DERIVATIVE TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

2 มิถุนายน 2565

SET50 FUTURES:

แนะนำ Trading S50M22 ในกรอบ 990-1005 จุด และเปิด Short ที่กรอบบน คาด SET50 Index พักฐานจากความกังวลเงินเฟ้อฯกดดันการเติบโตเศรษฐกิจ

SET50 OPTION:

แนะนำรอ Long S50M22P1000 ที่ 10 จุด (SET50=1005) เป้า 25 จุด (SET50=990) และ Cut Loss 3 จุด คาด SET50 พักฐาน

SINGLE STOCK FUTURES:

แนะนำ Long BLAM22 บริเวณ 39.50 บาท เป้าทำกำไร 42.00 บาท และ Cut Loss 0.75 บาทจากทุน หนุนจากทิศทาง Bond Yield ที่กลับมาเร่งตัว

แนะนำรอ Long MAJORM22 ที่ 20.90 บาท เป้าทำกำไร 21.50 บาทและ Cut Loss 0.3 บาท หนุนจากความต่อเนื่องตามการเปิดกิจกรรมทางเศรษฐกิจ

GOLD FUTURES:

การดีดตัวขึ้นของราคาทองคำวานนี้ ทำให้สถานะ Short GFM22 ทุนเฉลี่ย 30170 บาท ปิดสถานะและรับรู้กำไร 100 บาท วันนี้แนะนำ Trading กรอบ 29910-30400 บาท ($1830-1860) คาดราคายังผันผวนตามความกังวลเรื่องดอกเบี้ย

DOLLAR INDEX เริ่มกลับมาแข็งค่า

ที่มา : สายงานวิจัย บล.เอเซีย พลัส

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

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องดำเนินการได้อย่างรวดเร็วขึ้น ฝ่ายวิจัย จึงเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันทำการผ่าน 2 ช่องทาง เพื่อให้นักลงทุนสามารถปรับเปลี่ยนกลยุทธ์ ได้มีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น คือ

* แอปพลิเคชั่น “ASP Smart”

* Telegram “Asia plus group”

Follow now

Asia Plus Group

RESEARCH DIVISION

บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส

เทิดศักดิ์ ทวีธีระธรรม
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจกมล, CISA, CFA
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นวลพรรณ น้อยรัชชุกร
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันทาธนากิจ
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธร เกิดเนตร
ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

ข้อมูลในเอกสารฉบับนี้ รวบรวมมาจากแหล่งข้อมูลที่น่าเชื่อถือ อย่างไรก็ดี บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด ไม่สามารถที่จะยืนยันหรือรับรองความถูกต้องของข้อมูลเหล่านี้ได้ ไม่ว่าประการใดๆ บทวิเคราะห์ในเอกสารนี้ จัดทำขึ้นโดยอ้างอิงหลักเกณฑ์ทางวิชาการเกี่ยวกับหลักการวิเคราะห์ และมิได้เป็นการชี้นำ หรือเสนอแนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ การตัดสินใจซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ ของผู้อ่าน ไม่ว่าจะเกิดจากการอ่านบทความในเอกสารนี้หรือไม่ก็ตาม ล้วนเป็นผลจากการใช้วิจารณญาณของผู้อ่าน โดยไม่มีส่วนเกี่ยวข้องหรือพันธะผูกพันใดๆ กับ บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด ไม่ว่ากรณีใด

สถานะของนักลงทุน

All Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	108,048	104,439	3,609	14,104	-21,975	193,438
Foreign	108,041	94,145	13,896	30,049	68,506	147,719
Retail	191,657	209,162	-17,505	-44,153	-46,531	-341,157

SET50 Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	30,162	32,620	-2,458	-5,432	-11,489	-9,700
Foreign	69,009	55,061	13,948	33,574	71,928	122,955
Retail	69,692	81,182	-11,490	-28,142	-60,439	-113,255

Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	67,058	60,627	6,431	17,795	-1,925	251,506
Foreign	15,442	10,153	5,289	2,506	1,769	27,436
Retail	68,626	80,346	-11,720	-20,301	156	-278,942

Metal Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	4,963	7,807	-2,844	-3,035	-4,054	-4,082
Foreign	23,110	28,145	-5,035	-5,902	-5,067	-8,444
Retail	27,497	19,618	7,879	8,937	9,121	12,526

Call Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	279	243	36	104	239	-1,744
Foreign	101	217	-116	20	-145	1,269
Retail	3,284	3,204	80	-124	-94	475

Put Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	176	71	105	221	-4	1,207
Foreign	234	168	66	86	155	4,867
Retail	4,494	4,665	-171	-307	-151	-6,074

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

SET50 OVERVIEW

ความกังวลต่อเงินเฟ้อที่สร้างแรงกดดันต่อการเติบโตของเศรษฐกิจกลับมาสร้างแรงกดดันต่อตลาดหุ้นต่างประเทศอีกครั้ง เริ่มจากฝั่งยุโรปวานนี้การรายงานดัชนี PMI ภาคการผลิตเดือน พ.ค. ที่ 54.6 ต่ำสุดนับตั้งแต่ ธ.ค. 2020 ที่อยู่ที่ 54.9 หลังจากวันก่อนรายงานเงินเฟ้อฯขยายตัว 8.1%yoy ทำจุดสูงสุดเป็นประวัติการณ์ สร้างแรงกดดันต่อตลาดหุ้นยุโรปติดลบ 0.7 ถึง 1% ส่วนฝั่งสหรัฐฯแม้การรายงานดัชนี PMI ภาคการผลิตโดยสถาบัน ISM เดือน พ.ค. และการตัวเลขการเปิดรับสมัครงานที่ยังแข็งแกร่ง แต่นักลงทุนตีความไปที่ผลที่ตามมาซึ่งจะทำให้เงินเฟ้อยังทรงตัวในระดับสูง ทำให้การดำเนินนโยบายเชิงรุกของ FED ยังมีต่อไป กดดันตลาดหุ้นสหรัฐฯวานนี้ปรับลงในช่วง -0.5 ถึง – 0.7% สวนทางเม็ดเงินมีแนวโน้มไหลเข้าสู่สินทรัพย์ปลอดภัยหนุน Dollar Index แข็งค่า ที่อาจส่งผลต่อการชะลอการไหลเข้าของ Fund Flow ต่างชาติ ส่วนปัจจัยในประเทศมีสัญญาณบวกจากการเปิดประเทศหลังการรายงานนักท่องเที่ยวเดือน พ.ค. แตะระดับ 9 แสนราย ทำให้ 5M65 จำนวนนักท่องเที่ยวรวม 1.9 ล้านราย หากอ้างอิงคาดการณ์จำนวนนักท่องเที่ยวโดย ททท. ช่วง 3Q65 และ 4Q65 ที่จะมีนักท่องเที่ยวเข้ามา 5 แสนราย/เดือนและ 1 ล้านราย/เดือน หมายความว่าจำนวนนักท่องเที่ยวอยู่ที่ 6.6 ล้านราย ซึ่งถือว่ามี Upside ส่วนเพิ่มต่อภาคการท่องเที่ยว แต่อย่างไรก็ตามผลต่อแรงขับเคลื่อนดัชนียังไม่มากภายใต้ปัจจัยแวดล้อมที่น้ำหนักในทางลบมากกว่าจึงคาด SET50 Index วันนี้พักฐานในกรอบ 990-1005 จุด

SET50 INDEX FUTURES

Direction Trading: แนะนำ Trading S50M22 ในกรอบ 990-1005 จุดและเปิด Short ที่กรอบบน คาด SET50 Index พักฐานจากความกังวลเงินเฟ้อฯกดดันการเติบโตเศรษฐกิจ

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50U22 ลบด้วย S50M22 ณ วันที่ 29 มิ.ย. 2565 จะเท่ากับ -8.45 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -7.80 จุด ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: แนะนำรอ Long S50M22P1000 ที่ 10 จุด (SET50=1005) เป้า 25 จุด (SET50=990) และ Cut Loss 3 จุด คาด SET50 พักฐาน

	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	990	1005
S50M22	990	1005

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยจึงเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ

* แอปพลิเคชั่น “ASP Smart”

* Telegram “Asia plus group”

Follow now

Asia Plus Group

	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	1002.24	12.17578	9.844868

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
S50M22C1050	1.50	0.10	> 1051.5	0.00	1.50	4.91%	1.44	632	9121	12.68	0.09	58.52	0.0
S50M22C1025	4.90	0.30	> 1029.9	0.00	4.90	2.76%	5.32	1170	8919	12.07	0.25	50.17	0.0
S50M22C1000	15.00	1.40	> 1015	2.24	12.76	1.27%	14.58	388	7266	12.60	0.52	34.68	0.0
S50M22C975	32.10	2.00	> 1007.1	27.24	4.86	0.48%	30.69	172	5495	13.81	0.76	23.73	0.0
S50M22C950	53.60	2.30	> 1003.6	52.24	1.36	0.14%	52.21	63	2086	15.30	0.89	16.68	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
S50M22P1050	50.00	-4.50	< 1000	47.76	2.24	-0.22%	50.18	1	165	14.28	-0.87	-17.51	0.0
S50M22P1025	28.90	-2.80	< 996.1	22.76	6.14	-0.61%	29.07	90	984	12.92	-0.75	-25.85	0.0
S50M22P1000	14.00	-1.50	< 986	0.00	14.00	-1.62%	13.35	431	3128	13.22	-0.48	-34.25	0.0
S50M22P975	5.90	-0.90	< 969.1	0.00	5.90	-3.31%	4.46	937	5550	14.41	-0.25	-41.97	0.0
S50M22P950	2.60	-0.70	< 947.4	0.00	2.60	-5.47%	0.99	910	7054	16.53	-0.12	-46.74	-0.1

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 INDEX

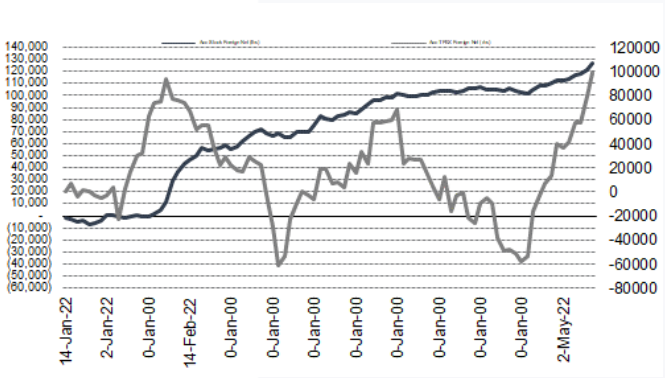
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สรุปการซื้อขาย
SET50	1002.24	0.00	0.00%	1/6/22

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50J22	984.23	0.0	0.0%	70	41	0
S50K22	996.67	0.0	0.0%	26	160	0
S50M22	1001.10	3.1	0.3%	144,414	383,172	-5,449
S50U22	993.60	2.7	0.3%	14,788	56,517	1,324
S50Z22	991.60	2.4	0.2%	7,341	21,337	400
S50H23	986.80	2.8	0.3%	2,302	6,717	48

SET50 Futures Long(Short) : สัญญา				สะสม Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	1 เดือน
สถาบัน	30,162	32,620	-2,458	-5,432	-15,311	-9,700
ต่างชาติ	69,009	55,061	13,948	33,574	116,437	122,955
รายย่อย	69,692	81,182	-11,490	-28,142	-101,126	-113,255

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 FUTURES



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คาดการณ์ SPREAD ณ สิ้นเดือนจาก ASPS MODEL

	เป้าหมาย Spread ซีรีย์ใกล้ - ซีรีย์ใกล้					
	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. เอเซีย พลัส

SET50 ที่ระดับค่า PER ต่างๆ

SET 50 Sensitivity

(เท่า)	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. เอเซีย พลัส

SINGLE STOCK FUTURES

Long BLAM22

แนวโน้มกำไรสุทธิปี 2565 คาดการณ์จะปรับเพิ่มขึ้น 18% yoy จากธุรกิจประกันฟื้นตัว ส่วนกำไรสุทธิงวด 2Q65 จะยังดีต่อเนื่องจากงวด 1Q65 กำหนด Fair value ปี 2565 เท่ากับ 52 บาทตามวิธี Appraisal value (ให้ส่วนเพิ่มจากคาดการณ์ Embedded Value:EV ณ สิ้นปี 2565 ราว 20%) เทียบเท่า PBV ปี 2565 ที่ 1.7 เท่า ซึ่งมีส่วนลดจากค่าเฉลี่ย PBV 10 ปี ย้อนหลังของ BLA อยู่ 0.5 SD รับปัจจัยบวกจากแนวโน้ม Bond yield ที่เป็นขาขึ้น ส่งผลบวกต่อภาพรวมธุรกิจลงทุนของบริษัทประกันชีวิต

ภาพทางเทคนิค จังหวะรีบาวน์หลังจากพักตัวเหนือเส้น EMA 200 วัน พร้อมสัญญาณบวกทางเทคนิคจากจังหวะ Higher Low ประเมินเป้าหมายทำกำไรไว้ที่ 42.00 บาท

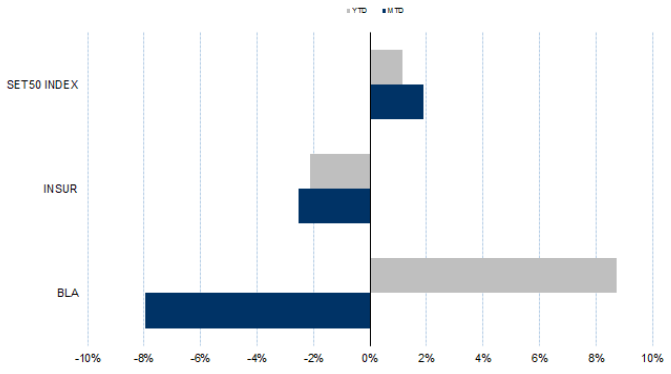
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long BLAM22 บริเวณ 39.50 บาท เป้าทำกำไร 42.00 บาท และ Cut Loss 0.75 บาทจากทุน

	Future						Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
BLAM22	40.50	-0.38	548	1104	208	21.03	-15.08%	20.44	1.51	17.61%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ STOCK FUTURES

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

Long MAJORM22

ภาพยนตร์เรื่อง Dr.Strange กระแสตอบรับดีมาก สะท้อนผ่าน Box office ในประเทศสหรัฐฯทำรายได้เป็นอันดับที่ 2 อยู่ที่ 352 ล้านเหรียญฯ นับตั้งแต่ต้นปี 2565 และกวาดรายได้ในประเทศไทยกว่า 337 ล้านบาท หลังออกฉายได้ 3 สัปดาห์ นอกเหนือจากภาพนตร์ เรื่อง Dr.Strange ยังมีเรื่อง Jurassic World, Light Year ที่น่าจะสร้างรายได้ค่อนข้างสูง และภาพยนตร์เรื่อง Top Gun กระแสตอบค่อนข้างดีจากเทรนด์ออนไลน์ใน Twitter หลังออกฉายได้เพียง 2 วัน อิงวิธี DCF ได้ Fair Value ปี 2565 เท่ากับ 25 บาท

ภาพทางเทคนิค พักตัวเหนือกรอบบน Symmetrical Triangle โดยจะมีจุดเปิด Upside หากผ่านบริเวณแนวต้านที่ 21.00 บาท ส่วนเป้าหมายทำกำไรอยู่บริเวณ 21.50 บาท

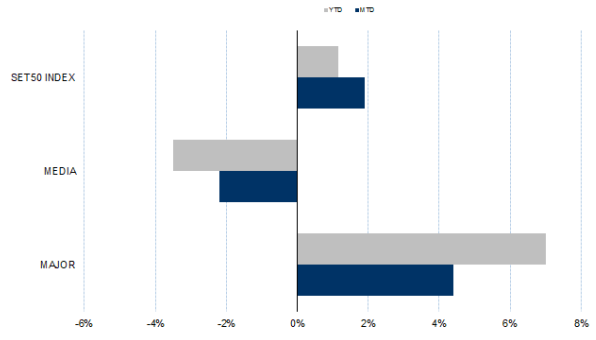
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long MAJORM22 บริเวณ 20.90 บาท เป้าทำกำไร 21.50 บาท และ Cut Loss 0.30 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
MAJORM22	21.29	-0.26	-	3016	2	8.70	21.95%	22.22	2.39	-49.43%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

HISTORICAL PRICE

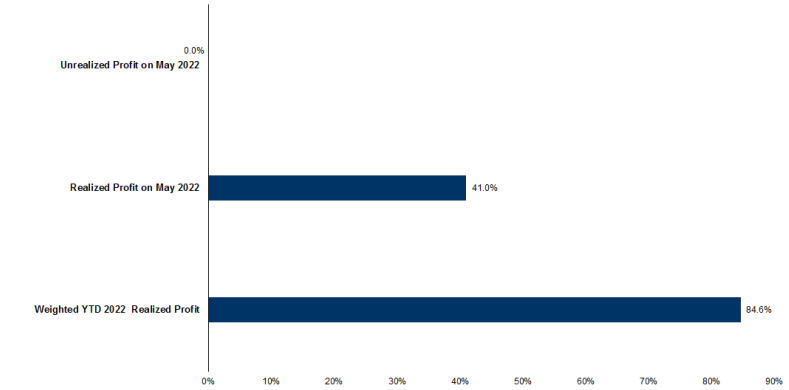


ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

TECHNICAL CHART

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

TRACKING PERFORMANCE



หมายเหตุ การคำนวณผลตอบแทนจะใช้ราคาเปิดในวันแนะนำเป็นต้นทุน เทียบกับราคาปิดล่าสุด เป็นผลตอบแทนสะสมจนกว่าจะถึงวันที่ฝ่ายวิจัยแนะนำให้ปิดสถานะทำกำไร/ตัดขาดทุน

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

TOP 20 MOST ACTIVE VOLUME

	Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	TRUEM22	4.83	-0.01	10083	130702	25714	12.74	4.67	4.44
2	WHAM22	3.35	-0.03	10082	41333	1006	8.09	3.30	3.15
3	GUNKULM22	5.79	-0.06	9111	143624	103150	21.99	5.94	5.37
4	TTBM22	1.30	0.01	2504	89217	4605		1.31	1.27
5	JASM22	3.75	0.03	2154	221604	-5005	8.16	3.62	3.37
6	GPSCM22	67.40	0.90	1950	9149	784	7.58	68.42	63.86
7	ICHIM22	11.60	-0.30	1830	25683	2350	7.28	9.75	8.29
8	BANPUM22X	11.55	-0.05	1319	31357	330	13.88	12.63	12.05
9	PTTEPM22	144.49	-0.01	1253	1780	128	14.14	167.36	156.66
10	BDMSM22	26.30	0.05	1209	1103	-99	15.70	27.34	25.80
11	KCEM22	62.26	0.26	1132	4686	501	11.65	66.47	62.68
12	AAVM22X	2.80	-0.08	1066	7306	1	8.71	2.82	2.65
13	TUM22	17.00	0.20	936	8203	2518	9.21	17.37	16.83
14	CBGM22	109.25	0.25	688	10584	6945	7.61	112.03	106.64
15	QHM22	2.26	-0.02	656	43698	-2707	12.00	2.28	2.21
16	IRPCM22	3.46	0.00	584	59183	2507	10.12	3.57	3.34
17	SPRCM22	10.00	0.00	554	8124	500	7.97	12.41	11.41
18	BLAM22	44.37	-0.38	548	1104	208	21.03	43.39	39.75
19	THANIM22	4.37	-0.03	520	23004	20	4.54	4.54	4.23
20	ESSOM22	8.77	0.12	519	9026	9	6.90	10.36	9.61

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

GOLD FUTURES

ราคาทองคำตลาดสหรัฐ เพิ่มขึ้น 9.2 เหรียญฯ ปิดที่ 1,846 เหรียญฯ จากแรงเข้าซื้อบางส่วนหลังราคาร่วงลงเกือบ 20 เหรียญฯ ในวันก่อนหน้า แต่อย่างไรก็ดีการดีดตัวขึ้นของราคาถูกจำกัดด้วยการแข็งค่าของค่าเงินดอลลาร์สหรัฐ ที่ขานรับการรายงานตัวเลขเศรษฐสหรัฐเชิงบวก นำโดยดัชนี PMI ปรับขึ้นในเดือน พ.ค. และสวนทางนักวิเคราะห์คาดลดลง หนุนให้ Dollar Index ขยับขึ้น 0.75% ปิดที่ 102.5 จุด โดยวันนี้ ต้องติดตามตัวเลขการจ้างงานภาคเอกชนและจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานของสหรัฐ ส่วนวันพรุ่งนี้จะมีการรายงานข้อมูลการจ้างงานนอกภาคเกษตร ฯลฯ ซึ่งจะมีผลต่อการเคลื่อนไหวของตลาดเงินและตลาดทองคำในระยะต่อไป

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GFM22	30,180	290	0.97	92	277	6
GFQ22	30,220	300	1.00	62	140	16
GFV22	30,240	310	1.04	23	41	-16

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GF10M22	30,140	220	0.74	3,974	9,393	923
GF10Q22	30,170	230	0.77	1,284	4,771	27
GF10V22	30,190	220	0.73	814	2,254	96

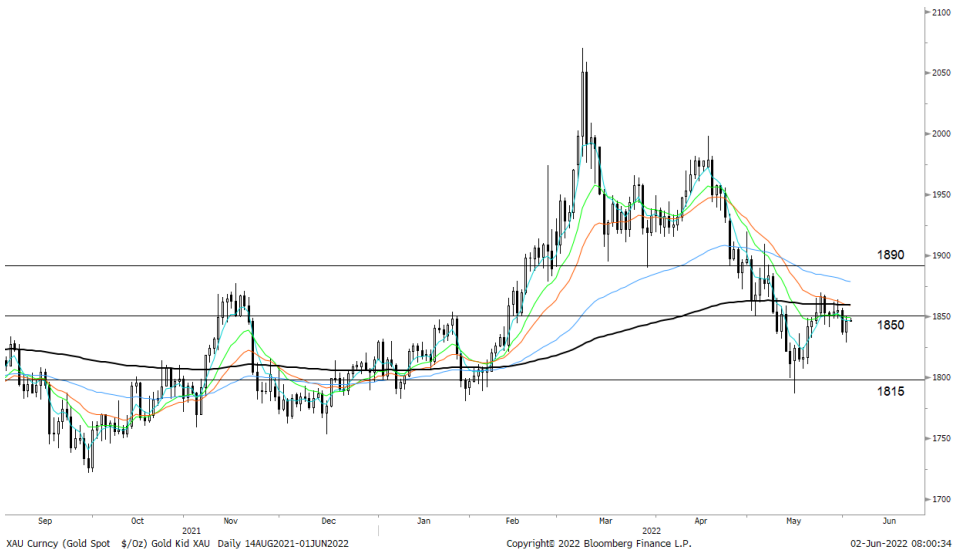
ที่มา: สายงานวิจัย บล.เอเซีย พลัส

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

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFM22 เมื่อคืน เพิ่มขึ้น 210 บาท ปิดที่ 30,180 บาท (เทียบเท่า 1,846 เหรียญฯ) ใกล้เคียงราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,846-1,847 เหรียญฯ คาดราคา GFM22 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 30,000-30,400 บาท การดีดตัวขึ้นของราคาทองคำวานนี้ และค่าเงินบาทอ่อนค่า ทำให้นักลงทุนที่มีสถานะ Short GFM22 ต้นทุนเฉลี่ย 30,170 บาท ปิดสถานะ ณ จุด Stop profit และรับรู้กำไร 100 บาท สำหรับกลยุทธ์วันนี้ เนื่องจากตลาดทองคำไทยจะปิดทำการหลายวันในวันหยุดเทศกาล จึงไม่แนะนำถือสถานะข้ามวันหยุดยาว ฝ่ายวิจัยแนะนำ Trading GFM22 บริเวณ 1,830-1,860 เหรียญฯ หรือ 29,910-30,400 บาท และกำหนดจุด Cut Loss ไว้ 100 บาทจากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

เทคนิค GOLD SPOT



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

GOLD TECHNICAL

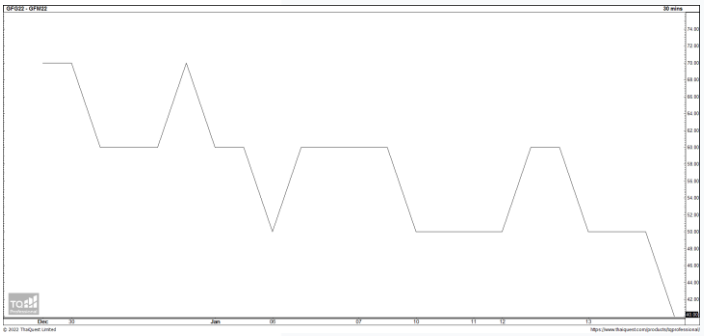
ทิศทางราคาทองคำ หลุดเส้น EMA 200 วัน ลงมา พร้อมแท่งเทียน Bearish Breakout ส่งสัญญาณเปิด Downside คาดแกว่งในกรอบการเคลื่อนไหวที่ $1815-$1850

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD Londin AM (USD/Ounce)	FX (บาท/ USD)				
	34.00	34.25	34.50	34.75	35.00
1,760	28,444	28,653	28,862	29,071	29,280
1,790	28,928	29,141	29,354	29,567	29,779
1,820	29,413	29,630	29,846	30,062	30,278
1,850	29,898	30,118	30,338	30,558	30,778
1,880	30,383	30,606	30,830	31,053	31,277
1,910	30,868	31,095	31,322	31,549	31,776
1,940	31,353	31,583	31,814	32,044	32,275
1,970	31,838	32,072	32,306	32,540	32,774
2,000	32,322	32,560	32,798	33,035	33,273

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

SPREAD ระหว่าง GFJ22 – GFQ22



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ GOLD FUTURES

นักลงทุนรายย่อย
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)

ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
30,430.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
30,380.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
30,330.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
30,280.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
30,230.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
30,180.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
30,130.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
30,080.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
30,030.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
29,980.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
29,930.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ MINI GOLD FUTURES

นักลงทุนรายย่อย
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)

ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
30,390.00	250.0	2,500	(210)	2,290
30,340.00	200.0	2,000	(210)	1,790
30,290.00	150.0	1,500	(210)	1,290
30,240.00	100.0	1,000	(210)	790
30,190.00	50.0	500	(210)	290
30,140.00	0.0	-	(210)	(210)
30,090.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
30,040.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
29,990.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
29,940.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
29,890.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส