



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

29 ตุลาคม 2564

S50Z21 975 **S=965-970** **R=979-984**



กลยุทธ์: ปิดได้เส้น 10 วันต่อ จึงทำให้น้ำขึ้นได้เปรียบจนกว่าจะปิดเหนือเส้น 10 วันได้ใหม่เลขอวางแผนการ TRADE ตามนี้กล่าวคือ หากซิงดังก่อนก็ OPEN SHORT แถวๆแนวด้านที่ให้แล้วรอปิดทำกำไรตอนย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดยกำหนดจุดตัดขาดทุนหรือ CUT LOSS เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50Z21 ปิดเหนือ 985 ในทางกลับกันหากเกิดการย่อตัวลงมาก่อนก็เสี่ยง OPEN LONG แถวๆแนวรับที่ให้แล้วรอขายทำกำไรตอนดีดกลับขึ้นมาแต่ก็ควรวาง Trailing stop ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50Z21 ลงมาปิดต่ำกว่า 964

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50V21	973.9	977.1	973.9	976.8	977.0	0.74	26	77
S50X21	973.2	977.3	973.1	976.9	975.7	-1.2	127	199
S50Z21	973.8	978.7	972.1	975.9	975.1	-0.9	109,163	359,159
S50F22	971.0	973.5	971.0	973.0	972.3	-0.7	8	6
S50H22	969.1	974.2	968.0	971.4	970.8	-0.8	8,186	41,728
S50M22	968.1	973.0	966.8	970.2	969.5	-0.8	2,570	14,959

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDV21	33.26	33.26	33.24	33.37	33.24	-0.11	24	220
USDX21	33.29	33.33	33.26	33.34	33.33	-0.03	128	131
USDZ21	33.35	33.35	33.25	33.39	33.32	-0.07	8,721	102,321
USDF22	-	-	-	33.27	-	0.02	-	-

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทนักลงทุน (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	49,067	41,744	7,323	16,690	22,516	-5,826	55,181	56,678	-1,497
Metal Futures	31,709	24,239	7,470	8,429	6,359	2,070	18,180	27,720	-9,540
Single Stock Futures	13,299	13,430	-131	67,582	86,993	-19,411	100,293	80,751	19,542
Currency Futures	0	0	0	1,083	2,403	-1,320	9,300	7,980	1,320

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10V21	28,520	28,240	28,510	28,320	119	1,166	1,350
GFV21	28,550	28,360	28,530	28,200	239	50	138
GF10Z21	28,550	28,260	28,490	28,350	130	6,124	9,965
GFZ21	28,560	28,270	28,520	28,350	170	96	231
GOZ21	1,806	1,788	1,800	1,790	9	38,856	16,982
SVFZ21	24	24	24	24	0	239	829
GF10G22	28,580	28,300	28,520	28,400	120	2,317	4,486
GFG22	28,600	28,300	28,520	28,360	160	32	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	61	1.58%	0.0	976.67	979.3	975	-4.3	-0.4	-1.7
S50H22	30-Mar-22	152	1.67%	15.2	976.67	968.4	970.6	2.2	0.2	-6.1
S50M22	29-Jun-22	243	1.79%	2.0	976.67	986.4	969.4	-17.0	-1.7	-7.3
S50U22	29-Sep-22	335	1.65%	17.3	976.67	974.3	966.5	-7.8	-0.8	-10.2

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 (%)
GFZ21	29-Dec-21	61	1,801.6	2.50%	33.188	28,540	28,480	-60	-0.2%
GFG22	25-Feb-22	119	1,801.6	2.53%	33.188	28,656	28,520	-136	-0.5%
GFJ22	28-Apr-22	181	1,801.6	2.59%	33.188	28,788	28,500	-288	-1.0%

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 (%)
USDZ21	29-Dec-21	61	33.185	2.60%	0.11%	33.32	33.21	-0.11	-0.3%
USDF22	28-Jan-22	91	33.185	2.60%	0.11%	33.39	33.29	-0.10	-0.3%
USDH22	30-Mar-22	152	33.185	2.60%	0.11%	33.53	33.22	-0.31	-0.9%

* 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)										
		1,752	1,762	1,772	1,782	1,792	1,802	1,812	1,822	1,832	1,842	1,852
THB/USD	32.94	27,421	27,578	27,734	27,891	28,047	28,204	28,361	28,517	28,674	28,830	28,987
	32.99	27,463	27,620	27,776	27,933	28,090	28,247	28,404	28,560	28,717	28,874	29,031
	33.04	27,504	27,661	27,819	27,976	28,133	28,290	28,447	28,604	28,761	28,918	29,075
	33.09	27,546	27,703	27,861	28,018	28,175	28,332	28,490	28,647	28,804	28,961	29,119
	33.14	27,588	27,745	27,903	28,060	28,218	28,375	28,533	28,690	28,848	29,005	29,163
	33.19	27,629	27,787	27,945	28,103	28,260	28,418	28,576	28,734	28,891	29,049	29,207
	33.24	27,671	27,829	27,987	28,145	28,303	28,461	28,619	28,777	28,935	29,093	29,251
	33.29	27,713	27,871	28,029	28,187	28,345	28,504	28,662	28,820	28,978	29,137	29,295
	33.34	27,754	27,913	28,071	28,230	28,388	28,546	28,705	28,863	29,022	29,180	29,339
	33.39	27,796	27,955	28,113	28,272	28,431	28,589	28,748	28,907	29,065	29,224	29,383
	33.44	27,837	27,996	28,155	28,314	28,473	28,632	28,791	28,950	29,109	29,268	29,427