

CREDIT BALANCE FINANCING REPORT
2Q/2024
TOP 30 STOCKS - CREDIT BALANCE COLLATERAL IS VOLUME CHANGE IN 2Q/2024.

หลักประกันในบัญชีสินเชื่อมาร์จิ้นลอนค่างทั้งหมดในตลาดรวม หรือ Total Market Credit Balance Financing - Collateral ในงวด 2Q/67 ที่มีมูลค่ารวม 2.50 แสนล. เทียบกับงวด 1Q/67 ที่ 2.70 แสนล. โดยลดลง 2.03 พันล. (-7.51% QoQ)

ทั้งนี้หลักทรัพย์ที่เป็นหลักประกันมาร์จิ้นค่างในระบบ ที่มีปริมาณหุ้น (จำนวนหุ้นเมื่อเทียบทุนจดทะเบียนชำระแล้ว) เพิ่มขึ้นสูงสุด 30 อันดับแรกในงวด 2Q/67 นั้น พบว่าถึงหนึ่งเป็นหุ้นขนาดเล็กในกลุ่ม MAI และ มีหุ้นขนาดใหญ่ในกลุ่ม SET50/SET100 จำนวน 4 หลักทรัพย์ ได้แก่ BYD, SIRI, COM7 และ SPALI

โดยรายชื่อหุ้น 3 อันดับแรก คือ BTC, JPARK และ PRIN ที่มีปริมาณหุ้นเทียบกับสัดส่วนทุนจดทะเบียน (% of listed shares) เพิ่มขึ้นมากที่สุดบัญชีมาร์จิ้น คือ +10.9%, +8.8%, +6.8% of listed shares ตามลำดับนั้น เมื่อพิจารณาจากการเคลื่อนไหวของหลักทรัพย์ คาดว่าส่วนใหญ่ จะเข้ามาจากการวางหลักประกันเพิ่มในบัญชีมาร์จิ้นเป็นหลัก

Top 30 Margin Collateral is Volume Change Up (% of Listed shares) in 2Q/2024.

Rank	Row Labels	Sum of % chg of Listed	Sum of No. of Shares is Chg. QoQ (M.shrs.)	Sum of Margin % of Paid up	Sum of % Price Chg. QoQ	Sum of Mkt. Collateral Value (MB.) - Jun 2024	Sum of Mkt. Collateral Value (MB.) - Mar 2023	Sum of Collateral Value is Chg. QoQ (MB.)	Sum of Collateral Value is Chg. YTD (MB.)	Sector
1	BTC	▲ 10.9%	1,012.48	10.87%	▼ 13.6%	516 MB	0 MB	516 MB	516 MB	MAI
2	JPARK	▲ 8.8%	35.03	10.38%	▲ 45.7%	351 MB	38 MB	313 MB	271 MB	MAI
3	PRIN	▲ 6.8%	82.36	7.61%	▼ 2.7%	269 MB	31 MB	238 MB	241 MB	PROP
4	IP	▲ 5.3%	32.38	25.47%	▼ 17.6%	743 MB	713 MB	31 MB	(341) MB	MAI
5	ARIN	▲ 5.0%	29.82	6.20%	▼ 70.4%	31 MB	21 MB	10 MB	2 MB	MAI
6	LTS	▲ 4.9%	10.11	4.89%	▲ 0.0%	83 MB	0 MB	0 MB	83 MB	MAI
7	PRM	▲ 4.8%	119.45	11.94%	▲ 12.4%	2,566 MB	1,369 MB	1,197 MB	1,838 MB	TRANS
8	TAKUNI	▲ 4.7%	37.97	22.53%	▼ 24.5%	144 MB	151 MB	(7) MB	(130) MB	MAI
9	A5	▲ 4.5%	54.83	45.17%	▼ 4.3%	1,715 MB	1,612 MB	103 MB	230 MB	MAI
10	GSC	▲ 4.0%	10.01	11.63%	▼ 21.2%	35 MB	29 MB	6 MB	17 MB	MAI
11	JAS	▲ 3.1%	268.40	5.30%	▲ 31.3%	1,376 MB	431 MB	945 MB	965 MB	ICT
12	EURO	▲ 3.0%	9.30	4.67%	▼ 11.2%	85 MB	33 MB	52 MB	85 MB	MAI
13	BYD	▲ 3.0%	158.78	3.99%	▼ 61.1%	285 MB	172 MB	112 MB	54 MB	FIN
14	SIRI	▲ 2.9%	493.53	4.57%	▼ 2.3%	1,314 MB	501 MB	812 MB	737 MB	PROP
15	TVDH	▲ 2.8%	48.88	17.08%	▼ 14.7%	87 MB	85 MB	2 MB	5 MB	MAI
16	SSF	▲ 2.8%	7.50	2.78%	▲ 0.0%	57.76	0.01	57.75	57.75	FOOD
17	SAAM	▲ 2.3%	6.91	49.88%	▼ 10.4%	1,100 MB	1,170 MB	(71) MB	46 MB	MAI
18	MASTER	▲ 2.1%	6.42	6.49%	▼ 7.0%	1,229 MB	889 MB	340 MB	446 MB	MAI
19	XPG	▲ 2.1%	222.06	11.19%	▼ 27.3%	1,209 MB	1,355 MB	(146) MB	(161) MB	FIN
20	DITTO	▲ 2.0%	13.71	13.56%	▼ 36.6%	1,383 MB	1,865 MB	(482) MB	(791) MB	ICT
21	NEO	▲ 1.9%	5.67	1.89%	▲ 0.0%	327 MB	0 MB	0 MB	327 MB	PERSON
22	COM7	▲ 1.6%	38.12	11.96%	▼ 2.6%	5,340 MB	4,756 MB	585 MB	(731) MB	COMM
23	SPALI	▲ 1.6%	30.44	16.78%	▼ 13.9%	5,899 MB	6,213 MB	(314) MB	417 MB	PROP
24	HTECH	▲ 1.6%	4.66	7.66%	▲ 50.5%	77 MB	41 MB	36 MB	33 MB	IMM
25	PRI	▲ 1.5%	4.85	4.94%	▼ 41.4%	156 MB	184 MB	(29) MB	(114) MB	MAI
26	KLINIQ	▲ 1.4%	3.11	8.37%	▲ 12.0%	815 MB	605 MB	210 MB	100 MB	MAI
27	ASIAN	▲ 1.4%	11.25	8.34%	▲ 54.9%	699 MB	377 MB	323 MB	360 MB	FOOD
28	EASON	▲ 1.4%	7.80	2.66%	▲ 4.1%	19 MB	9 MB	10 MB	7 MB	AUTO
29	BBIK	▲ 1.3%	2.57	2.32%	▼ 47.0%	127 MB	107 MB	20 MB	(85) MB	MAI
30	SGC	▲ 1.3%	41.68	3.72%	▲ 29.1%	221 MB	113 MB	109 MB	111 MB	FIN

*เอกสารฉบับนี้ จะเสนอข้อมูลหลักทรัพย์ที่เป็นหลักประกันในบัญชีมาร์จิ้น ที่มีการเปลี่ยนแปลงในแง่ปริมาณหลักทรัพย์ เมื่อเทียบเป็นสัดส่วนหุ้นเทียบทุนจดทะเบียน (หรือ % of Listed Shares) เพื่อให้เห็นภาพของปริมาณหลักทรัพย์นั้นๆ ในส่วนที่มีการเคลื่อนไหวในบัญชีมาร์จิ้นในช่วงเวลาดังกล่าว อย่างแท้จริง

ในขณะที่หลักทรัพย์ที่เป็นหลักประกันมาร์จิ้นคงค้างในระบบรวม ที่มีการลดลงในแง่ปริมาณหุ้นเมื่อเทียบกับจุดทะเบียน สูงสุด 30 อันดับแรกในงวด 2Q/67 พบว่าในงวดนี้ มีเพียงหุ้น NEX ที่เป็นหุ้นขนาดใหญ่ในกลุ่ม SET100 นอกนั้น จะเป็นเป็นหุ้นขนาดกลาง/เล็ก ที่อยู่ในกลุ่ม Non-SET100 ทั้งหมด โดยแยกเป็นหุ้นในกลุ่ม MAI จำนวน 11 หลักทรัพย์

ทั้งนี้พบว่าหุ้นในรายชื่อ 4 อันดับแรก ได้แก่ NRF, SABUY, SBNEXT และ NEX มีปริมาณหุ้นเทียบกับทุนจดทะเบียน (% of listed shares) ลดลงจากบัญชีมาร์จิ้นคงค้างในไตรมาสก่อนมากผิดปกติ นั่น โดยลดลง -37.6%, -23.7%, -19.2% และ -16.4% of listed shares ตามลำดับนั้น เมื่อพิจารณาจากข้อมูลการเคลื่อนไหวของหลักทรัพย์รายวัน พบว่าหุ้นทั้ง 4 ตัว ราคาหุ้นมีการปรับตัวลดลงอย่างรุนแรง โดยราคาหุ้น NRF -64%, SABUY -82%, SBNEXT -55% และ NEX -82% ซึ่งผลกระทบต่อราคาหุ้นที่ปรับตัวลดลงแรง อาจทำให้ผู้ถือหุ้นบางส่วนที่ถือหุ้นผ่านบัญชีมาร์จิ้นขายหุ้นไม่ทัน และ คาดจะถูกบังคับขาย (force sell) หุ้นดังกล่าวออกมา นั่นจึงเป็นเหตุผลหลักที่ทำให้ปริมาณหุ้นดังกล่าว ลดลงจากบัญชีมาร์จิ้นคงค้างของตลาดรวม มากกว่าปกติ

Top 30 Margin Collateral is Volume Change Down (% of Listed shares) in 2Q/2024.

Rank	Row Labels	Sum of % chg of Listed	Sum of No. of Shares is Chg. QoQ (M.shrs.)	Sum of Margin % of Paid up	Sum of % Price Chg. QoQ	Sum of Mkt. Collateral Value (MB.) - Jun 2024	Sum of Mkt. Collateral Value (MB.) - Mar 2023	Sum of Collateral Value is Chg. QoQ (MB.)	Sum of Collateral Value is Chg. YTD (MB.)	Sector
1	NRF	▼ 37.6%	(533.21)	1.42%	▼ 64.6%	37 MB	2,877 MB	(2,840) MB	(2,961) MB	FOOD
2	SABUY	▼ 23.7%	(418.08)	4.74%	▼ 82.0%	66 MB	2,208 MB	(2,142) MB	(2,547) MB	COMM
3	SBNEXT	▼ 19.2%	(116.21)	7.87%	▼ 55.6%	15 MB	118 MB	(103) MB	(200) MB	HOME
4	NEX	▼ 16.4%	(332.18)	3.42%	▼ 82.2%	116 MB	3,792 MB	(3,676) MB	(3,760) MB	AUTO
5	KUN	▼ 7.5%	(56.44)	30.76%	▼ 6.9%	343 MB	459 MB	(116) MB	(173) MB	MAI
6	GLORY	▼ 6.7%	(18.02)	30.40%	▼ 17.9%	105 MB	156 MB	(51) MB	(66) MB	MAI
7	EE	▼ 3.8%	(105.81)	16.28%	▼ 44.0%	63 MB	140 MB	(76) MB	(87) MB	AGRI
8	THREL	▼ 3.6%	(22.50)	6.51%	▼ 18.8%	71 MB	137 MB	(66) MB	(238) MB	INSUR
9	TMI	▼ 3.3%	(22.23)	4.70%	▲ 24.8%	45 MB	61 MB	(16) MB	(20) MB	MAI
10	AKP	▼ 3.3%	(13.14)	4.25%	▼ 32.1%	12 MB	32 MB	(20) MB	(25) MB	MAI
11	PPPM	▼ 3.2%	(20.78)	0.17%	▼ 67.6%	0 MB	16 MB	(15) MB	(1) MB	AGRI
12	GENCO	▼ 3.0%	(33.96)	0.92%	▼ 7.8%	5 MB	23 MB	(18) MB	(16) MB	PROF
13	TAPAC	▼ 2.8%	(11.36)	11.28%	▼ 65.3%	24 MB	87 MB	(63) MB	(138) MB	MAI
14	YGG	▼ 2.2%	(12.98)	46.22%	▼ 44.2%	1,119 MB	2,097 MB	(978) MB	(1,181) MB	MAI
15	BM	▼ 2.2%	(13.06)	27.36%	▼ 5.6%	444.34	507.96	(64) MB	(98) MB	MAI
16	BEC	▼ 2.0%	(40.38)	13.62%	▼ 20.1%	1,062 MB	1,526 MB	(464) MB	(262) MB	MEDIA
17	ADVICE	▼ 2.0%	(12.20)	4.77%	▼ 3.2%	124 MB	181 MB	(57) MB	124 MB	COMM
18	TTA	▼ 1.9%	(35.25)	3.87%	▲ 10.8%	507 MB	687 MB	(180) MB	(145) MB	TRANS
19	BWG	▼ 1.9%	(100.24)	7.54%	▼ 33.3%	147 MB	274 MB	(127) MB	(146) MB	PROF
20	PACO	▼ 1.8%	(18.14)	12.85%	▼ 12.7%	203 MB	265 MB	(62) MB	(43) MB	MAI
21	THCOM	▼ 1.8%	(19.82)	5.11%	▼ 23.6%	599 MB	1,062 MB	(462) MB	(206) MB	ICT
22	INSET	▼ 1.6%	(13.34)	3.83%	▲ 10.6%	78 MB	101 MB	(23) MB	11 MB	ICT
23	SCI	▼ 1.6%	(12.26)	1.75%	▼ 1.3%	10 MB	20 MB	(10) MB	(7) MB	IMM
24	SA	▼ 1.6%	(19.58)	39.65%	▲ 11.3%	3,756 MB	3,514 MB	241 MB	241 MB	PROP
25	SGF	▼ 1.6%	(20.48)	0.29%	▼ 25.6%	1 MB	9 MB	(8) MB	(10) MB	MAI
26	TACC	▼ 1.5%	(9.39)	5.18%	▼ 0.8%	153 MB	200 MB	(47) MB	(26) MB	MAI
27	SVR	▼ 1.4%	(7.19)	0.39%	▼ 12.6%	3 MB	14 MB	(11) MB	(13) MB	MAI
28	SNC	▼ 1.3%	(4.79)	2.28%	▼ 6.3%	55 MB	93 MB	(38) MB	(59) MB	IMM
29	SSP	▼ 1.3%	(17.55)	19.67%	▼ 16.9%	1,797 MB	2,302 MB	(505) MB	(471) MB	ENERG
30	PJW	▼ 1.3%	(7.79)	21.86%	▼ 10.5%	369 MB	436 MB	(67) MB	(166) MB	PKG

คำชี้แจงที่สำคัญ (Disclaimer)

SOURCE: SETSMART, TSFC

ข้อมูลที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้ จัดทำขึ้นบนพื้นฐานของแหล่งข้อมูลที่มีอยู่ ณ วันที่จัดทำรายงานหลักทรัพย์ เพื่อธุรกิจหลักทรัพย์ จำกัด (มหาชน) (“บริษัท”) มิได้ยืนยันหรือรับรองถึงความถูกต้อง หรือ ความสมบูรณ์ของข้อมูลดังกล่าวแต่อย่างใด ความคิดเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานนี้เป็นเพียงการนำเสนอในมุมมองของบริษัท และเป็นการคิดเห็น ณ วันที่ปรากฏในรายงานเท่านั้น ซึ่งอาจเปลี่ยนแปลงได้ภายหลังวันดังกล่าว โดยบริษัทไม่จำเป็นต้องแจ้งให้ทราบล่วงหน้ารายฉบับนี้ จัดทำขึ้นเพื่อเผยแพร่ข้อมูลเท่านั้น บริษัทไม่รับผิดชอบต่อการนำข้อมูล หรือความคิดเห็นใดๆ ไปใช้ในทุกรณี ดังนั้น ผู้ที่นำข้อมูลไปใช้ จึงควรใช้ดุลพินิจในการพิจารณาตัดสินใจก่อนนำไปใช้หรือบริการของสงวนสิทธิ์ ในข้อมูล และความคิดเห็นที่ปรากฏอยู่ในรายงานฉบับนี้ ห้ามมิให้ผู้ใด นำข้อมูล และความคิดเห็นในเอกสารฉบับนี้ไป ทำซ้ำ สดุดี เผยแพร่ ขาย จำหน่าย คัดลอก นำออกแสดง หรือนำไปแสวงหาประโยชน์ในเชิงพาณิชย์ ไม่ว่าด้วยวิธีการใดๆ โดยมิได้รับอนุญาตเป็นลายลักษณ์อักษรจากบริษัทเป็นการล่วงหน้า