



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

13 กันยายน 2564

S50U21 **983.9** **S=967-975** **R=988-996**



กลยุทธ์: พลิกลูกกลับมาปิดคลอเคลียแถวๆเส้น 10 วันใหม่เลยทำให้สามารถเล่นได้ทั้งสองหน้า โดยหากหายอลงมาแล้วอยากเล่นหน้ายาว
 ดั้งเดิมก็รอ OPEN LONG แถวๆแนวรับที่ให้แล้วรอขายทำกำไรตอนตีกลับขึ้นมาในระหว่างวันแต่ก็ควรวาง Trailing stop ด้วยนะหากราคา
 ออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50U21 ลงมาปิดต่ำกว่า 966
 แต่ในทางกลับกันซึ่งตีกลับแล้วอยากเล่นหน้าสั้นก็ OPEN SHORT แถวๆแนวต้านที่ให้แล้วรอปิดทำกำไรตอนย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน
 โดยกำหนดจุดตัดขาดทุนหรือ CUT LOSS เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50U21 ปิดเหนือเส้น 10 วัน

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50U21	982.0	987.5	973.4	977.3	984.1	6.6	187,351	321,253
S50V21	979.9	985.2	973.6	976.4	983.5	7.1	76	127
S50X21	979.0	986.7	979.0	977.4	982.7	5.3	37	88
S50Z21	979.0	985.0	971.2	975.0	982.1	6.8	33,603	63,225
S50H22	976.4	981.7	968.0	971.8	979.0	6.5	5,327	13,144
S50M22	974.0	979.0	965.4	969.4	976.0	6.3	2,329	9,068

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDU21	32.70	32.70	32.61	32.73	32.65	-0.08	13,401	44,137
USDV21	32.70	32.70	32.63	32.73	32.63	-0.10	18	647
USDX21	32.62	32.62	32.62	32.74	32.62	-0.08	20	49
USDZ21	32.69	32.70	32.60	32.74	32.65	-0.09	4,559	72,783

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทหลักทรัพย์ (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	70,903	74,640	-3,737	40,537	40,679	-142	117,283	113,404	3,879
Metal Futures	24,469	23,161	1,308	6,491	5,420	1,071	18,198	20,577	-2,379
Single Stock Futures	18,955	10,218	8,737	109,984	92,871	17,113	88,149	113,999	-25,850
Currency Futures	0	0	0	4,877	6,370	-1,493	13,121	11,628	1,493

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GOU21	1,804	1,785	1,800	1,796	4	28,847	11,436
SVFU21	24	24	24	24	0	69	2,783
GF10V21	27,990	27,800	27,930	27,940	-	2,583	4,960
GFV21	27,990	27,810	27,940	27,940	-	76	205
GF10Z21	28,020	27,840	27,960	27,960	-	873	5,636
GFZ21	28,000	27,880	27,980	27,960	-	8	165
GOZ21	1,807	1,788	1,802	1,799	4	15,317	13,413
SVFZ21	24	24	24	24	0	28	449

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	16	1.58%	0.0	985.29	986.0	983.9	-2.1	-0.2	-1.4
S50Z21	29-Dec-21	107	1.67%	15.2	985.29	975.0	981.8	6.8	0.7	-3.5
S50H22	30-Mar-22	198	1.79%	2.0	985.29	992.9	978.3	-14.6	-1.5	-7.0
S50M22	29-Jun-22	289	1.65%	17.3	985.29	981.0	975.7	-5.3	-0.5	-9.6

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 (%)
GFV21	28-Oct-21	45	1,789.6	2.50%	32.726	27,924	27,850	-74	-0.3%
GFZ21	29-Dec-21	107	1,789.6	2.53%	32.726	28,046	27,960	-86	-0.3%
GFG22	25-Feb-22	165	1,789.6	2.59%	32.726	28,166	28,040	-126	-0.4%

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 (%)
USDU21	29-Sep-21	16	32.72	2.60%	0.11%	32.76	32.65	-0.11	-0.3%
USDV21	28-Oct-21	45	32.72	2.60%	0.11%	32.82	32.63	-0.19	-0.6%
USDZ21	29-Dec-21	107	32.72	2.60%	0.11%	32.96	32.65	-0.31	-0.9%

* 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)										
		1,740	1,750	1,760	1,770	1,780	1,790	1,800	1,810	1,820	1,830	1,840
THB/USD	32.47	26,849	27,003	27,158	27,312	27,466	27,621	27,775	27,929	28,084	28,238	28,392
	32.52	26,890	27,045	27,199	27,354	27,508	27,663	27,818	27,972	28,127	28,281	28,436
	32.57	26,932	27,086	27,241	27,396	27,551	27,706	27,860	28,015	28,170	28,325	28,480
	32.62	26,973	27,128	27,283	27,438	27,593	27,748	27,903	28,058	28,213	28,368	28,523
	32.67	27,014	27,170	27,325	27,480	27,635	27,791	27,946	28,101	28,257	28,412	28,567
	32.72	27,056	27,211	27,367	27,522	27,678	27,833	27,989	28,144	28,300	28,455	28,611
	32.77	27,097	27,253	27,408	27,564	27,720	27,876	28,031	28,187	28,343	28,499	28,655
	32.82	27,138	27,294	27,450	27,606	27,762	27,918	28,074	28,230	28,386	28,542	28,698
	32.87	27,180	27,336	27,492	27,648	27,805	27,961	28,117	28,273	28,430	28,586	28,742
	32.92	27,221	27,377	27,534	27,690	27,847	28,003	28,160	28,316	28,473	28,629	28,786
	32.97	27,262	27,419	27,576	27,732	27,889	28,046	28,203	28,359	28,516	28,673	28,829