

11 มีนาคม 2565


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

S50H22
994.4
S=979-984
R=998-1,003


กลยุทธ์: ยังคงเล่นได้สั้น 10 วันที่ 999 ต่อเลยทำให้หน้าสั้นเป็นฝ่ายได้เปรียบอยู่จึงขอวางแผนการ Trade ตามนี้กล่าวคือหากซิงติดกลับขึ้นมาก่อนก็ให้ไป OPEN SHORT แถวๆแนวต้านที่ให้เพื่อรอปิดตัวทำกำไรตอนอ่อนตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดยกำหนดจุดตัดขาดทุนหรือ CUT LOSS เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50H22 ปิดเหนือ 1,004

ในทางกลับกันหากซิงย่อลงมาก่อนก็อาจเล่นสวนด้วยการเสี่ยง OPEN LONG แถวๆแนวรับที่ให้แล้วรอขายทำกำไรตอนติดกลับขึ้นมาใน Intra-day trade แต่ก็ควรวาง Trailing stop ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือเมื่อ S50H22 ลงมาปิดต่ำกว่า 978

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50H22	997.1	999.8	992.0	989.1	993.8	5.3	205,252	350,574
S50J22	996.8	996.8	991.7	987.2	992.0	4.8	20	163
S50K22	994.2	996.2	991.7	985.5	991.7	6.2	6	50
S50M22	993.0	994.3	986.8	984.7	988.6	4.3	36,399	54,028
S50U22	990.8	990.8	982.1	980.1	983.9	4.2	5,170	19,524
S50Z22	984.6	989.0	981.4	979.3	983.5	4.7	2,654	9,105

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDH22	33.08	33.17	32.97	33.07	33.15	0.07	20,061	64,252
USDJ22	33.05	33.11	32.97	33.07	33.11	0.04	66	334
USDK22	33.04	33.11	32.99	33.07	33.11	0.04	211	100
USDM22	33.04	33.13	32.95	33.04	33.08	0.04	7,661	51,580

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทหลักทรัพย์ (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	102,502	71,641	30,861	43,037	42,019	1,018	103,962	135,841	-31,879
Metal Futures	56,271	65,047	-8,776	14,525	16,756	-2,231	48,408	37,401	11,007
Single Stock Futures	19,060	19,222	-162	94,861	98,767	-3,906	109,201	105,133	4,068
Currency Futures	0	0	0	7,861	9,635	-1,774	20,138	18,359	1,779

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GOH22	2,023	1,975	1,984	2,019	-36	68,583	18,178
SVFH22	26	25	26	26	0	94	1,013
GF10J22	31,790	31,050	31,290	31,770	-530	9,045	9,885
GFJ22	31,660	31,110	31,210	31,830	-620	164	297
GF10M22	31,790	31,050	31,290	31,790	-540	3,724	7,069
GFM22	31,610	31,100	31,220	31,720	-500	76	322
GOM22	2,029	1,981	1,991	2,024	-36	35,428	18,840
SVFM22	27	26	26	26	-1	321	784



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)
S50H22	30-Mar-22	19	1.58%	0.0	998.41	999.2	994.4	-4.8	-0.5	-4.0
S50M22	29-Jun-22	110	1.67%	15.2	998.41	988.3	989	0.7	0.1	-9.4
S50U22	29-Sep-22	202	1.79%	2.0	998.41	1006.4	984.3	-22.1	-2.2	-14.1
S50Z22	29-Dec-22	293	1.65%	17.3	998.41	994.5	984	-10.5	-1.1	-14.4

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 (%)
GFG22	25-Feb-22	-14	1,998.1	2.50%	33.205	31,506	29,565	-1,942	-6.2%
GFJ22	28-Apr-22	48	1,998.1	2.53%	33.205	31,642	31,440	-202	-0.6%
GFM22	29-Jun-22	110	1,998.1	2.59%	33.205	31,784	31,500	-284	-0.9%

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 (%)
USDF22	28-Jan-22	-42	33.195	2.60%	0.11%	33.10	33.24	0.14	0.4%
USDH22	30-Mar-22	19	33.195	2.60%	0.11%	33.24	33.13	-0.11	-0.3%
USDM22	29-Jun-22	110	33.195	2.60%	0.11%	33.45	33.11	-0.34	-1.0%

* 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)										
		1,948	1,958	1,968	1,978	1,988	1,998	2,008	2,018	2,028	2,038	2,048
THB/USD	32.95	30,507	30,663	30,820	30,976	31,133	31,290	31,446	31,603	31,759	31,916	32,073
	33.00	30,553	30,710	30,867	31,023	31,180	31,337	31,494	31,651	31,808	31,964	32,121
	33.05	30,599	30,756	30,913	31,070	31,228	31,385	31,542	31,699	31,856	32,013	32,170
	33.10	30,646	30,803	30,960	31,117	31,275	31,432	31,589	31,747	31,904	32,061	32,219
	33.15	30,692	30,849	31,007	31,165	31,322	31,480	31,637	31,795	31,952	32,110	32,267
	33.20	30,738	30,896	31,054	31,212	31,369	31,527	31,685	31,843	32,000	32,158	32,316
	33.25	30,784	30,942	31,101	31,259	31,417	31,575	31,733	31,891	32,049	32,207	32,365
	33.30	30,831	30,989	31,147	31,306	31,464	31,622	31,780	31,939	32,097	32,255	32,413
	33.35	30,877	31,036	31,194	31,353	31,511	31,670	31,828	31,987	32,145	32,304	32,462
	33.40	30,923	31,082	31,241	31,400	31,558	31,717	31,876	32,035	32,193	32,352	32,511
	33.45	30,970	31,129	31,288	31,447	31,606	31,765	31,923	32,082	32,241	32,400	32,559