| 95 | TASCO | TIPCO ASPHALT PCL | 4,200 | 700 |
| 96 | TCAP | THANACHART CAPITAL PCL | 1,900 | 100 |
| 97 | THANI | RATCHTHANI LEASING PCL | 10,600 | -3,200 |
| 98 | THCOM | THAICOM PCL | 3,700 | -1,100 |
| 99 | THG | THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL | 200 | 100 |
| 100 | TISCO | TISCO FINANCIAL GROUP PCL | 8,100 | -600 |
| 101 | TKN | TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL | 4,100 | -1,400 |
| 102 | TTB | TMBTHANACHART BANK PCL | 492,700 | 102,100 |
| 103 | TOA | TOA PAINT (THAILAND) PCL | 900 | -300 |
| 104 | TPIPL | TPI POLENE PCL | 5,900 | 2,300 |
| 105 | TPIPP | TPI POLENE POWER PCL | 1,700 | -300 |
| 106 | TQM | TQM CORPORATION PCL | 600 | -100 |
| 107 | TRUE | TRUE CORPORATION PCL | 89,300 | -600 |
| 108 | TTA | THORESEN THAI AGENCIES PCL | 11,900 | 1,200 |
| 109 | TTCL | TTCL PCL | 300 | -100 |
| 110 | TTW | TTW PCL | 1,600 | 200 |
| 111 | TU | THAI UNION GROUP PCL | 31,600 | 1,900 |
| 112 | VGI | VGI GLOBAL MEDIA PCL | 40,000 | -7,500 |
| 113 | WHA | WHA CORPORATION PCL | 33,800 | 3,000 |
| 114 | WHAUP | WHA UTILITIES AND POWER PCL | 6,000 | 3,500 |

15. การระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures เทียบกับเงินกองทุนของบริษัท (คำนวณล่าสุด โดย ฝ่ายบัญชีการเงิน) ที่ยอมรับได้ อยู่ที่ 488 ล้านบาท

NB

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

ประกาศนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม 2567 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 มิถุนายน พ.ศ. 2567



(นายณัฐชัย บุณยะประภัสร์)

รองกรรมการผู้อำนวยการ