

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 9 กรกฎาคม 2562 ดังนี้.-

ประเภทลูกค้า	หลักประกันเริ่มต้น (Initial Margin Multiplier) (เท่า)	หลักประกันรักษาสภาพ (Maintenance Margin Multiplier) (เท่า)	หลักประกันบังคับปิดสัญญา (Intraday Force Close Multiplier) (เท่า)
ลูกค้าทั่วไป	1.90	1.33	0.57
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	39,520.00	27,664.00	11,856.00	9,880.00	6,916.00	2,964.00
10 Baht Gold Futures	7,904.00	5,532.80	2,371.20	1,976.00	1,383.20	592.80
GOLD-ONLINE	21,850.00	15,295.00	6,555.00	-	-	-

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับโลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	5,320.00	16,910.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	3,724.00	11,837.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	1,596.00	5,073.00

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	20,140.00	14,098.00	6,042.00	5,035.00	3,524.50	1,510.50
COMM	19,570.00	13,699.00	5,871.00	4,892.50	3,424.75	1,467.75
ENERG	12,920.00	9,044.00	3,876.00	3,230.00	2,261.00	969.00
FOOD	4,560.00	3,192.00	1,368.00	1,140.00	798.00	342.00
ICT	7,372.00	5,160.40	2,211.60	1,843.00	1,290.10	552.90
SET 50	9,500.00	6,650.00	2,850.00	2,375.00	1,662.50	712.50

4. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า SET 50 Index Options

- 3.1 กรณีซื้อ (Long) สัญญา Options ลูกค้ำทั่วไปจะต้องมีหลักประกันไม่ต่ำกว่าค่าพรีเมียม (Premium) ก่อนสั่งซื้อ เพื่อเปิดฐานะสัญญา
- 3.2 กรณีขาย (Short) สัญญา Options ลูกค้ำทั่วไปจะต้องวางหลักประกันขั้นต่ำของออพชั่น 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	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
ADVANC	9,690.00	6,783.00	2,907.00	2,422.50	1,695.75	726.75
AEONTS	20,330.00	14,231.00	6,099.00	5,082.50	3,557.75	1,524.75
AMATA	2,280.00	1,596.00	684.00	570.00	399.00	171.00
AOT	6,650.00	4,655.00	1,995.00	1,662.50	1,163.75	498.75
AP	722.00	505.40	216.60	180.50	126.35	54.15
BA	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
BANPU	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
BAY	1,900.00	1,330.00	570.00	475.00	332.50	142.50
BBL	9,120.00	6,384.00	2,736.00	2,280.00	1,596.00	684.00
BCH	1,406.00	984.20	421.80	351.50	246.05	105.45

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)
BCP	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
BCPG	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
BDMS	1,824.00	1,276.80	547.20	456.00	319.20	136.80
BEAUTY	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
BEC	1,368.00	957.60	410.40	342.00	239.40	102.60
BEM	874.00	611.80	262.20	218.50	152.95	65.55
BGRIM	3,420.00	2,394.00	1,026.00	855.00	598.50	256.50
BH	8,968.00	6,277.60	2,690.40	2,242.00	1,569.40	672.60
BJC	4,294.00	3,005.80	1,288.20	1,073.50	751.45	322.05
BLA	2,318.00	1,622.60	695.40	579.50	405.65	173.85
BLAND	114.00	79.80	34.20	28.50	19.95	8.55
BTS	874.00	611.80	262.20	218.50	152.95	65.55
CBG	10,070.00	7,049.00	3,021.00	2,517.50	1,762.25	755.25
CENTEL	3,230.00	2,261.00	969.00	807.50	565.25	242.25
CHG	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10
CK	2,204.00	1,542.80	661.20	551.00	385.70	165.30
CKP	532.00	372.40	159.60	133.00	93.10	39.90
COM7	2,280.00	1,596.00	684.00	570.00	399.00	171.00
CPALL	4,940.00	3,458.00	1,482.00	1,235.00	864.50	370.50
CPF	2,394.00	1,675.80	718.20	598.50	418.95	179.55
CPN	4,940.00	3,458.00	1,482.00	1,235.00	864.50	370.50
DELTA	11,400.00	7,980.00	3,420.00	2,850.00	1,995.00	855.00
DTAC	4,940.00	3,458.00	1,482.00	1,235.00	864.50	370.50
EA	5,890.00	4,123.00	1,767.00	1,472.50	1,030.75	441.75
EARTH	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
EGCO	16,340.00	11,438.00	4,902.00	4,085.00	2,859.50	1,225.50
EPG	722.00	505.40	216.60	180.50	126.35	54.15
ERW	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
ESSO	1,102.00	771.40	330.60	275.50	192.85	82.65
GFPT	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25
GLOBAL(For seriesH20 onwards)	1,482.00	1,037.40	444.60	370.50	259.35	111.15

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)
GLOW	12,616.00	8,831.20	3,784.80	3,154.00	2,207.80	946.20
GPSC	6,840.00	4,788.00	2,052.00	1,710.00	1,197.00	513.00
GULF	9,044.00	6,330.80	2,713.20	2,261.00	1,582.70	678.30
GUNKUL(For seriesM20 onwards)	342.00	239.40	102.60	85.50	59.85	25.65
HANA	4,294.00	3,005.80	1,288.20	1,073.50	751.45	322.05
HMPRO	1,216.00	851.20	364.80	304.00	212.80	91.20
ICHI	1,140.00	798.00	342.00	285.00	199.50	85.50
INTUCH	4,940.00	3,458.00	1,482.00	1,235.00	864.50	370.50
IRPC	456.00	319.20	136.80	114.00	79.80	34.20
ITD	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
IVL	4,370.00	3,059.00	1,311.00	1,092.50	764.75	327.75
JAS	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
KBANK	10,260.00	7,182.00	3,078.00	2,565.00	1,795.50	769.50
KCE	2,774.00	1,941.80	832.20	693.50	485.45	208.05
KKP	3,990.00	2,793.00	1,197.00	997.50	698.25	299.25
KTB	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
KTC	5,130.00	3,591.00	1,539.00	1,282.50	897.75	384.75
LH	836.00	585.20	250.80	209.00	146.30	62.70
LPN	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
MAJOR	2,508.00	1,755.60	752.40	627.00	438.90	188.10
MEGA	3,800.00	2,660.00	1,140.00	950.00	665.00	285.00
MINT	3,040.00	2,128.00	912.00	760.00	532.00	228.00
MTC	5,510.00	3,857.00	1,653.00	1,377.50	964.25	413.25
ORI	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
PLANB	874.00	611.80	262.20	218.50	152.95	65.55
PRM	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
PSH	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
PSL	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
PTG	2,432.00	1,702.40	729.60	608.00	425.60	182.40
PTT	3,420.00	2,394.00	1,026.00	855.00	598.50	256.50
PTTEP	10,830.00	7,581.00	3,249.00	2,707.50	1,895.25	812.25

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)
PTTGC	4,370.00	3,059.00	1,311.00	1,092.50	764.75	327.75
QH	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
RATCH	3,800.00	2,660.00	1,140.00	950.00	665.00	285.00
ROBINS	4,560.00	3,192.00	1,368.00	1,140.00	798.00	342.00
RS	2,280.00	1,596.00	684.00	570.00	399.00	171.00
S	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
SAMART	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
SAWAD (For series M20 onwards)	6,460.00	4,522.00	1,938.00	1,615.00	1,130.50	484.50
SCB	7,980.00	5,586.00	2,394.00	1,995.00	1,396.50	598.50
SCC	21,470.00	15,029.00	6,441.00	5,367.50	3,757.25	1,610.25
SGP	1,140.00	798.00	342.00	285.00	199.50	85.50
SIRI	152.00	106.40	45.60	38.00	26.60	11.40
SPALI	1,900.00	1,330.00	570.00	475.00	332.50	142.50
SPCG	1,368.00	957.60	410.40	342.00	239.40	102.60
SPRC	836.00	585.20	250.80	209.00	146.30	62.70
STA	1,558.00	1,090.60	467.40	389.50	272.65	116.85
STEC	2,280.00	1,596.00	684.00	570.00	399.00	171.00
STPI	1,178.00	824.60	353.40	294.50	206.15	88.35
SUPER	114.00	79.80	34.20	28.50	19.95	8.55
TASCO	2,280.00	1,596.00	684.00	570.00	399.00	171.00
TCAP	3,800.00	2,660.00	1,140.00	950.00	665.00	285.00
THAI	1,938.00	1,356.60	581.40	484.50	339.15	145.35
THANI	646.00	452.20	193.80	161.50	113.05	48.45
THCOM	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
TISCO	14,554.00	10,187.80	4,366.20	3,638.50	2,546.95	1,091.55
TKN	1,558.00	1,090.60	467.40	389.50	272.65	116.85
TMB	152.00	106.40	45.60	38.00	26.60	11.40
TOP	5,510.00	3,857.00	1,653.00	1,377.50	964.25	413.25
TPIPL	152.00	106.40	45.60	38.00	26.60	11.40
TRUE	494.00	345.80	148.20	123.50	86.45	37.05
TTA	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35

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)
TTCL	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
TTW	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
TU	1,444.00	1,010.80	433.20	361.00	252.70	108.30
TVO	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
UNIQ	1,292.00	904.40	387.60	323.00	226.10	96.90
VGI	836.00	585.20	250.80	209.00	146.30	62.70
VNG	380.00	266.00	114.00	95.00	66.50	28.50
WHA	342.00	239.40	102.60	85.50	59.85	25.65

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	5,320.00	3,724.00	1,596.00	1,330.00	931.00	399.00
3M BIBOR	722.00	505.40	216.60	-	-	-

7. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้ายางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3)

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	32,110.00	32,110.00	100,700.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	22,477.00	22,477.00	70,490.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	9,633.00	9,633.00	30,210.00

8. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้ายางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3D)

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	32,110.00	32,110.00	100,700.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	22,477.00	22,477.00	70,490.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	9,633.00	9,633.00	30,210.00

9. อัตราหลักประกันสำหรับ Single Stock Futures ที่มีการปรับสัญญาเนื่องจาก Corporate Actions

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ 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)
GLOBAL Futures						
GLOBALU19X	1,556.10	1,089.27	466.83	389.03	272.32	116.71
GLOBALZ19X	1,556.10	1,089.27	466.83	389.03	272.32	116.71
GUNKUL Futures						
GUNKULU19X	410.40	287.28	123.12	102.60	71.82	30.78
GUNKULZ19X	410.40	287.28	123.12	102.60	71.82	30.78
GUNKULH20X	410.40	287.28	123.12	102.60	71.82	30.78
SAWAD Futures						
SAWADU19X	7,1067.00	4,974.20	2,131.80	1,776.50	1,243.55	532.95
SAWADZ19X	7,1067.00	4,974.20	2,131.80	1,776.50	1,243.55	532.95
SAWADH20X	7,1067.00	4,974.20	2,131.80	1,776.50	1,243.55	532.95

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	7,600.00
RSS3	176,700.00
RSS3D	176,700.00

*หมายเหตุ

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 12 กรกฎาคม 2562 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลง และให้ถือเป็นการยกเลิก REF.No.AFC2019/06/012 วันที่ 27 มิถุนายน 2562

ประกาศ ณ วันที่ 10 กรกฎาคม 2562