



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

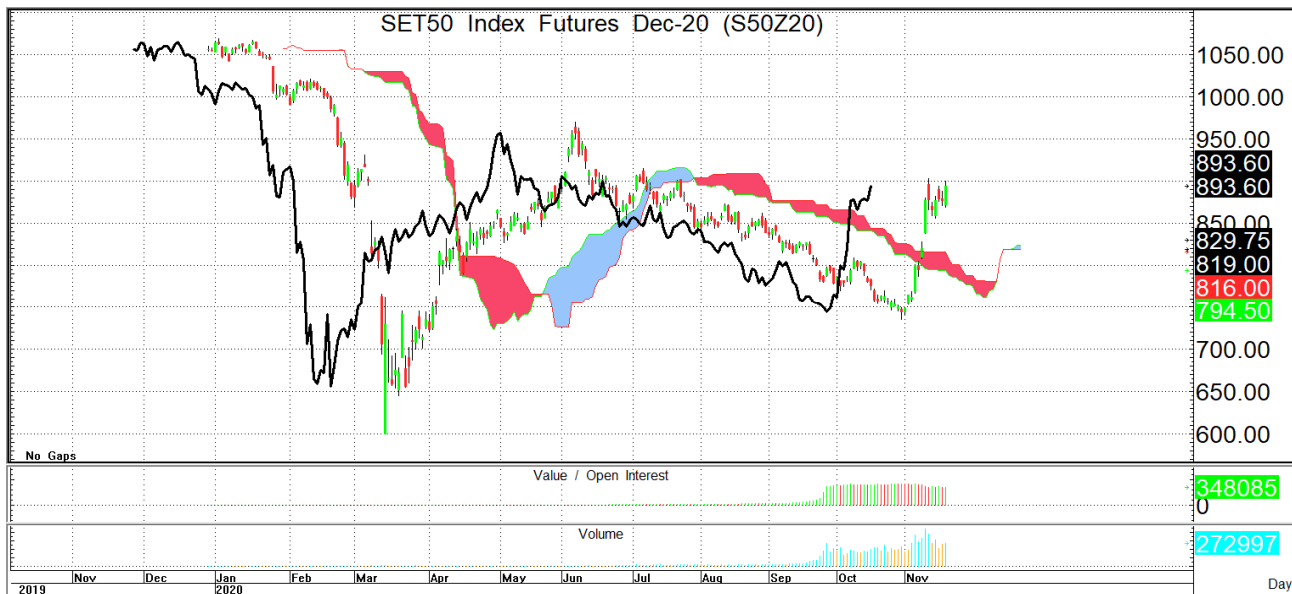
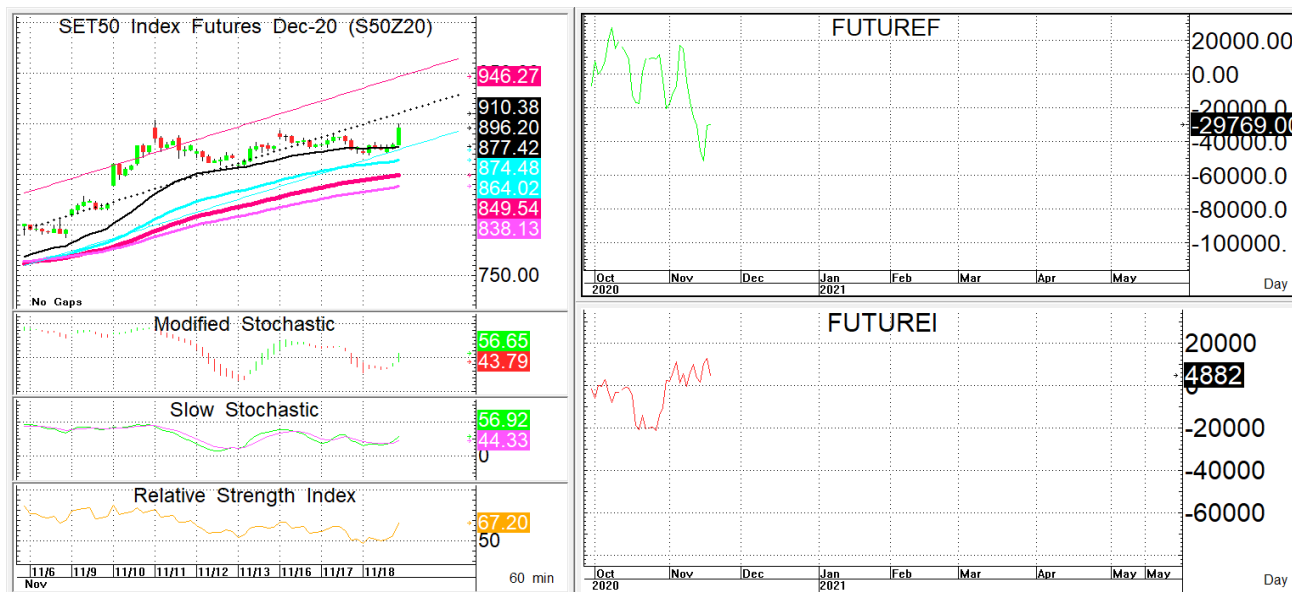
19 พฤศจิกายน 2563

S50Z20

893.6

S=873-883

R=904-914



กลยุทธ์: เพราะวาปิดเหนือเส้น 10 วันได้อยู่จึงทำให้ทางขึ้นเป็นฝ่ายได้เปรียบต่อโดย **OPEN LONG** แถวๆแนวรับที่ให้ไว้แล้วรอขาย
ทำกำไรตอนที่พื้นตัวกลับขึ้นมาแต่ก็ต้องวาง **Trailing stop** ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือลงมาปิดต่ำกว่า 870
ในทางกลับกันหากซิงแดงกลับก่อนก็แค่ไป **OPEN SHORT** แถวๆแนวต้านที่ให้ไว้แล้วรอทำกำไรตอนที่ย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดย
กำหนดจุดตัดขาดทุน (STOPLOSS) เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ **S50Z20** ปิดเหนือ 915

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50X20	874.0	893.6	872.0	877.2	893.6	16.4	68	153
S50Z20	872.1	900.0	869.2	876.7	896.2	16.9	272,997	348,085
S50F21	870.0	890.3	869.5	876.8	890.3	13.5	57	129
S50H21	866.3	895.0	865.0	872.4	891.7	16.3	32,549	32,419
S50M21	853.5	890.9	853.5	867.7	887.6	16.9	6,035	7,653
S50U21	854.0	885.5	854.0	863.3	885.5	16.7	2,080	2,842

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDZ20	30.23	30.30	30.20	30.17	30.30	0.14	1,921	154
USDZ20	30.23	30.34	30.22	30.17	30.33	0.17	6,132	36,209
USDF21	30.28	30.32	30.28	30.17	30.32	0.15	68	106
USDH21	30.23	30.37	30.21	30.20	30.34	0.14	7,359	15,944

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทนักลงทุน (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	101,548	100,645	903	49,275	57,369	-8,094	162,963	155,772	7,191
Metal Futures	10,761	7,456	3,305	3,320	4,132	-812	9,265	11,758	-2,493
Single Stock Futures	10,734	8,197	2,537	71,588	65,798	5,790	69,669	77,996	-8,327
Currency Futures	0	0	0	6,000	6,990	-990	9,480	8,490	990

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10Z20	27,150	26,950	27,070	27,120	-40	2,290	10,689
GFZ20	27,140	26,970	27,000	27,140	-140	40	555
GOZ20	1,897	1,878	1,881	1,891	-10	15,094	18,334
SVFZ20	25	24	25	25	0	161	386
GF10G21	27,200	27,000	27,120	27,160	-40	896	6,825
GFG21	27,200	27,030	27,040	27,190	-150	37	400
GOH21	1,905	1,885	1,888	1,900	-12	4,634	6,892
GF10J21	27,250	27,060	27,160	27,210	-40	191	3,747

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)
S50Z20	29-Dec-20	40	1.58%	0.0	888.51	890.1	893.6	3.5	0.4	5.1
S50H21	30-Mar-21	131	1.67%	15.2	888.51	878.7	888.7	10.0	1.1	0.2
S50M21	29-Jun-21	222	1.79%	2.0	888.51	896.2	884.6	-11.6	-1.3	-3.9
S50U21	29-Sep-21	314	1.65%	17.3	888.51	884.0	880	-4.0	-0.4	-8.5

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 (%)
GFZ20	29-Dec-20	40	1,873.5	2.50%	30.378	27,127	27,010	-117	-0.4%
GFG21	25-Feb-21	98	1,873.5	2.53%	30.378	27,237	27,150	-87	-0.3%
GFJ21	29-Apr-21	161	1,873.5	2.59%	30.378	27,364	27,090	-274	-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 (%)
USDX20	27-Nov-20	8	30.375	2.60%	0.11%	30.39	30.31	-0.08	-0.3%
USDZ20	29-Dec-20	40	30.375	2.60%	0.11%	30.46	30.34	-0.12	-0.4%
USDH21	30-Mar-21	131	30.375	2.60%	0.11%	30.65	30.34	-0.31	-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)										
		1,824	1,834	1,844	1,854	1,864	1,874	1,884	1,894	1,904	1,914	1,924
THB/USD	30.12	26,103	26,246	26,389	26,532	26,675	26,818	26,961	27,105	27,248	27,391	27,534
	30.17	26,146	26,289	26,433	26,576	26,719	26,863	27,006	27,150	27,293	27,436	27,580
	30.22	26,189	26,333	26,476	26,620	26,764	26,907	27,051	27,195	27,338	27,482	27,625
	30.27	26,233	26,376	26,520	26,664	26,808	26,952	27,096	27,240	27,383	27,527	27,671
	30.32	26,276	26,420	26,564	26,708	26,852	26,996	27,140	27,285	27,429	27,573	27,717
	30.37	26,319	26,464	26,608	26,752	26,897	27,041	27,185	27,330	27,474	27,618	27,763
	30.42	26,363	26,507	26,652	26,796	26,941	27,085	27,230	27,375	27,519	27,664	27,808
	30.47	26,406	26,551	26,696	26,840	26,985	27,130	27,275	27,420	27,564	27,709	27,854
	30.52	26,449	26,594	26,739	26,884	27,029	27,174	27,320	27,465	27,610	27,755	27,900
	30.57	26,493	26,638	26,783	26,928	27,074	27,219	27,364	27,510	27,655	27,800	27,945
	30.62	26,536	26,681	26,827	26,972	27,118	27,264	27,409	27,555	27,700	27,846	27,991