

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์



🕒 7 มิถุนายน 2566

SET50 FUTURES:

ความคาดหวังต่อคงดอกเบี้ยของ FED และออกมาตรการกระตุ้นของจีนเป็นแรงหนุนแต่ FUND FLOW ที่ไหลออกเป็นปัจจัยจำกัดการขึ้นแนะนำ TRADING S50M23 ในกรอบ 915-925 จุด และ SHORT กรอบบน

SET50 OPTION:

แนะนำรอ LONG S50M23P950 ที่ 33 จุด (SET50 = 927) เป้าทำกำไร 43 จุด (SET50 = 917) และ CUT LOSS 3 จุดขาด SET50 ขึ้นอย่างจำกัด

SINGLE STOCK FUTURES:

แนะนำ LONG KBANKM23 บริเวณ 130.50 บาท เป้าทำกำไร 136.00 บาท และ CUT LOSS 1.50 บาทจากทุน

แนะนำถือ LONG LHM23 ทุน 8.50 บาท เป้าทำกำไร 9.00 บาท และ CUT LOSS 0.15 บาทจากทุน

GOLD FUTURES:

GF10 FUTURES: แนะนำ TRADING GF10M23 ที่ 32190-32680 บาท และ CUT LOSS 100 บาท

GOLD ONLINE: แนะนำ TRADING GOM23 ที่ \$1960-1990 และ CUT LOSS \$3

FEDWATCH TOOL คาดคงดอกเบี้ยฯเดือน มิ.ย.

MEETING DATE	MEETING PROBABILITIES													
	250-275	275-300	300-325	325-350	350-375	375-400	400-425	425-450	450-475	475-500	500-525	525-550	550-575	
6/14/2023						0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	81.7%	18.3%	0.0%	
7/26/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	37.1%	52.9%	10.0%	
9/20/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	4.8%	39.2%	47.3%	8.7%	
11/1/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	2.3%	21.3%	43.1%	28.8%	4.5%	
12/13/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	1.2%	11.9%	32.3%	35.8%	16.5%	2.2%		
1/31/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.8%	9.0%	26.7%	34.9%	21.8%	6.2%	0.6%		
3/20/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.7%	7.6%	23.7%	33.5%	24.1%	8.8%	1.6%	0.1%	
5/1/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.1%	1.6%	9.8%	25.0%	32.2%	22.0%	7.9%	1.4%	0.1%	0.0%	
6/19/2024	0.0%	0.0%	0.1%	1.1%	6.8%	19.5%	29.6%	25.7%	13.0%	3.7%	0.6%	0.0%	0.0%	
7/31/2024	0.0%	0.1%	0.9%	6.0%	17.7%	28.2%	26.3%	14.8%	5.0%	1.0%	0.1%	0.0%	0.0%	
9/25/2024	0.0%	0.7%	4.8%	14.9%	25.6%	26.7%	17.5%	7.4%	2.0%	0.3%	0.0%	0.0%	0.0%	
11/6/2024	0.5%	3.6%	12.0%	22.6%	26.4%	20.1%	10.2%	3.5%	0.8%	0.1%	0.0%	0.0%	0.0%	

ที่มา: FEDWATCH TOOL

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

ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องดำเนินการได้อย่างรวดเร็วทัน ฝ่าวยวิจัยจึงเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันทำการผ่าน 2 ช่องทาง เพื่อให้นักลงทุนสามารถปรับเปลี่ยนกลยุทธ์ได้มีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น คือ

แอปพลิเคชัน ASP Smart

Telegram Asia Plus Group

Asia Plus Group
Follow Now

RESEARCH DIVISION

บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส

เกิตศักดิ์ ทวีธีระ-ธรรมา

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจภมร, CISA, CFA

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นวลพรรณ น้อยรัชชกุล

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันพานิชกิจ

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธ เกิตเนตร

ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

สถานะของนักลงทุน

	All Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	130,433	144,391	-13,958	-19,600	-3,989	145,817
Foreign	120,757	133,640	-12,883	26,952	1,858	-4,506
Retail	259,395	232,554	26,841	-7,352	2,131	-141,311

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	27,197	21,915	5,282	-3,458	7,612	12,768
Foreign	74,002	83,085	-9,083	20,598	-14,597	-19,354
Retail	90,744	86,943	3,801	-17,140	6,985	6,586

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	60,152	96,192	-36,040	-24,634	-30,960	68,222
Foreign	15,016	7,181	7,835	9,429	10,308	36,290
Retail	99,379	71,174	28,205	15,205	20,652	-104,512

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	1,117	2,361	-1,244	-523	312	-1,719
Foreign	30,024	41,916	-11,892	-3,207	5,290	-26,303
Retail	31,616	18,480	13,136	3,730	-5,602	28,022

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	631	466	165	523	-313	-1,855
Foreign	663	675	-12	376	50	2,562
Retail	4,384	4,537	-153	-899	263	-707

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	64	99	-35	-2	-78	535
Foreign	352	481	-129	-403	780	511
Retail	2,706	2,542	164	405	-702	-1,046

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

SET50 OVERVIEW

ปัจจัยต่างประเทศยังมี SENTIMENT บวกจาก 1) ความคาดหวังต่อการประชุม FED ระหว่างวันที่ 13-14 มิ.ย. ที่จะคงดอกเบี้ยระดับ 5.25% และ 2) ความคาดหวังเชิงบวกต่อการออกมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจจีน หนุนต่อตลาดหุ้นสหรัฐฯ +0.03% ถึง 0.36% ด้านปัจจัยในประเทศควานี้การรายเงินเฟ้อเดือน พ.ค. ขยายตัว 0.53%YOY ต่ำสุดในรอบ 21 เดือนและต่ำกว่าตลาดที่ 1.6%YOY จาก การลดลงของราคาเชื้อเพลิง ขณะที่เงินเฟ้อพื้นฐานขยายตัว 1.55%YOY โดย กระทรวงพาณิชย์คาดว่าเงินเฟ้อเดือน มิ.ย. มีแนวโน้มลดลงจากฐานที่สูงในเดือน มิ.ย.65 และต้นทุนเชื้อเพลิงที่ลดลง ส่วนมุมมองเงินเฟ้อปี 2566 คาดขยายตัว ในช่วง 1.7% - 2.7% ประเมินทิศทางเงินเฟ้อฯที่มีแนวโน้มชะลอตัวและอยู่ในกรอบ เป้าหมายของ ธปท. ทำให้ความจำเป็นต่อการเร่งขึ้นดอกเบี้ยฯลดลง ภายใต้ปัจจัย แวดล้อมทางบวกเป็นแรงหนุนต่อ SET50 INDEX ในช่วงต้น แต่อย่างไรก็ตาม ทิศทาง FUND FLOW ที่ยังมีแนวโน้มไหลออกหลังจากวานนี้ขายสุทธิทั้ง 3 ตลาด (ตลาดหุ้น 4.38 พันล้านบาท , SET50 INDEX FUTURES 9.08 พันสัญญา และ ตลาดบอนด์ 887 ล้านบาท) เป็นปัจจัยจำกัดการขึ้น จึงมองกรอบการเคลื่อนไหว ของวันที่ 917- 927 จุด

SET50 INDEX FUTURES

DIRECTION TRADING: ความคาดหวังต่อคงดอกเบี้ยของ FED และการออก มาตรการกระตุ้นของจีนเป็นแรงหนุนแต่ FUND FLOW ที่ไหลออกเป็นปัจจัยจำกัด การขึ้นและนำ TRADING S50M23 ในกรอบ 915-925 จุด และ SHORT กรอบบน

SPREAD TRADING: เปิด SHORT SPREAD S50M23U23 ได้ที่ -1.71 จุด ปัจจุบันกำไร 0.9 จุด แนะนำถือต่อโดยคาด SPREAD ระหว่าง S50U23 ลบด้วย S50M23 ณ วันที่ 29 มิ.ย. 2566 จะเท่ากับ -4.91 จุด

SET50 OPTION: แนะนำรอ LONG S50M23P950 ที่ 33 จุด (SET50 = 927) เป้า ทำกำไร 43 จุด (SET50 = 917) และ CUT LOSS 3 จุดคาด SET50 ขึ้นอย่างจำกัด

	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	917	927
S50M23	915	925

S50M23 (30 MIN CHART)



TECHNICAL COMMENT

S50M23 อยู่ในช่วงพักตัวมองกรอบการ เคลื่อนไหวที่ 915-925 จุด

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

SET50 Index	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
	923.54	11.56	8.85002

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
S50M23C1000	0.60	-0.10	> 1000.6	0.00	0.60	8.34%	0.02	0	16560	17.94	0.04	56.58	8.3%
S50M23C975	2.20	-0.20	> 977.2	0.00	2.20	5.81%	0.26	0	17179	18.03	0.11	46.57	5.8%
S50M23C950	5.70	-0.70	> 955.7	0.00	5.70	3.48%	2.03	0	13218	17.12	0.25	40.00	3.5%
S50M23C925	13.40	-2.30	> 938.4	0.00	13.40	1.61%	9.04	0	6180	16.22	0.47	32.53	1.6%
S50M23C900	29.00	-1.70	> 929	23.54	5.46	0.59%	24.72	0	973	17.39	0.71	22.71	0.6%

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
S50M23P1000	77.80	1.00	< 922.2	76.46	1.34	-0.15%	78.13	0	896	#N/A N/A	-1.00	-11.87	-0.1%
S50M23P975	55.50	3.30	< 919.5	51.46	4.04	-0.44%	53.41	0	1893	18.27	-0.88	-14.69	-0.4%
S50M23P950	35.00	3.10	< 915	26.46	8.54	-0.92%	30.21	0	4579	18.56	-0.73	-19.31	-0.9%
S50M23P925	17.00	0.20	< 908	1.46	15.54	-1.68%	12.25	0	6326	16.60	-0.52	-28.46	-1.7%
S50M23P900	7.10	-0.10	< 892.9	0.00	7.10	-3.32%	2.96	0	9959	17.16	-0.28	-36.60	-3.3%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 INDEX

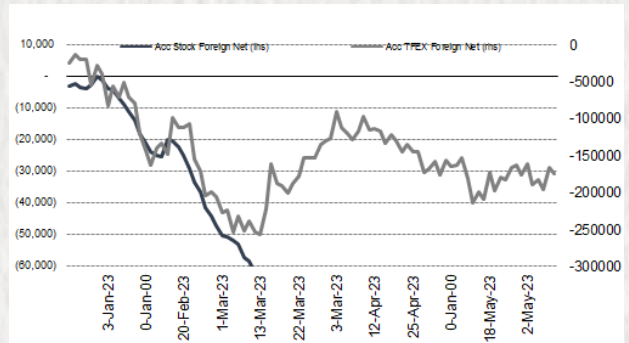
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	ลบการซื้อขาย
SET50	923.54	-1.35	-0.15%	6/6/23

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50J23	925.01	0.0	0.0%	73	81	0
S50K23	926.92	0.0	0.0%	40	133	0
S50M23	921.40	-2.3	-0.2%	170,710	516,898	-29,362
S50U23	918.90	-1.7	-0.2%	17,218	79,853	-479
S50Z23	919.10	-2.3	-0.3%	2,957	32,638	-923
S50H24	915.80	-2.2	-0.2%	1,043	7,865	-360

SET50 Futures Long(Short) : สิ้นวัน	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	1 เดือน
สถานะ	27,197	21,915	5,282	-3,458	-103	12,768
ต่างชาติ	74,002	83,085	-9,083	20,598	3,999	-19,354
รายย่อย	90,744	86,943	3,801	-17,140	-3,896	6,586

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 FUTURES



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คาดการณ์ SPREAD ณ สิ้นเดือนจาก ASPS MODEL

	เป้าหมาย Spread ซีรียโทล - ซีรียโทล					
	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. เอเซีย พลัส

SET50 ที่ระดับค่า PER ต่างๆ

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

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

SINGLE STOCK FUTURES

LONG KBANKM23

กำไรสุทธิ 1Q66 คิดเป็นสัดส่วน 28% ของประมาณการกำไรสุทธิปี 2566 ที่ 3.8 หมื่นล้านบาท (+8% YOY) ขณะที่แนวโน้ม 2Q66 มีแรงหนุนจากรายได้ดอกเบี้ยรับสุทธิ (NII) ตามการปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยเงินให้สินเชื่อกลุ่ม M-RATE ช่วง เม.ย. 66 ราคาหุ้น KBANK ซื้อขายบน PBV ราว 0.59 เท่า มองว่าไม่แพงเมื่อเทียบกับค่าเฉลี่ยกลุ่มฯ ซื้อขายราว 0.67 เท่า

ราคาหุ้นรายวัน แนวโน้มลักษณะ: SIDEWAY ล่าสุดเริ่มทำฐานให้เห็นแนวโซน 125 บาท พร้อมยืน EMA 10 วัน บ่งชี้ DOWNSIDE ที่จำกัด ประเมินเป้าหมายทำกำไรไว้ที่ 134 บาท

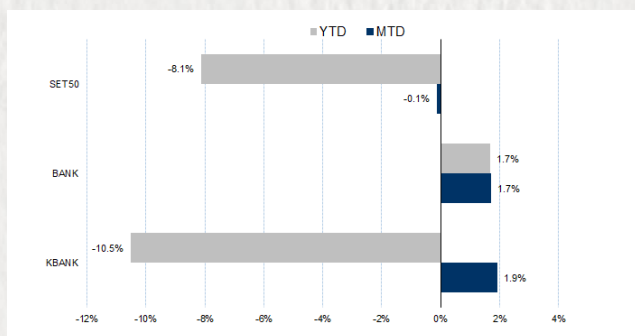
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ LONG KBANKM23 บริเวณ 130.50 บาท เป้าทำกำไร 136.00 บาท และ CUT LOSS 1.50 บาทจากทุน

Future							Underlying	
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 66F
KBANKM23	132.00	0.00	403	4498	15	13.64	25.00%	7.56

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

TECHNICAL CHART



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

SINGLE STOCK FUTURES

LONG LHM23

เชื่อว่าถ้าไตรมาส 1Q66 เป็นจุดต่ำสุดของปี และทิศทางจากนี้ตั้งแต่ 2Q-4Q66 คาดฟื้นตัวมากขึ้น โดยเฉพาะ 4Q66 จะเป็นจุดสูงสุดของปี ทำให้การปรับลงของราคาหุ้นถือเป็นจังหวะที่ดีในการเข้าลงทุน ราคาหุ้นมี UPSIDE 24% และน่าสนใจด้วยปันผลสูงเฉลี่ยกว่า 6% ต่อปี

ราคาหุ้นรายวัน จังหวะ TECHNICAL REBOUND หลังจากทดสอบกรอบล่าง SIDEWAY UP โดยแท่งเทียนทำจังหวะ HIGHER LOW คาดโอกาสกลับทดสอบแนวต้านช่วงสั้นที่ 9.00 บาท

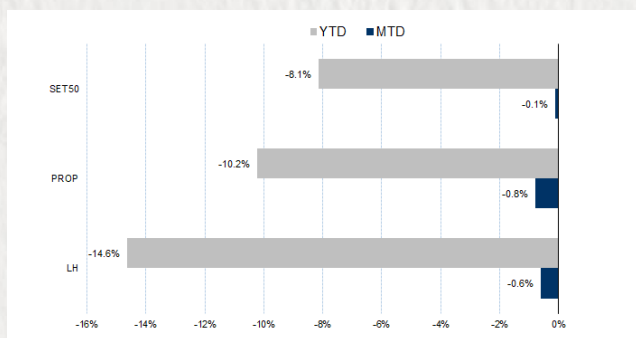
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำถือ LONG LHM23 ทุน 8.50 บาท เป้าทำกำไร 9.00 บาท และ CUT LOSS 0.15 บาทจากทุน

Future							Underlying	
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 66F
LHM23	8.42	-0.03	-	2837	0	-	16.73%	13.44

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

TECHNICAL CHART

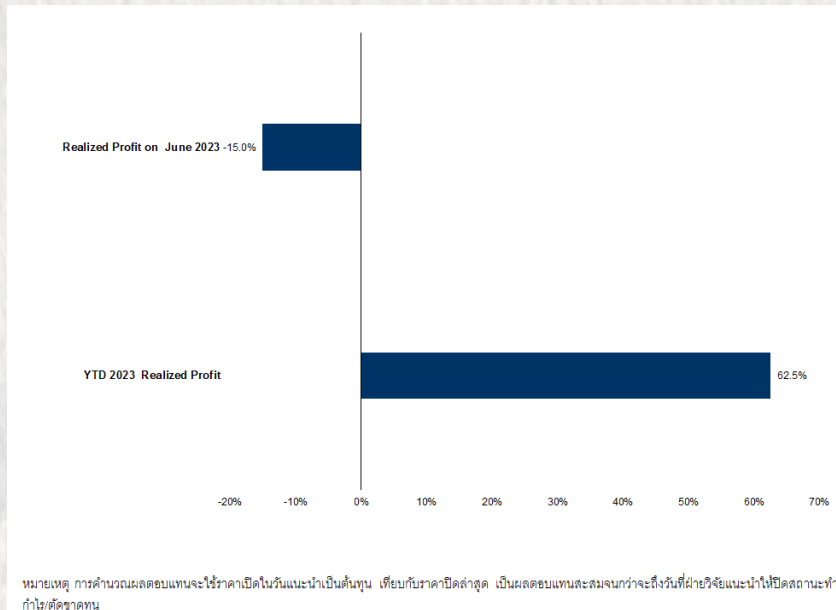


ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

TRACKING PERFORMANCE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

TOP 20 MOST ACTIVE VOLUME

	Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	TTBM23	1.64	1.65	35,911	54,398	33,388		1.65	1.63
2	TUM23	13.6	13.6	9,932	15,822	-	72	9.10	14.50
3	AAVM23	2.9	2.9	5,813	35,953	-	1,036	8.48	2.87
4	CKPM23	3.29	3.26	5,010	13,297	-	1,997	4.88	3.34
5	GULFM23	45.19	45.25	3,743	10,002	-	1,740	2.72	48.23
6	SIRIM23	1.76	1.76	2,130	23,878	-	2,131	15.44	1.76
7	PTTEPM23	145.31	145	1,627	3,937	-	167	16.78	147.31
8	IRPCM23	2.28	2.26	1,609	20,022	-	990	8.54	2.38
9	BANPUM23	8.32	8.35	1,575	44,889	-	157	16.03	8.61
10	BEAUTYM23	0.7	0.69	1,094	17,067	-	1,043	4.05	0.70
11	BLANDM23	0.88	0.87	1,004	74,523	-	3	8.95	0.88
12	TPIPLM23	1.45	1.45	1,002	2,697	-	11.97	1.47	1.43
13	HMPROM23	13.5	13.5	813	4,095	-	800	9.59	13.65
14	PSLM23	9.55	9.6	757	1,262	-	668	14.76	9.80
15	CRCM23	38.9	39	624	1,743	-	192	39.75	38.99
16	CHGM23	3.09	3.14	516	2,211	-	495	13.31	3.17
17	BGRIMM23	35.82	36.25	510	2,992	-	198	6.38	35.90
18	MTCM23	40.29	40.5	450	2,888	-	1,568	5.77	41.94
19	PTTGCM23	35.76	35.5	435	3,927	-	222	7.27	36.75
20	KBANKM23	132	132	403	4,498	-	15	11.21	133.20

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

GOLD FUTURES

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืนที่ผ่านมา เคลื่อนไหวในกรอบแคบ ปรับเพิ่มขึ้น 1.35 เหรียญฯ ปิดอยู่ที่ 1,963.3 เหรียญฯ โดยมีแรงกดดันจากการติดตัวขึ้นของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐ และการแข็งค่าของค่าเงินดอลลาร์ เมื่อเทียบกับเงินสกุลหลักอื่น นำโดยค่าเงินยูโรอ่อนค่า หลังเยอรมนีเปิดเผยข้อมูลคำสั่งซื้อภาคอุตสาหกรรมหดตัวในเดือน เม.ย. และสวนทางกับนักวิเคราะห์คาดการณ์ภาพรวม DOLLAR INDEX งานนี้ยังขึ้น 0.13% ปิดที่ 104.13 จุด สำหรับสัปดาห์นี้ ต้องติดตามการรายงานข้อมูลเศรษฐกิจสำคัญหลายประเทศ เช่น จีดีพี 1Q66 ของญี่ปุ่น และยูโรโซน, ดัชนี CPI และ PPI ของจีน ขณะที่ฝั่งสหรัฐจะเปิดเผยผลการค้า และจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ ฯลฯ

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GF10M23 เมื่อคืน ปรับเพิ่มขึ้น 160 บาท ปิดที่ 32,470 บาท (1,967 เหรียญฯ) สูงกว่าราคาทองคำตลาด SPOT ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,964 เหรียญฯ คาดราคา GF10M23 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 32,300-32,600 บาท ทิศทางราคาทองคำยังแกว่งตัวในกรอบที่ประเมินไว้ 1,950-1,980 เหรียญฯ จึงแนะนำให้ TRADING GF10M23 บริเวณ 32,190-32,680 บาท และกำหนดจุด CUT LOSS 100 บาทจากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

GOLD SPOT



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

GOLD ONLINE FUTURES

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GOM23	1,972	1	0.03	22,000	34,940	-5299
GOU23	2,001	0	0.00	6,960	10,221	-780

MINI GOLD FUTURES

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10M23	32,470	-10	-0.03	2,411	6,055	-536
GF10Q23	32,630	30	0.09	739	3,495	-212
GF10V23	32,730	110	0.34	126	578	57

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

หมายเหตุ 9 ราคาปิดของ GOLD FUTURES (NIGHT SESSION) SETTLE ณ เวลา 22.00 น. และปริมาณการซื้อขายเกิดขึ้นในช่วงเวลา 19.30-22.30 น.

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

GOLD ONLINE FUTURES (GOM23)

ทิศทางราคาทองคำ แรงยกหด หลุด EMA 75 วัน เป็นแท่งเทียน BEARISH BREAKOUT ส่งสัญญาณลบ เป็นจังหวะแกว่งหาฐานต่อ คาดกรอบ \$1960-1990

GOLD ONLINE: แนะนำ TRADING GOM23 ที่ \$1960-1990 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
1,850	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
2,030	32,807	33,048	33,290	33,531	33,772
2,060	33,292	33,537	33,782	34,026	34,271
2,090	33,777	34,025	34,274	34,522	34,770

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ MINI GOLD FUTURES

มิถุนายนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด	กำไร	ค่าธรรมเนียม+	กำไร	
future	เปลี่ยนแปลง	(ขาดทุน)	VAT (บาท)	(ขาดทุน)สุทธิ
32,880.00	250.0	2,500	(210)	2,290
32,830.00	200.0	2,000	(210)	1,790
32,780.00	150.0	1,500	(210)	1,290
32,730.00	100.0	1,000	(210)	790
32,680.00	50.0	500	(210)	290
32,630.00	0.0	-	(210)	(210)
32,580.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
32,530.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
32,480.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
32,430.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
32,380.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส