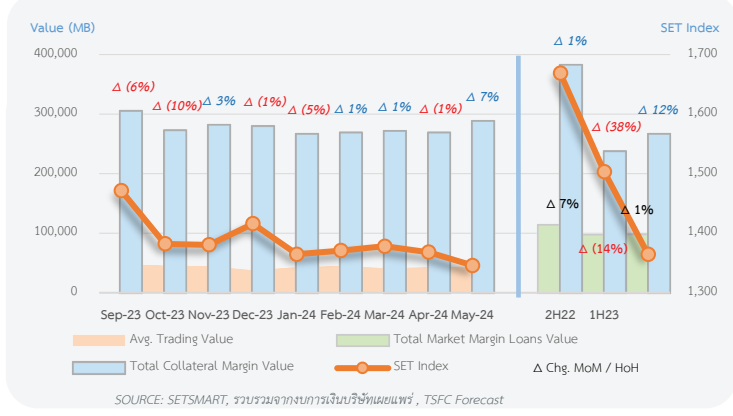


MONTHLY REPORT - CREDIT BALANCE COLLATERAL

MAY, 2024.

HIGHLIGHT

- มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม ในเดือน พ.ค. 67 มีมูลค่ารวมทั้งสิ้น 2.87 แสนลบ. เพิ่มขึ้น 1.9 หมื่นลบ. (+7.17% MoM)
- ยอดสินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม งวดเดือน พ.ค. 67 คาดอยู่ที่ 8.56 หมื่นลบ. ลดลง 2.5 พันลบ. (-0.2.9% MoM, -5.2% YTD : TSFC Forecast)
- SET Index ยังทรุดตัวลงอีกกว่า 22 จุด จากปัญหาความไม่แน่นอนการเมืองในประเทศ เรื่องการวินิจฉัยการดำรงตำแหน่งนายกฯ และ คดียุบพรรคก้าวไกล
- มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นหุ้นกลุ่มพลังงาน ลดลงมาอยู่ในอันดับ 2 เป็นครั้งแรก โดยมีกลุ่มอาหาร ขยับขึ้นมาเป็นอันดับ 1 ที่มีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นสูงสุดในตลาด



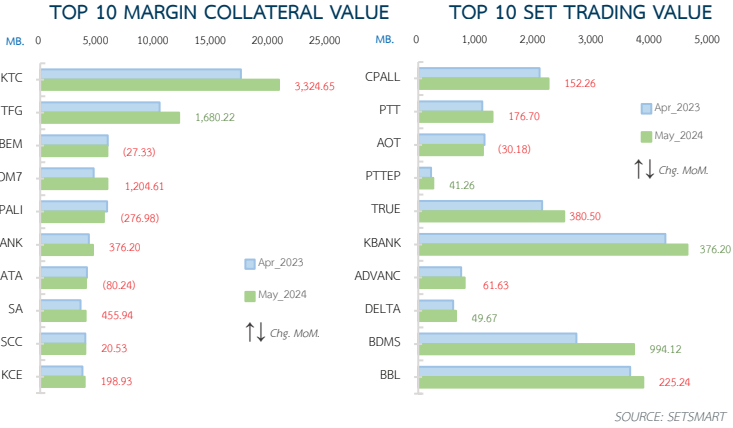
Net Buy/Sell	Y2023	Y24-YTD	Apr-24	May-24
Insitutions	81,011	(94)	(199)	5,377
Properitary	(5,256)	(1,601)	(2,055)	3,357
Foreign	(192,083)	(81,641)	3,787	(16,566)
Local	116,327	83,336	(1,534)	7,832

CREDIT BALANCE COLLATERAL OVERVIEW

ยอดสินเชื่อมาร์จิ้นสินเชื่อเดือน พ.ค. 67 คาด ยังคงปรับลดลงทำจุดต่ำสุดอย่างต่อเนื่อง โดยคาดว่าจะลดลงเหลือ 8.56 หมื่นลบ. (-2.9% MoM) จากภาพการลงหุ้นในตลาดที่ขาดปัจจัยบวก ผ่นวกกับการรอดำตัดสินของศาลา ในคดีการเมืองสำคัญ ทำให้นักลงทุนชะลอการลงทุนลง กระทั่งถึงปริมาณการใช้สินเชื่อมาร์จิ้นที่ลดลงตาม ขณะที่มูลค่าหลักประกัน Margin Collateral คงค้างในระบบรวม มีมูลค่าทั้งสิ้น 2.87 แสนลบ. เพิ่มขึ้น 1.9 หมื่นลบ. ส่วนทางกับยอดสินเชื่อมาร์จิ้นรวมที่ลดลง ซึ่งเกิดจากมีแรงซื้อหุ้นบางตัว ในกลุ่ม SET100 เข้ามาอย่างหนาแน่น

FACTOR EFFECT CREDIT BALANCE COLLATERAL

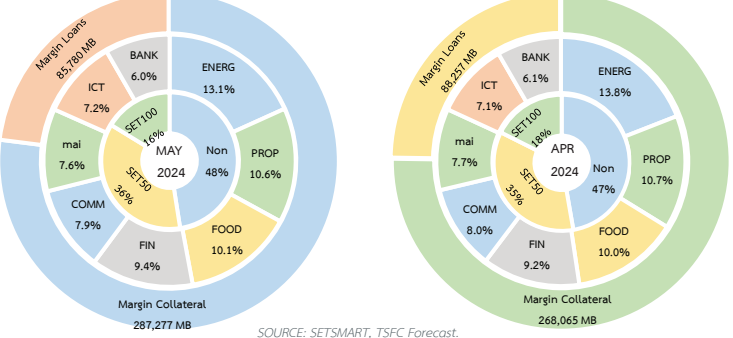
- กลุ่ม Food ขึ้นมาเป็นอันดับ 1 ของกลุ่มที่มีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นสูงสุดในตลาดหลักๆ มาจากการเพิ่มขึ้นของหุ้น OSP และ TFG มูลค่ารวมกันกว่า 3.5 พันลบ.
- กลุ่ม Energy ลดลงมาสู่อันดับ 2 ของกลุ่มที่มีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นสูงสุดในตลาด หลังจากราคาหุ้นธุรกิจโรงไฟฟ้าหลายตัว มีราคาปรับลดลงอย่างต่อเนื่อง
- กลุ่ม Finance มีมูลค่าหลักประกันเพิ่มขึ้นกว่า 3.9 พันลบ. โดยเกิดจากหุ้น KTC มีปริมาณหุ้นเพิ่มขึ้นจากการซื้อ/โอน เข้ามาในบัญชีมาร์จิ้นรวมกว่า 48 ล้านหุ้น
- กลุ่ม Auto เป็นกลุ่มที่มีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นลดลงมากที่สุดในตลาดฯ ภายหลังจากราคาหุ้น NEX ดิ่งลงกว่า 69% MoM จนทำให้เกิดการ force sell ขึ้นมา
- กลุ่ม ICT มีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นเพิ่มขึ้นมากกว่า 13.9% MoM หลักๆ เกิดจากหุ้น JTS ซึ่งมีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นสูงสุดในกลุ่ม มีราคาบวกแรงกว่า 46%



TOP VALUE CREDIT BALANCE COLLATERAL

สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นสินเชื่อรวมทั้งหมดของระบบ ที่มีมูลค่าสูงสุด 20 อันดับแรก งวดเดือน พ.ค. 67 พบว่าหุ้นที่มีมูลค่าหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้นเพิ่มขึ้นเกินกว่าพันลบ. (> 1,000 ลบ.) ในงวดนี้มีถึง 5 ตัว ได้แก่ KTC (+3,324 ลบ.), TFG (+1,680 ลบ.), COM7 (+1,204 ลบ.), OSP (+1,809 ลบ.), และ JTS (+1,007 ลบ.)

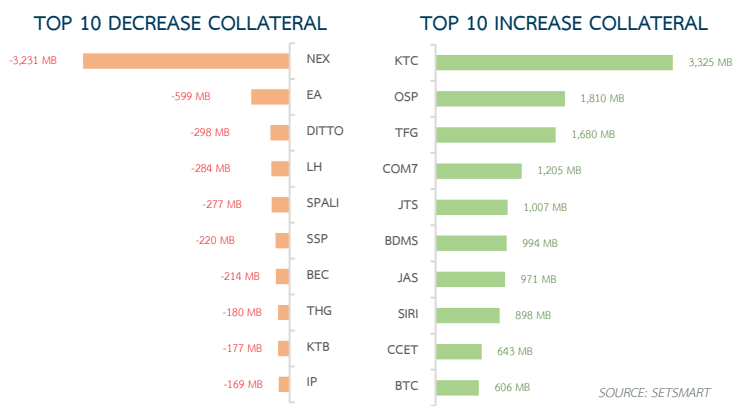
สำหรับหุ้นที่มีมูลค่าซื้อขายสูงสุดในตลาดฯ 10 อันดับแรกในเดือน พ.ค. 67 ที่มีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างเพิ่มมากที่สุดในกลุ่ม ได้แก่ BDMS จากปริมาณหุ้นมาร์จิ้นเพิ่มขึ้นกว่า 43.76 ล.หุ้น หรือ +994 ลบ. ขณะที่ราคาหุ้น -6.9% MoM



TOP INCREASE – TOP DECREASE COLLATERAL (Δ MoM)

หลักประกันคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นตลาดรวม ที่มีมูลค่าเพิ่มขึ้นสูงสุด 10 อันดับแรก ในเดือน พ.ค. 67 นี้ พบว่ามีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้น ที่เพิ่มขึ้นรวมกว่า 1.31 หมื่นลบ. โดยเป็นหุ้นขนาดใหญ่ในกลุ่ม SET50/SET100 ครั้งหนึ่ง อันได้แก่ KTC, OSP, COM7, BDMS และ SIRI โดยส่วนใหญ่เกิดจากการซื้อ/โอน หุ้นเข้ามาในบัญชีมาร์จิ้น แต่มี 2 หลักทรัพย์ ที่เกิดจากราคาหุ้น มีการปรับขึ้นแรง ได้แก่ JTS ที่ราคาหุ้น +46% MoM และ CCET ที่ราคาหุ้น +58.4% MoM

สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในตลาดรวม ที่มีมูลค่าลดลงมากที่สุด 10 อันดับแรกในงวดนี้ พบว่ามีมูลค่าหลักประกันมาร์จิ้น ที่ลดลงรวมกันกว่า 5.64 พันลบ. โดยเฉพาะอันดับ 1 คือ หุ้น NEX ที่ถูก force sell ออกมา หลังราคาหุ้นดิ่งลงแรงกว่า 69% MoM ส่งผลให้มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นคงค้าง ลดลงไปกว่า 3.23 พันลบ.



คำชี้แจงที่สำคัญ (Disclaimer)

ข้อมูลนี้ปรากฏในรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นบนพื้นฐานของข้อมูลที่ได้รับจากแหล่งข้อมูลที่น่าเชื่อถือได้ ทั้งนี้บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน) ("บริษัท") มิได้ยืนยันหรือรับรองถึงความถูกต้อง หรือ ความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด ความคิดเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานนี้เป็นเพียงการนำเสนอในมุมมองของบริษัท และเป็นความคิดเห็น ณ วันที่ปรากฏในรายงานเท่านั้น ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังดังกล่าว โดยบริษัทไม่จำเป็นต้องให้ทราบล่วงหน้าหรือแจ้งให้ทราบล่วงหน้าก่อนบริษัทมีมติขอถอนการนำข้อมูล หรือความคิดเห็นใดไปใช้ในทุกระดับ ดังนั้น ผู้ที่นำข้อมูลไปใช้ จักควรใช้ข้อมูลนี้ในการพิจารณาตัดสินใจก่อนนำไปใช้หรือใช้ของระบบอัตโนมัติ และควรเห็นว่าการลงทุนในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใด นำข้อมูล และความคิดเห็นในเอกสารฉบับนี้ ทำซ้ำ ส่งต่อ แสพหรือ ขาย จำหน่าย คัดลอก นำออกแสดง หรือนำไปเผยแพร่โดยไม่ขออนุญาต บริษัทฯ มิว่าด้วยวิธีการใดๆ โดยมิได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทเป็นกรณีแรก