

SET และ SET50 มีโอกาสปรับตัวเพิ่มขึ้นตามบรรยากาศการลงทุนที่สดใส แต่คาดว่าผลกระทบเชิงบวกอาจเกิดขึ้นเพียงชั่วขณะเท่านั้น

สินค้า	ทิศทาง	คำแนะนำ
S50U16 หมดอายุ 29 ก.ย. 16	↔	Short S50U16 ที่ 955-960 จุด ทำกำไรที่ 935-940 จุด ตัดขาดทุน 965 จุด
S50U16P950 หมดอายุ 29 ก.ย. 16	↔	ปล่อยสถานะว่าง
USDU16 หมดอายุ 29 ก.ย. 16	↔	Long USDU16 ทำกำไรที่กรอบ 35.00-10 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ ตัดขาดทุน 34.50 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ
KTBU16 หมดอายุ 29 ก.ย. 16	↔	Short KTBU16 ทำกำไร 17.50-17.70 บาท ตัดขาดทุน 18.30 บาท
BEMU16 หมดอายุ 29 ก.ย. 16	↔	Long BEMU16 ทำกำไร 7.50-7.60 บาท ตัดขาดทุน 7.20 บาท
GFV16 หมดอายุ 28 ต.ค. 16	↔	ปิดสถานะ Long GFV16 เพื่อทำกำไร

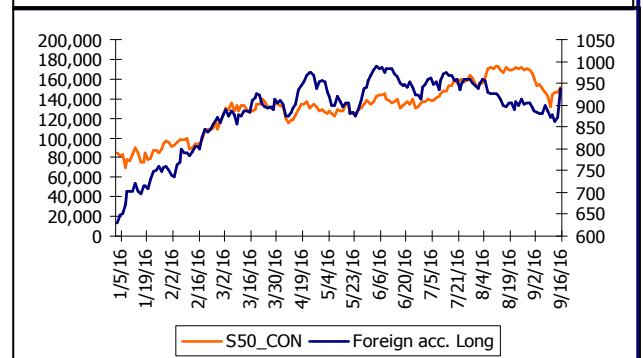
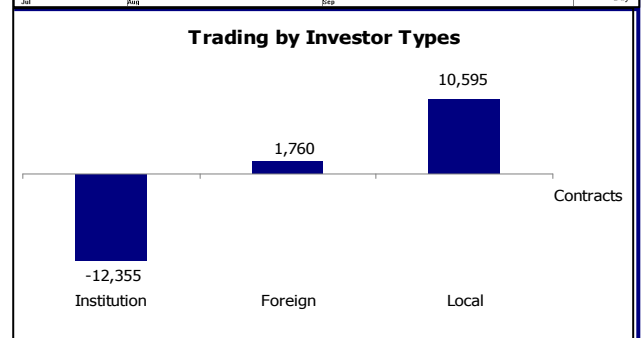
SET50 Index Futures: ผล FOMC หนุนสินทรัพย์เสี่ยงแค่ระยะสั้น

กลยุทธ์หลัก: Short S50U16 ที่ 955-960 จุด ทำกำไรที่ 935-940 จุด ตัดขาดทุน 965 จุด

การเคลื่อนไหวของ SET50 และ S50U16 วานนี้ไม่ได้ผิดจากที่คาดแต่ถ้าเล่นตามเราอาจไม่ได้กำไร เพราะการเคลื่อนไหวของ S50U16 ในช่วงบ่ายมีการกระชากขึ้นไปยืนเหนือ 955 จุดที่เป็นจุดถอยฝั่ง Short ของเราก่อนจะพลิกกลับมาอ่อนตัวลงเร็ว ทำให้กลยุทธ์การกลับเข้า Short อีกครั้งในช่วงบ่ายพลาดโอกาสทำกำไรไปอย่างน่าเสียดาย (S50U16 ลงมาปิดที่ 946 จุด)

สำหรับแนวโน้มวันนี้ขึ้นอยู่กับความผลประทุม FOMC ของเฟดเมื่อคืนที่ผ่านมา มุมมองทางเศรษฐกิจที่ดีขึ้นแต่ยังไม่ปรับขึ้นดอกเบี้ยในทันที ทำให้บรรยากาศการลงทุนในสินทรัพย์เสี่ยงสดใสได้ชั่วขณะ ซึ่งก็จะทำให้บ้านเราได้รับอานิสงส์เชิงบวกตามไปด้วย โดยเงินบาทแข็งค่าขึ้นต่อเนื่องในเช้าวันนี้ แต่เพราะการปรับขึ้นในภาพรวมที่เริ่มแสดงอาการแปลกๆ โดยมีจังหวะการปรับขึ้นแล้วพลิกกลับมาอ่อนตัวลงเร็วจนทำให้ดัชนีบ่งชี้สัญญาณขัดแย้งเชิงลบ เราจึงไม่เชื่อว่า SET50 และ S50U16 จะขยับขึ้นได้ไกล และถ้าอิงการประชุม FOMC รอบที่ผ่านมา จะพบว่าสินทรัพย์เสี่ยงจะดีใจรับการไม่ปรับขึ้นดอกเบี้ยเพียงวันเดียวแล้วมักพลิกกลับมาอ่อนตัวลงเร็ว เราจึงไม่แนะนำให้ Follow Long ตามเมื่อเปิดกระโดดขึ้น และให้มองทาง Short ที่กรอบ 955-960 จุดแทน โดยตั้งจุดตัดขาดทุนเผื่อโอกาสเกิด Slippage ที่ 965 จุด

ยอดซื้อขายรายประเภทวานนี้ ต่างชาติ Net Long ใน Index Futures 1,760 สัญญา รวมตั้งแต่ต้นปี Long สะสม 144,284 สัญญาหรือ 27,000 ล้านบาท ส่วนค่า Basis แกว่งแคบลงเหลือ -2.2 จุด จาก 1.7 จุด สะท้อนจิตวิทยาการลงทุนที่เป็นลบอยู่เล็กน้อย



SET50 Index Options: ปลอยสถานะว่าง

ปลอยสถานะว่าง

กราฟทางเทคนิคของ SET50 รายวันดูดีขึ้น แต่ยังไม่ถึงขั้นเปลี่ยนแนวโน้มจากลบเป็นบวก เพราะการฟื้นเฟื่องได้ครึ่งทางของชุดที่ปรับตัวลงในระลอกก่อนหน้านี้ และดัชนีบ่งชี้ยังไม่กลับมาส่งสัญญาณเชิงบวกอย่างเต็มตัว การเข้าไปเก็งกำไรใน Index Option ที่มีความเสี่ยงด้านสภาพคล่องอยู่แล้ว จึงอาจต้องชะลอเพื่อรอดูทิศทางที่ชัดเจนก่อน



Single Stock Futures: Short KTB16

Short KTB16 ทำกำไร 17.50-17.70 บาท ตัดขาดทุน 18.30 บาท

ราคา KTB16 ปรับตัวเพิ่มขึ้นแล้วเผชิญแรงกดดันเป็นระยะที่เส้นค่าเฉลี่ย 75 วันแถว 18.30 บาท ทำให้รูปแบบการเคลื่อนไหวยังไม่หลุดพ้นจากรอบ Sideway จึงแนะนำให้เล่น Trading ในกรอบแบบขึ้น Short ลง Long คาดกรอบ 17.70-18.30 บาท

Single Stock Futures: Long BEMU16

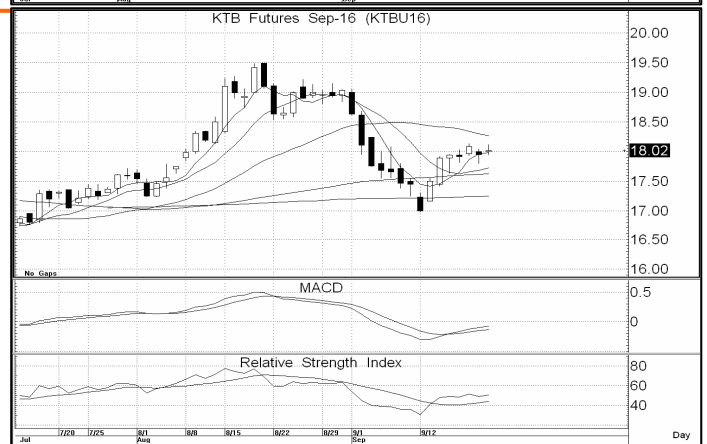
Long BEMU16 ทำกำไร 7.50-7.60 บาท ตัดขาดทุน 7.20 บาท

ราคา BEMU16 เริ่มชะลอการปรับลงที่เส้นค่าเฉลี่ยระยะสั้น 5 และ 10 วัน ทำให้คาดว่า Downside จะอยู่ในกรอบจำกัดและมีโอกาสผันกลับระยะสั้นหา 7.50-7.60 บาท ที่เป็นเส้นค่าเฉลี่ย 75 วัน เราจึงแนะนำให้เก็งกำไรฝั่ง Long ระยะสั้น

USD Futures: เงินสกุลหลักเคลื่อนไหวแคบเพื่อรอจุดเฟด

Long USDU16 ทำกำไรที่กรอบ 35.00-10 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ ตัดขาดทุน 34.75 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ

การเคลื่อนไหวของ USD/THB พลิกกลับมาอ่อนตัวลงตาม Dollar Index ที่เฟดยังไม่ปรับขึ้นดอกเบี้ยในทันที ขณะที่ กระแสเงินทุนต่างชาติไหลเข้าบ้านเราต่อเนื่อง ทำให้ USDU16 ยังมีแนวโน้มอ่อนตัวลงต่อ แต่ถ้าอิงภาพทางเทคนิคถือว่า Downside จำกัด และรูปแบบการเคลื่อนไหวยังมีโอกาสผันกลับระยะสั้น เนื่องจากจังหวะการปรับลงยังมีแรง Long คอยพยุงและยังไม่ได้หลุดตัวทำจุดต่ำสุดใหม่ จึงแนะนำให้เก็งกำไรฝั่ง Long USDU16 ต่อไป



Gold Futures: ปรับตัวเพิ่มขึ้นได้ไม่ไกลแล้วอ่อนตัวลง
ปิดสถานะ Long GVF16 เพื่อทำกำไร

ราคาทองคำปรับตัวเพิ่มขึ้นใกล้จุดทำกำไรฝั่ง Long ของเราที่ \$1,340/Oz โดยได้แรงหนุนจาก Dollar Index ที่พักตัวลง ซึ่งทำให้ทองคำได้รับความน่าสนใจในการเก็งกำไรตามหลักความเสมอภาคของค่าเงิน แต่เพราะผลประชุม FOMC ยังไม่ปิดกั้นการปรับขึ้นดอกเบี้ย ทำให้คาดว่า Upside จะไม่เปิดกว้าง โดยอ้างอิงตามโมเมนตัมคาดว่าจะขึ้นต่อได้ไม่เกิน \$1,345-1,350/Oz แล้วพลิกกลับมาอ่อนตัวลง แต่ Downside หลังจากนี้จะเริ่มจำกัด จากโอกาสที่กระแสเงินจะไหลเข้าพักในทางค่าด้วยคุณสมบัติแหล่งพักเงินชั้นดี โดยเราเชื่อว่าตลาดหุ้นหลักจะขยับได้ไม่ไกลมาก เพราะถ้าเป็นเรื่องของเฟดจะดีใจได้ไม่เกิน 2 วันทำการแล้วอ่อนตัวลง อีกทั้ง ตลาดหุ้นเหล่านั้นก็ซื้อขายที่ PE กรอบบนด้วย โดยมีปัจจัยที่น่าจับตาคือ การเปิดเผยยอดผู้ขอรับสวัสดิการว่างงานรายสัปดาห์ และยอดขายบ้านมือสองของสหรัฐฯ (19.30 น.)


RSS3 Futures: แกว่งออกด้านข้างในกรอบแคบ
ปล่อยสถานะว่าง

ราคายาง TOCOM อยู่ในช่วงพักตัวลง หลังจากปรับขึ้นแล้วไม่สามารถยืนเหนือ 180 เยนได้ ขณะที่ ดอลลาร์ไม่ได้อ่อนค่าจริง (อ่อนครู่เดียวแล้วพลิกกลับมาแข็งเร็ว) ทำให้ภาพใหญ่ยังถูกกดดันตามหลักความเสมอภาคของค่าเงินเหมือนสินค้าโภคภัณฑ์อื่น เมื่อผนวกกับอุปทานที่เริ่มออกมากกดดันจากปัจจัยฤดูกาล ทำให้คาดว่า Upside จะอยู่ในกรอบจำกัด และมีความเสี่ยงที่จะอ่อนตัวลงหารอบล่างของรอบ Sideway ที่ 140-180 เยน แนะนำให้ชะลอการลงทุน เพราะไม่มีสภาพคล่อง แต่ถ้าอยากเล่นให้เลือกฝั่ง Short คาดกรอบการเคลื่อนไหวที่ 140-180 เยน



DISCLAIMER: รายงานฉบับนี้จัดทำโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) "บริษัท" ข้อมูลที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ถูกจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่เราเชื่อหรือควรเชื่อว่ามีที่น่าเชื่อถือ และ/หรือมีความถูกต้อง อย่างไรก็ตาม บริษัทไม่รับรองความถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลดังกล่าว ข้อมูลและความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้อาจมีการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือเพิ่มเติมได้ตลอดเวลาโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า บริษัทไม่มีความประสงค์ที่จะชี้แจงหรือชี้ชวนให้ลงทุน ลงทุนซื้อหรือขายหลักทรัพย์ตามที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ รวมทั้งบริษัทไม่ได้รับประกันผลตอบแทนหรือราคาของหลักทรัพย์ตามข้อมูลที่ปรากฏแต่อย่างใด บริษัทจึงไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการนำข้อมูลหรือความเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ไม่ว่ากรณีใดก็ตาม ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและใช้ดุลยพินิจอย่างรอบคอบในการตัดสินใจลงทุน บริษัทขอสงวนลิขสิทธิ์ในข้อมูลและความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใดนำข้อมูลและความเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ประโยชน์ คัดลอก ดัดแปลง ทำซ้ำ นำออกแสดงหรือเผยแพร่ต่อสาธารณชนไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน โดยไม่ได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทล่วงหน้า การลงทุนในหลักทรัพย์มีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและพิจารณาอย่างรอบคอบก่อนการตัดสินใจลงทุน

บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) อาจเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market Maker) และผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants) บนหลักทรัพย์ที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ โดยบริษัท อาจจัดทำใบวิเคราะห์ของหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวนี้ ดังนั้น นักลงทุนควรศึกษารายละเอียดในหนังสือชี้ชวนของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าวก่อนตัดสินใจลงทุน