



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

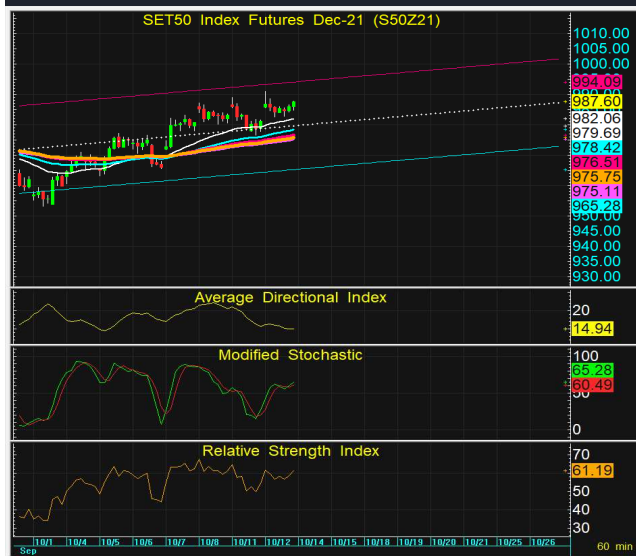
15 ตุลาคม 2564

S50Z21

987.9

S=974-979

R=994-999



กลยุทธ์: ยืนปิดเหนือเส้น 10 วันได้ต่อเลยทำให้หน่วยยาวได้เปรียบอยู่ ดังนั้นหากเกิดการย่อตัวก็ตัดกรอบ OPEN LONG แถวๆแนวรับที่ให้แล้ว รอขายทำกำไรตอนดีดกลับขึ้นมาแต่ก็ควรวาง Trailing stop ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50Z21 ลงมาปิดต่ำกว่า 973 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	994.1	994.1	984.3	988.0	987.8	-0.2	972	350
S50X21	992.0	992.4	986.5	988.4	986.5	-1.9	10	158
S50Z21	993.0	994.0	983.3	987.4	987.9	-	145,559	347,819
S50H22	987.0	989.0	978.5	982.7	983.0	-0.2	13,239	41,750
S50M22	985.8	987.0	976.4	980.8	980.8	-0.4	3,785	11,835
S50U22	981.1	983.3	973.5	977.2	977.5	0.2	2,110	2,914

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDV21	33.44	33.44	33.19	33.45	33.20	-0.25	287	410
USDX21	33.28	33.37	33.18	33.46	33.20	-0.26	170	147
USDZ21	33.36	33.39	33.16	33.46	33.19	-0.25	19,567	111,538
USDH22	33.37	33.39	33.19	33.44	33.20	-0.24	3,386	16,585

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทนักลงทุน (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	59,224	64,421	-5,197	25,938	26,525	-587	80,513	74,729	5,784
Metal Futures	47,615	39,798	7,817	9,236	6,954	2,282	31,953	42,052	-10,099
Single Stock Futures	20,347	47,551	-27,204	162,855	140,036	22,819	187,689	183,304	4,385
Currency Futures	0	0	0	933	8,856	-7,923	22,477	14,554	7,923

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10V21	28,340	27,790	28,310	27,990	330	2,899	2,989
GFV21	28,350	27,800	28,350	27,990	360	77	254
GF10Z21	28,380	27,830	28,360	28,020	340	5,164	7,969
GFZ21	28,370	27,900	28,370	28,000	370	57	208
GOZ21	1,801	1,757	1,799	1,764	35	67,126	14,528
SVFZ21	23	22	23	23	1	197	865
GF10G22	28,410	27,870	28,390	28,060	330	2,414	3,601
GFG22	28,370	27,950	28,370	28,060	340	46	64

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	75	1.58%	0.0	987.28	990.5	987.4	-3.1	-0.3	0.1
S50H22	30-Mar-22	166	1.67%	15.2	987.28	979.7	982.5	2.8	0.3	-4.8
S50M22	29-Jun-22	257	1.79%	2.0	987.28	997.8	980.4	-17.4	-1.7	-6.9
S50U22	29-Sep-22	349	1.65%	17.3	987.28	985.8	977.4	-8.4	-0.8	-9.9

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	13	1,797.3	2.50%	33.166	28,359	28,300	-59	-0.2%
GFZ21	29-Dec-21	75	1,797.3	2.53%	33.166	28,482	28,380	-102	-0.4%
GFG22	25-Feb-22	133	1,797.3	2.59%	33.166	28,603	28,410	-193	-0.7%

USD

	Expiration date	Days to maturity	Current FX	TH1YY	US1YY	Fair future price	Current future price	Premium / Discount from fair price (Bt)	premium / discount (%)
USDV21	28-Oct-21	13	33.16	2.60%	0.11%	33.19	33.21	0.02	0.1%
USDZ21	29-Dec-21	75	33.16	2.60%	0.11%	33.33	33.19	-0.14	-0.4%
USDH22	29-Dec-21	75	33.16	2.60%	0.11%	33.33	33.20	-0.13	-0.4%

* 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)										
		1,747	1,757	1,767	1,777	1,787	1,797	1,807	1,817	1,827	1,837	1,847
THB/USD	32.91	27,333	27,490	27,646	27,802	27,959	28,115	28,272	28,428	28,585	28,741	28,897
	32.96	27,375	27,531	27,688	27,845	28,001	28,158	28,315	28,471	28,628	28,785	28,941
	33.01	27,416	27,573	27,730	27,887	28,044	28,201	28,358	28,515	28,671	28,828	28,985
	33.06	27,458	27,615	27,772	27,929	28,086	28,243	28,401	28,558	28,715	28,872	29,029
	33.11	27,499	27,657	27,814	27,971	28,129	28,286	28,444	28,601	28,758	28,916	29,073
	33.16	27,541	27,698	27,856	28,014	28,171	28,329	28,486	28,644	28,802	28,959	29,117
	33.21	27,582	27,740	27,898	28,056	28,214	28,372	28,529	28,687	28,845	29,003	29,161
	33.26	27,624	27,782	27,940	28,098	28,256	28,414	28,572	28,730	28,889	29,047	29,205
	33.31	27,665	27,824	27,982	28,140	28,299	28,457	28,615	28,774	28,932	29,090	29,249
	33.36	27,707	27,865	28,024	28,183	28,341	28,500	28,658	28,817	28,975	29,134	29,293
	33.41	27,748	27,907	28,066	28,225	28,384	28,542	28,701	28,860	29,019	29,178	29,336