

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

17 สิงหาคม 2565

SET50 FUTURES:

สภาพแวดล้อมขาดปัจจัยหนุนแต่ทิศทาง Fund Flow ที่ยังไหลเข้าทำให้ SET50 Index อยู่ในช่วง Sideway Up แนะนำ Trading S50U22 กรอบ 975-990 จุด

SET50 OPTION:

สถานะ Long S50U22C975 ที่ 19 จุด (SET50=985) แนะนำถือต่อเป้าทำกำไร 29 จุด (SET50=995) และ Cut Loss 3 จุดขาด SET50 อยู่ในช่วงปรับขึ้น

SINGLE STOCK FUTURES:

รอ Long KBANKU22 ที่ 149 บาท เป้าทำกำไร 153 บาท Cut Loss 1.5 บาท หนุนจากทิศทางดอกเบี้ยขาขึ้นและถูกเข้าคำนวณใน MSCI

แนะนำ Long MU22 บริเวณ 53.25 บาท เป้าทำกำไร 55.00 บาท และ Cut Loss 0.5 บาทจากทุน ได้ประโยชน์จากการเปิดกิจกรรมเศรษฐกิจในประเทศ

GOLD FUTURES:

สถานะ Short GFQ22 ทุนเฉลี่ย 30260 บาท มีกำไรเพิ่มเป็น 350 บาท แนะนำถือต่อ มีเป้าทำกำไร 29620 บาท (\$1760) และ Lock กำไรสูงขึ้นไป 250 บาทจากทุน

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 INDEX

| Symbol | Close | Chg | %Chg | Vol (Contracts) | OI (Contracts) | OI Chg (Contracts) |
|----------|--------|---------|--------|-----------------|----------------|--------------------|
| SET50 | 986.68 | 0.03 | 0.00% | n.a. | n.a. | n.a. |
| S50U22 | 981 | -2.00 | -0.20% | 185,153 | 498,943 | 1,926 |
| KBANKU22 | 150.35 | -0.04 | -0.03% | 79 | 3,130 | (377) |
| MU22 | 53.17 | -0.81 | -1.50% | 18 | 697 | (2) |
| GFQ22 | 29940 | -130.00 | -0.43% | 49 | 241 | (23) |

ที่มา : สายงานวิจัย บล. เอเชีย 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

* แอปพลิเคชัน “ASP Smart”



* Telegram “Asia plus group”

Follow now



Asia Plus Group

RESEARCH DIVISION

บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส

เกิดศักดิ์ ทวีธรรษ

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจภมา, CISA, CFA

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นวลพรรณ น้อยรัชชกร

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันพานากิจ

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธ เกิดเนตร

ผู้ช่วยนักวิเคราะห์



สถานะของนักลงทุน

| | All Futures Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|---|---------|---------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 141,770 | 124,870 | 16,900 | 48,228 | 15,938 | -35,969 |
| Foreign | 108,743 | 132,991 | -24,248 | 5,129 | 36,999 | 145,064 |
| Retail | 226,776 | 219,428 | 7,348 | -53,357 | -52,937 | -109,095 |

| | SET50 Futures Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|---|--------|--------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 40,349 | 40,378 | -29 | -4,891 | -2,460 | -12,917 |
| Foreign | 82,495 | 90,464 | -7,969 | 24,370 | 50,907 | 159,625 |
| Retail | 94,659 | 86,661 | 7,998 | -19,479 | -48,447 | -146,708 |

| | Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|--|--------|---------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 89,182 | 66,340 | 22,842 | 38,860 | 57,956 | 969 |
| Foreign | 12,035 | 26,016 | -13,981 | -15,647 | -15,007 | -45,073 |
| Retail | 87,694 | 96,555 | -8,861 | -23,213 | -42,949 | 44,104 |

| | Metal Futures Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|---|--------|--------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 3,804 | 3,891 | -87 | -1,803 | -1,755 | 350 |
| Foreign | 13,764 | 15,936 | -2,172 | -3,464 | 1,179 | 24,790 |
| Retail | 17,541 | 15,282 | 2,259 | 5,267 | 576 | -25,140 |

| | Call Option Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|---|-------|------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 79 | 380 | -301 | -15 | 1,374 | 280 |
| Foreign | 129 | 345 | -216 | -186 | 16 | 590 |
| Retail | 2,936 | 2,419 | 517 | 201 | -1,390 | -870 |

| | Put Option Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|--|-------|------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 75 | 14 | 61 | 973 | 3,731 | 5,133 |
| Foreign | 248 | 185 | 63 | 31 | -275 | 3,721 |
| Retail | 2,937 | 3,061 | -124 | -1,004 | -3,456 | -8,854 |



SET50 OVERVIEW

ตลาดหุ้นสหรัฐวานนี้แกว่งผันผวนไร้ทิศทางที่ชัดเจนในช่วง -0.2% ถึง 0.7% หลังจากขาดปัจจัยหนุนใหม่และนักลงทุนอยู่ในช่วงติดตามการรายงาน Fed Minutes เดือน ก.ค. ที่ผ่านมาต่อการสัญญาณขึ้นดอกเบี้ยในระยะถัดไป ส่วนปัจจัยภายในประเทศให้ความสนใจไปที่ทิศทางผลประกอบการบริษัทไทยงวด 2Q65 ที่กำไรสุทธิ 3.46 แสนล้านบาท เพิ่มขึ้น 22.4%qoq และ 26.6%yoy ซึ่งถือเป็นผลประกอบการที่สูงสุดเป็นประวัติการณ์ หนุนหลักจากหุ้นในกลุ่มพลังงานที่ได้ประโยชน์จากทิศทางพลังงานช่วง 2Q65 ที่อยู่ในระดับสูง สถานการณ์ดังกล่าวมองเป็นปัจจัยบวกสำคัญที่ดึงดูด Fund Flow ต่างชาติ ซึ่งวานนี้ยังมีสัญญาณบวกจากการซื้อสุทธิในตลาดหุ้นติดต่อกัน 7 วันทำการอีก 5 พันล้านบาท สภาพแวดล้อมข้างต้นทำให้ SET50 Index ยังอยู่ในโหมด Sideway Up ตามกรอบ 975-990 จุด

SET50 INDEX FUTURES

Direction Trading: สภาพแวดล้อมขาดปัจจัยหนุนแต่ทิศทาง Fund Flow ที่ยังไหลเข้าทำให้ SET50 Index อยู่ในช่วง Sideway Up แนะนำ Trading S50U22 ในกรอบ 975-990 จุด

Spread Trading: นักลงทุนน่าจะเปิดสถานะ Long Spread S50U22Z22 ได้ที่ -1.60 จุด กำไรเล็กน้อย แนะนำถือต่อเพื่อคาดหวัง Spread ระหว่าง S50Z22 ลบด้วย S50U22 จะลู่เข้าค่าทางทฤษฎีที่ 2.53 จุด

SET50 Option: สถานะ Long S50U22C975 ที่ 19 จุด (SET50=985) แนะนำถือต่อเป้าทำกำไร 29 จุด (SET50=995) และ Cut Loss 3 จุดขาด SET50 อยู่ในช่วงปรับขึ้น

S50U22 (30 MIN CHART)



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

| | แนวรับ | แนวต้าน |
|--------|--------|---------|
| SET50 | 975 | 990 |
| S50U22 | 975 | 990 |

* ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยจึงเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ

- * แอปพลิเคชัน "ASP Smart" 
- * Telegram "Asia plus group"

Follow now

 Asia Plus Group

TECHNICAL COMMENT

S50U22 ระยะสั้นติดแนวต้านบริเวณ 985/990 จุด แต่หากยืนเหนือ 975 จุด ยังมองแนวโน้มหลักยังเป็น Sideway Up ประกอบการเคลื่อนไหวระยะสั้นที่ 975-990 จุด



| | Last | 1Yr Hist. Volatility | 2Week Hist. Volatility |
|-------------|--------|----------------------|------------------------|
| SET50 Index | 986.68 | 12.10808 | 4.86069 |

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 | 0.70 | 0.10 | > 1050.7 | 0.00 | 0.70 | 6.49% | 0.75 | 377 | 6892 | 11.38 | 0.04 | 62.56 | 0.1 |
| S50U22C1025 | 2.20 | -0.20 | > 1027.2 | 0.00 | 2.20 | 4.11% | 2.80 | 651 | 8673 | 10.73 | 0.12 | 55.10 | 0.0 |
| S50U22C1000 | 7.90 | -0.20 | > 1007.9 | 0.00 | 7.90 | 2.15% | 8.15 | 1181 | 9018 | 11.34 | 0.32 | 39.85 | 0.0 |
| S50U22C975 | 19.80 | -0.90 | > 994.8 | 11.68 | 8.12 | 0.82% | 18.90 | 324 | 7143 | 12.24 | 0.56 | 28.06 | 0.0 |
| S50U22C950 | 37.10 | -2.00 | > 987.1 | 36.68 | 0.42 | 0.04% | 35.76 | 64 | 4643 | 12.95 | 0.77 | 20.35 | 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 | 65.30 | -3.70 | < 984.7 | 63.32 | 1.98 | -0.20% | 69.46 | 0 | 247 | #N/A N/A | -1.00 | -15.11 | 0.0 |
| S50U22P1025 | 46.50 | 2.00 | < 978.5 | 38.32 | 8.18 | -0.83% | 46.53 | 32 | 280 | 11.36 | -0.86 | -18.17 | 0.0 |
| S50U22P1000 | 26.10 | 0.80 | < 973.9 | 13.32 | 12.78 | -1.30% | 26.91 | 122 | 1030 | 10.80 | -0.68 | -25.84 | 0.0 |
| S50U22P975 | 13.90 | 0.90 | < 961.1 | 0.00 | 13.90 | -2.59% | 12.68 | 721 | 4348 | 12.40 | -0.43 | -30.59 | 0.0 |
| S50U22P950 | 6.70 | 0.60 | < 943.3 | 0.00 | 6.70 | -4.40% | 4.57 | 760 | 5991 | 13.60 | -0.24 | -35.11 | 0.0 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 INDEX

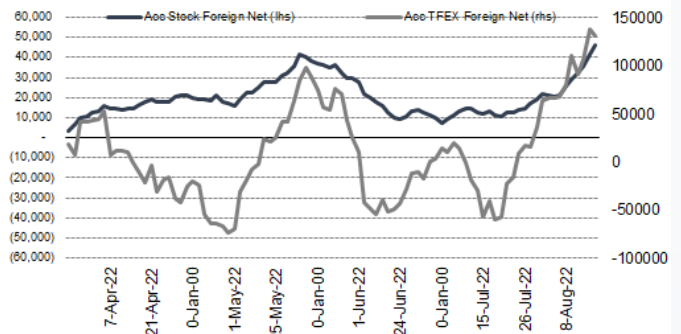
| UNDERLYING | Close | Chg | %Chg | สัปดาห์ซื้อขาย |
|------------|--------|------|-------|----------------|
| SET50 | 986.68 | 0.03 | 0.00% | 16/8/22 |

| Symbol | Settle | Chg | %Chg | Vol. | OI | OI Chg |
|--------|--------|------|-------|---------|---------|--------|
| S50N22 | 950.67 | 0.0 | 0.0% | 72 | 538 | 0 |
| S50Q22 | 986.30 | 0.4 | 0.0% | 355 | 222 | -84 |
| S50U22 | 981.00 | -2.0 | -0.2% | 185,153 | 498,943 | 1,926 |
| S50Z22 | 979.70 | -1.7 | -0.2% | 25,286 | 58,027 | 237 |
| S50H23 | 973.30 | -1.5 | -0.2% | 3,905 | 14,742 | 273 |
| S50M23 | 968.20 | -2.2 | -0.2% | 2,790 | 5,458 | 59 |

| SET50 Futures Long(Short) : สัปดาห์ | Long | Short | Net | 2 วัน | 2 สัปดาห์ | 1 เดือน |
|-------------------------------------|--------|--------|--------|---------|-----------|----------|
| สกลามัน | 40,349 | 40,378 | -29 | -4,891 | -3,348 | -12,917 |
| ต่างชาติ | 82,495 | 90,464 | -7,969 | 24,370 | 94,535 | 159,625 |
| รายย่อย | 34,653 | 86,661 | 7,998 | -19,479 | -91,187 | -146,708 |

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 | | | | | |
|--------|-------------------------------------|-------------|--------------|-------------|-------------|-------------|
| | 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. เอเชีย พลัส

SET50 ที่ระดับค่า PER ต่างๆ

| SET 50 Sensitivity | 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. เอเชีย พลัส



Long KBANKU22

ธิดดอกเบ๊ยะขาขึ้น กอปรกับเป็น ธ.พ. ที่ได้รับประโยชน์มากสุดในกลุ่มฯ หากเศรษฐกิจฟื้นตัวบวกต่อคุณภาพลูกหนี้กลุ่ม SME ขณะที่คุณภาพสินทรัพย์ แม้ในช่วงเศรษฐกิจกำลังฟื้นตัวยังมีความเสี่ยง แต่เชื่อว่าประมาณการสะท้อนความเสี่ยงส่วนใหญ่แล้ว ราคาหุ้นมี PBV ซื้อขายที่ 0.67 เท่า และ PER ราว 8 เท่า ในระยะสั้นมีแรงหนุนเพิ่มจากการถูกเข้าคำนวณในดัชนี MSCI มีผลราคาปิด 31 ส.ค.65

ภาพทางเทคนิค จังหวะฟื้นตัวสนับสนุนด้วยเส้น EMA 10 วัน พร้อมล่าสุดปิดเป็นแท่งเทียนเงาล่างยาว สะท้อน Downside ที่จำกัด โดยมีเป้าหมายทำกำไรอยู่บริเวณ 153.00 บาท

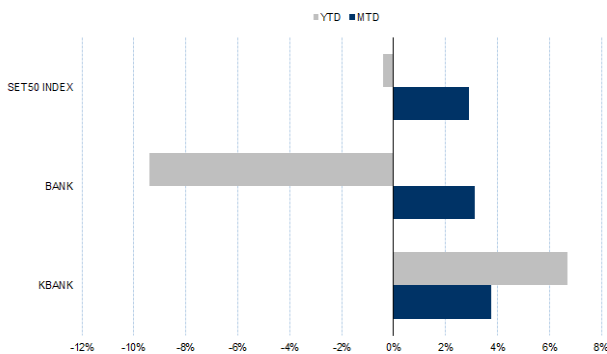
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long KBANKU22 บริเวณ 149 บาท เป้าทำกำไร 153.00 บาทและ Cut Loss 1.50 บาทจากทุน

| Future | | | | | | | Underlying | | | |
|----------|--------------|-------|-----|------|-----------|----------|------------|---------|---------|----------------|
| Future | Settle Price | Basis | Vol | OI | OI Change | Leverage | Upside | PER 65F | PBV 65F | EPS GROWTH 65F |
| KBANKU22 | 150.35 | 0.22 | 709 | 1048 | 1 | 11.80 | 24.73% | 8.98 | 0.76 | - |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ STOCK FUTURES



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส



Long MU22

พัฒนาการกำไรในเชิง YoY รายไตรมาสและปี 2566 กลับสู่ระดับ 70% ของ Pre-COVID ตามการ Recovery ของเศรษฐกิจไทย กอปรกับโครงสร้างทางการเงินเป็น Net Cash ราว 7.9 พันล้านบาท พร้อมต่อยอดการเติบโตผ่าน M&A ด้านราคาหุ้น M ยัง Laggard หุ้น Reopening อื่น Upside 15.40% Dividend yield 2.1%

ภาพทางเทคนิค เปิด Gap Up ยืนเหนือ EMA 200 วัน สนับสนุนด้วยเส้น EMA 10 วัน บ่งชี้แรงซื้อเข้าหนุนแบบมีนัยสำคัญ ประเมินแนวต้านถัดไปไว้ที่ 55.00 บาท

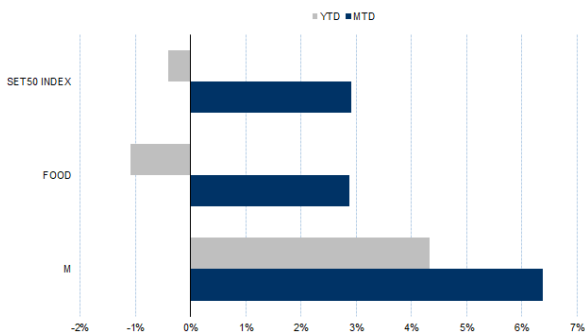
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long MU22 บริเวณ 53.25 บาท เป้าทำกำไร 55.00 บาท และ Cut Loss 0.50 บาทจากทุน

| Future | | | | | | | Underlying | | | |
|--------|--------------|-------|-----|-----|-----------|----------|------------|---------|---------|----------------|
| Future | Settle Price | Basis | Vol | OI | OI Change | Leverage | Upside | PER 65F | PBV 65F | EPS GROWTH 65F |
| MU22 | 53.17 | -0.06 | 18 | 573 | 0 | | 24.14% | 27.73 | 3.60 | 1231.22% |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

HISTORICAL PRICE

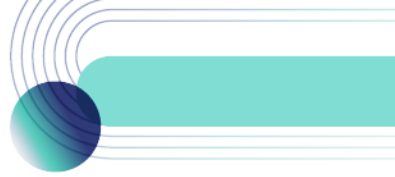


ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

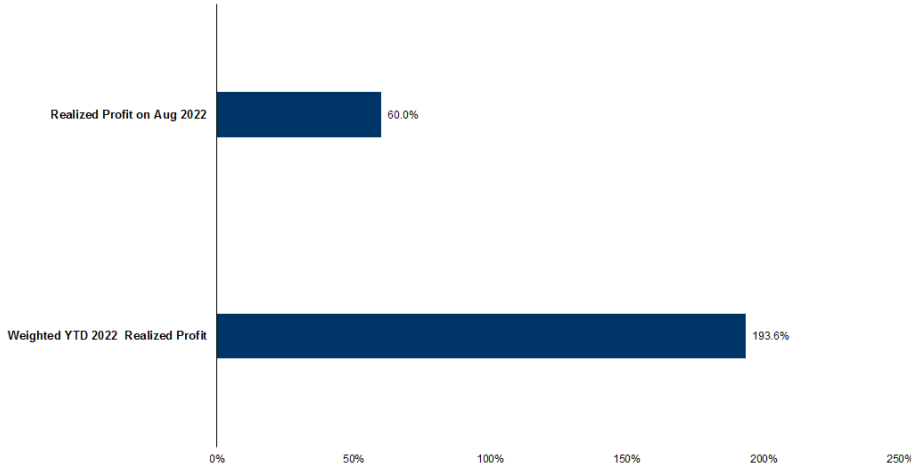
TECHNICAL CHART



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



TRACKING PERFORMANCE



หมายเหตุ: การคำนวณผลตอบแทนจะใช้ราคาเปิดในวันแนะนำเป็นต้นทุน เทียบกับราคาปิดล่าสุด เป็นผลตอบแทนสะสมจนกว่าจะถึงวันที่ฝ่ายวิจัยแนะนำให้ปิดสถานะทำกำไรหรือตัดขาดทุน

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

TOP 20 MOST ACTIVE VOLUME

| | Future | Settle Price | Basis | Vol | OI | OI Change | Leverage | Resistance | Support |
|----|-----------|--------------|-------|-------|-------|-----------|----------|------------|---------|
| 1 | SIRU22 | 1.01 | 0.01 | 15416 | 1072 | 7 | 9 | 1.04 | 1.01 |
| 2 | WHAU22 | 3.08 | 0.00 | 7510 | 16581 | 1000 | 7 | 3.23 | 3.07 |
| 3 | SPRCU22 | 12.13 | 0.03 | 3510 | 6015 | 1033 | 10 | 11.82 | 11.13 |
| 4 | KTBU22 | 15.63 | 0.03 | 3303 | 6647 | 0 | 17 | 16.80 | 15.69 |
| 5 | BAMU22 | 17.40 | 0.00 | 2862 | 2018 | 200 | | 18.06 | 16.98 |
| 6 | JASU22 | 3.62 | 0.02 | 2004 | 9553 | -1500 | 8 | 2.67 | 2.57 |
| 7 | ESSOU22 | 11.40 | 0.00 | 1717 | 9 | 0 | 9 | 11.29 | 10.55 |
| 8 | CRCU22 | 35.42 | -0.08 | 1703 | 880 | -100 | | 40.10 | 37.07 |
| 9 | TRUEU22 | 4.64 | 0.00 | 1616 | 9552 | 0 | 12 | 5.06 | 4.80 |
| 10 | MAJOU22 | 21.37 | -0.33 | 1604 | 580 | 100 | 9 | 20.10 | 19.16 |
| 11 | BHU22 | 179.35 | -0.65 | 1539 | 330 | -80 | 16 | 188.79 | 182.08 |
| 12 | BGRIMU22 | 35.90 | -0.10 | 1521 | 4244 | 200 | 6 | 39.67 | 38.15 |
| 13 | HMPROU22 | 12.70 | 0.00 | 1420 | 603 | -100 | 8 | 13.92 | 13.34 |
| 14 | PTTU22 | 34.23 | -0.27 | 1375 | 1044 | 900 | 10 | 36.57 | 34.61 |
| 15 | TTBU22 | 1.23 | 0.01 | 1231 | 13102 | 1000 | | 1.24 | 1.19 |
| 16 | BCHU22 | 18.70 | -0.10 | 1217 | 7082 | 100 | 15 | 20.11 | 19.66 |
| 17 | CHGU22 | 3.77 | 0.05 | 1146 | 3 | 0 | 14 | 3.85 | 3.74 |
| 18 | BTSU22 | 8.45 | -0.10 | 1103 | 3508 | 0 | 8 | 8.56 | 8.40 |
| 19 | CKPU22 | 5.63 | -0.07 | 1077 | 13501 | 2000 | 6 | 5.29 | 5.11 |
| 20 | GUNKULU22 | 5.64 | -0.01 | 1040 | 41522 | 1 | 21 | 5.24 | 4.84 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส



GOLD FUTURES

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ปรับลดลง 3.6 เหรียญฯ หรือ 0.2% ปิดที่ 1,775 เหรียญฯ มีแรงกดดันจากการดีดตัวขึ้นของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐ 10 ปี สู่ 2.835% ขณะที่ค่าเงินดอลลาร์แกว่งตัวในกรอบแคบ ทำให้ Dollar Index ยังใกล้เคียงวันก่อนหน้าที่ 106.48 จุด หลังสหรัฐเปิดเผยข้อมูลเศรษฐกิจไร้ทิศทาง มีทั้งบวกและลบ ประกอบกับนักลงทุนรอดูรายงานการประชุมของธนาคารกลางสหรัฐ (เฟด) วันที่ 26-27 ก.ค. ในคืนวันนี้อยู่ตามเวลาสหรัฐ (เข้าวันพฤหัสบดี ของไทย) เพื่อหาสัญญาณบ่งชี้ทิศทางอัตราดอกเบี้ยของเฟด รวมถึงตัวเลขเศรษฐกิจด้านอื่นในสัปดาห์นี้ เช่น ยอดค้าปลีก, ยอดขายบ้านมือสอง และจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ ฯลฯ

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFO22 เมื่อคืนลดลง 110 บาท ปิดที่ 29,910 บาท (1,777 เหรียญฯ) สูงกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,774-1,775 เหรียญฯ คาดราคา GFO22 วันนี้อยู่ในกรอบ 29,750-30,100 บาท ฝ่ายวิจัยคงแนะนำให้นักลงทุนที่มีสถานะ Short GFO22 ต้นทุนเฉลี่ย 30,260 บาท และปัจจุบันมีกำไรเพิ่มเป็น 350 บาท ถือสถานะไว้ต่อไป โดยมีเป้าหมายกำไรที่ 1,760 เหรียญฯ หรือ 29,620 บาท และขยับจุด stop profit ไว้ที่ 30,010 บาท เพื่อ Lock กำไรขั้นต่ำเพิ่มเป็น 250 บาทจากทุน ป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

เทคนิค GOLD SPOT



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Futures

| FUTURES | Last | Chg | %Chg | Vol | OI | OI Chg |
|---------|--------|-----|-------|-----|-----|--------|
| GFQ22 | 29,910 | -30 | -0.10 | 92 | 196 | -17 |
| GFV22 | 29,950 | -40 | -0.13 | 43 | 148 | 13 |
| GFZ22 | 30,020 | -30 | -0.10 | 35 | 28 | 13 |

Mini Gold Futures

| | Last | Chg | %Chg | Vol | OI | OI Chg |
|---------|--------|-----|-------|-------|-------|--------|
| GF10Q22 | 29,910 | -20 | -0.07 | 4,304 | 6,651 | -289 |
| GF10V22 | 29,940 | -30 | -0.10 | 3,480 | 3,702 | 255 |
| GF10Z22 | 30,010 | -40 | -0.13 | 893 | 1,453 | -50 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล.เอเชีย พลัส

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



GOLD TECHNICAL

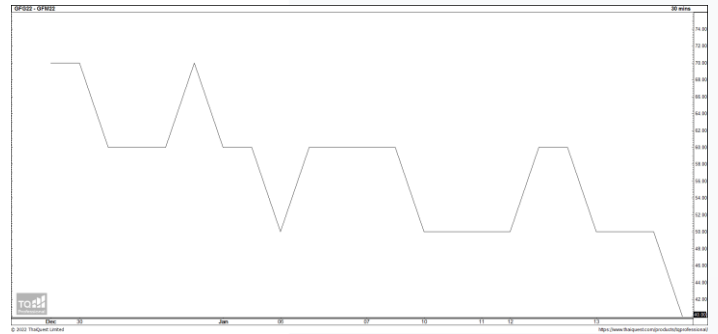
ทิศทางราคาทองคำ Bullish Breakout ขึ้นเหนือเส้น EMA 10 วัน สะท้อนแรงซื้อเข้าหนุน พร้อมแท่งเทียนทำจังหวะ Higher Low เป็นสัญญาณบวกทางเทคนิค คาดกรอบการเคลื่อนไหวในระยะนี้อยู่ที่ \$1750-\$1800

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

| | FX (บาท/ USD) | | | | |
|-------|-----------------|--------|--------|--------|--------|
| | 35.00 | 35.25 | 35.50 | 35.75 | 36.00 |
| 1,650 | 27,450 | 27,646 | 27,842 | 28,038 | 28,235 |
| 1,680 | 27,949 | 28,149 | 28,349 | 28,548 | 28,748 |
| 1,710 | 28,448 | 28,652 | 28,855 | 29,058 | 29,261 |
| 1,740 | 28,948 | 29,154 | 29,361 | 29,568 | 29,775 |
| 1,770 | 29,447 | 29,657 | 29,867 | 30,078 | 30,288 |
| 1,800 | 29,946 | 30,160 | 30,373 | 30,587 | 30,801 |
| 1,830 | 30,445 | 30,662 | 30,880 | 31,097 | 31,315 |
| 1,860 | 30,944 | 31,165 | 31,386 | 31,607 | 31,828 |
| 1,890 | 31,443 | 31,668 | 31,892 | 32,117 | 32,341 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

SPREAD ระหว่าง GFJ22 – GFQ22



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ GOLD FUTURES

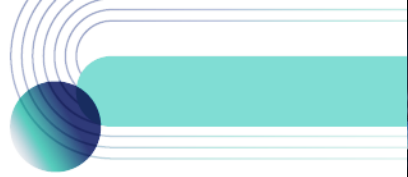
| นิลกองทุนรายย่อย | | | | |
|--------------------------------------|-------------|---------------|-------------------------|--------------------|
| (ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง) | | | | |
| ราคาปิด future | เปลี่ยนแปลง | กำไร (ขาดทุน) | ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท) | กำไร (ขาดทุน)สุทธิ |
| 30,160.00 | 250.0 | 12,500 | (1,049) | 11,451 |
| 30,110.00 | 200.0 | 10,000 | (1,049) | 8,951 |
| 30,060.00 | 150.0 | 7,500 | (1,049) | 6,451 |
| 30,010.00 | 100.0 | 5,000 | (1,049) | 3,951 |
| 29,960.00 | 50.0 | 2,500 | (1,049) | 1,451 |
| 29,910.00 | 0.0 | - | (1,049) | (1,049) |
| 29,860.00 | -50.0 | (2,500) | (1,049) | (3,549) |
| 29,810.00 | -100.0 | (5,000) | (1,049) | (6,049) |
| 29,760.00 | -150.0 | (7,500) | (1,049) | (8,549) |
| 29,710.00 | -200.0 | (10,000) | (1,049) | (11,049) |
| 29,660.00 | -250.0 | (12,500) | (1,049) | (13,549) |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ MINI GOLD FUTURES

| นิลกองทุนรายย่อย | | | | |
|-------------------------------------|-------------|---------------|-------------------------|--------------------|
| (ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง) | | | | |
| ราคาปิด future | เปลี่ยนแปลง | กำไร (ขาดทุน) | ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท) | กำไร (ขาดทุน)สุทธิ |
| 30,160.00 | 250.0 | 2,500 | (210) | 2,290 |
| 30,110.00 | 200.0 | 2,000 | (210) | 1,790 |
| 30,060.00 | 150.0 | 1,500 | (210) | 1,290 |
| 30,010.00 | 100.0 | 1,000 | (210) | 790 |
| 29,960.00 | 50.0 | 500 | (210) | 290 |
| 29,910.00 | 0.0 | - | (210) | (210) |
| 29,860.00 | -50.0 | (500) | (210) | (710) |
| 29,810.00 | -100.0 | (1,000) | (210) | (1,210) |
| 29,760.00 | -150.0 | (1,500) | (210) | (1,710) |
| 29,710.00 | -200.0 | (2,000) | (210) | (2,210) |
| 29,660.00 | -250.0 | (2,500) | (210) | (2,710) |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



DW08 Top Pick: CENT08C2209A ,AOT08C2209A

DW08 WATCH LIST

| DW08 | BID | GEAR | Decay (วัน/หุ้น) |
|---------------|------|------|------------------|
| AOT08C2209A | 0.10 | 12.2 | 3 |
| AWC08C2212A | 0.24 | 7.0 | 3 |
| BANP08C2209A | 0.11 | 7.9 | 4 |
| BBL08C2209A | 0.05 | 14.0 | 5 |
| BCH08C2212A | 0.16 | 6.9 | 5 |
| BGRI08C2208A | 0.14 | 10.2 | 3 |
| BPP08C2301A | 0.13 | 6.3 | 8 |
| CBG08C2209A | 0.08 | 10.2 | 3 |
| CENT08C2209A | 0.04 | 10.5 | 6 |
| CHG08C2212A | 0.12 | 8.3 | 6 |
| CK08C2209A | 0.07 | 10.5 | 4 |
| CPALL08C2301A | 0.08 | 10.5 | 9 |
| CPF08C2209A | 0.15 | 11.2 | 3 |
| GRC08C2212A | 0.11 | 7.4 | 7 |
| DOHO08C2212A | 0.02 | 8.9 | 21 |
| DTAC08C2212A | 0.21 | 5.7 | 4 |
| EA08C2209A | 0.05 | 9.8 | 5 |
| EGC08C2209A | 0.28 | 8.8 | 1 |
| EPG08C2212A | 0.10 | 5.7 | 10 |
| ESS008C2301A | 0.19 | 4.6 | 9 |
| FORTH08C2301A | 0.40 | 3.0 | 4 |
| JMART08C2301A | 0.15 | 5.0 | 7 |
| JMT08C2301A | 0.45 | 4.1 | 3 |
| KEX08C2301A | 0.21 | 5.3 | 5 |
| LH08C2212A | 0.09 | 7.8 | 8 |

| DW08 | BID | GEAR | Decay (วัน/หุ้น) |
|---------------|------|-------|------------------|
| MAJO08C2209A | 0.04 | 9.9 | 6 |
| MEGA08C2209A | 0.06 | 8.2 | 5 |
| MINT08C2301A | 0.14 | 5.6 | 9 |
| PSL08C2301A | 0.21 | 4.1 | 6 |
| PTTE08C2209A | 0.14 | 10.1 | 2 |
| RBF08C2301A | 0.07 | 5.2 | 13 |
| RCL08C2301A | 0.14 | 4.3 | 8 |
| SAWA08C2209A | 0.04 | 9.8 | 6 |
| SCG08C2209A | 0.03 | 16.4 | 8 |
| SCGP08C2212A | 0.17 | 7.0 | 5 |
| SIRI08C2212A | 0.05 | 6.3 | 15 |
| SPAL08C2212A | 0.12 | 6.9 | 6 |
| STGT08C2212A | 0.04 | 6.6 | 14 |
| SUPE08C2212A | 0.09 | 3.8 | 12 |
| SYNEX08C2301A | 0.17 | 4.4 | 6 |
| TQM08C2209A | 0.05 | 9.2 | 5 |
| TRUE08C2212A | 0.37 | 4.8 | 3 |
| BBL08P2209A | 0.03 | -11.8 | 6 |
| KBAN08P2209A | 0.06 | -10.9 | 4 |
| SCB08P2209A | 0.11 | -8.3 | 2 |
| TOP08P2209A | 0.06 | -9.5 | 3 |
| S5008C2209A | 0.07 | 29.5 | 3 |
| S5008C2209B | 0.15 | 23.4 | 3 |
| S5008P2209A | 0.10 | -21.7 | 2 |
| S5008P2209B | 0.20 | -17.6 | 2 |
| SET5008P2209C | 0.05 | -24.8 | 3 |

ข้อมูลล่าสุด สำหรับ 11 สิงหาคม 2022



DW TUTOR

ย่นเวลาศึกษา DW หลักปี
ให้เหลือเพียง
1 ชั่วโมง 25 นาที เท่านั้น !!

สแกนเรียนฟรีที่นี่



วิธีเลือก DW สำหรับมือใหม่

- เลือกตัวที่มีค่า Decay > 3 วัน ขึ้นไป
 - ✓ ยิ่งค่า จำนวนวันที่จะ Decay ในตารางยิ่งเยอะยิ่งดี เพราะจะทำให้ต้นทุนการถือครองถูกกว่าค่าเฉลี่ยตลาด
- เลือกตัวที่มีค่า Gear ในช่วง 4-8 เท่ากำลังดี
 - ✓ ยิ่งเกียร์แรง ถ้าถูกทางยิ่งทำให้พอร์ตโตได้ไว แต่สำหรับมือใหม่ที่มีโอกาสถูก-ผิดทางได้พอกัน เลือกค่าเกียร์ (อัตราทด) ในโซน 4-8 เท่า ถือว่าเหมาะสม