Morning Note

PHILLIP SECURITIES
Your Partner in Investment

Thailand Equities Research
8 มีนาคม 2555

กลยุทธ์การลงทุน: เทรดดิ้งในกรอบ 1149-1160
แนวโน้มตลาดวันนี้: ผันผวนในกรอบอิงทางอ่อนตัวลง

คาดตลาดหุ้นไทยวันนี้จะมีความผันผวนในกรอบ 1149-1160 อิงทางอ่อนตัวลงก่อน หลังจากในช่วงวันหยุดที่ผ่านมา ตลาดหุ้นต่างประเทศปรับลงเป็นส่วนใหญ่ นำโดยดัชนีดาวโจนส์ที่ดิ่งหนักกว่า 203 จุด ก่อนฟื้นตัว 78 จุด คืนวานนี้ ส่วนตลาดภูมิภาคปรับลงโดยเฉลี่ยประมาณ 0.6% แม้ในวันนี้ตลาดต่างๆ เริ่มฟื้นตัวขึ้น หลังข้อมูลภาคแรงงานสหรัฐดีกว่าคาด และมีความหวังเรื่องการหลีกเลี่ยงการผิดนัดชำระหนี้ของกรีซ แต่ยังไม่มาก จึงคาดไม่มีกำลังพอผลักดันการฟื้นตัวของ SETI ได้อย่างจริงจัง ขณะที่นักลงทุนยังควรจับตาแรงซื้อสุทธิของต่างชาติอย่างใกล้ชิดภายหลังการเริ่มสะสมหุ้นที่น้อยลง และถือสถานะ Short ในตลาดอนุพันธ์

กลยุทธ์การลงทุน: ระยะสั้นเทรดดิ้งต่อในกรอบระหว่าง 1149-1160 จุด
แนวต้าน : 1160-1166 แนวรับ : 1149-1133

ปัจจัยเด่นวันนี้:

+ นักลงทุนต่างชาติซื้อสุทธิ 585.79 ล้านบาท เมื่อวันอังคาร
+ ครม.อนุมัติ 246 โครงการ ในวงเงิน 2.48 หมื่นล้านบาท เพื่อให้กท.คมนาคมดำเนินการยกระดับถนน, ทำคันกั้นน้ำ และทำช่องทางระบายน้ำสำหรับป้องกันปัญหาน้ำท่วมในปีนี้ตาม กบอ. เสนอ
+ ดัชนีดาวโจนส์ปิดบวก 78.18 จุด มาที่ 12,837.33 จุด ในวันพุธ จากรายงานที่บ่งชี้ว่าภาคเอกชนสหรัฐมีการจ้างงานเพิ่มขึ้นเกินคาดในเดือน ก.พ. และข่าวที่ว่าเฟดกำลังพิจารณารูปแบบใหม่ของโครงการซื้อพันธบัตรและสัญญาจำนอง ขณะที่ตลาดได้ร่วงลงหนักสุดในรอบ 3 เดือนในวันอังคาร (-203.66 จุด)
+ ราคาน้ำมันดิบ NYMEX ปิดพุ่งขึ้น 1.46 ดอลลาร์ มาที่ 106.16 ดอลลาร์/บาร์เรล จากตัวเลขการจ้างงานภาคเอกชนสหรัฐที่ดี และคาดการณ์ทางบวกที่ว่ากรีซจะสามารถหลีกเลี่ยงจากการผิดนัดชำระหนี้ได้ ส่งผลให้ดอลลาร์ร่วงลง
0 กท.คลังเผยบริษัท Rating & Investment Information (R&I) ซึ่งเป็นสถาบันจัดอันดับความน่าเชื่อถือจากญี่ปุ่นยืนยันสถานะอันดับความน่าเชื่อถือของรัฐบาล สกุลเงินต่างประเทศ และสกุลบาทที่ BBB และ BBB+ ตามลำดับ

การจัดพอร์ตระยะสั้น* - หุ้น 50-75% : เงินสด 50-25%

ถือต่อในพอร์ต : SAT, BGH, TK, IVL

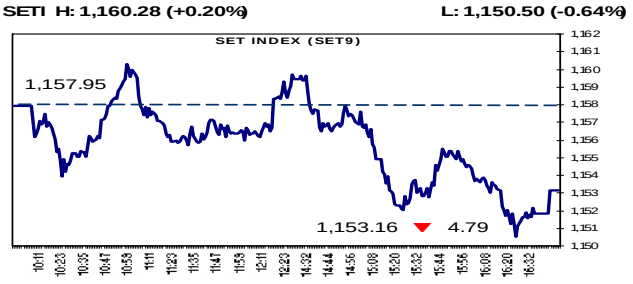
หุ้นที่ปรับออก : AP, CFRESH

หุ้นที่ปรับเข้า :

1. TUF ข่าวเพิ่มทุนกดดันราคาไปมากแล้ว ยังคง FV ที่ 80 บาท กรอบเทรดระยะสั้น ต้าน 68.25-70 รับ 64-63 Cut loss 62.50 บาท

* ผลการดำเนินงานของพอร์ตล่าสุดของปีนี้ (YTD) เมื่อสิ้นสุดสัปดาห์ที่ผ่านมาอยู่ที่ +13.64% เทียบกับตลาดที่ +13.82%

ตลาดเมื่อวานนี้



	ปิด	+/-	% +/-
SETI	1,153.16	-4.79	-0.41%
SET50	810.79	-3.89	-0.48%
มูลค่าตลาด (พันล้านบาท)			9,445.32
มูลค่าการซื้อขายวานนี้ (ล้านบาท)			31,425.70
P/E ตลาด (เท่า)			15.59
P/BV ตลาด (เท่า)			2.09
Div. Yield (%)			3.78

	ซื้อ	ขาย	สุทธิ
ต่างชาติ	7,595.36	7,009.56	585.80
สถาบัน	1,586.96	2,423.10	-836.14
บัญชีบริษัทหลักทรัพย์	4,441.32	4,313.56	127.76
รายย่อย	17,802.05	17,679.47	122.58
สะสม (มี.ค.)	**ซื้อ**	**ขาย**	**สุทธิ**
ต่างชาติ	31,308.50	23,245.18	8,063.32
สถาบัน	8,431.31	11,623.83	-3,192.52
บัญชีบริษัทหลักทรัพย์	17,965.35	17,115.32	850.03
รายย่อย	68,894.50	74,615.35	-5,720.85

ดัชนีต่างประเทศ	**ปิด**	**+/-**	**%+/-**
DJIA	12,837.33	78.18	0.61%
NASDAQ	2,935.69	25.37	0.87%
NIKKEI	9,576.06	-61.57	-0.64%
Hang Seng	20,627.78	-178.47	-0.86%
FTSE	5,791.41	25.61	0.44%
DAX	6,671.11	38.00	0.57%
CAC40	3,392.33	29.77	0.89%

อัตราแลกเปลี่ยน	**ปิด**	**+/-**	**% +/-**
Baht/US$	30.77	0.120	0.39%
Yen/US$	81.09	-0.340	-0.42%
US$/Euro	1.3145	-0.007	-0.55%
ดัชนีดอลลาร์ (DXYO)	79.7120	0.412	0.52%
น้ำมัน US$/barrel	**ปิด**	**+/-**	**% +/-**
NYMEX - Crude (เม.ย.)	106.16	1.46	1.39%
ICE - Brent (เม.ย.)	124.12	2.14	1.80%
ค่าการกลั่น (สิงคโปร์)	6.57	0.79	13.67%
ทองคำ COMEX (US$/oz.)	1,683.90	11.80	0.71%
BDI Index	798.00	11.00	1.40%

ธีรดา ชาญยิ่งยงค์ นักวิเคราะห์ # 9501
โทร : 66 2 635 1700 ต่อ 487 E-mail : teeradac@phillip.co.th