

ประกาศ MR 06/2568

เรื่อง จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit)

ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อ้างอิง คำสั่งบริษัท ที่ 59/2558 เรื่อง มาตรการในการดูแลเรื่องการกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ถูกค่าของบริษัทถือครอง (Position Concentration) และ นโยบายบริหารความเสี่ยงและวิธีปฏิบัติในการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ในบัญชีประเภท DERIATIVE ACCOUNT และการทำธุรกรรม SSF BLOCK TRADE

เพื่อให้การปฏิบัติงานเกี่ยวกับการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) สามารถดำเนินการได้อย่างมีประสิทธิภาพ มีกระบวนการควบคุมความเสี่ยงที่ดี โดยอาศัยคำสั่งบริษัท ที่ 59/2558 และเพื่อให้ลูกค้าของบริษัทฯ ทราบและสามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขหรือข้อกำหนดของ บริษัทฯ ได้ตามสัญญาแต่งตั้งตัวแทนซื้อขายล่วงหน้า บริษัทฯ จึงขอแจ้ง “จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ในตลาด สัญญาซื้อขายล่วงหน้า” ดังต่อไปนี้

- 1. ยกเลิกประกาศ MR 05/2568 ของวันที่ 27 มีนาคม 2568
- 2. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนพฤษภาคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	18,157

- 3. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Currency Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนพฤษภาคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	USD/THB Exchange Rate	USD Futures	5,581
2	EUR/USD Exchange Rate	EURUSD	299
3	USD/JPY Exchange Rate	USDJPY	1,019
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 ของเดือนพฤษภาคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	96.5% pure gold bars	50 Baht Gold Futures (GF50 Futures)	20
2	96.5% pure gold bars	10 Baht Gold Futures (G10 Futures)	841

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	3,215

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with purity of 99.99%	Silver Online Futures	253

7. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold-D เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนพฤษภาคม 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 ของเดือนพฤษภาคม 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 ของเดือนพฤษภาคม 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), ENERG (ดัชนีหมวดธุรกิจพลังงาน), FOOD (ดัชนีหมวดธุรกิจอาหารและเครื่องดื่ม), COMM (ดัชนีหมวดธุรกิจพาณิชย์) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนพฤษภาคม 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 ของเดือนพฤษภาคม 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 ของเดือนพฤษภาคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3)	Japanese Rubber Futures	24

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนพฤษภาคม 2568 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนเมษายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจากเดือนเมษายน
1	BAY	BANK OF AYUDHYA PCL	300	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	GULF	GULF DEVELOPMENT PCL	5,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
4	HANA	HANA MICROELECTRONICS PCL	5,600	ไม่เปลี่ยนแปลง

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนเมษายน
5	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	1,100	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PCL	900	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	PSL	PRECIOUS SHIPPING PCL	5,100	ไม่เปลี่ยนแปลง
9	PTG	PTG ENERGY PCL	1,400	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	45,100	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	RS	RS PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	SPCG	SPCG PCL	400	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
14	THAI	THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
15	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
16	TOP	THAI OIL PCL	22,300	ไม่เปลี่ยนแปลง
17	TQM	TQM CORPORATION PCL	900	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 เกณฑ์บริษัท ๆ ของ เดือนพฤษภาคม 2568 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนเมษายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนเมษายน
1	AAV	ASIA AVIATION PCL	27,500	7,100
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	12,200	-2,000
3	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL	300	100
4	AMATA	AMATA CORPORATION PCL	18,300	10,500
5	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	37,600	1,200
6	AP	AP (THAILAND) PCL	22,400	2,400
7	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	32,900	6,800
8	BA	BANGKOK AIRWAYS PCL	2,700	100
9	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL	9,000	-800
10	BANPU	BANPU PCL	37,500	-8,300

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนเมษายน
11	BBL	BANGKOK BANK PCL	18,000	1,400
12	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL	2,500	-800
13	BCP	BANGCHAK CORPORATION PCL	14,900	-3,300
14	BCPG	BCPG PCL	9,300	-2,100
15	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	39,700	-4,600
16	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PCL	2,500	-100
17	BEC	BEC WORLD PCL	100	-100
18	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	37,000	-1,100
19	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	16,100	-1,000
20	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	3,400	-700
21	BJC	BERLI JUCKER PCL	5,500	800
22	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PCL	2,300	400
23	BLAND	BANGKOK LAND PCL	4,800	-400
24	BPP	BANPU POWER PCL	2,200	500
25	BSRC	BANGCHAK SRIRACHA PCL	1,400	-200
26	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	55,200	-6,200
27	CBG	CARABAO GROUP PCL	3,400	-100
28	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL	2,000	-200
29	CHG	CHULARAT HOSPITAL PCL	22,000	-800
30	CK	CH. KARNCHANG PCL	1,800	-200
31	CKP	CK POWER PCL	4,200	400
32	COM7	COM7 PCL	9,400	-1,500
33	CPALL	CP ALL PCL	39,200	-5,100
34	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	5,100	200
35	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	31,800	7,400
36	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	7,900	-1,000
37	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	25,500	1,100
38	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	500	-300
39	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	1,700	200

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนเมษายน
40	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PCL	2,400	500
41	ERW	THE ERAWAN GROUP PCL	13,800	-1,300
42	GFPT	GFPT PCL	3,500	500
43	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	8,400	-700
44	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	10,000	-800
45	GULFI	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	27,900	4,500
46	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PCL	8,000	-200
47	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PCL	36,100	5,300
48	ICHI	ICHITAN GROUP PCL	2,900	500
49	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PCL	18,900	-1,800
50	IRPC	IRPC PCL	27,600	-2,500
51	IVL	INDORAMA VENTURES PCL	26,200	-3,100
52	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PCL	30,100	10,400
53	JMT	JMT NETWORK SERVICES PCL	6,300	-1,700
54	KBANK	KASIKORNBANK PCL	23,700	1,200
55	KCE	KCE ELECTRONICS PCL	9,000	100
56	KEX	KERRY EXPRESS (THAILAND) PCL	13,000	4,000
57	KKP	KIATNAKIN BANK PCL	5,100	400
58	KTB	KRUNG THAI BANK PCL	120,100	10,600
59	KTC	KRUNGTHAI CARD PCL	8,200	-1,100
60	LH	LAND AND HOUSES PCL	64,800	-4,800
61	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PCL	2,300	-300
62	M	MK RESTAURANT GROUP PCL	2,100	-100
63	MBK	MBK PCL	1,200	-300
64	MINT	MINOR INTERNATIONAL PCL	15,700	-3,500
65	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PCL	3,800	500
66	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PCL	24,000	6,000
67	ORI	ORIGIN PROPERTY PCL	11,300	2,900
68	OSP	OSOTSPA PCL	7,400	-700
69	PLANB	PLAN B MEDIA PCL	10,900	-800

NB

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนเมษายน
70	PRM	PRIMA MARINE PCL	10,300	1,800
71	PSH	PRUKSA HOLDING PCL	1,700	-400
72	PTT	PTT PCL	69,400	-4,700
73	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	14,500	1,100
74	QH	QUALITY HOUSES PCL	24,500	3,900
75	RATCH	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL	4,400	-400
76	S	SINGHA ESTATE PCL	700	-300
77	SAMART	SAMART CORPORATION PCL	2,000	400
78	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PCL	7,100	-200
79	SCB	SCBX PCL	21,200	4,800
80	SCC	THE SIAM CEMENT PCL	6,200	-500
81	SCGP	SCG PACKAGING PCL	16,600	-2,300
82	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL	0	-100
83	SIRI	SANSIRI PCL	49,600	3,400
84	SPALI	SUPALAI PCL	7,000	300
85	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PCL	11,200	-2,100
86	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL	5,900	-200
87	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	6,600	700
88	STECON	STECON GROUP PCL	6,600	700
89	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PCL	2,700	300
90	STPI	STP&I PCL	1,200	100
91	TASCO	TIPCO ASPHALT PCL	3,100	-900
92	TCAP	THANACHART CAPITAL PCL	2,100	300
93	THANI	RATCHTHANI LEASING PCL	11,500	200
94	THCOM	THAICOM PCL	3,600	1,700
95	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	9,500	1,800
96	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL	800	-300
97	TTB	TMBTHANACHART BANK PCL	655,900	20,300
98	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PCL	2,400	400

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนเมษายน
99	TPIPL	TPI POLENE PCL	5,200	-1,100
100	TPIPP	TPI POLENE POWER PCL	2,200	-200
101	TRUE	TRUE CORPORATION PCL	78,600	-13,900
102	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PCL	4,400	-500
103	TTCL	TTCL PCL	300	100
104	TTW	TTW PCL	1,900	-100
105	TU	THAI UNION GROUP PCL	18,000	-1,600
106	TVO	THAI VEGETABLE OIL PCL	400	100
107	VGI	VGI GLOBAL MEDIA PCL	67,600	4,900
108	WHA	WHA CORPORATION PCL	94,300	19,000
109	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PCL	3,500	-1,000

15. การกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures เทียบกับเงินกองทุนของบริษัท (คำนวณล่าสุด โดย ฝ่ายบัญชีการเงิน) ที่ยอมรับได้ อยู่ที่ 487.8 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 พฤษภาคม 2568 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 28 เมษายน พ.ศ. 2568



(นายณัฐชัย บุญยะประกาศร์)

รองกรรมการผู้อำนวยการ