

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 07 กรกฎาคม 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	57,418.00	40,192.60	17,225.40	14,354.50	10,048.15	4,306.35
10 Baht Gold Futures	11,483.60	8,038.52	3,445.08	2,870.90	2,009.63	861.27
GOLD-ONLINE	25,308.00	17,715.60	7,592.40	50,616.00	35,431.20	15,184.80

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ โลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	9,082.00	18,164.00	28,690.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	6,357.40	12,714.80	20,083.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	2,724.60	5,449.20	8,607.00

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	45,600.00	31,920.00	13,680.00	11,400.00	7,980.00	3,420.00
COMM	27,740.00	19,418.00	8,322.00	6,935.00	4,854.50	2,080.50
ENERG	24,130.00	16,891.00	7,239.00	6,032.50	4,222.75	1,809.75
FOOD	9,120.00	6,384.00	2,736.00	2,280.00	1,596.00	684.00
ICT	8,778.00	6,144.60	2,633.40	2,194.50	1,536.15	658.35
SET 50	17,442.00	12,209.40	5,232.60	4,360.50	3,052.35	1,308.15

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	456.00	319.20	136.80	114.00	79.80	34.20
ADVANC	14,022.00	9,815.40	4,206.60	3,505.50	2,453.85	1,051.65
AEONTS	20,710.00	14,497.00	6,213.00	5,177.50	3,624.25	1,553.25
AMATA	2,850.00	1,995.00	855.00	712.50	498.75	213.75
AOT	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
AP	1,102.00	771.40	330.60	275.50	192.85	82.65
BA	1,330.00	931.00	399.00	332.50	232.75	99.75
BANPU	2,546.00	1,782.20	763.80	636.50	445.55	190.95
BAY	3,800.00	2,660.00	1,140.00	950.00	665.00	285.00
BBL	20,330.00	14,231.00	6,099.00	5,082.50	3,557.75	1,524.75
BCH	1,786.00	1,250.20	535.80	446.50	312.55	133.95

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	3,344.00	2,340.80	1,003.20	836.00	585.20	250.80
BCPG	1,862.00	1,303.40	558.60	465.50	325.85	139.65
BDMS	2,470.00	1,729.00	741.00	617.50	432.25	185.25
BEAUTY	342.00	239.40	102.60	85.50	59.85	25.65
BEC	1,178.00	824.60	353.40	294.50	206.15	88.35
BEM	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
BGRIM	8,018.00	5,612.60	2,405.40	2,004.50	1,403.15	601.35
BH	13,148.00	9,203.60	3,944.40	3,287.00	2,300.90	986.10
BJC	5,510.00	3,857.00	1,653.00	1,377.50	964.25	413.25
BLA	2,128.00	1,489.60	638.40	532.00	372.40	159.60
BLAND	152.00	106.40	45.60	38.00	26.60	11.40
BPP	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
BTS (For seriesM21 onwards)	1,254.00	877.80	376.20	313.50	219.45	94.05
CBG	14,326.00	10,028.20	4,297.80	3,581.50	2,507.05	1,074.45
CENTEL	4,522.00	3,165.40	1,356.60	1,130.50	791.35	339.15
CHG	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
CK	2,698.00	1,888.60	809.40	674.50	472.15	202.35
CKP	532.00	372.40	159.60	133.00	93.10	39.90
COM7 (For seriesM21 onwards)	5,054.00	3,537.80	1,516.20	1,263.50	884.45	379.05
CPALL	4,712.00	3,298.40	1,413.60	1,178.00	824.60	353.40
CPF	3,610.00	2,527.00	1,083.00	902.50	631.75	270.75
CPN	7,752.00	5,426.40	2,325.60	1,938.00	1,356.60	581.40
DELTA	8,474.00	5,931.80	2,542.20	2,118.50	1,482.95	635.55
DTAC	5,814.00	4,069.80	1,744.20	1,453.50	1,017.45	436.05
EA	5,434.00	3,803.80	1,630.20	1,358.50	950.95	407.55
EASTW	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
EGCO	30,780.00	21,546.00	9,234.00	7,695.00	5,386.50	2,308.50
EPG	722.00	505.40	216.60	180.50	126.35	54.15
ERW	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
ESSO	1,748.00	1,223.60	524.40	437.00	305.90	131.10
GFPT	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25

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)
GLOBAL(For seriesH21 onwards)	2,432.00	1,702.40	729.60	608.00	425.60	182.40
GPSC	10,488.00	7,341.60	3,146.40	2,622.00	1,835.40	786.60
GULF (For seriesM21 onwards)	4,826.00	3,378.20	1,447.80	1,206.50	844.55	361.95
GUNKUL	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
HANA	4,750.00	3,325.00	1,425.00	1,187.50	831.25	356.25
HMPRO	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
ICHI	1,254.00	877.80	376.20	313.50	219.45	94.05
INTUCH	4,712.00	3,298.40	1,413.60	1,178.00	824.60	353.40
IRPC	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
ITD	190.00	133.00	57.00	47.50	33.25	14.25
IVL	5,016.00	3,511.20	1,504.80	1,254.00	877.80	376.20
JAS	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
JMT	3,724.00	2,606.80	1,117.20	931.00	651.70	279.30
KBANK	18,582.00	13,007.40	5,574.60	4,645.50	3,251.85	1,393.65
KCE	3,914.00	2,739.80	1,174.20	978.50	684.95	293.55
KKP	7,562.00	5,293.40	2,268.60	1,890.50	1,323.35	567.15
KTB	1,520.00	1,064.00	456.00	380.00	266.00	114.00
KTC	5,738.00	4,016.60	1,721.40	1,434.50	1,004.15	430.35
LH	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
LPN	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
M	6,194.00	4,335.80	1,858.20	1,548.50	1,083.95	464.55
MAJOR	2,964.00	2,074.80	889.20	741.00	518.70	222.30
MBK	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25
MEGA	5,548.00	3,883.60	1,664.40	1,387.00	970.90	416.10
MINT (For series M21 onwards)	4,332.00	3,032.40	1,299.60	1,083.00	758.10	324.90
MTC	9,120.00	6,384.00	2,736.00	2,280.00	1,596.00	684.00
ORI	950.00	665.00	285.00	237.50	166.25	71.25
OSP	4,940.00	3,458.00	1,482.00	1,235.00	864.50	370.50
PLANB	1,254.00	877.80	376.20	313.50	219.45	94.05
PRM	1,406.00	984.20	421.80	351.50	246.05	105.45
PSH	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)
PSL	1,368.00	957.60	410.40	342.00	239.40	102.60
PTG	2,774.00	1,941.80	832.20	693.50	485.45	208.05
PTT	5,168.00	3,617.60	1,550.40	1,292.00	904.40	387.60
PTTEP	16,530.00	11,571.00	4,959.00	4,132.50	2,892.75	1,239.75
PTTGC	8,322.00	5,825.40	2,496.60	2,080.50	1,456.35	624.15
QH	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
RATCH	6,612.00	4,628.40	1,983.60	1,653.00	1,157.10	495.90
ROBINS U20X Z20X	12,633.10	8,843.17	3,789.93	1,995.00	1,396.50	598.50
RS	2,622.00	1,835.40	786.60	655.50	458.85	196.65
S	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10
SAMART	1,140.00	798.00	342.00	285.00	199.50	85.50
SAWAD	10,032.00	7,022.40	3,009.60	2,508.00	1,755.60	752.40
SCB (For series H21 onwards)	13,452.00	9,416.40	4,035.60	3,363.00	2,354.10	1,008.90
SCC	37,126.00	25,988.20	11,137.80	9,281.50	6,497.05	2,784.45
SGP	1,292.00	904.40	387.60	323.00	226.10	96.90
SIRI	190.00	133.00	57.00	47.50	33.25	14.25
SPALI	2,166.00	1,516.20	649.80	541.50	379.05	162.45
SPCG	1,824.00	1,276.80	547.20	456.00	319.20	136.80
SPRC	1,368.00	957.60	410.40	342.00	239.40	102.60
STA	6,536.00	4,575.20	1,960.80	1,634.00	1,143.80	490.20
STEC	2,356.00	1,649.20	706.80	589.00	412.30	176.70
STPI	874.00	611.80	262.20	218.50	152.95	65.55
SUPER	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10
TASCO	5,928.00	4,149.60	1,778.40	1,482.00	1,037.40	444.60
TCAP (For series Z20 onwards)	5,928.00	4,149.60	1,778.40	1,482.00	1,037.40	444.60
THAI	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
THANI	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
THCOM	1,368.00	957.60	410.40	342.00	239.40	102.60
THG	1,824.00	1,276.80	547.20	456.00	319.20	136.80
TISCO	10,792.00	7,554.40	3,237.60	2,698.00	1,888.60	809.40
TKN	2,356.00	1,649.20	706.80	589.00	412.30	176.70

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)
TMB	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10
TOA	4,522.00	3,165.40	1,356.60	1,130.50	791.35	339.15
TOP	8,246.00	5,772.20	2,473.80	2,061.50	1,443.05	618.45
TPIPL	152.00	106.40	45.60	38.00	26.60	11.40
TPIPP	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
TQM	22,078.00	15,454.60	6,623.40	5,519.50	3,863.65	1,655.85
TRUE	494.00	345.80	148.20	123.50	86.45	37.05
TTA	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
TTCL	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
TTW	950.00	665.00	285.00	237.50	166.25	71.25
TU	1,558.00	1,090.60	467.40	389.50	272.65	116.85
TVO	2,432.00	1,702.40	729.60	608.00	425.60	182.40
UNIQ	1,178.00	824.60	353.40	294.50	206.15	88.35
VGI	1,406.00	984.20	421.80	351.50	246.05	105.45
VNG	646.00	452.20	193.80	161.50	113.05	48.45
VNT	3,040.00	2,128.00	912.00	760.00	532.00	228.00
WHA	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
WHAUP	494.00	345.80	148.20	123.50	86.45	37.05

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	9,804.00	6,862.80	2,941.20	2,451.00	1,715.70	735.30
3M BIBOR	3,876.00	2,713.20	1,162.80	7,752.00	5,426.40	2,325.60

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	24,586.00	17,210.20	7,375.80	24,586.00	17,210.20	7,375.80
RSS3D	24,586.00	17,210.20	7,375.80	24,586.00	17,210.20	7,375.80
Spot Month Margin	77,710.00	54,397.00	23,313.00	-	-	-

8. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ USD

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	532.00	133.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	372.40	93.10
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	159.60	39.90

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						
BTSU20X	1,271.10	889.77	381.33	317.57	222.29	95.28
BTSZ120X	1,271.10	889.77	381.33	317.57	222.29	95.28
BTSH21X	1,271.10	889.77	381.33	317.57	222.29	95.28
COM7 Futures						
COM7U20X	5,099.60	3,569.72	1,529.88	1,274.87	892.40	382.47
COM7Z20X	5,099.60	3,569.72	1,529.88	1,274.87	892.40	382.47
COM7H21X	5,099.60	3,569.72	1,529.88	1,274.87	892.40	382.47
GLOBAL Futures						
GLOBALU20X	2,547.90	1,783.53	764.37	637.18	446.02	191.16
GLOBALZ20X	2,547.90	1,783.53	764.37	637.18	446.02	191.16
GULF Futures						
GULFU20X	24,130.00	16,891.00	7,239.00	6,032.50	4,222.75	1,809.75
GULFZ20X	24,130.00	16,891.00	7,239.00	6,032.50	4,222.75	1,809.75

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)
GULF Futures						
GULFH21X	24,130.00	16,891.00	7,239.00	6,032.50	4,222.75	1,809.75
MINT Futures						
MINTU20X	1,608.60	1,126.02	482.58	1,091.66	764.16	327.50
MINTZ20X	1,608.60	1,126.02	482.58	1,091.66	764.16	327.50
MINTH21X	1,608.60	1,126.02	482.58	1,091.66	764.16	327.50
ROBINS Futures						
ROBINSU20X	12,633.10	8,843.17	3,789.93	3,158.08	2,210.65	947.43
ROBINSZ20X	12,633.10	8,843.17	3,789.93	3,158.08	2,210.65	947.43
SCB Futures						
SCBU20X	13,560.30	9,492.21	4,068.09	3,389.90	2,372.93	1,016.97
SCBZ20X	13,560.30	9,492.21	4,068.09	3,389.90	2,372.93	1,016.97
TCAP Futures						
TCAPU20X	6,372.60	4,460.82	1,911.78	1,593.15	1,115.20	477.95

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	12,844.00
RSS3	134,710.00
RSS3D	134,710.00

ทั้งนี้ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 13 กรกฎาคม 2563 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลงและให้ถือเป็นกรณียกเลิก REF.No.AFC2020/06/013 วันที่ 29 มิถุนายน 2563

ประกาศ ณ วันที่ 08 กรกฎาคม 2563