

TOP 30 CREDIT BALANCE COLLATERAL IS VOLUME CHANGE IN 4Q/2023.

หลักประกันในบัญชีสินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างทั้งหมดในตลาดรวม หรือ Total Market Credit Balance Financing - Collateral ในงวด 4Q66 ที่มีมูลค่ารวม 2.78 แสนล. เทียบกับงวด 3Q66 ที่ 3.03 แสนล. โดยลดลง 2.51 หมื่นล. (-8.26% QoQ) และ ลดลง 1.02 แสนล. (-26.78% YoY)

ทั้งนี้หลักทรัพย์ที่เป็นหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบ ที่มีปริมาณหุ้น (จำนวนหุ้น) เพิ่มขึ้นสูงสุด เมื่อเทียบทุนจดทะเบียน 30 อันดับแรกในงวด 4Q66 นั้น พบว่าเกือบทั้งหมดเป็นหุ้นในกลุ่ม Non-SET100 โดยมีจำนวนทั้งสิ้น 28 หลักทรัพย์ และ ในจำนวนนี้ครึ่งหนึ่งเป็นหุ้นขนาดเล็กในกลุ่ม MAI โดยมีจำนวนทั้งสิ้น 14 หลักทรัพย์

ขณะที่หุ้นในกลุ่ม SET100 ที่มีจำนวนหุ้นที่เป็นหลักประกันคงค้างในบัญชีสัดส่วนหลักประกันเมื่อเทียบกับทุนจดทะเบียน เพิ่มขึ้นมากสุดในกลุ่ม Top 30 จำนวน 2 หลักทรัพย์ ได้แก่หุ้น GUNKUL โดยเพิ่มขึ้น 162.5 ล.หุ้น หรือ +1.8% of listed shares หรือ เพิ่มขึ้น 184 ล. และหุ้น SPALI โดยเพิ่มขึ้น 34.28 ล.หุ้น หรือ +1.8% of listed shares หรือ เพิ่มขึ้น 247 ล.

Top 30 Margin Collateral is Volume Change Up (% of Listed shares) in 4Q/2023.

Rank	Securities	Sum of % chg of Listed	Sum of No. of Shares is Chg. QoQ (M.shrs.)	Sum of Price Chg %	Sum of Margin % of Paid up	Sum of Mkt. Collateral Value (MB.) - Dec 2023	Sum of Mkt. Collateral Value (MB.) - Sep 2022	Sum of Collateral Value is Chg. QoQ (MB.)	Sum of Collateral Value is Chg. YTD (MB.)	Sector	Group
1	SCM	▲ 7.7%	46.37	▼ 20.5%	52.31%	1,104 MB	1,184 MB	(80) MB	(238) MB	COMM	non
2	SFLEX-W2	▲ 7.3%	7.53	▼ 16.0%	11.78%	3 MB	1 MB	1 MB	2 MB	warrant	non
3	TGE	▲ 6.1%	134.42	▲ 66.7%	6.83%	436 MB	28 MB	408 MB	404 MB	ENERG	Non-SSL
4	TRP	▲ 5.7%	19.87	▲ 0.0%	5.68%	356 MB	0 MB	0 MB	356 MB	MAI	non
5	TKC	▲ 5.2%	20.70	▼ 38.4%	10.62%	633 MB	527 MB	106 MB	432 MB	ICT	Non-SSL
6	KUN	▲ 5.0%	37.10	▼ 1.6%	38.30%	516 MB	457 MB	59 MB	(83) MB	MAI	non
7	JCK	▲ 4.8%	182.64	▲ 4.0%	5.77%	57 MB	9 MB	48 MB	43 MB	PROP	non
8	ALPHAX	▲ 4.2%	389.72	▼ 24.1%	4.60%	269 MB	31 MB	238 MB	231 MB	MAI	non
9	MALEE	▲ 3.9%	21.29	▲ 44.4%	5.81%	330 MB	75 MB	255 MB	110 MB	FOOD	non
10	JPARK	▲ 3.1%	12.25	▲ 0.0%	3.06%	80 MB	0 MB	0 MB	80 MB	MAI	non
11	READY	▲ 3.0%	2.96	▼ 10.7%	25.08%	313 MB	310 MB	4 MB	313 MB	MAI	non
12	W	▲ 2.9%	29.00	▼ 6.6%	7.92%	55 MB	37 MB	18 MB	(246) MB	FOOD	non
13	MGI	▲ 2.8%	5.87	▲ 0.0%	2.80%	112 MB	0 MB	0 MB	112 MB	MAI	non
14	GSC	▲ 2.8%	6.97	▼ 8.0%	5.61%	18 MB	10 MB	8 MB	(112) MB	MAI	non
15	ANI	▲ 2.7%	50.66	▲ 0.0%	2.74%	301 MB	0 MB	0 MB	301 MB	TRANS	non
16	MCA	▲ 2.7%	6.25	▲ 0.0%	2.72%	16 MB	0 MB	0 MB	16 MB	MAI	non
17	SRS	▲ 2.7%	4.27	▲ 0.0%	2.67%	44 MB	0 MB	0 MB	44 MB	MAI	non
18	B-WORK	▲ 2.5%	9.40	▼ 16.7%	2.77%	46 MB	4 MB	42 MB	46 MB	PF&REIT	non
19	SIMAT	▲ 2.4%	15.61	▼ 7.0%	16.13%	195 MB	178 MB	17 MB	5 MB	MAI	non
20	GABLE	▲ 2.3%	16.40	▼ 10.2%	3.48%	107 MB	39 MB	68 MB	107 MB	ICT	non
21	K	▲ 2.1%	10.00	▼ 2.4%	5.87%	34 MB	23 MB	12 MB	11 MB	MAI	non
22	ERWPF	▲ 2.0%	3.60	▲ 12.9%	3.89%	54 MB	23 MB	31 MB	53 MB	PF&REIT	non
23	PDJ	▲ 2.0%	12.00	▼ 9.5%	9.21%	104 MB	89 MB	14 MB	58 MB	FASHION	non
24	XPG	▲ 1.9%	180.42	▲ 4.7%	10.82%	1,369.89	1,078.96	290.93	986.80	FIN	Non-SSL
25	GFC	▲ 1.8%	4.06	▲ 5.8%	6.38%	153 MB	103 MB	50 MB	153 MB	MAI	non
26	GUNKUL	▲ 1.8%	162.53	▼ 10.3%	11.36%	2,825 MB	2,641 MB	184 MB	(1,444) MB	ENERG	SET100
27	TRITN	▲ 1.8%	200.56	▼ 13.3%	19.07%	276 MB	288 MB	(12) MB	(89) MB	CONS	non
28	SPALI	▲ 1.8%	34.28	▼ 7.5%	15.09%	5,482 MB	5,235 MB	247 MB	(975) MB	PROP	SET100
29	MASTER	▲ 1.6%	4.33	▼ 6.8%	5.11%	783 MB	571 MB	212 MB	783 MB	MAI	Non-SSL
30	NETBAY	▲ 1.6%	3.23	▲ 15.3%	6.54%	324 MB	212 MB	113 MB	115 MB	MAI	non

*เอกสารฉบับนี้ จะเสนอข้อมูลหลักทรัพย์ที่เป็นหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้น ที่มีการเปลี่ยนแปลงในแง่ปริมาณหลักทรัพย์ เมื่อเทียบเป็นสัดส่วนหุ้นเทียบทุนจดทะเบียน (หรือ % of Listed Shares) เพื่อให้เห็นภาพของปริมาณหลักทรัพย์นั้นๆ ในส่วนที่มีการเคลื่อนไหวในบัญชีมาร์จิ้นในช่วงเวลาดังกล่าว อย่างแท้จริง

ในขณะที่หลักทรัพย์ที่เป็นหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม ที่มีการลดลงในแง่ปริมาณหุ้นเมื่อเทียบทุนจดทะเบียน สูงสุด 30 อันดับแรกในงวด 4Q66 พบว่าในงวดนี้ หุ้นในกลุ่ม Top 5 ได้แก่ PRIME, NCL, DOD, CV และ AIT มีจำนวนหุ้นที่ลดลงจากบัญชีมาร์จิ้นในสัดส่วนที่มากกว่าปกติ โดยลดลงมากกว่า 10% of listed shares

ทั้งนี้หุ้นที่มีปริมาณหุ้นในบัญชีมาร์จิ้นคงค้างลดลงมากที่สุดอันดับ 1 เป็นหุ้นในกลุ่ม Energy คือ PRIME ที่ปริมาณหุ้นลดลงไปกว่า 1,871 ล.หุ้น หรือ -44% of listed shares หลังจากราคาหุ้นดิ่งลงแตะ floor ติดต่อกัน 3 ครั้ง ซึ่งคาดว่าจะสาเหตุทำให้ถูก force sell ออกมาจากบัญชีมาร์จิ้น จนจำนวนหุ้นคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นลดลงอย่างมาก

ขณะที่มีหุ้นบางตัวที่ปริมาณหุ้นคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นลดลงมาก พบว่ามีปัญหาพิพาททางข้อกฎหมาย หรือ มีปัญหาด้านความน่าเชื่อถือ เฉพาะตัว เช่น NCL, JKN, NUSA ส่งผลให้ราคาหุ้นปรับตัวลงแรง 30-60% QoQ นั้นอาจเป็นสาเหตุสำคัญทำให้นักลงทุนลดพอร์ตหุ้นดังกล่าวเพื่อลดความเสี่ยง โดยส่วนหนึ่งเป็นการขายผ่านบัญชีมาร์จิ้น

Top 30 Margin Collateral is Volume Change Down (% of Listed shares) in 4Q/2023.

Rank	Securities	Sum of % chg of Listed	Sum of No. of Shares is Chg. QoQ (M.shrs.)	Sum of Price Chg %	Sum of Margin % of Paid up	Sum of Mkt. Collateral Value (MB.) - Dec 2023	Sum of Mkt. Collateral Value (MB.) - Sep 2022	Sum of Collateral Value is Chg. QoQ (MB.)	Sum of Collateral Value is Chg. YTD (MB.)	Sector	Group
1	PRIME	▼ 44.0%	(1,871.01)	▼ 53.8%	0.20%	5 MB	2,481 MB	(2,476) MB	(2,396) MB	ENERG	Non-SSL
2	NCL	▼ 26.6%	(140.67)	▼ 60.4%	4.11%	18 MB	344 MB	(326) MB	(416) MB	MAI	non
3	DOD	▼ 21.8%	(98.20)	▼ 9.3%	7.13%	119 MB	532 MB	(413) MB	(434) MB	MAI	non
4	CV	▼ 20.3%	(260.27)	▼ 45.2%	0.54%	4 MB	249 MB	(245) MB	(496) MB	ENERG	Non-SSL
5	AIT	▼ 12.2%	(179.00)	▼ 17.8%	4.11%	228 MB	1,100 MB	(873) MB	(1,728) MB	ICT	Non-SSL
6	CIG	▼ 8.5%	(233.24)	▼ 42.9%	0.15%	0 MB	50 MB	(49) MB	(46) MB	MAI	non
7	PSP	▼ 8.2%	(114.37)	▼ 47.3%	4.67%	293 MB	1,527 MB	(1,235) MB	293 MB	IMM	non
8	JSP	▼ 7.8%	(36.85)	▼ 2.5%	31.62%	345 MB	441 MB	(96) MB	(356) MB	MAI	non
9	JKN	▼ 5.9%	(60.80)	▼ 55.8%	0.38%	2 MB	73 MB	(71) MB	(704) MB	MEDIA	non
10	NUSA	▼ 4.8%	(623.32)	▼ 36.2%	12.99%	509 MB	1,091 MB	(582) MB	(2,216) MB	PROP	Non-SSL
11	III	▼ 4.2%	(34.29)	▼ 17.8%	27.41%	2,203 MB	3,094 MB	(891) MB	(582) MB	TRANS	Non-SSL
12	CMO	▼ 4.1%	(11.60)	▼ 40.0%	0.19%	0 MB	17 MB	(17) MB	(22) MB	MAI	non
13	B	▼ 4.1%	(328.16)	▼ 26.7%	2.81%	25 MB	83 MB	(58) MB	(78) MB	TRANS	non
14	DEMCO	▼ 4.0%	(29.08)	▼ 15.6%	24.76%	448.53	617.22	(169) MB	(877) MB	ENERG	Non-SSL
15	NRF	▼ 3.9%	(55.12)	▲ 7.1%	40.27%	2,998 MB	3,068 MB	(70) MB	(553) MB	FOOD	Non-SSL
16	CHO	▼ 3.6%	(6.63)	▼ 31.1%	0.01%	0.01	4.06	(4) MB	(0) MB	MAI	non
17	COMAN	▼ 3.1%	(4.20)	▼ 13.0%	14.34%	69 MB	97 MB	(28) MB	(62) MB	MAI	non
18	ASIAN	▼ 2.7%	(22.03)	▼ 4.1%	6.00%	340 MB	514 MB	(174) MB	(660) MB	FOOD	Non-SSL
19	PRI	▼ 2.7%	(8.61)	▼ 18.2%	3.62%	269.86	575.36	(306) MB	(71) MB	MAI	non
20	JTS	▼ 2.6%	(18.24)	▲ 198.3%	6.17%	3,833 MB	1,823 MB	2,010 MB	277 MB	ICT	Non-SSL
21	AQUA	▼ 2.4%	(143.19)	▼ 12.8%	24.37%	490 MB	618 MB	(128) MB	(571) MB	MEDIA	non
22	COM7	▼ 2.2%	(53.09)	▼ 23.8%	10.63%	6,071 MB	9,631 MB	(3,560) MB	(13,329) MB	COMM	SET50
23	TPIPL	▼ 2.2%	(409.84)	▼ 3.4%	3.30%	875 MB	1,500 MB	(625) MB	(896) MB	CONMAT	Non-SSL
24	NUSA-W5	▼ 2.1%	(54.40)	▼ 45.5%	2.49%	4 MB	13 MB	(9) MB	4 MB	warrant	non
25	PEACE	▼ 2.0%	(10.19)	▼ 19.1%	3.31%	53.78	107.02	(53) MB	(89) MB	PROP	non
26	THREL	▼ 2.0%	(12.04)	▼ 23.4%	19.35%	309 MB	445 MB	(136) MB	(45) MB	INSUR	non
27	SFLEX	▼ 2.0%	(16.06)	▲ 6.5%	30.59%	898 MB	897 MB	1 MB	48 MB	PKG	non
28	AS	▼ 1.9%	(9.72)	▼ 13.1%	14.63%	563 MB	734 MB	(170) MB	(313) MB	MEDIA	Non-SSL
29	ICHI	▼ 1.9%	(24.79)	▼ 6.5%	3.60%	735 MB	1,203 MB	(468) MB	(11) MB	FOOD	Non-SSL
30	AAI	▼ 1.9%	(40.34)	▲ 13.0%	4.34%	401 MB	509 MB	(109) MB	(270) MB	FOOD	Non-SSL

คำชี้แจงที่สำคัญ (Disclaimer)

SOURCE: SETSMART, TSFC

ข้อมูลที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่น่าเชื่อถือได้ ทั้งนี้บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน) (“บริษัท”) มิได้ยืนยันหรือรับรองถึงความถูกต้อง หรือ ความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด ความคิดเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานนี้เป็นเพียงการนำเสนอในมุมมองของบริษัท และเป็นความคิดเห็น ณ วันที่ปรากฏในรายงานเท่านั้น ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังวันดังกล่าว โดยบริษัทไม่จำเป็นต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้ารายฉบับนี้ จัดทำขึ้นเพื่อเผยแพร่ข้อมูลเท่านั้น บริษัทไม่รับผิดชอบต่อการนำข้อมูล หรือความคิดเห็นใดๆ ไปใช้ในทุกรกรณี ดังนั้น ผู้ที่นำข้อมูลไปใช้ จึงควรใช้ดุลพินิจในการพิจารณาตัดสินใจก่อนนำไปใช้หรือขอสงวนสิทธิ์ ในข้อมูล และความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใด นำข้อมูล และความคิดเห็นในเอกสารฉบับนี้ไป ทำซ้ำ ส่งต่อ เผยแพร่ ขาย จำหน่าย คัดลอก นำออกแสดง หรือนำไปแสวงหาประโยชน์ในเชิงพาณิชย์ ไม่ว่าด้วยวิธีการใดๆ โดยไม่ได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทเป็นการล่วงหน้า