



ประกาศคณะกรรมการชรมมผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า

เลขที่ FIC 1/2563

เรื่อง อัตราทดความเสี่ยงของหลักประกันและอัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า

เพื่อให้อัตราทดความเสี่ยงของหลักประกัน (Margin Multiplier) และอัตราของอัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit Multiplier) ที่ประกาศโดยชรมมผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้ามีความเหมาะสมยิ่งขึ้น คณะกรรมการชรมมผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้าขอยกเลิกประกาศคณะกรรมการชรมมฯ เลขที่ FIC 1/2560 เรื่อง อัตราทดความเสี่ยงของหลักประกันและอัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าของ RSS3 Futures และ RSS3D Futures ลงวันที่ 23 มีนาคม 2560 เลขที่ FIC 2/2560 เรื่อง อัตราทดความเสี่ยงของหลักประกันและอัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าของ Gold-D ลงวันที่ 23 สิงหาคม 2560 เลขที่ FIC 1/2561 เรื่อง อัตราทดความเสี่ยงของหลักประกันของ Gold Online Futures ลงวันที่ 17 ตุลาคม 2561 รวมถึงอัตราทดความเสี่ยงของหลักประกันและอัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าที่ระบุในมาตรฐานการประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ฉบับ ธันวาคม 2562 และให้บริษัทสมาชิกใช้อัตราทดความเสี่ยงของหลักประกันและอัตราของอัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้าไม่ต่ำกว่าอัตราดังต่อไปนี้

- 1) SET50 Index Futures, SET50 Index Options, Single Stock Futures, Sector Index Futures, Interest Rate Futures, USD Futures, Gold Futures, Gold Online Futures, Silver Online Futures และ Japanese Rubber Futures

ประเภทลูกค้า	หลักประกันเริ่มต้น (Initial Margin Multiplier) ¹ (เท่า)	หลักประกันรักษาสภาพ (Maintenance Margin Multiplier) ¹ (เท่า)	หลักประกันปิดฐานระหว่างวัน (Intraday Force Close Multiplier) ¹ (เท่า)
ลูกค้าทั่วไป	1.75	1.23	0.53
ลูกค้าสถาบัน	1.35	1.00	-

¹ สำหรับหลักประกัน Maintenance Margin ที่ประกาศโดยสำนักหักบัญชี

- 2) Gold-D, RSS3 Futures และ RSS3D Futures

ประเภทลูกค้า	หลักประกันเริ่มต้น (Initial Margin Multiplier) ¹ (เท่า)	หลักประกันรักษาสภาพ (Maintenance Margin Multiplier) ¹ (เท่า)	หลักประกันปิดฐานระหว่างวัน (Intraday Force Close Multiplier) ¹ (เท่า)	อัตราทรัพย์สินเพื่อการส่งมอบสินค้า (Delivery Deposit Multiplier) (เท่า)
ลูกค้าทั่วไป	1.75	1.23	0.53	1.00
ลูกค้าสถาบัน	1.35	1.00	-	1.00
ผู้ประกันความเสี่ยง (Hedger) ² และผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market Maker)	1.35	1.00	-	1.00

¹ สำหรับหลักประกัน Maintenance Margin และ Spot Month Margin ที่ประกาศโดยสำนักหักบัญชี

² ผู้ประกันความเสี่ยง (Hedger) หมายถึง ผู้ประกันความเสี่ยง (Hedger) ที่ได้รับการขึ้นทะเบียนกับตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (TFEX)

ประกาศนี้มีผลบังคับตั้งแต่วันที่ 2 พฤศจิกายน 2563 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 27 ตุลาคม 2563

(นายชาญชัย กงทองลักษณะ)

ประธานกรรมการ

ชรมมผู้ประกอบธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า สมาคมบริษัทหลักทรัพย์ไทย