

REF.No.CAF2020/01/002

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 26 ธันวาคม 2562 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	39,900.00	27,930.00	11,970.00	9,975.00	6,982.50	2,992.50
10 Baht Gold Futures	7,980.00	5,586.00	2,394.00	1,995.00	1,396.50	598.50
GOLD-ONLINE	19,000.00	13,300.00	5,700.00	38,000.00	26,600.00	11,400.00

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ โลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	6,650.00	13,300.00	21,033.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	4,655.00	9,310.00	14,723.10
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	1,995.00	3,990.00	6,909.90

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	32,870.00	23,009.00	9,861.00	8,217.50	5,752.25	2,465.25
COMM	19,456.00	13,619.20	5,836.80	4,864.00	3,404.80	1,459.20
ENERG	10,982.00	7,687.40	3,294.60	2,745.50	1,921.85	823.65
FOOD	6,270.00	4,389.00	1,881.00	1,567.50	1,097.25	470.25
ICT	9,690.00	6,783.00	2,907.00	2,422.50	1,695.75	726.75
SET 50	9,500.00	6,650.00	2,850.00	2,375.00	1,662.50	712.50

4. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า SET 50 Index Options

3.1 กรณีซื้อ (Long) สัญญา Options ลูกค้าทั่วไปจะต้องมีหลักประกันไม่ต่ำกว่าค่าพรีเมียม (Premium) ก่อนสั่งซื้อ เพื่อเปิดฐานะสัญญา

3.2 กรณีขาย (Short) สัญญา Options ลูกค้าทั่วไปจะต้องวางหลักประกันขั้นต่ำของออพชั่น ตามที่ประกาศของ บริษัทหลักทรัพย์กักบัญชี (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	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
ADVANC	14,250.00	9,975.00	4,275.00	3,562.50	2,493.75	1,068.75
AEONTS	20,710.00	14,497.00	6,213.00	5,177.50	3,624.25	1,553.25
AMATA	2,470.00	1,729.00	741.00	617.50	432.25	185.25
AOT	4,598.00	3,218.60	1,379.40	1,149.50	804.65	344.85
AP	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
BA	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
BANPU	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
BAY	1,976.00	1,383.20	592.80	494.00	345.80	148.20
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	3,268.00	2,287.60	980.40	817.00	571.90	245.10
BCPG	1,596.00	1,117.20	478.80	399.00	279.30	119.70
BDMS	1,824.00	1,276.80	547.20	456.00	319.20	136.80
BEAUTY	456.00	319.20	136.80	114.00	79.80	34.20
BEC	836.00	585.20	250.80	209.00	146.30	62.70
BEM	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
BGRIM	6,270.00	4,389.00	1,881.00	1,567.50	1,097.25	470.25
BH	18,050.00	12,635.00	5,415.00	4,512.50	3,158.75	1,353.75
BJC	4,408.00	3,085.60	1,322.40	1,102.00	771.40	330.60
BLA	2,128.00	1,489.60	638.40	532.00	372.40	159.60
BLAND	114.00	79.80	34.20	28.50	19.95	8.55
BTS	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
CBG	10,336.00	7,235.20	3,100.80	2,584.00	1,808.80	775.20
CENTEL	3,496.00	2,447.20	1,048.80	874.00	611.80	262.20
CHG	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
CK	2,014.00	1,409.80	604.20	503.50	352.45	151.05
CKP	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
COM7	2,660.00	1,862.00	798.00	665.00	465.50	199.50
CPALL	5,472.00	3,830.40	1,641.60	1,368.00	957.60	410.40
CPF	2,166.00	1,516.20	649.80	541.50	379.05	162.45
CPN	5,016.00	3,511.20	1,504.80	1,254.00	877.80	376.20
DELTA	8,550.00	5,985.00	2,565.00	2,137.50	1,496.25	641.25
DTAC	6,270.00	4,389.00	1,881.00	1,567.50	1,097.25	470.25
EA	4,750.00	3,325.00	1,425.00	1,187.50	831.25	356.25
EGCO	20,520.00	14,364.00	6,156.00	5,130.00	3,591.00	1,539.00
EPG	874.00	611.80	262.20	218.50	152.95	65.55
ERW	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
ESSO	1,558.00	1,090.60	467.40	389.50	272.65	116.85
GFPT	2,204.00	1,542.80	661.20	551.00	385.70	165.30
GLOBAL	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
GPSC (For seriesU20 onwards)	11,400.00	7,980.00	3,420.00	2,850.00	1,995.00	855.00

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	19,342.00	13,539.40	5,802.60	4,835.50	3,384.85	1,450.65
GUNKUL(For seriesM20 onwards)	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10
HANA	4,902.00	3,431.40	1,470.60	1,225.50	857.85	367.65
HMPRO	1,178.00	824.60	353.40	294.50	206.15	88.35
ICHI	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
INTUCH	4,864.00	3,404.80	1,459.20	1,216.00	851.20	364.80
IRPC	494.00	345.80	148.20	123.50	86.45	37.05
ITD	190.00	133.00	57.00	47.50	33.25	14.25
IVL	6,460.00	4,522.00	1,938.00	1,615.00	1,130.50	484.50
JAS	798.00	558.60	239.40	199.50	139.65	59.85
KBANK	17,366.00	12,156.20	5,209.80	4,341.50	3,039.05	1,302.45
KCE	3,686.00	2,580.20	1,105.80	921.50	645.05	276.45
KKP	4,484.00	3,138.80	1,345.20	1,121.00	784.70	336.30
KTB	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
KTC	4,066.00	2,846.20	1,219.80	1,016.50	711.55	304.95
LH	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
LPN	456.00	319.20	136.80	114.00	79.80	34.20
MAJOR	2,850.00	1,995.00	855.00	712.50	498.75	213.75
MEGA	3,192.00	2,234.40	957.60	798.00	558.60	239.40
MINT	3,078.00	2,154.60	923.40	769.50	538.65	230.85
MTC	6,650.00	4,655.00	1,995.00	1,662.50	1,163.75	498.75
ORI	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
PLANB	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
PRM	1,216.00	851.20	364.80	304.00	212.80	91.20
PSH	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25
PSL	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
PTG	2,850.00	1,995.00	855.00	712.50	498.75	213.75
PTT	2,964.00	2,074.80	889.20	741.00	518.70	222.30
PTTEP	8,094.00	5,665.80	2,428.20	2,023.50	1,416.45	607.05
PTTGC	5,320.00	3,724.00	1,596.00	1,330.00	931.00	399.00
QH	152.00	106.40	45.60	38.00	26.60	11.40

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	7,486.00	5,240.20	2,245.80	1,871.50	1,310.05	561.45
ROBINS	7,752.00	5,426.40	2,325.60	1,938.00	1,356.60	581.40
RS	1,710.00	1,197.00	513.00	427.50	299.25	128.25
S	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
SAMART	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
SAWAD (For series M20 onwards)	6,308.00	4,415.60	1,892.40	1,577.00	1,103.90	473.10
SCB (For series H21 onwards)	9,427.80	6,599.46	2,828.34	2,357.90	1,650.53	707.37
SCC	26,828.00	18,779.60	8,048.40	6,707.00	4,694.90	2,012.10
SGP	1,140.00	798.00	342.00	285.00	199.50	85.50
SIRI	114.00	79.80	34.20	28.50	19.95	8.55
SPALI	1,900.00	1,330.00	570.00	475.00	332.50	142.50
SPCG	1,330.00	931.00	399.00	332.50	232.75	99.75
SPRC	1,292.00	904.40	387.60	323.00	226.10	96.90
STA	1,292.00	904.40	387.60	323.00	226.10	96.90
STEC	3,002.00	2,101.40	900.60	750.50	525.35	225.15
STPI	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
SUPER	76.00	53.20	22.80	19.00	13.30	5.70
TASCO	2,812.00	1,968.40	843.60	703.00	492.10	210.90
TCAP (For series Z20 onwards)	3,572.00	2,500.40	1,071.60	893.00	625.10	267.90
THAI	950.00	665.00	285.00	237.50	166.25	71.25
THANI	532.00	372.40	159.60	133.00	93.10	39.90
THCOM	494.00	345.80	148.20	123.50	86.45	37.05
TISCO	7,866.00	5,506.20	2,359.80	1,966.50	1,376.55	589.95
TKN	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
TMB (For series U20 onwards)	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10
TOP	6,004.00	4,202.80	1,801.20	1,501.00	1,050.70	450.30
TPIPL	228.00	159.60	68.40	57.00	39.90	17.10
TRUE	494.00	345.80	148.20	123.50	86.45	37.05
TTA	532.00	372.40	159.60	133.00	93.10	39.90
TTCL	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
TTW	950.00	665.00	285.00	237.50	166.25	71.25

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)
TU	1,786.00	1,250.20	535.80	446.50	312.55	133.95
TVO	1,900.00	1,330.00	570.00	475.00	332.50	142.50
UNIQ	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
VGI	1,216.00	851.20	364.80	304.00	212.80	91.20
VNG	342.00	239.40	102.60	85.50	59.85	25.65
WHA	380.00	266.00	114.00	95.00	66.50	28.50

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	5,700.00	3,990.00	1,710.00	1,425.00	997.50	427.50
3M BIBOR	1,824.00	1,276.80	547.20	3,648.00	2,553.60	1,094.40

7. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้ายางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3)

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	20,710.00	20,710.00	65,550.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	14,497.00	14,497.00	45,885.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	6,213.00	6,213.00	19,665.00

8. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้ายางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3D)

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	20,710.00	20,710.00	65,550.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	14,497.00	14,497.00	45,885.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	6,213.00	6,213.00	19,665.00

9. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ USD

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	380.00	95.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	266.00	66.50
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	114.00	28.50

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)
GPSC Futures						
GPSCH20X	12,790.80	8,953.56	3,837.24	3,197.70	2,238.39	959.31
GPSCM20X	12,790.80	8,953.56	3,837.24	3,197.70	2,238.39	959.31
GUNKUL Futures						
GUNKULH20X	273.60	191.52	82.08	68.40	47.88	20.52
SAWAD Futures						
SAWADH20X	6,938.80	4,857.16	2,081.64	1,734.70	1,214.29	520.41
SCB Futures						
SCBH20X	9,500.00	6,650.00	2,850.00	2,376.76	1,663.73	713.03
SCBM20X	9,500.00	6,650.00	2,850.00	2,376.76	1,663.73	713.03
SCBU20X	9,500.00	6,650.00	2,850.00	2,376.76	1,663.73	713.03
SCBZ20X	9,500.00	6,650.00	2,850.00	2,376.76	1,663.73	713.03
TCAP Futures						
TCAPH20X	3,839.90	2,687.93	1,151.97	959.98	671.98	288.00
TCAPM20X	3,839.90	2,687.93	1,151.97	959.98	671.98	288.00
TCAPU20X	3,839.90	2,687.93	1,151.97	959.98	671.98	288.00
TMB Futures						
TMBH20X	248.90	174.23	74.67	62.36	43.65	18.71
TMBM20X	248.90	174.23	74.67	62.36	43.65	18.71

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	9,405.00
RSS3	113,430.00
RSS3D	113,430.00

***หมายเหตุ**

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 30 มกราคม 2563 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลงและให้ถือเป็น
การยกเลิก REF.No.AFC2020/01/001 วันที่ 21 มกราคม 2563

ประกาศ ณ วันที่ 30 มกราคม 2563