

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 20 เมษายน 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 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	105,450.00	73,815.00	31,635.00	26,362.50	18,453.75	7,908.75
10 Baht Gold Futures	21,090.00	14,763.00	6,327.00	5,272.50	3,690.75	1,581.75
GOLD-ONLINE	39,900.00	27,930.00	11,970.00	79,800.00	55,860.00	23,940.00

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับโลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	15,580.00	31,160.00	49,210.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	10,906.00	21,812.00	34,447.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	4,674.00	9,348.00	14,763.00

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	55,290.00	38,703.00	16,587.00	13,822.50	9,675.75	4,146.75
COMM	44,080.00	30,856.00	13,224.00	11,020.00	7,714.00	3,306.00
ENERG	41,458.00	29,020.60	12,437.40	10,364.50	7,255.15	3,109.35
FOOD	16,720.00	11,704.00	5,016.00	4,180.00	2,926.00	1,254.00
ICT	18,924.00	13,246.80	5,677.20	4,731.00	3,311.70	1,419.30
SET 50	32,452.00	22,716.40	9,735.60	8,113.00	5,679.10	2,433.90

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	380.00	266.00	114.00	95.00	66.50	28.50
ADVANC	25,270.00	17,689.00	7,581.00	6,317.50	4,422.25	1,895.25
AEONTS	31,274.00	21,891.80	9,382.20	7,818.50	5,472.95	2,345.55
AMATA	3,344.00	2,340.80	1,003.20	836.00	585.20	250.80
AOT	14,212.00	9,948.40	4,263.60	3,553.00	2,487.10	1,065.90
AP	1,444.00	1,010.80	433.20	361.00	252.70	108.30
BA	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
BANPU	2,546.00	1,782.20	763.80	636.50	445.55	190.95
BAY	2,850.00	1,995.00	855.00	712.50	498.75	213.75
BBL	20,368.00	14,257.60	6,110.40	5,092.00	3,564.40	1,527.60
BCH	3,420.00	2,394.00	1,026.00	855.00	598.50	256.50

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)
BCP	4,560.00	3,192.00	1,368.00	1,140.00	798.00	342.00
BCPG	3,040.00	2,128.00	912.00	760.00	532.00	228.00
BDMS	4,180.00	2,926.00	1,254.00	1,045.00	731.50	313.50
BEAUTY	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
BEC	1,520.00	1,064.00	456.00	380.00	266.00	114.00
BEM	2,014.00	1,409.80	604.20	503.50	352.45	151.05
BGRIM	10,982.00	7,687.40	3,294.60	2,745.50	1,921.85	823.65
BH	27,930.00	19,551.00	8,379.00	6,982.50	4,887.75	2,094.75
BJC	9,880.00	6,916.00	2,964.00	2,470.00	1,729.00	741.00
BLA	2,698.00	1,888.60	809.40	674.50	472.15	202.35
BLAND	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10
BTS (For seriesM21 onwards)	2,175.50	1,522.85	652.65	543.40	380.38	163.02
CBG	17,860.00	12,502.00	5,358.00	4,465.00	3,125.50	1,339.50
CENTEL	4,484.00	3,138.80	1,345.20	1,121.00	784.70	336.30
CHG	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
CK	3,914.00	2,739.80	1,174.20	978.50	684.95	293.55
CKP	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
COM7	5,282.00	3,697.40	1,584.60	1,320.50	924.35	396.15
CPALL	8,132.00	5,692.40	2,439.60	2,033.00	1,423.10	609.90
CPF	6,080.00	4,256.00	1,824.00	1,520.00	1,064.00	456.00
CPN	12,844.00	8,990.80	3,853.20	3,211.00	2,247.70	963.30
DELTA	11,970.00	8,379.00	3,591.00	2,992.50	2,094.75	897.75
DTAC	9,044.00	6,330.80	2,713.20	2,261.00	1,582.70	678.30
EA	8,436.00	5,905.20	2,530.80	2,109.00	1,476.30	632.70
EGCO	58,216.00	40,751.20	17,464.80	14,554.00	10,187.80	4,366.20
EPG	874.00	611.80	262.20	218.50	152.95	65.55
ERW	950.00	665.00	285.00	237.50	166.25	71.25
ESSO	1,520.00	1,064.00	456.00	380.00	266.00	114.00
GFPT	1,558.00	1,090.60	467.40	389.50	272.65	116.85
GLOBAL	3,230.00	2,261.00	969.00	807.50	565.25	242.25
GPSC (For seriesU20 onwards)	15,808.00	11,065.60	4,742.40	3,952.00	2,766.40	1,185.60

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)
GULF (For seriesM20 onwards)	7,182.00	5,027.40	2,154.60	1,795.50	1,256.85	538.65
GUNKUL(For seriesM20 onwards)	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
HANA	7,524.00	5,266.80	2,257.20	1,881.00	1,316.70	564.30
HMPRO	3,230.00	2,261.00	969.00	807.50	565.25	242.25
ICHI	874.00	611.80	262.20	218.50	152.95	65.55
INTUCH	7,676.00	5,373.20	2,302.80	1,919.00	1,343.30	575.70
IRPC	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
ITD	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
IVL	6,536.00	4,575.20	1,960.80	1,634.00	1,143.80	490.20
JAS	836.00	585.20	250.80	209.00	146.30	62.70
KBANK	21,926.00	15,348.20	6,577.80	5,481.50	3,837.05	1,644.45
KCE	5,776.00	4,043.20	1,732.80	1,444.00	1,010.80	433.20
KKP	10,982.00	7,687.40	3,294.60	2,745.50	1,921.85	823.65
KTB	2,318.00	1,622.60	695.40	579.50	405.65	173.85
KTC	8,208.00	5,745.60	2,462.40	2,052.00	1,436.40	615.60
LH	1,444.00	1,010.80	433.20	361.00	252.70	108.30
LPN	836.00	585.20	250.80	209.00	146.30	62.70
MAJOR	4,750.00	3,325.00	1,425.00	1,187.50	831.25	356.25
MEGA	5,130.00	3,591.00	1,539.00	1,282.50	897.75	384.75
MINT	7,600.00	5,320.00	2,280.00	1,900.00	1,330.00	570.00
MTC	13,110.00	9,177.00	3,933.00	3,277.50	2,294.25	983.25
ORI	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
PLANB	1,292.00	904.40	387.60	323.00	226.10	96.90
PRM	1,406.00	984.20	421.80	351.50	246.05	105.45
PSH	2,280.00	1,596.00	684.00	570.00	399.00	171.00
PSL	1,178.00	824.60	353.40	294.50	206.15	88.35
PTG	3,116.00	2,181.20	934.80	779.00	545.30	233.70
PTT	7,790.00	5,453.00	2,337.00	1,947.50	1,363.25	584.25
PTTEP	26,676.00	18,673.20	8,002.80	6,669.00	4,668.30	2,000.70
PTTGC	9,576.00	6,703.20	2,872.80	2,394.00	1,675.80	718.20
QH	380.00	266.00	114.00	95.00	66.50	28.50

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)
RATCH	13,148.00	9,203.60	3,944.40	3,287.00	2,300.90	986.10
ROBINS	15,821.30	11,074.91	4,746.39	2,498.50	1,748.95	749.55
RS	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25
S	1,900.00	1,330.00	570.00	475.00	332.50	142.50
SAMART	342.00	239.40	102.60	85.50	59.85	25.65
SAWAD (For series M20 onwards)	1,444.00	1,010.80	433.20	361.00	252.70	108.30
SCB (For series H21 onwards)	17,100.00	11,970.00	5,130.00	4,275.00	2,992.50	1,282.50
SCC	15,200.00	10,640.00	4,560.00	3,800.00	2,660.00	1,140.00
SGP	65,170.00	45,619.00	19,551.00	16,292.50	11,404.75	4,887.75
SIRI	1,520.00	1,064.00	456.00	380.00	266.00	114.00
SPALI	2,318.00	1,622.60	695.40	579.50	405.65	173.85
SPCG	3,990.00	2,793.00	1,197.00	997.50	698.25	299.25
SPRC	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
STA	2,888.00	2,021.60	866.40	722.00	505.40	216.60
STEC	3,154.00	2,207.80	946.20	788.50	551.95	236.55
STPI	1,368.00	957.60	410.40	342.00	239.40	102.60
SUPER	114.00	79.80	34.20	28.50	19.95	8.55
TASCO	3,610.00	2,527.00	1,083.00	902.50	631.75	270.75
TCAP (For series Z20 onwards)	9,120.00	6,384.00	2,736.00	2,280.00	1,596.00	684.00
THAI	1,330.00	931.00	399.00	332.50	232.75	99.75
THANI	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
THCOM	608.00	425.60	182.40	152.00	106.40	45.60
TISCO	15,314.00	10,719.80	4,594.20	3,828.50	2,679.95	1,148.55
TKN	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25
TMB (For series U20 onwards)	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
TOP	11,058.00	7,740.60	3,317.40	2,764.50	1,935.15	829.35
TPIPL	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
TRUE	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
TTA	722.00	505.40	216.60	180.50	126.35	54.15
TTCL	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
TTW	2,052.00	1,436.40	615.60	513.00	359.10	153.90

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	2,432.00	1,702.40	729.60	608.00	425.60	182.40
TVO	2,964.00	2,074.80	889.20	741.00	518.70	222.30
UNIQ	1,330.00	931.00	399.00	332.50	232.75	99.75
VGI	1,596.00	1,117.20	478.80	399.00	279.30	119.70
VNG	456.00	319.20	136.80	114.00	79.80	34.20
WHA	646.00	452.20	193.80	161.50	113.05	48.45

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	19,190.00	13,433.00	5,757.00	4,797.50	3,358.25	1,439.25
3M BIBOR	5,624.00	3,936.80	1,687.20	11,248.00	7,873.60	3,374.40

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	33,820.00	23,674.00	10,146.00	33,820.00	23,674.00	10,146.00
RSS3D	33,820.00	23,674.00	10,146.00	33,820.00	23,674.00	10,146.00
Spot Month Margin	106,970.00	74,879.00	32,091.00	-	-	-

8. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ USD

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	760.00	190.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	532.00	133.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	228.00	57.00

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)
BTS Futures						
BTSM20X	2,204.00	1,542.80	661.20	550.46	385.32	165.14
BTSU20X	2,204.00	1,542.80	661.20	550.46	385.32	165.14
BTSZ120X	2,204.00	1,542.80	661.20	550.46	385.32	165.14
BTSH20X	2,204.00	1,542.80	661.20	550.46	385.32	165.14
GLOBAL Futures						
GLOBALM20X	3,385.80	2,370.06	1,015.74	846.26	592.38	253.88
GLOBALU20X	3,385.80	2,370.06	1,015.74	846.26	592.38	253.88
GLOBALZ20X	3,385.80	2,370.06	1,015.74	846.26	592.38	253.88
GPSC Futures						
GPSCM20X	17,736.50	12,315.55	5,320.95	4,434.14	3,103.90	1,330.24
GULF Futures						
GULFM20X	35,910.00	25,137.00	10,773.00	8,977.50	6,284.25	2,693.25
GULFU20X	35,910.00	25,137.00	10,773.00	8,977.50	6,284.25	2,693.25
GULFZ20X	35,910.00	25,137.00	10,773.00	8,977.50	6,284.25	2,693.25
GULFH21X	35,910.00	25,137.00	10,773.00	8,977.50	6,284.25	2,693.25
ROBINS Futures						
ROBINSM20X	15,821.30	11,074.91	4,746.39	3,955.13	2,768.59	1,186.54
ROBINSU20X	15,821.30	11,074.91	4,746.39	3,955.13	2,768.59	1,186.54
ROBINSZ20X	15,821.30	11,074.91	4,746.39	3,955.13	2,768.59	1,186.54
SCB Futures						
SCBM20X	16,125.30	11,287.71	4,837.59	4,031.49	2,822.05	1,209.44
SCBU20X	16,125.30	11,287.71	4,837.59	4,031.49	2,822.05	1,209.44
SCBZ20X	16,125.30	11,287.71	4,837.59	4,031.49	2,822.05	1,209.44
TCAP Futures						
TCAPM20X	10,659.00	7,461.30	3,197.70	2,451.00	1,715.70	735.30
TCAPU20X	10,659.00	7,461.30	3,197.70	2,451.00	1,715.70	735.30
TMB Futures						
TMBM20X	290.70	203.49	87.21	72.75	50.93	21.82

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	22,040.00
RSS3	185,250.00
RSS3D	185,250.00

***หมายเหตุ**

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 21 เมษายน 2563 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลงและให้ถือเป็น
การยกเลิก REF.No.AFC2020/03/006 วันที่ 17 เมษายน 2563

ประกาศ ณ วันที่ 20 เมษายน 2563