

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 04 พฤศจิกายน 2564 ดังนี้.-

ประเภทลูกค้า	หลักประกันเริ่มต้น (Initial Margin Multiplier) (เท่า)	หลักประกันรักษาสภาพ (Maintenance Margin Multiplier) (เท่า)	หลักประกันบังคับปิดสัญญา (Intraday Force Close Multiplier) (เท่า)
ลูกค้าทั่วไป	1.75	1.23	0.53
ลูกค้าสถาบัน	1.35	1.00	-

สำหรับลูกค้าทั่วไป

1. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับโลหะมีค่า (Metal Market Futures)

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ โลหะมีค่า	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
50 Baht Gold Futures	50,575.00	35,547.00	15,317.00	12,643.75	8,886.75	3,829.25
10 Baht Gold Futures	10,115.00	7,109.40	3,063.40	2,528.75	1,777.35	765.85
GOLD ONLINE	21,875.00	15,375.00	6,625.00	5,468.75	3,843.75	1,656.25
SILVER ONLINE	5,565.00	3,911.40	1,685.40	1,391.25	977.85	421.35

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับโลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	7,385.00	14,770.00	23,275.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	5,190.60	10,381.20	16,359.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	2,236.60	4,473.20	7,049.00

3. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับดัชนีกลุ่ม (Index Market Futures)

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ ดัชนีกลุ่ม	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
BANK	26,600.00	18,696.00	8,056.00	6,650.00	4,674.00	2,014.00
COMM	18,725.00	13,161.00	5,671.00	4,681.25	3,290.25	1,417.75
ENERG	10,710.00	7,527.60	3,243.60	2,677.50	1,881.90	810.90
FOOD	5,775.00	4,059.00	1,749.00	1,443.75	1,014.75	437.25
ICT	6,650.00	4,674.00	2,014.00	1,662.50	1,168.50	503.50
SET 50	9,205.00	6,469.80	2,787.80	2,301.25	1,617.45	696.95

4. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า SET 50 Index Options

- 3.1 กรณีซื้อ (Long) สัญญา Options ลูกค้าย่อมไปจะต้องมีหลักประกันไม่ต่ำกว่าค่าพรีเมียม (Premium) ก่อนสั่งซื้อ เพื่อเปิดฐานะสัญญา
- 3.2 กรณีขาย (Short) สัญญา Options ลูกค้าย่อมไปจะต้องวางหลักประกันขั้นต่ำของออพชั่น ตามที่ประกาศของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) กำหนด

5. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับตราสารทุน (Stock Market Futures)

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ ตราสารทุน	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
AAV	385.00	270.60	116.60	96.25	67.65	29.15
ADVANC	8,750.00	6,150.00	2,650.00	2,187.50	1,537.50	662.50
AEONTS	25,200.00	17,712.00	7,632.00	6,300.00	4,428.00	1,908.00
AMATA	2,030.00	1,426.80	614.80	507.50	356.70	153.70
AOT	5,075.00	3,567.00	1,537.00	1,268.75	891.75	384.25
AP (M22 series)	770.00	541.20	233.20	192.50	135.30	58.30

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ ตราสารทุน	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
AWC	455.00	319.80	137.80	113.75	79.95	34.45
BA	1,820.00	1,279.20	551.20	455.00	319.80	137.80
BAM	1,365.00	959.40	413.40	341.25	239.85	103.35
BANPU (U22 onwards)	1,855.00	1,303.80	561.80	463.75	325.95	140.45
BAY	3,815.00	2,681.40	1,155.40	953.75	670.35	288.85
BBL	7,875.00	5,535.00	2,385.00	1,968.75	1,383.75	596.25
BCH	1,855.00	1,303.80	561.80	463.75	325.95	140.45
BCP	2,975.00	2,091.00	901.00	743.75	522.75	225.25
BCPG (Z21 onwards)	1,190.00	836.40	360.40	297.50	209.10	90.10
BDMS	1,295.00	910.20	392.20	323.75	227.55	98.05
BEAUTY	210.00	147.60	63.60	52.50	36.90	15.90
BEC	1,785.00	1,254.60	540.60	446.25	313.65	135.15
BEM	560.00	393.60	169.60	140.00	98.40	42.40
BGRIM	2,975.00	2,091.00	901.00	743.75	522.75	225.25
BH	11,865.00	8,339.40	3,593.40	2,966.25	2,084.85	898.35
BJC	2,835.00	1,992.60	858.60	708.75	498.15	214.65
BLA	3,675.00	2,583.00	1,113.00	918.75	645.75	278.25
BLAND	105.00	73.80	31.80	26.25	18.45	7.95
BPP	1,400.00	984.00	424.00	350.00	246.00	106.00
BTS	630.00	442.80	190.80	157.50	110.70	47.70
CBG	11,515.00	8,093.40	3,487.40	2,878.75	2,023.35	871.85
CENTEL	4,865.00	3,419.40	1,473.40	1,216.25	854.85	368.35
CHG	350.00	246.00	106.00	87.50	61.50	26.50
CK	1,995.00	1,402.20	604.20	498.75	350.55	151.05
CKP	595.00	418.20	180.20	148.75	104.55	45.05
COM7	7,840.00	5,510.40	2,374.40	1,960.00	1,377.60	593.60
CPALL	3,920.00	2,755.20	1,187.20	980.00	688.80	296.80
CPF	1,680.00	1,180.80	508.80	420.00	295.20	127.20
CPN	5,425.00	3,813.00	1,643.00	1,356.25	953.25	410.75
CRC	3,045.00	2,140.20	922.20	761.25	535.05	230.55
DELTA	121,450.00	85,362.00	36,782.00	30,362.50	21,340.50	9,195.50

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ ตราสารทุน	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
	DTAC	3,920.00	2,755.20	1,187.20	980.00	688.80
EA	4,540.00	1,135.00	4,540.00	1,135.00	4,540.00	1,135.00
EASTW	455.00	319.80	137.80	113.75	79.95	34.45
EGCO	11,130.00	7,822.80	3,370.80	2,782.50	1,955.70	842.70
EPG	1,295.00	910.20	392.20	323.75	227.55	98.05
ERW (M22 onwards)	455.00	319.80	137.80	113.75	79.95	34.45
ESSO	945.00	664.20	286.20	236.25	166.05	71.55
GFPT	1,085.00	762.60	328.60	271.25	190.65	82.15
GLOBAL (H22 onwards)	2,135.00	1,500.60	646.60	533.75	375.15	161.65
GPSC	6,650.00	4,674.00	2,014.00	1,662.50	1,168.50	503.50
GULF	3,605.00	2,533.80	1,091.80	901.25	633.45	272.95
GUNKUL	560.00	393.60	169.60	140.00	98.40	42.40
HANA	9,695.00	6,814.20	2,936.20	2,423.75	1,703.55	734.05
HMPRO	1,225.00	861.00	371.00	306.25	215.25	92.75
ICHI	1,435.00	1,008.60	434.60	358.75	252.15	108.65
INTUCH	7,455.00	5,239.80	2,257.80	1,863.75	1,309.95	564.45
IRPC	420.00	295.20	127.20	105.00	73.80	31.80
ITD	350.00	246.00	106.00	87.50	61.50	26.50
IVL	4,935.00	3,468.60	1,494.60	1,233.75	867.15	373.65
JAS	280.00	196.80	84.80	70.00	49.20	21.20
JMT	5,230.75	3,676.47	1,584.17	1,307.25	918.81	395.91
KBANK	12,985.00	9,126.60	3,932.60	3,246.25	2,281.65	983.15
KCE	9,660.00	6,789.60	2,925.60	2,415.00	1,697.40	731.40
KEX	3,640.00	2,558.40	1,102.40	910.00	639.60	275.60
KKP	4,235.00	2,976.60	1,282.60	1,058.75	744.15	320.65
KTB	735.00	516.60	222.60	183.75	129.15	55.65
KTC	6,195.00	4,354.20	1,876.20	1,548.75	1,088.55	469.05
LH	525.00	369.00	159.00	131.25	92.25	39.75
LPN	420.00	295.20	127.20	105.00	73.80	31.80
M	3,605.00	2,533.80	1,091.80	901.25	633.45	272.95

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ ตราสารทุน	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
MAJOR	2,835.00	1,992.60	858.60	708.75	498.15	214.65
MBK	1,505.00	1,057.80	455.80	376.25	264.45	113.95
MEGA	4,830.00	3,394.80	1,462.80	1,207.50	848.70	365.70
MINT	3,325.00	2,337.00	1,007.00	831.25	584.25	251.75
MTC	5,775.00	4,059.00	1,749.00	1,443.75	1,014.75	437.25
OR	2,030.00	1,426.80	614.80	507.50	356.70	153.70
ORI	1,085.00	762.60	328.60	271.25	190.65	82.15
OSP	2,625.00	1,845.00	795.00	656.25	461.25	198.75
PLANB	805.00	565.80	243.80	201.25	141.45	60.95
PRM	735.00	516.60	222.60	183.75	129.15	55.65
PSH	1,050.00	738.00	318.00	262.50	184.50	79.50
PSL	3,290.00	2,312.40	996.40	822.50	578.10	249.10
PTG	1,330.00	934.80	402.80	332.50	233.70	100.70
PTT	2,590.00	1,820.40	784.40	647.50	455.10	196.10
PTTEP	9,135.00	6,420.60	2,766.60	2,283.75	1,605.15	691.65
PTTGC	5,250.00	3,690.00	1,590.00	1,312.50	922.50	397.50
QH	175.00	123.00	53.00	43.75	30.75	13.25
RATCH	2,940.00	2,066.40	890.40	735.00	516.60	222.60
RS	1,855.00	1,303.80	561.80	463.75	325.95	140.45
S	245.00	172.20	74.20	61.25	43.05	18.55
SAMART	1,015.00	713.40	307.40	253.75	178.35	76.85
SAWAD	6,685.00	4,698.60	2,024.60	1,671.25	1,174.65	506.15
SCB	13,965.00	9,815.40	4,229.40	3,491.25	2,453.85	1,057.35
SCC	23,100.00	16,236.00	6,996.00	5,775.00	4,059.00	1,749.00
SCGP	4,760.00	3,345.60	1,441.60	1,190.00	836.40	360.40
SGP	1,575.00	1,107.00	477.00	393.75	276.75	119.25
SIRI	175.00	123.00	53.00	43.75	30.75	13.25
SPALI	1,303.80	561.80	463.75	325.95	140.45	1,303.80
SPCG	1,225.00	861.00	371.00	306.25	215.25	92.75
SPRC	1,225.00	861.00	371.00	306.25	215.25	92.75
STA	4,480.00	3,148.80	1,356.80	1,120.00	787.20	339.20

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ ตราสารทุน	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
STEC	1,365.00	959.40	413.40	341.25	239.85	103.35
STGT	2,800.00	1,968.00	848.00	700.00	492.00	212.00
STPI	560.00	393.60	169.60	140.00	98.40	42.40
SUPER	105.00	73.80	31.80	26.25	18.45	7.95
TASCO	1,505.00	1,057.80	455.80	376.25	264.45	113.95
TCAP	2,695.00	1,894.20	816.20	673.75	473.55	204.05
THAI	1,155.00	811.80	349.80	288.75	202.95	87.45
THANI	420.00	295.20	127.20	105.00	73.80	31.80
THCOM	1,785.00	1,254.60	540.60	446.25	313.65	135.15
THG	2,065.00	1,451.40	625.40	516.25	362.85	156.35
TISCO	6,160.00	4,329.60	1,865.60	1,540.00	1,082.40	466.40
TKN	770.00	541.20	233.20	192.50	135.30	58.30
TOA	3,010.00	2,115.60	911.60	752.50	528.90	227.90
TOP	5,075.00	3,567.00	1,537.00	1,268.75	891.75	384.25
TPIPL	175.00	123.00	53.00	43.75	30.75	13.25
TPIPP	210.00	147.60	63.60	52.50	36.90	15.90
TQM	9,590.00	6,740.40	2,904.40	2,397.50	1,685.10	726.10
TRUE	455.00	319.80	137.80	113.75	79.95	34.45
TTA	2,415.00	1,697.40	731.40	603.75	424.35	182.85
TTB	105.00	73.80	31.80	26.25	18.45	7.95
TTCL	735.00	516.60	222.60	183.75	129.15	55.65
TTW	560.00	393.60	169.60	140.00	98.40	42.40
TU	1,645.00	1,156.20	498.20	411.25	289.05	124.55
TVO	2,870.00	2,017.20	869.20	717.50	504.30	217.30
UNIQ	805.00	565.80	243.80	201.25	141.45	60.95
VGI	665.00	467.40	201.40	166.25	116.85	50.35
VNG	1,400.00	984.00	424.00	350.00	246.00	106.00
VNT	3,220.00	2,263.20	975.20	805.00	565.80	243.80
WHA	245.00	172.20	74.20	61.25	43.05	18.55
WHAUP	315.00	221.40	95.40	78.75	55.35	23.85

6. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับอัตราดอกเบี้ย (Interest Rate Market Futures)

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ อัตราดอกเบี้ย	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
5Y Government Bond Futures	5,565.00	3,911.40	1,685.40	1,391.25	977.85	421.35
3M BIBOR	1,120.00	787.20	339.20	2,240.00	1,574.40	678.40

7. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้ายางแผ่นรมควันชั้น 3

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ อัตราดอกเบี้ย	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
RSS3	31,850.00	22,386.00	9,646.00	31,850.00	22,386.00	9,646.00
RSS3D	31,850.00	22,386.00	9,646.00	31,850.00	22,386.00	9,646.00
Spot Month Margin	100,800.00	70,848.00	30,528.00	-	-	-
Japanese Rubber	6,230.00	4,378.80	1,886.80	6,230.00	4,378.80	1,886.80

8. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ USD

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	700.00	175.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	492.00	123.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	212.00	53.00

9. อัตราหลักประกันสำหรับ Single Stock Futures ที่มีการปรับสัญญาเนื่องจาก Corporate Actions

ประเภทสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ การปรับสัญญา Corporate Actions	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
AP Futures						
APZ21X	668.50	469.86	202.46	167.25	117.55	50.65
APH22X	668.50	469.86	202.46	167.25	117.55	50.65

ประเภทสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ การปรับสัญญา Corporate Actions	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
BANPU Futures						
BANPUZ21X	2,243.50	1,576.86	679.46	560.86	394.20	169.86
BANPUH22X	2,243.50	1,576.86	679.46	560.86	394.20	169.86
BANPUM22X	2,243.50	1,576.86	679.46	560.86	394.20	169.86
ERW Futures						
ERWZ21X	708.75	498.15	214.65	177.22	124.56	53.67
ERWH22X	708.75	498.15	214.65	177.22	124.56	53.67
GLOBAL Futures						
GLOBALZ21X	2,231.25	1,568.25	675.75	557.77	392.03	168.92
JMT Futures						
JMTZ21X	5,355.00	3,763.80	1,621.80	1,338.62	940.86	405.42
JMTH22X	5,355.00	3,763.80	1,621.80	1,338.62	940.86	405.42
JMTM22X	5,355.00	3,763.80	1,621.80	1,338.62	940.86	405.42
JMTU22X	5,355.00	3,763.80	1,621.80	1,338.62	940.86	405.42

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	10,447.50
RSS3D	174,475.00

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 10 พฤศจิกายน 2564 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลงและให้ถือเป็นการยกเลิก REF.No.AFC2021/10/020 วันที่ 14 ตุลาคม 2564

ประกาศ ณ วันที่ 10 พฤศจิกายน 2564