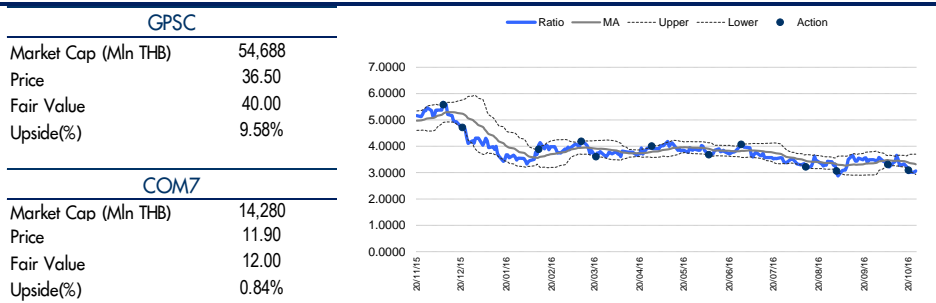


กลยุทธ์ Pairs Trade

แนะนำให้ปิดสถานะ Pairs Trade ด้วยการขาย GPSC พร้อมกับซื้อคืน COM7

Pairs Trade Action: หลังจากแนะนำเปิดสถานะเมื่อช่วงบ่ายวันที่ 20 ต.ค. 2559 แม้ COM7 จะติด Cash Balance และล่าสุดอัตราส่วนราคายังไม่ตัดเส้นค่าเฉลี่ย 20 วันก็ตาม แต่ราคาหุ้น COM7 มีโอกาสกลับมาฟื้นตัวอีกครั้ง จากยอดขาย iPhone7 ที่คึกคัก หนุนการเติบโตช่วง High Season ในงวด 4Q59 จึงแนะนำให้ปิดสถานะ: โดยการขาย GPSC ที่ราคาไม่ต่ำกว่า 36.50 บาท และ ซื้อคืน COM7 ที่ราคาไม่เกิน 11.90 บาท จะทำให้ได้ผลตอบแทนไม่ต่ำกว่า 2.15% ขณะที่ SET Index ที่ให้ผลตอบแทนราว 0.68% ในช่วงเวลาเดียวกัน

สัญญาณการทำ Pairs Trade ย้อนหลัง 1 ปี ของ COM7 และ GPSC



สถานะคงค้างใน Pairs Trade Portfolio

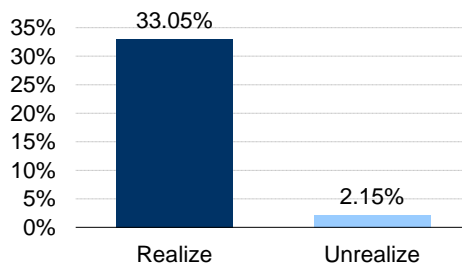
ข้อมูลการปิดสถานะในอดีต												
No.	Long	ต้นทุน	ราคาปิดสถานะ	ผลตอบแทน	Short	ต้นทุน	ราคาปิดสถานะ	ผลตอบแทน	วันที่เปิดสถานะ	วันที่ปิดสถานะ	กำไร/ขาดทุน	SET
1	SIRI	1.52	1.54	1.32%	SCB	132	131.5	0.11%	29/01/2016	16/02/2016	1.42%	-0.53%
2	SPCG	20.9	22.2	6.22%	SIRI	1.65	1.63	-1.18%	29/02/2016	02/03/2016	7.40%	1.62%
3	BEC	27.5	27.75	0.91%	PSL	6.35	6.55	-3.15%	04/04/2016	04/04/2016	-2.24%	0.15%
4	KCE	72.5	78	7.59%	AOT	404	393	2.68%	25/04/2016	28/04/2016	10.26%	-0.75%
5	KBANK	160	162	1.25%	SCB	130	125	3.38%	18/04/2016	19/05/2016	4.63%	0.36%
6	WHA	3.1	3.38	9.03%	DTAC	36	36.5	-1.42%	31/05/2016	02/06/2016	7.61%	0.39%
7	GPSC	32.5	32.5	0.00%	THAI	18.9	19.4	-2.65%	20/06/2016	20/06/2016	-2.65%	-0.28%
8	CPN	57.5	56	-2.61%	HMPRO	10.1	10	0.99%	01/08/2016	01/08/2016	-1.62%	-0.78%
9	AP	7.1	7.25	2.11%	CBG	65.5	61.5	6.11%	15/09/2016	15/09/2016	8.22%	1.16%

สถานะคงค้างในปัจจุบัน												
No.	Long	ต้นทุน	ราคาล่าสุด	ผลตอบแทน	Short	ต้นทุน	ราคาล่าสุด	ผลตอบแทน	วันที่เปิดสถานะ	วันที่ล่าสุด	กำไร/ขาดทุน	SET
1	GPSC	36	36.5	1.39%	COM7	12	11.9	0.78%	20/10/2016	25/10/2016	2.15%	0.68%

สรุป Performance ของคำแนะนำ

Pair Trade Port Summary			
Number of Trade	10	Total Profit	35.19%
Winning	7	Winning (%)	70.00%
Losing	3	Losing (%)	30.00%

กำไรสะสมของการทำ Pair Trade



ประสิทธิ์ รัตนกิจมงคล CISA, CFA

prasit.re@asiaplus.co.th

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 025917

พชชัย กัทธาภิณ

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 052647

ภราดร เตียรณปรานีไทย

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 075365

ข้อมูลในเอกสารฉบับนี้ รวบรวมมาจากแหล่งข้อมูลที่น่าเชื่อถือ อย่างไรก็ตาม บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด ไม่สามารถที่จะยืนยันหรือรับรองความถูกต้องของข้อมูลเหล่านี้ได้ ไม่ว่าประการใดๆ บทวิเคราะห์ในเอกสารนี้ จัดทำขึ้นโดยอ้างอิงหลักเกณฑ์ทางวิชาการเกี่ยวกับหลักการวิเคราะห์ และได้เป็นการชี้นำ หรือเสนอแนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ การตัดสินใจซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ ของผู้อ่าน ไม่ว่าจะเกิดจากการอ่านบทความในเอกสารนี้หรือไม่ก็ตาม ส่วนเป็นผลจากการใช้วิจารณญาณของผู้อ่าน โดยไม่มีส่วนเกี่ยวข้องกับหรือพันธะผูกพันใดๆ กับ บริษัทหลักทรัพย์ เอเชีย พลัส จำกัด ไม่ว่ากรณีใด