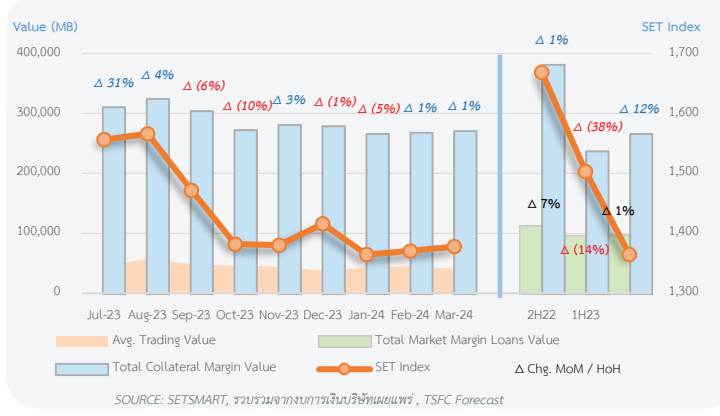


MONTHLY REPORT - CREDIT BALANCE COLLATERAL

MAR, 2024.

HIGHLIGHT

- มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม ในเดือน มี.ค.67 มีมูลค่ารวมทั้งสิ้น 2.70 แสนลบ. เพิ่มขึ้น 2.5 พันลบ. เมื่อเทียบกับเดือนก่อน (+0.94% MoM)
- ยอดสินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม จวดเดือน มี.ค. 67 คาดอยู่ที่ 8.86 หมื่นลบ. ลดลง 468 ลบ. (-0.53% MoM, -1.96% YTD : TSFC Forecast)
- บรรยากาศการลงทุนตลาดหุ้นไทยยังคงมีความผันผวนสูง ด้วยปริมาณการซื้อขายเบาบางสุดในรอบปี แม้จะมีการขยายเวลาเทรดเพิ่มขึ้นอีก 30 นาที ก็ตาม
- เศรษฐกิจไทยแสดงสัญญาณอ่อนแอกว่าคาด โดยสำนักวิจัยเศรษฐกิจต่างๆ ได้ปรับลดประมาณการเศรษฐกิจไทยปี 67 ลงจาก 2.8-3.2% เหลือ 2.4-2.7%



Net Buy/Sell	Y2023	Y24-YTD	Feb-24	Mar-24
Insitutions	81,011	(5,272)	(5,891)	1,696
Proprietary	(5,256)	(2,903)	(2,189)	(1,569)
Foreign	(192,083)	(68,862)	3,246	(41,238)
Local	116,327	77,037	4,834	41,111

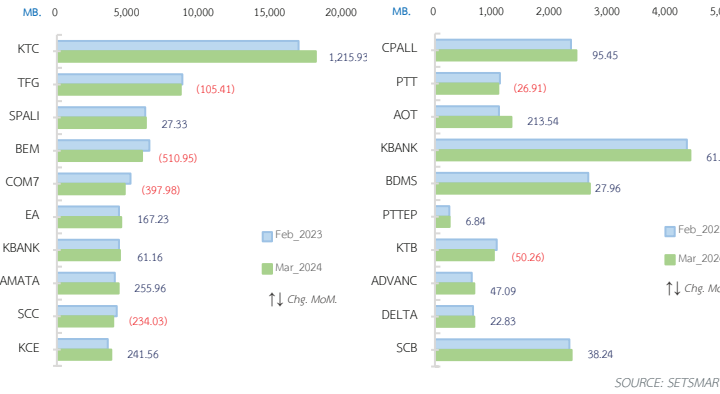
CREDIT BALANCE COLLATERAL OVERVIEW

ยอดสินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างในเดือน มี.ค. 67 คาด ยังมีปริมาณการใช้ที่ลดลง หลังจากพุ่งไปทำจุดสูงสุดที่ 1.14 แสนลบ. ในเดือน ต.ค. 65 จากนั้นก็ลดลงอย่างต่อเนื่อง และ สร้างจุดต่ำสุดในรอบ 34 เดือน ที่ระดับ 8.86 หมื่นลบ. จากความกังวลต่อเศรษฐกิจของไทยที่อ่อนแอ ที่ทำให้ GDP ไทยขยายตัวต่ำสุดในภูมิภาค ขณะที่มูลค่าหลักประกัน Margin Collateral คงค้างในระบบรวม มีมูลค่า 2.70 แสนลบ. เพิ่มขึ้น 2.5 พันลบ. (+0.94% MoM) โดยเป็นการปรับขึ้นตาม SET Index เดือน มี.ค. 67 ที่ปรับขึ้นเล็กน้อย โดย +7.27 จุด หรือ +0.5% MoM

FACTOR EFFECT CREDIT BALANCE COLLATERAL

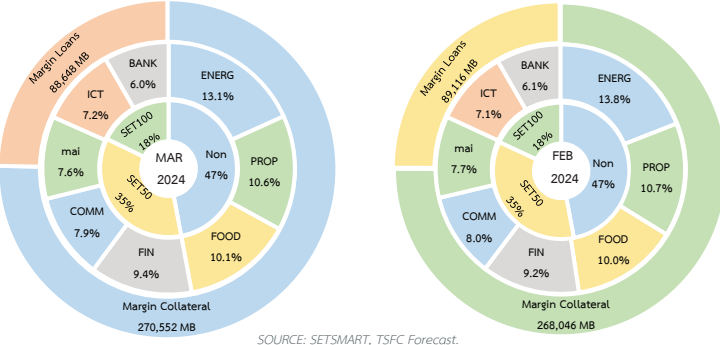
- ตลาดหลักทรัพย์ฯ ขยายเวลาซื้อขายขึ้นอีก 30 นาที แต่ยังไม่สามารถช่วยกระตุ้นบรรยากาศการลงทุนได้ โดยปริมาณการซื้อขายลดลง 3.7 พันลบ. (-8.4% MoM)
- ราคาน้ำมันดิบโลกปรับขึ้นแรงกว่า 6.1% MoM จากความตึงเครียดใน Middle East ส่งผลบวกต่อหุ้นในกลุ่มพลังงาน เช่น BCP (+9.6%), PTTEP (+1.3%)
- ราคาหุ้นกลุ่ม ETRON ปรับขึ้นแรง (+4.5% MoM) คาดเป็นการปรับขึ้นตามตลาดหุ้นภูมิภาค เช่น SMT (+10%), HANA (+7.4%), DELTA (+4.6%)
- ตัวเลขการบริโภคภาคเอกชนหดตัวลง หลังจากจบบัตรการ Easy-E-receipt ซึ่งกระทบ หุ้นกลุ่มค้าปลีก เช่น COM7 (-7.7%), CPW (-9.7%), HMPRO (-5.4%)
- หุ้นกลุ่มท่องเที่ยว (+3.4% MoM) ปรับขึ้นแรง หลังจำนวนนักท่องเที่ยวสะสมใน 1Q67 อยู่ที่ 9.37 ล้านคน เพิ่มขึ้น 44% YoY ซึ่งขยายตัวสูงกว่าที่คาดการณ์ไว้

TOP 10 MARGIN COLLATERAL VALUE TOP 10 SET TRADING VALUE



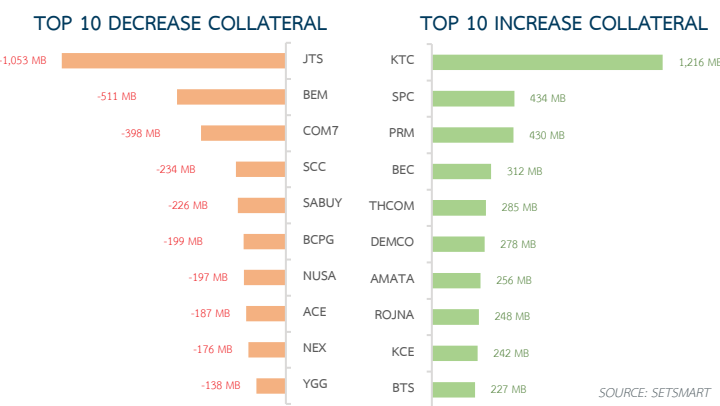
TOP 10 CREDIT BALANCE COLLATERAL

สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างทั้งหมดของระบบ ที่มีมูลค่าสูงสุด 10 อันดับแรก จวดเดือน มี.ค. 67 พบว่าหุ้นที่มีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นเพิ่มขึ้นมากที่สุด ได้แก่ KTC โดยเพิ่มขึ้น 1,215 ลบ. ภายหลังจากปรับขึ้นแรงกว่า 7% MoM ทำให้ KTC ยังคงฐานะอันดับ 1 ของหุ้นที่มีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นมากที่สุดของระบบ ซึ่งคิดเป็นสัดส่วน 6.7% ของหลักประกันทั้งหมดในระบบ ขณะที่หุ้นที่มีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นลดลงมากที่สุด ในกลุ่ม Top 10 ได้แก่ BEM (-510 ลบ.) หลังมีการขาย/โอน ออกจากบัญชีมาร์จิ้นกว่า 68 ล.หุ้น



TOP INCREASE - TOP DECREASE COLLATERAL (Δ MoM)

หลักประกันคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นตลาดรวม ที่มีมูลค่าเพิ่มขึ้นสูงสุด 10 อันดับแรก ในเดือน มี.ค. 67 นี้ อันดับ 1 คือ KTC ที่มีมูลค่าหลักประกันเพิ่มขึ้น 1.21 พันลบ. ขณะที่หุ้นที่มีปริมาณหุ้นเพิ่มเข้ามาในบัญชีมาร์จิ้นมากที่สุด (% เทียบทุนจดทะเบียน) ในกลุ่ม Top10 คือ หุ้น SPC โดยมีจำนวนหุ้นที่ ซื้อ/โอน เข้ามาในบัญชีมาร์จิ้นรวมในระบบ จำนวน 7 ล.หุ้น หรือ คิดเป็น 2.1% of Listed shares สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในตลาดรวม ที่มีมูลค่าลดลงมากที่สุด 10 อันดับแรก ในจวดเดือน มี.ค. 67 นี้ พบว่าอันดับ 1 ได้แก่ หุ้น JTS ที่ราคาหุ้น -31% MoM โดยคาดเกิดจากการขายทำกำไร ภายหลังจากหุ้น JTS มีการพุ่งขึ้นกว่า 200% ในช่วง 5 เดือนล่าสุด ขณะที่อันดับ 7 คือหุ้น NUSA ที่มีราคาลดลง 24% MoM หลังมีประเด็นข้อขัดแย้งของผู้ถือหุ้น จนทำให้ตลาดฯ สั่งให้มีการทำหนังสือชี้แจง



คำชี้แจงที่สำคัญ (Disclaimer)

ข้อมูลปรากฏในรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นบนพื้นฐานของข้อมูลที่ได้รวบรวมและเชื่อถือได้ ทั้งนี้บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน) ("บริษัท") มิได้ยืนยันหรือรับรองถึงความถูกต้อง หรือ ความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด ความคิดเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานนี้เป็นเพียงการนำเสนอในมุมมองของบริษัท และเป็นความคิดเห็น ณ วันที่ปรากฏในรายงานเท่านั้น ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังดังกล่าว โดยบริษัทไม่จำเป็นต้องให้ทราบล่วงหน้ารายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นเพื่อเผยแพร่ข้อมูลเท่านั้น บริษัทไม่รับผิดชอบต่อการนำข้อมูล หรือความคิดเห็นใดๆ ไปใช้ในทุกรณณ สิ้นสุด ผู้มีข้อมูลผู้ใช้ จักรวรรดิในการพิจารณาตัดสินใจก่อนนำไปใช้ข้อมูลของบรรษัทในข้อมูล และความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใด นำข้อมูล และความคิดเห็นในเอกสารฉบับนี้ไปทำซ้ำ ส่งต่อ แสพหรือ ขาย จำหน่าย คัดลอก นำออกแสดง หรือนำไปเผยแพร่โดยไม่ขออนุญาต มิฉะนั้นจะถือว่าผิดกฎหมาย