

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

24 มกราคม 2565



SET50 Futures:

การปรับลงของสินทรัพย์เสี่ยงต่างๆก่อนการประชุม FED ทำให้ SET50 Index อยู่ในภาวะพักตัวแต่ Downside จำกัด แนะนำ Trading S50H22 ในกรอบ 970-985 จุด

SET50 Option:

แนะนำรอเปิด Long S50H22C975 ที่ 20 จุด (SET50=980) เป้าทำกำไรที่ 30 จุด (SET50= 990) Cut Loss 3 จุดจากทุน ประเมินว่า SET 50 ยังอยู่ในช่วงผันผวนรอความชัดเจนการประชุม FED แต่เชื่อว่า Downside จำกัด

Single Stock Futures:

สถานะ Long ADVANCH22 ที่ทุน 218 บาท ถูกปิด Stop Profit ที่ทุน สำหรับวันนี้แนะนำรอเปิดสถานะ Long CPALLH22 ที่ 58.75 บาท เป้าทำกำไร 60.00 บาทและ Cut Loss 0.50 บาทจากทุน โดยปัจจัยขับเคลื่อนจากทิศทาง SSSG ที่เริ่มเห็นการฟื้นตัว

แนะนำรอ Long BECH22 ที่ 13.80 บาท เป้าทำกำไร 14.40 บาท และ Cut Loss 0.30 บาทจากทุน คาดกำไรช่วง 1-2 ปีเติบโตเฉลี่ยโดดเด่น

Gold Futures:

คาดสัปดาห์นี้ราคาทองคำผันผวนในกรอบแคบเพื่อรอผลประชุม Fed จึงแนะนำถือสถานะ Short GFG22 ที่ทุน 28740 บาท ปัจจุบันมีกำไร 20 บาท และเป้าทำกำไร 28340 บาท (1810\$) Cut Loss 100 บาทจากทุน

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 [ASIA PLUS GROUP](#)
▶ [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

นอวพรรณ น้อยรัชชกุล
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันพานิชกิจ
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธ ฤกษ์นคร
ผู้ช่วยนักวิเคราะห์



สถานะของนักลงทุน

	All Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	270,275	225,433	44,842	6,913	25,045	-553,476
Foreign	129,952	89,208	40,744	33,844	32,755	-41,575
Retail	269,377	354,963	-85,586	-40,757	-57,800	595,051

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	34,723	34,772	-49	-1,816	2,211	580
Foreign	55,187	57,889	-2,702	-3,669	-2,573	16,939
Retail	94,043	91,292	2,751	5,485	362	-17,519

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	216,332	169,553	46,779	14,059	49,897	-513,182
Foreign	47,852	7,493	40,359	23,440	26,204	-97,892
Retail	128,375	215,513	-87,138	-37,499	-76,101	611,074

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	8,952	11,054	-2,102	673	-1,080	-1,915
Foreign	21,994	23,191	-1,197	9,783	2,118	21,717
Retail	22,898	19,599	3,299	-10,456	-1,038	-19,802

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	312	863	-551	977	652	1,648
Foreign	1,591	201	1,390	1,369	2,114	4,957
Retail	3,577	4,416	-839	-2,346	-2,766	-6,605

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	384	1,043	-659	-809	-1,732	1,304
Foreign	3,255	370	2,885	2,920	4,968	11,119
Retail	4,973	7,199	-2,226	-2,111	-3,236	-12,423

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



SET50 Overview

ปัจจัยแวดล้อมยังไม่ประเด็นใหม่เข้ามาเพิ่มเติม โดยประเด็นต่างประเทศยังให้น้ำหนักไปที่การรอความชัดเจนของผลการประชุม FED ระหว่างวันที่ 25-26 ม.ค. (รู้ผลช่วงเช้าวันที่ 27 ม.ค. ตามเวลาบ้านเรา) ที่ความเห็นต่อการเร่งขึ้นดอกเบี้ยของ FED มีมากขึ้นเพื่อสกัดปัญหาเงินเฟ้อสหรัฐฯ สร้างแรงกดดันต่อตลาดหุ้นสหรัฐฯวันศุกร์ที่ผ่านมาปรับลง โดยเฉพาะ NASDAQ ที่ลดลง -2.72% Dow Jones ลดลง 1.3% ขณะที่ค่าเงิน Dollar Index แข็งค่าในโซน +/-95.5 จุด แต่อย่างไรก็ตามค่าเงินบาทที่ยังคงมีทิศทางแข็งค่าที่ 33 บาท/usd จึงยังไม่เห็นสัญญาณลบของ Fund Flow ที่มีแนวโน้มไหลออก ด้านปัจจัยในประเทศการรายงานงบ 4Q64 ของหุ้นในกลุ่ม ธ.พ. ส่วนใหญ่ออกมาดีกว่าตลาดคาด จากกำไรสุทธิมีแนวโน้มขยายตัว QoQ จากรายได้ที่มีไข่ออกเบี้ย (Non-NII) และต้นทุนการตั้งสำรอง (Credit Cost) ลดลงจากงวดก่อน โดยรวมจึงไม่สร้างแรงกดดันต่อ SET50 Index ส่วนประเด็นอื่น ๆ วนนี้ติดตามการประชุม ครม. พิจารณามาตรการลดภาระค่าใช้จ่ายประชาชนรวมถึงมาตรการ EV ภายใต้ปัจจัยแวดล้อมข้างต้นคาด SET50 Index แกว่งพื้นฐานในกรอบ 980-990 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: การปรับลงของสินทรัพย์เสี่ยงต่างๆก่อนการประชุม FED ทำให้ SET50 Index อยู่ในภาวะพักตัวแต่ Downside จำกัด แนะนำ Trading S50H22 ในกรอบ 970-985 จุด

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50M22 ลบด้วย S50H22 ณ วันที่ 30 มี.ค. 2565 จะเท่ากับ -4.46 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -4.8 จุด ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: คงคำแนะนำให้รอเปิด Long S50H22C975 ที่ 20 จุด (SET50=980) เป้าทำกำไรที่ 30 จุด (SET50= 990) Cut Loss 3 จุดจากทุน ประเมินว่า SET 50 ยังอยู่ในช่วงผันผวนเพื่อรอความชัดเจนการประชุม FED แต่เชื่อว่า Downside จำกัด

	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	980	993
S50H22	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	987.06	14.13871	8.043445

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
S50H22C1025	6.00	-0.20	> 1031	0.00	6.00	4.45%	5.88	902	5293	12.49	0.20	32.84	0.0
S50H22C1000	12.80	-0.10	> 1012.8	0.00	12.80	2.61%	12.48	1197	6323	12.63	0.35	27.07	0.0
S50H22C975	25.00	-0.60	> 1000	12.06	12.94	1.31%	23.36	1681	5191	13.43	0.53	20.94	0.0
S50H22C950	41.00	-2.90	> 991	37.06	3.94	0.40%	38.98	721	1576	14.60	0.68	16.48	0.0
S50H22C925	62.50	-2.40	> 987.5	62.06	0.44	0.04%	58.75	8	302	16.47	0.76	12.03	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
S50H22P1025	50.50	1.50	< 974.5	37.94	12.56	-1.27%	50.51	27	200	11.82	-0.83	-16.85	0.0
S50H22P1000	32.50	1.50	< 967.5	12.94	19.56	-1.98%	32.12	254	1669	12.71	-0.63	-19.48	0.0
S50H22P975	19.60	1.60	< 955.4	0.00	19.60	-3.21%	18.02	2020	4826	12.76	-0.46	-22.86	0.0
S50H22P950	11.90	0.90	< 938.1	0.00	11.90	-4.96%	8.65	1137	7312	14.17	-0.30	-24.07	0.0
S50H22P925	7.30	0.60	< 917.7	0.00	7.30	-7.03%	3.44	1364	5297	15.55	-0.19	-24.14	-0.1

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	ลบการซื้อขาย
SET50	987.06	-3.38	-0.34%	211/122

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50F22	987.80	-1.3	-0.1%	269	627	57
S50G22	984.00	-1.5	-0.2%	101	155	17
S50H22	980.20	-2.2	-0.2%	157,249	367,365	11,801
S50M22	975.70	-2.0	-0.2%	21,322	44,104	-1,131
S50U22	972.50	-2.1	-0.2%	3,265	16,052	-26
S50Z22	972.60	-2.2	-0.2%	1,747	4,845	0

SET50 Futures	Long(Short)	สัญญา	ลบ Long(Short)			
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	1 เดือน
สถานะ	34,723	34,772	-49	1,861	2,981	-8,205
ต่างชาติ	55,187	57,889	-2,702	11,577	4,965	38,852
รายย่อย	34,043	91,292	2,751	-13,438	-7,946	-30,647

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

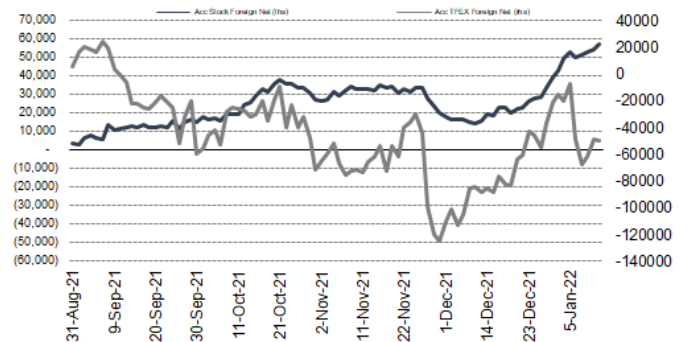
	เป้าหมาย Spread ซีรียโกล - ซีรียโกล					
	S50J21	S50K21	S50M21	S50N21	S50Q21	S50U21
	ณ 29 เม.ย.64	ณ 28 พ.ค.64	ณ 29 มิ.ย.64	ณ 29 ก.ค.64	ณ 30 ส.ค.64	ณ 29 ก.ย.64
S50J21						
S50K21	-1.68					
S50M21	-1.28	0.40				
S50N21	-1.16	0.53	0.13			
S50Q21	-5.13	-3.62	-4.02	-4.15		
S50U21	-5.81	-4.13	-4.53	-4.66	-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
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 BECH22

แนวโน้ม 4Q64 ฝ่ายวิจัยคาดการณ์กำไรสุทธิอยู่ที่ 202 ล้านบาท (+41%QoQ) จากการขายลิขสิทธิ์ไปยังแพลตฟอร์มต่างประเทศ โดยมีแผนในการ Simulcast คอนเทนต์ 2 เรื่อง ได้แก่ Help me คุณผีช่วยด้วย และเกมล่าทรชน ผ่านช่องทาง Netflix ทั้งในประเทศ เวียดนาม,ฟิลิปปินส์,สิงคโปร์ และอินโดนีเซีย ขณะที่คาดการณ์กำไรปี 2564-2566 จะเติบโตเฉลี่ยปีละ 25.9% จากอัตราค่าโฆษณาต่อนาทีและอัตราการใช้สื่อพื้นตัวตามอุตสาหกรรม ภาพทางเทคนิค แนว Sideway กรอบการเคลื่อนไหวที่ 13.80-14.40 บาท โดยมีสัญญาณกลับตัวจากแท่งเทียน Hammer สะท้อนแรงซื้อเข้าหนุน เป้าหมายบริเวณ 14.40 บาท

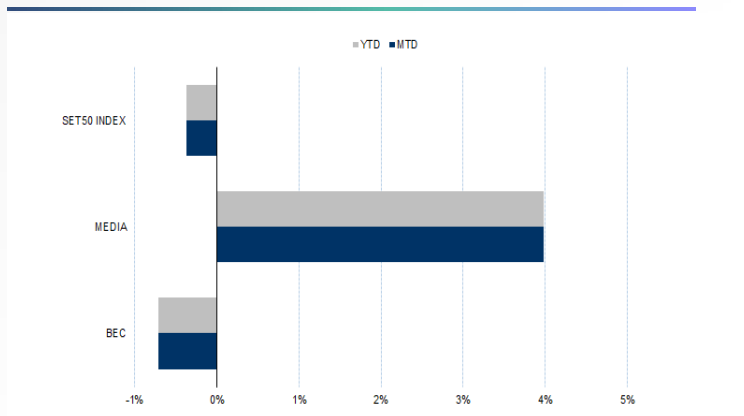
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long BECH22 บริเวณ 13.80 บาท เป้าทำกำไร 14.40 บาท Cut Loss 0.30 บาท จากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
BECH22	14.12	-0.04	1114	65118	-1021	19.94	-58.33%	41.16	3.89	25.02%

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 CPALLH22

คาดการณ์ว่า CPALL จะกลับมาฟื้นตัวถึง 107% ในปี 2565 สูงขึ้นจากฐานปี 2564 ที่ต่ำลง โดยผลกระทบการถือหุ้น MAKRO ลดลงราว 54.7% หลัง MAKRO ขายหุ้น PO รวมกับที่ CPALL จะขายหุ้น MAKRO บางส่วนพร้อม PO จะช่วยให้ MAKRO และ CPALL ได้เงินมาคืนหนี้ที่เกี่ยวข้องกับการซื้อ Lotus's ด้วยพัฒนาการทั้งธุรกิจและผลประกอบการที่จะเห็นต่อเนื่องนับจากนี้ ประเมิน มูลค่าพื้นฐานปี 2565 ที่ 70.20 บาท Upside นำเข้าลงทุน ภาพทางเทคนิค ฟอรัมฐานแนวรับได้แก่งบริเวณ 58.00 บาท พร้อมสัญญาณ Bullish Divergence ใน MACD และ RSI สะท้อนสัญญาณกลับตัว เป้าหมายอยู่ที่ 60.00 บาท

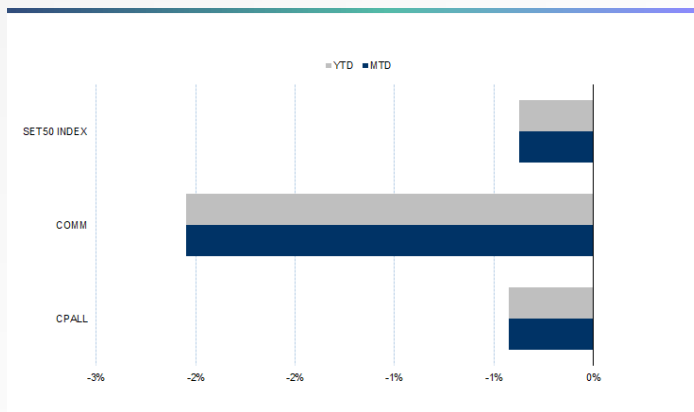
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long CPALLH22 บริเวณ 58.75 บาท เป้าทำกำไร 60.00 บาท และ Cut Loss 0.50 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
CPALLH22	58.90	1.00	1116	9805	737	13.16	21.03%	67.83	6.72	-51.61%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

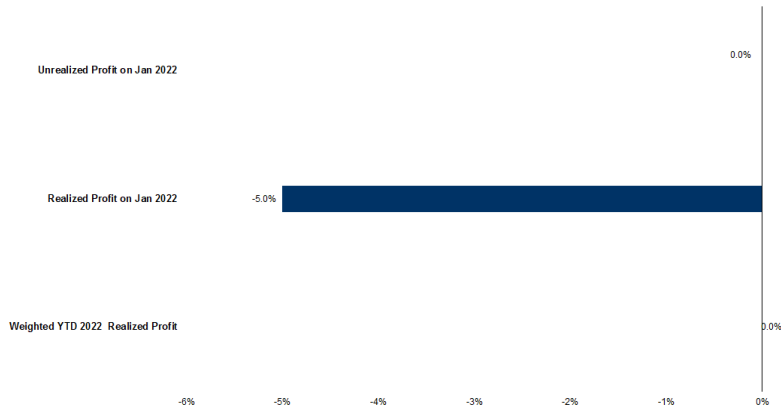
DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



Tracking Performance



หมายเหตุ การคำนวณผลตอบแทนจะใช้ราคาเปิดในวันแนะนำเป็นต้นทุน เทียบกับราคาปิดล่าสุด เป็นผลตอบแทนสะสมจนกว่าจะถึงวันที่ฝ่ายวิจัยแนะนำให้ปิดสถานะทำกำไรตัดขาดทุน

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Top 20 Most Active Volume

	Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	SIRIH22	1.26	-0.03	82234	193984	-31582	11.32	1.33	1.28
2	JASH22	4.02	0.00	77093	157407	11454	8.82	4.09	3.68
3	GUNKULH22	6.53	-0.17	46027	249556	-13016	25.19	6.70	5.90
4	GULFH22	50.50	0.00	11842	15601	-4254	2.58	52.52	47.42
5	TRUEH22	4.63	0.01	8843	155144	8543	12.16	4.83	4.69
6	THANH22	4.40	0.00	8041	22474	-5035	4.54	4.47	4.26
7	WHAH22	3.42	0.06	6545	92807	2499	8.04	3.57	3.47
8	WHAH22	3.42	0.06	6545	92807	2499	8.04	3.57	3.47
9	TIPLH22	1.92	0.00	6511	36908	-489	12.63	1.99	1.83
10	TTBH22	1.45	0.01	5836	120608	3276		36.23	33.86
11	KBANKH22	144.33	0.33	5264	8763	1415	11.21	3.31	3.31
12	IRPCH22	3.94	-0.04	4982	54540	-1151	11.64	32.18	30.88
13	BANPUH22X	10.90	0.00	4345	77324	-3232	13.04	10.10	9.59
14	OSPH22	33.00	0.25	3724	21823	-477	7.06	1.99	1.94
15	GFPTH22	13.87	-0.03	3022	10861	-85	8.51	18.64	18.32
16	AOTH22	61.25	0.00	2671	7035	295	9.32	11.54	11.29
17	SCBH22	124.30	0.80	2354	6366	-337	10.33	6.32	6.04
18	STAH22	29.65	0.15	2319	8835	-1890	6.16	3.13	2.98
19	STECH22	14.70	-0.10	2228	14494	598	7.21	16.96	16.60
20	GPSCH22	86.00	0.00	2135	11342	-905	9.80	9.29	9.14

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

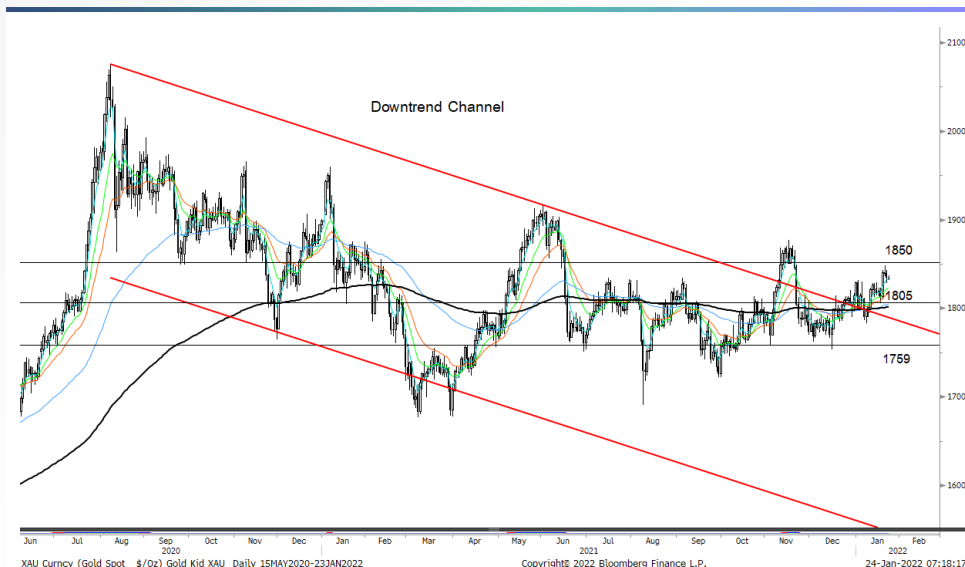
Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืนวันศุกร์ที่ผ่านมา ระหว่างการซื้อขายลดลงไปแตะจุดต่ำสุดของวันที่ 1,828 เหรียญฯ ก่อนดีดตัวขึ้นมาปิดที่ 1,833 เหรียญฯ เป็นการปรับลดลง 5.9 เหรียญฯ จากวันก่อนหน้า โดยการเคลื่อนไหวของราคาทองคำมีแรงพุงจากค่าเงินดอลลาร์สหรัฐที่อ่อนค่า เมื่อเทียบกับสกุลเงินอื่น ทำให้ Dollar Index ลดลง 0.2% ปิดที่ 95.64 จุด และการร่วงลงแรงของตลาดหุ้นดาวโจนส์สหรัฐ 450.02 จุด หรือ 1.3% ทำให้มีแรงเข้าซื้อบางส่วนในทองคำฐานะสินทรัพย์ปลอดภัย โดยสัปดาห์นี้มีหลายประเด็นต้องติดตามทั้งการรายงานข้อมูลดัชนี PMI ของฝั่งยูโรโซน และสหรัฐ รวมถึงการประชุมของธนาคารกลางสหรัฐ (เฟด) วันที่ 25-26 ม.ค. นี้

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFG22 เมื่อคืนวันศุกร์ที่ผ่านมา เพิ่มขึ้น 20 บาท ปิดที่ 28,720 บาท (1,834.5 เหรียญฯ) สูงกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,833-1,834 เหรียญฯ คาดราคา GFG22 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 28,600-28,900 บาท ฝ่ายวิจัยคงแนะนำให้นักลงทุนที่มีสถานะ Short GFG22 ต้นทุนเฉลี่ย 28,740 บาท และปัจจุบันมีกำไร 20 บาท แนะนำถือสถานะไว้ต่อไป โดยมีเป้าหมายทำกำไร 1,810 เหรียญฯ เท่าเทียบ 28,340 บาท และกำหนดจุด cut loss ไว้ 100 จากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GFG22	28,720	0	0.00	95	314	-59
GF322	28,710	-30	-0.10	40	246	-8
GFM22	28,730	-40	-0.14	-	-	0

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10G22	28,700	-20	-0.07	3,249	6,887	75
GF10J22	28,740	0	0.00	2,505	5,061	594
GF10M22	28,750	-10	-0.03	146	125	0

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

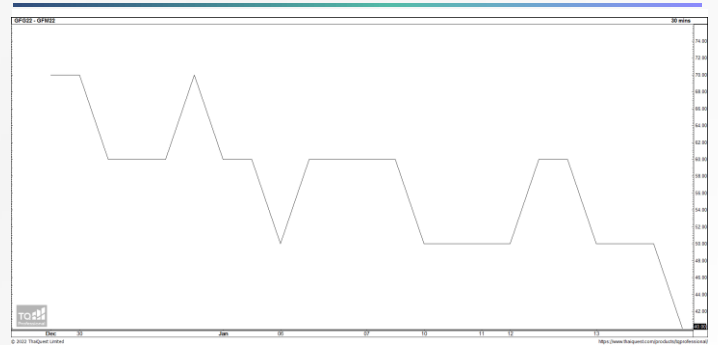
ทิศทางราคาทองคำ เกิดสัญญาณ Breakout แนวต้าน 1805 เหรียญฯ ทำให้ในระยะถัดไปมีลุ้น Technical Rebound ต่อแนวต้านถัดไปที่ 1850 เหรียญฯ

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 GFG22 – GFM22



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Gold Futures

นิลกองทุนรายย่อย (ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)					
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ	
28,970.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451	
28,920.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951	
28,870.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451	
28,820.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951	
28,770.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451	
28,720.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)	
28,670.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)	
28,620.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)	
28,570.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)	
28,520.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)	
28,470.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)	

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

นิลกองทุนรายย่อย (ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)					
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ	
28,950.00	250.0	2,500	(210)	2,290	
28,900.00	200.0	2,000	(210)	1,790	
28,850.00	150.0	1,500	(210)	1,290	
28,800.00	100.0	1,000	(210)	790	
28,750.00	50.0	500	(210)	290	
28,700.00	0.0	-	(210)	(210)	
28,650.00	-50.0	(500)	(210)	(710)	
28,600.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)	
28,550.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)	
28,500.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)	
28,450.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)	

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส