

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

5 เมษายน 2565



SET50 Futures:

วันนี้แนะนำ Trading S50M22 ในกรอบ 1015-1030 จุด คาด SET50 แกว่งออกข้าง คาดนักลงทุนอยู่ในช่วง Wait & See ติดตามพัฒนาการรัสเซีย-ยูเครน, Covid-19 และเงินเฟ้อฯ ไทย

SET50 Option:

แนะนำปรับจุดเปิด Long S50M22C1000 ไปที่ 25 จุด (SET50=1015) เป้าทำกำไรที่ 35 จุด (SET50=1025) Cut Loss 3 จุดจากทุน คาดว่า SET50 อยู่ในช่วงแกว่งออกเพื่อรอปัจจัยใหม่ขับเคลื่อน

Single Stock Futures:

เปิดสถานะ Long RSM22 ได้ที่ทุน 16.80 บาท เป้าทำกำไร 17.50 บาทและตั้งจุด Cut Loss 0.30 บาท มีมุมมองบวกต่อผลประกอบการในปี 2565 ที่จะค่อยๆฟื้นตัวจากกำลังซื้อของผู้บริโภคที่กลับมา

เปิดสถานะ Long AOTM22 ได้ที่ 66 บาท ปัจจุบันมีกำไร 23.6% แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 68 บาท และเลื่อน Stop Profit มาที่ 66.50 บาท เพื่อ Lock กำไรขั้นต่ำ 10% โดยมีแรงสนับสนุนจากแนวทางการผ่อนคลายให้นักท่องเที่ยวเดินทางได้ง่ายขึ้นช่วยสร้าง Sentiment เชิงบวก


Gold Futures:

ความกังวลต่อสถานการณ์รัสเซีย-ยูเครน กลับมาหนุนต่อราคาทองคำ แต่ราคายังผันผวนอยู่ในกรอบที่ประเมินไว้ แนะนำ Trading GFJ22 กรอบ 30360-30830 บาท (1910-1940\$) และรอเปิด Short กรอบบน

SET50 Index Futures / Option	P. 3
Single Stock Futures	P. 6
Gold Futures	P. 8

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องสามารถดำเนินการได้อย่างรวดเร็วทัน ฝ่ายวิจยฯ 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 พันพานกิจ
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธ เกิดเนตร
ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

ข้อมูลในเอกสารฉบับนี้ รวบรวมมาจากแหล่งข้อมูลที่น่าเชื่อถือ อย่างไรก็ตาม บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด ไม่สามารถที่จะยืนยันหรือรับรองความถูกต้องของข้อมูลเหล่านี้ได้ ไม่ว่าประการใดๆ บทวิเคราะห์ในเอกสารนี้ จัดทำขึ้นโดยอ้างอิงหลักเกณฑ์ทางวิชาการเกี่ยวกับหลักการวิเคราะห์ และมีได้เป็นการชี้แนะ หรือเสนอแนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ การตัดสินใจซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ ของผู้อ่าน ไม่ว่าจะเกิดจากการอ่านบทความในเอกสารนี้หรือไม่ก็ตาม ล้วนเป็นผลจากการใช้วิจารณญาณของผู้อ่าน โดยไม่มีส่วนเกี่ยวข้องกับหรือผู้ผูกพันใดๆ กับ บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด ไม่ว่ากรณีใด

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	112,894	115,340	-2,446	-13,807	-64,865	229,485
Foreign	79,466	76,757	2,709	2,214	54,611	170,076
Retail	168,912	169,175	-263	11,593	10,254	-399,561

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	21,258	20,330	928	1,772	-5,811	-12,358
Foreign	41,343	40,755	588	2,453	25,883	88,602
Retail	48,718	50,234	-1,516	-4,225	-20,072	-76,244

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	77,125	84,787	-7,662	-27,269	-31,172	218,481
Foreign	16,622	11,594	5,028	-191	26,901	94,560
Retail	84,770	82,136	2,634	27,460	4,271	-313,041

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	4,453	8,215	-3,762	-1,787	912	-147
Foreign	21,161	24,192	-3,031	-463	487	-5,892
Retail	25,373	18,580	6,793	2,250	-1,399	6,039

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	34	26	8	113	-226	-173
Foreign	91	29	62	237	707	374
Retail	581	651	-70	-350	-481	-201

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	39	58	-19	118	-138	123
Foreign	41	138	-97	-55	354	971
Retail	1,366	1,250	116	-63	-216	-1,094

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

SET50 Overview

ประเด็นรัสเซีย-ยูเครนล่าสุดมีรายงานยุโรปและสหรัฐอเมริกาอยู่ระหว่างพิจารณามาตรการคว่ำบาตรรัสเซียเพิ่มเติม หนุนให้ราคาน้ำมันดิบวานนี้ปรับขึ้น 3% น่าจะเป็นบวกต่อหุ้นกลุ่มพลังงาน แต่อีกด้านหนึ่งเป็นแรงกดดันต่อหุ้นกลุ่มที่ใช้ต้นทุนพลังงาน เช่น กลุ่มโรงไฟฟ้า กลุ่มวัสดุก่อสร้าง ขณะอีกประเด็นที่ให้ความสนใจสถานการณ์ COVID-19 ในประเทศจีนที่แนวโน้มผู้ติดเชื้อยังเร่งตัวซึ่งอาจเป็นความเสี่ยงต่อการใช้มาตรการ Lockdown เพิ่มเติม หากเกิดขึ้นอาจเป็น Sentiment เชิงลบต่อหุ้นที่เกี่ยวข้องกับภาคการผลิต ส่วน COVID-19 ในประเทศจำนวนผู้ติดเชื้อยังทรงตัวในระดับกว่า 2 หมื่นรายและพบผู้ติดเชื้อ Omicron สายพันธุ์อื่นๆ อาทิ XJ และ XE ซึ่งยังต้องติดตามในแง่ความรุนแรง ความเร็วในการแพร่กระจายโรครวมถึงความสามารถของวัคซีนในการป้องกัน แต่อย่างไรก็ตามท่าทีของภาครัฐฯที่ยังเดินหน้าเปิดกิจกรรมทางเศรษฐกิจผลกระทบต่อตลาดหุ้นจึงจำกัด ส่วนประเด็นอื่น ๆ วนนี้ติดตามเงินเฟ้อบ้านเราคาดว่าขยายตัว 5.6%yoy และการรายงาน FED Minutes ในวันที่ 6 เม.ย. สภาพแวดล้อมยังอยู่ในช่วงการติดตามพัฒนาการต่างๆของเหตุการณ์ประกอบกับมูลค่าการซื้อขายที่มีแนวโน้มเบาบางลงทำให้ SET50 Index วันนี้แกว่งออกข้างตามกรอบ 1015-1025 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: วันนี้แนะนำ Trading S50M22 ในกรอบ 1015-1030 จุด คาด SET50 แกว่งออกข้าง คาดนักลงทุนอยู่ในช่วง Wait & See ติดตามพัฒนาการรัสเซีย-ยูเครน, FED Minutes และเงินเฟ้อฯ ไทย

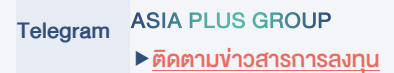
Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50U22 ลบด้วย S50M22 ณ วันที่ 29 มิ.ย. 2565 จะเท่ากับ -8.45 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -6.10 จุด ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: แนะนำปรับจุดเปิด Long S50M22C1000 ไปที่ 30 จุด (SET50=1013) เป้าทำกำไรที่ 40 จุด (SET50=1025) Cut Loss 3 จุดจากทุน คาดว่า SET50 อยู่ในช่วงแกว่งออกข้างแต่ Downside จำกัด



	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	1013	1025
S50M22	1015	1030

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยฯจึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ



DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	1022.81	12.45796	6.281211

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
S50M22C1125	0.90	-0.10	> 1125.9	0.00	0.90	10.08%	1.91	7	786	11.65	0.04	44.75	0.1
S50M22C1100	1.90	-0.30	> 1101.9	0.00	1.90	7.73%	3.99	29	1143	11.28	0.08	43.23	0.1
S50M22C1075	4.40	-0.50	> 1079.4	0.00	4.40	5.53%	7.73	155	2438	10.89	0.16	36.17	0.1
S50M22C1050	9.40	-0.80	> 1059.4	0.00	9.40	3.58%	13.92	161	3206	10.80	0.28	30.81	0.0
S50M22C1025	18.50	-0.80	> 1043.5	0.00	18.50	2.02%	23.28	165	2642	11.15	0.46	25.20	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
S50M22P1125	107.90	0.40	< 1017.1	102.19	5.71	-0.56%	108.59	0	3	14.33	-0.90	-8.55	0.0
S50M22P1100	84.40	0.20	< 1015.6	77.19	7.21	-0.70%	85.70	0	14	13.06	-0.87	-10.51	0.0
S50M22P1075	62.40	1.60	< 1012.6	52.19	10.21	-1.00%	64.47	0	201	10.42	-0.84	-13.82	0.0
S50M22P1050	41.50	0.00	< 1008.5	27.19	14.31	-1.40%	45.69	1	141	11.16	-0.70	-17.25	0.0
S50M22P1025	25.20	0.10	< 999.8	2.19	23.01	-2.25%	30.08	99	1022	10.96	-0.54	-21.91	0.0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

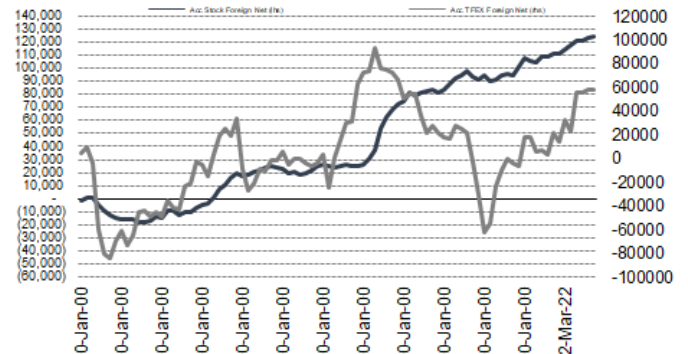
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สรุปการซื้อขาย
SET50	1022.81	-0.85	-0.08%	4/4/22

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50J22	1020.90	0.6	0.1%	232	339	-4
S50K22	1017.00	-3.1	-0.3%	7	110	4
S50M22	1018.50	-0.2	0.0%	97,670	338,088	-1,015
S50U22	1012.30	-0.2	0.0%	10,256	29,791	621
S50Z22	1010.60	-0.7	-0.1%	2,610	14,081	935
S50H23	1007.40	-0.5	0.0%	544	928	280

SET50 Futures	Long(Short) : สัญญา			สะสม Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	1 เดือน
สถานะ	21,258	20,330	928	1,772	-16,694	-12,358
ต่างชาติ	41,343	40,755	588	2,453	52,729	88,602
รายย่อย	48,718	50,234	-1,516	-4,225	-36,035	-76,244

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 Futures



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%

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
(ล้านบาท)							
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

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Single Stock Futures

Long RSM22

แผนธุรกิจปี 2565 โดดเด่น จากการเตรียมเปิดตัวสินค้าใหม่ภายใต้แบรนด์เดิม การพัฒนา แอปพลิเคชันช่อง 8 และการนำเหรียญ Popcoin เข้ามาเติมเต็ม Ecosystem ให้สมบูรณ์ รวมถึงการได้หน่วยธุรกิจขายตรง “ULife” เข้ามาต่อยอดโมเดล Entertainmerce ประเมินมูลค่าเหมาะสมวิธี DCF ได้ 22.60 บาท Dividend Yield ที่ 2.06% XD 3 พ.ค 65 ภาพทางเทคนิค จังหวะพักตัวเหนือเส้น EMA 10 วัน บ่งชี้ Downside ที่จำกัด ใช้จังหวะย่อมาบริเวณ 16.90 บาท เข้าสะสม โดยเป้าหมายทำกำไรอยู่ที่ 17.50 บาท

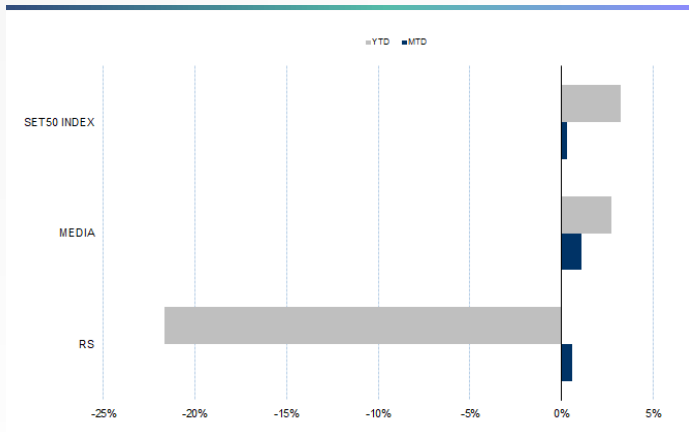
กลยุทธ์การลงทุน

เปิด Long RSM22 ได้ที่ 16.80 บาท เป้าทำกำไร 17.50 บาทและ Cut Loss 0.30 บาท

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
RSM22	16.83	-0.10	160	40770	102	6.39	32.94%	21.05	7.31	210.49%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures



DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



Long AOTM22

หลังจากกระทรวงการท่องเที่ยวและกีฬาเตรียมนำเสนอที่ประชุม ศคช. พิจารณายกเลิกตรวจ RT-PCR จากที่ตรวจในวันแรกที่มาไทยให้มาตรวจ ATK แทน พร้อมทั้งเสนอยกเลิกระบบ ไทยแลนด์พาส ตั้งแต่ 1 มิ.ย. ให้นักท่องเที่ยวเดินทางเข้าไทยได้ปกติเหมือนช่วงก่อนการเกิด Covid-19 มองเป็น Sentiment เชิงบวกต่อกลุ่มท่องเที่ยวอย่าง AOT ที่รับประโยชน์เต็มที่จากประเด็นดังกล่าว Fair Value 69.60 บาท

ภาพทางเทคนิค จังหวะฟื้นตัว ทำจังหวะ Higher Low สนับสนุนด้วยเส้น EMA 10 วัน เป็นสัญญาณบวกทางเทคนิค ประเมินแนวรับไว้ที่ 66.00 บาท แนวต้านที่ 68.00 บาท

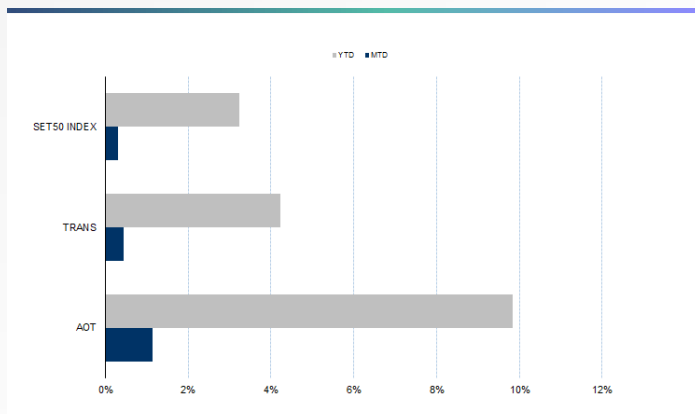
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำถือ Long AOTM22 ทุน 66 บาท กำไร 23.6% เป้าทำกำไรที่ 68 บาท Lock กำไร 10% ที่ 66.50 บาท

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
AOTM22	67.00	0.05	1778	2866	0	10.04	5.44%		8.54	-63.32%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

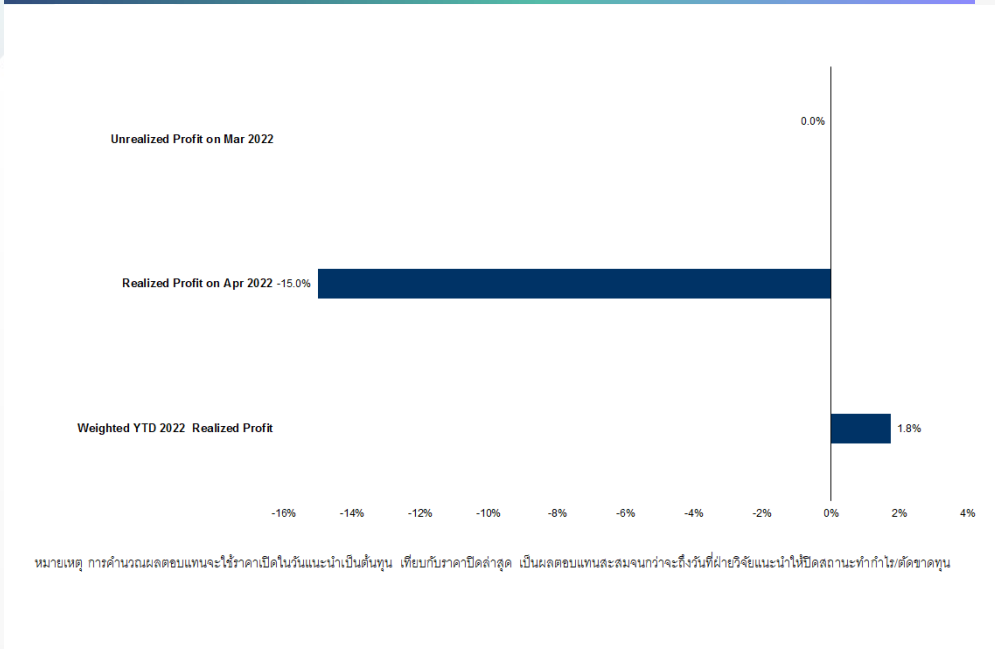
Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



Tracking Performance



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Top 20 Most Active Volume

	Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	JASM22	3.92	0.05	44123	221604	99	8.51	4.11	3.68
2	GUNKUM22	6.02	-0.05	31690	143624	-496	23.12	6.21	5.98
3	TRUEM22	5.05	-0.03	7185	130702	0	13.55	5.15	5.00
4	TUM22	19.09	0.19	6560	8203	-200	10.42	19.00	18.40
5	TTBM22	1.29	-0.01	5696	89217	1545		1.32	1.29
6	IRPCM22	3.63	0.04	4596	59183	1083	10.47	3.62	3.55
7	TTAM22	9.70	0.10	3661	12157	1	22.73	10.00	8.89
8	ICHIM22	11.40	-0.50	2664	25683	0	7.16	11.72	10.93
9	AOTM22	65.89	0.05	1778	2866	0	10.04	66.93	64.90
10	EAM22	96.99	-0.40	1614	11071	51	16.53	102.00	90.57
11	GFPTM22	12.50	0.18	1202	15111	1	7.65	12.99	12.43
12	CHGM22	3.85	-0.16	1025	10279	0	14.59	3.91	3.71
13	BEAUTYM22	1.50	0.02	1004	15786	0	4.97	1.52	1.46
14	BECM22	17.46	-0.49	1004	43174	-985	23.55	16.88	16.07
15	SPRCM22	10.07	0.05	1000	8124	0	7.85	10.40	9.40
16	WHAM22	3.32	-0.02	925	41333	6503	8.09	3.43	3.33
17	WHAM22	3.32	-0.02	925	41333	6503	8.09	3.43	3.33
18	CRCM22	38.73	0.24	923	831	0		40.24	38.44
19	PTTM22	39.10	0.25	914	10840	-200	11.33	39.15	38.65
20	KBANKM22	156.50	-1.50	839	7273	43	12.46	161.48	157.50

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



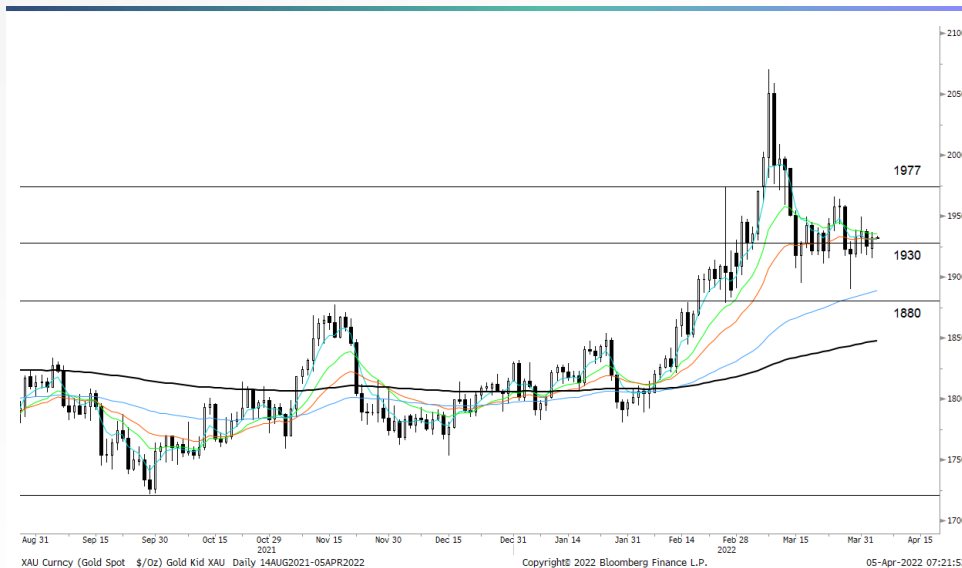
Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ดิดตัวขึ้น 8.4 เหรียญฯ ปิดที่ 1,933 เหรียญฯ ท่ามกลางความกังวลเกี่ยวกับสงครามรัสเซีย-ยูเครน ภายหลังมีสัญญาณบ่งชี้ว่าสงครามมีแนวโน้มบานปลาย โดยรายงานล่าสุดทางการยูเครนพบว่าผู้เสียชีวิตจำนวนมาก ในทางตะวันตกเฉียงเหนือของกรุงเคียฟ ประเด็นดังกล่าวหนุนให้เกิดแรงเข้าซื้อทองคำในฐานะสินทรัพย์ปลอดภัย และสวนทางกับการเคลื่อนไหวของค่าเงินดอลลาร์สหรัฐที่แข็งค่า ทำให้ Dollar Index วานนี้ขยับขึ้น 0.43% ปิดบริเวณ 98.99 จุด สำหรับสัปดาห์นี้ คงต้องติดตามสถานการณ์ระหว่างรัสเซียและยูเครน รวมถึงการเปิดเผยข้อมูลเศรษฐกิจสหรัฐ เช่น รายงานผลประชุมเฟดเดือน มี.ค, ดุลการค้า และจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ เป็นต้น

กลยุทธ์การลงทุน

ราคา GFJ22 เมื่อคืน เพิ่มขึ้น 220 บาท ปิดที่ 30,770 บาท (1,936 เหรียญฯ) สูงกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,932 เหรียญฯ คาดราคา GFF22 วันนี้น่าจะอยู่ในกรอบ 30,550-30,900 บาท ทิศทางราคาทองคำยังแกว่งตัวในกรอบที่ประเมินไว้ 1,910-1,940 เหรียญฯ จึงคงแนะนำ Trading บริเวณ 30,360-30,830 บาท และรอเปิดสถานะ Short GFJ22 หากราคาขยับขึ้นไปแตะกรอบบน พร้อมกำหนดจุด 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	30,770	40	0.13	136	250	2
GFM22	30,750	-40	-0.13	38	223	5
GFQ22	30,770	40	0.13	17	7	0

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10J22	30,700	20	0.07	5,206	7,426	970
GF10M22	30,730	30	0.10	2,110	6,410	407
GF10Q22	30,750	30	0.10	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 แรกซื้อกลับขึ้นเหนือแนวรับที่ \$1930 จากแท่งเทียน Hammer คาด

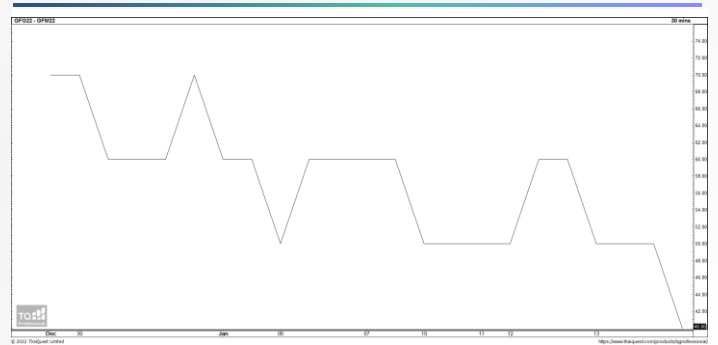
แกว่งเข้าสู่กรอบการเคลื่อนไหวที่ \$1930-\$1977

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
31,020.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
30,970.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
30,920.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
30,870.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
30,820.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
30,770.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
30,720.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
30,670.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
30,620.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
30,570.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
30,520.00	-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
30,950.00	250.0	2,500	(210)	2,290
30,900.00	200.0	2,000	(210)	1,790
30,850.00	150.0	1,500	(210)	1,290
30,800.00	100.0	1,000	(210)	790
30,750.00	50.0	500	(210)	290
30,700.00	0.0	-	(210)	(210)
30,650.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
30,600.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
30,550.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
30,500.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
30,450.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส