

บรรยากาศการลงทุนที่สดใส และเงินบาทที่กลับมาแข็งค่าขึ้น ทำให้ SET50 พลอยได้อานิสงส์เชิงบวกตามไปด้วย

สินค้า	ทิศทาง	คำแนะนำ
S50Z16 หมดอายุ 29 ธ.ค. 16	↔	<u>กลยุทธ์หลัก:</u> Long S50Z16 ทำกำไรที่ 950-954 จุด ตัดขาดทุน 940 จุด <u>กลยุทธ์ทางเลือก:</u> Short S50Z16 ที่ 950-954 จุด ทำกำไร 938-940 จุด ตัดขาดทุน 957 จุด
Index Options หมดอายุ 29 ธ.ค. 16	↔	ปล่อยสถานะว่าง
USDZ16 หมดอายุ 29 ธ.ค. 16	↔	Long USDZ16 ทำกำไรที่กรอบ 34.90-95 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ ตัดขาดทุน 34.55 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ
KTZ16 หมดอายุ 29 ธ.ค. 16	↔	ปิด Short KTZ16 แล้วปล่อยสถานะว่าง
TMBZ16 หมดอายุ 29 ธ.ค. 16	↔	Short TMBZ16 ทำกำไร 2.00-2.05 บาท ตัดขาดทุน 2.20 บาท
GFV16 หมดอายุ 28 ธ.ค. 16	↔	Short GFV16 ทำกำไรที่ \$1,300-1,310/Oz ตัดขาดทุน \$1,350/Oz

SET50 Index Futures: กลับมาเล่นฝั่ง Long ชั่วคราว

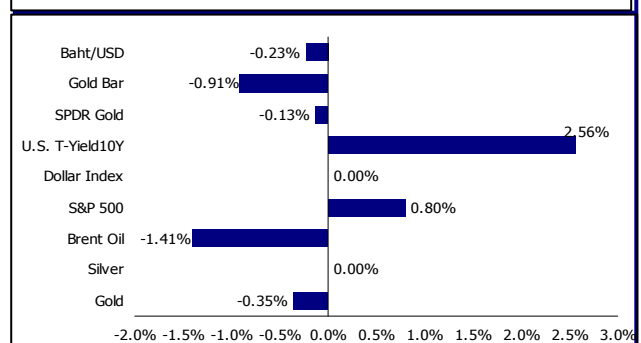
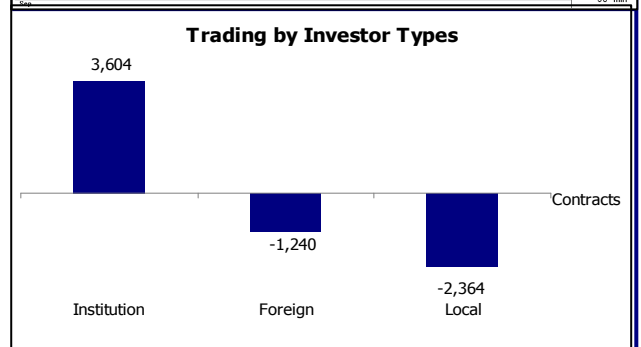
กลยุทธ์หลัก: Long S50Z16 ทำกำไรที่ 950-954 จุด ตัดขาดทุน 940 จุด

กลยุทธ์ทางเลือก: Short S50Z16 ที่ 950-954 จุด ทำกำไร 938-940 จุด ตัดขาดทุน 957 จุด

SET50 และ S50Z16 เมื่อวันศุกร์ยังแกว่งออกด้านข้างในกรอบแคบ แต่ดูเหมือน **Downside** จะถูกจำกัดลงเรื่อยๆ แม้จะถูกกดดันจากบรรยากาศการลงทุนที่เป็นลบ และกระแสเงินที่เริ่มไหลออกต่อเนื่องขึ้น โดยต่างชาติขายหุ้นเป็นวันที่ 2 อีก 558 ล้านบาท และ Net Short ใน Index Futures 1,240 สัญญาหรือราว 230 ล้านบาท แต่ภาพทางเทคนิคในกราฟรายชั่วโมงของ S50Z16 ดูดีขึ้นจากรอบการพักตัวที่ไม่ลดฐานราคา ซึ่งก็ทำให้ค่า Basis กลับมาเคลื่อนไหวแดนบวกอีกครั้งด้วย สะท้อนให้เห็นถึงจิตวิทยาการเก็งกำไรใน Index Futures เป็นบวกมากขึ้น ซึ่งน่าจะส่งผลดีต่อภาพการเคลื่อนไหวในวันนี้

สำหรับแนวโน้มวันนี้ คาดว่าจะได้เห็นการฟื้นกลับของ S50Z16 หาดู 950-954 จุด โดยมุมมองระยะกลางยังเป็นบวก (อ่านรายละเอียดเพิ่มเติม จากบทวิเคราะห์ FSS Thailand Daily Focus) ขณะที่ ระยะสั้นได้แรงหนุนจากบรรยากาศการลงทุนรวมที่กลับมาสดใสชั่วคราว ซึ่งถ้าหาก S50Z16 ไม่ถอยหลุดกรอบแนวรับสำคัญที่ 940 จุด ก็น่าจะได้เห็นการปรับตัวเพิ่มขึ้นหากรอบบนของรอบ Sideway ที่ 950-954 จุด ส่วนปัจจัยบวกอื่นคือ การแข็งค่าของเงินบาทมาอยู่ที่ 34.50 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ ที่น่าจะช่วยให้การไหลออกของกระแสเงินชะลอตัวได้ อย่างไรก็ตาม Upside อาจไม่เปิดกว้างในทันที เพราะสัปดาห์นี้สหรัฐจะมีการเปิดเผยข้อมูลภาคแรงงานสหรัฐ ซึ่งตลาดคาดไว้ค่อนข้างดี ถ้าออกมาสดใสกว่าคาดอาจทำให้กระแสเงินกลับไปไหลออกอีกครั้ง นักเก็งกำไรจึงเป็นเพียงแค่ Trading ไม่เกิน 50% ของจำนวนสัญญาที่สามารถเล่นได้ทั้งหมด

ในเชิงกลยุทธ์ แนะนำให้ Trading Long S50Z16 ทำกำไรที่ 950-954 จุด ตัดขาดทุน 940 จุด



SET50 Index Options: ปลอยสถานะว่าง
ปลอยสถานะว่าง

กราฟทางเทคนิคของ SET50 ในภาพรายสัปดาห์กลับมาแกว่งในกรอบ Sideway หลังจากที่ยังหาการปรับขึ้นไม่สามารถยืนเหนือแนวต้านสำคัญที่ 1,000 จุด ซึ่งเมื่อพักตัวลงชุดใหญ่มาแล้วไม่สามารถฟื้นกลับไปยืนเหนือกรอบแนวต้านกระจุกตัวได้ ทำให้ความเสี่ยงที่จะพักตัวลงหลังจากนี้ยังมี ซึ่งเมื่อคำนึงถึงสภาพคล่องในการซื้อขายที่อยู่ในระดับต่ำ จึงแนะนำให้ปลอยสถานะว่างไปก่อน


Single Stock Futures: ปิด Short KTBZ16
ปิด Short KTBZ16 แล้วปลอยสถานะว่าง

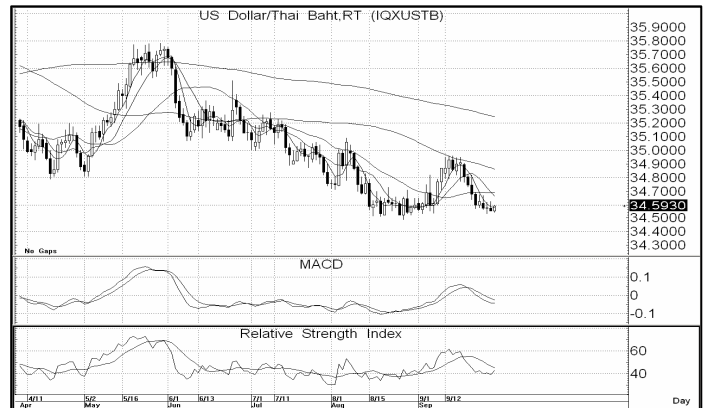
ราคา KTBZ16 ปรับตัวลงต่อเนื่องพร้อมปริมาณการซื้อขายที่หนาแน่นขึ้น ทำให้ยังมีความเสี่ยงที่จะอ่อนตัวลงต่อตามทิศทางดัชนีบ่งชี้ที่เป็นลบ แต่เพราะบรรยากาศการลงทุนเข้าวันนี้ดีเสียอย่างมาก และเราเริ่มเห็นแรง Long เข้ามาพยุงไม่ให้ราคาทรุดตัวลงเร็ว เราจึงแนะนำให้ปิดสถานะ Short เพื่อลดความเสี่ยงออกไปก่อน คาดกรอบ 17.50-18.20 บาท

Single Stock Futures: Short TMBZ16
Short TMBZ16 ทำกำไร 2.00-2.05 บาท ตัดขาดทุน 2.20 บาท

ราคา TMBZ16 อยู่ในแนวโน้มพักตัวลง ตามแรงกดดันของเส้นค่าเฉลี่ย และ MACD ที่เคลื่อนไหวต่ำกว่า Signal Line ตัวเอง ทำให้ในเชิงแนวโน้มแล้วยังมีความเสี่ยงที่จะอ่อนตัวลงต่อ แม้บรรยากาศการลงทุนที่สดใสนี้ควรจะทำให้ฝั่ง Short เสียเปรียบ แต่เพราะปัจจัยพื้นฐานยังไม่ดีจากค่าใช้จ่ายในการตั้งสำรองที่สูง ตามแผนการตัดจำหน่าย NPL อย่างเข้มงวด เราจึงคาดว่า การฟื้นกลับของราคาตามทิศทางตลาดจะเกิดขึ้นเพียงระยะสั้นเท่านั้น

USD Futures: เงินบาทแข็งค่าแค่ช่วงสั้น
Long USDZ16 ทำกำไรที่กรอบ 34.90-95 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ ตัดขาดทุน 34.55 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ

การเคลื่อนไหวของ USD/THB พลิกกลับมาอ่อนตัวลง จากการกลับไปแข็งค่าเงินสกุลยูโร หลังจากคอยซ์เบงก็มีโอกาสถูกปรับน้อยกว่าที่ประเมินไว้ก่อนหน้านี้ แต่เพราะตัวเลขเศรษฐกิจสหรัฐยังออกมาสดใสต่อเนื่อง และกระแสมือมีแนวโน้มกลับมาไหลออกอีกครั้ง เพื่อรอดูความชัดเจนในการเปิดเผยข้อมูลภาคแรงงานสหรัฐ ทำให้การอ่อนตัวลงของ USD/THB เป็นเพียงปรากฏการณ์ชั่วคราวเท่านั้น จึงยังแนะนำให้ Long S50Z16 ต่อไป



Gold Futures: ฟิ้นกลับแค่ชั่วคราว

Short GFV16 ทำกำไรที่ \$1,300-1,310/Oz ตัดขาดทุน \$1,340/Oz

ราคาทองคำโลกไม่ได้แรงหนุนจาก Dollar Index ที่อ่อนตัวลงเท่าที่ควร โดยกลายเป็นถูกกดดันจากสินทรัพย์เสี่ยงที่ปรับตัวเพิ่มขึ้นซึ่งทำให้ทองคำถูกลดความน่าสนใจในฐานะแหล่งพักเงินขึ้นตั้งไป อีกทั้ง ตัวเลขเศรษฐกิจสหรัฐก็ออกมาดีต่อเนื่อง ยิ่งทำให้ทองคำถูกลดความน่าสนใจในการเก็งกำไรไปเช่นกัน

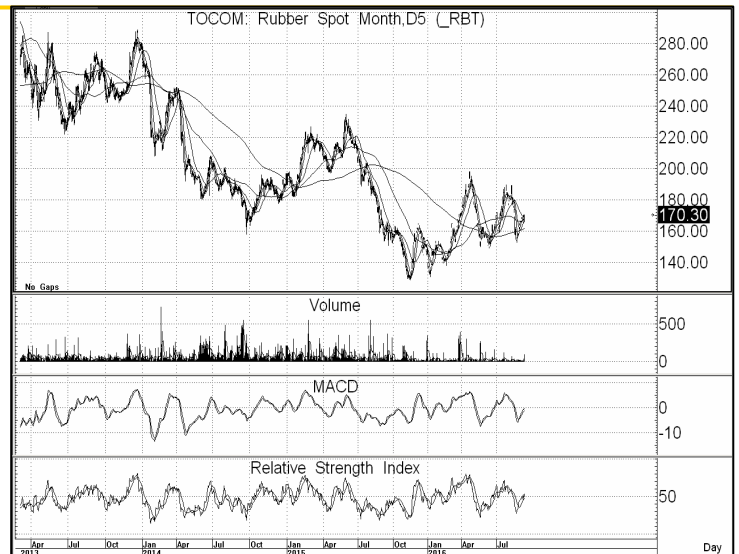
สำหรับแนวโน้มวันนี้ เราคาดว่าจะแกว่งออกด้านข้างต่อเนื่อง โดยการเคลื่อนไหวเมื่อสัปดาห์ที่ผ่านมา ได้สะท้อนให้เห็นถึงจิตวิทยาการลงทุนที่เป็นลบอยู่พอสมควร เพราะไม่ว่า Dollar Index จะปรับตัวเพิ่มขึ้นหรืออ่อนตัวลง ราคาทองคำก็เลือกที่จะอ่อนตัวลงทั้งสิ้น ซึ่งส่วนหนึ่งอาจเป็นเพราะตลาดพยายามลดสถานะการเก็งกำไรลงเพื่อรอดตัวเลขจ้างงานนอกภาคเกษตรสหรัฐที่จะเปิดเผยกลางถึงปลายสัปดาห์นี้ โดยสะท้อนมายังสถานะการถือครองทองคำของ SPDR Gold Trust ที่ลดลงอีก 1.19 ตัน เหลือ 947.95 ตัน คาดกรอบการเคลื่อนไหวของราคาทองคำโลกที่ \$1,310-1,325/Oz



RSS3 Futures: แกว่งออกด้านข้างในกรอบแคบ

ปล่อยสถานะว่าง

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



DISCLAIMER: รายงานฉบับนี้จัดทำโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) "บริษัท" ข้อมูลที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ถูกจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่เราเชื่อหรือความเชื่อว่ามีที่น่าเชื่อถือ และ/หรือมีความถูกต้อง อย่างไรก็ตาม บริษัทไม่รับรองความถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลดังกล่าว ข้อมูลและความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้อาจมีการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือเพิ่มเติมได้ตลอดเวลาโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า บริษัทไม่มีความประสงค์ที่จะชี้แจงหรือชี้ชวนให้ลงทุน ลงทุนซื้อหรือขายหลักทรัพย์ตามที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ รวมทั้งบริษัทไม่ได้รับประกันผลตอบแทนหรือราคาของหลักทรัพย์ตามที่ปรากฏตามข้อมูลข้อมูลที่ปรากฏแต่อย่างใด 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