



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

08 ตุลาคม 2564

S50Z21 979.7 **S=967-973** **R=986-992**



กลยุทธ์: พลิกกลับขึ้นมาปิดเหนือเส้น 10 วันได้สำเร็จอีกครั้งเลยทำให้หน้ายาวกลับมาได้เปรียบใหม่ ดังนั้นหากเกิดการย่อตัวก็ดักกรอ OPEN LONG แถวๆแนวรับที่ไว้แล้วรอขายทำกำไรตอนตีกลับขึ้นมาแต่ก็ควรวาง Trailing stop ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50Z21 ลงมาปิดต่ำกว่า 970 และในทางกลับกันหากซิ่งดีก่อนก็อาจเสี่ยง OPEN SHORT แถวๆแนวต้านที่ไว้แล้วรอปิดทำกำไรตอนย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดยกำหนดจุดตัดขาดทุนหรือ CUT LOSS เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50Z21 ปิดเหนือ 993

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50V21	974.5	983.9	973.9	968.4	981.8	12.9	521	340
S50X21	973.0	983.7	973.0	967.9	980.9	13	54	149
S50Z21	972.0	983.2	971.7	966.3	980.7	13.4	194,194	343,624
S50H22	966.0	978.0	966.0	961.8	975.5	12.9	20,943	40,996
S50M22	963.5	975.7	963.5	959.7	973.3	12.8	5,506	11,873
S50U22	958.9	972.1	958.9	956.5	969.9	12.8	2,925	1,729

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDV21	33.90	33.90	33.78	33.94	33.78	-0.16	15	358
USDX21	33.90	33.90	33.75	33.95	33.76	-0.16	86	103
USDZ21	33.92	33.92	33.68	33.92	33.79	-0.14	14,277	116,241
USDH22	33.90	33.90	33.71	33.93	33.78	-0.15	2,350	8,502

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทนักลงทุน (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	93,764	69,306	24,458	31,723	47,276	-15,553	98,656	107,561	-8,905
Metal Futures	29,447	21,268	8,179	5,714	3,322	2,392	15,882	26,453	-10,571
Single Stock Futures	24,099	54,277	-30,178	168,021	578,652	-410,631	602,074	161,265	440,809
Currency Futures	0	0	0	561	1,139	-578	16,167	15,589	578

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10V21	28,380	28,250	28,290	28,200	100	1,330	5,143
GFV21	28,370	28,250	28,250	28,210	40	29	191
GF10Z21	28,420	28,300	28,340	28,260	70	1,676	9,040
GFZ21	28,400	28,380	28,400	28,260	140	2	132
GOZ21	1,770	1,757	1,764	1,751	12	38,468	16,041
SVFZ21	23	23	23	22	0	301	844
GF10G22	28,450	28,330	28,380	28,280	90	559	3,929
GFG22	28,380	28,380	28,380	28,290	10	2	65

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)
S50Z21	29-Dec-21	82	1.58%	0.0	982.1	985.6	979.7	-5.9	-0.6	-2.4
S50H22	30-Mar-22	173	1.67%	15.2	982.1	974.8	974.7	-0.1	0.0	-7.4
S50M22	29-Jun-22	264	1.79%	2.0	982.1	992.9	972.5	-20.4	-2.1	-9.6
S50U22	29-Sep-22	356	1.65%	17.3	982.1	980.8	969.3	-11.5	-1.2	-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 (%)
GFV21	28-Oct-21	20	1,757.9	2.50%	33.806	28,286	28,250	-36	-0.1%
GFZ21	29-Dec-21	82	1,757.9	2.53%	33.806	28,409	28,250	-159	-0.6%
GFG22	25-Feb-22	140	1,757.9	2.59%	33.806	28,530	28,300	-230	-0.8%

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 (%)
USDV21	28-Oct-21	20	33.8	2.60%	0.11%	33.85	33.83	-0.02	0.0%
USDZ21	29-Dec-21	82	33.8	2.60%	0.11%	33.99	33.77	-0.22	-0.6%
USDH22	29-Dec-21	82	33.8	2.60%	0.11%	33.99	33.79	-0.20	-0.6%

* 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)										
		1,708	1,718	1,728	1,738	1,748	1,758	1,768	1,778	1,788	1,798	1,808
THB/USD	33.56	27,244	27,404	27,564	27,723	27,883	28,042	28,202	28,361	28,521	28,680	28,840
	33.61	27,285	27,445	27,605	27,764	27,924	28,084	28,244	28,403	28,563	28,723	28,883
	33.66	27,326	27,486	27,646	27,806	27,966	28,126	28,286	28,446	28,606	28,766	28,926
	33.71	27,366	27,526	27,687	27,847	28,007	28,167	28,328	28,488	28,648	28,808	28,969
	33.76	27,407	27,567	27,728	27,888	28,049	28,209	28,370	28,530	28,691	28,851	29,012
	33.81	27,447	27,608	27,769	27,930	28,090	28,251	28,412	28,572	28,733	28,894	29,055
	33.86	27,488	27,649	27,810	27,971	28,132	28,293	28,454	28,615	28,776	28,937	29,097
	33.91	27,529	27,690	27,851	28,012	28,173	28,335	28,496	28,657	28,818	28,979	29,140
	33.96	27,569	27,731	27,892	28,053	28,215	28,376	28,538	28,699	28,861	29,022	29,183
	34.01	27,610	27,771	27,933	28,095	28,256	28,418	28,580	28,741	28,903	29,065	29,226
	34.06	27,650	27,812	27,974	28,136	28,298	28,460	28,622	28,784	28,946	29,107	29,269