

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

1 พฤศจิกายน 2564



SET50 Futures:

การเปิดประเทศและกิจกรรมทางเศรษฐกิจที่กำลังเริ่มต้นขึ้น สร้าง Sentiment เชิงบวก แต่ยังมีแรงกดดันจากราคา Commodity ที่ปรับลดลง คาด SET50 จะยังผันผวน แนะนำ Trading S50Z21 ในกรอบ 970-980 จุด

SET50 Option:

แนะนำให้รอเปิด Long S50Z21C950 ที่ 30 จุด (SET50=970) เป้าทำกำไรที่ 40 จุด (SET50=980) และ Cut Loss 3 จุดจากทุน คาด SET50 ผันผวน ในกรอบแคบรอจังหวะปรับตัวขึ้นรอบใหม่

Single Stock Futures:

แนะนำให้เปิด Long VNGZ21 ที่บริเวณ 9.30 บาท เป้าทำกำไรที่ 9.70 บาท และ Cut Loss 0.20 บาทจากทุน แนวโน้มผลประกอบการดีขึ้นอย่างชัดเจน ล่าสุดนักวิเคราะห์ปรับประมาณการกำไรและ Fair Value ขึ้น

สถานะ Long SCCZ21 ทุน 398 บาท ปิดเท่าทุน แนะนำให้เปิด Long AOTZ21 ที่บริเวณ 64.75 บาท เป้าทำกำไรที่ 66.25 บาท Cut Loss 0.75 บาทจากทุน การเปิดประเทศเป็นสัญญาณการกลับมาของกำไร

Gold Futures:

ราคาทองคำผันผวนในทิศทางลง แรงกดดันหลักมาจาก USD ที่แข็งค่า อย่างไรก็ตามราคายังอยู่ในกรอบที่คาดไว้ แนะนำ Trading GFZ21 ในกรอบ 27900 - 28350 บาท (1770-1800\$) และให้ Short กรอบบน

SET50 Index Futures / Option	P. 3
Single Stock Futures	P. 5
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 กวีธีระธรรม
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจมงคล, CISA, CFA
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นวลพรรณ น้อยรัชกุล
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันการนากิจ
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	103,023	144,781	-41,758	-66,407	-90,932	-875,740
Foreign	100,020	105,455	-5,435	10,279	-23,267	-81,045
Retail	204,500	157,307	47,193	56,128	114,199	956,785

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	26,535	22,427	4,108	-1,718	-1,555	-1,280
Foreign	44,292	59,577	-15,285	-7,962	-37,776	-27,162
Retail	60,106	48,929	11,177	9,680	39,331	28,442

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	69,485	110,392	-40,907	-60,318	-75,322	-848,177
Foreign	26,285	16,136	10,149	10,018	8,479	-80,750
Retail	99,157	68,399	30,758	50,300	66,843	928,927

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	6,610	7,531	-921	1,149	-1,423	3,910
Foreign	25,321	29,135	-3,814	3,656	-546	8,838
Retail	25,578	20,843	4,735	-4,805	1,969	-12,748

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	99	185	-86	-115	-227	-458
Foreign	1,195	323	872	986	1,339	6,436
Retail	2,891	3,677	-786	-871	-1,112	-5,978

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	63	483	-420	-554	-198	2,602
Foreign	2,905	274	2,631	3,532	5,201	11,364
Retail	4,713	6,924	-2,211	-2,978	-5,003	-13,966

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

SET50 Overview

ประเด็นที่ให้น้ำหนักสัปดาห์นี้อยู่ที่ผลการประชุม FED ระหว่างวันที่ 2-3 พ.ย. ที่จะรู้ผลในวันที่ 4 พ.ย. ช่วงเช้าตามเวลาบ้านเรา ซึ่งมีโอกาสที่จะประกาศการทำ QE Tapering ในรอบนี้ รวมถึงมุมมองต่ออัตราเงินเฟ้อสหรัฐฯซึ่งอาจส่งผลกระทบต่อช่วงเวลาการปรับขึ้นดอกเบี้ยฯ ในระยะถัดไป ทั้งนี้หากประเมินจาก FED Fund Futures ล่าสุดความน่าจะเป็นในการปรับขึ้นดอกเบี้ยฯ อยู่ในช่วง มิ.ย.-ก.ย. 64 จากช่วงต้นเดือน ต.ค. อยู่ที่ ธ.ค.64 ส่งผลให้ Dollar Index พลิกกลับมาแข็งค่า 0.8% และส่วนหนึ่งเป็นแรงกดดันต่อทิศทางราคาน้ำมันดิบในระยะสั้นปรับลงซึ่งมองเป็น Sentiment ลบต่อหุ้นในกลุ่มพลังงานในวันนี้ ขณะที่ปัจจัยในประเทศวันนี้อยู่ที่การเริ่มเปิดประเทศรับนักท่องเที่ยวต่างชาติ โดยไม่ต้องกักตัวซึ่งล่าสุดปรับเพิ่มประเทศที่เดินทางเข้าโดยไม่ต้องกักตัวเป็น 63 ประเทศจากเดิมอยู่ที่ 46 ประเทศ แต่อย่างไรก็ตามเชื่อว่าตลาดน่าจะรับรู้ไปพอสมควรและลำดับถัดไปจะอยู่ที่การติดตามพัฒนาการของกิจกรรมเศรษฐกิจในประเทศที่จะเพิ่มขึ้นต่อเนื่องหรือไม่ ขณะที่อีกด้านหนึ่งติดตามจำนวนผู้ติดเชื้อ COVID-19 ในประเทศหลังเปิดประเทศ ภายใต้ปัจจัยแวดล้อมข้างต้นจึงคาด SET50 Index อยู่ในช่วงพักตัวในกรอบ 970-980 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: การเปิดประเทศและกิจกรรมทางเศรษฐกิจที่กำลังเริ่มตื้นขึ้น สร้าง Sentiment เชิงบวก แต่ยังมีแรงกดดันจากราคา Commodity ที่ปรับลดลง คาด SET50 จะยังผันผวน แนะนำ Trading S50Z21 ในกรอบ 970-980 จุด

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50H22 ลบด้วย S50Z21 (S50Z21H22) ณ วันที่ 29 ธ.ค. 2564 จะเท่ากับ -5.72 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -4.20 จุด ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: แนะนำให้รอเปิด Long S50Z21C950 ที่ 30 จุด (SET50=970) เป้าทำกำไรที่ 40 จุด (SET50=980) และ Cut Loss 3 จุดจากทุน คาด SET50 ผันผวนในกรอบ แคมรอลจังหวะปรับตัวขึ้นรอบใหม่



	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	970	980
S50U21	970	980

*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	974.67	18.30231	7.923156

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
S50Z21C1025	4.30	0.10	> 1029.3	0.00	4.30	5.60%	3.30	550	4636	12.42	0.17	37.77	0.1
S50Z21C1000	9.90	0.00	> 1009.9	0.00	9.90	3.61%	8.37	944	4906	12.57	0.31	30.50	0.0
S50Z21C975	20.10	0.10	> 995.1	0.00	20.10	2.10%	17.89	684	6880	12.90	0.50	24.19	0.0
S50Z21C950	35.50	-0.40	> 985.5	24.67	10.83	1.11%	32.77	85	1273	13.12	0.69	19.07	0.0
S50Z21C925	55.50	-2.30	> 980.5	49.67	5.83	0.60%	52.45	4	311	13.99	0.82	14.34	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
S50Z21P1025	55.00	1.40	< 970	50.33	4.67	-0.48%	53.71	3	162	11.93	-0.85	-15.75	0.0
S50Z21P1000	35.30	1.60	< 964.7	25.33	9.97	-1.02%	33.79	57	767	12.01	-0.70	-19.75	0.0
S50Z21P975	20.30	0.50	< 954.7	0.33	19.97	-2.05%	18.33	981	4467	12.53	-0.50	-24.02	0.0
S50Z21P950	11.20	0.20	< 938.8	0.00	11.20	-3.68%	8.22	1174	4778	13.42	-0.32	-26.86	0.0
S50Z21P925	6.00	0.10	< 919	0.00	6.00	-5.71%	2.92	1309	6069	14.77	-0.18	-28.02	-0.1

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

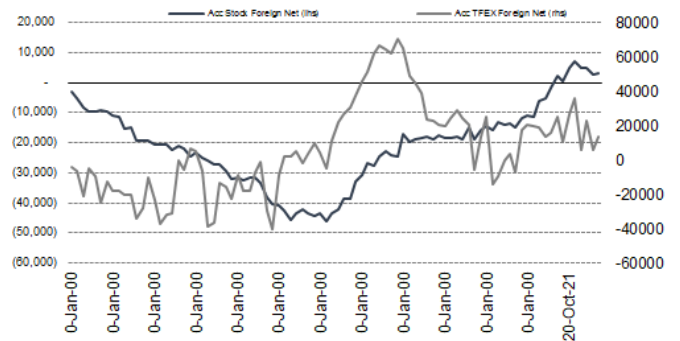
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สเปกการซื้อขาย
SET50	974.67	-2.00	-0.21%	29/10/21

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50V21	977.54	0.0	0.0%	26	77	0
S50X21	975.60	-0.1	0.0%	117	176	0
S50Z21	974.70	-0.3	0.0%	116,654	363,095	0
S50H22	970.40	-0.2	0.0%	10,151	41,475	0
S50M22	969.10	-0.3	0.0%	2,886	15,202	0
S50U22	966.30	-0.2	0.0%	1,082	5,089	0

SET50 Futures Long(Short) : สัญญา	สเปก Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	QTD
สถานะ	102,861	144,113	-41,252	-1,718	-6,126	0
ค้างขาด	95,920	104,858	-8,938	-7,962	-15,564	0
ขายย่อย	196,896	146,706	50,190	3,680	21,630	0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 Futures



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

	เป้าหมาย Spread ซีรียัล - ซีรียัล					
	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 VNGZ21

ประเมินกำไรสุทธิ 3Q64 ที่ 401 ล้านบาท (+18%QoQ) มี driver จากราคา MDF ที่ปรับเพิ่ม 10%QoQ และปริมาณส่งมอบที่เพิ่มขึ้นเนื่องจากมี order ค้างส่งจากช่วง 2Q64 ด้าน gross margin ปรับเพิ่มเล็กน้อย จากอานิสงส์ของเงินบาทที่อ่อนค่า ทิศทางธุรกิจยังคงสดใส เตรียมเปิดโรงงานใหม่ ได้แก่ โรงงาน OSB และเปลี่ยนสายการผลิต Particle Board ที่สุราษฎร์ธานี เป็นสินค้า Super Particle Board ที่ให้ margin ดีกว่า เริ่มผลิตได้ต้นปี 2565 ปรับประมาณการกำไรปี 2565 ขึ้นเป็น 1,332 ล้านบาท และขยับ FV เป็น PER 15 เท่า ราคาเหมาะสมปี 2565 ที่ 11.50 บาท

ภาพทางเทคนิค ปรับฐานแรงจูงใจใกล้แนวรับบริเวณ 9.30 บาท ใช้เป็นจุดเข้าซื้อสะสมเพื่อคาดหวังการปรับขึ้นต่อ ตามแนวโน้มขาขึ้น สนับสนุนด้วย RSI ที่มากกว่า 50 บ่งชี้การเข้าสู่ Bullish Zone โดยประเมินแนวต้านถัดไปไว้ที่ 9.70 บาท

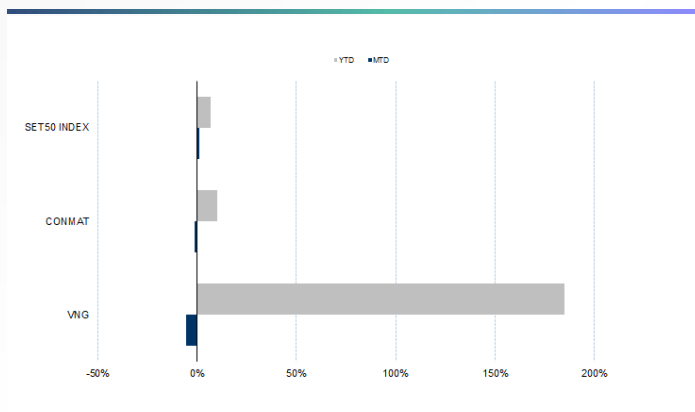
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long VNGZ21 บริเวณ 9.30 บาท เป้าทำกำไร 9.70 บาท และ Cut Loss 0.20 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
VNGZ21	9.32	0.02	69	10431	60	24.47	23.66%	14.70	2.29	-285.91%

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



Long AOTZ21

คาด AOT จะกลับมาเป็นหุ้นที่ตลาดสนใจอีกครั้งในระยะถัดไป จากแผนการเปิดประเทศให้นักเดินทาง 63 ประเทศเดินทางเข้ามาภายใต้เงื่อนไขโดยไม่ต้องกักตัว เสริมด้วยจุดเด่นที่มีฐานะการเงินแข็งแกร่ง มีศักยภาพอยู่รอดผ่านช่วงวิกฤต COVID ได้แน่นอน บวกกับจุดเด่นผูกขาดบริการสนามบินหลัก จึงสามารถคาดหวังการฟื้นตัวได้แน่นอนและเร็วสุดในกลุ่ม ราคาหุ้นปัจจุบัน Laggard SET Index มาก ถือเป็นโอกาสสะสม

ภาพทางเทคนิค ปรับฐานลงมาทดสอบแนวรับบริเวณ 63.25 บาท พร้อมแท่งเทียนกลับตัว Dragonfly Doji ระยะถัดไป มีโอกาสรีบาวนด์ขึ้นได้ต่อ โดยมีเป้าหมายการทำการกำไรไว้บริเวณ 66.25 บาท

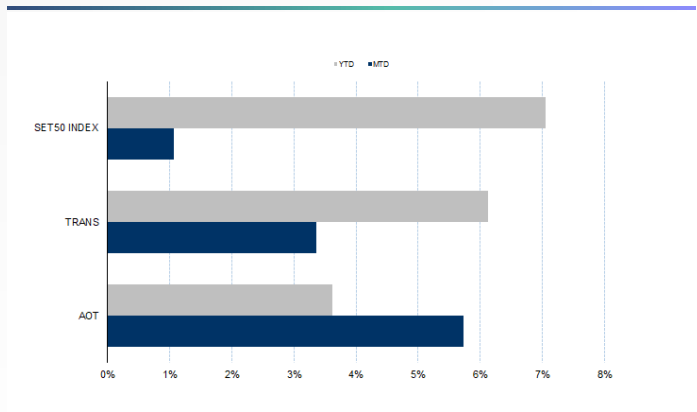
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long AOTZ21 บริเวณ 64.75 บาท เป้าทำกำไร 66.25 บาท และ Cut loss 0.75 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
AOTZ21	64.75	0.25	304	4422	279	9.81	8.51%		8.15	-424.87%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

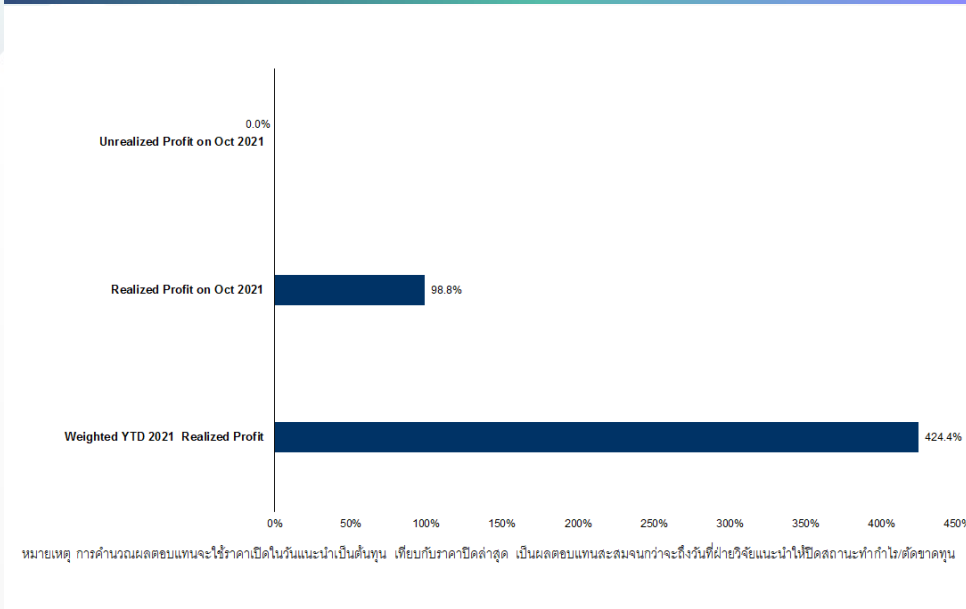
Technical Chart



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	SUPERZ21	0.99	0.02	20005	175815	20000	6.38	0.99	0.97
2	GUNKULZ21	5.42	0.02	9478	224632	-7512	20.30	5.46	4.99
3	AAVZ21	2.89	-0.03	8077	9821	8030	8.54	2.89	2.72
4	KBANKZ21	141.60	0.60	5902	6846	-1180	10.98	145.22	140.05
5	TRUEZ21	4.09	0.03	5130	138817	3974	10.68	4.10	3.81
6	SCBZ21	126.00	0.00	4114	4848	3533	10.54	126.10	123.92
7	ITDZ21	2.36	0.02	3858	46659	875	15.39	2.41	2.23
8	LHZ21	8.50	0.05	3510	16171	-1507	11.70	8.62	8.20
9	PTGZ21	15.73	0.13	2902	28267	1202	5.55	15.90	15.45
10	JASZ21	2.87	0.01	2517	66876	1503	6.27	2.97	2.76
11	IRPCZ21	4.35	0.05	2258	28010	1081	12.57	4.45	4.15
12	BLANDZ21	1.12	0.02	2160	141948	103	9.65	1.14	1.12
13	THANIZ21	4.10	0.00	2010	13016	1010	4.23	4.13	4.04
14	VGIZ21	6.70	0.05	2009	14077	-1500	5.30	6.73	6.45
15	BBMZ21	9.00	0.00	2005	34452	1000	12.47	9.18	8.99
16	MLZ21	42.03	0.03	1779	8650	438	10.23	44.39	41.00
17	CBGZ21	124.59	0.59	1679	10584	30	8.66	124.40	120.70
18	GULFZ21	43.23	-0.02	1592	8938	45	2.21	43.27	41.64
19	TKNZ21	6.65	0.05	1550	6383	-1549	3.22	6.83	6.51
20	CHGZ21	3.76	-0.04	1505	13240	-1001	14.29	3.83	3.74

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐคืนวันศุกร์ที่ผ่านมา ปรับตัวลง 16.05 เหรียญฯ ปิดที่ 1,782.76 เหรียญฯ โดยได้รับแรงกดดันจากเงินดอลลาร์ที่กลับมาแข็งค่าขึ้น หลังการเปิดเผยดัชนีราคาการใช้จ่ายเพื่อการบริโภคส่วนบุคคล (PCE) ของสหรัฐ เดือน ก.ย. ปรับขึ้นต่อเนื่อง โดยดัชนี PCE ถือเป็นมาตรวัดอัตราเงินเฟ้อที่ธนาคารกลางสหรัฐให้ความสำคัญ ยืนยันมุมมองว่าเฟดน่าจะมีการส่งสัญญาณการใช้นโยบายการเงินเข้มงวด จากการประชุมในวันที่ 2-3 พ.ย นี้ โดย Dollar Index คืนวันศุกร์ปรับเพิ่มขึ้น 0.83% อยู่ที่ 94.134 จุด สัปดาห์นี้ต้องติดตามตัวเลขเศรษฐกิจสำคัญได้แก่ ดัชนี PMI ภาคการบริการ ตัวเลขการจ้างงานในสหรัฐ รวมถึงการประชุมธนาคารกลางสหรัฐและอังกฤษ ซึ่งจะส่งต่อการเคลื่อนไหวของสินทรัพย์และราคาทองคำ

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFZ21 คืนวันศุกร์ที่ผ่านมา ปรับลง 300 บาท ปิดที่ 28,180 บาท (1,781 เหรียญฯ) ใกล้เคียงราคาตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,780 เหรียญฯ คาดราคา GFZ21 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 27,900-28,250 บาท เชื้อสัปดาห์นี้ราคาทองคำยังคงผันผวน แนะนำ Trading GFZ21 บริเวณ 1,770-1,800 เหรียญฯ หรือ 27,900-28,350 บาท แต่หากราคาขึ้นไปแตะกรอบบน แนะนำรอเปิด Short GFZ21 และกำหนดจุด Cut loss ไว้ 100 จากทุน ป้องกันความเสี่ยง หากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดคาด

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GFZ21	28,180	-220	-0.77	58	245	14
GFG22	28,220	-200	-0.70	15	107	13
GFJ22	28,280	-170	-0.60	12	10	0

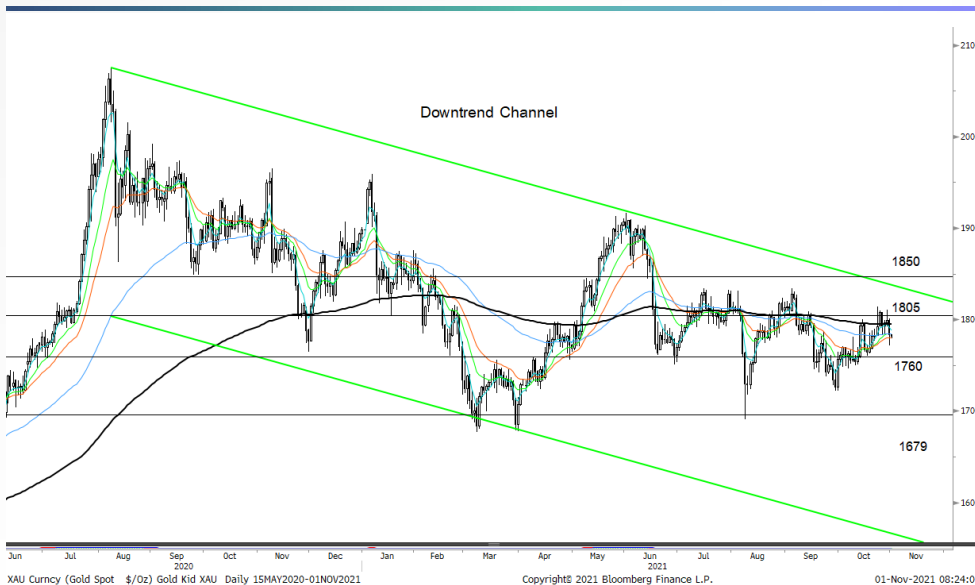
Mini Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10Z21	28,310	-80	-0.28	4,629	9,489	-476
GF10G22	28,340	-80	-0.28	2,012	4,180	-306
GF10J22	28,360	-100	-0.35	446	351	111

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

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



GOLD Technical

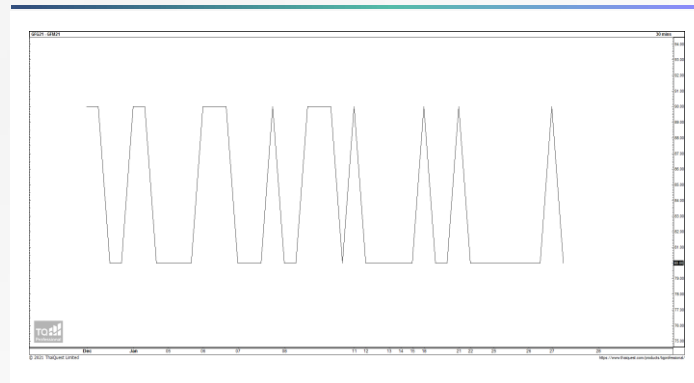
ทิศทางราคาทองคำ จังหวะ Technical Rebound กลับเข้าสู่กรอบ Trading Zone เดิม ที่ \$1760-\$1805 อย่างไรก็ตามด้วยสัญญาณลบจากจังหวะ Lower High ยังมีความเสี่ยงปรับฐาน โดยมี Downside อยู่บริเวณ \$1679

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD London AM (USD/Ounce)	FX (บาท/ USD)				
	33.00	33.25	33.50	33.75	34.00
1,650	25,882	26,078	26,274	26,470	26,666
1,680	26,352	26,552	26,751	26,951	27,151
1,710	26,823	27,026	27,229	27,432	27,636
1,740	27,293	27,500	27,707	27,914	28,120
1,770	27,764	27,974	28,185	28,395	28,605
1,800	28,235	28,448	28,662	28,876	29,090
1,830	28,705	28,923	29,140	29,357	29,575
1,860	29,176	29,397	29,618	29,839	30,060
1,890	29,646	29,871	30,095	30,320	30,545

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Spread ระหว่าง GFQ21 – GFZ21



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Gold Futures

บิลลงทุนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
28,430.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
28,380.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
28,330.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
28,280.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
28,230.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
28,180.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
28,130.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
28,080.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
28,030.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
27,980.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
27,930.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

บิลลงทุนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
28,560.00	250.0	2,500	(210)	2,290
28,510.00	200.0	2,000	(210)	1,790
28,460.00	150.0	1,500	(210)	1,290
28,410.00	100.0	1,000	(210)	790
28,360.00	50.0	500	(210)	290
28,310.00	0.0	-	(210)	(210)
28,260.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
28,210.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
28,160.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
28,110.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
28,060.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส