

“เปิด” สถานะ Long S50U21 เป้าหมาย 970 / 978... “ซื้อ” Block BANPU



อดิศักดิ์ ผู้พัฒนศิริสกุล,
CFA วิหันธ์ ธรรมบำรุง

มุมมองตลาดวันนี้: SET พื้นตัวขึ้นได้ต่อเนื่อง หลังเริ่มคลายกังวลประเด็น Evergrande มีแรงซื้อเด่นในธนาคารและสื่อสาร SCB ADVANC TRUE และ DTAC แม้ DELTA กดดันต่างชาติขาย -1,025 ลบ. มอง SET มีโอกาสพื้นตัวขึ้นต่อ ด้วยแนวต้าน 1,625 / 1,636

ทำอะไรดี:

- 1) **“เปิด” สถานะ Long S50U21 เป้าหมาย 970 / 978** S50U21 มีสัญญาณ Breakout ทะลุแนวทศ Downtrend Line ในกราฟรายชั่วโมงขึ้นได้...ต่างชาติ Short -4,691 สัญญา แนะนำ **“เปิด Long”** S50U21 เป้าหมาย 970 / 978... โดยมี Trailing Stop ที่ 959
- 2) **“ซื้อ” Block BANPU...ราคาถ่วงหินและก๊าซหนุนกำไร** มองกำไรแรงตัวขึ้นใน 2H21 จากทั้งราคาถ่วงหินและก๊าซที่ปรับตัวสูงขึ้นต่อเนื่อง คาดกำไรโต +22% ปีหน้า ซื้อขายยังไม่แพงที่ PE22 6.5x และปันผลสูง 6.2% พื้นฐาน 20 บาท

BANPU ยกฐานขึ้นต่อหลังพักตัว แนวต้าน 13.00 / 13.30...Leverage 6.6x



รายงานฉบับนี้จัดทำโดยบริษัทหลักทรัพย์ธนชาต จำกัด (มหาชน) โดยจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่เชื่อถือได้ว่าน่าเชื่อถือ ทั้งนี้มีวัตถุประสงค์ เพื่อให้บริการเผยแพร่ข้อมูลแก่ผู้ลงทุนและใช้เป็นข้อมูลประกอบการตัดสินใจซื้อขายหลักทรัพย์ แต่ไม่ได้มีเจตนาชี้แนะหรือเชิญชวนให้ซื้อหรือขายหรือประกันราคาหลักทรัพย์แต่อย่างใด ทั้งนี้รายงานและความเห็นในเอกสารฉบับนี้อาจมีการเปลี่ยนแปลงแก้ไขได้ หากข้อมูลที่ได้รับมาเปลี่ยนแปลงไป การนำข้อมูลที่ปรากฏอยู่ในเอกสารฉบับนี้ ไม่ว่าทั้งหมดหรือบางส่วนไปทำซ้ำ ดัดแปลง แก้ไข หรือนำออกเผยแพร่แก่สาธารณชน จะต้องได้รับความยินยอมจากบริษัทก่อน

SET50 Futures

LONG

สัญญา	S50U21
ราคาปิดเมื่อวาน	966.40
เป้าหมายทางเทคนิค	970 / 978
จุดตัดขาดทุน	959.00
วันหมดอายุ	29 ก.ย. 21
ราคาทางทฤษฎี	969.21
Premium/Discount	-0.3%

BLOCK TRADE

BANPUU21X

สัญญา	BANPUU21X	
ราคาปิด	12.5	
เป้าหมายทางเทคนิค	13.3	
ผลตอบแทนที่เป้าหมาย	42%	
จุดตัดขาดทุน	12.1	
วันหมดอายุ	29 ก.ย. 21	
จำนวนสัญญาขั้นต่ำ (สัญญา)	500.00	
ตัวคูณสัญญา (หุ้น)	1,187.00	
หลักประกันต่อ 1 Block (บาท)	1,121,750	
Leverage (x)	6.61	
เปรียบเทียบ	BANPU	BANPUU21X
เงินลงทุน/Block	7,418,750	1,121,750
ผลตอบแทนก่อนดอกเบี้ย		
12.20	-2.4%	-15.9%
12.30	-1.6%	-10.6%
12.40	-0.8%	-5.3%
12.50	0.0%	0.0%
12.60	0.8%	5.3%
12.70	1.6%	10.6%
12.80	2.4%	15.9%
13.30	6.4%	42.3%

ติดต่อฝ่าย Derivatives: 02-779-9000

3) “ซื้อ” DW16 หุ้นกลุ่มโรงไฟฟ้า...GULF ACE และ GPSC มอง SET ยังคงแกว่งผันผวนจากความกังวล QE และประเด็น Evergrande...มอง Selective กลุ่มโรงไฟฟ้าที่ยังมีประเด็นบวกรออยู่ แนะนำ GULF กลับตัวจากแนวรับ ด้าน 42.25/ 43.25 (Stop 40.00) ACE ประเด็นโรงไฟฟ้าชุมชนหนุน ด้าน 4.12 / 4.20 (Stop 3.98) และ GPSC ราคาหุ้นปรับลงมากเกินไป ธุรกิจ EV Battery หนุนกำไรระยะยาว ด้าน 79/ 80.25 (Stop 76.75)

GULF16C2112A Sens. 1.14, Gearing 6.13x, Decay 2 วัน/Tick

ACE16C2201A Sens. 0.99, Gearing 5.48x, Decay 2 วัน/Tick

GPSC16C2201A Sens. 0.73, Gearing 6.18x, Decay 1 วัน/Tick

GULF กลับตัวขึ้นจากแนวรับ แนวด้าน 42.25 / 43.25

Gulf Energy Development PCL (GULF)



GULF16C2112A indicative price

Underlying Bid	23 Sep 21	27 Sep 21	28 Sep 21	29 Sep 21	30 Sep 21
42.50	0.38	0.37	0.37	0.36	0.36
42.25	0.37	0.36	0.36	0.35	0.35
42.00	0.35	0.35	0.34	0.34	0.33
41.75	0.34	0.34	0.33	0.33	0.32
41.50	0.33	0.32	0.32	0.31	0.31
41.25	0.32	0.31	0.31	0.30	0.30
41.00	0.31	0.30	0.30	0.29	0.29
40.75	0.29	0.29	0.28	0.28	0.27
40.50	0.28	0.28	0.27	0.27	0.26
40.25	0.27	0.27	0.26	0.26	0.25
40.00	0.26	0.26	0.25	0.25	0.24

Source: Thanachart estimate

Derivatives Warrant
GULF16C2112A

สัญญา	GULF16C2112A
ราคาปิด DW	0.32
ราคาเป้าหมาย DW	0.42
ผลตอบแทนที่เป้าหมาย	31.3%
ราคาเป้าหมายหุ้นอ้างอิง	43.25
Strike Price	50.00
Sensitivity	1.1
Gearing (x)	6.13
Time Decay (day/tick)	2
Time to Maturity (Day)	98
Moneyness	OTM
Implied Volatility	57%

Bid Price

Stock	GULF16C2112A
42	0.35
41.75	0.34
41.5	0.33
41.25	0.32
41	0.31
40.75	0.29
40.5	0.28

www.dw16.com for more indicative price

Thanachart Research Team

หัวหน้าฝ่าย

พิมพ์ผกา นิजरูณ, CFA
Tel: 662-779-9199
pimpaka.nic@thanachartsec.co.th

พลังงาน, บีโตร์เคมี, กระดาษ

จักร เรืองสินภิญญา
Tel: 662-779-9104
chak.reu@thanachartsec.co.th

สาธารณูปโภค, สื่อสาร

ณัฐภาพ ประสิทธิ์สุขสันต์
Tel: 662-483-8296
nuttapop.Pra@thanachartsec.co.th

อิเล็กทรอนิกส์, อาหาร, เครื่องดื่ม, เติบเร็ว

พัทธดนย์ บุญนา
Tel: 662-483-8298
pattadol.bun@thanachartsec.co.th

อสังหาริมทรัพย์, พาณิชยกรรม

พรรณารายณ์ ดิยะพิทยารัตน์
Tel: 662-779-9109
phannarai.von@thanachartsec.co.th

ยานยนต์, นิคมฯ, Property Fund, REITs, บ้านเชิง

รดา ลิ้มสุทธิวันภูมิ
Tel: 662-483-8297
rata.lim@thanachartsec.co.th

ธนาคาร, ธุรกิจการเงิน, ประกัน

สรชดา สรทรง
Tel: 662-779-9106
sarachada.sor@thanachartsec.co.th

ขนส่ง, รับเหมา

ศักดิ์สิทธิ์ พัฒนานารักษ์
Tel: 662-779-9112
saksid.pha@thanachartsec.co.th

Small Cap, การแพทย์, โรงแรม

ศิริพร อรุโณทัย
Tel: 662-779-9113
siriporn.aru@thanachartsec.co.th

กลยุทธ์การลงทุน

อดิศักดิ์ ผู้พัฒนาหลักทรัพย์, CFA
Tel: 662-779-9120
adisak.phu@thanachartsec.co.th

วิเคราะห์เทคนิค

ภัทรวัลย์ หวังมิ่งมาศ
Tel: 662-779-9105
pattarawan.wan@thanachartsec.co.th

วิเคราะห์ทางเทคนิค

วิชานันท์ ธรรมบำรุง
Tel: 662-779-9123
witchanan.tam@thanachartsec.co.th

กลยุทธ์การลงทุน

เถลิงศักดิ์ คูเจริญไพศาล
Tel: 662-483-8304
thaloengsak.kuc@thanachartsec.co.th

วิเคราะห์เชิงปริมาณ

สิทธิเชษฐ รุ่งรัมย์พัฒน์
Tel: 662-483-8303
sittichet.run@thanachartsec.co.th

นักวิเคราะห์, แพล

ลาภินี ทิพยมณฑล
Tel: 662-779-9115
lapinee.dib@thanachartsec.co.th

Data Support Team

มลฤดี เพชรแสงใสกุล

Tel: 662-779-9108
monrudee.pet@thanachartsec.co.th

เกษมรัตน์ จิตกุล

Tel: 662-779-9118
kasemrat.jit@thanachartsec.co.th

วราทิพย์ รุ่งประดับวงศ์

Tel: 662-779-9114
varathip.run@thanachartsec.co.th

สุนทร รัชชาวัต

Tel: 662-779-9117
sunet.rak@thanachartsec.co.th

สุขสวัสดิ์ ลิ้มวางษ์ปราวณี

Tel: 662-779-9116
suksawat.lim@thanachartsec.co.th

สุจินตนา สถาพร

Tel: 662-779-9198
sujintana.sth@thanachartsec.co.th

Thanachart Securities Pcl.

Research Team

19 Floor, MBK Tower
444 Phayathai Road, Pathumwan Road, Bangkok 10330
Tel: 662 -779-9119
Email: thanachart.res@thanachartsec.co.th