

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

15 ธันวาคม 2565

SET50 FUTURES:

การประชุม FED เป็นไปตามคาดทำให้ตลาดผ่านช่วงความกังวลต่อเงินเฟ้อ/ดอกเบี้ยสหรัฐฯและให้น้ำหนักไปที่ทิศทางเศรษฐกิจ ซึ่งบ้านเราอยู่ในช่วงขยายตัวได้ดีกว่าโลก แนะนำ Trading S50Z22 ในกรอบ 983-995 จุดและ Long กรอบล่าง

SET50 OPTION:

SET50 Option: เปิดสถานะ Long S50Z22C975 ที่ 10 จุด กำไร 5.8 จุด แนะนำถือต่อเป้ากำไร 20 จุด (SET50=990) และ Stop Profit ที่ทุนเพื่อปิดโอกาสขาดทุน

SINGLE STOCK FUTURES:

เปิดสถานะ Long CBGZ22 ได้ที่ 95.15 บาท ปัจจุบันกำไร 21.85% เป้าทำกำไร 98.50 บาท และ Lock กำไร 10% ที่ 95.75 บาท

แนะนำ Long BEMZ22 บริเวณ 9.50 บาท เป้าทำกำไร 9.80 บาท และ Cut Loss 0.10 บาทจากทุน

GOLD FUTURES:

สถานะ Short GFZ22 ทุนเฉลี่ย 29880 บาท มีกำไรเพิ่มเป็น 330 บาท แนะนำถือต่อคงเป้าทำกำไร \$1770 หรือ 29110 บาท และ Lock กำไรเพิ่มเป็น 200 บาทจากทุน

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-สสส

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจกมล, CISA, CFA

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นवलพรรณ น้อยรัชชกร

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

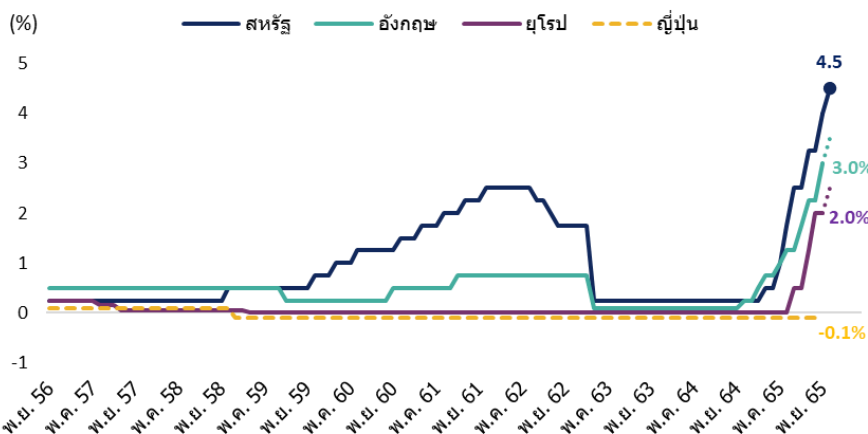
ชาญชัย พันพานากิจ

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธ เกิดเนตร

ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

การขึ้นดอกเบี้ยของธนาคารกลางต่างๆ



ที่มา : ASPS Research

ข้อมูลในเอกสารฉบับนี้ รวบรวมมาจากแหล่งข้อมูลที่น่าเชื่อถือ อย่างไรก็ตาม บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด ไม่สามารถที่จะยืนยันหรือรับรองความถูกต้องของข้อมูลเหล่านี้ได้ ไม่ว่าประการใดๆ บทวิเคราะห์ในเอกสารนี้ จัดทำขึ้นโดยอ้างอิงหลักเกณฑ์ทางวิชาการเกี่ยวกับหลักการวิเคราะห์ และมีได้เป็นการชี้แนะ หรือเสนอแนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ การตัดสินใจซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ ของผู้อ่าน ไม่ว่าจะเกิดจากการอ่านบทความในเอกสารนี้หรือไม่ก็ตาม ล้วนเป็นผลจากการใช้วิจารณญาณของผู้อ่าน โดยไม่มีส่วนเกี่ยวข้องกับหรือพันธะผูกพันใดๆ กับ บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด ไม่ว่ากรณีใด



สถานะของนักลงทุน

All Futures Long(Short) Position : Contract

	Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	202,287	184,729	17,558	42,162	-33,907	-253,246
Foreign	189,145	146,198	42,947	18,647	-62,061	-197,876
Retail	292,904	353,409	-60,505	-60,809	95,968	451,122

SET50 Futures Long(Short) Position : Contract

	Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	37,761	40,605	-2,844	-2,178	-6,631	-16,267
Foreign	83,343	71,374	11,969	1,770	-40,742	-59,549
Retail	87,126	96,251	-9,125	408	47,373	75,816

Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract

	Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	140,047	125,685	14,362	36,155	-1,222	-161,626
Foreign	73,161	44,440	28,721	14,745	-26,477	-135,451
Retail	146,059	189,142	-43,083	-50,900	27,699	297,077

Metal Futures Long(Short) Position : Contract

	Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	4,038	3,282	756	-812	-830	-737
Foreign	32,155	29,572	2,583	2,330	-3,254	-4,114
Retail	25,936	29,275	-3,339	-1,518	4,084	4,851

Call Option Long(Short) Position : Contract

	Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	23	17	6	-158	-249	-638
Foreign	236	215	21	-75	41	69
Retail	2,840	2,844	-4	272	210	656

Put Option Long(Short) Position : Contract

	Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	421	285	136	609	526	2,982
Foreign	177	323	-146	-208	-65	703
Retail	4,046	4,036	10	-401	-461	-3,687



SET50 OVERVIEW

ผลการประชุม FED มีการปรับขึ้นดอกเบี้ย 0.5% มาที่ 4.5% ตามตลาดคาด ขณะที่การส่งสัญญาณของประธาน FED ที่ยังเดินทางขึ้นดอกเบี้ยจนกว่าจะมั่นใจว่าเงินเฟ้อจะลดลงสู่ระดับเป้าหมายที่ 2% ประเมินจากมุมมองการปรับขึ้นดอกเบี้ยของคณะกรรมการ FED ผ่าน FOMC Dot Plot คาดดอกเบี้ยปีหน้าจะขึ้นทำจุดสูงสุด 5.1% (หรือดอกเบี้ยน่าจะขึ้นสู่ระดับ 5-5.25%) ซึ่งสูงกว่าที่ตลาดคาดเล็กน้อย 5.0% ตลาดหุ้นสหรัฐฯวานนี้ติดลบเล็กน้อยในช่วง -0.4% ถึง -0.8% การตอบสนองข้างต้นสะท้อนถึงความกังวลต่อเงินเฟ้อสูง การเร่งขึ้นดอกเบี้ยของ FED มีน้ำหนักลดลง โดยประเด็นถัดไปเชื่อว่าตลาดจะให้น้ำหนักไปที่ทิศทางเศรษฐกิจมากกว่าซึ่งหากอ้างอิงการคาดการณ์ล่าสุดจาก World Bank ที่คาดเศรษฐกิจบ้านเราปีนี้และปีหน้าจะเติบโต 3.4% และ 3.6% มากกว่า GDP โลกที่ขยายตัว 2.9% และ 3.0% ซึ่งมองเป็นปัจจัยที่ช่วยดึงดูด Fund Flow ไหลเข้า ซึ่งล่าสุดเห็นสัญญาณบวกจากเงินบาทที่แข็งค่าที่ 34.50 บาท/USD รวมถึงการเปิดสถานะนักลงทุนต่างชาติที่ซื้อสุทธิในตลาดหุ้น 2.17 พันล้านบาท ตลาดตราสารหนี้ 347 ล้านบาท และ Net Long SET50 Futures 1.12 หมื่นสัญญา ภายใต้ปัจจัยข้างต้นจึงคาด SET50 Index แนว Sideway/Sideway Up ตามกรอบ 984-995 จุด

SET50 INDEX FUTURES

Direction Trading: การประชุม FED เป็นไปตามคาดทำให้ตลาดผ่านช่วงความกังวลต่อเงินเฟ้อ/ดอกเบี้ยสหรัฐฯและให้น้ำหนักไปที่ทิศทางเศรษฐกิจ ซึ่งบ้านเราอยู่ในช่วงขยายตัวได้ดีกว่าโลก แนะนำ Trading S50Z22 ในกรอบ 983-995 จุดและ Long กรอบล่าง

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50H23 ลบด้วย S50Z22 ณ วันที่ 29 ธ.ค. 2565 จะเท่ากับ -6.50 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -7.60 ยังไม่กว้างมากพอให้เปิดสถานะใดๆ

SET50 Option: เปิดสถานะ Long S50Z22C975 ที่ 10 จุด กำไร 5.8 จุด แนะนำถือต่อเป้ากำไร 20 จุด (SET50=990) และ Stop Profit ที่ทุนเพื่อปิดโอกาสขาดทุน

S50Z22 (30 MIN CHART)



	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	984	995
S50Z22	984	995

* ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยจึงเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ

* แอปพลิเคชัน “ASP Smart” 

* Telegram “Asia plus group”

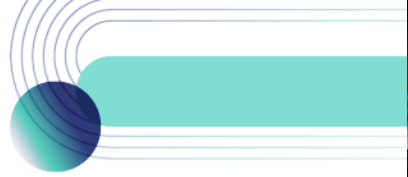
Follow now



Asia Plus Group

TECHNICAL COMMENT

S50Z22 เริ่มขึ้นสร้างฐานและกำลังอยู่ในโหมด Sideway Up มองกรอบแนวรับที่ 984 จุด โดยมีแนวต้านที่ 990/995 จุด



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	981.17	11.74585	8.116786

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	
S50Z22C1025	0.30	0.00	> 1025.3	0.00	0.30	4.50%	0.05	70	13757	11.26	0.03	108.86	0.0	
S50Z22C1000	1.90	-0.10	> 1001.9	0.00	1.90	2.11%	1.43	1200	10713	9.66	0.18	92.15	0.0	
S50Z22C975	12.50	0.40	> 987.5	6.17	6.33	0.65%	10.75	384	6532	11.00	0.61	48.26	0.0	
S50Z22C950	33.10	0.80	> 983.1	31.17	1.93	0.20%	31.58	10	3850	13.69	0.87	25.90	0.0	
S50Z22C925	56.00	-1.20	> 981	56.17	#N/A	N/A	-0.02%	56.30	4	1207	na	1.00	17.52	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
S50Z22P1025	44.50	1.60	< 980.5	43.83	0.67	-0.07%	43.70	2	530	13.88	-0.93	-20.52	0.0
S50Z22P1000	21.00	0.40	< 979	18.83	2.17	-0.22%	20.09	237	7014	10.46	-0.80	-37.46	0.0
S50Z22P975	6.30	0.30	< 968.7	0.00	6.30	-1.27%	4.42	713	11904	11.16	-0.39	-60.16	0.0
S50Z22P950	1.20	-0.20	< 948.8	0.00	1.20	-3.30%	0.27	889	12976	12.20	-0.10	-81.65	0.0
S50Z22P925	0.30	0.00	< 924.7	0.00	0.30	-5.76%	0.00	167	11514	14.64	-0.03	-84.97	-0.1

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 INDEX

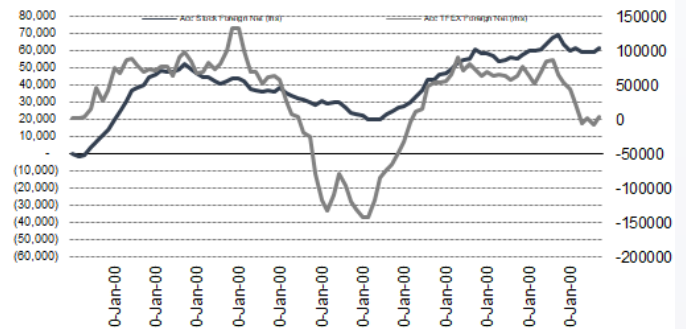
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สนบการซื้อขาย
SET50	984.70	3.53	0.36%	14/12/22

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50V22	974.87	0.0	0.0%	24	145	0
S50X22	985.61	0.0	0.0%	12	48	0
S50Z22	986.50	5.2	0.5%	161,718	402,172	3,395
S50H23	978.80	4.1	0.4%	39,197	106,297	7,799
S50M23	976.50	3.8	0.4%	6,007	23,475	-946
S50U23	970.70	4.1	0.4%	1,230	12,710	146

SET50 Futures Long(Short) : สิ้นวัน	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	1 เดือน
สถาบัน	37,761	40,605	-2,844	-2,178	-3,485	-16,267
ต่างชาติ	83,343	71,374	11,969	1,770	-64,957	-53,549
รายย่อย	87,126	96,251	-9,125	408	68,442	75,816

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	

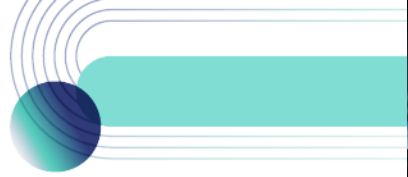
*สมมติฐานอัตราดอกเบี้ยนโยบายระหว่าง มิ.ย. - ก.ย. 64 เท่ากับ 0.5%

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



SINGLE STOCK FUTURES

Long BEMZ22

แนวโน้มกำไรที่ฟื้นตัวได้ดีตามจำนวน Traffic ผู้โดยสารรถไฟฟ้าใต้ดินที่ปรับเปลี่ยนขึ้นโดดเด่น รับ Sentiment หลักจากศูนย์ประชุมสิริกิติ์ที่กลับมาเปิดใหม่ และงานกาชาดที่จะจัดขึ้นที่สวนลุมพินี กรุงเทพฯ ในระหว่างวันที่ 8-18 ธ.ค. 65 อ้างอิงจากการจัดงานกาชาดครั้งก่อนในเดือน พ.ย. 62 ที่ Ridership ขึ้นทำจุดสูงสุดถึง 5.3 แสนเที่ยว/วัน ส่งผลให้ Ridership เฉลี่ยในเดือน พ.ย. 62 อยู่ที่ 4.1 แสนเที่ยว/วัน (ทำจุดสูงสุดในปี 2562) โดยประเมิน Valuation ด้วยวิธี SOTP ได้มูลค่าเหมาะสม 12.00 บาท

ภาพทางเทคนิค แนวโน้มขาขึ้น ลักษณะ Sideway Up ล่าสุดอยู่ในช่วงทดสอบแนวต้านสำคัญโซน 9.65 บาท หากผ่านได้ มีโอกาสปรับขึ้นทดสอบแนวต้านถัดไปที่ 9.80 บาท

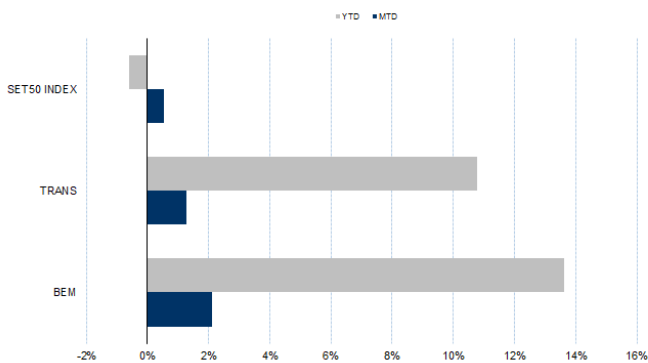
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long BEMZ22 บริเวณ 9.50 บาท เป้าทำกำไร 9.80 บาท และ Cut Loss 0.10 บาทจากทุน

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
BEMZ22	9.65	0.09	10	9044	0	12.88	25.00%	36.38	3.22	-

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

TECHNICAL CHART



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



Long CBGZ22

เชื่อว่ากำไรผ่านจุดต่ำสุดของปีแล้ว และจะเห็นการฟื้นตัวได้ตั้งแต่ 4Q65 เพราะยอดขายมีแนวโน้มเพิ่มขึ้น โดยยอดขายในประเทศ จะได้ประโยชน์จากอุตสาหกรรมเครื่องดื่มชูกำลังที่เห็นการฟื้นตัวแล้วตั้งแต่ 3Q65 บวกกับมาตรการกระตุ้นกำลังซื้อจากภาครัฐ คาดเป้าหมายกำไรปี 2566 จะกลับมาเติบโตอีกครั้งในอัตรา 32% YoY โดย ราคาหุ้นปัจจุบันซื้อขายที่ PER ปี 2566 ที่ 28.6 เท่า ยังต่ำกว่าคู่แข่งอย่าง OSP ซึ่งซื้อขายที่ PER 30.2 เท่า

ภาพทางเทคนิค พักสะสมบริเวณเส้น EMA 75 วัน ที่ 95.50 บาท พร้อมกับสัญญาณบวกจากจังหวะ Higher Low ส่งสัญญาณเปิด Upside เป้าหมายอยู่บริเวณ 98.50 บาท

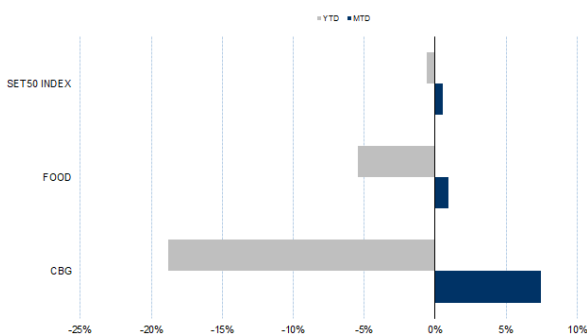
กลยุทธ์การลงทุน

เปิดสถานะ Long CBGZ22 ได้ที่ 95.15 บาท ปัจจุบันกำไร 21.85% เป้าทำกำไร 98.50 บาท และ Lock กำไร 10% ที่ 95.75 บาท

Future							Underlying			
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 65F	PBV 65F	EPS GROWTH 65F
CBGZ22	96.55	0.79	798	1582	-80	6.33	19.40%	-	-	-

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

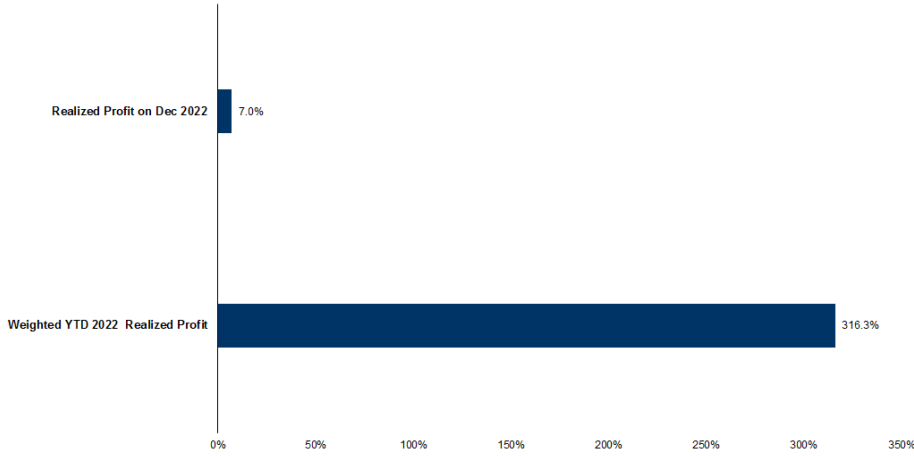
TECHNICAL CHART



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	GUNKULZ22	5.25	0.00	42671	48101	516	20	5.63	5.34
2	RSZ22	15.43	0.13	10350	21443	-100	6	16.67	15.90
3	KTCZ22	58.22	-0.03	8161	1823	0	17	59.91	59.02
4	JASZ22	2.72	-0.06	8035	23778	-498	6	2.38	2.26
5	SIRIZ22	1.15	0.01	5034	102221	-1	10	1.86	1.56
6	TTBZ22	1.24	0.01	3065	18257	36		1.40	1.37
7	EAZ22	88.50	0.00	2949	19839	-80	15	98.00	95.70
8	TPIPLZ22	1.71	-0.03	1501	22510	0	11	1.94	1.84
9	BCPGZ22	9.69	0.14	1214	9919	2	4	10.44	10.01
10	IRPCZ22	3.19	0.01	1079	12745	-483	9	3.03	2.95
11	WHAZ22	3.50	0.00	849	26513	-995	8	3.94	3.81
12	STAZ22	20.18	0.08	802	967	0	4	19.09	18.32
13	CBGZ22	91.54	0.79	798	1582	-80	6	96.52	94.58
14	BLANDZ22	1.00	0.00	650	180750	0	9	1.09	1.04
15	MTCZ22	38.00	0.25	564	1383	21	6	39.64	37.20
16	THCOMZ22	10.88	0.18	540	1504	0	8	13.58	12.06
17	TRUEZ22	4.93	-0.03	535	8183	8490	13	4.95	4.67
18	TUZ22	17.27	0.07	400	5299	-801	9	17.08	16.63
19	HMPROZ22	13.40	0.00	305	1663	0	8	15.03	14.67
20	SAWADZ22	45.45	0.20	270	2918	-80	6	50.28	45.59

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส



GOLD FUTURES

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน เคลื่อนไหวผันผวน โดยระหว่างการซื้อขายลงไปแตะจุดต่ำสุดของวันที่ 1,797 เหรียญฯ ก่อนติดตัวขึ้นมาปิดท้ายตลาดอยู่ที่ 1,806 เหรียญฯ เป็นการปรับลดลง 3.7 เหรียญฯ จากวันก่อนหน้า มีแรงพยุงจากค่าเงินดอลลาร์สหรัฐอ่อนค่า แม้ที่ประชุมธนาคารกลางสหรัฐ (เฟด) มีมติขึ้นดอกเบี้ยตามคาด 0.5% แต่ระดับดังกล่าวสะท้อนถึงการปรับขึ้นดอกเบี้ยได้ผ่านจุดสูงสุดไปแล้ว หลังจากก่อนหน้านี้มีการปรับขึ้น 0.75% ติดต่อกันในการประชุม 4 ครั้งที่ผ่านมา ทำให้ Dollar Index ปรับลง 0.4% ปิดที่ 103.62 จุด โดยวันนี้ ต้องติดตามการประชุมของธนาคารกลางยุโรป (อีซีบี) และธนาคารกลางอังกฤษ (BOE) ซึ่งคาดจะปรับขึ้นดอกเบี้ยในอัตรา 0.5% รวมถึงการรายงานตัวเลขเศรษฐกิจสหรัฐ เช่น จำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ และยอดค้าปลีก เป็นต้น

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFZ22 เมื่อคืน ลดลง 170 บาท ปิดที่ 29,550 บาท (1,797 เหรียญฯ) ต่ำกว่าราคาทองคำตลาด Spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,806 เหรียญฯ คาดราคา GFZ22 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 29,500-29,900 บาท ฝ่ายวิจัยคงแนะนำให้นักลงทุนที่มีสถานะ Short GFZ22 ทุนเฉลี่ย 29,880 บาท ปัจจุบันมีกำไรเพิ่มเป็น 330 บาท ถือสถานะไว้ต่อไป โดยมีเป้าหมายกำไร 1,770 เหรียญฯ หรือ 29,110 บาท และขยับจุด Stop profit ไว้ที่ 29,680 บาท เพื่อ Lock กำไรเพิ่มเป็น 200 บาทจากทุน เป็นการป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

อินดิก GOLD SPOT



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GFZ22	29,550	-150	-0.51	91	212	36
GFZ23	29,550	-210	-0.71	29	106	0
GFJ23	29,600	-240	-0.80	8	8	0

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10Z22	29,620	-70	-0.24	3,202	6,584	635
GF10G23	29,610	-110	-0.37	1,243	3,848	253
GF10J23	29,670	-100	-0.34	258	241	0

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

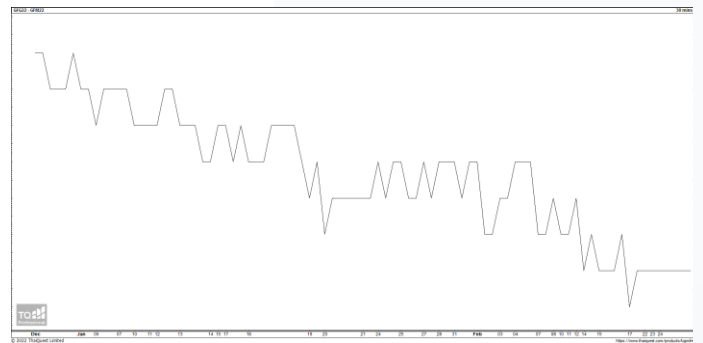
ทิศทางราคาทองคำ ปรับขึ้นต่อ หลักจากทดสอบเส้นค่าเฉลี่ย 10 วัน พร้อมสัญญาณบวกจากการทำจังหวะ Higher Low เป็นแท่งเทียน Bullish Breakout คาดเปลี่ยนกรอบ Trading เป็นกรอบการเคลื่อนไหวในช่วง \$1810-\$1850

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

	FX (บาท/ USD)				
	34.50	34.75	35.00	35.25	35.50
1,600	26,238	26,428	26,618	26,809	26,999
1,630	26,730	26,924	27,117	27,311	27,505
1,660	27,222	27,419	27,617	27,814	28,011
1,690	27,714	27,915	28,116	28,317	28,517
1,720	28,206	28,410	28,615	28,819	29,024
1,750	28,698	28,906	29,114	29,322	29,530
1,780	29,190	29,401	29,613	29,824	30,036
1,810	29,682	29,897	30,112	30,327	30,542
1,840	30,174	30,393	30,611	30,830	31,048

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

SPREAD ระหว่าง GFV22 – GFJ23



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ GOLD FUTURES

มิถุนายนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
29,800.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
29,750.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
29,700.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
29,650.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
29,600.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
29,550.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
29,500.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
29,450.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
29,400.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
29,350.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
29,300.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ MINI GOLD FUTURES

มิถุนายนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
29,860.00	250.0	2,500	(210)	2,290
29,810.00	200.0	2,000	(210)	1,790
29,760.00	150.0	1,500	(210)	1,290
29,710.00	100.0	1,000	(210)	790
29,660.00	50.0	500	(210)	290
29,610.00	0.0	-	(210)	(210)
29,560.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
29,510.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
29,460.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
29,410.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
29,360.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส