



นักวิเคราะห์: กมลชัย พลอินทวงษ์
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 018239
Tel. (662) 088 9341

27 กรกฎาคม 2564



กลยุทธ์: ยังคงเล่นได้สั้น 10 วันต่อหน้า Short จึงได้เปรียบอยู่ ดังนั้นก็ OPEN SHORT แถวๆแนวต้านที่ให้แล้วรอปิดทำกำไรตอนย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดยกำหนดจุดตัดขาดทุนหรือ CUT LOSS เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50U21 ปิดเหนือ 928

แต่ในทางกลับกันหากลงมาแล้วมี Bull di ก็พอจะเล่นฝั่งสวน trend แบบ BET rebound ได้บ้างโดยไปเลี้ยงดัก OPEN LONG ตอนถอยลงมาแถวๆแนวรับที่ให้แล้วรอขายทำกำไรตอนดีดในระหว่างวันตามแนวต้านของ FIBO or MAVs แต่ก็ควรวาง Trailing stop ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50U21 ลงมาปิดต่ำกว่า 905

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50N21	925.4	925.9	920.0	929.0	923.2	-5.8	50	201
S50Q21	920.1	920.3	917.6	927.6	920.0	-7.6	20	154
S50U21	922.0	922.0	915.2	923.8	917.0	-6.3	136,771	324,681
S50Z21	921.2	921.2	914.4	922.6	916.2	-6.0	10,812	35,258
S50H22	919.9	919.9	911.6	920.1	913.5	-6.1	1,555	7,286
S50M22	914.0	914.0	907.6	916.1	910.0	-5.7	1,558	2,310

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDN21	32.90	32.90	32.90	32.87	32.90	0.03	1	321
USDQ21	32.92	32.93	32.90	32.87	32.93	0.06	13	3,984
USDU21	32.92	32.94	32.89	32.88	32.94	0.05	5,868	71,504
USDZ21	32.94	32.94	32.92	32.89	32.94	0.05	2,379	33,292

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทหลักทรัพย์ (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	46,668	49,078	-2,410	26,694	24,978	1,716	77,404	76,710	694
Metal Futures	27,463	23,375	4,088	7,446	6,056	1,390	22,116	27,594	-5,478
Single Stock Futures	24,453	12,925	11,528	65,821	55,211	10,610	50,959	73,097	-22,138
Currency Futures	0	0	0	3,821	20	3,801	4,440	8,241	-3,801

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10Q21	28,340	28,080	28,270	28,100	150	2,874	4,377
GFQ21	28,330	28,080	28,300	28,060	160	55	313
GOU21	1,813	1,798	1,806	1,800	6	40,609	21,955
SVFU21	26	25	26	25	0	158	2,996
GF10V21	28,380	28,130	28,300	28,150	140	949	4,477
GFV21	28,380	28,130	28,360	28,160	200	50	221
GF10Z21	28,410	28,170	28,340	28,190	150	1,363	2,144
GFZ21	28,370	28,210	28,370	28,160	110	7	22

SET50

	Expiration date	Days to maturity	Rf	FV of periodic dividend	Current spot	Fair future price	Current future price	Premium / Discount from fair price (pts)	premium / discount (%)	Premium / Discount from spot price (pts)
S50U21	29-Sep-21	65	1.58%	0.0	923.24	925.9	917.5	-8.4	-0.9	-5.7
S50Z21	29-Dec-21	156	1.67%	15.2	923.24	914.7	916.6	1.9	0.2	-6.6
S50H22	30-Mar-22	247	1.79%	2.0	923.24	932.5	914	-18.5	-2.0	-9.2
S50M22	29-Jun-22	338	1.65%	17.3	923.24	920.2	910.4	-9.8	-1.1	-12.8

Gold

	Expiration date	Days to maturity	Current spot (USD)	Rf	Current FX	Fair future price	Current future price	Premium / Discount from fair price (Bt)	premium / discount (%)
GFQ21	30-Aug-21	35	1,807.6	2.50%	32.956	28,384	28,240	-144	-0.5%
GFV21	28-Oct-21	94	1,807.6	2.53%	32.956	28,501	28,320	-181	-0.6%
GFZ21	29-Dec-21	156	1,807.6	2.59%	32.956	28,631	28,360	-271	-0.9%

USD

	Expiration date	Days to maturity	Current FX	TH1 YY	US1YY	Fair future price	Current future price	Premium / Discount from fair price (Bt)	premium / discount (%)
USDN21	29-Jul-21	3	32.95	2.60%	0.11%	32.96	32.90	-0.06	-0.2%
USDU21	29-Sep-21	65	32.95	2.60%	0.11%	33.10	32.93	-0.17	-0.5%
USDZ21	29-Dec-21	156	32.95	2.60%	0.11%	33.30	32.94	-0.36	-1.1%

* In computing fair future price of oil, gold, and silver we disregard storage cost & convenience yield for simplicity reason

Fair gold spot price

		Gold spot (USD/oz)										
		1,758	1,768	1,778	1,788	1,798	1,808	1,818	1,828	1,838	1,848	1,858
THB/USD	32.70	27,317	27,473	27,628	27,784	27,939	28,094	28,250	28,405	28,561	28,716	28,872
	32.75	27,359	27,515	27,670	27,826	27,982	28,137	28,293	28,449	28,604	28,760	28,916
	32.80	27,401	27,557	27,713	27,869	28,024	28,180	28,336	28,492	28,648	28,804	28,960
	32.85	27,443	27,599	27,755	27,911	28,067	28,223	28,379	28,536	28,692	28,848	29,004
	32.90	27,484	27,641	27,797	27,953	28,110	28,266	28,423	28,579	28,735	28,892	29,048
	32.95	27,526	27,683	27,839	27,996	28,153	28,309	28,466	28,622	28,779	28,936	29,092
	33.00	27,568	27,725	27,882	28,038	28,195	28,352	28,509	28,666	28,823	28,980	29,136
	33.05	27,610	27,767	27,924	28,081	28,238	28,395	28,552	28,709	28,866	29,024	29,181
	33.10	27,651	27,809	27,966	28,123	28,281	28,438	28,595	28,753	28,910	29,067	29,225
	33.15	27,693	27,851	28,008	28,166	28,323	28,481	28,639	28,796	28,954	29,111	29,269
	33.20	27,735	27,893	28,051	28,208	28,366	28,524	28,682	28,840	28,997	29,155	29,313