

แนวทางการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

ตามหลักเกณฑ์ 710 ของข้อบังคับของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า กำหนดแนวทางการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่องในตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า นั้น เพื่อให้เกิดความชัดเจนในการปฏิบัติหน้าที่ของผู้ดูแลสภาพคล่อง ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้ากำหนดแนวทางดังต่อไปนี้

ผู้ดูแลสภาพคล่องมีหน้าที่ในการเสนอซื้อและเสนอขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าอย่างต่อเนื่อง (Continuous Basis) เพื่อให้มีราคาปรากฏอยู่ในระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าใน Series ที่ตนมีหน้าที่ตลอดช่วงระยะเวลาการซื้อขายตามเงื่อนไข ดังนี้

1. Gold Futures

Contract Month	Maximum Bid / Offer Spreads		Minimum Volume per Side	Quotation Time	
	Scheme 1	Scheme 2		Scheme 1	Scheme 2
1 st Contract	40 บาท	80 บาท	GF10 = 50 สัญญา GF50 = 10 สัญญา	60%	50%
2 nd Contract	60 บาท	120 บาท			
3 rd Contract	60 บาท	120 บาท			

2. Gold Online Futures

Contract Month	Maximum Bid / Offer Spreads		Minimum Volume per Side	Quotation Time	
	Scheme 1	Scheme 2		Scheme 1	Scheme 2
1 st Contract	1 ดอลลาร์ สรอ.	2 ดอลลาร์ สรอ.	50 สัญญา	70%	60%
2 nd Contract	1 ดอลลาร์ สรอ.	2 ดอลลาร์ สรอ.			

3. Gold-D Futures

Contract Month	Maximum Bid / Offer Spreads		Minimum Volume per Side	Quotation Time	
	Scheme 1	Scheme 2		Scheme 1	Scheme 2
1 st Contract	1 ดอลลาร์ สรอ.	2 ดอลลาร์ สรอ.	100 สัญญา	70%	60%
2 nd Contract	1 ดอลลาร์ สรอ.	2 ดอลลาร์ สรอ.			

4. Silver Online Futures

Contract Month	Maximum Bid / Offer Spreads		Minimum Volume per Side	Quotation Time	
	Scheme 1	Scheme 2		Scheme 1	Scheme 2
1 st Contract	0.1 ดอลลาร์ سرو.	0.2 ดอลลาร์ سرو.	50 สัญญา	60%	50%
2 nd Contract	0.1 ดอลลาร์ سرو.	0.2 ดอลลาร์ سرو.			

5. Single Stock Futures

Bid Price	Maximum Bid / Offer Spreads (บาท)		Minimum Volume Per Side	Quotation Time
	1 st contract month	2 nd contract month		
ราคา < 2 บาท	0.03	0.05	100 สัญญา	50%
2 บาท ≤ ราคา < 5 บาท	0.06	0.10	100 สัญญา	
5 บาท ≤ ราคา < 10 บาท	0.15	0.25	100 สัญญา	
10 บาท ≤ ราคา < 25 บาท	0.30	0.50	50 สัญญา	
25 บาท ≤ ราคา < 100 บาท	1.00	1.50	50 สัญญา	
100 บาท ≤ ราคา < 200 บาท	2.00	3.00	20 สัญญา	
200 บาท ≤ ราคา < 400 บาท	4.00	6.00	20 สัญญา	
ตั้งแต่ 400 บาทขึ้นไป	8.00	12.00	20 สัญญา	

Compulsory Stocks Requirement	Stock Lists*
Market Maker ต้องปฏิบัติหน้าที่ดูแลสภาพคล่องให้ผ่านตามเงื่อนไข โดยต้องทำหน้าที่บนรายชื่อบริษัทที่ระบุในตารางอย่างน้อย 10 หุ้น จาก 15 หุ้น	AAV, AOT, CPALL, CPF, EA, GULF, HANA, IRPC, KTB, OR, PTTGC, SAWAD, SCGP, TTB, WHA

6. SET50 Index Options

Scheme 1

Best Bid Price	Maximum Bid / Offer Spreads (Points)		Min Volume Per Side	Quotation Time
	Nearest Quarterly Month Contract	Next Quarterly Month Contract		
ราคา < 20 จุด	1.5	2.5	20 สัญญา	80%
20 จุด ≤ ราคา < 40 จุด	2.5	5.0		
40 จุด ≤ ราคา < 60 จุด	4.0	8.0		
60 จุด ≤ ราคา < 80 จุด	5.5	10.0		
80 จุด ≤ ราคา < 120 จุด	6.5	12.0		
ราคา ≥ 120 จุด	8.0	15.0		

Scheme 2

Best Bid Price	Maximum Bid / Offer Spreads (Points)		Min Volume Per Side	Quotation Time
	Nearest Quarterly Month Contract	Next Quarterly Month Contract		
ราคา < 20 จุด	2.0	3.0	20 สัญญา	70%
20 จุด ≤ ราคา < 40 จุด	3.0	6.0		
40 จุด ≤ ราคา < 60 จุด	4.5	9.0		
60 จุด ≤ ราคา < 80 จุด	6.0	12.0		
80 จุด ≤ ราคา < 120 จุด	7.5	15.0		
ราคา ≥ 120 จุด	9.0	18.0		

- ประเภทสัญญาที่ต้องปฏิบัติงานได้แก่ สัญญา Call และ Put Options เดือนสุดท้ายของไตรมาส จำนวน 2 ไตรมาสที่ใกล้ที่สุดที่เป็น **ATM 1 Series / OTM 4 Series / ITM 4 Series**
- หมายเหตุ: ATM = At-the-money, OTM = Out-of-the-money, ITM = In-the-money

7. USD Futures

Contract Month	Maximum Bid / Offer Spreads		Min Volume Per Side	Quotation Time
	Scheme 1	Scheme 2		
1 st – 4 th Contract	0.05 บาท (5 Ticks)	0.10 บาท (10 Ticks)	100 สัญญา	70%

8. EURUSD Futures

Contract Month	Maximum Bid / Offer Spreads		Min Volume Per Side	Quotation Time
	Scheme 1	Scheme 2		
1 st Contract	0.0005 ดอลลาร์ สรอ (5 Ticks)	0.0010 ดอลลาร์ สรอ (10 Ticks)	100 สัญญา	70%

9. USDJPY Futures

Contract Month	Maximum Bid / Offer Spreads		Min Volume Per Side	Quotation Time
	Scheme 1	Scheme 2		
1 st Contract	0.05 เยน (5 Ticks)	0.10 เยน (10 Ticks)	100 สัญญา	70%

10. RSS3D Futures

Scheme	Contract Months	Maximum Bid / Offer Spreads	Min Volume Per Side	Quotation Time
1	1 st – 6 th Contract	1 บาท (20 Ticks)	2 สัญญา	60%
2	7 th Contract	0.50 บาท (10 Ticks)	2 สัญญา	60%

11. Japanese Rubber Futures

Contract Months	Maximum Bid / Offer Spreads		Min Volume Per Side	Quotation Time
	Scheme 1	Scheme 2		
2 nd - 4 th contract	1.5 เยน (15 Ticks)	2.2 เยน (22 Ticks)	5 สัญญา	55%
5 th - 6 th contract	0.5 เยน (5 Ticks)	0.7 เยน (7 Ticks)	20 สัญญา	

ทั้งนี้ ผู้ดูแลสภาพคล่องอาจไม่ปฏิบัติตามหน้าที่ตามเงื่อนไขข้างต้น ในกรณีต่างๆ ดังนี้

1. ในช่วง Pre-Open ตามที่กำหนดไว้ในแบบของสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแต่ละแบบ
2. ในวันที่ซื้อขายวันสุดท้ายที่สัญญาซื้อขายล่วงหน้าจะสิ้นสุดอายุ
3. ในกรณีที่ระบบการซื้อขายของตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือระบบเชื่อมต่อกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า หรือระบบส่งคำสั่งซื้อขายของผู้ดูแลสภาพคล่องเกิดขัดข้อง
4. เมื่อตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นว่ามีความผันผวนหรือเหตุผิดปกติในสภาพตลาด อันเป็นเหตุให้ผู้ดูแลสภาพคล่องไม่สามารถปฏิบัติตามหน้าที่ต่อไปได้ หรือเหตุอื่นๆ ที่ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเห็นว่าเหมาะสม
