

สินทรัพย์เสี่ยงเริ่มส่งสัญญาณพักตัวลง หลังจากการปรับขึ้นขาดปัจจัยหนุนใหม่ให้ทะลุผ่านแนวต้านสำคัญ

สินค้า	ทิศทาง	คำแนะนำ
S50U16 หมดอายุ 29 ก.ย. 16	↔	กลยุทธ์หลัก: Short S50U16 ทำกำไรที่ 938-942 จุด ตัดขาดทุน 955 จุด Spread Trading: สะสม Long S50U16Z16 คาดหวังจุดทำกำไรที่ +2 จุด จากปิดเมื่อวันศุกร์ที่ -2 จุด
S50U16P950 หมดอายุ 29 ก.ย. 16	↔	ปล่อยสถานะว่าง
USDU16 หมดอายุ 29 ก.ย. 16	↔	Long USDU16 ทำกำไรที่กรอบ 34.90-95 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ ตัดขาดทุน 34.55 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ
KTBU16 หมดอายุ 29 ก.ย. 16	↔	Short KTBU16 ทำกำไร 17.70-17.75 บาท ตัดขาดทุน 18.35 บาท
BEMU16 หมดอายุ 29 ก.ย. 16	↔	เปลี่ยน Long เป็น Short ใน BEMU16 ทำกำไร 6.85-7.00 บาท ตัดขาดทุน 7.52 บาท
GFV16 หมดอายุ 28 ต.ค. 16	↔	Short GFV16 ทำกำไรที่ \$,1310-1,320/Oz ตัดขาดทุน \$1,350/Oz

SET50 Index Futures: สัญญาณเตือนที่เกิดขึ้นเป็นสิ่งที่ต้องระวัง

กลยุทธ์หลัก: Short S50U16 ทำกำไรที่ 938-942 จุด ตัดขาดทุน 955 จุด

Spread Trading: สะสม Long S50U16Z16 คาดหวังจุดทำกำไรที่ +2 จุด จากปิดเมื่อวันศุกร์ที่ -2 จุด

SET50 และ S50U16 พ้นตัวกลับขึ้นมาได้ดี แต่वलุ่มซื้อไม่เข้า จึงเป็นไปได้ที่จะเกิดสัญญาณลง แม้ว่ารูปแบบการเคลื่อนไหวอาจก่อให้เกิดจิตวิทยาการลงทุนเชิงบวก เพราะแรง Long สามารถดันให้ราคาปรับตัวขึ้นเร็วในช่วงตลาดวันศุกร์ แต่ในมุมมองของเราประเมินว่าการปรับขึ้นดังกล่าวมีความเปราะบาง เนื่องจากทั้ง SET50 และ S50U16 ยังไม่สามารถข้ามผ่านแนวต้านสำคัญ ในทางตรงข้ามกลับมาแรงขาย/Short ออกมาหนาแน่นเมื่อปรับขึ้นทดสอบแนวต้านดังกล่าว (ดูกราฟขวามือ) อีกทั้งปริมาณการซื้อขายก็ไม่หนาแน่นเพียงพอให้ SET50 และ S50U16 เลือกข้างได้ในทันที รูปแบบดังกล่าวจึงถือเป็นสัญญาณหลอก ที่ทำให้เรายังเชื่อว่าราคาจะกว้างในกรอบ Sideway ของภาพรายนาที่ ซึ่งนั่นหมายถึงวันนี้มีความเสี่ยงที่จะถอยมาเล่นที่กรอบล่างแถว 938-942 จุด และเป็นไปได้ที่ลงไปเล่นในกรอบล่างถัดไปแถว 930-932 จุด

เนื่องจากปัจจัยแวดล้อมภายนอกค่อนข้างเอื้อไปทางขาลง ไม่ว่าจะเป็นบรรยากาศการลงทุนในตลาดหุ้นสหรัฐที่เป็นลบ ราคาน้ำมันดิบที่ทรุดตัวลงแรง และเงินบาทที่เริ่มอ่อนค่ารับการไหลเข้าของกระแสเงินที่ชะลอตัว ซึ่งล้วนเป็นปัจจัยลบกับ SET50 ทั้งสิ้น

เมื่อผนวกกับผลของการ Roll Over ของนักลงทุนต่างชาติที่เราคาดว่าจะยังเป็นฝั่ง Long จากยอดสะสมต้นปีที่สูงถึง 1.5 แสนสัญญา ซึ่งจะทำให้ราคา S50U16 ถูกกดดันจากการเร่ง Short Close เราจึงแนะนำให้เล่นฝั่ง Short โดยจะกลับมาเล่นฝั่ง Long ก็ต่อเมื่อราคากลับไปยืนเหนือ 955 จุด



SET50 Index Options: ปลอยสถานะว่าง
ปลอยสถานะว่าง

กราฟทางเทคนิคของ SET50 ในภาพรายสัปดาห์กลับมาแกว่งในกรอบ Sideway หลังจากที่ยังหาการปรับขึ้นไม่สามารถยืนเหนือแนวต้านสำคัญที่ 1,000 จุด ซึ่งเมื่อพักตัวลงชุดใหญ่มาแล้วไม่สามารถฟื้นกลับไปยืนเหนือกรอบแนวต้านกระจุกตัวได้ด้วย ทำให้ความเสี่ยงที่จะพักตัวลงหลังจากนี้มีมากขึ้น เราจึงแนะนำให้เล่น Long Put หรือ Short Call เพียงแต่ต้องคำนึงถึงสภาพคล่องในการซื้อขายให้มากกว่าปกติ เพราะเป็นช่วงที่ Series U กำลังหมดอายุ (29 ก.ย. 16)


Single Stock Futures: Short KTB16
Short KTB16 ทำกำไร 17.70-17.75 บาท ตัดขาดทุน 18.35 บาท

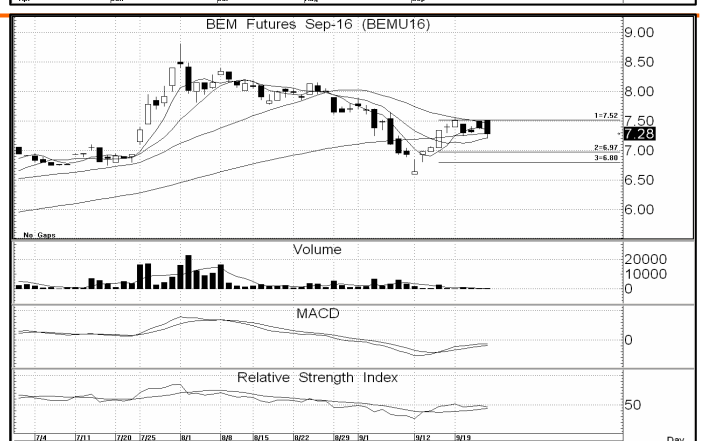
ราคา KTB16 ปรับตัวขึ้นไม่พ้นแนวต้านสำคัญแล้วพลิกกลับมาอ่อนตัวลงเร็ว โดยเฉพาะในภาพรายชั่วโมงที่ยังถูกกดดันจากสัญญาณขัดแย้งเชิงลบกับ MACD ทำให้ยังมีความเสี่ยงที่จะอ่อนตัวลงหารอบล่างที่กรอบ 17.70-17.75 บาท คาดกรอบ 17.70-18.35 บาท

Single Stock Futures: Short BEMU16
เปลี่ยน Long เป็น Short ใน BEMU16 ทำกำไร 6.85-7.00 บาท ตัดขาดทุน 7.52 บาท

ราคา BEMU16 ไม่ปรับตัวเพิ่มขึ้นอย่างที่เราคาดการณ์เอาไว้ แต่กลับพลิกมาอ่อนตัวลง ทำให้แนวต้านแถว 7.50 บาทหนาแน่นมากขึ้น ซึ่งราคาไม่น่าจะชกไปยืนเหนือได้ในทันที การพักตัวของภาพรายนาทิจึงกลับมาที่น่าหนักมากขึ้นอีกครั้ง คาดกรอบ 7.00-7.52 บาท

USD Futures: บาทแข็งแค่ชั่วคราว
Long USDU16 ทำกำไรที่กรอบ 34.90-95 บาท/ดอลลาร์สหรัฐฯ ตัดขาดทุน 34.55 บาท/ดอลลาร์สหรัฐฯ

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



Gold Futures: แนวโน้มแกว่งออกด้านข้าง ขึ้นแล้วไม่ผ่านก็ต้องลง
Short GFV16 ทำกำไรที่ \$,1310-1,320/Oz ตัดขาดทุน \$1,350/Oz

ราคาทองคำปลายสัปดาห์ก่อนปรับตัวเพิ่มขึ้นเล็กน้อย จากการเปิดเผยข้อมูลภาคการผลิตของสหรัฐฯ ที่ดีกว่าสหรัฐฯ ทำให้เงินสกุลดอลลาร์กลับไปแข็งค่าและกดดันให้ Dollar Index พักตัวลง แต่เรายังมองกรอบการปรับขึ้นของราคาทองคำยังจำกัด และมีโอกาสพลิกกลับมาอ่อนตัวลงหากรอบล่างอีกครั้งจาก

(1) รูปแบบการเคลื่อนไหวยังไม่หลุดพ้นจากกรอบ Sideway เมื่อปรับขึ้นหากรอบบนแล้วยังไม่สามารถยืนเหนือ ทำให้มีความเสี่ยงที่จะถดถอยหากรอบล่าง (2) Dollar Index เริ่มยกฐานราคาขึ้น ตามแนวโน้มการเปิดเผยตัวเลขเศรษฐกิจสหรัฐระยะหลังที่ออกมาอยู่ในเกณฑ์ดี (3) กองทุนต่างๆ เริ่มปิดสถานะ Long ใน COMEX Gold Futures สะท้อนจิตวิทยาการลงทุนที่เริ่มเป็นลบ

ทั้งนี้ กองทุน SPDR Gold Trust เพิ่มสถานะถือครองทองคำ 0.30 ตัน มาอยู่ที่ 951.22 ตัน

ส่วนตัวเลขเศรษฐกิจสหรัฐที่น่าจับตามอง ยอดขายบ้านใหม่ (21.00 น.) ตลาดคาด 598,000 หลัง จาก 654,000 หลัง

RSS3 Futures: แนวโน้มแกว่งออกด้านข้างในกรอบแคบ
ปล่อยสถานะว่าง

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



DISCLAIMER: รายงานฉบับนี้จัดทำโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) "บริษัท" ข้อมูลที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ถูกจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่เกี่ยวข้องหรือความเชื่อที่เชื่อถือได้ และ/หรือมีความถูกต้อง อย่างไรก็ตาม บริษัทไม่รับรองความถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลดังกล่าว ข้อมูลและความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้อาจมีการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือเพิ่มเติมได้ตลอดเวลาโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า บริษัทไม่มีความประสงค์ที่จะชักจูงหรือชวนให้ลงทุน ลงทุนซื้อหรือขายหลักทรัพย์ตามที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ รวมทั้งบริษัทไม่ได้รับประกันผลตอบแทนหรือราคาของหลักทรัพย์ตามข้อมูลที่ปรากฏตัวอย่างใด 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