DERIVATIVE TALK

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

BY RESEARCH DIVISION

25 เมษายน 2566

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

* แอปพลิเคชั่น “ASP Smart”

* Telegram “Asia plus group”

Follow now

Asia Plus Group

SET50 FUTURES:

SET50 Index ได้แรงหนุนจากราคาน้ำมันและการเก็งกำไรผลประกอบการและนโยบายหาเสียงก่อนเลือกตั้งแต่มูลค่าการซื้อขายเบาบางทำให้กรอบการขึ้นลงจำกัด แนะนำ Trading ตามกรอบ 930-945 จุด และ Long กรอบล่าง

SET50 OPTION:

รอ Long S50M23C925 ที่ 22 จุด (SET50=933 จุด) เป้าทำกำไร 32 จุด (set50=945) Cut Loss 3 จุด คาด SET50 แกว่งพักแต่ Downside จำกัด

SINGLE STOCK FUTURES:

แนะนำเปิด Long SCGPM23 รอบใหม่ บริเวณ 42.50 บาท เป้าทำกำไร 44.25 บาท และ Cut Loss 0.50 บาทจากทุน

แนะนำถือ Long CPALLM23 ทุน 62.87 บาท เป้าทำกำไร 66.00 บาท และ Cut Loss 0.75 บาทจากทุน

GOLD FUTURES:

GF10 Futures : แนะนำ Trading GF10M23 ที่ 32140-32630 บาท ($1970-2000) และรอเปิด Short กรอบบน พร้อม Cut Loss 100 บาทจากทุน

Gold Online: แนะนำ Trading GOM23 ที่ $1990-2020 และ Cut loss $3

สรุปวงเงินที่ต้องใช้จ่ายในการกำหนดนโยบายของแต่ละพรรค

Logo	พรรค	จำนวนนโยบาย	รวมวงเงินทั้งหมด (ล้านบาท)	ตัวอย่างนโยบายที่ใช้วงเงินสูง	วงเงินที่ต้องใช้ (ล้านบาท/ปี)
พท	เพื่อไทย	70	3,000,000	เติมเงินกระเป๋าดิจิทัล 10,000 บาท	560,000
				บริหารจัดการน้ำ ไม่ท่วม ไม่แล้ง	500,000
				สวัสดิการผู้สูงอายุ	300,000
ภูมิใจไทย	ภูมิใจไทย	10	2,563,002	Land Bridge อ่าวไทย-อันดามัน	1,700,000
				ภาษีบ้านเกิดเมืองนอน (Hometown Tax)	101,334
				เงินกู้ฉุกเฉิน 50,000 บาท	700,000
ก้าวไกล	ก้าวไกล	52	1,288,610	สวัสดิการผู้สูงอายุ 3,000 บาท/เดือน	500,000
				เพิ่มงบจังหวัดจัดการตนเอง	200,000
				สวัสดิการทุกช่วงวัย	98,500
พลังประชารัฐ	พลังประชารัฐ	14	1,000,000	เบี้ยยังชีพผู้สูงอายุ	495,658
				แม่-บุตร-ธิดา ประชารัฐ	174,216
				บัตรประชารัฐ 700 และฟรีประกันชีวิตประชา	128,392
ประชาธิปัตย์	ประชาธิปัตย์	11	685,400	Startup-SME ต้องมีแต้มต่อ 3 แสนล้านบาท	300,000
				ธนาคารหมู่บ้านแห่งละ 2 ล้านบาท	160,000
				ข้าวนาจับ 3 หมื่นบาทต่อครัวเรือน	97,000
รวมไทยสร้างชาติ	รวมไทยสร้างชาติ	11	250,000	บัตรสวัสดิการพลัส 1,000 บาท/คน/เดือน	71,000
				เบี้ยยังชีพผู้สูงอายุ 1,000 บาท/คน/เดือน	40,000
				คนละครึ่งภาค 2 จำนวน 26 ล้านสิทธิ์	40,000

ที่มา : ASPS Research รวบรวม

RESEARCH DIVISION

บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส

เทิดศักดิ์ ทวีธีระธรรม
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจกมล, CISA, CFA
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นวลพรรณ น้อยรัชชุกร
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันทาธนากิจ
นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธร เกิดเนตร
ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

สถานะของนักลงทุน

ข้อมูลในเอกสารฉบับนี้ รวบรวมมาจากแหล่งข้อมูลที่น่าเชื่อถือ อย่างไรก็ดี บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด ไม่สามารถที่จะยืนยันหรือรับรองความถูกต้องของข้อมูลเหล่านี้ได้ ไม่ว่าประการใดๆ บทวิเคราะห์ในเอกสารนี้ จัดทำขึ้นโดยอ้างอิงหลักเกณฑ์ทางวิชาการเกี่ยวกับหลักการวิเคราะห์ และมิได้เป็นการชี้นำ หรือเสนอแนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ การตัดสินใจซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ ของผู้อ่าน ไม่ว่าจะเกิดจากการอ่านบทความในเอกสารนี้หรือไม่ก็ตาม ล้วนเป็นผลจากการใช้วิจารณญาณของผู้อ่าน โดยไม่มีส่วนเกี่ยวข้องหรือพันธะผูกพันใดๆ กับ บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด ไม่ว่ากรณีใด

All Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	88,857	84,936	3,921	10,435	23,249	-14,459
Foreign	94,759	85,961	8,798	-1,857	-13,351	102,536
Retail	159,099	171,818	-12,719	-8,578	-9,898	-88,077

SET50 Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	26,353	28,815	-2,462	-8,143	-8,595	-19,961
Foreign	62,453	52,490	9,963	-3,861	-18,177	43,262
Retail	63,534	71,035	-7,501	12,004	26,772	-23,301

Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	39,055	40,852	-1,797	21,791	50,170	8,081
Foreign	4,339	1,780	2,559	10,302	11,251	57,192
Retail	42,641	43,403	-762	-32,093	-61,421	-65,273

Metal Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	3,702	3,481	221	-496	-819	-3,336
Foreign	27,177	30,821	-3,644	-7,966	-6,964	-4,655
Retail	25,182	21,759	3,423	8,462	7,783	7,991

Call Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	377	284	93	-835	-2,197	-761
Foreign	408	81	327	279	337	1,297
Retail	1,709	2,129	-420	556	1,860	-536

Put Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	5	46	-41	-104	-1,356	-127
Foreign	152	300	-148	-71	77	-46
Retail	2,201	2,012	189	175	1,279	173

SET50 OVERVIEW

การรายงานดัชนีภาคการผลิตของ FED สาขาดัชลาสเดือน เม.ย. ที่ชะลอตัว -23.4 แย่กว่าคาด -11.00 และต่ำกว่าเดือนก่อน -15.7 ทำให้ตลาดเชื่อว่าการปรับขึ้นดอกเบี้ยฯของ FED จะใกล้เข้าสู่ช่วงปลายขาขึ้น กดดัน Dollar Index วานนี้ปรับลง -0.47% ช่วยหนุนให้ราคาน้ำมันดิบวานนี้ดีด +1.85% สัญญาณข้างต้นมองเป็นบวกต่อหุ้นกลุ่มพลังงาน ส่วนปัจจัยในประเทศอยู่ในช่วงเก็งกำไรไปตามผลประกอบการงบ 1Q66F และนโยบายหาเสียงก่อนการเลือกตั้งที่โดยส่วนใหญ่เน้นไปที่การแก้ปัญหาปากท้อง กระตุ้นในภาคการบริโภค ซึ่งเป็นบวกต่อหุ้นกลุ่มค้าปลีก ไฟแนนซ์ ในระยะสั้น สภาพแวดล้อมที่ไม่ได้ประเด็นลบใหม่ข้างต้นช่วยหนุนต่อ SET50 แต่อย่างไรก็ตามมูลค่าการซื้อขายที่กลับมาเบาบาง ทำให้การฟื้นตัวเป็นไปอย่างจำกัด มองกรอบการเคลื่อนไหวของวันที่ 930-945 จุด

	แนวรับ	แนวต้าน
SET50	930	945
S50M23	930	945

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยจึงเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ

* แอปพลิเคชั่น “ASP Smart”

* Telegram “Asia plus group”

Follow now

Asia Plus Group

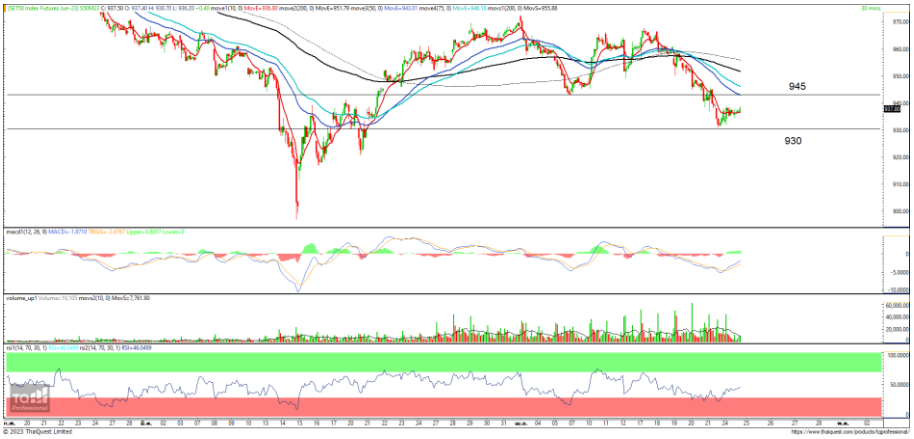
SET50 INDEX FUTURES

Direction Trading : SET50 Index ได้แรงหนุนจากราคาน้ำมันและการเก็งกำไรผลประกอบการและนโยบายหาเสียงก่อนเลือกตั้งแต่มูลค่าการซื้อขายเบาบางทำให้กรอบการขึ้นลงจำกัด แนะนำ Trading ตามกรอบ 930-945 จุด และ Long กรอบล่าง

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: นำรอ Long S50M23C925 ที่ 22 จุด (SET50=933 จุด) เป้าทำกำไร 32 จุด (set50=945) และ Cut Loss 3 จุด คาด SET50 แกว่งพักแต่ Downside จำกัด

S50M23 (30 MIN CHART)



TECHNICAL COMMENT

S50M23 ยังอยู่ในภาวะพักฐานในกรอบจำกัดตามกรอบ 930-945 จุด

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

SET50 Index	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
	939.38	11.4	11.7864

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
S50M23C1025	1.90	0.00	> 1026.9	0.00	1.90	9.32%	1.75	210	7952	14.27	0.08	37.60	9.3%
S50M23C1000	4.20	0.10	> 1004.2	0.00	4.20	6.90%	4.16	561	9041	14.06	0.15	33.25	6.9%
S50M23C975	8.70	0.00	> 983.7	0.00	8.70	4.72%	8.85	492	10241	13.89	0.27	28.64	4.7%
S50M23C950	16.00	-0.40	> 966	0.00	16.00	2.83%	16.92	289	6850	13.42	0.42	24.76	2.8%
S50M23C925	28.50	-1.30	> 953.5	14.38	14.12	1.50%	29.20	74	1772	13.55	0.60	19.93	1.5%

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
S50M23P1025	88.40	-1.30	< 936.6	85.62	2.78	-0.30%	88.35	0	199	14.08	-0.92	-9.80	-0.3%
S50M23P1000	66.10	-0.50	< 933.9	60.62	5.48	-0.58%	65.84	2	895	14.27	-0.84	-11.98	-0.6%
S50M23P975	45.00	-0.60	< 930	35.62	9.38	-1.00%	45.61	35	1807	13.53	-0.74	-15.37	-1.0%
S50M23P950	28.30	-0.50	< 921.7	10.62	17.68	-1.88%	28.77	72	4341	13.70	-0.57	-18.97	-1.9%
S50M23P925	16.50	-0.30	< 908.5	0.00	16.50	-3.29%	16.13	663	7131	14.24	-0.39	-22.46	-3.3%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 INDEX

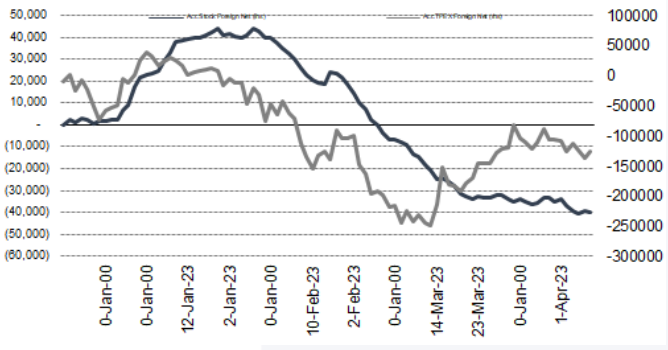
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สรุปการซื้อขาย
SET50	939.38	0.88	0.09%	24/4/23

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50J23	939.10	0.5	0.1%	76	141	-33
S50K23	938.00	0.3	0.0%	45	184	7
S50M23	937.80	0.4	0.0%	134,101	415,825	8,489
S50U23	935.00	0.2	0.0%	13,043	49,708	554
S50Z23	935.50	0.3	0.0%	3,373	22,951	46
S50H24	932.10	-0.2	0.0%	1,702	4,000	32

SET50 Futures Long(Short) : สัญญา				สะสม Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	1 เดือน
สถาบัน	26,353	28,815	-2,462	-8,143	-18,618	-19,961
ต่างชาติ	62,453	52,490	9,963	-3,861	-5,780	43,262
รายย่อย	63,534	71,035	-7,501	12,004	24,398	-23,301

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 FUTURES



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คาดการณ์ SPREAD ณ สิ้นเดือนจาก ASPS MODEL

เป้าหมาย Spread ซีรีย์ใกล - ซีรีย์ใกล้						
	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							
(เท่า)	ม.ค. 66E	มี.ค. 66E	เม.ย. 66E	พ.ค. 66E	มิ.ย. 66E	ก.ย. 66E	ธ.ค. 66E
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. เอเซีย พลัส

SINGLE STOCK FUTURES

Long SCGPM23

คาดการณ์กำไรสุทธิ 1Q66 ฟื้นตัว 166%QoQ อยู่ที่ 1,196 ล้านบาท หลายปัจจัยลบเริ่มผ่อนคลายลง ทั้งเรื่องต้นทุนวัตถุดิบ ต้นทุนพลังงาน และการส่งออกสินค้าไปประเทศจีน ราคาหุ้นที่ปรับฐานลงมาแล้ว 25% ในช่วง 3 เดือน น่าจะเป็นการตอบรับปัจจัยลบดังกล่าวไปแล้ว โดย Upside ราคาหุ้นที่กลับมาเปิดกว้าง ราคาเป้าหมายปี 66 เท่ากับ 56.00 บาท

ราคาหุ้นรายวัน จังหวะแกว่งหาฐาน ปรับฐานลงมาแรงจน RSI เข้าสู่เขต Oversold ใช้จังหวะย่อมาแถวโซนแนวรับที่ 42.50 บาท ประเมินเป้าหมายทำกำไรอยู่ที่ 44.25 บาท

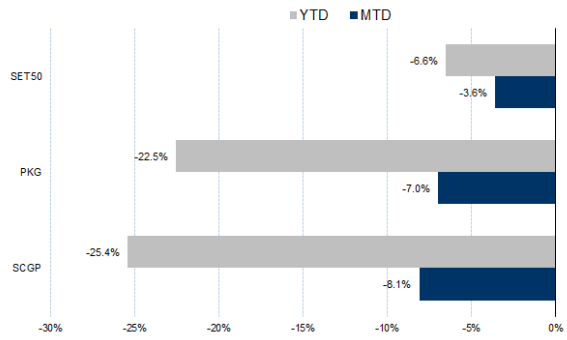
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำเปิด Long SCGPM23 รอบใหม่ บริเวณ 42.50 บาท เป้าทำกำไร 44.25 บาท และ Cut Loss 0.50 บาทจากทุน

Future							Underlying	
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 66F
SCGPM23	43.25	0.75	47	3948	5	-	11.71%	28.86

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

TECHNICAL CHART

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

Long CPALLM23

คาดกำไรสุทธิ 1Q66 อยู่ที่ 3.65 พันล้านบาท (+16% QoQ, +6% YoY) กำไรที่โตขึ้นทั้ง QoQ และ YoY ได้แรงหนุนจากรายได้จากการขายและบริการที่เพิ่มขึ้นในทุกๆหน่วยธุรกิจ (ธุรกิจร้านสะดวกซื้อ ธุรกิจค้าส่ง และธุรกิจค้าปลีก) ซึ่งสามารถชดเชยกับค่าใช้จ่ายที่สูงขึ้น โดยเฉพาะค่าไฟฟ้าที่ปรับเพิ่มขึ้นแรงตามค่า FT Fair Value เท่ากับ 72 บาท

ราคาหุ้นส่งสัญญาณกลับตัว จาก Inverted Head & Shoulder ดีงกลับขึ้นมายืนเหนือเส้น EMA 200 วัน พร้อมแท่งเทียน Bullish Breakout เป้าหมายทำกำไรอยู่ที่ 66.00 บาท

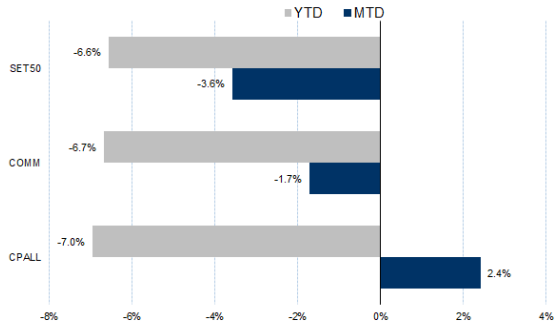
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำถือ Long CPALLM23 ทุน 62.87 บาท เป้าทำกำไร 66.00 บาท และ Cut Loss 0.75 บาทจากทุน

Future							Underlying	
Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 66F
CPALLM23	63.05	-0.45	382	3513	-115	14.97	13.64%	30.54

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

HISTORICAL PRICE

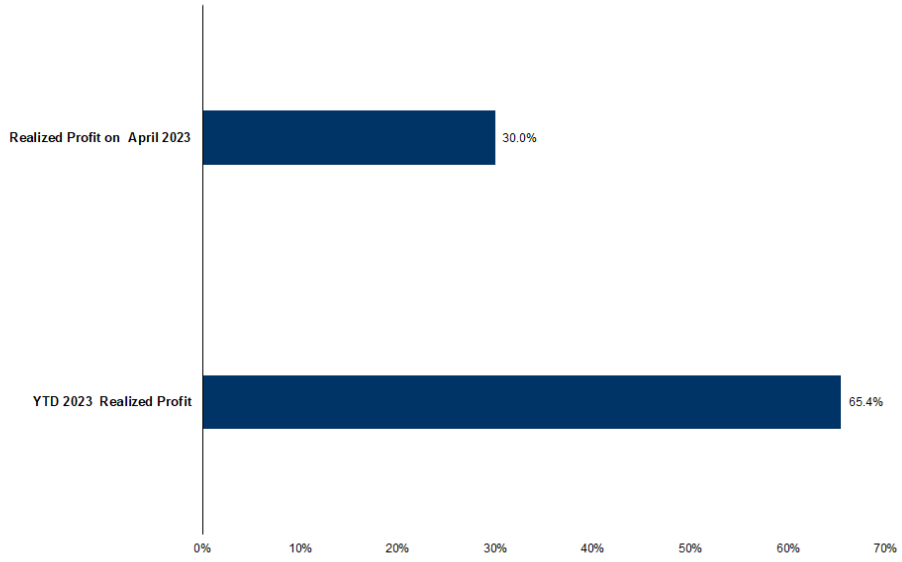


ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

TECHNICAL CHART

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

TRACKING PERFORMANCE



หมายเหตุ การคำนวณผลตอบแทนจะใช้ราคาเปิดในวันแนะนำเป็นต้นทุน เทียบกับราคาปิดล่าสุด เป็นผลตอบแทนสะสมจนกว่าจะถึงวันที่ฝ่ายวิจัยแนะนำให้ปิดสถานะทำกำไร/ตัดขาดทุน

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

TOP 20 MOST ACTIVE VOLUME

	Future	Settle Price	Basis	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	TTBM23	1.46	1.46	20,360	20,816	11,836		1.45	1.45
2	KTCM23	53.2	53.25	3,002	4,024	- 3,000	17.45	53.62	51.99
3	PLANBM23	8.58	8.2	1,514	18,523	- 1,497	7.02	8.96	7.97
4	TQMM23	29.3	28.5	1,255	5,988	- 828	1.66	29.30	29.83
5	KTBM23	17.9	18	1,253	21,206	- 389	19.63	17.75	17.85
6	SIRIM23	1.85	1.85	1,097	23,618	8	15.44	1.87	1.81
7	PTTEPM23	155.5	155.5	993	4,251	485	16.78	166.35	152.68
8	JMTM23	40.52	40.5	886	6,226	- 441		41.00	38.85
9	KBANKM23	128.4	127.5	819	8,525	527	11.21	129.95	126.68
10	CBGM23	74.15	74	779	5,521	- 25	6.56	76.90	73.88
11	HMPROM23	13.7	13.7	624	5,995	- 499	9.59	13.70	13.60
12	OSPM23	28	28	578	2,753	549	5.88	28.25	27.22
13	IRPCM23	2.43	2.4	547	32,104	- 508	8.54	2.44	2.39
14	THANIM23	3.76	3.78	501	2,522	- 500	4.21	3.85	3.69
15	AWCM23	5.41	5.4	500	8,710	500		5.41	5.27
16	BAMM23	13.01	13.4	463	14,026	- 245		13.08	13.01
17	IVLM23	33	33	422	12,965	169	9.62	33.00	32.66
18	TASCOM23	19.62	19.6	414	2,686	- 213	4.22	20.05	19.62
19	MINTM23	30.63	31.25	414	2,403	4	8.96	30.63	29.76
20	SPALIM23	21.72	21.6	403	2,560	401	11.61	21.78	21.37

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

GOLD FUTURES

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน เพิ่มขึ้น 6.3 เหรียญฯ ปิดที่ 1,989 เหรียญฯ จากแรงเข้าซื้อหลังราคาร่วงลงแรงกว่า 20 เหรียญฯ เมื่อวันศุกร์ที่ผ่านมา นอกจากนี้ราคาทองคำมีปัจจัยหนุนจากการปรับลดลงของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐ และการอ่อนค่าของค่าเงินดอลลาร์ หลังสหรัฐเปิดเผยดัชนีชี้วัดกิจกรรมภาคการผลิตเดือนเม.ย. ปรับตัวสู่ระดับต่ำสุดตั้งแต่ ก.ค. 2565 และต่ำกว่าคาด ทำให้ Dollar Index วานนี้ปรับลง 0.4% ปิดที่ 101.32 จุด โดยสัปดาห์นี้ ต้องติดตามการรายงานตัวเลขเศรษฐกิจสำคัญของสหรัฐ เริ่มจากวันนี้จะเปิดเผยราคาบ้านเดือน ก.พ. และยอดขายบ้านใหม่เดือน มี.ค. ต่อด้วยยอดสั่งซื้อสินค้งคงทนในวันพุธ และจำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงาน รวมถึงจีดีพี 1Q66 ในวันพฤหัสฯ และดัชนี PCE ในศุกร์ เพื่อหาสัญญาณของทิศทางดอกเบี้ยในการประชุมธนาคารกลางสหรัฐครั้งต่อไป (พ.ค. 2566)

Gold Online Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GOM23	2,009	2	0.12	38,888	24,972	1270
GOU23	2,038	2	0.12	10,600	5,331	276

Mini Gold Futures

	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GF10J23	32,450	0	0.00	1,121	3,038	-304
GF10M23	32,540	0	0.00	3,862	5,588	-306
GF10Q23	32,630	0	0.00	1,374	2,511	268

ที่มา: สายงานวิจัย บล.เอเซีย พลัส

หมายเหตุ 9 ราคาปิดของ Gold Futures (Night Session) Settle ณ เวลา 22.00 น. และปริมาณการซื้อขายเกิดขึ้นในช่วงเวลา 19.30-22.30 น.

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GF10J23 เมื่อคืน ลดลง 30 บาท ปิดที่ 32,450 บาท (1,990 เหรียญฯ) ต่ำกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,995-1,997 เหรียญฯ คาดราคา GF10J23 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 32,400-32,800 บาท ทิศทางราคาทองคำยังแกว่งตัวในกรอบที่ประเมินไว้ 1,970-2,000 เหรียญฯ ทำให้ฝ่ายวิจัยคงแนะนำ Trading GF10M23 (แทน GF10J23 ที่จะหมดอายุเดือนนี้) บริเวณ 32,140-32,630 บาท แต่หากราคาขยับขึ้นแตะกรอบบน แนะนำรอเปิด Short และกำหนดจุด cut loss 100 บาทจากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยง หากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

GOLD SPOT

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

GOLD ONLINE FUTURES (GOM23)

ทิศทางราคาทองคำ ทำฐานได้แกร่งเหนือ EMA 10 วัน พร้อมจังหวะ Higher Low ด้วย Bullish Breakout ประเมินแนวโน้มโดยรวมยังเป็นขาขึ้น คาดกรอบ $1990-$2020

Gold Online: แนะนำ Trading GOM23 ที่ $1990-2020 และ Cut loss $3

GOM23

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

BASIS ระหว่าง GOM23-GOLD SPOT

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

	FX (บาท/ USD)				
	33.50	33.75	34.00	34.25	34.50
1,900	30,255	30,480	30,706	30,932	31,158
1,930	30,732	30,962	31,191	31,420	31,650
1,960	31,210	31,443	31,676	31,909	32,142
1,990	31,688	31,924	32,161	32,397	32,634
2,020	32,165	32,406	32,646	32,886	33,126
2,050	32,643	32,887	33,130	33,374	33,618
2,080	33,121	33,368	33,615	33,862	34,110
2,110	33,599	33,849	34,100	34,351	34,602
2,140	34,076	34,331	34,585	34,839	35,094

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ MINI GOLD FUTURES

นักลงทุนรายย่อย
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)

ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
32,700.00	250.0	2,500	(210)	2,290
32,650.00	200.0	2,000	(210)	1,790
32,600.00	150.0	1,500	(210)	1,290
32,550.00	100.0	1,000	(210)	790
32,500.00	50.0	500	(210)	290
32,450.00	0.0	-	(210)	(210)
32,400.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
32,350.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
32,300.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
32,250.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
32,200.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส