

บรรยากาศการลงทุนในสินทรัพย์เสี่ยงเป็นกลาง แต่กลุ่มแบงก์น่าจะนำ SET50 ขึ้นขึ้นได้ในวันนี้

สินค้า	ทิศทาง	คำแนะนำ
S50Z16 หมดอายุ 29 ธ.ค. 16	↔	กลยุทธ์หลัก: เก็งกำไรฝั่ง Long S50Z16 ทำกำไรที่ 955-960 จุด ตัดขาดทุน 938 จุด สถานะข้ามวัน: ส่วนที่ถือ Long S50Z16 ข้ามวันมา ให้ถือต่อตามเงื่อนไขของกลยุทธ์หลัก
S50Z16C950 หมดอายุ 29 ธ.ค. 16	↔	ปล่อยสถานะว่าง รอดูทิศทางที่ชัดเจนอีกครั้ง
USDZ16 หมดอายุ 29 ธ.ค. 16	↔	ปล่อยสถานะว่าง รอดูทิศทางที่ชัดเจนอีกครั้ง
PTTEPZ16 หมดอายุ 29 ธ.ค. 16	↔	ปิด Short PTTEPZ16 เพื่อลดความเสี่ยงตามแนวโน้มขาขึ้น
KTBZ16 หมดอายุ 29 ธ.ค. 16	↔	Long KTBZ16 ทำกำไร 17.80-18.00 บาท ตัดขาดทุน 17.40 บาท
GFZ16 หมดอายุ 29 ธ.ค. 16	↔	Long GFZ16 ทำกำไรที่ \$1,150/Oz ตัดขาดทุน \$1,110/Oz

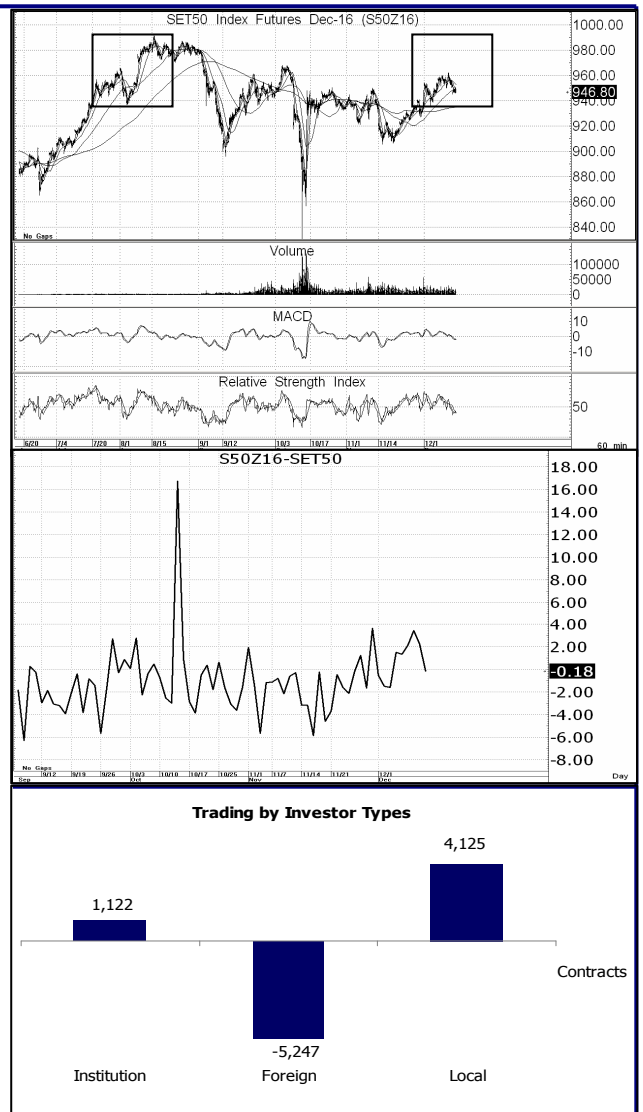
SET50 Index Futures: ถือ Long ลุ้นฟื้นกลับระยะสั้นต่อไปก่อน

กลยุทธ์หลัก: เก็งกำไรฝั่ง Long S50Z16 ทำกำไรที่ 955-960 จุด ตัดขาดทุน 938 จุด

สถานะข้ามวัน: ส่วนที่ถือ Long S50Z16 ข้ามวันมา ให้ถือต่อตามเงื่อนไขของกลยุทธ์หลัก

S50Z16 และ SET50 อ่อนตัวลงตามบรรยากาศการลงทุนในสินทรัพย์เสี่ยงที่เป็นลบ แต่ถือว่า Outperform ภูมิภาค โดยยังมีแรงเก็งกำไรในหุ้นขนาดเล็ก-กลางเป็นตัวพยุง SET ซึ่งหักล้างแรงขายหุ้นใหญ่ในกลุ่มพลังงานและแบงก์ ขณะที่ แรงขายของต่างชาติกลับมาหนาแน่นอีกครั้ง แต่ยังคงอยู่ในระดับปกติเมื่อเทียบกับช่วงก่อนหน้านี้ โดยขายหุ้น 1,457 ล้านบาท และ Net Short ใน Index Futures 5,247 สัญญาหรือ 990 ล้านบาท

สำหรับแนวโน้มวันนี้ คาดว่า SET50 และ S50Z16 จะปรับตัวเพิ่มขึ้นต่อตามแรงซื้อในหุ้นกลุ่มแบงก์จากโอกาสการกลับสำรวจกรณี SSI รวมถึงเป็นไปตามตลาดอื่นในภูมิภาคที่คาดหมายกันว่าแบงก์น่าจะได้ประโยชน์จากแนวโน้มอัตราดอกเบี้ยขาขึ้น (จากส่วนต่างอัตราดอกเบี้ยที่กว้างขึ้น) ขณะที่ หุ้นกลุ่มแบงก์บ้านเราก็ก้าว Laggard ควบคู่กับกลุ่มสื่อสารมานาน จึงเป็นไปได้ที่จะเกิดการฟื้นกลับในลักษณะปรับสมดุล ขณะที่ การฟื้นตัวของราคาน้ำมันดิบ ก็มีโอกาสช่วยพยุงการเคลื่อนไหวของหุ้นกลุ่มพลังงานด้วยเช่นกัน โดยในภาพทางเทคนิคของ S50Z16 รายสัปดาห์ยังได้แรงหนุนจากเส้นค่าเฉลี่ย 5 สัปดาห์ ส่วนภาพรายวันอาจดูเป็นลบเล็กน้อยจากการลดจุดต่ำสุดของวันลง แต่ด้วยความที่ภาพรายชั่วโมงยังไม่ต่ำกว่า 938 จุด ทำให้รูปแบบการเคลื่อนไหวยังคงคล้ายคลึงปลายก.ค. 16 ถึงต้น ส.ค. 16 ที่การอ่อนตัวเป็นเพียงลักษณะการพักชั่วคราวเพื่อขึ้นต่อ คาดกรอบการเคลื่อนไหววันนี้ที่ 943-955 จุด



SET50 Index Options: ปลอยสถานะว่าง

ปลอยสถานะว่างเพราะคาดว่า SET50 จะแกว่งออกด้านข้าง

กราฟทางเทคนิคของ SET50 ในภาพรายวันอยู่ในช่วงขาขึ้น แต่เพราะกรอบการแกว่งตัวค่อนข้างแคบ ขณะที่ ภาพรายชั่วโมงเกิดสัญญาณขัดแย้งเชิงลบกับดัชนีปิงชีระยะกลาง ซึ่งสะท้อนว่ายังมีโอกาสพลิกกลับมาอ่อนตัวลง จึงยังไม่มีความแนะนำให้เก็งกำไรใน Index Options ช่วงนี้


Single Stock Futures: ปิด Short PTTEPZ16

ปิด Short PTTEPZ16 เพื่อลดความเสี่ยงตามแนวโน้มขาขึ้น

ราคา PTTEPZ16 ปรับตัวลงวานนี้ตามทิศทางราคาน้ำมันดิบที่ทรุดตัวลงแรง แต่เพราะลงแล้วมี Long กลับเข้ามาเร็ว ทำให้คาดว่า Downside จะอยู่ในกรอบจำกัดไม่ต่ำกว่าแนวเส้นค่าเฉลี่ย แล้วติดตัวกลับขึ้นไปใหม่ จึงแนะนำให้ปิดสถานะเพื่อลดความเสี่ยงตามรูปแบบการเคลื่อนไหวที่ยังแกว่งในกรอบขาขึ้นออกไปก่อน คาดกรอบการเคลื่อนไหวที่ 92.0-94.0 บาท

Single Stock Futures: Long KTBZ16

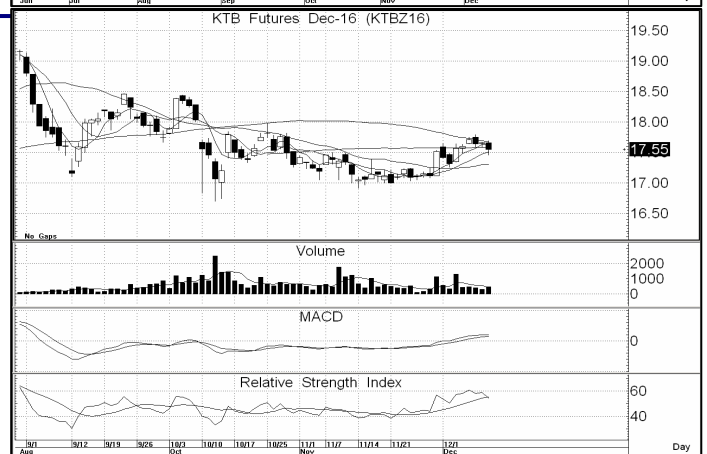
Long KTBZ16 ทำกำไร 17.80-18.00 บาท ตัดขาดทุน 17.40 บาท

ราคา KTBZ16 ยังแกว่งออกด้านข้างในกรอบแคบ แม้จะมีจังหวะอ่อนตัวลงแต่ยังมีแรงพุงการเคลื่อนไหวเป็นระยะ ทำให้ยังคาดว่า Downside จะอยู่ใกรอบจำกัด และมีโอกาสฟื้นตัวในระยะสั้นหากรอบบนแถว 17.80-18.00 บาท โดยมีปัจจัยหนุนเพิ่มเติมจากการที่ศาลล้มละลายกลางเห็นชอบแผนฟื้นฟูกิจการ SSI คาดกรอบการเคลื่อนไหวระยะสั้นที่ 17.40-17.80 บาท

USD Futures: Dollar Index แกว่งออกข้างเชิงลบ

ปลอยสถานะว่าง

การเคลื่อนไหวของ USD/THB ปรับตัวเพิ่มขึ้นตามทิศทาง Dollar Index ที่ได้แรงหนุนจากคาดการณ์การปรับขึ้นดอกเบี้ยของเฟด แต่ถ้าอิงตามภาพทางเทคนิคถือว่ากรอบการปรับขึ้นยังจำกัดที่ 35.70-35.80 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ ซึ่งการเคลื่อนไหวของเงินบาทดูจะ Underperform ภูมิภาคในช่วงนี้ ทำให้โอกาสที่จะอ่อนกว่านี้เริ่มจำกัด คาดกรอบการเคลื่อนไหวที่ 35.50-35.70 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ

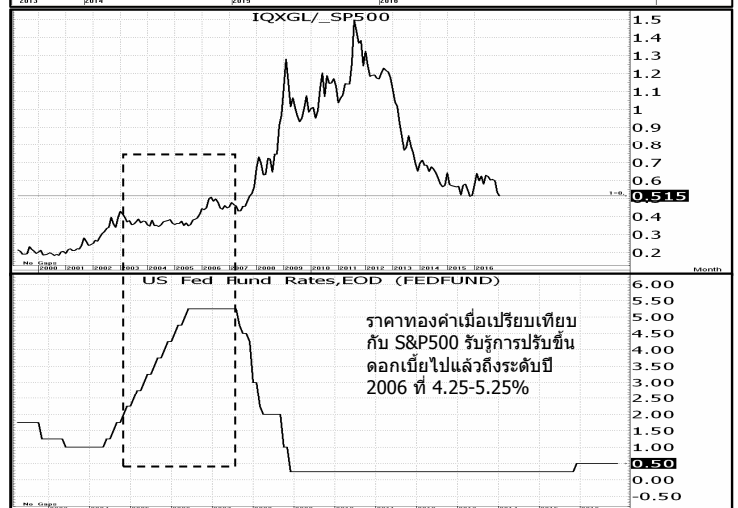


Gold Futures: กลับเข้า Long อีกครั้ง

Long GFZ16 ทำกำไรที่ \$1,150/Oz ตัดขาดทุน \$1,110/Oz

สำหรับแนวโน้มวันนี้ ราคาทองคำยังอยู่ในทิศทางอ่อนตัวลง ตามแรงกดดันของ Dollar Index ที่ทำจุดสูงสุดใหม่ในระยะสั้นอย่างต่อเนื่อง โดยล่าสุดขึ้นมายู่ที่ 103 จุด มากกว่าคาดการณ์ของเราในช่วงก่อนหน้านี้ที่คาดว่าจะไม่เกิน 102 จุด จากแรงหนุนของตัวเลขเศรษฐกิจสหรัฐที่ออกมาดี โดยเฉพาะข้อมูลภาคการผลิตของเฟดสาขาฟิลาเดเฟียและเอ็มไพร์สเตทที่เพิ่มขึ้นมายู่ที่ 21.5 และ 9.0 จุด มากกว่าช่วงก่อนที่ 9.1 และ 3.2 จุด

อย่างไรก็ตาม เรายังคาดว่า Downside จะอยู่ในกรอบจำกัดเช่นเดิม และจังหวะการพักยังมองเป็นโอกาสซื้อสะสม ตามข้อสังเกตของอัตราส่วนราคาระหว่าง Gold : S&P500 ที่ลงมาเหลือเพียง 0.5 เท่า ใกล้เคียงกับปี 2006 ที่อัตราดอกเบี้ยเฟดเท่ากับ 4.5-5.5% ซึ่งสะท้อนให้เห็นว่าราคาทองคำปรับตัวลงรับข่าวการปรับขึ้นดอกเบี้ยมากเกินไป รวมถึงจังหวะการพักที่ลงมาทดสอบบริเวณ Downtrend Line ของภาพรายสัปดาห์ที่เพิ่มทะลุผ่านขึ้นไปเมื่อช่วงต้นปี ซึ่งปกติมักจะมีการปรับตัวกลับ 1 ระลอกแล้วค่อยเลือกข้างใหม่ คาดกรอบการเคลื่อนไหววันนี้ที่ \$1,110-1,140/Oz



RSS3 Futures: แกว่งออกด้านข้างเชิงบวก

ปล่อยสถานะว่าง

ราคายาง TOCOM ปรับตัวเพิ่มขึ้นจนมาอยู่ที่ 200 เยน ซึ่งถ้าอิงตามกรอบ Parallel Uptrend Channel ยังมีโอกาสปรับตัวเพิ่มขึ้นหากรอบบนแถว 270-280 เยน แต่ด้วยความที่รูปแบบการเคลื่อนไหวเป็นลักษณะ Sideway up ที่มีกรอบการแก่งกำไรมากขึ้นแคบ จึงแนะนำให้เล่น Trading ในกรอบไปก่อน โดยคาดกรอบการเคลื่อนไหวที่ 250-280 เยน



DISCLAIMER: รายงานฉบับนี้จัดทำโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) "บริษัท" ข้อมูลที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ถูกจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่เราเชื่อหรือมีความน่าเชื่อถือ และ/หรือมีความถูกต้อง อย่างไรก็ตาม บริษัทไม่รับรองความถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลดังกล่าว ข้อมูลและความคิดเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้อาจมีการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือเพิ่มเติมได้ตลอดเวลาโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า บริษัทไม่มีความประสงค์ที่จะชักจูงหรือชักชวนให้ผู้ลงทุน ลงทุนซื้อหรือขายหลักทรัพย์ตามที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ รวมทั้งบริษัทไม่ได้รับประกันผลตอบแทนหรือราคาของหลักทรัพย์ตามข้อมูลที่ปรากฏแต่อย่างใด บริษัทจึงไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการนำข้อมูลหรือความเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ไม่ว่ากรณีใดก็ตาม ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและใช้ดุลยพินิจอย่างรอบคอบในการตัดสินใจลงทุน

บริษัทขอสงวนลิขสิทธิ์ในข้อมูลและความคิดเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใดนำข้อมูลและความคิดเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ประโยชน์ คัดลอก ตัดแปลง ทำซ้ำ นำออกแสดงหรือเผยแพร่ต่อสาธารณชนไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน โดยไม่ได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทล่วงหน้า การลงทุนในหลักทรัพย์มีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและพิจารณาอย่างรอบคอบก่อนการตัดสินใจลงทุน

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