

Analyst: Natapon Khamthakrue
Register No.: 026637

www.fnsyrus.com, FB: Finansia Syrus Research

SET และ SET50 เคลื่อนไหว Outperform ภูมิภาค แต่ด้วยรูปแบบที่ไม่ชัด ทำให้ยังมีโอกาสแกว่งออกด้านข้างในกรอบเดิมต่อไป

SET50 Index Futures: เริ่มฟื้น แต่ Upside จำกัด

กลยุทธ์หลัก: Short S50Z16 ทำกำไร 926-930 จุด ตัดขาดทุน 943 จุด

สถานะข้ามวัน: พิจารณา SET50 ที่ 944 จุด ยืนเหนือได้ถือ Long S50Z16 แต่ถ้าต่ำกว่าให้ถือ Short

S50Z16 ปรับตัวเพิ่มขึ้นได้ดีกว่าที่ประเมินไว้ในช่วงเช้า โดยได้แรงหนุนจากการซื้อกลับในหุ้นกลุ่มแบงก์และพลังงาน รวมถึงกลุ่มที่คาดว่าจะผลประกอบการ 3Q16 จะออกมาดี แต่เพราะบรรยากาศการลงทุนภายนอกยังเป็นลบ และเงินบาทเคลื่อนไหวเชิงอ่อนค่า จึงทำให้คาดว่า Upside การปรับขึ้นจะอยู่ในกรอบจำกัดไม่เกิน 943 จุดแล้วอ่อนตัวลง โดยหลังจากเปิด Short ช่วงเปิดตลาดที่ 935 จุดเพื่อหวังทำกำไรที่ 926-930 จุดไปแล้ว ให้พิจารณาถือสถานะเดิมไว้ก่อน แต่อาจต้องตัดขาดทุนเพื่อลดความเสี่ยงเมื่อยืนเหนือ 943 จุด เนื่องจากทิศทางหลัก (ภาพรายสัปดาห์) ยังเป็นบวก การ Trading ผัง Short ซึ่งเราให้น้ำหนักจากปัจจัยภายนอกที่เป็นลบ จึงถือเป็นการเล่นสวนแนวโน้มที่มีความเสี่ยงสูง



Single Stock Futures: ถือสถานะ Long TMBZ16

Long TMBZ16 ทำกำไร 2.20-2.25 บาท ตัดขาดทุน 2.00 บาท

ราคา TMBZ16 ในภาพรายสัปดาห์เกิดสัญญาณขัดแย้งเชิงบวกกับ MACD อยู่เล็กน้อย ทำให้มีลุ้นปรับตัวเพิ่มขึ้นหาแนวเส้นค่าเฉลี่ยต่างๆแถว 2.15 บาท และ 2.20 บาท ตามลำดับ ขณะที่ในเชิงปัจจัยพื้นฐาน แม้จะดูน่าเป็นห่วงสุดในกลุ่มแบงก์ ทั้งจากยอด NPL ที่สูงและสำรองที่ต่ำ แต่ก็ยังเป็นสิ่งที่ตลาดรับรู้มาตลอด จึงทำให้ Downside เริ่มจำกัดในเชิงมูลค่า ส่วนภาพระยะสั้นรายชั่วโมง ถ้าไม่ถดถอยต่ำกว่า 2.00 บาท ยังมีลุ้นติดตัวขึ้นหา 2.20-2.25 บาท แนะนำให้ถือสถานะ Long ไว้ก่อน



Gold Futures: ถือสถานะ Long GFV16

Long GFV16 ทำกำไรที่ \$1,290-1,295/Oz ตัดขาดทุน \$1,260/Oz

ราคาทองคำโลกเริ่มพักตัวลง จากแรงกดดันของ Dollar Index ที่ปรับตัวเพิ่มขึ้นและการลดสถานะถือครองทองคำของ SPDR Gold Trust แต่ด้วยความที่ตัวเลขเศรษฐกิจสหรัฐฯระยะหลังออกมาแยกว่าคาด จนทำให้ความน่าจะเป็นในการปรับขึ้นดอกเบี้ยของเฟดงวดสุดท้ายปีนี้ (FedWatch) ลดลงเหลือ 74.2% จาก 78.3% ในสัปดาห์ก่อน อีกทั้งภาพทางเทคนิครายวันยังคงได้แรงหนุนจากเส้นค่าเฉลี่ย 5 และ 10 วัน ทำให้คาดว่า Downside การปรับย่อจะอยู่ในกรอบจำกัด จึงแนะนำให้ Long GFV16 ต่อไปก่อน คาดกรอบบายที่ \$1,260-1,270/Oz



DISCLAIMER: รายงานฉบับนี้จัดทำโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) "บริษัท" ข้อมูลที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ถูกจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่เราเชื่อว่ามีคุณภาพ เชื่อถือ และ/หรือมีความถูกต้อง อย่างไรก็ตามบริษัทไม่รับรองความถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลดังกล่าว ข้อมูลและความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้อาจมีการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือเพิ่มเติมได้ตลอดเวลาโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า บริษัทไม่มีความประสงค์ที่จะชักจูงหรือชี้ชวนให้ผู้ลงทุน ลงทุนซื้อหรือขายหลักทรัพย์ตามที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ รวมทั้งบริษัทไม่ได้รับประกันผลตอบแทนหรือราคาของหลักทรัพย์ตามข้อมูลที่ปรากฏแต่อย่างใด บริษัทจึงไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการนำข้อมูลหรือความเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ไม่ว่ากรณีใดก็ตาม ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและใช้ดุลยพินิจอย่างรอบคอบในการตัดสินใจลงทุน บริษัทขอสงวนสิทธิ์ในข้อมูลและความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใดนำข้อมูลและความเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ประโยชน์ คัดลอก ตัดแปลง ทำซ้ำ นำออกแสดงหรือเผยแพร่ต่อสาธารณชนไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน โดยไม่ได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทล่วงหน้า การลงทุนในหลักทรัพย์มีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและพิจารณาอย่างรอบคอบก่อนการตัดสินใจลงทุน บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) อาจเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market Maker) และผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants) บนหลักทรัพย์ที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ โดยบริษัทฯ อาจจัดทำบทวิเคราะห์ของหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวนี้ ดังนั้น นักลงทุนควรศึกษารายละเอียดในหนังสือชี้ชวนของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าวก่อนตัดสินใจลงทุน