

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

3 กันยายน 2564



SET50 Futures:

SET50 ถูกขับเคลื่อนด้วยหุ้นใหญ่ Free Float ต่ำและน่าจะมีความต่อเนื่อง ทำให้การเปิด Short S50U21 ที่ 990 จุด ถูก Cut Loss 4 จุด แนะนำ Trading S50U21 กรอบ 990 - 1000 จุด

SET50 Option:

เปิด Long S50U21P1000 ได้ที่ 15 จุด ปัจจุบันมีกำไรเล็กน้อย แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 30 จุด (SET50=980) Cut Loss 3 จุดจากทุน แม้ SET50 จะยังปรับขึ้นได้ แต่รูปแบบการปรับขึ้นตัวยังคงค่อนข้างเปราะบาง

Single Stock Futures:

แนะนำถือสถานะ CPFU21 ทุน 26.90 บาท เป้าทำกำไรที่ 28 บาท Cut Loss 0.50 บาทจากทุน ทั้งนี้ประเมิน Deal การปรับโครงสร้างการถือหุ้นธุรกิจค้าปลีกของกลุ่ม CP จะเป็นประโยชน์ต่อ CPF ในระยะต่อไป

แนะนำ Follow Short BCHU21 เมื่อราคาหลุด 22.20 บาทลงมา เป้าทำกำไรที่ 21.50 บาท Cut Loss 0.30 บาทจากทุน เชื่อว่าการรับประโยชน์จากสถานการณ์ระบาด Covid-19 น่าจะผ่านจุดสูงสุดในงวด 3Q64

Gold Futures:

การย้ายเงินเข้าสินทรัพย์เสี่ยงสร้างแรงกดดันต่อราคาทองคำให้ปรับลดลง แต่ประเมินว่า Downside ยังมีไม่มาก แนะนำ Trading GFV21 ในกรอบ 27770 - 28230 บาท (1800 - 1830\$) 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 พันพานอกิจ
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธ 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	194,190	173,833	20,357	-26,214	-51,114	-75,024
Foreign	127,797	117,836	9,961	6,819	7,148	15,429
Retail	256,652	286,970	-30,318	19,395	43,966	59,595

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	29,015	24,703	4,312	1,056	-1,547	13,729
Foreign	82,987	71,661	11,326	16,465	35,552	69,404
Retail	81,099	96,737	-15,638	-17,521	-34,005	-83,133

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	156,455	136,248	20,207	-23,836	-42,104	-70,724
Foreign	24,045	24,505	-460	-8,014	-34,089	-82,833
Retail	135,463	155,210	-19,747	31,850	76,193	153,557

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	6,144	6,259	-115	1,159	967	-702
Foreign	19,585	21,399	-1,814	6,869	567	6,359
Retail	20,244	18,315	1,929	-8,028	-1,534	-5,657

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	286	254	32	182	-508	-231
Foreign	1,083	167	916	1,160	2,721	2,827
Retail	2,886	3,834	-948	-1,342	-2,213	-2,596

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	110	98	12	-56	-389	-1,246
Foreign	57	35	22	144	1,264	7,281
Retail	3,213	3,247	-34	-88	-875	-6,035

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

SET50 Overview

ทิศทางค่าเงิน Dollar Index ที่มีแนวโน้มอ่อนค่า น่าจะเป็นสัญญาณบวกต่อทิศทาง Fund Flow ที่ไหลเข้าตลาดหุ้นบ้านเรา รวมถึงสัญญาณบวกเพิ่มเติมจากการเปิดสถานะ Long สุทธิของ SET50 Index Futures 9 วันทำการติดต่อกันรวม 7.1 หมื่นสัญญา น่าจะสะท้อนถึงมุมมองเชิงบวกต่อ SET50 Index ในระยะนี้ แต่อย่างไรก็ตามเป็นที่น่าสังเกตว่าการปรับขึ้นของ SET50 Index ในระยะหลังมักจะถูกพยุงโดยหุ้น Market Cap ใหญ่ Free Float ต่ำ ตัวอย่างเช่น วานนี้ SET50 Index ปรับขึ้น 1.07% หรือเท่ากับ 10.6 จุด แต่หากประเมินองค์ประกอบการขึ้นที่พบว่ามาจาก DELTA ที่เพิ่มขึ้น 10.7% หนุน SET50 Index ไปมากถึง 7 จุด สะท้อนการปรับขึ้นเป็นลักษณะกระจุยตัวและยังขาดเสถียรภาพ ขณะที่หากประเมินจากปัจจัยแวดล้อมที่ในประเทศคงต้องติดตามพัฒนาการทางการเมืองทั้งในและนอกสภาที่มีความเสี่ยงมากขึ้นรวมถึงต่างประเทศที่วันนี้ติดตามการรายงานตัวเลขการจ้างงานนอกภาคการเกษตรสหรัฐฯเดือน ส.ค. จึงต้องระมัดระวังแรงขายทำกำไรที่อาจเกิดขึ้นได้ตลอดเวลา จึงมองกรอบการเคลื่อนไหวของวัน SET50 Index แกว่งในช่วง 985-1010 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: SET50 ถูกขับเคลื่อนด้วยหุ้นใหญ่ Free Float ต่ำและน่าจะมีความต่อเนื่อง ทำให้การเปิด Short S50U21 ที่ 990 จุด ถูก Cut Loss 4 จุด แนะนำ Trading S50U21 กรอบ 990 - 1000 จุด

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50U21 ลบด้วย S50M21 ณ วันที่ 29 มิ.ย. 2564 จะเท่ากับ -1.57 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -2.3 จุด ประเมิน Spread ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: เปิด Long S50U21P1000 ได้ที่ 15 จุด ปัจจุบันมีกำไรเล็กน้อย แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 30 จุด (SET50=980) Cut Loss 3 จุดจากทุน แม้ SET50 จะยังปรับขึ้นได้ แต่รูปแบบการปรับขึ้นตัวยังค่อนข้างเปราะบาง



	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	985	1005
S50U21	990	1000

*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	998.81	19.05262	13.38056

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	1.90	0.40	> 1051.9	0.00	1.90	5.32%	1.04	547	4626	14.92	0.10	52.83	0.1	
S50U21C1025	4.40	0.90	> 1029.4	0.00	4.40	3.06%	4.10	1052	5091	13.33	0.22	49.98	0.0	
S50U21C1000	11.00	2.90	> 1011	0.00	11.00	1.22%	11.92	1177	3929	11.91	0.46	41.41	0.0	
S50U21C975	27.10	7.10	> 1002.1	23.81	3.29	0.33%	26.44	1047	3691	13.06	0.73	26.93	0.0	
S50U21C950	48.00	9.00	> 998	48.81	#N/A	N/A	-0.08%	46.92	551	3630	11.83	0.93	19.34	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	53.90	-9.90	< 996.1	51.19	2.71	-0.27%	55.60	0	33	14.45	-0.94	-18.26	0.0
S50U21P1025	34.00	-10.00	< 991	26.19	7.81	-0.78%	33.66	51	258	14.76	-0.75	-22.53	0.0
S50U21P1000	15.40	-6.60	< 984.6	1.19	14.21	-1.42%	16.49	757	991	12.91	-0.54	-34.77	0.0
S50U21P975	6.60	-2.90	< 968.4	0.00	6.60	-3.04%	6.02	1306	2645	13.76	-0.28	-40.81	0.0
S50U21P950	2.80	-1.60	< 947.2	0.00	2.80	-5.17%	1.50	962	4560	15.89	-0.13	-44.53	-0.1

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

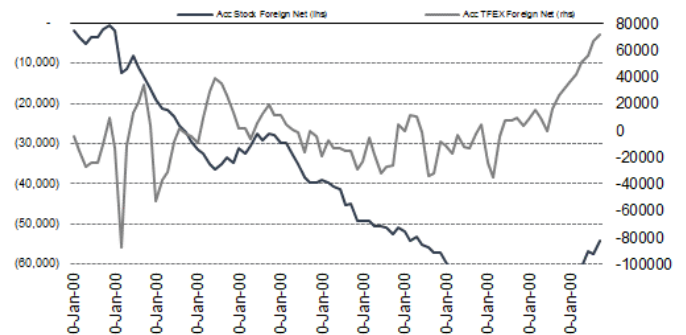
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สเปกการซื้อขาย
SET50	998.81	10.61	1.06%	2/9/21

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50Q21	986.63	0.0	0.0%	26	59	0
S50U21	995.50	9.8	1.0%	193,469	349,893	-43
S50V21	994.80	10.2	1.0%	43	131	0
S50Z21	993.20	9.8	1.0%	25,274	58,631	0
S50H22	989.10	9.4	1.0%	5,428	12,648	0
S50M22	987.00	9.7	1.0%	1,888	7,946	0

SET50 Futures Long(Short) : สิบวัน	ส.ส. Long(Short)		
	Long	Short	Net
สถานะ	146,567	160,103	-13,536
ค้างขาด	118,876	108,980	9,896
รายย่อย	242,253	238,613	3,640

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 Futures



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

	เป้าหมาย Spread ชีรีโกล - ชีรีโกล					
	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 ค.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 CPFU21

คาดการณ์ราคาไก่และหมูจะฟื้นตัว หลังรัฐบาลคลาย lock down แล้ว จะหนุนให้ความต้องการบริโภคเนื้อสัตว์ฟื้นตัว ทั้งในไทย เวียดนามและจีน ซึ่งคาดหวังการฟื้นตัวได้ตั้งแต่งวด 4Q64 ขณะที่ในวันนี้คาดว่าจะได้แรงขับเคลื่อนจากการปรับโครงสร้างธุรกิจของกลุ่ม CP ที่เชื่อว่าจะเป็นบวกต่อ CPF ในระยะกลาง-ยาว ราคาหุ้นปัจจุบันมี PBV ปี 2565 เพียง 1 เท่า Fair Value 30 บาท

ภาพทางเทคนิค ราคาทำจิ้งหะ Higher Low แนวขึ้นกลับมาขึ้นเหนือเส้น EMA 10 วัน โดยอยู่ในลักษณะการแกว่งออกข้าง ระยะถัดไป จะมีแนวต้านสำคัญบริเวณ 27.50 บาท (EMA 200 วัน) ซึ่งหากผ่านได้ มองเป็นจุดเปิด Upside เป้าหมายที่ 28.00 บาท

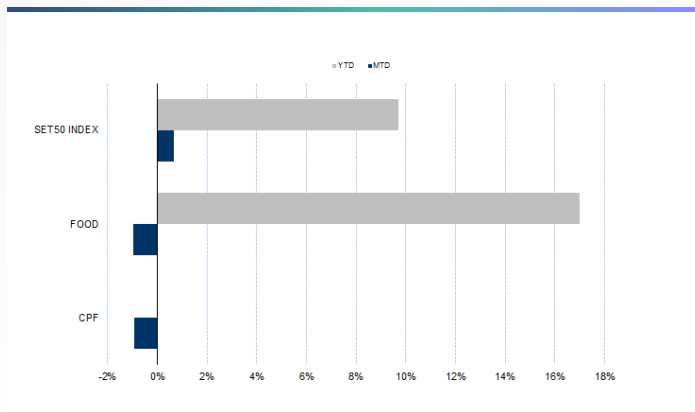
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำถือ Long CPFU21 หุน 26.90 บาท เป้าทำกำไร 28.00 บาท และ Cut Loss 0.50 บาทจากหุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
CPFU21	26.84	0.09	418	25899	-403	8.69	15.89%	13.05	0.99	-34.98%

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 BCHU21

คาดการณ์ว่าจะผ่านจุดสูงสุดไปแล้วในงวด 3Q64 และจะหดตัวในปี 2565 จากฐานที่สูง รวมถึงความกังวลการตรวจ Rapid Antigen test ที่รัฐจะให้ประชาชนทั่วไปซื้อตรวจเองได้ ประกอบกับราคาหุ้นที่ปรับตัวขึ้นมาสูงถึง 55% YTD ขณะที่เริ่มเห็นการระบาดที่บรรเทาลง จะขาดความต่อเนื่องของกำไร ที่มาจากรายได้ COVID และ Upside เริ่มจำกัด ภาพทางเทคนิค อยู่ในจังหวะปรับฐาน โดยมีสัญญาณลบทางเทคนิค จากการทำจังหวะ Lower High พร้อมเส้น EMA 10 วันคอยกดดัน ขณะที่หากหลุดแนวรับสำคัญที่ 22.20 บาท มองเป็นสัญญาณเปิด Downside ประเมินแนวรับถัดไปไว้ที่ 21.50 บาท

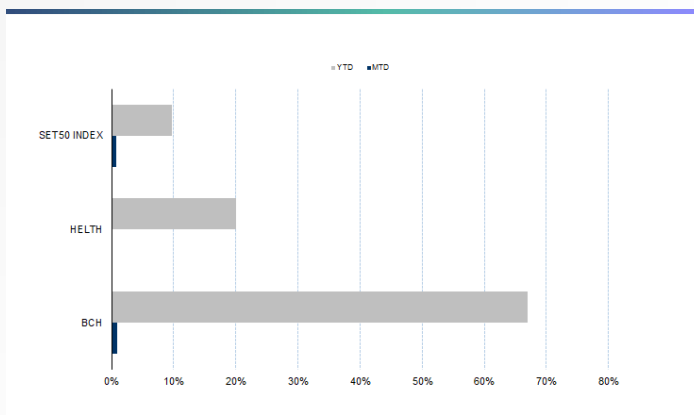
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Follow Short BCHU21 เมื่อหลุด 22.20 บาท เป้าทำกำไร 21.50 บาท และ Cut loss 0.30 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
BCHU21	22.87	0.17	164	4760	38	18.10	9.91%	24.54	5.95	87.60%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

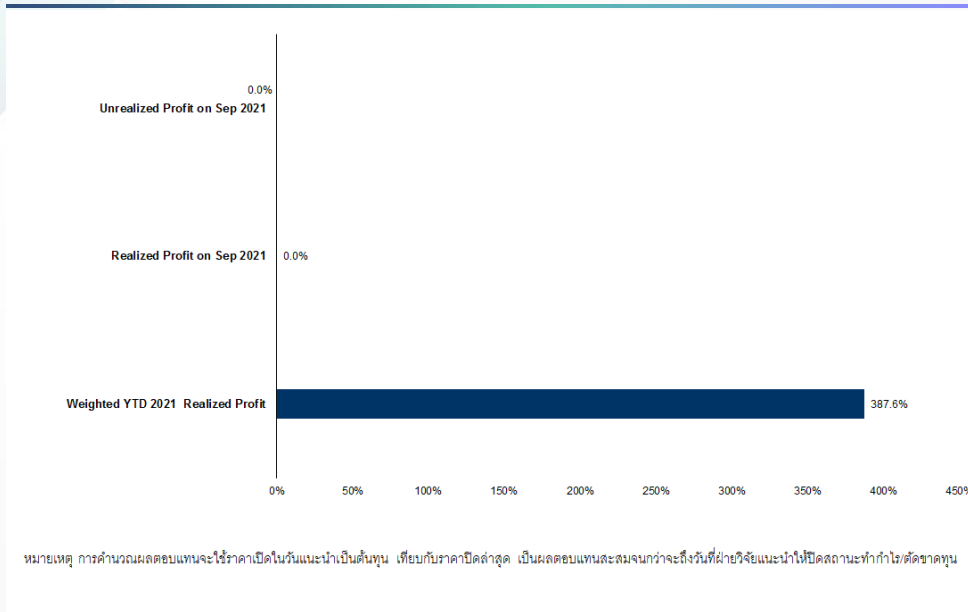
Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



Tracking Performance



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Top 20 Most Active Volume

	Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	TRUEU21	3.40	0.02	7103	21150	-5310	8.89	3.42	3.18
2	BCPGU21X	14.44	-0.16	5151	9346	-2420	6.20	15.02	14.40
3	TUU21	20.80	0.20	3560	6428	82	11.29	20.95	19.27
4	VGIU21	6.67	0.12	3304	10596	1238	5.22	6.72	6.04
5	GUNKULU21	4.84	0.00	3265	118200	-1396	18.20	4.98	4.81
6	SIRIU21	1.33	0.02	3229	108385	3016	11.49	1.33	1.23
7	PLANBU21	6.55	0.05	2279	3055	-1241	6.34	6.61	5.82
8	CHGU21	3.76	-0.02	1651	14838	-1536	14.21	3.90	3.61
9	KCEU21	79.25	0.00	1188	2135	-496	14.90	80.30	76.11
10	TTAU21	16.01	0.11	1069	11045	30	38.04	16.25	15.05
11	TPIPLU21	1.82	0.02	1057	32356	-944	11.84	1.85	1.75
12	WHAU21	3.24	0.02	1027	27289	-521	7.70	3.32	3.17
13	EAU21	65.74	-0.01	1025	3160	192	11.09	66.11	60.78
14	ORIU21	10.08	0.08	1021	10159	4	9.75	10.50	9.21
15	INTUCHU21	85.00	0.25	1011	1349	17	18.59	89.25	74.87
16	JMTU21	47.76	-0.49	1006	5407	-468		48.00	42.87
17	CPALLU21	63.99	-0.01	950	3025	219	14.52	65.38	60.24
18	MINTU21	32.25	-0.25	917	3528	-697	9.32	33.84	31.26
19	SGPU21	11.52	-0.08	901	2558	899	10.90	11.63	11.30
20	DTACU21	39.62	0.12	892	1401	419	9.45	40.25	35.49

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



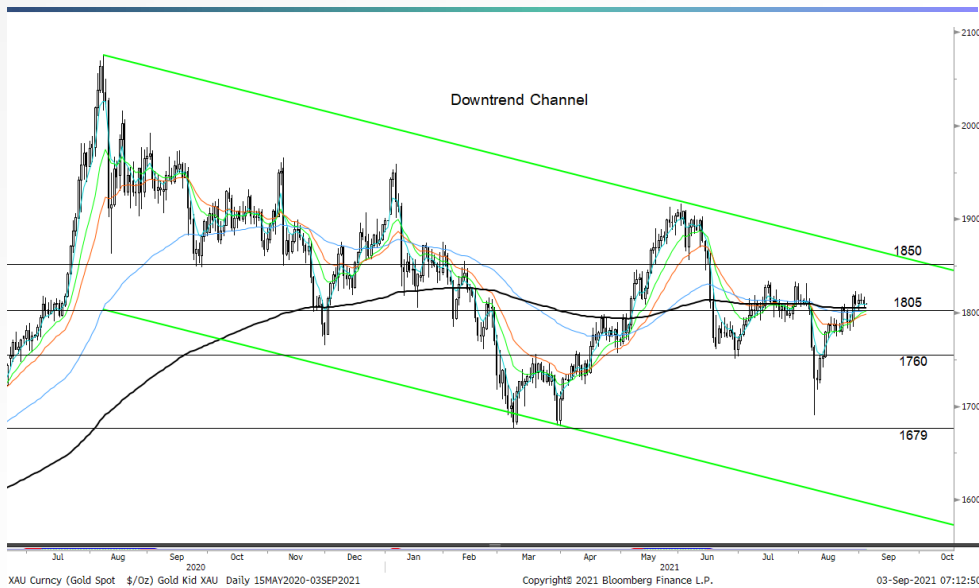
Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ปรับลดลง 4.3 เหรียญฯ ปิดอยู่ที่ 1,810 เหรียญฯ จากแรงเทขาย หลังสหรัฐรายงานข้อมูลเศรษฐกิจเชิงบวก นำโดยจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ปรับลงสู่ต่ำสุดในรอบ 17 เดือน หนุนให้ตลาดหุ้นดาวโจนส์สหรัฐเมื่อคืนปิดบวก 131.29 จุด หรือ 0.37% ทำให้นักลงทุนบางส่วนโยกเม็ดเงินลงทุนจากสินทรัพย์ปลอดภัยสู่สินทรัพย์เสี่ยงมากขึ้น โดยวันนี้ ต้องติดตามการเปิดเผยการจ้างงานภาคเกษตรซึ่งคาดว่าจะเพิ่มขึ้นในเดือน ส.ค. และอัตราว่างงานลดลงสู่ระดับ 5.2%

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFV21 เมื่อคืน เพิ่มขึ้น 160 บาท ปิดที่ 27,960 บาท (1,812 เหรียญฯ) สูงกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,809-1,810 เหรียญฯ คาดราคา GFV21 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 27,800-28,100 บาท ทิศทางราคาทองคำยังแกว่งตัวในกรอบที่ประเมินไว้ 1,800-1,830 เหรียญฯ ฝ่ายวิจัยจึงคงแนะนำให้นักลงทุน Trading บริเวณ 27,770-28,230 บาท แต่หากราคาลงมาแตะกรอบล่าง แนะนำให้รอเปิดสถานะ Long GFV21 และกำหนดจุด Cut Loss ไว้ 100 บาทจากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยง หากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GFV21	27,960	-70	-0.25	44	194	-13
GFZ21	27,990	-60	-0.21	9	150	-2
GF22	28,070	150	0.54	2	5	1

Mini Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10V21	27,960	-90	-0.32	4,019	5,155	-531
GF10Z21	27,990	-90	-0.32	1,770	5,544	220
GF10G22	28,030	-80	-0.28	688	870	147

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 แรง Technical Rebound จากแนวรับบริเวณ \$1700 จนทำให้ปัจจุบันเข้าสู่กรอบ Trading Zone \$1760-\$1805 หากผ่านกรอบบนได้ มีโอกาสเปิด Upside ไปที่ \$1850

ASPS Gold Valuation Matrix (เหรียญฯ / ทรอยออนซ์)

	Dollar Index										
	← 93	94	95	96	97	98	99	100	101	102	103
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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

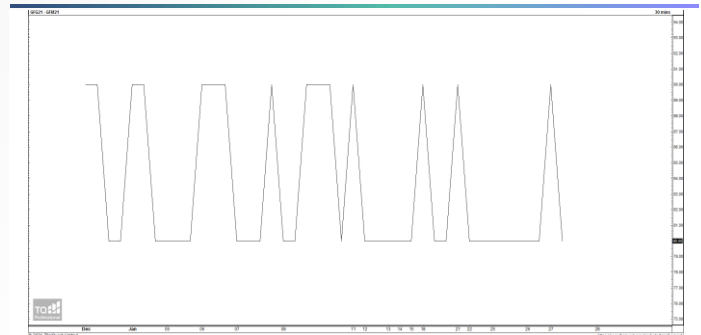
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD London AM (USD/Ounce)	FX (บาท/ USD)				
	32.00	32.25	32.50	32.75	33.00
1,700	25,858	26,060	26,262	26,464	26,666
1,730	26,314	26,520	26,725	26,931	27,137
1,760	26,771	26,980	27,189	27,398	27,607
1,790	27,227	27,440	27,652	27,865	28,078
1,820	27,683	27,899	28,116	28,332	28,548
1,850	28,139	28,359	28,579	28,799	29,019
1,880	28,596	28,819	29,043	29,266	29,489
1,910	29,052	29,279	29,506	29,733	29,960
1,940	29,508	29,739	29,969	30,200	30,431

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Spread ระหว่าง GFQ21 - GFZ21



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Gold Futures

นิลกองทุนรายย่อย					
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)					
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ	กำไร
28,210.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451	
28,160.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951	
28,110.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451	
28,060.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951	
28,010.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451	
27,960.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)	
27,910.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)	
27,860.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)	
27,810.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)	
27,760.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)	
27,710.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)	

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

นิลกองทุนรายย่อย					
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)					
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ	กำไร
28,210.00	250.0	2,500	(210)	2,290	
28,160.00	200.0	2,000	(210)	1,790	
28,110.00	150.0	1,500	(210)	1,290	
28,060.00	100.0	1,000	(210)	790	
28,010.00	50.0	500	(210)	290	
27,960.00	0.0	-	(210)	(210)	
27,910.00	-50.0	(500)	(210)	(710)	
27,860.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)	
27,810.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)	
27,760.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)	
27,710.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)	

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส