

MONTHLY REPORT - TOTAL MARKET MARGIN LOANS COLLATERAL

OCT, 2024.

HIGHLIGHT

- มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม งวดเดือน ต.ค. 67 มีมูลค่ารวมทั้งสิ้น 2.64 แสนลพ. ใกล้เคียงกับเดือน ก.ย. ที่ 2.65 แสนลพ.
- ยอดสินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม งวดเดือน ต.ค. 67 คาดอยู่ที่ 7.61 หมื่นลพ. ลดลงเล็กน้อย เมื่อเทียบกับเดือนก่อนหน้า โดย -345 ลพ. (-0.45% MoM)
- บรรยากาศการลงทุนมีการแกว่งตัวอย่างผันผวนตลอดเดือน ตามทิศทางตลาดหุ้นภูมิภาค ก่อนทราบผลการเลือกตั้งใหญ่สหรัฐต้นเดือน พ.ย. 67
- SET Index ปรับขึ้นต่อเนื่อง 4 เดือนติดต่อกัน โดยปรับขึ้น 17.21 จุด หลักๆ มาจากหุ้น DELTA ที่มีมาร์เกตแคปใหญ่บวกแรง สวนทางกับหุ้นกลุ่มอื่นๆ ที่ปรับลง

MARKET MARGIN LOANS OVERVIEW

ปริมาณการใช้สินเชื่อมาร์จิ้นคงค้างของตลาดรวม งวดเดือน ต.ค. 67 กลับมาลดลงเล็กน้อย โดยลดลง 345 ลพ. เทียบกับเดือน ก.ย. ที่เพิ่มขึ้น 556 ลพ. เมื่อนักลงทุนรายย่อยทยอยขายทำกำไรออกมา หลังจาก SET Index ปรับขึ้นติดต่อกัน 4 เดือน ขณะที่นักลงทุนสถาบันเข้าซื้อสุทธิสูงกว่า 3.39 หมื่นลพ.

ขณะที่มูลค่าหลักประกัน Margin Collateral คงค้างในระบบรวม มีมูลค่าทั้งสิ้น 2.64 แสนลพ. โดยลดลง 400 ลพ. ซึ่งส่วนใหญ่เกิดจากการลดลงของหลักประกันในหุ้นกลุ่มพลังงาน (-4.6% MoM) และ กลุ่มธนาคาร (-12.9% MoM)

FACTOR EFFECT CREDIT BALANCE COLLATERAL

- นักลงทุนบางส่วนปรับลดพอร์ต และ ชะลอการลงทุนลง เพื่อรอผลการเลือกตั้งใหญ่สหรัฐ และการรอผลการประชุม FOMC เรื่องปรับลดดอกเบี้ย ต้นเดือน พ.ย. นี้ ส่งผลให้บรรยากาศการลงทุนผันผวนตลอดเดือน
- ผลประกอบการของ บจ. งวด 3Q67 ที่ทยอยประกาศออกมา ในหุ้นกลุ่มธนาคาร และ กลุ่มพลังงาน ปรากฏว่าต่ำกว่าตลาดคาด ทำให้เกิดแรงขายออกมา
- กลุ่มรับเหมาก่อสร้าง ดิ่งลงแรง (-8.47% MoM) หลังเกิดปัญหาในโครงการก่อสร้าง CFP ของ TOP ที่มีมูลค่ากว่าแสนลพ. ทำให้ผู้รับเหมายังไม่สามารถเก็บหนี้ได้
- ค่าเงิน US Dollar กลับมาแข็งค่าขึ้นกว่า 3.13% MoM หลังกระแส Fund Flow เริ่มไหลกลับเข้าในสินทรัพย์สกุลเงินดอลลาร์เพิ่มมากขึ้น
- หุ้น DELTA พุ่งขึ้นแรงกว่า 29% MoM หนุนให้ SET Index ปรับขึ้นเป็นบวกได้

TOP VALUE CREDIT BALANCE COLLATERAL

สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างทั้งหมดของตลาด ที่มีมูลค่าสูงสุด 10 อันดับแรกนั้น พบว่ามีหุ้นที่มีราคาปรับขึ้นมากที่สุด ได้แก่ COM7 (+17.2%), AMATA (+17.0%) และ JMT (+9.9%)

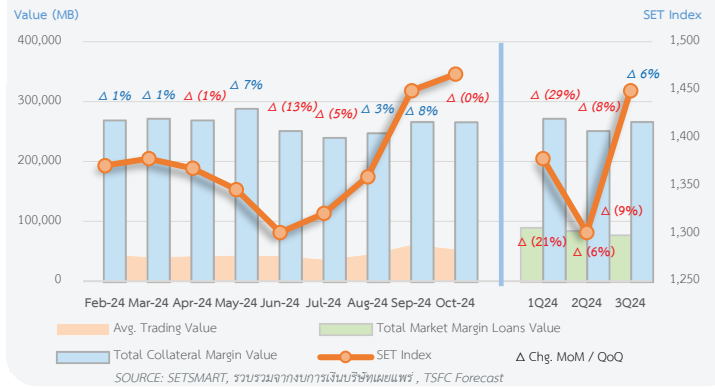
ในขณะที่มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างแยกรายอุตสาหกรรม พบว่าส่วนใหญ่มีการปรับตัวลดลง หลักๆ ได้แก่หุ้นในกลุ่มรับเหมา (-8.47%) กลุ่มปิโตร (-4.0%) และ กลุ่มวัสดุก่อสร้าง (-8.8%) ภายหลังจากผลประกอบการงวด 3Q67 มีผลขาดทุนมากกว่าคาด สวนทางกับหุ้นในกลุ่มอิเล็กทรอนิกส์ที่ปรับขึ้นโดดเด่น (+15%) อันเป็นผลมาจากหุ้นบางตัวที่ปรับขึ้นแรง เช่น DELTA (+29%), CCET (+42%)

TOP 10 COLLATERAL MOVEMENT (Δ MoM)

หลักประกันคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นตลาดรวม ที่มีมูลค่าเพิ่มขึ้นสูงสุด 10 อันดับแรก พบว่าหุ้นที่เพิ่มขึ้นมากที่สุดในแง่มูลค่า ได้แก่ AOT ที่มีการ ซื้อ/โอน เพิ่มเข้ามาในบัญชีมาร์จิ้นกว่า 1.17 พันลพ. หรือ เพิ่มขึ้น 20 ล.หุ้น (+0.14% of listed shares) ในขณะที่หุ้นที่มีการ ซื้อ/โอน เข้ามาในบัญชีมาร์จิ้นมากสุดในแง่ปริมาณหุ้น ได้แก่ THCOM โดยเพิ่มขึ้น 15.77 ล.หุ้น (+1.44% of listed shares)

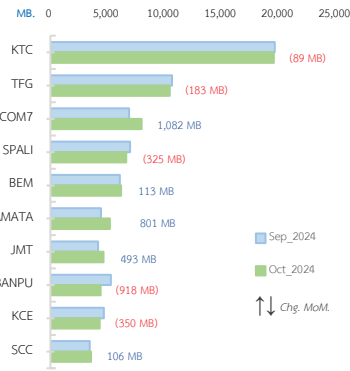
สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในตลาดรวม ที่มีมูลค่าลดลงมากที่สุด 10 อันดับแรกนั้น พบว่าหุ้นที่ลดลงมากสุดในแง่มูลค่า ได้แก่ NER ที่มีการ ขาย/โอน ออกจากบัญชีมาร์จิ้นจำนวน 247 ล.หุ้น หรือ -1,364 ลพ. ขณะที่หุ้นที่มีลดลงมากสุดในแง่ปริมาณหุ้นได้แก่ BEYOND โดยลดลง -17.25% of listed shares หรือ -499 ลพ.

Total Market Margin Loans Movement

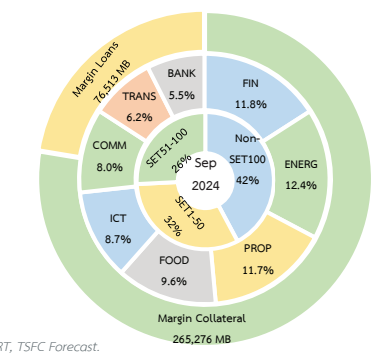
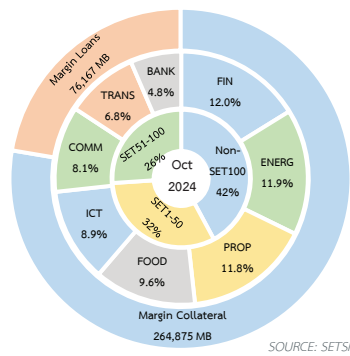
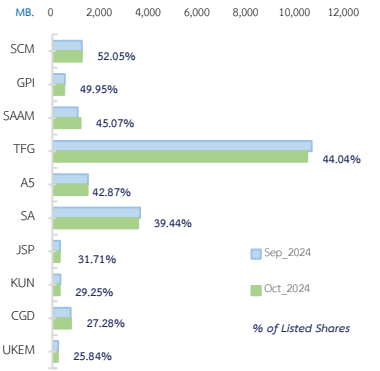


Net Buy/Sell	Y2023	Y24-YTD	Sep-24	Oct-24
Insitutions	81,011	35,809	(1,812)	33,936
Proprietary	(5,256)	992	4,002	(442)
Foreign	(192,083)	(122,757)	28,904	(27,968)
Local	116,327	85,957	(31,094)	(5,525)

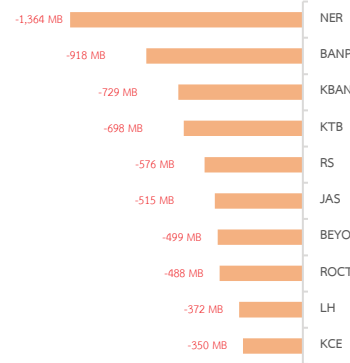
TOP 10 MARGIN COLLATERAL VALUE



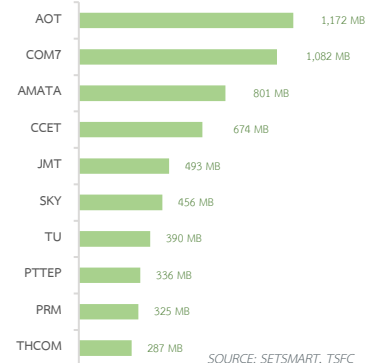
TOP 10 MARGIN % OF LISTED SHARES



TOP 10 DECREASE COLLATERAL



TOP 10 INCREASE COLLATERAL



คำชี้แจงที่สำคัญ (Disclaimer)

ข้อมูลปรากฏในรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นบนพื้นฐานของข้อมูลที่ได้รวบรวมและเชื่อถือได้ ทั้งนี้บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน) ("บริษัท") มิได้ยืนยันหรือรับรองถึงความถูกต้อง หรือ ความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด ความคิดเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานนี้เป็นเพียงการนำเสนอข้อมูลของบริษัท และเป็นการคิดเห็น ณ วันที่ปรากฏในรายงานเท่านั้น ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังในระยะเวลาอันสั้น โดยบริษัทไม่จำเป็นต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้ารายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นเพื่อเผยแพร่ข้อมูลเท่านั้น บริษัทไม่รับผิดชอบต่อการนำข้อมูล หรือความคิดเห็นใดๆไปใช้ในทางปฏิบัติ ผู้ที่นำข้อมูลไปใช้ จักรวรรดิควรพิจารณาถึงความเสี่ยงและดำเนินการตามขั้นตอนที่เหมาะสมก่อนการตัดสินใจลงทุน และควรเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใด นำข้อมูล และความคิดเห็นในเอกสารฉบับนี้ ไปทำ สแปม แล่ หรือ ขาย จำนวน ค่าคอมมิชชั่น หรือค่าโฆษณาในสื่อโซเชียลมีเดีย ไม่ว่าด้วยวิธีการใดๆ โดยมิได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทเป็นกรณีแรก