



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

27 ตุลาคม 2564

S50Z21 **984** **S=972-978** **R=987-993**



กลยุทธ์: ตั้งกลับมาปิดคลอเคลียเส้น 10 วันใหม่ จึงทำให้เล่นได้ทั้งสองหน้าเลยขอวางแผนการเล่นตามนี้กล่าวคือ หากซิงเด็งก่อนก็ OPEN SHORT แถวๆแนวต้านที่ให้แล้วรอปิดทำกำไรตอนย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดยกำหนดจุดตัดขาดทุนหรือ CUT LOSS เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50Z21 ปิดเหนือ 994 ในทางกลับกันหากเกิดการย่อตัวลงมาก่อนก็เสี่ยง OPEN LONG แถวๆแนวรับที่ให้แล้วรอขายทำกำไรตอนดีดกลับขึ้นมาแต่ก็ควรวาง Trailing stop ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50Z21 ลงมาปิดต่ำกว่า 971

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50V21	982.6	985.8	977.9	981.1	985.8	3.8	498	128
S50X21	982.4	984.6	976.5	982.8	984.4	1.6	117	186
S50Z21	980.3	984.8	975.9	980.2	984.2	3.8	159,083	360,489
S50H22	975.0	979.9	971.5	975.7	979.2	3.5	11,797	42,677
S50M22	974.0	978.2	970.1	974.2	977.8	3.6	3,156	14,228
S50U22	971.0	975.2	967.0	971.2	974.6	3.3	1,294	4,315

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDV21	33.15	33.17	33.05	33.13	33.11	-0.02	39	372
USDX21	33.11	33.11	33.09	33.14	33.09	-0.03	51	64
USDZ21	33.14	33.19	33.06	33.16	33.13	-0.03	12,843	105,552
USDH22	33.16	33.19	33.05	33.19	33.14	-0.05	1,721	18,268

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทนักลงทุน (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	79,767	63,209	16,558	26,148	28,566	-2,418	70,030	84,170	-14,140
Metal Futures	13,403	11,910	1,493	3,951	3,607	344	11,135	12,972	-1,837
Single Stock Futures	12,458	20,668	-8,210	92,306	96,290	-3,984	108,751	96,557	12,194
Currency Futures	0	0	0	1,524	4,149	-2,625	13,130	10,505	2,625

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10V21	28,460	28,340	28,390	28,350	30	894	1,929
GFV21	28,420	28,370	28,370	28,320	50	5	173
GF10Z21	28,500	28,370	28,430	28,380	40	1,352	9,689
GFZ21	28,500	28,390	28,390	28,350	40	23	224
GOZ21	1,812	1,803	1,807	1,802	4	21,045	16,043
SVFZ21	25	24	24	24	0	121	838
GF10G22	28,530	28,420	28,460	28,410	50	780	4,186
GFG22	28,490	28,420	28,420	28,370	70	19	98

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	63	1.58%	0.0	984.04	986.7	984	-2.7	-0.3	0.0
S50H22	30-Mar-22	154	1.67%	15.2	984.04	975.9	979.2	3.3	0.3	-4.8
S50M22	29-Jun-22	245	1.79%	2.0	984.04	993.9	977.8	-16.1	-1.6	-6.2
S50U22	29-Sep-22	337	1.65%	17.3	984.04	981.9	974.5	-7.4	-0.8	-9.5

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	1	1,792.5	2.50%	33.176	28,269	28,330	61	0.2%
GFZ21	29-Dec-21	63	1,792.5	2.53%	33.176	28,391	28,350	-41	-0.1%
GFG22	25-Feb-22	121	1,792.5	2.59%	33.176	28,511	28,380	-131	-0.5%

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	1	33.17	2.60%	0.11%	33.17	33.14	-0.03	-0.1%
USDZ21	29-Dec-21	63	33.17	2.60%	0.11%	33.31	33.23	-0.08	-0.2%
USDH22	29-Dec-21	63	33.17	2.60%	0.11%	33.31	33.21	-0.10	-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)										
		1,743	1,753	1,763	1,773	1,783	1,793	1,803	1,813	1,823	1,833	1,843
THB/USD	32.92	27,266	27,423	27,579	27,736	27,892	28,049	28,205	28,362	28,518	28,675	28,831
	32.97	27,308	27,464	27,621	27,778	27,935	28,091	28,248	28,405	28,561	28,718	28,875
	33.02	27,349	27,506	27,663	27,820	27,977	28,134	28,291	28,448	28,605	28,762	28,919
	33.07	27,391	27,548	27,705	27,862	28,019	28,177	28,334	28,491	28,648	28,805	28,962
	33.12	27,432	27,589	27,747	27,904	28,062	28,219	28,377	28,534	28,691	28,849	29,006
	33.17	27,473	27,631	27,789	27,946	28,104	28,262	28,419	28,577	28,735	28,892	29,050
	33.22	27,515	27,673	27,831	27,989	28,146	28,304	28,462	28,620	28,778	28,936	29,094
	33.27	27,556	27,714	27,872	28,031	28,189	28,347	28,505	28,663	28,821	28,979	29,138
	33.32	27,598	27,756	27,914	28,073	28,231	28,390	28,548	28,706	28,865	29,023	29,181
	33.37	27,639	27,798	27,956	28,115	28,274	28,432	28,591	28,749	28,908	29,067	29,225
	33.42	27,680	27,839	27,998	28,157	28,316	28,475	28,634	28,792	28,951	29,110	29,269