

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

19 เมษายน 2565



SET50 Futures:

สถานะ Short S50M22 ที่ 995 จุด ปิดทำกำไรที่บริเวณ 987 จุด สำหรับวันนี้แนะนำรอเปิดสถานะ Short S50M22 ที่ 993 จุด เป้าทำกำไรที่ 985 จุดและ Cut Loss 4 จุดจากทุน คาด SET50 อยู่ในช่วงพักตัวฐานจากความเสี่ยงเติบโตเศรษฐกิจโลกและแรงกดดันเฉพาะตัวจาก SCB

SET50 Option:

รอเปิด Long S50M22P1000 ที่ 23 จุด (SET50=995) เป้าทำกำไรที่ 33 จุด (SET50=985) Cut Loss 3 จุดจากทุน คาดว่า SET50 ยังปรับขึ้นได้จำกัด

Single Stock Futures:

สถานะ Long BLAM22 ทุน 43 บาท ถูกปิด Stop Proffit ที่ทุน สำหรับวันนี้แนะนำรอ Long MM22 บริเวณ 54.75 บาท เป้าทำกำไร 56 บาทและ Cut Loss 0.50 บาทจากทุน ราคาได้แรงหนุนจากทิศทางผลประกอบมีแนวโน้มฟื้นตัว

แนะนำรอ Long BDMS บริเวณ 25.25 บาท เป้าทำกำไร 26 บาท cut 0.25 บาทจากทุนจากแนวโน้มผลประกอบการฟื้นตัวตามการเปิดประเทศ

Gold Futures:

ค่าเงินดอลลาร์แข็งค่า กดดันให้ราคาทองคำไม่ผ่าน 2000\$ จึงแนะนำ Trading GFJ22 ในกรอบ 31400-31880 บาท (1960-1990\$) และรอเปิด Short หากราคาแตะกรอบบน

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

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องสามารถดำเนินการได้อย่างรวดเร็วทัน ฝ่ายวิจยฯ จึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันทำการผ่าน 2 ช่องทาง เพื่อให้นักลงทุนสามารถปรับเปลี่ยนกลยุทธ์ 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

นวลพรรณ น้อยรัชชกุล
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันการนากิจ
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธส เกิดเนตร
ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

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	100,609	90,830	9,779	-1,659	35,925	967
Foreign	76,783	81,839	-5,056	-10,009	-32,365	73,909
Retail	165,878	170,601	-4,723	11,668	-3,560	-74,876

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	23,279	18,310	4,969	5,245	9,486	-8,598
Foreign	45,145	56,423	-11,278	-12,231	-53,851	18,376
Retail	78,246	71,937	6,309	6,986	44,365	-9,778

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	66,133	61,260	4,873	-18,766	-1,459	-21,525
Foreign	7,347	5,439	1,908	541	11,147	43,322
Retail	51,924	58,705	-6,781	18,225	-9,688	-21,797

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	8,278	6,514	1,764	14	2,209	5,685
Foreign	23,090	19,529	3,561	796	8,464	12,061
Retail	17,546	22,871	-5,325	-810	-10,673	-17,746

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	109	58	51	45	-193	181
Foreign	490	217	273	300	669	1,379
Retail	2,121	2,445	-324	-345	-476	-1,360

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	28	435	-407	-335	-290	-554
Foreign	460	141	319	414	1,249	1,620
Retail	2,063	1,975	88	-79	-959	-1,066

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

SET50 Overview

คาด SET50 Index วันนี้พักตัวในกรอบ 985-993 จุด จุด จากปัจจัยแวดล้อมที่มีน้ำหนักในทางลบ จากแรงกดดันต่อการปรับลดคาดการณ์เติบโตเศรษฐกิจโลกของ World Bank ปรับลดคาดการณ์ GDP Growth 65 ลงจาก 4.1%yoy มาที่ 3.2% จากความเสี่ยงเงินเฟ้อและความไม่แน่นอนของรัสเซียยูเครน นอกจากนี้ในมุมมองฝ่ายวิจัยฯ คาดว่า Downside อาจมีเพิ่มเติมจากการดำเนินนโยบายการเงินของธนาคารกลางหลักต่างๆ ที่เชิงรุกมากขึ้น ขณะที่บ้านเรา ธปท. ได้ให้มุมมองต่อการเติบโตเศรษฐกิจไทยคาดว่าจะเติบโต 3.2%yoy (จากเดิม 3.4%yoy) ขณะที่ปัจจัยเสี่ยงที่ติดตาม 1) Supply Disruption ที่อาจแรงกว่าคาด 2) ค่าครองชีพที่อาจสูงขึ้นจนกระทบภาคการบริโภค 3) Omicron หากมีการกลายพันธุ์ ขณะที่การดำเนินนโยบายการเงินยังย้ำว่าจะคงดอกเบี้ยเพื่อสนับสนุนการฟื้นตัวของเศรษฐกิจ ทั้งนี้ในมุมมองของฝ่ายวิจัยฯ ประเมินว่าในระยะถัดไปหากเศรษฐกิจเริ่มฟื้นกลับอาจเห็นการปรับขึ้นดอกเบี้ยตามทิศทางต่างประเทศเช่นกัน เนื่องจากดอกเบี้ยที่แท้จริงบ้านเราที่อยู่ในระดับต่ำที่สุดในภูมิภาค ส่วนประเด็นอื่นๆ ที่อาจสร้างความผันผวนต่อ SET50 Index เพิ่มเติมคือแรงกดดันจาก SCB ที่อยู่ในช่วงรอยต่อการเปลี่ยนผ่านเป็น SCBX ซึ่งทำให้ราคาหุ้นถูกกดดันจนถึงวันที่ 26 เม.ย. ทั้งนี้การปรับลงของ SCB ทุก 10 บาท จะกระทบกับ SET50 Index 3.3 จุด

SET50 Index Futures

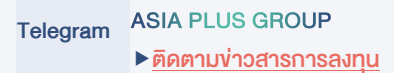
Direction Trading: สถานะ Short S50M22 ที่ 995 จุด ปิดทำกำไรที่บริเวณ 987 จุด สำหรับวันนี้แนะนำรอเปิดสถานะ Short S50M22 ที่ 993 จุด เป้าทำกำไรที่ 985 จุด และ Cut Loss 4 จุดจากทุน คาด SET50 อยู่ในช่วงพักตัวฐานจากความเสี่ยงเติบโตเศรษฐกิจโลกและแรงกดดันเฉพาะตัวจาก SCB

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50U22 ลบด้วย S50M22 ณ วันที่ 29 มิ.ย. 2565 จะเท่ากับ -8.45 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -5.6 จุด ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: รอเปิด Long S50M22P1000 ที่ 23 จุด (SET50=995) เป้าทำกำไรที่ 33 จุด (SET50=985) Cut Loss 3 จุดจากทุน คาดว่า SET50 ยังปรับขึ้นได้จำกัด

	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	985	995
S50M22	987	995

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยฯ จึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ



DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	991.80	12.5445	8.30153

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	0.50	0.10	> 1125.5	0.00	0.50	13.48%	0.17	8	850	13.92	0.02	43.98	0.1
S50M22C1100	0.70	-0.20	> 1100.7	0.00	0.70	10.98%	0.55	142	1494	12.64	0.03	46.25	0.1
S50M22C1075	1.40	-0.30	> 1076.4	0.00	1.40	8.53%	1.53	258	2842	11.96	0.06	41.63	0.1
S50M22C1050	3.10	-0.70	> 1053.1	0.00	3.10	6.18%	3.81	445	3609	11.65	0.12	39.79	0.1
S50M22C1025	6.90	-1.90	> 1031.9	0.00	6.90	4.04%	8.40	808	3664	11.65	0.25	35.29	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	137.20	4.40	< 987.8	133.20	4.00	-0.40%	136.28	0	3	39.27	-0.68	-4.90	0.0
S50M22P1100	110.40	2.10	< 989.6	108.20	2.20	-0.22%	111.67	1	11	11.56	-0.98	-8.77	0.0
S50M22P1075	88.20	3.80	< 986.8	83.20	5.00	-0.50%	87.67	0	176	9.28	-0.95	-10.72	0.0
S50M22P1050	63.50	3.40	< 986.5	58.20	5.30	-0.53%	64.97	1	144	11.39	-0.86	-13.40	0.0
S50M22P1025	43.30	3.80	< 981.7	33.20	10.10	-1.02%	44.58	262	1154	9.96	-0.79	-18.02	0.0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

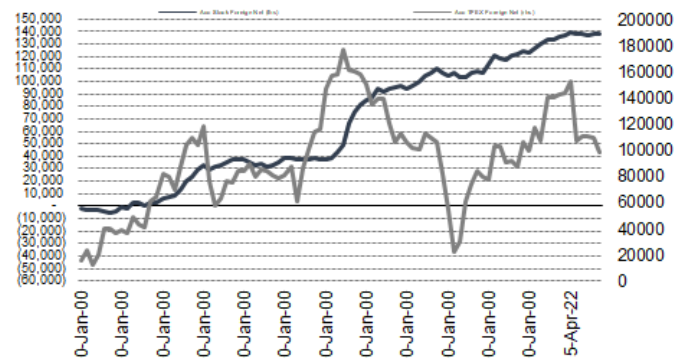
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สปรนการซื้อขาย
SET50	991.80	-4.74	-0.48%	18/4/22

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50J22	990.10	-6.7	-0.7%	63	303	-27
S50K22	990.20	-5.6	-0.6%	83	120	-10
S50M22	988.50	-6.4	-0.6%	133,211	341,696	4,348
S50U22	982.90	-6.0	-0.6%	9,446	29,161	-72
S50Z22	981.10	-5.9	-0.6%	3,066	13,359	-154
S50H23	977.90	-5.8	-0.6%	801	2,405	209

	SET50 Futures Long(Short) : สัปดาห์			สัปดาห์		
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	1 เดือน
สถานะ	23,279	18,310	4,969	5,245	5,116	-8,598
ค่าขาด	45,145	56,423	-11,278	-12,231	-8,198	18,376
รายย่อย	78,246	71,937	6,309	6,986	3,082	-9,778

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%

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 MM22

คาดการณ์ 1Q65 ทรงตัว QoQ เหตุเพราะช่วง ธ.ค. เป็นฤดูกาลเฉลิมฉลองจึงมีฐานสูง แต่คาดการณ์เติบโตสูง YoY จากฐานกำไร 88 ล้านบาทในงวด 1Q64 และต่อเนื่องถึง 2Q65 หนุนด้วยเทศกาลสงกรานต์ (Turn Around จากขาดทุน 99 ล้านบาทในงวด 2Q64 ส่วนทั้งปีประเมินกำไร 1.7 พันล้านบาท สัดส่วน 67% ของกำไรปี 2562 อานิสงค์จากกิจกรรมทางเศรษฐกิจดีขึ้นอีกครั้ง ขณะที่ราคาหุ้นยัง Laggard หุ้นกลุ่ม Reopening อย่างโรงแรม กอปรกับราคาบริเวณนี้อยู่ใกล้ IPO ที่ 49 บาท จึงเชื่อว่า Downside จำกัด

ภาพทางเทคนิค แกว่งฟื้นตัวในแนวโน้มขาขึ้น สนับสนุนด้วยเส้น EMA 10 วัน สะท้อนแรงซื้อที่ยังคงแกร่ง ใช้จังหวะย่อมาบริเวณ 54.75 บาท เข้าสะสม โดยมีเป้าหมายที่ 56 บาท

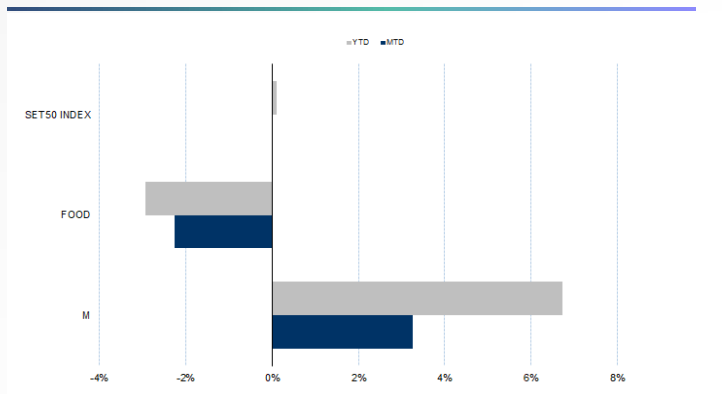
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long MM22 บริเวณ 54.75 บาท เป้าทำกำไร 56 บาท cut 0.50 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
MM22	55.45	1.15	87	2318	-49		17.76%	27.99	3.50	-2018.04%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures



DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION



Long BDMSM22

แนวโน้มกำไรของ BDMS ในงวด 1Q65 คาดจะเติบโต YoY และ QoQ หลักๆมาจาก การฟื้นตัวของฐานลูกค้าคนไทยและต่างชาติ โดยเฉพาะกลุ่ม Fly-In นับตั้งแต่การเริ่มการมาเปิด Test&Go อีกครั้งในรอบ ก.พ. ที่ผ่านมา ขณะที่คาดจะเติบโตต่อเนื่องในปี 2565-66 เฉลี่ยปีละ 28.2% จากผู้ป่วยต่างชาติกลุ่ม Fly-in ที่สามารถคาดหวังได้ต่อเนื่อง จากการยกเลิกระบบ Thailand Pass กล่าวคือการเดินทางเข้าสู่ประเทศไทยกลับสู่ภาวะปกติ (เหมือนปี 2562) คาดเริ่มมีผลช่วง มิ.ย. – ก.ค.

ภาพทางเทคนิค Breakout กรอบบน Bullish Flag ด้วยแท่งเทียนเขียวเต็มแท่ง สะท้อนแรงซื้อกลับเข้าหนุน ใช้จังหวะย่อมาที่ 25.25 บาท เข้าสะสม โดยมีแนวต้านที่ 26 บาท

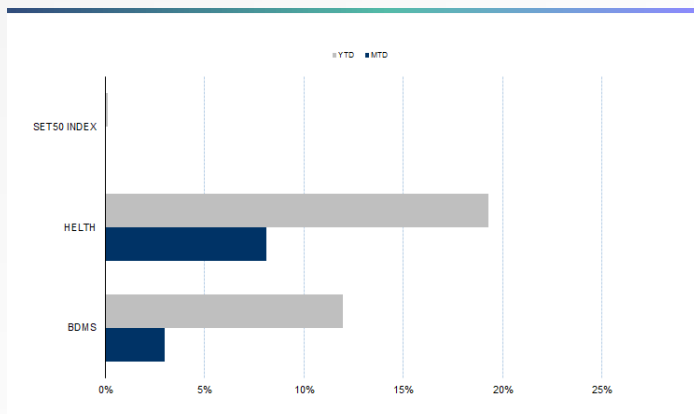
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long BDMS บริเวณ 25.25 บาท เป้าทำกำไร 26 บาท cut 0.25 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
BDMSM22	25.80	-0.35	815	1103	200	14.95	16.00%	39.00	3.67	19.54%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

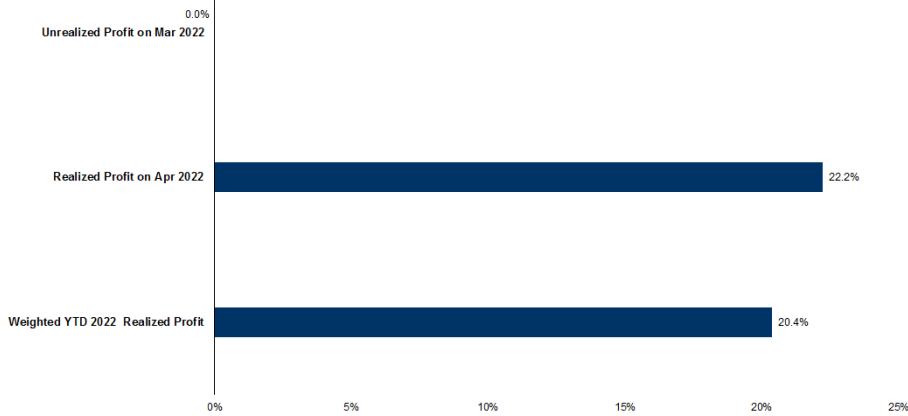
Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



Tracking Performance



หมายเหตุ การคำนวณผลตอบแทนจะใช้ราคาเปิดในวันแนะนำเป็นต้นทุน เทียบกับราคาปิดล่าสุด เป็นผลตอบแทนสะสมจนกว่าจะถึงวันที่ฝ่ายวิจัยแนะนำไปปิดสถานะหากไม่ตัดขาดทุน

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Top 20 Most Active Volume

	Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	KTCM22	60.50	0.24	16013	41033	-1	18.18	60.41	57.83
2	GUNKULM22	6.02	-0.05	4641	143624	-496	23.12	6.03	5.84
3	BTSM22	9.16	-0.01	3585	23977	-500	8.80	9.18	9.01
4	GULFM22	49.75	0.43	2342	9778	-199	2.61	49.79	47.74
5	CHGM22	3.85	-0.16	2111	10279	0	14.59	3.95	3.78
6	EAM22	96.99	-0.40	1656	11071	51	16.53	92.29	83.86
7	IRPCM22	3.63	0.04	1624	59183	1083	10.47	3.58	3.48
8	BANPUM22X	11.26	-0.16	1544	31357	14	13.40	11.26	10.96
9	TIPLM22	1.62	0.06	1518	25718	0	10.79	1.63	1.52
10	BEMM22	8.60	-0.01	1510	11416	1	11.98	8.62	8.37
11	WHAM22	3.32	-0.02	1503	41333	6503	8.09	3.34	3.30
12	WHAM22	3.32	-0.02	1503	41333	6503	8.09	3.34	3.30
13	ICHIM22	11.40	-0.50	1329	25683	0	7.16	11.48	11.16
14	TTBM22	1.29	-0.01	1286	89217	1545		1.29	1.26
15	CEN TELM22	39.75	0.00	1222	2656	0	10.03	41.89	39.59
16	TUM22	19.09	0.19	1206	8203	-200	10.42	18.51	16.83
17	LPNM22	4.63	0.12	1133	704	1002	6.78	4.62	4.52
18	PTTEPM22	149.89	-1.50	1092	1780	-39	14.48	153.12	147.11
19	BLANDM22	1.04	0.02	1018	69714	0	8.86	1.04	1.01
20	TASCOM22	16.46	-0.06	997	8298	0	4.27	16.53	16.07

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

DERIVATIVES TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

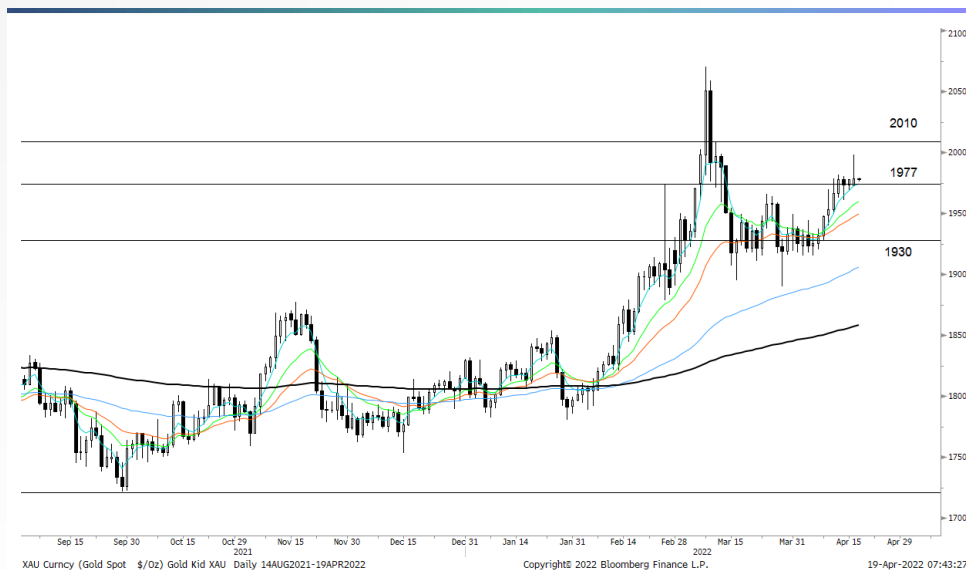
Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ระหว่างการซื้อขายขึ้นไปแตะจุดสูงสุดของวันที่ 1,998 เหรียญฯ ก่อนลดช่วงบวกลงมาปิดอยู่ที่ 1,979 เหรียญฯ ปรับเพิ่ม 4.4 เหรียญฯ จากวันก่อนหน้า โดยแรงกดดันต่อการเคลื่อนไหวของราคาทองคำมาจากการพุ่งขึ้นของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐอายุ 10 ปี และการแข็งค่าของค่าเงินดอลลาร์สหรัฐ จากคาดการณ์ธนาคารกลางสหรัฐ (เฟด) จะเร่งปรับขึ้นดอกเบี้ยในเดือน ๆ ต่อไป ท่ามกลางเงินเฟ้อในระดับสูง หนุนให้ Dollar Index ขยับขึ้น 0.3% ปิดบริเวณ 100.83 จุด โดยสัปดาห์นี้ ต้องติดตามสถานการณ์รัสเซีย-ยูเครน และการเปิดเผยข้อมูลเศรษฐกิจสหรัฐ เช่น ยอดขายบ้านมือสอง, จำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงาน และดัชนี PMI

กลยุทธ์การลงทุน

ราคา GFJ22 เมื่อคืน เพิ่มขึ้น 250 บาท ปิดที่ 31,740 บาท (1,981 เหรียญฯ) สูงกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,978 เหรียญฯ คาดราคา GFF22 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 31,500-31,900 บาท ทิศทางค่าเงินดอลลาร์แข็งค่า กดดันให้ราคาทองคำไม่สามารถผ่าน 2,000 เหรียญฯ ทำให้ฝ่ายวิจัยคงแนะนำ Trading บริเวณ 1,960-1,990 เหรียญฯ เทียบเท่า 31,400-31,880 บาท แต่หากราคาขยับขึ้นไปแตะกรอบบน แนะนำให้รอเปิด Short GFJ22 และกำหนดจุด 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	31,740	320	1.02	136	250	2
GFM22	31,710	-170	-0.53	38	223	5
GFQ22	31,900	-20	-0.06	17	7	0

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10J22	31,740	-180	-0.56	5,206	7,426	970
GF10M22	31,740	-180	-0.56	2,110	6,410	407
GF10Q22	31,770	-180	-0.56	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 แรงซื้อกลับขึ้นเหนือแนวต้านที่ \$1977 พร้อมแท่งเทียน Bullish

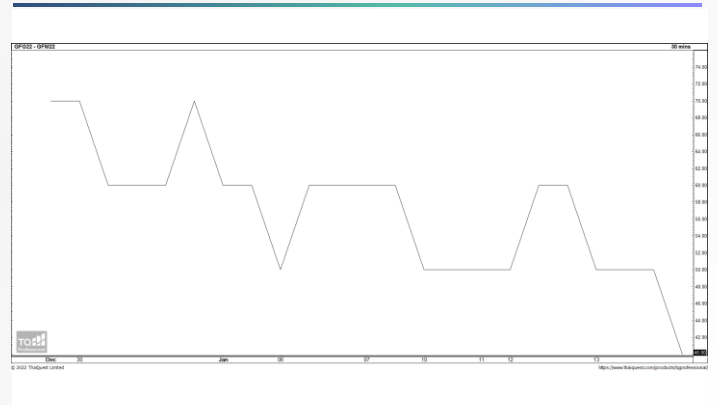
Breakout แกว่งเข้าสู่กรอบการเคลื่อนไหวที่ \$1977-\$2010

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD London AM (USD/Ounce)	FX (บาท/ USD)				
	33.00	33.25	33.50	33.75	34.00
1,850	29,019	29,239	29,458	29,678	29,898
1,880	29,489	29,713	29,936	30,160	30,383
1,910	29,960	30,187	30,414	30,641	30,868
1,940	30,431	30,661	30,892	31,122	31,353
1,970	30,901	31,135	31,369	31,603	31,838
2,000	31,372	31,609	31,847	32,085	32,322
2,030	31,842	32,083	32,325	32,566	32,807
2,060	32,313	32,558	32,802	33,047	33,292
2,090	32,783	33,032	33,280	33,528	33,777

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
31,990.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
31,940.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
31,890.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
31,840.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
31,790.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
31,740.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
31,690.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
31,640.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
31,590.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
31,540.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
31,490.00	-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
31,990.00	250.0	2,500	(210)	2,290
31,940.00	200.0	2,000	(210)	1,790
31,890.00	150.0	1,500	(210)	1,290
31,840.00	100.0	1,000	(210)	790
31,790.00	50.0	500	(210)	290
31,740.00	0.0	-	(210)	(210)
31,690.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
31,640.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
31,590.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
31,540.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
31,490.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส