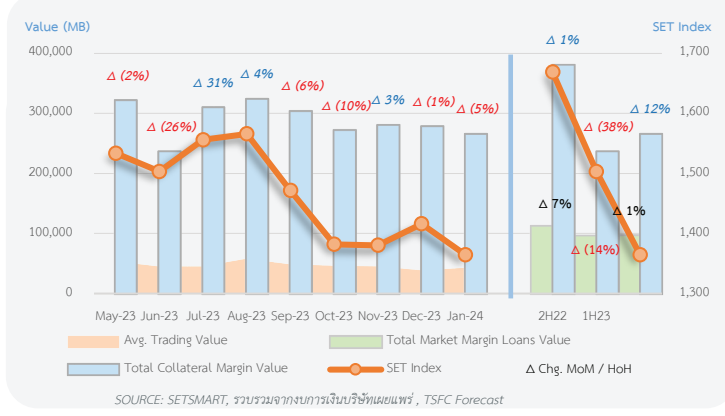


MONTHLY REPORT - CREDIT BALANCE COLLATERAL

JAN, 2024.

HIGHLIGHT

- มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวมเดือน ม.ค.67 มีมูลค่ารวมทั้งสิ้น 2.66 แสนลบ. ลดลง 1.28 พันลบ. (-4.58% MoM และ -30.94% YoY)
- ยอดสินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวมงวดเดือน ม.ค.67 คาดอยู่ที่ 9.27 หมื่นลบ. เพิ่มขึ้น 2.3 พันลบ. (+2.56% MoM) (TSFC Forecast)
- บรรยากาศการลงทุนในตลาดหุ้นไทยมีความผันผวนสูง โดยปรับขึ้นสั้นๆ ช่วงต้นเดือนก่อนจะปรับตัวลงแรง หลังสัญญาณเศรษฐกิจภายในมีแนวโน้มเติบโตต่ำกว่าคาด
- หุ้นในกลุ่มธนาคาร กลุ่มอิเล็กทรอนิกส์ และ กลุ่มปิโตรเคมี เผชิญแรงเทขายอย่างหนาแน่น หลังแนวโน้มผลประกอบการไตรมาส 4/66 จะต่ำกว่าเป้า



Net Buy/Sell	Y2022	Y2023	Dec-23	Jan-24
Insitutions	(154,419)	81,011	10,477	(1,078)
Proprietary	(3,434)	(5,256)	(2,775)	855
Foreign	196,886	(192,083)	70	(30,870)
Local	(39,033)	116,327	(7,772)	31,093

CREDIT BALANCE COLLATERAL OVERVIEW

ยอดสินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างเดือน ม.ค. 67 เริ่มมีการฟื้นตัวขึ้นเล็กน้อยจากเดือนก่อน โดยคาดมียอดการใช้สินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวมทั้งสิ้น 9.27 หมื่นลบ. เพิ่มขึ้น 2.3 พันลบ. (+2.56% MoM) หลังนักลงทุนรายย่อย ได้กลับเข้าซื้อสุทธิรวมกว่า 3.1 หมื่นลบ. ในเดือน ม.ค. 67

ขณะที่หลักประกัน Margin Collateral คงค้างในระบบรวม มีมูลค่า 2.66 แสนลบ. ลดลง 1.28 พันลบ. (-4.58% MoM) โดยเป็นการปรับลดตาม SET Index เดือน ม.ค. 67 ที่ลดลงกว่า 51.33 จุด หรือ -3.6% MoM

FACTOR EFFECT CREDIT BALANCE COLLATERAL

- บรรยากาศการลงทุนในเดือน ม.ค.67 ยังคงผันผวนสูง โดยปริมาณการซื้อขายปรับเพิ่มขึ้นตาม January Effect เฉลี่ย 4.27 หมื่นลบ./วัน (+12.2% MoM)
- สศค. ได้ประกาศคาดการณ์ตัวเลข GDP ไทย ปี 66 จะเติบโตน้อยกว่า 2% ซึ่งต่ำกว่าที่นักวิเคราะห์คาดไว้ที่ระดับ 2.5% และ ต่ำกว่า GDP ปี 65 ที่ 2.6%
- ผลประกอบการหุ้นกลุ่มธนาคาร 4Q66 ออกมาน่าผิดหวัง จากปัญหา NPL และ การตั้งสำรองเพิ่ม ทำให้ทำให้เกิดแรงเทขาย จนหุ้นกลุ่มธนาคารปรับตัวลงกว่า 5.9%
- หุ้นกลุ่มชิ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ปรับลงแรงกว่า 10% ภายหลังจากตัวเลขการส่งออกชิ้นส่วนฯ ชะลอลงมาก ส่งผลให้มีแรงเทขายในหุ้น เช่น KCE, HANA, DELTA, SMT
- หุ้นกลุ่ม PETRO ดิ่งลงแรงกว่า 11.31% MoM จากแนวโน้มผลประกอบการที่ต่ำกว่าคาด ทำให้ราคาหุ้น IVL และ PTTGC ปรับลงแรงมากกว่า 10%

TOP 10 CREDIT BALANCE COLLATERAL

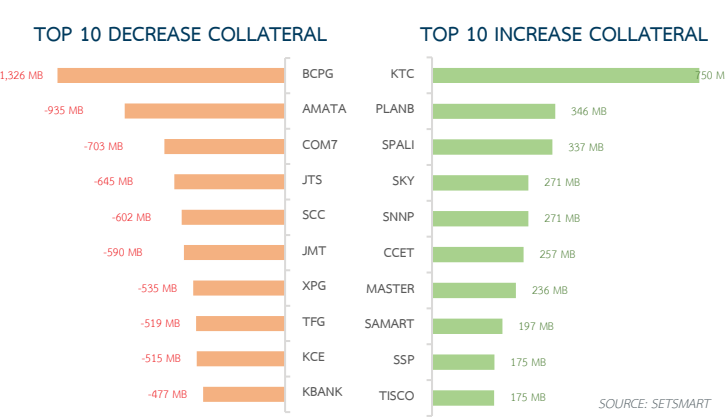
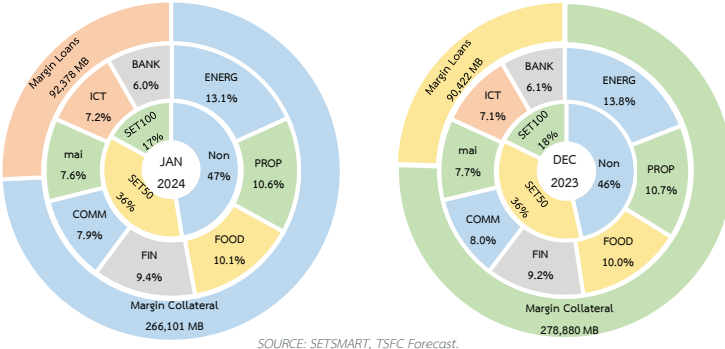
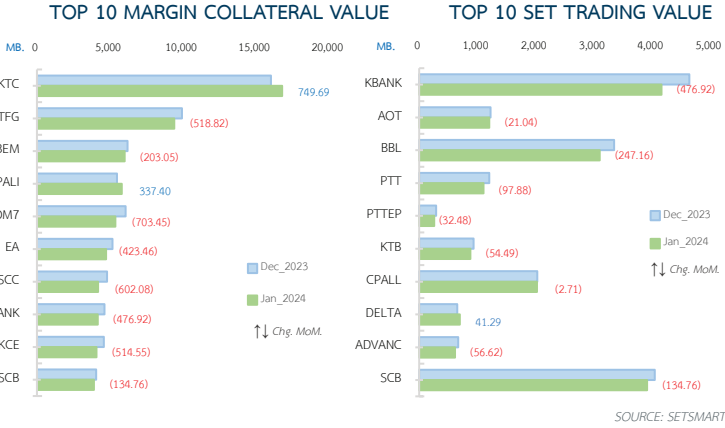
สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างของระบบ ที่มีมูลค่าสูงสุด 10 อันดับแรกงวดเดือน ม.ค. 67 พบว่าหุ้นที่มีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นเพิ่มขึ้นมีเพียง 2 หลักทรัพย์ ได้แก่ KTC โดย +749 ลบ. และ SPALI โดย +337 ลบ. หลังมีแรงซื้อหุ้นเข้ามาผ่านบัญชีมาร์จิ้น จำนวน 15.03 ล้านหุ้น และ 0.67 ล้านหุ้น ตามลำดับ

ขณะที่หุ้นที่มีปริมาณการซื้อขายสูงสุด 10 อันดับแรกของตลาด ในเดือน ม.ค. 67 พบว่า หุ้นที่ราคาตกลงแรงสุด คือกลุ่มธนาคาร โดย KTB -13.6%, KBANK -11.1%, BBL -9.9% รวมถึงหุ้น DELTA ที่ราคาหุ้นปรับลงแรงกว่า -10.5% MoM

TOP INCREASE - TOP DECREASE COLLATERAL (Δ MoM)

หลักประกันคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นตลาดรวม ที่มีมูลค่าเพิ่มขึ้นสูงสุด 10 อันดับแรก ในเดือน ม.ค. 67 นี้ พบว่ามีหลักทรัพย์ที่ ราคาหุ้นปรับเพิ่มขึ้นมากที่สุดมี 2 ตัว คือ CCET โดยราคาหุ้น +28% MoM และ SAMART ที่ +17.6% ในขณะที่หุ้นที่มีปริมาณเพิ่มเข้ามาสูงสุดในบัญชีมาร์จิ้น (เทียบ % ของทุนจดทะเบียน) ได้แก่หุ้น PLANB โดยมีปริมาณหุ้นเพิ่มเข้ามาในบัญชีมาร์จิ้นตลาดรวม จำนวน 40.57 ล้านหุ้น

สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในตลาดรวม ที่มีมูลค่าลดลงมากที่สุด 10 อันดับแรก ในงวดเดือน ม.ค.67 นี้ พบว่าอันดับ 1 คือ BCPG ที่มีปริมาณหุ้นออกจากบัญชีมาร์จิ้นคงค้างตลาดรวม จำนวน 147 ล้านหุ้น (4.9% of listed shares) ซึ่งอาจเกิดจากการถอนหลักประกันออก หรือ ผ่านการขายในตลาดฯ ภายหลังจากหุ้นปรับลงกว่า 5.7% MoM ทำให้มูลค่าหลักประกันคงค้าง ลดลงกว่า 1,326 ลบ.



คำชี้แจงที่สำคัญ (Disclaimer)

ข้อมูลปรากฏในรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นบนพื้นฐานของข้อมูลที่ได้มาซึ่งเชื่อถือได้ ทั้งนี้บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน) ("บริษัท") มิได้ยืนยันหรือรับรองถึงความถูกต้อง หรือ ความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด ความคิดเห็นที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้เป็นเพียงการนำเสนอข้อมูลของบริษัท และเป็นการคิดเห็น ณ วันที่ปรากฏในรายงานเท่านั้น ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังวันดังกล่าว โดยบริษัทไม่จำเป็นต้องให้ทราบล่วงหน้าถึงรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นเพื่อเผยแพร่ข้อมูลเท่านั้น บริษัทไม่มีมติขอต่อการนำข้อมูล หรือความคิดเห็นใดไปใช้ในทุกรณณ สิ้นสุด ผู้มีข้อมูลผู้ใช้ จีควรรู้ว่าข้อมูลดังกล่าวเป็นเพียงข้อมูลเบื้องต้นและมีความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใด นำข้อมูล และความคิดเห็นในเอกสารฉบับนี้ไปทำซ้ำ ส่งต่อ แสพหรือ ขาย จำนวน ผลิตออก น้าออกแสดง หรือนำไปเผยแพร่โดยไม่ขออนุญาต บริษัท ขอสงวนสิทธิ์ในข้อมูล โดยไม่ได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทเป็นกรณี