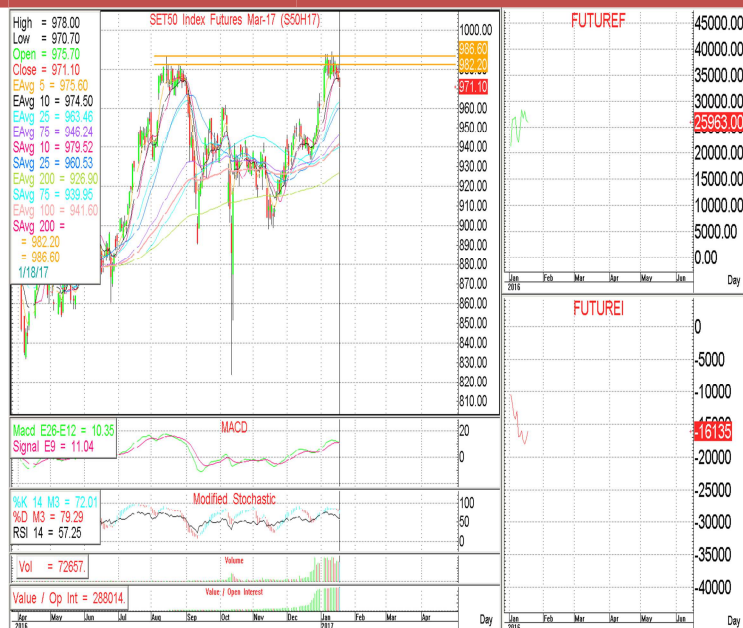


19 มกราคม 2560

 นักวิเคราะห์: กมลชัย พลอินทวงษ์
 เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 18239
 Tel. (662) 801 9341

S50H17 971.1

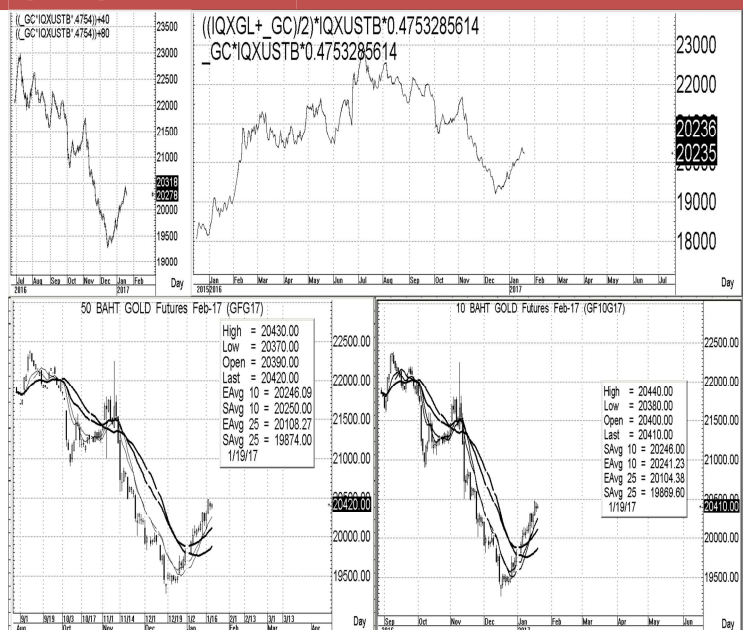


S= 963-968 R=975-980



กลยุทธ์: **LONG** แถวๆกรอบแนวรับที่ 1 แล้วรอทำกำไร แถวๆกรอบแนวต้านที่บอกโดยกำหนดจุดตัดขาดทุน (STOPLOSS) เมื่อราคาออกจากกรอบที่ 5 Points เพื่อทำ Risk Control

GFG17 20,420



S=20,150-20,250 R=20,500-20,600



กลยุทธ์: **LONG** แถวๆกรอบแนวรับที่ 1 แล้วรอทำกำไร แถวๆกรอบแนวต้านที่บอกโดยกำหนดจุดตัดขาดทุน (STOPLOSS) เมื่อราคาออกจากกรอบที่ 100 บาทเพื่อทำ Risk Control

ปล: หาก SET50, GOLD SPOT, TFEX ยังคงสามารถขึ้นปิดเหนือ MAV(10) ได้ต่อทางขึ้นก็จะได้เปรียบกว่าทางลงอยู่

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50F17	961.1	977.1	961.1	975.5	972.8	-2.8	22	227
S50G17	972.5	972.7	972.5	974.4	972.7	-1.8	3	44
S50H17	975.7	978.0	970.7	974.2	971.1	-3.1	72,657	288,014
S50M17	970.2	972.1	965.3	969.0	965.9	-3.2	3,959	11,205
S50U17	964.4	966.2	959.4	962.7	959.6	-3.0	449	3,403
S50Z17	962.6	966.0	959.7	962.4	960.0	-2.5	208	1,073

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDF17	35.24	35.29	35.24	35.29	35.29	-	16	77
USDG17	35.25	35.32	35.25	35.32	35.29	-0.03	18	192
USDH17	35.31	35.33	35.27	35.39	35.28	-0.11	1410	9,967
USDM17	35.36	35.36	35.32	35.41	35.35	-0.06	63	3,116

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทนักลงทุน (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	14,866	15,299	-433	15,848	14,675	1,173	46,584	47,324	-740
Metal Futures	340	824	-484	3,508	3,528	-20	3,928	3,424	504
Single Stock Futures	1,214	176	1,038	100,755	121,379	-20,624	124,572	104,986	19,586
Currency Futures	20	15	5	476	236	240	1,011	1,256	-245

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
Future Bt50							
GFG17	20,460	20,350	20,400	20,480	-80	295	1,388
GFJ17	20,540	20,440	20,490	20,570	-80	122	1,727
GFM17	20,620	20,560	20,560	20,590	-30	18	59
Future Bt10							
GF10G17	20,460	20,340	20,390	20,470	-80	4,780	13,624
GF10J17	20,550	20,430	20,480	20,560	-80	1,823	9,819
GF10M17	20,610	20,490	20,550	20,630	-80	738	922

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)
S50H17	30-Mar-17	70	1.58%	0.0	972.59	975.6	971.1	-4.5	-0.5	-1.5
S50M17	29-Jun-17	161	1.67%	15.2	972.59	964.7	965.8	1.1	0.1	-6.8
S50U17	28-Sep-17	252	1.79%	2.0	972.59	982.7	959.7	-23.0	-2.3	-12.9
S50Z17	28-Dec-17	343	1.65%	17.3	972.59	970.6	959.9	-10.7	-1.1	-12.7
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 (%)	
GFG17	27-Feb-17	39	1,203.7	2.50%	35.434	20,328	20,420	92	0.5%	
GFJ17	27-Apr-17	98	1,203.7	2.53%	35.434	20,412	20,510	98	0.5%	
GFM17	29-Jun-17	161	1,203.7	2.59%	35.434	20,507	20,550	43	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 (%)	
USDF17	30-Jan-17	11	35.404	2.60%	0.11%	35.43	35.99	0.55	1.6%	
USDG17	27-Feb-17	39	35.404	2.60%	0.11%	35.50	35.29	-0.21	-0.6%	
USDH17	30-Mar-17	70	35.404	2.60%	0.11%	35.57	35.28	-0.29	-0.8%	
* 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)										
		1,154	1,164	1,174	1,184	1,194	1,204	1,214	1,224	1,234	1,244	1,254
THB/USD	35.15	19,280	19,447	19,614	19,781	19,948	20,115	20,282	20,449	20,616	20,784	20,951
	35.20	19,307	19,474	19,642	19,809	19,976	20,144	20,311	20,478	20,646	20,813	20,980
	35.25	19,334	19,502	19,670	19,837	20,005	20,172	20,340	20,508	20,675	20,843	21,010
	35.30	19,362	19,530	19,698	19,865	20,033	20,201	20,369	20,537	20,704	20,872	21,040
	35.35	19,389	19,557	19,725	19,893	20,062	20,230	20,398	20,566	20,734	20,902	21,070
	35.40	19,417	19,585	19,753	19,922	20,090	20,258	20,426	20,595	20,763	20,931	21,100
	35.45	19,444	19,613	19,781	19,950	20,118	20,287	20,455	20,624	20,792	20,961	21,129
	35.50	19,472	19,640	19,809	19,978	20,147	20,315	20,484	20,653	20,822	20,990	21,159
	35.55	19,499	19,668	19,837	20,006	20,175	20,344	20,513	20,682	20,851	21,020	21,189
	35.60	19,526	19,696	19,865	20,034	20,203	20,373	20,542	20,711	20,880	21,050	21,219
	35.65	19,554	19,723	19,893	20,062	20,232	20,401	20,571	20,740	20,910	21,079	21,249