

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

7 ธันวาคม 2564



SET50 Futures:

แม้จะพบผู้ติดเชื้อ Omicron รายแรกในบ้านเรา แต่เชื่อว่า SET50 น่าจะได้รับผลกระทบที่จำกัด ส่วนหนึ่งเป็นเพราะราคาหุ้นได้ดูดซับปัจจัยดังกล่าวไปมากแล้ว แนะนำ Trading S50Z21 ในกรอบ 930 - 945 จุด

SET50 Option:

แนะนำให้สลับมาเปิด Long S50Z21C925 ที่ 12 จุด (SET50=930) เป้าทำกำไร 27 จุด (SET50=945) Cut Loss 3 จุด ประเมินว่า SET50 ยังผันผวนไปตามข่าวเรื่อง Omicron แต่จะมีกรอบการเคลื่อนไหวที่แคบลง

Single Stock Futures:

สถานะ Long TUZ21 ทุน 19.70 บาท ปิดรับกำไร 36.47% แนะนำให้รอเปิด Long รอบใหม่ที่บริเวณ 20 บาท เป้าทำกำไรที่ 20.70 บาท Cut Loss 0.30 บาทจากทุนเงินบาทที่อ่อนค่า+ความต้องการสินค้าเพิ่มขึ้นดีต่อราคาหุ้น แนะนำเปิด Long ADVANCZ21 ที่บริเวณ 207 บาท เป้าทำกำไรที่ 212 บาท Cut Loss 1.25 บาทจากทุน เชื่อว่า ADVANC ยังสามารถรักษารฐานกำไรได้ หากเกิดภาวะ Covid มีการแพร่ระบาด


Gold Futures:

ราคาทองคำถูกกดดันต่อเนื่อง อาจเป็นเพราะความกังวลเรื่อง Omicron ที่เริ่มผ่อนคลายลงหลังมีข้อมูลที่มากขึ้น คาดราคาจะผันผวนในกรอบแคบลง แนะนำ Trading GFZ21 กรอบ 28320 - 28800 บาท (1760 - 1790\$)

SET50 Index Futures / Option	P. 3
Single Stock Futures	P. 5
Gold Futures	P. 8

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องสามารถดำเนินการได้อย่างรวดเร็วทัน ฝ่ายวิจักษณ์ 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

นวลพรรณ น้อยรัชชกุล
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันการนากิจ
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐ เกตุเนตร
ผู้ช่วยนักวิเคราะห์



สถานะของนักลงทุน

	All Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	75,884	66,844	9,040	17,621	307,854	816,502
Foreign	85,940	97,584	-11,644	-171	54,343	-26,451
Retail	138,420	135,816	2,604	-17,450	-362,197	-790,051

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	22,354	21,011	1,343	800	947	8,637
Foreign	47,541	59,138	-11,597	-3,157	-13,118	-46,189
Retail	58,879	48,625	10,254	2,357	12,171	37,552

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	37,767	35,780	1,987	7,811	291,611	762,500
Foreign	8,803	8,024	779	4,751	72,497	43,094
Retail	41,930	44,696	-2,766	-12,562	-364,108	-805,594

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	8,296	7,943	353	273	167	-1,397
Foreign	28,850	30,041	-1,191	-2,390	-4,964	-21,512
Retail	24,645	23,807	838	2,117	4,797	22,909

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	59	327	-268	130	1,613	947
Foreign	553	210	343	146	-244	3,219
Retail	4,800	4,875	-75	-276	-1,369	-4,166

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	309	46	263	-225	-4,309	-1,703
Foreign	171	130	41	514	253	7,126
Retail	3,233	3,537	-304	-289	4,056	-5,424

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

SET50 Overview

ความกังวลต่อการแพร่ระบาด Omicron กลับมามีน้ำหนักหลังวานนี้พบผู้ติดเชื้อของชาวต่างชาติที่เดินทางเข้ามาในประเทศไทยอาจเป็น Sentiment เชิงลบต่อ SET50 Index ในช่วงเปิดตลาด แต่อย่างไรก็ตามท่าทีของภาครัฐฯที่ยังไม่ได้กลับมาใช้มาตรการเข้มงวด ขณะที่หากประเมินอัตราผลตอบแทนตลาดหุ้นต่างประเทศนับตั้งแต่วันที่ 26 พ.ย.64 (วันที่ WHO ประกาศ Omicron เป็นสายพันธุ์ที่น่ากังวล) ถึงปัจจุบันพบตลาดหุ้นไทยลดลง 3.66% มากกว่าตลาดหุ้นที่พบการแพร่ระบาด Omicron เช่น ตลาดหุ้นสหรัฐฯ -1.61% ตลาดหุ้นยุโรปปรับลง -2.7% และตลาดหุ้นเพื่อนบ้านอย่างมาเลเซีย -2.25% เสียอีก สะท้อนว่าตลาดหุ้นบ้านเรา Price In กับประเด็น Omicron ไปพอสมควรแล้ว นอกจากนี้สภาพแวดล้อมที่มีน้ำหนักในทางบวกจากต่างประเทศหลังสหรัฐฯเปิดเผยว่าจากข้อมูลในปัจจุบันพบว่าอาการของ Omicron ไม่รุนแรงและยังไม่พบการเสียชีวิต ซึ่งหนุนต่อดัชนี Dow Jones ปรับขึ้น 1.9% จะเป็นปัจจัยที่ช่วยจำกัด Downside ของ SET50 Index ภายใต้สภาพแวดล้อมข้างต้นจึงคาด SET50 Index อยู่ในภาวะแกว่งผันผวนสูงในกรอบ 930-945 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: แม้จะพบผู้ติดเชื้อ Omicron รายแรกในบ้านเรา แต่เชื่อว่า SET50 น่าจะได้รับผลกระทบที่จำกัด ส่วนหนึ่งเป็นเพราะราคาหุ้นได้ดูดซับปัจจัยดังกล่าวไปมากแล้ว แนะนำ Trading S50Z21 ในกรอบ 930 - 945 จุด

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50H22 ลบด้วย S50Z21 (S50Z21H22) ณ วันที่ 29 ธ.ค. 2564 จะเท่ากับ -5.72 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -4.90 จุด ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: แนะนำให้สลับมารอเปิด Long S50Z21C925 ที่ 12 จุด (SET50=930) เป้าทำกำไร 27 จุด (SET50=945) Cut Loss 3 จุด ประเมินว่า SET50 ยังผันผวนไปตามข่าวเรื่อง Omicron แต่จะมีกรอบการเคลื่อนไหวที่แคบลง



	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	930	945
S50Z21	930	945

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยฯจึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ

แอปพลิเคชัน  ASP SMART
▶ [ดาวน์โหลด](#)

Telegram  ASIA PLUS GROUP
▶ [ติดตามข่าวสารการลงทุน](#)

FOLLOW NOW




DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	943.76	17.59865	18.56743

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	0.50	-0.30	> 1025.5	0.00	0.50	8.66%	0.02	343	4631	16.49	0.03	59.03	0.1
S50Z21C1000	1.10	-0.90	> 1001.1	0.00	1.10	6.08%	0.23	1248	7938	14.67	0.07	58.76	0.1
S50Z21C975	3.60	-2.60	> 978.6	0.00	3.60	3.69%	1.73	1468	9587	14.02	0.19	49.46	0.0
S50Z21C950	10.60	-4.60	> 960.6	0.00	10.60	1.78%	7.78	816	3071	14.04	0.43	37.84	0.0
S50Z21C925	25.60	-6.30	> 950.6	18.76	6.84	0.72%	21.99	98	762	15.01	0.69	25.35	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	82.30	1.70	< 942.7	81.24	1.06	-0.11%	82.24	0	241	#N/A N/A	-1.00	-12.45	0.0
S50Z21P1000	58.20	3.60	< 941.8	56.24	1.96	-0.21%	57.45	10	1648	12.63	-0.95	-16.35	0.0
S50Z21P975	36.00	2.00	< 939	31.24	4.76	-0.50%	33.96	226	4761	14.00	-0.81	-21.94	0.0
S50Z21P950	18.10	0.40	< 931.9	6.24	11.86	-1.26%	15.01	768	4588	14.33	-0.57	-30.01	0.0
S50Z21P925	8.50	-0.50	< 916.5	0.00	8.50	-2.89%	4.22	670	6201	16.09	-0.32	-35.00	0.0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	ส.บ.การซื้อขาย
SET50	943.76	-4.08	-0.43%	3/12/21

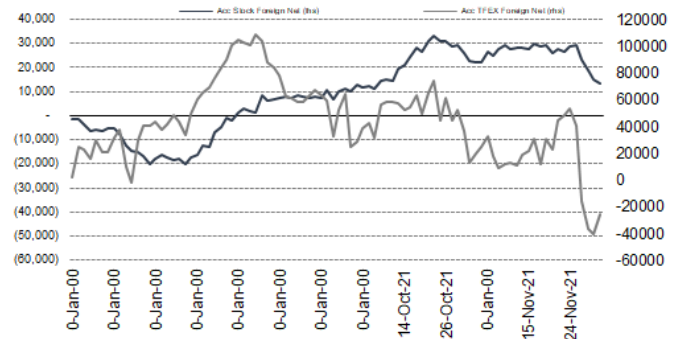
Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50V21	977.54	0.0	0.0%	26	77	0
S50X21	948.60	0.0	0.0%	47	70	0
S50Z21	942.30	-5.1	-0.5%	112,101	309,004	-10,614
S50H22	937.40	-4.9	-0.5%	13,345	73,844	940
S50M22	935.90	-5.0	-0.5%	2,094	24,253	-123
S50U22	934.20	-5.2	-0.6%	1,187	8,989	-94

SET50 Futures Long(Short) : สัญญา	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	QTD
สถาบัน	75,516	66,471	9,045	800	4,787	0
ต่างชาติ	85,216	97,244	-12,028	-3,157	-51,126	0
รายย่อย	130,387	127,404	2,983	2,357	46,339	0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ

ในตราสารทุน และ SET50 Futures



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

เป้าหมาย Spread ซีรียก - ซีรียก

	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

(ล้านบาท)	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 ADVANCZ21

ADVANC ยังเด่นที่ฐานธุรกิจปัจจุบันมั่นคง หนุนเป็นฐานต่อยอดธุรกิจใหม่เพิ่มขึ้น อาทิ บริการไอซีทีลูกค้าองค์กร, Digital Lending ที่มีศักยภาพเติบโตสูง การต่อยอด แม้อาจไม่เห็นผลบวกต่อกำไรชัด 1-2 ปี แต่ แต่ระหว่างรอการกำไรที่มั่นคง ให้ Yield เกินปีละ 3.5% ซึ่งยังมีลุ้น Upside Payout เพิ่มขึ้นหลัง GULF เข้ามา

ภาพทางเทคนิค แรงซื้อกลับด้วยแท่งเทียนเงาล่างยาว ส่งสัญญาณการกลับตัว ขณะที่การย่อตัว ใช้แนวรับบริเวณ 207 บาท เป็นจังหวะเข้าซื้อสะสม โดยมีเป้าหมายที่ 212 บาท

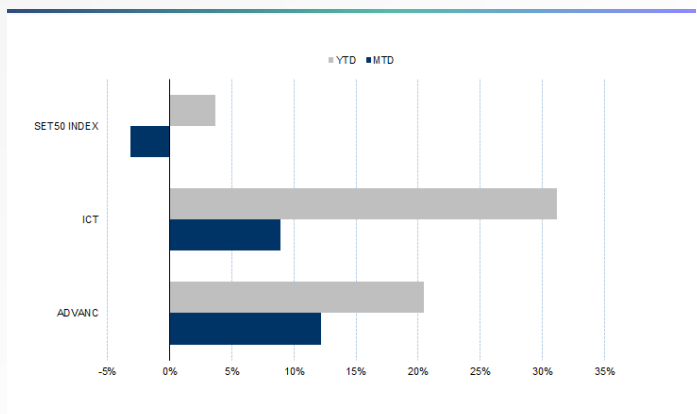
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long ADVANCZ21 บริเวณ 207 บาท เป้าทำกำไร 212 บาท Cut Loss 1.25 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
ADVANCZ21	211.19	-0.81	741	2708	-181	15.58	15.57%	23.31	7.44	-1.42%

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 TUZ21

หุ้นกลุ่มส่งออกที่ได้ประโยชน์เวลาบาทอ่อนค่า คาดผันผวนน้อยกว่าตลาดฯ แม้ค่ากำไรสุทธิงวด 4Q64 จะอ่อนตัวลงจากงวด 3Q64 จากธุรกิจ Red Lobster ที่อ่อนตัวลงตามฤดูกาล แต่คาดทิศทางกำไรสุทธิจะกลับมาฟื้นตัวได้อีกครั้งในงวด 1Q65 โดยค่ากำไรสุทธิปี 2564-65 จะเพิ่มขึ้น 21.9% yoy และ 3.4% yoy ขณะที่ Valuation น่าสนใจทั้งในมุมมองของ PE และ Div Yield

ภาพทางเทคนิค ทิศทางราคา ส่งสัญญาณบวก จากการทำจังหวะ Higher Low พร้อมกลับขึ้นมาขึ้นเหนือเส้น EMA 10 วัน ส่งสัญญาณเปิด Upside การย่อตัวมาบริเวณ 20.00 บาท ใช้เป็นจังหวะสะสม เพื่อคาดหวังการปรับขึ้นทดสอบ บริเวณ 20.70 บาท ในระยะถัดไป

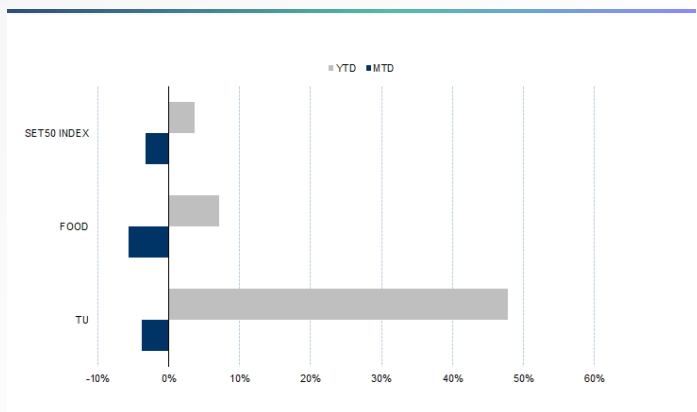
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long TUZ21 บริเวณ 20.00 เป้าทำกำไรที่ 20.70 บาท และ Cut Loss 0.30 บาท จากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 64F	PBV 64F	EPS GROWTH 64F
TUZ21	20.50	0.40	744	8200	96	11.02	29.35%	12.60	1.72	21.87%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

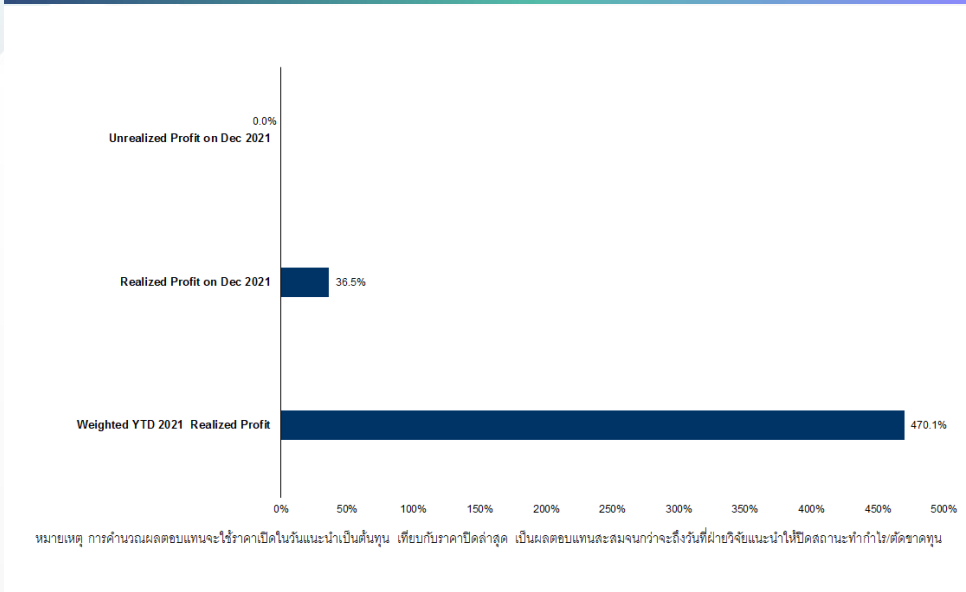
Technical Chart



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	JASZ21	3.04	0.02	7175	35991	-3325	6.62	3.06	2.91
2	TRUEZ21	4.57	0.01	2899	79555	-1473	12.00	5.09	4.34
3	BEMZ21	8.39	0.04	2502	21125	-2501	11.57	8.83	8.18
4	GUNKULZ21	4.77	0.01	1580	195499	-550	17.89	4.77	4.59
5	PTGZ21	15.10	0.00	1064	16497	379	5.37	15.13	14.31
6	BCHZ21	21.18	0.18	943	4572	33	16.75	21.85	20.58
7	VNTZ21	38.45	-0.05	841	1203	-841	14.47	38.52	38.18
8	TUZ21	20.50	0.40	744	8200	96	11.02	20.63	20.08
9	ADVANCZ21	211.19	-0.81	741	2708	-181	15.58	219.31	202.86
10	WHAZ21	3.37	0.01	591	14293	519	8.04	3.48	3.26
11	KTBZ21	11.67	0.07	576	9807	245	12.72	11.77	11.44
12	CHGZ21	3.91	0.03	527	6019	-505	14.59	3.93	3.76
13	CKPZ21	4.94	-0.02	526	13216	-524	5.22	5.15	4.86
14	ICHIZ21	10.00	0.15	503	10367	-498	6.03	10.68	9.96
15	TRIPZ21	1.66	0.00	500	22364	-500	10.92	1.72	1.65
16	BAMZ21	20.00	0.00	457	11228	-57		20.16	18.56
17	BGRMZ21	39.56	0.81	422	6899	-270	6.26	41.48	38.50
18	EAZ21	82.00	-0.25	369	1189	17	13.87	87.06	74.28
19	INTUCHZ21	74.64	0.39	363	1415	323	16.28	76.11	72.74
20	CPALLZ21	58.72	0.22	354	3127	210	13.27	63.04	57.65

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

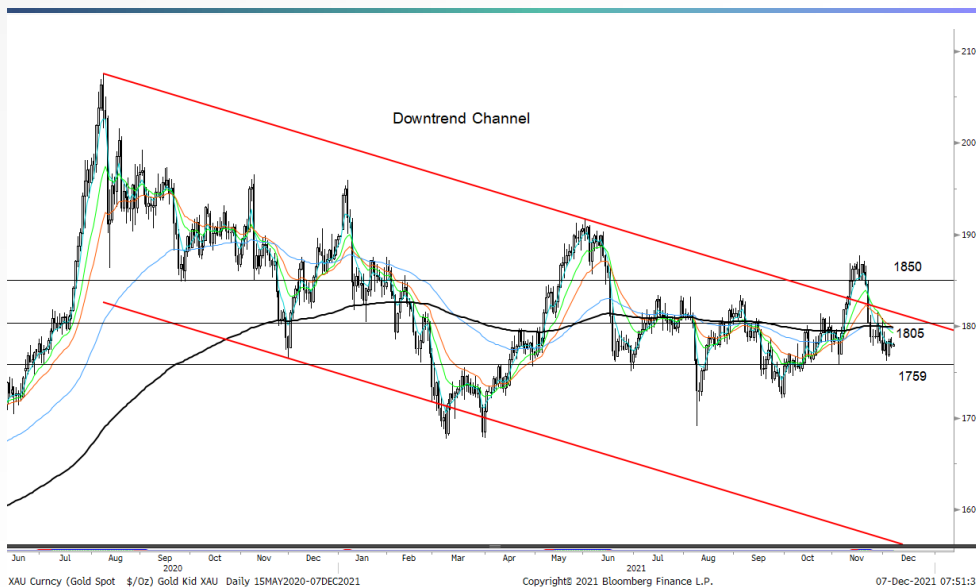
Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐช่วง 2 วันทำการที่ผ่านมา เพิ่มขึ้นรวม 10 เหรียญฯ โดยราคาติดตัวขึ้นปิดเมื่อวันศุกร์ที่ 1,782.3 เหรียญฯ ก่อนปรับตัวลงมาปิดเมื่อคืนวันจันทร์ที่ 1,778.3 เหรียญฯ หลังความเห็นของนายแพทย์แอนโทนี เฟาซี แพทย์ใหญ่ประจำทำเนียบขาว มองว่าการระบาดของโควิด-19 สายพันธุ์โอไมครอนยังไม่ก่อให้เกิดอาการเจ็บป่วยรุนแรง ทำให้นักลงทุนคลายความกังวลเกี่ยวกับโอไมครอน หนุนให้ตลาดหุ้นดาวโจนส์สหรัฐเมื่อคืนพุ่งขึ้น 646.95 จุด หรือ 1.87% และค่าเงินดอลลาร์สหรัฐแข็งค่าโดย Dollar Index ยืนระดับสูง 96.28 จุด ส่งผลให้ความต้องการถือครองทองคำลดลงสำหรับสัปดาห์นี้ ต้องติดตามการรายงานข้อมูลเศรษฐกิจสหรัฐ เช่น ดุลการค้า, จำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างรายสัปดาห์ และดัชนีราคาผู้บริโภค เป็นต้น

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFZ21 เมื่อคืนวันศุกร์ที่ผ่านมา เพิ่มขึ้น 150 บาท ปิดที่ 28,660 บาท (เทียบเท่า 1,781 เหรียญฯ) ใกล้เคียงราคาตลาด spot ที่ล่าสุดเคลื่อนไหวบริเวณ 1,781 เหรียญฯ คาดราคา GFZ21 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 28,550-28,850 บาท ทิศทางค่าเงินดอลลาร์แข็งค่า คงกดดันให้ราคาทองคำแกว่งตัวในกรอบที่ประเมินไว้ 1,760-1,790 เหรียญฯ จึงแนะนำให้ Trading บริเวณ 28,320-28,800 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	28,660	300	1.06	64	306	34
GFZ22	28,720	220	0.77	4	215	1
GF322	28,740	330	1.16	5	121	0

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10Z21	28,670	190	0.67	4,843	6,433	590
GF10G22	28,700	190	0.67	3,779	5,895	1171
GF10J22	28,730	190	0.67	2,793	3,156	186

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

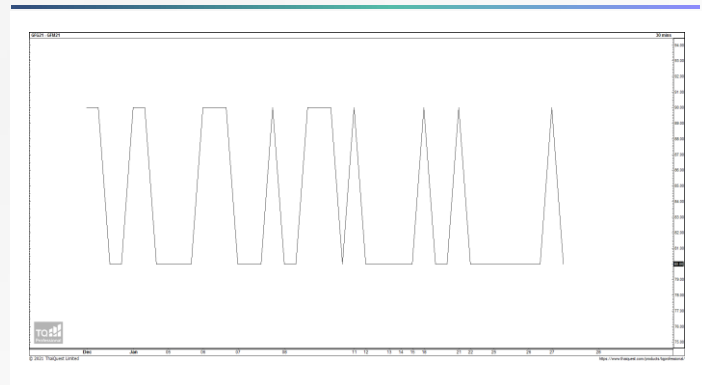
ทิศทางราคาทองคำ โดรนแรง Take Profit หลังจากติดแนวต้านบริเวณ \$1850 ด้วยแท่งเทียนแดงยาว บ่งชี้แรงขายเข้ากดดัน จนลงมาทดสอบเส้น EMA 200 วัน ทั้งนี้ ประเมินกรอบการเคลื่อนไหวไว้ที่ \$1805-\$1850

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD London AM (USD/Ounce)	FX (บาท/ USD)				
	32.50	32.75	33.00	33.25	33.50
1,650	25,489	25,686	25,882	26,078	26,274
1,680	25,953	26,153	26,352	26,552	26,751
1,710	26,416	26,620	26,823	27,026	27,229
1,740	26,880	27,087	27,293	27,500	27,707
1,770	27,343	27,554	27,764	27,974	28,185
1,800	27,807	28,021	28,235	28,448	28,662
1,830	28,270	28,488	28,705	28,923	29,140
1,860	28,734	28,955	29,176	29,397	29,618
1,890	29,197	29,422	29,646	29,871	30,095

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Spread ระหว่าง GFQ21 – GFZ21



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Gold Futures

นิลลงทุนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
28,910.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
28,860.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
28,810.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
28,760.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
28,710.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
28,660.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
28,610.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
28,560.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
28,510.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
28,460.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
28,410.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

นิลลงทุนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
28,920.00	250.0	2,500	(210)	2,290
28,870.00	200.0	2,000	(210)	1,790
28,820.00	150.0	1,500	(210)	1,290
28,770.00	100.0	1,000	(210)	790
28,720.00	50.0	500	(210)	290
28,670.00	0.0	-	(210)	(210)
28,620.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
28,570.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
28,520.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
28,470.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
28,420.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส