



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

14 ตุลาคม 2564

S50Z21 987.4 **S=973-980** **R=992-999**



กลยุทธ์: ยืนปิดเหนือเส้น 10 วันได้ต่อเลยทำให้หน้ายาวได้เปรียบอยู่ ดังนั้นหากเกิดการย่อตัวก็ตัดรอ OPEN LONG แถวๆแนวรับที่ให้แล้ว รอขายทำกำไรตอนดีดกลับขึ้นมาแต่ก็ควรวาง Trailing stop ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50Z21 ลงมาปิดต่ำกว่า 972 และในทางกลับกันหากซิ่งเด็งก่อนก็อาจเสี่ยง OPEN SHORT แถวๆแนวต้านที่ให้แล้วรอปิดทำกำไรตอนย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดยกำหนดจุดตัดขาดทุนหรือ CUT LOSS เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50Z21 ปิดเหนือ 1,000

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50V21	989.0	990.0	984.1	982.4	988.0	5.6	590	307
S50X21	990.9	990.9	985.2	982.1	988.4	6.3	41	161
S50Z21	985.7	991.0	982.6	981.2	987.6	6.2	129,675	343,351
S50H22	980.3	986.0	977.8	976.4	983.0	6.3	12,264	40,798
S50M22	977.1	984.2	976.0	974.6	980.9	6.2	3,374	11,893
S50U22	975.2	980.8	972.8	971.3	977.3	5.9	2,091	2,324

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDV21	33.88	33.88	33.45	33.87	33.45	-0.42	415	331
USDX21	33.76	33.76	33.44	33.89	33.49	-0.43	105	108
USDZ21	33.85	33.88	33.43	33.86	33.45	-0.40	27,771	111,254
USDH22	33.86	33.87	33.44	33.86	33.44	-0.42	9,756	14,455

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทหลักทรัพย์ (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	51,938	52,615	-677	20,167	22,786	-2,619	75,930	72,634	3,296
Metal Futures	16,074	18,774	-2,700	7,394	5,579	1,815	14,300	13,415	885
Single Stock Futures	27,774	30,580	-2,806	158,080	188,174	-30,094	210,427	177,527	32,900
Currency Futures	0	0	0	1,764	11,217	-9,453	36,283	26,830	9,453

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10V21	28,300	27,930	27,990	28,250	-260	3,525	3,075
GFV21	28,290	27,940	27,990	28,250	-260	141	225
GF10Z21	28,340	27,970	28,010	28,300	-280	4,561	8,322
GFZ21	28,290	27,970	28,000	28,290	-290	196	200
GOZ21	1,764	1,753	1,764	1,756	7	21,805	15,136
SVFZ21	23	23	23	23	0	57	875
GF10G22	28,370	28,010	28,050	28,340	-280	1,963	3,490
GFG22	28,360	28,030	28,060	28,300	-240	47	59

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	76	1.58%	0.0	989.66	992.9	987.4	-5.5	-0.6	-2.3
S50H22	30-Mar-22	167	1.67%	15.2	989.66	982.2	982.7	0.5	0.1	-7.0
S50M22	29-Jun-22	258	1.79%	2.0	989.66	1000.3	980.8	-19.5	-1.9	-8.9
S50U22	29-Sep-22	350	1.65%	17.3	989.66	988.2	977.2	-11.0	-1.1	-12.5

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	14	1,793.7	2.50%	33.258	28,383	27,890	-493	-1.7%
GFZ21	29-Dec-21	76	1,793.7	2.53%	33.258	28,506	27,960	-546	-1.9%
GFG22	25-Feb-22	134	1,793.7	2.59%	33.258	28,627	28,000	-627	-2.2%

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	14	33.255	2.60%	0.11%	33.29	33.29	0.00	0.0%
USDZ21	29-Dec-21	76	33.255	2.60%	0.11%	33.43	33.33	-0.10	-0.3%
USDH22	29-Dec-21	76	33.255	2.60%	0.11%	33.43	33.32	-0.11	-0.3%

* 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)										
		1,744	1,754	1,764	1,774	1,784	1,794	1,804	1,814	1,824	1,834	1,844
THB/USD	33.01	27,356	27,512	27,669	27,826	27,983	28,140	28,297	28,454	28,611	28,767	28,924
	33.06	27,397	27,554	27,711	27,868	28,025	28,183	28,340	28,497	28,654	28,811	28,968
	33.11	27,438	27,596	27,753	27,911	28,068	28,225	28,383	28,540	28,697	28,855	29,012
	33.16	27,480	27,637	27,795	27,953	28,110	28,268	28,425	28,583	28,741	28,898	29,056
	33.21	27,521	27,679	27,837	27,995	28,153	28,310	28,468	28,626	28,784	28,942	29,100
	33.26	27,563	27,721	27,879	28,037	28,195	28,353	28,511	28,669	28,827	28,985	29,143
	33.31	27,604	27,763	27,921	28,079	28,237	28,396	28,554	28,712	28,871	29,029	29,187
	33.36	27,646	27,804	27,963	28,121	28,280	28,438	28,597	28,755	28,914	29,073	29,231
	33.41	27,687	27,846	28,005	28,163	28,322	28,481	28,640	28,799	28,957	29,116	29,275
	33.46	27,729	27,888	28,047	28,206	28,365	28,524	28,683	28,842	29,001	29,160	29,319
	33.51	27,770	27,929	28,088	28,248	28,407	28,566	28,726	28,885	29,044	29,203	29,363