

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์



SET50 FUTURES:

ประเด็นการเมือง และความเชื่อมั่นนักลงทุนลดลงเป็นแรงกดดัน SET50 แต่สัญญาณ OVERSOLD ที่ปรากฏ จะช่วยจำกัด DOWNSIDE แนะนำ TRADING S50U23 รอบ 895-905 จุดและเสี่ยง LONG รอบล่าง

SET50 OPTION:

แนะนำ LONG S50U23C900 ที่ 20 จุด (SET50=900) เป้าทำกำไร 30 จุด (SET50=910) และ CUT LOSS 3 จุด คาด SET50 พักฐานแต่ DOWNSIDE จำกัด

SINGLE STOCK FUTURES:

แนะนำ LONG IVLU23 บริเวณ 33.75 บาท เป้าทำกำไร 36.00 บาท และ CUT LOSS 0.50 บาทจากทุน

สถานะ LONG ERWM23 ทุน 4.66 บาท ปิดติดขาดทุน 15% สำหรับวันนี้แนะนำ LONG BEMU23 บริเวณ 8.10 บาท เป้าทำกำไร 8.30 บาท และ CUT LOSS 0.10 บาทจากทุน

GOLD FUTURES:

GF10 FUTURES: สถานะ LONG GF10M23 ทุนที่ 31900 บาท มีกำไร 360 บาท ถือต่อ เป้าทำกำไร 32450 บาท และ LOCK กำไร 250 บาท

GOLD ONLINE: แนะนำ TRADING GOM23 ที่ \$1910-1940 และ CUT LOSS \$3

S50U23 มีสัญญาณ OVERSOLD



ที่มา: TQ PROFESSIONAL



27 มิถุนายน 2566

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

ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องดำเนินการได้อย่างรวดเร็วทัน ฝายวิจัยจึงเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันทำการผ่าน 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 รัตนกิจภมร, CISA, CFA

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นवलพรรณ น้อยรัชชกุล

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันพานากิจ

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธ เกิดเนตร

ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

ข้อมูลในเอกสารฉบับนี้ รวบรวมมาจากแหล่งข้อมูลที่นำเสนอไว้ อย่างไรก็ดี บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด ไม่สามารถที่จะยืนยันหรือรับรองความถูกต้องของข้อมูลเหล่านี้ได้ ไม่ว่าประการใดๆ บทวิเคราะห์ในเอกสารนี้ จัดทำขึ้นโดยอ้างอิงหลักเกณฑ์ทางวิชาการเกี่ยวกับหลักการวิเคราะห์ และมิได้เป็นการชี้แนะ 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 | 231,248 | 202,980 | 28,268 | -4,144 | 54,596 | 73,168 |
| Foreign | 407,106 | 387,911 | 19,195 | 9,196 | -75,309 | 31,961 |
| Retail | 307,544 | 355,007 | -47,463 | -5,052 | 20,713 | -105,129 |

| | SET50 Futures Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|---|---------|--------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 66,353 | 65,750 | 603 | -1,605 | -2,443 | -11,584 |
| Foreign | 335,838 | 339,472 | -3,634 | -5,674 | -90,824 | -6,376 |
| Retail | 142,869 | 139,838 | 3,031 | 7,279 | 93,267 | 17,960 |

| | Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|--|---------|---------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 116,508 | 79,995 | 36,513 | 15,011 | 77,346 | 70,061 |
| Foreign | 39,445 | 24,246 | 15,199 | 5,922 | 22,574 | 37,310 |
| Retail | 100,496 | 152,208 | -51,712 | -20,933 | -99,920 | -107,371 |

| | Metal Futures Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|---|--------|--------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 1,877 | 1,021 | 856 | 524 | -564 | 1,542 |
| Foreign | 29,705 | 21,930 | 7,775 | 8,394 | -7,455 | 146 |
| Retail | 18,203 | 26,834 | -8,631 | -8,918 | 8,019 | -1,688 |

| | Call Option Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|---|-------|------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 311 | 78 | 233 | 40 | -931 | -2,015 |
| Foreign | 981 | 920 | 61 | 48 | -766 | 852 |
| Retail | 4,879 | 5,173 | -294 | -88 | 1,697 | 1,163 |

| | Put Option Long(Short) Position : Contract | | | Accumulated Long(Short) | | |
|-------------|--|-------|------|-------------------------|---------|----------|
| | Long | Short | Net | 2 Days | 1 Weeks | 1 Months |
| Institution | 169 | 187 | -18 | 68 | 309 | 586 |
| Foreign | 827 | 1,012 | -185 | 446 | 1,183 | 207 |
| Retail | 3,998 | 3,795 | 203 | -514 | -1,492 | -793 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

SET50 OVERVIEW

การปรับลงของ SET INDEX ในช่วง 5 วันทำการที่ผ่านมา 41 จุดหรือคิดเป็น 4.35% ประเมินมาจาก 3 ปัจจัย 1) ประเด็นการเมืองที่ยังมีความไม่แน่นอนต่อการจัดตั้งรัฐบาล 2) การส่งสัญญาณปรับขึ้นดอกเบี้ยฯของ สปท. เพื่อกดดันเงินเฟ้อ และ 3) ระดับความเชื่อมั่นของนักลงทุนที่ลดลงจากผลกระทบของหุ้นเฉพาะตัว แรงกดดันจาก 3 ประเด็นข้างต้นที่ยังคงอยู่ เป็นปัจจัยที่กดดันต่อกิศทาง FUND FLOW ไหลออกและส่งผลต่อสภาพคล่องในระบบที่ลดลงสะท้อนจากมูลค่าการซื้อขาย SET50 INDEX ล่าสุดอยู่ที่ 2.4 หมื่นล้านบาทเทียบกับมูลค่าการซื้อขายเฉลี่ยของปีที่ 3.5 หมื่นล้านบาท ส่วนปัจจัยต่างประเทศอยู่ในภาวะติดตามการรายงานตัวเศรษฐกิจ โดยวันนี้ฝั่งสหรัฐฯ ติดตามยอดคำสั่งซื้อสินค้าคงทนเดือน พ.ค. คาดหดตัว -1.0%MOM และดัชนีความเชื่อมั่นผู้บริโภคเดือน มิ.ย. คาดที่ 103.7 ภายใต้อัตราเงินเฟ้อที่แรงกดดันให้ SET50 INDEX ยังอยู่ในภาวะพักฐานแต่อย่างไรก็ตามสัญญาณทางเทคนิคที่เริ่มส่งสัญญาณ OVERSOLD จึงมองพื้นที่การปรับลงจำกัดประเมินกรอบการเคลื่อนไหวที่ 900 – 915 จุด

SET50 INDEX FUTURES

DIRECTION TRADING: ประเด็นการเมือง และระดับความเชื่อมั่นนักลงทุนลดลง กดดัน SET50 แต่สัญญาณ OVERSOLD ที่ปรากฏช่วยจำกัด DOWNSIDE แนะนำ TRADING S50U23 กรอบ 895-905 จุดและเสียง LONG กรอบล่าง

SPREAD TRADING: เปิด SHORT SPREAD S50M23U23 ได้ที่ -1.71 จุด ปัจจุบันกำไร 1.69 จุด แนะนำถือต่อโดยคาด SPREAD ระหว่าง S50U23 ลบด้วย S50M23 ณ วันที่ 29 มิ.ย. 2566 จะเท่ากับ -4.91 จุด

SET50 OPTION: แนะนำ LONG S50U23C900 ที่ 20 จุด (SET50=900) เป้ากำไร 30 จุด (SET50=910) และ CUT LOSS 3 จุด คาด SET50 พักฐานแต่ DOWNSIDE จำกัด

| | แนวรับ | แนวต้าน |
|--------|--------|---------|
| SET50 | 900 | 915 |
| S50U23 | 895 | 905 |

S50U23 (30 MIN CHART)



TECHNICAL COMMENT

S50U23 อยู่ในช่วงหาฐานมองกรอบการเคลื่อนไหวที่ 895-905 จุด

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

| SET50 Index | Last | 1Yr Hist. Volatility | 2Week Hist. Volatility |
|-------------|--------|----------------------|------------------------|
| | 908.30 | 11.53 | 10.2019 |

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 |
|-------------|---------|-------|------------|-----------------|------------|----------------|--------------|--------|---------------|--------------------|-------|-------------------|------------|
| S50U23C1000 | 0.10 | 0.00 | > 1000.1 | 0.00 | 0.10 | 10.11% | 0.00 | 12 | 16560 | 36.95 | 0.01 | 75.95 | 10.1% |
| S50U23C975 | 0.10 | -0.10 | > 975.1 | 0.00 | 0.10 | 7.35% | 0.00 | 322 | 16575 | 28.36 | 0.01 | 96.26 | 7.4% |
| S50U23C950 | 0.40 | -0.20 | > 950.4 | 0.00 | 0.40 | 4.64% | 0.00 | 1229 | 13083 | 24.03 | 0.04 | 95.17 | 4.6% |
| S50U23C925 | 1.70 | -1.80 | > 926.7 | 0.00 | 1.70 | 2.03% | 0.27 | 1555 | 7377 | 18.35 | 0.18 | 93.99 | 2.0% |
| S50U23C900 | 11.60 | -6.40 | > 911.6 | 8.30 | 3.30 | 0.36% | 9.35 | 328 | 1237 | 17.88 | 0.68 | 52.91 | 0.4% |

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 |
|-------------|---------|------|------------|-----------------|------------|----------------|--------------|--------|---------------|--------------------|-------|-------------------|------------|
| S50U23P1000 | 91.70 | 7.80 | < 908.3 | 91.70 | 0.00 | 0.00% | 92.06 | 0 | 953 | #N/A | -1.00 | -9.91 | 0.0% |
| S50U23P975 | 66.20 | 6.90 | < 908.8 | 66.70 | #N/A | 0.06% | 67.06 | 68 | 1826 | #N/A | -1.00 | -13.72 | 0.1% |
| S50U23P950 | 42.50 | 7.90 | < 907.5 | 41.70 | 0.80 | -0.09% | 42.07 | 189 | 4430 | 23.41 | -0.96 | -20.55 | -0.1% |
| S50U23P925 | 18.80 | 5.70 | < 906.2 | 16.70 | 2.10 | -0.23% | 17.34 | 541 | 6620 | 18.13 | -0.83 | -39.93 | -0.2% |
| S50U23P900 | 3.90 | 1.60 | < 896.1 | 0.00 | 3.90 | -1.34% | 1.42 | 1762 | 6512 | 18.27 | -0.33 | -76.16 | -1.3% |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 INDEX

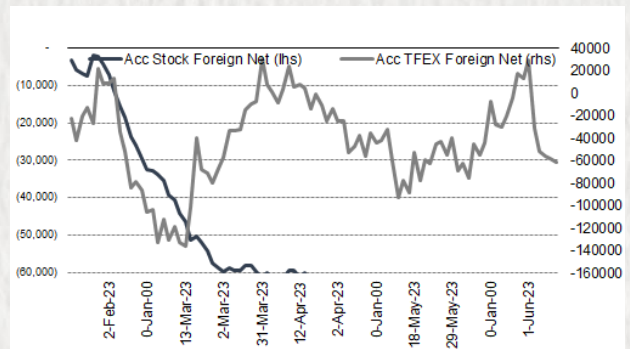
| UNDERLYING | Close | Chg | %Chg | สเปกการซื้อขาย |
|------------|--------|-------|--------|----------------|
| SET50 | 908.30 | -9.28 | -1.02% | 26/6/23 |

| Symbol | Settle | Chg | %Chg | Vol. | OI | OI Chg |
|--------|--------|------|-------|---------|---------|---------|
| S50J23 | 925.01 | 0.0 | 0.0% | 73 | 81 | 0 |
| S50K23 | 926.92 | 0.0 | 0.0% | 40 | 133 | 0 |
| S50M23 | 908.10 | -7.3 | -0.8% | 252,238 | 501,060 | 49,215 |
| S50U23 | 904.60 | -8.7 | -1.0% | 203,786 | 299,100 | 135,763 |
| S50Z23 | 906.70 | -8.4 | -0.9% | 17,271 | 60,540 | 2,957 |
| S50H24 | 904.70 | -7.9 | -0.9% | 6,320 | 14,474 | 2,374 |

| | SET50 Futures Long(Short) : สิ้นวัน | | | สเปก Long(Short) | | |
|---------|-------------------------------------|---------|--------|------------------|-----------|---------|
| | Long | Short | Net | 2 วัน | 2 สัปดาห์ | 1 เดือน |
| สถานะ | 66,353 | 65,750 | 603 | -1,605 | -5,204 | -11,584 |
| ล้างขาด | 335,838 | 339,472 | -3,634 | -5,674 | -31,660 | -6,376 |
| รายย่อย | 142,869 | 139,838 | 3,031 | 7,279 | 36,864 | 17,960 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศ ในตราสารทุน และ SET50 FUTURES



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คาดการณ์ SPREAD ณ สิ้นเดือนจาก ASPS MODEL

| | เป้าหมาย Spread ซีรียโทล - ซีรียโทล | | | | | |
|--------|-------------------------------------|-------------|--------------|--------------|-------------|--------------|
| | 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 | 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

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

SINGLE STOCK FUTURES

LONG IVLU23

ทิศทางกำไรงวด 2Q66 ผ่านมุมมองของผู้บริหาร คาดการณ์กำไรปกติจะปรับตัวเพิ่มขึ้น QOQ หนุนหลักจากปริมาณขายที่เพิ่มขึ้นมาอยู่ราว 3.90 จาก 3.45 ล้านตัน ขณะที่ค่า SPREAD พลิตกิ้นที่ภายใต้หลักความระมัดระวังน่าจะทรงตัวใกล้เคียงกับงวดก่อนหน้า หรือดีขึ้นเล็กน้อยได้ FAIR VALUE เท่ากับ 44 บาท

ราคาหุ้นรายวัน ย่อตัวเล็กน้อย หลังจากติดแนวต้านโซน EMA 75 วัน ขณะที่หากถอยมาโซน 33.75 (EMA 10 วัน) แนะนำเข้าสะสม เพื่อคาดหวังรอบรีบาวด์

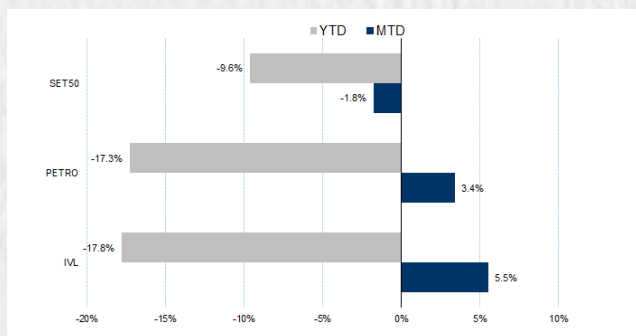
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ LONG IVLU23 บริเวณ 33.75 บาท เป้าทำกำไร 36.00 บาท และ CUT LOSS 0.50 บาทจากทุน

| Future | | | | | | | Underlying | |
|--------|--------------|-------|------|------|-----------|----------|------------|---------|
| Future | Settle Price | Basis | Vol | OI | OI Change | Leverage | Upside | PER 66F |
| BEMU23 | 8.19 | -0.06 | 1002 | 7090 | 13 | - | 25.00% | 36.68 |

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 BEMU23

งวด 2Q66 มีแนวโน้มจะดีขึ้นอีก เพราะมีการรับรู้เงินปันผลจาก CKP และ TTW เข้ามาอีกจำนวน 337 ล้านบาท ภาพการฟื้นตัวของผลประกอบการชัดเจนในลักษณะ V SHAPE พร้อมเดิหน้าทำจุดสูงสุดใหม่ของกำไรจากการดำเนินงานต่อเนื่องในช่วง 3 ปีข้างหน้า โดย FAIR VALUE ปี 2566 อยู่ที่ 11.50 บาท ราคาหุ้นรายวัน สัญญาณ TECHNICAL REBOUND จากแนวรับสำคัญโซน 8.10 +/- บาท เป็นแท่งเทียน HAMMER บ่งชี้ DOWNSIDE ที่จำกัด

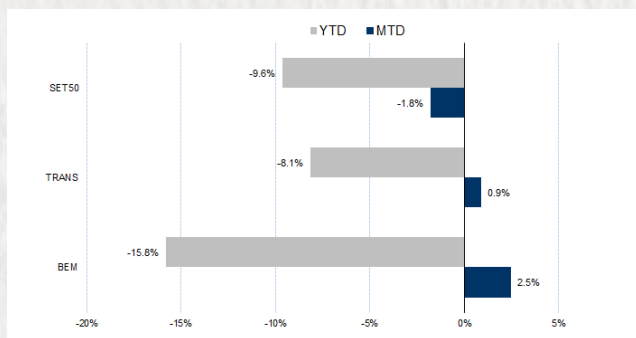
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ LONG BEMU23 บริเวณ 8.10 บาท เป้าทำกำไร 8.30 บาท และ CUT LOSS 0.10 บาทจากทุก

| Future | | | | | | | Underlying | |
|--------|--------------|-------|------|------|-----------|----------|------------|---------|
| Future | Settle Price | Basis | Vol | OI | OI Change | Leverage | Upside | PER 66F |
| BEMU23 | 8.19 | -0.06 | 1002 | 7090 | - | - | 25.00% | 36.68 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

HISTORICAL PRICE



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

TECHNICAL CHART

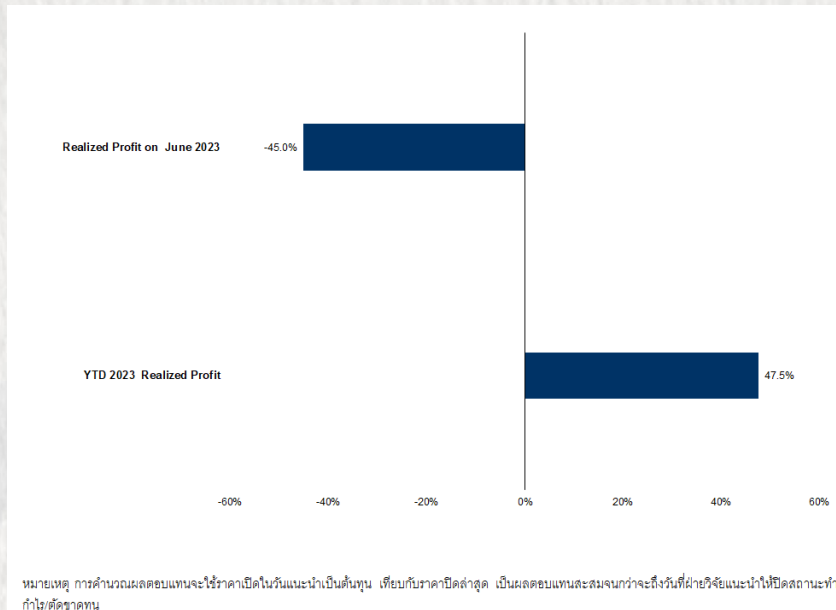


ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

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 | BLANDU23 | 0.85 | 0.82 | 6,182 | 170,032 | 167 | 8.95 | 0.86 | 0.86 |
| 2 | BANPUU23 | 8.84 | 9 | 5,880 | 53,722 | 3,194 | 16.03 | 9.20 | 8.80 |
| 3 | SIRIU23 | 1.87 | 1.84 | 5,549 | 17,098 | - | 14.76 | 15.44 | 1.95 |
| 4 | TTBU23 | 1.59 | 1.6 | 4,683 | 19,306 | 1,561 | 15.51 | 1.59 | 1.55 |
| 5 | GUNKULU23 | 3.03 | 3.02 | 4,563 | 53,065 | 2,053 | 19.36 | 3.13 | 3.14 |
| 6 | SAMARTU23 | 5.21 | 5.2 | 3,531 | 10,876 | 30 | 6.64 | 5.68 | 5.28 |
| 7 | SAWADU23 | 46.9 | 46 | 3,249 | 11,407 | 2,950 | 6.65 | 47.68 | 47.37 |
| 8 | THCOMU23 | 10 | 10 | 3,032 | 4,688 | 20 | 10.00 | 10.90 | 10.54 |
| 9 | AAVU23 | 2.74 | 2.7 | 2,057 | 53,413 | 39 | 8.48 | 2.76 | 2.68 |
| 10 | PSLU23 | 10.4 | 10.1 | 2,018 | 3,167 | 93 | 14.76 | 10.51 | 10.00 |
| 11 | CHGU23 | 2.93 | 2.96 | 2,006 | 5,543 | 506 | 13.31 | 2.98 | 2.88 |
| 12 | EAU23 | 53 | 52.5 | 1,902 | 15,138 | - | 78 | 15.81 | 57.00 |
| 13 | BCHU23 | 17.08 | 17.2 | 1,665 | 4,647 | 1,165 | 15.79 | 17.16 | 17.21 |
| 14 | KCEU23 | 36.9 | 36.5 | 1,647 | 2,886 | - | 110 | 8.55 | 37.54 |
| 15 | CPFU23 | 19.96 | 19.8 | 1,580 | 12,942 | 1,342 | 7.99 | 20.07 | 19.51 |
| 16 | IRPCU23 | 2.25 | 2.24 | 1,566 | 10,688 | 1,537 | 8.54 | 2.32 | 2.22 |
| 17 | IVLU23 | 34 | 33.5 | 1,503 | 5,785 | 391 | 9.62 | 35.68 | 33.33 |
| 18 | BECU23 | 8.06 | 7.75 | 1,306 | 41,938 | - | 20,094 | 13.57 | 8.06 |
| 19 | GULFU23 | 43.7 | 43.75 | 1,240 | 12,080 | 221 | 2.72 | 44.70 | 43.45 |
| 20 | JMTU23 | 33.5 | 33.5 | 1,168 | 3,369 | - | 94 | 35.50 | 35.49 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

GOLD FUTURES

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน เพิ่มขึ้น 1.2 เหรียญฯ ปิดที่ 1,923 เหรียญฯ มีแรงหนุนจากการปรับลงของอัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐ และค่าเงินดอลลาร์อ่อนค่า เมื่อเทียบกับสกุลเงินอื่น นำโดยเงินเยนแข็งค่าขึ้นหลังญี่ปุ่นส่งสัญญาณอาจแทรกแซงตลาดเงินเพื่อสกัดการอ่อนค่าของเยน ส่งผลให้ DOLLAR INDEX วานนี้ลดลง 0.11% ปิดที่ 102.75 จุด สำหรับสัปดาห์นี้ ต้องติดตามการเปิดเผยข้อมูลเศรษฐกิจสำคัญสหรัฐ เช่น ยอดสั่งซื้อสินค้าคงทน, ยอดขายบ้านใหม่, GDP 1Q66, จำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ และดัชนี PCE ฯลฯ

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GF10M23 เมื่อคืน เพิ่มขึ้น 60 บาท ปิดที่ 32,260 บาท (1,928 เหรียญฯ) สูงกว่าราคาทองคำตลาด SPOT ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,924 เหรียญฯ คาดราคา GF10M23 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 32,050-32,500 บาท ฝ่ายวิจัยแนะนำให้ นักลงทุนที่มีสถานะ LONG GF10M23 ทุนที่ 31,900 บาท ปัจจุบันมีกำไรเพิ่มเป็น 360 บาท แนะนำถือต่อไป มีเป้าหมายกำไร 1,940 เหรียญฯ หรือ 32,450 บาท และขยับจุด STOP PROFIT ที่ 32,150 บาท เพื่อ LOCK กำไรขั้นต่ำ 250 บาทจากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

GOLD ONLINE FUTURES

| | Last | Chg | %Chg | Vol | OI | OI Chg |
|-------|-------|-----|-------|--------|--------|--------|
| GOM23 | 1,925 | -7 | -0.36 | 22,000 | 34,940 | -5299 |
| GOU23 | 1,955 | -7 | -0.35 | 6,960 | 10,221 | -780 |

MINI GOLD FUTURES

| | Last | Chg | %Chg | Vol | OI | OI Chg |
|---------|--------|-----|-------|-------|-------|--------|
| GF10M23 | 32,260 | -70 | -0.22 | 2,411 | 6,055 | -536 |
| GF10Q23 | 32,350 | -70 | -0.22 | 739 | 3,495 | -212 |
| GF10V23 | 32,470 | -50 | -0.15 | 126 | 578 | 111 |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

หมายเหตุ 9 ราคาปิดของ GOLD FUTURES (NIGHT SESSION) SETTLE ณ เวลา 22.00 น. และปริมาณการซื้อขายเกิดขึ้นในช่วงเวลา 19.30-22.30 น.

GOLD SPOT



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Derivative talk

กลยุทธ์การลงทุนอนุพันธ์

GOLD ONLINE FUTURES (GOM23)

ทิศทางราคาทองคำ หลุดแนวรับสำคัญโซน \$1940 HIGH เริ่มโดนกด สนับสนุนด้วย EMA 10 วัน เป็นแนวต้าน คาดราคากลับมาสู่กรอบการเคลื่อนไหวที่ \$1910-1940

GOLD ONLINE: แนะนำ TRADING GOM23 ที่ \$1910-1940 และ CUT LOSS \$3

GOM23



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

BASIS ระหว่าง GOM23-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

| มิถุนายนรายย่อย | | | | |
|-------------------------------------|-------------|---------------|--------------|---------------|
| (ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/บ้าง) | | | | |
| ราคาปิด | กำไร | ค่าธรรมเนียม+ | กำไร | |
| future | เปลี่ยนแปลง | (ขาดทุน) | VAT (บาท) | (ขาดทุน)สุทธิ |
| 32,600.00 | 250.0 | 2,500 | (210) | 2,290 |
| 32,550.00 | 200.0 | 2,000 | (210) | 1,790 |
| 32,500.00 | 150.0 | 1,500 | (210) | 1,290 |
| 32,450.00 | 100.0 | 1,000 | (210) | 790 |
| 32,400.00 | 50.0 | 500 | (210) | 290 |
| 32,350.00 | 0.0 | - | (210) | (210) |
| 32,300.00 | -50.0 | (500) | (210) | (710) |
| 32,250.00 | -100.0 | (1,000) | (210) | (1,210) |
| 32,200.00 | -150.0 | (1,500) | (210) | (1,710) |
| 32,150.00 | -200.0 | (2,000) | (210) | (2,210) |
| 32,100.00 | -250.0 | (2,500) | (210) | (2,710) |

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส