

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 18 พฤศจิกายน 2563 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 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	68,250.00	47,970.00	20,670.00	17,062.50	11,992.50	5,167.50
10 Baht Gold Futures	13,650.00	9,594.00	4,134.00	3,412.50	2,398.50	1,033.50
GOLD ONLINE	30,625.00	21,525.00	9,275.00	7,656.25	5,381.25	2,318.75
SILVER ONLINE **	10,675.00	7,503.00	3,233.00	21,350.00	15,006.00	6,466.00

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ โลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	9,030.00	18,060.00	28,525.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	6,346.80	12,693.60	20,049.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	2,734.80	5,469.60	8,639.00

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	20,825.00	14,637.00	6,307.00	5,206.25	3,659.25	1,576.75
COMM	17,500.00	12,300.00	5,300.00	4,375.00	3,075.00	1,325.00
ENERG	16,835.00	11,832.60	5,098.60	4,208.75	2,958.15	1,274.65
FOOD	6,230.00	4,378.80	1,886.80	1,557.50	1,094.70	471.70
ICT	7,000.00	4,920.00	2,120.00	1,750.00	1,230.00	530.00
SET 50	9,170.00	6,445.20	2,777.20	2,292.50	1,611.30	694.30

4. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า SET 50 Index Options

- 3.1 กรณีซื้อ (Long) สัญญา Options ลูกค้านำไปจะต้องมีหลักประกันไม่ต่ำกว่าค่าพรีเมียม (Premium) ก่อนสั่งซื้อ เพื่อเปิดฐานะสัญญา
- 3.2 กรณีขาย (Short) สัญญา Options ลูกค้านำไปจะต้องวางหลักประกันขั้นต่ำของออพชั่น 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	280.00	196.80	84.80	70.00	49.20	21.20
ADVANC	11,130.00	7,822.80	3,370.80	2,782.50	1,955.70	842.70
AEONTS	17,675.00	12,423.00	5,353.00	4,418.75	3,105.75	1,338.25
AMATA (U21 onwards)	1,575.00	1,107.00	477.00	393.75	276.75	119.25
AOT	5,390.00	3,788.40	1,632.40	1,347.50	947.10	408.10
AP	805.00	565.80	243.80	201.25	141.45	60.95
BA	630.00	442.80	190.80	157.50	110.70	47.70
BANPU	1,085.00	762.60	328.60	271.25	190.65	82.15
BAY	1,750.00	1,230.00	530.00	437.50	307.50	132.50
BBL	9,310.00	6,543.60	2,819.60	2,327.50	1,635.90	704.90
BCH	1,295.00	910.20	392.20	323.75	227.55	98.05
BCP	1,890.00	1,328.40	572.40	472.50	332.10	143.10

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)
BCPG	1,680.00	1,180.80	508.80	420.00	295.20	127.20
BDMS	1,365.00	959.40	413.40	341.25	239.85	103.35
BEAUTY	280.00	196.80	84.80	70.00	49.20	21.20
BEC	665.00	467.40	201.40	166.25	116.85	50.35
BEM	560.00	393.60	169.60	140.00	98.40	42.40
BGRIM	5,005.00	3,517.80	1,515.80	1,251.25	879.45	378.95
BH	9,030.00	6,346.80	2,734.80	2,257.50	1,586.70	683.70
BJC	3,115.00	2,189.40	943.40	778.75	547.35	235.85
BLA	2,275.00	1,599.00	689.00	568.75	399.75	172.25
BLAND	105.00	73.80	31.80	26.25	18.45	7.95
BPP	1,260.00	885.60	381.60	315.00	221.40	95.40
BTS (M21 onwards)	770.00	541.20	233.20	192.50	135.30	58.30
CBG	12,250.00	8,610.00	3,710.00	3,062.50	2,152.50	927.50
CENTEL	3,080.00	2,164.80	932.80	770.00	541.20	233.20
CHG	245.00	172.20	74.20	61.25	43.05	18.55
CK	1,890.00	1,328.40	572.40	472.50	332.10	143.10
CKP	805.00	565.80	243.80	201.25	141.45	60.95
COM7 (M21 onwards)	6,335.00	4,452.60	1,918.60	1,583.75	1,113.15	479.65
CPALL	3,605.00	2,533.80	1,091.80	901.25	633.45	272.95
CPF	2,380.00	1,672.80	720.80	595.00	418.20	180.20
CPN	7,560.00	5,313.60	2,289.60	1,890.00	1,328.40	572.40
DELTA	31,325.00	22,017.00	9,487.00	7,831.25	5,504.25	2,371.75
DTAC	3,430.00	2,410.80	1,038.80	857.50	602.70	259.70
EA	5,075.00	3,567.00	1,537.00	1,268.75	891.75	384.25
EASTW	595.00	418.20	180.20	148.75	104.55	45.05
EGCO	19,775.00	13,899.00	5,989.00	4,943.75	3,474.75	1,497.25
EPG	560.00	393.60	169.60	140.00	98.40	42.40
ERW	455.00	319.80	137.80	113.75	79.95	34.45
ESSO	1,015.00	713.40	307.40	253.75	178.35	76.85
GFPT	1,365.00	959.40	413.40	341.25	239.85	103.35
GLOBAL (H21 onwards)	2,730.00	1,918.80	826.80	682.50	479.70	206.70

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)
GPSC	6,650.00	4,674.00	2,014.00	1,662.50	1,168.50	503.50
GULF (U21 onwards)	3,185.00	2,238.60	964.60	796.25	559.65	241.15
GUNKUL	210.00	147.60	63.60	52.50	36.90	15.90
HANA	7,315.00	5,141.40	2,215.40	1,828.75	1,285.35	553.85
HMPRO	1,470.00	1,033.20	445.20	367.50	258.30	111.30
ICHI	1,680.00	1,180.80	508.80	420.00	295.20	127.20
INTUCH	3,710.00	2,607.60	1,123.60	927.50	651.90	280.90
IRPC	245.00	172.20	74.20	61.25	43.05	18.55
ITD	140.00	98.40	42.40	35.00	24.60	10.60
IVL	3,430.00	2,410.80	1,038.80	857.50	602.70	259.70
JAS	350.00	246.00	106.00	87.50	61.50	26.50
JMT	5,320.00	3,739.20	1,611.20	1,330.00	934.80	402.80
KBANK	8,295.00	5,830.20	2,512.20	2,073.75	1,457.55	628.05
KCE	6,265.00	4,403.40	1,897.40	1,566.25	1,100.85	474.35
KKP	4,550.00	3,198.00	1,378.00	1,137.50	799.50	344.50
KTB	630.00	442.80	190.80	157.50	110.70	47.70
KTC	3,850.00	2,706.00	1,166.00	962.50	676.50	291.50
LH	595.00	418.20	180.20	148.75	104.55	45.05
LPN	455.00	319.80	137.80	113.75	79.95	34.45
M	3,465.00	2,435.40	1,049.40	866.25	608.85	262.35
MAJOR	1,855.00	1,303.80	561.80	463.75	325.95	140.45
MBK	1,400.00	984.00	424.00	350.00	246.00	106.00
MEGA	4,515.00	3,173.40	1,367.40	1,128.75	793.35	341.85
MINT (M21 onwards)	2,870.00	2,017.20	869.20	717.50	504.30	217.30
MTC	6,230.00	4,378.80	1,886.80	1,557.50	1,094.70	471.70
ORI	910.00	639.60	275.60	227.50	159.90	68.90
OSP	3,290.00	2,312.40	996.40	822.50	578.10	249.10
PLANB	980.00	688.80	296.80	245.00	172.20	74.20
PRM	1,365.00	959.40	413.40	341.25	239.85	103.35
PSH	980.00	688.80	296.80	245.00	172.20	74.20
PSL	1,015.00	713.40	307.40	253.75	178.35	76.85

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)
PTG	2,555.00	1,795.80	773.80	638.75	448.95	193.45
PTT	2,555.00	1,795.80	773.80	638.75	448.95	193.45
PTTEP	8,330.00	5,854.80	2,522.80	2,082.50	1,463.70	630.70
PTTGC	4,725.00	3,321.00	1,431.00	1,181.25	830.25	357.75
QH	175.00	123.00	53.00	35.00	24.60	10.60
RATCH	4,340.00	3,050.40	1,314.40	1,085.00	762.60	328.60
ROBINS (Z20X)	6,980.75	4,906.47	2,114.17	1,102.50	774.90	333.90
RS	2,415.00	1,697.40	731.40	603.75	424.35	182.85
S	140.00	98.40	42.40	35.00	24.60	10.60
SAMART	700.00	492.00	212.00	175.00	123.00	53.00
SAWAD	6,650.00	4,674.00	2,014.00	1,662.50	1,168.50	503.50
SCB (H21 onwards)	7,770.00	5,461.20	2,353.20	1,942.50	1,365.30	588.30
SCC	26,600.00	18,696.00	8,056.00	6,650.00	4,674.00	2,014.00
SGP	980.00	688.80	296.80	245.00	172.20	74.20
SIRI	70.00	49.20	21.20	17.50	12.30	5.30
SPALI	2,135.00	1,500.60	646.60	533.75	375.15	161.65
SPCG	2,275.00	1,599.00	689.00	568.75	399.75	172.25
SPRC	910.00	639.60	275.60	227.50	159.90	68.90
STA	5,040.00	3,542.40	1,526.40	1,260.00	885.60	381.60
STEC	1,470.00	1,033.20	445.20	367.50	258.30	111.30
STPI	455.00	319.80	137.80	113.75	79.95	34.45
SUPER	140.00	98.40	42.40	35.00	24.60	10.60
TASCO	3,535.00	2,484.60	1,070.60	883.75	621.15	267.65
TCAP (Z20 onwards)	3,500.00	2,460.00	1,060.00	875.00	615.00	265.00
THAI	665.00	467.40	201.40	166.25	116.85	50.35
THANI (U21 onwards)*	490.00	344.40	148.40	122.50	86.10	37.10
THCOM	1,085.00	762.60	328.60	271.25	190.65	82.15
THG	1,400.00	984.00	424.00	350.00	246.00	106.00
TISCO	7,280.00	5,116.80	2,204.80	1,820.00	1,279.20	551.20
TKN	2,345.00	1,648.20	710.20	586.25	412.05	177.55
TMB	105.00	73.80	31.80	26.25	18.45	7.95

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)
TOA	3,640.00	2,558.40	1,102.40	910.00	639.60	275.60
TOP	4,830.00	3,394.80	1,462.80	1,207.50	848.70	365.70
TPIPL	175.00	123.00	53.00	43.75	30.75	13.25
TIPIP	420.00	295.20	127.20	105.00	73.80	31.80
TQM	20,125.00	14,145.00	6,095.00	5,031.25	3,536.25	1,523.75
TRUE	280.00	196.80	84.80	70.00	49.20	21.20
TTA	385.00	270.60	116.60	96.25	67.65	29.15
TTCL	700.00	492.00	212.00	175.00	123.00	53.00
TTW	1,015.00	713.40	307.40	253.75	178.35	76.85
TU	1,470.00	1,033.20	445.20	367.50	258.30	111.30
TVO	3,780.00	2,656.80	1,144.80	945.00	664.20	286.20
UNIQ	490.00	344.40	148.40	122.50	86.10	37.10
VGI	910.00	639.60	275.60	227.50	159.90	68.90
VNG	280.00	196.80	84.80	70.00	49.20	21.20
VNT	2,380.00	1,672.80	720.80	595.00	418.20	180.20
WHA	315.00	221.40	95.40	78.75	55.35	23.85
WHAUP	350.00	246.00	106.00	87.50	61.50	26.50

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	5,390.00	3,788.40	1,632.40	1,347.50	947.10	408.10
3M BIBOR	3,325.00	2,337.00	1,007.00	6,650.00	4,674.00	2,014.00

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	61,250.00	43,050.00	18,550.00	61,250.00	43,050.00	18,550.00
RSS3D	61,250.00	43,050.00	18,550.00	61,250.00	43,050.00	18,550.00
Spot Month Margin	193,725.00	136,161.00	58,671.00	-	-	-

8. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับ USD

ประเภทหลักประกัน	กรณี Outright	กรณี Spread
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	490.00	122.50
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	344.40	86.10
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	148.40	37.10

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)
AMATA Futures						
AMATAZ20X	1,587.25	1,111.08	476.17	396.90	277.83	119.07
AMATAH21X	1,587.25	1,111.08	476.17	396.90	277.83	119.07
AMATAM21X	1,587.25	1,111.08	476.17	396.90	277.83	119.07
BCPG Futures						
BCPGZ20X	1,702.75	1,191.93	510.82	425.88	298.12	127.76
BCPGH21X	1,702.75	1,191.93	510.82	425.88	298.12	127.76
BCPGM21X	1,702.75	1,191.93	510.82	425.88	298.12	127.76
BCPGU21X	1,702.75	1,191.93	510.82	425.88	298.12	127.76
BTS Futures						
BTSZ120X	780.50	546.35	234.15	195.00	136.50	58.50
BTSH21X	780.50	546.35	234.15	195.00	136.50	58.50
COM7 Futures						
COM7Z20X	6,392.75	4,474.93	1,917.82	1,598.00	1,118.60	479.40
COM7H21X	6,392.75	4,474.93	1,917.82	1,598.00	1,118.60	479.40

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)
GLOBAL Futures						
GLOBALZ20X	2,861.25	2,002.88	858.37	715.26	500.68	214.58
GULF Futures						
GULFZ20Y	16,107.00	11,274.90	4,832.10	4,026.64	2,818.65	1,207.99
GULFH21Y	16,107.00	11,274.90	4,832.10	4,026.64	2,818.65	1,207.99
GULF Futures						
GULFM21X	3,220.00	2,254.00	966.00	805.01	563.51	241.50
MINT Futures						
MINTZ20X	2,892.75	2,024.93	867.82	723.24	506.27	216.97
MINTH21X	2,892.75	2,024.93	867.82	723.24	506.27	216.97
ROBINS Futures						
ROBINSZ20X	6,980.75	4,886.53	2,094.22	1,745.26	1,221.68	523.58
SCB Futures						
SCBZ20X	7,833.00	5,483.10	2,349.90	1,958.04	1,370.63	587.41
THANI Futures						
THANIZ20X	658.00	460.60	197.40	164.40	115.08	49.32
THANIH21X	658.00	460.60	197.40	164.40	115.08	49.32
THANIM21X	658.00	460.60	197.40	164.40	115.08	49.32

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	13,870.00
RSS3D	364,230.00

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 23 พฤศจิกายน 2563 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลงและให้ถือเป็นการยกเลิก REF.No.AFC2020/10/031 วันที่ 13 พฤศจิกายน 2563

ประกาศ ณ วันที่ 19 พฤศจิกายน 2563