

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

8 พฤศจิกายน 2564



SET50 Futures:

สถานะ Long S50Z21 ทุน 975 จุด ปัจจุบันมีกำไร 3.60 จุด แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 985 จุด Cut Loss 4 จุดจากทุน ปัจจัยแวดล้อมทางพื้นฐานเริ่มมีน้ำหนักค่อนข้างไปทางบวกมากขึ้น ทำให้ SET50 น่าจะแกว่งตัวในทิศทางขึ้น

SET50 Option:

แนะนำให้เปิด Long S50Z21C975 ที่ 20 จุด (SET50=978) เป้าทำกำไรที่ 30 จุด (SET50=988) และ Cut Loss 3 จุดจากทุน คาด SET50 เคลื่อนไหว Sideway Up สัปดาห์นี้รอดูประชุม กนง. และมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจเพิ่ม

Single Stock Futures:

แนะนำเปิด Long CRCZ21 ที่บริเวณ 34.50 บาท เป้าทำกำไรที่ 36 บาท Cut Loss 0.50 บาทจากทุน มีความเป็นไปได้ที่จะเห็นการกลับมาของมาตรการ ช้อปดีมีคืน ซึ่งจะเป็นแรงหนุนผลประกอบการของ CRC

สถานะ Long AOTZ21 ทุน 64.75 บาท ปัจจุบันมีกำไร 17.73% แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 66.25 บาท Stop Profit ที่ 65.25 บาท Lock กำไร 10% การเปิดประเทศเป็นสัญญาณการกลับมาของการทำกำไรของธุรกิจการบิน

Gold Futures:

ราคาทองคำปรับตัวขึ้นแรง โดยที่ไม่มีปัจจัยบวกหนุนทำให้มีโอกาสเห็นการปรับฐานตามมา แนะนำรอ Short GFZ21 ที่ 28650 บาท (1820\$) เป้าทำกำไร ที่ 28180 บาท (1790\$) Cut Loss 100 บาทจากทุน

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




 Asia Plus Group

RESEARCH DIVISION
บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส

เกิดศักดิ์ ทวีธีระธรรม
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจภมร, CISA, CFA
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นवलพรรณ น้อยรัชชกุล
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันพานอกิจ
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	75,315	88,763	-13,448	-28,157	20,735	-770,464
Foreign	101,428	102,496	-1,068	-6,005	-3,257	-26,228
Retail	153,418	138,902	14,516	34,162	-17,478	796,692

SET50 Futures Long(Short) Position : Contract	Accumulated Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	20,215	18,167	2,048	-721	1,558	-22,862
Foreign	47,918	62,702	-14,784	-7,301	-19,097	-14,120
Retail	52,292	39,556	12,736	8,022	17,539	36,982

Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract	Accumulated Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	42,057	61,694	-19,637	-34,230	10,867	-724,563
Foreign	10,887	14,708	-3,821	-10,340	8,120	-36,813
Retail	68,836	45,378	23,458	44,570	-18,987	761,376

Metal Futures Long(Short) Position : Contract	Accumulated Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	10,456	7,387	3,069	3,145	3,044	5,500
Foreign	42,506	24,673	17,833	12,308	7,198	9,700
Retail	13,074	33,976	-20,902	-15,453	-10,242	-15,200

Call Option Long(Short) Position : Contract	Accumulated Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	82	5	77	365	-36	81
Foreign	88	272	-184	-649	-671	2,264
Retail	1,388	1,281	107	284	707	-2,345

Put Option Long(Short) Position : Contract	Accumulated Long(Short)					
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	563	1	562	2,239	2,506	5,021
Foreign	15	125	-110	41	1,339	8,781
Retail	1,850	2,302	-452	-2,280	-3,845	-13,802

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

SET50 Overview

ตลาดหุ้นสหรัฐฯ วันศุกร์ที่ผ่านมาปรับขึ้น All Time High ต่อเนื่องจาก 3 ประเด็นบวก 1) การรายงานตัวเลขการจ้างงานนอกภาคการเกษตรสหรัฐฯเดือน ต.ค. เพิ่มขึ้น 5.3 แสน ตำแหน่งมากกว่าตลาดคาด 4.5 แสนตำแหน่ง 2) สภาคองเกรสผ่านร่างงบประมาณลงทุนโครงสร้างพื้นฐาน 1.2 ล้านล้านเหรียญฯ และ 3) ความคืบหน้าผลการทดลองยารักษา COVID-19 ของ Pfizer ที่ช่วยในการเข้ารักษาตัวในโรงพยาบาลหรือเสียชีวิตได้สูงถึง 89% ซึ่งปัจจุบันส่งผลการทดลองให้ FDA พิจารณาเพื่อขออนุมัติการใช้ในกรณีฉุกเฉิน ส่วนปัจจัยในประเทศให้ความสนใจกับมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจ ซึ่งคาดว่าจะเตรียมปิดฝุ่นมาตรการซื้อปดมีคืบในช่วงปลายปีซึ่งมองเป็นบวกต่อหุ้นกลุ่มค่าปลีกและห้างสรรพสินค้า ด้านทิศทาง Fund Flow สัปดาห์ที่ผ่านมาเห็นสัญญาณบวกจากนักลงทุนสถาบันที่กลับมาซื้อสุทธิเป็นครั้งแรกในรอบ 4 สัปดาห์ 2.33 พันล้านบาท ส่วนนักลงทุนต่างชาติแม้ขายสุทธิ 1.9 พันล้านบาทแต่หากประเมินจากทิศทางค่าเงินบาทที่ยังแข็งค่าจึงสะท้อนเม็ดเงินยังไม่ไหลออก ภายใต้อปัจจัยแวดล้อมที่มีน้ำหนักในทางบวกข้างต้นคาด SET50 Index แกว่งขึ้นตามกรอบ 978-988 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: เปิดสถานะ Long S50Z21 ได้ที่ 975 จุด ปัจจุบันกำไรอยู่ 3.6 จุด แนะนำถือต่อเข้าทำกำไรที่ 985 จุดและตั้ง Cut Loss 4 จุด คาด SET50 Index อยู่ในแนวโน้มปรับขึ้น

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50H22 ลบด้วย S50Z21 (S50Z21H22) ณ วันที่ 29 ธ.ค. 2564 จะเท่ากับ -5.72 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -4.00 จุด ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: แนะนำให้รอเปิด Long S50Z21C975 ที่ 20 จุด (SET50=978) เข้าทำกำไรที่ 30 จุด (SET50=988) และ Cut Loss 3 จุดจากทุน คาด SET50 เคลื่อนไหว Sideway Up สัปดาห์นี้รอดูประชุม กนง. และมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจเพิ่ม



	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	978	988
S50Z21	975	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	980.03	18.19891	7.208653

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	4.30	-0.20	> 1029.3	0.00	4.30	5.03%	2.64	380	4857	12.63	0.17	39.25	0.1
S50Z21C1000	9.80	-0.50	> 1009.8	0.00	9.80	3.04%	7.65	431	5534	12.40	0.33	32.76	0.0
S50Z21C975	21.10	-0.70	> 996.1	5.03	16.07	1.64%	17.78	308	6898	12.72	0.53	24.64	0.0
S50Z21C950	37.50	-1.50	> 987.5	30.03	7.47	0.76%	33.93	17	1292	12.91	0.72	18.91	0.0
S50Z21C925	58.00	-1.00	> 983	55.03	2.97	0.30%	54.98	4	331	15.51	0.83	14.00	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	50.90	1.60	< 974.1	44.97	5.93	-0.61%	49.13	8	183	13.44	-0.81	-16.21	0.0
S50Z21P1000	31.40	0.40	< 968.6	19.97	11.43	-1.17%	29.15	20	900	11.99	-0.68	-21.55	0.0
S50Z21P975	17.50	0.00	< 957.5	0.00	17.50	-2.30%	14.29	401	4689	12.84	-0.46	-25.90	0.0
S50Z21P950	9.10	0.00	< 940.9	0.00	9.10	-3.99%	5.46	411	5224	13.47	-0.28	-29.08	0.0
S50Z21P925	4.40	-0.10	< 920.6	0.00	4.40	-6.06%	1.53	457	6481	14.21	-0.15	-32.30	-0.1

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

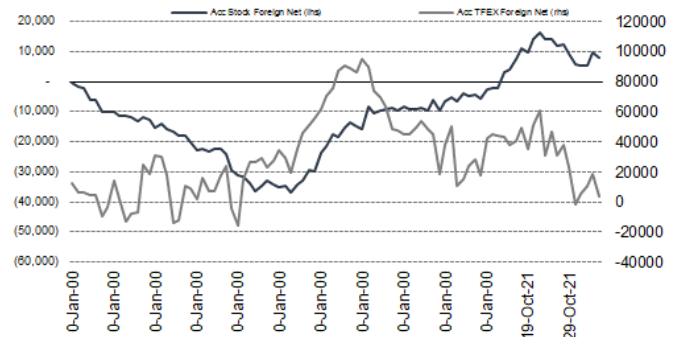
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สเปกการซื้อขาย
SET50	980.03	-0.08	-0.01%	5/11/21

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50V21	977.54	0.0	0.0%	26	77	0
S50X21	979.50	-1.0	-0.1%	34	158	0
S50Z21	978.60	-0.3	0.0%	109,538	361,673	0
S50H22	974.60	-0.2	0.0%	8,353	41,829	0
S50M22	973.20	-0.2	0.0%	1,690	16,101	0
S50U22	970.20	-0.1	0.0%	771	5,205	0

SET50 Futures Long(Short) : สัญญา	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	QTD
สกลมัน	74,670	88,757	-14,087	-721	3	0
ถ่านชาติ	101,325	102,099	-774	-7,301	-56,873	0
รายย่อย	150,180	135,319	14,861	8,022	56,870	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 - ชีรีไคส์

	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 ค.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 CRCZ21

แนวโน้มราคาหุ้นระยะสั้นเชื่อว่ายังคงได้รับ Sentiment เชิงบวก หลังจากการเปิดเมือง ตามแผนการของภาครัฐบวกกับแผนกระตุ้นเศรษฐกิจเพิ่มเติมที่จะออกมา โดยมาตรการที่คาดหวังถัดไปคือ ข้อปดิมิคืน ขณะที่ราคาหุ้นปัจจุบันยัง Laggard กลุ่มค่าปลึกที่ยืนเหนือระดับก่อน Covid-19 สายพันธุ์ DELTA ระบาดไปแล้ว

ภาพทางเทคนิค ทำจังหวะ Higher Low กลับมายืนเหนือเส้น EMA 10 วัน บ่งชี้ทิศทาง การปรับตัวขึ้น มีโอกาสทดสอบบริเวณ High เดิมที่ 36.00 บาท

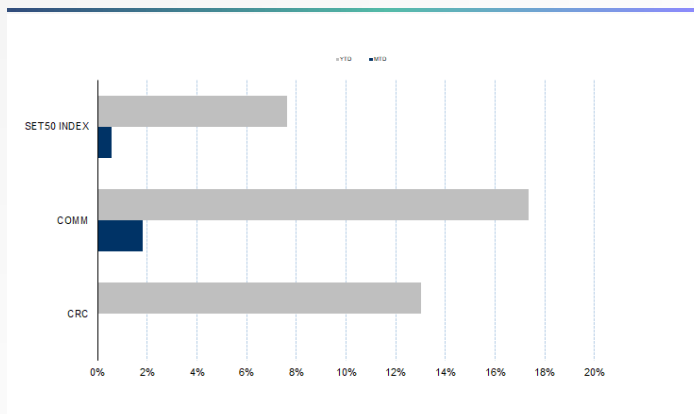
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long CRCZ21 ที่ 34.50 บาท เป้าทำกำไร 36.00 บาท Cut Loss 0.50 บาท

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
CRCZ21	34.72	-0.03	100	2353	-100		1.29%		4.04	-3292.71%

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 AOTZ21

คาด AOT จะกลับมาเป็นหุ้นที่ตลาดสนใจอีกครั้งในระยะถัดไป จากแผนการเปิดประเทศให้นักเดินทาง 63 ประเทศเดินทางเข้ามาภายใต้เงื่อนไขโดยไม่ต้องกักตัว เสริมด้วยจุดเด่นที่มีฐานะการเงินแข็งแกร่ง มีศักยภาพอยู่รอดผ่านช่วงวิกฤต COVID ได้แน่นอน บวกกับจุดเด่นผูกขาดบริการสนามบินหลัก จึงสามารถคาดหวังการฟื้นตัวได้แน่นอนและเร็วสุดในกลุ่ม ราคาหุ้นปัจจุบัน Laggard SET Index มาก ถือเป็นโอกาสสะสม

ภาพทางเทคนิค ปรับฐานลงมาทดสอบแนวรับบริเวณ 63.25 บาท พร้อมแท่งเทียนกลับตัว Dragonfly Doji ระยะถัดไป มีโอกาสปรับขึ้นได้ต่อ โดยมีเป้าหมายการทำการไว้บริเวณ 66.25 บาท

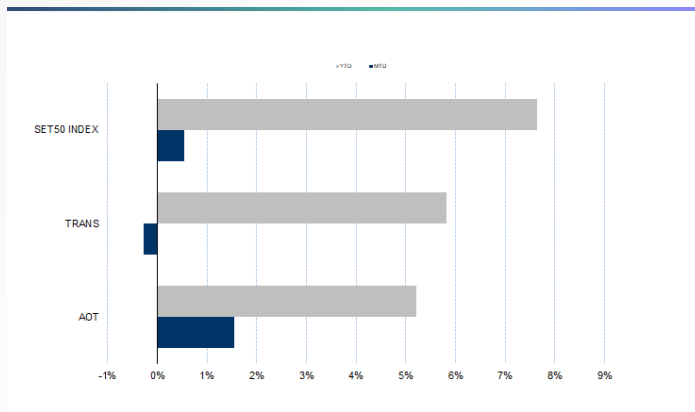
กลยุทธ์การลงทุน

สถานะ Long AOTZ21 ทุน 64.75 บาท ปัจจุบันมีกำไร 17.73% เป้าทำกำไร 66.25 บาท และ Lock กำไร 10% ที่ 65.25 บาท

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
AOTZ21	65.65	0.15	716	3529	273	9.96	6.86%		8.28	-424.87%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

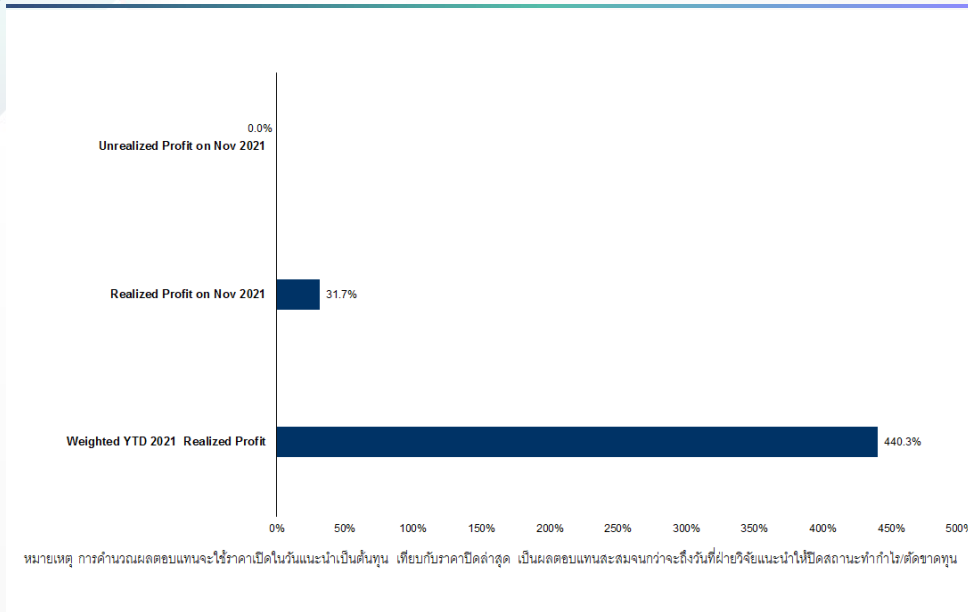
Technical Chart



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	3.77	0.03	7956	100009	-2391	9.84	4.09	3.72
2	GUNKULZ21	5.41	0.01	7320	232913	7001	20.30	5.56	5.40
3	BAMZ21	18.90	0.00	4206	17336	-2201		19.44	18.21
4	AMATAZ21	20.46	0.06	3805	4927	-200	11.93	21.26	19.59
5	BGRMZ21	43.92	0.17	3607	9915	1147	7.06	43.40	41.03
6	SIRIZ21	1.31	0.01	3511	140507	3450	11.40	1.33	1.24
7	HMPROZ21	15.24	0.04	3294	12127	-1811	9.52	154.00	13.85
8	SPALIZ21	22.90	0.10	3107	1429	-500	10.71	24.36	18.87
9	IRPCZ21	4.15	0.03	2291	27757	1948	12.05	4.44	4.10
10	GPSCZ21	78.71	0.21	2206	8917	-424	8.94	78.80	75.86
11	WHAZ21	3.40	0.02	1569	40168	1537	8.09	3.46	3.32
12	SPRCZ21	10.03	0.13	1535	2876	-1	7.89	10.63	10.00
13	THANIZ21	4.20	-0.02	1520	14549	-480	4.36	4.20	4.14
14	BEMZ21	8.98	0.03	1502	33425	-500	12.40	9.01	8.95
15	EAZ21	66.27	0.02	1220	3455	203	11.18	66.75	65.50
16	ITDZ21	2.30	0.02	1071	44610	996	15.00	2.40	2.28
17	CHGZ21	3.74	0.04	1001	11785	1	13.91	3.74	3.74
18	PLANBZ21	6.64	-0.01	1000	13870	-1000	6.48	6.87	6.05
19	JASZ21	2.88	0.04	949	65795	832	6.23	2.96	2.82
20	BDMZ21	24.00	0.10	801	3120	200	14.29	24.48	22.16

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

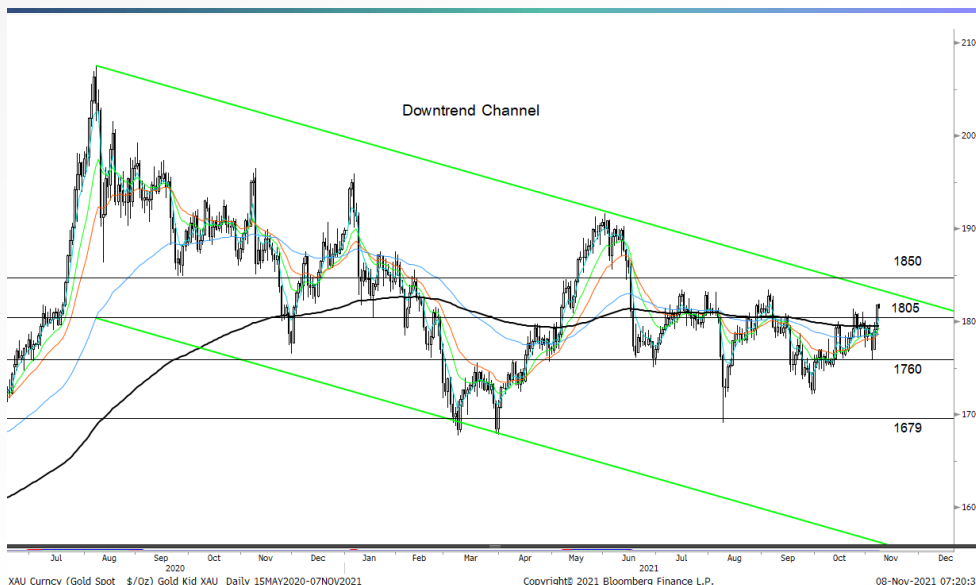
Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืนวันศุกร์ที่ผ่านมา ปรับขึ้นแรง 25.7 เหรียญฯ หรือ 1.4% ยืนเหนือ 1,800 เหรียญฯ ปิดที่ 1,817 เหรียญฯ มีแรงหนุนจากการร่วงลงของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐ และการอ่อนค่าของค่าเงินดอลลาร์สหรัฐ หลังแข็งค่าเร็วเกินไป และไม่ได้ตอบรับกับการรายงานข้อมูลเศรษฐกิจจ้างงานของสหรัฐที่ออกมาแข็งแกร่ง โดย Dollar Index เมื่อวันศุกร์อ่อนค่า 0.12% ปิดบริเวณ 94.22 จุด สำหรับสัปดาห์นี้ ต้องติดตามการรายงานตัวเลข CPI และ PPI ของทั้งจีน และสหรัฐ รวมถึงจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงาน และดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภคของสหรัฐ เป็นต้น

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFZ21 เมื่อคืนวันศุกร์ที่ผ่านมา เพิ่มขึ้น 190 บาท ปิดที่ 28,630 บาท (1,818 เหรียญฯ) สูงกว่าราคาตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,814-1,815 เหรียญฯ คาดราคา GFZ21 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 28,450-28,800 บาท การติดตัวแรงของราคาทองคำ 2 วันทำที่ผ่านมารวมกว่า 40 เหรียญฯ ขณะที่ยังไม่เห็นประเด็นใหม่ในการขับเคลื่อนราคาทองคำอย่างมีนัยฯ ในสัปดาห์นี้ หลังหมดการประชุมเฟด จึงแนะนำให้นักลงทุนรอเปิด Short GFZ21 บริเวณ 1,820 เหรียญฯ หรือ 28,650 บาท โดยมีเป้าหมายกำไรที่ 1,790 เหรียญฯ เทียบเท่า 28,180 บาท และกำหนดจุด cut loss ไว้ 100 บาทจากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยง หากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดคาด

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GFZ21	28,630	160	0.56	100	199	-13
GFG22	28,660	170	0.60	44	141	20
GFJ22	28,690	170	0.60	33	35	10

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10Z21	28,650	200	0.70	5,877	8,585	1764
GF10G22	28,670	190	0.67	3,058	4,671	558
GF10J22	28,690	180	0.63	1,044	1,500	-4

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

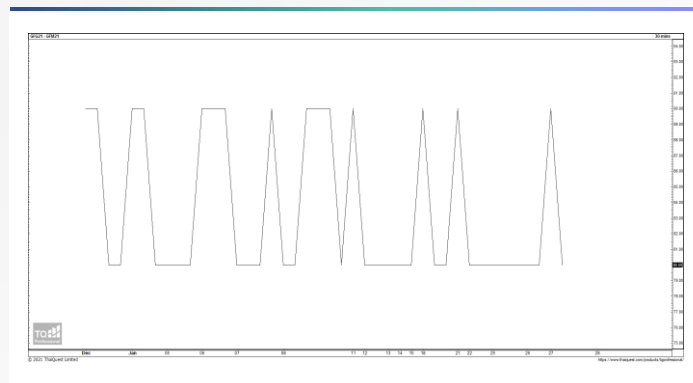
ทิศทางราคาทองคำ จังหวะ Technical Rebound กลับเข้าสู่กรอบ Trading Zone เดิม ที่ \$1805-\$1850 พร้อมจังหวะ Higher Low ยืนเหนือเส้น EMA 200 วัน บ่งชี้สัญญาณ การเปิด Upside อยู่ในแนวโน้มการปรับขึ้นต่อ

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD London 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

บิลลงทุนรายย่อย (ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
28,880.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
28,830.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
28,780.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
28,730.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
28,680.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
28,630.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
28,580.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
28,530.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
28,480.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
28,430.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
28,380.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

บิลลงทุนรายย่อย (ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
28,900.00	250.0	2,500	(210)	2,290
28,850.00	200.0	2,000	(210)	1,790
28,800.00	150.0	1,500	(210)	1,290
28,750.00	100.0	1,000	(210)	790
28,700.00	50.0	500	(210)	290
28,650.00	0.0	-	(210)	(210)
28,600.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
28,550.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
28,500.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
28,450.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
28,400.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส