

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 11 ตุลาคม 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	42,750.00	29,925.00	12,825.00	10,687.50	7,481.25	3,206.25
10 Baht Gold Futures	8,550.00	5,985.00	2,565.00	2,137.50	1,496.25	641.25
GOLD-ONLINE	19,722.00	13,805.40	5,916.60	39,444.00	27,610.80	11,833.20

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับโลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	5,624.00	11,248.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	3,936.80	7,873.60
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	1,687.20	3,374.40

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	25,080.00	17,556.00	7,524.00	6,270.00	4,389.00	1,881.00
COMM	20,292.00	14,204.40	6,087.60	5,073.00	3,551.10	1,521.90
ENERG	12,426.00	8,698.20	3,727.80	3,106.50	2,174.55	931.95
FOOD	5,130.00	3,591.00	1,539.00	1,282.50	897.75	384.75
ICT	11,780.00	8,246.00	3,534.00	2,945.00	2,061.50	883.50
SET 50	10,298.00	7,208.60	3,089.40	2,574.50	1,802.15	772.35

4. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า SET 50 Index Options

- 3.1 กรณีซื้อ (Long) สัญญา Options ลูกค้าทั่วไปจะต้องมีหลักประกันไม่ต่ำกว่าค่าพรีเมียม (Premium) ก่อนสั่งซื้อ เพื่อเปิดฐานะสัญญา
- 3.2 กรณีขาย (Short) สัญญา Options ลูกค้าทั่วไปจะต้องวางหลักประกันขั้นต่ำของออพชั่น 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	494.00	345.80	148.20	123.50	86.45	37.05
ADVANC	19,076.00	13,353.20	5,722.80	4,769.00	3,338.30	1,430.70
AEONTS	18,696.00	13,087.20	5,608.80	4,674.00	3,271.80	1,402.20
AMATA	2,394.00	1,675.80	718.20	598.50	418.95	179.55
AOT	4,218.00	2,952.60	1,265.40	10,554.50	7,388.15	3,166.35
AP	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
BA	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
BANPU	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
BAY	2,394.00	1,675.80	718.20	598.50	418.95	179.55
BBL	10,260.00	7,182.00	3,078.00	2,565.00	1,795.50	769.50
BCH	1,216.00	851.20	364.80	304.00	212.80	91.20

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)
BCP	2,432.00	1,702.40	729.60	608.00	425.60	182.40
BCPG	2,546.00	1,782.20	763.80	636.50	445.55	190.95
BDMS	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25
BEAUTY	646.00	452.20	193.80	161.50	113.05	48.45
BEC	1,444.00	1,010.80	433.20	361.00	252.70	108.30
BEM	950.00	665.00	285.00	237.50	166.25	71.25
BGRIM	3,990.00	2,793.00	1,197.00	997.50	698.25	299.25
BH	14,136.00	9,895.20	4,240.80	3,534.00	2,473.80	1,060.20
BJC	4,028.00	2,819.60	1,208.40	1,007.00	704.90	302.10
BLA	2,546.00	1,782.20	763.80	636.50	445.55	190.95
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	10,868.00	7,607.60	3,260.40	2,717.00	1,901.90	815.10
CENTEL	3,610.00	2,527.00	1,083.00	902.50	631.75	270.75
CHG	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
CK	2,774.00	1,941.80	832.20	693.50	485.45	208.05
CKP	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
COM7	2,432.00	1,702.40	729.60	608.00	425.60	182.40
CPALL	4,484.00	3,138.80	1,345.20	1,121.00	784.70	336.30
CPF	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
CPN	5,320.00	3,724.00	1,596.00	1,330.00	931.00	399.00
DELTA	6,156.00	4,309.20	1,846.80	1,539.00	1,077.30	461.70
DTAC	5,624.00	3,936.80	1,687.20	1,406.00	984.20	421.80
EA	4,674.00	3,271.80	1,402.20	1,168.50	817.95	350.55
EGCO	28,044.00	19,630.80	8,413.20	7,011.00	4,907.70	2,103.30
EPG	874.00	611.80	262.20	218.50	152.95	65.55
ERW	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
ESSO	1,140.00	798.00	342.00	285.00	199.50	85.50
GFPT	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
GLOBAL(For seriesH20 onwards)	1,558.00	1,090.60	467.40	389.50	272.65	116.85
GLOW	5,700.00	3,990.00	1,710.00	1,425.00	997.50	427.50

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)
GPSC (For seriesU20 onwards)	8,702.00	6,091.40	2,610.60	2,175.50	1,522.85	652.65
GULF	18,316.00	12,821.20	5,494.80	4,579.00	3,205.30	1,373.70
GUNKUL(For seriesM20 onwards)	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
HANA	3,230.00	2,261.00	969.00	807.50	565.25	242.25
HMPRO	1,862.00	1,303.40	558.60	465.50	325.85	139.65
ICHI	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
INTUCH	5,700.00	3,990.00	1,710.00	1,425.00	997.50	427.50
IRPC	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
ITD	190.00	133.00	57.00	47.50	33.25	14.25
IVL	5,206.00	3,644.20	1,561.80	1,301.50	911.05	390.45
JAS	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
KBANK	12,426.00	8,698.20	3,727.80	3,106.50	2,174.55	931.95
KCE	2,470.00	1,729.00	741.00	617.50	432.25	185.25
KKP	5,282.00	3,697.40	1,584.60	1,320.50	924.35	396.15
KTB	1,140.00	798.00	342.00	285.00	199.50	85.50
KTC	4,370.00	3,059.00	1,311.00	1,092.50	764.75	327.75
LH	722.00	505.40	216.60	180.50	126.35	54.15
LPN	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
MAJOR	2,850.00	1,995.00	855.00	712.50	498.75	213.75
MEGA	3,040.00	2,128.00	912.00	760.00	532.00	228.00
MINT	3,344.00	2,340.80	1,003.20	2,061.50	1,443.05	618.45
MTC	8,246.00	5,772.20	2,473.80	2,061.50	1,443.05	618.45
ORI	1,216.00	851.20	364.80	304.00	212.80	91.20
PLANB	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
PRM	1,330.00	931.00	399.00	332.50	232.75	99.75
PSH	2,318.00	1,622.60	695.40	579.50	405.65	173.85
PSL	1,330.00	931.00	399.00	332.50	232.75	99.75
PTG	2,926.00	2,048.20	877.80	731.50	512.05	219.45
PTT	3,230.00	2,261.00	969.00	807.50	565.25	242.25
PTTEP	10,640.00	7,448.00	3,192.00	2,660.00	1,862.00	798.00
PTTGC	5,814.00	4,069.80	1,744.20	1,453.50	1,017.45	436.05

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)
QH	190.00	133.00	57.00	47.50	33.25	14.25
RATCH	3,800.00	2,660.00	1,140.00	950.00	665.00	285.00
ROBINS	7,296.00	5,107.20	2,188.80	1,824.00	1,276.80	547.20
RS	1,824.00	1,276.80	547.20	456.00	319.20	136.80
S	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
SAMART	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
SAWAD (For series M20 onwards)	7,372.00	5,160.40	2,211.60	1,843.00	1,290.10	552.90
SCB	9,500.00	6,650.00	2,850.00	2,375.00	1,662.50	712.50
SCC	24,320.00	17,024.00	7,296.00	6,080.00	4,256.00	1,824.00
SGP	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
SIRI	114.00	79.80	34.20	28.50	19.95	8.55
SPALI	1,748.00	1,223.60	524.40	437.00	305.90	131.10
SPCG	1,558.00	1,090.60	467.40	389.50	272.65	116.85
SPRC	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25
STA	1,368.00	957.60	410.40	342.00	239.40	102.60
STEC	2,356.00	1,649.20	706.80	589.00	412.30	176.70
STPI	1,482.00	1,037.40	444.60	370.50	259.35	111.15
SUPER	114.00	79.80	34.20	28.50	19.95	8.55
TASCO	2,508.00	1,755.60	752.40	627.00	438.90	188.10
TCAP	6,080.00	4,256.00	1,824.00	1,520.00	1,064.00	456.00
THAI	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
THANI	874.00	611.80	262.20	218.50	152.95	65.55
THCOM	608.00	425.60	182.40	152.00	106.40	45.60
TISCO	8,094.00	5,665.80	2,428.20	2,023.50	1,416.45	607.05
TKN	2,052.00	1,436.40	615.60	513.00	359.10	153.90
TMB (For series U20 onwards)	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10
TOP	7,068.00	4,947.60	2,120.40	1,767.00	1,236.90	530.10
TPIPL	152.00	106.40	45.60	38.00	26.60	11.40
TRUE	608.00	425.60	182.40	152.00	106.40	45.60
TTA	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
TTCL	1,368.00	957.60	410.40	342.00	239.40	102.60

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)
TTW	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
TU	1,330.00	931.00	399.00	332.50	232.75	99.75
TVO	1,900.00	1,330.00	570.00	475.00	332.50	142.50
UNIQ	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
VGI	836.00	585.20	250.80	209.00	146.30	62.70
VNG	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
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	6,840.00	4,788.00	2,052.00	1,710.00	1,197.00	513.00
3M BIBOR	722.00	505.40	216.60	-	-	-

7. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้ายางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3)

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	19,760.00	19,760.00	62,700.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	13,832.00	13,832.00	43,890.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	5,928.00	5,928.00	18,810.00

8. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้ายางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3D)

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	19,760.00	19,760.00	62,700.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	13,832.00	13,832.00	43,890.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	5,928.00	5,928.00	18,810.00

9. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ USD

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	494.00	123.50
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	345.80	86.45
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	148.20	37.05

10. 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						
GLOBALZ19X	1,635.90	1,145.13	490.77	408.98	286.29	122.69
GPSC Futures						
GPSCZ19X	9,764.10	6,834.87	2,929.23	2,440.91	1,708.64	732.77
GPSCH20X	9,764.10	6,834.87	2,929.23	2,440.91	1,708.64	732.77
GPSCM20X	9,764.10	6,834.87	2,929.23	2,440.91	1,708.64	732.77
GUNKUL Futures						
GUNKULZ19X	364.80	255.36	109.44	91.20	63.84	27.36
GUNKULH20X	364.80	255.36	109.44	91.20	63.84	27.36
SAWAD Futures						
SAWADZ19X	8,109.20	5,676.44	2,432.76	2,027.30	1,419.11	608.19
SAWADH20X	8,109.20	5,676.44	2,432.76	2,027.30	1,419.11	608.19
TMB Futures						
TMBZ19X	248.90	174.23	74.67	62.36	43.65	18.71
TMBH20X	248.90	174.23	74.67	62.36	43.65	18.71
TMBM20X	248.90	174.23	74.67	62.36	43.65	18.71

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	7,980.00
RSS3	108,300.00
RSS3D	108,300.00

***หมายเหตุ**

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 18 ตุลาคม 2562 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลงและให้ถือเป็น
การยกเลิก REF.No.AFC2019/09/022 วันที่ 11 ตุลาคม 2562

ประกาศ ณ วันที่ 17 ตุลาคม 2562