

ประกาศ

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด เรื่อง อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

บริษัทหลักทรัพย์ที่ปรึกษาการลงทุน คลาสสิก ออสสิริส จำกัด ขอประกาศขนาดของหลักประกันต่างๆ ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้าในตลาดอนุพันธ์ โดยกำหนดให้เรียกเก็บจากลูกค้าตามอัตราความเสี่ยงของอัตราหลักประกันตามประกาศอัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ของบริษัทสำนักหักบัญชี (ประเทศไทย) ในวันที่ 20 มกราคม 2564 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	63,175.00	44,403.00	19,133.00	15,793.75	11,100.75	4,783.25
10 Baht Gold Futures	12,635.00	8,880.60	3,826.60	3,158.75	2,220.15	956.65
GOLD ONLINE	30,625.00	21,525.00	9,275.00	7,656.25	5,381.25	2,318.75
SILVER ONLINE	8,750.00	6,150.00	2,650.00	17,500.00	12,300.00	5,300.00

2. อัตราหลักประกันการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า เกี่ยวกับโลหะมีค่า (Metal Market Futures)

GOLD-D	กรณี Outright	กรณี Spread	Spot Month Margin
หลักประกันเริ่มต้น (IM)	8,820.00	17,587.50	27,825.00
หลักประกันรักษาสภาพ (MM)	6,199.20	12,361.50	19,557.00
หลักประกันบังคับปิดสัญญา (FM)	2,671.20	5,326.50	8,427.00

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	37,975.00	26,691.00	11,501.00	9,493.75	6,672.75	2,875.25
COMM	22,225.00	15,621.00	6,731.00	5,556.25	3,905.25	1,682.75
ENERG	19,600.00	13,776.00	5,936.00	4,900.00	3,444.00	1,484.00
FOOD	9,240.00	6,494.40	2,798.40	2,310.00	1,623.60	699.60
ICT	8,015.00	5,633.40	2,427.40	2,003.75	1,408.35	606.85
SET 50	17,465.00	12,275.40	5,289.40	4,366.25	3,068.85	1,322.35

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	560.00	393.60	169.60	140.00	98.40	42.40
ADVANC	12,985.00	9,126.60	3,932.60	3,246.25	2,281.65	983.15
AEONTS	45,500.00	31,980.00	13,780.00	11,375.00	7,995.00	3,445.00
AMATA (U21 onwards)	2,800.00	1,968.00	848.00	700.00	492.00	212.00
AOT	7,070.00	4,969.20	2,141.20	1,767.50	1,242.30	535.30
AP	1,085.00	762.60	328.60	271.25	190.65	82.15
BA	1,435.00	1,008.60	434.60	358.75	252.15	108.65
BANPU	1,715.00	1,205.40	519.40	428.75	301.35	129.85
BAY	5,880.00	4,132.80	1,780.80	1,470.00	1,033.20	445.20
BBL	14,315.00	10,061.40	4,335.40	3,578.75	2,515.35	1,083.85
BCH	1,575.00	1,107.00	477.00	393.75	276.75	119.25
BCP	3,220.00	2,263.20	975.20	805.00	565.80	243.80

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	2,100.00	1,476.00	636.00	525.00	369.00	159.00
BDMS	2,415.00	1,697.40	731.40	603.75	424.35	182.85
BEAUTY	350.00	246.00	106.00	87.50	61.50	26.50
BEC	1,085.00	762.60	328.60	271.25	190.65	82.15
BEM	735.00	516.60	222.60	183.75	129.15	55.65
BGRIM	6,090.00	4,280.40	1,844.40	1,522.50	1,070.10	461.10
BH	16,695.00	11,734.20	5,056.20	4,173.75	2,933.55	1,264.05
BJC	4,305.00	3,025.80	1,303.80	1,076.25	756.45	325.95
BLA	3,150.00	2,214.00	954.00	787.50	553.50	238.50
BLAND	175.00	123.00	53.00	43.75	30.75	13.25
BPP	1,855.00	1,303.80	561.80	463.75	325.95	140.45
BTS (M21 onwards)	1,015.00	713.40	307.40	253.75	178.35	76.85
CBG	15,050.00	10,578.00	4,558.00	3,762.50	2,644.50	1,139.50
CENTEL	5,355.00	3,763.80	1,621.80	1,338.75	940.95	405.45
CHG	245.00	172.20	74.20	61.25	43.05	18.55
CK	2,555.00	1,795.80	773.80	638.75	448.95	193.45
CKP	700.00	492.00	212.00	175.00	123.00	53.00
COM7 (M21 onwards)	6,020.00	4,231.20	1,823.20	1,505.00	1,057.80	455.80
CPALL	4,760.00	3,345.60	1,441.60	1,190.00	836.40	360.40
CPF	3,780.00	2,656.80	1,144.80	945.00	664.20	286.20
CPN	7,560.00	5,313.60	2,289.60	1,890.00	1,328.40	572.40
DELTA	209,230.00	147,058.80	63,366.80	52,307.50	36,764.70	15,841.70
DTAC	4,690.00	3,296.40	1,420.40	1,172.50	824.10	355.10
EA	10,640.00	7,478.40	3,222.40	2,660.00	1,869.60	805.60
EASTW	595.00	418.20	180.20	148.75	104.55	45.05
EGCO	23,100.00	16,236.00	6,996.00	5,775.00	4,059.00	1,749.00
EPG	1,050.00	738.00	318.00	262.50	184.50	79.50
ERW	665.00	467.40	201.40	166.25	116.85	50.35
ESSO	1,260.00	885.60	381.60	315.00	221.40	95.40
GFPT	1,505.00	1,057.80	455.80	376.25	264.45	113.95
GLOBAL (H21 onwards)	2,170.00	1,525.20	657.20	542.50	381.30	164.30

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	14,035.00	9,864.60	4,250.60	3,508.75	2,466.15	1,062.65
GULF (U21 onwards)	4,690.00	3,296.40	1,420.40	1,172.50	824.10	355.10
GUNKUL	315.00	221.40	95.40	78.75	55.35	23.85
HANA	6,825.00	4,797.00	2,067.00	1,706.25	1,199.25	516.75
HMPRO	1,925.00	1,353.00	583.00	481.25	338.25	145.75
ICHI	1,540.00	1,082.40	466.40	385.00	270.60	116.60
INTUCH	3,885.00	2,730.60	1,176.60	971.25	682.65	294.15
IRPC	630.00	442.80	190.80	157.50	110.70	47.70
ITD	175.00	123.00	53.00	43.75	30.75	13.25
IVL	7,000.00	4,920.00	2,120.00	1,750.00	1,230.00	530.00
JAS	385.00	270.60	116.60	96.25	67.65	29.15
JMT	5,180.00	3,640.80	1,568.80	1,295.00	910.20	392.20
KBANK	17,465.00	12,275.40	5,289.40	4,366.25	3,068.85	1,322.35
KCE	7,350.00	5,166.00	2,226.00	1,837.50	1,291.50	556.50
KKP	6,965.00	4,895.40	2,109.40	1,741.25	1,223.85	527.35
KTB	1,365.00	959.40	413.40	341.25	239.85	103.35
KTC	7,595.00	5,338.20	2,300.20	1,898.75	1,334.55	575.05
LH	805.00	565.80	243.80	201.25	141.45	60.95
LPN	595.00	418.20	180.20	148.75	104.55	45.05
M	6,020.00	4,231.20	1,823.20	1,505.00	1,057.80	455.80
MAJOR	2,800.00	1,968.00	848.00	700.00	492.00	212.00
MBK	1,820.00	1,279.20	551.20	455.00	319.80	137.80
MEGA	4,795.00	3,370.20	1,452.20	1,198.75	842.55	363.05
MINT (M21 onwards)	4,480.00	3,148.80	1,356.80	1,120.00	787.20	339.20
MTC	6,895.00	4,846.20	2,088.20	1,723.75	1,211.55	522.05
ORI	1,120.00	787.20	339.20	280.00	196.80	84.80
OSP	3,920.00	2,755.20	1,187.20	980.00	688.80	296.80
PLANB	1,120.00	787.20	339.20	280.00	196.80	84.80
PRM	1,365.00	959.40	413.40	341.25	239.85	103.35
PSH	1,330.00	934.80	402.80	332.50	233.70	100.70
PSL	1,330.00	934.80	402.80	332.50	233.70	100.70

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)
PTG	2,345.00	1,648.20	710.20	586.25	412.05	177.55
PTT	4,795.00	3,370.20	1,452.20	1,198.75	842.55	363.05
PTTEP	11,025.00	7,749.00	3,339.00	2,756.25	1,937.25	834.75
PTTGC	7,350.00	5,166.00	2,226.00	1,837.50	1,291.50	556.50
QH	245.00	172.20	74.20	61.25	43.05	18.55
RATCH	5,320.00	3,739.20	1,611.20	1,330.00	934.80	402.80
RS	2,310.00	1,623.60	699.60	577.50	405.90	174.90
S	210.00	147.60	63.60	52.50	36.90	15.90
SAMART	1,050.00	738.00	318.00	262.50	184.50	79.50
SAWAD	8,785.00	6,174.60	2,660.60	2,196.25	1,543.65	665.15
SCB (H21 onwards)	10,815.00	7,601.40	3,275.40	2,703.75	1,900.35	818.85
SCC	28,525.00	20,049.00	8,639.00	7,131.25	5,012.25	2,159.75
SGP	1,155.00	811.80	349.80	288.75	202.95	87.45
SIRI	140.00	98.40	42.40	35.00	24.60	10.60
SPALI	2,765.00	1,943.40	837.40	691.25	485.85	209.35
SPCG	2,275.00	1,599.00	689.00	568.75	399.75	172.25
SPRC	1,575.00	1,107.00	477.00	393.75	276.75	119.25
STA	4,620.00	3,247.20	1,399.20	1,155.00	811.80	349.80
STEC	1,715.00	1,205.40	519.40	428.75	301.35	129.85
STPI	700.00	492.00	212.00	175.00	123.00	53.00
SUPER	175.00	123.00	53.00	43.75	30.75	13.25
TASCO	2,695.00	1,894.20	816.20	673.75	473.55	204.05
TCAP	4,550.00	3,198.00	1,378.00	1,137.50	799.50	344.50
THAI	700.00	492.00	212.00	175.00	123.00	53.00
THANI (U21 onwards)*	560.00	393.60	169.60	140.00	98.40	42.40
THCOM	1,610.00	1,131.60	487.60	402.50	282.90	121.90
THG	1,925.00	1,353.00	583.00	481.25	338.25	145.75
TISCO	9,695.00	6,814.20	2,936.20	2,423.75	1,703.55	734.05
TKN	1,995.00	1,402.20	604.20	498.75	350.55	151.05
TMB	175.00	123.00	53.00	43.75	30.75	13.25
TOA	3,605.00	2,533.80	1,091.80	901.25	633.45	272.95

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)
TOP	7,700.00	5,412.00	2,332.00	1,925.00	1,353.00	583.00
TPIPL	210.00	147.60	63.60	52.50	36.90	15.90
TPIPP	385.00	270.60	116.60	96.25	67.65	29.15
TQM	19,600.00	13,776.00	5,936.00	4,900.00	3,444.00	1,484.00
TRUE	490.00	344.40	148.40	122.50	86.10	37.10
TTA	1,330.00	934.80	402.80	332.50	233.70	100.70
TTCL	1,120.00	787.20	339.20	280.00	196.80	84.80
TTW	1,155.00	811.80	349.80	288.75	202.95	87.45
TU	1,680.00	1,180.80	508.80	420.00	295.20	127.20
TVO	3,500.00	2,460.00	1,060.00	875.00	615.00	265.00
UNIQ	630.00	442.80	190.80	157.50	110.70	47.70
VGI	1,400.00	984.00	424.00	350.00	246.00	106.00
VNG	385.00	270.60	116.60	96.25	67.65	29.15
VNT	4,620.00	3,247.20	1,399.20	1,155.00	811.80	349.80
WHA	420.00	295.20	127.20	105.00	73.80	31.80
WHAUP	455.00	319.80	137.80	113.75	79.95	34.45

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	5,425.00	3,813.00	1,643.00	1,356.25	953.25	410.75
3M BIBOR	2,240.00	1,574.40	678.40	4,480.00	3,148.80	1,356.80

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	68,425.00	48,093.00	20,723.00	68,425.00	48,093.00	20,723.00
RSS3D	68,425.00	48,093.00	20,723.00	68,425.00	48,093.00	20,723.00
Spot Month Margin	216,300.00	152,028.00	65,508.00	-	-	-

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						
AMATAH21X	2,822.75	1,975.93	846.82	705.60	493.92	211.68
AMATAM21X	2,822.75	1,975.93	846.82	705.60	493.92	211.68
BCPG Futures						
BCPGH21X	2,129.75	1,490.83	638.92	532.35	372.65	159.70
BCPGM21X	2,129.75	1,490.83	638.92	532.35	372.65	159.70
BCPGU21X	2,129.75	1,490.83	638.92	532.35	372.65	159.70
BTS Futures						
BTSH21X	1,029.00	720.30	308.70	257.05	179.94	77.11
COM7 Futures						
COM7H21X	6,074.25	4,251.98	1,822.27	1,518.55	1,062.99	455.56
GULF Futures						
GULFH21Y	23,717.75	16,602.43	7,115.32	5,929.33	4,150.53	1,778.80
GULFM21X	4,740.75	3,318.53	1,422.22	1,185.40	829.78	355.62

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)
MINT Futures						
MINTH21X	4,515.00	3,160.50	1,345.50	1,128.96	790.27	338.69
THANI Futures						
THANIH21X	750.75	525.53	225.22	187.88	131.52	56.36
THANIM21X	750.75	525.53	225.22	187.88	131.52	56.36

อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit)

Underlying	Delivery Deposit (Per Contract)
GOLD-D	12,477.50
RSS3D	374,850.00

ทั้งนี้ ให้มีผลบังคับใช้ตั้งแต่วันที่ 25 มกราคม 2564 เป็นต้นไป จนกว่าจะมีการประกาศเปลี่ยนแปลงและให้ถือเป็น
การยกเลิก REF.No.AFC2021/01/002 วันที่ 13 มกราคม 2564

ประกาศ ณ วันที่ 22 มกราคม 2564