

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

24 กุมภาพันธ์ 2565



SET50 Futures:

Fund Flow จากต่างชาติ ช่วยลดผลกระทบจาก Sentiment ของสถานการณ์ ยูเครน-รัสเซีย ลงไป คาด SET50 ผันผวนโดยมี Downside จำกัด Trading S50H22 กรอบ 1005-1020 จุด และให้ 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:

เปิด Long GPSCH22 ได้ที่ 74.50 บาท ปัจจุบันมีกำไร 10.88% แนะนำถือเป้าทำกำไร 76 บาท Stop Profit ที่ทุน ราคาหุ้นที่ปรับลดลงแรง จน Upside เปิด ขณะที่ยังมีเรื่องการส่งเสริม EV เป็นแรงหนุน ทำให้มีโอกาสตีตัวกลับ

สถานะ Long SCCH22 ทุน 393 บาท ปิดรับกำไร 10% แนะนำให้รอเปิด Long BDMSH22 ที่บริเวณ 22.60 บาท เป้าทำกำไรที่ 23 บาท Cut Loss 0.20 บาทจากทุน

Gold Futures:

สถานการณ์ ยูเครน-รัสเซีย ที่ตึงเครียดทำให้เกิดแรงซื้อราคาทองคำปรับในฐานสินทรัพย์ปลอดภัยจนขึ้นมาขึ้นเหนือ 1900\$ ได้อีกครั้ง แนะนำ Trading GFJ22 กรอบ 28880 – 29490 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




 Asia Plus Group

RESEARCH DIVISION
บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส

เกิดศักดิ์ กวีธีระธรรม
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจมงคล, CISA, CFA
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นवलพรรณ น้อยรัชชกุล
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันพานิชกิจ
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	219,171	228,442	-9,271	6,571	-45,786	-343,390
Foreign	139,137	112,793	26,344	12,202	-26,707	24,080
Retail	308,589	325,662	-17,073	-18,773	72,493	319,310

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	38,400	34,921	3,479	1,996	2,334	-1,038
Foreign	74,860	68,318	6,542	-8,442	-22,750	31,708
Retail	90,910	100,931	-10,021	6,446	20,416	-30,670

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	165,157	163,081	2,076	13,177	-36,351	-286,723
Foreign	44,045	21,565	22,480	19,931	-8,946	-18,175
Retail	146,752	171,308	-24,556	-33,108	45,297	304,898

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	5,179	5,845	-666	-95	1,828	2,706
Foreign	19,660	22,579	-2,919	-822	3,433	-531
Retail	17,401	13,816	3,585	917	-5,261	-2,175

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	218	90	128	-261	-68	-2,521
Foreign	328	225	103	629	752	4,175
Retail	3,318	3,549	-231	-368	-684	-1,819

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	132	103	29	-255	379	1,667
Foreign	244	106	138	904	793	4,498
Retail	5,356	5,523	-167	-649	-1,172	-6,458

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

SET50 Overview

สินทรัพย์ทางการเงินต่างๆเผชิญความผันผวนสูงขึ้นจากความตึงเครียดระหว่างยูเครน-รัสเซีย สะท้อนได้จากค่าเงินรูเบิลพลิกอ่อนค่าทำจุดสูงสุดของปี ราคาทองคำเตรียมขึ้นทดสอบ High เดิมที่ 1915 เหรียญฯ สวนทางตลาดหุ้นสหรัฐฯที่ดัชนี Dow Jones ปรับลงสภาพแวดล้อมข้างต้นน่าจะเป็นปัจจัยที่กดดันต่อ SET50 Index ในวันนี้ แต่อย่างไรก็ตามหากประเมินจากผลกระทบทางเศรษฐกิจต่อบ้านเราที่มีมูลค่าการส่งออก/นำเข้ากับรัสเซียคิดเป็นสัดส่วนไม่ถึง 1% ขณะที่ค่าเงินบาทที่มีแนวโน้มแข็งค่าที่บริเวณ 32.20 บาท/usd สะท้อน Fund Flow ที่ยังมีแนวโน้มไหลเข้า จึงน่าจะเป็นปัจจัยที่ช่วยจำกัด Downside ของ SET50 Index ได้เป็นอย่างดี ส่วนประเด็นอื่นๆยังเกาะติดสถานการณ์ COVID-19 ที่แนวโน้มจำนวนผู้ติดเชื้อยังเร่งตัว แต่อย่างไรก็ตามผลกระทบยังจำกัดหากไม่มีการ Lockdown นอกจากนี้ยังมีความคืบหน้าเพิ่มเติมหลังวานนี้ ศบค. มีการปรับเกณฑ์การรับต่างชาติผ่านระบบ Test & Go โดยลดการตรวจ RT-PCR เหลือครั้งเดียว ภายใต้ปัจจัยแวดล้อมข้างต้นทำให้ SET50 Index วันนี้พักตัวแต่ Downside จำกัดตามกรอบ 1005-1025 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: Fund Flow จากต่างชาติ ช่วยลดผลกระทบจาก Sentiment ของสถานการณ์ ยูเครน-รัสเซีย ลงไป คาด SET50 ผันผวนโดยมี Downside จำกัด Trading S50H22 กรอบ 1005-1020 จุด และให้ Long ที่กรอบล่าง

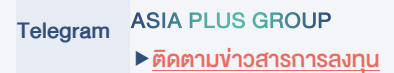
Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50M22 ลบด้วย S50H22 ณ วันที่ 30 มี.ค. 2565 จะเท่ากับ -4.46 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -5.20 จุด ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

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



	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	1005	1025
S50H22	1000	1020

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยฯจึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ



DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	1021.68	12.9509	11.867

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	2.00	0.20	> 1077	0.00	2.00	5.41%	0.38	121	5098	13.49	0.10	49.14	0.1
S50H22C1050	4.50	0.40	> 1054.5	0.00	4.50	3.21%	2.25	1122	7394	12.23	0.21	46.65	0.0
S50H22C1025	11.90	1.60	> 1036.9	0.00	11.90	1.49%	8.62	1534	7481	12.36	0.43	36.61	0.0
S50H22C1000	27.30	3.20	> 1027.3	21.68	5.62	0.55%	22.49	643	6048	13.59	0.66	24.77	0.0
S50H22C975	48.00	5.50	> 1023	46.68	1.32	0.13%	43.23	78	6148	16.51	0.80	17.02	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	60.00	-8.70	< 1015	53.32	6.68	-0.65%	58.13	4	28	15.12	-0.87	-14.80	0.0
S50H22P1050	37.20	-7.60	< 1012.8	28.32	8.88	-0.87%	35.01	46	447	12.25	-0.79	-21.67	0.0
S50H22P1025	20.00	-5.00	< 1005	3.32	16.68	-1.63%	16.39	377	2033	12.52	-0.57	-28.99	0.0
S50H22P1000	10.10	-3.60	< 989.9	0.00	10.10	-3.11%	5.27	881	5103	14.58	-0.32	-32.68	0.0
S50H22P975	5.60	-2.30	< 969.4	0.00	5.60	-5.12%	1.03	1284	9067	16.37	-0.19	-35.35	-0.1

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

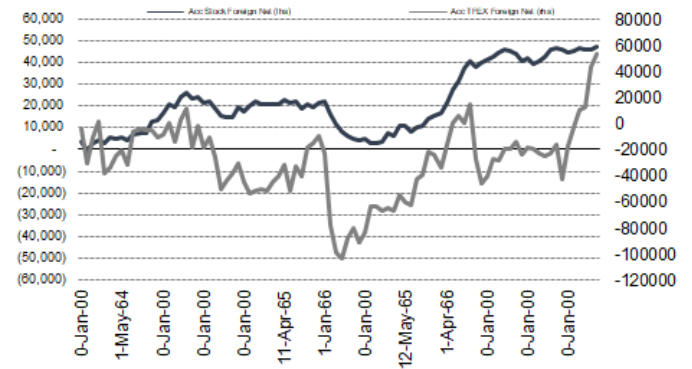
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สรุปการซื้อขาย
SET50	1021.68	5.13	0.50%	23/2/22

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50F22	989.59	0.0	0.0%	96	163	0
S50G22	1023.30	7.0	0.7%	76	208	24
S50H22	1016.80	6.9	0.7%	179,359	437,722	5,707
S50M22	1011.50	6.6	0.7%	18,516	53,354	-1,085
S50U22	1006.20	6.5	0.6%	3,720	18,663	-269
S50Z22	1006.10	6.4	0.6%	2,459	6,784	28

SET50 Futures	สัญญา			สะสม Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	1 เดือน
สถานะ	38,400	34,921	3,479	-1,050	-3,778	-3,737
ต่างชาติ	74,860	68,318	6,542	41,113	76,281	100,058
รายย่อย	90,910	100,931	-10,021	-40,063	-72,503	-96,321

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 Futures



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

	เป้าหมาย Spread ซีรียโก - ซีรียโก					
	S50J21	S50K21	S50M21	S50N21	S50Q21	S50U21
	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	ณ 29 ก.ย.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

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

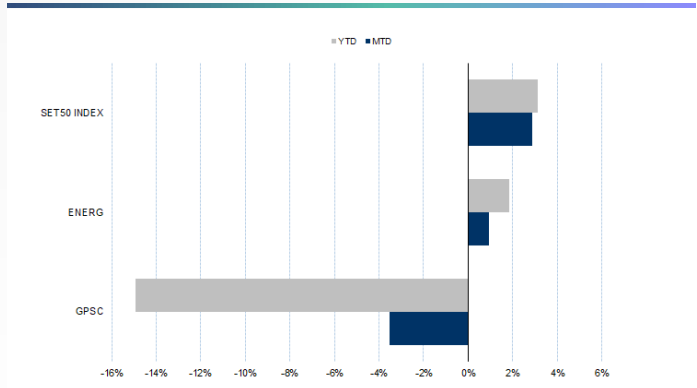
กลยุทธ์การลงทุน

เปิด Long GPSCH22 ได้ที่ 74.50 บาท กำไร 10.88% เป้าทำกำไร 76บาท Stop profit ที่ทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
GPSCH22	75.14	-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 BDMSH22

ปี 2565 คาดฟื้นตัวมั่นคงอีก 18.4% แม้กำหนดให้อานิสงส์รายได้ COVID ลดลงมีนัยๆ แต่ชดเชยได้จากการฟื้นตัวของทั้งลูกค้าไทยและต่างชาติซึ่งจะเห็นความต่อเนื่องนับจาก ก.พ. 65 ที่กลับมาเปิด ประเทศ Test&Go ยาวไปถึงปี 2566 ที่กำไรกลับสู่ระดับก่อน COVID ชัดเจน มูลค่าพื้นฐาน อิง DCF อยู่ที่ 27 บาท (WACC 7.1%, Growth 3%)

ภาพทางเทคนิค จังหวะพักตัวเหนือเส้น EMA 10 วัน บ่งชี้ Downside จำกัด ใช้การย่อตัวมาบริเวณ 22.60 บาท เป็นจังหวะเข้าสะสม โดยมีเป้าหมายบริเวณ 23.00 บาท

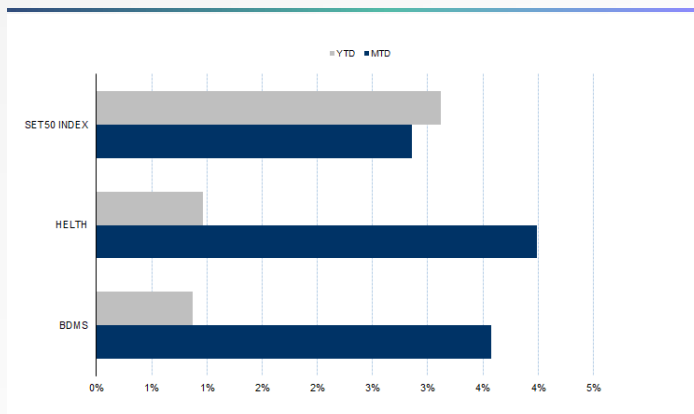
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long BDMSH22 บริเวณ 22.60 บาท เป้าทำกำไร 23 บาท cut loss 0.20 บาท จากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
BDMSH22	22.81	-0.40	1504	8082	630	13.88	11.41%	39.00	3.67	19.54%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Technical Chart



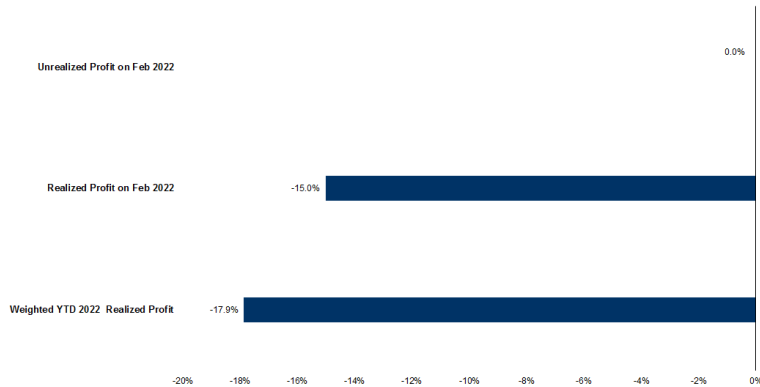
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Tracking Performance

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



หมายเหตุ: การคำนวณผลตอบแทนจะใช้ราคาเปิดในวันและนำเป็นต้นทุน เปรียบกับราคาปิดล่าสุด เป็นผลตอบแทนสะสมจนกว่าจะถึงวันที่ฝ่ายวิจัยแนะนำให้ปิดสถานะหากไม่ตัดขาดทุน

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	134453	122814	-8	15.00	5.29	4.94
2	TTBH22	1.45	0.03	8147	92596	1067		1.46	1.40
3	JASH22	3.72	-0.02	6767	139632	2446	8.20	3.47	3.16
4	GUNKULH22	6.71	0.01	5593	221517	-533	25.19	6.74	6.45
5	BECH22	15.35	0.15	3671	60883	-693	21.05	15.91	14.56
6	CKPH22	5.20	0.00	3115	23994	22	5.47	5.48	5.21
7	SPRCH22	8.99	-0.01	3059	12250	975	7.18	9.54	8.65
8	BANPUH22X	10.93	0.03	2747	67249	696	13.04	11.59	11.07
9	BEMH22	8.97	0.07	2517	25341	-10	12.33	9.05	8.55
10	KBANKH22	169.02	0.02	2131	3995	228	13.16	175.97	158.63
11	BDMSH22	22.80	-0.40	1704	8082	630	13.88	23.02	22.49
12	WHAH22	3.65	0.01	1693	65390	2501	8.71	3.51	3.38
13	PRMH22	5.83	-0.02	1554	9881	0	3.85	6.17	5.85
14	CHGH22	3.24	0.02	1458	13576	1500	12.11	3.44	3.28
15	MTCH22	53.50	-0.25	1325	4216	141	8.32	55.63	52.13
16	TUH22	20.97	-0.13	1280	8944	99	11.57	20.66	20.26
17	SIRIH22	1.29	-0.01	1086	72794	8549	11.40	1.30	1.23
18	TPIPLH22	1.76	-0.01	1081	25790	0	11.64	1.76	1.72
19	IRPCH22	3.84	-0.14	1071	51505	1114	11.64	3.83	3.76
20	APH22X	11.07	0.07	1021	2207	-1000	13.16	11.49	10.63

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ปรับเพิ่มขึ้น 10.7 เหรียญฯ กลับมายืนเหนือ 1,900 เหรียญฯ อีกครั้ง โดยปิดที่ 1,908.9 เหรียญฯ ท่ามกลางความกังวลเกี่ยวกับสถานการณ์ตึงเครียดในยูเครนที่ทวีความรุนแรงมากขึ้น โดยล่าสุดยูเครนประกาศภาวะฉุกเฉิน และสหรัฐระบุมีแนวโน้มที่รัสเซียจะบุกโจมตียูเครนในไม่ช้านี้ คงเป็นปัจจัยหลักนำไปสู่การเทขายสินทรัพย์เสี่ยง สะท้อนจากตลาดหุ้นดาวโจนส์สหรัฐเมื่อคืนปิดลบ 464.85 จุด หรือ 1.38% และหนุนให้เกิดแรงเข้าซื้อทองคำในฐานะสินทรัพย์ปลอดภัย ล่าสุดเข้านี้ (7.45 น.) ราคาขยับขึ้นใกล้บริเวณ 1,912 เหรียญฯ ประเด็นต้องติดตามวันนี้ นอกจากประเด็นรัสเซีย-ยูเครน ยังมีการรายงานข้อมูลเศรษฐกิจสหรัฐ เช่น GDP 4Q64, จำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงาน และยอดขายบ้านใหม่ ฯลฯ

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFG22 เมื่อคืน ปรับลดลง 90 บาท ปิดที่ 29,270 บาท (สวนทางตลาดโลกจากผลกระทบค่าเงินบาทกลับมาแข็งค่า) เทียบเท่า 1,906 เหรียญฯ ต่ำกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดวันที่ใกล้เคียง 1,912 เหรียญฯ คาดราคา GFG22 วันนี้จะแกว่งตัวในกรอบ 29,200-29,600 บาท จากความกังวลต่อรัสเซีย-ยูเครน ยังหนุนให้ราคาทองคำแกว่งตัวในกรอบที่ฝ่ายวิจัยประเมินไว้ 1,880-1,920 เหรียญฯ จึงคงแนะนำ Trading โดยสลับไปใช้ GFJ22 (แทน GFG22 ที่จะหมดอายุพรุ่งนี้) เทียบเท่า 28,880-29,490 บาท และกำหนดจุด Cut Loss ไว้ 100 บาทจากทุน ป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GFG22	29,270	270	0.93	66	222	11
GFJ22	29,240	260	0.90	95	231	-34
GFM22	29,270	180	0.62	64	135	-30

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10G22	29,240	210	0.72	2,155	5,532	-22
GF10J22	29,240	220	0.76	3,205	8,894	1039
GF10M22	29,240	210	0.72	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

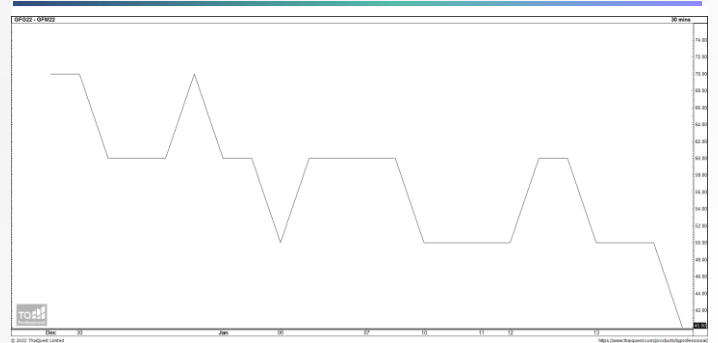
ทิศทางราคาทองคำ Breakout High บริเวณ \$1900 สนับสนุนด้วยแท่งเทียนทำจิ้งหะ Higher Low พร้อม EMA 10 วันสนับสนุน คาดแกว่งกรอบการเคลื่อนไหวที่ \$1900-\$1960

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
29,520.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
29,470.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
29,420.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
29,370.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
29,320.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
29,270.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
29,220.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
29,170.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
29,120.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
29,070.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
29,020.00	-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
29,490.00	250.0	2,500	(210)	2,290
29,440.00	200.0	2,000	(210)	1,790
29,390.00	150.0	1,500	(210)	1,290
29,340.00	100.0	1,000	(210)	790
29,290.00	50.0	500	(210)	290
29,240.00	0.0	-	(210)	(210)
29,190.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
29,140.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
29,090.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
29,040.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
28,990.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส