

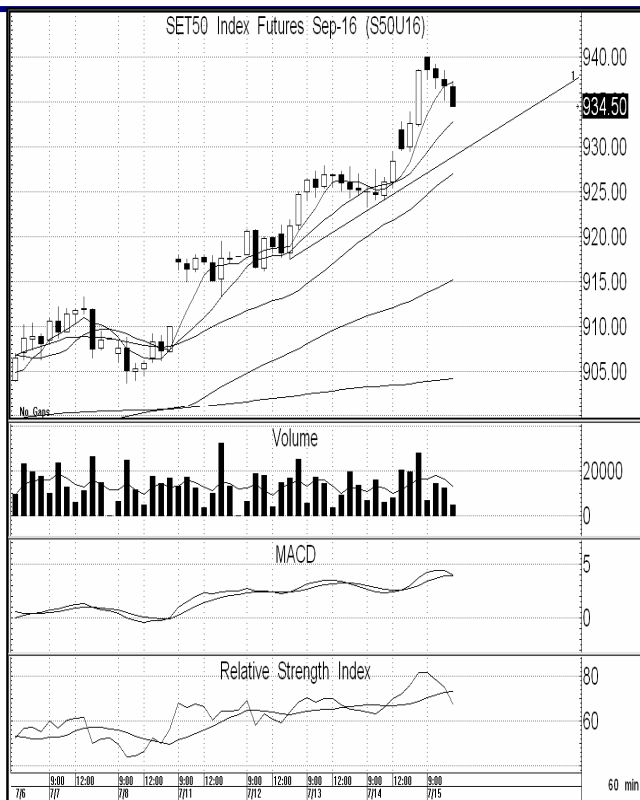
SET50 Index Futures: กลับมาเล่นฝั่ง Short

กลยุทธ์หลัก: ปรับกลยุทธ์โดยการเปลี่ยน Long เป็น Short ใน S50U16 ทำกำไรที่ 928-929 จุด ตัดขาดทุน 939 จุด

S50U16 เปิดปรับตัวเพิ่มขึ้นตามบรรยากาศการลงทุนที่สดใสแล้วพลิกกลับมาอ่อนตัวลง ซึ่งเป็นเงื่อนไขที่ทำให้เราต้องกลับสถานะเปลี่ยนจาก Long เป็น Short อีกครั้ง โดยการกำหนดสถานะในช่วงนี้อาจกลับขึ้นมาและสร้างความเสียหายให้กับผู้ที่ติดตาม แต่เป็นเพราะปัจจัยของโมเดลที่เราใช้มีความขัดแย้งกันเองสูง จึงทำให้การกำหนดกลยุทธ์มีความคลาดเคลื่อนไปบ้าง

สำหรับแนวโน้มช่วงบ่าย เราคาดว่าจะอ่อนตัวลงจาก (1) บรรยากาศการลงทุนในหุ้นกลุ่ม TIPS ที่เป็นบวกน้อยลง (2) กลุ่มพลังงานที่ส่งสัญญาณพักตามทิศทางราคาน้ำมันดิบ (3) ภาพทางเทคนิครายชั่วโมงที่ชะลอการปรับขึ้น โดยมี Downside ตาม Minor Uptrend Line ที่ 929 จุด

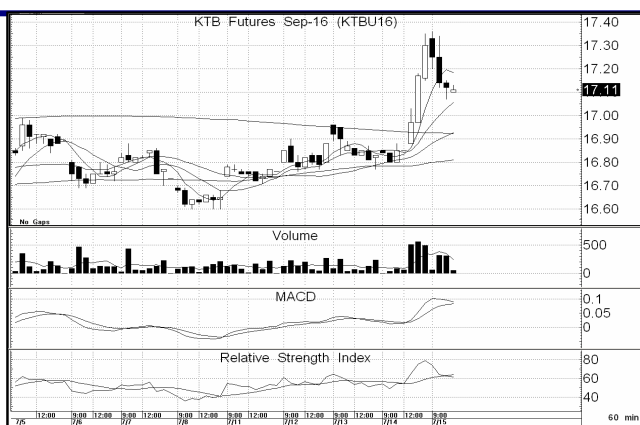
อย่างไรก็ตาม ยังมี 2 ปัจจัยบวกที่อาจสร้างความเสี่ยงให้กับขา Short คือ (1) เงินบาทที่แข็งค่า และ (2) Basis ที่ติดลบมากขึ้นเป็น -8 จุด จาก -4 จุด ทำให้ Downside ของ S50U16 อาจจำกัดกว่า SET50 การเล่นฝั่ง Short จึงแนะนำเพียง Trading ระยะสั้นเท่านั้น


Single Stock Futures: เปิดสถานะ Short KTBU16

เปิด Short KTBU16 ทำกำไรที่ 16.80-16.90 บาท ตัดขาดทุน 17.20 บาท

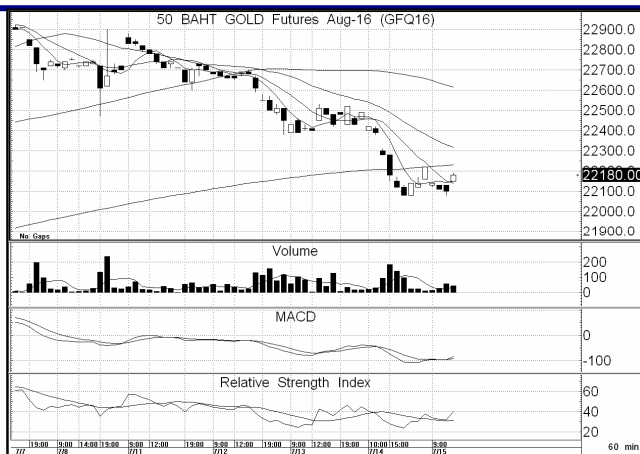
ราคา KTBU16 ปรับตัวเพิ่มขึ้นแล้วพลิกกลับมาอ่อนตัวลงเร็ว ทำให้ดัชนีบ่งชี้ทั้งระยะสั้นและกลางเกิดสัญญาณขัดแย้งเชิงลบกับ MACD จึงมีความเสี่ยงที่จะพักตัวลงช่วงสั้น โดยมีแนวรับตามเส้นค่าเฉลี่ยอยู่ที่ 16.80-16.90 บาท

แนะนำให้เก็งกำไรฝั่ง Short เพื่อรับการพักตัวลงชั่วคราว


Gold Futures: ถือ Short GFQ16

ถือ Short GFQ16 ทำกำไรที่ 22,050-22,080 บาท/บาททอง (\$1,315-1,320/Oz) ตัดขาดทุน 22,270 บาท/บาททอง (\$1,340/Oz)

ราคาทองคำโลกปรับตัวเพิ่มขึ้นเล็กน้อย แต่โดยรวมยังแกว่งออกด้านข้าง แม้ว่า GDP2Q16 ของจีนจะออกมาดีกว่าคาดเล็กน้อย แต่เพราะนั้นจะเป็นตัวสะกดกันไม่ให้ธนาคารกลางจีนผ่อนคลายนโยบายการเงินได้เต็มที่ เราจึงคาดว่าจะรอบการฟื้นตัวยังคงจำกัด และมีความเสี่ยงที่จะปรับตัวลงในทางเทคนิคหาบริเวณ \$1,315-1,320/Oz อีกครั้ง คาดกรอบการเคลื่อนไหวในช่วงบ่ายที่ \$1,320-1,340/Oz



DISCLAIMER: รายงานฉบับนี้จัดทำโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) "บริษัท" ข้อมูลที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ถูกจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่เราเชื่อว่ามีคุณภาพ เชื่อว่ามีความน่าเชื่อถือ และ/หรือมีความถูกต้อง อย่างไรก็ตาม บริษัทไม่รับรองความถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลดังกล่าว ข้อมูลและความคิดเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้อาจมีการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือเพิ่มเติมได้ตลอดเวลาโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า บริษัทไม่มีความประสงค์ที่จะชักจูงหรือชวนให้ผู้ลงทุนลงทุนหรือขายหลักทรัพย์ตามที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ รวมทั้งบริษัทไม่ได้รับประกันผลตอบแทนหรือราคาของหลักทรัพย์ตามข้อมูลที่ปรากฏแต่อย่างใด บริษัทจึงไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการนำข้อมูลหรือความเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ไม่ว่ากรณีใดก็ตาม ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและใช้ดุลยพินิจอย่างรอบคอบในการตัดสินใจลงทุน บริษัทขอสงวนลิขสิทธิ์ในข้อมูลและความคิดเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใดนำข้อมูลและความคิดเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ประโยชน์ คัดลอก ตัดแปลง ทำซ้ำ ออกแสดงหรือเผยแพร่ต่อสาธารณชนไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน โดยไม่ได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทล่วงหน้า การลงทุนในหลักทรัพย์มีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและพิจารณาอย่างรอบคอบก่อนการตัดสินใจลงทุน บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) อาจเป็นผู้ดูแลตลาด (Market Maker) และผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants) บนหลักทรัพย์ที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ โดยบริษัท อาจจัดทำวิเคราะห์ของหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวนี้ ดังนั้น นักลงทุนควรศึกษาและยึดในหนังสือชี้ชวนของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าวก่อนตัดสินใจลงทุน