

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 15 พฤษภาคม 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	91,580.00	64,106.00	27,474.00	22,895.00	16,026.50	6,868.50
10 Baht Gold Futures	18,316.00	12,821.20	5,494.80	4,579.00	3,205.30	1,373.70
GOLD-ONLINE	37,430.00	26,201.00	11,229.00	74,860.00	52,402.00	22,458.00

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับโลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	14,250.00	28,500.00	45,030.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	9,975.00	19,950.00	31,521.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	4,275.00	8,550.00	13,509.00

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	53,390.00	37,373.00	16,017.00	13,347.50	9,343.25	4,004.25
COMM	39,558.00	27,690.60	11,867.40	9,889.50	6,922.65	2,966.85
ENERG	39,292.00	27,504.40	11,787.60	9,823.00	6,876.10	2,946.90
FOOD	15,162.00	10,613.40	4,548.60	3,790.50	2,653.35	1,137.15
ICT	15,390.00	10,773.00	4,617.00	3,847.50	2,693.25	1,154.25
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 ลูกค้ำทั่วไปจะต้องมีหลักประกันไม่ต่ำกว่าค่าพรีเมียม (Premium) ก่อนสั่งซื้อ เพื่อเปิดฐานะสัญญา
- 3.2 กรณีขาย (Short) สัญญา Options ลูกค้ำทั่วไปจะต้องวางหลักประกันขั้นต่ำของออปชั่น 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	21,090.00	14,763.00	6,327.00	5,272.50	3,690.75	1,581.75
AEONTS	31,274.00	21,891.80	9,382.20	7,818.50	5,472.95	2,345.55
AMATA	3,078.00	2,154.60	923.40	769.50	538.65	230.85
AOT	12,654.00	8,857.80	3,796.20	3,163.50	2,214.45	949.05
AP	1,444.00	1,010.80	433.20	361.00	252.70	108.30
BA	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
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	3,990.00	2,793.00	1,197.00	997.50	698.25	299.25
BCPG	2,812.00	1,968.40	843.60	703.00	492.10	210.90
BDMS	4,180.00	2,926.00	1,254.00	1,045.00	731.50	313.50
BEAUTY	646.00	452.20	193.80	161.50	113.05	48.45
BEC	1,520.00	1,064.00	456.00	380.00	266.00	114.00
BEM	1,786.00	1,250.20	535.80	446.50	312.55	133.95
BGRIM	10,830.00	7,581.00	3,249.00	2,707.50	1,895.25	812.25
BH	18,012.00	12,608.40	5,403.60	4,503.00	3,152.10	1,350.90
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)	2,204.00	1,542.80	661.20	551.00	385.70	165.30
CBG	17,708.00	12,395.60	5,312.40	4,427.00	3,098.90	1,328.10
CENTEL	4,902.00	3,431.40	1,470.60	1,225.50	857.85	367.65
CHG	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
CK	3,230.00	2,261.00	969.00	1,187.50	831.25	356.25
CKP	646.00	452.20	193.80	161.50	113.05	48.45
COM7	4,750.00	3,325.00	1,425.00	1,187.50	831.25	356.25
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	12,084.00	8,458.80	3,625.20	3,021.00	2,114.70	906.30
DELTA	11,970.00	8,379.00	3,591.00	2,992.50	2,094.75	897.75
DTAC	8,398.00	5,878.60	2,519.40	2,099.50	1,469.65	629.85
EA	8,094.00	5,665.80	2,428.20	2,023.50	1,416.45	607.05
EGCO	58,216.00	40,751.20	17,464.80	14,554.00	10,187.80	4,366.20
EPG	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
ERW	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
ESSO	1,520.00	1,064.00	456.00	380.00	266.00	114.00
GFPT	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
GLOBAL	3,230.00	2,261.00	969.00	807.50	565.25	242.25
GPSC (For seriesU20 onwards)	14,744.00	10,320.80	4,423.20	3,686.00	2,580.20	1,105.80

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)	6,992.00	4,894.40	2,097.60	1,748.00	1,223.60	524.40
GUNKUL	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
HANA	7,106.00	4,974.20	2,131.80	1,776.50	1,243.55	532.95
HMPRO	3,230.00	2,261.00	969.00	807.50	565.25	242.25
ICHI	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
INTUCH	7,030.00	4,921.00	2,109.00	1,757.50	1,230.25	527.25
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	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
KBANK	21,926.00	15,348.20	6,577.80	5,481.50	3,837.05	1,644.45
KCE	5,472.00	3,830.40	1,641.60	1,368.00	957.60	410.40
KKP	10,450.00	7,315.00	3,135.00	2,612.50	1,828.75	783.75
KTB	2,318.00	1,622.60	695.40	579.50	405.65	173.85
KTC	8,056.00	5,639.20	2,416.80	2,014.00	1,409.80	604.20
LH	1,330.00	931.00	399.00	332.50	232.75	99.75
LPN	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
MAJOR	4,750.00	3,325.00	1,425.00	1,187.50	831.25	356.25
MEGA	5,358.00	3,750.60	1,607.40	1,339.50	937.65	401.85
MINT	7,600.00	5,320.00	2,280.00	1,900.00	1,330.00	570.00
MTC	12,350.00	8,645.00	3,705.00	3,087.50	2,161.25	926.25
ORI	950.00	665.00	285.00	237.50	166.25	71.25
PLANB	1,292.00	904.40	387.60	323.00	226.10	96.90
PRM	1,520.00	1,064.00	456.00	380.00	266.00	114.00
PSH	1,862.00	1,303.40	558.60	465.50	325.85	139.65
PSL	1,254.00	877.80	376.20	313.50	219.45	94.05
PTG	2,888.00	2,021.60	866.40	722.00	505.40	216.60
PTT	7,790.00	5,453.00	2,337.00	1,947.50	1,363.25	584.25
PTTEP	22,990.00	16,093.00	6,897.00	5,747.50	4,023.25	1,724.25
PTTGC	9,462.00	6,623.40	2,838.60	2,365.50	1,655.85	709.65
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	11,400.00	7,980.00	3,420.00	2,850.00	1,995.00	855.00
ROBINS	15,821.30	11,074.91	4,746.39	2,498.50	1,748.95	749.55
RS	2,356.00	1,649.20	706.80	589.00	412.30	176.70
S	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
SAMART	1,140.00	798.00	342.00	285.00	199.50	85.50
SAWAD (For series M20 onwards)	13,908.00	9,735.60	4,172.40	3,477.00	2,433.90	1,043.10
SCB (For series H21 onwards)	12,920.00	9,044.00	3,876.00	3,230.00	2,261.00	969.00
SCC	6,080.00	4,256.00	1,824.00	15,200.00	10,640.00	4,560.00
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	2,166.00	1,516.20	649.80	541.50	379.05	162.45
SPCG	3,990.00	2,793.00	1,197.00	997.50	698.25	299.25
SPRC	1,900.00	1,330.00	570.00	475.00	332.50	142.50
STA	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
STEC	2,660.00	1,862.00	798.00	665.00	465.50	199.50
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)	7,334.00	5,133.80	2,200.20	1,833.50	1,283.45	550.05
THAI	2,318.00	1,622.60	695.40	579.50	405.65	173.85
THANI	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
THCOM	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
TISCO	13,262.00	9,283.40	3,978.60	3,315.50	2,320.85	994.65
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	10,298.00	7,208.60	3,089.40	2,574.50	1,802.15	772.35
TPIPL	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
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	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
TTW	1,596.00	1,117.20	478.80	399.00	279.30	119.70

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	1,824.00	1,276.80	547.20	456.00	319.20	136.80
TVO	2,850.00	1,995.00	855.00	712.50	498.75	213.75
UNIQ	1,520.00	1,064.00	456.00	380.00	266.00	114.00
VGI	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
VNG	646.00	452.20	193.80	161.50	113.05	48.45
WHA	608.00	425.60	182.40	152.00	106.40	45.60

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	18,430.00	12,901.00	5,529.00	4,607.50	3,225.25	1,382.25
3M BIBOR	3,800.00	2,660.00	1,140.00	7,600.00	5,320.00	2,280.00

7. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้าอย่างแผ่นรมควันชั้น 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	26,600.00	18,620.00	7,980.00	26,600.00	18,620.00	7,980.00
RSS3D	26,600.00	18,620.00	7,980.00	26,600.00	18,620.00	7,980.00
Spot Month Margin	84,170.00	58,919.00	25,251.00	-	-	-

8. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ USD

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	646.00	161.50
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	452.20	113.05
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	193.80	48.45

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	2,232.50	1,562.72	669.75	558.16	390.71	167.45
BTSU20X	2,232.50	1,562.72	669.75	558.16	390.71	167.45
BTSZ120X	2,232.50	1,562.72	669.75	558.16	390.71	167.45
BTSH21X	2,232.50	1,562.72	669.75	558.16	390.71	167.45
COM7 Futures						
COM7M20X	4,793.70	3,355.59	1,438.11	1,198.19	838.73	359.46
COM7U20X	4,793.70	3,355.59	1,438.11	1,198.19	838.73	359.46
COM7Z20X	4,793.70	3,355.59	1,438.11	1,198.19	838.73	359.46
COM7H21X	4,793.70	3,355.59	1,438.11	1,198.19	838.73	359.46
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	16,543.30	11,580.31	4,962.99	4,135.69	2,894.98	1,240.71
GULF Futures						
GULFM20X	35,960.00	24,472.00	10,488.00	8,740.00	6,118.00	2,622.00
GULFU20X	35,960.00	24,472.00	10,488.00	8,740.00	6,118.00	2,622.00
GULFZ20X	35,960.00	24,472.00	10,488.00	8,740.00	6,118.00	2,622.00
GULFH21X	35,960.00	24,472.00	10,488.00	8,740.00	6,118.00	2,622.00
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	13,022.60	9,115.82	3,906.78	3,255.84	2,279.09	976.75
SCBU20X	13,022.60	9,115.82	3,906.78	3,255.84	2,279.09	976.75
SCBZ20X	13,022.60	9,115.82	3,906.78	3,255.84	2,279.09	976.75

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)
TCAP Futures						
TCAPM20X	7,885.00	5,519.50	2,365.50	1,971.01	1,379.71	591.30
TCAPU20X	7,885.00	5,519.50	2,365.50	1,971.01	1,379.71	591.30
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	20,159.00
RSS3	145,730.00
RSS3D	145,730.00

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 20 พฤษภาคม 2563 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลงและให้ถือเป็นการยกเลิก REF.No.AFC2020/04/010 วันที่ 29 เมษายน 2563

ประกาศ ณ วันที่ 19 พฤษภาคม 2563