

Call Derivative Warrant on PTTEP

Underlying : PTTEP

วันนี้ SET น้ำมันดิบโลกพุ่งขึ้นมาขึ้นเหนือ 50 เหรียญฯ ต่อบาร์เรลในรอบ 1 ปี กลยุทธ์เน้นลงทุนในหุ้นน้ำมัน อย่าง PTTEP ที่ราคาหุ้นเพิ่งปรับตัวขึ้นมาเพียง 1% หลังผู้นำ OPEC เห็นชอบลดกำลังการผลิต ขณะที่ราคาน้ำมันดิบโลกปรับตัวเพิ่มขึ้นไปแล้วกว่า 15%

Underlying Fundamental View

เมื่อคืนราคาน้ำมันดิบโลกพุ่งขึ้นมาขึ้นเหนือ 50 เหรียญฯ ต่อบาร์เรลในรอบ 1 ปี หลังจากนาย วลาดีเมียร์ ปูติน ประธานาธิบดีรัสเซีย ได้ออกมาส่งสัญญาณว่าจะให้ความร่วมมือในข้อตกลงปรับลดเพดานการผลิตน้ำมัน พร้อมกับเรียกร้องให้ประเทศผู้ส่งออกน้ำมันรายอื่นๆ ดำเนินตามเช่นกัน นอกจากนี้ราคาน้ำมันดิบโลกยังปรับตัวเพิ่มขึ้นมาแล้วกว่า 15% หลังจากวันที่ 27 ก.ย. 59 ที่ผู้นำ OPEC เห็นชอบด้วยการปรับลดเพดานการผลิตน้ำมัน ขณะที่ราคาหุ้น PTTEP กลับปรับตัวขึ้นมาเพียง 1% ในช่วงเวลาเดียวกัน ดังนั้นจึงเป็นโอกาสดีที่จะเข้าไปลงทุนในหุ้นดังกล่าว โดยฝ่ายวิจัยให้ราคาเหมาะสมที่ 102 บาท โดยมี Upside สูงถึง 26.71%

Underlying Technical View

PTTEP แม้จะเปิด Gap ลงแรงแต่ก็สามารถยืนเหนือระดับ Low เดิมที่ 79.25 บาทได้ และปิดเป็นแท่งเทียนคล้าย Hammer โดยยังเห็น RSI วิ่งคล้ายตามกับ Price Action ประกอบกับ MACD ที่ยังอยู่ในแดนบวก จึงมีโอกาสที่ราคาจะสามารถฟื้นตัวขึ้นได้ต่อ ในระยะสั้นประเมินแนวต้านไว้ที่ 83.50 บาท หากผ่านได้มีโอกาสขึ้นทดสอบ High เดิมที่ 86.75 บาท

ราคาปัจจุบัน (บาท):	80.50
ราคาเป้าหมาย (บาท):	102.00
Upside	26.71%
มูลค่าตลาด (ล้านบาท)	319,584

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 ภัทราวิชญ์

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 052647

ชาญชัย พันธนากิจ

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 064045

กรรณ เตียรณปรานิภย์

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 075365

DW	Issuer Name	DW Price	Eff Gearing	Sensitivity	Implied Vol	Time Decay (Baht)
PTTE01C1611A	BLS	0.79	3.90	0.97	72.30%	-0.0050
PTTE01C1701A	BLS	0.72	3.70	0.82	64.30%	-0.0037
PTTE06C1709A	PTSEC	1.33	2.30	0.96	51.90%	-0.0013
PTTE08C1610A	ASPS	0.30	8.10	0.76	77.10%	-0.0147
PTTE08C1702A	ASPS	0.67	3.60	0.75	75.30%	-0.0053
PTTE11C1610A	KS	1.14	4.30	1.53	56.10%	-0.0020
PTTE11C1704A	KS	1.02	3.20	1.02	54.90%	-0.0028
PTTE13C1610A	KGI	0.20	15.30	1.05	61.70%	-0.0227
PTTE13C1611A	KGI	0.86	4.00	1.07	68.80%	-0.0050
PTTE13C1703A	KGI	0.73	3.90	0.87	62.80%	-0.0047
PTTE16C1612A	TNS	0.94	3.90	1.05	54.80%	-0.0027
PTTE23C1611A	SCBS	1.50	4.80	1.93	58.30%	-0.0088
PTTE23C1705A	SCBS	0.38	4.60	0.53	54.60%	-0.0031
PTTE24C1705A	FSS	0.99	4.00	1.09	54.10%	-0.0048
PTTE27C1701A	RHBS	0.86	3.70	1.00	66.60%	-0.0051
PTTE28C1611A	MACQ	0.11	10.40	0.32	59.60%	-0.0054
PTTE28C1701A	MACQ	0.71	4.30	0.95	63.80%	-0.0054

ข้อมูลในเอกสารฉบับนี้ รวบรวมมาจากแหล่งข้อมูลที่น่าเชื่อถือ อย่างไรก็ดี บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด ไม่สามารถที่จะยืนยันหรือรับรองความถูกต้องของข้อมูลเหล่านี้ได้ ไม่ว่าประการใดๆ บทวิเคราะห์ในเอกสารนี้ จัดทำขึ้นโดยอ้างอิงหลักเกณฑ์ทางวิชาการเกี่ยวกับหลักการวิเคราะห์ และได้ผ่านการพิจารณา หรือเสนอแนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ การตัดสินใจซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ ของผู้อ่าน ไม่ว่าจะเกิดจากการอ่านบทความในเอกสารนี้หรือไม่ก็ตาม ล้วนเป็นผลจากการใช้วิจารณญาณของผู้อ่าน โดยไม่มีส่วนเกี่ยวข้องกับหรือพันธะผูกพันใดๆ กับ บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด ไม่ว่ากรณีใด