

ประกาศ MR 04/2568

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 03/2568 วันที่ 7 กุมภาพันธ์ 2568 และ MR 02/2568 วันที่ 27 มกราคม 2568
- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมีนาคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	24,614

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	USD/THB Exchange Rate	USD Futures	5,473
2	EUR/USD Exchange Rate	EURUSD	265
3	USD/JPY Exchange Rate	USDJPY	1,096
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 ของเดือนมีนาคม 2568 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)	910

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	3,028

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with purity of 99.99%	Silver Online Futures	321

7. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold-D เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมีนาคม 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 ของเดือนมีนาคม 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 ของเดือนมีนาคม 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 ของเดือนมีนาคม 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 ของเดือนมีนาคม 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 ของเดือนมีนาคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3)	Japanese Rubber Futures	33

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนมีนาคม 2568 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนกุมภาพันธ์ 2568 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	BEC	BEC WORLD PCL	200	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	KEX	KERRY EXPRESS (THAILAND) PCL	800	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	RS	RS PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
9	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	SPCG	SPCG PCL	200	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PCL	2,600	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	THAI	THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
14	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
15	TOP	THAI OIL PCL	22,300	ไม่เปลี่ยนแปลง
16	TTW	TTW PCL	1,900	ไม่เปลี่ยนแปลง
17	TVO	THAI VEGETABLE OIL PCL	200	ไม่เปลี่ยนแปลง
18	UNIQ	UNIQUE ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
19	VNG	VANACHAI GROUP PCL	100	ไม่เปลี่ยนแปลง

14. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เหนือบริษัท
ๆ ของ เดือนมีนาคม 2568 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนธันวาคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนกุมภาพันธ์
1	AAV	ASIA AVIATION PCL	18,900	-1,100
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	13,500	2,600
3	AMATA	AMATA CORPORATION PCL	7,100	1,200
4	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	30,500	16,000
5	AP	AP (THAILAND) PCL	20,700	1,500
6	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	21,400	-100

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนกุมภาพันธ์
7	BA	BANGKOK AIRWAYS PCL	2,300	200
8	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL	9,100	1,300
9	BANPU	BANPU PCL	52,900	-1,400
10	BBL	BANGKOK BANK PCL	16,500	4,500
11	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL	3,300	-400
12	BCPG	BCPG PCL	11,800	3,600
13	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	44,200	-2,600
14	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PCL	3,000	700
15	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	28,800	400
16	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	15,100	2,400
17	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	3,800	-500
18	BJC	BERLI JUCKER PCL	4,900	-700
19	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PCL	2,100	-300
20	BLAND	BANGKOK LAND PCL	4,600	900
21	BPP	BANPU POWER PCL	1,100	300
22	BSRC	BANGCHAK SRIRACHA PCL	1,200	700
23	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	73,000	-4,700
24	CBG	CARABAO GROUP PCL	3,600	700
25	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL	1,700	200
26	CHG	CHULARAT HOSPITAL PCL	18,400	-4,500
27	CK	CH. KARNCHANG PCL	1,600	100
28	CKP	CK POWER PCL	3,800	200
29	COM7	COM7 PCL	5,400	400
30	CPALL	CP ALL PCL	49,600	21,600
31	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	3,800	-300
32	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	22,900	4,200
33	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	8,500	1,000
34	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	23,300	5,500
35	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	1,000	-200

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนกุมภาพันธ์
36	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	1,200	100
37	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PCL	2,300	-400
38	ERW	THE ERAWAN GROUP PCL	11,900	900
39	GFPT	GFPT PCL	2,100	300
40	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	7,200	3,200
41	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	10,500	1,800
42	GULF	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	25,600	1,300
43	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PCL	7,100	600
44	HANA	HANA MICROELECTRONICS PCL	4,600	-800
45	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PCL	25,900	-500
46	ICHI	ICHITAN GROUP PCL	2,400	100
47	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PCL	24,500	3,200
48	IRPC	IRPC PCL	21,500	1,800
49	IVL	INDORAMA VENTURES PCL	25,800	-1,900
50	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PCL	20,800	-13,200
51	JMT	JMT NETWORK SERVICES PCL	7,100	-3,100
52	KBANK	KASIKORN BANK PCL	20,700	3,300
53	KCE	KCE ELECTRONICS PCL	10,900	-1,800
54	KKP	KIATNAKIN BANK PCL	4,800	1,800
55	KTB	KRUNG THAI BANK PCL	109,000	32,300
56	KTC	KRUNGTHAI CARD PCL	7,900	2,100
57	LH	LAND AND HOUSES PCL	66,700	7,100
58	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PCL	1,600	400
59	M	MK RESTAURANT GROUP PCL	2,200	900
60	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	1,300	-700
61	MBK	MBK PCL	1,700	-400
62	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PCL	900	-100
63	MINT	MINOR INTERNATIONAL PCL	21,400	5,900
64	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PCL	2,900	200
65	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PCL	15,600	4,500

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนกุมภาพันธ์
66	ORI	ORIGIN PROPERTY PCL	6,400	1,000
67	OSP	OSOTSPA PCL	8,600	4,800
68	PLANB	PLAN B MEDIA PCL	10,300	1,000
69	PRM	PRIMA MARINE PCL	9,100	-4,900
70	PSH	PRUKSA HOLDING PCL	1,200	400
71	PSL	PRECIOUS SHIPPING PCL	3,600	-200
72	PTG	PTG ENERGY PCL	1,200	-100
73	PTT	PTT PCL	48,800	10,300
74	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	12,500	-300
75	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	33,000	7,000
76	QH	QUALITY HOUSES PCL	18,100	4,800
77	RATCH	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL	4,500	-300
78	S	SINGHA ESTATE PCL	900	-300
79	SAMART	SAMART CORPORATION PCL	1,400	400
80	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PCL	5,200	300
81	SCB	SCBX PCL	17,300	4,000
82	SCC	THE SIAM CEMENT PCL	4,500	-100
83	SCGP	SCG PACKAGING PCL	16,500	400
84	SIRI	SANSIRI PCL	43,400	4,000
85	SPALI	SUPALAI PCL	6,500	1,000
86	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PCL	14,700	1,100
87	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL	7,000	-1,000
88	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	2,000	800
89	STECON	STECON GROUP PCL	2,000	800
90	STPI	STP&I PCL	800	-200
91	TASCO	TIPCO ASPHALT PCL	5,000	-300
92	TCAP	THANACHART CAPITAL PCL	1,600	400
93	THANI	RATCHTHANI LEASING PCL	8,600	1,500
94	THCOM	THAICOM PCL	2,700	-1,300

NB

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนกุมภาพันธ์
95	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	6,200	1,200
96	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL	1,300	-700
97	TTB	TMBTHANACHART BANK PCL	680,300	265,400
98	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PCL	1,600	100
99	TPIPL	TPI POLENE PCL	4,600	200
100	TPIPP	TPI POLENE POWER PCL	1,600	200
101	TQM	TQM CORPORATION PCL	800	100
102	TRUE	TRUE CORPORATION PCL	85,000	13,400
103	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PCL	6,000	-1,700
104	TTCL	TTCL PCL	100	-100
105	TU	THAI UNION GROUP PCL	27,200	1,500
106	VGI	VGI GLOBAL MEDIA PCL	69,900	7,000
107	WHA	WHA CORPORATION PCL	63,500	32,800
108	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PCL	5,800	-300

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 มีนาคม 2568 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 กุมภาพันธ์ พ.ศ. 2568



(นายณัฐชัย บุณยะประภัสร์)

รองกรรมการผู้อำนวยการ