

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 13 ธันวาคม 2561 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	24,700.00	17,290.00	7,410.00	6,175.00	4,322.50	1,852.50
10 Baht Gold Futures	4,940.00	3,458.00	1,482.00	1,235.00	864.50	370.50
GOLD-ONLINE	13,110.00	9,177.00	3,933.00	-	-	-

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ โลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	3,420.00	10,830.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	2,394.00	7,581.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	1,026.00	3,249.00

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	22,230.00	15,561.00	6,669.00	5,557.50	3,890.25	1,667.25
COMM	23,408.00	16,385.60	7,022.40	5,852.00	4,096.40	1,755.60
ENERG	19,304.00	13,512.80	5,791.20	4,826.00	3,378.20	1,447.80
FOOD	4,446.00	3,112.20	1,333.80	1,111.50	778.05	333.45
ICT	8,170.00	5,719.00	2,451.00	2,042.50	1,429.75	612.75
SET 50	10,450.00	7,315.00	3,135.00	2,612.50	1,828.75	783.75

4. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า SET 50 Index Options

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

3.2 กรณีขาย (Short) สัญญา Options ลูกค้ำทั่วไปจะต้องวางหลักประกันขั้นต่ำของออพชั่น 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	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
ADVANC	11,590.00	8,113.00	3,477.00	2,897.50	2,028.25	869.25
AMATA	2,470.00	1,729.00	741.00	617.50	432.25	185.25
AOT	4,294.00	3,005.80	1,288.20	1,073.50	751.45	322.05
AP	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
BA	1,026.00	718.20	307.80	256.50	179.55	76.95
BANPU	1,482.00	1,037.40	444.60	370.50	259.35	111.15
BAY	2,470.00	1,729.00	741.00	617.50	432.25	185.25
BBL	9,500.00	6,650.00	2,850.00	2,375.00	1,662.50	712.50
BCH	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
BCP	2,470.00	1,729.00	741.00	617.50	432.25	185.25
BDMS	2,812.00	1,968.40	843.60	703.00	492.10	210.90

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ ตราสารทุน	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)
BEAUTY	2,964.00	2,074.80	889.20	741.00	518.70	222.30
BEC	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
BEM	532.00	372.40	159.60	133.00	93.10	39.90
BH	8,170.00	5,719.00	2,451.00	2,042.50	1,429.75	612.75
BJC	5,320.00	3,724.00	1,596.00	1,330.00	931.00	399.00
BLA	3,800.00	2,660.00	1,140.00	950.00	665.00	285.00
BLAND	76.00	53.20	22.80	19.00	13.30	5.70
BTS	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
CBG	6,650.00	4,655.00	1,995.00	1,662.50	1,163.75	498.75
CENTEL	4,446.00	3,112.20	1,333.80	1,111.50	778.05	333.45
CHG	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95
CK	1,938.00	1,356.60	581.40	484.50	339.15	145.35
CKP	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
CPALL	4,636.00	3,245.20	1,390.80	1,159.00	811.30	347.70
CPF	2,166.00	1,516.20	649.80	541.50	379.05	162.45
CPN	5,510	3,857	1,653	1,378	964	413
DELTA	2,850.00	1,995.00	855.00	712.50	498.75	213.75
DTAC	4,560.00	3,192.00	1,368.00	1,140.00	798.00	342.00
EARTH	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
EGCO (For seriesU19 onwards)	11,400.00	7,980.00	3,420.00	2,850.00	1,995.00	855.00
EPG	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
GLOBAL (For seriesH19 onwards)	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
GLOW(For seriesM19 onwards)	7,676.00	5,373.20	2,302.80	1,919.00	1,343.30	575.70
GPSC	6,194.00	4,335.80	1,858.20	1,548.50	1,083.95	464.55
GUNKUL	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
HANA	4,180.00	2,926.00	1,254.00	1,045.00	731.50	313.50
HMPRO	1,178.00	824.60	353.40	294.50	206.15	88.35
ICHI	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
INTUCH	3,154.00	2,207.80	946.20	788.50	551.95	236.55
IRPC	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
ITD	266.00	186.20	79.80	66.50	46.55	19.95

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ ตราสารทุน	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)
IVL	6,574.00	4,601.80	1,972.20	1,643.50	1,150.45	493.05
JAS	380.00	266.00	114.00	95.00	66.50	28.50
KBANK	13,300.00	9,310.00	3,990.00	3,325.00	2,327.50	997.50
KCE (For series M19 onwards)	6,460.00	4,522.00	1,938.00	1,615.00	1,130.50	484.50
KKP	4,940.00	3,458.00	1,482.00	1,235.00	864.50	370.50
KTB	950.00	665.00	285.00	237.50	166.25	71.25
KTC (For series U19 onwards)	3,192.00	2,234.40	957.60	798.00	558.60	239.40
LH	1,330.00	931.00	399.00	332.50	232.75	99.75
LPN	1,178.00	824.60	353.40	294.50	206.15	88.35
MAJOR	1,786.00	1,250.20	535.80	446.50	312.55	133.95
MINT	3,610.00	2,527.00	1,083.00	902.50	631.75	270.75
MTC	6,574.00	4,601.80	1,972.20	1,643.50	1,150.45	493.05
PLANB	494.00	345.80	148.20	123.50	86.45	37.05
PSH	1,368.00	957.60	410.40	342.00	239.40	102.60
PTG	1,976.00	1,383.20	592.80	494.00	345.80	148.20
PTT (For series M19 onwards)	4,674.00	3,271.80	1,402.20	1,168.50	817.95	350.55
PTTEP	17,594.00	12,315.80	5,278.20	4,398.50	3,078.95	1,319.55
PTTGC	5,130.00	3,591.00	1,539.00	1,282.50	897.75	384.75
QH	304.00	212.80	91.20	76.00	53.20	22.80
RATCH	6,080.00	4,256.00	1,824.00	1,520.00	1,064.00	456.00
ROBINS	5,890.00	4,123.00	1,767.00	1,472.50	1,030.75	441.75
S	380.00	266.00	114.00	95.00	66.50	28.50
SAMART	1,064.00	744.80	319.20	266.00	186.20	79.80
SAWAD (For series M19 onwards)	6,194.00	4,335.80	1,858.20	1,548.50	1,083.95	464.55
SCB	9,120.00	6,384.00	2,736.00	2,280.00	1,596.00	684.00
SCC	21,850.00	15,295.00	6,555.00	5,462.50	3,823.75	1,638.75
SIRI	152.00	106.40	45.60	38.00	26.60	11.40
SPALI	1,520.00	1,064.00	456.00	380.00	266.00	114.00
SPCG	1,596.00	1,117.20	478.80	399.00	279.30	119.70
STA	3,230.00	2,261.00	969.00	807.50	565.25	242.25
STEC	1,976.00	1,383.20	592.80	494.00	345.80	148.20

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ ตราสารทุน	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)
STPI	1,254.00	877.80	376.20	313.50	219.45	94.05
TASCO	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
TCAP	2,850.00	1,995.00	855.00	712.50	498.75	213.75
THAI	1,634.00	1,143.80	490.20	408.50	285.95	122.55
THCOM	912.00	638.40	273.60	228.00	159.60	68.40
TISCO	5,016.00	3,511.20	1,504.80	1,254.00	877.80	376.20
TMB	190.00	133.00	57.00	47.50	33.25	14.25
TOP	6,840.00	4,788.00	2,052.00	1,710.00	1,197.00	513.00
TPIPL	190.00	133.00	57.00	47.50	33.25	14.25
TRUE	418.00	292.60	125.40	104.50	73.15	31.35
TTA	570.00	399.00	171.00	142.50	99.75	42.75
TTCL	988.00	691.60	296.40	247.00	172.90	74.10
TTW	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
TU	1,444.00	1,010.80	433.20	361.00	252.70	108.30
TVO	1,482.00	1,037.40	444.60	370.50	259.35	111.15
UNIQ	1,748.00	1,223.60	524.40	437.00	305.90	131.10
VGI	684.00	478.80	205.20	171.00	119.70	51.30
VNG	760.00	532.00	228.00	190.00	133.00	57.00
WHA	342.00	239.40	102.60	85.50	59.85	25.65

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	5,130.00	3,591.00	1,539.00	1,282.50	897.75	384.75
3M BIBOR	722.00	505.40	216.60	-	-	-

7. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้ายางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3)

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	22,800.00	22,800.00	72,200.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	15,960.00	15,960.00	50,540.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	6,840.00	6,840.00	21,660.00

8. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับสินค้ายางแผ่นรมควันชั้น 3 (RSS3D)

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	22,800.00	22,800.00	72,200.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	15,960.00	15,960.00	50,540.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	6,840.00	6,840.00	21,660.00

9. อัตราหลักประกันสำหรับ Single Stock Futures ที่มีกรปรับสัญญาเนื่องจาก 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)
GLOBAL Futures						
GLOBALZ18X	2,177.40	1,524.18	653.22	544.45	381.11	163.34
GLOBALH19	2,090.00	1,463.00	627.00	522.50	365.75	156.75
GLOW Futures						
GLOWZ18X	7,845.10	5,491.57	2,353.53	1,961.22	1,372.85	588.37
GLOWH19X	7,845.10	5,491.57	2,353.53	1,961.22	1,372.85	588.37
GLOWM19	7,676.00	5,373.20	2,302.80	1,919.00	1,343.30	575.70
KTC Futures						
KTCZ18X	31,920.00	22,344.00	9,576.00	7,980.00	5,586.00	2,394.50
KTCH19X	31,920.00	22,344.00	9,576.00	7,980.00	5,586.00	2,394.50
KTCM19X	31,920.00	22,344.00	9,576.00	7,980.00	5,586.00	2,394.50
KTCU19	3,192.00	2,234.40	957.60	798.00	558.60	239.40
PTT Futures						
PTTZ18X	46,740.00	32,718.00	14,022.00	11,685.00	8,179.50	3,505.50
PTTH19X	46,740.00	32,718.00	14,022.00	11,685.00	8,179.50	3,505.50
PTTM19	4,674.00	3,271.80	1,402.20	1,168.50	817.95	350.55

ประเภทสัญญาซื้อขาย ล่วงหน้าเกี่ยวกับ การปรับสัญญา Corporate Actions	กรณี Outright			กรณี Spread		
	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)	หลักประกัน เริ่มต้น (IM)	หลักประกัน รักษาสภาพ (MM)
SAWAD Futures						
SAWADZ18X	6,541.70	4,579.19	1,962.51	1,635.22	1,144.65	490.57
SAWADH19X	6,541.70	4,579.19	1,962.51	1,635.22	1,144.65	490.57
SAWADM19	6,194.00	4,335.80	1,858.20	1,548.50	1,083.95	464.55

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	4,750.00
RSS3	125,400.00
RSS3D	125,400.00

***หมายเหตุ**

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 19 ธันวาคม 2561 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลง และให้ถือเป็นการยกเลิก REF.No.AFC2018/11/018 วันที่ 19 พฤศจิกายน 2561

ประกาศ ณ วันที่ 17 ธันวาคม 2561