

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

11 พฤศจิกายน 2564



SET50 Futures:

เปิด Long S50Z21 ได้ที่ทุน 972 จุด ปัจจุบันมีกำไร 5.20 จุด แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 990 จุด แต่ให้ Stop profit ที่ทุนเพื่อปิดโอกาสขาดทุนรอบนี้ คาด SET50 ยังอยู่ในช่วงผันผวนโดยขาดปัจจัยบวกใหม่ๆ หนุน

SET50 Option:

สถานะ Long S50Z21C975 ทุน 20 จุด ถูกปิดขาดทุน 3 จุด แนะนำให้รอ เปิด Long S50Z21C975 รอบใหม่ที่ 13 จุด (SET50=973) เป้าทำกำไรที่ 25 จุด (SET50=985) และ Cut Loss 3 จุดจากทุน

Single Stock Futures:

แนะนำเปิด Long TVOZ21 ที่บริเวณ 30.50 บาท เป้าทำกำไรที่ 32 บาท Cut Loss 0.50 บาทจากทุน กระแสราคาน้ำมันปาล์มที่ปรับขึ้นแรง น่าจะมี ส่วนช่วยหนุนราคาน้ำมันถั่วเหลืองถือเป็นปัจจัยบวกต่อ TVO

เปิด Long ADVANCZ21 ได้ที่ทุน 193.08 บาท ปัจจุบันมีกำไร 14.91% แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 197 บาท และ Stop Profit ที่ 194 บาท Lock กำไร 10% การรักษารฐานกำไรสุทธิที่ระดับสูงหนุนราคาหุ้นให้อยู่แนวโน้มขึ้น

Gold Futures:

สถานะ Short GFZ21 ทุน 28650 บาท ปิดรับกำไร 100 บาท แนะนำ Trading GFZ21 กรอบ 28580 – 29050 บาท (1830 – 1860\$) Short ที่ กรอบบน เงิน USD ที่แข็งค่าอาจสร้างแรงกดดันต่อราคาทองคำในระยะต่อไป

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

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องสามารถดำเนินการได้อย่างรวดเร็วทัน ฝ่ายวิจยฯ 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

ธนัฐธส เกิดเนตร
ผู้ช่วยนักวิเคราะห์



สถานะของนักลงทุน

	All Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	107,485	161,476	-53,991	-98,556	-5,427	-148,721
Foreign	95,506	96,151	-645	692	40,005	51,432
Retail	232,102	177,466	54,636	97,864	-34,578	97,289

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	25,482	22,731	2,751	639	1,852	-5,201
Foreign	57,447	56,541	906	3,417	-12,425	-45,659
Retail	61,888	65,545	-3,657	-4,056	10,573	50,860

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	74,812	127,578	-52,766	-88,460	8,829	-94,286
Foreign	18,774	18,623	151	-2,286	30,030	65,817
Retail	135,578	82,963	52,615	90,746	-38,859	28,469

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	6,103	5,722	381	-1,336	1,883	3,704
Foreign	18,988	20,659	-1,671	-489	22,471	18,406
Retail	16,042	14,752	1,290	1,825	-24,354	-22,110

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	54	94	-40	-31	374	-29
Foreign	63	137	-74	-16	-402	1,720
Retail	2,815	2,701	114	47	28	-1,691

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	316	91	225	522	2,809	5,154
Foreign	230	145	85	105	438	8,965
Retail	3,630	3,940	-310	-657	-3,410	-14,124

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



SET50 Overview

การรายงานเงินเพื่อสหรัฐฯเดือน ต.ค. ที่ขยายตัว 6.2%yoy ทำจุดสูงสุดในรอบกว่า 30 ปี ทำให้ความกังวลต่อการปรับขึ้นดอกเบี้ยเร็วกว่าที่คาด โดยล่าสุดนักลงทุนเริ่มให้น้ำหนักการปรับขึ้นดอกเบี้ยในเดือน ก.ค.65 สถานการณ์ข้างต้นส่งผลให้ Dollar Index แข็งค่าขึ้น 94.88 จุดทำจุดสูงสุดในรอบกว่า 1 เดือน Bond Yield 10 ปีสหรัฐฯปรับขึ้น 11 bps มาที่ 1.56% ขณะที่ตลาดหุ้นสหรัฐฯปรับลงในช่วง -0.6% ถึง -1.67% ซึ่งอาจสร้าง Sentiment เชิงลบต่อตลาดหุ้นบ้านเราวันนี้ แต่อย่างไรก็ตามหากประเมินการตอบสนองของค่าเงินบาทที่ยังคงแข็งค่าต่ำกว่า 33 บาท/usd อาจบ่งชี้ผลกระทบต่อตลาดหุ้นบ้านเราจำกัด ส่วนปัจจัยในประเทศผลการประชุม กนง. วานนี้มีมติคงอัตราดอกเบี้ยที่ 0.5% ตามคาดและมีมุมมองต่อทิศทางเศรษฐกิจที่ผ่านจุดต่ำสุดใน 3Q64 แต่การฟื้นตัวยังคงเปราะบาง ซึ่งในมุมมองฝ่ายวิจัยฯ เชื่อว่าการดำเนินนโยบายการเงินที่ผ่อนคลายจึงจะยังมีต่อไปตลอดปี 2565 ซึ่งจะเป็บวาทต่อทิศทาง Fund Flow ของนักลงทุนในประเทศที่ยังอยู่ในภาวะ Search For Yield ต่อไป ส่วนประเด็นอื่นๆในระยะสั้นติดตามประเด็นการเมืองนอกสภาที่อุณหภูมิอาจสูงขึ้นหลังวานนี้ศาลรัฐธรรมนูญวินิจฉัยข้อเรียกร้องปฏิรูปสถาบันเมื่อวันที่ 10 ส.ค.2563 เข้าข่ายล้มล้างการปกครอง ภายใต้ปัจจัยแวดล้อมที่มีน้ำหนักในทางลบทำให้ SET50 Index พักตัวในกรอบ 973-985 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: เปิดสถานะ Long S50Z21 ได้ที่ทุนเฉลี่ยที่ 972 จุด ปัจจุบันกำไรอยู่ 5.2 จุดแนะนำถือต่อเป้าทำกำไรที่ 990 จุด และตั้ง Stop Profit ที่ทุนเพื่อปิดโอกาสขาดทุน คาดแรงกดดันจากเงินเพื่อสหรัฐฯ ต่อตลาดหุ้นบ้านเราจำกัด


Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50H22 ลบด้วย S50Z21 (S50Z21H22) ณ วันที่ 29 ธ.ค. 2564 จะเท่ากับ -5.72 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -3.80 จุด ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: สถานะ Long S50Z21C975 ทุน 20 จุด ถูก Cut Loss 3 จุด สำหรับวันนี้แนะนำรอเปิดสถานะ Long S50Z21C975 ที่ 13 จุด (SET50=973) เป้าทำกำไรที่ 25 จุด (SET50=985) และ Cut Loss 3 จุด

	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	973	985
S50Z21	970	985

*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	979.27	18.16543	6.055447

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	3.40	-0.70	> 1028.4	0.00	3.40	5.02%	2.12	740	5016	12.36	0.15	42.39	0.1
S50Z21C1000	8.40	-1.10	> 1008.4	0.00	8.40	2.97%	6.63	822	5599	12.26	0.31	35.64	0.0
S50Z21C975	18.60	-2.10	> 993.6	4.27	14.33	1.46%	16.29	324	7376	12.16	0.53	27.71	0.0
S50Z21C950	35.00	-3.30	> 985	29.27	5.73	0.59%	32.22	31	1320	13.09	0.73	20.33	0.0
S50Z21C925	55.00	-4.20	> 980	54.27	0.73	0.07%	53.28	5	338	15.24	0.83	14.82	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	51.50	0.00	< 973.5	45.73	5.77	-0.59%	50.21	6	189	12.84	-0.83	-16.59	0.0
S50Z21P1000	31.70	1.50	< 968.3	20.73	10.97	-1.12%	29.73	66	945	12.25	-0.69	-21.70	0.0
S50Z21P975	16.60	0.10	< 958.4	0.00	16.60	-2.13%	14.40	707	5299	12.59	-0.48	-27.96	0.0
S50Z21P950	8.30	-0.10	< 941.7	0.00	8.30	-3.84%	5.34	609	5484	13.26	-0.27	-31.26	0.0
S50Z21P925	3.90	0.00	< 921.1	0.00	3.90	-5.94%	1.42	545	6709	14.41	-0.14	-34.04	-0.1

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	ส.ปการซื้อขาย
SET50	979.27	-1.26	-0.13%	10/11/21

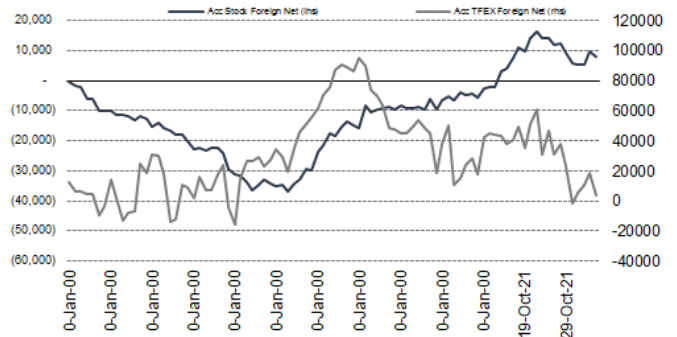
Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50V21	977.54	0.0	0.0%	26	77	0
S50X21	977.20	-3.8	-0.4%	65	149	0
S50Z21	977.20	-1.8	-0.2%	129,083	353,872	0
S50H22	973.30	-1.9	-0.2%	10,730	42,038	0
S50M22	972.10	-2.0	-0.2%	3,365	17,896	0
S50U22	969.10	-1.8	-0.2%	1,559	5,404	0

SET50 Futures Long(Short) : สัญญา	ส.ส Long(Short)			2 วัน	2 สัปดาห์	QTD
	Long	Short	Net			
สถาบัน	107,115	161,291	-54,176	639	2,413	0
ต่างชาติ	95,213	95,869	-656	3,417	-32,183	0
รายย่อย	225,657	170,825	54,832	-4,056	29,770	0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ

ในตราสารทุน และ SET50 Futures



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

เป้าหมาย Spread ชีรีไทด์ - ชีรีไทด์						
	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 ADVANCZ21

แม้กำไร 3Q64 ลดลง 9.5%qoq แต่เป็นผลจากรายการพิเศษ นับเฉพาะกำไรปกติเติบโต 1.5%qoq ดีกว่าคาด แม้อยู่ในช่วง COVID ระบาดหนัก จากการปรับตัว, 5G และงานโครงการลูกค้าองค์กร ซึ่งทั้งหมดเสริมภาพการฟื้นตัวระยะถัดไป, ร่วมกับปัจจัยบวก COVID คลี่คลาย หนุนความมั่นคงธุรกิจหลักในระยะกลาง-ยาว และสามารถต่อยอดโอกาสต่อยอดธุรกิจใหม่ๆ Yield เกินปีละ 3.5% ซึ่งยังมีลุ้น Upside Payout เพิ่มขึ้นหลัง GULF เข้ามา โดยยังไม่รวมแผนสร้างมูลค่าเพิ่มอื่นๆ Fair Value 226 บาท

ภาพทางเทคนิค จังหวะ Technical Rebound กลับมายืนเหนือเส้น EMA 10 วัน บ่งชี้แรงซื้อกลับเข้าหุ้น ประเมินเป้าหมายการทำกำไรไว้ที่ 195.00 บาท

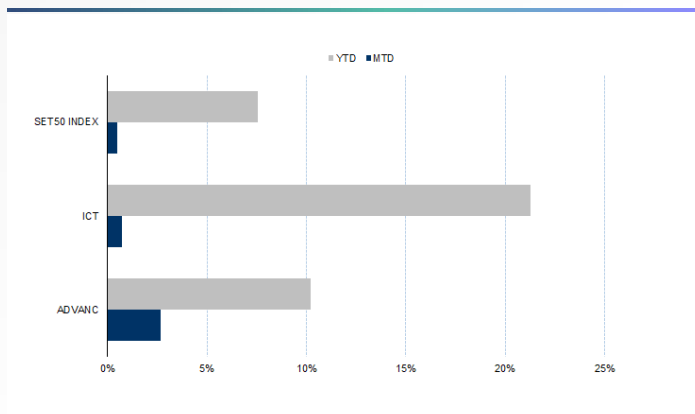
กลยุทธ์การลงทุน

เปิดสถานะ Long ADVANCZ21 ได้ที่ 193.08 บาท ปัจจุบันกำไร 14.91% เป้าทำกำไร 197 บาท Lock กำไร 10% ที่ 194 บาท

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
ADVANCZ21	194.50	0.50	366	5710	-161	14.26	16.49%	21.33	6.81	-1.42%

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 TVOZ21

ราคาน้ำมันปาล์มที่ปรับขึ้นในระยะนี้ เชื่อว่าจะเป็นบวกต่อทิศทางราคาน้ำมันถั่วเหลืองใน เช่นกันเนื่องจากถูกมองเป็นสินค้าที่ใช้ทดแทนกัน ซึ่งสถานการณ์ดังกล่าวจะเป็นบวกต่อ TVO ที่ราคาหุ้นปัจจุบันยังคง Laggard โดยตั้งแต่ต้นปี -8.1%YTD ตอรับความกังวลต่อ ทิศทางผลประกอบการ 2H64 ซะลดตัวไปมากแล้ว เทียบกับราคาน้ำมันถั่วเหลืองที่ปรับขึ้น มากถึง 51%YTD

ภาพทางเทคนิค แกว่งพักตัว ภายใต้เส้นกต EMA 200 วัน กรอบการเคลื่อนไหวที่ 30.50-32.00 บาท หากย่อลงมาบริเวณกรอบล่าง ใช้เป็นจังหวะเข้าสะสม เพื่อคาดหวังการปรับ ขึ้นทดสอบกรอบบนที่ 32.00 บาทในระยะถัดไป

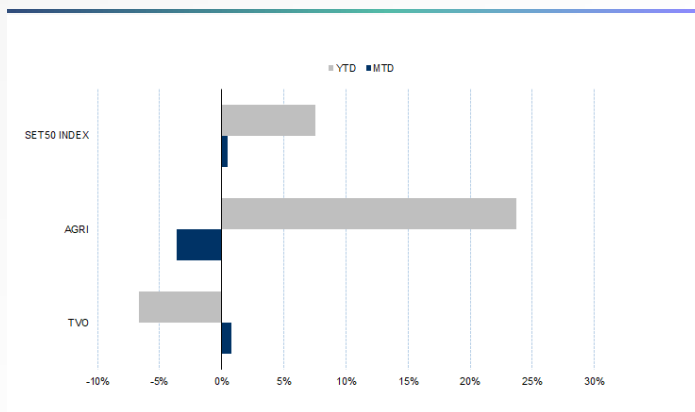
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำเปิด Long TVOZ21 ที่ 30.50 บาท เป้าทำกำไร 32 บาท Cut loss 0.50 บาทจาก ทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
TVOZ21	31.29	-0.21	-	738	0	10.63	11.11%	9.75	2.54	57.73%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

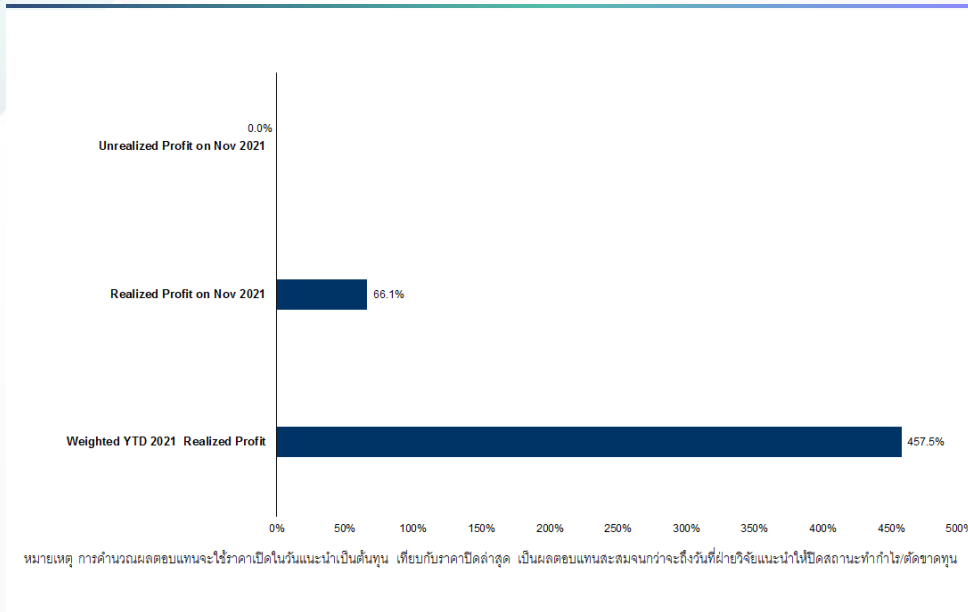
Technical Chart



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	TRUEZ21	3.80	0.02	20949	84003	13987	9.95	4.03	3.67
2	IRPCZ21	4.17	0.05	5815	30695	-2056	12.05	4.41	4.06
3	WHAZ21	3.47	-0.01	5534	41021	-2543	8.33	3.48	3.40
4	BGRMZ21	41.20	0.20	4810	10772	373	6.62	42.23	40.94
5	GUNKULZ21	4.82	0.02	3916	189786	1572	18.05	5.44	4.78
6	ORIZ21	11.90	0.10	3762	7916	-2749	11.50	11.90	11.13
7	CPALLZ21	64.80	0.05	3040	5581	2541	14.69	64.87	64.04
8	AAVZ21	2.91	-0.01	2664	20428	-2524	8.54	3.04	2.90
9	LHZ21	8.66	0.06	2504	6142	-998	11.91	8.74	8.39
10	KCEZ21	89.97	-0.53	2495	1993	153	17.01	91.83	84.76
11	CHGZ21	3.68	0.00	2000	13134	2000	13.83	3.74	3.63
12	SPALIZ21	23.40	0.10	1856	1228	309	10.95	24.70	22.02
13	CKPZ21	5.23	0.03	1717	17480	-698	5.47	5.33	5.14
14	SIRIZ21	1.33	0.03	1242	142973	138	11.40	1.33	1.29
15	AMATAZ21	21.09	0.29	1212	4027	-698	12.16	21.30	20.63
16	CPFZ21	25.42	0.52	1102	22872	1101	8.09	25.66	25.05
17	TPIPLZ21	1.73	0.01	1012	29585	1002	11.32	1.74	1.66
18	THCOMZ21	10.90	0.00	1005	8305	-497	8.20	11.34	10.86
19	PTGZ21	14.80	0.20	869	23505	684	5.19	15.37	14.36
20	GPSCZ21	74.65	0.15	851	7200	-247	8.49	77.18	74.00

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

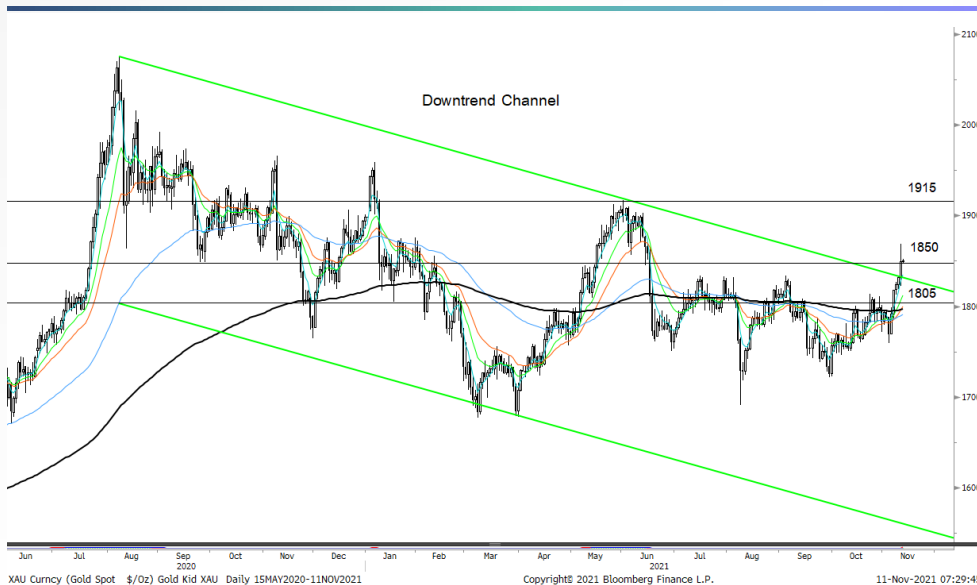
Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน เคลื่อนไหวผันผวน ระหว่างการซื้อขายขึ้นไปแตะจุดสูงสุดของวันที่ 1,868 เหรียญฯ ก่อนลดช่วงบวกลงมาปิดที่ 1,849 เหรียญฯ (+17.4 เหรียญฯ จากวันก่อนหน้า) เนื่องจากมีแรงถ่วงของค่าเงินดอลลาร์แข็งค่า หลังเกิดการคาดการณ์ว่าการพุ่งขึ้นของตัวเลขเงินเฟ้อสหรัฐในรอบกว่า 30 ปี อาจส่งผลให้ธนาคารกลางสหรัฐ (เฟด) ปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยเร็วกว่าคาด หนุนให้ Dollar Index ปรับขึ้นทันทีเกือบ 1% ปิดบริเวณ 94.89 จุด สำหรับวันนี้และพรุ่งนี้ ทางสหรัฐจะมีการรายงานตัวเลขการเปิดรับสมัครงาน และดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภคของสหรัฐ เป็นต้น

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFZ21 เมื่อคืน เพิ่มขึ้น 320 บาท ปิดที่ 28,800 บาท (1,842 เหรียญฯ) ต่ำกว่าราคาตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,850 เหรียญฯ คาดราคา GFZ21 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 28,750-29,100 บาท การติดตัวแรงของราคาทองคำเมื่อวาน ทำให้นักลงทุนที่เปิด Short GFZ21 ต้นทุน 28,650 บาท ปิดสถานะ และรับรู้กำไร 100 บาท จากทุน สำหรับกลยุทธ์วันนี้ ทิศทางราคาทองคำที่ผันผวน จึงแนะนำให้ให้นักลงทุน Trading บริเวณ 1,830-1,860 เหรียญฯ หรือ 28,580-29,050 บาท แต่หากราคาขึ้นไปแตะกรอบบน แนะนำให้รอเปิด Short รอบใหม่ ทั้งนี้นักลงทุนควรกำหนดจุด cut loss ไว้ 100 บาทจากทุน เพื่อ ป้องกันความเสี่ยง หากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดคาด

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GFZ21	28,800	390	1.37	48	176	-20
GFG22	28,830	400	1.41	3	147	0
GFJ22	28,800	340	1.19	-	32	0

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10Z21	28,810	380	1.34	2,389	9,246	67
GF10G22	28,860	410	1.44	1,024	4,817	-55
GF10J22	28,880	400	1.40	804	1,667	-93

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

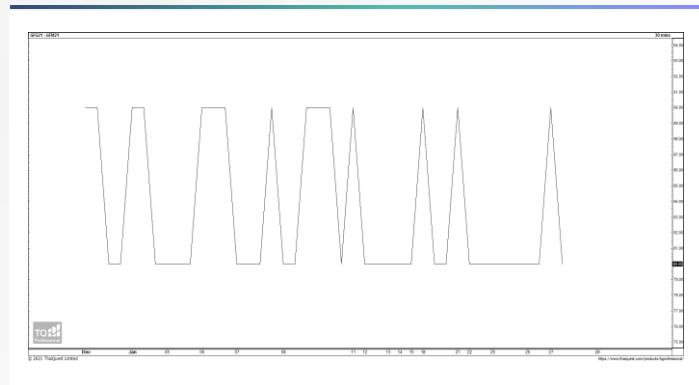
ทิศทางราคาทองคำ แรงซื้อกลับเข้าค่อนข้างแกร่ง Breakout แนวต้านบริเวณ \$1850 ทำ
และทำจังหวะ Higher Low มองภาพปัจจุบัน เป็นภาพการเปิด Upside ขึ้นต่อ คาค
กรอบการเคลื่อนไหวอยู่ที่ \$1850-\$1915

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD London AM (USD/Ounce)	FX (บาท/ USD)				
	32.50	32.75	33.00	33.25	33.50
1,650	25,489	25,686	25,882	26,078	26,274
1,680	25,953	26,153	26,352	26,552	26,751
1,710	26,416	26,620	26,823	27,026	27,229
1,740	26,880	27,087	27,293	27,500	27,707
1,770	27,343	27,554	27,764	27,974	28,185
1,800	27,807	28,021	28,235	28,448	28,662
1,830	28,270	28,488	28,705	28,923	29,140
1,860	28,734	28,955	29,176	29,397	29,618
1,890	29,197	29,422	29,646	29,871	30,095

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Spread ระหว่าง GFQ21 – GFZ21



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Gold Futures

นิลลงทุนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
29,050.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
29,000.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
28,950.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
28,900.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
28,850.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
28,800.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
28,750.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
28,700.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
28,650.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
28,600.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
28,550.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

นิลลงทุนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
29,060.00	250.0	2,500	(210)	2,290
29,010.00	200.0	2,000	(210)	1,790
28,960.00	150.0	1,500	(210)	1,290
28,910.00	100.0	1,000	(210)	790
28,860.00	50.0	500	(210)	290
28,810.00	0.0	-	(210)	(210)
28,760.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
28,710.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
28,660.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
28,610.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
28,560.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส