

ประกาศ MR 10/2564

เรื่อง จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit)

ในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

อ้างอิง คำสั่งบริษัท ที่ 59/2558 เรื่อง มาตรการในการดูแลเรื่องการกระจุกตัวของฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าที่ถูกค้ำของบริษัถือครอง (Position Concentration)

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

1. ยกเลิกประกาศ MR 09/2564 ของวันที่ 29 กรกฎาคม 2564
2. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ที่อ้างอิงกับดัชนี SET50 Index ได้แก่ SET50 Index Futures และ SET50 Index Options เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกันยายน 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	SET50 Index	จำนวนฐานะรวมสุทธิในสัญญา SET50 Index Futures และ SET50 Index Options	14,820

3. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ USD Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยนเงินบาทต่อเงินดอลลาร์สหรัฐ) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกันยายน 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Baht/USD Exchange Rate	USD Futures	3,333

4. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 96.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกันยายน 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	คำอธิบาย	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	96.5% pure gold bars	50 Baht Gold Futures (GF50 Futures)	65
2	96.5% pure gold bars	10 Baht Gold Futures (G10 Futures)	1,254

5. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold Online Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับทองคำแท่งที่มีความบริสุทธิ์ 99.5%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกันยายน 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	99.5% pure gold bars	Gold Online Futures	2,639

6. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Silver Online Futures (สัญญาซื้อขายล่วงหน้าฟิวเจอร์สที่อ้างอิงกับโลหะเงินที่มีความบริสุทธิ์ 99.9%) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกันยายน 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	Silver with putiry of 99.99%	Silver Online Futures	286

7. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Gold-D เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกันยายน 2564 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 2564 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 2564 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 2564 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 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	RSS3D (Natural Rubber Ribbed Smoked Sheet No. 3) (Physical Delivery)	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 ที่ซื้อขายในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าประเทศไทย) เกณฑ์บริษัทฯ ของเดือนกันยายน 2564 เป็นดังนี้

อันดับ	สินค้าอ้างอิง	ชื่อ	Position Limit (จำนวนสัญญา)
1	JRSS3 (Japanese Natural Ribbed Smoke Sheet No. 3)	Japanese Rubber Futures	21

13. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือนกันยายน 2564 กลุ่มที่ไม่เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนสิงหาคม เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจากเดือนสิงหาคม
1	AAV	ASIA AVIATION PUBLIC COMPANY LIMITED	19,400	ไม่เปลี่ยนแปลง
2	BANPU	BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED	20,280	ไม่เปลี่ยนแปลง
3	BCH	BANGKOK CHAIN HOSPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	9,960	ไม่เปลี่ยนแปลง
4	BEAUTY	BEAUTY COMMUNITY PUBLIC COMPANY LIMITED	4,816	ไม่เปลี่ยนแปลง
5	BEC	BEC WORLD PUBLIC COMPANY LIMITED	8,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
6	CHG	CHULARAT HOSPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	44,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
7	EGCO	ELECTRICITY GENERATING PUBLIC COMPANY LIMITED	1,500	ไม่เปลี่ยนแปลง
8	GUNKUL	GUNKUL ENGINEERING PUBLIC COMPANY LIMITED	35,520	ไม่เปลี่ยนแปลง
9	ITD	ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	8,448	ไม่เปลี่ยนแปลง
10	KBANK	KASIKORNBANK PUBLIC COMPANY LIMITED	18,960	ไม่เปลี่ยนแปลง
11	KCE	KCE ELECTRONICS PUBLIC COMPANY LIMITED	16,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
12	PSL	PRECIOUS SHIPPING PUBLIC COMPANY LIMITED	8,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
13	PTG	PTG ENERGY PUBLIC COMPANY LIMITED	8,000	ไม่เปลี่ยนแปลง
14	RATCH	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PUBLIC CO.,LTD.	7,300	ไม่เปลี่ยนแปลง
15	SIRI	SANSIRI PUBLIC COMPANY LIMITED	23,776	ไม่เปลี่ยนแปลง
16	SUPER	SUPER ENERGY CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	109,400	ไม่เปลี่ยนแปลง
17	THCOM	THAICOM PUBLIC COMPANY LIMITED	3,200	ไม่เปลี่ยนแปลง
18	TTA	THORESEN THAI AGENCIES PUBLIC COMPANY LIMITED	3,200	ไม่เปลี่ยนแปลง

14. จำนวนการถือครองสัญญาซื้อขายล่วงหน้าสูงสุด (Position Limit) ของ Single Stock Futures เกณฑ์บริษัทฯ ของ เดือน กันยายน 2564 กลุ่มที่มีการเปลี่ยนแปลง ไปจากเดือนสิงหาคม เป็นดังนี้

อันดับ	หุ้นอ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวนสัญญา)	เปลี่ยนแปลงไปจากเดือนสิงหาคม
1	ADVANC	ADVANCED INFO SERVICE PUBLIC COMPANY LIMITED	6,700	1,700
2	AEONTS	AEON THANA SINSAP (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	500	-50
3	AMATA	AMATA CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	5,100	-950
4	AOT	AIRPORTS OF THAILAND PUBLIC COMPANY LIMITED	22,800	-100
5	AP	AP (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	6,850	-1,250
6	AWC	ASSET WORLD CORP PUBLIC COMPANY LIMITED	13,420	-1,920
7	BA	BANGKOK AIRWAYS PUBLIC COMPANY LIMITED	1,220	-240
8	BAM	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	9,650	1,450
9	BAY	BANK OF AYUDHYA PUBLIC COMPANY LIMITED	200	20
10	BBL	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	10,400	400
11	BCP	BANGCHAK CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	1,850	-150
12	BCPG	BCPG PUBLIC COMPANY LIMITED	6,650	1,250
13	BDMS	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PUBLIC COMPANY LIMITED	32,700	-3,800
14	BEM	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO PUBLIC COMPANY LIMITED	47,500	-1,800
15	BGRIM	B.GRIMM POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	8,500	700
16	BH	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	1,400	100
17	BJC	BERLI JUCKER PUBLIC COMPANY LIMITED	4,500	800
18	BLA	BANGKOK LIFE ASSURANCE PUBLIC COMPANY LIMITED	640	-80
19	BLAND	BANGKOK LAND PUBLIC COMPANY LIMITED	4,300	-1,740
20	BPP	BANPU POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	1,080	-80
21	BTS	BTS GROUP HOLDINGS PUBLIC COMPANY LIMITED	46,900	-3,500
22	CBG	CARABAO GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	6,600	-800

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน สิงหาคม
23	CENEL	CENTRAL PLAZA HOTEL PUBLIC COMPANY LIMITED	1,700	100
24	CK	CH. KARNCHANG PUBLIC COMPANY LIMITED	4,950	-1,350
25	CKP	CK POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	12,950	-1,400
26	COM7	COM7 PUBLIC COMPANY LIMITED	8,800	-300
27	CPALL	CP ALL PUBLIC COMPANY LIMITED	20,600	100
28	CRC	CENTRAL RETAIL CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	11,800	2,000
29	CPF	CHAROEN POKPHAND FOODS PUBLIC COMPANY LIMITED	38,600	-1,500
30	CPN	CENTRAL PATTANA PUBLIC COMPANY LIMITED	10,600	900
31	DELTA	DELTA ELECTRONICS (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	1,300	-800
32	DTAC	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PUBLIC COMPANY LIMITED	18,960	8,460
33	EA	ENERGY ABSOLUTE PUBLIC COMPANY LIMITED	12,300	-800
34	EASTW	EASTERN WATER RESOURCES DEVELOPMENT AND MANAGEMENT PCL.	440	-20
35	EPG	EASTERN POLYMER GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	4,180	120
36	ERW	THE ERAWAN GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	3,100	-80
37	ESSO	ESSO (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	7,300	-1,950
38	GFPT	GFPT PUBLIC COMPANY LIMITED	1,480	300
39	GLOBAL	SIAM GLOBAL HOUSE PUBLIC COMPANY LIMITED	13,400	1,000
40	GPSC	GLOBAL POWER SYNERGY PUBLIC COMPANY LIMITED	16,600	-200
41	GULF	GULF ENERGY DEVELOPMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	26,700	16,500
42	HANA	HANA MICROELECTRONICS PUBLIC COMPANY LIMITED	7,450	-550
43	HMPRO	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC COMPANY LIMITED	25,900	4,200
44	ICHI	ICHITAN GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	4,500	-850
45	INTUCH	INTOUCH HOLDINGS PUBLIC COMPANY LIMITED	12,600	4,900
46	IRPC	IRPC PUBLIC COMPANY LIMITED	145,800	-17,640

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน สิงหาคม
47	IVL	INDORAMA VENTURES PUBLIC COMPANY LIMITED	24,200	1,700
48	JAS	JASMINE INTERNATIONAL PUBLIC COMPANY LIMITED	29,700	-4,660
49	JMT	JMT NETWORK SERVICES PUBLIC COMPANY LIMITED	3,100	-300
50	KEX	KERRY EXPRESS (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	1,060	-340
51	KKP	KIATNAKIN BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	1,650	-350
52	KTB	KRUNG THAI BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	28,200	1,700
53	KTC	KRUNGTHAI CARD PUBLIC COMPANY LIMITED	11,400	-1,900
54	LH	LAND AND HOUSES PUBLIC COMPANY LIMITED	38,100	-4,400
55	LPN	L.P.N. DEVELOPMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	1,360	-220
56	M	MK RESTAURANT GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	220	-60
57	MAJOR	MAJOR CINEPLEX GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	4,800	900
58	MBK	MBK PUBLIC COMPANY LIMITED	480	-100
59	MEGA	MEGA LIFESCIENCES PUBLIC COMPANY LIMITED	4,050	1,700
60	MINT	MINOR INTERNATIONAL PUBLIC COMPANY LIMITED	14,800	-1,200
61	MTC	MUANGTHAI CAPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	9,800	-300
62	OR	PTT OIL AND RETAIL BUSINESS PUBLIC COMPANY LIMITED	28,800	-3,600
63	ORI	ORIGIN PROPERTY PUBLIC COMPANY LIMITED	6,600	-400
64	OSP	OSOTSPA PUBLIC COMPANY LIMITED	8,700	-1,500
65	PLANB	PLAN B MEDIA PUBLIC COMPANY LIMITED	7,350	450
66	PRM	PRIMA MARINE PUBLIC COMPANY LIMITED	5,100	-1,900
67	PSH	PRUKSA HOLDING PUBLIC COMPANY LIMITED	300	-100
68	PTT	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED	64,700	4,700
69	PTTEP	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION PUBLIC COMPANY LIMITED	8,400	-700
70	PTTGC	PTT GLOBAL CHEMICAL PUBLIC COMPANY LIMITED	25,300	-400

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน สิงหาคม
71	QH	QUALITY HOUSES PUBLIC COMPANY LIMITED	10,000	-3,150
72	RS	RS PUBLIC COMPANY LIMITED	5,550	-250
73	S	SINGHA ESTATE PUBLIC COMPANY LIMITED	1,900	-840
74	SAMART	SAMART CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	1,160	-600
75	SAWAD	SRISAWAD CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	9,600	-1,100
76	SCB	THE SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	12,700	-400
77	SCC	THE SIAM CEMENT PUBLIC COMPANY LIMITED	2,100	-200
78	SCGP	SCG PACKAGING PUBLIC COMPANY LIMITED	14,500	-4,500
79	SGP	SIAMGAS AND PETROCHEMICALS PUBLIC COMPANY LIMITED	680	-200
80	SPALI	SUPALAI PUBLIC COMPANY LIMITED	2,850	-150
81	SPCG	SPCG PUBLIC COMPANY LIMITED	400	20
82	SPRC	STAR PETROLEUM REFINING PUBLIC COMPANY LIMITED	10,650	350
83	STA	SRI TRANG AGRO-INDUSTRY PUBLIC COMPANY LIMITED	15,700	-300
84	STEC	SINO-THAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION PUBLIC CO.,LTD.	6,400	-1,250
85	STGT	SRI TRANG GLOVES (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	18,600	-4,280
86	STPI	STP&I PUBLIC COMPANY LIMITED	2,140	-1,060
87	TASCO	TIPCO ASPHALT PUBLIC COMPANY LIMITED	6,100	350
88	TCAP	THANACHART CAPITAL PUBLIC COMPANY LIMITED	2,100	-300
89	THANI	RATCHTHANI LEASING PUBLIC COMPANY LIMITED	19,700	-1,900
90	THG	THONBURI HEALTHCARE GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	480	-40
91	TISCO	TISCO FINANCIAL GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	4,600	-1,400
92	TKN	TAOKAENOI FOOD & MARKETING PUBLIC COMPANY LIMITED	3,800	-950
93	TTB	TMBTHANACHART BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	326,300	-38,800
94	TOA	TOA PAINT (THAILAND) PUBLIC COMPANY LIMITED	580	-280

อันดับ	หุ้น อ้างอิง	ชื่อบริษัท	Position Limit (จำนวน สัญญา)	เปลี่ยนแปลง ไปจากเดือน สิงหาคม
95	TOP	THAI OIL PUBLIC COMPANY LIMITED	15,300	2,400
96	TPIPL	TPI POLENE PUBLIC COMPANY LIMITED	2,340	-1,560
97	TPIPP	TPI POLENE POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	2,100	-500
98	TQM	TQM CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	300	-100
99	TRUE	TRUE CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	71,800	12,500
100	TTCL	TTCL PUBLIC COMPANY LIMITED	1,400	660
101	TTW	TTW PUBLIC COMPANY LIMITED	780	-160
102	TU	THAI UNION GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	35,100	500
103	TVO	THAI VEGETABLE OIL PUBLIC COMPANY LIMITED	1,800	-200
104	UNIQ	UNIQUE ENGINEERING AND CONSTRUCTION PUBLIC COMPANY LIMITED	680	-500
105	VGI	VGI GLOBAL MEDIA PUBLIC COMPANY LIMITED	11,850	-900
106	VNG	VANACHAI GROUP PUBLIC COMPANY LIMITED	1,020	480
107	VNT	VINYTHAI PUBLIC COMPANY LIMITED	80	-80
108	WHA	WHA CORPORATION PUBLIC COMPANY LIMITED	32,950	-9,900
109	WHAUP	WHA UTILITIES AND POWER PUBLIC COMPANY LIMITED	1,120	-340

ประกาศนี้ ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันที่ 1 กันยายน 2564 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 สิงหาคม พ.ศ. 2564



(นายณัฐชัย บุญยะประสงค์)

ผู้ช่วยกรรมการผู้อำนวยการ