

16 กันยายน 2563



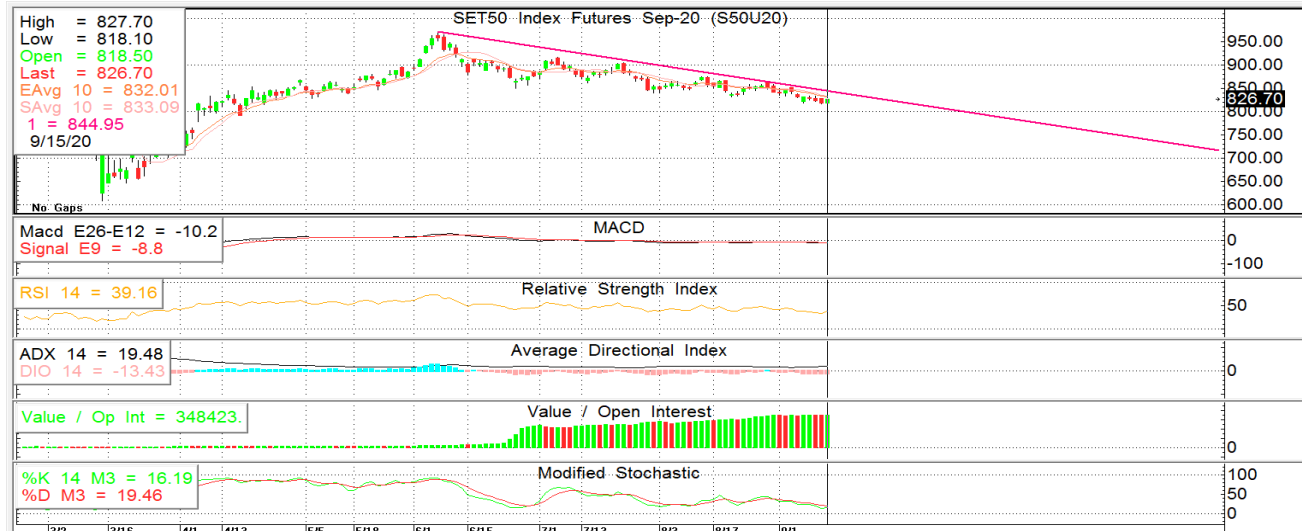
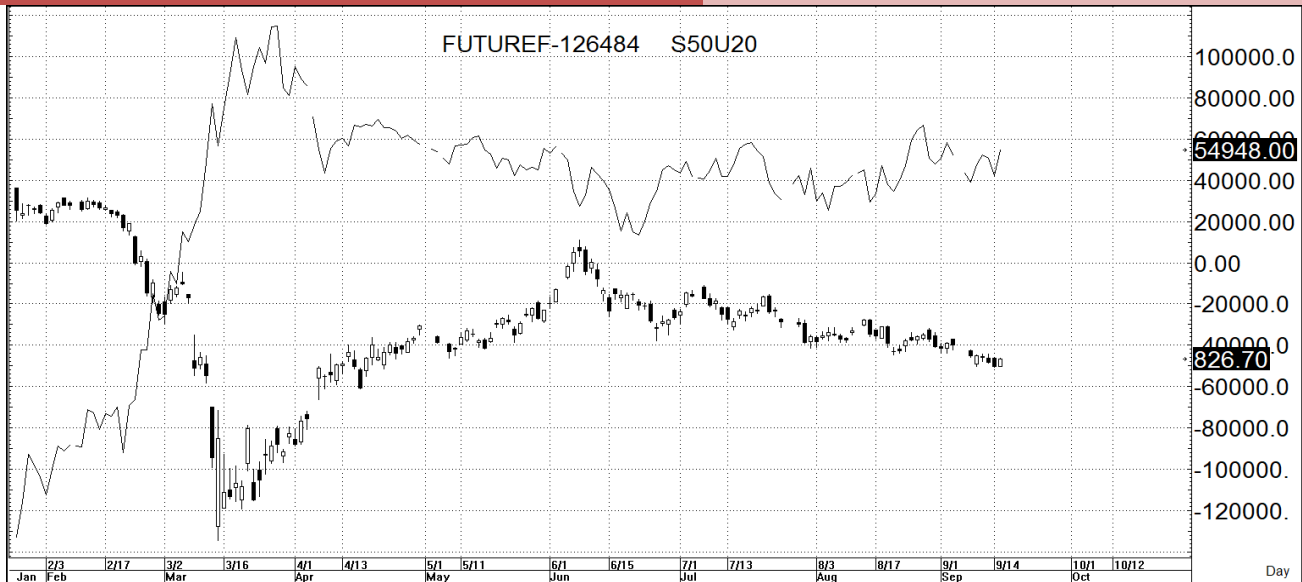
นักวิเคราะห์: กมลชัย พลอินทวงษ์
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 018239
Tel. (662) 088 9341

S50U20

826.7

S=814-820

R=830-833



กลยุทธ์: ยังคงเล่นได้สั้น 10 วันต่อเลยทำให้หน้าสั้นยังคงเป็นฝ่ายได้เปรียบอยู่ **จึง OPEN SHORT** แถวๆ แนวต้านที่ให้แล้วรอทำกำไรตอนย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดยกำหนดจุดตัดขาดทุน (STOPLOSS) เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ **S50U20 ปิดเหนือเส้น 10 วันที่ 834**
 <ปล: ถ้าข้ามเส้น 10 วันที่ 833 ขึ้นมาได้ก็ตั้งรอระวังไว้ด้วยเพราะจะทำให้ Upside เปิดโดยมีโอกาสขึ้นต่อไปยังเส้น 25 วันแถวๆ 841+/-3 ได้

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50U20	818.5	827.7	818.1	818.3	827.0	8.4	173,174	348,423
S50V20	819.9	825.7	816.8	817.0	825.7	8.7	71	92
S50X20	820.6	822.0	820.6	814.1	822.0	7.9	4	9
S50Z20	815.9	824.6	815.2	815.4	823.9	8.3	32,302	50,756
S50H21	815.0	821.0	812.0	812.1	820.4	8.2	2,351	8,736
S50M21	809.9	817.0	808.0	808.3	816.4	8.0	1,415	3,686

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDU20	31.24	31.25	31.19	31.36	31.20	-0.16	4,889	17,753
USDV20	31.24	31.24	31.24	31.31	31.24	-0.08	17	221
USDX20	-	-	-	31.32	-	-0.08	-	-
USDZ20	31.27	31.27	31.19	31.35	31.21	-0.13	6,118	23,350

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทนักลงทุน (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	84,036	71,675	12,361	29,598	31,538	-1,940	95,683	106,104	-10,421
Metal Futures	15,230	12,804	2,426	9,897	11,761	-1,864	15,779	16,341	-562
Single Stock Futures	3,742	11,815	-8,073	69,429	58,623	10,806	63,015	65,748	-2,733
Currency Futures	0	0	0	1,780	6,496	-4,716	9,244	4,528	4,716

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GOU20	1,970	1,945	1,966	1,943	24	20,841	15,535
GF10V20	29,270	29,010	29,220	29,010	210	9,626	12,706
GFV20	29,260	29,100	29,210	29,030	180	221	1,214
GF10Z20	29,330	29,070	29,270	29,070	210	1,568	6,431
GFZ20	29,300	29,200	29,300	29,090	210	47	479
GOZ20	1,976	1,951	1,973	1,948	25	5,469	5,139
GF10G21	29,380	29,150	29,340	29,130	220	3,066	1,861
GFG21	29,360	29,290	29,330	29,170	90	68	182

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)
S50U20	29-Sep-20	13	1.58%	0.0	827.38	827.8	826.7	-1.1	-0.1	-0.7
S50Z20	29-Dec-20	104	1.67%	15.2	827.38	816.2	823.7	7.5	0.9	-3.7
S50H21	30-Mar-21	195	1.79%	2.0	827.38	833.3	820.3	-13.0	-1.6	-7.1
S50M21	29-Jun-21	286	1.65%	17.3	827.38	820.9	816.3	-4.6	-0.6	-11.1

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 (%)
GFV20	29-Oct-20	43	1,956.3	2.50%	31.226	29,122	29,130	8	0.0%
GFZ20	29-Dec-20	104	1,956.3	2.53%	31.226	29,247	29,200	-47	-0.2%
GFG21	25-Feb-21	162	1,956.3	2.59%	31.226	29,373	29,150	-223	-0.8%

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 (%)
USDU20	29-Sep-20	13	31.22	2.60%	0.11%	31.25	31.20	-0.05	-0.2%
USDV20	29-Oct-20	43	31.22	2.60%	0.11%	31.31	31.23	-0.08	-0.3%
USDX20	27-Nov-20	72	31.22	2.60%	0.11%	31.37	31.24	-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)										
		1,906	1,916	1,926	1,936	1,946	1,956	1,966	1,976	1,986	1,996	2,006
THB/USD	30.97	28,063	28,210	28,357	28,504	28,651	28,799	28,946	29,093	29,240	29,387	29,535
	31.02	28,108	28,255	28,403	28,550	28,698	28,845	28,992	29,140	29,287	29,435	29,582
	31.07	28,153	28,301	28,448	28,596	28,744	28,892	29,039	29,187	29,335	29,482	29,630
	31.12	28,198	28,346	28,494	28,642	28,790	28,938	29,086	29,234	29,382	29,530	29,678
	31.17	28,244	28,392	28,540	28,688	28,836	28,985	29,133	29,281	29,429	29,577	29,725
	31.22	28,289	28,437	28,586	28,734	28,883	29,031	29,179	29,328	29,476	29,625	29,773
	31.27	28,334	28,483	28,632	28,780	28,929	29,078	29,226	29,375	29,523	29,672	29,821
	31.32	28,380	28,529	28,677	28,826	28,975	29,124	29,273	29,422	29,571	29,719	29,868
	31.37	28,425	28,574	28,723	28,872	29,021	29,171	29,320	29,469	29,618	29,767	29,916
	31.42	28,470	28,620	28,769	28,918	29,068	29,217	29,366	29,516	29,665	29,814	29,964
31.47	28,516	28,665	28,815	28,964	29,114	29,263	29,413	29,563	29,712	29,862	30,011	