

REF.No.CAF2022/03/006

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 22 มีนาคม 2565 ดังนี้.-

ประเภทลูกค้า	หลักประกันเริ่มต้น (Initial Margin Multiplier) (เท่า)	หลักประกันรักษาสภาพ (Maintenance Margin Multiplier) (เท่า)	หลักประกันบังคับปิดสัญญา (Intraday Force Close Multiplier) (เท่า)
ลูกค้าทั่วไป	1.75	1.23	0.53
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	59,850.00	42,066.00	18,126.00	14,962.50	10,516.50	4,531.50
10 Baht Gold Futures	11,970.00	8,413.20	3,625.20	2,992.50	2,103.30	906.30
GOLD ONLINE	23,275.00	16,359.00	7,049.00	5,818.75	4,089.75	1,762.25
SILVER ONLINE	5,565.00	3,911.40	1,685.40	1,391.25	977.85	421.35

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับโลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	11,480.00	22,960.00	36,225.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	8,068.80	16,137.60	25,461.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	3,476.80	6,953.60	10,971.00

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	26,600.00	18,696.00	8,056.00	6,650.00	4,674.00	2,014.00
COMM	18,200.00	12,792.00	5,512.00	4,550.00	3,198.00	1,378.00
ENERG	9,975.00	7,011.00	3,021.00	2,493.75	1,752.75	755.25
FOOD	5,145.00	3,616.20	1,558.20	1,286.25	904.05	389.55
ICT	11,690.00	8,216.40	3,540.40	2,922.50	2,054.10	885.10
SET 50	7,560.00	5,313.60	2,289.60	1,890.00	1,328.40	572.40

4. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า SET 50 Index Options

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

3.2 กรณีขาย (Short) สัญญา Options ลูกค้านำไปจะต้องวางหลักประกันขั้นต่ำของออพชั่น ตามที่ประกาศของ บริษัทสำนักหักบัญชี (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 (Z22 series)	315.00	221.40	95.40	78.75	55.35	23.85
ADVANC	15,750.00	11,070.00	4,770.00	3,937.50	2,767.50	1,192.50
AEONTS	17,465.00	12,275.40	5,289.40	4,366.25	3,068.85	1,322.35
AMATA	1,890.00	1,328.40	572.40	472.50	332.10	143.10
AOT	4,235.00	2,976.60	1,282.60	1,058.75	744.15	320.65
AP (M22 series)	1,155.00	811.80	349.80	288.75	202.95	87.45
AWC	455.00	319.80	137.80	113.75	79.95	34.45
BA	1,435.00	1,008.60	434.60	358.75	252.15	108.65
BAM	1,505.00	1,057.80	455.80	376.25	264.45	113.95
BANPU (U22 onwards)	1,435.00	1,008.60	434.60	358.75	252.15	108.65
BAY	3,850.00	2,706.00	1,166.00	962.50	676.50	291.50
BBL	8,995.00	6,322.20	2,724.20	2,248.75	1,580.55	681.05

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)
BCH	1,575.00	1,107.00	477.00	393.75	276.75	119.25
BCP	2,800.00	1,968.00	848.00	700.00	492.00	212.00
BCPG	980.00	688.80	296.80	245.00	172.20	74.20
BDMS	1,295.00	910.20	392.20	323.75	227.55	98.05
BEAUTY	175.00	123.00	53.00	43.75	30.75	13.25
BEC	1,925.00	1,353.00	583.00	481.25	338.25	145.75
BEM	560.00	393.60	169.60	140.00	98.40	42.40
BGRIM	2,240.00	1,574.40	678.40	560.00	393.60	169.60
BH	12,915.00	9,077.40	3,911.40	3,228.75	2,269.35	977.85
BJC	2,625.00	1,845.00	795.00	656.25	461.25	198.75
BLA	5,355.00	3,763.80	1,621.80	1,338.75	940.95	405.45
BLAND	70.00	49.20	21.20	17.50	12.30	5.30
BPP	1,085.00	762.60	328.60	271.25	190.65	82.15
BTS	735.00	516.60	222.60	183.75	129.15	55.65
CBG	8,470.00	5,953.20	2,565.20	2,117.50	1,488.30	641.30
CENTEL	4,095.00	2,878.20	1,240.20	1,023.75	719.55	310.05
CHG	280.00	196.80	84.80	70.00	49.20	21.20
CK	1,610.00	1,131.60	487.60	402.50	282.90	121.90
CKP	525.00	369.00	159.00	131.25	92.25	39.75
COM7 (H23 onwards)	3,570.00	2,509.20	1,081.20	892.50	627.30	270.30
CPALL	3,535.00	2,484.60	1,070.60	883.75	621.15	267.65
CPF	1,995.00	1,402.20	604.20	498.75	350.55	151.05
CPN	4,515.00	3,173.40	1,367.40	1,128.75	793.35	341.85
CRC	3,465.00	2,435.40	1,049.40	866.25	608.85	262.35
DELTA	74,900.00	52,644.00	22,684.00	18,725.00	13,161.00	5,671.00
DTAC	4,445.00	3,124.20	1,346.20	1,111.25	781.05	336.55
EA	4,540.00	1,135.00	4,540.00	1,135.00	4,540.00	1,135.00
EASTW	630.00	442.80	190.80	157.50	110.70	47.70
EGCO	11,060.00	7,773.60	3,349.60	2,765.00	1,943.40	837.40
EPG	1,610.00	1,131.60	487.60	402.50	282.90	121.90
ERW (M22 onwards)	385.00	270.60	116.60	96.25	67.65	29.15

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)
ESSO	770.00	541.20	233.20	192.50	135.30	58.30
GFPT	1,120.00	787.20	339.20	280.00	196.80	84.80
GLOBAL (H23 onwards)	1,680.00	1,180.80	508.80	420.00	295.20	127.20
GPSC	5,215.00	3,665.40	1,579.40	1,303.75	916.35	394.85
GULF	3,675.00	2,583.00	1,113.00	918.75	645.75	278.25
GUNKUL	770.00	541.20	233.20	192.50	135.30	58.30
HANA	12,355.00	8,683.80	3,741.80	3,088.75	2,170.95	935.45
HMPRO	1,225.00	861.00	371.00	306.25	215.25	92.75
ICHI	980.00	688.80	296.80	245.00	172.20	74.20
INTUCH	5,495.00	3,862.20	1,664.20	1,373.75	965.55	416.05
IRPC	280.00	196.80	84.80	70.00	49.20	21.20
ITD	315.00	221.40	95.40	78.75	55.35	23.85
IVL	4,585.00	3,222.60	1,388.60	1,146.25	805.65	347.15
JAS	525.00	369.00	159.00	131.25	92.25	39.75
JMT (Z22 onwards)	6,825.00	4,797.00	2,067.00	1,706.25	1,199.25	516.75
KBANK	13,545.00	9,520.20	4,102.20	3,386.25	2,380.05	1,025.55
KCE	7,875.00	5,535.00	2,385.00	1,968.75	1,383.75	596.25
KEX	3,290.00	2,312.40	996.40	822.50	578.10	249.10
KKP	4,515.00	3,173.40	1,367.40	1,128.75	793.35	341.85
KTB	945.00	664.20	286.20	236.25	166.05	71.55
KTC	6,475.00	4,551.00	1,961.00	1,618.75	1,137.75	490.25
LH	665.00	467.40	201.40	166.25	116.85	50.35
LPN	280.00	196.80	84.80	70.00	49.20	21.20
M	3,360.00	2,361.60	1,017.60	840.00	590.40	254.40
MAJOR	2,275.00	1,599.00	689.00	568.75	399.75	172.25
MBK	1,225.00	861.00	371.00	306.25	215.25	92.75
MEGA	4,515.00	3,173.40	1,367.40	1,128.75	793.35	341.85
MINT	2,835.00	1,992.60	858.60	708.75	498.15	214.65
MTC	4,725.00	3,321.00	1,431.00	1,181.25	830.25	357.75
OR	1,750.00	1,230.00	530.00	437.50	307.50	132.50
ORI	1,225.00	861.00	371.00	306.25	215.25	92.75

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)
OSP	3,080.00	2,164.80	932.80	770.00	541.20	233.20
PLANB (Z22 onwards)	945.00	664.20	286.20	236.25	166.05	71.55
PRM	840.00	590.40	254.40	210.00	147.60	63.60
PSH	1,435.00	1,008.60	434.60	358.75	252.15	108.65
PSL	2,905.00	2,041.80	879.80	726.25	510.45	219.95
PTG	1,155.00	811.80	349.80	288.75	202.95	87.45
PTT	2,240.00	1,574.40	678.40	560.00	393.60	169.60
PTTEP	12,110.00	8,511.60	3,667.60	3,027.50	2,127.90	916.90
PTTGC	3,710.00	2,607.60	1,123.60	927.50	651.90	280.90
QH	175.00	123.00	53.00	43.75	30.75	13.25
RATCH	3,675.00	2,583.00	1,113.00	918.75	645.75	278.25
RS	2,100.00	1,476.00	636.00	525.00	369.00	159.00
S	210.00	147.60	63.60	52.50	36.90	15.90
SAMART	805.00	565.80	243.80	201.25	141.45	60.95
SAWAD	5,495.00	3,862.20	1,664.20	1,373.75	965.55	416.05
SCB	9,485.00	6,666.60	2,872.60	2,371.25	1,666.65	718.15
SCC	17,850.00	12,546.00	5,406.00	4,462.50	3,136.50	1,351.50
SCGP	4,760.00	3,345.60	1,441.60	1,190.00	836.40	360.40
SGP	1,365.00	959.40	413.40	341.25	239.85	103.35
SIRI	175.00	123.00	53.00	43.75	30.75	13.25
SPALI	1,715.00	1,205.40	519.40	428.75	301.35	129.85
SPCG	1,120.00	787.20	339.20	280.00	196.80	84.80
SPRC	1,050.00	738.00	318.00	262.50	184.50	79.50
STA	2,975.00	2,091.00	901.00	743.75	522.75	225.25
STEC	1,225.00	861.00	371.00	306.25	215.25	92.75
STGT	2,380.00	1,672.80	720.80	595.00	418.20	180.20
STPI	1,155.00	811.80	349.80	288.75	202.95	87.45
SUPER	70.00	49.20	21.20	17.50	12.30	5.30
TASCO	1,155.00	811.80	349.80	288.75	202.95	87.45
TCAP	3,185.00	2,238.60	964.60	796.25	559.65	241.15
THAI	1,155.00	811.80	349.80	288.75	202.95	87.45

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)
THANI	420.00	295.20	127.20	105.00	73.80	31.80
THCOM	1,505.00	1,057.80	455.80	376.25	264.45	113.95
THG	6,370.00	4,477.20	1,929.20	1,592.50	1,119.30	482.30
TISCO	5,740.00	4,034.40	1,738.40	1,435.00	1,008.60	434.60
TKN	945.00	664.20	286.20	236.25	166.05	71.55
TOA	2,415.00	1,697.40	731.40	603.75	424.35	182.85
TOP	4,305.00	3,025.80	1,303.80	1,076.25	756.45	325.95
TPIPL	140.00	98.40	42.40	35.00	24.60	10.60
TPIPP	140.00	98.40	42.40	35.00	24.60	10.60
TQM (H23 onwards)	3,570.00	2,509.20	1,081.20	892.50	627.30	270.30
TRUE	595.00	418.20	180.20	148.75	104.55	45.05
TTA	1,645.00	1,156.20	498.20	411.25	289.05	124.55
TTB	140.00	98.40	42.40	35.00	24.60	10.60
TTCL	700.00	492.00	212.00	175.00	123.00	53.00
TTW	455.00	319.80	137.80	113.75	79.95	34.45
TU	1,470.00	1,033.20	445.20	367.50	258.30	111.30
TVO	2,345.00	1,648.20	710.20	586.25	412.05	177.55
UNIQ	665.00	467.40	201.40	166.25	116.85	50.35
VGI (H23 onwards)	560.00	393.60	169.60	140.00	98.40	42.40
VNG	1,155.00	811.80	349.80	288.75	202.95	87.45
WHA	245.00	172.20	74.20	61.25	43.05	18.55
WHAUP	245.00	172.20	74.20	61.25	43.05	18.55

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	5,460.00	3,837.60	1,653.60	1,365.00	959.40	413.40
3M BIBOR	560.00	393.60	169.60	1,120.00	787.20	339.20

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	27,475.00	19,311.00	8,321.00	27,475.00	19,311.00	8,321.00
RSS3D	27,475.00	19,311.00	8,321.00	27,475.00	19,311.00	8,321.00
Spot Month Margin	86,800.00	61,008.00	26,288.00	-	-	-
Japanese Rubber	6,230.00	4,378.80	1,886.80	6,230.00	4,378.80	1,886.80

8. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ USD

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	630.00	157.50
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	442.80	110.70
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	190.80	47.70

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)
AAV Futures						
AAVH22X	330.75	232.47	100.17	82.85	58.23	25.09
AAVM22X	330.75	232.47	100.17	82.85	58.23	25.09
AAVU22X	330.75	232.47	100.17	82.85	58.23	25.09
AP Futures						
APH22X	1,162.00	816.72	351.92	290.48	204.17	87.97
BANPU Futures						
BANPUH22X	1,702.75	1,196.79	515.69	425.84	299.30	128.97
BANPUM22X	1,702.75	1,196.79	515.69	425.84	299.30	128.97
COM7 Futures						
COM7H22X	7,140.00	5,018.40	2,162.40	1,785.00	1,254.60	540.60
COM7M22X	7,140.00	5,018.40	2,162.40	1,785.00	1,254.60	540.60
COM7U22X	7,140.00	5,018.40	2,162.40	1,785.00	1,254.60	540.60
COM7Z22X	7,140.00	5,018.40	2,162.40	1,785.00	1,254.60	540.60

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)
ERW Futures						
ERWH22X	600.25	421.89	181.79	149.96	105.40	45.42
GLOBAL Futures						
GLOBALH22X	1,751.75	1,231.23	530.53	438.06	307.89	132.67
GLOBALM22X	1,751.75	1,231.23	530.53	438.06	307.89	132.67
GLOBALU22X	1,751.75	1,231.23	530.53	438.06	307.89	132.67
GLOBALZ22X	1,751.75	1,231.23	530.53	438.06	307.89	132.67
JMT Futures						
JMTH22X	6,989.50	4,912.62	2,116.82	1,747.20	1,228.03	529.15
JMTM22X	6,989.50	4,912.62	2,116.82	1,747.20	1,228.03	529.15
JMTU22X	6,989.50	4,912.62	2,116.82	1,747.20	1,228.03	529.15
PLANB Futures						
PLANBH22X	966.00	678.96	292.56	241.68	169.87	73.20
PLANBM22X	966.00	678.96	292.56	241.68	169.87	73.20
PLANBU22X	966.00	678.96	292.56	241.68	169.87	73.20
TQM Futures						
TQMH22X	7,140.00	5,018.40	2,162.40	1,785.00	1,254.60	540.60
TQMM22X	7,140.00	5,018.40	2,162.40	1,785.00	1,254.60	540.60
TQMU22X	7,140.00	5,018.40	2,162.40	1,785.00	1,254.60	540.60
TQMZ22X	7,140.00	5,018.40	2,162.40	1,785.00	1,254.60	540.60
VGI Futures						
VGIH22X	582.75	409.59	176.49	145.88	102.53	44.18
VGIM22X	582.75	409.59	176.49	145.88	102.53	44.18
VGIU22X	582.75	409.59	176.49	145.88	102.53	44.18
VGIZ22X	582.75	409.59	176.49	145.88	102.53	44.18

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	16,240.00
RSS3D	147,525.00

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 28 มีนาคม 2565 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลงและให้ถือเป็น
การยกเลิก REF.No.AFC2022/03/005 วันที่ 17 มีนาคม 2565

ประกาศ ณ วันที่ 23 มีนาคม 2565