

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

28 ตุลาคม 2564



SET50 Futures:

สถานะ Long S50Z21 ทุน 978 จุด ปิดรับผลกำไร 4 จุด คาดว่า SET50 น่าจะอยู่ในภาวะผันผวน แต่มี Downside จำกัด แนะนำให้ Trading S50Z21 ในกรอบ 970-980 จุด

SET50 Option:

สถานะ Long S50Z21C975 ทุนเฉลี่ย 23 จุด ปัจจุบันขาดทุน 2.4 จุด แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 34 จุด (SET50=992) และ Cut Loss 3 จุดจากทุน ประเมินว่า SET50 น่าจะผันผวนต่อไปอีกระยะรอดูผลการเปิดเมือง

Single Stock Futures:

แนะนำถือสถานะ Long HMPROZ21 ทุน 14.20 บาท ปัจจุบันมีกำไร 24.48% เป้าทำกำไรที่ 14.80 บาท Stop Profit ที่ 14.20 บาท Lock กำไร 10% SSSG พื้นตัวชัดเจน และมีแนวโน้มดีขึ้นต่อเนื่องช่วงที่เหลือของปี

เปิดสถานะ Long SCCZ21 ที่ 398 บาท ปัจจุบันมีกำไร 5.83% แนะนำถือ เป้าทำกำไร 406 บาท Cut Loss 4 บาทจากทุน ประเมินว่า SCC กำลังเคลื่อนออกจากจุดต่ำสุดทั้งด้าน ราคาและ การทำกำไร

Gold Futures:

ราคาทองคำเคลื่อนไหวในกรอบแคบ รอดูผลการประชุมธนาคารกลางต่างๆ ช่วงปลายสัปดาห์นี้ต่อเนื่องสัปดาห์หน้า แนะนำ Trading GFZ21 ในกรอบ 28050 – 28530 บาท (1780-1810\$) และให้ Short กรอบบน

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  [▶ ติดตามข่าวสารการลงทุน](#)

FOLLOW NOW




 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

ธนัฐธ เกิดเนตร
ผู้ช่วยนักวิเคราะห์



สถานะของนักลงทุน

	All Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	137,670	125,573	12,097	3,518	-17,897	-747,814
Foreign	93,160	104,263	-11,103	-450	12,679	-49,410
Retail	219,890	220,884	-994	-3,068	5,218	797,224

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	24,522	27,089	-2,567	-4,985	-6,702	-6,565
Foreign	44,054	60,456	-16,402	156	-4,295	11,826
Retail	78,408	59,439	18,969	4,829	10,997	-5,261

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	100,070	88,328	11,742	7,758	-2,526	-725,144
Foreign	23,885	12,603	11,282	3,072	13,020	-81,982
Retail	93,304	116,328	-23,024	-10,830	-10,494	807,126

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	5,906	7,491	-1,585	-987	3,046	2,010
Foreign	23,979	30,565	-6,586	2,384	15,181	8,056
Retail	26,003	17,832	8,171	-1,397	-18,227	-10,066

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	42	206	-164	-167	32	-519
Foreign	468	453	15	244	431	6,051
Retail	2,555	2,406	149	-77	-463	-5,532

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	274	36	238	345	347	3,139
Foreign	690	85	605	1,158	2,277	8,021
Retail	3,483	4,326	-843	-1,503	-2,624	-11,160

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



SET50 Overview

ดัชนี Dow Jones วานนี้ปรับลง 0.74% จากแรงขายทำกำไรหลังจากเริ่มขาดปัจจัยใหม่สนับสนุนโดยแรงกดดันจากหุ้นในกลุ่ม ธ.พ. ที่ปรับลงตามทิศทาง Bond Yield 10 ปี สหรัฐฯ ที่ปรับลง 7 bps มาที่ 1.56% และหุ้นในกลุ่มพลังงานที่ปรับลงตามทิศทางราคาน้ำมันดิบลดลง 2.11% จากการรายงานสต็อกน้ำมันดิบโดย EIA ที่ออกมาเพิ่มขึ้นมากกว่าตลาดคาดว่าสร้างแรงกดดันต่อ SET50 Index ในวันนี้ ส่วนปัจจัยในประเทศให้ความสนใจไปที่ความคืบหน้าการลงนามเอกอัครราชทูตหลังวานนี้รองนายกฯ สุปัตินพงษ์เผยว่าปี 2565 จะมีความชัดเจนต่อแผนการเข้าร่วมข้อตกลงการค้า CPTPP และ FTA-EU มองเป็น Sentiment บวกเล็กน้อยต่อหุ้นในกลุ่มนิคมฯ แต่ไม่น่าจะสร้างแรงขับเคลื่อนต่อ SET50 Index อย่างมีนัยยะ ส่วนประเด็นอื่นๆ อยู่ในช่วงติดตามพัฒนาการ โดยวันนี้การประชุม BOJ และ ECB ต่อการส่งสัญญาณการดำเนินนโยบายการเงินในระยะถัดไป และวันที่ 29 ต.ค. การประชุม ศบค. ชุดใหญ่ที่จะเป็นการเตรียมความพร้อมของก่อนการเปิดประเทศตั้งแต่วันที่ 1 พ.ย.64 เป็นต้นไป ภายใต้อัตราดอกเบี้ยที่ต่ำได้มีประเด็นบวกหนุนทำให้ SET50 Index วันนี้แกว่งพักฐานตามกรอบ 970-980 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: สถานะ Long S50Z21 ทุน 978 จุด ปิดรับผลกำไร 4 จุด คาดว่า SET50 น่าจะอยู่ในภาวะผันผวน แต่มี Downside จำกัด แนะนำให้ 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 -4.60 จุด ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: สถานะ Long S50Z21C975 ทุนเฉลี่ย 23 จุด ปัจจุบันขาดทุน 2.4 จุด แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 34 จุด (SET50=992) และ Cut Loss 3 จุดจากทุน ประเมินว่า SET50 น่าจะผันผวนต่อไปอีกระยะรอดูผลการเปิดเมือง

	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	970	980
S50U21	970	980

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยฯ จึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 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	977.32	18.42925	7.974519

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	4.40	-1.60	> 1029.4	0.00	4.40	5.33%	3.97	390	4448	12.35	0.17	38.05	0.1
S50Z21C1000	10.00	-2.90	> 1010	0.00	10.00	3.34%	9.46	779	4387	12.17	0.32	30.99	0.0
S50Z21C975	20.60	-5.00	> 995.6	2.32	18.28	1.87%	19.35	229	6510	12.79	0.51	24.39	0.0
S50Z21C950	36.60	-6.40	> 986.6	27.32	9.28	0.95%	34.38	26	1213	12.85	0.71	18.83	0.0
S50Z21C925	52.20	-10.50	> 977.2	52.32	#N/A	-0.01%	54.01	0	308	15.27	0.83	15.52	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	53.50	4.90	< 971.5	47.68	5.82	-0.60%	53.05	10	157	11.49	-0.84	-16.17	0.0
S50Z21P1000	34.10	4.80	< 965.9	22.68	11.42	-1.17%	33.56	57	735	12.17	-0.67	-19.57	0.0
S50Z21P975	20.00	3.10	< 955	0.00	20.00	-2.28%	18.47	424	3799	12.57	-0.48	-23.56	0.0
S50Z21P950	10.80	1.80	< 939.2	0.00	10.80	-3.90%	8.51	844	4462	13.29	-0.30	-26.74	0.0
S50Z21P925	5.80	1.20	< 919.2	0.00	5.80	-5.95%	3.16	674	5263	14.22	-0.18	-28.32	-0.1

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สปรการซื้อขาย
SET50	977.32	-6.72	-0.69%	27/10/21

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50V21	976.80	-8.1	-0.8%	352	80	0
S50X21	976.90	-7.5	-0.8%	87	181	0
S50Z21	975.90	-8.1	-0.8%	132,727	360,399	0
S50H22	971.40	-7.8	-0.8%	10,108	41,841	0
S50M22	970.20	-7.6	-0.8%	2,178	14,898	0
S50U22	967.20	-7.3	-0.8%	1,532	4,711	0

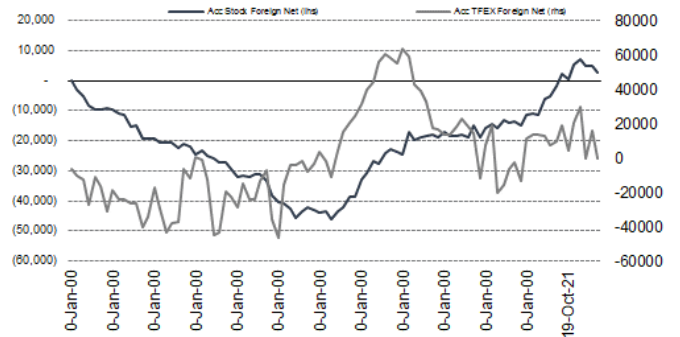
SET50 Futures Long(Short) : สัญญา	ส.ส. Long(Short)		
	Long	Short	Net
สถาบัน	137,354	125,331	12,023
ต่างชาติ	92,002	103,725	-11,723
รายย่อย	213,852	214,152	-300

	2 วัน		2 สัปดาห์		QTD
	Long	Short	Long	Short	
สถาบัน	4,985	-7,614	0	0	0
ต่างชาติ	156	-13,476	0	0	0
รายย่อย	4,829	21,090	0	0	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	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 HMPROZ21

คาดการณ์ 3Q64 อยู่ที่ 880 ล้านบาท ลดลง 38%yoy จากผลกระทบการ Lockdown สาขาในพื้นที่ระบาดสูง กระทบทั้งยอดขาย, มาร์จิ้น และรายได้พื้นที่เช่าอย่างมีนัยยะ แต่จะเป็นจุดต่ำสุด การฟื้นตัวกลับมาค่อนข้างเร็วสะท้อนจากยอดขายสาขาเดิม (SSSG) ที่เริ่มกลับมาบวก 4%-5% ตั้งแต่กลับมาเปิดสาขา ขณะที่กลับมาเติบโตระดับ 10%yoy ตั้งแต่เข้างวด 4Q64

ภาพทางเทคนิค จังหวะพักตัว หลังจาก Breakout เส้นกต Downtrend โดยมีแนวรับที่นำเข้าสู่สม อยู่บริเวณ 14.20 บาท ขณะที่ MACD เคลื่อนที่เหนือแกนศูนย์ สะท้อนโมเมนตัมเชิงบวก ประเมินแนวต้านถัดไปไว้ที่ 14.80 บาท

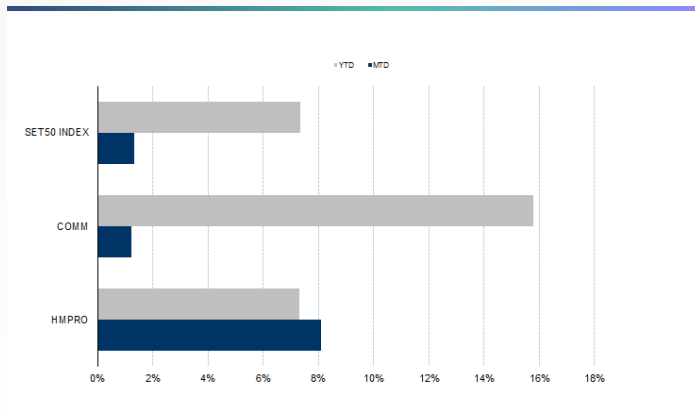
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำถือ Long HMPROZ21 ทุน 14.20 บาท ปัจจุบันกำไร 24.48% เป้าทำกำไร 14.80 บาท และ Lock กำไร 10% ที่ 14.20 บาท

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
HMPROZ21	14.50	-0.20	904	5788	300	9.21	8.84%	37.46	8.77	0.13%

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 SCCZ21

คาดการณ์กำไร 3Q64 ลดลง 55%QoQ จากแรงกดดันจากทุกธุรกิจ แต่เชื่อว่าราคาหุ้นตอบรับประเด็นดังกล่าวไปมากแล้วสะท้อนจากการปรับลงจากช่วง มิ.ย. ราวๆ 9% หากมองแนวโน้มกำไรในระยะถัดไปที่เชื่อว่า 4Q64 จะกลับมาเติบโต QoQ ตามการฟื้นตัวของเศรษฐกิจโลกและในประเทศ ขณะที่ภาพ Outlook ธุรกิจในระยะยาวที่ยังเห็นโอกาสการเติบโตอีกมาก จึงเชื่อว่า Downside ในการปรับลงของราคาหุ้นจะจำกัด

ภาพทางเทคนิค แรงขายเริ่มชะลอ จากการฟอร์มฐานบริเวณ 396 บาท โดยจะมีสัญญาณเปิด Upside ขึ้น เมื่อกลับมาขึ้นเหนือเส้น EMA 10 วัน ที่ 400 บาท ประเมินเป้าหมายทำกำไรไว้ที่ EMA 200 วันที่ 405-406 บาท

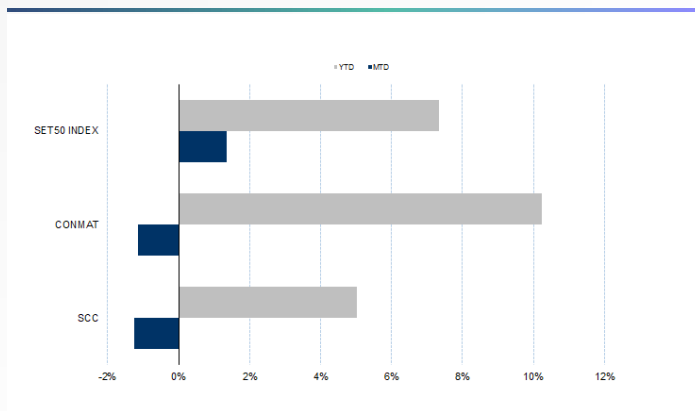
กลยุทธ์การลงทุน

เปิดสถานะ Long SCCZ21 ได้ที่หุ้น 398 บาท ปัจจุบันกำไร 5.83% เป้าทำกำไร 406 บาท และ Cut loss 4 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
SCCZ21	399.45	2.45	48	2754	4	14.31	25.94%	10.16	1.37	37.38%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

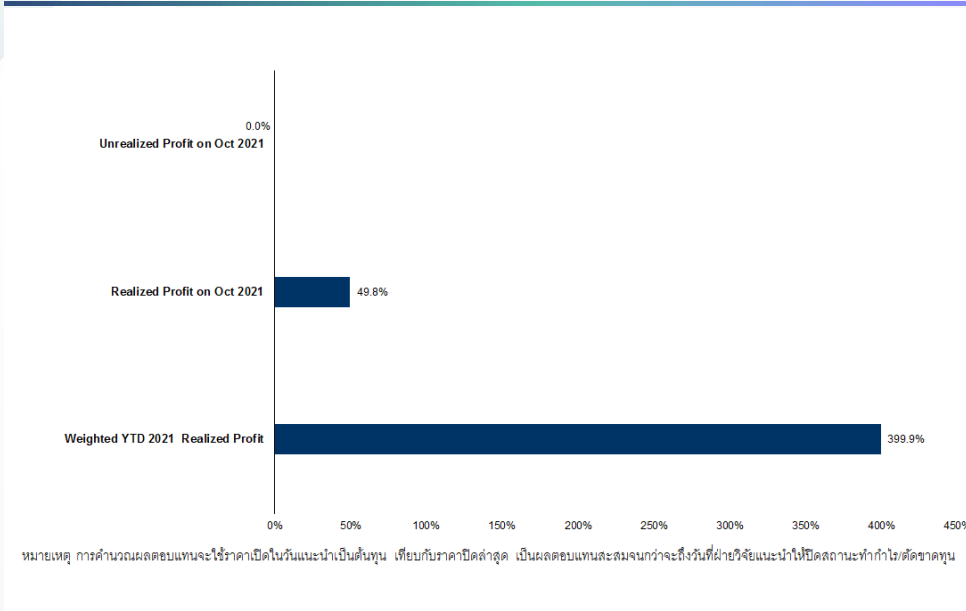
Technical Chart



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	4.11	0.03	12652	129762	7512	10.74	4.37	4.09
2	LHZ21	8.45	0.00	9007	21188	-5007	11.70	8.54	8.15
3	JASZ21	2.91	0.05	8584	70896	-4524	6.27	2.98	2.78
4	WHAZ21	3.36	0.00	6218	51917	-33	8.04	3.49	3.33
5	SIRIZ21	1.29	0.02	6048	121925	-3067	11.14	1.31	1.26
6	IRPCZ21	4.42	0.02	4963	30157	-3976	12.87	4.43	4.09
7	KTBZ21	11.68	0.08	3525	15179	66	12.72	12.13	11.59
8	GUNKULZ21	5.55	0.05	3336	222293	2842	20.68	5.99	5.39
9	BAMZ21	18.75	-0.05	2732	17811	-795		19.35	18.67
10	BEAUTYZ21	1.66	-0.01	2527	24504	494	5.49	1.75	1.58
11	ITDZ21	2.40	0.02	2262	49841	-1102	15.66	2.41	2.21
12	BLANDZ21	1.13	0.01	2081	142658	-265	9.82	1.14	1.12
13	TPIPLZ21	1.72	-0.01	2000	37126	-2000	11.38	1.78	1.72
14	SPALIZ21	22.83	-0.17	1879	865	891	10.81	23.20	20.52
15	BCHZ21	20.43	0.13	1778	11222	564	16.19	20.85	20.12
16	TTAZ21	11.49	0.09	1762	7660	1197	27.27	12.71	11.13
17	TUZ21	20.80	0.10	1312	8294	-291	11.35	21.18	20.31
18	KCEZ21	86.60	-0.65	1163	1637	-270	16.40	87.00	80.35
19	SUPERZ21	0.97	0.02	1043	180800	-986	6.25	0.99	0.97
20	HMPROZ21	14.50	-0.20	904	5788	300	9.21	14.82	14.07

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

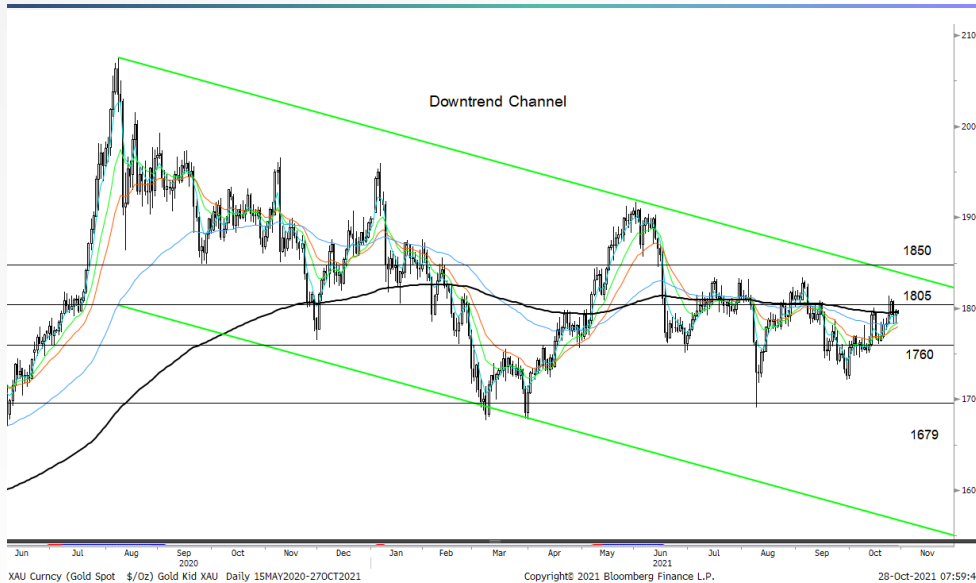
Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน เพิ่มขึ้น 3.14 เหรียญฯ ปิดที่ 1,796 เหรียญฯ แรงหนุนจากการปรับลดลงของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐ และการอ่อนค่าของค่าเงินดอลลาร์สหรัฐ หลังเปิดเผยข้อมูลเศรษฐกิจอ่อนแอ โดยยอดสั่งซื้อสินค้าคงทนลดลงในเดือน ก.ย. กดดันให้ Dollar Index ชัยบลง 0.11% ปิดที่ 93.86 จุด สำหรับวันนี้ ต้องติดตามการประชุมของธนาคารกลางญี่ปุ่น (ปีโอเจ) และธนาคารกลางยุโรป (อีซีบี) ส่วนฝั่งสหรัฐวันนี้และพรุ่งนี้ จะรายงานตัวเลขจีดีพี 3Q64, จำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ และ ดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภค เป็นต้น

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFZ21 เมื่อคืน เพิ่มขึ้น 90 บาท ปิดที่ 28,440 บาท (1,805 เหรียญฯ) ต่ำกว่าราคาตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,796 เหรียญฯ คาดราคา GFZ21 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 28,200-28,500 บาท ทิศทางราคายังแกว่งตัวในกรอบที่ประเมินไว้ จึงคงแนะนำ Trading GFZ21 บริเวณ 1,780-1,810 เหรียญฯ หรือ 28,110-28,580 บาท แต่หากราคาขึ้นไปแตะกรอบบน แนะนำรอเปิด Short GFZ21 และกำหนดจุด Cut loss ไว้ 100 จากทุน ป้องกันความเสี่ยง หากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดคาด

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GFV21	28,360	160	0.57	45	172	-1
GFZ21	28,440	90	0.32	55	220	-4
GF22	28,480	120	0.42	33	94	-4

Mini Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10V21	28,380	60	0.21	1,270	1,689	-240
GF10Z21	28,410	60	0.21	4,074	9,241	-448
GF10G22	28,430	30	0.11	2,029	4,049	-137

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

ASPS Gold Valuation Matrix (เหรียญ / ทรอยออนซ์)

	Dollar Index										
	← 93	94	95	96	97	98	99	100	101	102	103
40	1,617.66	1,589.21	1,560.76	1,532.31	1,503.86	1,475.41	1,446.96	1,418.52	1,390.07	1,361.62	1,333.17
43	1,616.71	1,588.26	1,559.81	1,531.36	1,502.91	1,474.47	1,446.02	1,417.57	1,389.12	1,360.67	1,332.22
46	1,615.76	1,587.31	1,558.86	1,530.42	1,501.97	1,473.52	1,445.07	1,416.62	1,388.17	1,359.72	1,331.28
49	1,614.82	1,586.37	1,557.92	1,529.47	1,501.02	1,472.57	1,444.12	1,415.67	1,387.23	1,358.78	1,330.33
52	1,613.87	1,585.42	1,556.97	1,528.52	1,500.07	1,471.62	1,443.18	1,414.73	1,386.28	1,357.83	1,329.38
55	1,612.92	1,584.47	1,556.02	1,527.57	1,499.13	1,470.68	1,442.23	1,413.78	1,385.33	1,356.88	1,328.43
58	1,611.97	1,583.53	1,555.08	1,526.63	1,498.18	1,469.73	1,441.28	1,412.83	1,384.38	1,355.94	1,327.49
61	1,611.03	1,582.58	1,554.13	1,525.68	1,497.23	1,468.78	1,440.33	1,411.89	1,383.44	1,354.99	1,326.54
64	1,610.08	1,581.63	1,553.18	1,524.73	1,496.28	1,467.84	1,439.39	1,410.94	1,382.49	1,354.04	1,325.59
67	1,609.13	1,580.68	1,552.24	1,523.79	1,495.34	1,466.89	1,438.44	1,409.99	1,381.54	1,353.09	1,324.65
70	1,608.19	1,579.74	1,551.29	1,522.84	1,494.39	1,465.94	1,437.49	1,409.04	1,380.60	1,352.15	1,323.70
73	1,607.24	1,578.79	1,550.34	1,521.89	1,493.44	1,464.99	1,436.55	1,408.10	1,379.65	1,351.20	1,322.75

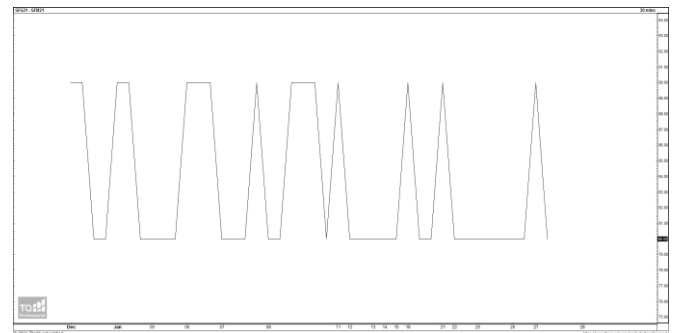
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD Londin 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

มิถุนายนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
28,610.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
28,560.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
28,510.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
28,460.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
28,410.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
28,360.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
28,310.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
28,260.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
28,210.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
28,160.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
28,110.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

มิถุนายนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
28,630.00	250.0	2,500	(210)	2,290
28,580.00	200.0	2,000	(210)	1,790
28,530.00	150.0	1,500	(210)	1,290
28,480.00	100.0	1,000	(210)	790
28,430.00	50.0	500	(210)	290
28,380.00	0.0	-	(210)	(210)
28,330.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
28,280.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
28,230.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
28,180.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
28,130.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส