



SET50 Futures:

ราคาน้ำมันดิบที่ปรับลดกดดัน SET50 Index ช่วงสั้น แนะนำ Trading S50H21 ในกรอบ 953-968 จุด

SET50 Option:

แนะนำรอเปิด Long S50H21C950 ที่ 6 จุด (SET50 = 955 จุด) เป้าทำกำไรที่ 21 จุด (SET50 = 970 จุด) และ Cut Loss 3 จุด

Single Stock Futures:

แนะนำให้เปิด Long GPSCM21 ที่ 76.00 บาท เป้าทำกำไร 80 บาท Cut Loss 2 บาท จากทุน

แนะนำให้รอเปิด Long TUM21 ที่ 14.60 บาท เป้าทำกำไรที่ 15.20 บาท Cut loss 0.30 บาทจากทุน

Gold Futures:

ราคากองคำผันผวนในทิศทางลง โดยในระยะสั้นยังขาดปัจจัยขับเคลื่อน แนะนำ Trading GFJ21 กรอบ 25470 – 25910 (1720 – 1750\$)

สถานะของนักลงทุน

All Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	237,367	297,589	-60,222	-76,788	-122,343	-440,357
Foreign	201,270	214,787	-13,517	-20,556	-21,003	-65,526
Retail	385,812	312,073	73,739	97,344	143,346	505,883

SET50 Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	33,531	36,054	-2,523	-3,851	-4,654	-6,618
Foreign	153,414	152,682	732	1,152	4,288	-2,854
Retail	82,965	81,174	1,791	2,699	366	9,472

Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	192,951	249,004	-56,053	-64,998	-101,797	-396,099
Foreign	36,773	51,873	-15,100	-18,940	-27,088	-73,751
Retail	276,209	205,056	71,153	83,938	128,885	469,850

Metal Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	3,835	3,325	510	-729	-410	474
Foreign	10,984	10,110	874	-2,731	1,460	4,857
Retail	11,511	12,895	-1,384	3,460	-1,050	-5,331

Call Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	151	256	-105	-239	-739	-1,189
Foreign	1	6	-5	-8	-10	1,184
Retail	1,290	1,180	110	247	749	-39

Put Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	135	290	-155	-229	-435	-4,124
Foreign	1	1	0	181	987	2,148
Retail	1,546	1,391	155	230	72	1,088

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

SET50 Index Futures / Option **P. 2**

Single Stock Futures **P. 4**

Gold Futures **P. 7**

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องสามารถดำเนินการได้อย่างรวดเร็วทัน ฝายวิจัยจึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันทำการผ่าน 2 ช่องทาง เพื่อให้นักลงทุนสามารถปรับเปลี่ยนกลยุทธ์ได้มีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น คือ

- แอปพลิเคชัน: **ASP Smart**
- Telegram: **ASIA PLUS GROUP**
(<http://bit.ly/TeleAsiaplusgroup>)

RESEARCH DIVISION

บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส

เกิดศักดิ์ ทวีระธรรม

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจมล, CISA, CFA

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นวลพรรณ น้อยรัชชกุล

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันพานกิจ

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธรรม เกิดเมตต

ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

SET50 Overview

การรายงานส่งออกเดือน ก.พ.2564 ที่แผ่หดตัว -2.6%yoy แต่ถ้าวัดสินค้าที่เกี่ยวข้องกับน้ำมัน, ทองคำ, อัญมณี จะขยายตัวสูง 5.2%yoy โดยพาณิชย์ประเมินว่ามูลค่าส่งออกเดือนนี้ยังสูงกว่าค่าเฉลี่ยย้อนหลัง 5 ปี ที่ 2 หมื่นล้านเหรียญ และถ้ากำหนดให้มูลค่าส่งออกช่วงที่เหลือของปีเฉลี่ยที่ 2 หมื่นล้านเหรียญ/เดือน ทำให้การส่งออกทั้งปี จะขยายตัวไม่ต่ำกว่า 4%yoy ดีกว่าสมมติฐานที่ฝ่ายวิจัยประเมินไว้ที่ 3.5%yoy มองสถานการณ์ข้างต้นสะท้อน Downside ในแง่การปรับลด GDP Growth 64 จุดที่ซึ่งยังเป็นบวกต่อทิศทาง SET50 Index ในระยะกลาง-ยาว แต่อย่างไรก็ตามช่วงสั้นประเด็นลบจากราคาน้ำมันดิบที่พลิกปรับลง 4% จากนักลงทุนต่อความกังวลต่อความต้องการใช้จากยุโรปที่ลดลงหลังหลายประเทศ เช่น ฝรั่งเศส เยอรมัน และเนเธอร์แลนด์ ยังใช้มาตรการ Partial Lockdown จากจำนวนผู้ติดเชื้อ COVID-19 กลับมาเร่งตัวจะเป็นปัจจัยกดดันหุ้นกลุ่มพลังงาน ส่วนทิศทาง Fund Flow ในระยะนี้จากที่นักลงทุนสถาบันในประเทศและนักลงทุนต่างชาติยังมีทิศทางซื้อสลับขายไม่ชัดเจนทำให้ตลาดหุ้นยังอยู่ในภาวะผันผวนต่อไปจึงคาด SET50 Index วันนี้น่าจะแกว่งตามกรอบ 955-970 จุด

	SET50	S50H21	S50M21
แนวรับ	955	953	950
แนวต้าน	970	968	965

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยจึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ

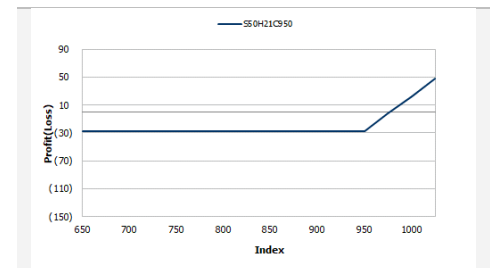
- แอปพลิเคชัน: **ASP Smart**
- Telegram: **ASIA PLUS GROUP**
(<http://bit.ly/TeleAsiaplusgroup>)

SET50 Index Futures

Direction Trading: ราคาน้ำมันดิบที่ปรับลงกดดัน SET50 Index ช่วงสั้น แนะนำ Trading S50H21 ในกรอบ 953-968 จุด

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50M21 ลบด้วย S50H21 ณ วันที่ 30 มี.ค. 2564 จะเท่ากับ -6.42 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -3.0 จุด แนะนำให้เปิด Short Spread ที่ระดับราคาไม่ต่ำกว่า -3.0 จุด เพื่อคาด Spread ผู้เข้าค่าทางทฤษฎี

SET50 Option: แนะนำรอเปิด Long S50H21C950 ที่ 6 จุด (SET50 = 955 จุด) เป้าทำกำไรที่ 21 จุด (SET50 = 970 จุด) และ Cut Loss 3 จุด



หมายเหตุ : ตัวคูณดัชนีเท่ากับ 200 บาท ต่อ 1 จุดของดัชนี

	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	961.75	33.4643	5.551963

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
S50M21C1050	5.90	-0.80	> 1055.9	0.00	5.90	9.79%	11.72	41	398	16.52	0.15	24.13	0.1
S50M21C1025	9.40	-1.10	> 1034.4	0.00	9.40	7.55%	17.00	57	280	16.12	0.22	22.22	0.1
S50M21C1000	15.00	-1.20	> 1015	0.00	15.00	5.54%	24.04	99	471	16.30	0.32	20.30	0.1
S50M21C975	23.50	-1.00	> 998.5	0.00	23.50	3.82%	33.15	68	374	15.96	0.43	17.52	0.0
S50M21C950	33.10	-3.90	> 983.1	11.75	21.35	2.22%	44.53	22	373	15.85	0.55	16.09	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
S50M21P1050	96.80	-0.70	< 953.2	88.25	8.55	-0.89%	105.04	0	0	14.26	-0.89	-9.62	0.0
S50M21P1025	75.40	-0.60	< 949.6	63.25	12.15	-1.26%	85.34	0	14	14.80	-0.80	-10.91	0.0
S50M21P1000	57.60	-3.40	< 942.4	38.25	19.35	-2.01%	67.41	4	70	15.96	-0.68	-11.85	0.0
S50M21P975	40.40	-2.10	< 934.6	13.25	27.15	-2.82%	51.54	20	170	16.55	-0.56	-13.58	0.0
S50M21P950	29.00	-0.80	< 921	0.00	29.00	-4.24%	37.95	40	294	16.81	-0.44	-14.50	0.0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

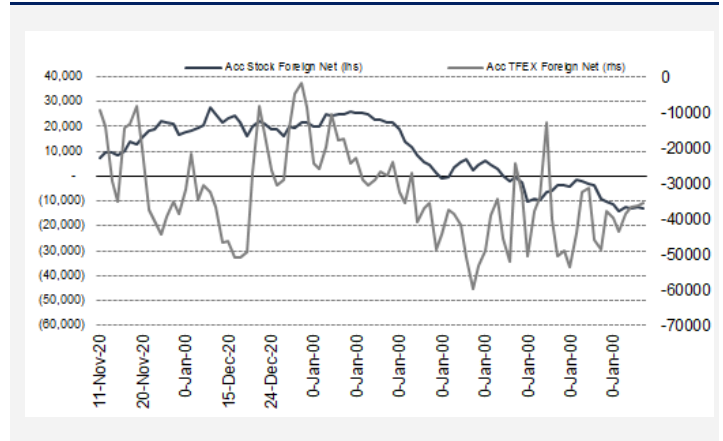
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สรุปการซื้อขาย
SET50	961.75	0.16	0.02%	25/3/21

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50G21	928.46	0.0	0.0%	27	75	0
S50H21	959.00	-1.8	-0.2%	164,230	224,417	-115
S50J21	957.30	-1.0	-0.1%	339	172	0
S50M21	955.80	-1.3	-0.1%	89,350	110,040	489
S50U21	952.70	-1.5	-0.2%	4,762	11,322	-43
S50Z21	953.80	-1.1	-0.1%	1,751	5,475	0

SET50 Futures Long(Short) : ลักษณะ	สถานะ Long(Short)			สถานะ Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	QTD
สถาบัน	237,081	297,043	-59,962	-3,851	-8,105	0
ต่างชาติ	201,268	214,780	-13,512	1,152	-3,187	0
รายย่อย	382,976	309,502	73,474	2,699	11,292	0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศในตราสารทุน
และ SET50 Futures



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

	เป้าหมาย Spread ชีรีไทล์ - ชีรีไทล์					
	S50J20	S50K20	S50M20	S50N20	S50Q20	S50U20
	ณ 29 เม.ย.63	ณ 28 พ.ค.63	ณ 29 มิ.ย.63	ณ 30 ก.ค.63	ณ 28 ส.ค.63	ณ 29 ก.ย.63
S50J20						
S50K20	-1.60					
S50M20	-1.32	0.28				
S50N20	-1.47	0.13	-0.15			
S50Q20	-5.84	-4.23	-4.52	-4.37		
S50U20	-6.88	-5.28	-5.56	-5.41	-1.04	

*สมมติฐานอัตราดอกเบี้ยนโยบายระหว่าง มิ.ย. - ก.ย. 63 เท่ากับ 0.5%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

SET50 ที่ระดับค่า PER ต่างๆ

SET 50 Sensitivity	ม.ค. 62E	มี.ค. 62E	เม.ย. 62E	พ.ค. 62E	มิ.ย. 62E	ก.ย. 62E	ธ.ค. 62E
PER 15.5	898	870	857	843	830	789	748
PER 16	926	899	885	871	857	815	773
PER 16.5	955	927	912	898	883	840	797
PER 17	984	955	940	925	910	866	821
PER 17.5	1,013	983	967	952	937	891	845
PER 18	1,042	1,011	995	979	964	916	869
PER 18.5	1,071	1,039	1,023	1,007	990	942	893
PER 19	1,100	1,067	1,050	1,034	1,017	967	918

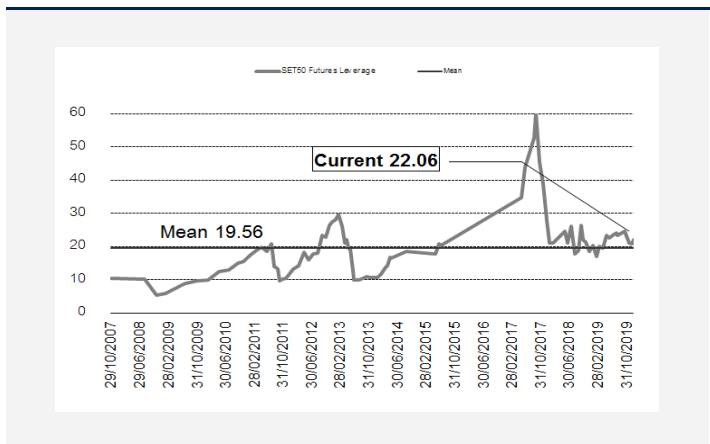
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ SET50 Futures

ราคาปิด	chg (จุด)	นักลงทุนรายย่อย		
		กำไร	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร
Futures	เทียบกับ	(ขาดทุน)		(ขาดทุน)สุทธิ
964.00	5.0	1,000	(186)	814
963.00	4.0	800	(186)	614
962.00	3.0	600	(186)	414
961.00	2.0	400	(186)	214
960.00	1.0	200	(186)	14
959.00	0.0	0.0	(186)	(186)
958.00	-1.0	(200)	(186)	(386)
957.00	-2.0	(400)	(186)	(586)
956.00	-3.0	(600)	(186)	(786)
955.00	-4.0	(800)	(186)	(986)
954.00	-5.0	(1,000)	(186)	(1,186)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ระดับ Leverage ของ SET50 Futures



ที่มา: Thailand Clearing House, ฝ่ายวิจัย ASPS

Single Stock Futures

Long GPSCM21

ภาพรวมทั้งปี 2564 คาดกำไรสุทธิ และกำไรปกติจะปรับตัวเพิ่มขึ้นราว 10.3%yoy และ 11.1% yoy มาอยู่ที่ 8.3 พันล้านบาท และ 1.0 หมื่นล้านบาท จากการรับรู้โครงการ NNEG 18 เมกะวัตต์ได้เต็มปี รวมถึงจะมีโครงการ Rayong WTE จะ COD ในช่วง 2Q64 มี backlog ในมืออีก 250 เมกะวัตต์ที่รอ COD ได้ภายในปี 2566 จาก 5 พันเมกะวัตต์ อีกทั้งมีแผนรุกธุรกิจใหม่ แบตเตอรี่ 141 เมกะวัตต์ซึ่งเป็นหนึ่งในกลยุทธ์ New S-Curve ของบริษัทโดยสร้างโรงงานผลิตแบตเตอรี่ต้นแบบ 30.0 MWh ด้วยเทคโนโลยี semi-solid ขณะทีราคาหุ้นในปัจจุบันเริ่มมี upside FV 82 บาท ภาพทางเทคนิค แนวพักตัวอยู่บริเวณแนวรับ 74.50 บาท โดยมีสัญญาณบวกทางเทคนิค จากการยก Low ขึ้น ระยะถัดไป หาก Breakout เส้น EMA 10 วัน ที่ 75.00 บาท มองเป็นการเปิด Upside มีโอกาสปรับขึ้นทดสอบแนวต้านถัดไปที่ 77.00 บาท

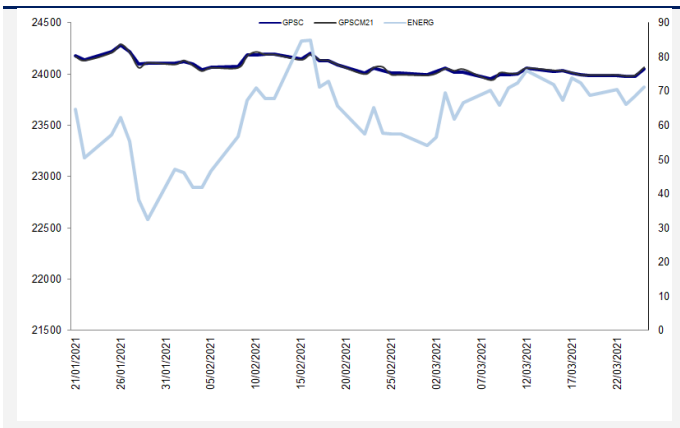
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long GPSCM21 ที่ 76.00 บาท เป้าทำกำไร 80 บาท Cut Loss 2 บาทจากทุน

Future								Underlying			
Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 63F	PBV 63F	EPS GROWTH 63F
GPSCM21	77.00	0.50	76.51	4403	6092	917	8.71	7.19%	26.04	1.79	5.81%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



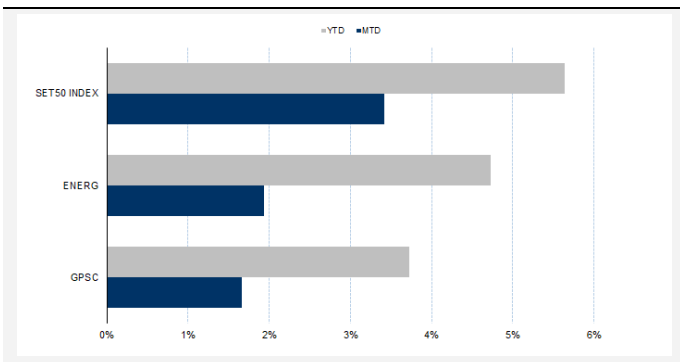
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures

นักลงทุนรายย่อย					
ราคาปิด future	chg (จุด) เทียบกับราคา	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม +VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ	
77.50	0.5	500	5.29	495	
77.40	0.4	400	5.29	395	
77.30	0.3	300	5.29	295	
77.20	0.2	200	5.29	195	
77.10	0.1	100	5.29	95	
77.00	0.0	-	5.29	(5)	
76.90	-0.1	(100)	5.29	(105)	
76.80	-0.2	(200)	5.29	(205)	
76.70	-0.3	(300)	5.29	(305)	
76.60	-0.4	(400)	5.29	(405)	
76.50	-0.5	(500)	5.29	(505)	

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Return



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Single Stock Futures

Long TUM21

คาดการณ์ราคาหุ้นปี 2564 จะเพิ่มขึ้น 2.3% yoy จากธุรกิจที่น่าจะปกป้อง อาหารสัตว์เลี้ยงสัตว์ ต่อเนื่อง ธุรกิจอาหารแช่เย็นแช่แข็งและร้านอาหาร Red Lobster เป็นต้น นอกจากนี้ยังให้ความสำคัญกับการเพิ่มประสิทธิภาพการทำการค้า ทั้งลดต้นทุนและขยายการลงทุนในธุรกิจใหม่ที่มีมูลค่าเพิ่มสูง อาทิ ธุรกิจ **Ingredients, Supplement และ Plant based meat** Valuation น่าสนใจ PER เพียง 10 เท่า พร้อมปันผลกว่า 5%

ภาพทางเทคนิค รีบาวน์ เกิดแท่งเทียนเขียวเต็มแท่ง หลังปรับฐานลงมาทดสอบเส้น EMA 200 วัน มองเป็นการเปิด Upside มีโอกาสปรับขึ้นทดสอบกรอบบนของ Uptrend Channel บริเวณ 15.20 บาท

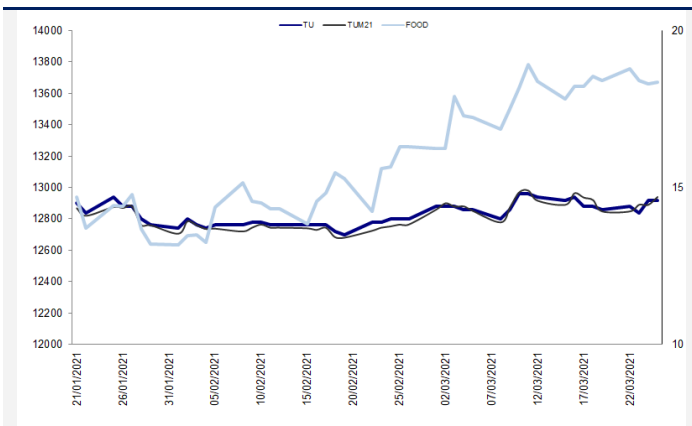
กลยุทธ์การลงทุน

สถานะ Long TUM21 ที่ 14.60 บาท เป้าทำกำไร 15.20 บาท Cut Loss 0.30 บาท จากทุน

Future								Underlying			
Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 63F	PBV 63F	EPS GROWTH 63F
TUM21	14.70	0.10	14.60	1202	6506	600	8.00	36.99%	10.90	1.27	2.30%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



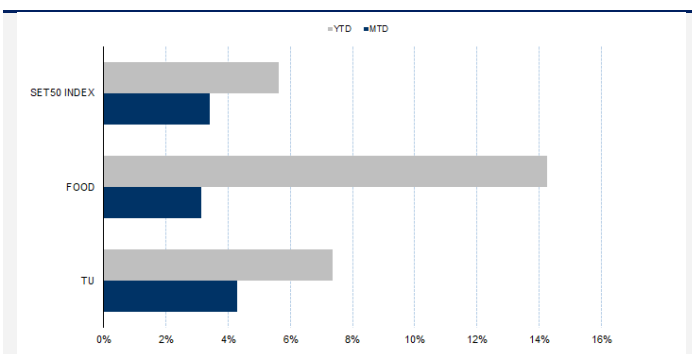
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures

ราคาปิด future	น้กลงทุนรายย่อย			
	chg (จุด) เทียบกับราคา	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม +VAT (บาท)	กำไรสุทธิ (ขาดทุน)สุทธิ
15.20	0.5	500	15.44	485
15.10	0.4	400	15.44	385
15.00	0.3	300	15.44	285
14.90	0.2	200	15.44	185
14.80	0.1	100	15.44	85
14.70	0.0	-	15.44	(15)
14.60	-0.1	(100)	15.44	(115)
14.50	-0.2	(200)	15.44	(215)
14.40	-0.3	(300)	15.44	(315)
14.30	-0.4	(400)	15.44	(415)
14.20	-0.5	(500)	15.44	(515)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Return



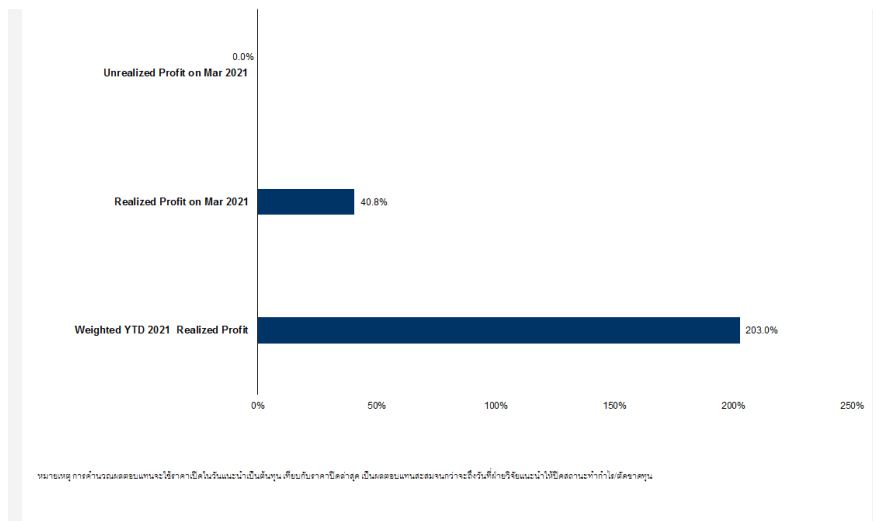
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Tracking Performance



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Top 20 Most Active Volume

	Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	KTCM21	75.70	-0.80	76.51	51251	26205	37	22.62	78.01	70.87
2	TRUEM21	3.58	0.04	3.54	39919	17574	23018	9.32	3.70	3.30
3	SIRIM21	1.05	0.01	1.04	34064	37893	-18760	9.12	1.11	0.90
4	JASM21	3.13	0.11	3.02	21911	14481	7269	6.62	3.16	2.88
5	BLANDM21	1.19	0.01	1.18	21435	172661	5477	10.35	1.20	1.13
6	SUPERM21	1.03	0.02	1.01	14659	143997	12629	6.64	1.04	0.97
7	WHAM21	3.52	0.02	3.50	12569	42450	-4591	8.37	3.68	3.42
8	WHAM21	3.52	0.02	3.50	12569	42450	-4591	8.37	3.68	3.42
9	IRPCM21	3.78	0.04	3.74	11308	116830	4154	10.94	3.98	3.67
10	LHM21	8.41	-0.24	8.65	9077	14667	987	11.98	8.60	8.11
11	LHM21	8.41	-0.24	8.65	9077	14667	987	11.98	8.60	8.11
12	BANPUM21	12.12	0.02	12.10	8627	17603	5560	14.47	12.29	11.39
13	TMBM21	1.20	-0.01	1.21	7130	57115	6357	7.96	1.26	1.18
14	GUNKULM21	3.62	-0.14	3.76	6785	48769	5213	14.14	3.94	3.12
15	BEAUTYM21	1.84	0.04	1.80	6044	30302	6040	5.92	1.85	1.77
16	TTAM21	12.80	-0.10	12.90	4786	8826	3536	30.86	13.28	9.35
17	GPSCM21	77.00	0.50	76.51	4403	6092	917	8.71	77.19	75.38
18	BPPM21	20.28	0.48	19.80	4236	5428	1025		20.30	19.01
19	ICHIM21	13.86	-0.44	14.30	4033	10381	-993	8.75	14.55	13.67
20	STPIM21	4.12	0.00	4.12	4000	6507	1000	6.38	4.25	3.74

Gold Futures

ราคาทองคำตลาดทองคำสหรัฐเมื่อคืน ปรับลดลง 7.2 เหรียญฯ หรือ 0.4% ปิดอยู่ที่ 1,727 เหรียญฯ ภายหลังจากสหรัฐรายงานตัวเลขเศรษฐกิจแข็งแกร่งเกินคาด นำโดยจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ลดลงและระดับต่ำสุดนับตั้งแต่มี.ค. 2563 และต่ำกว่านักวิเคราะห์คาดไว้ รวมถึงต่ำกว่าระดับสูงสุดในช่วงก่อนเกิดการระบาดของโควิด-19 ภาพรวมหนุนให้ตลาดหุ้นดาวโจนส์สหรัฐเมื่อคืนปิดบวก 199.42 จุด หรือ 0.62% รวมถึงค่าเงินดอลลาร์สหรัฐแข็งค่า ส่งผลให้ Dollar Index ปรับขึ้น 0.3% ปิดบริเวณ 92.85 จุด และเป็นปัจจัยหลักที่กดดันต่อราคาทองคำ สำหรับวันนี้ ทางสหรัฐจะเปิดเผยข้อมูลเศรษฐกิจได้แก่ ดัชนีการใช้จ่ายเพื่อการบริโภค และดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภคเป็นต้น

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFJ21 เมื่อคืน ปรับเพิ่มขึ้น 20 บาท ปิดอยู่ที่ 25,640 บาท เทียบเท่า 1,731.23 เหรียญฯ สูงกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหว 1,727-1,729 เหรียญฯ คาดราคา GFJ21 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 25,450-25,750 บาท ทิศทางราคาทองคำยังแกว่งตัวในกรอบแคบตามที่ฝ่ายวิจัยประเมินไว้ 1,720-1,750 เหรียญฯ จึงคงแนะนำให้ นักลงทุน Trading บริเวณ 25,470-25,910 บาท และกำหนดจุด Cut Loss ไว้ 100 บาท จากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยง หากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดคาด

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

GOLD Technical: ทิศทางราคาทองคำรับาวร์ หลังจากลงมาทดสอบแนวรับบริเวณ \$1700 และมีแรงซ็อกกลับ โดยประเมินแนวต้านไว้ที่ \$1720 และ \$1775 แต่ต้องระวังหากรับไม่อยู่ จะเป็นการเปิด Downside ประเมินแนวรับถัดไปไว้ที่ \$1670

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GFJ21	25,640	10	0.04	28	514	-11
GFJ21	25,660	0	0.00	17	198	-10
GFQ21	25,710	-40	0.16	1	102	0

Mini Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GF10J21	25,650	0	0.00	1,318	8,860	-156
GF10M21	25,650	-20	-0.08	1,132	5,757	588
GF10Q21	25,690	0	0.00	462	3,348	120

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

ที่มา : สายงานวิจัย บล.เอเชีย พลัส

ASPS Gold Valuation Matrix (เหรียญฯ/ทรอยออนซ์)

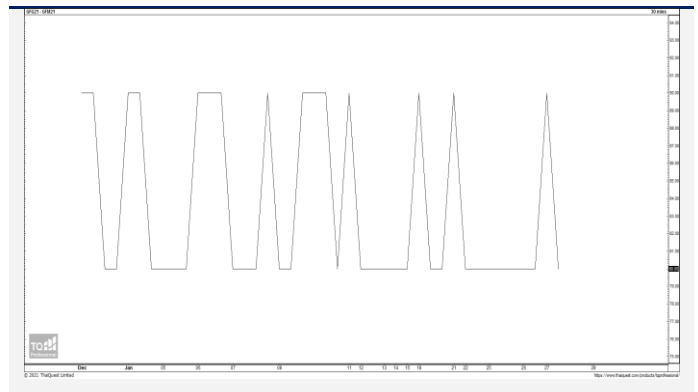
	← ลอนค่า					Dollar Index					แข็งค่า →				
	93	94	95	96	97	98	99	100	101	102	103				
Nymex (USD/Barrel)	40	1,617.66	1,589.21	1,560.76	1,532.31	1,503.86	1,475.41	1,446.96	1,418.52	1,390.07	1,361.62	1,333.17			
	43	1,616.71	1,588.26	1,559.81	1,531.36	1,502.91	1,474.47	1,446.02	1,417.57	1,389.12	1,360.67	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)				
	30.50	30.75	31.00	31.25	31.50
1,650	23,921	24,117	24,313	24,509	24,705
1,680	24,356	24,555	24,755	24,955	25,154
1,710	24,791	24,994	25,197	25,400	25,604
1,740	25,226	25,432	25,639	25,846	26,053
1,770	25,661	25,871	26,081	26,292	26,502
1,800	26,096	26,309	26,523	26,737	26,951
1,830	26,530	26,748	26,965	27,183	27,400
1,860	26,965	27,186	27,407	27,628	27,850
1,890	27,400	27,625	27,850	28,074	28,299

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Spread ระหว่าง GFJ21 – GFQ21



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Gold Futures

บัลลงทอนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
25,890.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
25,840.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
25,790.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
25,740.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
25,690.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
25,640.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
25,590.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
25,540.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
25,490.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
25,440.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
25,390.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

บัลลงทอนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
25,900.00	250.0	2,500	(210)	2,290
25,850.00	200.0	2,000	(210)	1,790
25,800.00	150.0	1,500	(210)	1,290
25,750.00	100.0	1,000	(210)	790
25,700.00	50.0	500	(210)	290
25,650.00	0.0	-	(210)	(210)
25,600.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
25,550.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
25,500.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
25,450.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
25,400.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส