

ประกาศ MR 03/2567

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 02/2567 ของวันที่ 23 กุมภาพันธ์ 2567
- จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนเมษายน 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานะรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	22,131

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Baht/USD Exchange Rate	USD Futures	5,043
2	EUR/USD Exchange Rate	EURUSD	227
3	USD/JPY Exchange Rate	USDJPY	970

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	96.5% pure gold bars	50 Baht Gold Futures (GF50 Futures)	28
2	96.5% pure gold bars	10 Baht Gold Futures (G10 Futures)	1,652

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	3,224

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with purity of 99.99%	Silver Online Futures	174

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3)	Japanese Rubber Futures	36

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนเมษายน 2567 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนมีนาคม 2567 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไป จากเดือนมีนาคม
1	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL	100	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	BAY	BANK OF AYUDHYA PCL	500	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	CBG	CARABAO GROUP PCL	3,900	ไม่เปลี่ยนแปลง
4	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	2,300	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PCL	1,100	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	PLANB	PLAN B MEDIA PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	PSH	PRUKSA HOLDING PCL	600	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL	100	ไม่เปลี่ยนแปลง
9	THAI	THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL	300	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	TPIPP	TPI POLENE POWER PCL	1,700	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	TTCL	TTCL PCL	300	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	UNIQ	UNIQUE ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
14	VNG	VANACHAI GROUP PCL	100	ไม่เปลี่ยนแปลง

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

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไป จากเดือนมีนาคม
1	AAV	ASIA AVIATION PCL	18,000	1,500
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	9,400	900
3	AMATA	AMATA CORPORATION PCL	7,800	-1,100
4	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	22,400	-6,000
5	AP	AP (THAILAND) PCL	16,500	2,900
6	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	31,000	-1,300
7	BA	BANGKOK AIRWAYS PCL	1,500	100
8	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL	8,600	4,200
9	BANPU	BANPU PCL	84,100	15,900
10	BBL	BANGKOK BANK PCL	15,300	-1,100
11	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL	5,500	-900
12	BCP	BANGCHAK CORPORATION PCL	7,000	2,200

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไป จากเดือนมีนาคม
13	BCPG	BCPG PCL	2,500	500
14	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	36,900	100
15	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PCL	25,800	-4,100
16	BEC	BEC WORLD PCL	1,400	600
17	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	39,500	9,000
18	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	12,600	-2,800
19	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	2,600	300
20	BJC	BERLI JUCKER PCL	22,200	8,300
21	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PCL	1,500	100
22	BLAND	BANGKOK LAND PCL	3,000	-500
23	BPP	BANPU POWER PCL	600	200
24	BSRC	BANGCHAK SRIRACHA PCL	1,700	400
25	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	65,600	28,200
26	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL	1,300	-100
27	CHG	CHULARAT HOSPITAL PCL	28,200	-2,200
28	CK	CH. KARNCHANG PCL	2,600	600
29	CKP	CK POWER PCL	7,600	200
30	COM7	COM7 PCL	7,000	-100
31	CPALL	CP ALL PCL	25,000	2,200
32	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	5,400	-400
33	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	21,600	200
34	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	8,000	-200
35	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	13,200	300
36	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	10,200	700
37	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	800	400
38	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PCL	2,400	-800
39	ERW	THE ERAWAN GROUP PCL	7,300	-1,400
40	GFPT	GFPT PCL	2,500	400
41	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	4,000	400

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไป จากเดือนมีนาคม
42	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	6,000	-1,000
43	GULF	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	9,900	-600
44	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PCL	12,800	-3,100
45	HANA	HANA MICROELECTRONICS PCL	6,000	1,400
46	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PCL	20,400	-1,000
47	ICHI	ICHITAN GROUP PCL	4,000	300
48	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PCL	6,400	-300
49	IRPC	IRPC PCL	30,500	2,600
50	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL	30,400	10,600
51	IVL	INDORAMA VENTURES PCL	29,800	4,200
52	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PCL	19,400	-14,600
53	JMT	JMT NETWORK SERVICES PCL	10,800	-1,300
54	KBANK	KASIKORNBANK PCL	22,400	-1,100
55	KCE	KCE ELECTRONICS PCL	8,600	-300
56	KEX	KERRY EXPRESS (THAILAND) PCL	7,200	-1,500
57	KKP	KIATNAKIN BANK PCL	4,000	400
58	KTB	KRUNG THAI BANK PCL	127,100	15,600
59	KTC	KRUNGTHAI CARD PCL	5,900	-600
60	LH	LAND AND HOUSES PCL	92,600	35,200
61	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PCL	1,000	300
62	M	MK RESTAURANT GROUP PCL	600	100
63	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	4,300	1,500
64	MBK	MBK PCL	3,000	2,200
65	MINT	MINOR INTERNATIONAL PCL	14,900	-1,300
66	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PCL	3,600	-400
67	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PCL	11,300	-700
68	ORI	ORIGIN PROPERTY PCL	11,600	2,900
69	OSP	OSOTSPA PCL	6,600	2,100
70	PRM	PRIMA MARINE PCL	11,200	2,000
71	PSL	PRECIOUS SHIPPING PCL	10,700	-3,500

NB

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไป จากเดือนมีนาคม
72	PTG	PTG ENERGY PCL	3,700	100
73	PTT	PTT PCL	57,400	-400
74	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	11,700	-1,200
75	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	14,500	-1,600
76	QH	QUALITY HOUSES PCL	29,600	7,700
77	RATCH	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL	6,100	-2,800
78	RS	RS PCL	700	100
79	S	SINGHA ESTATE PCL	2,800	-1,100
80	SAMART	SAMART CORPORATION PCL	1,900	600
81	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PCL	6,600	-300
82	SCB	SCBX PCL	18,400	900
83	SCC	THE SIAM CEMENT PCL	3,000	200
84	SCGP	SCG PACKAGING PCL	9,000	600
85	SIRI	SANSIRI PCL	100,700	38,800
86	SPALI	SUPALAI PCL	5,300	-900
87	SPCG	SPCG PCL	400	200
88	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PCL	21,000	2,700
89	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL	14,000	8,000
90	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	3,000	100
91	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PCL	4,200	1,000
92	STPI	STP&I PCL	500	-100
93	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PCL	41,800	26,300
94	TASCO	TIPCO ASPHALT PCL	3,900	-700
95	TCAP	THANACHART CAPITAL PCL	2,400	600
96	THANI	RATCHTHANI LEASING PCL	13,400	1,900
97	THCOM	THAICOM PCL	5,100	1,700
98	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	7,100	100
99	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL	6,200	1,800
100	TTB	TMBTHANACHART BANK PCL	393,500	-113,000
101	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PCL	600	100

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไป จากเดือนมีนาคม
102	TOP	THAI OIL PCL	18,500	2,500
103	TPIPL	TPI POLENE PCL	3,000	700
104	TQM	TQM CORPORATION PCL	600	200
105	TRUE	TRUE CORPORATION PCL	79,900	7,600
106	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PCL	12,300	-3,300
107	TTW	TTW PCL	2,400	-500
108	TU	THAI UNION GROUP PCL	32,900	-3,800
109	TVO	THAI VEGETABLE OIL PCL	200	100
110	VGI	VGI GLOBAL MEDIA PCL	54,900	20,700
111	WHA	WHA CORPORATION PCL	32,400	-3,900
112	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PCL	3,100	200

15. การกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures เทียบกับเงินกองทุนของบริษัท (คำนวณล่าสุด โดย ฝ่ายบัญชีการเงิน) ที่ยอมรับได้ อยู่ที่ 497 ล้านบาท
16. การกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures รวมกับสถานะเงินให้กู้ยืมเงิน (Margin Loan) ที่มีหุ้นสามัญนั้นรองรับอยู่ ที่ยอมรับได้ 5 เท่า ของ room (room อิงตาม Class ของหุ้น บน Volume 60/20)

ประกาศนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 เมษายน 2567 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 26 มีนาคม พ.ศ. 2567



(นายณัฐชัย บุญยะประสงค์)

ผู้ช่วยกรรมการผู้อำนวยการ