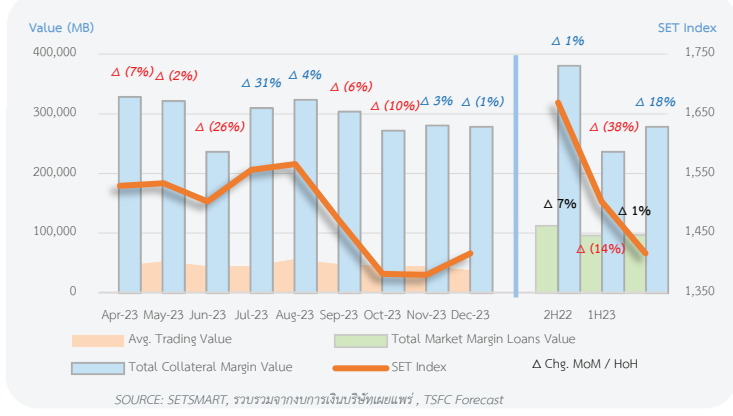


MONTHLY REPORT - CREDIT BALANCE COLLATERAL

DEC, 2023.

HIGHLIGHT

- มูลค่าหลักทรัพย์ค้ำประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวมเดือน ธ.ค. 66 มีมูลค่ารวมทั้งสิ้น 2.78 แสนลบ. ลดลง 2.25 พันลบ. (-0.89%MoM) และ ลดลง 1.02 แสนลบ. (-27%YoY)
- ยอดสินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม งวดเดือน ธ.ค.66 คาดอยู่ที่ 9.04 หมื่นลบ. ลดลง 1.95 พันลบ. (-2.12% MoM) (TSFC Forecast)
- FED ส่งสัญญาณว่าวัฏจักรดอกเบี้ยขาขึ้น ได้สิ้นสุดลงแล้ว โดยผลจาก Fed Watch Tools ล่าสุด คาดดอกเบี้ยจะปรับลดลงในปี 67 ระหว่าง 0.75-1.50%
- นักลงทุนเข้าซื้อหุ้นในตลาดฯ เพื่อเก็งกำไรจากการเกิด January Effect รวมถึง ESG Fund ทำให้ SET Index ตีกลับขึ้นปิดบวกกว่า 35 จุด (+2.6% MoM)



Net Buy/Sell	Y2022	Y2023	Nov-23	Dec-23
Insitutions	(154,419)	70,534	8,841	10,477
Properitary	(3,434)	(2,481)	366	(2,775)
Foreign	196,886	(192,153)	(21,132)	70
Local	(39,033)	124,099	11,926	(7,772)

CREDIT BALANCE COLLATERAL OVERVIEW

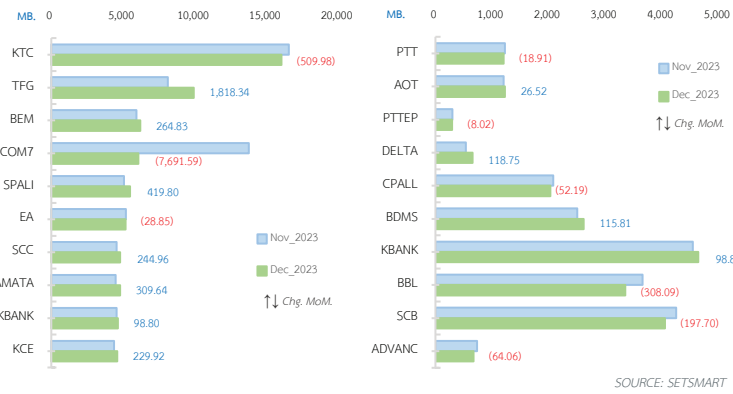
ยอดสินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างในเดือน ธ.ค. 66 คาดมียอดการใช้สินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวมทั้งสิ้น 9.04 หมื่นลบ. ลดลง 1.95 พันลบ. (-2.12% MoM) และ ลดลง 2.19 หมื่นลบ. (-20% YoY) ซึ่งเป็นยอดการใช้สินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างต่ำสุดในรอบกว่า 30 เดือน นับจากเดือน มิ.ย. 64

ขณะที่หลักประกัน Margin Collateral คงค้างในระบบรวม มีมูลค่า 2.78 แสนลบ. ลดลง 2.49 พันลบ. (-0.80% MoM) และ ลดลง 1.02 แสนลบ. (-27% YoY) โดยเป็นการปรับลดลง ตามการใช้สินเชื่อมาร์จิ้นที่ชะลอตัวลงอย่างต่อเนื่อง

FACTOR EFFECT CREDIT BALANCE COLLATERAL

- บรรยากาศการลงทุนในเดือน ธ.ค. 66 ชบเซาลงอย่างเห็นได้ชัด โดยปริมาณการซื้อขายเหลือเฉลี่ยเพียง 3.81 หมื่นลบ./วัน ต่ำสุดนับจากเดือน พ.ค. 57
- ตลาดหุ้นไทยเปิดตลาดช่วงแรกปรับตัวลงแรง จากความกังวลเรื่องเศรษฐกิจ และข่าวลบในหุ้น AOT รวมถึงความกังวลต่อปัญหาหุ้นกู้ หลัง ITD อาจมีปัญหาระงับการชำระหนี้ ทำให้ SET Index ปรับลงทำจุดต่ำสุดในรอบปีที่ 1,354.73 จุด
- FED ตัดสินใจคงดอกเบี้ยในการประชุมเดือน ธ.ค. 66 และ ส่งสัญญาณว่าอาจมีการปรับลดดอกเบี้ยในปี 67 ทำให้ตลาดหุ้นทั่วโลกปรับขึ้นรับข่าวดีดังกล่าว
- โดย SET Index กลับฟื้นตัวขึ้น ตามแรงซื้อที่กลับเข้ามาในหุ้นขนาดใหญ่เกือบทุกกลุ่ม โดยเฉพาะกลุ่ม ETRON, BANK, ARG1 ที่กลับมาบวกขึ้นแรง สวนทางกับ PKG, FIN ที่ปรับตัวลดลง ทำให้ดัชนีฯ กลับขึ้นมาปิดตลาดในแดนบวกได้

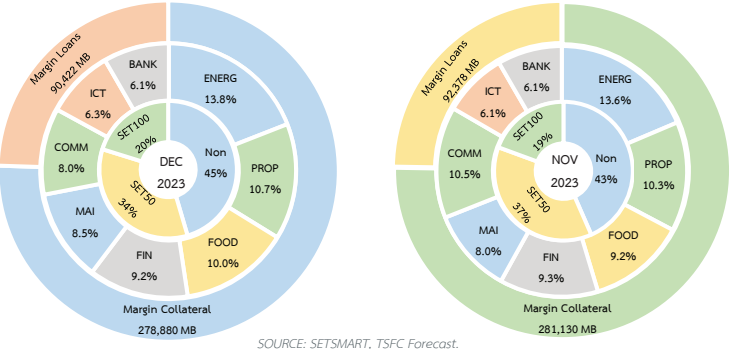
TOP 10 MARGIN COLLATERAL VALUE TOP 10 SET TRADING VALUE



TOP 10 CREDIT BALANCE COLLATERAL

สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างของระบบ ที่มีมูลค่าสูงสุด 10 อันดับแรก งวดเดือน ธ.ค. 66 พบว่าส่วนใหญ่เป็นหุ้นในกลุ่ม SET50/SET100 ทั้งสิ้น โดยหุ้นที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ลดลงมากที่สุดคือ COM7 โดยลดลง 7.69 พันลบ. MoM ขณะที่หุ้นที่อยู่ในกลุ่ม Non-SET100 ได้แก่ TFG มีมูลค่าหลักทรัพย์เพิ่มขึ้นกว่า 1.8 พันลบ.

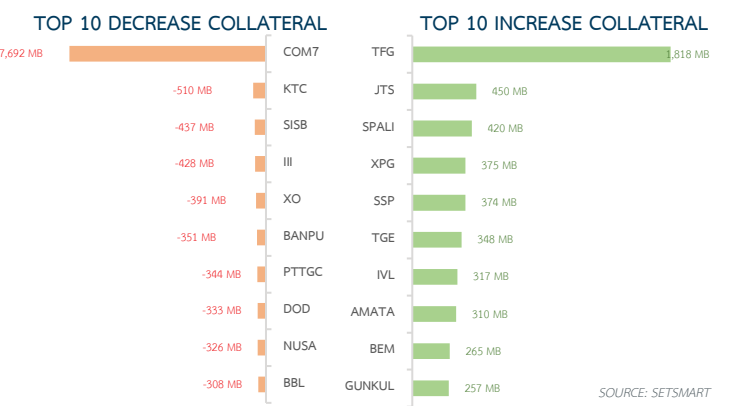
ขณะที่หุ้นที่มีปริมาณการซื้อขายสูงสุด 10 อันดับแรกของตลาด ในเดือน ธ.ค. 66 ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์ขึ้นมากที่สุดคือ DELTA (+118 ลบ.) ภายหลังจากราคาหุ้นพุ่งขึ้นมาสูงสุดในกลุ่ม โดย +13.2% MoM



TOP INCREASE - TOP DECREASE COLLATERAL (Δ MoM)

หลักทรัพย์ค้ำประกันคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นตลาดรวม ที่มีมูลค่าเพิ่มขึ้นสูงสุด 10 อันดับแรก ในเดือน ธ.ค. 66 นี้ พบว่ามีหลักทรัพย์ที่ราคาหุ้นปรับขึ้นมากที่สุดคือ TFG โดยที่มูลค่าหลักทรัพย์มาร์จิ้นเพิ่มขึ้นกว่า 1.81 พันลบ. (มีมูลค่าหลักทรัพย์มาร์จิ้นสูงสุดเป็นอันดับ 2 ในระบบ) หลังจากราคาหุ้นขึ้นแรง โดย +22.4% MoM ภายหลังจากข่าวการปราบปรามการนำเข้าหมูเถื่อน ซึ่งส่งผลบวกต่อราคาหุ้นในกลุ่ม

สำหรับหลักทรัพย์ค้ำประกันคงค้างในตลาดรวม ที่มีมูลค่าลดลงมากที่สุด 10 อันดับแรก ในงวดเดือน ธ.ค. 66 นี้ พบว่าอันดับ 1 คือ COM7 หลังจากที่มีปริมาณหุ้นคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นลดลงไปกว่า 345 ล.หุ้น หรือ คิดเป็นสัดส่วนกว่า 14.4% of listed shares ทำให้มูลค่าหลักทรัพย์ค้ำประกันคงค้างรวมในระบบลดลงไป 7.69 พันลบ. ขณะที่หุ้นที่เหลือในกลุ่ม top10 ที่มีมูลค่าหลักทรัพย์คงค้างใกล้เคียงกัน คือ 300-500 ลบ.



คำชี้แจงที่สำคัญ (Disclaimer)

ข้อมูลนี้ปรากฏในรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นบนพื้นฐานของข้อมูลที่ได้รวบรวมและเชื่อถือได้ ทั้งนี้บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน) ("บริษัท") มิได้ยืนยันหรือรับรองถึงความถูกต้อง หรือ ความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด ความคิดเห็นที่ปรากฏในรายงานนี้เป็นเพียงการนำเสนอในมุมมองของบริษัท และเป็นความคิดเห็น ณ วันที่ปรากฏในรายงานเท่านั้น ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังดังกล่าว โดยบริษัทไม่จำเป็นต้องให้ทราบล่วงหน้าหรือแจ้งเตือนก่อน บริษัทไม่รับผิดชอบต่อการนำข้อมูล หรือความคิดเห็นไปใช้ในทุกรณณ สิ้นสุด ผู้มีข้อมูลผู้ใช้ จึงควรใช้ข้อมูลนี้ในการพิจารณาตัดสินใจก่อนนำไปใช้หรือเผยแพร่ข้อมูล และความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใด นำข้อมูล และความคิดเห็นในเอกสารฉบับนี้ ไปทำซ้ำ ส่งต่อ เผยแพร่ ขาย จำหน่าย คัดลอก นำออกแสดง หรือนำไปเผยแพร่โดยไม่ได้รับอนุญาตจากบริษัทหรือตัวแทนของบริษัท