

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 10 มีนาคม 2563 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 เกี่ยวกับ โลหะมีค่า (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	67,602.00	47,321.40	20,280.60	16,900.50	11,830.35	5,070.15
10 Baht Gold Futures	13,520.40	9,464.28	4,056.12	3,380.10	2,366.07	1,014.03
GOLD-ONLINE	24,738.00	17,316.60	7,421.40	49,476.00	34,633.20	14,842.80

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ โลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	10,640.00	21,280.00	33,630.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	7,448.00	14,896.00	23,541.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	3,192.00	6,384.00	10,089.00

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	40,508.00	28,355.60	12,152.40	10,127.00	7,088.90	3,038.10
COMM	34,960.00	24,472.00	10,488.00	8,740.00	6,118.00	2,622.00
ENERG	21,356.00	14,949.20	6,406.80	5,339.00	3,737.30	1,601.70
FOOD	11,400.00	7,980.00	3,420.00	2,850.00	1,995.00	855.00
ICT	12,844.00	8,990.80	3,853.20	3,211.00	2,247.70	963.30
SET 50	16,986.00	11,890.20	5,095.80	4,246.50	2,972.55	1,273.95

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	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
ADVANC	19,380.00	13,566.00	5,814.00	4,845.00	3,391.50	1,453.50
AEONTS	23,712.00	16,598.40	7,113.60	5,928.00	4,149.60	1,778.40
AMATA	2,546.00	1,782.20	763.80	636.50	445.55	190.95
AOT	7,030.00	4,921.00	2,109.00	1,757.50	1,230.25	527.25
AP	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
BA	874.00	611.80	262.20	218.50	152.95	65.55
BANPU	2,166.00	1,516.20	649.80	541.50	379.05	162.45
BAY	2,356.00	1,649.20	706.80	589.00	412.30	176.70
BBL	17,100.00	11,970.00	5,130.00	4,275.00	2,992.50	1,282.50
BCH	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55

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	3,800.00	2,660.00	1,140.00	950.00	665.00	285.00
BCPG	1,900.00	1,330.00	570.00	475.00	332.50	142.50
BDMS	2,622.00	1,835.40	786.60	655.50	458.85	196.65
BEAUTY	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
BEC	1,102.00	771.40	330.60	275.50	192.85	82.65
BEM	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
BGRIM	9,690.00	6,783.00	2,907.00	2,422.50	1,695.75	726.75
BH	19,950.00	13,965.00	5,985.00	4,987.50	3,491.25	1,496.25
BJC	5,054.00	3,537.80	1,516.20	1,263.50	884.45	379.05
BLA	2,318.00	1,622.60	695.40	579.50	405.65	173.85
BLAND	152.00	106.40	45.60	38.00	26.60	11.40
BTS	1,216.00	851.20	364.80	304.00	212.80	91.20
CBG	12,008.00	8,405.60	3,602.40	3,002.00	2,101.40	900.60
CENTEL	3,458.00	2,420.60	1,037.40	864.50	605.15	259.35
CHG	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
CK	3,382.00	2,367.40	1,014.60	845.50	591.85	253.65
CKP	532.00	372.40	159.60	133.00	93.10	39.90
COM7	3,382.00	2,367.40	1,014.60	845.50	591.85	253.65
CPALL	7,258.00	5,080.60	2,177.40	1,814.50	1,270.15	544.35
CPF	3,990.00	2,793.00	1,197.00	997.50	698.25	299.25
CPN	8,170.00	5,719.00	2,451.00	2,042.50	1,429.75	612.75
DELTA	11,324.00	7,926.80	3,397.20	2,831.00	1,981.70	849.30
DTAC	7,410.00	5,187.00	2,223.00	1,852.50	1,296.75	555.75
EA	7,144.00	5,000.80	2,143.20	1,786.00	1,250.20	535.80
EGCO	30,780.00	21,546.00	9,234.00	7,695.00	5,386.50	2,308.50
EPG	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
ERW	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
ESSO	1,178.00	824.60	353.40	294.50	206.15	88.35
GFPT	1,216.00	851.20	364.80	304.00	212.80	91.20
GLOBAL	1,995.00	1,396.50	598.50	499.70	349.79	149.91
GPSC (For seriesU20 onwards)	12,046.00	8,432.20	3,613.80	3,011.50	2,108.05	903.45

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)
GULF	25,878.00	18,114.60	7,763.40	6,469.50	4,528.65	1,940.85
GUNKUL(For seriesM20 onwards)	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10
HANA	6,764.00	4,734.80	2,029.20	1,691.00	1,183.70	507.30
HMPRO	1,444.00	1,010.80	433.20	361.00	252.70	108.30
ICHI	874.00	611.80	262.20	218.50	152.95	65.55
INTUCH	5,130.00	3,591.00	1,539.00	1,282.50	897.75	384.75
IRPC	494.00	345.80	148.20	123.50	86.45	37.05
ITD	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
IVL	4,636.00	3,245.20	1,390.80	1,159.00	811.30	347.70
JAS	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
KBANK	19,380.00	13,566.00	5,814.00	4,845.00	3,391.50	1,453.50
KCE	5,776.00	4,043.20	1,732.80	1,444.00	1,010.80	433.20
KKP	5,510.00	3,857.00	1,653.00	1,377.50	964.25	413.25
KTB	1,444.00	1,010.80	433.20	361.00	252.70	108.30
KTC	4,408.00	3,085.60	1,322.40	1,102.00	771.40	330.60
LH	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
LPN	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
MAJOR	3,458.00	2,420.60	1,037.40	864.50	605.15	259.35
MEGA	3,876.00	2,713.20	1,162.80	969.00	678.30	290.70
MINT	5,510.00	3,857.00	1,653.00	1,377.50	964.25	413.25
MTC	6,650.00	4,655.00	1,995.00	1,662.50	1,163.75	498.75
ORI	950.00	665.00	285.00	237.50	166.25	71.25
PLANB	1,140.00	798.00	342.00	285.00	199.50	85.50
PRM	1,102.00	771.40	330.60	275.50	192.85	82.65
PSH	1,406.00	984.20	421.80	351.50	246.05	105.45
PSL	1,178.00	824.60	353.40	294.50	206.15	88.35
PTG	2,850.00	1,995.00	855.00	712.50	498.75	213.75
PTT	3,192.00	2,234.40	957.60	798.00	558.60	239.40
PTTEP	13,604.00	9,522.80	4,081.20	3,401.00	2,380.70	1,020.30
PTTGC	7,372.00	5,160.40	2,211.60	1,843.00	1,290.10	552.90
QH	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10

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)
RATCH	6,840.00	4,788.00	2,052.00	1,710.00	1,197.00	513.00
ROBINS	12,933.30	9,053.31	3,879.99	2,042.50	1,429.75	612.75
RS	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25
S	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
SAMART	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
SAWAD (For series M20 onwards)	8,474.00	5,931.80	2,542.20	2,118.50	1,482.95	635.55
SCB (For series H21 onwards)	13,490.00	9,443.00	4,047.00	3,372.50	2,360.75	1,011.75
SCC	35,226.00	24,658.20	10,567.80	8,806.50	6,164.55	2,641.95
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	1,938.00	1,356.60	581.40	484.50	339.15	145.35
SPCG	2,204.00	1,542.80	661.20	551.00	385.70	165.30
SPRC	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
STA	2,470.00	1,729.00	741.00	617.50	432.25	185.25
STEC	3,002.00	2,101.40	900.60	750.50	525.35	225.15
STPI	1,178.00	824.60	353.40	294.50	206.15	88.35
SUPER	76.00	53.20	22.80	19.00	13.30	5.70
TASCO	3,420.00	2,394.00	1,026.00	855.00	598.50	256.50
TCAP (For series Z20 onwards)	4,446.00	3,112.20	1,333.80	1,111.50	778.05	333.45
THAI	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
THANI	608.00	425.60	182.40	152.00	106.40	45.60
THCOM	646.00	452.20	193.80	161.50	113.05	48.45
TISCO	6,270.00	4,389.00	1,881.00	1,567.50	1,097.25	470.25
TKN	1,672.00	1,170.40	501.60	418.00	292.60	125.40
TMB (For series U20 onwards)	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
TOP	9,044.00	6,330.80	2,713.20	2,261.00	1,582.70	678.30
TPIPL	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
TRUE	494.00	345.80	148.20	123.50	86.45	37.05
TTA	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
TTCL	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
TTW	1,254.00	877.80	376.20	313.50	219.45	94.05

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)
TU	1,596.00	1,117.20	478.80	399.00	279.30	119.70
TVO	3,078.00	2,154.60	923.40	769.50	538.65	230.85
UNIQ	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
VGI	1,330.00	931.00	399.00	332.50	232.75	99.75
VNG	342.00	239.40	102.60	85.50	59.85	25.65
WHA	532.00	372.40	159.60	133.00	93.10	39.90

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	8,246.00	5,772.20	2,473.80	2,061.50	1,443.05	618.45
3M BIBOR	4,218.00	2,952.60	1,265.40	8,436.00	5,905.20	2,530.80

7. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้ายางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3)

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	28,880.00	28,880.00	91,390.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	20,216.00	20,216.00	63,973.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	8,664.00	8,664.00	27,417.00

8. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้ายางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3D)

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	28,880.00	28,880.00	91,390.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	20,216.00	20,216.00	63,973.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	8,664.00	8,664.00	27,417.00

9. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ USD

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	570.00	142.50
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	399.00	99.75
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	171.00	42.75

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						
GLOBALH20X	2,090.00	1,463.00	627.00	523.69	366.58	157.11
GLOBALM20X	2,090.00	1,463.00	627.00	523.69	366.58	157.11
GLOBALU20X	2,090.00	1,463.00	627.00	523.69	366.58	157.11
GLOBALZ20X	2,090.00	1,463.00	627.00	523.69	366.58	157.11
GPSC Futures						
GPSCH20X	13,514.70	9,460.29	4,054.41	3,378.90	2,365.23	1,013.67
GPSCM20X	13,514.70	9,460.29	4,054.41	3,378.90	2,365.23	1,013.67
GUNKUL Futures						
GUNKULH20X	273.60	191.52	82.08	68.40	47.88	20.52
ROBINS Futures						
ROBINSH20X	12,933.30	9,053.31	3,879.99	3,233.28	2,263.30	969.98
ROBINSM20X	12,933.30	9,053.31	3,879.99	3,233.28	2,263.30	969.98
ROBINSU20X	12,933.30	9,053.31	3,879.99	3,233.28	2,263.30	969.98
ROBINSZ20X	12,933.30	9,053.31	3,879.99	3,233.28	2,263.30	969.98
SAWAD Futures						
SAWADH20X	9,321.40	6,524.98	2,796.42	2,330.35	1,631.25	699.10
SCB Futures						
SCBH20X	13,598.30	9,518.81	4,079.49	3,399.48	2,379.64	1,019.84
SCBM20X	13,598.30	9,518.81	4,079.49	3,399.48	2,379.64	1,019.84
SCBU20X	13,598.30	9,518.81	4,079.49	3,399.48	2,379.64	1,019.84
SCBZ20X	13,598.30	9,518.81	4,079.49	3,399.48	2,379.64	1,019.84
TCAP Futures						
TCAPH20X	4,780.40	3,346.28	1,434.12	1,194.86	836.40	358.46

TCAPM20X	4,780.40	3,346.28	1,434.12	1,194.86	836.40	358.46
TCAPU20X	4,780.40	3,346.28	1,434.12	1,194.86	836.40	358.46
TMB Futures						
TMBH20X	290.70	203.49	87.21	72.75	50.93	21.82
TMBM20X	290.70	203.49	87.21	72.75	50.93	21.82

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	15,048.00
RSS3	158,270.00
RSS3D	158,270.00

***หมายเหตุ**

1. ทั้งนี้ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 16 มีนาคม 2563 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลงและให้ถือเป็นการยกเลิก REF.No.AFC2020/03/004 วันที่ 05 มีนาคม 2563

2. GLOBAL มีผลบังคับใช้วันที่ 12 มีนาคม 2563

ประกาศ ณ วันที่ 12 มีนาคม 2563