

25 ตุลาคม 2564



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

S50Z21 988.2 **S=980-983** **R=992-997**



กลยุทธ์: ยืนปิดเหนือเส้น 10 วันได้ต่อจึงทำให้น้ำยาวได้เปรียบอยู่จนกว่าจะหลุดลงมาปิดต่ำกว่าใหม่เลยยังสามารถเล่นได้ทั้งสองหน้า
ตั้งนี้กล่าวคือ หากซิงเต็งก่อนก็อาจเสี่ยง OPEN SHORT แถวๆแนวต้านที่ให้แล้วรอปิดทำกำไรตอนย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดย
กำหนดจุดตัดขาดทุนหรือ CUT LOSS เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50Z21 ปิดเหนือ 998
ในทางกลับกันหากเกิดการย่อตัวหรือ OPEN LONG แถวๆแนวรับที่ให้แล้วรอขายทำกำไรตอนดีดกลับขึ้นมาแต่ก็ควรวาง Trailing stop
ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50Z21 ลงมาปิดต่ำกว่า 979

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50V21	987.4	989.0	983.5	983.2	988.4	5.2	180	216
S50X21	987.4	989.3	987.0	981.9	989.3	7.4	10	159
S50Z21	986.2	989.3	982.0	983.3	988.5	4.9	123,293	351,707
S50H22	982.1	984.3	977.3	978.5	983.5	4.9	12,000	43,647
S50M22	979.2	982.6	976.0	977.0	981.9	4.8	3,971	12,986
S50U22	976.6	979.5	972.8	974.0	978.6	4.4	1,882	3,662

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDV21	33.36	33.42	33.36	33.37	33.39	0.02	109	287
USDX21	33.35	33.35	33.35	33.36	33.35	0.02	1	75
USDZ21	33.38	33.42	33.33	33.36	33.40	0.04	8,036	106,608
USDH22	33.39	33.42	33.35	33.38	33.40	0.02	1,314	17,205

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทหลักทรัพย์ (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	54,733	45,637	9,096	21,427	24,626	-3,199	65,176	71,073	-5,897
Metal Futures	24,465	18,682	5,783	5,657	4,004	1,653	15,298	22,734	-7,436
Single Stock Futures	24,685	14,452	10,233	110,284	139,198	-28,914	131,045	112,364	18,681
Currency Futures	0	0	0	1,044	1,768	-724	8,416	7,692	724

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10V21	28,350	28,170	28,340	28,200	140	873	2,267
GFV21	28,330	28,170	28,330	28,240	90	23	177
GF10Z21	28,390	28,210	28,380	28,250	140	3,402	9,324
GFZ21	28,380	28,280	28,380	28,190	190	35	215
GOZ21	1,791	1,778	1,790	1,781	9	32,317	14,382
SVFZ21	25	24	24	24	0	225	861
GF10G22	28,410	28,250	28,410	28,260	150	1,480	4,073
GFG22	28,410	28,250	28,410	28,290	90	7	79

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	65	1.58%	0.0	988.81	991.6	988.2	-3.4	-0.3	-0.6
S50H22	30-Mar-22	156	1.67%	15.2	988.81	980.8	983.4	2.6	0.3	-5.4
S50M22	29-Jun-22	247	1.79%	2.0	988.81	988.9	981.8	-17.1	-1.7	-7.0
S50U22	29-Sep-22	339	1.65%	17.3	988.81	986.9	978.4	-8.5	-0.9	-10.4

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	3	1,793.3	2.50%	33.266	28,362	28,300	-62	-0.2%
GFZ21	29-Dec-21	65	1,793.3	2.53%	33.266	28,484	28,300	-184	-0.6%
GFG22	25-Feb-22	123	1,793.3	2.59%	33.266	28,605	28,390	-215	-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	3	33.26	2.60%	0.11%	33.27	33.40	0.13	0.4%
USDZ21	29-Dec-21	65	33.26	2.60%	0.11%	33.41	33.38	-0.03	-0.1%
USDH22	29-Dec-21	65	33.26	2.60%	0.11%	33.41	33.37	-0.04	-0.1%

* 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)										
		1,743	1,753	1,763	1,773	1,783	1,793	1,803	1,813	1,823	1,833	1,843
THB/USD	33.01	27,353	27,510	27,667	27,824	27,981	28,138	28,295	28,452	28,609	28,766	28,922
	33.06	27,395	27,552	27,709	27,866	28,023	28,181	28,338	28,495	28,652	28,809	28,966
	33.11	27,436	27,594	27,751	27,908	28,066	28,223	28,381	28,538	28,695	28,853	29,010
	33.16	27,478	27,635	27,793	27,951	28,108	28,266	28,423	28,581	28,739	28,896	29,054
	33.21	27,519	27,677	27,835	27,993	28,151	28,308	28,466	28,624	28,782	28,940	29,098
	33.26	27,561	27,719	27,877	28,035	28,193	28,351	28,509	28,667	28,825	28,983	29,142
	33.31	27,602	27,760	27,919	28,077	28,235	28,394	28,552	28,710	28,869	29,027	29,185
	33.36	27,643	27,802	27,961	28,119	28,278	28,436	28,595	28,753	28,912	29,071	29,229
	33.41	27,685	27,844	28,002	28,161	28,320	28,479	28,638	28,797	28,955	29,114	29,273
	33.46	27,726	27,885	28,044	28,203	28,362	28,522	28,681	28,840	28,999	29,158	29,317
	33.51	27,768	27,927	28,086	28,246	28,405	28,564	28,723	28,883	29,042	29,201	29,361