

Call Derivative Warrant on PTTEP

Underlying : PTTEP

เชื่อว่าตลาดยังขาดแรงหนุน ทำให้ดัชนีพันธพวน และอยู่ต่ำกว่า 1,500 จุด กลยุทธ์แนะนำลงทุนในหุ้นที่มีปัจจัยบวกหนุน อย่าง PTTEP โดยราคาหุ้นมีโอกาสปรับตัวเพิ่มขึ้นตามราคาน้ำมันดิบโลกที่พุ่งขึ้นกว่า 2.6% ในคืนที่ผ่านมา เนื่องจากตัวเลขสต็อกน้ำมันที่ออกมาต่ำกว่าคาดมาก อีกทั้งราคาหุ้นยัง laggard กว่า การฟื้นตัวของราคาน้ำมันดิบโลกอยู่มาก

Underlying Fundamental View

เมื่อคืนราคาน้ำมันดิบโลกพุ่งขึ้นไปทำจุดสูงสุดที่ 51.93 เหรียญต่อบาร์เรล ซึ่งเป็นการทำจุดสูงสุดใหม่ในรอบ 1 ปี 3 เดือน หลังจาก EIA รายงานสต็อกน้ำมันสิ้นสุดสัปดาห์ (14 ต.ค.) พบว่า ลดลง 5.2 ล้านบาร์เรล ซึ่งต่ำกว่าที่นักวิเคราะห์คาดการณ์มาก (คาดว่าเพิ่มขึ้น 2.7 ล้านบาร์เรล) โดยราคาน้ำมันดิบโลกได้ปรับตัวเพิ่มขึ้นต่อเนื่องกว่า 16.25% หลังผู้ผลิตน้ำมันในกลุ่ม OPEC ได้ตกลงร่วมมือกันคงกำลังการผลิตวันละ 32.5-33 ล้านบาร์เรล (27 ก.ย.) ซึ่งช่วยลดปัญหา Over Supply ขณะที่ราคาหุ้น PTTEP กลับปรับตัวขึ้นมาเพียง 5.37% ในช่วงเวลาเดียวกัน ดังนั้นจึงเป็นโอกาสดีที่จะเข้าไปลงทุนในหุ้นดังกล่าว โดยฝ่ายวิจัยให้ราคาเหมาะสมที่ 102 บาท โดยมี Upside กว่า 20%

Underlying Technical View

PTTEP : กรอบแนวโน้มขาขึ้นและแท่งเทียน Hammer ยังคงมีผลอยู่ ล่าสุดราคาปิดจ่อแนวต้านเดิมที่ 83.50 บาท พร้อมสัญญาณบวกจาก MACD ที่อยู่ระดับเหนือศูนย์ และ RSI ที่ขึ้นสูงกว่าระดับ 55 สื่อถึงความแข็งแกร่งของราคาที่มากขึ้น จึงมีโอกาสที่ราคาจะฟื้นต่อและขึ้นทดสอบแนวต้านระดับ High เดิมที่ 86.75 บาท หากสามารถผ่านได้ประเมินแนวต้านถัดไปที่ 89.00 บาท

DW	Issuer Name	DW Price	Eff Gearing	Sensitivity	Implied Vol	Time Decay (Baht)
PTTE01C1611A	BLS	0.88	4.10	1.05	68.30%	-0.0046
PTTE01C1701A	BLS	0.78	3.70	0.86	63.60%	-0.0038
PTTE06C1709A	PTSEC	1.44	2.40	0.99	50.00%	-0.0013
PTTE08C1610A	ASPS	0.25	11.90	0.83	68.40%	-0.0193
PTTE08C1702A	ASPS	0.72	3.70	0.78	73.20%	-0.0056
PTTE11C1610A	KS	1.34	3.90	1.54	84.50%	-0.0034
PTTE11C1704A	KS	1.12	3.10	1.06	55.40%	-0.0029
PTTE13C1611A	KGI	0.94	4.30	1.18	59.00%	-0.0038
PTTE13C1703A	KGI	0.81	3.90	0.91	62.60%	-0.0050
PTTE16C1612A	TNS	0.98	3.90	1.12	51.30%	-0.0022
PTTE23C1611A	SCBS	1.47	5.00	2.14	53.40%	-0.0077
PTTE23C1705A	SCBS	0.41	4.60	0.57	54.80%	-0.0034
PTTE24C1705A	FSS	0.93	4.00	1.15	53.80%	-0.0051
PTTE27C1701A	RHBS	0.94	3.90	1.06	63.90%	-0.0051
PTTE28C1611A	MACQ	0.10	12.80	0.35	58.40%	-0.0071
PTTE28C1701A	MACQ	0.78	4.40	1.01	62.80%	-0.0056

ราคาปัจจุบัน (บาท):	83.25
ราคาเป้าหมาย (บาท):	102.00
Upside	22.52%
มูลค่าตลาด (ล้านบาท)	330,501

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 กัทธาวิชญ์

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 052647

ชาญชัย พันธนากิจ

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 064045

กราด เตียรณปรโมทัย

เลขทะเบียนนักวิเคราะห์ : 075365

ข้อมูลในเอกสารฉบับนี้ รวบรวมมาจากแหล่งข้อมูลที่เชื่อถือได้อย่างดีที่สุด บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด ไม่สามารถที่จะยืนยันหรือรับรองความถูกต้องของข้อมูลเหล่านี้ได้ ไม่ว่าประการใดๆ บทวิเคราะห์ในเอกสารนี้ จัดทำขึ้นโดยอ้างอิงหลักเกณฑ์ทางวิชาการเกี่ยวกับหลักการวิเคราะห์ และมีได้เป็นการชี้แนะ หรือเสนอแนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ การตัดสินใจซื้อหรือขายหลักทรัพย์ใดๆ ของผู้อ่าน ไม่ว่าจะเกิดจากการอ่านบทความในเอกสารนี้หรือไม่ก็ตาม ล้วนเป็นผลจากการใช้วิจารณญาณของผู้อ่าน โดยไม่มีส่วนเกี่ยวข้องหรือพันธะผูกพันใดๆ กับ บริษัทหลักทรัพย์ เอเซีย พลัส จำกัด ไม่ว่ากรณีใด