



SET50 Futures:

SET50 ยังถูกแวดล้อมด้วยความกังวลเรื่อง Covid-19 แต่เชื่อว่า Downside มีไม่มาก และนำ Trading S50M21 กรอบ 935 – 950 จุด และให้เปิด Long ที่กรอบล่าง

SET50 Option:

แนะนำให้ปรับมารอ Long S50M21C950 ที่ 15 จุด (SET50= 940) เป้าทำกำไร 30 จุด (SET50=955) Cut Loss 3 จุด เชื่อว่า SET50 มี Downside ที่จำกัด

Single Stock Futures:

สถานะ Long BBLM21 ถูกปิดรับผลขาดทุน 15% แนะนำให้รอเปิด Long BDMSM21 ที่ 21.40 บาท เป้าทำกำไรที่ 22 บาท และ Cut Loss 0.30 บาทจากทุน

สถานะ Long SCCM21 ถูกปิดรับผลขาดทุน 28% แนะนำให้เปิด Long STAM21 ที่ 46.50 บาท เป้าทำกำไรที่ 49 บาท Cut Loss ที่ 1.25 บาทจากทุน

Gold Futures:

ราคาเคลื่อนไหวในกรอบแคบลง แต่ด้วยสภาพแวดล้อมปัจจุบันเชื่อว่า Upside จำกัด Trading GFJ21 กรอบ 25650 – 26090 บาท (1720 - 1750\$) และเปิด Short กรอบบน

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

*ภายใต้สภาวะที่ตลาดเผชิญกับความผันผวนสูง ทำให้การปรับกลยุทธ์ใน Derivative Talk ต้องสามารถดำเนินการได้อย่างรวดเร็วขึ้น ฝ่ายวิจัยฯจึงได้มีการเพิ่มช่องทางติดตามคำแนะนำกลยุทธ์การซื้อขาย ระหว่างวันทำการผ่าน 2 ช่องทาง เพื่อให้นักลงทุนสามารถปรับเปลี่ยนกลยุทธ์ได้มีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น 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	249,008	137,303	111,705	125,556	498	-320,306
Foreign	105,922	102,872	3,050	-3,748	-110,411	-200,182
Retail	222,466	337,221	-114,755	-121,808	109,913	520,488

SET50 Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)			
Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months	
Institution	31,997	33,861	-1,864	458	3,361	-15,011
Foreign	61,822	71,428	-9,606	-22,151	-19,566	16,505
Retail	93,822	82,352	11,470	21,693	16,205	-1,494

Single Stock Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)			
Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months	
Institution	207,384	92,871	114,513	125,682	-9,409	-296,056
Foreign	30,572	17,861	12,711	17,855	-99,596	-232,353
Retail	99,778	227,002	-127,224	-143,537	109,005	528,409

Metal Futures Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)			
Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months	
Institution	3,557	3,550	7	-567	4,475	3,932
Foreign	13,222	13,526	-304	260	8,415	12,789
Retail	13,729	13,432	297	307	-12,890	-16,721

Call Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)			
Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months	
Institution	108	180	-72	-5	599	87
Foreign	3	1	2	-213	-220	1,464
Retail	2,438	2,368	70	218	-387	-961

Put Option Long(Short) Position : Contract			Accumulated Long(Short)			
Long	Short	Net	2 Days	1 Weeks	1 Months	
Institution	247	348	-101	211	545	-2,130
Foreign	302	54	248	474	538	2,529
Retail	4,084	4,231	-147	-685	-1,089	-485

ที่มา: ฝ่ายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

RESEARCH DIVISION

บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส

เกิดศักดิ์ ทวีระธรรม

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 004132

ประสิทธิ์ รัตนกิจมงคล, CISA, CFA

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 025917

นวลพรรณ น้อยรัชชกุล

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และด้านเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 019994

ชาญชัย พันการนาทิจ

นักวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานด้านตลาดทุน และทางเทคนิค
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 064045

ธนัฐธรรม เกิดเมตต

ผู้ช่วยนักวิเคราะห์

SET50 Overview

การแพร่ระบาดของ COVID-19 ในประเทศยังเป็นปัจจัยหลักที่สร้างแรงกดดันตลาดหุ้นบ้านเรา หลังวานนี้จำนวนผู้ติดเชื้อเพิ่มขึ้นเป็น 334 รายและมีแนวโน้มที่จะเร่งตัวขึ้นเนื่องจากพบการแพร่ระบาดเป็นสายพันธุ์อังกฤษที่จากข้อมูลทางการแพทย์พบว่าการแพร่ระบาดจะเร็วกว่าสายพันธุ์ปกติ 1.7 เท่า ทั้งนี้ฝ่ายวิจัยได้ศึกษารูปแบบการแพร่ระบาดของ COVID-19 ในอังกฤษที่พบเชื่อดังกล่าวช่วงเดือน พ.ย.-ธ.ค.63 ซึ่งพบว่าจำนวนผู้ติดเชื้อเร่งตัวขึ้น 4.5 เท่าในระยะเวลาเพียง 1 เดือน แต่อย่างไรก็ตามหากประเมินจากการตอบสนองของดัชนี FTSE100 ของอังกฤษกลับปรับขึ้นสวนทางจากนักลงทุนให้น้ำหนักกับความคืบหน้าของวัคซีนมากกว่า (ช่วงเวลานั้นในอังกฤษเริ่มมีการกระจายวัคซีนของบริษัท Pfizer) ซึ่งหากเทียบกับสถานการณ์ปัจจุบันในบ้านเราที่ในช่วงเดือน เม.ย. จะนำได้รับวัคซีนจาก Sinovac จำนวน 1 ล้านโดสและตามมาด้วยวัคซีน AstraZeneca จำนวน 6 ล้านโดสในเดือนมิ.ย. ประกอบกับท่าทีของรัฐบาลที่เน้นย้ำว่าจะไม่มีการ Lockdown ประเทศ น่าจะทำให้กิจกรรมดำเนินเศรษฐกิจยังคงดำเนินต่อไปภายใต้สถานการณ์ข้างต้นจึงมองว่าการปรับลงไม่น่าจะแรงเท่ากับแพร่ระบาดในครั้งสมุทรศาสตร์ (SET50 Index ปรับลงทำจุดต่ำสุด 6.9% ในเวลา 2 วันทำการ) ภายใต้สถานการณ์ข้างต้นคาด SET50 Index วันนี้แกว่งตามกรอบ 940 - 955 จุด

SET50 Index Futures

Direction Trading: แรงกดดันจากการแพร่ระบาดของ COVID-19 ยังมีอยู่แต่เชื่อว่า Downside การปรับลงไม่มากเท่าการระบาดที่สมุทรศาสตร์ แนะนำ Trading S50M21 กรอบ 935 - 950 จุด และเปิด Long ที่กรอบล่าง

Spread Trading: คาดการณ์ Spread ระหว่าง S50U21 ลบด้วย S50M21 ณ วันที่ 29 มิ.ย. 2564 จะเท่ากับ -4.53 จุด ปัจจุบันอยู่ที่ -3.20 จุด ประเมิน Spread ยังไม่เปิดกว้างมากพอจึงแนะนำ Wait & See

SET50 Option: แนะนำกลับมา Long S50M21C950 ที่ 15 จุด (SET50= 940) เป้าทำกำไร 30 จุด (SET50=955) และ Cut Loss 3 จุด

	Last	1Yr Hist. Volatility	2Week Hist. Volatility
SET50 Index	950.22	31.6509	11.72442

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
S50M21C1050	2.00	-1.00	> 1052	0.00	2.00	10.71%	7.17	282	1424	14.88	0.07	35.56	0.1
S50M21C1025	3.30	-2.10	> 1028.3	0.00	3.30	8.22%	11.19	395	1150	13.42	0.11	32.93	0.1
S50M21C1000	7.00	-3.20	> 1007	0.00	7.00	5.98%	16.92	554	1841	13.67	0.20	27.72	0.1
S50M21C975	13.70	-4.50	> 988.7	0.00	13.70	4.05%	24.73	672	1433	14.15	0.34	23.32	0.0
S50M21C950	24.10	-8.10	> 974.1	0.22	23.88	2.51%	34.98	308	836	14.47	0.49	19.13	0.0

Put Option

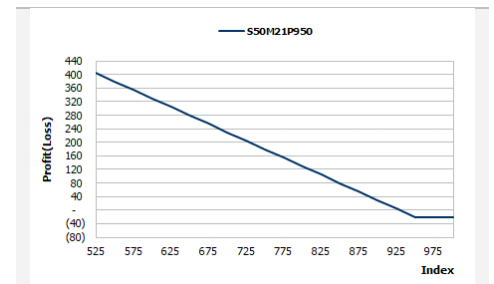
	Premium	Chg	Break Even	Intrinsic Value	Time Value	All-in-Premium	Theory Price	Volume	Open Interest	Implied Volatility	Delta	Effective Gearing	Time Decay
S50M21P1050	105.10	13.60	< 944.9	99.78	5.32	-0.56%	111.31	0	1	17.07	-0.82	-8.17	0.0
S50M21P1025	80.60	13.70	< 944.4	74.78	5.82	-0.61%	90.36	1	65	11.88	-0.90	-11.43	0.0
S50M21P1000	60.10	11.00	< 939.9	49.78	10.32	-1.09%	71.10	10	169	13.89	-0.77	-12.74	0.0
S50M21P975	43.10	11.10	< 931.9	24.78	18.32	-1.93%	53.94	177	736	14.43	-0.65	-14.62	0.0
S50M21P950	28.80	8.30	< 921.2	0.00	28.80	-3.05%	39.21	899	1977	14.84	-0.51	-16.76	0.0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

	SET50	S50M21	S50U21
แนวรับ	940	935	932
แนวต้าน	955	950	947

*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	สปรการซื้อขาย
SET50	964.71	-11.42	-1.18%	5/4/21

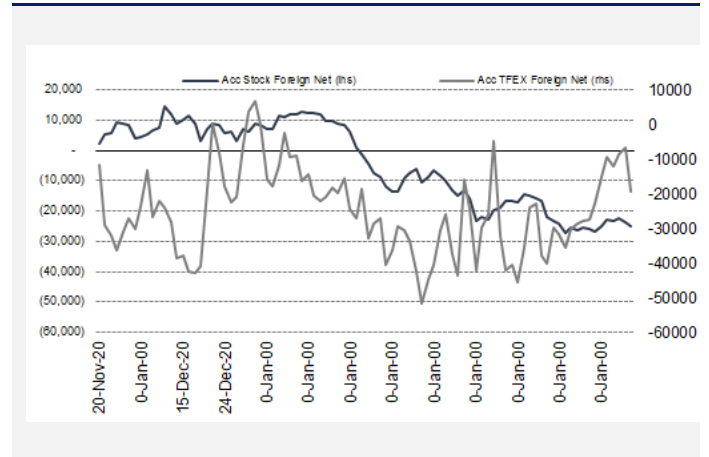
Symbol	Settle	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
S50G21	928.46	0.0	0.0%	27	75	0
S50H21	973.64	0.0	0.0%	36,861	48,955	-115
S50J21	961.50	-11.7	-1.2%	43	233	0
S50M21	961.80	-9.9	-1.0%	150,221	263,101	489
S50U21	958.00	-9.4	-1.0%	11,264	13,401	-43
S50Z21	958.60	-9.2	-1.0%	2,101	6,190	0

SET50 Futures Long(Short) : สัญญา	สถานะ Long(Short)			2 วัน	2 สัปดาห์	QTD
	Long	Short	Net			
สถาบัน	222,056	208,584	13,472	4,777	1,141	0
ต่างชาติ	76,978	83,787	-6,809	-10,640	10,971	0
รายย่อย	273,156	279,819	-6,663	5,863	-12,112	0

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

ความสัมพันธ์สถานะของนักลงทุนต่างประเทศในตราสารทุน

และ- SET50 Futures



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คาดการณ์ Spread ณ สิ้นเดือนจาก ASPS Model

	เป้าหมาย Spread ชริย์ไกล - ชริย์ใกล้					
	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 มิ.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

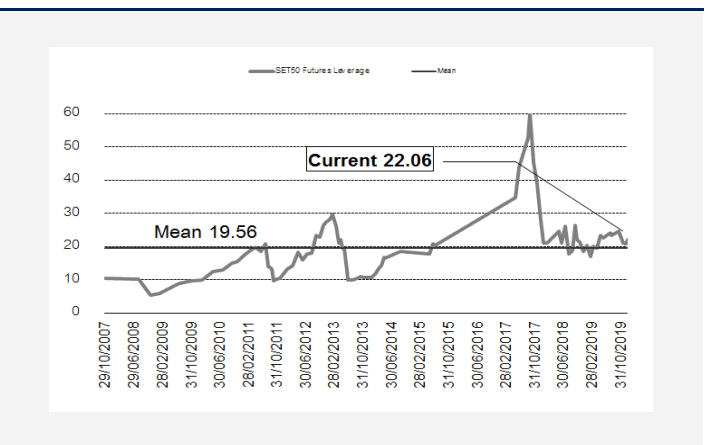
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ SET50 Futures

ราคาปิด	chg (จุด)	นักลงทุนรายย่อย		
		กำไร	ค่าธรรมเนียม+	กำไร
Futures	เทียบกับ	(ขาดทุน)	VAT (บาท)	(ขาดทุน)สุทธิ
952.00	5.0	1,000	(186)	814
951.00	4.0	800	(186)	614
950.00	3.0	600	(186)	414
949.00	2.0	400	(186)	214
948.00	1.0	200	(186)	14
947.00	0.0	0.0	(186)	(186)
946.00	-1.0	(200)	(186)	(386)
945.00	-2.0	(400)	(186)	(586)
944.00	-3.0	(600)	(186)	(786)
943.00	-4.0	(800)	(186)	(986)
942.00	-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

Long STAM21

ราคาทำไรส์สุทธิปี 2564 จะเติบโตถึง 58.3% yoy จากธุรกิจถุงมือยางและยางพาราเติบโต ตามการฟื้นตัวของเศรษฐกิจโลก หนุนความต้องการใช้ยางพาราสูงขึ้น ยังได้อานิสงค์จาก ยอดผู้ติดเชื้อในไทยที่เร่งตัวขึ้นจากกลุ่มคนเมือง ตามสถานบันเทิงมอเป็น Sentiment บวกดีต่อ STGT(บริษัทลูก STA ที่ทำธุรกิจถุงมือยาง ส่งผลให้ออเดอร์ทะลักอย่างต่อเนื่อง PE เพียง 8 เท่า ประกาศจ่ายปันผลวันที่ 12 เม.ย 64 1.75 บาทต่อหุ้น ภาพทางเทคนิค ส่งสัญญาณรื้อบาวนหลังจากพักตัวอยู่ Zone แนวรับบริเวณ EMA 10 วัน ปิดเป็นแท่งเทียนเขียวเต็มแท่ง Breakout แนวต้านระยะสั้นที่ 46.50 บาท มองเป็นการเปิด Upside โดยมีเป้าหมายการทำกำไรไว้ที่ 49.00 บาท

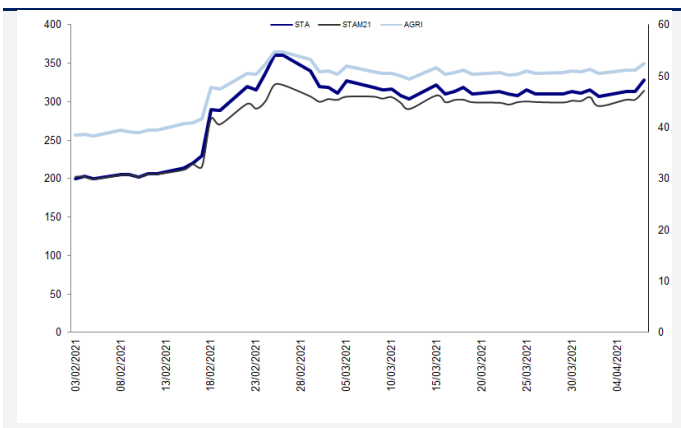
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long STAM21 บริเวณ 46.50 บาท เป้าทำกำไร 49.00 บาท Cut Loss 1.25 บาทจากทุน

Future								Underlying			
Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 63F	PBV 63F	EPS GROWTH 63F
STAM21	47.18	-2.07	49.24	3526	10734	269	10.29	1.52%	5.01	1.56	58.31%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

Historical Price



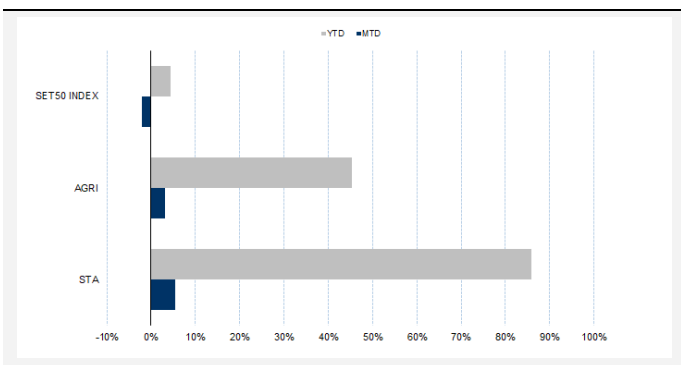
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures

บัลลงทุณรายย่อย					
ราคาปิด future	chg (จุด) เทียบกับราคา	กำไร (บาท)	ค่าธรรมเนียม +VAT (บาท)	กำไรสุทธิ (บาท)	กำไรสุทธิ
47.68	0.5	500	30.12	470	470
47.58	0.4	400	30.12	370	370
47.48	0.3	300	30.12	270	270
47.38	0.2	200	30.12	170	170
47.28	0.1	100	30.12	70	70
47.18	0.0	-	30.12	(30)	(30)
47.08	-0.1	(100)	30.12	(130)	(130)
46.98	-0.2	(200)	30.12	(230)	(230)
46.88	-0.3	(300)	30.12	(330)	(330)
46.78	-0.4	(400)	30.12	(430)	(430)
46.68	-0.5	(500)	30.12	(530)	(530)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

Historical Return



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

Single Stock Futures

Long BDMSM21

หากนับเฉพาะเดือนมี.ค 64(รายได้รวมจะลดลงเพียง 2%-4% YoY สะท้อนรายได้ผู้ป่วยไทย(70% รายได้ปกติ) คาดกลับมาเติบโตราย 7% Yoy MTD โดยที่เห็นสัญญาณบวกมากขึ้น จากการลดวันกักตัวเหลือ 7 วัน ทิศทางการเปิดประเทศ วัคซีนที่กระจายในพื้นที่กรุงเทพและปริมณฑล โดยที่ฝ่ายวิจัย ยังขึ้นชอบมากที่สุดในกลุ่มฯ จากธุรกิจที่แข็งแกร่ง และมีเครือข่ายครอบคลุม มูลค่าพื้นฐานที่ 24 บาท

ภาพทางเทคนิค เกิด Technical Rebound หลังจากปรับฐานลงไปทดสอบเส้น EMA 200 วัน บ่งชี้ว่ายังมีแรงซื้อคอยสนับสนุน ระยะถัดไป หาก Breakout แนวต้านที่ 21.50 บาท จะเป็นการเปิด Upside โดยมีแนวต้านถัดไปที่ 22.00 บาท

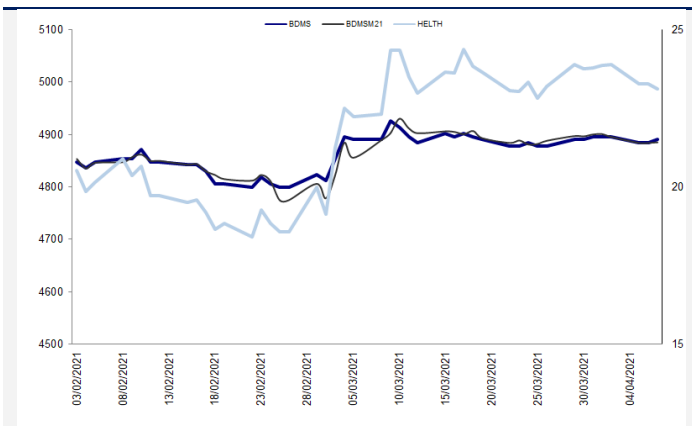
กลยุทธ์การลงทุน

แนะนำ Long BDMSM21 บริเวณ 21.40 บาท เข้าทำกำไร 22.00 บาท และ Cut Loss 0.30 บาทจากทุน

Future								Underlying			
Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Upside	PER 63F	PBV 63F	EPS GROWTH 63F
BDMSM21	21.42	-0.08	21.50	1595	15735	-31	12.86	11.63%	39.45	3.72	20.06%

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Price



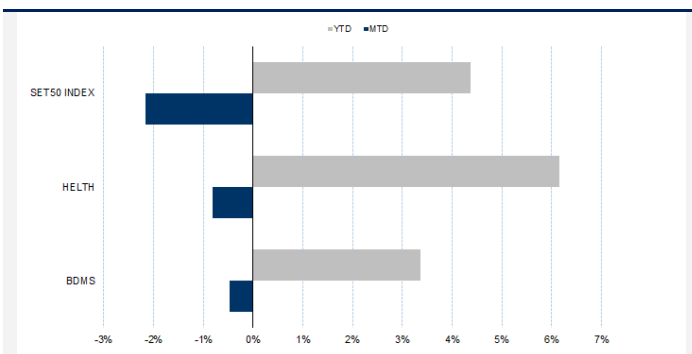
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Stock Futures

ราคาปิด future	น้กลงทุนรายย่อย			
	chg (จุด) เทียบกับราคา	กำไร (บาท)	ค่าธรรมเนียม +VAT (บาท)	กำไรสุทธิ (บาท)
21.92	0.5	500	15.40	485
21.82	0.4	400	15.40	385
21.72	0.3	300	15.40	285
21.62	0.2	200	15.40	185
21.52	0.1	100	15.40	85
21.42	0.0	-	15.40	(15)
21.32	-0.1	(100)	15.40	(115)
21.22	-0.2	(200)	15.40	(215)
21.12	-0.3	(300)	15.40	(315)
21.02	-0.4	(400)	15.40	(415)
20.92	-0.5	(500)	15.40	(515)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Historical Return



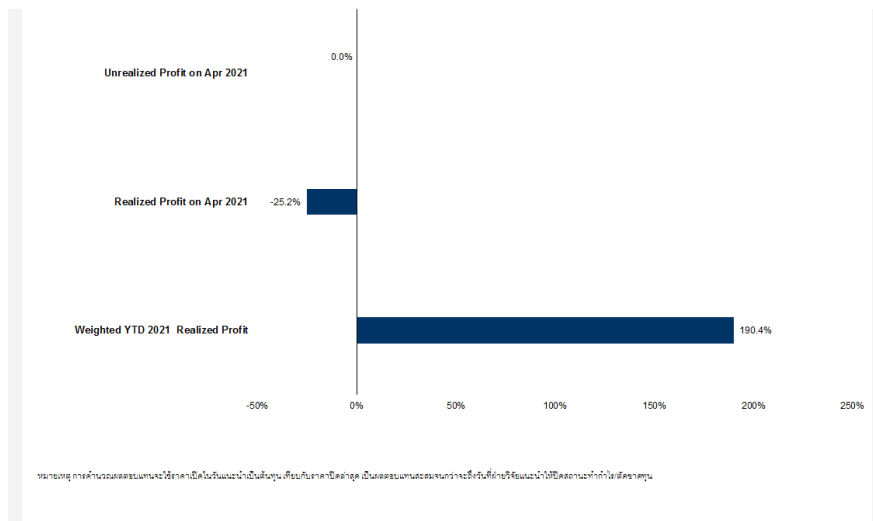
ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Technical Chart



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Tracking Performance



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

Top 20 Most Active Volume

	Future	Settle Price	Basis	ASP Theory Price	Vol	OI	OI Change	Leverage	Resistance	Support
1	GUNKUM21	3.70	-0.16	3.86	25830	55333	-3406	14.51	4.08	3.51
2	IRPCM21	3.89	-0.03	3.92	23701	201696	-10259	11.46	4.03	3.82
3	TMBM21	1.17	-0.03	1.20	23212	173074	-16366	7.89	1.21	1.16
4	SIRIM21	0.99	0.00	0.99	17090	37922	753	8.68	1.13	0.98
5	BEAUTYM21	1.70	0.02	1.68	15846	45569	-13492	5.53	1.84	1.68
6	BLANDM21	1.08	-0.01	1.09	12766	183441	-7534	9.56	1.17	1.08
7	AAVM21	2.69	0.01	2.68	8677	10245	-5234	7.84	2.81	2.66
8	PRMM21	7.81	0.01	7.80	7775	30747	-4222	5.13	7.98	7.49
9	TRUEM21	3.25	0.01	3.24	6845	37567	-5053	8.53	3.37	3.20
10	BEMM21	8.15	-0.05	8.20	6066	38534	-123	11.36	8.63	8.07
11	BTSM21	9.25	0.00	9.25	5903	48373	-2085	8.89	9.48	9.15
12	WHAM21	3.30	-0.04	3.34	5185	50013	-3685	7.99	3.48	3.28
13	WHAM21	3.30	-0.04	3.34	5185	50013	-3685	7.99	3.48	3.28
14	ITDM21	1.74	0.02	1.72	5078	14151	2212	11.32	2.02	1.49
15	MINTM21	30.36	-0.64	31.00	4962	10298	-2028	8.89	31.13	29.63
16	ICHIM21	13.40	-0.40	13.80	4319	12204	-2193	8.45	13.88	13.26
17	CPFM21	28.50	-0.25	28.75	4231	33820	-3043	9.34	29.64	28.34
18	VGIM21	6.75	0.05	6.70	4142	23838	524	5.34	7.05	6.66
19	QHM21	2.40	-0.04	2.44	4012	10339	-1498	12.84	2.45	2.38
20	STAM21	47.18	-2.07	49.24	3526	10734	269	10.29	47.75	45.16

Gold Futures

ราคาทองคำตลาดสหรัฐเมื่อคืน ปรับลดลง 5.25 เหรียญฯ หรือ 0.3% ปิดอยู่ที่ 1,737.4 เหรียญฯ จากแรงเทขาย หลังราคาทองคำปรับตัวขึ้นมาหลายวันทำการที่ผ่านมา รวมถึงการขายของกองทุน SPDR โดยวานนี้รายงานปริมาณการถือครองทองคำลดลง 0.35 ตัน ปิดอยู่ที่ 1028.69 ตัน นอกจากนี้การแข็งค่าของค่าเงินดอลลาร์สหรัฐ และการปิดบวกของตลาดหุ้นดาวโจนส์สหรัฐ เป็นอีกส่วนทำให้ทองคำมีความน่าสนใจลดลง สำหรับวันนี้และพรุ่งนี้ ทางสหรัฐมีกำหนดเปิดเผยข้อมูลเศรษฐกิจสำคัญ ได้แก่ จำนวนผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์, ดัชนีราคาผู้ผลิต และสต็อกสินค้าคงคลังภาคค้าส่ง เป็นต้น ซึ่งจะเป็นตัวกำหนดทิศทางและการเคลื่อนไหวของเงินทุนระหว่างสินทรัพย์เสี่ยงอย่างตลาดหุ้นและสินทรัพย์ปลอดภัยอย่างทองคำ

กลยุทธ์การลงทุน

ราคาทองคำ GFJ21 เมื่อคืน ปรับเพิ่มขึ้น 240 บาท ปิดอยู่ที่ 25,980 บาท เทียบเท่า 1,742.07 เหรียญฯ สูงกว่าราคาทองคำตลาด spot ล่าสุดที่เคลื่อนไหว 1,736-1,737 เหรียญฯ คาดราคา GFJ21 วันนี้จะอยู่ในกรอบ 25,800-26,100 บาท แม้ค่าเงินดอลลาร์สหรัฐแข็งค่า กดดันต่อราคาทองคำ แต่ราคายังแกว่งตัวในกรอบที่ประเมินไว้ 1,720-1,750 เหรียญฯ ทำให้ฝ่ายวิจัยคงแนะนำให้นักลงทุน Trading บริเวณ 25,650-26,090 บาท แต่หากราคาทองคำขยับขึ้นไปแตะกรอบบน 1,750 เหรียญฯ แนะนำให้รอเปิดสถานะ Short GFJ21 ทั้งนี้นักลงทุนควรกำหนดจุด Cut Loss ไว้ 100 บาทจากทุน เพื่อป้องกันความเสี่ยง หากราคาทองคำเคลื่อนไหวผิดคาด

เทคนิค Gold Spot



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเชีย พลัส

GOLD Technical: ทิศทางราคาทองคำ ทำจิ้งหะ Double Bottom โดยปัจจุบัน อยู่ในโหมดการฟื้นตัว สนับสนุนด้วย EMA 10 วัน โดยประเมินกรอบการเคลื่อนไหวไว้ที่ \$1720-\$1765

Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GFJ21	25,980	40	0.15	11	450	-3
GFM21	26,030	120	0.46	6	232	2
GFQ21	25,900	-50	-0.19	5	92	5

Mini Gold Futures

FUTURES	Last	Chg	%Chg	Vol.	OI	OI Chg
GF10J21	25,910	0	0.00	1,398	6,027	233
GF10M21	25,940	0	0.00	693	5,803	97
GF10Q21	25,970	0	0.00	310	4,745	21

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

ASPS Gold Valuation Matrix (เหรียญฯ/ทรอยออนซ์)

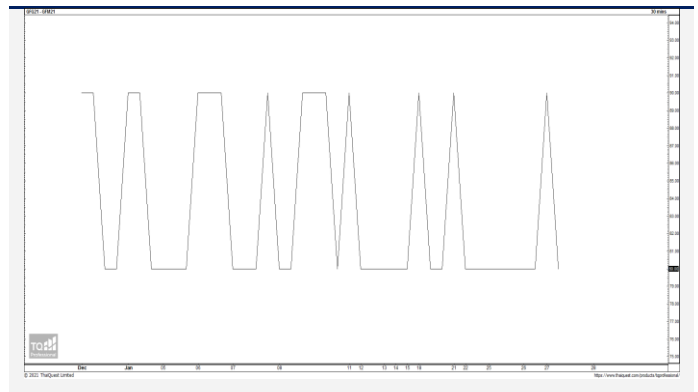
	← ลอนค่า					Dollar Index					→ แข็งค่า				
	93	94	95	96	97	98	99	100	101	102	103				
40	1,617.66	1,589.21	1,560.76	1,532.31	1,503.86	1,475.41	1,446.96	1,418.52	1,390.07	1,361.62	1,333.17				
43	1,616.71	1,588.26	1,559.81	1,531.36	1,502.91	1,474.47	1,446.02	1,417.57	1,389.12	1,360.67	1,332.22				
46	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	1,583.53	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)				
	30.50	30.75	31.00	31.25	31.50
1,650	23,921	24,117	24,313	24,509	24,705
1,680	24,356	24,555	24,755	24,955	25,154
1,710	24,791	24,994	25,197	25,400	25,604
1,740	25,226	25,432	25,639	25,846	26,053
1,770	25,661	25,871	26,081	26,292	26,502
1,800	26,096	26,309	26,523	26,737	26,951
1,830	26,530	26,748	26,965	27,183	27,400
1,860	26,965	27,186	27,407	27,628	27,850
1,890	27,400	27,625	27,850	28,074	28,299

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

Spread ระหว่าง GFJ21 – GFQ21



ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Gold Futures

บัลลงทอนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 490.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
26,230.00	250.0	12,500	(1,049)	11,451
26,180.00	200.0	10,000	(1,049)	8,951
26,130.00	150.0	7,500	(1,049)	6,451
26,080.00	100.0	5,000	(1,049)	3,951
26,030.00	50.0	2,500	(1,049)	1,451
25,980.00	0.0	-	(1,049)	(1,049)
25,930.00	-50.0	(2,500)	(1,049)	(3,549)
25,880.00	-100.0	(5,000)	(1,049)	(6,049)
25,830.00	-150.0	(7,500)	(1,049)	(8,549)
25,780.00	-200.0	(10,000)	(1,049)	(11,049)
25,730.00	-250.0	(12,500)	(1,049)	(13,549)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส

คำนวณกำไรขาดทุนของ Mini Gold Futures

บัลลงทอนรายย่อย				
(ค่าธรรมเนียม 98.10 บาท/สัญญา/ข้าง)				
ราคาปิด future	เปลี่ยนแปลง	กำไร (ขาดทุน)	ค่าธรรมเนียม+ VAT (บาท)	กำไร (ขาดทุน)สุทธิ
26,160.00	250.0	2,500	(210)	2,290
26,110.00	200.0	2,000	(210)	1,790
26,060.00	150.0	1,500	(210)	1,290
26,010.00	100.0	1,000	(210)	790
25,960.00	50.0	500	(210)	290
25,910.00	0.0	-	(210)	(210)
25,860.00	-50.0	(500)	(210)	(710)
25,810.00	-100.0	(1,000)	(210)	(1,210)
25,760.00	-150.0	(1,500)	(210)	(1,710)
25,710.00	-200.0	(2,000)	(210)	(2,210)
25,660.00	-250.0	(2,500)	(210)	(2,710)

ที่มา: สายงานวิจัย บล. เอเซีย พลัส