



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

04 พฤศจิกายน 2564

**S50Z21**

971.9

**S=957-964**

**R=975-979**



กลยุทธ์: ปิดได้เส้น 10 วันต่อ จึงทำให้หน้าสั้นได้เปรียบจนกว่าจะปิดเหนือเส้น 10 วันได้ใหม่เลยขอวางแผนการ TRADE ตามนี้กล่าวคือ หากซิงดังก่อนก็ OPEN SHORT แถวๆแนวด้านที่ให้แล้วรอปิดทำกำไรตอนย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดยกำหนดจุดตัดขาดทุนหรือ CUT LOSS เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50Z21 ปิดเหนือ 980 ในทางกลับกันหากเกิดการย่อตัวลงมาก่อนก็เสี่ยง OPEN LONG แถวๆแนวรับที่ให้แล้วรอขายทำกำไรตอนดีดกลับขึ้นมาแต่ก็ควรวาง Trailing stop ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50Z21 ลงมาปิดต่ำกว่า 956

**สรุปตลาด SET50 Index Futures**

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50X21	975.4	976.0	969.6	973.7	972.6	-1.1	52	168
S50Z21	973.8	975.0	968.0	971.5	972.0	0.4	130,549	360,469
S50F22	970.3	972.3	966.6	970.1	969.2	-0.9	31	49
S50H22	969.0	970.7	964.0	967.4	967.7	0.2	10,917	40,224
S50M22	967.1	969.3	962.9	966.1	966.4	0.3	2,541	16,048
S50U22	964.7	966.5	959.8	963.1	963.5	0.3	753	5,372

**สรุปตลาด Currency Futures**

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDZ21	-	-	-	33.25	-	0.09	-	234
USDZ21	33.26	33.38	33.25	33.27	33.33	0.06	6,122	97,862
USDF22	33.35	33.35	33.35	33.28	33.35	0.06	10	27
USDH22	33.26	33.40	33.26	33.28	33.34	0.06	1,014	19,349

**สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทนักลงทุน (สัญญา)**

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	58,952	53,585	5,367	23,157	23,623	-466	62,734	67,635	-4,901
Metal Futures	16,535	22,275	-5,740	5,311	7,811	-2,500	19,622	11,382	8,240
Single Stock Futures	43,062	20,720	22,342	201,266	154,802	46,464	157,727	226,533	-68,806
Currency Futures	0	0	0	390	1,778	-1,388	6,756	5,368	1,388

**สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures**

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10Z21	28,390	28,220	28,240	28,400	-170	2,928	7,690
GFZ21	28,390	28,240	28,270	28,380	10	52	231
GOZ21	1,796	1,782	1,784	1,797	-13	27,113	15,289
SVFZ21	24	23	24	24	0	173	866
GF10G22	28,420	28,270	28,280	28,440	-170	1,274	3,948
GFG22	28,380	28,380	28,380	28,440	-30	2	118
GOH22	1,799	1,785	1,787	1,799	-12	8,750	7,092
SVFH22	25	24	24	24	0	258	714

**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	55	1.58%	0.0	972.64	975.0	971.9	-3.1	-0.3	-0.7
S50H22	30-Mar-22	146	1.67%	15.2	972.64	964.1	967.6	3.5	0.4	-5.0
S50M22	29-Jun-22	237	1.79%	2.0	972.64	982.0	966.4	-15.6	-1.6	-6.2
S50U22	29-Sep-22	329	1.65%	17.3	972.64	970.0	963.4	-6.6	-0.7	-9.2

**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	55	1,763.6	2.50%	33.278	28,002	28,100	98	0.3%
GFG22	25-Feb-22	113	1,763.6	2.53%	33.278	28,116	28,140	24	0.1%
GFJ22	28-Apr-22	175	1,763.6	2.59%	33.278	28,246	28,180	-66	-0.2%

**USD**

	Expiration date	Days to maturity	Current FX	TH1YY	US1YY	Fair future price	Current future price	Premium / Discount from fair price (Bt)	premium / discount (%)
USDZ21	29-Dec-21	55	33.275	2.60%	0.11%	33.40	33.44	0.04	0.1%
USDF22	28-Jan-22	85	33.275	2.60%	0.11%	33.47	33.34	-0.13	-0.4%
USDH22	30-Mar-22	146	33.275	2.60%	0.11%	33.61	33.45	-0.16	-0.5%

\* 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)										
		1,714	1,724	1,734	1,744	1,754	1,764	1,774	1,784	1,794	1,804	1,814
THB/USD	<b>33.02</b>	26,891	27,048	27,205	27,362	27,519	27,676	27,833	27,990	28,147	28,304	28,461
	<b>33.07</b>	26,932	27,089	27,247	27,404	27,561	27,718	27,875	28,032	28,190	28,347	28,504
	<b>33.12</b>	26,973	27,130	27,288	27,445	27,603	27,760	27,917	28,075	28,232	28,390	28,547
	<b>33.17</b>	27,014	27,171	27,329	27,487	27,644	27,802	27,960	28,117	28,275	28,432	28,590
	<b>33.22</b>	27,054	27,212	27,370	27,528	27,686	27,844	28,002	28,160	28,317	28,475	28,633
	<b>33.27</b>	27,095	27,253	27,411	27,569	27,728	27,886	28,044	28,202	28,360	28,518	28,676
	<b>33.32</b>	27,136	27,294	27,453	27,611	27,769	27,928	28,086	28,244	28,403	28,561	28,719
	<b>33.37</b>	27,177	27,335	27,494	27,652	27,811	27,970	28,128	28,287	28,445	28,604	28,762
	<b>33.42</b>	27,217	27,376	27,535	27,694	27,853	28,011	28,170	28,329	28,488	28,647	28,806
	<b>33.47</b>	27,258	27,417	27,576	27,735	27,894	28,053	28,212	28,371	28,531	28,690	28,849
	<b>33.52</b>	27,299	27,458	27,617	27,777	27,936	28,095	28,255	28,414	28,573	28,732	28,892