

ประกาศ MR 11/2568

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 และเพื่อให้ลูกค่าของบริษัทฯ ทราบและสามารถปฏิบัติตามเงื่อนไขหรือข้อกำหนดของ บริษัทฯ ได้ตามสัญญาแต่งตั้งตัวแทนซื้อขายล่วงหน้า บริษัทฯ จึงขอแจ้ง “จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ในตลาด สัญญาซื้อขายล่วงหน้า” ดังต่อไปนี้

- 1. ยกเลิกประกาศ MR 10/2568 ของวันที่ 30 กรกฎาคม 2568
- 2. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกันยายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	20,476

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	USD/THB Exchange Rate	USD Futures	6,277
2	EUR/USD Exchange Rate	EURUSD	276
3	USD/JPY Exchange Rate	USDJPY	970
4	EUR/THB Exchange Rate	EUR	10,000
5	JPY/THB Exchange Rate	JPY	10,000

4. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าอ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 96.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกันยายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	96.5% pure gold bars	50 Baht Gold Futures (GF50 Futures)	21
2	96.5% pure gold bars	10 Baht Gold Futures (G10 Futures)	797

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	2,743

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with purity of 99.99%	Silver Online Futures	353

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3)	Japanese Rubber Futures	14

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนกันยายน 2568 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนสิงหาคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจากเดือนสิงหาคม
1	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL	300	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL	8,300	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
4	GUNKUL	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	11,100	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	ITD	INTOUCH HOLDINGS PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	MBK	MK RESTAURANT GROUP PCL	1,400	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	MEGA	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	1,100	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	RS	QUALITY HOUSES PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนสิงหาคม
9	SGP	THE SIAM CEMENT PCL	100	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	SUPER	STECON GROUP PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	TASCO	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PCL	2,500	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	THG	THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	TKN	THAICOM PCL	1,500	ไม่เปลี่ยนแปลง
14	TQM	THAI OIL PCL	200	ไม่เปลี่ยนแปลง
15	TTA	TPI POLENE POWER PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
16	UNIQ	TTW PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
17	VNG	THAI VEGETABLE OIL PCL	100	ไม่เปลี่ยนแปลง

14. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัท
ฯ ของ เดือนกันยายน 2568 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนเมษายน 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนสิงหาคม
1	AAV	ASIA AVIATION PCL	47,900	11,200
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	11,300	-1,300
3	AMATA	AMATA CORPORATION PCL	19,300	2,500
4	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	39,200	-7,900
5	AP	AP (THAILAND) PCL	13,800	-2,000
6	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	38,400	400
7	BA	BANGKOK AIRWAYS PCL	4,600	1,500
8	BANPU	BANPU PCL	38,300	6,600
9	BAY	BANK OF AYUDHYA PCL	300	100
10	BBL	BANGKOK BANK PCL	16,800	2,100
11	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL	3,300	400
12	BCP	BANGCHAK CORPORATION PCL	9,100	-1,000
13	BCPG	BCPG PCL	10,600	3,000
14	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	57,300	16,300
15	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PCL	7,500	2,000
16	BEC	BEC WORLD PCL	17,800	-2,000

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนสิงหาคม
17	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	41,700	-9,700
18	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	18,900	3,800
19	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	5,100	1,500
20	BJC	BERLI JUCKER PCL	6,600	1,400
21	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PCL	4,000	1,000
22	BLAND	BANGKOK LAND PCL	5,400	200
23	BPP	BANPU POWER PCL	3,100	900
24	BSRC	BANGCHAK SRIRACHA PCL	600	-100
25	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	100,400	13,300
26	CBG	CARABAO GROUP PCL	3,600	200
27	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL	2,100	-500
28	CHG	CHULARAT HOSPITAL PCL	17,500	-4,700
29	CK	CH. KARNCHANG PCL	1,700	-100
30	CKP	CK POWER PCL	7,000	1,500
31	COM7	COM7 PCL	10,100	1,100
32	CPALL	CP ALL PCL	35,800	700
33	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	39,800	-1,700
34	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	9,400	-1,200
35	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	11,100	-2,000
36	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	17,100	-4,200
37	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	1,100	-100
38	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	1,400	200
39	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PCL	2,700	500
40	ERW	THE ERAWAN GROUP PCL	16,100	3,000
41	GFPT	GFPT PCL	2,800	200
42	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	18,900	-800
43	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	7,900	1,600
44	GULF	GULF DEVELOPMENT PCL	28,500	-3,500
45	HANA	GUNKUL ENGINEERING PCL	10,500	2,800

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนสิงหาคม
46	HMPRO	HANA MICROELECTRONICS PCL	20,000	-25,600
47	ICHI	HOME PRODUCT CENTER PCL	8,800	2,900
48	IRPC	ICHITAN GROUP PCL	20,000	-3,400
49	IVL	IRPC PCL	28,900	4,500
50	JAS	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL	52,800	-5,600
51	JMT	INDORAMA VENTURES PCL	11,800	1,400
52	KBANK	JASMINE INTERNATIONAL PCL	24,500	800
53	KCE	JMT NETWORK SERVICES PCL	17,500	1,300
54	KEX	KASIKORNBANK PCL	2,500	-1,900
55	KKP	KCE ELECTRONICS PCL	4,000	-400
56	KTB	KERRY EXPRESS (THAILAND) PCL	35,000	-58,900
57	KTC	KIATNAKIN BANK PCL	20,000	-5,800
58	LH	KRUNG THAI BANK PCL	57,200	1,600
59	LPN	KRUNGTHAI CARD PCL	400	100
60	M	LAND AND HOUSES PCL	4,900	1,000
61	MAJOR	L.P.N. DEVELOPMENT PCL	3,700	500
62	MINT	MBK PCL	17,600	-900
63	MTC	MEGA LIFESCIENCES PCL	4,200	800
64	OR	MINOR INTERNATIONAL PCL	24,600	5,300
65	ORI	MUANGTHAI CAPITAL PCL	11,800	5,400
66	OSP	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PCL	5,100	-500
67	PLANB	ORIGIN PROPERTY PCL	17,800	1,300
68	PRM	OSOTSPA PCL	7,900	-600
69	PSH	PLAN B MEDIA PCL	700	-100
70	PSL	PRIMA MARINE PCL	2,800	-300
71	PTG	PRUKSA HOLDING PCL	3,900	800
72	PTT	PRECIOUS SHIPPING PCL	20,000	-44,700
73	PTTEP	PTG ENERGY PCL	15,900	-800
74	PTTGC	PTT PCL	48,900	10,800
75	QH	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	23,100	1,100

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนสิงหาคม
76	RATCH	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	4,900	700
77	S	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL	1,300	500
78	SAMART	RS PCL	400	-400
79	SAWAD	SINGHA ESTATE PCL	24,500	4,500
80	SCB	SAMART CORPORATION PCL	19,400	-500
81	SCC	SRISAWAD CORPORATION PCL	6,400	-100
82	SCGP	SCBX PCL	15,300	1,300
83	SIRI	SCG PACKAGING PCL	42,900	1,500
84	SPALI	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL	6,600	-200
85	SPCG	SANSIRI PCL	300	100
86	SPRC	SUPALAI PCL	19,400	6,200
87	STA	SPCG PCL	5,500	1,500
88	STECON	STAR PETROLEUM REFINING PCL	2,800	-300
89	STGT	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL	2,100	100
90	STPI	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	0	-3,400
91	TCAP	STP&I PCL	2,200	200
92	THAI	SUPER ENERGY CORPORATION PCL	54,400	54,400
93	THANI	TIPCO ASPHALT PCL	16,500	7,200
94	THCOM	THANACHART CAPITAL PCL	2,100	200
95	TISCO	RATCHTHANI LEASING PCL	6,500	200
96	TOA	THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL	1,200	200
97	TOP	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	20,000	-2,300
98	TPIPL	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL	8,300	3,500
99	TPIPP	TOA PAINT (THAILAND) PCL	2,300	1,000
100	TRUE	TPI POLENE PCL	104,900	10,600
101	TTB	TQM CORPORATION PCL	20,000	-602,500
102	TTCL	TRUE CORPORATION PCL	500	100
103	TTW	THORESEN THAI AGENCIES PCL	1,600	100
104	TU	TMBTHANACHART BANK PCL	25,200	2,000

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนสิงหาคม
105	TVO	TTCL PCL	400	100
106	VGI	THAI UNION GROUP PCL	23,100	-1,200
107	WHA	UNIQUE ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	20,000	-43,500
108	WHAUP	VGI GLOBAL MEDIA PCL	2,600	500

15. การกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures เทียบกับเงินกองทุนของบริษัท (คำนวณล่าสุด โดย ฝ่ายบัญชีการเงิน) ที่ยอมรับได้ อยู่ที่ 491 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 กันยายน 2568 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 สิงหาคม พ.ศ. 2568



(นายณัฐชัย บุณยะประภัสร์)

รองกรรมการผู้อำนวยการ