

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

23 กุมภาพันธ์ 2565



SET50 Futures:

SET50 ผันผวนแต่จบลงด้วยการเปลี่ยนแปลงที่ไม่มากนัก สะท้อนภาพราคาหุ้นที่ตูดซับเหตุการณ์ไปแล้วระดับหนึ่ง คาด SET50 ยังผันผวนต่อไปอีกระยะ Trading S50H22 กรอบ 1005-1020 จุด และให้เปิด Long ที่กรอบล่าง

SET50 Option:

แนะนำให้รอเปิด Long S50H22C1000 ที่ 14 จุด (SET50= 1005) เป้าทำกำไรที่ 24 จุด (SET50=1025) Cut Loss 3 จุดจากทุน คาด SET50 น่าจะปรับฐาน แต่ยังคงเชื่อว่า Downside จะมีไม่มาก

Single Stock Futures:

แนะนำเปิด Long GPSCH22 ที่บริเวณ 74.50 บาท เป้าทำกำไรที่ 76 บาท Cut Loss 0.75 บาทจากทุน ราคาหุ้นที่ปรับลดลงแรง จน Upside เปิดขณะที่ยังมีเรื่องการส่งเสริม EV เป็นแรงหนุน ทำให้มีโอกาสติดตัวกลับ

แนะนำถือสถานะ Long SCCH22 ทุน 393 บาท ปัจจุบันมีกำไร 19.75% เป้าทำกำไรที่ 400 บาท Stop Profit ที่ 395 บาท Lock กำไร 15% SCC กำลังเข้าสู่วัฏจักรของกำไรขาขึ้น ขณะที่ Valuation ปัจจุบันยังต่ำ

Gold Futures:

ราคาทองคำปรับขึ้นไปทดสอบบริเวณ 1900\$ แต่เชื่อว่ายังต้องย่อฐานในบริเวณดังกล่าวต่อไปอีกระยะหนึ่ง แนะนำ Trading GFG22 กรอบ 28970 – 29580 บาท (1880-1920\$)

SET50 Index Futures / Option	P. 3
Single Stock Futures	P. 6
Gold Futures	P. 8

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องสามารถดำเนินการได้อย่างรวดเร็วทัน ฝายวิจัยฯ จึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันทำการผ่าน 2 ช่องทาง เพื่อให้ นักลงทุนสามารถปรับเปลี่ยนกลยุทธ์ ได้มีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น คือ

แอปพลิเคชัน  ASP SMART [▶ ดาวน์โหลด](#)

Telegram [ASIA PLUS GROUP](#) [▶ ติดตามข่าวสารการลงทุน](#)

FOLLOW NOW  [Q Asia Plus Group](#)

RESEARCH DIVISION
บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส

เกิดศักดิ์ ทวีธีระธรรม
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจมงคล, CISA, CFA
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นวลพรรณ น้อยรัชชกุล
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันพานิชกิจ
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธส เกิดเนตร
ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



สถานะของนักลงทุน

	All Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	199,422	183,580	15,842	-20,799	-49,048	-326,320
Foreign	127,952	142,094	-14,142	-52,783	-59,280	10,474
Retail	333,917	335,617	-1,700	73,582	108,328	315,846

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	41,899	43,382	-1,483	-4,486	-4,025	-3,938
Foreign	84,934	99,918	-14,984	-33,249	-44,618	27,507
Retail	142,507	126,040	16,467	37,735	48,643	-23,569

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	132,759	121,658	11,101	-18,963	-50,733	-284,613
Foreign	19,998	22,547	-2,549	-23,690	-25,529	-28,418
Retail	127,612	136,164	-8,552	42,653	76,262	313,031

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	7,629	7,058	571	735	827	3,372
Foreign	20,984	18,887	2,097	2,903	9,498	2,388
Retail	14,837	17,505	-2,668	-3,638	-10,325	-5,760

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	178	567	-389	-574	-558	-2,435
Foreign	867	341	526	513	624	4,188
Retail	4,364	4,501	-137	61	-66	-1,838

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	181	465	-284	-90	555	1,270
Foreign	1,156	390	766	735	695	5,027
Retail	7,692	8,174	-482	-645	-1,250	-6,452

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

SET50 Overview

ประเด็นความเสี่ยงทางภูมิรัฐศาสตร์ระหว่างยูเครน-รัสเซียยังมีอยู่ จากล่าสุดสหรัฐฯและยุโรปที่ออกมาตราการคว่ำบาตรในทางเศรษฐกิจกับรัสเซีย แต่อย่างไรก็ตามหากประเมินจากทิศทางสินทรัพย์ต่างๆเริ่มนิ่งมากขึ้นสะท้อนจากค่าเงินรูเบิลของรัสเซียที่เริ่มชะลอการอ่อนค่า ราคาทองคำที่ทรงตัวบริเวณ 1900 เหรียญฯสวนทางตลาดหุ้นภูมิภาคและดัชนี Dow Jones Futures ที่เริ่มเห็นการรีバวนซึ่งสะท้อนนักลงทุนได้ Price In กับประเด็นดังกล่าวไปพอสมควร หากสถานการณ์ไม่ได้รุนแรงเพิ่มเติมเชื่อว่าแรงกดดันต่อตลาดหุ้นจะเริ่มจำกัดลง ด้านปัจจัยในประเทศจำนวนผู้ติดเชื้อ COVID-19 ที่ยังมีแนวโน้มปรับขึ้นโดยวันนี้จำนวนผู้ติดเชื้อไต่ระดับมาที่ 2.12 หมื่นรายเช่นเดียวกับจำนวนผู้เสียชีวิตที่เพิ่มขึ้น 39 รายซึ่งอาจมองเป็น Sentiment เชิงลบได้บ้าง แต่เชื่อว่าผลกระทบต่อตลาดยังจำกัดหากไม่กลับ Lockdown ส่วนประเด็นอื่น ๆวันนี้ติดตามการประชุม ศบค. ที่คาดว่าจะพิจารณาการปรับเกณฑ์ Test & Go โดยลดการตรวจ RT-PCR จาก 2 ครั้งเหลือ 1 ครั้ง ภายใต้ปัจจัยแวดล้อมที่ไม่ได้มีปัจจัยลบใหม่กดดันขณะที่ทิศทาง Fund Flow ต่างชาติยังคงไหลเข้า จึงคาด Downside ในการปรับลงของ SET50 Index จำกัดคาดการณ์การเคลื่อนไหวที่ 1005-1025 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: แรงกดดันระหว่างยูเครนและรัสเซียน่าจะดูซบไปในการราคาหุ้นพอสมควร ขณะที่ Fund Flow ยังมีแนวโน้มไหลเข้าจึงคาด Downside ในการปรับลงจำกัด แนะนำ Trading S50H22 ในกรอบ 1005-1020 จุดและเปิด Long ที่กรอบล่าง

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50M22 ลบด้วย S50H22 ณ วันที่ 30 มี.ค. 2565 จะเท่ากับ -4.46 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -5.30 จุด ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: แนะนำให้รอเปิด Long S50H22C1000 ที่ 14 จุด (SET50= 1005) เป้าทำกำไรที่ 24 จุด (SET50=1025) Cut Loss 3 จุดจากทุน คาด SET50 Downside ในการปรับลงจะมีไม่มาก



	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	1005	1025
S50H22	1000	1020

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยฯจึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ

แอปพลิเคชัน  ASP SMART
▶ [ดาวน์โหลด](#)

Telegram **ASIA PLUS GROUP**
▶ [ติดตามข่าวสารการลงทุน](#)

FOLLOW NOW
   
 Asia Plus Group

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	1016.55	13.03422	15.4416

Call Option

	Premium	Chg	Break Even	Intrinsic Value	Time Value	All-in-Premium	Theory Price	Volume	Open Interest	Implied Volatility	Delta	Effective Gearing	Time Decay
S50H22C1075	1.80	-0.10	> 1076.8	0.00	1.80	5.93%	0.24	286	5082	14.17	0.09	49.58	0.1
S50H22C1050	4.10	-0.80	> 1054.1	0.00	4.10	3.69%	1.52	977	7067	13.17	0.19	46.08	0.0
S50H22C1025	10.30	-1.60	> 1035.3	0.00	10.30	1.84%	6.35	1935	7253	12.92	0.37	37.00	0.0
S50H22C1000	24.10	-2.30	> 1024.1	16.55	7.55	0.74%	18.01	1341	5832	14.16	0.60	25.48	0.0
S50H22C975	42.50	-4.50	> 1017.5	41.55	0.95	0.09%	37.07	67	6204	15.62	0.77	18.48	0.0

Put Option

	Premium	Chg	Break Even	Intrinsic Value	Time Value	All-in-Premium	Theory Price	Volume	Open Interest	Implied Volatility	Delta	Effective Gearing	Time Decay
S50H22P1075	68.70	8.10	< 1006.3	58.45	10.25	-1.01%	64.91	2	26	16.14	-0.91	-13.41	0.0
S50H22P1050	44.80	5.80	< 1005.2	33.45	11.35	-1.12%	41.21	32	428	13.86	-0.81	-18.27	0.0
S50H22P1025	25.00	3.10	< 1000	8.45	16.55	-1.63%	21.06	623	1788	13.10	-0.62	-25.11	0.0
S50H22P1000	13.70	2.10	< 986.3	0.00	13.70	-2.98%	7.73	1666	4942	14.02	-0.41	-30.28	0.0
S50H22P975	7.90	1.40	< 967.1	0.00	7.90	-4.86%	1.80	1522	8759	16.95	-0.24	-30.66	0.0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สรุปการซื้อขาย
SET50	1016.55	-3.15	-0.31%	22/2/22

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50F22	989.59	0.0	0.0%	96	163	0
S50G22	1016.30	-3.8	-0.4%	114	233	24
S50H22	1009.90	-5.0	-0.5%	235,551	424,922	5,707
S50M22	1004.90	-5.0	-0.5%	25,177	53,329	-1,085
S50U22	999.70	-4.6	-0.5%	5,512	18,644	-269
S50Z22	999.70	-4.4	-0.4%	2,918	6,929	28

SET50 Futures Long(Short) : สัญญา	สะสม Long(Short)		
	Long	Short	Net
สถาบัน	41,899	43,382	-1,483
ต่างชาติ	84,934	99,918	-14,984
รายย่อย	142,507	126,040	16,467

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

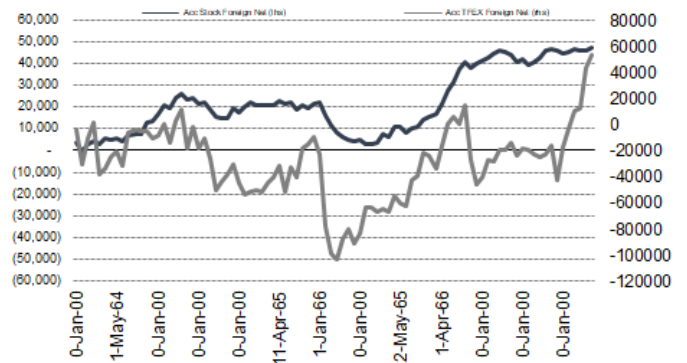
คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

	เป้าหมาย Spread ซีรียโกล - ซีรียโกล				
	S50J21	S50K21	S50M21	S50N21	S50Q21
	ณ 29 เม.ย.64	ณ 28 พ.ค.64	ณ 29 มิ.ย.64	ณ 29 ก.ค.64	ณ 30 ส.ค.64
S50J21					
S50K21	-1.68				
S50M21	-1.28	0.40			
S50N21	-1.16	0.53	0.13		
S50Q21	-5.13	-3.62	-4.02	-4.15	
S50U21	-5.81	-4.13	-4.53	-4.66	-0.51

*สมมติฐานอัตราดอกเบี้ยนโยบายระหว่าง มิ.ย. - ก.ย. 64 เท่ากับ 0.5%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 Futures



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

SET50 ที่ระดับค่า PER ต่างๆ

SET 50 Sensitivity	ม.ค. 65E	มี.ค. 65E	เม.ย. 65E	พ.ค. 65E	มิ.ย. 65E	ก.ย. 65E	ธ.ค. 65E
PER 20	933	952	961	971	980	1,008	1,036
PER 20.5	957	976	985	995	1,005	1,033	1,062
PER 21	980	1,000	1,009	1,019	1,029	1,058	1,088
PER 21.5	1,003	1,023	1,033	1,043	1,054	1,084	1,114
PER 22	1,027	1,047	1,057	1,068	1,078	1,109	1,140
PER 22.5	1,050	1,071	1,082	1,092	1,103	1,134	1,166
PER 23	1,073	1,095	1,106	1,116	1,127	1,159	1,191
PER 23.5	1,097	1,119	1,130	1,141	1,152	1,184	1,217

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



Single Stock Futures

Long GPSCH22

กำไรสุทธิงวด 4Q64 ลดลง 37.7%qoq ต่ำกว่าคาด กดดันจากกำไรปกติที่ลดลงถึง 66.8%qoq หลักๆมาจากต้นทุนที่ก๊าซฯ และถ่านหิน ที่เพิ่มขึ้น รวมถึงการหยุดฉุกเฉิน โรงไฟฟ้า GLOW Energy phase 5 และส่วนแบ่งกำไรบริษัทร่วมที่ลดลงจาก XPCL เป็นหลัก ช่วงสั้น 1Q65 คาดกำไรปกติจะเริ่มฟื้นตัว QoQ จากความต้องการการใช้ไฟฟ้าที่เพิ่มขึ้นตามช่วงฤดูกลาง FV ใหม่อยู่ที่ 86.5 บาท/หน่วย

ภาพทางเทคนิค อยู่ในจังหวะการปรับฐาน โดยมีสัญญาณบวกทางเทคนิค จากการทำ จังหวะ Higher Low พร้อมแท่งเทียนปิดเป็นแท่งเทียน Hammer โดยประเมินเป้าหมาย ทำกำไรไว้ที่ 76.00 บาท

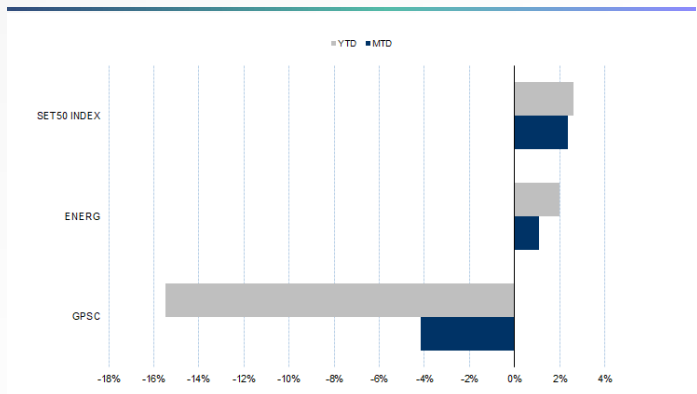
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long GPSCH22 บริเวณ 74.50 บาท เป้าทำกำไร 76บาท cut 0.75 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
GPSCH22	74.62	-0.40	519	8771	208	8.71	17.65%	29.89	1.85	-1.33%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures



DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



Long SCCH22

งวด 4Q64 กำไรสุทธิ 8,307 ล้านบาท ต่ำกว่า ธุรกิจปิโตรเคมีกำไรลดลง แม้ Spread เพิ่มขึ้น แต่ได้ประโยชน์ไม่เต็มที่เพราะมีการขายสินค้าล่วงหน้าบวกกับส่วนแบ่งกำไรบริษัทร่วมที่ลดลงมาก ธุรกิจซีเมนต์-ผลิตภัณฑ์ก่อสร้างทำกำไรเติบโต ได้แรงหนุนจากยอดขายและส่วนแบ่งกำไรบริษัทร่วม ธุรกิจ Packaging กำไรเติบโตแต่เกิดจากรายการพิเศษ โดยรวมปี 2564 กำไร 47,174 ล้านบาท เพิ่มขึ้น 38%YoY XD 7 เม.ย 65

ภาพทางเทคนิค จังหวะปรับขึ้น พร้อมสัญญาณบวกทางเทคนิค จากแท่งเทียนเขียวเต็มแท่ง ยืนเหนือเส้น EMA 200 วัน สะท้อนโมเมนตัมเชิงบวก โดยมีเป้าหมายที่ 400 บาท

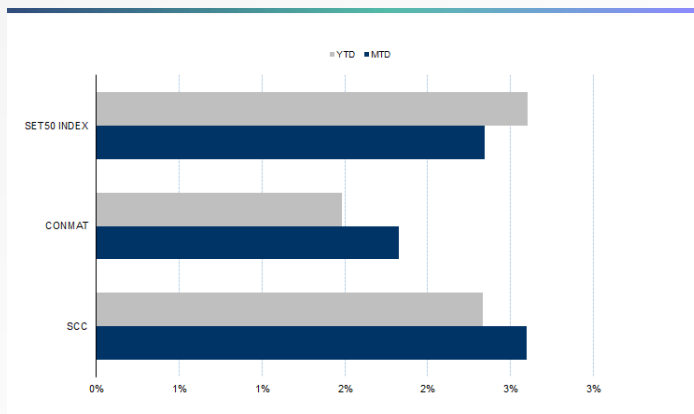
กลยุทธ์การลงทุน

เปิด Long SCCH22 ได้บริเวณ 393 บาท กำไร 19.75% เป้าทำกำไร 400 บาท Lock กำไร 15% ที่ 395 บาท

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
SCCH22	396.75	3.90	633	3102	-60	14.31	25.94%	10.25	1.19	-4.20%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Technical Chart



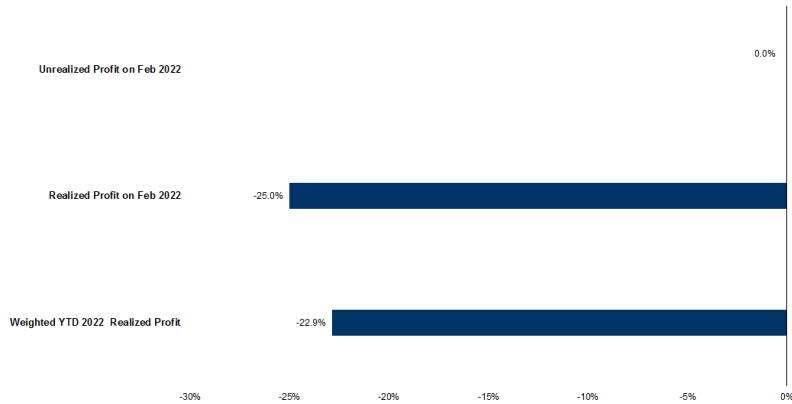
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Tracking Performance

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



หมายเหตุ: การคำนวณผลตอบแทนจะใช้ราคาเปิดในวันและนำเป็นต้นทุน เทียบกับราคาปิดล่าสุด เป็นผลตอบแทนสะสมจนกว่าจะถึงวันที่ฝ่ายวิจัยแนะนำให้ปิดสถานะทำกำไรหรือตัดขาดทุน

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Top 20 Most Active Volume

	Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	TRUEH22	5.59	-0.11	66627	122814	-8	15.00	5.28	4.93
2	IRPCH22	3.84	-0.14	14186	51505	1114	11.64	3.84	3.76
3	BTSH22	10.24	0.04	11409	22468	-500	9.81	9.93	9.36
4	JASH22	3.72	-0.02	10393	139632	2446	8.20	3.79	3.48
5	BEMH22	8.97	0.07	10148	25341	-10	12.33	9.04	8.52
6	GULFH22	51.50	-0.50	7492	15086	1312	2.65	50.05	48.67
7	PTTH22	38.84	-0.66	7249	11289	-874	11.55	38.59	37.27
8	BCPGH22	13.04	-0.06	6877	15562	313	5.56	13.47	12.58
9	TTBH22	1.45	0.03	6079	92596	1067		1.40	1.33
10	GUNKULH22	6.71	0.01	6031	221517	-533	25.19	6.74	6.44
11	CKPH22	5.20	0.00	3088	23994	22	5.47	5.49	5.19
12	KBANKH22	169.02	0.02	3079	3995	228	13.16	175.28	157.40
13	SPRCH22	8.99	-0.01	2578	12250	975	7.18	9.63	8.73
14	DTACH22	50.51	-0.74	2466	6272	-486	12.26	48.80	46.50
15	WHAH22	3.65	0.01	2126	65390	2501	8.71	3.50	3.36
16	CPALLH22	65.50	-0.25	2101	6886	-360	14.92	67.39	63.18
17	SIRIH22	1.29	-0.01	2008	72794	8549	11.40	1.30	1.23
18	CPFH22	26.00	0.00	1932	22863	-193	8.45	26.42	25.89
19	MAJORH22	21.20	0.40	1913	6722	-100	8.83	21.55	20.10
20	BANPUH22X	10.93	0.03	1852	67249	696	13.04	11.06	10.52

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ปรับลดลง 5.2 เหรียญฯ ปิดที่ 1,898 เหรียญฯ จากแรงเทขายบางส่วน หลังราคาปรับขึ้นต่อเนื่องตั้งแต่ต้นเดือนที่ผ่านมา แต่อย่างไรก็ดีการปรับลงของราคาทองคำยังเป็นไปอย่างจำกัด เพราะมีแรงหนุนจากค่าเงินดอลลาร์อ่อนค่า และความกังวลเกี่ยวกับสถานการณ์รัสเซีย-ยูเครน หลังวุฒิสภารัสเซียอนุมัติให้ผู้นำรัสเซียสามารถใช้กองทัพนอกประเทศเพื่อให้การสนับสนุนกลุ่มแบ่งแยกดินแดนในยูเครน ขณะที่ฝั่งสหรัฐและเยอรมันเริ่มประกาศมาตรการคว่ำบาตรต่อรัสเซีย โดยปัจจัยดังกล่าวคงเป็นแรงหนุนให้เกิดแรงเข้าซื้อต่อทองคำในฐานะสินทรัพย์ปลอดภัยสำหรับสัปดาห์นี้ ต้องติดตามประเด็นรัสเซีย-ยูเครน ยังมีการรายงานข้อมูลเศรษฐกิจสหรัฐ เช่น GDP 4Q64, จำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงาน และยอดขายบ้านใหม่ ฯลฯ

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFG22 เมื่อคืน เพิ่มขึ้น 220 บาท ปิดที่ 29,360 บาท (สวนทางตลาดโลกจากผลกระทบค่าเงินบาทอ่อนค่า) เทียบเท่า 1,905 เหรียญฯ สูงกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดวันนี้ที่ใกล้เคียงระดับ 1,900 เหรียญฯ คาดราคา GFG22 วันนี้จะแกว่งตัวในกรอบ 29,100-29,500 บาท จากความกังวลต่อรัสเซีย-ยูเครน ยังหนุนให้ราคาทองคำแกว่งตัวในกรอบที่ฝ่ายวิจัยประเมินไว้ จึงคงแนะนำ Trading GFG22 บริเวณ 1,880-1,920 เหรียญฯ หรือ 28,970-29,580 บาท และกำหนดจุด Cut Loss ไว้ 100 บาท จากทุน ป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GFG22	29,360	170	0.58	66	222	11
GF322	29,320	70	0.24	95	231	-34
GF22	29,320	70	0.24	64	135	-30

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10G22	29,300	50	0.17	2,155	5,532	-22
GF10J22	29,310	50	0.17	3,205	8,894	1039
GF10M22	29,300	30	0.10	1,860	3,505	-94

หมายเหตุ : ราคาปิดของ Gold Futures (Night Session) Settle ณ เวลา 22.00 น. และปริมาณการซื้อขายเกิดขึ้นในช่วงเวลา 19.30-22.30 น.

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



GOLD Technical

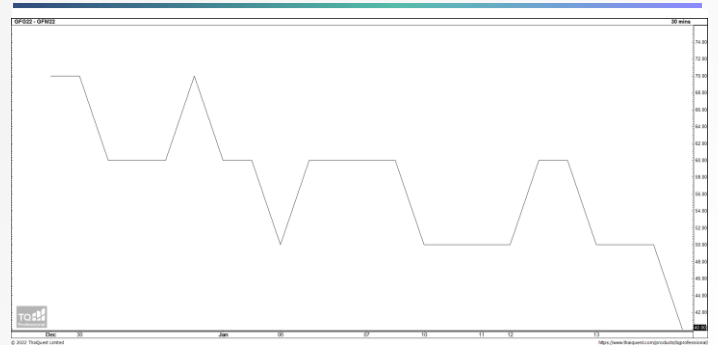
ทิศทางราคาทองคำ Breakout High บริเวณ \$1900 สนับสนุนด้วยแท่งเทียนทำจิ้งหะ Higher Low พร้อม EMA 10 วันสนับสนุน คาดแกว่งกรอบการเคลื่อนไหวที่ \$1900-\$1960

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD Londin AM (USD/Ounce)	FX (บาท/ USD)				
	32.50	32.75	33.00	33.25	33.50
1,700	26,262	26,464	26,666	26,868	27,070
1,730	26,725	26,931	27,137	27,342	27,548
1,760	27,189	27,398	27,607	27,816	28,025
1,790	27,652	27,865	28,078	28,290	28,503
1,820	28,116	28,332	28,548	28,765	28,981
1,850	28,579	28,799	29,019	29,239	29,458
1,880	29,043	29,266	29,489	29,713	29,936
1,910	29,506	29,733	29,960	30,187	30,414
1,940	29,969	30,200	30,431	30,661	30,892

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Spread ระหว่าง GFG22 – GFM22



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Gold Futures

นักลงทุนรายย่อย (ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร(ขาดทุน)สุทธิ
29,610.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
29,560.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
29,510.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
29,460.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
29,410.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
29,360.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
29,310.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
29,260.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
29,210.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
29,160.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
29,110.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

นักลงทุนรายย่อย (ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร(ขาดทุน)สุทธิ
29,550.00	250.0	2,500	(210)	2,290
29,500.00	200.0	2,000	(210)	1,790
29,450.00	150.0	1,500	(210)	1,290
29,400.00	100.0	1,000	(210)	790
29,350.00	50.0	500	(210)	290
29,300.00	0.0	-	(210)	(210)
29,250.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
29,200.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
29,150.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
29,100.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
29,050.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส