

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 09 กันยายน 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	92,910.00	65,037.00	27,873.00	23,227.50	16,259.25	6,968.25
10 Baht Gold Futures	18,582.00	13,007.40	5,574.60	4,645.50	3,251.85	1,393.65
GOLD-ONLINE	39,330.00	27,531.00	11,799.00	78,660.00	55,062.00	23,598.00

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ โลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	12,844.00	25,688.00	40,660.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	8,990.80	17,981.60	28,462.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	3,853.20	7,706.40	12,198.00

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	36,480.00	25,536.00	10,944.00	9,120.00	6,384.00	2,736.00
COMM	20,520.00	14,364.00	6,156.00	5,130.00	3,591.00	1,539.00
ENERG	15,390.00	10,773.00	4,617.00	3,847.50	2,693.25	1,154.25
FOOD	7,334.00	5,133.80	2,200.20	1,833.50	1,283.45	550.05
ICT	8,436.00	5,905.20	2,530.80	2,109.00	1,476.30	632.70
SET 50	11,134.00	7,793.80	3,340.20	2,783.50	1,948.45	835.05

4. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า SET 50 Index Options

- 3.1 กรณีซื้อ (Long) สัญญา Options ลูกค้าย่อมไปจะต้องมีหลักประกันไม่ต่ำกว่าค่าพรีเมียม (Premium) ก่อนสั่งซื้อ เพื่อเปิดฐานะสัญญา
- 3.2 กรณีขาย (Short) สัญญา Options ลูกค้าย่อมไปจะต้องวางหลักประกันขั้นต่ำของออปชั่น 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	342.00	239.40	102.60	85.50	59.85	25.65
ADVANC	13,604.00	9,522.80	4,081.20	3,401.00	2,380.70	1,020.30
AEONTS	13,338.00	9,336.60	4,001.40	3,334.50	2,334.15	1,000.35
AMATA	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25
AOT	6,574.00	4,601.80	1,972.20	1,643.50	1,150.45	493.05
AP	836.00	585.20	250.80	209.00	146.30	62.70
BA	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
BANPU	836.00	585.20	250.80	209.00	146.30	62.70
BAY	2,850.00	1,995.00	855.00	712.50	498.75	213.75
BBL	20,330.00	14,231.00	6,099.00	5,082.50	3,557.75	1,524.75
BCH	1,254.00	877.80	376.20	313.50	219.45	94.05
BCP	2,546.00	1,782.20	763.80	636.50	445.55	190.95

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)
BCPG	2,356.00	1,649.20	706.80	589.00	412.30	176.70
BDMS	1,672.00	1,170.40	501.60	418.00	292.60	125.40
BEAUTY	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
BEC	722.00	505.40	216.60	180.50	126.35	54.15
BEM	722.00	505.40	216.60	180.50	126.35	54.15
BGRIM	6,194.00	4,335.80	1,858.20	1,548.50	1,083.95	464.55
BH	11,476.00	8,033.20	3,442.80	2,869.00	2,008.30	860.70
BJC	3,800.00	2,660.00	1,140.00	950.00	665.00	285.00
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	1,520.00	1,064.00	456.00	380.00	266.00	114.00
BTS (M21 onwards)	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
CBG	14,326.00	10,028.20	4,297.80	3,581.50	2,507.05	1,074.45
CENTEL	3,990.00	2,793.00	1,197.00	997.50	698.25	299.25
CHG	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
CK	2,204.00	1,542.80	661.20	551.00	385.70	165.30
CKP	950.00	665.00	285.00	237.50	166.25	71.25
COM7 (M21 onwards)	6,422.00	4,495.40	1,926.60	1,605.50	1,123.85	481.65
CPALL	4,408.00	3,085.60	1,322.40	1,102.00	771.40	330.60
CPF	3,078.00	2,154.60	923.40	769.50	538.65	230.85
CPN	5,358.00	3,750.60	1,607.40	1,339.50	937.65	401.85
DELTA	26,220.00	18,354.00	7,866.00	6,555.00	4,588.50	1,966.50
DTAC	4,180.00	2,926.00	1,254.00	1,045.00	731.50	313.50
EA	5,928.00	4,149.60	1,778.40	1,482.00	1,037.40	444.60
EASTW	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
EGCO	20,140.00	14,098.00	6,042.00	5,035.00	3,524.50	1,510.50
EPG	608.00	425.60	182.40	152.00	106.40	45.60
ERW	646.00	452.20	193.80	161.50	113.05	48.45
ESSO	1,254.00	877.80	376.20	313.50	219.45	94.05
GFPT	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
GLOBAL (H21 onwards)	2,470.00	1,729.00	741.00	617.50	432.25	185.25

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)
GPSC	8,778.00	6,144.60	2,633.40	2,194.50	1,536.15	658.35
GULF (U21 onwards)	3,876.00	2,713.20	1,162.80	969.00	678.30	290.70
GUNKUL	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
HANA	7,714.00	5,399.80	2,314.20	1,928.50	1,349.95	578.55
HMPRO	1,596.00	1,117.20	478.80	399.00	279.30	119.70
ICHI	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
INTUCH	4,560.00	3,192.00	1,368.00	1,140.00	798.00	342.00
IRPC	342.00	239.40	102.60	85.50	59.85	25.65
ITD	190.00	133.00	57.00	47.50	33.25	14.25
IVL	4,104.00	2,872.80	1,231.20	1,026.00	718.20	307.80
JAS	456.00	319.20	136.80	114.00	79.80	34.20
JMT	5,358.00	3,750.60	1,607.40	1,339.50	937.65	401.85
KBANK	18,582.00	13,007.40	5,574.60	4,645.50	3,251.85	1,393.65
KCE	5,320.00	3,724.00	1,596.00	1,330.00	931.00	399.00
KKP	4,560.00	3,192.00	1,368.00	1,140.00	798.00	342.00
KTB	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
KTC	3,382.00	2,367.40	1,014.60	845.50	591.85	253.65
LH	722.00	505.40	216.60	180.50	126.35	54.15
LPN	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
M	4,332.00	3,032.40	1,299.60	1,083.00	758.10	324.90
MAJOR	2,356.00	1,649.20	706.80	589.00	412.30	176.70
MBK	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25
MEGA	5,092.00	3,564.40	1,527.60	1,273.00	891.10	381.90
MINT (M21 onwards)	3,458.00	2,420.60	1,037.40	864.50	605.15	259.35
MTC	6,460.00	4,522.00	1,938.00	1,615.00	1,130.50	484.50
ORI	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
OSP	4,636.00	3,245.20	1,390.80	1,159.00	811.30	347.70
PLANB	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
PRM	1,520.00	1,064.00	456.00	380.00	266.00	114.00
PSH	1,254.00	877.80	376.20	313.50	219.45	94.05
PSL	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ ตราสารทุน	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาภาพ (MM)	หลักประกัน บังคับปิด สัญญา (FM)
PTG	2,812.00	1,968.40	843.60	703.00	492.10	210.90
PTT	3,420.00	2,394.00	1,026.00	855.00	598.50	256.50
PTTEP	10,222.00	7,155.40	3,066.60	2,555.50	1,788.85	766.65
PTTGC	6,156.00	4,309.20	1,846.80	1,539.00	1,077.30	461.70
QH	190.00	133.00	57.00	38.00	26.60	11.40
RATCH	5,358.00	3,750.60	1,607.40	1,339.50	937.65	401.85
ROBINS (U20X Z20X)	9,264.40	6,485.08	2,779.32	1,463.00	1,024.10	438.90
RS	2,660.00	1,862.00	798.00	665.00	465.50	199.50
S	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10
SAMART	836.00	585.20	250.80	209.00	146.30	62.70
SAWAD	7,182.00	5,027.40	2,154.60	1,795.50	1,256.85	538.65
SCB (H21 onwards)	13,452.00	9,416.40	4,035.60	3,363.00	2,354.10	1,008.90
SCC	27,740.00	19,418.00	8,322.00	6,935.00	4,854.50	2,080.50
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	2,128.00	1,489.60	638.40	532.00	372.40	159.60
SPCG	2,470.00	1,729.00	741.00	617.50	432.25	185.25
SPRC	1,254.00	877.80	376.20	313.50	219.45	94.05
STA	4,788.00	3,351.60	1,436.40	1,197.00	837.90	359.10
STEC	2,052.00	1,436.40	615.60	513.00	359.10	153.90
STPI	646.00	452.20	193.80	161.50	113.05	48.45
SUPER	152.00	106.40	45.60	38.00	26.60	11.40
TASCO	3,914.00	2,739.80	1,174.20	978.50	684.95	293.55
TCAP (Z20 onwards)	4,408.00	3,085.60	1,322.40	1,102.00	771.40	330.60
THAI	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
THANI (U21 onwards)*	722.00	505.40	216.60	180.50	126.35	54.15
THCOM	1,330.00	931.00	399.00	332.50	232.75	99.75
THG	1,672.00	1,170.40	501.60	418.00	292.60	125.40
TISCO	8,094.00	5,665.80	2,428.20	2,023.50	1,416.45	607.05
TKN	2,356.00	1,649.20	706.80	589.00	412.30	176.70
TMB	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)
TOA	4,484.00	3,138.80	1,345.20	1,121.00	784.70	336.30
TOP	6,118.00	4,282.60	1,835.40	1,529.50	1,070.65	458.85
TPIPL	152.00	106.40	45.60	38.00	26.60	11.40
TIPIP	456.00	319.20	136.80	114.00	79.80	34.20
TQM	23,370.00	16,359.00	7,011.00	5,842.50	4,089.75	1,752.75
TRUE	380.00	266.00	114.00	95.00	66.50	28.50
TTA	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
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	1,824.00	1,276.80	547.20	456.00	319.20	136.80
TVO	2,964.00	2,074.80	889.20	741.00	518.70	222.30
UNIQ	608.00	425.60	182.40	152.00	106.40	45.60
VGI	1,254.00	877.80	376.20	313.50	219.45	94.05
VNG	380.00	266.00	114.00	95.00	66.50	28.50
VNT	2,660.00	1,862.00	798.00	665.00	465.50	199.50
WHA	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
WHAUP	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35

6. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าเกี่ยวกับอัตราดอกเบี้ย (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	7,030.00	4,921.00	2,109.00	1,757.50	1,230.25	527.25
3M BIBOR	3,648.00	2,553.60	1,094.40	7,296.00	5,107.20	2,188.80

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	34,770.00	24,339.00	15,618.00	34,770.00	24,339.00	15,618.00
RSS3D	34,770.00	24,339.00	15,618.00	34,770.00	24,339.00	15,618.00
Spot Month Margin	110,010.00	77,007.00	33,003.00	-	-	-

8. 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

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	1,039.30	727.51	311.79	259.83	181.88	77.95
BTSZ120X	1,039.30	727.51	311.79	259.83	181.88	77.95
BTSH21X	1,039.30	727.51	311.79	259.83	181.88	77.95
COM7 Futures						
COM7U20X	6,479.00	4,535.30	1,943.70	1,619.95	1,133.97	485.98
COM7Z20X	6,479.00	4,535.30	1,943.70	1,619.95	1,133.97	485.98
COM7H21X	6,479.00	4,535.30	1,943.70	1,619.95	1,133.97	485.98
GLOBAL Futures						
GLOBALU20X	2,587.80	1,811.46	776.34	647.14	453.00	194.14
GLOBALZ20X	2,587.80	1,811.46	776.34	647.14	453.00	194.14
GULF Futures						
GULFU20Y	19,600.40	13,720.28	5,880.12	4,900.23	3,430.16	1,470.07
GULFZ20Y	19,600.40	13,720.28	5,880.12	4,900.23	3,430.16	1,470.07
GULFH21Y	19,600.40	13,720.28	5,880.12	4,900.23	3,430.16	1,470.07

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						
GULFM21X	3,917.80	2,742.46	1,175.34	979.66	685.76	293.90
MINT Futures						
MINTU20X	3,486.50	2,440.55	1,045.95	871.42	609.95	261.43
MINTZ20X	3,486.50	2,440.55	1,045.95	871.42	609.95	261.43
MINTH21X	3,486.50	2,440.55	1,045.95	871.42	609.95	261.43
ROBINS Futures						
ROBINSU20X	9,264.40	6,485.08	2,779.32	2,315.93	1,621.15	694.78
ROBINSZ20X	9,264.40	6,485.08	2,779.32	2,315.93	1,621.15	694.78
SCB Futures						
SCBU20X	11,951.00	8,365.70	3,585.30	2,987.71	2,091.40	896.31
SCBZ20X	11,951.00	8,365.70	3,585.30	2,987.71	2,091.40	896.31
TCAP Futures						
TCAPU20X	4,738.60	3,317.02	1,421.58	1,184.65	829.26	355.39
THANI Futures						
THANIU20X	969.00	678.30	290.70	242.23	169.56	72.67
THANIZ20X	969.00	678.30	290.70	242.23	169.56	72.67
THANIH21X	969.00	678.30	290.70	242.23	169.56	72.67
THANIM21X	969.00	678.30	290.70	242.23	169.56	72.67

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	18,164.00
RSS3	190,380.00
RSS3D	190,380.00

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 15 กันยายน 2563 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลงและให้ถือเป็น
การยกเลิก REF.No.AFC2020/08/021 วันที่ 27 สิงหาคม 2563

ประกาศ ณ วันที่ 11 กันยายน 2563