

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

5 กรกฎาคม 2564



SET50 Futures:

SET50 ยังมีโอกาสปรับฐานต่อจากปัจจัยแวดล้อมที่ส่วนใหญ่มีน้ำหนักไปทางลบ เฉพาะอย่างยิ่ง Covid-19 ในประเทศ แนะนำ Trading S50U21 ในกรอบ 930 – 940 จุด และให้ Short ที่กรอบบน

SET50 Option:

แนะนำถือสถานะ Long S50U21P975 ทุน 36 จุด ปัจจุบันมีกำไรเพิ่มเป็น 6 จุด เป้าทำกำไรปรับมาที่ 56 จุด (SET50=935) ตั้ง Stop profit ที่ทุน เพื่อปิดโอกาสขาดทุนในรอบนี้

Single Stock Futures:

สถานะ Long ADVANCU21 ทุน 170.50 บาท ปิดรับกำไร 10% แนะนำเปิด Long BDMSU21 ที่บริเวณ 23.20 บาท เป้าทำกำไรที่ 24 บาท Cut Loss 0.30 บาทจากทุน กระแส Vaccine ทางเลือกช่วยหนุนราคาหุ้น

แนะนำถือสถานะ Short BTSU21 ทุน 9.22 บาท ปัจจุบันมีกำไร 8.16% เป้าทำกำไรที่ 8.90 บาท Cut Loss 0.10 บาทจากทุน เชื่อว่า BTS ได้รับผลกระทบจากมาตรการควบคุมการระบาดของ Covid-19 ในประเทศ

Gold Futures:

ราคาทองคำปรับตัวขึ้นเล็กน้อย แต่เชื่อว่าจะยังมีลักษณะเป็น Technical Rebound คาดหมายเคลื่อนไหวอยู่ในกรอบแคบๆ แนะนำ Trading GFQ21 ในกรอบ 270500 – 27510 (1770-1800\$) และให้เปิด Long กรอบล่าง

SET50 Index Futures / Option	P. 3
Single Stock Futures	P. 5
Gold Futures	P. 8

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องสามารถดำเนินการได้อย่างรวดเร็วทัน ฝ่ายวิจิชฯ 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 เอเชีย พลัส

เกิดศักดิ์ ทวีธีระธรรม
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจมงคล, CISA, CFA
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นवलพรรณ น้อยรัชชกุล
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันพานอกกิจ
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธ เกิดเนตร
ผู้ช่วยนักวิเคราะห์



สถานะของนักลงทุน

All Futures Long(Short) Position : Contract	Accumulated Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	118,255	135,061	-16,806	-50,091	-67,852	-215,496
Foreign	103,248	106,839	-3,591	-7,536	2,828	32,803
Retail	251,446	231,049	20,397	57,627	65,024	182,693

SET50 Futures Long(Short) Position : Contract	Accumulated Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	33,311	27,012	6,299	1,290	2,236	6,081
Foreign	59,343	73,167	-13,824	-14,172	-21,956	-30,900
Retail	104,496	96,971	7,525	12,882	19,720	24,819

Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract	Accumulated Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	74,203	101,224	-27,021	-58,929	-81,683	-269,381
Foreign	23,306	16,868	6,438	-2,513	16,340	75,826
Retail	109,182	88,599	20,583	61,442	65,343	193,555

Metal Futures Long(Short) Position : Contract	Accumulated Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	5,660	6,073	-413	3,829	2,163	4,483
Foreign	20,453	16,718	3,735	9,093	8,101	-10,999
Retail	20,767	24,089	-3,322	-12,922	-10,264	6,516

Call Option Long(Short) Position : Contract	Accumulated Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	176	310	-134	-145	-127	-1,337
Foreign	6	6	0	-218	-240	10
Retail	2,639	2,505	134	363	367	1,423

Put Option Long(Short) Position : Contract	Accumulated Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	752	154	598	484	690	1,018
Foreign	53	6	47	265	689	187
Retail	2,788	3,433	-645	-749	-1,243	-1,472

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



SET50 Overview

การรายงานตัวเลขการจ้างงานของสหรัฐฯเพิ่มขึ้น 8.5 แสนตำแหน่งดีกว่าตลาดคาด 7.2 แสนตำแหน่ง แต่อย่างไรก็ตามอัตราว่างงานที่กลับมาเพิ่มขึ้นมาที่ 5.9% แย่กว่าที่ตลาดคาด 5.6% ทำให้ตลาดคาดว่า FED จะยังไม่ปรับเปลี่ยนนโยบายการเงินฯ หนุนดัชนี Dow Jones ปรับขึ้น 0.44% แต่อย่างไรก็ตามประเมินจากมุมมองของ IMF ล่าสุดที่คาดว่า FED อาจมีการทำ QE Tapering ในช่วงต้นปี 2565 และขึ้นดอกเบี้ยฯปลายปี 2565 จากการพัฒนาตัวของเศรษฐกิจที่แข็งแกร่งของสหรัฐฯ (ถือว่าเร็วกว่า FOMC Dot Plot ที่คาดว่าขึ้นดอกเบี้ยฯในปี 2566) ทำให้ประเด็นดังกล่าวยังมีความไม่แน่นอนและอาจกลับมาสร้างความผันผวนต่อตลาดหุ้นได้ตลอดเวลา ทั้งนี้ฝ่ายวิจัยฯคาดว่า FED อาจมีการส่งสัญญาณทำ QE Tapering ในช่วง 3Q63 ส่วนประเด็นในประเทศมีน้ำหนักในทางลบจากการบริหารจัดการ COVID-19 ที่จำนวนผู้ติดเชื้อยังเร่งตัว การฉีดวัคซีนยังอยู่ในระดับต่ำซึ่งอาจนำมาซึ่งเป้าการเปิดประเทศภายใน 120 วันนี้อาจล่าช้าออกไป สถานการณ์ดังกล่าวมองเป็นความเสี่ยงต่อปรับการ Downgrade ประมาณการ GDP Growth64 และกำไรบริษัทจดทะเบียน 2H64 ด้านทิศทาง Fund Flow หากประเมินจากค่าเงินบาทที่ยังมีแนวโน้มอ่อนค่าล่าสุดอยู่ที่ 32.17 บาท/usd น่าจะขึ้นนำถึงเม็ดเงินต่างชาติยังมีแนวโน้มไหลออก ขณะที่เม็ดเงินในประเทศยังคาดหวังไม่ได้มากนักจากสภาพแวดล้อมปัจจุบัน จึงคาด SET50 Index วันนี้แกว่งผันผวนทางลงในกรอบ 935 – 950 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: คาด SET50 Index แกว่งผันผวนทางลงจากความกังวลต่อสถานการณ์ COVID-19 ในประเทศที่ยังกดดัน แนะนำ Trading Short ไม่ต่ำกว่า 940 จุด เป้าทำกำไร 930 จุด และ Cut Loss 4 จุดจากทุน

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50U21 ลบด้วย S50M21 ณ วันที่ 29 มิ.ย. 2564 จะเท่ากับ -1.57 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -1.20 จุด ประเมิน Spread ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: แนะนำถือสถานะ Long S50U21P975 ทุน 36 จุด ปัจจุบันมีกำไร 6 จุด แนะนำถือต่อและขยับเป้าทำกำไรปรับมาที่ 56 จุด (SET50=935) และเลื่อน Stop Profit มาที่ทุนเพื่อปิดโอกาสขาดทุนของรอบ

	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	935	950
S50U21	930	945

*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	949.27	20.25214	7.616855

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
S50U21C1050	1.60	-0.60	> 1051.6	0.00	1.60	10.78%	1.83	183	1485	13.54	0.06	33.63	0.1
S50U21C1025	2.80	-1.10	> 1027.8	0.00	2.80	8.27%	3.85	269	1609	13.19	0.10	35.36	0.1
S50U21C1000	5.40	-1.60	> 1005.4	0.00	5.40	5.91%	7.53	893	2005	12.90	0.18	32.31	0.1
S50U21C975	10.70	-2.80	> 985.7	0.00	10.70	3.84%	13.66	465	1764	12.34	0.30	26.44	0.0
S50U21C950	20.10	-4.60	> 970.1	0.00	20.10	2.19%	22.99	427	1158	12.50	0.46	21.66	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
S50U21P1050	105.00	7.90	< 945	100.73	4.27	-0.45%	108.39	0	30	18.11	-0.85	-8.55	0.0
S50U21P1025	84.30	7.60	< 940.7	75.73	8.57	-0.90%	85.44	4	154	10.37	-0.94	-11.41	0.0
S50U21P1000	62.00	7.00	< 938	50.73	11.27	-1.19%	64.13	89	258	11.18	-0.83	-13.34	0.0
S50U21P975	42.00	5.20	< 933	25.73	16.27	-1.71%	45.28	54	359	11.76	-0.70	-16.34	0.0
S50U21P950	26.70	3.60	< 923.3	0.73	25.97	-2.74%	29.63	641	1356	12.43	-0.53	-19.00	0.0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สปรนการซื้อขาย
SET50	949.27	-8.09	-0.85%	2/17/21

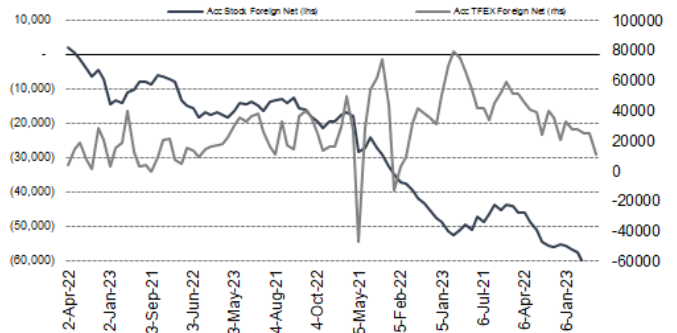
Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50K21	956.74	0.0	0.0%	17	154	0
S50M21	955.21	0.0	0.0%	43,671	51,204	489
S50N21	948.10	-7.9	-0.8%	526	464	0
S50U21	943.50	-7.6	-0.8%	174,160	326,168	-43
S50Z21	942.30	-7.6	-0.8%	17,150	30,680	0
S50H22	939.20	-7.3	-0.8%	3,763	6,513	0

SET50 Futures	Long(Short) : สับคยา			สลบ Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	QTD
สถาบัน	117,327	134,597	-17,270	1,290	542	0
ต่างชาติ	103,189	106,827	-3,638	-14,172	-27,828	0
รายย่อย	246,019	225,111	20,908	12,882	27,286	0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ

ในตราสารทุน และ SET50 Futures



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

เป้าหมาย Spread ชีรี่ใกล้ - ชีรี่ไกล

	S50N21	S50Q21	S50U21	S50V21	S50X21	S50Z21
	ณ 29 ก.ค.64	ณ 30 ส.ค.64	ณ 29 ก.ย.64	ณ 28 ต.ค.64	ณ 29 พ.ย.64	ณ 29 ธ.ค.64
S50N21						
S50Q21	-4.23					
S50U21	-4.74	-0.51				
S50V21	-5.58	-1.35	-0.84			
S50X21	-6.71	-2.47	-1.97	-1.13		
S50Z21	-6.31	-2.08	-1.57	-0.73	0.40	

*สมมติฐานอัตราดอกเบี้ยนโยบายระหว่าง ต.ค. - ธ.ค. 64 เท่ากับ 0.5%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

SET50 ที่ระดับค่า PER ต่างๆ

SET 50 Sensitivity	(บาท)	ม.ค. 62E	มี.ค. 62E	เม.ย. 62E	พ.ค. 62E	มิ.ย. 62E	ก.ย. 62E	ธ.ค. 62E
PER 15.5	898	870	857	843	830	789	748	
PER 16	926	899	885	871	857	815	773	
PER 16.5	955	927	912	898	883	840	797	
PER 17	984	955	940	925	910	866	821	
PER 17.5	1,013	983	967	952	937	891	845	
PER 18	1,042	1,011	995	979	964	916	869	
PER 18.5	1,071	1,039	1,023	1,007	990	942	893	
PER 19	1,100	1,067	1,050	1,034	1,017	967	918	

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



Single Stock Futures

Long BDMSU21

ทิศทางผลประกอบการทำจุด Bottom ใน 1Q64 ในช่วง 2Q64 รายได้เกี่ยวกับ COVID - 19 ทั้งในการให้บริการตรวจและรักษาผู้ป่วยชดเชยรายได้ผู้ป่วย Fly In ที่หายไป ขณะที่ระยะกลาง-ยาว เชื่อว่ารายได้ผู้ป่วย Fly In จะกลับมาในช่วง 2H64 จากความคืบหน้าการกระจายวัคซีน โดยประเมิน Fair Value ไว้ที่ 24 บาท

ภาพทางเทคนิค ทำจังหวะ Higher Low เป็นสัญญาณบวกทางเทคนิค สนับสนุนด้วยเส้น EMA 10 วัน เป็นแนวรับ ที่ 23.20 บาท หากย่อมาบริเวณดังกล่าว ใช้เป็นจุดเข้าสะสม โดยประเมินแนวต้านถัดไปอยู่บริเวณ 24.00 บาท

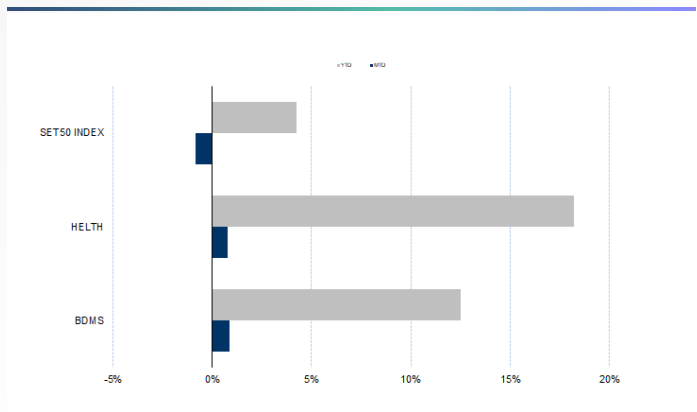
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำเปิด Long BDMSU21 บริเวณ 23.20 บาท เป้าทำกำไร 24.00 บาท และ Cut Loss 0.30 บาทจากทุน

Future								Underlying			
Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
BDMSU21	23.30	-0.10	23.37	2459	4839	-907	14.00	2.56%	42.93	4.05	20.06%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



Short BTSU21

มาตรการ Lock down คาดกระทบหุ้น Domestic Play จากการดำเนินกิจกรรมทางเศรษฐกิจชะลอลง โดยเฉพาะใน กทม. ที่เป็นหนึ่งในจังหวัดเป้าหมาย ซึ่ง BTS น่าจะเป็นหนึ่งในหุ้นที่เสียประโยชน์

ภาพทางเทคนิค หลุดกรอบ Sideway บริเวณเส้น EMA 200 วัน พร้อมเกิดแท่งเทียน Bearish Breakout บ่งชี้ว่า ราคาเลือกทางปรับฐานโดยมีเป้าหมายการต่ำทำไรอยู่บริเวณแนวรับที่ 9.30 บาท

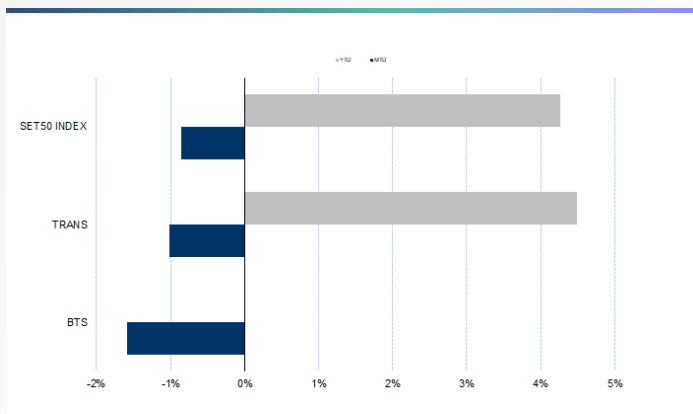
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำถือ Short BTSU21 ทุน 9.22 บาท ปัจจุบันกำไร 8.16% เป้าทำกำไร 8.90 บาท และ Cut loss 0.10 บาทจากทุน

Future								Underlying			
Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
BTSU21	9.19	-0.16	9.34	15	20058	-15	8.99	29.41%	45.08	1.74	-40.38%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

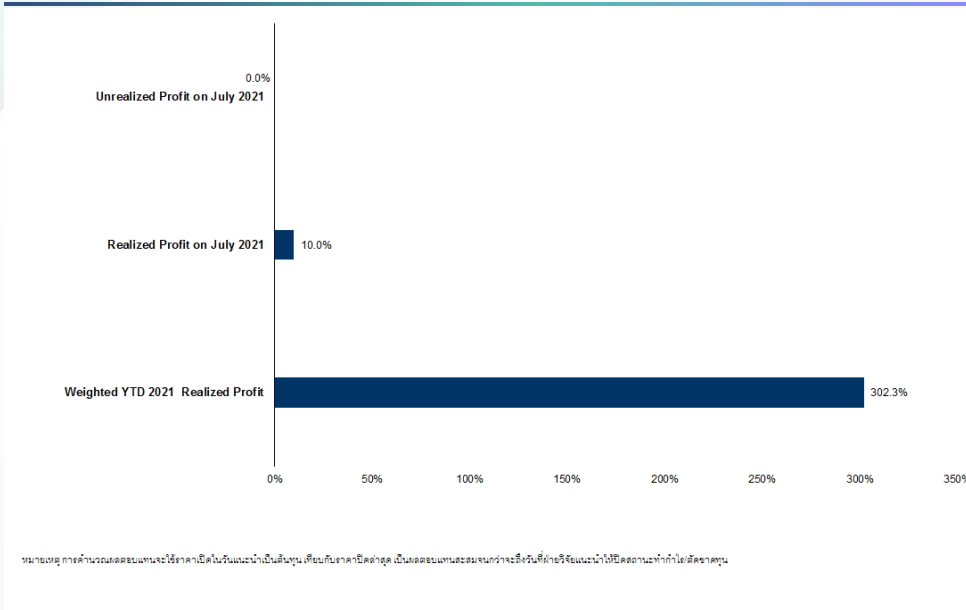
Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



Tracking Performance



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Top 20 Most Active Volume

	Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	SIRIU21	1.35	0.02	1.33	21779	248018	11099	11.67	1.37	1.31
2	GUNKULU21	4.90	-0.04	4.93	14918	128118	5822	18.57	5.28	4.50
3	BANPUU21	13.00	-0.30	13.28	14385	19097	8821	15.91	15.03	12.80
4	CHGU21	4.06	-0.04	4.09	9134	36700	-440	15.41	4.14	3.66
5	KBANKU21	121.82	-0.18	121.84	5509	9943	1662	9.50	123.16	116.39
6	SUPERU21	0.95	0.02	0.93	5060	175368	2374	6.12	0.98	0.93
7	BLANDU21	1.11	0.00	1.11	4320	132703	25	9.74	1.13	1.09
8	ITDU21	2.53	0.03	2.50	3269	22531	1533	16.45	2.64	2.29
9	WHAU21	3.26	0.04	3.22	3003	31058	-999	7.70	3.30	3.19
10	BDMU21	23.55	-0.15	23.67	2459	4934	-95	14.17	23.84	22.84
11	IRPCU21	3.92	0.00	3.92	2265	72814	2579	11.46	3.97	3.78
12	CPFU21	27.10	0.10	26.97	2252	37170	3	8.77	27.12	26.49
13	EPGU21	11.00	0.00	10.99	2084	13785	527	18.09	11.75	11.00
14	VGIU21	6.05	0.05	5.99	2044	15158	22	4.78	6.35	5.96
15	STPIU21	5.20	0.05	5.14	2021	11564	-995	7.97	5.20	4.71
16	PTTU21	39.62	0.62	38.95	1983	6502	3827	11.40	40.63	39.18
17	MINTU21	29.99	-0.26	30.21	1832	4010	95	8.68	31.36	28.96
18	BECU21	13.90	0.10	13.78	1671	13416	-3555	19.11	13.90	12.98
19	SPRCU21	9.66	0.01	9.64	1511	2018	1011	7.70	10.10	9.47
20	PTGU21	18.56	0.16	18.38	1506	14163	4	6.54	19.02	18.31

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



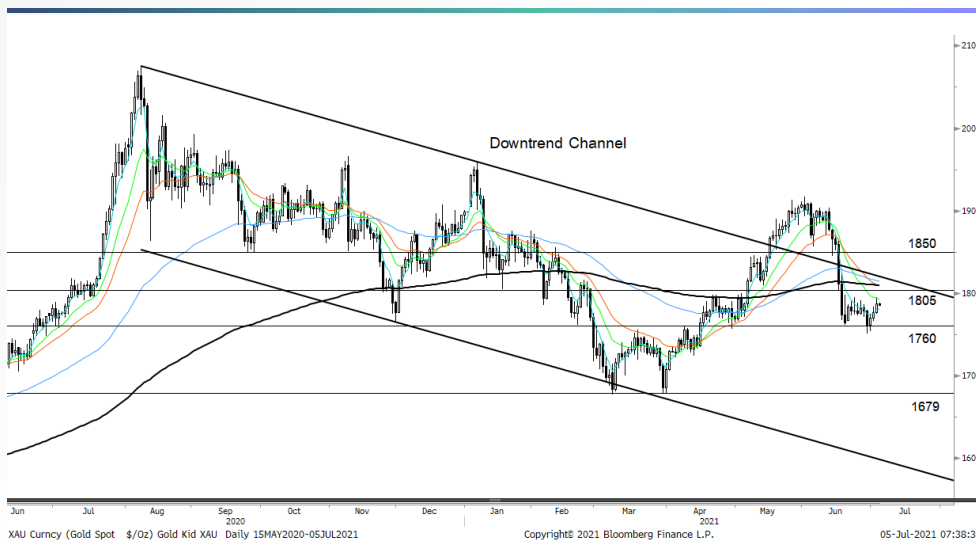
Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืนวันศุกร์ที่ผ่านมา เพิ่มขึ้น 11 เหรียญฯ หรือ 0.6% ปิดอยู่ที่ 1,787.3 เหรียญฯ แรงหนุนจากการปรับลงของอัตราผลตอบแทนสหรัฐอายุ 10 ปี และการอ่อนค่าของค่าเงินดอลลาร์สหรัฐ หลังแข็งค่าเร็วเกินไปในช่วงที่ผ่านมา และการเปิดเผยตัวเลขการว่างงานสหรัฐที่น่าผิดหวัง แม้การจ้างงานนอกภาคเกษตรเพิ่มขึ้นเกินคาดก็ตาม ภาพรวม Dollar Index ปรับลง 0.3% ปิดบริเวณ 92.24 จุด โดยสัปดาห์นี้ ต้องติดตามรายงานการประชุมเฟดประจำเดือนมิ.ย. และความคืบหน้าในการผลักดันร่างกฎหมายโครงสร้างพื้นฐานของประธานาธิบดีโจ ไบเดน

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFO21 เมื่อคืนวันศุกร์ที่ผ่านมา เพิ่มขึ้น 300 บาท ปิดอยู่ที่ 27,310 บาท (หรือ 1,786.8 เหรียญฯ) ใกล้เคียงราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหว 1,786 เหรียญฯ คาดราคา GFO21 วันนี้ จะอยู่ในกรอบ 27,200-27,500 บาท เนื่องจากไม่เห็นปัจจัยใหม่เข้ามาขับเคลื่อน ฝ่ายวิจัยจึงแนะนำให้นักลงทุน Trading GFO21 บริเวณ 1,770-1,800 เหรียญฯ หรือ 27,050-27,510 บาท แต่หากราคาทองคำขยับลงมาแตะกรอบล่าง แนะนำให้รอเปิดสถานะ Long ทั้งนี้ นักลงทุนควรกำหนดจุด Cut Loss ไว้ 100 บาทจากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GFQ21	27,310	-40	-0.15	47	465	1
GFV21	27,350	-40	-0.15	115	226	1
GFZ21	27,390	320	1.18	5	11	-1

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10Q21	27,400	70	0.26	3,930	7,439	502
GF10V21	27,420	50	0.18	2,127	4,649	441
GF10Z21	27,440	10	0.04	315	993	119

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 มีแรงซื้อกลับ เข้าสู่กรอบ Trading ที่ \$1760-\$1805 ระยะถัดไปหากไม่หลุดกรอบล่าง คาดอาจเห็นจังหวะการเกิด Technical Rebound ที่ \$1805 และ \$1850 แต่ต้องระวังหากหลุดกรอบล่าง มีความเสี่ยงเปิด Downside มาที่ \$1679

ASPS Gold Valuation Matrix (เหรียญฯ / ทรอยออนซ์)

	←												→											
	93	94	95	96	97	98	99	100	101	102	103	93	94	95	96	97	98	99	100	101	102	103		
Nymex (USD/Barrel)	40	1,617.66	1,589.21	1,560.76	1,532.31	1,503.86	1,475.41	1,446.96	1,418.52	1,390.07	1,361.62	1,333.17	1,333.17	1,361.62	1,390.07	1,418.52	1,446.96	1,475.41	1,503.86	1,532.31	1,560.76	1,589.21	1,617.66	
	43	1,616.71	1,588.26	1,559.81	1,531.36	1,502.91	1,474.47	1,446.02	1,417.57	1,389.12	1,360.67	1,332.22	1,332.22	1,360.67	1,389.12	1,417.57	1,446.02	1,474.47	1,502.91	1,531.36	1,559.81	1,588.26	1,616.71	
	46	1,615.76	1,587.31	1,558.86	1,530.42	1,501.97	1,473.52	1,445.07	1,416.62	1,388.17	1,359.72	1,331.28	1,331.28	1,359.72	1,388.17	1,416.62	1,445.07	1,473.52	1,501.97	1,530.42	1,558.86	1,587.31	1,615.76	
	49	1,614.82	1,586.37	1,557.92	1,529.47	1,501.02	1,472.57	1,444.12	1,415.67	1,387.23	1,358.78	1,330.33	1,330.33	1,358.78	1,387.23	1,415.67	1,444.12	1,472.57	1,501.02	1,529.47	1,557.92	1,586.37	1,614.82	
	52	1,613.87	1,585.42	1,556.97	1,528.52	1,500.07	1,471.62	1,443.18	1,414.73	1,386.28	1,357.83	1,329.38	1,329.38	1,357.83	1,386.28	1,414.73	1,443.18	1,471.62	1,500.07	1,528.52	1,556.97	1,585.42	1,613.87	
	55	1,612.92	1,584.47	1,556.02	1,527.57	1,499.13	1,470.68	1,442.23	1,413.78	1,385.33	1,356.88	1,328.43	1,328.43	1,356.88	1,385.33	1,413.78	1,442.23	1,470.68	1,499.13	1,527.57	1,556.02	1,584.47	1,612.92	
	58	1,611.97	1,583.53	1,555.08	1,526.63	1,498.18	1,469.73	1,441.28	1,412.83	1,384.38	1,355.94	1,327.49	1,327.49	1,355.94	1,384.38	1,412.83	1,441.28	1,469.73	1,498.18	1,526.63	1,555.08	1,583.53	1,611.97	
	61	1,611.03	1,582.58	1,554.13	1,525.68	1,497.23	1,468.78	1,440.33	1,411.89	1,383.44	1,354.99	1,326.54	1,326.54	1,354.99	1,383.44	1,411.89	1,440.33	1,468.78	1,497.23	1,525.68	1,554.13	1,582.58	1,611.03	
	64	1,610.08	1,581.63	1,553.18	1,524.73	1,496.28	1,467.84	1,439.39	1,410.94	1,382.49	1,354.04	1,325.59	1,325.59	1,354.04	1,382.49	1,410.94	1,439.39	1,467.84	1,496.28	1,524.73	1,553.18	1,581.63	1,610.08	
	67	1,609.13	1,580.68	1,552.24	1,523.79	1,495.34	1,466.89	1,438.44	1,409.99	1,381.54	1,353.09	1,324.65	1,324.65	1,353.09	1,381.54	1,409.99	1,438.44	1,466.89	1,495.34	1,523.79	1,552.24	1,580.68	1,609.13	
	70	1,608.19	1,579.74	1,551.29	1,522.84	1,494.39	1,465.94	1,437.49	1,409.04	1,380.60	1,352.15	1,323.70	1,323.70	1,352.15	1,380.60	1,409.04	1,437.49	1,465.94	1,494.39	1,522.84	1,551.29	1,579.74	1,608.19	
	73	1,607.24	1,578.79	1,550.34	1,521.89	1,493.44	1,464.99	1,436.55	1,408.10	1,379.65	1,351.20	1,322.75	1,322.75	1,351.20	1,379.65	1,408.10	1,436.55	1,464.99	1,493.44	1,521.89	1,550.34	1,578.79	1,607.24	

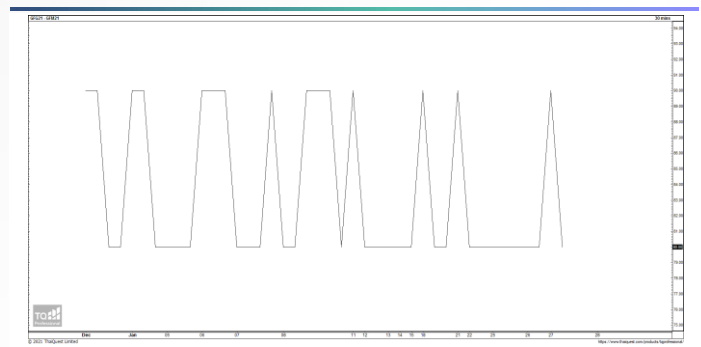
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD Londin AM (USD/Ounce)	FX (บาท/ USD)				
	30.50	30.75	31.00	31.25	31.50
1,760	25,516	25,725	25,934	26,143	26,352
1,790	25,951	26,163	26,376	26,589	26,801
1,820	26,385	26,602	26,818	27,034	27,251
1,850	26,820	27,040	27,260	27,480	27,700
1,880	27,255	27,479	27,702	27,926	28,149
1,910	27,690	27,917	28,144	28,371	28,598
1,940	28,125	28,356	28,586	28,817	29,047
1,970	28,560	28,794	29,028	29,262	29,497
2,000	28,995	29,233	29,470	29,708	29,946

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Spread ระหว่าง GFM21 – GFV21



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Gold Futures

มีกองทุนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
27,560.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
27,510.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
27,460.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
27,410.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
27,360.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
27,310.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
27,260.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
27,210.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
27,160.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
27,110.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
27,060.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

มีกองทุนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
27,650.00	250.0	2,500	(210)	2,290
27,600.00	200.0	2,000	(210)	1,790
27,550.00	150.0	1,500	(210)	1,290
27,500.00	100.0	1,000	(210)	790
27,450.00	50.0	500	(210)	290
27,400.00	0.0	-	(210)	(210)
27,350.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
27,300.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
27,250.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
27,200.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
27,150.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส