

MONTHLY REPORT - TOTAL MARKET CREDIT BALANCE COLLATERAL

AUG, 2024.

HIGHLIGHT

- มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม งวดเดือน ส.ค. 67 มีมูลค่ารวมทั้งสิ้น 2.46 แสนลบ. เพิ่มขึ้น 7,765 ลบ. (+3.25% MoM)
- หลักประกันมาร์จิ้นแยกตามกลุ่มอุตสาหกรรม ที่มีมูลค่าเพิ่มขึ้นมากที่สุด ได้แก่ กลุ่มไฟแนนซ์ และ สื่อสาร โดย +4.15 พันลบ. และ +1.60 พันลบ.
- SET Index ปรับขึ้น 3 เดือน ต่อเนื่อง หลังจากระหว่างเดือนทรุดลงแรงกว่า 50 จุด ก่อนจะติดตัวกลับขึ้นมาบวกได้กว่า 38 จุด ด้วยมูลค่าซื้อขายสูงสุดในรอบ 6 เดือน
- ความชัดเจนในการลดดอกเบี้ยของ FED การได้นายกฯ คนใหม่ การจัดตั้งกองทุน VAYU และ การแจกเงิน 1 หมื่นลบ. เป็นปัจจัยบวกที่มีผลต่อการลงทุนในเดือนนี้

MARKET MARGIN LOANS OVERVIEW

มูลค่าหลักประกัน Margin Collateral คงค้างในระบบรวม มีมูลค่าทั้งสิ้น 2.46 แสนลบ. (+3.25% MoM) โดยเป็นการฟื้นตัวตาม SET Index ที่ปรับขึ้น 2.89% MoM หลังการเกิดเหตุการณ์ Black Monday ช่วงต้นเดือน ที่ทำให้เกิด panic sell ส่งผลให้ดัชนีฯ ดิ่งลงแรง ก่อนที่จะฟื้นตัวขึ้นเร็ว ตามแรงซื้อของนักลงทุนในประเทศทั้งสถาบัน และ รายย่อย

โดยหลักประกันมาร์จิ้นแยกตามกลุ่มอุตสาหกรรม ส่วนใหญ่มีมูลค่าปรับขึ้น ยกเว้นกลุ่มหุ้นส่วนอิเล็กทรอนิกส์ที่มีมูลค่าปรับตัวลดลงกว่า 1.05 พันลบ. (-11.3%)

FACTOR EFFECT CREDIT BALANCE COLLATERAL

- เหตุการณ์ Black Monday ทำให้ตลาดหุ้นทั่วโลกดิ่งลงแรง จากความกังวลว่า US จะเกิด recession รวมถึงปัญหา Yen Carry Trade แต่สถานะการณ์ดังกล่าวก็คลี่คลายอย่างรวดเร็ว โดย FED จะปรับลดดอกเบี้ยลง ในการประชุมเดือน ก.ย. นี้
- ศาลาฯ ตัดสินยุบพรรคก้าวไกล และ สั่งยุติการทำงานของ นายเศรษฐา ก่อนที่จะมีการตัดสินใจเลือก นายแพทองธาร ขึ้นมาดำรงตำแหน่งแทนได้ ในเวลาที่รวดเร็ว
- คลังฯ เตรียมออกกองทุนวายุภักษ์ฯ ใหม่ มูลค่า 1.5 แสนลบ. ภายในเดือน ต.ค. 67 ทำให้เกิดแรงซื้อเข้ามาในหุ้นขนาดใหญ่ที่จะได้ประโยชน์
- รัฐบาลปรับเปลี่ยนนโยบาย Digital Wallet เป็นการจ่ายเงินช่วยเหลือ ประชาชนกลุ่มเปราะบางจำนวน 1 หมื่นบาท โดยจะเริ่มจ่ายภายในเดือน ก.ย. 67 นี้
- ความกังวลเรื่อง bond default ของ EA ยุติลง เมื่อเจ้าหนี้สามารถเจรจาร่วมกันได้

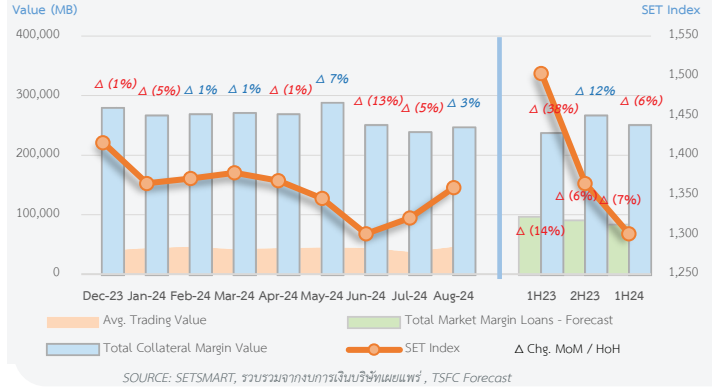
TOP VALUE CREDIT BALANCE COLLATERAL

สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นโดยรวมทั้งหมดของตลาด ที่มีมูลค่าสูงสุด 10 อันดับแรก พบว่ามีหุ้นที่ราคาปรับขึ้นถึง 7 หลักทรัพย์ โดยหุ้นที่ปรับขึ้นมากที่สุดจะเป็นหุ้น JMART ที่คาดมีการ ซื้อ/วาง ผ่านบัญชีมาร์จิ้น หลังจากปริมาณหุ้นคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นเพิ่มขึ้นกว่า 162 ล.หุ้น (+11% of listed shares) ขณะที่ราคา +39% MoM สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นที่มีสัดส่วนยอดคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นสูงสุด เมื่อเทียบเป็นสัดส่วนหุ้นต่อทุนจดทะเบียน พบว่ามีหลักทรัพย์ที่ปริมาณหุ้นลดลงในบัญชีมาร์จิ้นคงค้างของตลาดรวม มากสุดมีจำนวน 2 หลักทรัพย์ ได้แก่หุ้น A5 (-4.77% of listed shares) และ JSP (-4.79% of listed shares)

TOP 10 COLLATERAL MOVEMENT (Δ MoM)

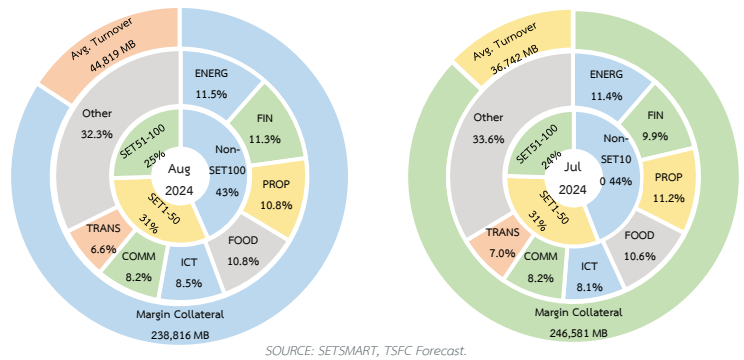
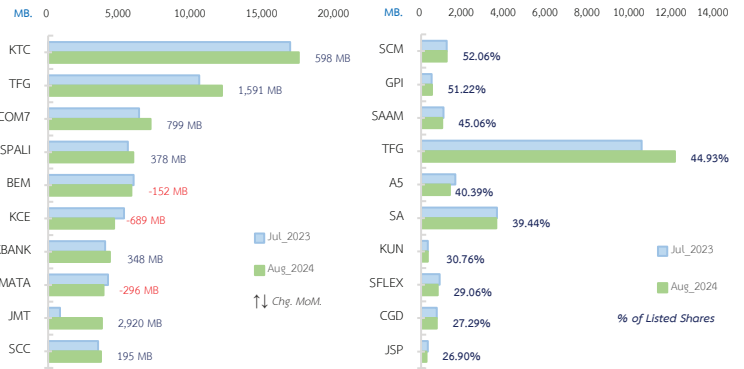
หลักประกันคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นตลาดรวม ที่มีมูลค่าเพิ่มขึ้นสูงสุด 10 อันดับแรก อันดับ 1 ได้แก่ JMT หลังมีข่าวการชำระหนี้หุ้นกู้ 2.5 พันลบ. ทันทตามกำหนด ทำให้ความกังวลของนักลงทุนคลี่คลาย ทำให้เกิดแรงซื้อจนราคาปรับขึ้นแรงกว่า 39% MoM นอกจากนี้ยังมีหุ้นอื่นที่ราคาปรับขึ้นแรงอีก เช่น DITTO (+48% MoM), VGI (+49% MoM) ซึ่งคาดแรงซื้อบางส่วน เกิดจากการซื้อผ่านบัญชีมาร์จิ้น สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในตลาดรวม ที่มีมูลค่าลดลงมากที่สุด 10 อันดับแรกนั้น พบว่าหุ้นที่ราคาร่วงลงแรงสุด 5 ตัว เป็นหุ้นขนาดใหญ่ในกลุ่ม SET100 โดยอันดับ 1 คือ KCE ที่ราคาร่วงลง 14% MoM ขณะที่หุ้นที่ราคาดีดลงมากที่สุดคืออันดับ 9 หุ้น SAPPE ที่ราคาหุ้นปรับตัวลดลงกว่า 23% MoM

SET Index & Margin Collateral

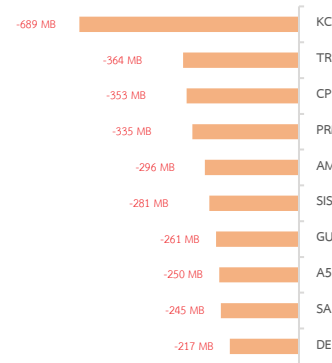


Net Buy/Sell	Y2023	Y24-YTD	Jul-24	Aug-24
Insitutions	81,011	3,684	(2,672)	2,057
Properitary	(5,256)	(2,568)	(692)	(1,086)
Foreign	(192,083)	(123,693)	(1,576)	(6,133)
Local	116,327	122,576	4,939	5,162

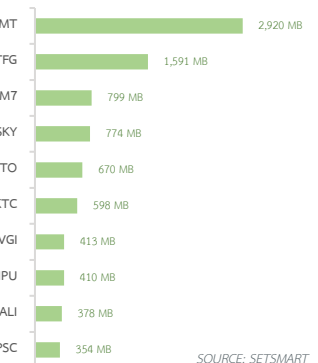
TOP 10 MARGIN COLLATERAL VALUE TOP 10 MARGIN % OF LISTED SHARES



TOP 10 DECREASE COLLATERAL



TOP 10 INCREASE COLLATERAL



คำชี้แจงที่สำคัญ (Disclaimer)

ข้อมูลปรากฏในรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นบนพื้นฐานของข้อมูลที่ได้เข้ามาแจ้งข้อมูลไว้ ทั้งนี้บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน) ("บริษัท") มิได้ยืนยันหรือรับรองถึงความถูกต้อง หรือ ความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด ความคิดเห็นที่ปรากฏในรายงานนี้เป็นเพียงการนำเสนอในมุมมองของบริษัท และเป็นการคิดเห็น ณ วันที่ปรากฏในรายงานเท่านั้น ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังดังกล่าว โดยบริษัทไม่จำเป็นต้องให้ทราบล่วงหน้าหรือรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นเพื่อเผยแพร่ข้อมูลเท่านั้น บริษัทไม่รับผิดชอบต่อการนำข้อมูล หรือความคิดเห็นไปใช้ในทางใดๆ สืบค้น ผู้มีข้อมูลผู้ใช้ ใจควรใช้ข้อมูลนี้ในการพิจารณาตัดสินใจก่อนนำไปใช้ประโยชน์ของรางวัลอื่นในข้อมูล และความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใด นำข้อมูล และความคิดเห็นในเอกสารฉบับนี้ ทำซ้ำ ส่งต่อ แสพแพร่ ขาย จำหน่าย คัดลอก นำออกแสดง หรือนำไปแสวงหาประโยชน์ในเชิงพาณิชย์ ไม่ว่าด้วยวิธีการใดๆ โดยไม่ได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทเป็นการล่วงหน้า