

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์



SET50 FUTURES:

สถานะ LONG S50U23 ที่ 938 จุด ปิด STOP PROFIT 5 จุด สำหรับวันนี้คาด SET50 พักตัวจากปัจจัยภายนอกกดดันแต่หากการเมืองในประเทศไทยดีขึ้นจะเป็นตัวช่วยจำกัด DOWNSIDE แนะนำ TRADING S50U23 ในกรอบ 928-940 จุดและ LONG กรอบล่าง

SET50 OPTION:

สถานะ LONG S50U23C950 ที่ 15 จุด ถูก STOP PROFIT ที่ทุน แนะนำ LONG S50U23C925 ที่ 18 จุด (SET50=930) เป้าทำกำไร 28 จุด (SET50=945 จุด) และ CUT LOSS 3 จุด คาด SET50 พักตัว

SINGLE STOCK FUTURES:

สถานะ LONG PTTGCU23 ทุน 39.12 บาท ปิดขาดทุน 15% สำหรับวันนี้แนะนำ LONG ADVANCU23 บริเวณ 218 บาท เป้าทำกำไร 225 บาท และ CUT LOSS 2 บาทจากทุน เปิด LONG ERWU23 ได้ที่ 4.70 บาท ปัจจุบันกำไร 24.76 % เป้าทำกำไร 5.00 บาท และ LOCK กำไร 20% ที่ 4.80 บาท

GOLD FUTURES:

GF10 FUTURES: แนะนำ LONG GF10Q23 ไม่เกิน 32020 บาท (\$1900) เป้าทำกำไร 32520 บาท และ CUT LOSS 100 บาทจากทุน GOLD ONLINE: แนะนำ TRADING GOU23 ที่ \$1910-1940 และ CUT LOSS \$3

ตัวเลขเศรษฐกิจจีนยังออกมาแย่กว่าคาดต่อเนื่อง

	Jan/23	Feb/22	Mar/23	Apr/23	May/23	Jun/23	Jul/23
PMI Manu	50.1	52.6	51.9	49.2	48.8	49	49.3
	49.8	50.5	51.5	51.4	51.4	49	49.2
	0.3	2.1	0.4	-2.2	-2.6	0	0.1
PMI Non-Manu	54.5	56.3	58.2	56.4	54.5	53.2	51.5
	52	54.9	55	57	54.9	53.7	52.9
	-2.5	-1.4	-3.2	-0.6	-0.4	-0.5	-1.4
CPI YoY %	2.1	1	0.7	0.1	0.20	0	-0.3
	2.2	1.9	1	0.4	0.4	0.2	-0.4
	-0.1	-0.9	-0.3	-0.3	-0.2	-0.2	0.1
PPI YoY %	-0.8	-1.4	-2.5	-3.6	-4.6	-5.4	-4.4
	-0.5	-1.3	-2.5	-3.2	-4.3	-5	-4.1
	-0.3	-0.1	0	-0.4	-0.3	-0.4	-0.3
Retail sale YoY%	3.5	10.6	18.4	12.7	3.1	2.5	
	3.5	7.4	21	13.7	3.2	4.5	
	0	-3.2	-2.6	-1	-0.1	-2	
Industrial Production	2.4	3.9	5.6	3.5	4.4	3.7	
	2.6	4	10.9	3.8	2.7	4.4	
	-0.2	-0.1	-5.3	-0.3	1.7	-0.7	

ที่มา ASPS RESEARCH สงวนลิขสิทธิ์



16 สิงหาคม 2566

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

ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องดำเนินการได้อย่างรวดเร็วทัน ฝ่ายวิจัยจึงเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันทำการผ่าน 2 ช่องทาง เพื่อให้นักลงทุนสามารถปรับเปลี่ยนกลยุทธ์ได้มีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น คือ

แอปพลิเคชัน ASP Smart

Telegram Asia Plus Group

Asia Plus Group
Follow Now

RESEARCH DIVISION

บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส

เกิดศักดิ์ ทวีธีระธรรม
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจมงคล, CISA, CFA
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นวลพรรณ น้อยรัชชกุล
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันพานากิจ
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธ วัฒนเดชา
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 048495

ข้อมูลในเอกสารฉบับนี้ รวบรวมมาจากแหล่งข้อมูลที่น่าเชื่อถือ อย่างไรก็ดี บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด ไม่สามารถที่จะยืนยันหรือรับรองความถูกต้องของข้อมูลเหล่านี้ได้ ไม่ว่าประการใดๆ บทวิเคราะห์ในเอกสารนี้ จัดทำขึ้นโดยอ้างอิงหลักการทางวิชาการเกี่ยวกับหลักการวิเคราะห์ และมีได้เป็นการชี้แนะ หรือเสนอแนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ การตัดสินใจซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ ของผู้อ่าน ไม่ว่าจะเกิดจากการอ่านบทความในเอกสารนี้หรือไม่ก็ตาม ล้วนเป็นผลจากการใช้วิจารณญาณของผู้อ่าน โดยไม่มีส่วนเกี่ยวข้องกับหรือพึ่งพิงกับ บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด ไม่ว่ากรณีใด



Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

สถานะของนักลงทุน

	All Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	137,374	115,568	21,806	20,448	-14,256	-115,716
Foreign	131,345	170,004	-38,659	-29,558	-72,964	-76,591
Retail	269,961	253,108	16,853	9,110	87,220	192,307

	SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	43,852	39,231	4,621	4,072	8,606	1,553
Foreign	88,971	125,736	-36,765	-27,507	-65,647	8,557
Retail	145,547	113,403	32,144	23,435	57,041	-10,110

	Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	62,326	57,254	5,072	515	-58,136	-178,584
Foreign	23,586	24,761	-1,175	-158	1,108	-54,859
Retail	77,669	81,566	-3,897	-357	57,028	233,443

	Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	1,301	715	586	-97	-1,709	-1,430
Foreign	16,647	18,497	-1,850	-7,881	-4,534	-22,865
Retail	14,331	13,067	1,264	7,978	6,243	24,295

	Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	57	332	-275	-283	-614	-1,079
Foreign	973	641	332	395	485	4,804
Retail	3,446	3,503	-57	-112	369	-3,586

	Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	124	185	-61	-43	-99	-1,397
Foreign	702	251	451	300	75	74
Retail	4,236	4,626	-390	-257	24	1,323

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

SET50 OVERVIEW

การรายงานยอดค้าปลีกและผลผลิตภาคอุตสาหกรรมของจีนเดือน ก.ค.ขยายตัวต่ำกว่าตลาดคาด ตอกย้ำความเสี่ยงต่อการฟื้นตัวเศรษฐกิจจีนที่ประจวบ ส่งผลให้ PBOC ทำ SURPRISE ตลาดผ่านการปรับลดดอกเบี้ยฯ -0.15% แต่อย่างไรก็ตามตลาดหุ้นยังตอบสนองในเชิงลบหลังวานนี้ดัชนี CSI 300 ปรับลง -0.2% ฝั่งสหรัฐฯการรายงานยอดค้าปลีกขยายตัว 0.7%MOM มากกว่าตลาดคาดทำให้ความกังวลต่อเงินเฟ้อและการดำเนินนโยบายการเงินของ FED ที่ยาวกว่าหลายฝ่ายคาด อีกทั้ง FITCH ออกมาเตือนว่าดอกเบี้ยสหรัฐฯที่อยู่ในระดับสูงถือเป็นความเสี่ยงต่อคุณภาพสินทรัพย์และประสิทธิภาพการดำเนินงานของ ส.พ. ซึ่งอาจเป็นเหตุให้ปรับลดอันดับ CREDIT RATING ของ ส.พ. สหรัฐฯ กดดันตลาดหุ้นสหรัฐฯและราคาน้ำมันดิบปรับลงเฉลี่ย 1% ส่วนในประเทศปัจจัยหลักวันนี้อยู่ที่การติดตามศาลรัฐธรรมนูญวินิจฉัยว่าจะรับหรือไม่รับคำร้องของผู้ตรวจการแผ่นดิน กรณีการใช้ข้อบังคับที่ 41 ของรัฐสภา สำหรับการโหวตเลือกนายกรัฐมนตรี หากศาลไม่มีคำสั่งห้ามใดๆ น่าจะทำให้กระบวนการโหวตเลือกนายกรัฐมนตรีเดินหน้าไป เป็นตัวช่วยจำกัด DOWNSIDE ของ SET50 INDEX แนวทางตามกรอบ 930-945 จุด

DIRECTION TRADING: สถานะ: LONG S50U23 ที่ 938 จุด ปิด STOP PROFIT 5 จุด สำหรับวันนี้คาด SET50 พักตัวจากปัจจัยภายนอกกดดันแต่หากการเมืองในประเทศคืบหน้าจะเป็นตัวช่วยจำกัด DOWNSIDE แนะนำ TRADING S50U23 ในกรอบ 928-940 จุดและ LONG กรอบล่าง

SPREAD TRADING: สถานะ: LONG SPREAD S50U23Z23 ที่ 1.8 จุด ปัจจุบันกำไร 0.4 จุด แนะนำถือต่อป้าทำกำไรที่ค่าทางทฤษฎีที่ 4.31 จุด

SET50 OPTION: สถานะ: LONG S50U23C950 ที่ 15 จุด ถูก STOP PROFIT ที่ทุน แนะนำรอ LONG S50U23C925 ที่ 18 จุด (SET50=930) เป้าทำกำไร 28 จุด (SET50=945 จุด) และ CUT LOSS 3 จุด คาด SET50 พักตัว

	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	930	945
S50U23	928	940

S50U23 (30 MIN CHART)



TECHNICAL COMMENT

S50U23 เกิดสัญญาณลบจากการหลุดแนวรับ LOW เดิมระยะสั้นแกว่งในกรอบ 928-940 จุด

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

SET50 Index	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
	939.78	11.51	12.772

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
S50U23C1025	0.80	-0.30	> 1025.8	0.00	0.80	9.15%	0.33	436	6564	14.41	0.04	48.79	9.2%
S50U23C1000	2.40	-0.90	> 1002.4	0.00	2.40	6.66%	1.32	716	11342	14.45	0.11	41.37	6.7%
S50U23C975	6.10	-2.60	> 981.1	0.00	6.10	4.40%	4.19	1486	12506	14.45	0.22	34.51	4.4%
S50U23C950	13.20	-4.80	> 963.2	0.00	13.20	2.49%	10.81	675	6083	14.31	0.40	28.33	2.5%
S50U23C925	25.50	-7.00	> 950.5	14.78	10.72	1.14%	22.87	298	4382	14.51	0.60	22.19	1.1%

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
S50U23P1025	85.90	11.10	< 939.1	85.22	0.68	-0.07%	88.41	0	15	#N/A N/A	-1.00	-10.94	-0.1%
S50U23P1000	65.00	8.00	< 935	60.22	4.78	-0.51%	64.46	7	282	13.43	-0.91	-13.09	-0.5%
S50U23P975	44.20	8.20	< 930.8	35.22	8.98	-0.96%	42.40	39	742	14.29	-0.77	-16.43	-1.0%
S50U23P950	25.70	4.70	< 924.3	10.22	15.48	-1.65%	24.08	308	2188	13.67	-0.60	-21.99	-1.6%
S50U23P925	13.80	3.10	< 911.2	0.00	13.80	-3.04%	11.21	1216	4316	14.44	-0.39	-26.67	-3.0%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 INDEX

UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	ลบการซื้อขาย
SET50	939.78	-11.45	-1.22%	15/8/23

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50N23	958.42	0.0	0.0%	27	140	0
S50Q23	939.00	-9.5	-1.0%	10	45	-1
S50U23	937.20	-9.9	-1.1%	243,376	512,525	50,552
S50Z23	939.10	-9.5	-1.0%	26,728	87,440	5,959
S50H24	935.50	-9.1	-1.0%	5,525	15,291	184
S50M24	932.80	-9.4	-1.0%	2,731	8,934	640

SET50 Futures Long(Short) : สัญญา	สถานะ Long(Short)		
	Long	Short	Net
สถานะ	43,852	39,231	4,621
ต่างชาติ	88,971	125,736	-36,765
รายย่อย	145,547	113,403	32,144

	2 วัน	2 สัปดาห์	1 เดือน
สถานะ	4,072	21,854	1,553
ต่างชาติ	-27,507	-78,455	8,557
รายย่อย	23,435	56,601	-10,110

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

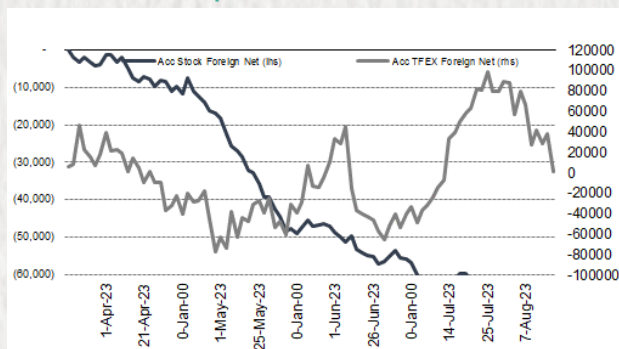
คาดการณ์ SPREAD ณ สิ้นเดือนจาก ASPS MODEL

	เป้าหมาย Spread ซีรียโทล - ซีรียโทล					
	S50N23	S50Q23	S50U23	S50V23	S50X23	S50Z23
	ณ 27 ก.ค.66	ณ 30 ส.ค.66	ณ 28 ก.ย.66	ณ 30 ต.ค.66	ณ 29 พ.ย.66	ณ 28 ธ.ค.66
S50N23						
S50Q23	-2.04					
S50U23	-5.44	-3.00				
S50V23	-4.23	-1.59	1.41			
S50X23	-3.06	-0.22	2.78	1.37		
S50Z23	-1.47	1.56	4.31	3.16	1.76	

*สมมติฐานอัตราดอกเบี้ยนโยบายระหว่าง ต.ค. - ธ.ค. 66 เท่ากับ 2.25%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 FUTURES



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

SET50 ที่ระดับค่า PER ต่างๆ

SET 50 Sensitivity	ม.ค. 66E	มี.ค. 66E	พ.ย. 66E	พ.ค. 66E	มิ.ย. 66E	ก.ย. 66E	ธ.ค. 66E
(เท่า)							
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

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

SINGLE STOCK FUTURES

LONG ADVANCU23

ADVANC จะ “Outperform” ตลาดได้เพราะ 1) มีปัจจัยหนุนระยะสั้นจากกำไรในงวด 2Q66 ที่ออกมาดีทั้ง QoQ และ YoY, 2) ระยะถัดไปกำไรช่วง 2H66 ยังดูมีแนวโน้มสดใส และ 3) มีเงินปันผลระหว่างกาลสำหรับงวด 1H66 ที่ 4.0 บาท/หุ้น หรือคิดเป็นผลตอบแทนจากปันผลราว 1.8% (XD วันที่ 18 ส.ค. 66) ราคาหุ้นรายวัน แกว่งในแนวโน้มขาขึ้น ราคาทำจิงหวะ Higher Low และ Higher High เคลื่อนไหวตามกรอบ Uptrend Channel บ่งชี้ Upside ที่เปิดกว้าง

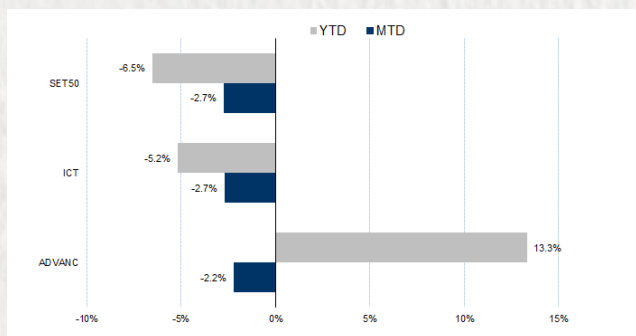
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ LONG ADVANCU23 บริเวณ 218 บาท เป้าทำกำไร 225 บาท และ CUT LOSS 2 บาทจากทุน

Future							Underlying	
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 66F
ADVANCU23	217.97	-3.03	31	2716	31	13.97	9.95%	22.32

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 ERWU23

ช่วงถัดไปคาดการณ์กำไรปกติไตรมาส QOQ ตั้งแต่ 3Q66 - 1Q67 ที่ถือว่าเป็น HIGH SEASON ของท่องเที่ยวไทย (ดีขึ้น YOY ทุกไตรมาส) สนับสนุนด้วย RECOVERY ของท่องเที่ยวไทย โดย FAIR VALUE ปี 2566 เท่ากับ 5.70 บาท ราคาหุ้นรายวัน Bullish Breakout กรอบบน Symmetrical Triangle สะท้อน Upside ที่เปิดกว้าง หากย่อมาโซนแนวรับที่ 4.78 บาท แนะนำเข้าสะสม

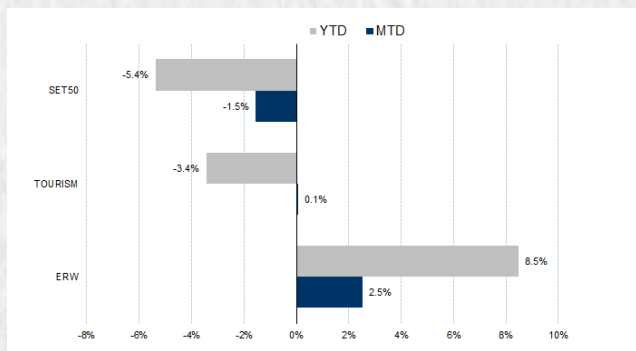
กลยุทธ์การลงทุน

เปิด LONG ERWU23 ได้ที่ 4.70 บาท ปัจจุบันกำไร 24.76 % เป้าทำกำไร 5.00 บาท และ LOCK กำไร 20% ที่ 4.80 บาท

Future							Underlying	
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 66F
ERWU23	4.83	0.01	512	2166	512	6.78	18.26%	41.73

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

TECHNICAL CHART

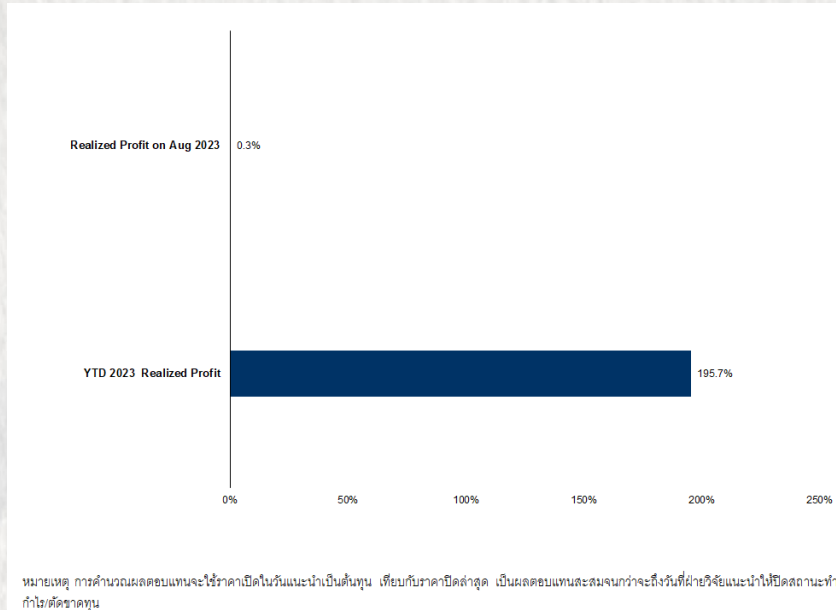


ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

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	SIRIU23	1.76	1.86	52,003	44,707	-	612	15.44	1.81	1.70
2	TRUEU23	6.6	6.65	8,005	23,509	-	3,997	12.42	6.72	6.56
3	GUNKULU23	3.36	3.26	6,525	128,126	-	3,500	19.36	3.49	3.28
4	BANPUU23	9.03	9.25	5,904	67,111	-	1,316	16.03	9.10	8.77
5	IRPCU23	2.34	2.36	3,443	23,299	-	2,865	8.54	2.45	2.29
6	EAU23	57.38	57.25	2,980	17,603	-	617	15.81	59.75	54.19
7	SPRCU23	9.35	9.2	2,023	168	-	8	8.69	9.59	9.05
8	TTBU23	1.72	1.74	1,826	13,700	-	603	-	1.74	1.70
9	CPALLU23	62.01	62	1,440	14,403	-	1,658	14.97	62.47	59.51
10	PTTEPU23	161.4	161.5	1,362	2,258	-	373	16.78	161.54	160.92
11	HANAU23	51.91	52.25	1,091	1,818	-	143	6.64	52.42	51.71
12	AWCU23	3.97	3.92	1,073	17,476	-	650	-	3.99	4.01
13	WHAU23	3.75	3.76	1,000	7,000	-	500	9.52	3.73	3.75
14	CENTELU23	42.2	42.5	727	1,039	-	211	12.47	47.05	42.75
15	IVLU23	31.5	31.5	715	7,344	-	264	9.62	32.11	32.09
16	JASU23	1.66	1.66	656	58,248	-	579	4.61	1.75	1.59
17	COM7U23	28.52	28.75	608	5,407	-	188	4.94	28.95	28.52
18	AAVU23	2.62	2.66	551	52,685	-	1,507	8.48	2.65	2.56
19	TKNU23	11.9	12.2	540	9,898	-	113	5.36	11.98	11.90
20	WHAU23	4.81	4.86	522	10,922	-	1,524	9.28	4.85	4.81

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

GOLD FUTURES

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ลดลง 6.9 เหรียญฯ ปิดที่ 1,901 เหรียญฯ โดยคงมีแรงกดดันจากการปรับขึ้นของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐ และการแข็งค่าของค่าเงินดอลลาร์ หลังสหรัฐเปิดเผยตัวเลขยอดค้าปลีกพุ่งขึ้นเกินคาด ทำให้ นักลงทุนกังวลว่าธนาคารกลางสหรัฐ (เฟด) อาจจะมีอัตราดอกเบี้ยที่ระดับสูงต่อไป หนุนให้ DOLLAR INDEX ยับขึ้น 0.04% ปิดที่ 103.21 จุด โดยสัปดาห์นี้ ต้องติดตามการแถลงของกรรมการเฟด และรายงานการประชุมเฟดครั้งล่าสุด เพื่อหาสัญญาณบ่งชี้ถึงทิศทางดอกเบี้ย รวมถึงข้อมูลเศรษฐกิจสำคัญของสหรัฐ เช่น ดัชนีภาคการผลิต และจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ ฯลฯ

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GF10Q23 เมื่อคืน เพิ่มขึ้น 30 บาท (ส่วนทางตลาดโลกจาผลกระทบของค่าเงินบาทอ่อนค่า) ปิดที่ 32,100 บาท เทียบเท่า 1,905 เหรียญฯ สูงกว่าราคาทองคำตลาด SPOT ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,902 เหรียญฯ คาดราคา GF10Q23 วันนี้จะอยู่ที่ 31,900-32,300 บาท การร่วงลงของราคาทองคำราว 40 เหรียญฯ นับตั้งแต่ต้นเดือน ทำให้คาดหวัง REBOUND ในช่วงสั้น จึงแนะนำให้ นักลงทุนรอเปิด LONG GF10Q23 บริเวณ 1,900 เหรียญฯ หรือไม่เกิน 32,020 บาท มีเป้าหมายกำไร 1,930 เหรียญฯ เทียบเท่า 32,520 บาท และกำหนดจุด CUT LOSS 100 บาทจากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดคาด

GOLD SPOT



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

GOLD ONLINE FUTURES

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GOU23	1,919	-1	-0.05	21,508	34,717	-6223
GOZ23	1,951	-1	-0.03	5,551	16,130	-2647

MINI GOLD FUTURES

	Last	Chg	%Chg	Vol	OI	OI Chg
GF10Q23	32,100	30	0.09	3,683	8,426	-1948
GF10V23	32,210	20	0.06	836	3,840	-409
GF10Z23	32,290	40	0.12	376	888	23

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 (GOU23)

ทิศทางราคาทองคำ สัญญาณลบทางเทคนิค ราคาหลุดแนวรับ EMA 10 วัน สะท้อน
โมเมนตัมช่วงสั้นที่อ่อนแรง ประเมิน กรอบการเคลื่อนไหวที่ \$1910-1940

GOLD ONLINE: แนะนำ TRADING GOU23 ที่ \$1910-\$1940 และ CUT LOSS \$3

GOU23



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

BASIS ระหว่าง GOU23-GOLD SPOT



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

	FX (บาท/ USD)				
	34.50	34.75	35.00	35.25	35.50
1,850	30,338	30,558	30,778	30,997	31,217
1,880	30,830	31,053	31,277	31,500	31,723
1,910	31,322	31,549	31,776	32,003	32,230
1,940	31,814	32,044	32,275	32,505	32,736
1,970	32,306	32,540	32,774	33,008	33,242
2,000	32,798	33,035	33,273	33,511	33,748
2,030	33,290	33,531	33,772	34,013	34,255
2,060	33,782	34,026	34,271	34,516	34,761
2,090	34,274	34,522	34,770	35,019	35,267

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ MINI GOLD FUTURES

นิลลงทุนรายย่อย					
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)					
ราคาปิด	กำไร	ค่าธรรมเนียม+	กำไร		
future	เปลี่ยนแปลง	(ขาดทุน)	VAT (บาท)	(ขาดทุน)สุทธิ	
32,460.00	250.0	2,500	(210)	2,290	
32,410.00	200.0	2,000	(210)	1,790	
32,360.00	150.0	1,500	(210)	1,290	
32,310.00	100.0	1,000	(210)	790	
32,260.00	50.0	500	(210)	290	
32,210.00	0.0	-	(210)	(210)	
32,160.00	-50.0	(500)	(210)	(710)	
32,110.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)	
32,060.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)	
32,010.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)	
31,960.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)	

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส