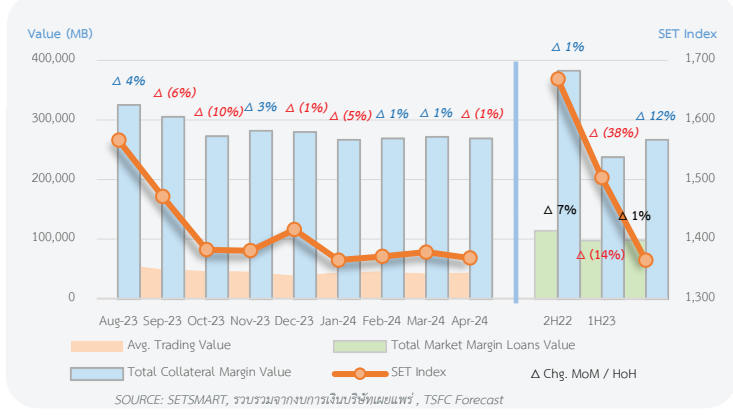


MONTHLY REPORT - CREDIT BALANCE COLLATERAL

APR, 2024.

HIGHLIGHT

- มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม ในเดือน เม.ย. 67 มีมูลค่ารวมทั้งสิ้น 2.68 แสนลบ. ลดลง 2.48 พันลบ. (-0.92% MoM)
- ยอดสินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม งวดเดือน เม.ย. 67 คาดอยู่ที่ 8.83 หมื่นลบ. ลดลง 347 ลบ. (-0.39% MoM, -2.35% YTD : TSFC Forecast)
- SET Index เหวี่ยงแรงตลอดเดือน โดยบวกขึ้นกว่า 40 จุด จากนั้นพลิกติดลบกว่า 58 จุด ก่อนจะฟื้นตัวกลับมาติดลบจากเดือนก่อนหน้า 9.99 จุด (-0.7% MoM)
- ความเสี่ยงเชิงภูมิรัฐศาสตร์ระหว่าง ความไม่ชัดเจนเรื่องทิศทางดอกเบี้ย FED และ สงครามไทยที่หดตัวแรง เป็นปัจจัยลบสำคัญที่มีผลต่อภาพการลงทุนในเดือนนี้



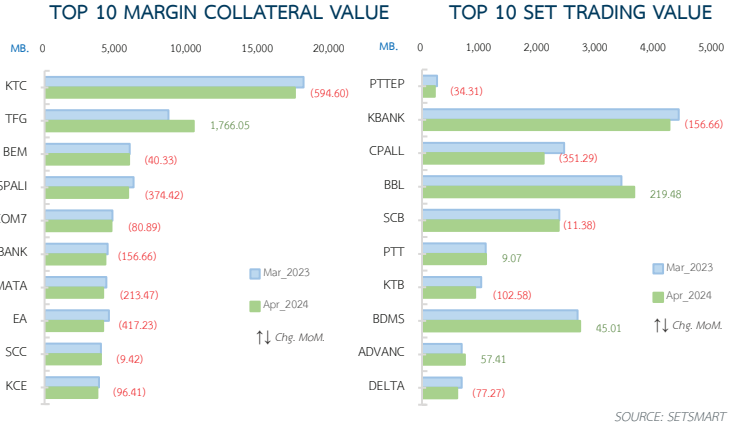
CREDIT BALANCE COLLATERAL OVERVIEW

ยอดสินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างในเดือน เม.ย. 67 คาด ยังคงลดลงอย่างต่อเนื่อง โดยทำจุดต่ำสุดอีกครั้งที่ 8.83 หมื่นลบ. ตามบรรยากาศการลงทุนที่ยังเต็มไปด้วยข่าวลบ ทั้งการใช้อาวุธโจมตีกันระหว่าง Israel กับ Iran ที่ทำให้น้ำมันดิบพุ่งขึ้นเหนือ 90 US\$/barrel นำไปสู่ความกังวลด้านเงินเฟ้อ กดดันให้ดอกเบี้ยทรงตัวสูงนานกว่าคาด ขณะที่มูลค่าหลักประกัน Margin Collateral คงค้างในระบบรวม มีมูลค่าทั้งสิ้น 2.68 แสนลบ. ลดลง 2.48 พันลบ. โดยเป็นการปรับตัวลดลง สอดคล้องกับปริมาณการใช้สินเชื่อมาร์จิ้นโดยรวมที่ลดลง และ การปรับตัวลดลงของ SET Index

Net Buy/Sell	Y2023	Y24-YTD	Mar-24	Apr-24
Insitutions	81,011	(5,472)	1,696	(199)
Properitary	(5,256)	(4,957)	(1,569)	(2,055)
Foreign	(192,083)	(65,075)	(41,238)	3,787
Local	116,327	75,503	41,111	(1,534)

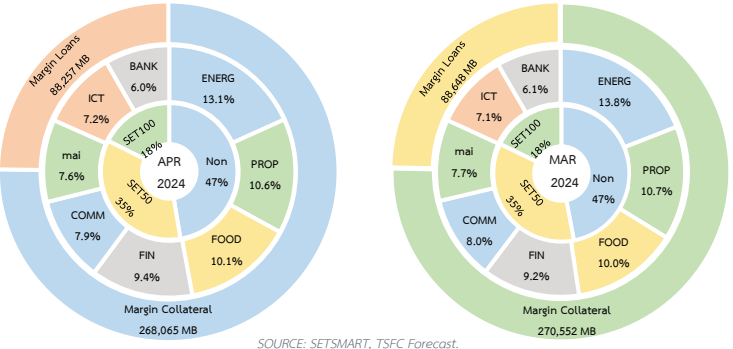
FACTOR EFFECT CREDIT BALANCE COLLATERAL

- ดัชนีฯ ปรับขึ้นแรงช่วงต้นเดือน ตามแรงซื้อเพื่อ Cover Shot ของนักลงทุนต่างชาติ ก่อนจะดิ่งลงเร็ว หลังเกิดความเสถียรที่จะเกิดสงครามใหญ่ในตะวันออกกลาง
- กลุ่ม ETRON ดิ่งลงแรงกว่า 5.6% ภายหลังตัวเลขส่งออก มี.ค. 67 หดตัวลงแรงกว่า 10.9% ส่งผลให้หุ้น DELTA, KCE, HANA มีแรงเทขายออกมากอย่างหนาแน่น
- กลุ่ม FOOD ปรับขึ้นแรง โดยพุ่งขึ้นกว่า 5.15% นำโดยหุ้น TFG (+13.8%) ที่พลิกกลับมาทำกำไรหลังขาดทุนในปีก่อน เช่นเดียวกับหุ้น MALEE (+12.3%)
- หุ้นกลุ่ม FINANCE ดิ่งลงกว่า 3.87% หลังกังวลต่อตัวเลขหนี้เสียที่พุ่งขึ้นแรง นำโดย XPG (-18%), ML (-10%), BYD (-12%), CHAYO (-11%)
- ราคาหุ้น SABUY หดตัวลงแรงกว่า 43% MoM คาดเป็นสาเหตุ ทำให้มีหุ้นถูกขายหรือ ถูก force sell ออกจากบัญชีมาร์จิ้น ด้วยปริมาณหุ้นรวมกว่า 434 ล.หุ้น



TOP 10 CREDIT BALANCE COLLATERAL

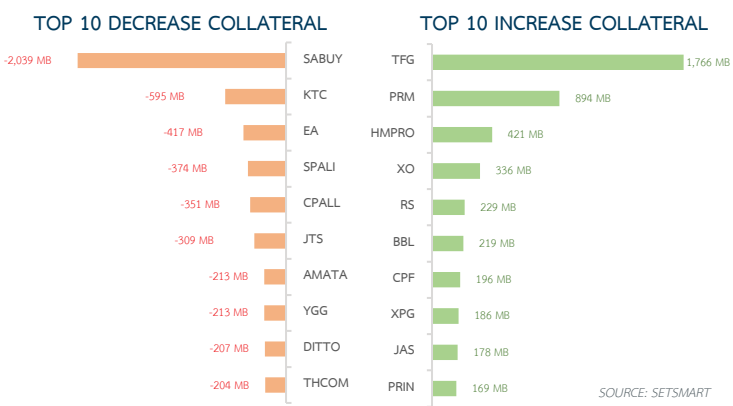
สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างทั้งหมดของระบบ ที่มีมูลค่าสูงสุด 10 อันดับแรก งวดเดือน เม.ย. 67 พบว่าหุ้นที่มีมูลค่าหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้นเพิ่มขึ้น มีเพียงตัวเดียวคือหุ้น TFG โดยเพิ่มขึ้น 1.76 พันลบ. ขณะที่หุ้นที่มีมูลค่าหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้นลดลงมากที่สุด ได้แก่ KTC (-594 ลบ.) และ EA (-417 ลบ.)



สำหรับหุ้นที่มีมูลค่าซื้อขายสูงสุดในตลาดฯ 10 อันดับแรกในเดือน เม.ย. 67 ที่มีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบมากที่สุด 3 อันดับแรก พบว่าอยู่ในกลุ่ม BANK ทั้งสิ้น ได้แก่ KBANK , BBL และ SCB ตามลำดับ

TOP INCREASE – TOP DECREASE COLLATERAL (Δ MoM)

หลักประกันคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นตลาดรวม ที่มีมูลค่าเพิ่มขึ้นสูงสุด 10 อันดับแรก ในเดือน เม.ย. 67 นี้ พบว่า TFG มีมูลค่าหลักประกันเพิ่มขึ้นมากที่สุด คือ 1.76 พันลบ. หลังมีการซื้อ/วาง หลักประกันเพิ่มเข้ามาในบัญชีมาร์จิ้นกว่า 150 ล.หุ้น (2.6% of listed shares) ขณะที่หุ้นที่มีปริมาณหุ้นเทียบทุนจดทะเบียน เพิ่มขึ้นในบัญชีมาร์จิ้นมากที่สุดในกลุ่ม Top10 ได้แก่หุ้น PRIN โดยมีการซื้อ/วาง หุ้นเข้ามาเป็นหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้นจำนวน 60 ล.หุ้น (คิดเป็น 4.9% of listed shares)



สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในตลาดรวม ที่มีมูลค่าลดลงมากที่สุด 10 อันดับแรก ในงวดนี้ พบว่าอันดับ 1 ได้แก่ หุ้น SABUY หลังมีการขายหุ้นให้พันธมิตรใหม่ และได้มีการเปลี่ยนแปลงผู้บริหาร จากนั้นราคาหุ้นได้ปรับลดลงกว่า 43% ส่งผลให้มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นของหุ้น SABUY ลดลงไปกว่า 2.03 พันลบ.

คำชี้แจงที่สำคัญ (Disclaimer)

ข้อมูลปรากฏในรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นบนพื้นฐานของข้อมูลที่เกี่ยวข้องที่เชื่อว่าเชื่อถือได้ ทั้งนี้บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน) ("บริษัท") มิได้ยืนยันหรือรับรองถึงความถูกต้อง หรือ ความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด ความคิดเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้เป็นเพียงการนำเสนอข้อมูลของบริษัท และเป็นการคิดเห็น ณ วันที่ปรากฏในรายงานเท่านั้น ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังดังกล่าว โดยบริษัทไม่จำเป็นต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้ารายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นเพื่อเผยแพร่ข้อมูลเท่านั้น บริษัทไม่รับผิดชอบต่อการนำข้อมูล หรือความคิดเห็นใดไปใช้ในทุกรณณ สิ้นนี้ ผู้มีข้อมูลผู้ใช้ จีควอใช้ข้อมูลนี้ในการพิจารณาตัดสินใจก่อนนำข้อมูลไปใช้หรือเผยแพร่ข้อมูล และความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใด นำข้อมูล และความคิดเห็นในรายงานฉบับนี้ไปทำซ้ำ ส่งต่อ แสพหรือ ขาย จำนวน อดุล น้าอดอง หรือนำไปแสวงหาประโยชน์ในเชิงพาณิชย์ ไม่ว่าด้วยวิธีการใดๆ โดยมิได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทเป็นการล่วงหน้า