

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

17 มีนาคม 2565



SET50 Futures:

สถานะ Long S50H22 ทุน 944 จุด ปัจจุบันมีกำไร 15 จุด แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไร 1015 จุด กำหนดจุด Stop profit ที่ 1004 จุด Lock กำไรขั้นต่ำ 10 จุด เชื่อว่า SET50 ยังมี Momentum ในทิศทางขึ้นได้ต่อ

SET50 Option:

สถานะ Long S50H22C975 ทุน 26 จุด ปัจจุบันมีกำไร 11 จุด แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 43 จุด (SET50=1015) Stop profit ที่ 34 จุด Lock กำไรขั้นต่ำ 8 จุด สถานการณ์ ยูเครน-รัสเซีย ที่ดีขึ้นเป็นแรงหนุนสำคัญของตลาด

Single Stock Futures:

ปรับจุดเข้าเปิด Long CPALLH22 ไปที่บริเวณ 66.50 บาท เป้าทำกำไรที่ 68 บาท Cut Loss 0.50 บาทจากทุน สัญญาณการฟื้นตัวของยอดขายค่อนข้างชัดเจน และเชื่อว่าจะมีความต่อเนื่อง หนุนผลประกอบการและราคาหุ้น

สถานะ Long GPSCH22 ทุน 68.10 บาท ปิดรับกำไร 32% แนะนำให้เปิด long AOTH22 ที่บริเวณ 63.75 บาท เป้าทำกำไรที่ 65.50 บาท Cut Loss 0.75 บาทจากทุน การผ่อนคลาย Test&Go สร้าง Sentiment เชิงบวก

Gold Futures:

ราคาทองคำผันผวนในทิศทางลง โดยมีแรงกดดันจากสถานการณ์ ยูเครน-รัสเซีย ที่มีแนวโน้มคลี่คลาย หนุน Fund Flow ไหลกลับสินทรัพย์เสี่ยง แนะนำ Trading GFJ22 ในกรอบ 30240 - 30720 บาท (1910-1940\$)

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  [▶ 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

นวลพรรณ น้อยรัชชกุล
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	124,701	127,579	-2,878	42,801	38,218	464,229
Foreign	111,362	118,095	-6,733	-11,995	28,790	84,619
Retail	255,358	245,747	9,611	-30,806	-67,008	-548,848

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	37,266	40,345	-3,079	1,946	-4,960	17,616
Foreign	64,265	66,808	-2,543	-6,824	47,785	-57,543
Retail	112,520	106,898	5,622	4,878	-42,825	39,927

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	72,433	74,170	-1,737	39,106	43,009	399,666
Foreign	16,207	18,804	-2,597	626	-2,770	138,045
Retail	89,929	85,595	4,334	-39,732	-40,239	-537,711

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	10,016	10,291	-275	-3,419	-3,845	-3,512
Foreign	30,588	32,170	-1,582	-5,848	-16,122	-1,098
Retail	26,165	24,308	1,857	9,267	19,967	4,610

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	396	21	375	129	147	-1,067
Foreign	116	60	56	111	21	1,951
Retail	3,798	4,229	-431	-240	-168	-884

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	333	110	223	284	830	1,401
Foreign	119	167	-48	2	-38	3,294
Retail	5,455	5,630	-175	-286	-792	-4,695

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



SET50 Overview

คาด SET50 Index วันนี้แกว่งขึ้นตามกรอบ 1000-1020 จุด จากสภาพแวดล้อมที่รายล้อมไปด้วย Sentiment เชิงบวก เริ่มจากยูเครน-รัสเซียที่ถึงแม้จะยังหาข้อสรุปไม่ได้แต่การเจรจาระหว่างสองฝ่ายยังมีต่อไปทำให้ความหวังต่อการหาข้อยุติร่วมกันยังเป็นไปได้ ขณะที่ผลการประชุม FED วานนี้มีประเด็นสำคัญประกอบด้วย 1) ปรับขึ้นดอกเบี้ยฯ 0.25% มาในกรอบ 0.25%-0.5% 2) ส่งสัญญาณการปรับขึ้นดอกเบี้ยฯ ในปีนี้อีก 6 ครั้งมาที่ 1.75%-2.00% 3) การลดขนาดงบดุลจะพิจารณาในการประชุมรอบถัดไปโดยยังไม่มี การระบรายละเอียด 4) ปรับคาดการณ์ GDP Growth ปีนี้ขยายตัว 2.8% (เดิมคาด 4.0%) และปรับคาดการณ์เงินเฟ้อสหรัฐฯขึ้น 4.3% (2.6%) จากผลของความขัดแย้งระหว่างยูเครน-รัสเซีย ผลการประชุมโดยรวมที่ไม่ได้เหนือกว่าคาดทำให้เม็ดเงินมีแนวโน้มไหลเข้าสินทรัพย์เสี่ยงมากขึ้น สะท้อนจากดัชนี Dow Jones ที่ปรับขึ้น 1.55% ส่วนทาง Dollar Index ที่อ่อนค่า 0.5% มองเป็นบวกต่อ Fund Flow ที่ไหลเข้าในภูมิภาครวมถึงบ้านเราเชื่อว่าจะเป็นหนึ่งในเป้าหมายจากทิศทางดอกเบี้ยฯที่จะอยู่ในระดับต่ำส่งผลให้ Valuation ในมิติ EYG เปิดกว้างระดับ 4.8% ซึ่งถือว่ามากกว่าค่าเฉลี่ยย้อนหลัง 10 ปี + 1 S.D. ส่วนประเด็นอื่น ๆ ติดตามการประชุม ศบค. ในวันพรุ่งนี้ คาดพิจารณาผ่อนคลายเกณฑ์ TEST & GO โดยการยกเว้นการตรวจ RT-PCR ตั้งแต่ต้นทางก่อน 72 ชม. ซึ่งมองเป็นบวกต่อหุ้นในกลุ่ม Reopening

SET50 Index Futures

Direction Trading: สถานะ Long S50H22 ทุน 944 จุด ปัจจุบันมีกำไร 15 จุด แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไร 1015 จุด กำหนดจุด Stop profit ที่ 1004 จุด Lock กำไรขั้นต่ำ 10 จุด เชื่อว่า SET50 ยังมี Momentum ในทิศทางขึ้นได้ต่อ


Spread Trading: สถานะ Long Spread S50H22M22 ได้ที่ -7.0 จุด ปัจจุบันกำไร 1.4 จุด แนะนำถือต่อโดยมีเป้าหมายกำไรที่ -4.46 จุด ซึ่งเป็นค่า Spread ทางทฤษฎีระหว่าง S50M22 ลบด้วย S50H22 ณ วันที่ 30 มี.ค.65

SET50 Option: สถานะ Long S50H22C975 ทุน 26 จุด ปัจจุบันมีกำไร 11 จุด แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 43 จุด (SET50=1015) Stop profit ที่ 34 จุด Lock กำไรขั้นต่ำ 8 จุด สถานการณ์ ยูเครน-รัสเซีย ที่ดีขึ้นเป็นแรงหนุนสำคัญของตลาด

	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	1000	1020
S50H22	1000	1020

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยฯจึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ

แอปพลิเคชัน  ASP SMART
▶ [ดาวน์โหลด](#)

Telegram 
▶ [ติดตามข่าวสารการลงทุน](#)

FOLLOW NOW




 Asia Plus Group

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	1011.95	13.21652	21.38828

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	0.30	0.00	> 1075.3	0.00	0.30	6.26%	0.20	57	5107	17.21	0.02	80.05	0.1
S50H22C1050	1.00	0.30	> 1051	0.00	1.00	3.86%	1.36	735	7249	13.63	0.08	83.01	0.0
S50H22C1025	4.30	1.70	> 1029.3	0.00	4.30	1.71%	5.95	1020	5570	12.12	0.28	66.88	0.0
S50H22C1000	17.00	6.80	> 1017	11.95	5.05	0.50%	17.40	1218	7643	12.99	0.67	39.86	0.0
S50H22C975	37.00	9.50	> 1012	36.95	0.05	0.00%	36.40	274	6470	13.57	0.91	25.01	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	67.80	-10.90	< 1007.2	63.05	4.75	-0.47%	65.55	1	40	#N/A/N/A	-1.00	-14.93	0.0
S50H22P1050	42.20	-12.10	< 1007.8	38.05	4.15	-0.41%	41.71	3	532	14.85	-0.91	-21.87	0.0
S50H22P1025	20.00	-12.00	< 1005	13.05	6.95	-0.69%	21.31	311	1917	14.66	-0.68	-34.33	0.0
S50H22P1000	7.60	-7.10	< 992.4	0.00	7.60	-1.93%	7.76	1165	5281	15.67	-0.36	-47.28	0.0
S50H22P975	3.00	-3.70	< 972	0.00	3.00	-3.95%	1.77	1254	9339	18.29	-0.15	-51.12	0.0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สปรนการซื้อขาย
SET50	1011.95	13.23	1.31%	16/3/22

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50F22	989.59	0.0	0.0%	96	163	0
S50G22	1014.15	0.0	0.0%	97	190	24
S50H22	1009.30	13.9	1.4%	161,832	320,172	5,707
S50M22	1003.60	14.5	1.4%	41,765	66,014	-1,085
S50U22	997.80	13.7	1.4%	7,464	19,977	-269
S50Z22	997.80	13.7	1.4%	2,957	9,430	28

SET50 Futures	Long(Short) : สัปดาห์			สะสม Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	1 เดือน
สถานะ	37,266	40,345	-3,079	-1,050	-3,778	-3,737
ต่างขาด	64,265	66,808	-2,543	41,113	76,281	100,058
รายย่อย	112,520	106,898	5,622	-40,063	-72,503	-96,321

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

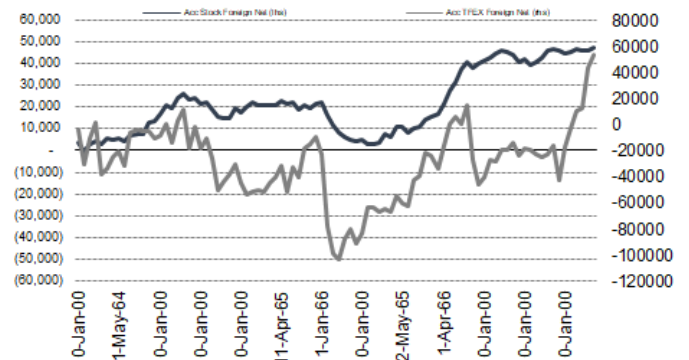
คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

	เป้าหมาย Spread ซีรียโกล - ซีรียโกล					
	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

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 Futures



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
(เท่า)							
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 CPALLH22

ภาพธุรกิจที่มีแนวโน้มฟื้นตัวต่อเนื่องของ CPALL จากช่วงปลายปี โดยยอดขายสาขาเดิม (SSSG) กลับมาบวกทั้ง yoy และ mom ขณะที่ CPALL จะรักษาความต่อเนื่อง เน้นจุดแข็งความสามารถตอบสนองความต้องการลูกค้า ทั้งในส่วนสินค้าภายในสาขา และการอำนวยความสะดวกส่งถึงบ้านที่ยังเป็นกลยุทธ์หลัก จุดแข็งดังกล่าว คาดช่วยหนุนยอดขายสาขาเดิม มาร์จิ้นและ GPM ที่จะกลับมาจากยอดขายสินค้ามาร์จิ้นสูงที่ลดลงไป และความประหยัดต่อขนาดที่กลับมา Fair Value 2565 อิงวิธี DCF อยู่ที่ 75 บาท

ภาพทางเทคนิค ภาพราย 60 นาที ทำจังหวะ Higher Low พร้อมด้วยการฟอร์มฐานแนวรับได้แกร่ง ที่ 65.75 บาท โดยมีเป้าหมายทำกำไรที่ 68.00 บาท

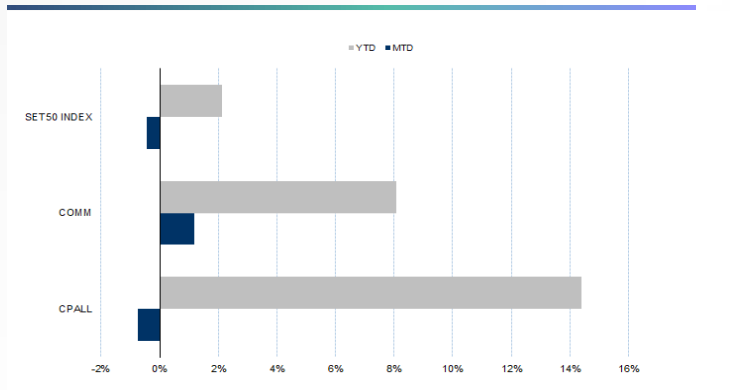
กลยุทธ์การลงทุน

ปรับจุดเข้า Long CPALLH22 ไปที่ 66.50 บาท เป้าทำกำไร 68 บาท cut 0.50 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
CPALLH22	67.00	-0.40	236	6886	-360	14.92	6.77%	34.99	6.20	98.49%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures



DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



Long AOTH22

กระทรวงสาธารณสุข เตรียมผ่อนคลาย ระบบ Test and Go เพื่อความคล่องตัว เสนอว่าไม่จำเป็นต้องตรวจ RT-PCR ใน 72 ชั่วโมงแล้ว เหลือเพียงการตรวจครั้งเดียวเมื่อมาถึงไทย และตรวจ ATK ด้วยตนเองซ้ำอีกครั้งในวันที่ 5 ของการเดินทาง คาดเป็น Sentiment เชิงบวกหนุนต่อหุ้นกลุ่มท่องเที่ยว ขณะที่ราคาหุ้นปัจจุบันยัง Laggard SET Index อยู่มาก Fair Value ปี 65 เท่ากับ 69.60 บาท

ภาพทางเทคนิค ราคาทำจังหวะ Higher Low พร้อมสัญญาณบวกทางเทคนิค จากการยืนเหนือ EMA 200 วัน หากผ่าน 64.50 บาทได้ จะเปิด Upside ไปที่ 65.50 บาท

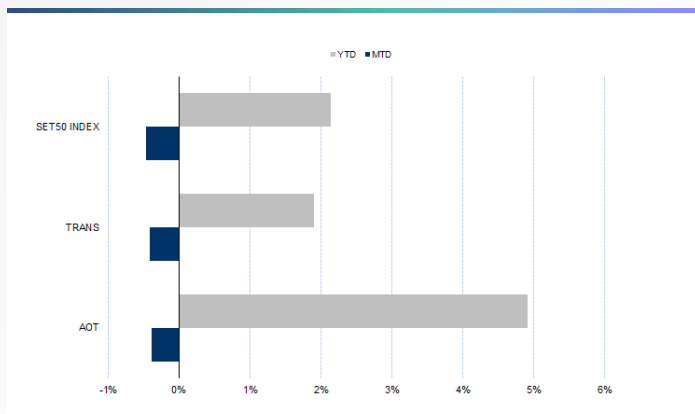
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long AOTH22 บริเวณ 63.75 บาท เป้าทำกำไร 65.50 บาท cut 0.75 บาทจากหุ้น

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
AOTH22	64.05	0.20	190	2632	728	9.96	6.31%		8.54	-63.32%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

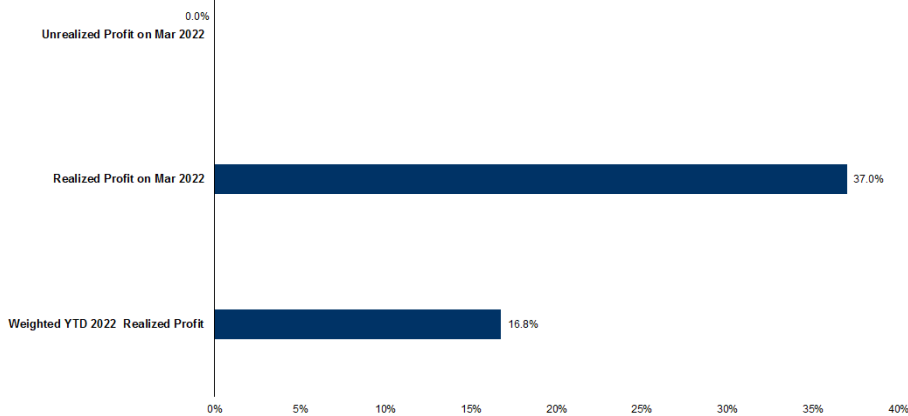
Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



Tracking Performance



หมายเหตุ การคำนวณผลตอบแทนจะใช้ราคาเปิดในวันแนะนำเป็นต้นทุน เทียบกับราคาปิดล่าสุด เป็นผลตอบแทนสะสมจนกว่าจะถึงวันที่ฝ่ายวิจัยแนะนำไม่ให้ปิดสถานะทำกำไรหรือตัดขาดทุน

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Top 20 Most Active Volume

	Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	TTBH22	1.36	0.00	4880	92596	1067		1.36	1.26
2	TRUEH22	4.99	-0.06	2870	122814	-8	15.00	4.99	4.67
3	IRPCH22	3.79	0.01	2675	51505	1114	11.64	3.72	3.52
4	OSPH22	37.73	-0.02	2011	25064	33	7.28	38.46	35.66
5	BECH22	16.57	-0.73	2002	60883	-693	21.05	17.42	16.26
6	TTAH22	10.33	-0.07	1580	5376	10	24.40	10.15	9.19
7	BTSH22	9.72	0.12	1321	22468	-500	9.81	9.51	8.91
8	GFPTH22	13.40	0.00	1300	13683	270	7.71	12.82	12.12
9	SIRIH22	1.20	-0.04	1035	72794	8549	11.40	1.28	1.21
10	WHAH22	3.46	0.02	1026	65390	2501	8.71	3.43	3.22
11	CHGH22	3.55	-0.07	1014	13576	1500	12.11	3.84	3.53
12	KBANKH22	162.59	0.59	971	3995	228	13.16	162.04	153.96
13	CPFH22	25.02	0.22	965	22863	-193	8.45	25.04	23.07
14	BPCGH22	12.35	0.05	806	15562	313	5.56	12.35	11.62
15	GULFH22	49.87	-0.63	759	15086	1312	2.65	49.23	46.75
16	KCEH22	58.65	0.15	703	3377	31	11.80	64.06	59.19
17	CBGH22	107.00	-1.00	644	17852	-99	7.05	108.67	103.31
18	THANIH22	4.21	0.01	590	18349	-2500	4.54	4.26	4.03
19	PTTGCH22	51.60	0.10	564	5647	1207	8.93	51.84	48.47
20	SPRCH22	9.05	0.00	522	12250	975	7.18	9.33	8.87

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



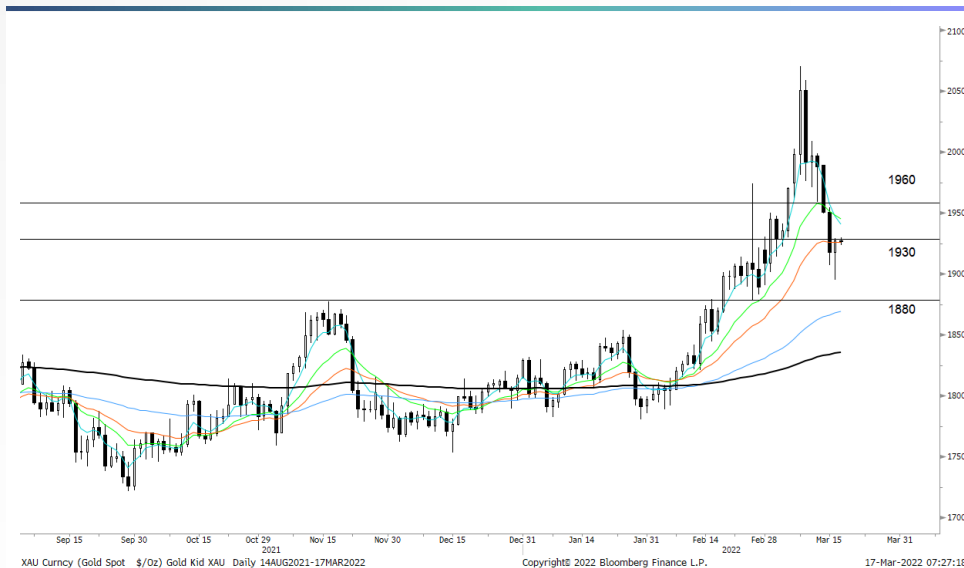
Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ปรับเพิ่มขึ้น 8 เหรียญฯ ปิดที่ 1,924 เหรียญฯ จากแรงเข้าซื้อเก็งกำไร หลังราคาทองคำร่วงลงมาติดต่อกันหลายวันทำการตั้งแต่ระดับ 2,050 เหรียญฯ นอกจากนี้ราคาทองคำมีแรงหนุนจากค่าเงินดอลลาร์อ่อนค่า เมื่อเทียบกับค่าเงินสกุลหลักอื่น โดยเฉพาะค่าเงินยูโรแข็งค่า ทำให้ Dollar Index ชัยบัลงมา 0.6% ปิดที่ 98.4 จุด ขณะที่ผลการประชุมธนาคารกลางสหรัฐ (เฟด) เมื่อคืน มีมติปรับขึ้นดอกเบี้ย 0.25% เป็นไปตามตลาดคาด สำหรับวันนี้และพรุ่งนี้ คงต้องติดตามพัฒนาการการเจรจาระหว่างรัสเซีย-ยูเครน, การประชุมของธนาคารกลางอังกฤษและญี่ปุ่น รวมถึงการรายงานข้อมูลเศรษฐกิจสหรัฐ เช่น ดัชนีภาคการผลิต, จำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงาน และยอดขายบ้านมือสอง เป็นต้น

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFJ22 เมื่อคืน ลดลง 100 บาท ปิดที่ 30,580 บาท (1,931 เหรียญฯ) สูงกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดวันนี้บริเวณ 1,927 เหรียญฯ คาดราคา GFJ22 วันนี้จะแกว่งตัวในกรอบ 30,350-30,700 บาท ทิศทางราคาทองคำยังแกว่งตัวในกรอบที่ประเมินไว้ 1,910-1,930 เหรียญฯ ฝ่ายวิจัยจึงแนะนำให้นักลงทุนเล่น Trading บริเวณ 30,240-30,720 บาท และกำหนดจุด Cut Loss ไว้ 100 บาท เพื่อป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GFJ22	30,580	10	0.03	136	250	2
GFM22	30,600	0	0.00	38	223	5
GFQ22	30,280	-340	-1.11	17	7	0

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10J22	30,590	40	0.13	5,206	7,426	970
GF10M22	30,600	40	0.13	2,110	6,410	407
GF10Q22	30,600	50	0.16	733	501	301

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 อยู่ในจังหวะการปรับฐาน ยังไม่มีสัญญาณฟื้นตัว หลุดแนวรับ EMA

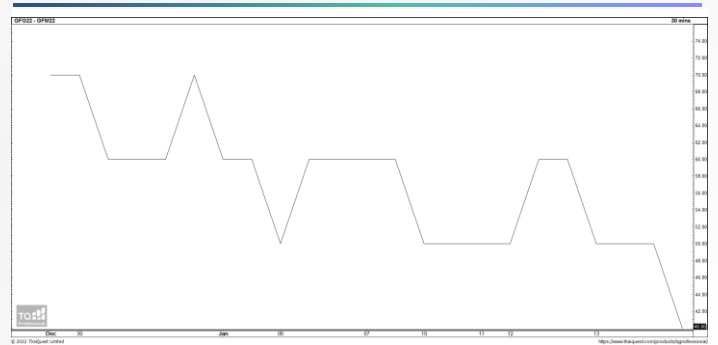
10 วัน คาดแกว่งในกรอบการเคลื่อนไหวที่ \$1880-\$1930

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD London 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 GFJ22 – GFQ22



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
30,830.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
30,780.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
30,730.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
30,680.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
30,630.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
30,580.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
30,530.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
30,480.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
30,430.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
30,380.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
30,330.00	-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
30,840.00	250.0	2,500	(210)	2,290
30,790.00	200.0	2,000	(210)	1,790
30,740.00	150.0	1,500	(210)	1,290
30,690.00	100.0	1,000	(210)	790
30,640.00	50.0	500	(210)	290
30,590.00	0.0	-	(210)	(210)
30,540.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
30,490.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
30,440.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
30,390.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
30,340.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส