



SET50 Futures:

คาดการณ์ Short Sell จะสร้างแรงกดดันต่อ SET50 เพิ่มในภาวะที่ราคาน้ำมันปรับลดลง
วันนี้แนะนำ Trading S50Z20 กรอบ 775- 785 จุด

SET50 Option:

แนะนำปรับราคาเปิด Long S50Z20P800 ไปที่ 278จุด (SET50=795) เป้าทำกำไร 43
จุด (SET50=780) Cut Loss 3 จุดจากทุน คาด SET50 ผันผวนต่อเนื่อง

Single Stock Futures:

คงคำแนะนำให้ทำ Follow Short PTTGCZ20 เมื่อราคาหลุด 38.50 บาท เป้าทำกำไร
36.50 บาท Cut Loss 1 บาทจากทุน PTTGC เป็นหุ้นที่มีความเสี่ยงต่อการ Short Sell

นักลงทุนเปิด Short MINTZ20X ได้ที่ทุน 19.73 บาท แนะนำถือต่อ เป้าทำกำไร 18.50
บาท Cut Loss 0.50 บาท แรงกดดันจาก Covid-19 ยิ่งกระทบกำไรต่อเนื่อง

Gold Futures:

ราคาทองคำติดลบมาบริเวณ 1900\$ และน่าจะอยู่ในกรอบ +/-10\$ การถือสถานะข้าม
วันผลตอบแทนไม่คุ้มเสี่ยง Trading GFV20 กรอบ 28370-28820 บาท (1870-1900\$)

SET50 Index Futures / Option	P. 2
Single Stock Futures	P. 4
Gold Futures	P. 7

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องสามารถ
ดำเนินการได้อย่างรวดเร็วขึ้น ฝ่ายวิจัยฯจึงได้มีการ
เพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขาย
ระหว่างวันทำการผ่าน 2 ช่องทาง เพื่อให้ นักลงทุน
สามารถปรับเปลี่ยนกลยุทธ์ได้มีประสิทธิภาพมาก
ยิ่งขึ้น คือ

- แอปพลิเคชัน: [ASP Smart](#)
- Telegram: [ASIA PLUS GROUP](#)
(<http://bit.ly/TeleAsiaplusgroup>)

สถานะของนักลงทุน

All Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	144,330	147,960	-3,630	-887	45,732	-610
Foreign	93,026	74,348	18,678	2,225	58,448	75,377
Retail	164,279	179,327	-15,048	-1,338	-104,180	-74,767

SET50 Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	33,517	37,820	-4,303	-5,928	-12,368	-18,892
Foreign	66,740	52,387	14,353	7,488	62,025	28,868
Retail	100,392	110,442	-10,050	-1,560	-49,657	-9,976

Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	102,728	97,776	4,952	11,203	40,199	-10,755
Foreign	9,247	5,108	4,139	-2,921	-10,236	43,336
Retail	38,042	47,133	-9,091	-8,282	-29,963	-32,581

Metal Futures Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	5,566	4,299	1,267	-966	1,214	2,641
Foreign	17,039	16,853	186	-2,342	6,659	3,152
Retail	15,533	16,986	-1,453	3,308	-7,873	-5,793

Call Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	161	117	44	-335	-575	-2,262
Foreign	2	137	-135	-160	-211	-508
Retail	2,755	2,664	91	470	785	2,710

Put Option Long(Short) Position : Contract				Accumulated Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months
Institution	148	519	-371	340	614	-1,455
Foreign	302	24	278	57	211	2,030
Retail	3,819	3,726	93	-397	-643	-650

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

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 พันทการนาทิจ

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธรรม เกิดเนตร

ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

SET50 Overview

การปรับลงของราคาน้ำมันดิบ WTI 4.5% จากความกังวลของฝั่ง Supply หลังการรายงานกลุ่ม OPEC เดือน ก.ย. เปิดเผยว่ากำลังการผลิตเพิ่มขึ้น 1.6 แสนบาร์เรลต่อวันจากอิหร่านและลิเบียที่กลับมาเพิ่มกำลังการผลิต อีกทั้งฝั่ง Demand ที่ยังไม่ฟื้นตัวจากหลายประเทศกลับมาใช้มาตรการ Partial Lockdown หลังพบการติดเชื้อระลอก 2 ของ COVID-19 ซึ่งอาจเป็นแรงกดดันต่อหุ้นกลุ่มพลังงานและอาจสร้างแรงกดดันต่อ SET50 Index ทั้งนี้เห็นสัญญาณลบหลังกลับมาใช้มาตรการ Short Sales ตามเดิมพบว่ามูลค่าขาย Short วานนี้กลับมาอยู่ในระดับสูงถึง 2.11 พันล้านบาทเพิ่มขึ้น 254% เทียบกับวันก่อนหน้า อาจจะเป็นอีกแรงหนึ่งที่ทำให้ความผันผวนในขาลงเพิ่มสูงขึ้น ส่วนประเด็นอื่นๆ วันนี้ติดตามคลังเตรียมกลับมาพิจารณาออกมาตรการ ชิม ชั๊อป ใช้ และคืนนี้ติดตามการรายงานตัวเลขการจ้างงานนอกภาคเกษตรสหรัฐฯเดือน ก.ย. คาดเพิ่มขึ้น 8.5 แสนตำแหน่งและอัตราการว่างงานเดือนเดียวกันคาดอยู่ที่ 8.2% ปัจจัยแวดล้อมที่ขาดปัจจัยบวกหนุนข้างต้นคาด SET50 Index ปรับลงตามกรอบ 777 - 790 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: ราคาน้ำมันดิบที่ปรับลงแรงกดดัน SET50 Index แนะนำ Trading S50Z20 กรอบ 775- 785 จุด

Spread Trading: นักลงทุนน่าจะเปิดสถานะ Short Spread ระหว่าง S50H21-S50Z20 ได้ที่ไม่ต่ำกว่า -4.0 จุด ปัจจุบันมีกำไรอย่างน้อย 0.2 จุดแนะนำถือต่อคาดหวัง Spread ลู่เข้าค่าทางทฤษฎีที่ -7.93 จุด

SET50 Option: แนะนำให้ปรับมาเปิด Long S50Z20P800 ที่ 28 จุด (SET50=795) เบ้าทำกำไร 43 จุด (SET50=780) Cut Loss 3 จุดจากทุน

	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	788.02	31.85897	20.86213

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
S50Z20C875	3.40	0.60	> 878.4	0.00	3.40	11.47%	5.13	221	1428	17.18	0.11	25.30	0.1
S50Z20C850	6.20	0.80	> 856.2	0.00	6.20	8.65%	8.97	639	1812	17.00	0.18	23.39	0.1
S50Z20C825	12.00	1.80	> 837	0.00	12.00	6.22%	14.90	489	2073	17.23	0.30	19.42	0.1
S50Z20C800	20.90	3.30	> 820.9	0.00	20.90	4.17%	23.53	541	1603	17.42	0.43	16.33	0.0
S50Z20C775	34.10	4.50	> 809.1	13.02	21.08	2.68%	35.31	400	511	18.58	0.57	13.27	0.0

Put Option

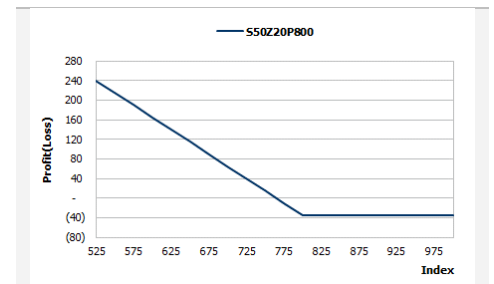
	Premium	Chg	Break Even	Intrinsic Value	Time Value	All-in-Premium	Theory Price	Volume	Open Interest	Implied Volatility	Delta	Effective Gearing	Time Decay
S50Z20P875	96.10	0.80	< 778.9	86.98	9.12	-1.16%	94.44	3	169	21.80	-0.82	-7.51	0.0
S50Z20P850	71.50	-5.00	< 778.5	61.98	9.52	-1.21%	73.30	14	283	18.28	-0.79	-9.39	0.0
S50Z20P825	51.00	-4.30	< 774	36.98	14.02	-1.78%	54.25	59	670	17.35	-0.69	-11.24	0.0
S50Z20P800	35.20	-4.50	< 764.8	11.98	23.22	-2.95%	37.90	459	2041	17.15	-0.57	-12.88	0.0
S50Z20P775	23.10	-3.00	< 751.9	0.00	23.10	-4.58%	24.69	826	2389	17.94	-0.42	-14.11	0.0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

	SET50	S50Z20	S50H21
แนวรับ	777	775	770
แนวต้าน	790	785	782

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ฝ่ายวิจัยจึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขายระหว่างวันผ่าน 2 ช่องทาง คือ

- แอปพลิเคชัน: **ASP Smart**
- Telegram: **ASIA PLUS GROUP**
(<http://bit.ly/TeleAsiaplusgroup>)



หมายเหตุ : ตัวคูณดัชนีเท่ากับ 200 บาท ต่อ 1 จุดของดัชนี

ภาพรวมการซื้อขาย SET50 Index

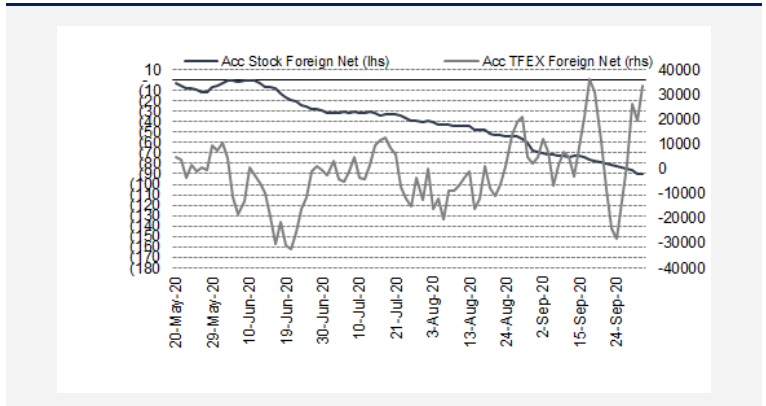
UNDERLYING	Close	Chg	%Chg	สรุปการซื้อขาย
SET50	788.02	6.96	0.88%	01/10/2020

Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50V20	787.30	8.3	1.1%	61	665	-7
S50X20	786.20	6.8	0.9%	90	85	-8
S50Z20	785.80	7.2	0.9%	180,892	390,078	1,845
S50H21	781.60	6.9	0.9%	15,947	15,779	1,868
S50M21	777.90	7.1	0.9%	2,755	5,367	115
S50U21	772.30	5.6	0.7%	904	678	273

	SET50 Futures Long(Short) : สัญญา			สะสม Long(Short)		
	Long	Short	Net	2 วัน	2 สัปดาห์	QTD
สถาบัน	33,517	37,820	-4,303	-5,928	-12,853	0
ต่างชาติ	66,740	52,387	14,353	7,488	-2,462	0
รายย่อย	100,392	110,442	-10,050	-1,560	15,315	0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศในตราสารทุน
II: SET50 Futures



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

	เป้าหมาย Spread ซีรียโกล - ซีรียโกล					
	S50J20	S50K20	S50M20	S50N20	S50Q20	S50U20
	ณ 29 เม.ย.63	ณ 28 พ.ค.63	ณ 29 มิ.ย.63	ณ 30 ก.ค.63	ณ 28 ส.ค.63	ณ 29 ก.ย.63
S50J20						
S50K20	-1.60					
S50M20	-1.32	0.28				
S50N20	-1.47	0.13	-0.15			
S50Q20	-5.84	-4.23	-4.52	-4.37		
S50U20	-6.88	-5.28	-5.56	-5.41	-1.04	

*สมมติฐานอัตราดอกเบี้ยนโยบายระหว่าง มี.ย. - ก.ย. 63 เท่ากับ 0.5%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

SET50 ที่ระดับค่า PER ต่างๆ

SET 50 Sensitivity	ม.ค. 62E	มี.ค. 62E	เม.ย. 62E	พ.ค. 62E	มิ.ย. 62E	ก.ย. 62E	ธ.ค. 62E
PER 15.5	898	870	857	843	830	789	748
PER 16	926	899	885	871	857	815	773
PER 16.5	955	927	912	898	883	840	797
PER 17	984	955	940	925	910	866	821
PER 17.5	1,013	983	967	952	937	891	845
PER 18	1,042	1,011	995	979	964	916	869
PER 18.5	1,071	1,039	1,023	1,007	990	942	893
PER 19	1,100	1,067	1,050	1,034	1,017	967	918

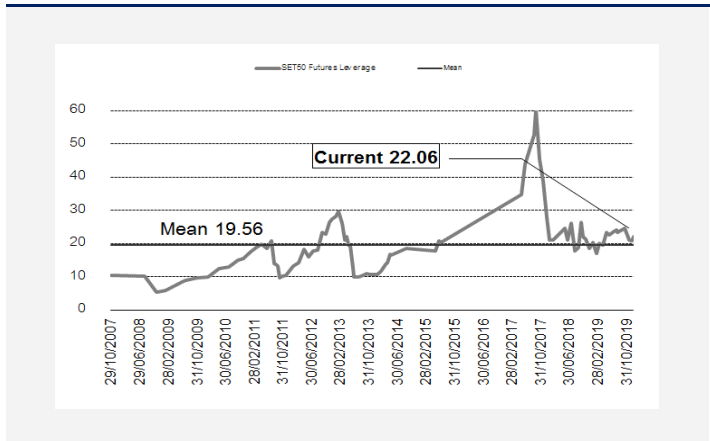
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ SET50 Futures

นักลงทุนรายย่อย					
(ค่าธรรมเนียม 87.10 บาท/สัญญา/ข้าง)					
ราคาปิด	chg (จุด)	กำไร	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร	
Futures	เทียบกับ	(ขาดทุน)		(ขาดทุน)สุทธิ	
790.80	5.0	1,000	(186)	814	
789.80	4.0	800	(186)	614	
788.80	3.0	600	(186)	414	
787.80	2.0	400	(186)	214	
786.80	1.0	200	(186)	14	
785.80	0.0	0.0	(186)	(186)	
784.80	-1.0	(200)	(186)	(386)	
783.80	-2.0	(400)	(186)	(586)	
782.80	-3.0	(600)	(186)	(786)	
781.80	-4.0	(800)	(186)	(986)	
780.80	-5.0	(1,000)	(186)	(1,186)	

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ระดับ Leverage ของ SET50 Futures



ที่มา: Thailand Clearing House, ฝ่ายวิจัย ASPS

Single Stock Futures

Short PTTGCZ20

ราคาหุ้นในระยะสั้นยังขาดแรงขับเคลื่อน อีกทั้งยังมีความเสี่ยงถูกแรงขายปรับพอร์ตของนักลงทุนสถาบันฯ เพื่อเตรียมซื้อหุ้น SCGP ในช่วงต้นเดือน ต.ค. 63 คาดว่าจะกดดันต่อหุ้นในกลุ่ม SET50 Index และในรายอุตสาหกรรมใกล้เคียงอย่างกลุ่มปิโตรฯ ส่วนภาพทางเทคนิค ราคาแกว่งในกรอบ Downtrend Channel พร้อมมีสัญญาณทางเทคนิค จากการทำจังหวะ Lower High บ่งชี้ทิศทางขาลง ทั้งนี้ หากราคาปรับตัวในระยะสั้นมาบริเวณกรอบบน ใช้เป็นจังหวะการเปิดสถานะ Short

กลยุทธ์การลงทุน

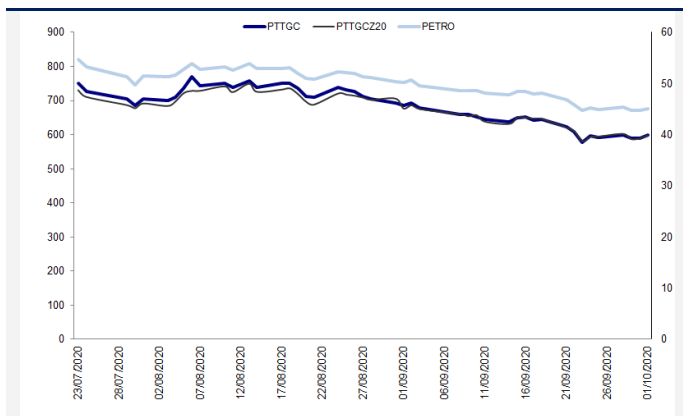
Follow Short PTTGCZ20 เมื่อต่ำกว่า 38.50 บาท เป้า 36.50 บาท Cut Loss 1 บาท

จากหุ้น

Future								Underlying			
Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 63F	PBV 63F	EPS GROWTH 63F
PTTGCZ20	39.85	-0.15	40.00	22	364	1	6.50	12.50%	85.47	0.61	-81.94%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



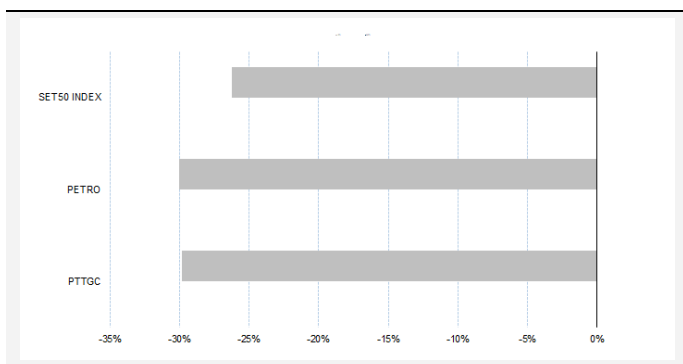
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures

นักลงทุนรายย่อย					
ราคาปิด future	chg (จุด) เทียบกับราคาปิด	กำไร (ขาดทุน) (บาท)	ค่าธรรมเนียม +VAT (บาท)	กำไรสุทธิ (ขาดทุน)สุทธิ (บาท)	กำไรสุทธิ (ขาดทุน)สุทธิ (บาท)
40.85	-1.00	(1,000)	7.12	(1,007)	(1,007)
40.65	-0.80	(800)	7.12	(807)	(807)
40.45	-0.60	(600)	7.12	(607)	(607)
40.25	-0.40	(400)	7.12	(407)	(407)
40.05	-0.20	(200)	7.12	(207)	(207)
39.85	0.00	-	7.12	(7)	(7)
39.65	0.20	200	7.12	193	193
39.45	0.40	400	7.12	393	393
39.25	0.60	600	7.12	593	593
39.05	0.80	800	7.12	793	793
38.85	1.00	1,000	7.12	993	993

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Return



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Single Stock Futures

Short MINTZ20X

เป็นหนึ่งในหุ้นที่ Valuation แพงและมีการถูก Short sales ปริมาณมากในช่วง 1 เดือนที่ผ่านมา อาจส่งผลกระทบต่อราคากลับเข้ามาเปิดให้มีการ Short Sales ตามปกติในวันนี้ ขณะที่แนวโน้มผลการดำเนินงานต้องใช้เวลาอย่างน้อย 2 ปี จะกลับเข้ามาสู่จุดเดียวกับปี 62 หลัง COVID-19 ที่แพร่ระบาดไปทั่วโลก ส่งผลกำลังซื้อมีทิศทางชะลอตัว

ภาพทางเทคนิค แกว่งอยู่ในแนวโน้มขาลง หลังจากที่ถูกดูดแนวรับ EMA 10 วันลงมา นอกจากนี้ หากวิเคราะห์จากแท่งเทียนปัจจุบันจ่อหลุด Low เดิม หากเกิดขึ้น จะเป็นการเปิด Downside มีความเสี่ยงถูกแรงขายกดดันต่อ

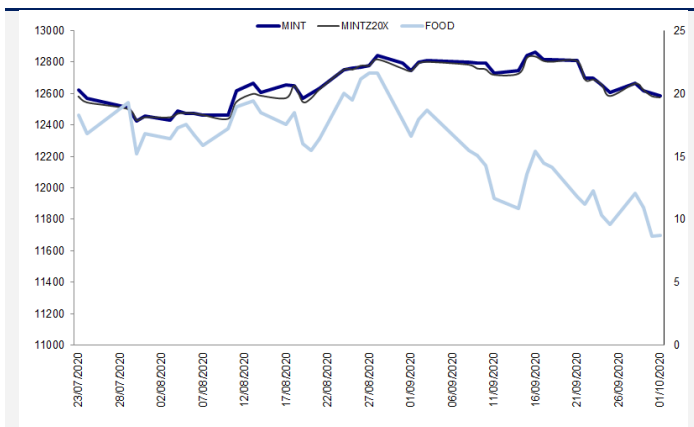
กลยุทธ์การลงทุน

เปิดสถานะ Short MINTZ20X ได้ที่ 19.73 บาท เป้าทำกำไร 18.50 บาท Cut Loss 0.50 บาทจากทุน

Future								Underlying			
Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 63F	PBV 63F	EPS GROWTH 63F
MINTZ20X	19.70	-0.10	19.80	1	3652	1	5.68	-24.24%		1.32	-193.90%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



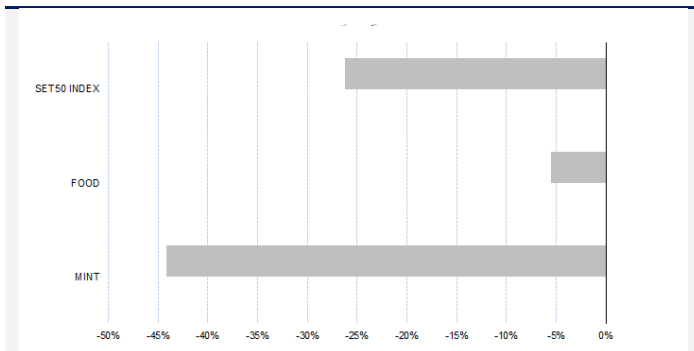
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures

นักลงทุนรายย่อย					
ราคาปิด future	chg (จุด) เทียบกับราคาปิด	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม +VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ	
20.70	-1.00	(1,000)	4.27	(1,004)	
20.50	-0.80	(800)	4.27	(804)	
20.30	-0.60	(600)	4.27	(604)	
20.10	-0.40	(400)	4.27	(404)	
19.90	-0.20	(200)	4.27	(204)	
19.70	0.00	-	4.27	(4)	
19.50	0.20	200	4.27	196	
19.30	0.40	400	4.27	396	
19.10	0.60	600	4.27	596	
18.90	0.80	800	4.27	796	
18.70	1.00	1,000	4.27	996	

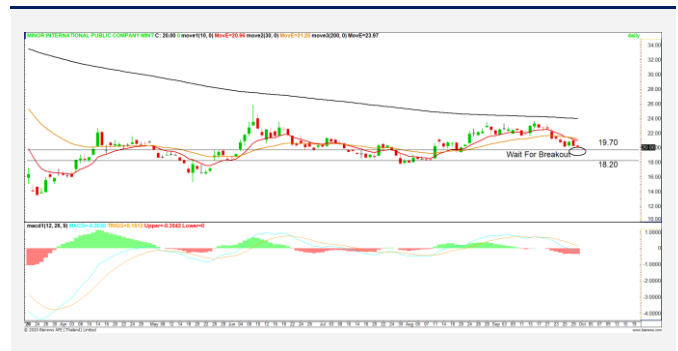
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Return



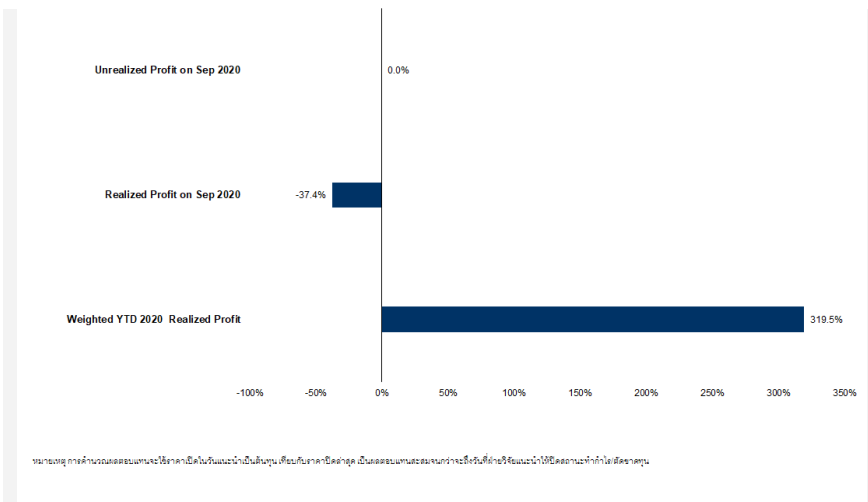
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Tracking Performance



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Top 20 Most Active Volume

No.	Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	SPRCZ20	5.51	-0.49	6.00	1750	1500	1000	4.78	5.84	5.16
2	SIRIZ20	0.60	0.01	0.59	1000	5297	1000	5.18	0.67	0.60
3	SUPERZ20	0.83	0.01	0.82	1000	10000	-1000	5.39	0.86	0.78
4	ESSOZ20	6.35	0.00	6.35	700	4910	700	5.06	6.57	6.21
5	STAZ20	26.51	0.01	26.50	614	222	208	5.53	27.07	26.06
6	QHZ20	2.15	-0.05	2.20	500	12828	500	11.58	2.16	2.12
7	APZ20	5.66	-0.29	5.95	500	1602	-500	7.12	6.20	5.73
8	CKPZ20	5.50	-0.10	5.60	500	1042	-500	5.89	5.71	5.39
9	PLANBZ20	5.80	-0.20	6.00	500	1501	-500	5.85	5.81	5.55
10	PSLZ20	5.48	0.03	5.45	500	3501	-500	5.12	5.52	4.68
11	EAZ20	39.30	-0.20	39.50	403	202	-3	6.66	40.59	38.41
12	GLOBALZ20X	19.50	-0.30	19.80	400		0	7.65	19.53	18.77
13	GULFZ20X	33.68	2.68	31.00	271	466	10	1.58	35.78	31.61
14	HMPROZ20	14.03	-0.07	14.10	200	103	-200	8.83	14.35	13.83
15	CBGZ20	117.00	-0.50	117.50	161	2088	80	8.20	124.04	116.31
16	CPFZ20	27.98	0.23	27.75	102	1338	-98	9.02	29.41	27.41
17	PTTZ20	33.00	0.00	33.00	102	3081	100	9.65	34.29	32.01
18	BDMSZ20	19.70	0.00	19.70	100	100	-100	11.78	20.15	19.55
19	KBANKZ20	77.80	0.05	77.75	62	527	-38	6.05	79.42	74.65
20	PTTEPZ20	79.26	-0.24	79.50	61	117	-21	7.78	83.39	77.18

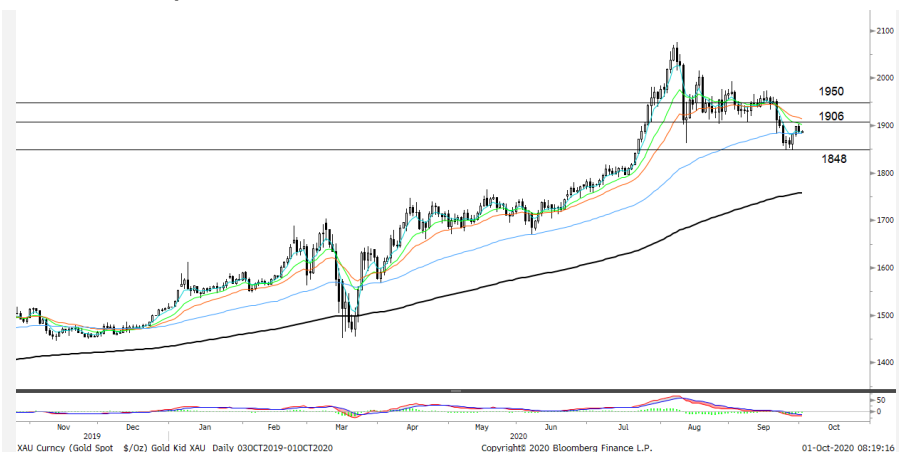
Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ปรับเพิ่มขึ้น 19.54 เหรียญฯ หรือ 1.04% ปิดอยู่ที่ 1,905.3 เหรียญฯ โดยมีแรงหนุนจากค่าเงินดอลลาร์สหรัฐอ่อนค่าลงสู่ระดับต่ำสุดรอบกว่า 1 สัปดาห์ หลังสหรัฐเปิดเผยข้อมูลเศรษฐกิจอ่อนแอ โดยแม้จำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ออกมาต่ำกว่าคาด แต่ยังคงอยู่ในระดับของภาวะเศรษฐกิจถดถอยเช่นเดียวกับกิจกรรมภาคการผลิตชะลอตัวลงในเดือน ก.ย. และต่ำกว่านักวิเคราะห์คาดไว้ นอกจากนี้มาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจรอบใหม่ที่ยังไม่ชัดเจน เนื่องจากทำเนียบขาวและสภาองเกรสยังมีความเห็นขัดแย้งเกี่ยวกับวงเงินของมาตรการดังกล่าว ภาพรวมทำให้ Dollar Index ปรับลดลง 0.19% ปิดบริเวณ 93.71 จุด ขณะที่กองทุน SPDR วานนี้ มีการรายงานปริมาณการถือครองทองคำเพิ่มขึ้น 7.3 ตัน สู่ระดับ 1,279.19 ตัน สำหรับวันนี้ คงต้องติดตามการเปิดเผยข้อมูลเศรษฐกิจสำคัญต่อเนื่องของสหรัฐ โดยเฉพาะตัวเลขการจ้างงานนอกภาคเกษตร และอัตราว่างงานเป็นต้น

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFV20 เมื่อคืน ปรับเพิ่มขึ้นตามตลาดโลกรวม 190 บาท ปิดอยู่ที่ 28,680 บาท เทียบเท่า 1,910.3 เหรียญฯ สูงกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหวบริเวณ 1,902-1,903 เหรียญฯ คาดราคา GFV20 วันนี้ จะอยู่ในกรอบ 28,450-28,750 บาท จากทิศทางราคาทองคำที่ยังผันผวนระหว่างวัน ทำให้ฝ่ายวิจัยไม่แนะนำให้มีสถานะลงทุนข้ามวันหยุด จึงคงให้ Trading บริเวณ 1,890-1,920 เหรียญฯ เทียบเท่า 28,370-28,820 บาท และกำหนดจุด Cut loss ไว้ 100 บาทจากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยงหากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดจากคาด

เทคนิควิเคราะห์ Gold Spot



ที่มา : สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

GOLD Technical: ราคาทองคำอยู่ในจังหวะแกว่งขึ้นทดสอบแนวต้านที่ \$1905 แต่อย่างไรก็ตาม เห็นการชะลอการฟื้นตัว จากแท่งเทียน หากหลุดบริเวณ \$1890 จะเป็นการเปิด Downside มีโอกาสย้อนกลับมาที่ \$1848 โดยประเมินกรอบการเคลื่อนไหวไว้ที่ \$1848-\$1906

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GFV20	28,680	170	0.60	98	1,203	2
GFZ20	28,730	140	0.49	64	471	0
GFQ21	28,850	210	0.73	5	142	-1

Mini Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GF10V20	28,650	110	0.42	6,063	9,665	-1956
GF10Z20	28,710	120	0.38	1,954	10,164	399
GF10G21	28,790	120	0.42	528	3,659	-34

หมายเหตุ : ราคาปิดของ Gold Futures (Night Session) Settle ณ เวลา 22.00 u. และปริมาณการซื้อขายเกิดขึ้นในช่วงเวลา 19.30-22.30 u.
ที่มา : สายงานวิจัย บล.เอเชีย พลัส

ASPS Gold Valuation Matrix (เหรียญฯ/ทรอยออนซ์)

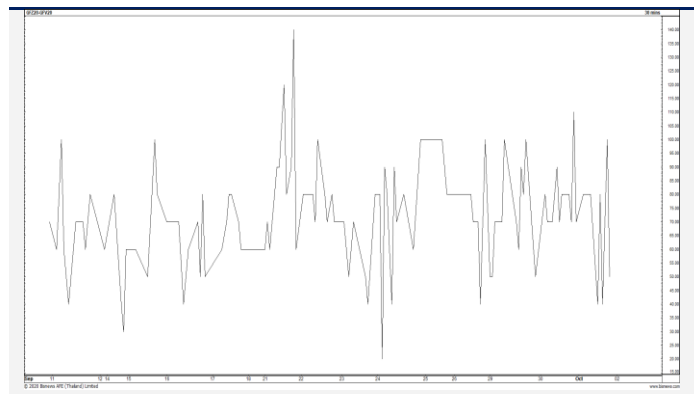
	▼					Dollar Index						▲				
	93	94	95	96	97	98	99	100	101	102	103	99	100	101	102	103
Nymex (USD/Barrel)	40	1,617.66	1,589.21	1,560.76	1,532.31	1,503.86	1,475.41	1,446.96	1,418.52	1,390.07	1,361.62	1,333.17				
	43	1,616.71	1,588.26	1,559.81	1,531.36	1,502.91	1,474.47	1,446.02	1,417.57	1,389.12	1,360.67	1,332.22				
	46	1,615.76	1,587.31	1,558.86	1,530.42	1,501.97	1,473.52	1,445.07	1,416.62	1,388.17	1,359.72	1,331.28				
	49	1,614.82	1,586.37	1,557.92	1,529.47	1,501.02	1,472.57	1,444.12	1,415.67	1,387.23	1,358.78	1,330.33				
	52	1,613.87	1,585.42	1,556.97	1,528.52	1,500.07	1,471.62	1,443.18	1,414.73	1,386.28	1,357.83	1,329.38				
	55	1,612.92	1,584.47	1,556.02	1,527.57	1,499.13	1,470.68	1,442.23	1,413.78	1,385.33	1,356.88	1,328.43				
	58	1,611.97	1,583.52	1,555.08	1,526.63	1,498.18	1,469.73	1,441.28	1,412.83	1,384.38	1,355.94	1,327.49				
	61	1,611.03	1,582.58	1,554.13	1,525.68	1,497.23	1,468.78	1,440.33	1,411.89	1,383.44	1,354.99	1,326.54				
	64	1,610.08	1,581.63	1,553.18	1,524.73	1,496.28	1,467.84	1,439.39	1,410.94	1,382.49	1,354.04	1,325.59				
	67	1,609.13	1,580.68	1,552.24	1,523.79	1,495.34	1,466.89	1,438.44	1,409.99	1,381.54	1,353.09	1,324.65				
	70	1,608.19	1,579.74	1,551.29	1,522.84	1,494.39	1,465.94	1,437.49	1,409.04	1,380.60	1,352.15	1,323.70				
	73	1,607.24	1,578.79	1,550.34	1,521.89	1,493.44	1,464.99	1,436.55	1,408.10	1,379.65	1,351.20	1,322.75				

การแปลงราคาทองคำให้เป็นบาท

GOLD Londin AM (USD/Ounce)	FX (บาท/ USD)					
	31.00	31.25	31.50	31.75	32.00	
1,780	26,229	26,440	26,652	26,863	27,075	
1,810	26,671	26,886	27,101	27,316	27,531	
1,840	27,113	27,331	27,550	27,769	27,987	
1,870	27,555	27,777	27,999	28,221	28,444	
1,900	27,997	28,223	28,448	28,674	28,900	
1,930	28,439	28,668	28,898	29,127	29,356	
1,960	28,881	29,114	29,347	29,580	29,813	
1,990	29,323	29,559	29,796	30,032	30,269	
2,020	29,765	30,005	30,245	30,485	30,725	

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Spread ระหว่าง GFV20 – GFQ20



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Gold Futures

บัลลงทอนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
28,930.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
28,880.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
28,830.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
28,780.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
28,730.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
28,680.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
28,630.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
28,580.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
28,530.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
28,480.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
28,430.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

บัลลงทอนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
28,900.00	250.0	2,500	(210)	2,290
28,850.00	200.0	2,000	(210)	1,790
28,800.00	150.0	1,500	(210)	1,290
28,750.00	100.0	1,000	(210)	790
28,700.00	50.0	500	(210)	290
28,650.00	0.0	-	(210)	(210)
28,600.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
28,550.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
28,500.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
28,450.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
28,400.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส