

Call Derivative Warrant on PTT

Underlying : PTT

วันนี้ SET มีโอกาสกลับไปทดสอบ 1500 จุด จาก Sentiment เชิงบวก หลังผู้นำ OPEC เห็นชอบลดกำลังการผลิต หนูนราคาน้ำมันดิบโลก เมื่อคืนที่ผ่านมา ดัชนีขึ้นมากกว่า 5% กลยุทธ์แนะนำให้เก็งกำไรระยะสั้นในหุ้นที่ได้ประโยชน์จากประเด็นดังกล่าว อย่าง PTT

Underlying Fundamental View

เมื่อคืนราคาน้ำมันดิบโลกปรับตัวเพิ่มขึ้นกว่า 5% และยังปรับตัวเพิ่มขึ้นต่อเนื่องในเช้านี้ เนื่องจากกลุ่ม OPEC ได้มีการตัดสินใจลดกำลังการผลิตลง 2 -7 แสนบาร์เรลต่อวัน จากปัจจุบันกำลังผลิตอยู่ที่ 33.2 ล้านบาร์เรลต่อวัน (ล่าสุด เดือน ส.ค.) เหลือ 32.5 - 33 ล้านบาร์เรลต่อวัน และถือเป็นการลดกำลังผลิตครั้งแรกในรอบ 8 ปี นอกจากนี้ยังมีการรายงานตัวเลขสต็อกน้ำมัน (สิ้นสุด 23 ก.ย.) ที่ลดลงมากกว่าคาด คือ สต็อกน้ำมันดิบลดลงกว่า 1.9 ล้านบาร์เรล (คาดลด 0.75 ล้านบาร์เรล) และเป็นการลดลงติดต่อกันเป็นสัปดาห์ที่ 5 โดยทั้งหมดที่กล่าวมาน่าจะช่วยหนุนราคาหุ้นน้ำมันให้ฟื้นตัวได้ในระยะสั้น กลยุทธ์แนะนำให้เก็งกำไรระยะสั้นในหุ้นน้ำมัน อย่าง PTT โดยฝ่ายวิจัยให้ราคาเหมาะสมที่ 400 บาท โดยมี Upside สูงถึง 21.58%

Underlying Technical View

PTT ยังสามารถยืนบนแนวรับกรอบแนวโน้มขาขึ้นใหญ่ได้ โดยเห็น Volume สอดคล้องกับทิศทางการเคลื่อนที่ของราคา และด้วย RSI ที่ฟื้นตัวขึ้นมาต่อเนื่องหลังร่วงลงเขต Oversold แสดงให้เห็นว่าราคาเริ่มกลับมาแข็งแกร่งมากขึ้น และจะมีโอกาสปรับตัวเพิ่มขึ้นต่อ โดยในระยะสั้นประเมินแนวต้านไว้ที่ 340 และ 357 บาท ตามลำดับ

DW	Issuer Name	DW Price	Eff Gearing	Sensitivity	ImpliedVol	Time Decay (Baht)
PTT01C1609A	BLS	1.13	3.50	1.20	100.00%	-0.0004
PTT01C1612A	BLS	0.92	3.50	0.98	59.40%	-0.0028
PTT01C1702A	BLS	0.90	3.30	0.89	59.30%	0.0029
PTT06C1611A	PTSEC	1.63	8.60	1.18	100.00%	-0.0035
PTT08C1610A	ASPS	0.58	377.90	1.15	100.00%	-0.0161
PTT08C1702A	ASPS	0.68	4.10	0.84	59.50%	-0.0045
PTT11C1609A	KS	1.60	3.10	1.47	100.00%	-0.0005
PTT11C1703A	KS	0.81	3.80	0.92	49.50%	-0.0028
PTT13C1611A	KGI	1.09	321.90	0.98	100.00%	-0.0052
PTT13C1612A	KGI	0.55	5.10	0.86	58.70%	-0.0057
PTT13C1705A	KGI	1.11	2.50	0.87	63.80%	-0.0022
PTT23C1611A	SCBS	1.57	566.80	1.72	100.00%	-0.0118
PTT23C1705A	SCBS	0.63	3.90	0.74	50.80%	-0.0028
PTT24C1709A	FSS	0.97	3.80	1.11	44.11%	-0.0033
PTT27C1703A	RHBS	1.11	374.40	1.14	100.00%	-0.0057
PTT28C1611A	MACQ	1.00	4.60	1.30	49.50%	-0.0025
PTT28C1612A	MACQ	0.44	6.20	0.82	53.80%	-0.0058
PTT42C1611A	MBKET	0.67	5.30	1.07	55.80%	-0.0060

ราคาปัจจุบัน (บาท): 329
ราคาเป้าหมาย (บาท): 400
Upside 21.58%
มูลค่าตลาด (ล้านบาท) 939,723

Technical Chart



“ปัจจุบันบริษัทกระทำการในฐานะบริษัทผู้ออกและผู้ดูแลสภาพคล่อง ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ในหุ้น AAV, ADVANC, AMATA, AOT, BA, BANPU, BBL, BCH, BCP, BDMS, BEAUTY, BEM, BH, BJCHI, BLA, BLAND, BTS, CBG, CENTEL, CHG, CK, CPALL, CPF, CPN, DTAC, EGCO, EPG, GL, GLOBAL, GPSC, GUNKUL, HANA, ICHI, IFEC, IRPC, ITD, IVL, JAS, KBANK, KCE, KTB, KTC, LH, LPN, MINT, MTLs, PLANB, PS, PTG, PTT, PTTEP, PTTGC, QH, ROBINS, RS, SAMART, SAWAD, SCB, SCC, SIRI, SPALI, STEC, STPI, TASCO, THAI, THCOM, TMB, TOP, TPIPL, TRUE, TTA, TTCL, UNIQ, VGI, WHA”

ประสิทธิ์ รัตนกิจมงคล CISA, CFA

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 025917
prasit.re@asiaplus.co.th

พณีย์ กัทรวิญญ์

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 052647

ชาญชัย พันธนากิจ

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 064045

กราดร เตียรณปราโมทย์

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 075365

ข้อมูลในเอกสารฉบับนี้ รวบรวมมาจากแหล่งข้อมูลที่น่าเชื่อถือ อย่างไรก็ดี บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด ไม่สามารถที่จะยืนยันหรือรับรองความถูกต้องของข้อมูลเหล่านี้ได้ ไม่ว่าประการใดๆ บทวิเคราะห์ในเอกสารนี้จัดทำขึ้นโดยอ้างอิงหลักเกณฑ์ทางวิชาการเกี่ยวกับหลักการวิเคราะห์ และมีได้เป็นการชี้แนะ หรือเสนอแนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ การตัดสินใจซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ ของผู้อ่าน ไม่ว่าจะเกิดจากการอ่านบทความในเอกสารนี้หรือไม่ก็ตาม ล้วนเป็นผลจากการใช้วิจารณญาณของผู้อ่าน โดยไม่มีส่วนเกี่ยวข้องกับหรือพันธะผูกพันใดๆ กับ บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด ไม่ว่ากรณีใด