

ประกาศ MR 02/2568

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 21/2567 วันที่ 27 ธันวาคม 2567 และ MR 01/2568 วันที่ 10 มกราคม 2568
- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกุมภาพันธ์ 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	17,377

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	USD/THB Exchange Rate	USD Futures	5,366
2	EUR/USD Exchange Rate	EURUSD	250
3	USD/JPY Exchange Rate	USDJPY	1,094
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 ของเดือนกุมภาพันธ์ 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	96.5% pure gold bars	50 Baht Gold Futures (GF50 Futures)	24
2	96.5% pure gold bars	10 Baht Gold Futures (G10 Futures)	912

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	3,058

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with purity of 99.99%	Silver Online Futures	347

7. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold-D เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกุมภาพันธ์ 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 ของเดือนกุมภาพันธ์ 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 ของเดือนกุมภาพันธ์ 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 ของเดือนกุมภาพันธ์ 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 ของเดือนกุมภาพันธ์ 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 ของเดือนกุมภาพันธ์ 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 เดือนกุมภาพันธ์ 2568 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนมกราคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนกุมภาพันธ์
1	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL	200	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	BAY	BANK OF AYUDHYA PCL	300	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	BCP	BANGCHAK CORPORATION PCL	20,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
4	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	S	SINGHA ESTATE PCL	1,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	1,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
9	STECON	STECON GROUP PCL	1,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	THAI	THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	TOP	THAI OIL PCL	22,300	ไม่เปลี่ยนแปลง
14	TTCL	TTCL PCL	200	ไม่เปลี่ยนแปลง
15	TU	THAI UNION GROUP PCL	25,700	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 เดือนกุมภาพันธ์ 2568 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนมกราคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนกุมภาพันธ์
1	AAV	ASIA AVIATION PCL	20,000	-9,500
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	10,900	-2,000
3	AMATA	AMATA CORPORATION PCL	5,900	-1,400
4	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	14,500	-700
5	AP	AP (THAILAND) PCL	19,200	-200
6	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	21,500	-400
7	BA	BANGKOK AIRWAYS PCL	2,100	-200

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนกุมภาพันธ์
8	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL	7,800	-1,200
9	BANPU	BANPU PCL	54,300	-8,400
10	BBL	BANGKOK BANK PCL	12,000	-800
11	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL	3,700	-1,600
12	BCPG	BCPG PCL	8,200	4,000
13	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	46,800	-15,300
14	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PCL	2,300	-200
15	BEC	BEC WORLD PCL	200	-300
16	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	28,400	-11,000
17	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	12,700	-100
18	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	4,300	-900
19	BJC	BERLI JUCKER PCL	5,600	-1,000
20	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PCL	2,400	-1,500
21	BLAND	BANGKOK LAND PCL	3,700	700
22	BPP	BANPU POWER PCL	800	300
23	BSRC	BANGCHAK SRIRACHA PCL	500	-100
24	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	77,700	-16,300
25	CBG	CARABAO GROUP PCL	2,900	-300
26	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL	1,500	200
27	CHG	CHULARAT HOSPITAL PCL	22,900	-3,600
28	CK	CH. KARNCHANG PCL	1,500	-300
29	CKP	CK POWER PCL	3,600	-2,900
30	COM7	COM7 PCL	5,000	900
31	CPALL	CP ALL PCL	28,000	-3,600
32	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	4,100	-900
33	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	18,700	-9,100
34	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	7,500	700
35	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	17,800	1,900
36	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	1,200	500

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนกุมภาพันธ์
37	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	1,100	-400
38	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PCL	2,700	-900
39	ERW	THE ERAWAN GROUP PCL	11,000	1,600
40	GFPT	GFPT PCL	1,800	-300
41	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	4,000	500
42	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	8,700	1,900
43	GULF	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	24,300	-2,400
44	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PCL	6,500	-200
45	HANA	HANA MICROELECTRONICS PCL	5,400	-1,200
46	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PCL	26,400	-2,800
47	ICHI	ICHITAN GROUP PCL	2,300	-600
48	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PCL	21,300	-2,800
49	IRPC	IRPC PCL	19,700	-2,300
50	IVL	INDORAMA VENTURES PCL	27,700	-5,400
51	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PCL	34,000	-23,400
52	JMT	JMT NETWORK SERVICES PCL	10,200	-1,400
53	KBANK	KASIKORNBANK PCL	17,400	-400
54	KCE	KCE ELECTRONICS PCL	12,700	-100
55	KEX	KERRY EXPRESS (THAILAND) PCL	800	-100
56	KKP	KIATNAKIN BANK PCL	3,000	-200
57	KTB	KRUNG THAI BANK PCL	76,700	-7,800
58	KTC	KRUNGTHAI CARD PCL	5,800	-600
59	LH	LAND AND HOUSES PCL	59,600	-8,100
60	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PCL	1,200	500
61	M	MK RESTAURANT GROUP PCL	1,300	500
62	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	2,000	-700
63	MBK	MBK PCL	2,100	-600
64	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PCL	1,000	-100
65	MINT	MINOR INTERNATIONAL PCL	15,500	1,700
66	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PCL	2,700	-300

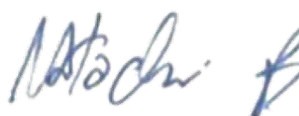
อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนกุมภาพันธ์
67	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PCL	11,100	600
68	ORI	ORIGIN PROPERTY PCL	5,400	-2,400
69	OSP	OSOTSPA PCL	3,800	-300
70	PLANB	PLAN B MEDIA PCL	9,300	200
71	PRM	PRIMA MARINE PCL	14,000	-5,500
72	PSH	PRUKSA HOLDING PCL	800	100
73	PSL	PRECIOUS SHIPPING PCL	3,800	-1,500
74	PTG	PTG ENERGY PCL	1,300	-200
75	PTT	PTT PCL	38,500	1,100
76	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	12,800	-1,600
77	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	26,000	-600
78	QH	QUALITY HOUSES PCL	13,300	-3,300
79	RATCH	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL	4,800	-300
80	RS	RS PCL	21,800	20,900
81	SAMART	SAMART CORPORATION PCL	1,000	-100
82	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PCL	4,900	-100
83	SCB	SCBX PCL	13,300	-2,500
84	SCC	THE SIAM CEMENT PCL	4,600	-500
85	SCGP	SCG PACKAGING PCL	16,100	-1,400
86	SIRI	SANSIRI PCL	39,400	-16,900
87	SPALI	SUPALAI PCL	5,500	200
88	SPCG	SPCG PCL	200	-100
89	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PCL	13,600	-1,500
90	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL	8,000	-3,100
91	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PCL	2,600	-700
92	STPI	STP&I PCL	1,000	-600
93	TASCO	TIPCO ASPHALT PCL	5,300	-1,300
94	TCAP	THANACHART CAPITAL PCL	1,200	-400
95	THANI	RATCHTHANI LEASING PCL	7,100	200
96	THCOM	THAICOM PCL	4,000	-3,300

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนกุมภาพันธ์
97	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	5,000	-100
98	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL	2,000	-900
99	TTB	TMBTHANACHART BANK PCL	414,900	22,300
100	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PCL	1,500	500
101	TPIPL	TPI POLENE PCL	4,400	-300
102	TPIPP	TPI POLENE POWER PCL	1,400	-600
103	TQM	TQM CORPORATION PCL	700	-500
104	TRUE	TRUE CORPORATION PCL	71,600	-4,600
105	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PCL	7,700	-2,600
106	TTW	TTW PCL	1,900	200
107	TVO	THAI VEGETABLE OIL PCL	200	-100
108	VGI	VGI GLOBAL MEDIA PCL	62,900	-7,500
109	WHA	WHA CORPORATION PCL	30,700	800
110	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PCL	6,100	-800

15. การระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures เทียบกับเงินกองทุนของบริษัท (คำนวณล่าสุด โดย ฝ่ายบัญชีการเงิน) ที่ยอมรับได้ อยู่ที่ 496 ล้านบาท
16. การระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures รวมกับสถานะเงินให้กู้ยืมเงิน (Margin Loan) ที่มีหุ้นสามัญนั้นรองรับอยู่ ที่ยอมรับได้ 5 เท่า ของ room (room อิงตาม Class ของหุ้น บน Volume 60/20)

ประกาศนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กุมภาพันธ์ 2568 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 มกราคม พ.ศ. 2568



(นายณัฐชัย บุนนยะประภัศร)

รองกรรมการผู้อำนวยการ