BUALUANG SECURITIES

ฝึกคัดหุ้น วางแผนเทรด DW

Agenda

- รู้จัก DW จะเทรดเป็นต้องรู้อะไรบ้าง
- คัดหุ้น ที่น่าสนใจเพื่อเก็งกำไรบน DW
- บริหารความเสี่ยงไม่ให้ Over trade

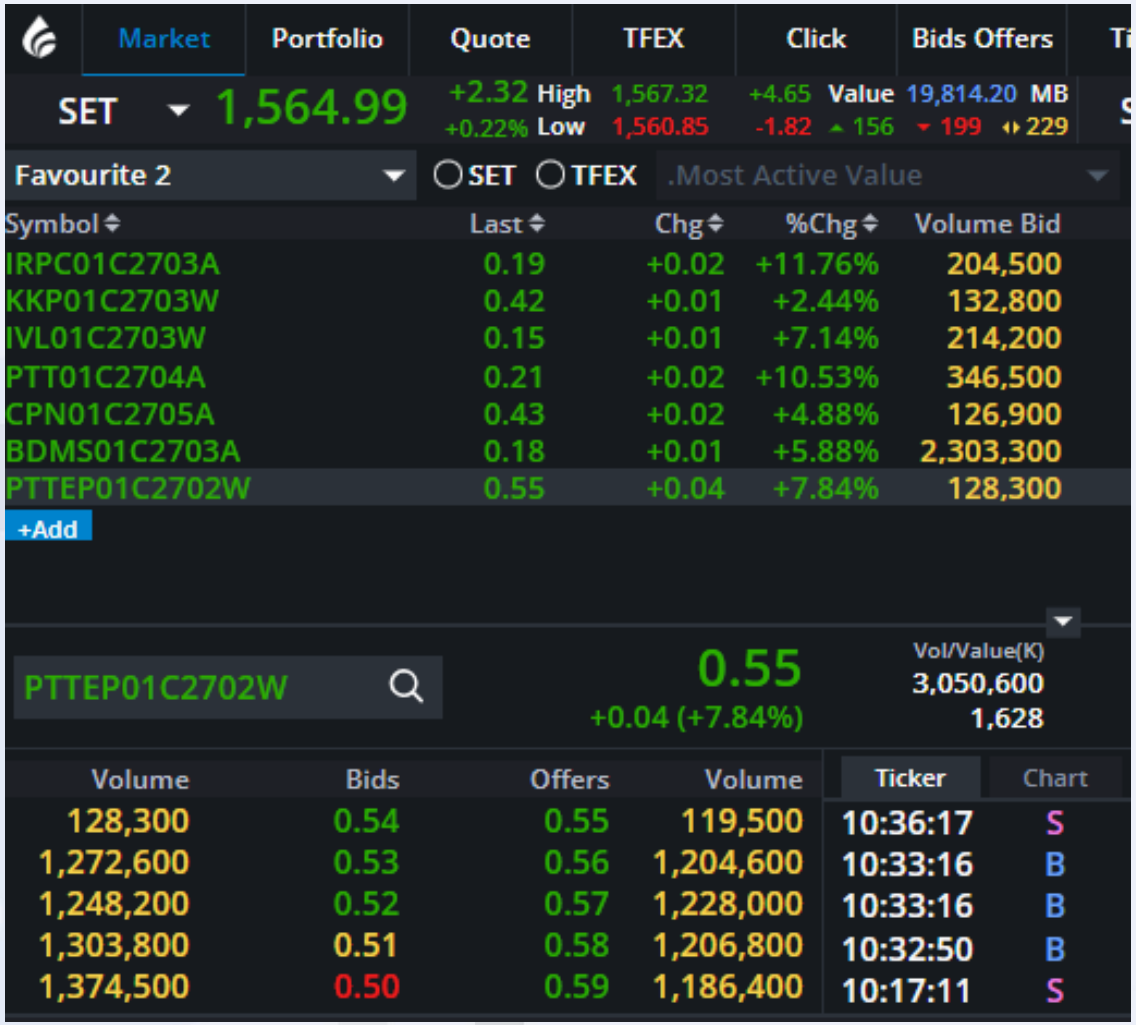


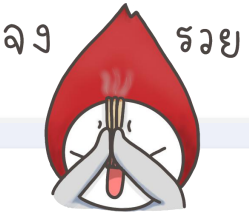
ทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทนและความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน

ทำความรู้จัก

Derivative Warrant (DW)

DW (Derivative Warrant)





จุดเด่นของ DW (Derivative Warrant)

1. ใช้เงินลงทุนน้อยกว่าการซื้อหุ้นตรง
2. มีอัตราทด (Leverage) ช่วยขยายผลตอบแทนเป็นหลายเท่าของการเคลื่อนไหวในหุ้นอ้างอิง
3. ทำกำไรได้สองทิศทาง

   DW Call : เก็งกำไรขาขึ้น

   DW Put : เก็งกำไรขาลง

ความเสี่ยงของ DW

1. ผันผวนสูงกว่าหุ้นอ้างอิง
2. มีค่าเสื่อมเวลา (Time Decay) มูลค่าจะลดลงเรื่อย ๆ ทุกวัน
3. มีอายุจำกัด



DW มีกี่ประเภท และมีหลักทรัพย์อ้างอิงอะไรบ้าง?

DW แบ่งเป็น 2 ประเภท



Call DW คือ สิทธิในการซื้อหุ้นอ้างอิงในอนาคต

ใช้สร้างผลตอบแทนในช่วงขาขึ้น



Put DW คือ สิทธิในการขายหุ้นอ้างอิงในอนาคต

ใช้สร้างผลตอบแทนในช่วงขาลง

Call — มองขึ้น ซื้อ Call

Put — มองลงซื้อ Put

หลักทรัพย์อ้างอิงแบ่งเป็น 3 ประเภท



หุ้นไทย

หุ้นที่อยู่ในดัชนี SET50 SET100



ดัชนีหุ้นไทย

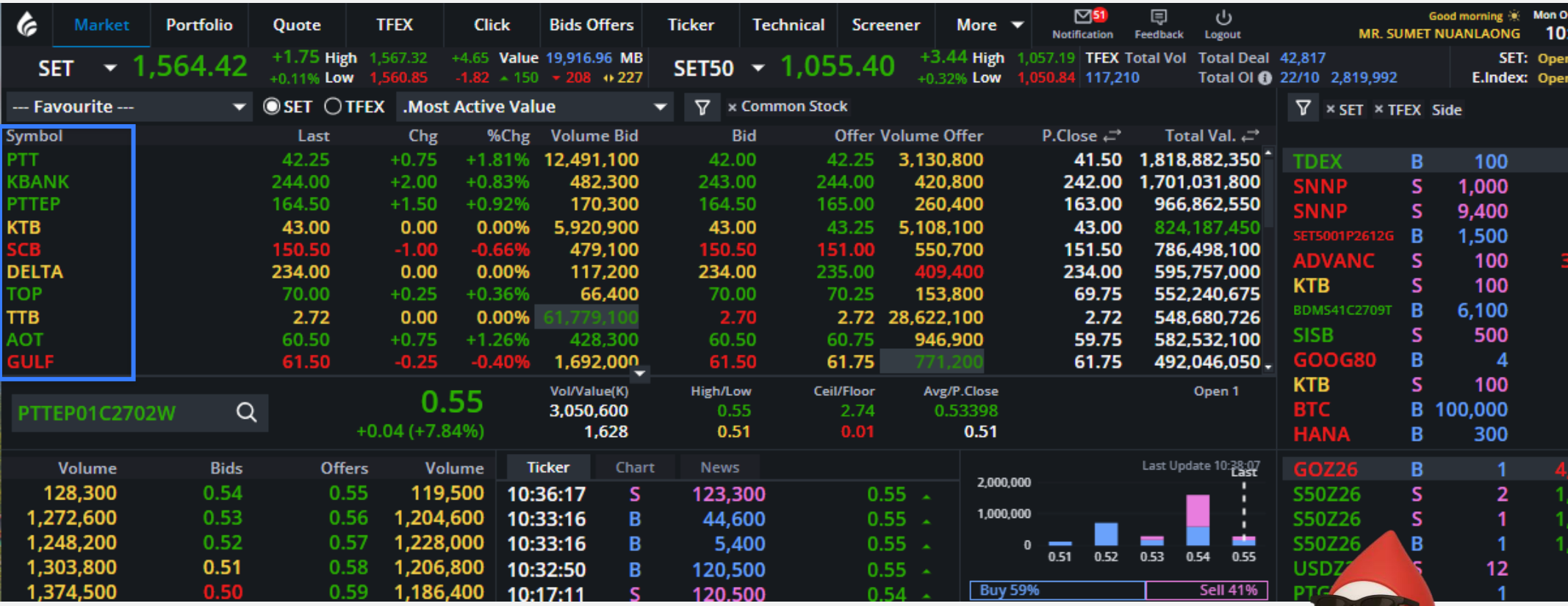
SET Index / SET50 Index



ดัชนีและหุ้นต่างประเทศ

Hang Seng Index (HSI), S&P 500 Index (SPX) และ Dow Jones (DJI) ,NIKKEI รวมถึงหุ้นรายตัวต่างประเทศ

หุ้นที่ติด Most Active Value ส่วนใหญ่มักมี DW

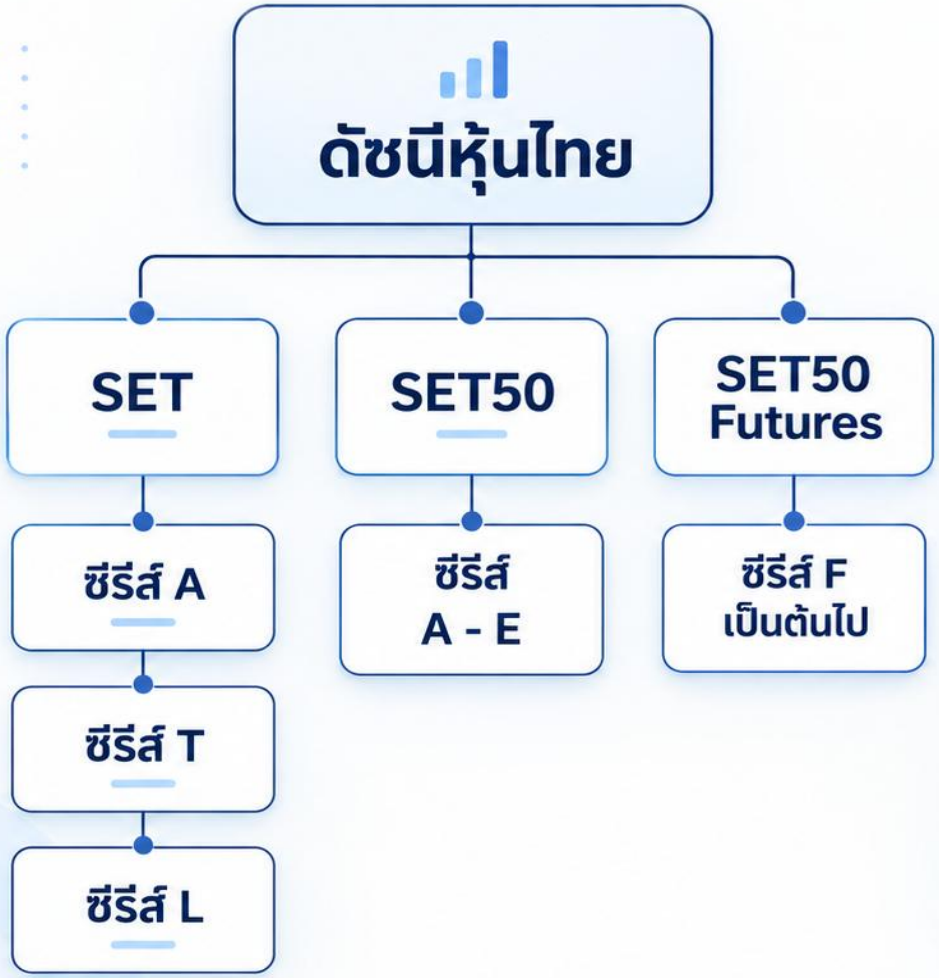


- หุ้นที่ผู้ออกสามารถออก DW หลักๆต้องอยู่ในดัชนี SET50 SET100
- แต่จะมี DW หรือไม่ขึ้นอยู่กับผู้ออก




ชื่อย่อหลักทรัพย์อ้างอิง
(สูงสุด 6 หลักแรก)
ประเภทของ
Call DW – C
Put DW - P
ซีรีส์ของ
DW
SET01C2701A
พิมพ์ชื่อหลักทรัพย์อ้างอิงเต็ม
หมายเลขผู้ออก
01 - บัวหลวง
ปีและเดือน
ที่หมดอายุ

DW01 มีซีรีส์อะไรบ้าง?





A	**ซีรีส์ A** = อัตราทดสูง เน้นเทรดสั้น 1 - 2 วัน
W	**ซีรีส์ W** = คิดค่าเสื่อมเวลา 2 ครั้งต่อสัปดาห์
T	**ซีรีส์ T** = ค่าเสื่อมต่ำ เน้นถือเก็งกำไร 3 – 7 วัน

ข้อมูล ณ วันที่ 26 ต.ค. 69

DW01 ซีรีส์ W คิดค่าเสื่อมเวลา 2 ครั้งต่อสัปดาห์

BLS DW01

DW01 ซีรีส์ W

คิดค่าเสื่อมเวลาวันอังคารและพฤหัสฯ

GULF01C2704W
BDMS01C2704W
IVL01C2703W
KKP01C2703W
RCL01C2704W

เริ่มซื้อขาย 9 ต.ค. 2569

NEW

DELTA01C2701W
HANA01C2701W
KCE01C2702W
GULF01C2702W
PTTEP01C2702W
MTC01C2702W

- ค่าเสื่อมเวลามีผลให้ราคา DW01 ซีรีส์ W ลดลงเฉพาะสิ้นวันอังคารและสิ้นวันพฤหัสบดี*
- หมดปัญหา...ไม่ต้องเสียเวลาดูว่าราคา DW จะลดลงจากค่าเสื่อมเวลาในวันไหน

BLS DW01

DW01 รุ่นใหม่

ซีรีส์ W คิดค่าเสื่อมเวลา 2 ครั้งต่อสัปดาห์

WHA01C2704W
HANA01C2704W
KCE01C2704W
MTC01C2704W
STA01C2704W

- ค่าเสื่อมเวลามีผลให้ราคา DW01 ซีรีส์ W ลดลงเฉพาะสิ้นวันอังคารและสิ้นวันพฤหัสบดี*
- หมดปัญหา...ไม่ต้องเสียเวลาดูว่าราคา DW จะลดลงจากค่าเสื่อมเวลาในวันไหน

AMATA01C2704A
ERW01C2705A

DELTA01C2707T

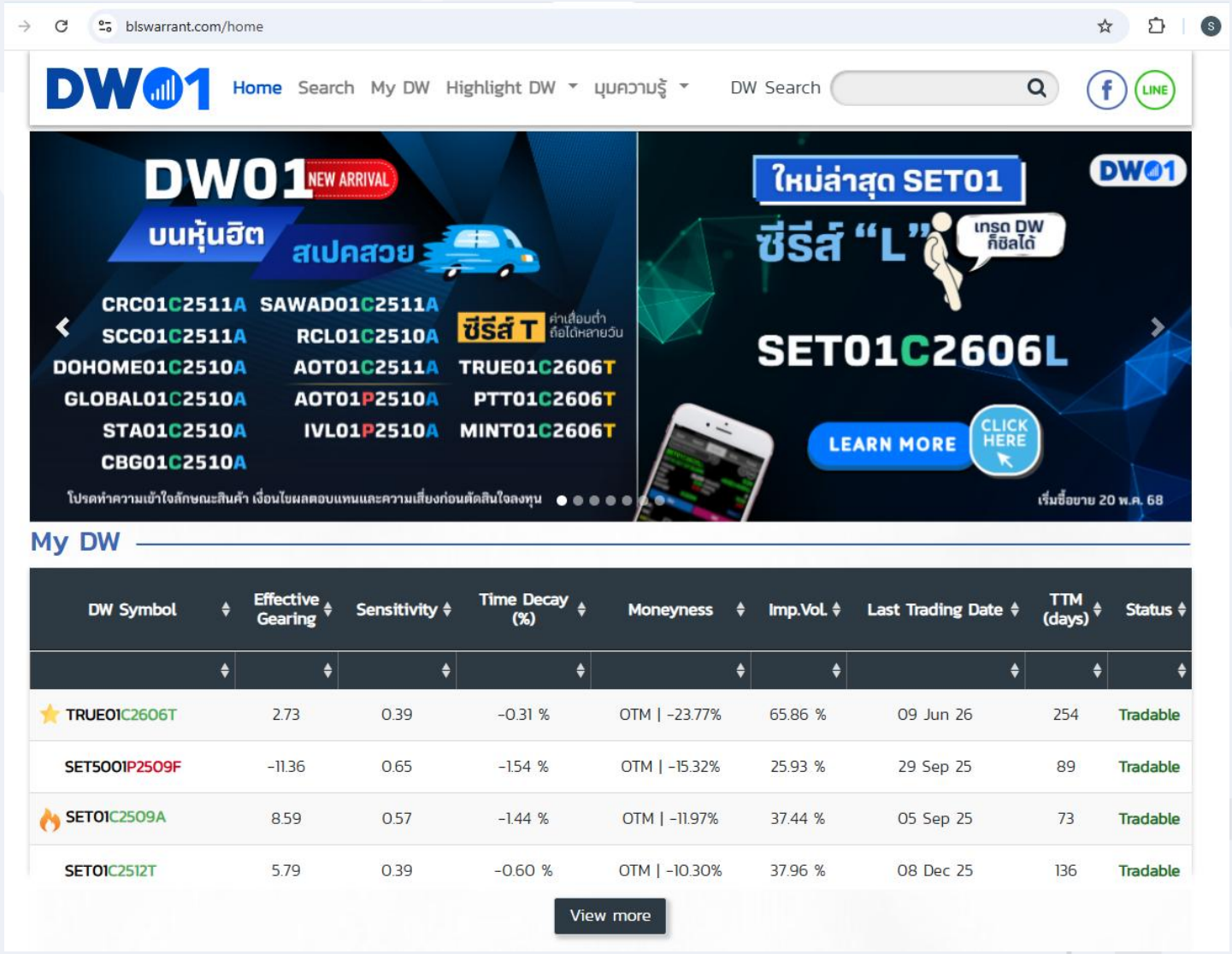
PUT

WHA01P2704A
KKP01P2703A

เริ่มซื้อขาย 26 ต.ค. 2569

3 Indicator สำคัญ
บอกพฤติกรรมของ DW

ก่อนซื้อขาย DW ต้องดูตารางราคา



www.blswarrant.com

3 Indicator สำคัญในการเทรด DW



Effective Gearing

เป็นค่าที่บอกว่า ถ้าราคาหุ้นอ้างอิงเปลี่ยนไป 1 %
ราคา DW จะเปลี่ยนไปประมาณกี่ %





Sensitivity

เป็นค่าที่บอกว่า ถ้าราคาหุ้นอ้างอิงเปลี่ยนไป 1 ช่อง
ราคา DW จะเปลี่ยนไปประมาณกี่ “ช่อง”





Time Decay

เป็นค่าที่บอกว่าเมื่อเวลาผ่านไป 1 วัน
ราคา DW จะลดลงประมาณกี่ %

3 Indicators บอกนิสัยของ DW แบบไหนคือ DW สเปคสวย



Gearing ความแรง = Gearing สูง = Time decay สูงตาม

Sensitivity ความอ่อนไหว = เป็นไปได้ ยิ่งใกล้ 1 ยิ่งดี

DW สเปคสวยหรือไม่สวยขึ้นอยู่กับแผนเทรดของแต่ละคน

ฝึกคัดหุ้น สำหรับเทรด DW

หุ้น 4 แบบที่อยากให้มองหา

1. หุ้นที่อยู่ในกระแส (บวกร้อนแรงอยู่ในช่วงนี้)
2. หุ้นที่ทะลุโซนต้านสำคัญ
3. หุ้นที่ลงมาแนวรับสำคัญ
4. หุ้นที่วอลุ่มเฉลี่ยเพิ่มขึ้นอย่างมีนัยสำคัญ

1. หุ้นในกระแส

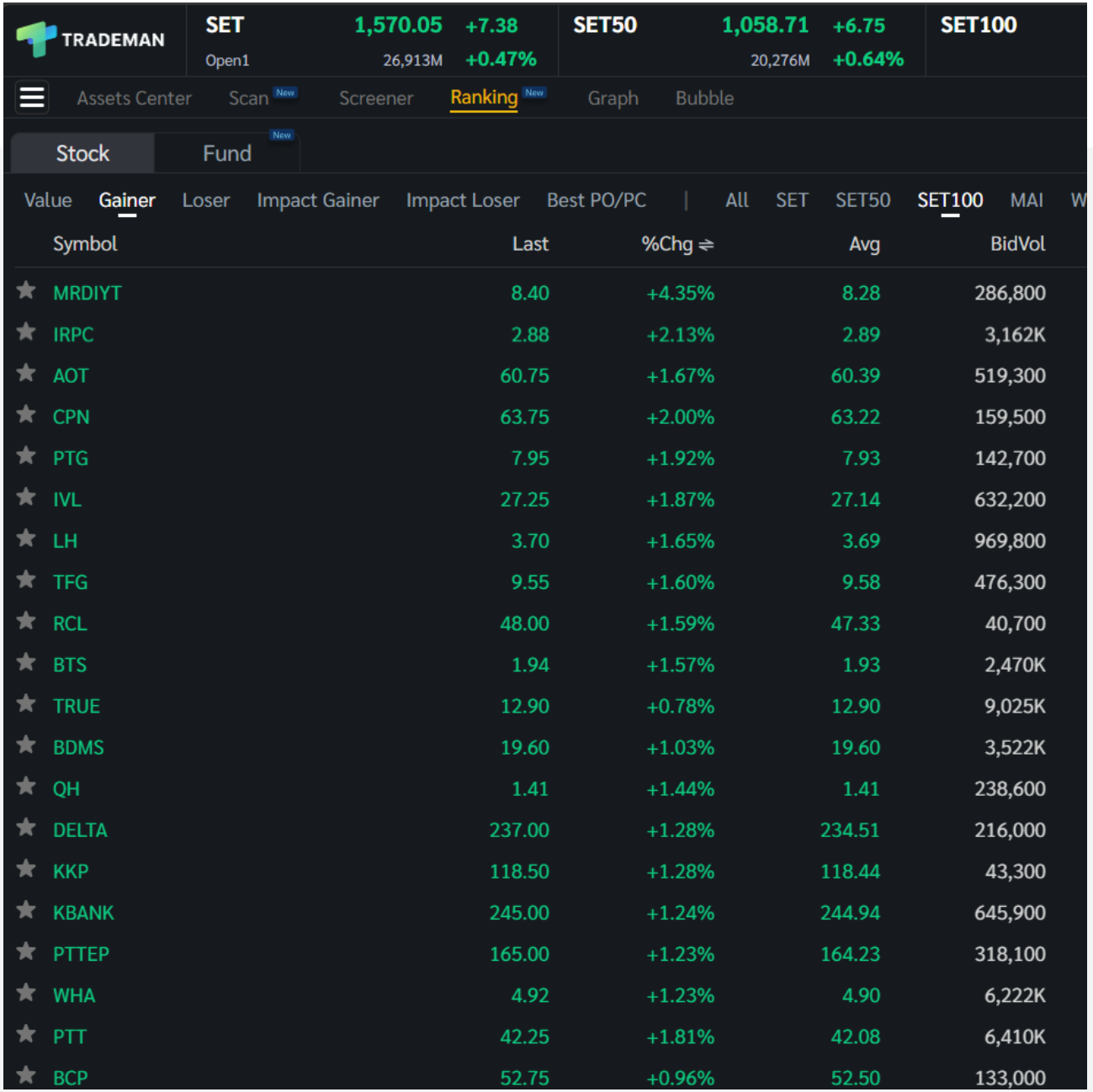
- Most Active Value



Symbol	Last	Chg	%Chg	Volume Bid	Bid	Offer	Volume Offer	P.Close	Total Val.
PTT	42.00	+0.50	+1.20%	5,987,700	42.00	42.25	10,366,200	41.50	2,702,511,150
KBANK	245.00	+3.00	+1.24%	658,200	244.00	245.00	827,000	242.00	2,139,178,200
SCB	151.00	-0.50	-0.33%	128,800	151.00	151.50	816,100	151.50	1,510,285,650
PTTEP	165.00	+2.00	+1.23%	281,200	164.50	165.00	433,000	163.00	1,198,449,150
KTB	43.50	+0.50	+1.16%	2,237,800	43.25	43.50	7,038,000	43.00	1,175,444,725
DELTA	236.00	+2.00	+0.85%	251,400	236.00	237.00	125,000	234.00	990,110,100
AOT	60.75	+1.00	+1.67%	617,400	60.50	60.75	687,000	59.75	944,689,425
TTB	2.72	0.00	0.00%	38,985,000	2.70	2.72	35,001,400	2.72	795,427,538
TOP	69.75	0.00	0.00%	188,000	69.75	70.00	330,200	69.75	701,566,700
KKP	118.50	+1.50	+1.28%	21,500	118.50	119.00	1,029,500	117.00	644,353,350

1. หุ้นในกระแส

- TOP Gainer



Symbol	Last	%Chg	Avg	BidVol
MRDIYT	8.40	+4.35%	8.28	286,800
IRPC	2.88	+2.13%	2.89	3,162K
AOT	60.75	+1.67%	60.39	519,300
CPN	63.75	+2.00%	63.22	159,500
PTG	7.95	+1.92%	7.93	142,700
IVL	27.25	+1.87%	27.14	632,200
LH	3.70	+1.65%	3.69	969,800
TFG	9.55	+1.60%	9.58	476,300
RCL	48.00	+1.59%	47.33	40,700
BTS	1.94	+1.57%	1.93	2,470K
TRUE	12.90	+0.78%	12.90	9,025K
BDMS	19.60	+1.03%	19.60	3,522K
QH	1.41	+1.44%	1.41	238,600
DELTA	237.00	+1.28%	234.51	216,000
KKP	118.50	+1.28%	118.44	43,300
KBANK	245.00	+1.24%	244.94	645,900
PTTEP	165.00	+1.23%	164.23	318,100
WHA	4.92	+1.23%	4.90	6,222K
PTT	42.25	+1.81%	42.08	6,410K
BCP	52.75	+0.96%	52.50	133,000

2. หุ้นทะลุต้านสำคัญ





3. หุ้นลงมาแนวรับสำคัญ









4. หุ้นวอลุ่มเพิ่มอย่างมีนัยสำคัญ

- Rel Vol

Symbol 100	Price	Chg %	Price x vol	Rel vol	Tech rating	Analyst rating	Pattern	Vol	Mkt c
OR	12.7 THB	+0.79%	257.07 M THB	1.58	Strong buy	Buy		20.24 M	151.2 B THB
LH	3.70 THB	+1.65%	122.02 M THB	1.54	Buy	Neutral	—	32.98 M	43.5 B THB
ICHI	13.9 THB	+0.72%	46.85 M THB	1.42	Buy	Strong buy	—	3.37 M	17.94 B THB
MRDIYT	8.50 THB	+5.59%	50.13 M THB	1.41	Neutral	Strong buy	—	5.9 M	48.44 B THB
VGI	1.09 THB	−3.54%	265.76 M THB	1.03	Buy	Neutral	—	243.82 M	23.84 B THB
PTT	42.25 THB	+1.81%	2.84 B THB	1.01	Strong buy	Buy	—	67.17 M	1.18 T THB
BTG	21.3 THB	−0.93%	59.3 M THB	0.96	Buy	Strong buy	—	2.78 M	41.6 B THB
SPALI	16.1 THB	+1.26%	38.24 M THB	0.92	Buy	Buy		2.38 M	27.95 B THB
EA	2.46 THB	−0.81%	54.93 M THB	0.86	Sell	No rating		22.33 M	18.42 B THB
TFG	9.50 THB	+1.06%	107.85 M THB	0.84	Buy	Strong buy		11.35 M	55.81 B THB
KKP	119.0 THB	+1.71%	681.55 M THB	0.80	Strong buy	Buy	—	5.73 M	104.76 B THB
PTG	7.90 THB	+1.28%	33.93 M THB	0.79	Sell	Buy		4.29 M	13.03 B THB
SCB	150.5 THB	−0.66%	1.57 B THB	0.76	Buy	Buy	—	10.4 M	510.12 B THB
BCPG	6.85 THB	+1.48%	17.79 M THB	0.72	Buy	Buy		2.6 M	20.22 B THB
IRPC	2.90 THB	+2.84%	226.77 M THB	0.72	Buy	Neutral	—	78.2 M	57.56 B THB

บริหารความเสี่ยงเงินที่เข้าซื้อขายไม่ให้ Over trade

อยากให้ DW ขยับ ช่องละ 500 ช่องละ 1,000 Tick ช่องละ 10,000 ต้องซื้อ DW กี่หน่วย

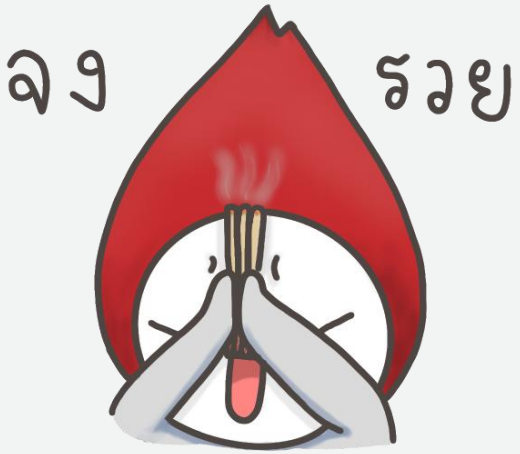
Tick ละ 500 บาท	Tick ละ 1,000 บาท	Tick ละ 5,000 บาท	Tick ละ 10,000 บาท
			
50,000 หน่วย	100,000 หน่วย	500,000 หน่วย	1,000,000 หน่วย

*กำไรขาดทุนยังไม่รวมค่าธรรมการซื้อขาย

ทำความเข้าใจลักษณะสินค้า เงื่อนไขผลตอบแทนและความเสี่ยงก่อนตัดสินใจลงทุน

ใช้ได้กับ DW ที่ราคาไม่เกิน 2.00 บาทและยังไม่รวมค่าธรรมเนียมการซื้อขาย

สรุป ขั้นตอนเทรด DW แบบมือโปร



1. ค้นหาหุ้นอ้างอิงที่สนใจ วิเคราะห์แนวโน้ม
2. เลือกซีรีส์ DW
3. กำหนด จุดซื้อ จุดตัดขายทุน จุดทำกำไร
4. เข้าซื้อ DW และทำตามแผน

สรุป เทคนิควางแผนเทรด

- เทรด DW ตามแนวโน้มปัจจุบันของหุ้นอ้างอิง
  - หุ้นขาขึ้นเน้นฝั่ง Call
  - หุ้นขาลงเน้นฝั่ง Put
- จังหวะในการซื้อขาย มองที่โซนรับ ต้าน
  - ใช้แนวรับเป็นจุดซื้อ วางจุดขายที่แนวต้าน ไม่เน้นไล่ราคา
  - จุดตัดขาดทุนไม่ลึกจนเกินไป และถ้าหุ้นไม่ขยับตัดขาดทุนจาก Time decay
- บริหารความเสี่ยงเงินที่เข้าซื้อขายไม่ให้ Over trade
  - ซื้อในปริมาณที่เหมาะสม ในจำนวนเงินที่รับขาดทุนได้เมื่อผิดทาง





อย่าลืมติดตามพวกเราได้ที่

www.blswarrant.com

Chat กับน้องบัวได้ที่ m.me/blswarrant

www.facebook.com/blswarrant

www.youtube.com/bualuangsec

Communities DW01 Trading Idea หุ้นกราฟสวย

Thank you!

ติดต่อ BLS DW โทร 02-618-1492