

30 มีนาคม 2566

SET50 FUTURES:

มูลค่าการซื้อขายไม่หนาแน่นและ Valuation ที่ตั้งตัวมากขึ้นหลังการขึ้นดอกเบี้ยฯกนง. เป็นปัจจัยจำกัดการขึ้นแนะนำ Short S50M23 ที่ 978 จุด เป้าทำกำไร 962 จุด และ Cut Loss 4 จุด

SET50 OPTION:

แนะนำรอ Long S50M23P975 ที่ 22 จุด (set50=978) เป้าทำกำไร 35 (set50=965) และ Cut Loss 3 จุด คาด SET50 ฟิ้นจำกัด

SINGLE STOCK FUTURES:

แนะนำถือ Long IVLM23 ทุน 35.00 บาท ปัจจุบันกำไร 12.38% เป้าทำกำไร 36.50 บาท และ Cut Loss 0.50 บาทจากทุน

แนะนำ Long CKM23 บริเวณ 20.10 บาท เป้าทำกำไร 20.70 บาท และ Cut Loss 0.20 บาทจากทุน

GOLD FUTURES:

GF10 Futures : แนะนำ Trading GF10J23 กรอบ 31710-32200 บาท (\$1950-1980) และตั้ง Cut Loss 100 บาท

Gold Online: แนะนำ Trading GOM23 ที่ \$1980-2010 และ Cut Loss \$3

| | |
|------------------------------|-----|
| 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

* แอปพลิเคชัน “ASP Smart”



* Telegram “Asia plus group”

Follow now



Asia Plus Group

RESEARCH DIVISION

บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส

เกิดศักดิ์ ทวีธีระ-sss

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจกมา, CISA, CFA

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นวลพรรณ น้อยรัชชกุล

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

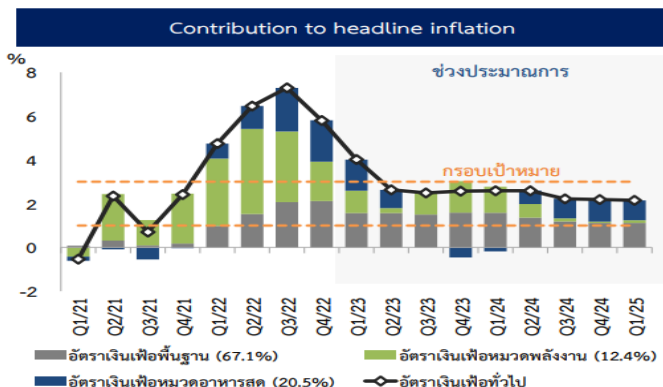
ชาญชัย พันพานากิจ

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธ เกิดเนตร

ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

เงินเฟ้อฯเป็นปัจจัยเสี่ยงต่อการปรับขึ้นดอกเบี้ยฯของ กนง.



ที่มา : ธปท.



สถานะของนักลงทุน

| | All Futures Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|---|---------|--------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 313,016 | 316,917 | -3,901 | 12,111 | -59,515 | 519,205 |
| Foreign | 262,143 | 256,019 | 6,124 | 24,013 | 98,598 | 251,490 |
| Retail | 418,989 | 421,212 | -2,223 | -36,124 | -39,083 | -770,695 |

| | SET50 Futures Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|---|---------|--------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 38,646 | 39,390 | -744 | -6,246 | -11,449 | 21,425 |
| Foreign | 196,471 | 190,653 | 5,818 | 23,327 | 48,239 | 76,565 |
| Retail | 81,989 | 87,063 | -5,074 | -17,081 | -36,790 | -97,990 |

| | Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|--|---------|---------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 225,691 | 236,454 | -10,763 | 6,497 | -63,185 | 493,188 |
| Foreign | 43,276 | 43,557 | -281 | 4,548 | 51,342 | 161,617 |
| Retail | 258,938 | 247,894 | 11,044 | -11,045 | 11,843 | -654,805 |

| | Metal Futures Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|---|--------|--------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 6,060 | 4,181 | 1,879 | 1,650 | 2,524 | 4,906 |
| Foreign | 21,170 | 20,540 | 630 | -4,243 | -1,848 | 14,307 |
| Retail | 23,614 | 26,123 | -2,509 | 2,593 | -676 | -19,213 |

| | Call Option Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|---|-------|--------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 1,425 | 342 | 1,083 | 1,797 | 1,493 | -9,043 |
| Foreign | 721 | 676 | 45 | 293 | 553 | 3,150 |
| Retail | 5,661 | 6,789 | -1,128 | -2,090 | -2,046 | 5,893 |

| | Put Option Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|--|-------|------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 285 | 63 | 222 | 434 | 533 | -6,986 |
| Foreign | 458 | 408 | 50 | 50 | 172 | -3,417 |
| Retail | 3,095 | 3,367 | -272 | -484 | -705 | 10,403 |

| | แนวรับ | แนวต้าน |
|--------|--------|---------|
| SET50 | 965 | 978 |
| S50M23 | 962 | 978 |



ผลการประชุม กนง.วานนี้มีมติปรับขึ้นดอกเบี้ยฯ 0.25% มาที่ 1.75% ขณะที่มุมมองต่อเศรษฐกิจยังฟื้นตัวได้ตามแรงขับเคลื่อนของภาคการท่องเที่ยวและบริโภค ด้านมุมมองทิศทางเงินเฟ้อยังอยู่ในคาดการณ์แต่ยังมีความเสี่ยงจากเงินเฟ้อพื้นฐานที่ยังยืนอยู่ในระดับสูง ทำให้โอกาสที่ปรับขึ้นดอกเบี้ยฯในระยะถัดไปยังมีต่อ มองการส่งสัญญาณข้างต้นจะเป็นลบต่อตลาดหุ้นในมุม Valuation ที่ตึงตัวมากขึ้นในระยะถัดไป ส่วนสภาพแวดล้อมต่างประเทศยังไม่มีประเด็นลบใหม่ทำให้ตลาดหุ้นสหรัฐฯฟื้นตัวในช่วง 1-1.8% บนความคาดหวังว่า FED จะสิ้นสุดดอกเบี้ยฯของขาขึ้น ซึ่งเป็นแรงหนุนต่อตลาดหุ้นภูมิภาคเข้านี้ แต่อย่างไรก็ตามข้อจำกัดทางมูลค่าการซื้อขายที่เบาบางรวมถึงความผันผวนที่เพิ่มขึ้นที่สูงขึ้นจากการปิดสถานะใน SET50 Futures Series H ในวันนี้จะทำให้การปรับขึ้นของ SET50 Index เป็นไปอย่างจำกัดในกรอบ 965-978 จุด

SET50 INDEX FUTURES

Direction Trading : มูลค่าการซื้อขายไม่หนาแน่นและ Valuation ที่ตึงตัวมากขึ้นหลังการขึ้นดอกเบี้ยฯกนง. เป็นปัจจัยจำกัดการขึ้นแนะนำ Short S50M23 ที่ 978 จุด เป้าทำกำไร 962 จุด และ Cut Loss 4 จุด

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50U23 ลบด้วย S50M23 ณ วันที่ 29 มิ.ย. 2566 จะเท่ากับ -4.91 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -2.80 ยังไม่กว้างมากพอให้เปิดสถานะใดๆ

SET50 Option: แนะนำรอ Long S50M23P975 ที่ 22 จุด (set50=978) เป้าทำกำไร 35 (set50=965)และ Cut Loss 3 จุด คาด SET50 ฟื้นจำกัด

S50M23 (30 MIN CHART)



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

TECHNICAL COMMENT

S50M23 อยู่ในโหมดฟื้นตัวมองกรอบการเคลื่อนไหวที่ 962-978 จุด



| SET50 Index | Last | 1Yr Hist. Volatility | 2Week Hist. Volatility |
|-------------|--------|----------------------|------------------------|
| | 971.45 | 11.6 | 10.8642 |

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 |
|-------------|---------|-------|------------|-----------------|------------|----------------|--------------|--------|---------------|--------------------|-------|-------------------|------------|
| S50M23C1025 | 0.10 | -0.10 | > 1025.1 | 0.00 | 0.10 | 5.52% | 0.00 | 484 | 13514 | 46.23 | 0.01 | 121.84 | 5.5% |
| S50M23C1000 | 0.10 | -0.10 | > 1000.1 | 0.00 | 0.10 | 2.95% | 0.00 | 271 | 16351 | 27.27 | 0.02 | 194.68 | 2.9% |
| S50M23C975 | 3.40 | 0.40 | > 978.4 | 0.00 | 3.40 | 0.72% | 0.89 | 2814 | 9168 | 24.80 | 0.39 | 111.79 | 0.7% |
| S50M23C950 | 22.20 | 4.40 | > 972.2 | 21.45 | 0.75 | 0.08% | 21.47 | 905 | 4101 | 32.93 | 0.91 | 39.73 | 0.1% |
| S50M23C925 | 47.10 | 5.40 | > 972.1 | 46.45 | 0.65 | 0.07% | 46.47 | 415 | 1463 | 58.34 | 0.95 | 19.60 | 0.1% |

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 |
|-------------|---------|-------|------------|-----------------|------------|----------------|--------------|--------|---------------|--------------------|-------|-------------------|------------|
| S50M23P1025 | 53.60 | -4.30 | < 971.4 | 53.55 | 0.05 | -0.01% | 53.53 | 0 | 1036 | 45.65 | -0.99 | -17.91 | 0.0% |
| S50M23P1000 | 27.50 | -5.20 | < 972.5 | 28.55 | #N/A N/A | 0.11% | 28.53 | 18 | 2976 | #N/A N/A | -1.00 | -35.33 | 0.1% |
| S50M23P975 | 5.60 | -5.80 | < 969.4 | 3.55 | 2.05 | -0.21% | 4.43 | 877 | 5259 | 17.87 | -0.65 | -112.89 | -0.2% |
| S50M23P950 | 0.30 | -1.20 | < 949.7 | 0.00 | 0.30 | -2.24% | 0.00 | 996 | 5223 | 26.92 | -0.05 | -170.33 | -2.2% |
| S50M23P925 | 0.10 | -0.30 | < 924.9 | 0.00 | 0.10 | -4.79% | 0.00 | 143 | 6583 | 43.09 | -0.01 | -128.06 | -4.8% |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 INDEX

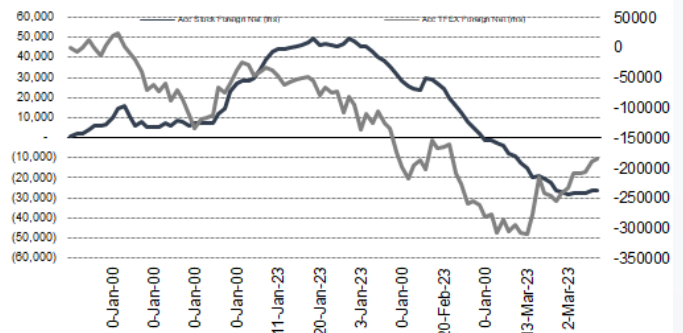
| UNDERLYING | Close | Chg | %Chg | ผลการซื้อขาย |
|------------|--------|------|-------|--------------|
| SET50 | 971.45 | 3.67 | 0.38% | 23/3/23 |

| Symbol | Settle | Chg | %Chg | Vol. | OI | OI Chg |
|--------|---------|-----|------|---------|---------|---------|
| S50F23 | 1002.44 | 0.0 | 0.0% | 35 | 106 | 0 |
| S50G23 | 971.18 | 0.0 | 0.0% | 81 | 97 | 0 |
| S50H23 | 972.60 | 5.9 | 0.6% | 92,523 | 267,592 | -64,726 |
| S50M23 | 967.50 | 5.0 | 0.5% | 199,141 | 374,620 | 36,239 |
| S50J23 | 964.60 | 5.1 | 0.5% | 8,484 | 36,763 | 951 |
| S50Z23 | 964.20 | 4.8 | 0.5% | 2,811 | 19,207 | 130 |

| | SET50 Futures Long(Short) : สัญญา | | | สะสม Long(Short) | | |
|----------|-----------------------------------|---------|--------|------------------|-----------|---------|
| | Long | Short | Net | 2 วัน | 2 สัปดาห์ | 1 เดือน |
| สถาบัน | 38,646 | 39,390 | -744 | -6,246 | -774 | 21,425 |
| ต่างชาติ | 196,471 | 190,653 | 5,818 | 23,327 | 31,041 | 76,565 |
| รายย่อย | 81,989 | 87,063 | -5,074 | -17,081 | -30,267 | -97,990 |

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 | | | | | |
|--------|-------------------------------------|-------------|--------------|--------------|-------------|--------------|
| | S50F23 | S50G23 | S50H23 | S50J23 | S50K23 | S50M23 |
| | ณ 30 ม.ค.66 | ณ 27 ก.พ.66 | ณ 30 มี.ค.66 | ณ 27 เม.ย.66 | ณ 30 พ.ค.66 | ณ 29 มิ.ย.66 |
| S50F23 | | | | | | |
| S50G23 | -3.33 | | | | | |
| S50H23 | -5.93 | -2.60 | | | | |
| S50J23 | -9.70 | -6.37 | -3.37 | | | |
| S50K23 | -9.81 | -6.47 | -3.06 | 0.31 | | |
| S50M23 | -8.80 | -5.45 | -1.64 | 1.73 | 1.42 | |

*สมมติฐานอัตราดอกเบี้ยนโยบายระหว่าง เม.ย. - มิ.ย. 66 เท่ากับ 1.75%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

SET50 ที่ระดับค่า PER ต่างๆ

| SET 50 Sensitivity | ม.ค. 66E | มี.ค. 66E | เม.ย. 66E | พ.ค. 66E | มิ.ย. 66E | ก.ย. 66E | ธ.ค. 66E |
|--------------------|----------|-----------|-----------|----------|-----------|----------|----------|
| PER 15.5 | 888 | 902 | 908 | 915 | 922 | 942 | 963 |
| PER 16 | 917 | 931 | 938 | 945 | 952 | 973 | 994 |
| PER 16.5 | 945 | 960 | 967 | 974 | 981 | 1,003 | 1,025 |
| PER 17 | 974 | 989 | 996 | 1,004 | 1,011 | 1,033 | 1,056 |
| PER 17.5 | 1,003 | 1,018 | 1,026 | 1,033 | 1,041 | 1,064 | 1,087 |
| PER 18 | 1,031 | 1,047 | 1,055 | 1,063 | 1,071 | 1,094 | 1,118 |
| PER 18.5 | 1,060 | 1,076 | 1,084 | 1,092 | 1,100 | 1,125 | 1,149 |
| PER 19 | 1,088 | 1,105 | 1,113 | 1,122 | 1,130 | 1,155 | 1,180 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



SINGLE STOCK FUTURES

Long IVLM23

ปี 2566 คาด IVL จะได้ปัจจัยบวกหนุนจากปริมาณขายรวมที่คาดว่าจะเพิ่มขึ้นมาอยู่ที่ 16.0 จาก 14.7 ล้านตัน ในปีก่อนหน้า จากความต้องการใช้ที่เพิ่มขึ้นจากจีนที่เปิดประเทศ ทำให้อัตราการเติบโตของความต้องการใช้ผลิตภัณฑ์กลุ่ม PET จะกลับมาสู่ภาวะปกติ ขณะที่ 1Q66 คาดจะเห็นการฟื้นตัว ลุ้นปัจจัยหนุนจากการเข้าสู่ช่วงฤดูกาลสะสมสต็อกไว้ใช้ในช่วง high season ไตรมาส 2 ของทุกปีอีกครั้ง Fair Value ปี 2566 อยู่ที่ 52 บาท

ราคาหุ้นรายวัน เกิดสัญญาณ Bullish Divergence ใน MACD และ RSI พร้อมกับแท่งเทียน Doji เงามล่างยาว บ่งชี้รอบ Technical Rebound โดยมีเป้าหมายที่ 36.50 บาท

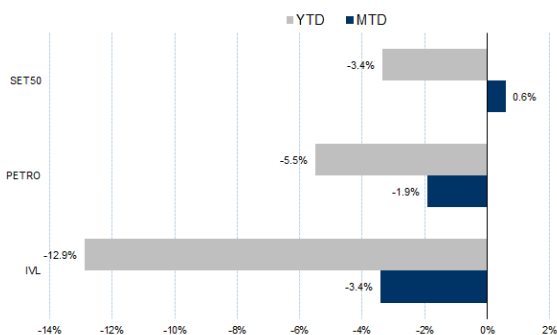
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำถือ Long IVLM23 ทุน 35.00 บาท ปัจจุบันกำไร 12.38% เป้าทำกำไร 36.50 บาท และ Cut Loss 0.50 บาทจากทุน

| Future | | | | | | | Underlying | |
|--------|--------------|-------|-----|-------|-----------|----------|------------|---------|
| Future | Settle Price | Basis | Vol | OI | OI Change | Leverage | Upside | PER 66F |
| IVLM23 | 35.39 | -0.11 | 635 | 11978 | 213 | - | 41.78% | 6.18 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

TECHNICAL CHART



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



Long CKM23

รายได้จากธุรกิจรับเหมาก่อสร้างเติบโตก้าวกระโดดตั้งแต่ช่วง 2Q66 เป็นต้นไป จากการเริ่มรับรู้งานก่อสร้างหลายโครงการใหญ่พร้อมกัน ทั้งงานก่อสร้างโรงไฟฟ้าหลวงพระบาง ใน สปป.ลาว ,งานก่อสร้างอุโมงค์ระบายน้ำ บางมด-สำโรง และรถไฟฟ้าสายสีม่วงใต้ ที่จะเริ่มลงหัวเจาะอุโมงค์ ขณะที่คาดส่วนแบ่งกำไร บริษัทลูกจาก BEM และ CKP ที่ดีขึ้น รับอานิสงค์เปิดเมือง ประเมิน Fair Value ปี 2566 เท่ากับ 27 บาท

ราคาหุ้นอยู่ในลักษณะผันตัวจากแนวโน้มขาลง โมเมนตัมระยะสั้นเริ่มกลับมาดีขึ้น หลังจากยืนเส้น EMA 10 วันได้ มีโอกาสเปิด Upside โดยมีเป้าหมายช่วงสั้นที่ 20.70 บาท

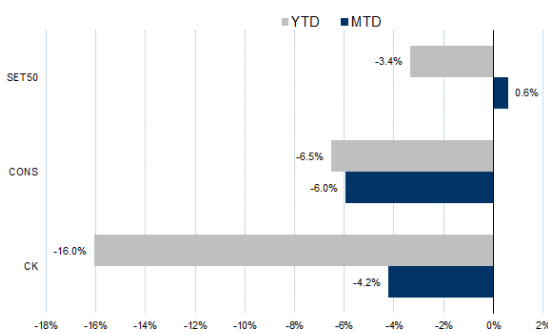
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long CKM23 บริเวณ 20.10 บาท เป้าทำกำไร 20.70 บาท และ Cut Loss 0.20 บาทจากทุน

| Future | | | | | | | Underlying | |
|--------|--------------|-------|-----|-----|-----------|----------|------------|---------|
| Future | Settle Price | Basis | Vol | OI | OI Change | Leverage | Upside | PER 66F |
| CKM23 | 20.60 | 0.20 | 200 | 607 | 200 | 10.75 | 13.92% | 26.23 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

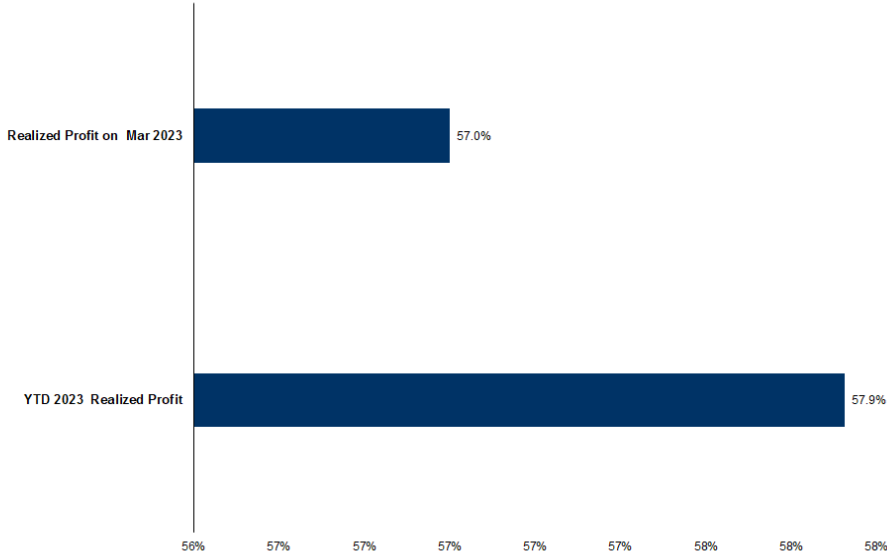
TECHNICAL CHART



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



TRACKING PERFORMANCE



หมายเหตุ การคำนวณผลตอบแทนจะใช้ราคาเปิดในวันแนะนำเป็นต้นทุน เทียบกับราคาปิดล่าสุด เป็นผลตอบแทนสะสมจนกว่าจะถึงวันที่ฝ่ายวิจัยแนะนำให้ปิดสถานะทำกำไร/ตัดขาดทุน

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

TOP 20 MOST ACTIVE VOLUME

| | Future | Settle Price | Basis | Vol | OI | OI Change | Leverage | Resistance | Support |
|----|-----------|--------------|-------|--------|--------|-----------|----------|------------|---------|
| 1 | AAVM23 | 2.81 | 2.78 | 25,317 | 68,634 | 4,271 | 8.48 | 2.96 | 2.81 |
| 2 | BEAUTYM23 | 1.24 | 1.24 | 24,182 | 48,137 | 23,969 | 4.05 | 1.24 | 1.19 |
| 3 | STPIM23 | 4.2 | 4.12 | 11,542 | 20,424 | 10,542 | 6.44 | 4.09 | 3.75 |
| 4 | TKNM23 | 9.82 | 9.85 | 11,300 | 14,624 | 11,300 | 5.36 | 9.82 | 9.63 |
| 5 | SIRIM23 | 1.71 | 1.71 | 9,067 | 25,993 | 1,480 | 15.44 | 1.71 | 1.59 |
| 6 | ICHIM23 | 13.31 | 13.4 | 8,409 | 13,256 | 8,209 | 6.92 | 13.48 | 13.31 |
| 7 | PTGM23 | 14.41 | 14.3 | 3,872 | 14,445 | 871 | 4.98 | 14.59 | 14.41 |
| 8 | BANPUM23 | 10.21 | 11 | 3,470 | 50,748 | 3,231 | 16.03 | 10.63 | 10.12 |
| 9 | EAM23 | 76.13 | 76 | 3,099 | 21,385 | 2,819 | 15.81 | 78.03 | 75.88 |
| 10 | IRPCM23 | 2.68 | 2.66 | 3,061 | 23,798 | 38 | 8.54 | 2.74 | 2.45 |
| 11 | THCOMM23 | 14.27 | 14.7 | 3,059 | 4,082 | 1,556 | 10.00 | 15.27 | 14.13 |
| 12 | TTBM23 | 1.39 | 1.45 | 2,406 | 24,778 | 778 | | 1.40 | 1.37 |
| 13 | ITDM23 | 1.67 | 1.63 | 2,049 | 31,717 | 1,969 | 12.17 | 1.78 | 1.65 |
| 14 | GUNKULM23 | 3.92 | 3.96 | 1,889 | 99,611 | 1,856 | 19.36 | 4.15 | 3.88 |
| 15 | TUM23 | 14.75 | 14.5 | 1,711 | 15,332 | 1,411 | 9.10 | 14.75 | 14.01 |
| 16 | THANIM23 | 3.73 | 3.76 | 1,505 | 6,017 | 1,505 | 4.21 | 3.88 | 3.77 |
| 17 | KBANKM23 | 131.84 | 134.5 | 1,305 | 7,656 | 438 | 11.21 | 139.49 | 131.01 |
| 18 | BAMM23 | 13.36 | 13.8 | 1,143 | 13,245 | 1,108 | | 13.46 | 12.50 |
| 19 | CPALLM23 | 62.53 | 63 | 1,076 | 4,794 | 547 | 14.97 | 63.98 | 62.01 |
| 20 | PTTEPM23 | 153.99 | 153.5 | 1,056 | 3,371 | - | 114 | 157.97 | 151.51 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



GOLD FUTURES

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ลดลง 9.1 เหรียญฯ ปิดที่ 1,964 เหรียญฯ จากแรงเทขาย หลังราคาทองคำวันนี้ดีดตัวขึ้นเกือบ 20 เหรียญฯ และเพื่อโยกเม็ดเงินลงทุนเข้าสินทรัพย์เสี่ยง สะท้อนจากตลาดหุ้นดาวโจนส์สหรัฐเมื่อคืนปิดบวก 323.35 จุด หรือ 1% ขานรับผลประกอบการกลุ่มบริษัทเทคโนโลยีที่สดใส ช่วยคลายความกังวลเกี่ยวกับเสถียรภาพทางเศรษฐกิจ นอกจากนี้ราคาทองคำมีแรงกดดันจากการแข็งค่าของค่าเงินดอลลาร์ โดย Dollar Index วานนี้ปรับขึ้น 0.21% ปิดที่ 102.64 จุด โดยวันนี้ทางสหรัฐจะมีการรายงานจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงาน และจีดีพี 4Q65 ส่วนพ่วงนี้จะเปิดเผยดัชนี PCE ซึ่งเป็นมาตรการวัดเงินเฟ้อที่ธนาคารกลางสหรัฐให้ความสำคัญ

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GF10J23 เมื่อคืน ลดลง 200 บาท ปิดที่ 31,890 บาท (1,961 เหรียญฯ) ใกล้เคียงราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,961-1,962 เหรียญฯ คาดราคา GF10J23 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 31,750-32,100 บาท จากทิศทางราคาทองคำผันผวนขึ้นลงรายวันตามสถานการณ์ที่เข้ามากระทบ ทำให้ฝ่ายวิจัยคงแนะนำ Trading GF10J23 บริเวณ 1,950-1,980 เหรียญฯ หรือ 31,710-32,200 บาท กำหนดจุด cut loss 100 บาท เพื่อป้องกันความเสี่ยง หากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

GOLD SPOT



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Online Futures

| | Last | Chg | %Chg | Vol | OI | OI Chg |
|-------|-------|-----|-------|--------|--------|--------|
| GOM23 | 1,965 | -3 | -0.15 | 23,337 | 24,289 | -333 |
| GOM23 | 1,992 | -3 | -0.14 | 6,860 | 3,316 | -201 |

Mini Gold Futures

| | Last | Chg | %Chg | Vol | OI | OI Chg |
|---------|--------|-----|-------|-------|-------|--------|
| GF10G23 | 30,215 | 35 | 0.12 | 3,590 | 8,318 | 67 |
| GF10J23 | 31,890 | -30 | -0.09 | 842 | 3,344 | 28 |
| GF10M23 | 31,960 | -30 | -0.09 | 656 | 1,521 | -3 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล.เอเชีย พลัส

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



GOLD ONLINE FUTURES (GOM23)

ทิศทางราคาทองคำ จังหวะสร้างฐานแนวโซนเส้น EMA 10 วัน พร้อมแท่งเทียน Hammer ระยะสั้นคาดมีแรงซื้อกลับ เกิดรอบรีบาวน์ คาดกรอบการเคลื่อนไหวที่ \$1980-\$2010

Gold Online: แนะนำ Trading \$1980-2010 และ Cut Loss \$3

GOM23



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

BASIS ระหว่าง GOM23-GOLD SPOT



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

| | FX (บาท/ USD) | | | | |
|-------|-----------------|--------|--------|--------|--------|
| | 34.00 | 34.25 | 34.50 | 34.75 | 35.00 |
| 1,800 | 29,090 | 29,304 | 29,518 | 29,732 | 29,946 |
| 1,830 | 29,575 | 29,792 | 30,010 | 30,227 | 30,445 |
| 1,860 | 30,060 | 30,281 | 30,502 | 30,723 | 30,944 |
| 1,890 | 30,545 | 30,769 | 30,994 | 31,218 | 31,443 |
| 1,920 | 31,029 | 31,258 | 31,486 | 31,714 | 31,942 |
| 1,950 | 31,514 | 31,746 | 31,978 | 32,209 | 32,441 |
| 1,980 | 31,999 | 32,234 | 32,470 | 32,705 | 32,940 |
| 2,010 | 32,484 | 32,723 | 32,962 | 33,201 | 33,439 |
| 2,040 | 32,969 | 33,211 | 33,454 | 33,696 | 33,938 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ MINI GOLD FUTURES

| มีลักษณะรายย่อย | | | | |
|-------------------------------------|------------------|------------------------|-------------------------|--------------------|
| (ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง) | | | | |
| ราคาปิด future | กำไร/เปลี่ยนแปลง | กำไร (ขาดทุน) (ขาดทุน) | ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท) | กำไร (ขาดทุน)สุทธิ |
| 32,140.00 | 250.0 | 2,500 | (210) | 2,290 |
| 32,090.00 | 200.0 | 2,000 | (210) | 1,790 |
| 32,040.00 | 150.0 | 1,500 | (210) | 1,290 |
| 31,990.00 | 100.0 | 1,000 | (210) | 790 |
| 31,940.00 | 50.0 | 500 | (210) | 290 |
| 31,890.00 | 0.0 | - | (210) | (210) |
| 31,840.00 | -50.0 | (500) | (210) | (710) |
| 31,790.00 | -100.0 | (1,000) | (210) | (1,210) |
| 31,740.00 | -150.0 | (1,500) | (210) | (1,710) |
| 31,690.00 | -200.0 | (2,000) | (210) | (2,210) |
| 31,640.00 | -250.0 | (2,500) | (210) | (2,710) |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส