



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

29 กรกฎาคม 2564



กลยุทธ์: ยังคงเล่นได้สั้น 10 วันต่อหน้า Short จึงได้เปรียบอยู่ ดังนั้นก็ OPEN SHORT แถวๆแนวต้านที่ให้แล้วรอปิดทำกำไรตอนย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดยกำหนดจุดตัดขาดทุนหรือ CUT LOSS เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50U21 ปิดเหนือ 923

แต่ในทางกลับกันหากลงมาแล้วมี Bull di ก็พอจะเล่นฝั่งสวน trend แบบ BET rebound ได้บ้างโดยไปเลี้ยงดัก OPEN LONG ตอนถอยลงมาแถวๆแนวรับที่ให้แล้วรอขายทำกำไรตอนดีดในระหว่างวันตามแนวต้านของ FIBO or MAVs แต่ก็ควรวาง Trailing stop ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50U21 ลงมาปิดต่ำกว่า 899

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50N21	922.0	922.2	914.0	923.2	917.0	-6.2	79	186
S50Q21	916.9	917.3	910.2	920.0	913.2	-6.8	42	174
S50U21	915.0	916.6	907.5	917.5	910.6	-6.5	147,142	327,064
S50Z21	914.0	915.4	906.5	916.6	909.7	-6.4	17,588	36,264
S50H22	911.5	912.8	904.2	914.0	907.4	-6.4	2,754	7,465
S50M22	908.0	909.3	900.8	910.4	903.5	-6.3	1,498	2,600

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDN21	32.88	32.97	32.87	32.90	32.97	0.07	8	320
USDQ21	32.87	32.99	32.87	32.93	32.97	0.05	17	3,981
USDU21	32.87	32.99	32.86	32.93	32.98	0.04	9,164	74,264
USDZ21	32.86	32.99	32.86	32.94	32.98	0.04	4,004	35,286

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทหลักทรัพย์ (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	58,633	65,222	-6,589	29,592	29,730	-138	80,878	74,151	6,727
Metal Futures	25,131	29,068	-3,937	6,388	7,379	-991	28,622	23,694	4,928
Single Stock Futures	12,873	9,751	3,122	55,116	49,495	5,621	54,531	63,274	-8,743
Currency Futures	0	0	0	6,260	1,045	5,215	6,933	12,148	-5,215

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10Q21	28,300	28,120	28,190	28,250	-80	2,530	3,993
GFQ21	28,240	28,100	28,140	28,220	-70	55	287
GOU21	1,808	1,796	1,801	1,806	-6	43,185	22,635
SVFU21	25	25	25	26	0	275	3,029
GF10V21	28,330	28,170	28,220	28,290	-70	1,276	4,447
GFV21	28,320	28,220	28,320	28,360	-60	53	206
GF10Z21	28,370	28,210	28,270	28,340	-70	389	2,232
GFZ21	28,360	28,220	28,220	28,270	-20	15	26

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	62	1.58%	0.0	917.72	920.2	911	-9.2	-1.0	-6.7
S50Z21	29-Dec-21	153	1.67%	15.2	917.72	909.1	910.2	1.1	0.1	-7.5
S50H22	30-Mar-22	244	1.79%	2.0	917.72	926.8	907.6	-19.2	-2.1	-10.1
S50M22	29-Jun-22	335	1.65%	17.3	917.72	914.5	904.1	-10.4	-1.1	-13.6

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	32	1,808.5	2.50%	32.805	28,262	28,210	-52	-0.2%
GFV21	28-Oct-21	91	1,808.5	2.53%	32.805	28,379	28,250	-129	-0.5%
GFZ21	29-Dec-21	153	1,808.5	2.59%	32.805	28,508	28,250	-258	-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	0	32.795	2.60%	0.11%	32.80	32.97	0.17	0.5%
USDU21	29-Sep-21	62	32.795	2.60%	0.11%	32.93	32.97	0.04	0.1%
USDZ21	29-Dec-21	153	32.795	2.60%	0.11%	33.14	32.98	-0.16	-0.5%

* 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	32.55	27,202	27,356	27,511	27,666	27,820	27,975	28,130	28,285	28,439	28,594	28,749
	32.60	27,243	27,398	27,553	27,708	27,863	28,018	28,173	28,328	28,483	28,638	28,793
	32.65	27,285	27,440	27,596	27,751	27,906	28,061	28,216	28,371	28,527	28,682	28,837
	32.70	27,327	27,482	27,638	27,793	27,949	28,104	28,260	28,415	28,570	28,726	28,881
	32.75	27,369	27,524	27,680	27,836	27,991	28,147	28,303	28,458	28,614	28,770	28,925
	32.80	27,411	27,567	27,722	27,878	28,034	28,190	28,346	28,502	28,658	28,814	28,969
	32.85	27,452	27,609	27,765	27,921	28,077	28,233	28,389	28,545	28,701	28,858	29,014
	32.90	27,494	27,651	27,807	27,963	28,120	28,276	28,432	28,589	28,745	28,901	29,058
	32.95	27,536	27,693	27,849	28,006	28,162	28,319	28,476	28,632	28,789	28,945	29,102
	33.00	27,578	27,735	27,891	28,048	28,205	28,362	28,519	28,676	28,832	28,989	29,146
	33.05	27,620	27,777	27,934	28,091	28,248	28,405	28,562	28,719	28,876	29,033	29,190