

MONTHLY REPORT - TOTAL MARKET MARGIN LOANS COLLATERAL

OCT, 2024.

HIGHLIGHT

- มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม งวดเดือน ต.ค. 67 มีมูลค่ารวมทั้งสิ้น 2.64 แสนล.บ. ใกล้เคียงกับเดือน ก.ย. ที่ 2.65 แสนล.บ.
- หลักประกันมาร์จิ้นแยกตามกลุ่มอุตสาหกรรม ที่มีค่าเพิ่มมากที่สุดได้แก่ กลุ่มขนส่ง โดย +1.7 พันล.บ. ขณะที่กลุ่มที่ลดลงมากที่สุด คือกลุ่มพลังงาน โดย -1.5 พันล.บ.
- 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

ขณะที่มูลค่าหลักประกัน Margin Collateral คงค้างในระบบรวม มีมูลค่าทั้งสิ้น 2.64 แสนล.บ. โดยลดลง 400 ล.บ. สะท้อนภาพการบรรยากาศการลงทุนที่ยังคงผันผวน ทำให้นักลงทุนบางกลุ่ม มีการปรับลดพอร์ตขายทำกำไรออกมา ภายหลัง SET Index ปรับขึ้นติดต่อกันกว่า 4 เดือน

โดยพิจารณาจากหลักประกันมาร์จิ้นกลุ่มหลักๆ พบว่ามีการแกว่งตัวสูง โดยกลุ่มพลังงาน และ กลุ่ม ธนาคาร มีมูลค่าปรับลดลงมากที่สุด คือ -1.5 และ -1.9 พันล.บ. สวนทางกับกลุ่มขนส่ง ที่มีมูลค่าปรับขึ้นมากที่สุด กว่า 1.7 พันล.บ. (+10.3% 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 ที่มีมูลค่ากว่าแสนล.บ. 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

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

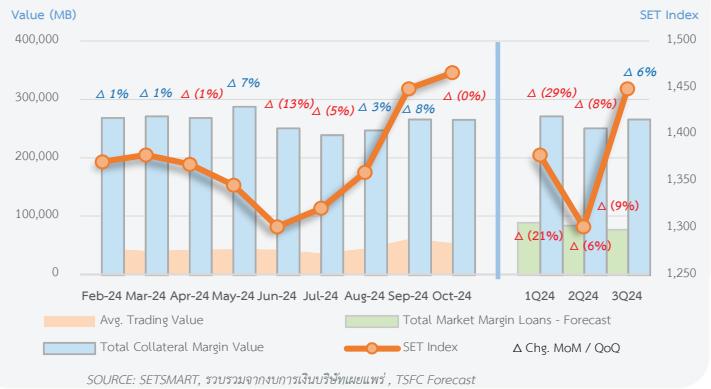
ในขณะที่มูลค่าหลักประกันมาร์จิ้นแยกรายอุตสาหกรรม พบว่าส่วนใหญ่มีการปรับตัวลดลง หลักๆ ได้แก่หุ้นในกลุ่มรับเหมา (-8.47%) กลุ่มปิโตร (-4.0%) และ กลุ่มวัสดุก่อสร้าง (-8.8%) ภายหลังจากผลประกอบการงวด 3Q67 มีผลขาดทุนมากกว่าคาด สวนทางกับหุ้นในกลุ่มอิเล็กทรอนิกส์ ที่ปรับขึ้นโดดเด่น (+15%) อันเป็นผลมาจากหุ้นบางตัวที่ปรับขึ้นแรง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

TOP 10 COLLATERAL MOVEMENT (Δ MoM)

หลักประกันคงค้างในบัญชีมาร์จิ้นตลาดรวม ที่มีมูลค่าเพิ่มขึ้นสูงสุด 10 อันดับแรก พบว่าหุ้นที่เพิ่มขึ้นมากที่สุดในมูลค่า ได้แก่ AOT ที่มีการ ซื้อ/โอน เพิ่มเข้ามาในบัญชีมาร์จิ้นกว่า 1.17 พันล.บ. 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)

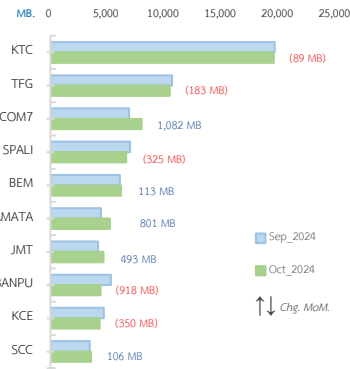
สำหรับหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในตลาดรวม ที่มีมูลค่าลดลงมากที่สุด 10 อันดับแรกนั้น พบว่าหุ้นที่ลดลงมากสุดในแง่มูลค่า ได้แก่ NER ที่มีการ ขาย/โอน ออกจากบัญชีมาร์จิ้นจำนวน 247 ล.หุ้น หรือ -1,364 ล.บ. ขณะที่หุ้นที่มีลดลงมากสุดในแง่ปริมาณหุ้นได้แก่ BEYOND โดยลดลง -17.25% of listed shares หรือ -499 ล.บ.

SET Index & Margin Collateral

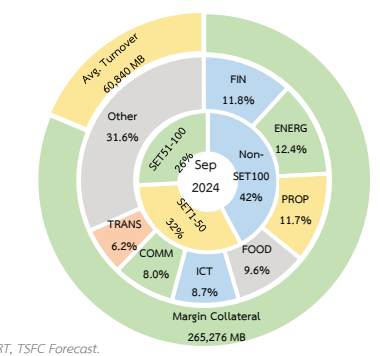
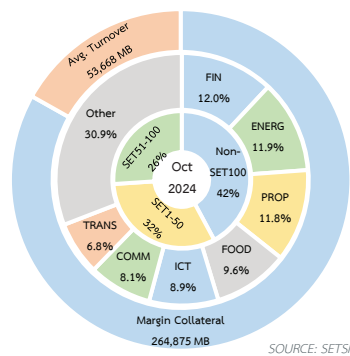
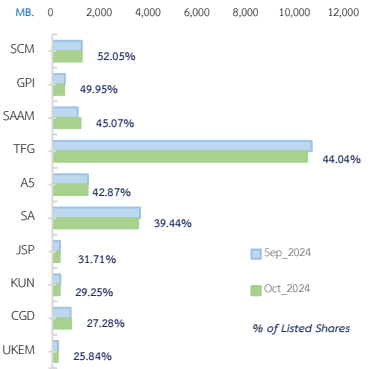


Net Buy/Sell	Y2023	Y24-YTD	Sep-24	Oct-24
Institutions	81,011	35,809	(1,812)	33,936
Proprietary	(5,256)	992	4,002	(442)
Foreign	(192,083)	(122,757)	28,904	(27,968)
Local	116,327	85,957	(31,094)	(5,525)

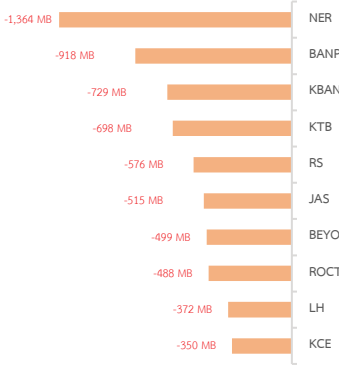
TOP 10 MARGIN COLLATERAL VALUE



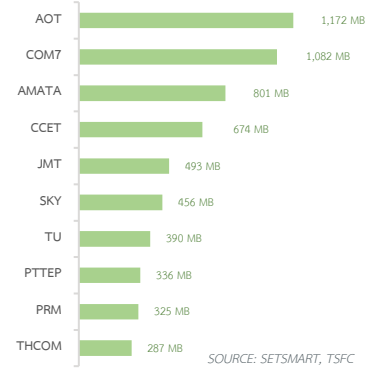
TOP 10 MARGIN % OF LISTED SHARES



TOP 10 DECREASE COLLATERAL



TOP 10 INCREASE COLLATERAL



คำชี้แจงที่สำคัญ (Disclaimer)

ข้อมูลปรากฏในรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นบนพื้นฐานของข้อมูลที่ได้มาซึ่งเชื่อถือได้ ทั้งนี้บริษัทหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน) ("บริษัท") มิได้ยืนยันหรือรับรองถึงความถูกต้อง หรือ ความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด ความคิดเห็นที่ปรากฏในรายงานนี้เป็นเพียงการนำเสนอในมุมมองของบริษัท และเป็นความคิดเห็น ณ วันที่ปรากฏในรายงานเท่านั้น ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังวันดังกล่าว โดยบริษัทไม่จำเป็นต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้ารายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นเพื่อเผยแพร่ข้อมูลเท่านั้น บริษัทไม่รับผิดชอบต่อการนำข้อมูล หรือความคิดเห็นใดไปใช้ในทางอื่นใด ผู้รับข้อมูลผู้ใช้ จึงควรใช้ดุลพินิจในการพิจารณาตัดสินใจก่อนนำไปใช้ประโยชน์ของรับสิทธิข้อมูล และความเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใด นำข้อมูล และความคิดเห็นในเอกสารฉบับนี้ ทำซ้ำ ส่งต่อ แสพแพร่ ขาย จำหน่าย คัดลอก นำออกแสดง หรือนำไปเผยแพร่โดยไม่ได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทเป็นกรณี