

ประกาศ MR 17/2568

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 16/2568 ของวันที่ 28 พฤศจิกายน 2568
- 2. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมกราคม 2569 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานะรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	19,102

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

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	USD/THB Exchange Rate	USD Futures	9,288
2	USD/THB Exchange Rate	USD/THB Options	614
3	EUR/USD Exchange Rate	EURUSD	215
4	USD/JPY Exchange Rate	USDJPY	784
5	EUR/THB Exchange Rate	EUR	1,286
5	JPY/THB Exchange Rate	JPY	2,383

4. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 96.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมกราคม 2569 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	96.5% pure gold bars	50 Baht Gold Futures (GF50 Futures)	30
2	96.5% pure gold bars	10 Baht Gold Futures (G10 Futures)	860

5. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Online Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 99.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมกราคม 2569 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	3,374

6. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Silver Online Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับโลหะเงินที่มีความบริสุทธิ์ 99.9%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมกราคม 2569 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with purity of 99.99%	Silver Online Futures	1,787

7. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold-D เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมกราคม 2569 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 ของเดือนมกราคม 2569 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 Sector Index Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับหมวดดัชนีธุรกิจ) ได้แก่ BANK (ดัชนีหมวดธุรกิจธนาคาร), ICT (ดัชนีหมวดธุรกิจเทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร), ENER (ดัชนีหมวดธุรกิจพลังงาน), FOOD (ดัชนีหมวดธุรกิจอาหารและเครื่องดื่ม), COMM (ดัชนีหมวดธุรกิจพาณิชย์) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมกราคม 2569 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Sector Index	จำนวนฐานรวมสุทธิในสัญญา Sector Futures ห้ามเกิน Position Limit ตามเกณฑ์บริษัทฯ	4,000

10. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ RSS3 (ยางแผ่นรมควันชั้น 3) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมกราคม 2569 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

11. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Japanese Rubber Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับยางแผ่นรมควันชั้น 3 ที่ซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเทศญี่ปุ่น) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนมกราคม 2569 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3)	Japanese Rubber Futures	16

12. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนมกราคม 2569 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนธันวาคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจากเดือนธันวาคม
1	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	BAY	BANK OF AYUDHYA PCL	300	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	BSRC	BANGCHAK SRIRACHA PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
4	EA	ENERGY ABSOLUTE PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PCL	300	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PCL	600	ไม่เปลี่ยนแปลง

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนธันวาคม
9	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PCL	3,100	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	PLANB	PLAN B MEDIA PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PCL	10,400	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	RS	RS PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	SAMART	SAMART CORPORATION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
14	SPCG	SPCG PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
15	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
16	THAI	THAI AIRWAYS INTERNATIONAL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
17	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
18	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PCL	1,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
19	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
20	TTCL	TTCL PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
21	UNIQ	UNIQUE ENGINEERING AND CONSTRUCTION PCL	0	ไม่เปลี่ยนแปลง
22	VNG	VANACHAI GROUP PCL	100	ไม่เปลี่ยนแปลง
23	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PCL	6,500	ไม่เปลี่ยนแปลง

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัท ๆ ของ เดือนมกราคม 2569 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนธันวาคม 2568 เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนธันวาคม
1	AAV	ASIA AVIATION PCL	32,300	2,900
2	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PCL	9,700	-1,200
3	AMATA	AMATA CORPORATION PCL	10,800	-300
4	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PCL	34,100	8,700
5	AP	AP (THAILAND) PCL	10,900	-4,300
6	AWC	ASSET WORLD CORP PCL	42,300	17,900
7	BA	BANGKOK AIRWAYS PCL	3,400	-600
8	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL	12,000	-2,100
9	BANPU	BANPU PCL	73,000	7,300
10	BBL	BANGKOK BANK PCL	14,300	1,600
11	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PCL	4,400	500
12	BCP	BANGCHAK CORPORATION PCL	12,400	4,300
13	BCPG	BCPG PCL	9,600	-500
14	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	62,200	-2,300

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนธันวาคม
15	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PCL	7,600	-6,300
16	BEC	BEC WORLD PCL	500	-400
17	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PCL	21,800	-7,000
18	BGRIM	B.GRIMM POWER PCL	12,500	-4,000
19	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL	2,800	-100
20	BJC	BERLI JUCKER PCL	6,400	-400
21	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PCL	2,700	-400
22	BLAND	BANGKOK LAND PCL	1,700	-500
23	BPP	BANPU POWER PCL	6,500	-300
24	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PCL	56,100	-15,300
25	CBG	CARABAO GROUP PCL	3,400	-800
26	CENTEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PCL	1,600	-100
27	CHG	CHULARAT HOSPITAL PCL	10,100	-2,100
28	CK	CH. KARNCHANG PCL	3,400	-600
29	CKP	CK POWER PCL	9,000	-1,600
30	COM7	COM7 PCL	9,300	-1,900
31	CPALL	CP ALL PCL	20,200	-3,700
32	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	25,800	-600
33	CPN	CENTRAL PATTANA PCL	5,600	-300
34	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PCL	6,100	-500
35	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PCL	11,400	300
36	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	0	-1,000
37	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PCL	2,900	-300
38	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PCL	1,100	-500
39	ERW	THE ERAWAN GROUP PCL	6,600	-1,300
40	GFPT	GFPT PCL	1,700	-500
41	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PCL	11,900	-2,100
42	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PCL	6,300	-600
43	GULF	GULF DEVELOPMENT PCL	19,400	-400
44	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PCL	8,800	-3,600
45	HANA	HANA MICROELECTRONICS PCL	6,800	-1,800
46	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PCL	32,300	-2,400
47	ICHI	ICHITAN GROUP PCL	4,700	-1,400
48	IRPC	IRPC PCL	40,800	-19,300

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนธันวาคม
49	IVL	INDORAMA VENTURES PCL	33,000	3,500
50	JMT	JMT NETWORK SERVICES PCL	3,700	-1,100
51	KBANK	KASIKORNBANK PCL	20,600	-1,200
52	KCE	KCE ELECTRONICS PCL	9,900	-2,300
53	KKP	KIATNAKIN PHATRA BANK PCL	4,800	-400
54	KTB	KRUNG THAI BANK PCL	84,800	-4,100
55	KTC	KRUNGTHAI CARD PCL	12,400	-3,700
56	LH	LAND AND HOUSES PCL	59,600	11,600
57	M	MK RESTAURANT GROUP PCL	3,800	-900
58	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PCL	4,200	800
59	MBK	MBK PCL	1,000	100
60	MINT	MINOR INTERNATIONAL PCL	21,400	3,800
61	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PCL	15,400	-4,300
62	ORI	ORIGIN PROPERTY PCL	3,700	-4,100
63	OSP	OSOTSPA PCL	3,400	-700
64	PRM	PRIMA MARINE PCL	3,200	-1,200
65	PSH	PRUKSA HOLDING PCL	700	-300
66	PSL	PRECIOUS SHIPPING PCL	2,600	-100
67	PTG	PTG ENERGY PCL	3,500	-1,100
68	PTT	PTT PCL	64,500	-1,000
69	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL	39,700	-3,200
70	QH	QUALITY HOUSES PCL	37,100	-4,400
71	RATCH	RATCH GROUP PCL	4,900	-400
72	S	SINGHA ESTATE PCL	600	-600
73	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PCL	8,600	-800
74	SCB	SCB X PCL	20,100	1,300
75	SCC	THE SIAM CEMENT PCL	4,200	100
76	SCGP	SCG PACKAGING PCL	7,900	-1,700
77	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PCL	100	100
78	SIRI	SANSIRI PCL	70,000	23,300
79	SPALI	SUPALAI PCL	4,300	-1,000
80	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PCL	23,900	-5,700
81	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PCL	1,900	-400
82	STECON	STECON GROUP PCL	3,800	-2,700
83	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PCL	1,400	100

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจาก เดือนธันวาคม
84	STPI	STP&I PCL	4,400	-3,100
85	TASCO	TIPCO ASPHALT PCL	1,800	-600
86	TCAP	THANACHART CAPITAL PCL	3,600	1,300
87	THANI	RATCHTHANI LEASING PCL	9,300	-5,200
88	THCOM	THAICOM PCL	900	-500
89	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PCL	7,200	100
90	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PCL	2,100	-300
91	TOP	THAI OIL PCL	19,500	-2,800
92	TPIPL	TPI POLENE PCL	3,200	-6,500
93	TPIPP	TPI POLENE POWER PCL	3,900	-500
94	TQM	TQM ALPHA PCL	600	200
95	TRUE	TRUE CORPORATION PCL	89,600	-7,600
96	TTB	TMBTHANACHART BANK PCL	837,100	67,600
97	TTW	TTW PCL	1,600	-400
98	TU	THAI UNION GROUP PCL	27,500	-3,900
99	TVO	THAI VEGETABLE OIL PCL	500	200
100	VGI	VGI PCL	31,900	6,700
101	WHA	WHA CORPORATION PCL	32,100	-3,600

14. การกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures เทียบกับเงินกองทุนของบริษัท (คำนวณล่าสุด โดย ฝ่ายบัญชีการเงิน) ที่ยอมรับได้ อยู่ที่ 488 ล้านบาท
15. การกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าของ Single Stock Futures รวมกับสถานะเงินให้กู้ยืมเงิน (Margin Loan) ที่มีหุ้นสามัญนั้นรองรับอยู่ ที่ยอมรับได้ 5 เท่า ของ room (room อิงตาม Class ของหุ้น บน Volume 60/20)

ประกาศนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 มกราคม 2569 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 25 ธันวาคม พ.ศ. 2568



(นายณัฐชัย บุญยะประกาศ)

รองกรรมการผู้อำนวยการ