

SET50 Index Futures: ออกข้าง

กลยุทธ์หลัก: Short S50M16 ทำกำไร 900 จุด ตัดขาดทุน 915 จุด

สถานะข้ามวัน: พิจารณา SET50 ที่ 910 จุด ปิดยื่นเหนือได้ให้ถือ Long แต่ถ้าต่ำกว่าให้ถือ Short

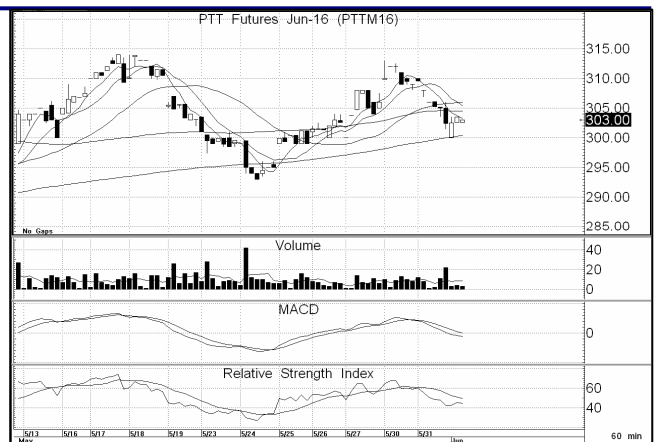
S50M16 อ่อนตัวลงเล็กน้อยในช่วงแรกก่อนจะปรับตัวเพิ่มขึ้นอีกครั้งตามบรรยากาศการลงทุนกลุ่ม TIPS ที่สดใส และความคาดหวังของกระแสเงินที่ไหลเข้าจากทิศทางเงินบาทที่แข็งค่าขึ้น ขณะเดียวกัน แรงซื้อ SCB จากกรณี AIA และ Prudential สนใจซื้อ SCB Life (SCB ถือ 94.66%) ก็มีน้ำหนักหนุนบรรยากาศการลงทุนในหุ้นกลุ่มแบงก์ด้วย อย่างไรก็ตาม เนื่องจากจังหวะการปรับขึ้นของ S50M16 เองเริ่มสะท้อนให้เห็นถึงความไม่มั่นใจ โดยเฉพาะแรง Short กดดันต่อเนื่องในปริมาณการซื้อขายที่มากกว่าฝั่ง Long ในช่วงติดตัวขึ้น ขณะที่ แรงเก็งกำไรใน SET ไปกระจุกตัวในหุ้นขนาดเล็กเป็นหลัก ทำให้เรายังคงว่า Upside การติดตัวจะอยู่ในกรอบจำกัด แม้ว่ารูปแบบการเคลื่อนไหวจะคล้ายช่วง 23-25 มี.ค. 16 ที่มีโอกาสกระชากขึ้นต่อ แต่สถานการณ์อาจต่างออกไปตรงที่น้ำมันดิบไม่ขึ้น ช่วงปลายแนะนำให้พิจารณาที่ตัวของ Index Futures เองว่าจะเดาตลาดถูกหรือไม่ เนื่องจาก Basis เริ่มติดลบมากขึ้นในจังหวะทดสอบแนวต้านแถว 915 จุด (นักเก็งกำไรใน Index Futures เดว่า SET50 จะไม่ผ่าน 915 จุด)



Single Stock Futures: ถือ Short ใน PTTM16

Short ใน PTTM16 ทำกำไรที่ 292-295 บาท ตัดขาดทุน 310 บาท

ราคา PTTM16 ยังเลี้ยงตัวเหนือ 300 บาทได้ดี แต่ราคาน้ำมันดิบและบริษัทลูกต่างๆ เริ่มชะลอการปรับขึ้น ขณะที่ ปริมาณการซื้อขายฝั่ง Long ยังเบาบาง ทำให้มีความอ่อนไหวต่อการพักตัวระยะสั้นยังไม่ถูกปิดกัน โดยช่วงปลายมีแนวต้านหลักที่ 305 บาท หากกลับไปยืนเหนือไม่ได้ อาจได้เห็นราคาพลิกกลับมาอ่อนตัวลงหา 292-295 บาท



Gold Futures: พักตัวลงชั่วคราว

ปล่อยสถานะว่าง รอประเมินทิศทางอีกครั้งในช่วง Night Session

ราคาทองคำโลกพลิกกลับมาอ่อนตัวลงเร็ว หลังจากขึ้นทดสอบ \$1,220/Oz แล้วไม่สามารถยืนเหนือได้ ซึ่งหลังจากถอยต่ำกว่าแนวรับระยะสั้น ทำให้ต้องขายลืดอกกำไรออกมาก่อน ทิศทางระยะสั้นอาจดูเป็นลบ (สัญญาณขัดแย้งเชิงลบกับ MACD) ทำให้คาดว่าจะได้เห็นการพักตัวลงต่อแต่ไม่หลุด \$1,205/Oz แล้วติดกลับทดสอบ \$1,230/Oz อีกครั้ง



DISCLAIMER: รายงานฉบับนี้จัดทำโดยบริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) "บริษัท" ข้อมูลที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ถูกจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่เราเชื่อว่ามีคุณภาพ เชื่อถือได้ และ/หรือมีความถูกต้อง อย่างไรก็ตาม บริษัทไม่รับรองความถูกต้องครบถ้วนของข้อมูลดังกล่าว ข้อมูลและความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้อาจมีการเปลี่ยนแปลง แก้ไข หรือเพิ่มเติมได้ตลอดเวลาโดยไม่ต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้า บริษัทไม่มีความประสงค์ที่จะชักจูงหรือชักชวนให้ลงทุน ลงทุนหรือขายหลักทรัพย์ตามที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ รวมทั้งบริษัทไม่ได้รับประกันผลตอบแทนหรือราคาของหลักทรัพย์ตามข้อมูลที่ได้รับจากแหล่งข้อมูลหรือความเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ว่ากรณีใดก็ตาม ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและใช้ดุลยพินิจอย่างรอบคอบในการตัดสินใจลงทุน บริษัทขอสงวนลิขสิทธิ์ในข้อมูลและความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใดนำข้อมูลและความเห็นในรายงานฉบับนี้ไปใช้ประโยชน์อื่นใด การลงทุนในหลักทรัพย์มีความเสี่ยง ผู้ลงทุนควรศึกษาข้อมูลและพิจารณาอย่างรอบคอบก่อนการตัดสินใจลงทุน บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันเซีย ไซรัส จำกัด (มหาชน) อาจเป็นผู้ดูแลสภาพคล่อง (Market Maker) และผู้ออกใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ (Derivative Warrants) บนหลักทรัพย์ที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ โดยบริษัทฯ อาจจัดทําบทวิเคราะห์ของหลักทรัพย์อ้างอิงดังกล่าวนี้ ดังนั้น นักลงทุนควรศึกษารายละเอียดในหนังสือชี้ชวนของใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ดังกล่าวก่อนตัดสินใจลงทุน