



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

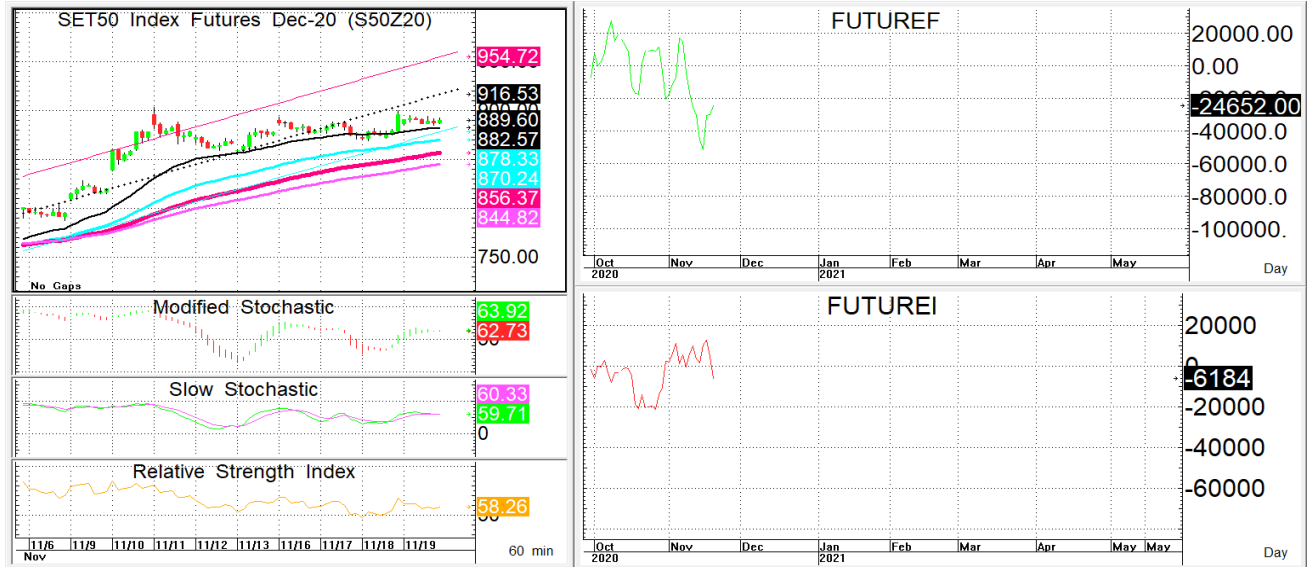
20 พฤศจิกายน 2563

S50Z20

889.6

S=870-880

R=896-906



กลยุทธ์: เนื่องจากยังคงเล่นเหนือเส้น 10 วันได้เลยทำให้ทางขึ้นยังคงได้เปรียบต่อโดย **OPEN LONG** แถวแนวรับที่ให้ไว้โดยเฉพาะอย่างยิ่งที่ 877+/- แล้วรอขายทำกำไรตอนที่ขึ้นตัวกลับขึ้นมาแต่ก็ต้องวาง **Trailing stop** ด้วยนะหากราคาออกจากต้นทุนเกิน 5 Points หรือลงมาปิดต่ำกว่า 869

ในทางกลับกันหากซึ่งดึงกลับก่อนก็แค่ไป **OPEN SHORT** แถวแนวต้านที่ให้ไว้แล้วรอทำกำไรตอนที่ย่อตัวกลับลงมาในระหว่างวัน โดยกำหนดจุดตัดขาดทุน (STOPLOSS) เมื่อราคาขาดทุนเกิน 5 Points เพื่อทำ Risk-Control หรือเมื่อ S50Z20 ปิดเหนือ 908

สรุปตลาด SET50 Index Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
S50X20	890.0	895.6	887.0	893.6	888.5	-5.1	33	159
S50Z20	887.0	894.8	885.0	893.6	889.6	-3.8	240,459	351,613
S50F21	885.2	892.8	884.0	890.3	889.6	-0.7	197	137
S50H21	883.4	890.5	880.6	888.7	885.2	-3.0	27,814	33,373
S50M21	878.0	886.2	876.5	884.6	881.0	-3.1	3,161	7,774
S50U21	873.1	881.3	872.0	880.0	876.5	-3.6	1,521	2,961

สรุปตลาด Currency Futures

	Price			Settlement Price			Volume	Open Interest
	Open	High	Low	Prior	Last	Change		
USDZ20	30.35	30.37	30.34	30.31	30.37	0.09	150	134
USDZ20	30.36	30.45	30.34	30.34	30.42	0.08	5,452	38,225
USDF21	30.35	30.40	30.35	30.32	30.37	0.08	1,990	200
USDH21	30.38	30.44	30.35	30.34	30.43	0.09	8,006	16,374

สรุปยอดซื้อขายสุทธิ Futures ตามประเภทหลักทรัพย์ (สัญญา)

	Foreign			Institution			Local		
	Long	Short	Net	Long	Short	Net	Long	Short	Net
SET50 Index Futures	99,184	94,067	5,117	47,251	58,317	-11,066	126,750	120,801	5,949
Metal Futures	19,422	21,140	-1,718	4,367	5,496	-1,129	22,802	19,955	2,847
Single Stock Futures	19,216	13,427	5,789	73,654	92,525	-18,871	99,654	86,572	13,082
Currency Futures	0	0	0	6,459	8,261	-1,802	9,139	7,337	1,802

สรุปตลาด Futures Gold & Oil Futures

	Price			Settlement Price		Volume	Open Interest
	High	Low	Close	Prior	Change		
GF10Z20	27,140	26,840	26,910	27,080	-150	4,095	10,057
GFZ20	27,120	26,860	26,970	27,000	-30	116	508
GOZ20	1,888	1,858	1,865	1,881	-16	33,030	18,387
SVFZ20	25	24	24	25	-1	427	361
GF10G21	27,190	26,880	26,960	27,120	-150	1,114	6,693
GFG21	27,150	26,880	26,990	27,040	-50	19	402
GOH21	1,895	1,865	1,873	1,888	-15	7,243	8,071
GF10J21	27,240	26,950	27,070	27,170	-110	538	3,743

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	39	1.58%	0.0	889.7	891.2	889.8	-1.4	-0.2	0.1
S50H21	30-Mar-21	130	1.67%	15.2	889.7	879.9	885.7	5.8	0.7	-4.0
S50M21	29-Jun-21	221	1.79%	2.0	889.7	897.4	881.5	-15.9	-1.8	-8.2
S50U21	29-Sep-21	313	1.65%	17.3	889.7	885.1	876.4	-8.7	-1.0	-13.3

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	39	1,861.1	2.50%	30.318	26,892	26,960	68	0.3%
GFG21	25-Feb-21	97	1,861.1	2.53%	30.318	27,002	26,900	-102	-0.4%
GFJ21	29-Apr-21	160	1,861.1	2.59%	30.318	27,127	27,060	-67	-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 (%)
USDX20	27-Nov-20	7	30.315	2.60%	0.11%	30.33	30.40	0.07	0.2%
USDZ20	29-Dec-20	39	30.315	2.60%	0.11%	30.40	30.42	0.02	0.1%
USDH21	30-Mar-21	130	30.315	2.60%	0.11%	30.59	30.43	-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)										
		1,811	1,821	1,831	1,841	1,851	1,861	1,871	1,881	1,891	1,901	1,911
THB/USD	30.07	25,882	26,025	26,168	26,311	26,454	26,597	26,739	26,882	27,025	27,168	27,311
	30.12	25,925	26,068	26,211	26,354	26,498	26,641	26,784	26,927	27,070	27,213	27,356
	30.17	25,968	26,111	26,255	26,398	26,542	26,685	26,828	26,972	27,115	27,259	27,402
	30.22	26,011	26,155	26,298	26,442	26,586	26,729	26,873	27,016	27,160	27,304	27,447
	30.27	26,054	26,198	26,342	26,486	26,630	26,773	26,917	27,061	27,205	27,349	27,493
	30.32	26,097	26,241	26,385	26,529	26,674	26,818	26,962	27,106	27,250	27,394	27,538
	30.37	26,140	26,285	26,429	26,573	26,718	26,862	27,006	27,151	27,295	27,439	27,584
	30.42	26,183	26,328	26,472	26,617	26,762	26,906	27,051	27,195	27,340	27,484	27,629
	30.47	26,226	26,371	26,516	26,661	26,806	26,950	27,095	27,240	27,385	27,530	27,674
	30.52	26,269	26,414	26,559	26,705	26,850	26,995	27,140	27,285	27,430	27,575	27,720
	30.57	26,312	26,458	26,603	26,748	26,894	27,039	27,184	27,329	27,475	27,620	27,765