

SET50 Index Futures: ทрудตัวลง

กลยุทธ์หลัก: Short S50M16 ทำกำไร 887-890 จุด ตัดขาดทุน 900 จุด

สถานะข้ามวัน: พิจารณา SET50 ที่ 898 จุด ปิดต่ำกว่าให้ถือ Short แต่ถ้าขึ้นเหนือได้ให้ถือ Long

S50M16 เคลื่อนไหวต่างจากที่เราประเมินไว้ในช่วงเช้า โดยทรุดตัวลงหนักจนต่ำกว่า 907 จุด ที่เป็นจุดเปลี่ยน Long เป็น Short ตามกลยุทธ์ทางเลือก โดยสถานการณ์ต่างจากที่เราประเมินไว้โดยสิ้นเชิง ตามแรงขายหุ่นขนาดใหญ่ที่ไล่เรียงไปเกือบจะทุกกลุ่ม สะท้อนให้เห็นถึงจิตวิทยาการลงทุนที่ไม่สดใสนัก

ซึ่งถ้าว่ากันตามแนวโน้มในช่วงบ่ายคาดว่า S50M16 จะอ่อนตัวลงต่อ แม้อาจจะมีพื้นที่ลักษณะ Technical Rebound แต่ยังเป็นแค่ฟื้นเพื่อลง ถ้าได้ Follow Short ตามมาและทำกำไรที่กรอบ 897-901 จุดไปแล้ว แนะนำให้กลับเข้า Short ใหม่ด้วยเหตุผล (1) ภาพการเคลื่อนไหวเสียความชันจากการลดฐานราคาลงเร็ว (2) บรรยากาศการลงทุนรวมที่เป็นลบ ทำให้กระแสเงินมีแนวโน้มกลับมาไหลออก (3) หุ่นที่น่าตลาดลงรอบนี้คือหุ่นขนาดใหญ่ ทำให้อาจมีการใช้ Index Futures เป็นเครื่องมือในการ Short Hedge จนกดดันให้ค่า Basis กลับมาเคลื่อนไหวแดนลบ



Single Stock Futures: Short KTBM16

Short KTBM16 ทำกำไร 16.30-16.40 บาท ตัดขาดทุน 16.75 บาท

ราคา KTBM16 พลิกกลับมาทรุดตัวลงเร็วจนหลุดจุดถอยฝั่ง Long ที่ประเมินไว้ใน 2 วันก่อนหน้าแถว 16.80 บาท ขณะที่ แรง Short ยังมีออกมามากขึ้นในช่วงท้ายตลาดภาคเช้า ทำให้มีความเสี่ยงที่ราคาจะทรุดตัวลงต่อ โดยเบื้องต้นประเมิน Downside ที่กรอบ 16.30-16.40 บาท ขณะที่ จังหวะพื้นที่ที่ถ้าหากเกิดขึ้นคาดว่าจะไม่เกิน 16.80 บาทแล้วอ่อนตัวลง เพราะรูปแบบการเคลื่อนไหวได้เสียแนวโน้มในระยะสั้นไปแล้ว คาดกรอบการเคลื่อนไหวในช่วงบ่าย 16.55-16.75 บาท



Gold Futures: กลับมา Long ตามแนวโน้ม

Long GFM16 ทำกำไร \$1,320/Oz ตัดขาดทุน \$1,297/Oz

ราคาทองคำโลกยังมีแนวโน้มปรับตัวเพิ่มขึ้น หลังจากกระชากขึ้นเหนือ \$1,300/Oz จาก Dollar Index ที่พักตัวลงและการถูกใช้เป็นแหล่งพักเงินขึ้นดี ซึ่งถ้าราคาขยับขึ้นต่อไปโดยแทบไม่ได้รับผลกระทบจากการประชุม FOMC ของเฟด แนวโน้มหลังจากนี้ยังน่าจะไหลได้อย่างมีนัยยะ และถ้าขยับ High ของรอบขึ้นได้แล้ว (\$1,307/Oz) ราคาทองคำตามรูปแบบปกติจะไม่จบลงโดยง่าย คาดกรอบบ่าย \$1,300-1,315/Oz



DISCLAIMER: รายงานฉบับนี้จัดทำโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) "บริษัท" ข้อมูลที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ถูกจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่เราเชื่อหรือการเชื่อว่ามีคุณภาพ เชื่อถือได้ และ/หรือมีความถูกต้อง อย่างไรก็ตาม บริษัทไม่รับรองความถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลดังกล่าว ข้อมูลและความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้อาจมีการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือเพิ่มเติมได้ตลอดเวลาโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า บริษัทไม่มีความประสงค์ที่จะชักจูงหรือชักชวนให้ลงทุน ลงทุนหรือขายหลักทรัพย์ตามที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ รวมทั้งบริษัทไม่ได้รับประกันผลตอบแทนหรือราคาของหลักทรัพย์ตามข้อมูลที่ปรากฏแต่อย่างใด บริษัทจึงไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการนำข้อมูลหรือความเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ไม่ว่ากรณีใดก็ตาม ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและใช้ดุลยพินิจอย่างรอบคอบในการตัดสินใจลงทุน บริษัทขอสงวนลิขสิทธิ์ในข้อมูลและความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใดนำข้อมูลและความเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ประโยชน์ คัดลอก ดัดแปลง ทำซ้ำ นอกเหนือแสดงหรือเผยแพร่ต่อสาธารณชนไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วน โดยไม่ได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทล่วงหน้า การลงทุนในหลักทรัพย์มีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและพิจารณาอย่างรอบคอบก่อนการตัดสินใจลงทุน บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) อาจเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market Maker) และผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants) บนหลักทรัพย์ที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ โดยบริษัท อาจจัดทำทวีตราห์ของหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวนี้ ดังนั้น นักลงทุนควรศึกษารายละเอียดในหนังสือชี้ชวนของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าวก่อนตัดสินใจลงทุน