DERIVATIVE TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

20 ตุลาคม 2565

SET50 FUTURES:

สถานะ Long S50Z22 ทุน 942 จุด ปัจจุบันกำไร 9 จุด แนะนำถือต่อเป้าทำกำไรที่ 953 จุดและเลื่อน Stop Profit มาที่ 950 จุด เพื่อ Lock กำไร 8 จุด คาด SET50 พักตัวจากความกังวลของปรับขึ้นดอกเบี้ยฯ FED แต่ Downside จำกัด

SET50 OPTION:

แนะนำรอ Long S50Z22C925 ที่ 30 จุด (SET50=945) เป้าทำกำไร 40 จุด (SET50 = 955) และ Cut Loss 3 จุด คาด SET50 พักแต่ Downside จำกัด

SINGLE STOCK FUTURES:

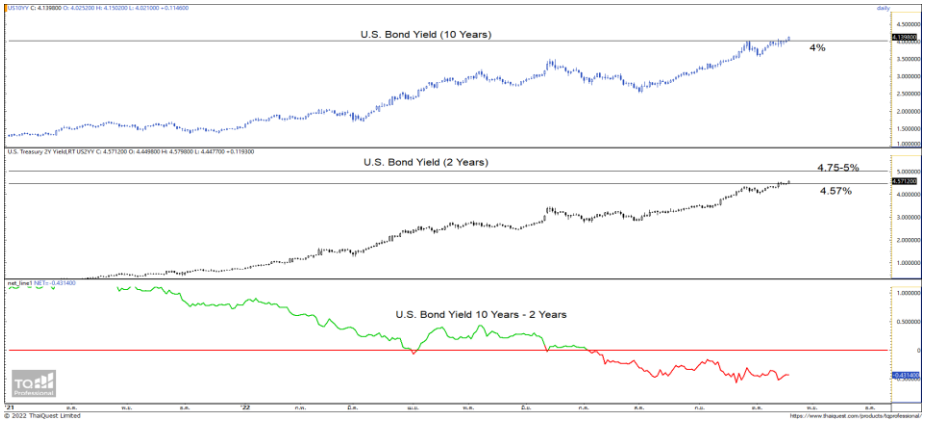
แนะนำ Long CKZ22 บริเวณ 22.50 บาท เป้าทำกำไร 23.10 บาท และ Cut Loss 0.20 บาทจากทุน ผลประกอบการในช่วง 3Q65 จะขยายตัวได้ดี

เปิด Long SCGPZ22 ได้ที่ 52.10 บาท เป้าทำกำไร 54.00 บาท และ Cut Loss 0.75 บาทจากทุนจากกำไรจะผ่าน Bottom ในงวด 3Q65

GOLD FUTURES:

วานนี้สถานะ Long GFV22 ทุน 29910 บาท ปิดและรับขาดทุน 100 บาท สำหรับวันนี้ เนื่องจากราคาทองคำกลับมาผันผวนตามการเคลื่อนไหวของ USD จึงแนะนำ Trading 29310-29850 บาท ($1610-1640) และให้เปิด Long กรอบล่าง

BOND YIELD 2 ปีและ 10 ปีสหรัฐฯกลับมาเร่งตัว



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

ที่มา : Investing, สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

สถานะของนักลงทุน

All Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	109,474	107,223	2,251	-16,880	-26,520	123,965
Foreign	108,329	93,865	14,464	26,262	-5,205	-81,947
Retail	188,821	205,536	-16,715	-9,382	31,725	-42,018

SET50 Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	36,219	35,340	879	5,272	-6,231	2,371
Foreign	87,144	53,172	33,972	58,654	34,706	-136,049
Retail	67,187	102,038	-34,851	-63,926	-28,475	133,678

Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	49,377	52,758	-3,381	-31,716	-40,535	102,511
Foreign	6,474	22,973	-16,499	-25,232	-24,048	23,897
Retail	71,906	52,026	19,880	56,948	64,583	-126,408

Metal Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	2,698	2,709	-11	-447	-924	-2,947
Foreign	14,377	17,380	-3,003	-7,167	-16,831	17,164
Retail	20,322	17,308	3,014	7,614	17,755	-14,217

Call Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	125	109	16	534	625	2,776
Foreign	171	152	19	28	222	1,915
Retail	2,510	2,545	-35	-562	-847	-4,691

Put Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	142	15	127	1,356	1,692	5,465
Foreign	125	157	-32	-65	663	10,998
Retail	2,097	2,192	-95	-1,291	-2,355	-16,463

SET50 OVERVIEW

ความกังวลต่อการดำเนินนโยบายการเงินเชิงรุกของ FED กลับมารบกวนหลังจาก FEDWatch Tool เริ่มมีการปรับคาดการณ์ขึ้นดอกเบี้ยฯ FED ปีหน้าทำจุดสูงสุดที่ 5-5.25% จากเดิม 4.75-5.00% กดดัน Bond Yield 2 ปีปรับขึ้นทำจุดสูงสุดของปีที่ 4.57% และตลาดหุ้นสหรัฐฯปรับลงในช่วง -0.33% ถึง -0.85% สวนทาง Dollar Index ที่แข็งค่า 0.8% มาที่ 113 จุดกดดันค่าเงินบาทเช้านี้อ่อนค่ามาที่ 38.42 บาท/USD ซึ่งอาจเป็นปัจจัยที่กดดันต่อทิศทาง Fund Flow ในระยะสั้น แต่อย่างไรก็ตามประเมินการอ่อนค่าของเงินบาทน่าจะเริ่มชะลอลงจากนี้จาก 1) ดุลบัญชีเดินสะพัดบ้านเราที่จะขาดดุลลดลงในปีนี้และมีโอกาสเป็นบวกในปีหน้าแรงหนุนจากภาคการท่องเที่ยว 2) ทิศทาง Dollar Index ในช่วง 4Q65 ที่เชื่อว่ามีโอกาสชะลอการแข็งค่าจากการดำเนินนโยบายการเงินที่เข้มงวดของธนาคารกลางอื่นๆรวมถึงการเข้ามาแทรกแซงค่าเงินของรัฐบาลต่างๆและ 3) เรื่องของปัจจัยทางฤดูกาลที่ 4Q ค่าเงินบาทมักจะแข็งค่าเสมอ โดยตลอด 5 ปีที่ผ่านมา แข็งค่าเฉลี่ย 2.07% และเป็นการแข็งค่า 4 ใน 5 ปี ซึ่ง 3 ปัจจัยข้างต้นน่าจะเป็นตัวช่วยลดความเสี่ยง Fx Loss ของต่างชาติ ช่วยให้ Fund Flow มีโอกาสไหลกลับโดยมีจุดดึงดูดจากเศรษฐกิจในประเทศและแนวโน้มกำไรบริษัทจดทะเบียนที่มีแนวโน้มฟื้นตัว ภายใต้ปัจจัยข้างต้นคาด SET50 Index วันนี้พักแต่ Downside จำกัดในกรอบ 942- 953 จุด

	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	942	953
S50Z22	942	953

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยจึงเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ

* แอปพลิเคชั่น “ASP Smart”

* Telegram “Asia plus group”

Follow now

Asia Plus Group

SET50 INDEX FUTURES

Direction Trading: สถานะ Long S50Z22 ทุน 942 จุด ปัจจุบันกำไร 9 จุด แนะนำถือต่อเป้าทำกำไรที่ 953 จุดและเลื่อน Stop Profit มาที่ 950 จุด เพื่อ Lock กำไร 8 จุด คาด SET50 พักตัวจากความกังวลของปรับขึ้นดอกเบี้ยฯ FED แต่ Downside จำกัด

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50H23 ลบด้วย S50Z22 ณ วันที่ 29 ธ.ค. 2565 จะเท่ากับ -6.50 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -5.60 ยังไม่กว้างมากพอให้เปิดสถานะใดๆ

SET50 Option: แนะนำรอ Long S50Z22C925 ที่ 30 จุด (SET50=945) เป้าทำกำไร 40 จุด (SET50 = 955) และ Cut Loss 3 จุด คาด SET50 พักแต่ Downside จำกัด

S50Z22 (30 MIN CHART)

TECHNICAL COMMENT

S50Z22 เริ่มติดแนวต้าน 953 จุดทำให้ระยะสั้นมีโอกาสพักตัวมองกรอบการเคลื่อนไหวที่ 942-953 จุด

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	982.59	11.92602	11.38141

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
S50U22C1050	0.20	0.00	> 1050.2	0.00	0.20	6.88%	0.01	1	7229	13.04	0.02	83.75	0.1
S50U22C1025	0.40	-0.10	> 1025.4	0.00	0.40	4.36%	0.17	560	9408	10.35	0.04	94.54	0.0
S50U22C1000	3.40	-0.60	> 1003.4	0.00	3.40	2.12%	1.99	1033	6794	11.06	0.22	62.55	0.0
S50U22C975	13.80	-1.00	> 988.8	7.59	6.21	0.63%	10.44	429	6043	12.41	0.54	38.34	0.0
S50U22C950	31.90	-0.60	> 981.9	32.59	#N/A N/A	-0.07%	28.94	57	3706	14.06	0.79	24.29	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
S50U22P1050	73.70	2.50	< 976.3	67.41	6.29	-0.64%	72.12	2	271	18.73	-0.92	-12.31	0.0
S50U22P1025	43.80	-3.60	< 981.2	42.41	1.39	-0.14%	47.30	0	357	#N/A N/A	-1.00	-22.43	0.0
S50U22P1000	25.30	-0.40	< 974.7	17.41	7.89	-0.80%	24.13	108	2827	10.57	-0.79	-30.64	0.0
S50U22P975	11.20	-1.20	< 963.8	0.00	11.20	-1.91%	7.60	1229	8239	12.55	-0.46	-40.04	0.0
S50U22P950	4.30	-0.50	< 945.7	0.00	4.30	-3.75%	1.10	803	9151	14.22	-0.21	-47.63	0.0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 INDEX

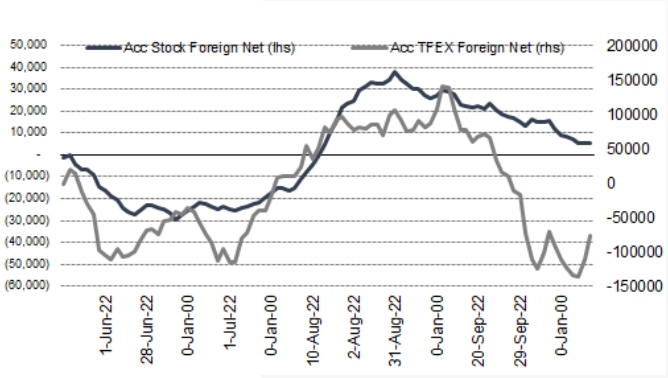
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สรุปการซื้อขาย
SET50	952.96	0.12	0.01%	19/10/22

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50V22	954.10	1.6	0.2%	123	255	50
S50X22	951.10	0.0	0.0%	32	88	2
S50Z22	951.00	1.9	0.2%	170,278	487,528	-2,402
S50H23	945.40	1.5	0.2%	15,830	51,075	138
S50M23	941.20	1.3	0.1%	2,528	10,506	-255
S50U23	934.70	1.7	0.2%	1,759	5,571	187

SET50 Futures Long(Short) : สัญญา				สะสม Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	1 เดือน
สถาบัน	36,219	35,340	879	5,272	-2,743	2,371
ต่างชาติ	87,144	53,172	33,972	58,654	33,999	-136,049
รายย่อย	67,187	102,038	-34,851	-63,926	-31,256	133,678

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 FUTURES



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คาดการณ์ SPREAD ณ สิ้นเดือนจาก ASPS MODEL

เป้าหมาย Spread ซีรีย์ใกล - 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 SCGPZ22

กิจกรรมทางเศรษฐกิจที่มีมากขึ้นหลังการเปิดรับนักท่องเที่ยวเต็มรูปแบบ การส่งออกที่เติบโตโดยได้อานิสงค์จากเงินบาทอ่อนค่า รวมถึงฐานรายได้ที่ขยับขึ้นจากการเข้าซื้อกิจการในต่างประเทศ 3Q65 ฝ่ายวิจัยประเมินรายได้งวด 3Q65 น่าจะเป็นช่วงผ่านจุด Bottom คาดการณ์เติบโตขึ้น 29%YoY อยู่ที่ 41,280 ล้านบาท ประกอบกับ Sentiment หนุนเพิ่มเติมจากราคาพลังงานที่ปรับตัวลงลง Fair Value ปี 2566 เท่ากับ 65 บาท

ภาพทางเทคนิค แท่งเทียน Dragonfly Doji เกิดขึ้นบริเวณแนวรับสำคัญ บ่งชี้ถึง Downside ระยะนี้ที่จำกัดแล้ว มีโอกาสรีบาวน์ ทดสอบด่านถัดไปที่ 54.00 บาท

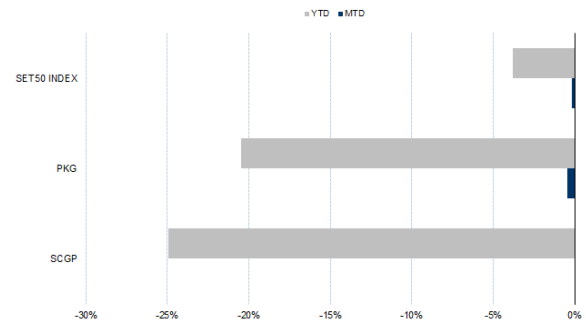
กลยุทธ์การลงทุน

เปิด Long SCGPZ22 ได้ที่ 52.10 บาท เป้าทำกำไร 54.00 บาท และ Cut Loss 0.75 บาท จากทุน

	Future						Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
SCGPZ22	52.10	-	89	4357	77	-	18.90%	28.40	2.21	-

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

TECHNICAL CHART

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

Long CKZ22

ธุรกิจหลักของ CK ยังไม่เห็นการเปลี่ยนแปลงที่ชัดเจนในช่วงครึ่งปีหลัง ประเมินรายได้ก่อสร้างอยู่ในช่วง 3-4 พันล้านบาท/ไตรมาส ส่งผลให้รายได้ก่อสร้างปีนี้น่าจะทำได้ราว 1.75 หมื่นล้านบาท เพิ่มขึ้น 25%YoY ขณะที่ ส่วนแบ่งกำไรจากบริษัทลูกทั้ง BEM และ CKP โดย BEM จะได้รับอานิสงค์โดยตรงจากการเปิดเมือง ขณะที่ CKP รับปัจจัยหนุนจากปริมาณน้ำที่ไหลผ่านโรงไฟฟ้าพลังงานน้ำ ในสปป. ลาว ทั้ง 2 แห่ง เพิ่มขึ้น

ภาพทางเทคนิค แท่งเทียน Bullish Engulfing ยืนเหนือ EMA 10 วัน พร้อมสัญญาณบวกจากจังหวะ Higher กรอบ Uptrend บ่งชี้การกลับตัว เป้าหมายอยู่ที่ 23.10 บาท

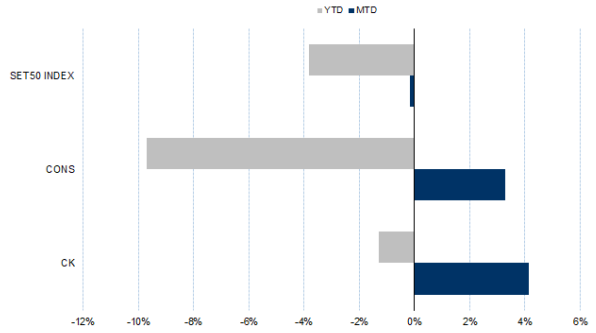
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long CKZ22 บริเวณ 22.50 บาท เป้าทำกำไร 23.10 บาท และ Cut Loss 0.20 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
CKZ22	22.61	0.00	-	2401	2	10.21	21.94%	25.79	1.29	-

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

HISTORICAL PRICE

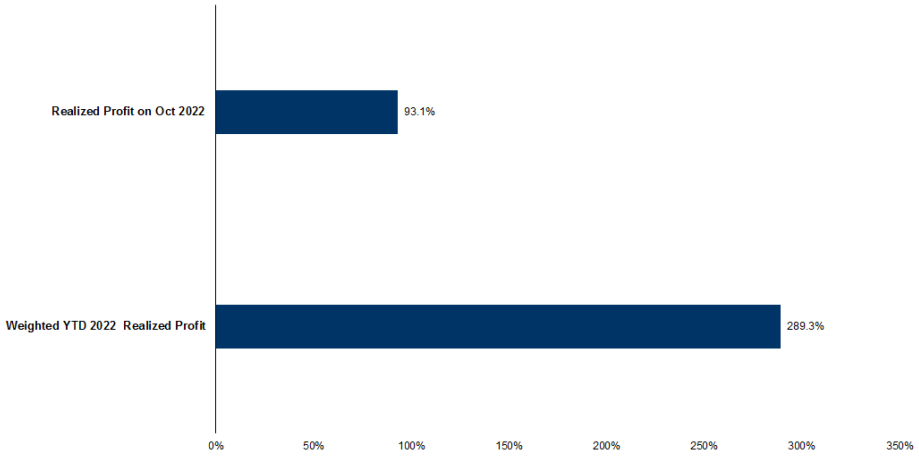


ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

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	SIRIZ22	1.15	0.01	15171	102221	-1	10	1.28	1.19
2	TTBZ22	1.24	0.01	12511	18257	36		1.28	1.23
3	JASZ22	2.72	-0.06	5628	23778	-498	6	2.54	2.36
4	SUPERZ22	0.74	0.02	5010	33200	0	5	0.77	0.72
5	TRUEZ22	4.93	-0.03	4198	8183	8490	13	5.14	4.98
6	THANIZ22	4.25	-0.03	4000	16505	0	4	4.41	4.16
7	OSPZ22	29.08	0.83	2118	2095	-100	6	27.39	24.90
8	CKPZ22	5.27	-0.03	1619	13514	0	6	5.06	4.68
9	GUNKULZ22	5.25	0.00	1529	48101	516	20	5.13	4.82
10	CPALLZ22	57.00	0.75	1516	1120	1	13	59.35	56.51
11	GFPTZ22	15.03	-0.07	1341	602	0	9	15.62	14.66
12	WHAZ22	3.50	0.00	1259	26513	-995	8	3.61	3.51
13	BDMSZ22	29.37	0.12	1113	2335	0	17	29.12	28.37
14	AMATAZ22	18.91	0.11	948	107	100	11	19.50	18.66
15	DTACZ22	45.20	-0.30	911	1593	-100	11	46.41	45.23
16	GULFZ22	53.00	0.00	734	2131	1	3	51.28	47.50
17	HANAZ22	38.62	-0.63	731	1064	46	5	36.80	32.55
18	BBLZ22	139.02	0.02	684	5279	-40	8	141.20	137.51
19	EAZ22	88.50	0.00	684	19839	-80	15	93.12	88.88
20	CBGZ22	91.54	0.79	678	1582	-80	6	95.44	86.32

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

GOLD FUTURES

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ร่วงลงแรง 23.2 เหรียญฯ หรือ 1.4% ปิดที่ 1,628 เหรียญฯ ท่ามกลางคาดการณ์ธนาคารกลางสหรัฐ (เฟด) จะปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยครั้งละ 0.75% ในการประชุมเดือน พ.ย.และ ธ.ค. หลังสหรัฐเปิดเผยดัชนีราคาผู้บริโภค (CPI) ที่สูงเกินคาด หนุนให้อัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐอายุ 10 ปี พุ่งขึ้นแตะระดับสูงสุดรอบกว่า 14 ปี และค่าเงินดอลลาร์กลับมาแข็งค่า ทำให้ Dollar Index วานนี้ขยับขึ้น 0.8% ปิดบริเวณ 112.89 จุด โดยวันนี้และพรุ่งนี้ ต้องติดตามจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์, ยอดขายบ้านมือสอง และดัชนีชี้นำเศรษฐกิจของสหรัฐเดือน ก.ย. ที่จะส่งผลต่อค่าเงินดอลลาร์และราคาทองคำในระยะต่อไป

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GFV22	29,730	-60	-0.20	82	142	-6
GFZ22	29,820	-100	-0.33	59	133	7
GFG23	29,880	-40	-0.13	2	2	0

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GF10V22	29,730	-100	-0.34	8,095	4,305	-1615
GF10Z22	29,830	-100	-0.33	3,823	5,362	844
GF10G23	29,880	-90	-0.30	4,120	1,010	0

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 GFV22 เมื่อคืน ลดลงตามตลาดโลกรวม 220 บาท ปิดที่ 29,730 บาท (1,633 เหรียญฯ) สูงกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่ 1,628 เหรียญฯ คาด GFV22 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 29,500-29,800 บาท จากการร่วงลงแรงของราคาทองคำวานนี้ ทำให้นักลงทุนที่เปิด Long GFV22 ทุนเฉลี่ย 29,910 บาท ปิดสถานะและรับผลขาดทุน 100 บาทจากทุน สำหรับกลยุทธ์วันนี้ ทิศทางราคาทองคำกลับมาผันผวนตามการเคลื่อนไหวของค่าเงินดอลลาร์ที่มีผลจากตัวเลขเศรษฐกิจสหรัฐ ทำให้ฝ่ายวิจัยแนะนำ Trading บริเวณ 1,610-1,640 เหรียญฯ หรือ 29,310-29,850 บาท แต่หากราคาขยับลงแตะกรอบล่าง แนะนำรอเปิด Long จากคาดหวัง Rebound และกำหนดจุด Stop Loss 100 บาท จากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

เทคนิค GOLD SPOT

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

GOLD TECHNICAL

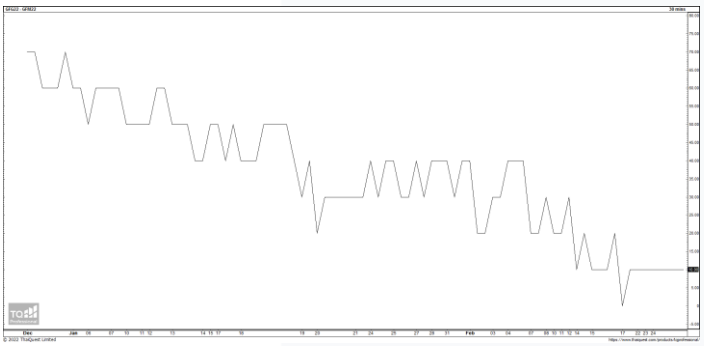
ทิศทางราคาทองคำ แรงขายเข้ากดดันหลุดแนวรับโซน $1650 เป็นแท่งเทียนแดงยาว สะท้อน Downside ที่เปิด คาดกลับเข้ากรอบการเคลื่อนไหวในระยะนี้ ที่ $1615-$1650

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

	FX (บาท/ USD)				
	37.50	37.75	38.00	38.25	38.50
1,600	28,520	28,710	28,900	29,090	29,280
1,630	29,054	29,248	29,442	29,636	29,829
1,660	29,589	29,786	29,984	30,181	30,378
1,690	30,124	30,325	30,526	30,726	30,927
1,720	30,659	30,863	31,067	31,272	31,476
1,750	31,193	31,401	31,609	31,817	32,025
1,780	31,728	31,940	32,151	32,363	32,574
1,810	32,263	32,478	32,693	32,908	33,123
1,840	32,798	33,016	33,235	33,454	33,672

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

SPREAD ระหว่าง GFV22 – GFJ23



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
29,980.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
29,930.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
29,880.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
29,830.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
29,780.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
29,730.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
29,680.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
29,630.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
29,580.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
29,530.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
29,480.00	-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
29,980.00	250.0	2,500	(210)	2,290
29,930.00	200.0	2,000	(210)	1,790
29,880.00	150.0	1,500	(210)	1,290
29,830.00	100.0	1,000	(210)	790
29,780.00	50.0	500	(210)	290
29,730.00	0.0	-	(210)	(210)
29,680.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
29,630.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
29,580.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
29,530.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
29,480.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส