

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

SET50 Futures:

การปรับลด GDP ของ IMF การเมืองในประเทศที่ร้อนแรง และงบประมาณฯ ที่อาจสะดุด กดดัน SET50 แนะนำ Short S50H20 ไม่ต่ำกว่า 1065 จุด เป้าทำกำไร 1055 จุด Cut Loss 4 จุดจากทุน

SET50 Option:

ปรับราคาเปิด Long S50H20P1100 ไปที่ 40 จุด (SET50=1070) เป้าทำกำไรที่ 50 จุด (SET50=1060) Cut Loss 3 จุดจากทุน SET50 วันนี้ถูกกดดันด้วยหลายปัจจัยลบ

Single Stock Futures:

นักลงทุนเปิด Long PTTEPH20 ได้ที่ทุน 130 บาท แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรที่ 135 บาท และ Cut Loss 128.50 บาท ราคาหุ้นน่าจะได้แรงหนุนจากราคาน้ำมันที่ยืนระดับสูง

แนะนำให้รอ Short CENTELH20 ที่ 23.80 บาท เป้าทำกำไรที่ 23 บาท และ Cut Loss 24.40 บาท กระแสความกังวลเรื่องการแพร่ระบาดของโรคปอดอักเสบจากจีน กดดันคราคาหุ้น

Gold Futures:

สถานะ Short GFG20 ทุน 22500 บาท ปัจจุบันมีผลขาดทุน 60 บาท/บาททองคำ แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไรอยู่ที่ 1540\$ เทียบเท่า 22230 บาท Cut Loss 100 บาทจากทุน

สถานะของนักลงทุน

All Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	173,803	107,520	66,283	66,100	40,420	307,030
Foreign	45,393	103,009	-57,616	-54,732	-41,712	326,651
Retail	234,046	242,713	-8,667	-11,368	1,292	-633,681

SET50 Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	28,244	22,714	5,530	10,358	7,951	-16,523
Foreign	32,635	60,110	-27,475	-17,391	-9,321	-5,322
Retail	102,002	80,057	21,945	7,033	1,370	21,845

Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	138,468	77,211	61,257	57,289	33,537	319,713
Foreign	9,772	39,853	-30,081	-38,391	-35,680	353,522
Retail	115,065	146,241	-31,176	-18,898	2,143	-673,235

Metal Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	6,031	6,489	-458	416	356	1,955
Foreign	2,986	3,046	-60	2,882	999	-29,298
Retail	16,060	15,542	518	-3,298	-1,355	27,343

Call Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	365	575	-210	82	-150	-687
Foreign	82	16	66	125	408	940
Retail	2,335	2,191	144	-207	-258	-176

Put Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	451	118	333	320	471	-1,620
Foreign	33	25	8	5	169	549
Retail	1,669	2,010	-341	-337	-693	984

ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

วันอังคารที่ 21 มกราคม พ.ศ. 2563

SET50 Index Futures / Option	P. 2
Single Stock Futures	P. 4
Gold Futures	P. 7

เพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่านช่องทาง Line Asia Plus Group ได้ที่: <http://bit.ly/Asiaplusgroup>

Derivatives Team	เลขทะเบียน นักวิเคราะห์
เกศศักดิ์ นวีระธรรณ	004132
ประสิทธิ์ รัตนกิจมงคล, CISA, CFA	025917
นवलพรรณ น้อยธรรณ	019994
เชนชัย พันธนาถกิจ	064045
จรรยาธรรณ จังจิรานนท์	ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

SET50 Overview

ปัจจัยต่างประเทศวันนี้ให้น้ำหนักไปที่ IMF ปรับลดประมาณการ GDP Growth โลกลงต่อเนื่องเป็นครั้งที่ 6 โดยในปีนี้อคาด GDP Growth โลกขยายตัว 3.3%yoy ลดลงจากเดิมที่ 3.4%yoy และปี 2564 ขยายตัว 3.4% จากเดิม 3.6% ทั้งนี้ IMF ยังเน้นย้ำว่ายังมีความเสี่ยงที่การขยายตัวเศรษฐกิจโลกจะฟื้นตัวช้าจากความกังวลการกีดกันทางการค้า ความเสี่ยงภูมิรัฐศาสตร์ที่สูงขึ้นในตะวันออกกลาง ขณะที่ปัจจัยในประเทศยังมีแรงกดดันทางด้านเมืองที่วันนี้ศาลรัฐธรรมนูญวินิจฉัยคำร้องให้ยุบพรรคอนาคตใหม่ในกรณีมีพฤติกรรมการล้มล้างการปกครองฯ ประกอบกับความเสียงต่อการผ่านร่างงบประมาณ 2563 ที่มีโอกาสล่าช้าหลังจากมีประเด็นร้องเรียนต่อกรณี ส.ส. เสียบบัตรลงคะแนนเสียงแทนกัน นอกจากนี้ยังมีประเด็นกดดันอื่นๆ จากความกังวลต่อการระบาดของไวรัสโคโรนาพันธุ์ใหม่มีโอกาสติดผู้คนที่ซึ่งจะกดดันต่อหุ้นกลุ่มท่องเที่ยว โรงแรม ขนส่งทางอากาศและ AOT อีกทั้งยังมีโอกาสถูกแรง Sell on Fact ของหุ้นกลุ่มอสังหาริมทรัพย์ หลังจากการมาตรการผ่อนปรน LTV ที่ออกมาไม่ได้ดีกว่าที่ตลาดคาด สภาพแวดล้อมวันนี้ให้น้ำหนักไปทางลบข้างต้นคาด SET50 Index วันนี้ปรับฐานตามกรอบ 1060 - 1070 จุด

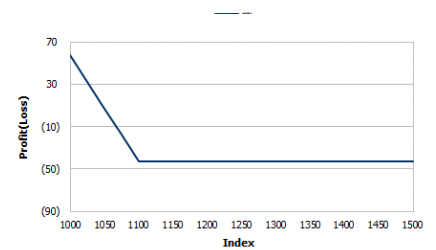
	SET50	S50H20	S50M20
แนวรับ	1060	1055	1050
แนวต้าน	1070	1068	1063

SET50 Index Futures

Direction Trading: การปรับลด GDP ของ IMF การเมืองในประเทศที่ร้อนแรง และงบประมาณฯ ที่อาจสะดุด กดดัน SET50 แนะนำ Short S50H20 ไม่ต่ำกว่า 1065 จุด เป้าทำกำไร 1055 จุด Cut Loss 4 จุดจากทุน

Spread Trading: วานนี้ นักลงทุนน่าจะเปิดสถานะ Short Spread S50H20M20 ได้ที่ -3.70 จุด ปัจจุบันมีกำไร 0.5 จุด แนะนำให้ถือต่อเพื่อคาดหวังทำกำไรจาก Spread ลู่เข้าค่าทางทฤษฎีที่ -7.00 จุด

SET50 Option : ปรับราคาเปิด Long S50H20P1100 ไปที่ 40 จุด (SET50=1070) เป้าทำกำไรที่ 50 จุด (SET50=1060) Cut Loss 3 จุดจากทุน SET50 วันนี้ถูกกดดันด้วยหลายปัจจัยลบ



หมายเหตุ : ตัวคูณดัชนีเท่ากับ 200 บาท ต่อ 1 จุดของดัชนี

	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	1071.80	11.0289	14.9456

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
S50H20C1150	1.50	-0.50	> 1151.5	0.00	1.50	0.07	2.78	160	4532	10.82	0.06	45.97	0.07
S50H20C1125	3.50	-1.40	> 1128.5	0.00	3.50	0.05	6.02	366	3761	10.51	0.14	42.29	0.05
S50H20C1100	8.30	-2.20	> 1108.3	0.00	8.30	0.03	11.83	955	5403	10.35	0.27	35.30	0.03
S50H20C1075	17.10	-3.50	> 1092.1	0.00	17.10	0.02	21.15	1003	3862	10.58	0.46	28.84	0.02
S50H20C1050	30.40	-5.30	> 1080.4	21.80	8.60	0.01	34.55	53	1329	10.13	0.67	23.50	0.01

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
S50H20P1150	80.80	4.80	< 1069.2	78.20	2.60	0.00	82.93	1	58	11.66	-0.91	-12.90	0.00
S50H20P1125	59.50	6.60	< 1065.5	53.20	6.30	-0.01	61.22	7	151	11.19	-0.84	-15.86	-0.01
S50H20P1100	38.20	5.20	< 1061.8	28.20	10.00	-0.01	42.09	51	731	10.19	-0.73	-20.89	-0.01
S50H20P1075	22.20	3.30	< 1052.8	3.20	19.00	-0.02	26.46	481	2036	10.57	-0.54	-25.97	-0.02
S50H20P1050	11.00	2.00	< 1039	0.00	11.00	-0.03	14.91	573	4413	10.57	-0.34	-32.37	-0.03

ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สรุปการซื้อขาย
SET50	1081.22	2.35	0.22%	17/01/2020

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50F20	1078.50	3.8	0.4%	54	423	27
S50G20	1079.90	3.4	0.3%	6	25	3
S50H20	1077.00	4.2	0.4%	119,198	309,023	3,596
S50M20	1072.10	4.0	0.4%	10,090	22,472	-379
S50U20	1066.00	4.0	0.4%	1,613	8,434	20
S50Z20	1064.90	4.0	0.4%	519	2,014	-4

SET50 Futures Long(Short) : ลักษณะ	สถานะ Long(Short)		
	Long	Short	Net
สถาบัน	25,096	20,268	4,828
ต่างชาติ	41,069	30,985	10,084
รายย่อย	65,315	80,227	-14,912

	2 วัน		2 สัปดาห์		QTD
	Long	Short	Long	Short	
สถาบัน	1,846	-17,501	-10,095		
ต่างชาติ	28,138	-5,111	15,011		
รายย่อย	-29,984	22,612	-4,916		

ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

Symbol	เป้าหมาย Spread ธีรย์โกก - ธีรย์โกก					
	S50F20	S50G20	S50H20	S50J20	S50K20	S50M20
	ณ 30 ม.ค.63	ณ 27 ก.พ.63	ณ 30 มี.ค.63	ณ 29 เม.ย.63	ณ 28 พ.ค.63	ณ 29 มิ.ย.63
S50F20						
S50G20	-2.15					
S50H20	-6.00	-3.85				
S50J20	-12.72	-10.57	-6.73			
S50K20	-14.12	-11.97	-8.13	-1.39		
S50M20	-12.99	-10.84	-7.00	-0.25	1.11	

* สมมติฐานอัตราดอกเบี้ยนโยบายระหว่าง พ.ย. - มิ.ย. 63 เท่ากับ 1.25%

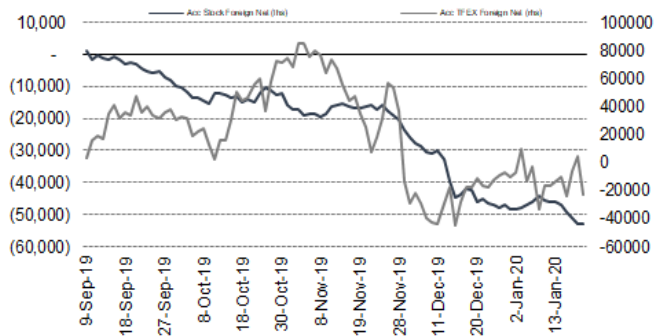
ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

คำนวณกำไรขาดทุนของ SET50 Futures

ราคาปิด Futures	chg (จุด) เทียบกับ	นักลงทุนรายย่อย (ค่าธรรมเนียม 87.10 บาท/สัญญา/ข้าง)		
		กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
1,074.70	5.0	1,000	(186)	814
1,073.70	4.0	800	(186)	614
1,072.70	3.0	600	(186)	414
1,071.70	2.0	400	(186)	214
1,070.70	1.0	200	(186)	14
1,069.70	0.0	0.0	(186)	(186)
1,068.70	-1.0	(200)	(186)	(386)
1,067.70	-2.0	(400)	(186)	(586)
1,066.70	-3.0	(600)	(186)	(786)
1,065.70	-4.0	(800)	(186)	(986)
1,064.70	-5.0	(1,000)	(186)	(1,186)

ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศในตราสารทุน และ SET50 Futures



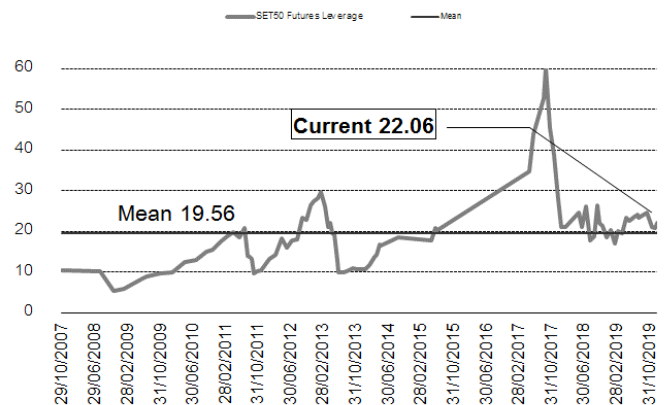
ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

SET50 ที่ระดับค่า PER ต่างๆ

(เท่า)	ม.ค.62E	มี.ค.62E	มิ.ย.62E	ก.ค.62E	ส.ค.62E	ก.ย.62E	ธ.ค.62E
PER 12	863	876	895	902	908	915	934
PER 13	935	949	970	977	984	991	1,012
PER 14	1,007	1,022	1,045	1,052	1,060	1,067	1,090
PER 15	1,079	1,095	1,119	1,127	1,135	1,144	1,168
PER 16	1,151	1,168	1,194	1,203	1,211	1,220	1,246
PER 17	1,223	1,241	1,269	1,278	1,287	1,296	1,323
PER 18	1,295	1,314	1,343	1,353	1,363	1,372	1,401
PER 19	1,367	1,387	1,418	1,428	1,438	1,448	1,479

ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

ระดับ Leverage ของ SET50 Futures



ที่มา : Thailand Clearing House, ฝ่ายวิจัย ASPS

Single Stock Futures

Short CENTELH20

กระแสความกังวลเรื่องการแพร่ระบาดของโรคปอดอักเสบจากจีนที่เริ่มขยายวงกว้างและมีโอกาสติดต่อกับคนผู้คนคาดว่าจะเป็แรงกดดันต่อราคาหุ้นในวันนี้ ประกอบกับหากประเมินทิศทางผลการดำเนินงาน 4Q62 ที่ยังไม่โดดเด่น อีกทั้งปี 2563 ยังถูกผลกระทบจากการเปลี่ยนมาตรฐานบัญชี IFRS16 เรื่องสัญญาเช่าดำเนินงานซึ่งจะเป็นความเสี่ยงต่อการปรับประมาณการ

ส่วนภาพทางเทคนิค ราคาเคลื่อนไหวอยู่ในแนวโน้มขาลงอย่างต่อเนื่องล่าสุดมีการหลุดแนวรับบริเวณ 23.90 บาทภาพรวมจึงมองว่าเป็นการเปิด Downside ไปแนวรับถัดไปที่ 22.90 บาท

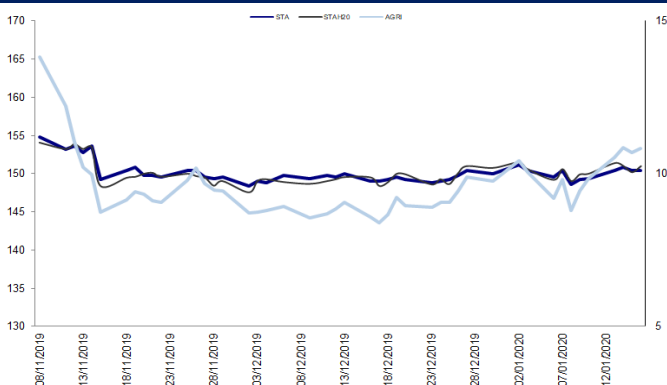
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำให้รอ Short CENTELH20 ที่ 23.80 บาท เป้าทำกำไรที่ 23 บาท และ Cut Loss 24.40 บาท

Future								Underlying			
Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 62F	PBV 62F	EPS GROWTH 62F
CENTELH20	23.76	-0.04	23.86	213	2080	-10	6.33	47.06%	15.81	1.99	16.43%

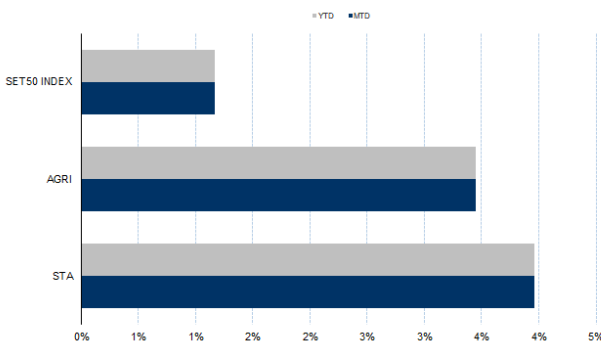
ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

Historical Price



ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

Historical Return



ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures

ราคาปิด future	นักลงทุนรายย่อย				
	chg (จุด) เทียบกับราคา	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม +VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ	
10.75	0.5	500	2.08	498	
10.65	0.4	400	2.08	398	
10.55	0.3	300	2.08	298	
10.45	0.2	200	2.08	198	
10.35	0.1	100	2.08	98	
10.25	0.0	-	2.08	(2)	
10.15	-0.1	(100)	2.08	(102)	
10.05	-0.2	(200)	2.08	(202)	
9.95	-0.3	(300)	2.08	(302)	
9.85	-0.4	(400)	2.08	(402)	
9.75	-0.5	(500)	2.08	(502)	

ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

Technical Chart



ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

Single Stock Futures

Long PTTEPH20

เชื่อว่าราคาหุ้น PTTEP มีโอกาสปรับขึ้น โดยแรงหนุนจากราคาน้ำมันดิบที่ปรับขึ้นกว่า 2% โดยมีสาเหตุจากสงครามการเมืองในประเทศลิเบียที่จะกระทบต่อกำลังการผลิตของประเทศ 7 แสตนบาร์เรลต่อวัน นอกจากนี้เชื่อว่า PTTEP ยังเป็นหุ้นที่น่าสนใจในการเก็งกำไรผลประกอบการ 4Q62 ซึ่งฝ่ายวิจัยคาดว่าจะทำกำไรสุทธิ 1.2 หมื่นล้านบาท เพิ่มขึ้น 11.5%qoq จากปริมาณและราคาขายผลิตภัณฑ์ที่สูงขึ้น โดยฝ่ายวิจัยประเมินมูลค่าพื้นฐานไว้ที่ 170.00 บาท มี Upside รวบรวม 30%

ส่วนทางเทคนิคราคายังอยู่ในโหมด Sideway Up และปัจจุบันผ่านการพักตัวมาในระดับหนึ่งแล้ว โดยล่าสุดได้เกิดสัญญาณบวกจากการกลับมายืนเหนือ EMA 10 วัน จึงคาดการณ์มีโอกาสกลับไปตามแนวโน้มเดิมโดยมีแนวต้านที่ 138.00 บาท

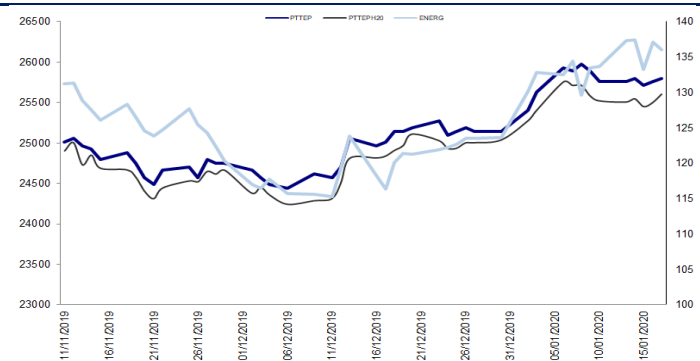
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำรอ Long PTTEPH20 ที่ 130 บาท เป้าทำกำไรที่ 135 บาท และ Cut Loss 128.50 บาท

Future								Underlying			
Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 62F	PBV 62F	EPS GROWTH 62F
PTTEPH20	129.75	-2.25	132.32	667	1615	-158	13.89	28.79%	10.51	1.07	5.53%

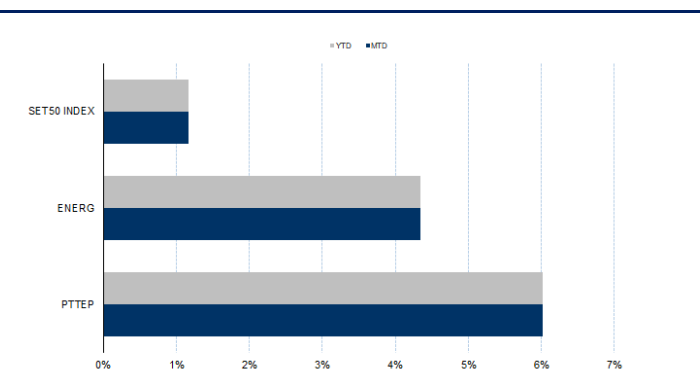
ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

Historical Price



ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

Historical Return



ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures

ราคาปิด future	chg (จุด) เทียบกับราคา	นัทลงทุนรายย่อย			
		กำไร (บาท)	ค่าธรรมเนียม +VAT (บาท)	กำไรสุทธิ (บาท)	
11.00	0.5	500	2.08	498	
10.90	0.4	400	2.08	398	
10.80	0.3	300	2.08	298	
10.70	0.2	200	2.08	198	
10.60	0.1	100	2.08	98	
10.50	0.0	-	2.08	(2)	
10.40	-0.1	(100)	2.08	(102)	
10.30	-0.2	(200)	2.08	(202)	
10.20	-0.3	(300)	2.08	(302)	
10.10	-0.4	(400)	2.08	(402)	
10.00	-0.5	(500)	2.08	(502)	

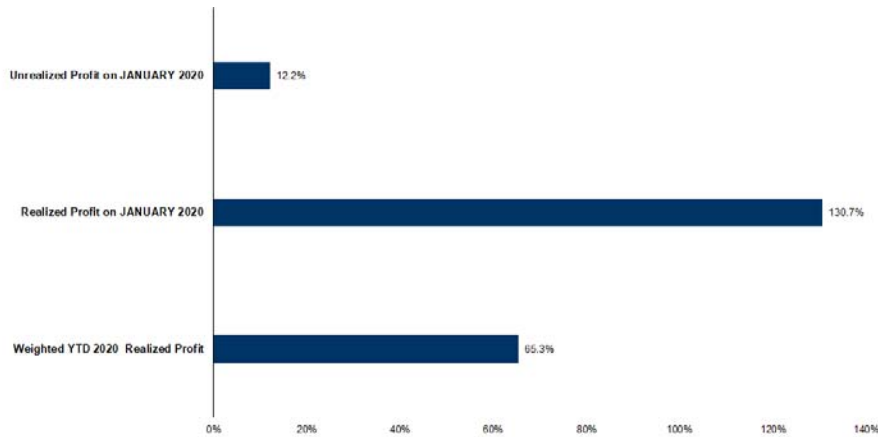
ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

Technical Chart



ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

Tracking Performance



หมายเหตุ: การคำนวณผลตอบแทนจะอิงตามเงินต้นรวม ณ วันที่เริ่มทำการซื้อขาย เป็นผลตอบแทนรวมตั้งแต่เริ่มทำการซื้อขายจนถึงวันที่ปิดสถานะทำการซื้อขาย

ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

Top 20 Most Active Volume

Top 20 Most Active Volume

No.	Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	WHAH20	3.32	0.00	3.33	56601	58479	-25432	12.48	3.77	3.30
2	TMBH20X	1.51	0.00	1.51	13835	59402	-12641	6.06	1.57	1.50
3	BEAUTYH20	2.82	0.00	2.83	7332	11231	1265	6.18	3.14	2.20
4	IRPCH20	3.25	-0.03	3.29	4987	116289	174	7.85	3.58	3.24
5	SCBH20	102.75	0.75	102.24	4546	3282	-30	10.74	117.18	102.10
6	TRUEH20	4.04	0.00	4.05	3702	51703	1297	7.09	4.40	3.97
7	KCEH20	21.89	0.19	21.75	3486	10157	1884	8.52	22.06	19.49
8	BTSH20	13.53	-0.07	13.63	3116	27090	2694	16.27	13.59	13.26
9	JASH20	5.03	-0.02	5.06	3081	124241	3004	4.43	5.12	4.93
10	ITDH20	1.65	0.03	1.62	2936	12089	1840	8.53	1.76	1.58
11	QHH20	2.61	-0.01	2.63	2501	15172	-499	17.24	2.68	2.60
12	KTBH20	16.20	0.10	16.14	2359	7016	427	17.65	16.46	16.16
13	CBGH20	85.55	-0.95	86.70	2025	19319	-1272	7.61	85.56	82.90
14	BBLH20	151.09	1.09	150.35	2010	7325	-178	13.71	157.45	150.32
15	CPFH20	30.55	0.05	30.57	1883	43850	661	12.35	30.70	28.42
16	AMATAH20	18.88	0.18	18.74	1833	4213	-613	7.24	19.69	18.61
17	STECH20	15.76	-0.14	15.94	1683	9369	-709	5.30	16.17	14.75
18	BLANDH20	1.32	0.02	1.30	1616	59635	609	11.40	1.36	1.30
19	SPALIH20	17.62	-0.38	18.04	1612	2260	-1	9.47	17.96	16.88
20	KBANKH20	135.53	0.53	135.32	1494	2779	-799	10.01	143.92	130.37

ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

Gold Futures

ตลาดทองคำสหรัฐเมื่อคืน ปิดทำการเนื่องในวันมาร์ติน ลูเธอร์ คิง จูเนียร์ ขณะที่ตลาดทองคำ spot เคลื่อนไหวในกรอบแคบ ปรับเพิ่ม 3.6 เหรียญฯ ปิดที่ 1,560.3 เหรียญฯ เนื่องจากไร้ปัจจัยใหม่เข้ามาขับเคลื่อนอย่างมีนัยฯ โดย Dollar Index ปิดใกล้เคียงวันก่อนที่ระดับ 97.6 จุด สำหรับสัปดาห์นี้มีหลายประเด็นต้องติดตาม อาทิเช่น การประชุมธนาคารกลางยุโรป (ECB) ในวันพฤหัสบดี รวมถึงการรายงานตัวเลขเศรษฐกิจสหรัฐตลอดสัปดาห์ ได้แก่ ดัชนีราคาที่อยู่อาศัย, ยอดขายบ้านมือสอง และจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ เป็นต้น

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFG20 เมื่อคืน ปิดทรงตัวที่ 22,560 บาท เทียบเท่า 1,562.9 เหรียญฯ สูงกว่าราคาทองคำตลาด Spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,561 เหรียญฯ คาดราคาทองคำ GFG20 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 22,450-22,650 บาท ฝ่ายวิจัยคงแนะนำให้นักลงทุนที่มีสถานะ Short GFG20 ต้นทุนเฉลี่ย 22,500 บาท แม้ปัจจุบันขาดทุน 60 บาท/บาททองคำ คงถือครองสถานะไว้ต่อไป โดยมีเป้าหมายทำกำไรที่ 1,540 เหรียญฯ หรือ 22,230 บาท และกำหนดจุด cut loss ไว้ 100 บาท เพื่อป้องกันความเสี่ยงหากราคาเคลื่อนไหวผิดคาด

Gold Futures

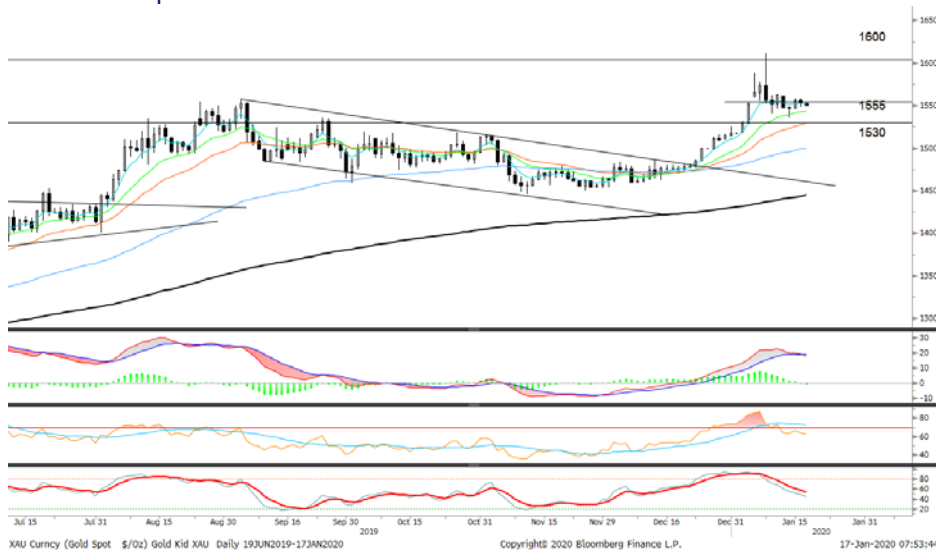
FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GFG20	22,560	0	0.00	356	902	-16
GFJ20	22,640	0	0.00	49	516	-3
GFM20	22,720	0	0.00	22	234	-16

Mini Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GF10G20	22,560	10	0.00	4,274	19,584	-824
GF10J20	22,620	-10	-0.04	1,356	15,062	251
GF10M20	22,700	-10	-0.04	417	5,475	31

หมายเหตุ : ราคาปิดของ Gold Futures (Night Session) Settle ณ เวลา 22.00 น. และปริมาณการซื้อขายเกิดขึ้นในช่วงเวลา 19.30-22.30 น.
ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

เทคนิก Gold Spot



ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

GOLD Technical: ราคาทองคำล่าสุดเริ่มเห็นการฟื้นตัวระยะสั้นจากแนวรับ \$1530 คาดเห็นการกลับมาแกว่งตัวในกรอบ \$1555-\$1600 ทั้ง indicator ต่างๆ ยังส่งสัญญาณลบ หากราคาหลุดแนวรับ \$1530 จะเป็นการยืนยันสัญญาณลบดังกล่าว

ASPS Gold Valuation Matrix (เหรียญ/ทройออนซ์)

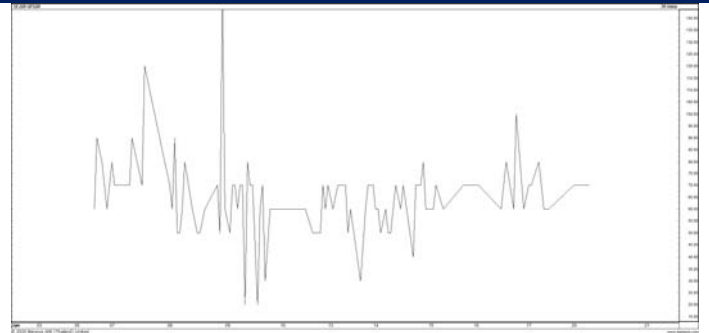
	←			Dollar Index						→		
	93	94	95	96	97	98	99	100	101	102	103	
Nymex (USD/Barrel)	40	1,617.66	1,589.21	1,560.76	1,532.31	1,503.86	1,475.41	1,446.96	1,418.52	1,390.07	1,361.62	1,333.17
	43	1,616.71	1,588.26	1,559.81	1,531.36	1,502.91	1,474.47	1,446.02	1,417.57	1,389.12	1,360.67	1,332.22
	46	1,615.76	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

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD Londin AM (USD/Ounce)	FX (บาท/ USD)				
	30.00	30.25	30.50	30.75	31.00
1,520	21,675	21,856	22,036	22,217	22,397
1,540	21,960	22,143	22,326	22,509	22,692
1,560	22,245	22,431	22,616	22,802	22,987
1,580	22,531	22,718	22,906	23,094	23,282
1,600	22,816	23,006	23,196	23,386	23,576
1,620	23,101	23,293	23,486	23,678	23,871
1,640	23,386	23,581	23,776	23,971	24,166
1,660	23,671	23,869	24,066	24,263	24,460
1,680	23,957	24,156	24,356	24,555	24,755

ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

Spread ระหว่าง GFJ20 – GFG20



ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

คำนวณกำไรขาดทุนของ Gold Futures

บัลลงกุนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
22,810.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
22,760.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
22,710.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
22,660.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
22,610.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
22,560.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
22,510.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
22,460.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
22,410.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
22,360.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
22,310.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

บัลลงกุนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
22,810.00	250.0	2,500	(210)	2,290
22,760.00	200.0	2,000	(210)	1,790
22,710.00	150.0	1,500	(210)	1,290
22,660.00	100.0	1,000	(210)	790
22,610.00	50.0	500	(210)	290
22,560.00	0.0	-	(210)	(210)
22,510.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
22,460.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
22,410.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
22,360.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
22,310.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา : ฝ่ายวิจัย ASPS