



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

28 ตุลาคม 2564

S50Z21 975.9 **S=965-970** **R=979-984**



กลยุทธ์: ลงมาปิดได้เส้น 10 วันใหม่ จึงทำให้หน้าสั้นพลิกกลับมาได้เปรียบใหม่ แต่ก็ขอวางแผนการเล่นตามนี้กล่าวคือ หากเกิดการย่อตัวลงมาก่อนก็เสี่ยง OPEN LONG แถวๆแนวรับที่ให้เพื่อลุ้นการดีดกลับในระหว่างวันแต่ก็ควรวาง Trailing stop ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50Z21 ลงมาปิดต่ำกว่า 964

ในทางกลับกันหากซิ่งดังก่อนก็ OPEN SHORT แถวๆแนวต้านที่ให้แล้วรอปิดทำกำไรตอนย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดยกำหนดจุดตัดขาดทุนหรือ CUT LOSS เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50Z21 ปิดเหนือเส้น 10 วันที่ 985

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50V21	982.1	982.1	976.3	984.9	976.3	-8.1	352	80
S50X21	980.6	980.6	976.5	984.4	977.0	-7.5	87	181
S50Z21	981.5	981.6	975.5	984.0	975.8	-8.1	132,727	360,399
S50H22	976.6	976.7	971.3	979.2	971.3	-7.8	10,108	41,841
S50M22	976.0	976.0	970.1	977.8	970.2	-7.6	2,178	14,898
S50U22	972.0	972.0	967.0	974.5	967.1	-7.3	1,532	4,711

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDV21	33.12	33.38	33.12	33.11	33.38	0.26	242	241
USDX21	33.16	33.28	33.16	33.11	33.28	0.23	60	63
USDZ21	33.12	33.39	33.12	33.13	33.39	0.26	19,945	103,396
USDH22	33.14	33.40	33.14	33.14	33.37	0.23	2,708	17,806

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทหลักทรัพย์ (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	44,054	60,456	-16,402	24,522	27,089	-2,567	78,408	59,439	18,969
Metal Futures	23,979	30,565	-6,586	5,906	7,491	-1,585	26,003	17,832	8,171
Single Stock Futures	23,885	12,603	11,282	100,070	88,328	11,742	93,304	116,328	-23,024
Currency Futures	0	0	0	6,856	2,422	4,434	16,099	20,533	-4,434

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10V21	28,370	28,170	28,320	28,380	-60	1,270	1,689
GFV21	28,360	28,200	28,320	28,370	-170	45	172
GF10Z21	28,420	28,210	28,370	28,420	-70	4,074	9,241
GFZ21	28,390	28,210	28,350	28,390	-40	55	220
GOZ21	1,807	1,785	1,791	1,806	-16	39,051	15,711
SVFZ21	24	24	24	24	0	167	816
GF10G22	28,440	28,240	28,400	28,460	-60	2,029	4,049
GFG22	28,420	28,250	28,360	28,440	-80	33	94

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	62	1.58%	0.0	977.32	980.0	975.9	-4.1	-0.4	-1.4
S50H22	30-Mar-22	153	1.67%	15.2	977.32	969.1	971.4	2.3	0.2	-5.9
S50M22	29-Jun-22	244	1.79%	2.0	977.32	987.1	970.2	-16.9	-1.7	-7.1
S50U22	29-Sep-22	336	1.65%	17.3	977.32	975.0	967.2	-7.8	-0.8	-10.1

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	0	1,797.8	2.50%	33.286	28,444	28,360	-84	-0.3%
GFZ21	29-Dec-21	62	1,797.8	2.53%	33.286	28,567	28,440	-127	-0.4%
GFG22	25-Feb-22	120	1,797.8	2.59%	33.286	28,688	28,480	-208	-0.7%

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	0	33.28	2.60%	0.11%	33.28	33.24	-0.04	-0.1%
USDZ21	29-Dec-21	62	33.28	2.60%	0.11%	33.42	33.26	-0.16	-0.5%
USDH22	29-Dec-21	62	33.28	2.60%	0.11%	33.42	33.29	-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)										
		1,748	1,758	1,768	1,778	1,788	1,798	1,808	1,818	1,828	1,838	1,848
THB/USD	33.03	27,441	27,598	27,755	27,912	28,069	28,226	28,383	28,540	28,697	28,854	29,011
	33.08	27,482	27,639	27,797	27,954	28,111	28,268	28,426	28,583	28,740	28,897	29,055
	33.13	27,524	27,681	27,839	27,996	28,154	28,311	28,469	28,626	28,784	28,941	29,098
	33.18	27,565	27,723	27,881	28,038	28,196	28,354	28,512	28,669	28,827	28,985	29,142
	33.23	27,607	27,765	27,923	28,081	28,239	28,397	28,555	28,712	28,870	29,028	29,186
	33.28	27,648	27,807	27,965	28,123	28,281	28,439	28,597	28,756	28,914	29,072	29,230
	33.33	27,690	27,848	28,007	28,165	28,324	28,482	28,640	28,799	28,957	29,116	29,274
	33.38	27,731	27,890	28,049	28,207	28,366	28,525	28,683	28,842	29,001	29,159	29,318
	33.43	27,773	27,932	28,091	28,250	28,409	28,567	28,726	28,885	29,044	29,203	29,362
	33.48	27,814	27,974	28,133	28,292	28,451	28,610	28,769	28,928	29,088	29,247	29,406
	33.53	27,856	28,015	28,175	28,334	28,494	28,653	28,812	28,972	29,131	29,290	29,450