

DAOL Weekly Strategy

15-18 Oct 2024

ฝ่ายวิเคราะห์กลยุทธ์การลงทุนหลักทรัพย์

เบอร์โทรศัพท์ : 02-351-1801

โดย : มงคล พ่วงเกตุรา (ต่อ 5450), พรรณนภา เหมะสุรัตน์ (ต่อ 5451)

“ อิสราเอลไม่จับหนักอิหร่าน และ กนง.จะลดดอกเบี้ยหรือไม่ ”

ประเด็นวิเคราะห์วันนี้

- จับตาดูอิสราเอล-อิหร่านมาแน่ !!!
- จีนเตรียมกระตุ้นเศรษฐกิจช่วยอสังหาฯ แต่หุ้นจีนไปต่อได้มั๊ย ?
- กลุ่มธนาคารสงบบ เริ่มด้วย TISCO วันนี้ หุ้นจะตกอีกมั๊ย ?
- เข้าสู่ฤดูกาลสงบบ เราประเมินภาพไตรมาสยังงัย?
- จับตาประชุม กนง. มีโอกาสลดดอกเบี้ยไหม?
- 3 ตัวแปรหลักที่กำหนดทิศทาง SET สัปดาห์นี้ วางกลยุทธ์ยังงัย?

ดัชนีตลาดหุ้นและราคาสินทรัพย์ทางการเงิน

Region/Country	Index	Week			1-Day	1 Mth	QTD	12M	Last
		Last	Net Chg.	WTD % Chg.	% chg	% chg	% chg	% chg	update
World	The Global Dow	5,022.4	14.6	0.3	0.5	2.8	-0.3	27.3	11-Oct-24
	DJ Global	641.5	3.6	0.6	0.6	3.1	-0.0	28.9	11-Oct-24
	Bloomberg World Index	1,984.3	12.7	0.6	0.6	3.4	0.1	29.3	11-Oct-24
	MSCI World	3,731.9	33.5	0.9	0.6	2.7	0.2	30.4	11-Oct-24
	MSCI Emergin Market	1,159.6	(19.8)	-1.7	0.2	7.1	-1.0	21.9	11-Oct-24
	MSCI Thailand	497.2	7.1	1.4	-0.2	2.9	1.7	3.1	11-Oct-24
Americas	Dow Jones	42,863.9	511.1	1.2	1.0	3.6	1.3	27.3	11-Oct-24
	NASDAQ	18,342.9	205.1	1.1	0.3	3.7	0.8	36.8	11-Oct-24
	S&P 500	5,815.0	64.0	1.1	0.6	3.4	0.9	34.4	11-Oct-24
Europe	Stoxx Europe 600	522.0	3.4	0.7	0.6	1.2	-0.2	16.2	11-Oct-24
Euro Zone	Euro Stoxx 50	5,003.9	49.0	1.0	0.7	3.3	0.1	21.0	11-Oct-24
France	CAC 40	7,577.9	36.5	0.5	0.5	1.5	-0.8	8.2	11-Oct-24
German	DAX	19,373.8	252.9	1.3	0.8	3.6	0.3	27.6	11-Oct-24
UK	FTSE 100	8,253.7	(27.0)	-0.3	0.2	-0.2	0.2	8.6	11-Oct-24
Asia-Pacific	MSCI AC Asia Pacific Index	192.5	(2.2)	-1.1	-0.0	5.2	-1.3	22.6	11-Oct-24
Thailand	SET Index	1,470.1	25.8	1.8	0.1	3.2	1.5	1.3	11-Oct-24
China	Shanghai SE Composit	3,217.7	130.2	4.2	-2.5	19.0	-3.6	4.2	11-Oct-24
China	Shenzhen CSI 300	3,887.2	183.5	5.0	-2.8	23.0	-3.3	6.1	11-Oct-24
Hong Kong	Hang Seng	21,252.0	(1484.9)	-6.5	3.0	24.2	0.6	18.8	10-Oct-24
Philippines	Philippines Stock Exchange	7,310.3	(157.6)	-2.1	-1.4	4.1	0.5	16.7	11-Oct-24
Indonesia	Jakarta SE Composite	7,520.6	24.5	0.3	0.5	-3.7	-0.1	8.6	11-Oct-24
Japan	Nikkei	39,605.8	970.2	2.5	0.6	11.2	4.4	24.0	11-Oct-24
Singapore	Straits Times	3,573.8	(15.4)	-0.4	-0.3	0.3	-0.3	12.2	11-Oct-24
South Korea	Korea Stock Exchange	2,596.9	27.2	1.1	-0.1	0.8	0.1	5.7	11-Oct-24
Vietnam	Ho Chi Minh Stock Exchange	1,288.4	17.8	1.4	0.2	2.8	0.0	12.0	11-Oct-24
India	BSE Sensex	81,381.4	(307.1)	-0.4	-0.3	-1.8	-3.5	22.8	11-Oct-24
Taiwan	Taiwan Weighted	22,901.6	598.9	2.7	1.1	5.2	3.0	36.5	11-Oct-24
Currency	USD Index Spot Rate	102.9	0.4	0.4	-0.1	1.2	2.1	-2.8	11-Oct-24
	USD-EUR	1.1	(0.0)	-0.3	0.0	-0.7	-1.8	3.0	11-Oct-24
	USD-GBP	1.3	(0.0)	-0.4	0.1	0.2	-2.3	6.1	11-Oct-24
	YEN-USD	149.1	0.4	0.3	-0.4	-4.5	3.8	0.0	11-Oct-24
	CNY-USD	7.1	0.1	0.8	0.1	0.7	0.7	3.3	11-Oct-24
	THB-USD	33.2	(0.2)	-0.5	0.9	1.6	2.2	9.9	11-Oct-24

Region/Country	Index	Week			1-Day	1 Mth	QTD	12M	Last
		Last	Net Chg.	WTD % Chg.	% chg	% chg	% chg	% chg	update
Bonds Yield (%)	US: 2-Year Bond	4.0	0.0	0.9	-0.05	8.6	8.6	-20.6	11-Oct-24
(Government)	US: 5-Year Bond	3.9	0.1	2.6	0.43	9.6	9.6	-14.7	11-Oct-24
	US: 10-Year Bond	4.1	0.1	3.4	0.97	8.4	8.4	-10.0	11-Oct-24
	US: 30-Year Bond	4.4	0.2	3.8	1.19	7.1	7.1	-6.0	11-Oct-24
	THAILAND: 2-Year Bond	2.2	0.0	1.3	-0.52				11-Oct-24
	THAILAND: 5-Year Bond	2.3	0.0	1.6	-0.46				11-Oct-24
	THAILAND: 10-Year Bond	2.5	0.0	0.7	-0.22				11-Oct-24
	THAILAND: 30-Year Bond	3.2	0.0	0.4	-0.37				11-Oct-24
Other	Bloomberg Commodity Index	100.8	(1.3)	-1.2	0.3	4.8	0.5	-4.3	11-Oct-24
	Crude Oil - WTI (spot month)	75.6	1.2	1.6	-0.4	12.3	10.8	-9.5	11-Oct-24
	Crude Oil - Brent	79.0	1.0	1.3	-0.5	11.9	10.1	-7.9	11-Oct-24
	Coal Newcatle (USD/Ton)	153.2	0.6	0.4	-0.4	8.8	3.0	-0.5	11-Oct-24
	Baltic Dry Index	1,809.0	(132.0)	-6.8	1.1	-4.3	-13.2	-7.0	11-Oct-24
	Rubber (TOCOM) Yen/Kg.	414.8	(11.4)	-2.7	-1.1	14.5	-0.8	69.2	11-Oct-24
	Sugar Futures (USD / lb.)	22.2	(0.8)	-3.3	0.4	16.6	-1.0	-6.5	11-Oct-24
	Copper (LME) USD/Ton	9,650.5	(145.9)	-1.5	0.7	7.6	-0.4	21.4	11-Oct-24
	China Hot Rolled Steel	3,617.0	303.0	9.1	-0.3	17.7	-1.6	-4.9	11-Oct-24
	GOLD (spot)	2,656.6	3.0	0.1	1.0	5.8	0.8	41.7	11-Oct-24
	Soybean Meal Futures	316.5	(14.0)	-4.2	-0.3	1.0	-8.1	-15.4	11-Oct-24
	Crude Palm Oil	4,283.0	(117.0)	-2.7	-1.5	8.0	3.9	21.3	11-Oct-24
	Corn	415.8	(9.0)	-2.1	-0.7	9.3	-2.1	-14.8	11-Oct-24
	Bitcoin	63,002.2	581.9	0.9	-0.7	7.5	-1.2	134.1	11-Oct-24
	Ethereum	2,456.9	28.0	1.2	-0.5	4.0	-6.0	59.2	11-Oct-24
	ARKW Investments	86.1	1.8	2.1	0.9	7.5	1.2	59.7	11-Oct-24
	Global x Auto & Electric ETF	23.4	0.1	0.6	0.6	8.0	-0.2	0.8	11-Oct-24

SET Impact Gain	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
GULF	1.8800	64.75↓	2.00	3.19	531581	3459989
PTT	1.7250	34.25	0.75	2.24	1189917	4074320
ADVANC	1.4400	278.00↑	6.00	2.21	43945	1207900
DELTA	1.0000	117.00	1.00	0.86	220258	2587289
KTB	0.5650	21.60	0.50	2.37	1345391	2880400
CPN	0.3600	67.75	1.00	1.50	99644	676060
PTTEP	0.3200	135.00↓	1.00	0.75	77459	1045372
BAY	0.2950	26.75↓	0.50	1.90	11849	31715
KBANK	0.2850	154.00	1.50	0.98	164229	2526266
BBL	0.2250	156.00	1.50	0.97	138407	2160031
KKP	0.2100	52.00	3.00	6.12	113951	587554
BH	0.1800	271.00↓	3.00	1.12	28485	771570
TTB	0.1568	1.89↓	0.02	1.07	2538317	479522
INTUCH	0.1300	103.50↓	0.50	0.49	141805	1477060
CRC	0.1225	33.75	0.25	0.75	43017	144975
RAM	0.1100	23.60	1.10	4.89	29349	69142
SCCC	0.1000	167.00↑	5.00	3.09	2827	46766
THG	0.0980	22.80↑	1.40	6.54	132458	309476
TLI	0.0920	11.20↓	0.10	0.90	281148	317515
BLA	0.0840	24.60↓	0.60	2.50	46125	114631
EGCO	0.0800	124.00↓	2.00	1.64	11501	142208
MCOT	0.0684	6.10↓	1.14	22.98	229627	137907
PLANB	0.0700	8.30	0.20	2.47	443842	369386
CCET	0.0672	4.62	0.08	1.76	1625600	748082
SCAP	0.0636	2.12	0.12	6.00	155991	34433
BTS	0.0636	4.58	0.06	1.33	1338264	613389
BEM	0.0615	8.20	0.05	0.61	352335	287772
TCAP	0.0600	52.25	0.75	1.46	24132	125213
AWC	0.0516	3.74↓	0.02	0.54	660269	249069
SKY	0.0480	23.70↓	0.80	3.49	18469	43412

mai Impact Gain	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
MASTER	0.3750	47.75↓	1.25	2.69	33535	159752
MEB	0.2250	31.00↑	0.75	2.48	2801	8588
AU	0.0810	10.10	0.10	1.00	39780	40260
SFT	0.0792	3.68↑	0.18	5.14	2601	937
SEI	0.0765	5.65↓	0.45	8.65	146898	81841
MORE	0.0716	0.07↑	0.01	16.67	6830	41
BEB	0.0520	20.00↓	0.20	1.01	8340	16778
MAGURO	0.0520	17.30	0.40	2.37	32018	55594
I2	0.0336	2.08↑	0.08	4.00	38791	7985
CHO	0.0305	0.06	0.01	20.00	389118	1952
SALEE	0.0304	0.52	0.02	4.00	4935	252
WINNER	0.0240	2.10	0.04	1.94	331	68
MVP	0.0238	0.90↑	0.07	8.43	192037	18224
JPARK	0.0200	7.30	0.05	0.69	36784	26830
TBN	0.0200	6.65	0.20	3.10	95	62
COLOR	0.0177	1.24	0.03	2.48	2311	286
TVDH	0.0175	0.20↑	0.01	5.26	10743	213
ASN	0.0171	1.61	0.09	5.92	1140	183
JUBILE	0.0170	13.80↑	0.10	0.73	133	182
GLOXY	0.0162	1.47	0.06	4.26	209	30
ZIGA	0.0148	2.02	0.02	1.00	14524	2925
KCM	0.0136	0.37	0.02	5.71	2670	96
SR	0.0136	0.68	0.02	3.03	353	23
TMI	0.0134	1.39	0.02	1.46	1048763	145963
UMS	0.0129	0.64	0.01	1.59	797	48
CHEWA	0.0127	0.48	0.01	2.13	1393	66
ARROW	0.0130	5.70	0.05	0.88	57	32
BM	0.0122	3.12	0.02	0.65	7321	2276
LDC	0.0120	0.63	0.02	3.28	19946	1277
VL	0.0118	1.00	0.01	1.01	14918	1490

SET Impact Loss	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
SCC	-1.5000	225.00↓	-15.00	-6.25	88351	2037421
BDMS	-1.2800	28.75↓	-1.00	-3.36	773189	2257555
TRUE	-0.8340	11.20	-0.30	-2.61	659779	742480
PTTGC	-0.7200	26.75	-2.00	-6.96	549729	1521911
AOT	-0.5750	63.75	-0.50	-0.78	90225	576673
CPALL	-0.5400	65.25	-0.75	-1.14	285203	1870248
IVL	-0.2700	23.70↓	-0.60	-2.47	657997	1597005
BJC	-0.2240	24.80	-0.70	-2.75	104970	262156
SCGP	-0.1750	27.25↓	-0.50	-1.80	163411	446519
CPF	-0.1700	25.00↓	-0.25	-0.99	365442	923104
CBG	-0.1400	78.25↓	-1.75	-2.19	59740	473794
MINT	-0.1150	28.75↓	-0.25	-0.86	57607	166688
HMPRO	-0.1060	10.50	-0.10	-0.94	205897	218809
OR	-0.0970	16.60	-0.10	-0.60	70886	118291
ITC	-0.0960	23.80↓	-0.40	-1.65	96104	233458
CREDIT	-0.0900	19.10↓	-0.90	-4.50	3772	7288
GLOBAL	-0.0840	16.30	-0.20	-1.21	89060	144667
VGI	-0.0720	2.82↓	-0.08	-2.76	754951	215834
OSP	-0.0720	22.30↑	-0.30	-1.33	142730	319893
TFG	-0.0658	4.24↓	-0.14	-3.20	46164	19816
SAWAD	-0.0600	42.00↓	-0.50	-1.18	92173	396014
WHA	-0.0600	5.60	-0.05	-0.88	385913	216923
BTG	-0.0640	22.20↓	-0.40	-1.77	66635	148848
HANA	-0.0525	41.00	-0.75	-1.80	124685	516163
KTC	-0.0525	48.25↓	-0.25	-0.52	30689	148987
SPRC	-0.0525	7.00↓	-0.15	-2.10	388776	276111
DOHOME	-0.0520	10.30	-0.20	-1.90	44817	46616
CKP	-0.0520	3.90↓	-0.08	-2.01	136997	54018
TOA	-0.0480	18.80↑	-0.30	-1.57	17742	33477
COM7	-0.0475	26.00	-0.25	-0.95	133684	350589

mai Impact Loss	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
NEWS	-1.8331	0.01↓	-0.01	-50.00	181778	259
PSG	-0.6487	0.55	-0.01	-1.79	50881	2833
AIRA	-0.4410	1.41	-0.07	-4.73	12	2
GTV	-0.2622	0.11↓	-0.02	-15.38	265672	2956
BTC	-0.2156	0.50↓	-0.02	-3.85	53240	2709
BBIK	-0.1000	39.00↓	-0.50	-1.27	6328	24950
LTS	-0.0840	12.30↓	-0.40	-3.15	16176	20342
24CS	-0.0602	3.96↓	-0.14	-3.41	168493	65864
KGEN	-0.0495	1.81↓	-0.03	-1.63	80048	14702
SICT	-0.0480	5.50↓	-0.10	-1.79	11804	6623
NAT	-0.0495	5.25	-0.15	-2.78	15829	8383
TQR	-0.0460	6.65	-0.20	-2.92	272	184
TNH	-0.0450	36.25↓	-0.25	-0.68	41	149
SENX	-0.0419	0.43↓	-0.01	-2.27	6536	282
BOL	-0.0410	5.95↓	-0.05	-0.83	9182	5479
NETBAY	-0.0400	17.30↓	-0.20	-1.14	3139	5479
EFORL	-0.0399	0.13↓	-0.01	-7.14	29055	374
STOWER	-0.0369	0.08	-0.01	-11.11	12892	104
APO	-0.0340	2.30↓	-0.10	-4.17	28602	6767
PRI	-0.0320	10.80↓	-0.10	-0.92	9515	10453
TITLE	-0.0312	3.96	-0.04	-1.00	180	71
SECURE	-0.0300	13.00	-0.30	-2.26	656	859
EURO	-0.0300	5.45	-0.10	-1.80	364	197
AUCT	-0.0275	9.20↓	-0.05	-0.54	2618	2428
MTW	-0.0268	1.32↓	-0.04	-2.94	4639	626
HEALTH	-0.0266	0.96↓	-0.07	-6.80	1074	114
LEO	-0.0256	3.96↓	-0.08	-1.98	2166	861
CMO	-0.0258	0.86↑	-0.06	-6.52	7093	621
SELIC	-0.0244	3.20	-0.04	-1.23	2119	679
READY	-0.0240	6.40↓	-0.20	-3.03	977	639



SET	1470.10	+1.58	+0.11%	Vol	Proj.	0.001468.52-100.00%	17:03
GAP:	B.Vol	Bid	Ask	O.Vol	Avg.	69.43	%Buy 51.80
					Open	1471.93	Volume 8666425
					High	1482.02	%B-S 3.60
					Low	1470.10	Vol5D 12514829
					Prev	1468.52	Mktcap 18237011
					%Swing	0.81	BVPS N/A
					EPS	N/A	P/BV 1.39
					%O_Vol	1.580	DPS N/A
					Impact	1.580	P/E 18.32
SET	1470.10	+1.58	+0.11%	60173.24MB	Gain 187	Lose 263	Unch 215
					P/E		18.32

Date	Country	Event	Period	Surv(M)	Prior
14-Oct	CH	Exports YoY	Sep	6.2%	8.7%
15-Oct	CH	1-Yr Medium-Term Lending Facility Rate	Oct-25	2.0%	2.0%
16-Oct	TH	BoT Benchmark Interest Rate	Oct-16	0.0	0.0
17-Oct	JN	Exports YoY	Sep	-0.6%	5.6%
	EC	CPI YoY	Sep F	1.8%	2.2%
	EC	ECB Policy Rate Meeting	Oct-17		
	US	Retail Sales Advance MoM	Sep	0.3%	0.1%
	US	Initial Jobless Claims	Oct-12	--	258k
	US	Manufacturing (SIC) Production	Sep	-0.2%	0.9%
18-Oct	CH	GDP YoY	3Q	4.6%	4.7%
	CH	Industrial Production YoY	Sep	0.05	0.05
	CH	Retail Sales YoY	Sep	2.5%	2.1%
	US	Housing Starts MoM	Sep	0.0%	9.6%
21-Oct	CH	1-Year Loan Prime Rate	Oct-21	3.2%	3.4%
23-Oct	US	Existing Home Sales MoM	Sep	-0.7%	-2.5%
24-Oct	US	Initial Jobless Claims	Oct-19	--	--
	US	New Home Sales MoM	Sep	--	-4.7%
	TH	Customs Exports YoY	Sep	--	7.0%
25-Oct	US	U. of Mich. Sentiment	Oct F	--	--

คาดดัชนีฯ มีโอกาสเดินทางต่อ ธนาการเริ่มส่งบ แต่ละวันผันผวนจากอิสราเอล-อิหร่าน และประชุม กนง.

15 Oct 24

- ตลาดหุ้นไทย ยังมีแรงไปต่อ แต่จะมีความผันผวนมากขึ้น จาก 3 ตัวแปร คือ ตะวันออกกลาง ประชุม กนง. และ หุ้นธนาการทยอยนำส่งงบการเงิน ประเมินกรอบดัชนีฯ สัปดาห์นี้ไว้ที่ 1465-1490 จุด (บนสมมติฐาน อิสราเอล-อิหร่าน มีความรุนแรงน้อย)
- จีน ประกาศแผนกระตุ้นเศรษฐกิจ(12 ต.ค.) หนุ่ภาคอสังหาริมทรัพย์ ส่งสัญญาณการใช้จ่ายเพิ่มมากขึ้น และมี แผนออกพันธบัตร 2.3 ล้านล้านหยวน เพื่อใช้ตามแผนนี้ โดยรวมของมาตรการเศรษฐกิจที่ออกมา น่าจะไปเน้นที่การก่อกำหน้ เพื่อมาช่วยภาคอสังหาฯ (ผู้ประกอบการ + คนซื้อ) ซึ่งก็ไปตามที่ตลาดคาดไว้ ทั้งในเรื่อง จำนวนการก่อกำหน้ ยังขาดมาตรการที่ช่วยเรื่องของภาคอุตสาหกรรมและการกระตุ้นการใช้จ่ายของผู้บริโภค ดูๆแล้ว ครั้งนี้ ดีกว่าที่ NDRC แกลงไปเมื่อต้นสัปดาห์ แล้วทำให้ดัชนีตลาดหุ้นจีนและฮ่องกงปรับตัวลง
- มีความเป็นไปได้สูงที่อิสราเอล จะมีการโจมตีอิหร่าน ล่าสุด สหรัฐฯ ส่งระบบต่อต้านขีปนาวุธ THAAD ให้ อิสราเอล และ ผู้นำอิสราเอลประกาศจะไม่โจมตีโครงการนิวเคลียร์และแหล่งผลิตหรือโรงกลั่นน้ำมัน ตามที่เคยประเมินไว้ ถ้าการโจมตีอิหร่าน มีนัยยะ(บานปลาย) ตลาดหุ้นจะลบ แต่ถ้าไม่มีนัยยะ (ไม่แรงและจบเร็ว) ตลาด จะมองข้าม และจะเป็นบวก



คาดดัชนีฯ มีโอกาสเดินทางขึ้นต่อ ธนาคารเริ่มส่งมอบ แต่ละวันผันผวนจากอิสราเอล-อิหร่าน และประชุม กนง.

15 Oct 24

- ตัวเลขเศรษฐกิจต่างประเทศที่สำคัญของสัปดาห์นี้ คือ ตัวเลข GDP 3Q ของจีนที่คาดว่าจะขยายตัว 4.6% จากไตรมาสก่อนที่ 4.7% ตัวเลขนี้ จะมีผลน้อยลง ถ้าการออกมาตรการเศรษฐกิจช่วงวันหยุดที่ผ่านมาของจีน นักลงทุนมองเป็นบวก
- เงินบาทไทยพุ่งสูงสุดในรอบเกือบเดือน ล่าสุด 33.2 บาท/ดอลลาร์ ส่งผลให้สกุลเงินเอเชียยกขึ้นสูงขึ้นหลัง การลดลงในอัตราผลตอบแทนพันธบัตรสหรัฐฯ และราคากองคำที่เพิ่มสูงขึ้น
- กนง. จะประชุมเพื่อพิจารณาดอกเบี้ยกลางสัปดาห์(16 ต.ค.) ตลาดประเมินไว้ทั้งคงและลดดอกเบี้ย 0.25% เราประเมินว่า ถ้า กนง.จะลดดอกเบี้ย ก็คงด้วยเหตุผลเดียวคือค่าของจากรัฐบาล อย่างไรก็ตาม ถ้ามีการคงดอกเบี้ยไว้ จะพลิกมาเป็นบวกต่อหุ้นกลุ่มธนาคาร ที่อาจถูกขายก่อนรู้ผลประชุม top pick ของเรา SCB, TTB
- เข้าสู่ฤดูกาลของการนำส่งงบการเงิน งวดไตรมาสที่ 3 นำโดย หุ้นธนาคาร โดย 7 ธนาคาร ที่เรากำกับวิเคราะห์ คาดมีกำไร 5.19 หมื่นลบ. +3% yoy; -2.9% qoq (Bloomberg's Survey 8 ธนาคาร กำไร 6.0 หมื่นลบ. +3% yoy; -3%qoq) ส่วนกำไรตลาด คาดไว้ที่ 2.56 แสนลบ. -10% yoy ; -1% qoq ผลการดำเนินงานหุ้นส่วนใหญ่ ลดลงเมื่อเทียบกับไตรมาสก่อน(2q) หุ้น commodity ถูกกระทบจากเศรษฐกิจ และผลขาดทุน stock(น้ำมัน)



คาดดัชนีฯ มีโอกาสเดินทางต่อ ธนาकारเริ่มสงบ แต่ในวันผันผวนจากอิสราเอล-อิหร่าน และประชุม กนง.

15 Oct 24

- อนุญาตให้การพนัน 23 ชนิด เล่นได้ในระยะเวลาที่กำหนด บังคับใช้ 11 ต.ค.ที่ผ่านมา แม้การพนันส่วนใหญ่เป็นประเภทการพนันพื้นบ้าน เรายังคงมองว่าเป็นการกระตุ้นการท่องเที่ยว ในรูปแบบหนึ่ง
- บอร์ด Financial Hub เคาะกรอบกฎหมายศูนย์กลางการเงิน มุ่ง 6 ธุรกิจเป้าหมาย อาทิ กลุ่มธนาकार ธุรกิจระบบการชำระเงิน ธุรกิจหลักทรัพย์ ธุรกิจสัญญาซื้อขายล่วงหน้า ธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัล ธุรกิจประกันภัย และธุรกิจอื่นตามกำหนด เพื่อส่งเสริมและให้สิทธิประโยชน์ เช่น ผ่อนปรนภาษี เพื่อดึงดูดการลงทุน
- Event สำคัญวันนี้ : ตัวเลขส่งออกจีน(14) ประชุม กนง.(16) ประชุมธนาकारกลางยุโรป(17) ตัวเลข GDP ของจีน(18)



การนำเข้าสินค้าจากจีน

สินค้า	มูลค่า : ล้านบาทสำหรับรัฐ			%chg	สัดส่วนนำเข้า จีนจากทั้งหมด
	2564-จีน	2567-จีน (ม.ค.-ส.ค.)	2567-โลก (ม.ค.-ส.ค.)		
รถยนต์โดยสารและรถบรรทุก	97.08	1,097.85	1,455.59	33.8%	75%
เครื่องจักรไฟฟ้าและส่วนประกอบ	8,264.24	6,891.30	13,849.86	3.3%	50%
เรือและสิ่งก่อสร้างลอยน้ำ	265.81	552.31	1,741.21	2.2%	32%
เครื่องจักรกลและส่วนประกอบ	6,401.06	5,149.49	14,135.04	2.0%	36%
เครื่องบิน เครื่องร่อน อุปกรณ์การบินและส่วนประกอบ	4.79	57.40	2,002.27	1.9%	3%
ผลิตภัณฑ์โลหะ	1,990.85	1,780.39	3,091.77	1.2%	58%
แผงวงจรไฟฟ้า	1,763.32	1,599.88	16,586.42	1.1%	10%
วงจรมพิมพ์	1,054.64	1,077.49	1,808.71	1.1%	60%
สินแร่โลหะอื่น ๆ เศษโลหะและผลิตภัณฑ์	2,744.76	2,265.75	8,602.35	1.0%	26%
เคมีภัณฑ์	5,626.34	4,127.94	12,227.05	0.8%	34%
ผลิตภัณฑ์ทำจากพลาสติก	2,056.13	1,641.18	3,404.46	0.6%	48%
เครื่องมือเครื่องใช้เกี่ยวกับวิทยาศาสตร์ การแพทย์	983.52	840.42	3,648.32	0.4%	23%
พืชและผลิตภัณฑ์จากพืช	486.23	480.83	6,292.08	0.4%	8%
เสื้อผ้าสำเร็จรูป	490.30	476.29	982.80	0.4%	48%
เครื่องใช้เบ็ดเตล็ด	1,037.69	861.44	1,689.69	0.4%	51%
ผัก ผลไม้และของปรุงแต่งที่ทำจากผัก ผลไม้	1,069.97	870.28	2,228.29	0.4%	39%
สนับ ผงซักฟอกและเครื่องสำอาง	134.97	174.13	970.16	0.3%	18%
เนื้อสัตว์สำหรับการบริโภค	153.82	189.94	875.17	0.3%	22%
กระดาษ และผลิตภัณฑ์กระดาษ	362.19	348.07	1,093.19	0.3%	32%
กล้อง เลนส์และอุปกรณ์การถ่ายรูป ถ่ายภาพยนตร์	120.85	158.29	281.62	0.3%	56%
เครื่องใช้และเครื่องตกแต่งภายในบ้านเรือน	1,136.35	876.97	1,053.87	0.3%	83%
สินค้าทุนอื่น ๆ	575.65	485.23	1,108.80	0.2%	44%
เครื่องเพชรพลอย อัญมณี เงินแท่งและทองคำ	378.44	345.10	11,937.93	0.2%	3%

สินค้านำเข้าจีนส่งผล
กระทบต่ออุตสาหกรรม
ไทยมากขึ้น สังเกตได้ว่า
สัดส่วนที่ไทยนำเข้าสินค้า
จีนเพิ่มขึ้นทุกปี โดยช่วง
หลังอุตสาหกรรมขนาดเล็ก/
SMEs เริ่มได้รับผลกระทบ
หนัก อาทิ กลุ่มวงจรมพิมพ์
เบ็ดเตล็ด เสื้อผ้าสำเร็จรูป
ผัดผลไม้

BOJ's Deputy Chief Says Will Raise Rate If Outlook Realized

(Bloomberg) -- The Bank of Japan will continue to raise its benchmark rate, unwinding easy policy settings, if the economy performs in line with projections, Deputy Governor Ryozo Himino said, signaling no change to the bank's stance after the nation installed a new government.

If the outlook for the economy and inflation is realized, "the bank will accordingly continue to raise the policy interest rate," Himino said in a speech Thursday at a Bloomberg conference in Tokyo. "The policy board will carefully assess incoming data, the evolving outlook, and the balance of risks at each meeting. We are not on a preset course."

[] Yen in 150s Would Bring Forward Next BOJ Rate Hike, Momma Says

[] BOJ's Deputy Chief Says Will Raise Rate If Outlook Realized



UPDATE : สถานการณ์ตะวันออกกลางรายวัน DAOL SEC

Tensions Ramp Up in the Middle East

Retaliatory strikes between Israel and Iran and its allies have increased since a July 19 drone attack by Houthis in Tel Aviv.

■ Israel ■ Iran and allies



Source: Bloomberg reporting

Bloomberg

Israel claims it killed Hezbollah leader. Here's what you need to know

From CNN staff



Smoke rises from Israeli airstrikes in Beirut's southern suburbs, on Saturday, September 28. Hassan Ammar/AP

<https://edition.cnn.com/world/live-news/israel-lebanon-war-hezbollah-09-28-24/index.html>

[] Israel's Security Cabinet Meets on Iran as Biden Urges Caution

[] Call between U.S., Israeli defense chiefs expected in near future: Pentagon

[] Iran warns of potential change in nuclear doctrine if Israel strikes facilities



Israel's Security Cabinet Meets on Iran as Biden Urges Caution

White House trying to temper Israel's retaliation against Iran
Israel defense minister says its response will be 'surprising'

By Henry Meyer and Dan Williams

(Bloomberg) -- Israel's security cabinet met Thursday night to discuss how to retaliate against Iran for its missile attack last week, as US efforts to influence the decision remained in question.

A final decision on the timing of the strike was to be made by Prime Minister Benjamin Netanyahu and his defense minister, Yoav Gallant, public broadcaster Kan said.

On Wednesday, Joe Biden's first call with Netanyahu since August threw into focus the American president's limited ability to have a say in the nature of what could be an imminent strike against Iran.

Biden has warned Israel against attacking Iran's nuclear sites, which Tehran would view as especially provocative. US officials also worry that hits on Iranian oil infrastructure would push up energy prices and hurt the global economy.



Benjamin Netanyahu and his aides speak to Joe Biden on Oct. 9, 2024.



Benjamin Netanyahu



Smoke rises from the site of an Israeli air strike in Kham, Southern Lebanon, on Oct. 9.

Looming Israeli Strike on Iran Offers Fresh Test of US Sway

(Bloomberg) -- President Joe Biden has warned Israel against attacking Iran's nuclear sites, and US officials worry a strike on its energy infrastructure could roil energy markets. But with Israeli retaliation against Iran expected at any time, the US is finding it has few assurances against further escalation.

Biden's team is pressing Israel to limit its retaliation against Iran for a strike last week to military targets such as air bases and missile sites. Rather than Israel knocking out economic targets, the US is proposing alternatives such as a fresh round of economic sanctions, according to people familiar with the matter who asked not to be identified discussing private deliberations.

The US thinking is based on giving Israeli Prime Minister Benjamin Netanyahu an off-ramp that would allow him to resist calls from hard-liners in his coalition who call for far more severe retribution. Whether he takes it is another matter, especially given that the Biden administration has so far declined to enforce its opinions by cutting off weapons sales to Israel.

ความเห็นของทีมนักกลยุทธ์

- **สถานการณ์ตะวันออกกลาง มีความเป็นไปได้สูงที่อิสราเอลจะโจมตีอิหร่าน แต่ช่วงเวลานี้ ต่อกันของอิหร่านและอิสราเอล น่าจะมีการคุยกันโดยมีประเทศซาอุดี เป็นคนกลาง รวมทั้งผู้นำอิสราเอลและสหรัฐฯ มีการหารือกันด้วย ซึ่งนับเป็นสัญญาณที่ดี หากจบปัญหาลงได้ จะดีต่อตลาด**

ความเห็นของทีมนักกลยุทธ์

ถ้าอิสราเอลโจมตีอิหร่าน

(อิสราเอล เตือนล่วงหน้า ตลาดจะ
ไม่ตกใจ (ยกเว้นมีอะไรเกินคาด)

มีนัยยะ → อิหร่านโต้กลับ → ตลาดจะเป็นลบ

ไม่มีนัยยะ → อิหร่านไม่
ตอบโต้ → ตลาดจะบวก

1 2 3 สงครามกับการลงทุน



จับ

China May Raise \$846 Billion to Boost Economy, Caixin Reports

By Dominic Lau

(Bloomberg) -- China may raise 6 trillion yuan (\$846 billion) from ultra-long special government bonds over three years as part of its efforts to boost the sputtering economy, Chinese media outlet Caixin reported.

The funds will be partly used to help local governments relieve their debt burden, according to the report late on Monday, citing unidentified people.



Lan Fo'an in Beijing on Oct. 12.

10/15/2024 ... 05:20:40 [BN] Bloomberg News

Speculation about the size of China's new fiscal stimulus has been rife since Finance Minister Lan Fo'an hinted at room for issuing more sovereign bonds on Saturday without specifying a headline dollar figure that investors had sought.

Revved up fiscal spending is still seen as holding the key to sustaining the rebound ignited by the central bank's stimulus blitz in late September. Traders are betting that the Standing Committee of the National People's Congress, China's top legislature, will approve extra budget funding at its meeting later this month.

การบรรยายสรุปของกระทรวงการคลังจีน

12 ต.ค. 11:33 น.

ตลาดต่างต้องการรายละเอียดเกี่ยวกับความพยายามของจีนในการฟื้นฟูการเติบโตทางเศรษฐกิจและยุติภาวะซบเซาของตลาดที่อยู่อาศัย ต่อไปนี้คือ 5 ประเด็นสำคัญจากการบรรยายสรุปของรัฐมนตรีว่าการกระทรวงการคลังจีน หลิน โฟอัน และเพื่อนร่วมงานในวันนี้

1. จีนจะกู้เงินเพิ่มเติมเพื่อระดมเงินและช่วยให้รัฐบาลท้องถิ่นสามารถจัดหาเงินทุนสำหรับ "หนี้อาบแฝง" หรือการกู้ยืมนอกงบดุล ซึ่งอาจช่วยบรรเทาแรงกดดันด้านหนี้สินของหน่วยงานระดับภูมิภาค ซึ่งประสบปัญหาในการระดมทุนจากช่องทางดั้งเดิม เช่น การขายที่ดิน และทำให้หน่วยงานเหล่านี้สามารถมุ่งเน้นไปที่การช่วยเหลือเศรษฐกิจได้ดียิ่งขึ้น รายละเอียดเพิ่มเติมเกี่ยวกับเรื่องนี้จะมาในภายหลัง ตามที่หลินกล่าว
2. รัฐบาลท้องถิ่นสามารถใช้เงินที่ระดมทุนจากพันธบัตรพิเศษเพื่อซื้อบ้านที่ขายไม่ออกและเปลี่ยนเป็นที่อยู่อาศัยที่ได้รับการอุดหนุน นี่เป็นขั้นตอนล่าสุดในการแก้ไขปัญหภาวะตกต่ำของอสังหาริมทรัพย์ที่เลวร้ายที่สุดในประวัติศาสตร์ของประเทศ แต่เจ้าหน้าที่ในพื้นที่ในอดีตกลับลังเลที่จะนำโปรแกรมนี้มาใช้เนื่องจากมีปัญหาเรื่องผลตอบแทนและราคา
3. เจ้าหน้าที่กล่าวว่ายังมีช่องทาง "อีกมาก" สำหรับรัฐบาลกลางในการก่อกำหน້และการขาดดุลการคลังจะเพิ่มขึ้น แต่พวกเขาไม่ยอมให้รายละเอียดเพิ่มเติม ความสนใจจะเปลี่ยนไปเป็นการประชุมครั้งต่อไปของสภานิติบัญญัติระดับสูงของจีนโดยเร็วที่สุดในช่วงปลายเดือนนี้สำหรับการประกาศใดๆ
4. ธนาคารของรัฐหลักๆ จะได้รับความช่วยเหลือในการเติมเงินทุน ผู้ให้กู้รายใหญ่ 6 รายมีระดับทุนที่เกินข้อกำหนดมาก แต่การสนับสนุนจะช่วยบรรเทาแรงกดดันใดๆ หลังจากธนาคารกลางเปิดเผยการลดอัตราดอกเบี้ยเงินกู้ที่อยู่อาศัยในวงกว้างและลดอัตราดอกเบี้ยหลักเพื่อฟื้นฟูเศรษฐกิจ
5. ไม่มีการระบุมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจใหม่เพื่อจูงใจการบริโภค ซึ่งเป็นจุดอ่อนในเศรษฐกิจ และไม่มีรายละเอียดเกี่ยวกับเงินอุดหนุนสำหรับครัวเรือนเช่นกัน และในขณะที่ยัง Lan กล่าวว่ารัฐบาลท้องถิ่นมีเงินทุน 2.3 ล้านล้านหยวนจากพันธบัตรพิเศษที่สามารถใช้ได้ภายในสิ้นปีนี้ นั้นไม่ใช่การกระตุ้นเศรษฐกิจใหม่ เนื่องจากประกอบด้วยพันธบัตรที่ออกแล้วแต่ยังไม่ได้ใช้ รวมถึงพันธบัตรที่ยังไม่ได้ออกแต่ยังอยู่ในโควตาของปีนี้

คลังใจเตรียมจัดแถลงข่าวเสาร์นี้ (12 ต.ค.)

DAOL SEC

11 Oct 24

China Investors Expect \$283 Billion of New Stimulus This Weekend

Finance Minister Lan to host anticipated briefing on Saturday
Polled analysts expect local debt relief, consumption boost

By Bloomberg News

(Bloomberg) -- Investors and analysts are expecting China to deploy as much as 2 trillion yuan (\$283 billion) in fresh fiscal stimulus as Beijing seeks to shore up the world's No. 2 economy and boost confidence.

That's what they're hoping the country's finance minister will announce at a highly anticipated briefing Saturday, according to a majority of 23 market participants surveyed by Bloomberg.

Beyond the amount of any fiscal package, the target of support will indicate where the government looks to steer its economy after years of debt-fueled expansion through investment, particularly in real estate and infrastructure.

"The stimulus should be multi-year and targeted to households and not restarting the real estate investment-led growth story," said Pushan Dutt, professor of economics at INSEAD. "It is the focus of the stimulus rather than the size that is important."

The weekend press conference, which the government said would introduce measures to strengthen fiscal policy, comes as investors assess how far the authorities plan to go with stimulus efforts that prompted a world-beating stock rally.

China has already cut interest rates and ramped up support for property and stock markets in a barrage of steps announced late September. But investors have clamored for fiscal interventions economists believe are crucial to lifting confidence.

Onshore Chinese shares remained volatile throughout the week after ending a 10-day rally on Wednesday, as officials disappointed by announcing no major new stimulus following a weeklong holiday.



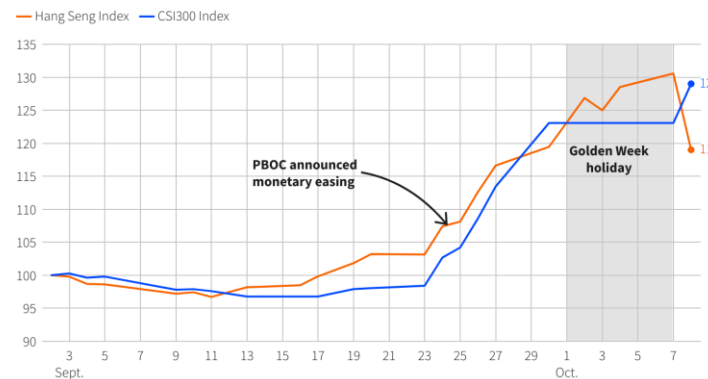
จีน นักลงทุนยังขายทำกำไรเป็นวันที่สองหลัง
กลับมาเปิดทำการ เนื่องจาก ผิดหวังต่อ
มาตรการเศรษฐกิจ เราคาดว่าตลาดหุ้นจีน
จะเป็นแค่พักตัวเพราะขึ้นมาเร็ว ส่วนมาตรการ
เศรษฐกิจ ที่จะออกมา คาดทางการจีน อาจรอดู
สถานการณ์ตะวันออกกลาง หรือไม่ก็รอผล
เลือกตั้งประธานาธิบดีสหรัฐฯ ก่อนที่จะออก
มาตรการชุดใหญ่ ก็เป็นไปได้



- เร่งการใช้จ่ายและมีแผนสนับสนุนกลุ่มที่มีรายได้น้อยและบริษัทจดทะเบียนใหม่
- มีแผนจะออกพันธบัตรรัฐบาลระยะยาวในปีหน้าเพื่อสนับสนุนโครงการสำคัญ
- นำงบการลงทุนกว่า 1 แสนล้านหยวน (1.4 พันล้านดอลลาร์สหรัฐฯ) มาใช้ลงทุนในพื้นที่ยุทธศาสตร์สำคัญในปีนี้แทน ซึ่งเดิมตั้งงบไว้สำหรับปี 2568
- จะเร่งออกพันธบัตรชุดพิเศษสำหรับรัฐบาลท้องถิ่น เพื่อสนับสนุนเศรษฐกิจในระดับภูมิภาค
- พลิกดินจังหวัดต่างๆ ออกพันธบัตรพิเศษท้องถิ่นใหม่วงเงิน 2.9 แสนล้านหยวน จัดสรรสำหรับปีนี้ภายในสิ้นเดือนตุลาคม
- เร่งรัดการใช้กองทุนพันธบัตรท้องถิ่นพิเศษและการก่อสร้างโครงการที่เกี่ยวข้อง
- การแถลงในครั้งนี้ไม่ได้มีการกระตุ้นใหม่ ๆ ออกมา



China stocks have rallied on stimulus measures



Note: Rebased to 100; Oct. 8 index numbers are as of 1330 HKT
Source: LSEG | A. Srivastav | Breakingviews | Oct. 8, 2024

CSI 300 Index Pares Gains After Opening Surge



23 Sep 2024

- ปรับลดอัตราดอกเบี้ย Reverse repo ระยะ 14 วัน ลง 0.1% มาอยู่ที่ระดับ 1.85%
- อดฉีดสภาพคล่องเข้าระบบ 7.45 หมื่นล้านหยวน (เกือบ 3.5 แสนล้านบาท)

24 Sep 2024



PBOC แกลงมาตรการกระตุ้นชุดใหญ่

- ลด RRR ลง 0.5% เพิ่มสภาพคล่องเข้าระบบ **1 ล้านล้านหยวน** (1.42 แสนล้านบาท) และอาจมีการลด RRR เพิ่มเติม 0.25-0.5% ขึ้นอยู่กับสถานการณ์สภาพคล่องในตลาดภายในปีนี้
- ลดอัตราดอกเบี้ย Reverse repo ระยะ 7 วันลง 0.2% มาอยู่ที่ 1.5% จาก 1.7%
- ลดอัตราดอกเบี้ยเฉลี่ยของสินเชื่อ 0.5% และปรับลดเงินดาวน์ขั้นต่ำสำหรับอสังหาริมทรัพย์มือสอง อยู่ที่ 15% จาก 25%
- Swap program **5 แสนล้านหยวน** สำหรับกองทุน ประกันภัย และโบรกเกอร์สามารถเข้าถึงเงินทุนได้ง่ายขึ้นเพื่อซื้อหุ้น
- ให้ออกใบดอกเบี้ยต่ำจากธนาคารกลางจีน (PBOC) สูงสุด **3 แสนล้านหยวน** สำหรับบริษัทจดทะเบียนและผู้ถือหุ้นรายใหญ่ เพื่อช่วยสนับสนุนการซื้อหุ้นและการซื้อคืนหุ้นของหน่วยงานอื่น

8 แสนล้านหยวน (1.13 แสนล้านบาท)

25 Sep 2024

27 Sep 24

- PBOC ประกาศลด MLF ระยะ 1 ปี (อัตราดอกเบี้ยนโยบายของจีน) ลง 0.30% มาอยู่ที่ระดับ 2.00%
- จีนออกมาตรการแจกเงินช่วยเหลือคนยากจนเด็กกำพร้า และคนไร้บ้าน โดยให้ทางท้องถิ่นกระจายเงินสู่ประชาชนก่อนวันชาติ (1 ต.ค.) ซึ่งเป็นวันหยุดยาวของจีนที่จะถึงนี้ หวังกระตุ้นการใช้จ่าย โดยหน่วยงานต่างๆ ได้จัดสรรงบจำนวน 1.55 แสนล้านหยวนไว้แล้ว (ประมาณ 2.2 หมื่นล้านบาท)

26 Sep 2024

- จีนกำลังพิจารณาอัดฉีดเงินทุนราว **1 ล้านล้านหยวน** (1.42 แสนล้านบาท) ให้กับธนาคารขนาดใหญ่ เพื่อเพิ่มศักยภาพในการช่วยเหลือเศรษฐกิจซบเซา โดยแหล่งเงินทุนส่วนใหญ่มาจากการออกพันธบัตรรัฐบาลชุดใหม่ ซึ่งยังไม่ได้เปิดเผยรายละเอียด ทicker ครั้งแรกนับตั้งแต่วิกฤตการเงินโลกในปี 2008 ที่ปักกิ่งได้อัดฉีดเงินทุนให้กับธนาคารขนาดใหญ่
- การประชุม Politburo ปรน. สี จิ้นผิง และสมาชิกทั้ง 24 คน ได้รับรองว่าจะบรรลุเป้าหมายเศรษฐกิจประจำปี เน้นความจำเป็นในการใช้จ่ายทางการคลัง และสร้างเสถียรภาพให้กับตลาดอสังหาริมทรัพย์

ส่งออก + ค่าเงินบาท + NEER

DOLLAR INDEX & THAI BAHT

THB Currency - Last Price (R1) 33.286 High on 10/14/22 38.334 Average 33.214 Low on 12/31/19 29.705 DXY Currency - Last Price (R2) 103.201 High on 09/27/22 114.106 Average 99.328 Low on 01/05/21 89.436

• เงินบาทกลับมาแข็งค่าอีกครั้ง วานนี้(9) เงินบาทปิดไปที่ 33.43 แข็งค่าขึ้น 0.10 บาท แม้ Dollar Index จะยับขึ้น เรามองเป็นสัญญาณบวกของตลาดหุ้น ว่าอาจมีเม็ดเงินใหม่ๆ กำลังไหลเข้าตลาดไทย



Bloomberg Cumulative FX Carry Trade Index for 8 Emerging Market Currencies » total return of a buy-and-hold carry trade position



FXCTEM8 Index (Bloomberg Cumulative FX Carry Trade Index for 8 Emerging Market Currencies) EM - Carry Trade Daily 09SEP2019-30OCT2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

15-Oct-2024 07:15:24

SET Index – Bond Yield 10 ปี ของไทย – ค่าเงินบาท

SET Index & Yields on Thai 10-year notes



Source: Bloomberg

TBDC10Y Index (Thai Bond Dealing Centre 10 Year Index) Thai bond yield Daily 02DEC2022-30OCT2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

15-Oct-2024 07:15:06

GDP – SET Index – ค่าเงินบาท ของไทย

Thai GDP -SET Index - Thai Baht



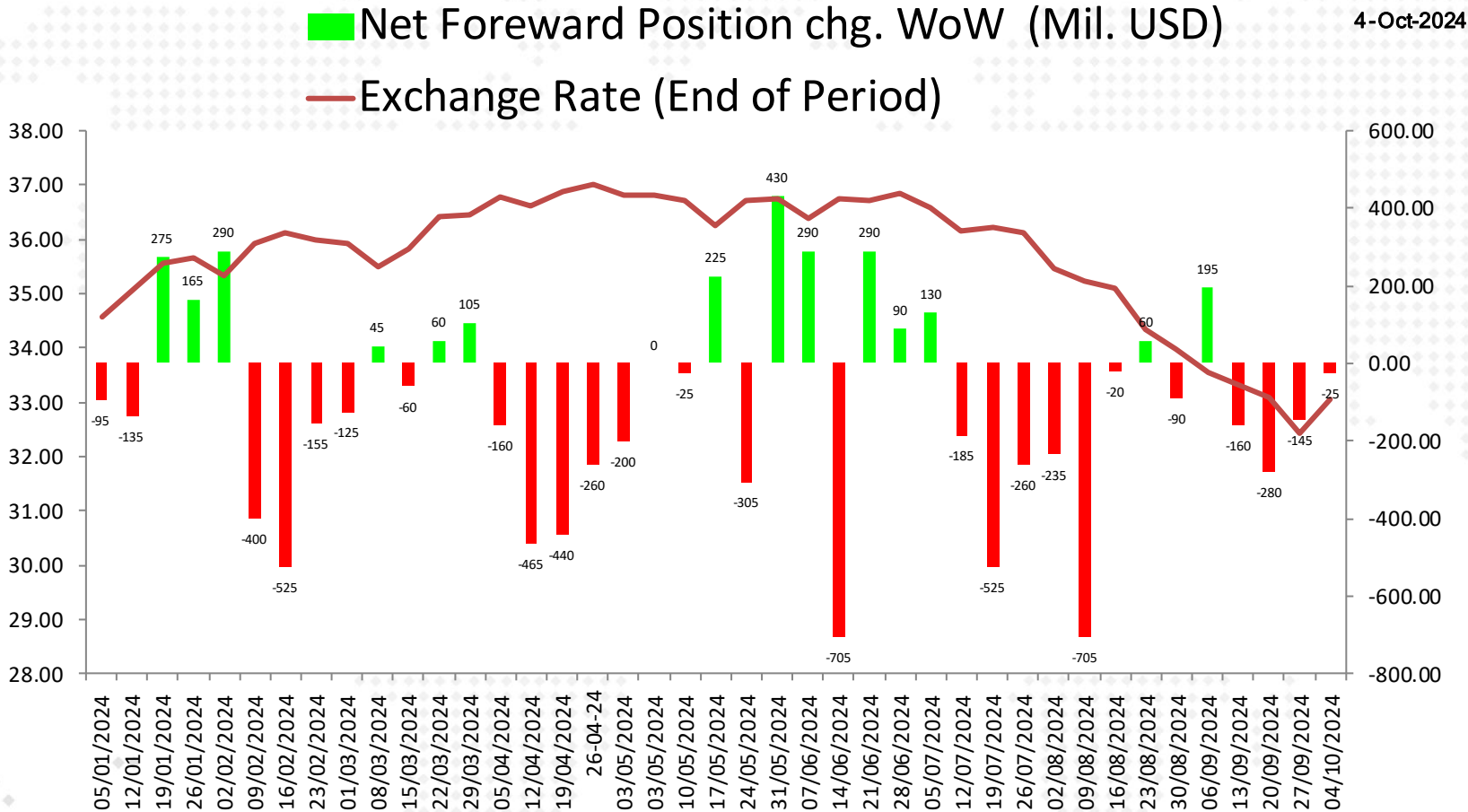
เงินทุนสำรองฯ สูงขึ้นต่อเนื่อง หนุนค่าเงินบาท ให้แข็งค่า

Foreign reseve-SET Index



Series	Last Price
THFRUS\$ Index (R1)	240.72
SET Index (R2)	1470.10
THB Currency - on 10/15/24 (L1)	33.300

THFRUS\$ Index (Thailand International Foreign Reserves Total) Foreign reseve-SET Index Daily 05NOV2018-30OCT2024 Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P. 15-Oct-2024 07:14:28



■ มีการพูดถึงการแทรกแซงค่าเงินบาทของ รปท. รูปด้านบน (แท่งแดง-เขียว) ซึ่งเป็นตัวเลข Forward Position ของเงิน USD ที่ รปท. มี ภาระอยู่ กลับไม่ได้เพิ่มขึ้น แสดงว่า รปท. ไม่ได้แทรกแซงผ่านตลาด Swap หรืออาจซื้อ USD ทีเดียว

■ รปท. ซื้อทองเพิ่ม เป็น 236 ตัน หรือเพิ่มราว 2 ตัน หลังจากไม่ได้มีการซื้อขาย ทอง ตั้งแต่ มี.ค.67 เป็นต้นมา

ดัชนีค่าเงินบาท (NEER) ยังเพิ่มขึ้นน้อยกว่า ค่าเงินบาท

26-Sep-24

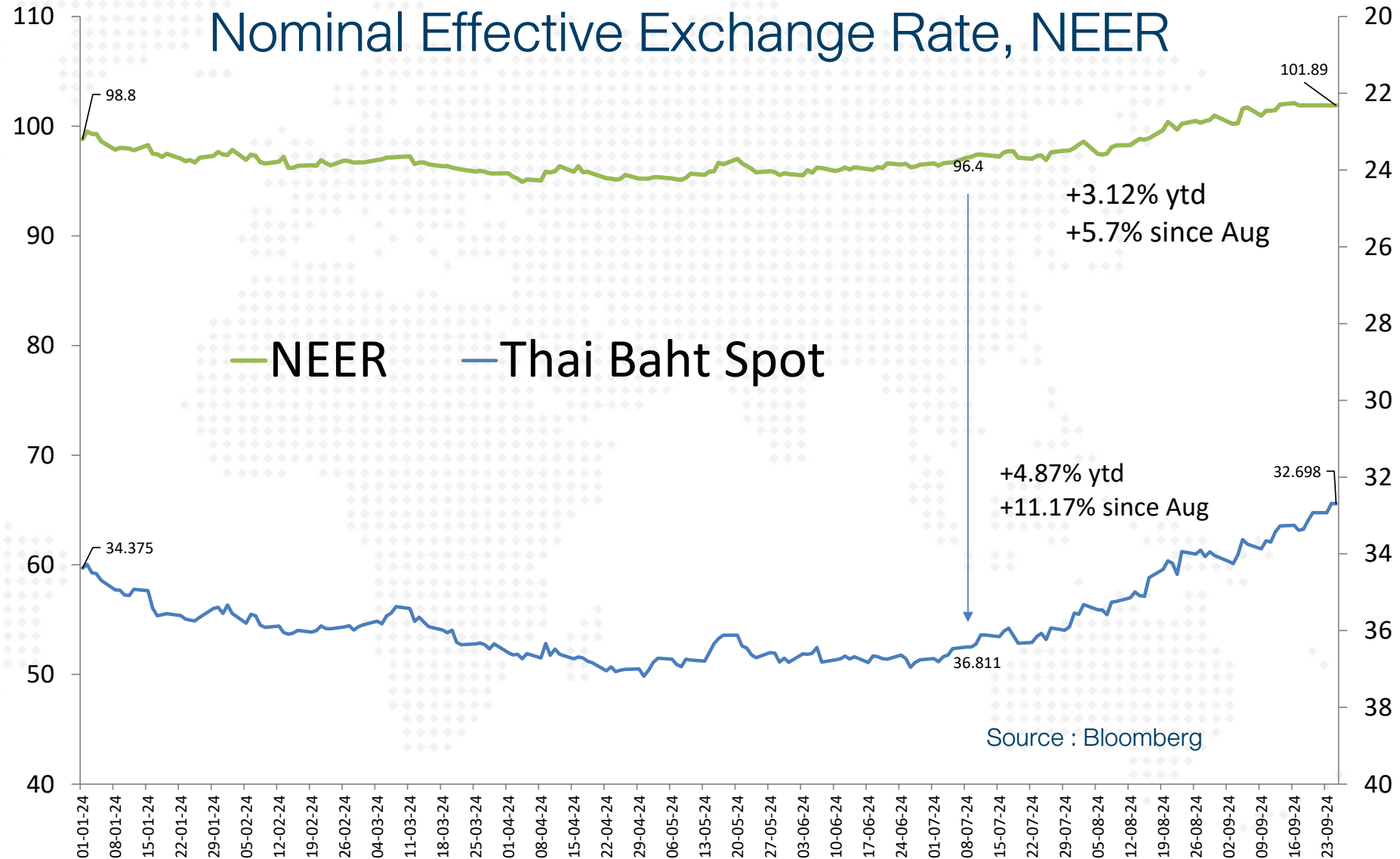
DAOL SEC

การเพิ่มขึ้นของค่าเงินบาท เทียบ 2 ช่วง คือ Ytd และ จาก ส.ค.67 พบว่า

- ดัชนีค่าเงินบาท (NEER) แห้งค่าขึ้น ทั้งสองเวลา
- แต่ยังคงต่ำกว่าการแข็งค่าของเงินบาท (ไม่แ่ มากนัก)
- ปกติ ถ้าค่าเงินไม่แข็งผิดปกติ ค่า NEER จะไม่เปลี่ยนแปลง หรือเปลี่ยนแปลงน้อยกว่า

หมายเหตุ :

- การเพิ่มขึ้นของดัชนีค่าเงิน หมายถึง เงินบาทแข็งค่าขึ้นเทียบกับสกุลเงินของประเทศคู่ค้าและผู้แข่งขันของไทย สะท้อนว่าไทยเสียเปรียบด้านราคาโดยรวมเมื่อเทียบกับประเทศคู่ค้าและผู้แข่ง
- NEER คำนวณโดยเปรียบเทียบค่าเงินบาทกับค่าเงินของประเทศคู่ค้าและผู้แข่งขันของไทย 25 สกุลเงิน และนำมาเฉลี่ยแบบถ่วงน้ำหนักตามสัดส่วนการค้าระหว่างกัน
- REER คำนวณจาก NEER ปรับด้วยระดับราคาโดยเปรียบเทียบกับประเทศคู่ค้าและผู้แข่ง สะท้อนอำนาจซื้อที่แท้จริงและความสามารถในการผลิตสินค้าของประเทศ



Source : Bloomberg

E:\Google Drive\Bloomberg\Thai Baht -NEER-REER.xlsx



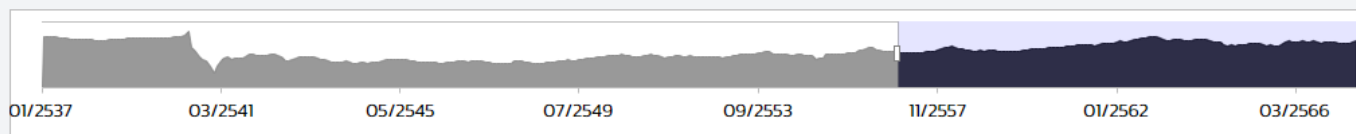
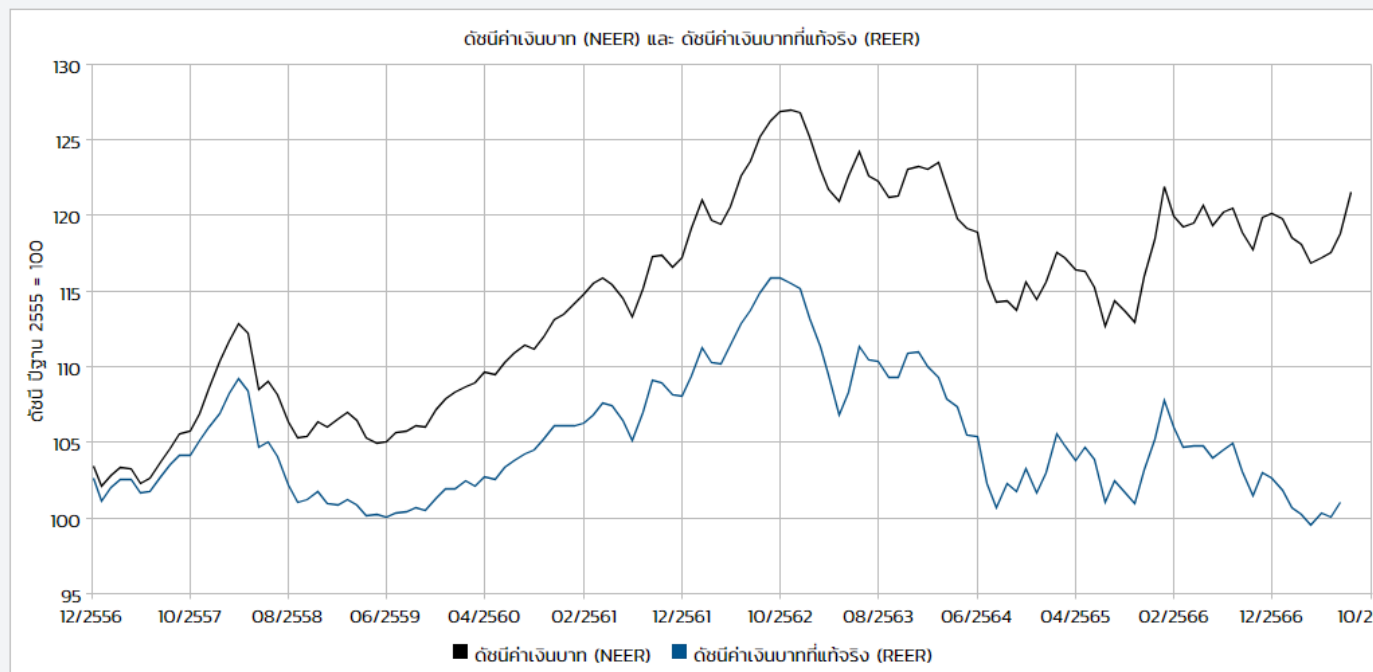
ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

หน้าแรก ข้อมูลสถิติ เกี่ยวกับ สปท. ติดต่อเรา ช่วยเหลือ / ร้องเรียน

ข้อมูล : ดัชนีค่าเงินบาท (NEER) และ ดัชนีค่าเงินบาทที่แท้จริง (REER)

ความถี่: ช่วงเวลา: 2557 - 2567

รูปแบบกราฟ: ข้อมูลที่แสดง:



<https://app.bot.or.th/BIZSHR/stat/DataSeries/3>

Real Effective Exchange Rate, REER

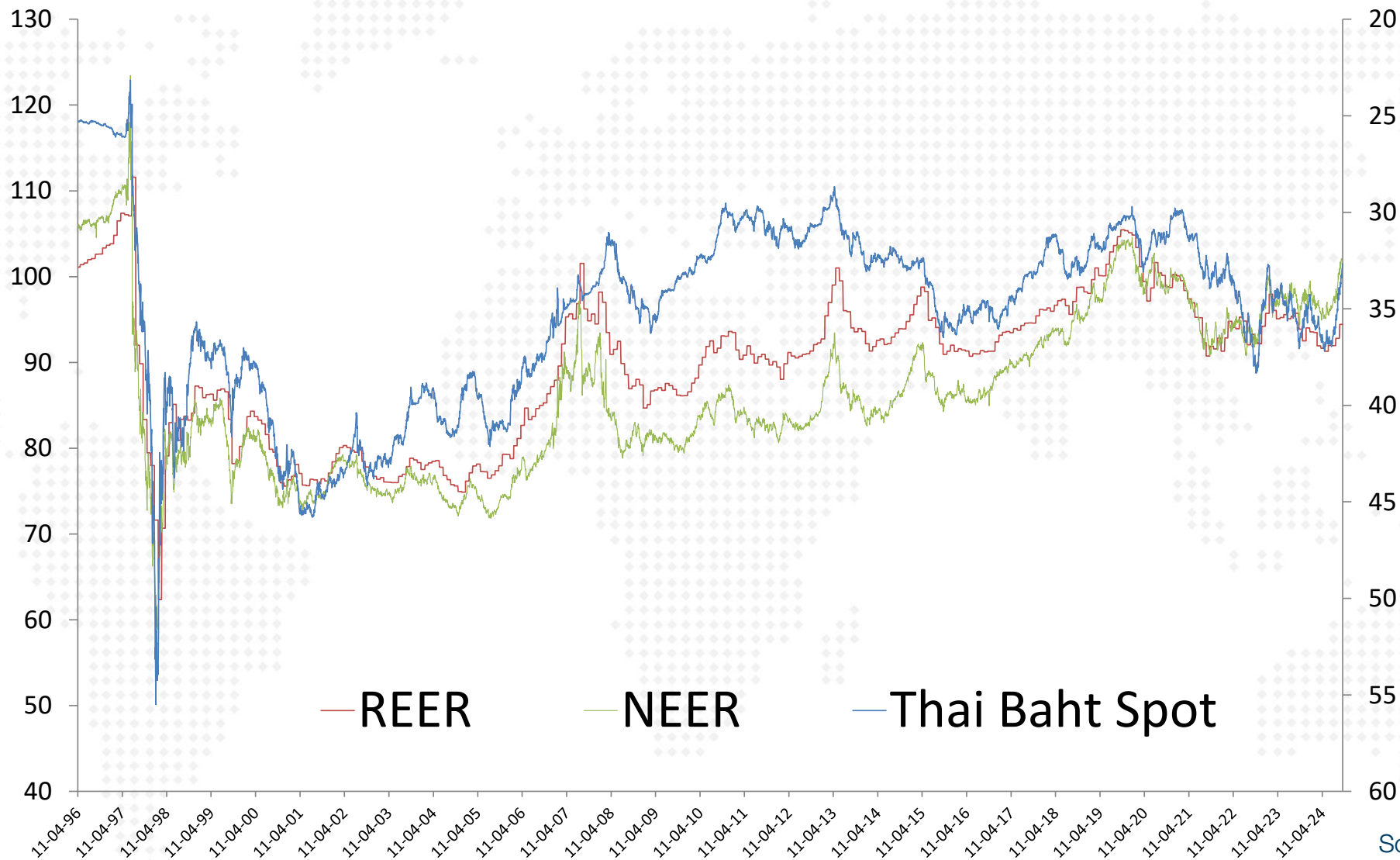
	REER	REER	REER	Index
YTD	3.1%	-2.6%	-2.5%	3.5%
	Thai	Indonesia	Phillipine	Thai

เงินบาทแข็งกว่าเงิน 2 สกุล เอเชีย

NEER & REER เทียบกับค่าเงินบาทในตลาด

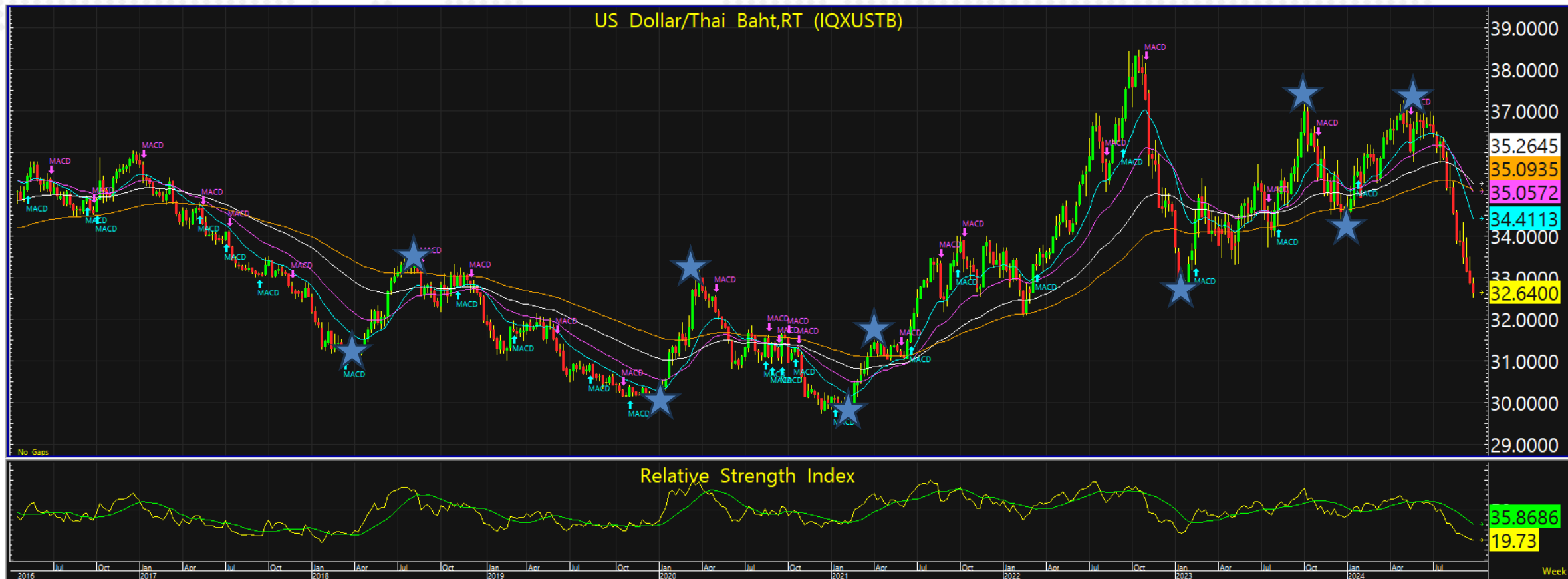
26-Sep-24

DAOL SEC



Source : Bloomberg

E:\Google Drive\Bloomberg\Thai Baht -NEER-REER.xlsx



เปรียบเทียบตั้งแต่ ปี 2018 เมื่อค่าเงินบาทอ่อนค่าลง SET Index จะไปทางใด

จำนวนวัน	เงินบาท	เปลี่ยนแปลง	SET Index	เปลี่ยนแปลง
12-Mar-18	31.23		1811	
16-Jul-18	33.34	-7%	1671	-8%
30-Dec-19	30.16		1594	
30-Mar-20	33.01	-9%	1138	-29%
14-Dec-20	29.84		1482	
12-Apr-21	31.19	-5%	1548	4%
30-Jan-23	33.33		1688	
02-Oct-23	36.97	-11%	1438	-15%
01-Jan-24	34.58		1427	
29-Apr-24	36.69	-6%	1369	-4%

ผู้ช่วยผู้ว่าการรปท. เผยพร้อมเข้า
แทรกแซงค่าเงินบาท หากผันผวน
ปิดปกติ หลังเงินบาทแข็งค่าขึ้น
3.8% ตั้งแต่ต้นปี และแข็งค่าเร็ว
กว่าสกุลอื่นในภูมิภาค.....

เราทำข้อมูลตั้งแต่ ปี 2018 ใน
จังหวะที่ค่าเงินบาทอ่อนค่าลง(จาก
ที่แข็งมาก) 5 ครั้ง ดัชนีฯ จะปรับตัว
ลดลง 4 ใน 5 ครั้ง (จริงๆ แล้ว ตัว
แปรที่มีผลต่อตลาด มีมากกว่า
ค่าเงินบาท)

25-Sep-24

บริษัทในตลาดหุ้น..... หุ่นส่งออก ที่ผ่านมา ถูกกระทบจาก ปริมาณการขายที่ลดลง และต้นทุนสูง ขณะที่เงินบาท มีผลน้อย

บางตัวได้อานิสงค์ในเชิงราคาสินค้าเช่น ยางพารา เป็นตัวช่วย บางตัวขายดีเพราะปริมาณส่งออกสูงขึ้น เช่น อาหารสัตว์เลี้ยง ไก่ หรือ hard disk

กำไรตลาดหุ้น มักจะได้านิสงค์จากเงินบาท ที่แข็งค่า (FX gain กลุ่มน้ำมัน-ปิโตรเคมี-โรงไฟฟ้า) ตามสถิติ เงินบาทแข็งทุกๆ 1 บาท = กำไร FX ของตลาด 1.0 หมื่นลบ.

- หุ่นเสียประโยชน์ : หลักๆ คือส่งออก ในตลาดหุ้นก็พวก KCE, HANA , KSL, BRR , ITC, AAI
- ได้ประโยชน์ : มีหนี้มาก ส่วนใหญ่หุ้นน้ำมัน + ปิโตรเคมี+โรงไฟฟ้า เช่น TOP, PTT, BGRIM กลุ่มนำเข้าสินค้าจากต่างประเทศ SIS, SYNEX, COM7, MSC , AAV

วิเคราะห์ Fed

Powell's Half-Pointer Is Hard to Repeat With FOMC in No Hurry

(Bloomberg) -- Federal Reserve Chair Jerome Powell is unlikely to win another big interest-rate cut from his policy committee so long as the labor market holds up.

Powell described the move as a recalibration aimed at making sure the labor market remained strong at his press conference after officials reduced the benchmark lending rate by a half percentage point to a range of 4.75% to 5%.

The move broke with the gradualism typical of Fed interest-rate changes. Some officials described their support of the move as arising from recent inflation data that convinced them the rate of price changes was headed toward their 2% target.

Nevertheless, minutes of the meeting showed there was a preference among some officials to cut rates at a more gradual pace, possibly because the economy remains remarkably resilient even in the face of what Fed officials call "restrictive" policy.

What Fed Officials Are Saying About the Path Ahead

Fed official	Comment
Mary Daly, San Francisco	"I think that two more cuts this year, or one more cut this year, really spans the range of what is likely in my mind." -- Oct. 9
Lorie Logan, Dallas	"Following last month's half-percentage-point cut in the fed funds rate, a more gradual path back to a normal policy stance will likely be appropriate from here." -- Oct. 9
Susan Collins, Boston	"I saw an initial 50-basis-point rate reduction as prudent in this context, recognizing that monetary policy remains in restrictive territory." -- Oct. 9
John Williams, New York	"I think monetary policy is well positioned for the outlook, and if you look at the SEP projections that capture the totality of the views, it's a very good base case." -- Oct. 7
Alberto Musalem, St. Louis	"I believe that further gradual reductions in the policy rate will likely be appropriate over time." -- Oct. 7
Neel Kashkari, Minneapolis	"As we go forward, I expect, on balance, we will probably take smaller steps unless the data changes materially." -- Sept. 23

Source: Quotes compiled by Bloomberg

Bloomberg

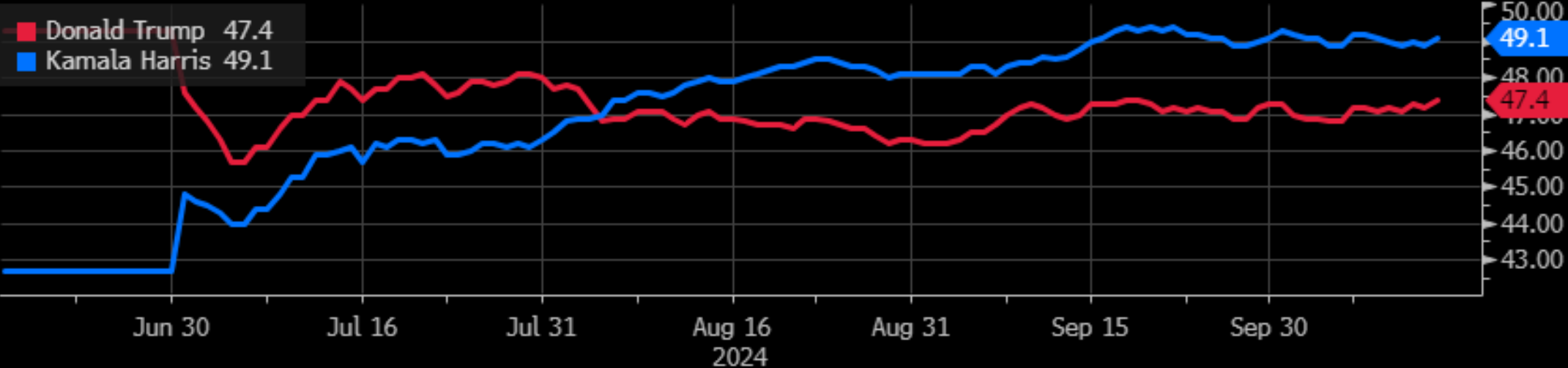
CME FEDWATCH TOOL - CONDITIONAL MEETING PROBABILITIES										
MEETING DATE	250-275	275-300	300-325	325-350	350-375	375-400	400-425	425-450	450-475	475-500
11/7/2024					0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	84.7%	15.3%
12/18/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	80.4%	18.8%	0.8%
1/29/2025	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	61.0%	33.7%	5.1%	0.2%
3/19/2025	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	57.3%	35.3%	6.8%	0.5%	0.0%
5/7/2025	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	37.1%	43.1%	16.9%	2.7%	0.2%	0.0%
6/18/2025	0.0%	0.0%	0.0%	23.4%	40.9%	26.6%	8.0%	1.1%	0.1%	0.0%
7/30/2025	0.0%	0.0%	8.5%	29.7%	35.7%	19.8%	5.5%	0.7%	0.0%	0.0%
9/17/2025	0.0%	2.9%	15.8%	31.8%	30.2%	14.9%	3.8%	0.5%	0.0%	0.0%
10/29/2025	0.7%	6.0%	19.6%	31.4%	26.6%	12.3%	3.1%	0.4%	0.0%	0.0%

โอกาสลด 0.25%



2024 General Election: Trump vs. Harris

RealClearPolitics Poll Average



ข้อมูลการขายชอร์ตและข้อมูลการขายชอร์ตที่ยังไม่ได้ซื้อคืน

ข้อมูลการขายชอร์ต

ภาพรวมตลาด (SET และ mai)

วันที่	มูลค่าการขายชอร์ต (ล้านบาท)	% มูลค่าการขายชอร์ตเทียบกับมูลค่าการซื้อขายรวม
11 ต.ค. 2567	2,478.64	4.04%

ข้อมูลการขายชอร์ตที่ยังไม่ได้ซื้อคืน (Outstanding Short Positions) เป็นข้อมูลรายวันที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้รับรายงานจากสมาชิก ซึ่งสมาชิกจะปรับปรุงรายการเมื่อได้รับแจ้งข้อมูลการซื้อคืนหลักทรัพย์จากลูกค้าหรือเมื่อเกิน 60 วันนับจากวันที่ลูกค้าฯ

ข้อมูลรายหลักทรัพย์

ข้อมูลการขายชอร์ต วันที่ 11 ต.ค. 2567

ข้อมูลการขายชอร์ตที่ยังไม่ได้ซื้อคืน ณ วันที่ 11 ต.ค. 2567

หลักทรัพย์	ปริมาณการขายชอร์ต (หุ้น)			มูลค่าการขายชอร์ต (บาท)	% มูลค่าการขายชอร์ตเทียบกับมูลค่าการซื้อขายรวม	ปริมาณการขายชอร์ตที่ยังไม่ได้ซื้อคืน ณ สิ้นวัน (หุ้น)			ปริมาณการขายชอร์ตที่ยังไม่ได้ซื้อคืนของหลักทรัพย์ทั้งหมด/จำนวนหุ้นชำระแล้ว (%)
	Local	NVDR	ทั้งหมด			Local	NVDR	ทั้งหมด	
SCC	252,200	1,437,900	1,690,100	390,296,500	19.12%	3,039,377	11,590,550	14,629,927	1.22%
GULF	1,570,700	731,500	2,302,200	149,912,225	4.33%	5,272,800	37,389,500	42,662,300	0.36%
PTTEP	119,900	958,300	1,078,200	145,557,000	13.89%	707,000	41,438,800	42,145,800	1.06%
DELTA	564,800	507,100	1,071,900	126,014,400	4.87%	6,742,900	38,567,626	45,310,526	0.36%
PTTGC	760,400	3,243,100	4,003,500	112,438,725	7.38%	9,039,900	53,216,600	62,256,500	1.38%
CPALL	496,000	1,022,900	1,518,900	99,614,900	5.33%	1,732,400	42,784,353	44,516,753	0.50%
AOT	682,400	733,800	1,416,200	90,636,800	15.71%	16,088,900	112,626,400	128,715,300	0.90%
KBANK	245,500	271,500	517,000	79,702,950	3.15%	1,104,500	15,041,900	16,146,400	0.68%
PTT	849,200	1,305,400	2,154,600	73,786,675	1.81%	9,080,200	68,494,100	77,574,300	0.27%
KTB	2,249,200	667,600	2,916,800	62,579,350	2.17%	4,890,500	38,050,100	42,940,600	0.31%
BCH	1,773,700	1,252,100	3,025,800	56,703,580	9.25%	8,505,200	16,446,100	24,951,300	1.00%
CRC	471,200	1,097,500	1,568,700	52,943,625	33.96%	4,163,100	50,242,726	54,405,826	0.90%
INTUCH	145,100	362,600	507,700	52,725,700	3.57%	1,212,900	12,664,500	13,877,400	0.43%
BBL	280,400	52,700	333,100	51,739,450	2.40%	5,891,000	3,549,200	9,440,200	0.49%
SCGP	929,800	828,900	1,758,700	47,833,800	10.70%	3,855,327	50,401,257	54,256,584	1.26%
SCB	219,400	195,500	414,900	45,769,950	3.95%	5,822,800	11,594,000	17,416,800	0.52%
CPN	75,400	571,000	646,400	44,122,025	6.53%	1,158,900	19,088,547	20,247,447	0.45%
TU	949,100	1,987,000	2,936,100	43,553,810	24.70%	8,195,500	22,390,600	30,586,100	0.69%
BTS	2,208,000	6,980,000	9,188,000	41,949,802	6.69%	14,648,300	128,350,510	142,998,810	1.09%
BDMS	1,364,500		1,364,500	39,911,625	1.75%	5,180,000	63,612,400	68,792,400	0.43%

วิเคราะห์การเมือง

นำร่องอนุญาตการพนัน 23 ชนิด เล่นได้ตามเวลา

DAOL SEC

15 Oct 24

หน้า ๑
เล่ม ๑๔๑ ตอนที่ ๖๓ ก
ราชกิจจานุเบกษา
๑๐ ตุลาคม ๒๕๖๗



กฎกระทรวง

ฉบับที่ ๔๖ (พ.ศ. ๒๕๖๗)

ออกตามความในพระราชบัญญัติการพนัน พุทธศักราช ๒๔๗๘

อาศัยอำนาจตามความในมาตรา ๔ และมาตรา ๑๗ แห่งพระราชบัญญัติการพนัน พุทธศักราช ๒๔๗๘ รัฐมนตรีว่าการกระทรวงมหาดไทยออกกฎกระทรวงไว้ดังต่อไปนี้

- ข้อ ๑ กฎกระทรวงนี้ให้ใช้บังคับตั้งแต่วันถัดจากวันประกาศในราชกิจจานุเบกษาเป็นต้นไป
- ข้อ ๒ ให้ยกเลิกความใน (ก) ของข้อ ๕ แห่งกฎกระทรวง ฉบับที่ ๑๗ (พ.ศ. ๒๕๐๓)

ออกตามความในพระราชบัญญัติการพนัน พุทธศักราช ๒๔๗๘ และให้ใช้ความต่อไปนี้แทน

“(ก) การพนันต่อไปนี้ให้เล่นได้ภายในกำหนดเวลา

การพนัน	กำหนดเวลา
๑. การเล่นต่าง ๆ ซึ่งให้สัตว์ต่อสู้หรือแข่งกัน ซึ่งไม่มีการเล่น โตแต้ไลเซเตอร์ สวีป หรือบูกเมกิง รวมอยู่ด้วย	๗ ถึง ๑๙ นาฬิกา
๑/๑. แข่งวัวลาน	๑๘ ถึง ๖ นาฬิกา ของวันรุ่งขึ้น
๒. วิ่งวัวคน	๗ ถึง ๑๙ นาฬิกา
๓. แข่งเรือพุง แข่งเรือล้อ	๗ ถึง ๑๙ นาฬิกา
๔. ช้องอ้อย	๗ ถึง ๑๙ นาฬิกา
๕. ชกมวย มวยปล้ำ	๑๒ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๖. ชีรูป	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๗. โยนห่วง	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๘. โยนสตาจค์หรือวัตถุใด ๆ ลงในภาชนะต่าง ๆ	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๙. ตกเบ็ด	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๑๐. จับสลากโดยวิธีใด ๆ	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๑๑. ยิงเป้า	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๑๒. ปาหน้าคน ปาสัตว์ หรือสิ่งใด ๆ	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา

หน้า ๒
เล่ม ๑๔๑ ตอนที่ ๖๓ ก
ราชกิจจานุเบกษา
๑๐ ตุลาคม ๒๕๖๗

การพนัน	กำหนดเวลา
๑๓. เต้าข้ามด่าน	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๑๔. หมากแก้ว	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๑๕. หมากหัวแดง	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๑๖. บิงโก	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๑๗. สะบ้าทอย	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๑๘. สะบ้าชุด	๗ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๑๙. การเล่นต่าง ๆ ซึ่งให้สัตว์ต่อสู้หรือแข่งกันซึ่งมีการเล่น โตแต้ไลเซเตอร์ รวมอยู่ด้วย	๑๒ ถึง ๒๐ นาฬิกา
๒๐. โตแต้ไลเซเตอร์ สำหรับการเล่นอย่างใดอย่างหนึ่ง	๑๒ ถึง ๒๐ นาฬิกา
๒๑. บูกเมกิง สำหรับการเล่นอย่างใดอย่างหนึ่ง	๑๒ ถึง ๒๐ นาฬิกา
๒๒. ไพ่นกกระจอก ไฟต่อแต้ม ไฟต่าง ๆ	วันอาทิตย์ ๑๒ ถึง ๒๔ นาฬิกา วันอื่น ๑๘ ถึง ๒๔ นาฬิกา
๒๓. ดวด	วันอาทิตย์ ๑๒ ถึง ๒๔ นาฬิกา วันอื่น ๑๘ ถึง ๒๔ นาฬิกา”

ข้อ ๓ ให้เพิ่มแบบพิมพ์ใบอนุญาตให้จัดให้มีการเล่นการพนันแข่งวัวลาน พ.น. ๒/๑ ท้ายกฎกระทรวงนี้เป็นแบบพิมพ์ใบอนุญาตให้จัดให้มีการเล่นการพนันแข่งวัวลาน พ.น. ๒/๑ ท้ายกฎกระทรวง ฉบับที่ ๑๗ (พ.ศ. ๒๕๐๓) ออกตามความในพระราชบัญญัติการพนัน พุทธศักราช ๒๔๗๘

ให้ไว้ ณ วันที่ ๓๐ กันยายน พ.ศ. ๒๕๖๗

อนุทิน ชาญวีรกูล

รัฐมนตรีว่าการกระทรวงมหาดไทย

นายธีรยุทธ สุวรรณเกษร ยื่นคำร้องต่อศาลรัฐธรรมนูญด้วยเอกสารกว่า 5,000 แผ่น กล่าวหา **"ทักษิณ ชินวัตร" และพรรคเพื่อไทย** ว่ามีพฤติกรรมเข้าข่ายล้มล้างการปกครองหรือไม่ - เอื้อประโยชน์ให้พิกชั้น 14 รพ.ตำรวจ - เอื้อประโยชน์ MOU2544 - ร่วมมือพรรคประชาชนแก่ รธน.-จับพปชร.พันรัฐบาล-ครอบงำนโยบาย



6 ข้อกล่าวหา

1. **พิกโทษในโรงพยาบาล:** ทักษิณได้รับพระราชทานลดโทษ แต่ใช้พรรคเพื่อไทยสั่งการให้พิกอาศัยในโรงพยาบาลเพื่อหลีกเลี่ยงการจำคุก
2. **ความสัมพันธ์กับสุน เชน:** ทักษิณมีพฤติกรรมฉักฉวยร่วมมือกับสุน เชน ผู้นำกัมพูชา เพื่อเอื้อประโยชน์ให้กับกัมพูชาในเรื่องเขตทะเล
3. **การแก้ไขรัฐธรรมนูญ:** ทักษิณสั่งการให้พรรคเพื่อไทยร่วมมือกับพรรคประชาชนเสนอแก้ไขรัฐธรรมนูญเพื่อเอื้อประโยชน์ต่อตนเอง
4. **การเจรจายก รัฐมนตรีใหม่:** นายทักษิณมีส่วนในการเจรจาเสนอชื่อบุคคลเป็นนายกรัฐมนตรีคนใหม่
5. **จับพรรคพลังประชารัฐออกจากรัฐบาล:** นายทักษิณสั่งการให้พรรคเพื่อไทยจับพรรคพลังประชารัฐออกจากการเป็นพรรคร่วมรัฐบาล
6. **การควบคุมการบริหาร:** นายทักษิณใช้พรรคเพื่อไทยเป็นเครื่องมือในการควบคุมการบริหารราชการแผ่นดินและการดำเนินงานของรัฐบาล

8 Oct 24

นายพิชัย ชุณหวชิร รองนายกรัฐมนตรี และ สมว.คลัง ได้มีคำสั่งแต่งตั้งคณะกรรมการกำหนดนโยบายและยกร่างกฎหมาย เพื่อจัดตั้งศูนย์กลางทางการเงินขึ้น เนื่องจากรัฐบาลได้แถลงนโยบายต่อรัฐสภา โดยมีเป้าหมายที่จะทำให้ประเทศไทยเป็นหนึ่งใน ศูนย์กลางทางการเงิน (Financial Hub) ของโลก



นายเผ่าภูมิ โรจนสกุล สมช.คลัง เป็นประธานกรรมการ ปลัดกระทรวงการคลัง เป็นรองประธานกรรมการ

กรรมการประกอบด้วย **ผู้ว่าการธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.)**, เลขาธิการคณะกรรมการกำกับและส่งเสริมการประกอบธุรกิจประกันภัย (คปภ.), เลขาธิการคณะกรรมการกฤษฎีกา, เลขาธิการสำนักงานคณะกรรมการกำกับหลักทรัพย์และตลาดหลักทรัพย์ (ก.ล.ต.), เลขาธิการคณะกรรมการป้องกันและปราบปรามการฟอกเงิน (ปปง.), เลขาธิการคณะกรรมการส่งเสริมการลงทุน (บีโอไอ), อธิบดีกรมการกงสุล, อธิบดีกรมพัฒนาธุรกิจการค้า, อธิบดีกรมสรรพากร, ผู้อำนวยการสำนักงานกิจการยุติธรรม, ผู้อำนวยการสำนักงานเศรษฐกิจการคลัง (สศค.), กรรมการและผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลท.), ประธานกรรมการสภาธุรกิจตลาดทุนไทย (FETCO), ประธานสมาคมธนาคารไทย, ประธานกรรมการสมาคมสถาบันการเงินของรัฐ, ประธานสมาคมธนาคารนานาชาติ, นายกสมาคมประกันชีวิตไทย, นายกสมาคมประกันวินาศภัยไทย, นายกสมาคมการค้าผู้ให้บริการชำระเงินทางอิเล็กทรอนิกส์ไทย, ประธานสมาคมการค้าผู้ประกอบการธุรกิจสินทรัพย์ดิจิทัลไทย, ศาสตราจารย์พิเศษ กิติพงษ์ อรุณพัฒน์พงศ์, นายพงษ์ศรัณย์ อัครชัยโสภณ, นายศุภกร คงสมจิตต์, นายฉัตริน จันทร์หอม, นายวรวิทย์ เรืองปีตาภรณ์ และนางสาวเบญจ สุพรรณกุล

หน้าที่และอำนาจ

1. ศึกษาและจัดทำนโยบายเพื่อผลักดันไทยเป็น ศูนย์กลางทางการเงิน รวมถึงร่างกฎหมายที่เกี่ยวข้อง
2. เชิญหน่วยงานรัฐและเอกชนให้ข้อมูลและ เอกสารหลักฐาน
3. แต่งตั้งคณะอนุกรรมการเพื่อตรวจสอบหรือ ปฏิบัติการตามที่เห็นสมควร
4. ปฏิบัติการตามที่รัฐมนตรีว่าการ กระทรวงการคลังมอบหมาย

แจก1หมื่น-ແຫ່ກອນคึกลุดซอปล นายกอั้งค้กคดปุ้ม

Source - มติชน

Thursday, September 26, 2024 at 07:34

ล้นพายุหมุนศก.ลูกแรก 3ล้านคนประเดิมรับเงิน มท.เข้มสกัดเจ้าหนีทวง
 ดีอีเตือนแก๊งคอลหลอก สปท.แจงจับตาค่าบาท
 พร้อมโอนเงินหมื่นกลุ่มเปราะบาง-พิการ วันที่ 2 อีก 4.5 ล้านคน หลัง
 วันแรก 3.17 ล้านคนได้รับเรียบร้อย ย้ำแบงก์ห้ามหักใช้หนี้เดิม นายกชชี่
 อัฒฉิต 1.45 แสนล้านเข้าระบบ สร้างพายุหมุนทาง เศรษฐกิจลูกใหญ่ ล้น
 เดินหน้าเฟส 2-3 ดิจิทัลวอลเล็ต ส.ส.ปช.แนะ'อั้งค์'จับเข้าคุยกุแบงก์ชาติ
 แก่บาทแข็ง-เลิกโจมตี สปท.

โอนเงินสด 10,000 บาท
กลุ่มเปราะบางเข้าบัญชีพร้อมเพย์ วันไหน?

25 กันยายน

- บัญชีผู้พิการ 2.6 ล้านคน และบัตรสวัสดิการแห่งรัฐ เลขหลังบัตรประชาชน ลงท้ายเลข 0

26 กันยายน

- บัตรสวัสดิการแห่งรัฐ เลขหลังบัตรประชาชน ลงท้ายเลข 1, 2, 3

27 กันยายน

- บัตรสวัสดิการแห่งรัฐ เลขหลังบัตรประชาชน ลงท้ายเลข 4, 5, 6, 7

30 กันยายน

- บัตรสวัสดิการแห่งรัฐ เลขหลังบัตรประชาชน ลงท้ายเลข 8, 9

ขอบคุณข้อมูลจาก กระทรวงการคลัง วันที่ 13 กันยายน 2567

องค์ประกอบคณะกรรมการ

- น.ส.แพทองธาร ชินวัตร นายกรัฐมนตรี เป็นประธานกรรมการ
- นายภูมิธรรม เวชยชัย รองนายกรัฐมนตรี และ รว.กลาโหม เป็นรองประธานกรรมการ คนที่ 1
- นายอนุทิน ชาญวีรกูล รองนายกรัฐมนตรี และ รว.มหาดไทย เป็นรองประธานกรรมการคนที่ 2
- นายพิชัย ชุณหวชิร รองนายกรัฐมนตรี และ รว.การคลัง เป็นรองประธานกรรมการคนที่ 3
- นายประเสริฐ จันทรรวงทอง รองนายกรัฐมนตรี และ รว.ดิจิทัลเพื่อเศรษฐกิจและสังคม เป็นรองประธานกรรมการคนที่ 4



<https://www.posttoday.com/business/713530>

กรรมการ

- นายพิชัย นริพทะพันธุ์ รว.พาณิชย์
- น.ส.จิราพร สินธุไพร รัฐมนตรีประจำสำนักนายกรัฐมนตรี
- นายชูศักดิ์ ศิรินิล รัฐมนตรีประจำสำนักนายกรัฐมนตรี
- นายจุลพันธ์ อมรวิวัฒน์ รว.คลัง
- นายเผ่าภูมิ โรจนสกุล รว.คลัง
- เลขาธิการนายกรัฐมนตรี
- ปลัดสำนักนายกรัฐมนตรี
- ปลัดกระทรวงมหาดไทย
- เลขาธิการคณะกรรมการกฤษฎีกา
- เลขาธิการสภาพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ (สศช.)
- ผู้อำนวยการสำนักงานงบประมาณ
- ผู้ว่าการธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.)
- ประธานกรรมการสำนักงานพัฒนารัฐบาลดิจิทัล
- ประธานสมาคมธนาคารไทย
- ประธานกรรมการสมาคมสถาบันการเงินของรัฐ

โดยมีปลัดกระทรวงการคลัง เป็นกรรมการและเลขาธิการ และผู้อำนวยการสำนักงานเศรษฐกิจการคลัง เป็นกรรมการและผู้ช่วยเลขาธิการ

นโยบายเร่งด่วน





- ปรับโครงสร้างหนี้ทั้งระบบ } + กลุ่มการเงิน คุณภาพหนี้จะดีขึ้น
- สนับสนุน SMEs } - แต่ถูกกดดันเรื่องการดูแลหนี้
- ลดราคาค่าพลังงานและสาธารณูปโภค
>>> - ลบต่อโรงไฟฟ้า ที่อิงรายได้กับ FT
- เร่งกระตุ้นเศรษฐกิจ พลักดันดิจิทัลวอลเล็ต
>>> + หุ้นค้าปลีก Inscip (CPALL, HMPRO, COM7, CRC, CPAXT)
- ส่งเสริมการท่องเที่ยว
>>> + กลุ่มโรงแรม ร้านอาหาร
- นำเศรษฐกิจนอกระบบภาษี/ใต้ดิน เข้าสู่ระบบภาษี
>>> จัดเก็บภาษีได้ดีขึ้น ใช้จ่ายงบประมาณได้มากขึ้น
รัฐสามารถกระตุ้นการใช้จ่ายได้มากขึ้น

นโยบายระยะกลาง-ยาว

- ส่งเสริมยานยนต์ไฟฟ้า
+ กลุ่มนิคมฯ (WHA) หรือ Supply Chain ของ EV
- หุ้นชิ้นส่วนฯ ที่ไม่สามารถปรับตัวได้
- ส่งเสริม Soft Power + กลุ่มท่องเที่ยว (CENTEL, ERW)
- เศรษฐกิจดิจิทัล Data Center
+ ADVANC, WHA, EPG, GULF
- มุ่งเป้าเป็น Financial Hub → Virtual Bank
+ GULF, ADVANC, KTB, SCB
- พัฒนาโครงสร้างคมนาคม + กลุ่มรับเหมาฯ (CK, STEC)
- ยกระดับสาธารณสุข + กลุ่มโรงพยาบาล (BCH, CHG)



รัฐบาลกระตุ้นแบบไหน จะดึงเศรษฐกิจไทยให้ฟื้นตัวเร็ว

	Weight of GDP	Contributions to growth rate of GDP	กึ่งนโยบายรัฐบาล ส่งเสริมการกระตุ้น GDP
	60%	2.4%	<ul style="list-style-type: none"> นโยบายการเงิน ← นโยบายลดหย่อนภาษี
 (Private + GOV)	21%	-1.4%	<ul style="list-style-type: none"> สนับสนุนการลงทุนของต่างชาติ ให้ประโยชน์ด้านภาษี ส่งเสริมการประมูลงานภาครัฐมากขึ้น
	16%	0.1%	<ul style="list-style-type: none"> เงินเดือนข้าราชการ ภาครัฐซื้อสินค้าจากเอกชนมากขึ้น
 72% (Net Export 3.0%)	3.2% (Exports & Services)		<ul style="list-style-type: none"> นโยบายกระตุ้นการท่องเที่ยว สนับสนุนสินค้าใหม่ๆ สร้างแรงจูงใจต่อพืชเศรษฐกิจ อาทิ ทุเรียน กล้วย
100%			

Contributions to growth rate of gross domestic product , chain volume measures [reference year = 2002] (original)

	Private final consumption expenditure (1)	General government final consumption expenditure (2)	Gross fixed capital formation (3)	Change in inventories (4)	Exports of goods and services (5)	Exports of goods (6)	Exports of services (7)	Gross domestic product (CVM) (11)
2022p	3.2	0.0	0.5		3.6	0.6	3.0	2.5
Q1	1.3	1.2	0.2		6.4	4.6	1.9	1.9
Q2	3.6	0.5	-0.2		4.8	2.4	2.3	2.4
Q3	5.0	-0.3	1.3		4.8	1.2	3.6	4.4
Q4	3.2	-1.3	0.9		-1.3	-5.6	4.3	1.3
2023p1	3.9	-0.8	0.3		1.4	-1.6	3.0	1.9
Q1	3.0	-1.0	0.7		1.1	-3.2	4.3	2.6
Q2	4.1	-0.8	0.1		0.8	-2.9	3.8	1.8
Q3	4.6	-1.0	0.4		1.0	-1.6	2.6	1.4
Q4	3.9	-0.5	-0.1		2.6	1.2	1.4	1.7
2024p1								
Q1r	3.6	-0.3	-1.0		1.6	-1.1	2.6	1.6
Q2	2.4	0.1	-1.4		3.2	1.1	2.2	2.3

กระตุ้นที่ C

CPALL, COM7

กลุ่มหุ้นแนะนำ

รับเหมา CK

ICT BBIK

Table 2.2 : Contributions to growth rate of gross domestic product , chain volume measures [reference year = 2002] (original)
https://www.nesdc.go.th/nesdb_en/ewt_news.php?nid=4516&filename=index

#Vision for Thailand 2024

DAOL SEC



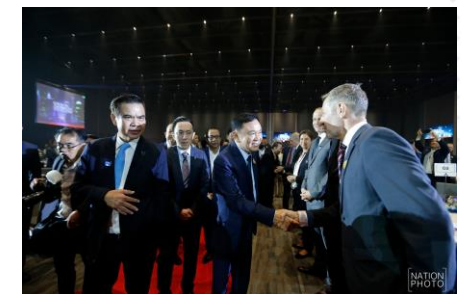
NATION GROUP
Dinner Talk
VISION FOR THAILAND
22 Thursday August 2024
17:30-21:00
@Paragon Hall, Floor 5, Siam Paragon
เต็มทุกที่นั่ง

“
ผมเนี่ยโดนเยอะที่สุด
เห็นมรดก เห็นสวรรค์
ในชาติเดียวกัน
แต่ผมคิดว่า
อดีตก็อดีตไป
ไม่ใช่ความจำเสื่อม
จำไม่ได้ ..จำได้หมด
แต่ผมอยู่กับปัจจุบัน
”
ทักษิณ ชินวัตร
อดีตนายกรัฐมนตรี
กล่าวในงาน "Vision for Thailand 2024"
จัดโดย แชน กรุ๊ป (22 ส.ค.67)
กรุงเทพฯธุรกิจ

22 ส.ค. 2567
กรุงเทพฯธุรกิจ
"ทักษิณ" แทะหับคำตังแบงก์
ลงครึ่งหนึ่ง จาก 0.47%
นำมาช่วยลดหนี้เสียประชาชน



“
จินเขาดันคุณต่ำ
ผลิตเยอะ ผลิตเกิน
ก็ขายประเทศอื่น
ต้องให้ SMEs บ้านเรา
เป็น 'Smart SMEs'
ต้องแก้ทีละสเต็ป
เพื่อให้แข่งขันกับคนอื่นได้
ไม่ได้เรียงเงินค่าเงิน
แต่ต้องแข่งขัน
อย่างเท่าเทียมกัน
”
ทักษิณ ชินวัตร
อดีตนายกรัฐมนตรี
กล่าวในงาน "Vision for Thailand 2024"
จัดโดย แชน กรุ๊ป (22 ส.ค.67)
กรุงเทพฯธุรกิจ



ที่มาของภาพ : <https://www.facebook.com/bangkokbiznews>

ลำดับโอเดียเศรษฐกิจ “ทักษิณ ชินวัตร” เรื่องไหนเกิดได้เร็วสุด

DAOL SEC

1	แจกเงินดิจิทัล กระตุ้นการบริโภค	
2	ดึงค่ายรถ EV ประกอบรถพวงมาลัยขงามาผลิตในไทย	
3	ตั้งกองทุนวายุภักษ์ พยุงตลาดหุ้นที่ราคาต่ำกว่าเป็นจริง	
4	ลดภาษีเงินได้นิติบุคคล และบุคคลธรรมดา คั้นภาษีให้กับคนที่อยู่ในระบบแต่มีรายได้น้อย	
5	ตั้งองค์กรขึ้นมาซื้อหนี้ Npl's จากธนาคาร เพื่อปรับโครงสร้างภาคประชาชน Hair cut หนี้, หนุนรปท.ลดเก็บเงินนำส่งกองทุนฟื้นฟูฯ จากแบงก์ ไปลดดอกเบี้ย	
6	Soft Power มวยไทย อาหารไทย ดาราไทย ไปเวทีโลก ,สนับสนุน E-Sport พัฒนาเกม	
7	การพัฒนาแหล่งพลังงานในพื้นที่ทับซ้อนไทย-กัมพูชา	
8	การปฏิรูปการเกษตร : การใช้ R&D เพื่อปรับปรุงพันธุ์ข้าวและเพิ่มความมั่นคงทางอาหาร	
9	สร้างรถไฟฟ้าความเร็วสูงไทยจีน กทม. หนองคาย	
10	สร้าง Entertainment Complex ใน กทม. มูลค่า 1 แสนล้าน ต่างจังหวัด 5 หมื่นล้าน	
11	ปรับการถือครองที่ดินของต่างชาติเป็น 99 ปี หกคสัญญาคตกเป็นของรัฐ	
12	เอาธุรกิจใต้ดิน มาไว้บนดิน	
13	Off Shore Financial HUB	
14	โครงการ Land Bridge	

กองทุนวายุภักษ์

“กระทรวงการคลังตั้งเป้าในการระดม
ทุนประมาณ 100,000 – 150,000 ล้าน
บาท สำหรับนักลงทุนทั่วไป นักลงทุน
รายย่อย ลงทุนขั้นต่ำคนละ 5,000 บาท
ระยะเวลาการลงทุนเบื้องต้น 10 ปี ”

คืนชีพ

กองทุนรวม
วายุภักษ์

เงินลงทุน 1.5 แสนล้านบาท

กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง
VAYUPAK FUND 1
อายุขั้นต่ำ 10 ปี

สร้างสรรโดย
FILAB

<https://www.moneybuffalo.in.th/mutual-fund/vayupak-fund>

วายุภักษ์หนึ่งเข้าเทรดวันนี้ สบช่องเก็บหุ้นช่วงดัชนีลง

Source - ข่าวหุ้น

Monday, October 07, 2024 at 05:24

DAOL SEC

วันนี้ (7 ต.ค.) “พีชัย” รองนายกฯ และรมว.คลัง เคาะระชังเปิดเทรดหน่วยลงทุนของกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง “ชวินดา” ผู้บริหาร บลจ.กรุงไทย (KTAM) ลั่น! เดินหน้าป็นผลตอบแทนให้นักลงทุนตามกรอบเป้าหมาย 3-9% ย้ำกองทุนฯ เน้นชีพพอร์ตนักลงทุนได้อย่างดีในช่วงตลาดขาลง ส่งชกช่วงดัชนีวูบเป็นจังหวะดีเข้าเก็บหุ้นคุณภาพ เพย 4 วันแรกเดือน ต.ค. นักลงทุนสถาบันลุยซื้อหุ้นกว่า 1.4 หมื่นล้านบาท

ผู้สื่อข่าวรายงานว่า วันนี้ (7 ต.ค. 2567) กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง หน่วยลงทุนประเภท ก. (VAYU 1) จะเปิดการซื้อขายหน่วยลงทุนวันแรกในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลท.) เวลา 09.00-10.20 น. ณ หอประชุมศุภกรีย์ แก้วเจริญ ชั้น 3 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยมีนายพีชัย ชุนหวจร รองนายกรัฐมนตรี และรัฐมนตรีว่าการกระทรวงการคลัง เป็นประธาน พร้อมด้วย นายลวรณ แสงสนิท ปลัดกระทรวงการคลัง นายริบัติ วัฒนกุล ผู้อำนวยการ สำนักงานคณะกรรมการนโยบายรัฐวิสาหกิจ (สคร.)

นายอัสสเดช คงสิริ กรรมการและผู้จัดการ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย นายวราห์ สุจริตกุล ประธานกรรมการ บริษัทหลักทรัพย์ ฟินันซ่า จำกัด ในฐานะที่ปรึกษาทางการเงิน กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง นางชวินดา หาญรัตนกุล กรรมการผู้จัดการ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน) หรือ KTAM ในฐานะบริษัทจัดการกองทุนรวมวายุภักษ์ฯ และนายธนโชติ รุ่งสิริวัฒน์ กรรมการผู้จัดการ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน) หรือ MFC ในฐานะบริษัทจัดการกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

นางชวินดา หาญรัตนกุล กรรมการผู้จัดการ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน) หรือ KTAM เปิดเผยกับ “ข่าวหุ้นธุรกิจ” ว่า กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง (VAYU 1) เริ่มซื้อขายบนกระดานตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลท.) วันนี้ (7 ต.ค. 2567) วันแรก สิ่งที่ผู้จัดการกองทุนในฐานะบริษัทจัดการคาดหวังอันดับแรกคือ ผลักดันผลตอบแทนจากการลงทุนของนักลงทุนให้เป็นไปตามกรอบเป้าหมายที่ระดับ 3-9% ให้ได้

ขณะเดียวกัน กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง มีเป้าหมายหลักนอกจากช่วยเพิ่มสภาพคล่องให้กับตลาดหุ้นไทยแล้ว ยังมีเป้าหมายเพื่อสนับสนุนนักลงทุนในการออมเงินระยะยาวได้อย่างแข็งแกร่ง ซึ่งกองทุนฯ นี้จะสามารถลดความเสี่ยงในช่วงตลาดขาลงได้ดี

สำหรับหลักทรัพย์กลุ่มเป้าหมาย ยังเป็นหลักทรัพย์ที่มีคุณภาพสูง มีการเติบโตแข็งแกร่งเป็นหลัก อย่างไรก็ตามกลยุทธ์ลงทุนของกองทุนฯ เน้นจับจังหวะตามสภาพตลาดในขณะนั้น ๆ เป็นสำคัญ โดยเฉพาะช่วงที่ดัชนีปรับตัวลงถือเป็นจังหวะดีในการเข้าลงทุน

ที่มา: นสพ.ข่าวหุ้น ฉบับวันที่ 7 ต.ค. 2567

กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่งใน (ชนิดผู้ถือหน่วยลงทุน ประเภท ก.) (VAYUA)

มูลค่าหน่วยลงทุน ณ
11/10/2567

10.0270
หน่วย : ตามสกุลเงินของกองทุน

ข้อมูลทั่วไป | เอกสารเผยแพร่ **NAV ย้อนหลัง**

เปรียบเทียบกองทุน [Export File Excel](#)

วันที่ (วัน/เดือน/ปี)	มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน	NAV
11/10/2567	150,405,737,704.92	10.027
10/10/2567	150,122,950,819.67	10.0082
09/10/2567	150,110,655,737.71	10.0073
08/10/2567	150,157,439,163.48	10.0105
07/10/2567	150,258,196,721.31	10.0172
04/10/2567	150,147,540,983.61	10.0098
03/10/2567	150,036,885,245.90	10.0024
02/10/2567	150,024,590,163.93	10.0016
01/10/2567	150,036,885,245.90	10.0024

Daily Outright Trading Value (Historical Data)

Unit: THB Mln.

As of Date	Investor Group	Buy	Sell	Net
04-10-24	Asset Mgmt. Companies	13,904	22,158	(8,254)
03-10-24	Asset Mgmt. Companies	42,048	10,815	31,233
02-10-24	Asset Mgmt. Companies	17,017	9,366	7,651
01-10-24	Asset Mgmt. Companies	108,427	10,010	98,417
30-09-24	Asset Mgmt. Companies	27,463	9,555	17,909
27-09-24	Asset Mgmt. Companies	16,277	9,268	7,009
26-09-24	Asset Mgmt. Companies	28,827	8,689	20,138
25-09-24	Asset Mgmt. Companies	22,950	12,076	10,874
24-09-24	Asset Mgmt. Companies	38,081	9,021	29,061
23-09-24	Asset Mgmt. Companies	26,299	9,400	16,899
20-09-24	Asset Mgmt. Companies	12,378	11,181	1,197
19-09-24	Asset Mgmt. Companies	16,853	12,108	4,745

ThaiBMA Dealer Price Report as of 01 October 2024

Filter Bond	Filter Type of Issue	Filter Coupon Rate (%)	Filter Maturity Date	Filter TTM (Years)	Filter Trading Value (THB mln.)
Government Bond : Outright trading value THB 35,531.94 mln.					
Government	CB25102B	0.00	02-Jan-25	0.25	54,708.62
Government	CB25002A	0.00	02-Oct-25	1.00	27,271.70
Government	LB346A	GB	17-Jun-34	9.72	5,644.46
Government	CB24D12B	0.00	12-Dec-24	0.20	4,446.00
Government	LB27NA	GB	17-Nov-27	3.13	4,431.53
Government	CB24D06A	0.00	06-Dec-24	0.18	4,206.95
Government	LB293A	GB	17-Mar-29	4.46	3,198.37
Government	CB25814A	0.00	14-Aug-25	0.87	3,120.11
Government	LB436A	GB	17-Jun-43	18.72	3,092.55
Government	LB273A	GB	17-Mar-27	2.46	2,811.84

เรื่องเงินขายหุ้นกองทุนวายุภักษ์ (20 ก.ย.)
แล้วนำไปพักในตลาดพันธบัตร

ข้อมูล ThaiBMA มีเงินจากนักลงทุนที่เป็น
กองทุนรวม เข้ามาซื้อพันธบัตรในระดับที่สูง
ผิดปกติ เพียงวันเดียว คือ 1 ต.ค. เป็น Buy =
1.08 แสนล้านบาท

เมื่อเข้าไปดูว่าซื้อพันธบัตร series ไหนมาก
มี 2 ตัว คือ CB25102B และ CB25002A
ซึ่งเป็นตั๋วเงินที่ออกโดย ธปท. มีอายุ 3 เดือน
และ 1 ปี ตามลำดับ

- ปริมาณการซื้อขายหุ้นในตลาด
- การได้มาของหุ้นในกองทุน
 1. ซื้อเองในตลาด
 2. ให้ Broker ซื้อเก็บไว้
 3. ซื้อจากรัฐบาล
- วันนี้จะซื้อต่ออีกมั๊ย

มูลค่าซื้อขาย

มูลค่าซื้อขายสะสม

ข้อมูล ณ วันที่ 08 ต.ค. 2567

สรุปมูลค่าการซื้อขายสิ้นวัน

54,745.88 ล้านบาท

นักลงทุน	ซื้อ (ล้านบาท)	ขาย (ล้านบาท)	สุทธิ
สถาบัน	8,618.71	6,324.29	+2,294.42
บัญชีบล.	3,727.74	3,676.19	+51.55
ต่างประเทศ	26,763.89	27,106.84	-342.95
ในประเทศ	15,635.55	17,638.57	-2,003.02



หุ้นที่กองทุนวายุภักษ์ ณ 30 มิ.ย.67

<< highlight หุ้นที่คาดว่าจะถูกยกขึ้น จะซื้อเข้า โดยพิจารณาจาก Dividend Yield ที่สูง >>

หุ้น	ผู้ออก	มูลค่าตาม ราคาตลาด	สัดส่วน	Dividend Yield
PTT	บมจ. ปตท.	112,898,207,500.00	35.07%	5.53
SCB	บมจ. เอสซีบี เอกซ์	80,885,714,600.00	25.13%	8.62
TTB	ธนาคารทหารไทยธนชาต จำกัด (มหาชน)	17,181,428,173.00	5.34%	5.82
KTB	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KTB)	10,516,955,117.00	3.27%	4.87
BCP	บมจ. บางจาก คอร์ปอเรชั่น	10,243,972,500.00	3.18%	5.77
AOT	บมจ. ท่าอากาศยานไทย	6,005,699,700.00	1.87%	1.04
ADVANC	บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	5,371,801,600.00	1.67%	3.66
BDMS	บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ	2,858,430,100.00	0.89%	2.30
BSRC	บมจ. บางจาก ศรีราชา	2,790,475,500.00	0.87%	3.64
GULF	บมจ. กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์	2,723,631,076.00	0.85%	1.66
KBANK	ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	2,278,791,350.00	0.71%	4.98
SCC	บมจ. ปูนซิเมนต์ไทย	2,196,315,000.00	0.68%	2.54
BBL	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	1,879,395,750.00	0.58%	4.82
CPN	บมจ. เซ็นทรัลพัฒนา	1,800,061,575.00	0.56%	2.67
TRUE	บมจ. ทู คอร์ปอเรชั่น	1,774,609,602.60	0.55%	n.a.
CPF	บมจ. เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	1,704,918,740.00	0.53%	2.92
BH	บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์	1,472,638,700.00	0.46%	1.90
MINT	บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	1,369,137,300.00	0.43%	1.73
CRC	บมจ. เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น	1,355,690,625.00	0.42%	1.75
SCGP	บมจ. เอสซีจี แพคเกจจิ้ง	1,071,685,957.60	0.33%	1.97
HMPRO	บมจ. โฮมโปร ดิสทริบิวชั่น	938,224,891.60	0.29%	3.87
BKIH	บมจ. บั๊กไอ โฮลดิ้งส์	918,559,334.00	0.29%	n.a.
INTUCH	บมจ. อินทิจ โฮลดิ้งส์	915,328,700.00	0.28%	3.92
IVL	บมจ. อินโดรามา เวนเจอร์ส	807,814,800.00	0.25%	1.93
CENDEL	บมจ. โรงแรมเซ็นทรัลพลาซา	804,118,650.00	0.25%	1.16
SCCC	บมจ. ปูนซิเมนต์นครหลวง	759,303,740.00	0.24%	5.72
BTS	บมจ. กางดงและรถไฟฟ้ากรุงเทพ	721,681,875.00	0.22%	0.78
KCE	บมจ. เคซีอี อีเลคโทรนิคส์	625,695,000.00	0.19%	3.09
OR	บมจ. ปตท. น้ำมันและการค้าปลีก	583,832,224.00	0.18%	2.60
GLOBAL	บมจ. สยามโกลบอลเฮ้าส์	566,026,650.00	0.18%	1.36

DAOL SEC

เราคาดว่า หุ้นกลุ่มธนาคาร จะเป็นกลุ่มแรกๆ ที่ กองทุนฯ จะเลือกเข้า ด้วย 3 เหตุผล คือ

1. Dividend Yield สูง
2. ผลการดำเนินงานดีมาก
3. ราคาหุ้นยังขึ้นมาไม่มาก (เมื่อเทียบกับช่วง peak)

3 ธนาคารที่ เล็งไว้ **TTB, KTB, KBANK**

เราคาดการณ์จากตัวเลข net buy ของ Foreign มีความเป็นไปได้ว่า ตัวเลข net buy หุ้นธนาคารในเดือน ก.ย. หลายตัว อาจเตรียมการเพื่อส่งมอบหุ้นครั้งนี้

ซึ่งจะรู้ชัด น่าจะเป็น วันที่ 1 ต.ค. เป็นต้นไป

WEEK

หุ้นที่มูลค่าการถือครองของนักลงทุนต่างประเทศเพิ่ม/ลด มากที่สุด

27-Sep-24 : (เปรียบเทียบกับสัปดาห์ก่อน)

รวบรวมโดย DAOL Strategy

หุ้นที่มี % การถือสูงขึ้น

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน* เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
KBANK	1.26%	4,496
BDMS	0.60%	2,894
CPALL	0.20%	1,192
ADVANC	0.11%	855
MFC	16.41%	593
KTB	0.20%	579
CPNREIT	0.75%	357
INTUCH	0.10%	297
PTTGC	0.17%	236
CPF	0.08%	159

หุ้นที่มี % การถือลดลง

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน* เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
PTTEP	-0.14%	-743
SCB	-0.17%	-633
BBL	-0.19%	-548
BH	-0.18%	-389
TOP	-0.34%	-386
SPALI	-0.69%	-277
HMPRO	-0.18%	-251
BCP	-0.45%	-234
TPIPL	-0.98%	-227
EA	-0.65%	-220

หมายเหตุ : มูลค่าเงินลงทุนที่เพิ่ม/ลด คำนวณจากจำนวนหุ้นที่เปลี่ยนแปลง โดยใช้ราคาปิดล่าสุด เพื่อเปรียบเทียบ (ไม่ใช่มูลค่าที่ลดลงจริงๆ)

source : Bloomberg , SETSMART , SET

MONTH to DATE

หุ้นที่มูลค่าการถือครองของนักลงทุนต่างประเทศเพิ่ม/ลด มากที่สุด

27-Sep-24 : (เปรียบเทียบกับวันสุดท้ายของเดือนก่อน)

รวบรวมโดย DAOL Strategy

หุ้นที่มี % การถือสูงขึ้น

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน* เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
KBANK	3.58%	12,775
BDMS	1.20%	5,788
BBL	1.25%	3,602
BH	1.58%	3,414
CPALL	0.56%	3,338
KTB	0.74%	2,142
GULF	0.26%	1,729
AOT	0.18%	1,646
ALPHAX	25.36%	1,644
SCB	0.40%	1,489

หุ้นที่มี % การถือลดลง

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน* เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
PTTEP	-0.90%	-4,778
IVL	-1.36%	-1,857
CPF	-0.57%	-1,132
BCP	-2.07%	-1,077
PTT	-0.10%	-961
AWC	-0.78%	-942
KEX	-9.44%	-931
TISCO	-0.89%	-691
EA	-1.87%	-632
TOP	-0.43%	-488

หมายเหตุ : มูลค่าเงินลงทุนที่เพิ่ม/ลด คำนวณจากจำนวนหุ้นที่เปลี่ยนแปลง โดยใช้ราคาปิดล่าสุด เพื่อเปรียบเทียบ (ไม่ใช่มูลค่าที่ลดลงจริงๆ)

source : Bloomberg , SETSMART , SET



ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงปานกลางค่อนข้างสูง

ความเสี่ยงของกองทุน ระดับ 5 หมายถึง กองทุนรวมผสม ที่มี net exposure ได้ทั้งในตราสารทุน ตราสารหนี้หรือทรัพย์สินทางเลือก

ข้อมูลกองทุนรวม

วันจดทะเบียนกองทุน 01/12/46

วันเริ่มต้น class 01/10/67

นโยบายการจ่ายเงินปันผล มี

อายุกองทุน ไม่กำหนดอายุโครงการ

ผู้จัดการกองทุนรวม

นาง แสงจันทร์ ลี ตั้งแต่ 07/09/49 บลจ. กรุงเทพ

นาย ศรชัย เตริยมารกุล ตั้งแต่ 12/11/63 บลจ. กรุงเทพ

นายโกเมน นิยมวานิช ตั้งแต่ 01/09/57 บลจ. เอ็มเอฟซี

นายพิพัฒน์ นรนนท์ ตั้งแต่ 14/02/54 บลจ. เอ็มเอฟซี

สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน

ทรัพย์สิน	% NAV
หุ้นสามัญ	88.36
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย	7.01
ตัวเงินคลัง	1.48
เงินฝากธนาคาร	1.07
หุ้นกู้	0.62
สินทรัพย์และหนี้สินอื่นๆ	0.45
หน่วยลงทุน ตราสารทุน	0.32
พันธบัตรรัฐบาล	0.27
หน่วยลงทุนในกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน	0.18
ตัวแลกเงิน	0.16
หุ้นบุริมสิทธิ	0.05
ใบสำคัญแสดงสิทธิที่จะซื้อหุ้น	0.02

ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก

ทรัพย์สิน	% NAV
บมจ. ปตท.	35.07
บมจ. เอสซีบี เอกซ์	25.03
ธนาคารทหารไทยธนชาต จำกัด (มหาชน)	5.54
ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	3.36
บมจ. บางจาก คอร์ปอเรชั่น	3.03

การจัดสรรการลงทุนในต่างประเทศ

ประเทศ	% NAV
สหรัฐอเมริกา	0.32

หมายเหตุ : ข้อมูล ณ วันที่ 30 สิงหาคม 2567

นโยบายการลงทุน

- ลงทุนหุ้น SET100 ที่มีคะแนน SET ESG Ratings 3 อันดับแรกขึ้นไป (ระดับ A ขึ้นไป)
- ลงทุนกองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐาน, กองทุนรวมอสังหาริมทรัพย์, และกรีสต์เพื่อการลงทุน ที่มีผลตอบแทนและมีแนวโน้มเติบโตสูง
- ลงทุนหุ้นนอก SET100 ที่แนวโน้มผลประกอบการดี และมีคะแนน SET ESG Ratings สูงสุด 2 อันดับแรก (ระดับ AA ขึ้นไป)

ผลตอบแทน

- จ่ายเงินปันผลผู้ถือหน่วยประเภท ก. อย่างน้อยปีละ 2 ครั้ง
- อัตราผลตอบแทนขั้นต่ำ 3% ต่อปี อัตราคงที่ตลอด 10 ปี
- อัตราผลตอบแทนขั้นสูง 9% ต่อปี อัตราคงที่ตลอด 10 ปี

การคุ้มครองเงินลงทุน

- ผู้ถือหน่วยประเภท ก. จะได้รับชำระคืนเงินลงทุนจากมูลค่า NAV ก่อนผู้ถือหน่วยประเภท v. (ผู้ถือหน่วยประเภท v. เป็นผู้รับผลขาดทุน)

ขั้นต่ำการจองซื้อ

- ลงทุนขั้นต่ำ 1,000 หน่วย (1,000 บาท) และเพิ่มเป็นทวีคูณของ 100 หน่วย (1,000 บาท)

การซื้อ-ขายหน่วยลงทุน

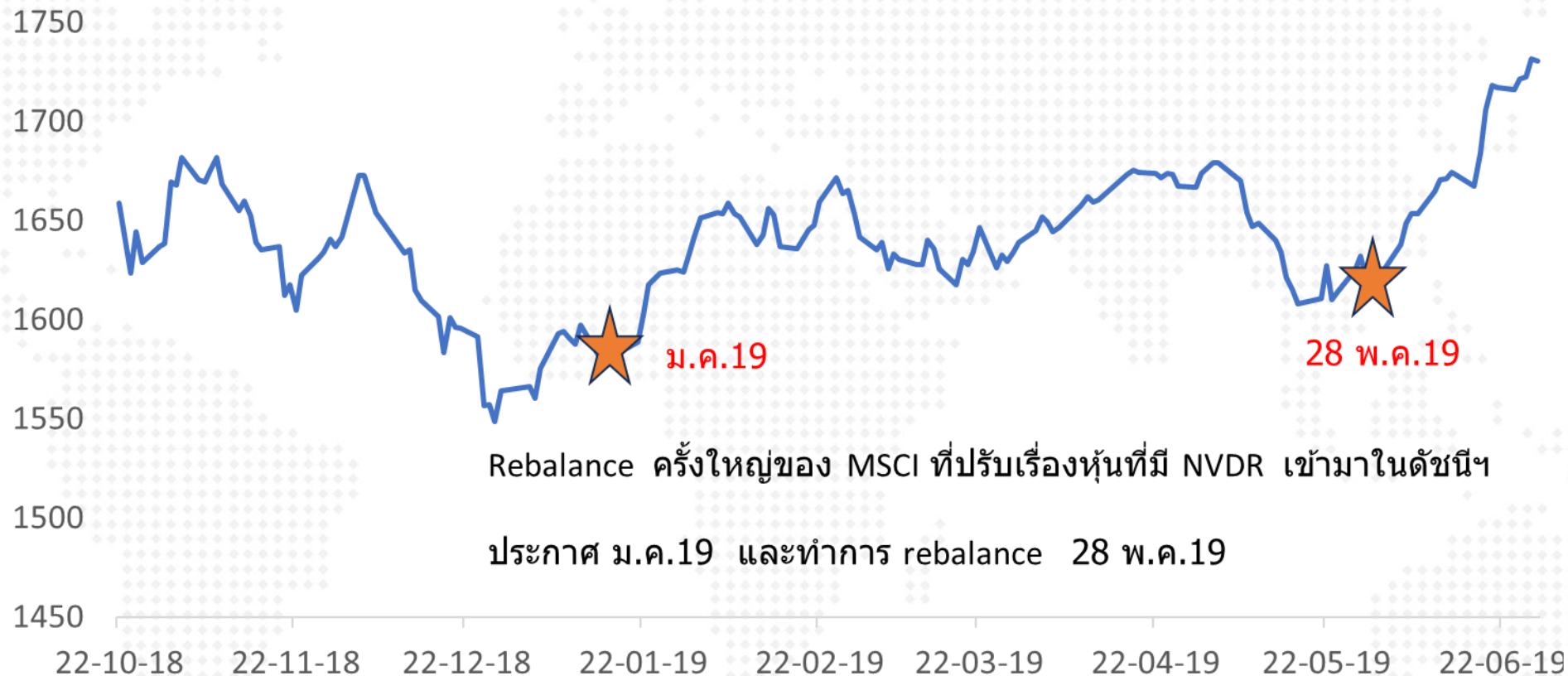
- **ซื้อ:** เสนอขายเพียงครั้งเดียว จากนั้นผู้ลงทุนสามารถซื้อขายหน่วยลงทุนได้ทุกวันทำการ
- **ขาย:** สามารถขายคืนได้ทุกวันทำการตลท. ตลอดระยะเวลา 10 ปี หากกองทุนจะระดมทุนหรือไม่ระดมทุนต่อ จะมีการแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้า

เงื่อนไขการถือครอง	ผลตอบแทนรายปีและการชำระคืนเงินลงทุน
1. กรณีถือหน่วยลงทุนตั้งแต่เริ่มต้นจนครบระยะเวลาการลงทุนเบื้องต้น 10 ปี	<ul style="list-style-type: none"> • ต้นทุนต่อหน่วย = มูลค่าที่ตราไว้ ("Par") = 10.00 บาท • ได้รับเงินปันผลตามผลตอบแทนจริงของกองทุนรวม ไม่น้อยกว่า 0.30 บาทต่อปี และไม่เกินกว่า 0.90 บาทต่อปี โดยคิดจาก Par 10.00 บาท คุณอัตราผลตอบแทนที่ได้รับต่อปี • เมื่อครบ 10 ปี ได้รับเงินลงทุนคืน <ul style="list-style-type: none"> - 10.00 บาท กรณี NAV รวมของกองทุนรวมสูงกว่า 150,000 ล้านบาท หรือ - น้อยกว่า 10.00 บาท กรณี NAV รวมของกองทุนรวมลดลงอย่างมากจากปัจจัยภายนอก เช่น การปรับตัวลดลงอย่างรุนแรงของดัชนีตลาดหลักทรัพย์ฯ และทำให้ NAV รวมของกองทุนรวมต่ำกว่า 150,000 ล้านบาท
2. กรณีถือหน่วยลงทุนตั้งแต่เริ่มต้นและขายหน่วยลงทุนในตลาดรองก่อนครบระยะเวลาการลงทุนเบื้องต้น 10 ปี	<ul style="list-style-type: none"> • ต้นทุนต่อหน่วย = Par = 10.00 บาท • ได้รับเงินปันผลตามผลตอบแทนจริงของกองทุนรวม ไม่น้อยกว่า 0.30 บาทต่อปี และไม่เกินกว่า 0.90 บาทต่อปี โดยคิดจาก Par 10.00 บาท คุณอัตราผลตอบแทนที่ได้รับต่อปี • ขายหน่วยลงทุนในตลาดรองในราคาตลาดซึ่งอาจจะสูงหรือต่ำกว่า NAV <ul style="list-style-type: none"> - ได้เงินลงทุนคืน 9.95 บาท ลบค่าธรรมเนียม⁽¹⁾ กรณีราคาตลาดต่ำกว่า NAV - ได้เงินลงทุนคืน 10.10 บาท ลบค่าธรรมเนียม⁽¹⁾ กรณีราคาตลาดสูงกว่า NAV
3. กรณีซื้อหน่วยลงทุนในตลาดรองและถือจนครบระยะเวลาการลงทุนเบื้องต้น 10 ปี	<ul style="list-style-type: none"> • ต้นทุนต่อหน่วย = ราคาในตลาดรอง บวกค่าธรรมเนียม⁽¹⁾ = 10.22 บาท • ได้รับเงินปันผลตามผลตอบแทนจริงของกองทุนรวม ไม่น้อยกว่า 0.30 บาทต่อปี และไม่เกินกว่า 0.90 บาทต่อปี โดยคิดจาก Par 10.00 บาท คุณอัตราผลตอบแทนที่ได้รับต่อปี • ในกรณีนี้อัตราผลตอบแทนที่ผู้ลงทุนได้รับเมื่อคำนวณจากต้นทุนต่อหน่วย จะต่ำกว่าอัตราผลตอบแทนที่คำนวณจาก Par • เมื่อครบ 10 ปี ได้รับเงินลงทุนคืน <ul style="list-style-type: none"> - 10.00 บาท กรณี NAV รวมของกองทุนรวมสูงกว่า 150,000 ล้านบาท หรือ - น้อยกว่า 10.00 บาท กรณี NAV รวมของกองทุนรวมลดลงอย่างมากจากปัจจัยภายนอก เช่น การปรับตัวลดลงอย่างรุนแรงของดัชนีตลาดหลักทรัพย์ฯ และทำให้ NAV รวมของกองทุนรวมต่ำกว่า 150,000 ล้านบาท

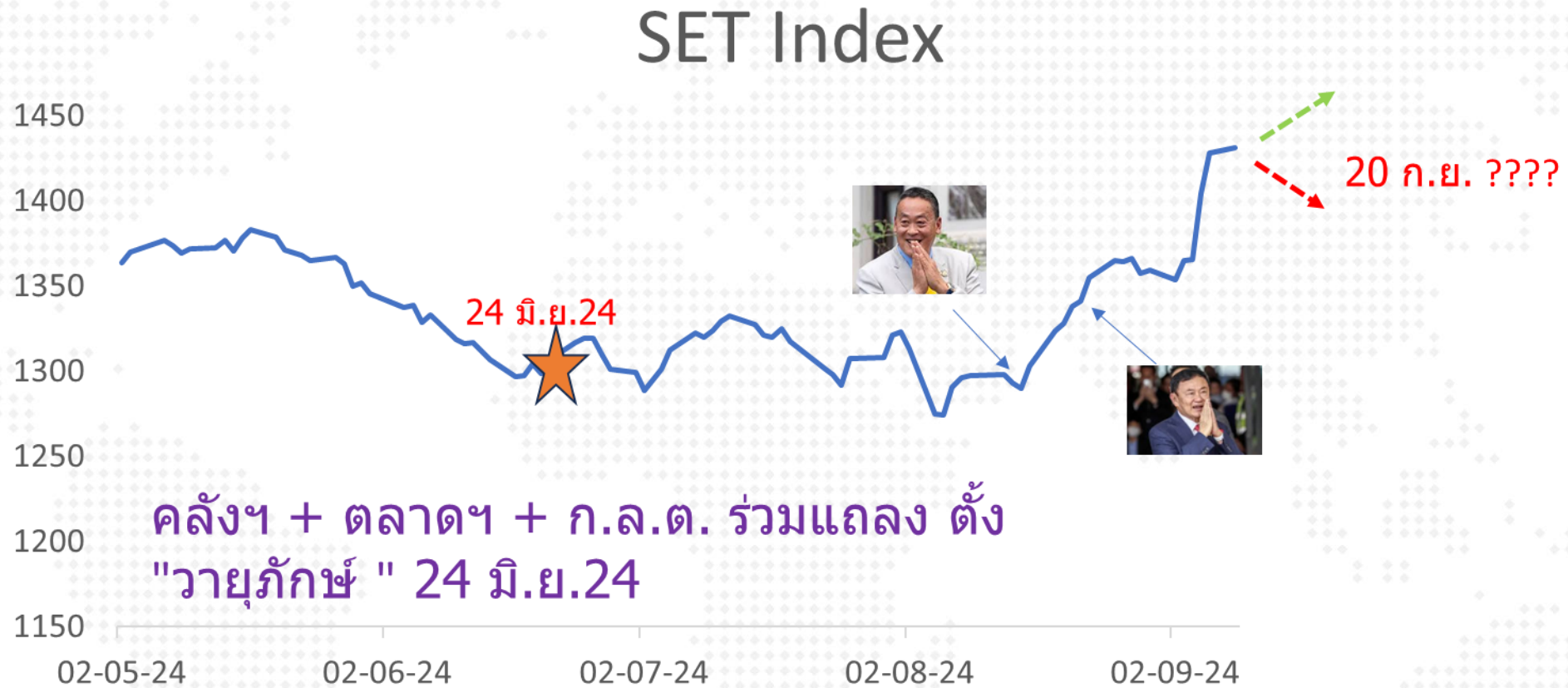
หมายเหตุ: (1) ค่าธรรมเนียม เช่น ค่าธรรมเนียมตามที่นายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์กำหนด เป็นต้น

การไม่ได้รับความคุ้มครอง เงินลงทุนและผลตอบแทน ขั้นต่ำของผู้ถือหน่วยลงทุน ประเภท ก. กรณีที่ซื้อหรือ ขายหน่วยลงทุนในตลาดรอง

SET Index



คลังฯ เผยว่า จะนำ “วายุภักษ์” กลับมาอีกครั้ง 24 มิ.ย.24



20 อันดับหุ้นกองทุนฯ วายุภักษ์ หนึ่ง

รายงานรอบระยะเวลาหกเดือน (30 มิ.ย. 67)

ประเภท	หุ้น	ผู้ออก	มูลค่าตาม ราคาตลาด	สัดส่วน
หุ้นสามัญ	PTT	บมจ. ปตท	112,898,207,500.00	35.07%
หุ้นสามัญ	SCB	บมจ. เอสซีบี เอกซ์	80,885,714,600.00	25.13%
หุ้นสามัญ	TTB	ธนาคารทหารไทยธนชาติ จำกัด (มหาชน)	17,181,428,173.00	5.34%
หุ้นสามัญ	KTB	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KTB)	10,516,955,117.00	3.27%
หุ้นสามัญ	BCP	บมจ. บางจาก คอร์ปอเรชั่น	10,243,972,500.00	3.18%
หุ้นสามัญ	AOT	บมจ. ท่าอากาศยานไทย	6,005,699,700.00	1.87%
หุ้นสามัญ	ADVANC	บมจ. แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส	5,371,801,600.00	1.67%
หุ้นสามัญ	BDMS	บมจ. กรุงเทพดุสิตเวชการ	2,858,430,100.00	0.89%
หุ้นสามัญ	BSRC	บมจ. บางจาก ศรีราชา	2,790,475,500.00	0.87%
หุ้นสามัญ	GULF	บมจ. กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์	2,723,631,076.00	0.85%
หุ้นสามัญ	KBANK	ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	2,278,791,350.00	0.71%
หุ้นสามัญ	SCC	บมจ. ปูนซิเมนต์ไทย	2,196,315,000.00	0.68%
หุ้นสามัญ	BBL	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	1,879,395,750.00	0.58%
หุ้นสามัญ	CPN	บมจ. เซ็นทรัลพัฒนา	1,800,061,575.00	0.56%
หุ้นสามัญ	TRUE	บมจ. ทู คอร์ปอเรชั่น	1,774,609,602.60	0.55%
หุ้นสามัญ	CPF	บมจ. เจริญโภคภัณฑ์อาหาร	1,704,918,740.00	0.53%
หุ้นสามัญ	BH	บมจ. โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์	1,472,638,700.00	0.46%
หุ้นสามัญ	MINT	บมจ. ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล	1,369,137,300.00	0.43%
หุ้นสามัญ	CRC	บมจ. เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น	1,355,690,625.00	0.42%
หุ้นสามัญ	SCGP	บมจ. เอสซีจี แพคเกจจิ้ง	1,071,685,957.60	0.33%

หลักทรัพย์ถือครองโดยกระทรวงการคลัง

หลักทรัพย์ของรัฐที่ถือครองโดยกระทรวงการคลัง ประจำไตรมาสที่ 1 ปีงบประมาณ 2567



หลักทรัพย์ 109 หลักทรัพย์

ไม่รวมหุ้นในรัฐวิสาหกิจ



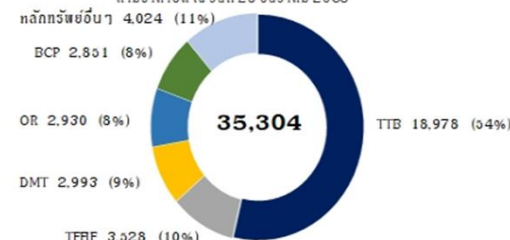
มูลค่ารวม 376,997.38 ล้านบาท

ข้อมูล ณ สิ้นเดือนธันวาคม 2566

เปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นร้อยละ 2.92% เมื่อเทียบกับเดือนกันยายน 2566

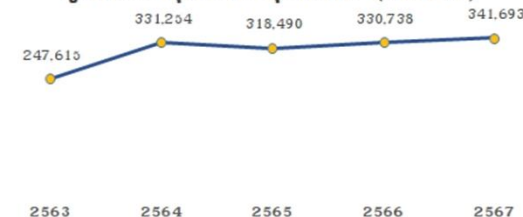
มูลค่าหลักทรัพย์ของรัฐ 108 หลักทรัพย์ (ล้านบาท)

ตามราคาปิด ณ วันที่ 28 ธันวาคม 2566



ไม่รวมมูลค่ากองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

มูลค่ากองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง (ล้านบาท)



มูลค่ากองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง สำหรับปี 2563 - 2566 เป็นมูลค่า ณ สิ้นเดือนกันยายน และสำหรับปี 2567 เป็นมูลค่า ณ สิ้นเดือนธันวาคม 2566

หลักทรัพย์ของรัฐที่จ่ายเงินปันผลสูงสุด 5 อันดับแรก (ล้านบาท)



ข้อมูล ณ สิ้นเดือนกันยายน 2566 โดยไม่รวมเงินปันผลจากกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

จัดทำโดยสำนักงานคณะกรรมการนโยบายรัฐวิสาหกิจ

ตั้งทีมขายหุ้น3หมื่นล้าน

Saturday, May 25, 2024 at 07:08

คลังเลี้ยงปล่อยมือหลักทรัพย์ไร้ค่า

คลังตั้งทีมเคาะขายหุ้น 3 หมื่นล้านบาทในกลุ่ม หลักทรัพย์ที่ยืดมา แต่ไม่มีแผนพัฒนาต่อหวังสร้างผลประโยชน์เข้ารัฐ

นายเผ่าภูมิ โรจนสกุล รมช.คลัง เปิดเผยว่า ได้มอบนโยบายสำนักงานคณะกรรมการนโยบายรัฐวิสาหกิจ (สคร.) เร่งทบทวนหลักทรัพย์ของรัฐที่

กระทรวงการคลังถือครองอยู่ที่ได้มาจากการยึดทรัพย์ หรือนิติเหตุ ซึ่งมีมูลค่าประมาณ 30,000 ล้านบาท พร้อมเร่งทำแนวทางการบริหารหลักทรัพย์ของรัฐ

และแผนการลงทุนที่สร้างผลกำไรให้แก่รัฐ โดยสั่งให้มีการตั้งคณะกรรมการขึ้นมาพิจารณาหลักเกณฑ์ เงื่อนไขต่างๆ ให้ได้ข้อสรุป โดยเร็วที่สุด

"จากได้พิจารณาหุ้นที่อยู่ในกลุ่มนี้พบว่าบางตัวเป็นหุ้นขนาดเล็กที่ไม่มีประสิทธิภาพ หุ้นต่างๆ เหล่านี้บางตัวเป็นหุ้นที่ขาดประสิทธิภาพ ที่ผ่านมาทาง

กระทรวงการคลังก็ไม่มีใครกล้าทำอะไร เพราะก็มีกรอบจำกัดว่ารัฐบาลจะขายได้ต่อเมื่อเป็น หุ้นที่ไม่สร้างประโยชน์ ไม่อยู่ในแผนการพัฒนา และต้องมีการ

ดูเพื่อผลประโยชน์สูงสุดของรัฐ" นายเผ่าภูมิกล่าว

ทั้งนี้ การตั้งคณะกรรมการชุดดังกล่าวจัดทำขึ้นเพื่อศึกษา ถึงความคุ้มค่าของหุ้นที่กระทรวงการคลังถือ เพื่อบริหารให้มีประโยชน์สูงสุดกับภาครัฐ

ประเมินความคุ้มค่าในเชิงเศรษฐศาสตร์ รวมถึงมองแนวโน้มของหลักทรัพย์ดังกล่าวในอนาคตด้วย นอกเหนือจากมาตรฐานทางบัญชี ดูกำไร-ขาดทุน และ

กรอบกฎหมาย ส่วนจะซื้อจะขายยังไม่ตัดสินใจตอนนี้ ต้องดูความคุ้มค่าในการถือครองหุ้นก่อน

นายเผ่าภูมิกล่าวว่า การตัดสินใจขายหุ้นตัวใดออกไปหรือไม่จำเป็นต้องพิจารณาให้ถูกต้องตามหลักกรอบกฎหมายในหลักทรัพย์ที่ถือครองไว้แต่ละแห่ง ซึ่ง

บางตัวต้องผ่านความเห็นชอบจากคณะรัฐมนตรี (ครม.) หรือบางตัวก็เป็นอำนาจของกระทรวง การคลังได้เลย โดยพิจารณาความคุ้มค่าในเชิงเศรษฐศาสตร์

เช่น มูลค่าหุ้นตอนนี้เหลือ 7-8 บาท จากที่ซื้อมา 10 บาท มองไปอนาคตมูลค่าอาจลดลงเหลือ 5 บาท หากไม่ขายออก ตอนนี้จะเป็นประโยชน์ต่อแผ่นดิน

หรือไม่

ปัจจุบันหลักทรัพย์ที่ภาครัฐถือแบ่งออกเป็น 3 ส่วนหลัก ได้แก่ 1.หุ้นที่ถือผ่านกองทุนรวมวายุภักษ์ 2.หุ้นรัฐวิสาหกิจ 3.หุ้นที่ได้จากหลักทรัพย์ที่ได้มา

จากการยึดทรัพย์ หรือ

นิติเหตุ ซึ่งในกลุ่มนี้มีมูลค่าประมาณ 30,000 ล้านบาท ประกอบด้วยหุ้นของบริษัทที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและหุ้นของบริษัทที่

จดทะเบียนนอกตลาด หลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

DAOL SEC

8-Oct-24

Stock	จำนวนหุ้น	ราคา	มูลค่า	สัดส่วนคลังถือหุ้น
AOT	10,000,000,000	63.75	637,500,000,000	70.00%
MCOT	452,134,022	4.44	2,007,475,058	65.80%
PTT	14,598,855,750	34.00	496,361,095,500	51.00%
THAI	1,044,737,191	3.32	3,468,527,474	47.86%
DMT	261,350,000	11.70	3,057,795,000	22.13%
MFC	20,000,000	27.50	550,000,000	15.92%
NEP	295,847,860	0.25	73,961,965	12.72%
TTB	11,364,282,005	1.88	21,364,850,169	11.68%
BEYOND	31,200,000	9.35	291,720,000	10.76%
TFFIF	457,000,000	6.65	3,039,050,000	10.00%
BCP	65,543,767	37.75	2,474,277,204	4.76%
RPH	14,700,000	5.80	85,260,000	2.69%
OR	153,349,808	16.90	2,591,611,755	1.28%

หลักทรัพย์ของรัฐที่ถือครองโดยกระทรวงการคลัง ประจำปีไตรมาสที่ 1 ปีงบประมาณ 2567



หลักทรัพย์ 109 หลักทรัพย์

ไม่รวมหุ้นในรัฐวิสาหกิจ

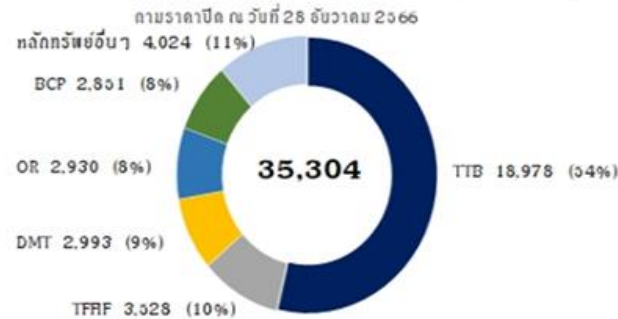


มูลค่ารวม 376,997.38 ล้านบาท

ข้อมูล ณ สิ้นเดือนธันวาคม 2566

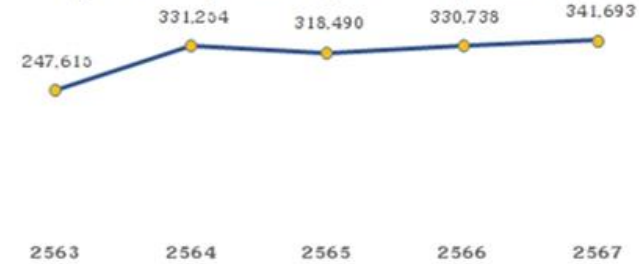
เปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นร้อยละ 2.92% เมื่อเทียบกับสิ้นเดือนธันวาคม 2565

มูลค่าหลักทรัพย์ของรัฐ 108 หลักทรัพย์ (ล้านบาท)



ไม่รวมมูลค่ากองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

มูลค่ากองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง (ล้านบาท)



มูลค่ากองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง สำหรับปี 2567 - 2569 เป็นมูลค่า ณ สิ้นเดือนธันวาคม และสำหรับปี 2567 เป็นมูลค่า ณ สิ้นเดือนธันวาคม 2566

หลักทรัพย์ของรัฐที่จ่ายเงินปันผลสูงสุด 5 อันดับแรก (ล้านบาท)



ข้อมูล ณ สิ้นเดือนธันวาคม 2566 โดยไม่รวมเงินปันผลจากกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

จัดทำโดยสำนักงานคณะกรรมการนโยบายรัฐวิสาหกิจ

งบไตรมาสที่ 3

Fig 2: Estimated net profits, 3Q24E

Net profit (Bt mn)	3Q24E	3Q23	YoY	2Q24	QoQ	Announce Date(E)	Reason
BBL	11,043	11,350	-2.7%	11,807	-6.5%	21-Oct-24	-YoY เพราะกำไรจากเงินลงทุนในส่วนของเงินปันผลรับลดลงตามฤดูกาล - QoQ เพราะ NIM ลดลงจากการ repricing เงินฝากประจำเพิ่มมากขึ้น
KBANK	12,012	11,282	6.5%	12,653	-5.1%	21-Oct-24	+YoY เพราะสำรองลดลงจากการตั้งเผื่อมาเยอะแล้ว -QoQ เพราะมีกำไรจากเงินลงทุนในส่วนของเงินปันผลรับลดลงตามฤดูกาล
KKP	881	1,281	-31.2%	769	14.6%	18-Oct-24	-YoY เพราะ NIM ลดลงจากการ repricing เงินฝากประจำเพิ่มมากขึ้น + QoQ เพราะสำรองที่รวมขาดทุนระยะเริ่มลดลง
KTB	10,933	10,282	6.3%	11,195	-2.3%	18-Oct-24	+YoY เพราะรายได้ค่าธรรมเนียมสุทธิเพิ่มขึ้นจากการ Cross-selling ในกลุ่ม -QoQ เพราะมีกำไรจากเงินลงทุนในส่วนของเงินปันผลรับลดลงตามฤดูกาล
SCB	10,102	9,663	4.5%	10,014	0.9%	21-Oct-24	+YoY เพราะสำรองลดลงจากการตั้งเผื่อมาเยอะแล้ว + QoQ เพราะขาย Robinhood ได้เงินทันที 400 ล้านบาท
TISCO	1,691	1,874	-9.8%	1,749	-3.3%	15-Oct-24	-YoY เพราะสำรองเพิ่มขึ้นตามการปล่อยสินเชื่อผลตอบแทนสูงมากขึ้น -QoQ เพราะมีกำไรจากเงินลงทุนในส่วนของเงินปันผลรับลดลงตามฤดูกาล
TTB	5,327	4,735	12.5%	5,355	-0.5%	21-Oct-24	+YoY เพราะได้ผลประโยชน์ทางภาษีราว 1.1 พันล้านบาท จากปีก่อนที่ไม่มี - QoQ เพราะ NIM ลดลงจากการ repricing เงินฝากประจำเพิ่มมากขึ้น
Total	51,988	50,467	3.0%	53,542	-2.9%		

Source: Company, DAOL

คาดการณ์กำไร 3Q-24 ของหุ้นกลุ่มธนาคาร

DAOL SEC



	Net Income (Quarter)	Net Income (Quarter)	Net Income (Quarter)	Net Income (Quarter)	Net Income (Quarter)	Net Income (Quarter)	Net Income (Quarter)	Net Income (Quarter)	Lastest Period	BEst Net Income					
										3Q-24(f)	Estimate next Q	Forecast Period	12-Oct-24	คาด	คาด
		4Q-22	1Q-23	2Q-23	3Q-23	4Q-23	1Q-24	2Q-24						คาด	คาด
									Last Actual					QoQ	YoY
BBL	9,347	7,569	10,129	11,294	11,350	8,863	10,524	11,807	2024:S1	11,442	09/24 Q3			-3%	1%
KBANK	9,929	3,191	10,741	10,994	11,282	9,388	13,486	12,653	2024:S1	12,024	09/24 Q3			-5%	7%
KTB	8,170	8,109	10,067	10,156	10,282	6,111	11,078	11,195	2024:S1	10,745	09/24 Q3			-4%	5%
BAY	7,010	7,391	8,676	8,425	8,096	7,732	7,543	8,209	2024:S1	7,791	09/24 Q3			-5%	-4%
SCB	10,976	7,143	10,995	11,868	9,663	10,995	11,281	10,014	2024:S1	10,196	09/24 Q3			2%	6%
TTB	1,917	3,847	4,295	4,566	4,735	4,867	5,334	5,355	2024:Q2	5,346	09/24 Q3			0%	13%
TISCO	1,798	1,809	1,793	1,854	1,874	1,780	1,733	1,753	2024:Q2	1,695	09/24 Q3			-3%	-10%
KKP	1,471	1,430	2,085	1,408	1,281	670	1,506	769	2024:Q2	918	09/24 Q3			19%	-28%
CIMBT	201	99	830	539	367	-131	626	668	2024:S1	--	09/24 Q3			--	--
LHFG	761	345	670	532	543	352	399	491	2024:Q2	--	09/24 Q3			--	--
	50,617	40,490	58,781	60,566	58,563	50,405	62,484	61,755		60,157				เฉพาะที่มีคาดการณ์	
								61,755	:สูตร รวมเฉพาะ	3%				: yoy	
										-3%				: QoQ	

NPL / Provision ไตรมาสล่าสุด (2Q-24)

	Total Loans Reserve for Losses on Loans (Current Quarter)	(Current Quarter)	Net Loans (Current Quarter)	Net Loans (Current Quarter)	Gross Nonperforming Loans (NPL)	Provision for Loan Losses (Current Quarter)	Provision for Loan Losses / Total Loan	Gross NPLs / Total Loan	Provision / Gross NPL (Accu) (Coverage Ratio)
	Credit Cost								
BBL	2,742,868	280,095	2,777,610	2,462,773	99,140	10,425	0.38%	3.6%	2.8
KBANK	2,504,828	129,923	1,257,915	2,374,905	92,447	11,672	0.47%	3.7%	1.4
KTB	2,584,824	173,292	2,634,890	2,411,532	98,701	8,004	0.31%	3.8%	1.8
BAY	1,915,425	--	2,004,870	1,915,425	72,973	9,702	0.51%	3.8%	n.m.
SCB	2,461,294	148,780	2,473,229	2,312,514	95,097	11,626	0.47%	3.9%	1.6
TTB	1,305,227	60,815	1,321,214	1,244,412	40,105	5,281	0.40%	3.1%	1.5
TISCO	233,448	9,261	240,473	224,186	5,697	401	0.17%	2.4%	1.6
KKP	398,749	21,078	202,297	377,671	16,108	1,769	0.44%	4.0%	1.3
CIMBT	251,362	9,114	--	242,248	7,451	540	0.21%	3.0%	1.2
LHFG	739,253	--	--	230,397	7,640	358	0.05%	1.0%	n.m.
	15,137,277	832,358	12,912,498	13,796,064	535,358	59,778	0.39%	3.5%	1.6

คาดการณ์กำไร 3Q-24 ของ SET

จำนวนบริษัท	3Q-24(f)	2Q-24	3Q-23	YoY	QoQ
117	212,482	207,745	205,109	3.6%	2.3%
คาดการณ์ SET	256,438	260,398	285,581	-10.2%	-1.5%

ประเมินกำไร 3Q-2024

10-Oct-24

source : Bloomberg

รวบรวมโดย DAOL Strategy

	3Q-24(f)	2Q-24	3Q-23	Growth YoY	Growth QoQ	Market	2024 (f)	9M % of Full year forecast	คาดการณ์วันส่งงบ
PTT	23,553	35,469	31,297	-24.7%	-33.6%	SET	100,039	88%	13-Nov-24
PTTEP	17,472	23,978	18,101	-3.5%	-27.1%	SET	2,258	2663%	25-Oct-24
KBANK	12,024	12,653	11,282	6.6%	-5.0%	SET	46,517	82%	18-Oct-24
BBL	11,442	11,807	11,350	0.8%	-3.1%	SET	42,481	79%	18-Oct-24
KTB	10,745	11,195	10,282	4.5%	-4.0%	SET	41,519	80%	18-Oct-24
SCB	10,196	10,014	9,663	5.5%	1.8%	SET	41,170	76%	18-Oct-24
ADVANC	8,436	8,577	8,146	4%	-1.7%	SET	33,274	77%	01-Nov-24
BAY	7,791	8,209	8,096	-3.8%	-5.1%	SET	31,176	76%	21-Oct-24
TCAP	6,383	1,926	1,812	252.3%	231.5%	SET	7,053	143%	13-Nov-24
CPF	6,175	6,925	-1,811	n.m.	-10.8%	SET	16,116	88%	13-Nov-24
DELTA	5,737	6,565	5,429	5.7%	-12.6%	SET	21,555	77%	25-Oct-24
CPALL	5,684	6,239	4,424	28.5%	-8.9%	SET	23,403	78%	08-Nov-24
TTB	5,346	5,356	4,735	12.9%	-0.2%	SET	20,845	51%	18-Oct-24
AOT	4,208	4,563	3,432	22.6%	-7.8%	SET	19,562	74%	20-Nov-24
BDMS	4,204	3,335	3,890	8.1%	26.1%	SET	15,955	73%	12-Nov-24
CPN	4,178	4,556	4,162	0.4%	-8.3%	SET	16,615	78%	13-Nov-24
TOP	3,627	5,547	10,828	-66.5%	-34.6%	SET	15,580	97%	08-Nov-24
GULF	3,423	4,741	3,360	1.9%	-27.8%	SET	18,397	63%	08-Nov-24
DIF	2,908	2,676	2,695	7.9%	8.7%	SET	11,623	71%	13-Nov-24
MINT	2,579	2,823	2,144	20.3%	-8.7%	SET	8,008	82%	08-Nov-24
OR	2,505	2,536	5,170	-51.6%	-1.3%	SET	11,224	78%	12-Nov-24
IVL	2,242	-22,996	195	1,047.0%	n.m.	SET	5,947	-330%	14-Nov-24
BH	2,108	1,932	1,954	7.9%	9.1%	SET	7,864	77%	07-Nov-24
CPAXT	2,098	2,176	1,677	25.1%	-3.6%	SET	10,476	64%	08-Nov-24
SPALI	1,926	1,599	1,191	61.8%	20.5%	SET	5,776	72%	14-Nov-24

ประเมินกำไร 3Q-2024

10-Oct-24

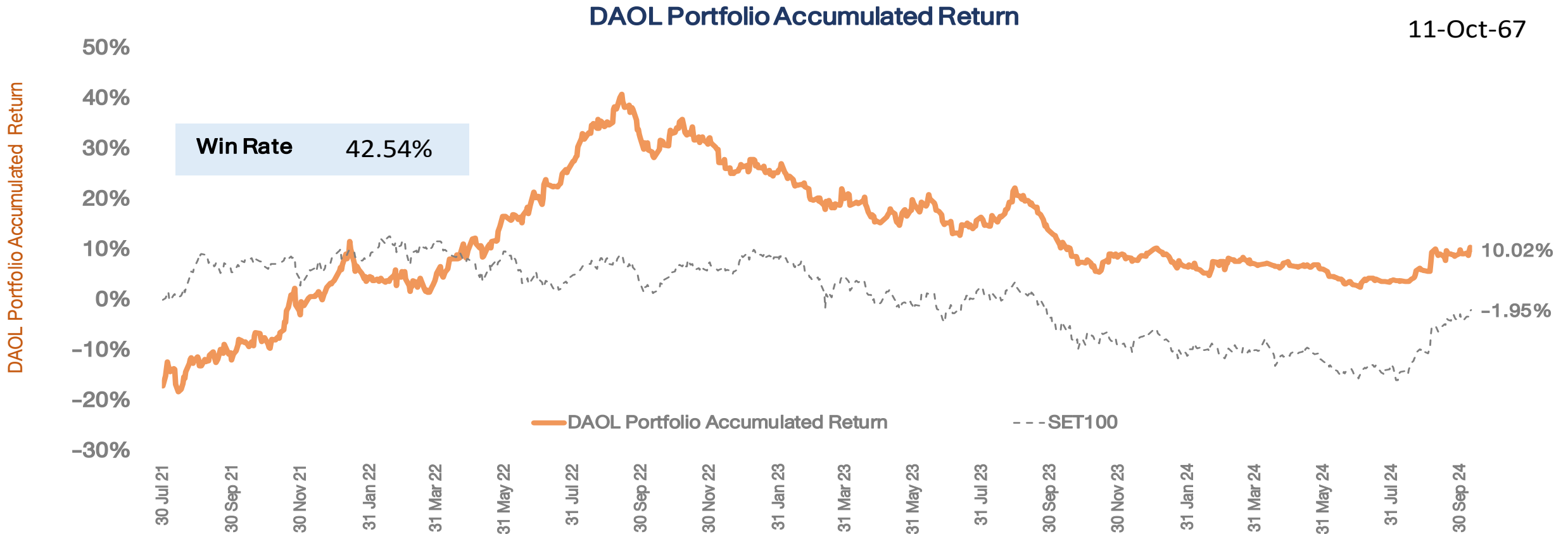
source : Bloomberg

รวบรวมโดย DAOL Strategy

	3Q-24(f)	2Q-24	3Q-23	Growth YoY	Growth QoQ	Market	2024 (f)	9M % of Full year forecast	คาดการณ์วันส่งงบ
TCAP	6,383	1,926	1,812	252.3%	231.5%	SET	7,053	143%	13-Nov-24
SPALI	1,926	1,599	1,191	61.8%	20.5%	SET	5,776	72%	14-Nov-24
CKP	1,163	74	1,022	13.8%	1,473.0%	SET	1,754	44%	18-Nov-24
TTW	1,019	623	897	13.6%	63.7%	SET	2,858	57%	08-Nov-24
CK	880	488	641	37.3%	80.3%	SET	1,791	83%	14-Nov-24
TASCO	761	99	202	277.1%	668.3%	SET	1,562	56%	13-Nov-24
OSP	733	604	642	14.2%	21.4%	SET	3,070	71%	08-Nov-24
BGRIM	624	229	344	81.3%	173.1%	SET	2,101	59%	13-Nov-24
BCH	533	277	441	20.9%	92.3%	SET	1,529	74%	08-Nov-24
AMATA	444	231	396	12.0%	92.1%	SET	2,259	50%	08-Nov-24
CHG	362	192	326	11.1%	88.3%	SET	1,134	72%	14-Nov-24
THANI	292	255	250	16.6%	14.7%	SET	1,244	72%	08-Nov-24
CENDEL	204	168	74	175.8%	21.5%	SET	1,509	75%	08-Nov-24
PR9	178	139	140	27.1%	28.0%	SET	661	72%	08-Nov-24
KAMART	175	52	144	21.9%	234.8%	SET	752	70%	13-Nov-24
MASTER	117	88	100	16.7%	33.0%	MAI	529	59%	14-Nov-24
MOSHI	99	81	81	21.6%	21.9%	SET	493	62%	08-Nov-24
WARRIX	60	17	40	48.8%	257.9%	MAI	140	55%	28-Feb-25
KISS	46	39	30	52.2%	18.8%	SET	168	69%	14-Nov-24

กลยุทธ์ลงทุนโดย DAOL





*หมายเหตุ: มูลค่าเริ่มต้นของพอร์ต ณ วันที่ 30 ก.ค. 64 อิงจากมูลค่าพอร์ต Skynet จากนั้นปรับวิธีการซื้อขายโดยใช้ราคาเปิด (ATO) ของทั้งการซื้อและขายเพื่อให้การ Action เป็นไปตามกลยุทธ์ที่วางไว้มากที่สุด

Portfolio Performance

11/10/2024 0:00	Market Price								
DAOL Portfolio	SECTOR	%Hold	Cost	Vol	Cost Value	CLOSE	Market Value	Gain/Loss	%Gain/Loss
GULF	ENERG	20%	59.00	3,701	218,337	64.75	239,615.66	21,278.61	9.75%
SISB	PROF	10%	35.25	3,091	108,952	34.75	107,406.44	(1,545.42)	-1.42%
WHA	PROP	10%	5.75	18,948	108,952	5.60	106,109.63	(2,842.22)	-2.61%
BDMS	HEALTH	15%	30.00	5,497	164,900	28.75	158,029.41	(6,870.84)	-4.17%
TRUE	ICT	10%	11.10	9,904	109,934	11.20	110,923.90	990.39	0.90%
CPALL	COMM	15%	65.75	2,508	164,900	65.25	163,646.26	(1,253.99)	-0.76%
SET						1470.1			
Total		80%	875,975				885,731	9,757	
CASH		20%					214,441		
Total Portfolio							1,100,172		10.02%



กลยุทธ์

- ตลาดหุ้นไทย ปรับฐานจบ ไปแล้ว แต่ยังมีเรื่องสถานการณ์ตะวันออกกลาง ที่รบกวน หากการโจมตีไม่มีนัยยะ ไม่บานปลาย แรงซื้อหุ้นไทย น่าจะยังมีต่อ กลยุทธ์ ยังคงแนะนำ “ซื้อ” แต่ตัวเลือกมีน้อยลง และควรพร้อมขายไว้ด้วย ถ้าสัญญาณลบจากตัวแปรใดตัวแปรหนึ่ง



Theme ลงทุน

- หุ้นในกลุ่ม GULF (GULF+ADVANC+INTUCH+THCOM) เรา มองว่า ความแรงยังมีต่อ เข้าถึงทำอะไรได้ แต่มี trailing stop ประกอบไปด้วยสัก 3 ช่องก็ได้



พอร์ตหุ้น DAOL

- พอร์ตหุ้นวันนี้ เราคงหุ้นทั้งหมดไว้
- หุ้นในพอร์ต BDMS(15%), TRUE*(10%), CPALL(15%), SISB(10%), WHA(10%), GULF(20%)

GULF's family มีผลบวกต่อ SET Index +39 จุด

11-Oct-24

	Shares	16-Jul-24 close	Market cap	10-Oct-24 close	Chg (%)	Market cap
ADVANC	2974	220.00	654,280	272.00	23.64%	808,928
GULF	11733	42.25	495,719	62.75	48.52%	736,246
THCOM	1096	11.10	12,166	14.60	31.53%	16,002
INTUCH	3207	76.25	244,534	103.00	35.08%	330,321
			1,406,699	8.60%	34.46%	1,891,496
SET		1,321.31	16,360,680	1,456.97	10.27%	18,074,240

IMPACT (points)	39.15
SET Index - GULFs	1,417.82

หุ้นในกลุ่ม GULF (GULF + ADVANC + INTUCH + THCOM)

กลายเป็นปาฏิหาริย์ของตลาดไปแล้ว

ตั้งแต่ประกาศรวมกิจการ 16 ก.ค.

ราคาหุ้นครอบครัวนี้ วิ่งขึ้นอย่าง

ต่อเนื่อง มีผลบวก(impact) ต่อดัชนี

ไปแล้ว 39 จุด (หักผลของหุ้นกลุ่มนี้

ออก SET Index อยู่แค่ 1417 จุด)

..... เรามองว่า ความแรงยังมีต่อ

เกินทำได้ แต่มี trailing stop ประท

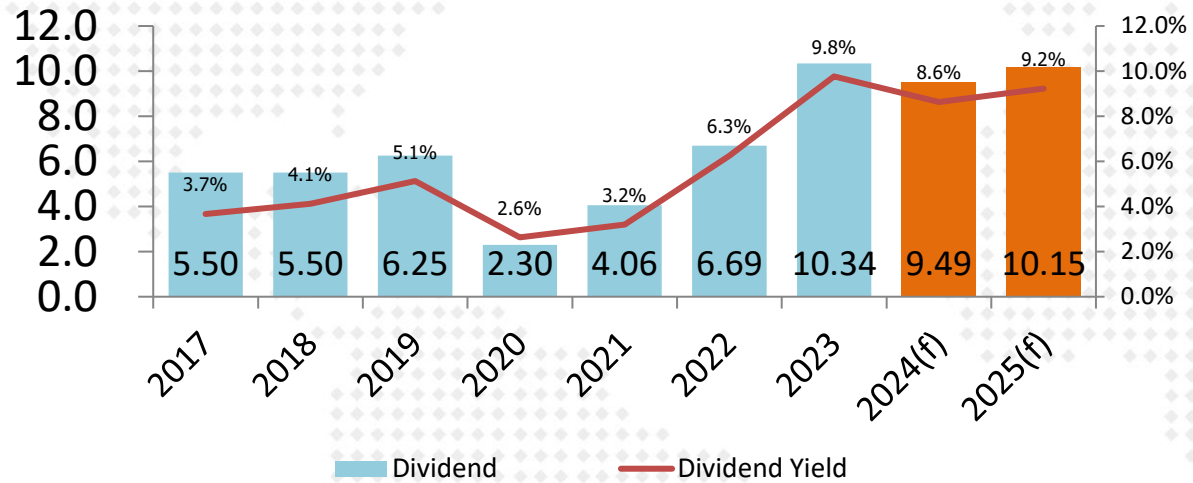
ไปด้วยสัก 3 ช่องก็ได้



source : Bloomberg

Dividend

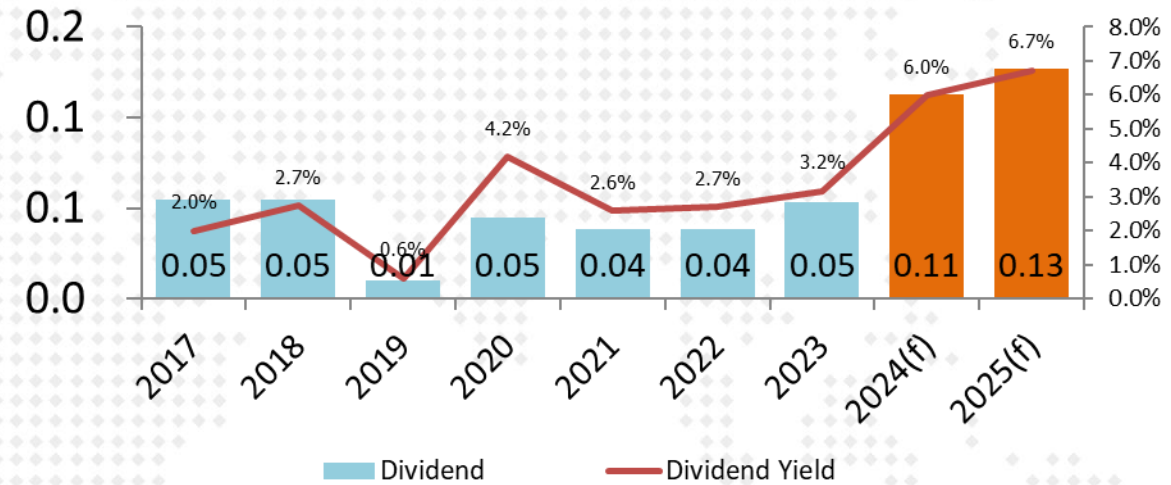
SCB

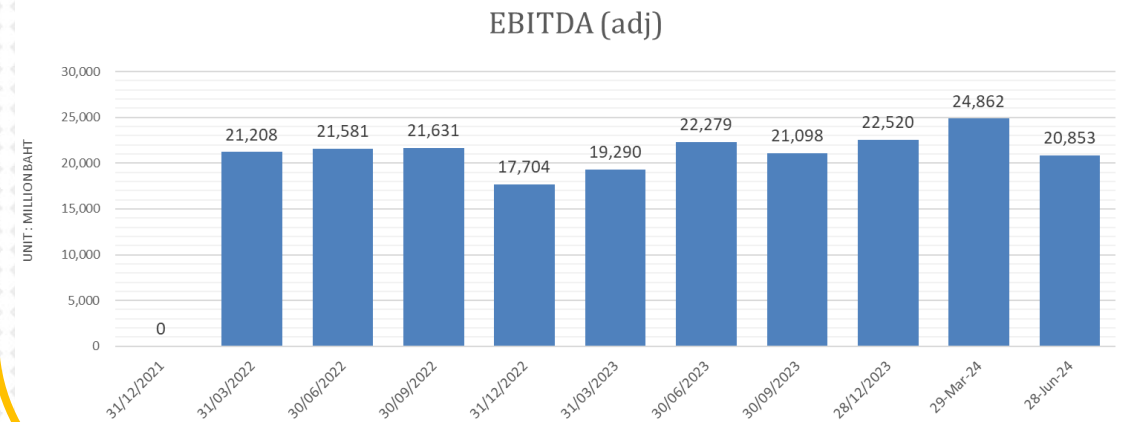
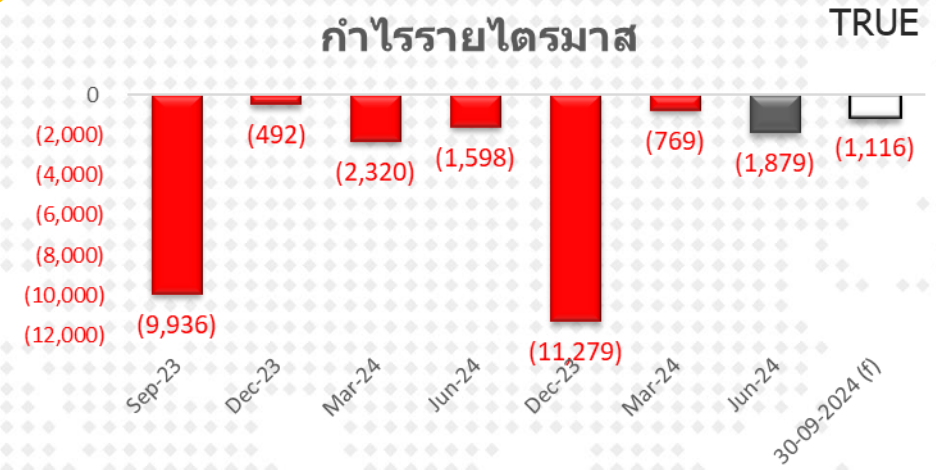
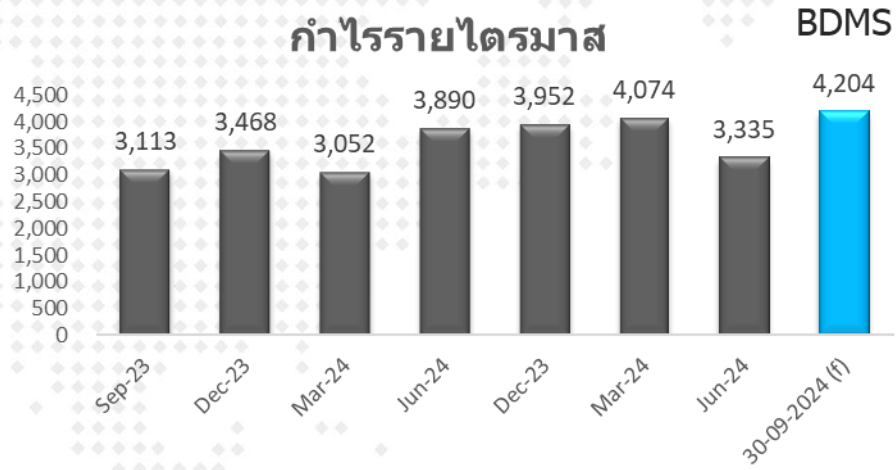


source : Bloomberg

Dividend

TTB







TECHNICAL VIEW

15 October 2024 # 194

DAOL SEC

SET : แนวโน้มตัวผันผวน

แนวรับ 1462-1466

แนวต้าน 1475-1480

SKY

CK

แนวรับ 23.30-23.50

แนวรับ 20.20-20.40

แนวต้าน 24.20-24.70

แนวต้าน 21.00-21.50

Cut Loss < 22.80

Cut Loss < 20.00

SET50 Index Futures

S50Z24

แนวโน้ม : แนวโน้มตัวผันผวน

กลยุทธ์

ไม่มีสถานะ: Trading 932-940

สถานะ Long : ปิด หากหลุด 929

สถานะ Short : ถือ หากหลุด 929

แนวรับ 932, 929, 926

แนวต้าน 938, 940, 942

Analyst: Phannapa Kemasurat (Reg. no. 060110)

Disclaimer: บทวิเคราะห์ฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยบริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) มีวัตถุประสงค์เพื่อนำเสนอและเผยแพร่บทวิเคราะห์ให้เป็นข้อมูลประกอบการตัดสินใจของนักลงทุนทั่วไป โดยจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของข้อมูลที่ได้เปิดเผยต่อสาธารณชนอันเชื่อถือได้ และมีได้มีเจตนาเชิงชวนหรือชี้แนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์แต่อย่างใด ดังนั้นบริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) จะไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการใช้บทวิเคราะห์ฉบับนี้ทั้งทางตรงและทางอ้อม และขอให้นักลงทุนใช้ดุลพินิจพิจารณาอย่างรอบคอบก่อนการตัดสินใจลงทุน



CASH BALANCE

DAOL SEC

15 October 2024

หลักทรัพย์ที่ติด Cash Balance ประจำสัปดาห์ (Turnover List)

หลักทรัพย์	วันเริ่มต้น – สิ้นสุด
-	-

หลักทรัพย์ที่ติด Cash Balance

หลักทรัพย์	วันเริ่มต้น – สิ้นสุด
-	-

หมายเหตุ

* ระดับ 1 : ให้ซื้อด้วยการวางเงินสด 100% ก่อนซื้อ (บัญชี Cash Balance) + **ห้ามคำนวณวงเงินซื้อขาย**

** ระดับ 2 : ให้ซื้อด้วยการวางเงินสด 100% ก่อนซื้อ (บัญชี Cash Balance) + ห้ามคำนวณวงเงินซื้อขาย + **ห้าม Net Settlement**

*** ระดับ 3 : ให้ซื้อด้วยการวางเงินสด 100% ก่อนซื้อ (บัญชี Cash Balance) + ห้ามคำนวณวงเงินซื้อขาย + ห้าม Net Settlement + **ห้ามซื้อขายชั่วคราว 1 วันทำการ**

News Comment

(-) Energy (Neutral) OPEC ปรับลดประมาณการอุปสงค์การใช้น้ำมันเป็นเดือนที่ 3

First Trading Day

MEDEZE (IPO/เป้า 11.50 บาท) ผู้นำการเก็บ Stem cells ที่อุตสาหกรรมเติบโต

Company Update

(0) KLINIQ (ซื้อ/ปรับเป้าลงเป็น 41.00 บาท) คาดกำไร 3Q24E โต YoY, QoQ จากการขยายสาขา

Results Announcement

15 Oct: TISCO

18 Oct: KKP, TTB

21 Oct: BBL, KBANK, KTB, SCB



Fund Flow

เม็ดเงินนักลงทุนต่างชาติ
ไหลเข้าตลาดหุ้นใดในฝั่งเอเชีย ...?

G-10-Bloomberg Cumulative FX Carry Trade Index Compare with USD/YEN and USD/CNY



FXCTG10 Index (Bloomberg Cumulative FX Carry Trade Index for Managed G10 Currencies) Bloomberg Cumulative FX Daily 01JAN2024-30OCT2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

15-Oct-2024 07:14:42

เงินทุนสำรองฯ สูงขึ้นต่อเนื่อง หนุนค่าเงินบาท ให้แข็งค่า

Foreign reseve-SET Index



THFRUS\$ Index (Thailand International Foreign Reserves Total) Foreign reseve-SET Index Daily 05NOV2018-30OCT2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

15-Oct-2024 07:14:28

Flow ตลาด EM (ทุก assets class) ปรับตัวขึ้น

Emerging Market Fund Flow (Accu YTD) (Commodity+Equity+Bond+Carry Trade)

■ YTD outflows from key EM Asian exchanges 153.069



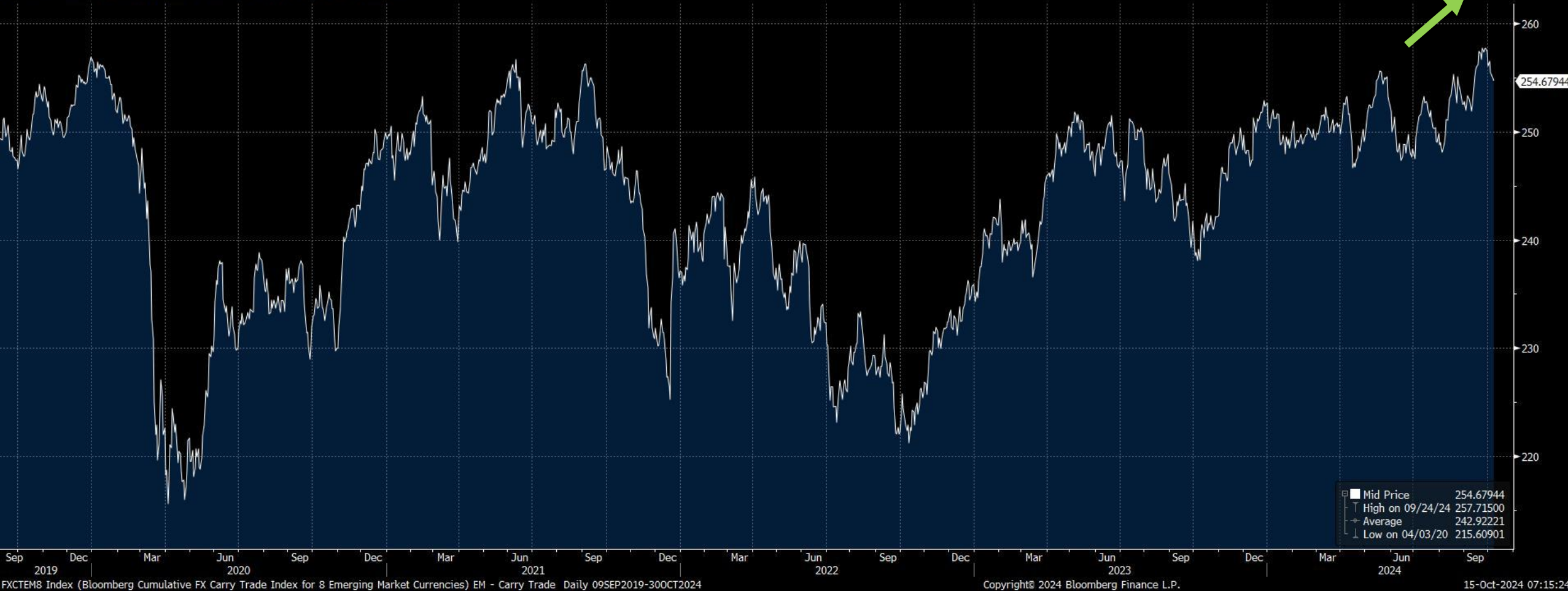
Source: Bloomberg, National Stock Exchanges

EMCFPROX Index (Bloomberg Emerging Markets Capital Flow Proxy Index) EM fund flow Daily 05NOV2018-30OCT2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

15-Oct-2024 07:15:32

Bloomberg Cumulative FX Carry Trade Index for 8 Emerging Market Currencies »
total return of a buy-and-hold carry trade position

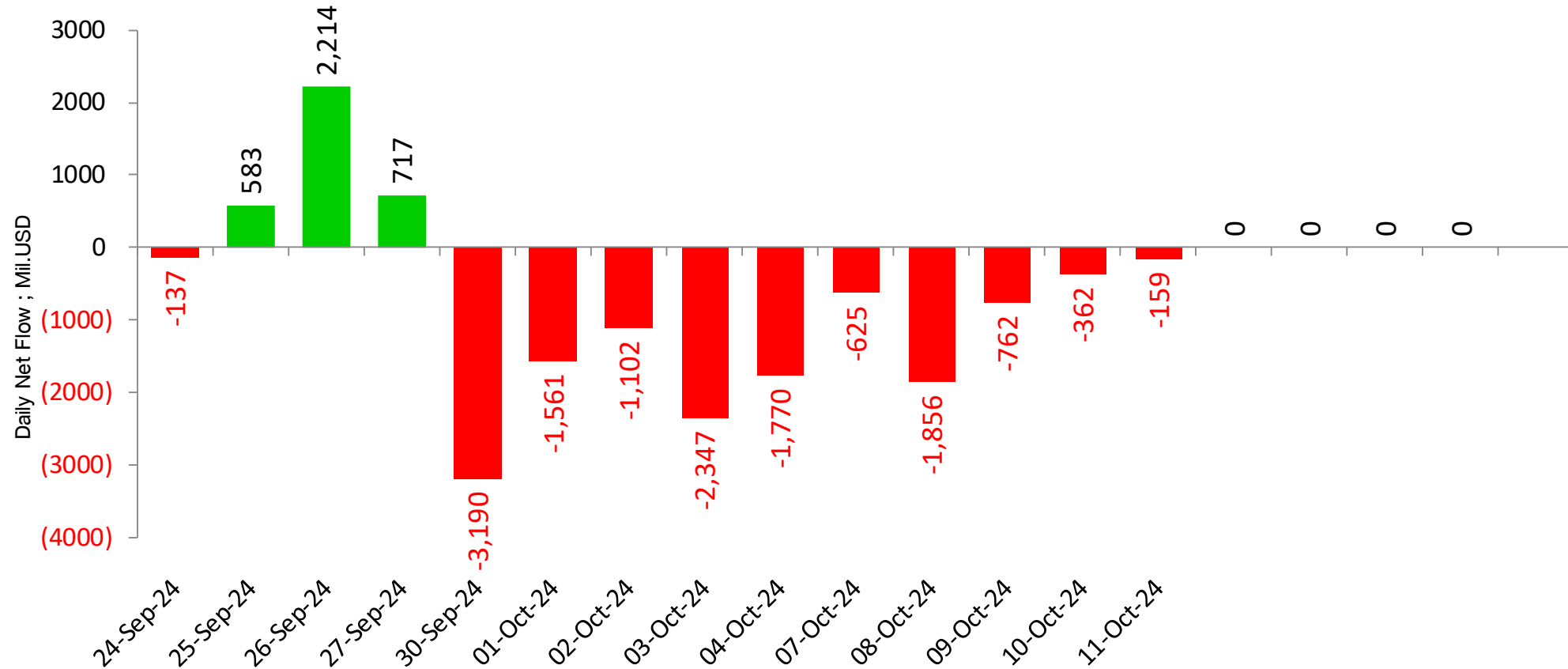


FXCTEM8 Index (Bloomberg Cumulative FX Carry Trade Index for 8 Emerging Market Currencies) EM - Carry Trade Daily 09SEP2019-30OCT2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

15-Oct-2024 07:15:24

Net Position (Equity) 6 ตลาดหุ้นเอเชีย



unit : Million USD

■ Sum of Foreign Net Position ; USD ; India-S.Korea-Taiwan-Veitnam-Philippines-Indonesia

Remark : ตัวเลข Net position ของนักลงทุนต่างประเทศ ใน 6 ตลาดหุ้นเอเชีย ประกอบด้วย **India-S.Korea-Taiwan-Veitnam-Philippines-Indonesia**

Net Position (Equity) 6 ตลาดหุ้นเอเชีย

DAOL SEC

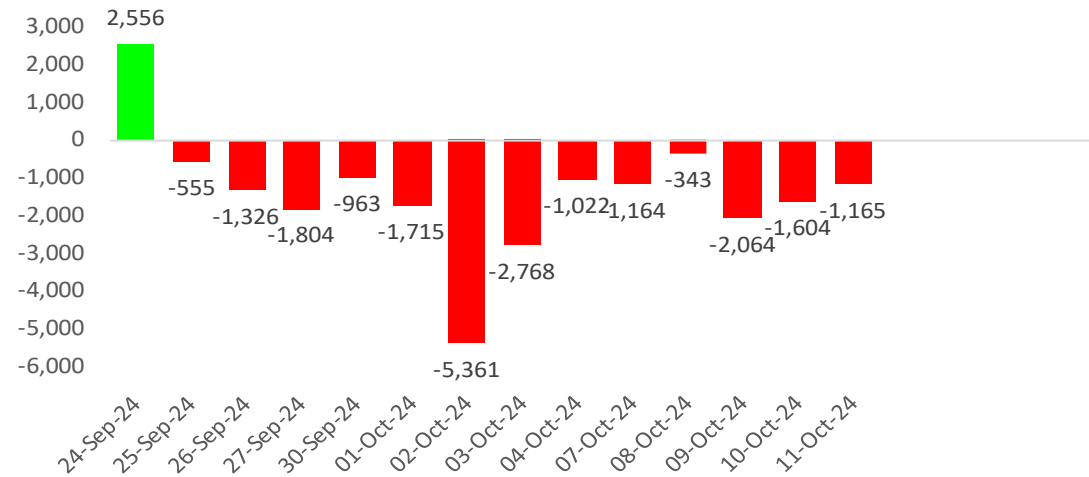
Foreign Net Position in Asia Stock Market

15-Oct-24

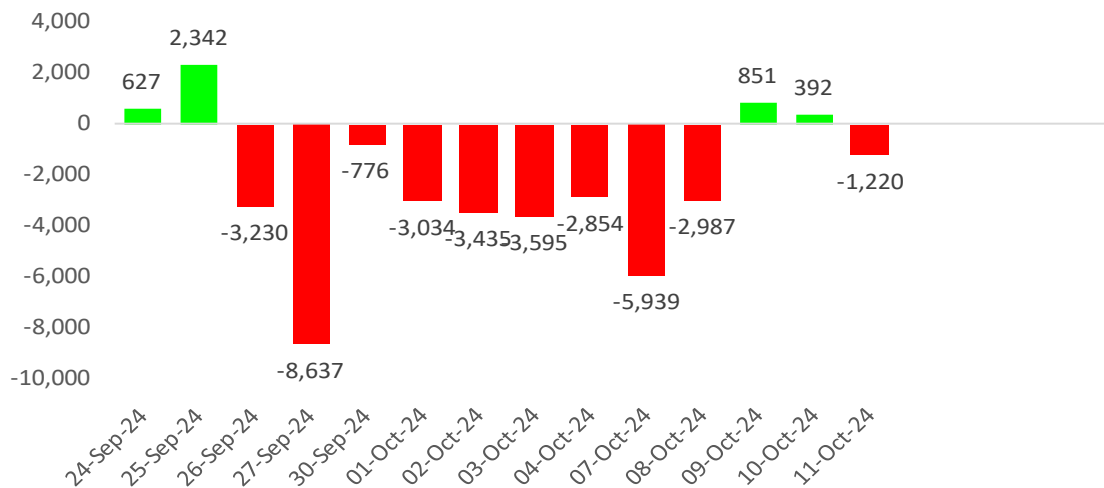
(USD mn)	Last Update	Daily	WTD	MTD	QTD	YTD	12M	YoY Lvl
China	30-Jun-24			-26,000	-14,623	-17,979	-92,253	
India	10-Oct-24	-564	-2,611	-6,228	-6,228	4,805	12,304	-7,876
Indonesia	11-Oct-24	-6	-291	-405	-405	2,844	2,798	3,823
Japan	04-Oct-24		6,182	6,182	6,182	181	8,517	-23,347
Malaysia	10-Oct-24	13	5	-197	-197	609	777	1,804
Philippines	11-Oct-24	-0	23	56	56	78	48	895
South Korea	11-Oct-24	-395	-613	-769	-769	9,794	14,847	6,876
Sri Lanka	11-Oct-24	0	2	0	0	-19	-17	-66
Taiwan	11-Oct-24	818	458	-420	-420	-13,761	-4,808	-4,869
Thailand	11-Oct-24	-35	-190	-520	-520	-3,100	-3,919	-796
Vietnam	11-Oct-24	-13	-12	5	5	-2,220	-2,690	-3,297

Foreign Net Position in Thai Market

Foreign Net Position in Thai Equity (Million THB)



Foreign Net Position in Thai Bond (Million THB)



Net Position Accumulate monthly

15-Oct-24

Year	Foreign Net Position (Equity)	Local Institutional - Net position (Equity)	Foreign Net Position (Bond)	Foreign -net (SET50 Futures)
2021	-48,577	-77,336	211,222	27,284
2022	202,695	-152,754	214,094	78,351
2023	-192,490	91,301	39,367	-3,063,681
Sep '23	-21,973	-4,600	-22,113	-380,373
Oct '23				
Nov '23	-19,379	8,469	16,561	-398,486
Dec '23	-204	11,177	-10,815	-326,034
Jan '24	-30,874	-1,405	-1,631	-398,486
Feb '24	2,862	-6,404	-13,327	-362,260
Mar '24	-41,314	1,689	-9,018	-380,373
Apr '24	3,914	-1,665	-49,080	-326,034
May '24	-16,747	9,018	25,925	-362,260
Jun '24	-34,872	4,301	-10,301	-344,147
Jul '24	-1,752	-2,404	32,889	-380,373
Aug '24	-5,964	2,440	36,198	-380,373
Sep '24	29,178	-1,717	4,661	-380,373
Oct '24	-17,206	27,206	-23,041	-163,017
Nov '24				
Dec '24				
2024	-112,776	31,059	-6,725	-3,477,696

Unit : Million Baht

หุ้นที่มูลค่าการถือครองของนักลงทุนต่างประเทศเพิ่ม/ลด มากที่สุด

11-Oct-24 : (เปรียบเทียบกับก่อน)

รวบรวมโดย DAOL Strategy

หุ้นที่มี % การถือสูงขึ้น

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
BH	0.68%	1,464
PTTEP	0.05%	268
GULF	0.02%	153
CPF	0.06%	125
TLI	0.05%	65
COM7	0.09%	56
CHG	0.16%	51
CBG	0.06%	48
MTC	0.04%	43
CPN	0.01%	30

หุ้นที่มี % การถือลดลง

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
WHA	-0.51%	-428
ADVANC	-0.04%	-327
BDMS	-0.07%	-325
DELTA	-0.02%	-293
TOP	-0.08%	-89
SCB	-0.02%	-74
INTUCH	-0.02%	-67
HANA	-0.18%	-66
RML	-2.70%	-61
CPALL	-0.01%	-59

หมายเหตุ : มูลค่าเงินลงทุนที่เพิ่ม/ลด คำนวณจากจำนวนหุ้นที่เปลี่ยนแปลง โดยใช้ราคาปิดล่าสุด เพื่อเปรียบเทียบ (ไม่ใช่มูลค่าที่ลดลงจริงๆ)

source : Bloomberg , SETSMART , SET

WEEK

หุ้นที่มูลค่าการถือครองของนักลงทุนต่างประเทศเพิ่ม/ลด มากที่สุด

11-Oct-24 : (เปรียบเทียบกับสัปดาห์ก่อน)

รวบรวมโดย DAOL Strategy

หุ้นที่มี % การถือสูงขึ้น

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
PTTEP	0.16%	857
BH	0.38%	818
AOT	0.03%	274
ADVANC	0.03%	245
GULF	0.03%	229
CPF	0.11%	229
CBG	0.26%	206
COM7	0.29%	179
TLI	0.08%	103
CPAXT	0.03%	100

หุ้นที่มี % การถือลดลง

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
KBANK	-0.24%	-875
BDMS	-0.17%	-789
SSC	-4.70%	-786
INTUCH	-0.19%	-635
WHA	-0.72%	-605
KTB	-0.12%	-359
CCET	-0.66%	-317
HANA	-0.83%	-304
DELTA	-0.02%	-293
AU	-3.15%	-260

หมายเหตุ : มูลค่าเงินลงทุนที่เพิ่ม/ลด คำนวณจากจำนวนหุ้นที่เปลี่ยนแปลง โดยใช้ราคาปิดล่าสุด เพื่อเปรียบเทียบ (ไม่ใช่มูลค่าที่ลดลงจริงๆ)

source : Bloomberg , SETSMART , SET

MONTH to DATE

หุ้นที่มูลค่าการถือครองของนักลงทุนต่างประเทศเพิ่ม/ลด มากที่สุด

11-Oct-24 : (เปรียบเทียบกับวันสุดท้ายของเดือนก่อน)

รวบรวมโดย DAOL Strategy

หุ้นที่มี % การถือสูงขึ้น

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
ADVANC	0.15%	1,226
BH	0.24%	517
TLI	0.30%	388
CBG	0.41%	325
CPF	0.13%	271
SPALI	0.53%	208
COM7	0.33%	204
PTT	0.02%	196
TOP	0.14%	156
CPAXT	0.04%	134

หุ้นที่มี % การถือลดลง

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
KBANK	-0.58%	-2,114
SCB	-0.50%	-1,855
SCCC	-2.51%	-1,237
INTUCH	-0.31%	-1,035
PTTEP	-0.18%	-964
BBL	-0.27%	-804
SSC	-4.70%	-786
AOT	-0.08%	-730
WHA	-0.85%	-714
KTB	-0.23%	-688

หมายเหตุ : มูลค่าเงินลงทุนที่เพิ่ม/ลด คำนวณจากจำนวนหุ้นที่เปลี่ยนแปลง โดยใช้ราคาปิดล่าสุด เพื่อเปรียบเทียบ (ไม่ใช่มูลค่าที่ลดลงจริงๆ)

source : Bloomberg , SETSMART , SET

Net Change

18 Jan 21 - Present

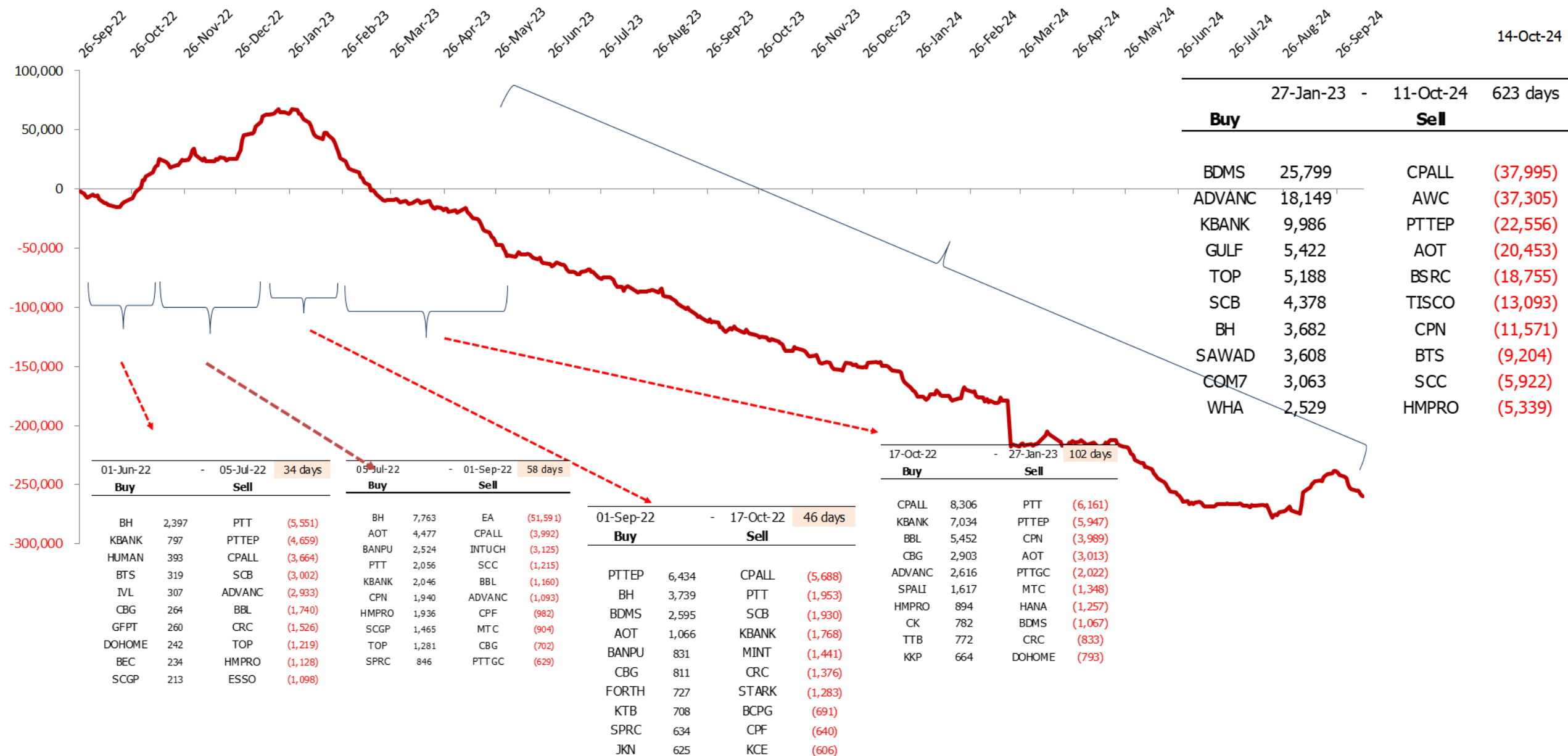
14-Oct-24

Net Buy		Net Sell	
BDMS	43,710	AWC	(38,694)
BH	36,173	AOT	(37,892)
ADVANC	21,010	CPALL	(30,455)
SCB	13,728	BSRC	(18,373)
KBANK	11,408	PTT	(18,191)
PTTEP	10,823	INTUCH	(15,632)
KTC	8,061	CPN	(12,606)
TOP	5,344	TTB	(11,708)
HUMAN	2,905	SCC	(10,765)
CK	2,849	CPF	(8,828)

นักลงทุนต่างประเทศได้ทยอยเข้าซื้อหุ้นไทย มาตั้งแต่ต้นปี 2021 ด้านขายมือ เป็นมูลค่าที่นักลงทุนกลุ่มนี้ เข้าซื้อ หรือขาย ตั้งแต่เวลานั้น มาจนถึงปัจจุบัน

Foreign Net (Equity) - Accumulate

Unit : Million Baht



27-Jan-23		-	11-Oct-24		623 days
Buy			Sell		
BDMS	25,799		CPALL	(37,995)	
ADVANC	18,149		AWC	(37,305)	
KBANK	9,986		PTTEP	(22,556)	
GULF	5,422		AOT	(20,453)	
TOP	5,188		BSRC	(18,755)	
SCB	4,378		TISCO	(13,093)	
BH	3,682		CPN	(11,571)	
SAWAD	3,608		BTS	(9,204)	
COM7	3,063		SCC	(5,922)	
WHA	2,529		HMPRO	(5,339)	



Dividend Stocks

หุ้นที่มีการจ่ายปันผลในอัตราที่สูง

ตารางหุ้นที่มี Dividend Yield สูง

High Dividend Yield Stock (หุ้นจ่าย Dividend มากกว่า 1 ครั้ง/ปี)

Stock	Last price	Last DPS	Est. DPS	24(f) div yield	Frequency	5 days avg volume
		Bt/sh	Bt/sh	%		
SCB	110.00	2.00	9.39	8.53	Semi-Anl	602.98
SIRI	1.87	0.07	0.15	8.18	Semi-Anl	144.75
SPRC	7.00	0.25	0.56	8.04	Semi-Anl	161.28
TISCO	97.00	2.00	7.74	7.98	Semi-Anl	264.32
MC	12.10	0.40	0.97	7.98	Semi-Anl	29.73
NER	5.05	0.05	0.39	7.62	Semi-Anl	74.43
TACC	4.92	0.20	0.36	7.22	Semi-Anl	12.26
ICHI	15.60	0.50	1.12	7.17	Semi-Anl	159.44
QH	1.88	0.03	0.13	7.07	Semi-Anl	31.61
ORI	4.98	0.30	0.35	7.01	Semi-Anl	36.06
LH	6.05	0.30	0.41	6.84	Semi-Anl	319.82
PTTEP	135.00	4.50	0.27	6.69	Semi-Anl	2,148.33
SC	3.02	0.05	0.20	6.59	Semi-Anl	28.79
SPALI	20.10	0.60	1.30	6.48	Semi-Anl	112.89
TTW	9.30	0.30	0.60	6.45	Semi-Anl	17.73
TCAP	52.25	1.25	3.33	6.37	Semi-Anl	55.70

High Dividend Yield Stock (หุ้นที่จ่ายปันผล 1 ครั้ง/ปี)

Stock	Last price	Last DPS	Est. DPS	24(f) div yield	Frequency	5 days avg volume
		Bt/sh	Bt/sh	%		
NYT	3.20	0.36	0.42	13.13	Annual	6.3
ASW	7.95	0.25	0.52	6.54	Annual	4.1
AP	9.90	0.70	0.63	6.31	Annual	137.3
ROJNA	7.05	0.40	0.42	5.96	Annual	36.6
TEGH	3.32	0.10	0.18	5.27	Annual	16.2
TPS	3.12	0.18	0.16	5.13	Annual	2.5
NETBAY	17.30	0.90	0.84	4.87	Annual	15.2
KTB	21.60	0.87	1.00	4.63	Annual	1,142.67
TTA	5.75	0.18	0.26	4.52	Annual	30.78
AMANAHA	1.37	0.01	0.06	4.38	Annual	2.37
BAM	9.15	0.38	0.38	4.16	Annual	122.64
SAPPE	67.25	2.18	2.76	4.10	Annual	102.29

High Dividend : Property Fund & REIT

14-Oct-24

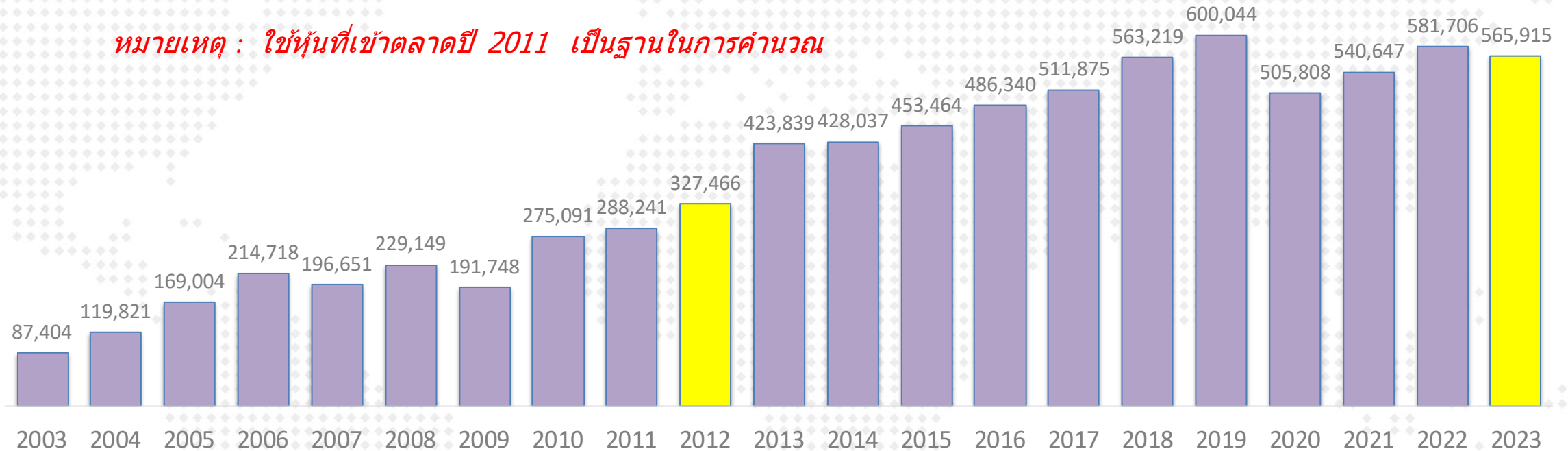
Stock	Last price	Last DPS	Est. DPS	div yield last	Frequency	5-day avg volume	Type
				year			
				(%)	(times)	Bt mn	
GVREIT	6.75	0.20	0.78	11.60	Quarter	2.64	Leasehold
POPF	6.30	0.29	0.79	11.10	Quarter	1.41	Free&Leaseho
ALLY	5.40	0.13	0.00	10.87	Quarter	2.76	#N/A
DIF	9.35	0.22	0.96	9.60	Quarter	167.11	Freehold
INETREIT	8.70	0.20	0.00	9.21	Quarter	3.28	#N/A
BOFFICE	5.10	0.06	0.66	9.09	Quarter	1.34	Leasehold
LHHOTEL	13.30	0.31	1.33	8.82	Quarter	8.24	Free&Leaseho
WHAIR	6.25	0.14	0.53	8.77	Quarter	2.58	#N/A
CPNCG	6.25	0.02	0.91	8.52	Quarter	1.58	Leasehold
AIMIRT	10.80	0.14	0.89	8.04	Quarter	5.90	Freehold
EGATIF	6.05	0.13	0.26	7.70	Quarter	2.62	n.a.
BAREIT	9.80	0.18	0.58	7.62	Quarter	8.32	#N/A
PROSPECT	8.55	0.22	0.22	7.51	Quarter	1.07	#N/A
WHART	10.50	0.19	0.77	7.37	Quarter	16.46	Leasehold
FTREIT	10.70	0.19	0.75	6.99	Quarter	13.48	Free&Leaseho
CPTGF	5.50	0.02	0.46	6.62	Quarter	2.65	Leasehold

(update สัปดาห์ละหนึ่งครั้ง)

บริษัทในตลาดหุ้นไทย จ่ายเงินปันผลอย่างต่อเนื่อง

CAGR (2011-22) = 3.1 %

หมายเหตุ : ใช้หุ้นที่เข้าตลาดปี 2011 เป็นฐานในการคำนวณ



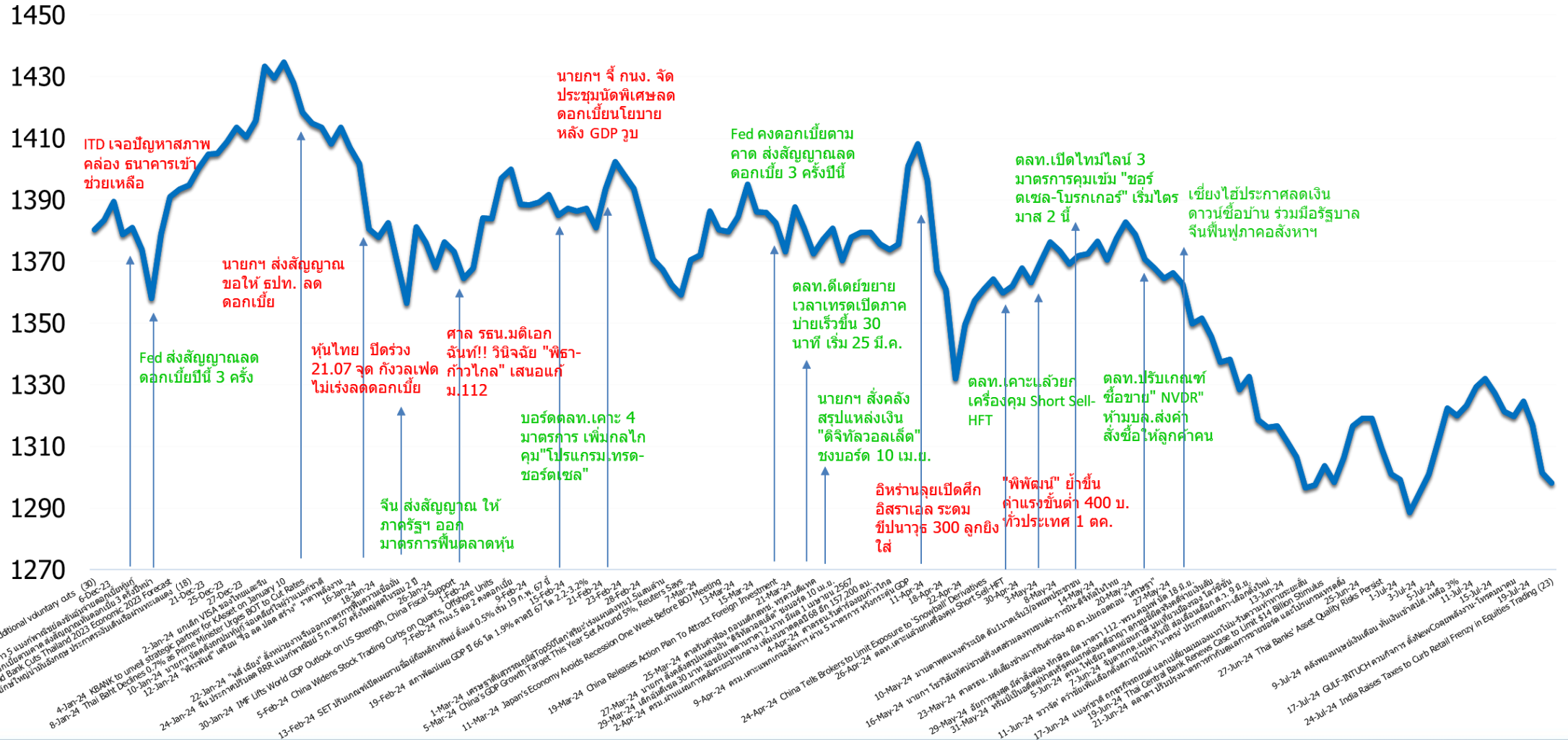
หมายเหตุ : ใช้หุ้นที่เข้าตลาดปี 2011 เป็นฐานในการคำนวณ

- ข้อมูล ณ ส.ค.2021 เงินปันผลที่จ่ายในปี 2023 คือ 5.6 แสบลบ. (ดึงข้อมูลจากงบกระแสเงินสด)
- นับตั้งแต่ปี 2012 เป็นต้นมา ทุกบริษัทรวมกัน มีการจ่ายเงินปันผลเพิ่มขึ้นในอัตราเฉลี่ย 3.1% ต่อปี

Market Indicators

Major Event Dec 23 - Jul 24

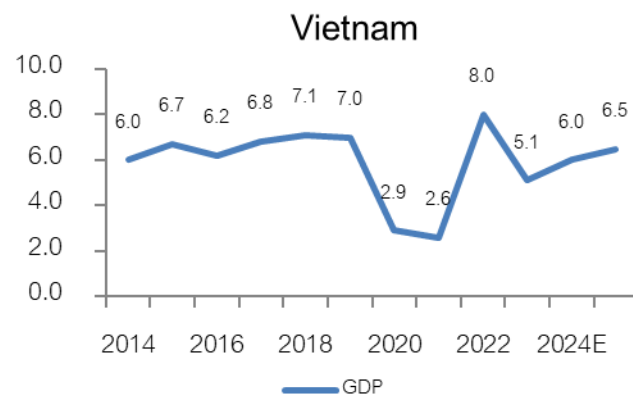
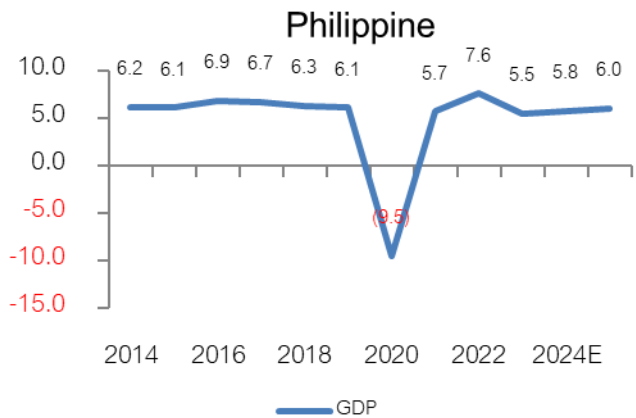
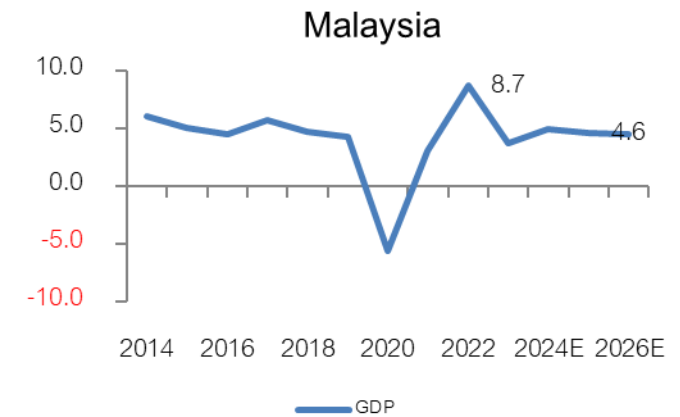
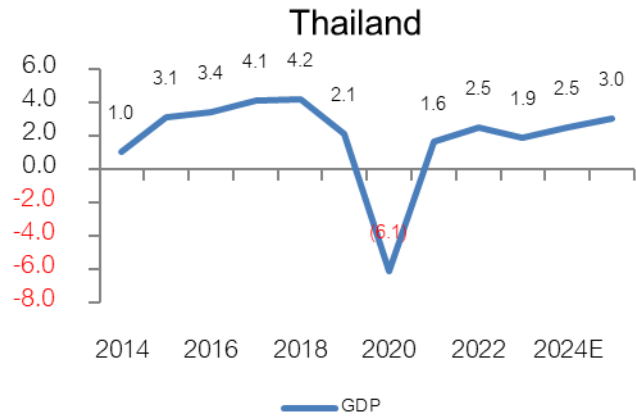
SET INDEX



Date	Country	Event	Period	Surv(M)	Prior
14-Oct	CH	Exports YoY	Sep	6.2%	8.7%
15-Oct	CH	1-Yr Medium-Term Lending Facility Rate	Oct-25	2.0%	2.0%
16-Oct	TH	BoT Benchmark Interest Rate	Oct-16	0.0	0.0
17-Oct	JN	Exports YoY	Sep	-0.6%	5.6%
	EC	CPI YoY	Sep F	1.8%	2.2%
	EC	ECB Policy Rate Meeting	Oct-17		
	US	Retail Sales Advance MoM	Sep	0.3%	0.1%
	US	Initial Jobless Claims	Oct-12	--	258k
	US	Manufacturing (SIC) Production	Sep	-0.2%	0.9%
18-Oct	CH	GDP YoY	3Q	4.6%	4.7%
	CH	Industrial Production YoY	Sep	0.05	0.05
	CH	Retail Sales YoY	Sep	2.5%	2.1%
	US	Housing Starts MoM	Sep	0.0%	9.6%
21-Oct	CH	1-Year Loan Prime Rate	Oct-21	3.2%	3.4%
23-Oct	US	Existing Home Sales MoM	Sep	-0.7%	-2.5%
24-Oct	US	Initial Jobless Claims	Oct-19	--	--
	US	New Home Sales MoM	Sep	--	-4.7%
	TH	Customs Exports YoY	Sep	--	7.0%
25-Oct	US	U. of Mich. Sentiment	Oct F	--	--

GDP ของประเทศใน Asean

Source : Bloomberg
(18 Sep 24)

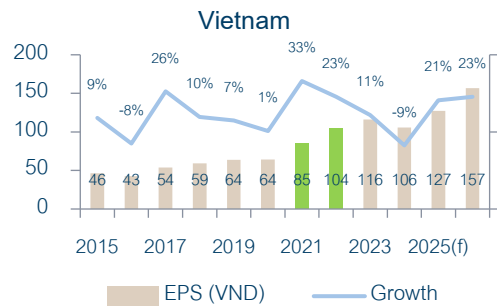
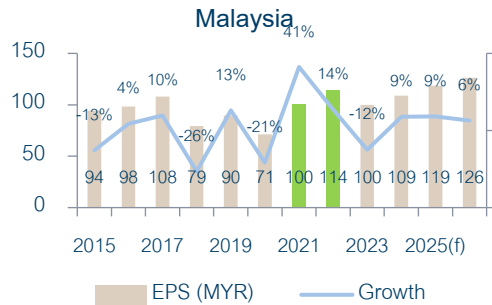
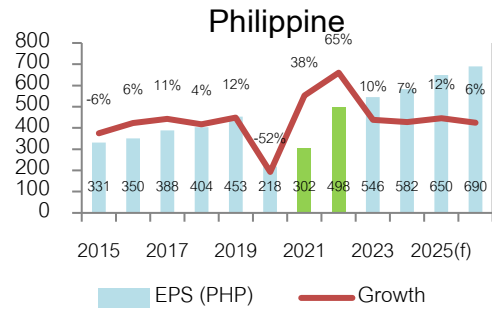
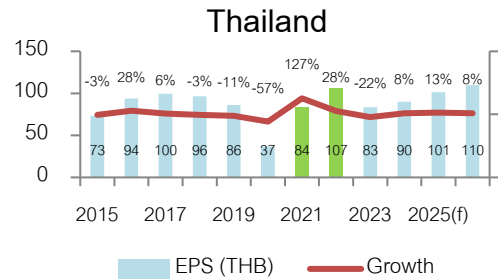


EPS (กำไรตลาด) ของประเทศใน Asean

Source : Bloomberg

(18 Sep 24)

Currency : Local Currency



EPS (กำไรต่อหุ้น) ของประเทศใน Asean

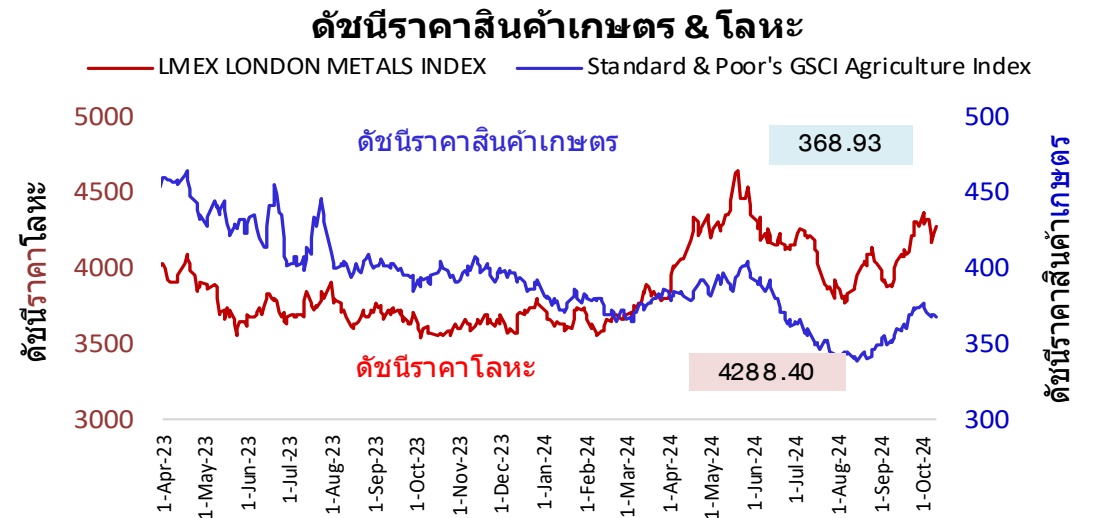
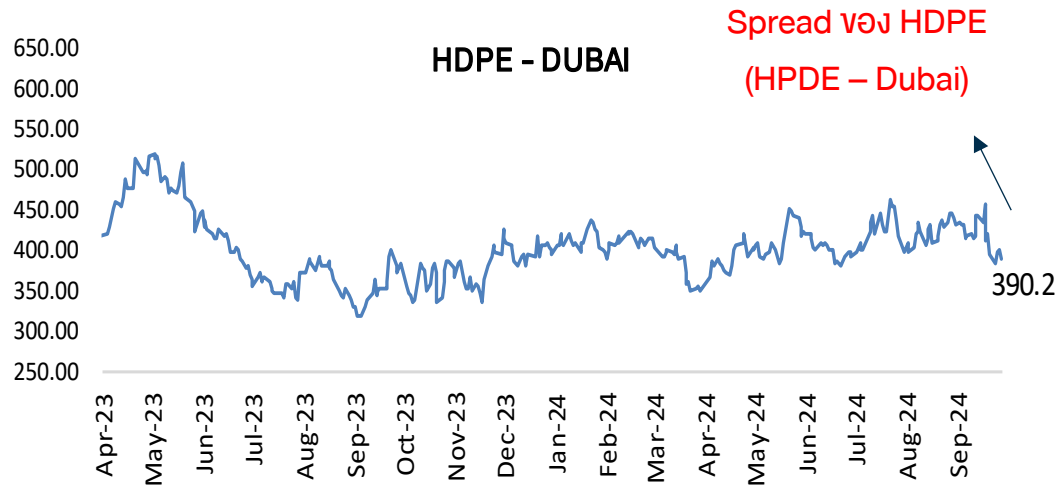
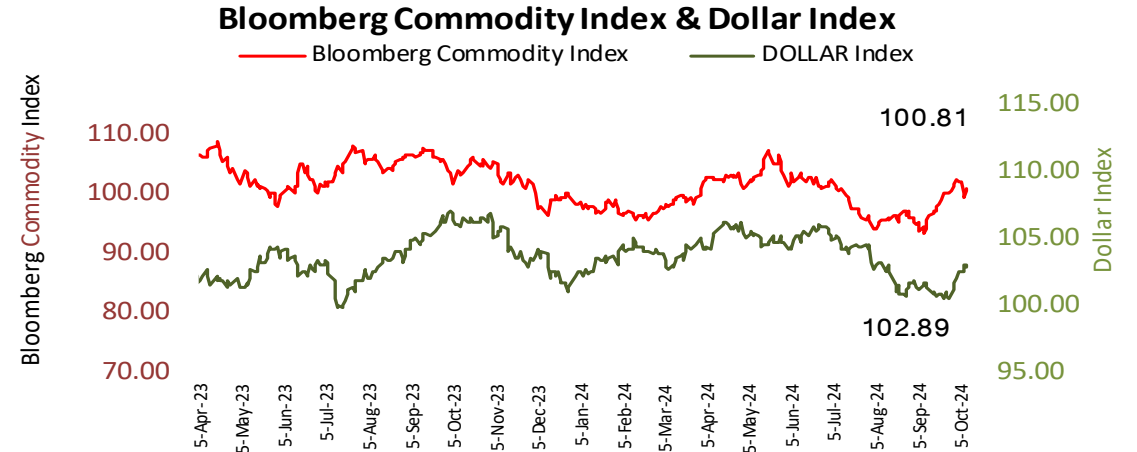
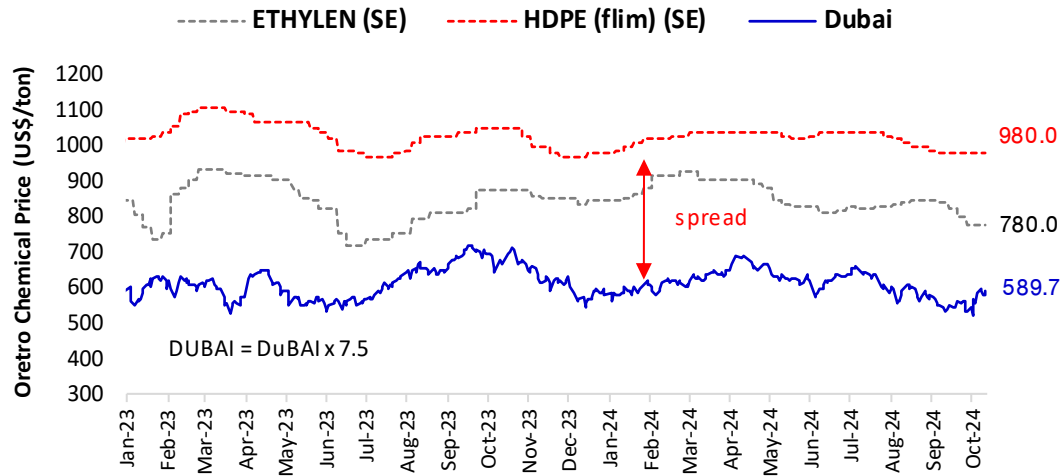
Thailand	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024(f)	2025(f)	2026(f)
EPS (THB)	75.43	73.25	93.67	99.66	96.34	86.2	36.8	83.7	106.8	83.47	89.88	101.26	109.74
Growth		-3%	28%	6%	-3%	-11%	-57%	127%	28%	-22%	8%	13%	8%
Index (end period)	1497.67	1288.02	1542.94	1753.71	1563.88	1579.84	1449.35	1657	1668	1415	1439.35	1439.35	1439.35
P/E	19.86	17.58	16.47	17.60	16.23	18.33	39.38	19.80	15.62	16.95	16.01	14.21	13.12
Indonesia	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024(f)	2025(f)	2026(f)
EPS (IDR)	237.59	156.85	224.11	321.21	288.66	287.7	121.5	227.8	480.6	472.3	526.76	581.2	651.55
Growth		-34%	43%	43%	-10%	0%	-58%	87%	111%	-2%	12%	10%	12%
Index (end period)	5226.95	4593.01	5296.71	6355.65	6194.5	6299.54	5979.07	6581	6850	7272	7836.07	7836.07	7836.07
P/E	22.00	29.28	23.63	19.79	21.46	21.90	49.21	28.89	14.25	15.40	14.88	13.48	12.03
Phillipine	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024(f)	2025(f)	2026(f)
EPS (PHP)	353	331.4	350.14	387.94	403.92	452.8	218.3	301.7	497.9	545.72	582.43	649.6	689.83
Growth		-6%	6%	11%	4%	12%	-52%	38%	65%	10%	7%	12%	6%
Index (end period)	7230.57	6952.08	6840.64	8558.42	7466.02	7815.26	7139.71	7122	6566	6450	7197.67	7197.67	7197.67
P/E	20.48	20.98	19.54	22.06	18.48	17.26	32.71	23.61	13.19	11.82	12.36	11.08	10.43
Vietnam	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024(f)	2025(f)	2026(f)
EPS (VND)	42.37	46.22	42.75	54.01	59.25	63.6	64	85.1	104.4	115.88	105.76	127.46	156.57
Growth		9%	-8%	26%	10%	7%	1%	33%	23%	11%	-9%	21%	23%
Index (end period)	545.63	579.03	664.87	984.24	892.54	960.99	1103.87	1498	1007	1129.93	1268.22	1268.22	1268.22
P/E	12.88	12.53	15.55	18.22	15.06	15.11	17.25	17.60	9.65	9.75	11.99	9.95	8.10
Malaysia	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024(f)	2025(f)	2026(f)
EPS (MYR)	108.19	94.15	98.28	107.9	79.32	89.7	71.1	100.4	114.1	99.94	108.82	118.64	126.33
Growth		-13%	4%	10%	-26%	13%	-21%	41%	14%	-12%	9%	9%	6%
Index (end period)	1761.25	1692.51	1641.73	1796.81	1690.58	1588.76	1627.21	1567	1496	1454	1657.69	1657.69	1657.69
P/E	16.28	17.98	16.70	16.65	21.31	17.71	22.89	15.61	13.11	14.55	15.23	13.97	13.12
China	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024(f)	2025(f)	2026(f)
EPS (CNY)	214.65	178.73	171.84	190.82	206.32	215.69	195.42	230.99	236.84	222.84	249.92	275.61	306.22
Growth		-17%	-4%	11%	8%	5%	-9%	18%	3%	-6%	12%	10%	11%
Index (end period)	3234.68	3539.18	3103.64	3307.17	2493.9	3050.12	3473.07	3639.78	3089.26	2974.94	3336.497	3336.497	3336.497
P/E	15.07	19.80	18.06	17.33	12.09	14.14	17.77	15.76	13.04	13.35	13.35	12.11	10.90
India	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024(f)	2025(f)	2026(f)
EPS (Rupee)	1349.82	1361.36	1371.18	1399.14	1505.71	1698.27	1774.53	1930.23	2522.35	2901.47	3529.41	4068.74	4223.75
Growth		1%	1%	2%	8%	13%	4%	9%	31%	15%	22%	15%	4%
Index (end period)	27499.4	26117.5	26626.5	34056.8	36068.3	41253.7	47751.3	58253.8	60840.7	72240.3	84198.9	84198.9	84198.9
P/E	20.37	19.18	19.42	24.34	23.95	24.29	26.91	30.18	24.12	24.90	23.86	20.69	19.93

Source : Bloomberg

(30 Sep 24)

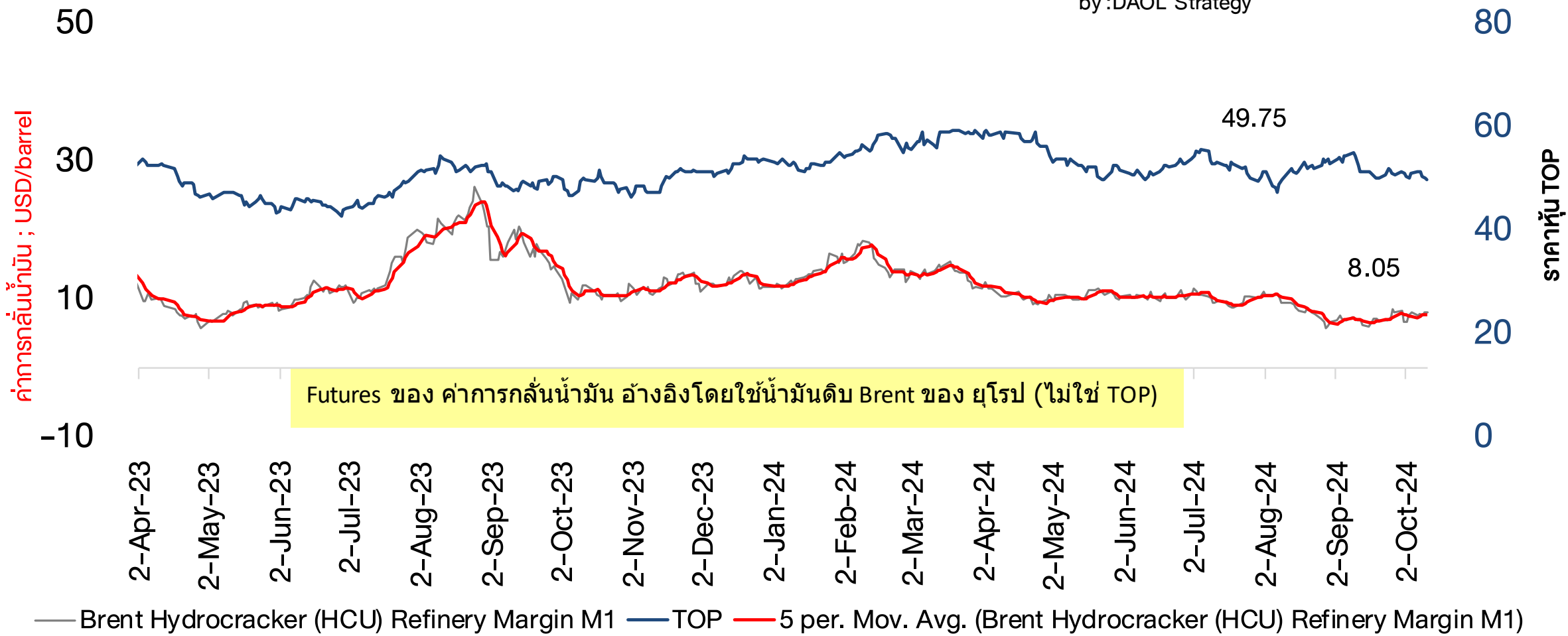
Currency : Local Currency

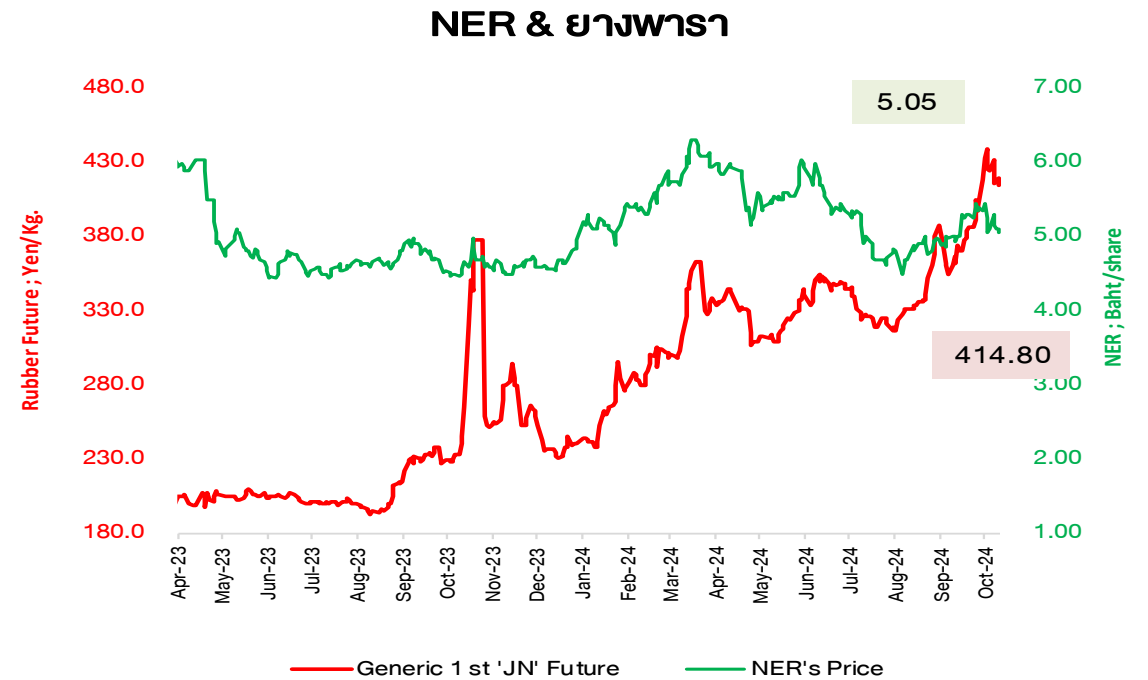
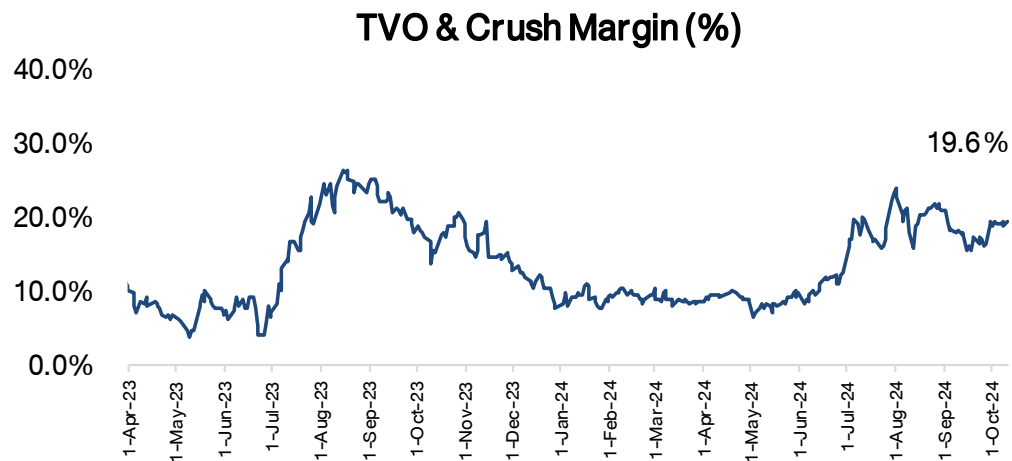
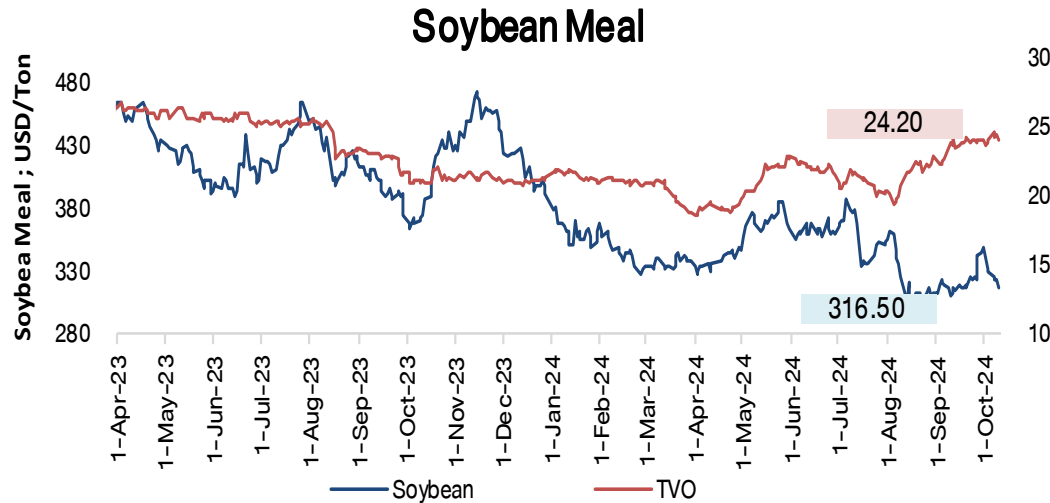
Spread ปีโตรเคมี และ ดัชนีราคาสินค้าโภคภัณฑ์



ราคาหุ้นโรงกลั่นน้ำมัน (TOP) กับค่าการกลั่นน้ำมัน

by : DAOL Strategy

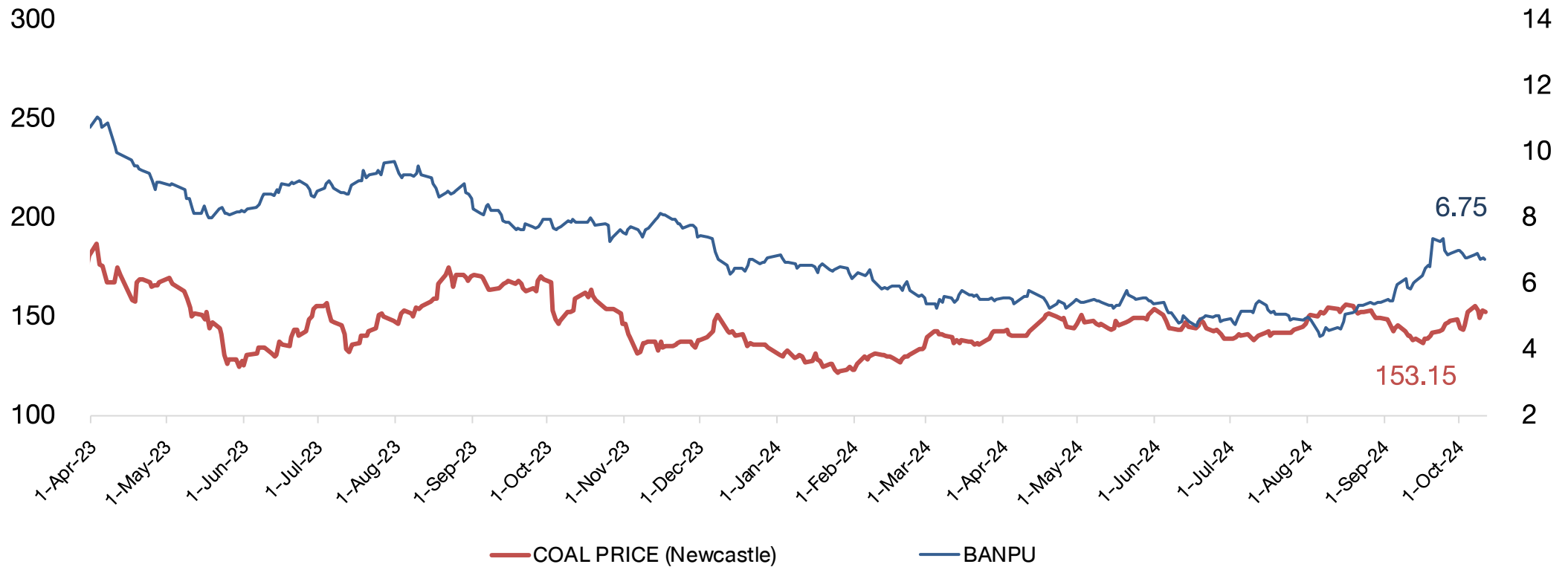




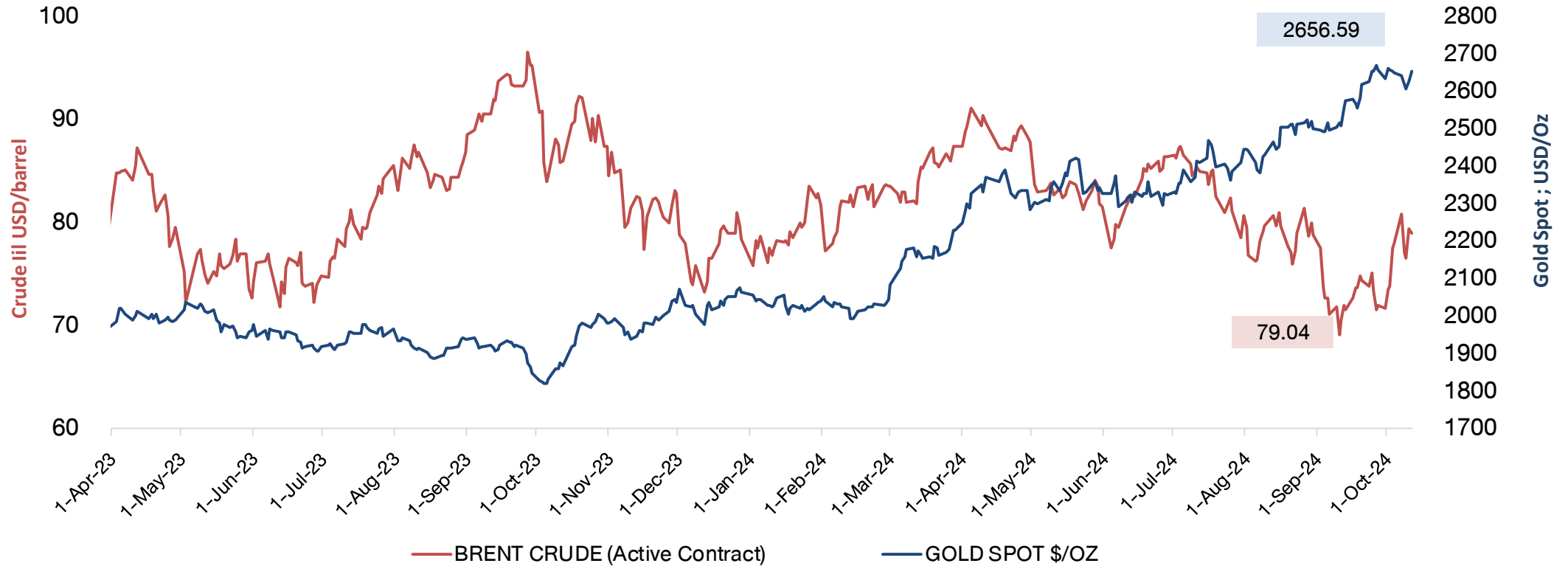
COTTON



COAL PRICE (Newcastle) & BANPU



Brent Crude & Gold Price



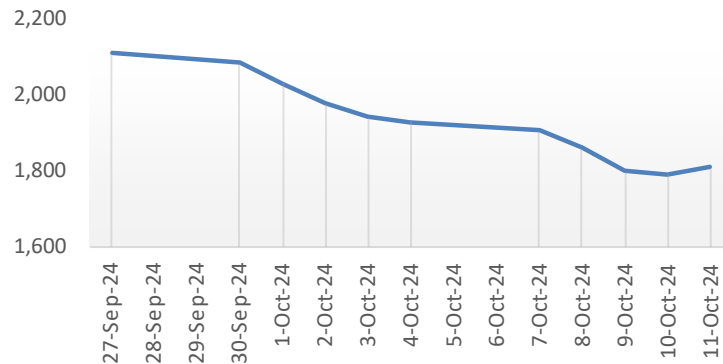
Shipping Index and Stock Performance

11-Oct-24

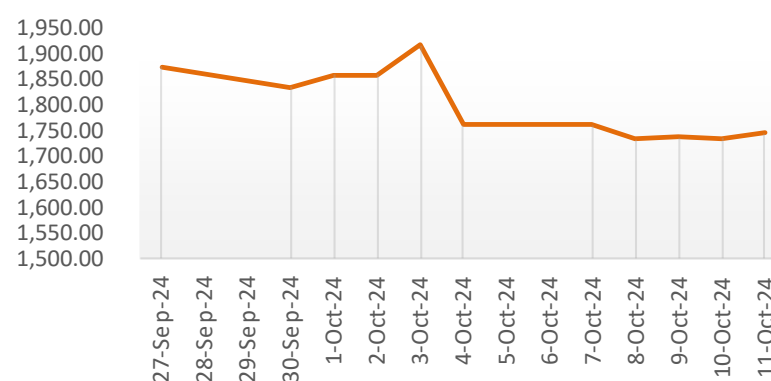
	BALTIC DRY INDEX (BDIY Index)	Change	BLOOMBERG DRY SHIPS INDEX (BDSX Index)	Change	TOPIX MARITIME TRAN INDX (TPMART Index)	Change	Container Ship Time Charter Assessment Index (ConTex)	Change	Stock Price					
									TTA	Change	PSL	Change	RCL	Change
11-Oct-24	1,809.00	1.1%	1,809.00	1.1%	1,746.66	0.6%	1,274.00	0.0%	5.75	-0.9%	8.70	0.6%	23.50	0.4%
10-Oct-24	1,790.00	-0.5%	1,790.00	-0.5%	1,736.32	-0.2%	1,274.00	0.0%	5.80	0.0%	8.65	-0.6%	23.40	-3.7%
9-Oct-24	1,799.00	-3.3%	1,799.00	-3.3%	1,739.22	0.3%	1,274.00	0.0%	5.80	-2.5%	8.70	-1.7%	24.30	-0.4%
8-Oct-24	1,860.00	-2.5%	1,860.00	-2.5%	1,734.24	-1.6%	1,274.00	-0.5%	5.95	0.0%	8.85	-1.7%	24.40	0.8%
7-Oct-24	1,907.00	-1.1%	1,907.00	-1.1%	1,762.80	0.0%	1,281.00	0.0%	5.95	0.8%	9.00	0.0%	24.20	-1.2%
4-Oct-24	1,928.00	-0.7%	1,928.00	-0.7%	1,763.05	-8.2%	1,281.00	0.0%	5.90	-1.7%	9.00	-2.2%	24.50	-0.8%
3-Oct-24	1,941.00	-1.9%	1,941.00	-1.9%	1,919.63	3.2%	1,281.00	0.0%	6.00	-4.8%	9.20	-1.1%	24.70	-3.1%
2-Oct-24	1,978.00	-2.6%	1,978.00	-2.6%	1,860.80	0.0%	1,281.00	0.0%	6.30	-2.3%	9.30	-2.1%	25.50	-3.8%
1-Oct-24	2,030.00	-2.6%	2,030.00	-2.6%	1,861.58	1.4%	1,281.00	-0.1%	6.45	1.6%	9.50	0.0%	26.50	-1.9%
30-Sep-24	2,084.00	-1.2%	2,084.00	-1.2%	1,836.39	-2.1%	1,282.00	0.0%	6.35	0.0%	9.50	2.7%	27.00	2.9%
27-Sep-24	2,110.00		2,110.00		1,876.71		1,282.00		6.35		9.25		26.25	

Remark : TTA and PSL are member of Bloomberg Dry Ships Index

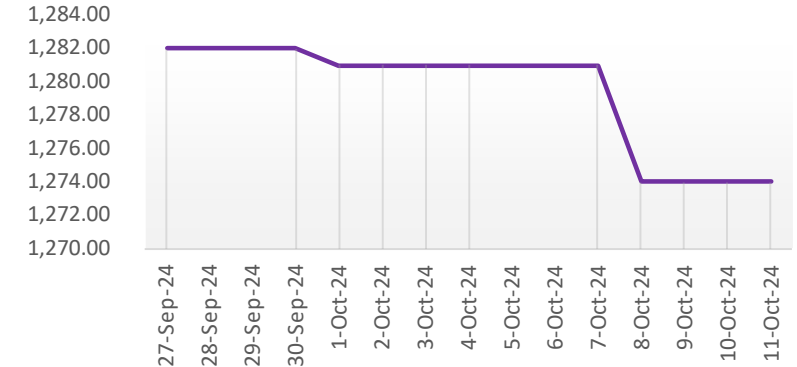
BLOOMBERG DRY SHIP INDEX



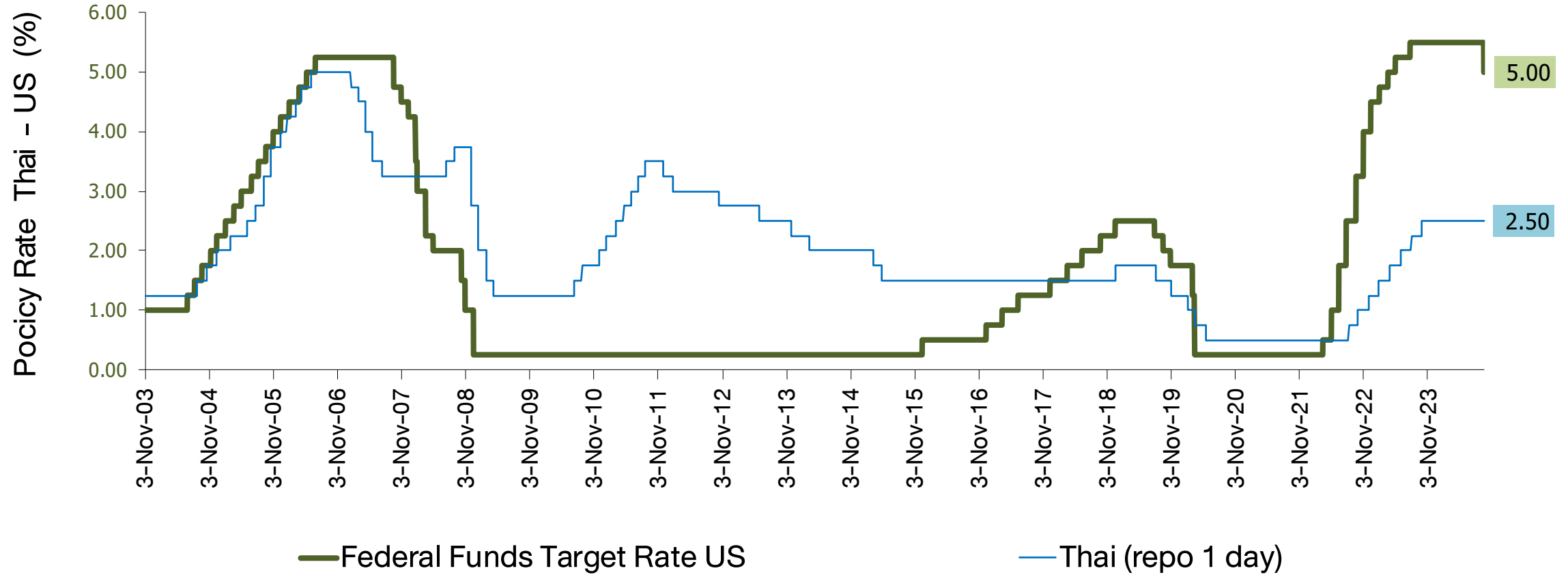
TOPIX MARITIME TRAN INDEX (TPMART Index)



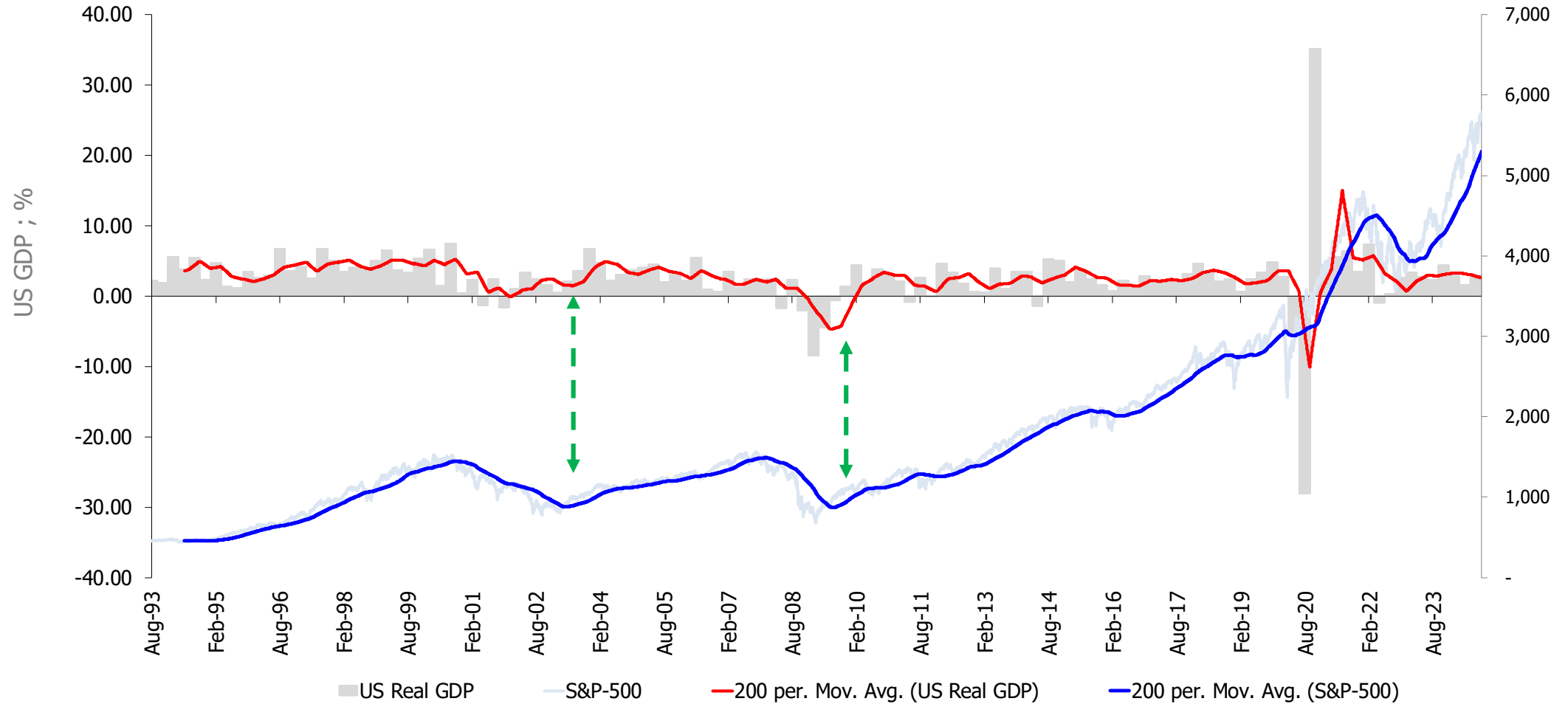
Container Ship Index (Con Tex)



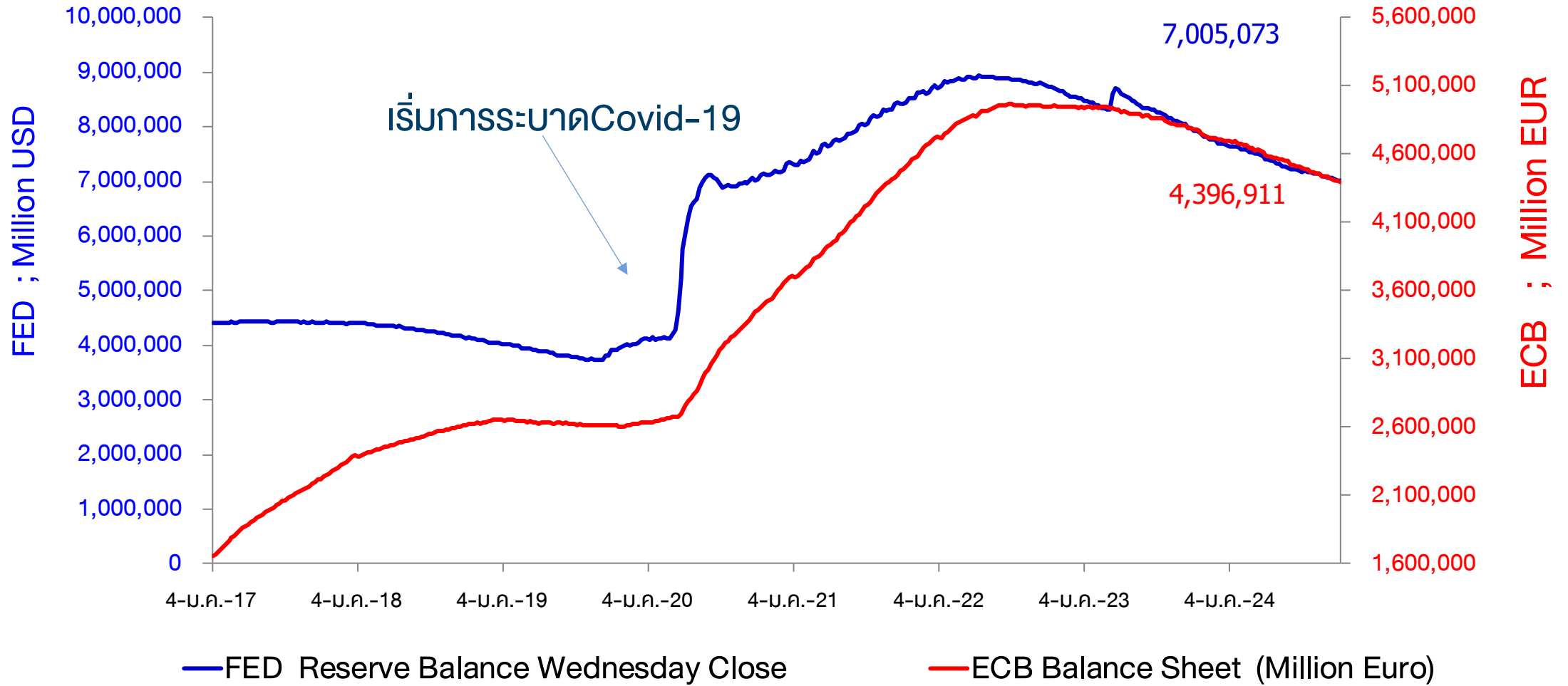
Federal Funds Rate & Thai Rate

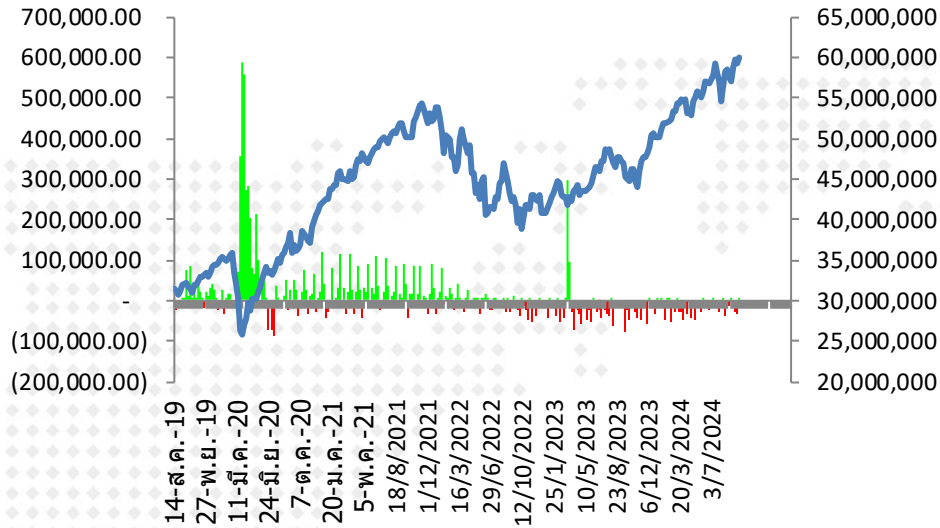


US Real GDP and S&P-500



Fed & ECB : Assets Purchase (QE Program)

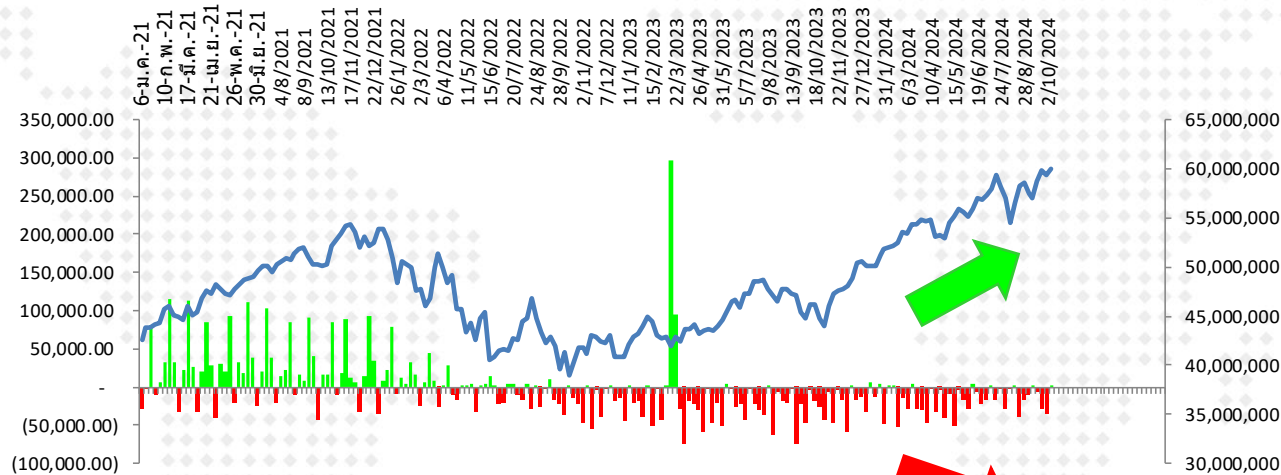




ตัวเลขการซื้อขายของ
Fed (QE) รายสัปดาห์

■ FED Reserve Balance Wednesday Close

— Bloomberg United States Exchange Market Capitalization USD

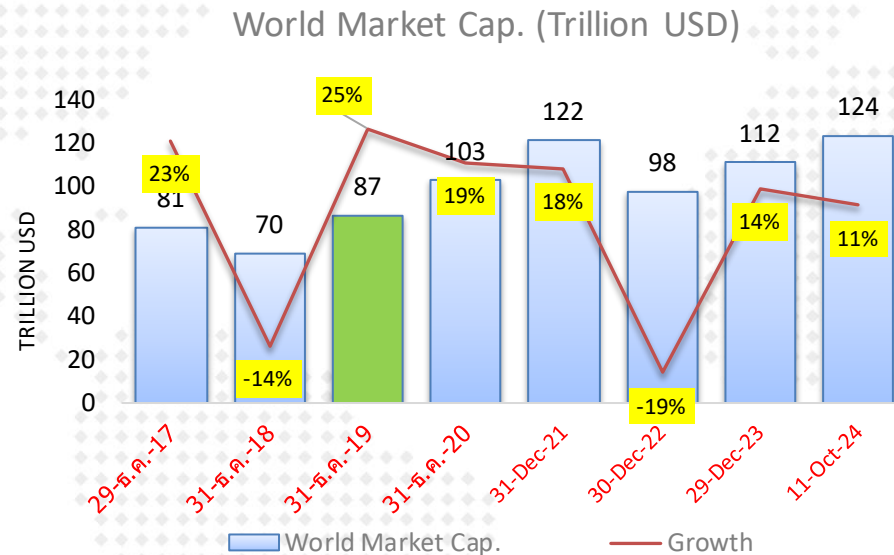


■ FED Reserve Balance Wednesday Close

— Bloomberg United States Exchange Market Capitalization USD

(27,338.00)	20/3/2024	7,478,100.0
(29,610.00)	27/3/2024	7,448,490.0
(45,575.00)	3/4/2024	7,402,915.0
(735.00)	10/4/2024	7,402,180.0
(32,502.00)	17/4/2024	7,369,678.0
(3,086.00)	24/4/2024	7,366,592.0
(40,314.00)	1/5/2024	7,326,278.0
(8,745.00)	8/5/2024	7,317,533.0
(49,357.00)	15/5/2024	7,268,176.0
(4,596.00)	22/5/2024	7,263,580.0
(15,409.00)	29/5/2024	7,248,171.0
(28,914.00)	5/6/2024	7,219,257.0
3,739.00	12/6/2024	7,222,996.0
(6,166.00)	19/6/2024	7,216,830.0
(21,390.00)	26/6/2024	7,195,440.0
(15,122.00)	3/7/2024	7,180,318.0
3,027.00	10/7/2024	7,183,345.0
(16,172.00)	17/7/2024	7,167,173.0
(2,806.00)	24/7/2024	7,164,367.0
(27,942.00)	31/7/2024	7,136,425.0
(2,661.00)	7/8/2024	7,133,764.0
2,264.00	14/8/2024	7,136,028.0
(37,948.00)	21/8/2024	7,098,080.0
(16,967.00)	28/8/2024	7,081,113.0
(10,948.00)	4/9/2024	7,070,165.0
2,934.00	11/9/2024	7,073,099.0
(6,040.00)	18/9/2024	7,067,059.0
(28,951.00)	25/9/2024	7,038,108.0
(33,686.00)	2/10/2024	7,004,422.0
651.00	9/10/2024	7,005,073.0

การเปลี่ยนแปลงของ Market Cap. ตลาดหุ้นโลก นับตั้งแต่ปี 2017 - ปัจจุบัน



	World Market Cap.	Growth
30-ธ.ค.-16	66,383,155	
29-ธ.ค.-17	81,434,892	23%
31-ธ.ค.-18	69,647,068	-14%
31-ธ.ค.-19	86,990,167	25%
31-ธ.ค.-20	103,229,711	19%
31-Dec-21	121,522,850	18%
30-Dec-22	97,867,296	-19%
29-Dec-23	111,605,590	14%
11-Oct-24	123,880,220	11%

หมายเหตุ : การอัดฉีดเงินเข้าระบบของธนาคารกลางต่าง มีส่วนให้ตลาดหุ้นปรับตัวสูงขึ้น ในช่วงปี 2020-2021

Market P/E (current & Forward)

12-Oct-24

Index Name	country	Index	P/E Ratio			Dividend Yield	Current Earnings Yield	LAST_UPDATE	TIME	
			Trailing 12M	Forward ('24)	Forward ('25)					
			Current 12M	2567(f)	2568(f)					
FTSE Bursa Malaysia KLCI	MA	1,633.55	15.08	15.05	13.84	4.12	6.63	11-Oct-24	11-Oct-24	มาเลเซีย
PSEI - PHILIPPINE SE IDX	PH	7,310.32	13.19	12.45	11.25	2.60	7.58	11-Oct-24	11-Oct-24	ฟิลิปปินส์
Straits Times Index STI	SI	3,573.76	12.57	11.63	11.13	4.91	7.96	11-Oct-24	11-Oct-24	สิงคโปร์
KOSPI INDEX	SK	2,596.91	13.35	10.25	8.30	1.89	7.49	11-Oct-24	11-Oct-24	เกาหลีใต้
TAIWAN TAIEX INDEX	TA	22,901.64	23.02	18.53	16.20	2.45	4.34	11-Oct-24	11-Oct-24	ไต้หวัน
STOCK EXCH OF THAI INDEX	TH	1,470.10	17.67	15.98	14.51	3.19	5.66	11-Oct-24	11-Oct-24	ไทย (SET)
THAI SET 50 INDEX	TH	936.64	17.73	17.12	15.43	2.93	5.64	11-Oct-24	11-Oct-24	ไทย (SET50)
SENSEX	IN	81,381.36	24.74	23.21	20.11	1.19	4.04	11-Oct-24	11-Oct-24	อินเดีย
JAKARTA COMPOSITE INDEX	ID	7,520.60	18.00	14.36	13.53	3.10	5.56	11-Oct-24	11-Oct-24	อินโดนีเซีย
HO CHI MINH STOCK INDEX	VN	1,288.39	15.86	12.16	10.14	1.79	6.31	11-Oct-24	11-Oct-24	เวียดนาม
SHANGHAI SE A SHARE INDX	CH	3,372.45	15.53	12.87	11.68	2.67	6.44	11-Oct-24	11-Oct-24	จีน (A-Shares)
SHANGHAI SE COMPOSITE	CH	3,217.74	15.53	12.87	11.68	2.67	6.44	11-Oct-24	11-Oct-24	จีน (Composite)
HANG SENG INDEX	HK	21,251.98	11.36	10.22	9.57	3.76	8.81	10-Oct-24	10-Oct-24	ฮ่องกง
DOW JONES INDUS. AVG	US	42,863.86	23.24	21.92	19.38	1.74	4.30	12-Oct-24	11-Oct-24	สหรัฐฯ (Dow Jones)
S&P 500 INDEX	US	5,815.03	26.53	24.51	21.18	1.28	3.77	12-Oct-24	11-Oct-24	สหรัฐฯ (S&P-500)
NASDAQ COMPOSITE	US	18,342.94	40.54	34.78	27.37	0.74	2.47	12-Oct-24	11-Oct-24	สหรัฐฯ (Nasdaq)
CAC 40 INDEX	FR	7,577.89	14.01	14.44	13.37	3.25	7.14	11-Oct-24	11-Oct-24	ฝรั่งเศส
DAX INDEX	GE	19,373.83	16.13	14.65	12.86	2.84	6.20	12-Oct-24	11-Oct-24	เยอรมัน
NIKKEI 225	JN	39,605.80	23.79	21.48	19.76	1.70	4.20	11-Oct-24	11-Oct-24	ญี่ปุ่น (Nikkei)
FTSEUROFIRST 300 INDEX	EC	2,068.88	15.50	14.83	13.83	3.22	6.45	11-Oct-24	11-Oct-24	ยุโรป (300 บริษัท)
Euro Stoxx 50 Pr	EC	5,003.92	14.45	14.56	13.53	3.15	6.92	11-Oct-24	11-Oct-24	ยุโรป (50 บริษัท)
STXE 600 (EUR) Pr	EC	521.98	15.59	14.75	13.65	3.26	6.41	11-Oct-24	11-Oct-24	ยุโรป (600 บริษัท)
MSCI WORLD	MULT	3,731.93	22.99	21.00	18.67	1.75	4.35	12-Oct-24	11-Oct-24	ตลาดหุ้นโลก (MSCI)

Source : Bloomberg

Total Return Index : ผลตอบแทนจากการลงทุนในตลาดต่าง ในแต่ละช่วงเวลา

	MSCI World		MSCI EM		MSCI APAC ex Japan		S&P-500		SET Index		NASDAQ	
	Total Return	SD*	Total Return	SD*	Total Return	SD*	Total Return	SD*	Total Return	SD*	Total Return	SD*
5 day	0.1%	6.6%	-1.9%	20.4%	-2.3%	25.6%	0.5%	13.3%	1.7%	5.1%	0.8%	16.8%
1 month	5.1%	8.3%	9.0%	16.1%	11.1%	18.5%	5.3%	9.9%	3.0%	9.5%	7.4%	14.9%
3 month	3.2%	13.8%	4.7%	16.9%	6.7%	18.3%	3.0%	16.2%	12.1%	12.8%	-1.8%	23.2%
6 month	10.7%	11.6%	11.2%	15.0%	15.4%	16.3%	12.8%	13.5%	6.5%	11.8%	13.5%	19.7%
9 month	18.8%	10.6%	19.5%	13.8%	25.0%	15.3%	22.1%	12.7%	7.3%	11.2%	22.8%	18.3%
12 month	29.9%	10.5%	25.7%	13.7%	28.3%	15.1%	34.6%	12.5%	5.9%	11.7%	35.8%	17.7%
Month to date	-0.4%	6.6%	-1.2%	17.9%	-0.9%	22.1%	0.4%	11.6%	1.4%	10.1%	0.5%	15.6%
Quarter to date	-0.4%	6.6%	-1.2%	17.9%	-0.9%	22.1%	0.4%	11.6%	1.4%	10.1%	0.5%	15.6%
Year to date	18.2%	10.5%	15.5%	13.7%	20.0%	15.1%	22.5%	12.6%	7.1%	11.2%	22.5%	18.3%
2 ปี	25.4%	11.8%	17.4%	14.4%	18.8%	16.2%	28.5%	14.5%	-0.2%	11.2%	32.8%	19.7%
3 ปี	7.5%	14.2%	-0.1%	15.9%	0.3%	17.3%	11.3%	17.6%	-0.6%	11.3%	8.7%	23.6%
4 ปี	11.6%	13.5%	3.3%	15.7%	2.7%	17.0%	15.3%	16.7%	6.9%	12.6%	13.0%	22.4%
5 ปี	12.4%	17.1%	5.6%	17.5%	6.5%	18.2%	16.3%	21.3%	1.3%	17.0%	19.1%	25.4%
10 ปี	9.8%	14.4%	4.1%	15.9%	5.4%	16.2%	13.8%	17.9%	2.6%	14.6%	16.8%	21.4%

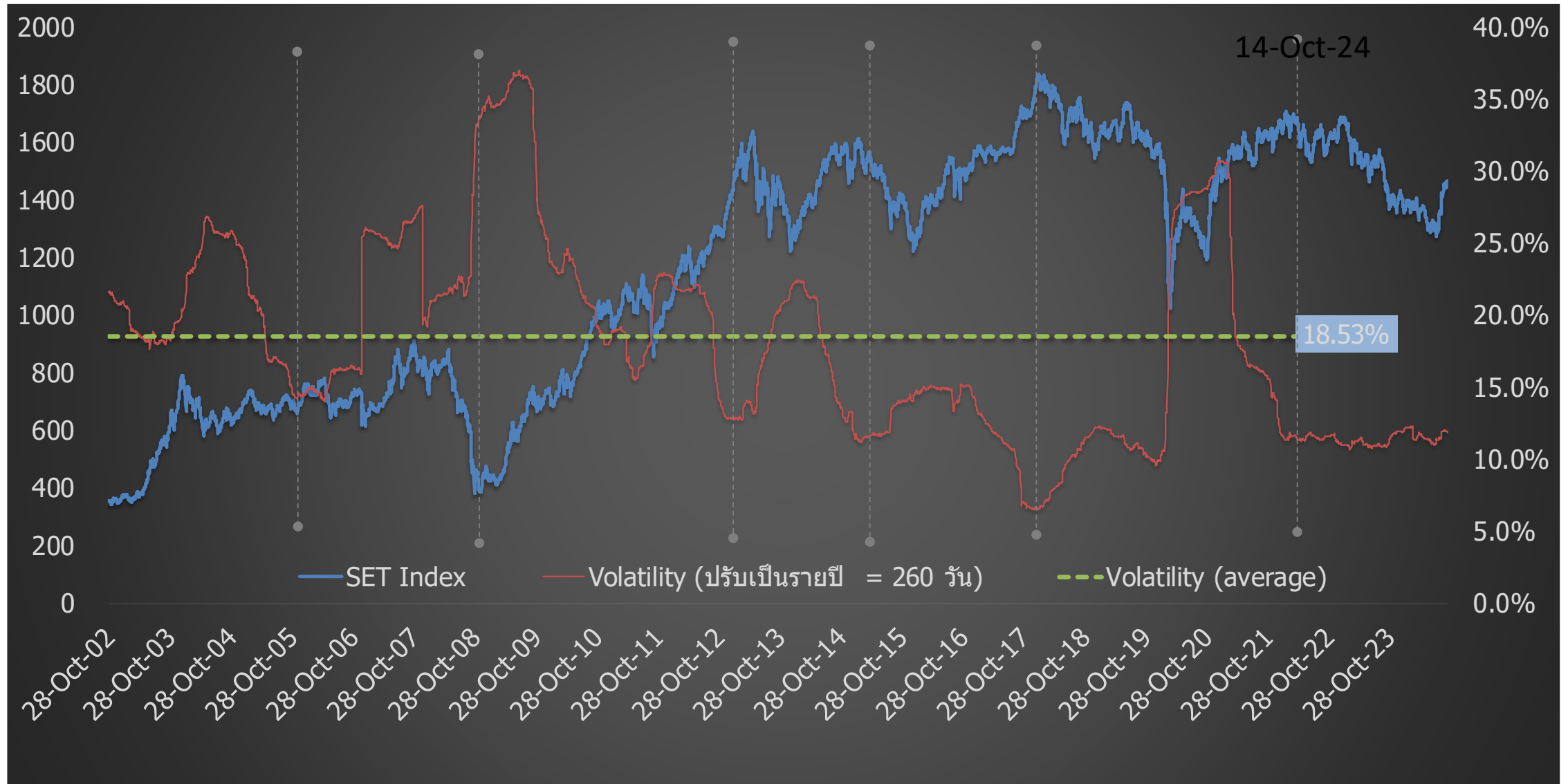
Remark : Total Return วัดจากวันสุดท้ายเทียบกับวันแรกของช่วงเวลานั้นๆ

14-Oct-2024

Source : Bloomberg

SD* = Standard Deviation ปรึ้มเป็น Annualized

ตลาดหุ้นไทย อยู่ในภาวะซบเซา ก็นเวลานานที่สุดที่เคยมีมา



SET Index Target for 2024

11-Sep-24

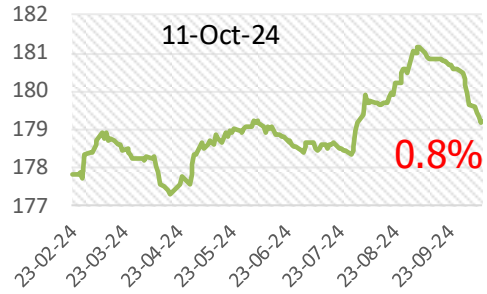
			SET TARGET		
			Worst	Base	Best
			-0.25 SD	+0 SD	+0.25 SD
	Net Profit	Net Profit Growth	EPS		
			16.62	17.28	17.95
Year 2020	453,584	-51%	41.8		
<i>(Exclude THAI)</i>	594,755	-35%	54.9		
Year 2021	1,016,531	124%	89.2		
Year 2022	1,001,815	-1.4%	84.0		
Year 2023	937,784	-6.4%	76.5		
Year 2024					
Base	1,061,657	13.2%	85.9	1542	
<i>SET Target for Year 2024 : Average P/E = 17.3 ; 1 SD = 2.64 times ; P/E= 17.96 (+0.25SD) ; Share = 12,354 Mil. Shares</i>					
Year 2025					
Best	1,146,589	8%	92.8		
Base	1,194,561	12.5%	96.6	1670	
Worst	1,220,905	15%	98.8		
<i>SET Target for Year 2025 : Average P/E = 17.3 ; 1 SD = 2.64 times ; P/E= 17.28 (Avg.) ; Share = 12,362 Mil. Shares</i>					
Year 2026	1,289,059	7.9%	104.3	1733	
<i>SET Profit for Year 2026 : Estimate Net Profit Growth = 7.9% (Bloomberg Survey ; 9 Sep 24) ; P/E=16.62x (-0.25SD)</i>					

Remark : Year 2021-2025 Exclude "THAI", STARK

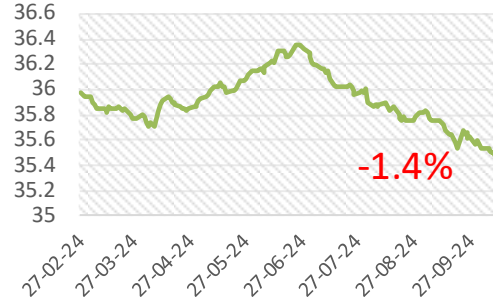
- กำไรของปี 2024 เราปรับขึ้น 5.2% จากประมาณการเดิม เป็น 1.061 ล้านล้านบาท EPS ปรับจาก 81.6 เป็น 85.9 บาท..... ดชนีสิ้นปี คาดอยู่ที่ 1542 จุด
- ปี '25 คาดกำไรขยายตัว 12.5% อยู่ที่ 1.19 ล้านล้านบาท ; EPS 96.6 บาท/หุ้น ค่า Forward P/E อยู่ที่ 14.8x (1431จุด)
- เป้าหมายดัชนี ปี '25 ที่ 1670 จุด โดยใช้ P/E ที่ค่าเฉลี่ย (17.3x)
- ความเสี่ยงที่จะทำให้ ดชนี ปี '25 ไม่ถึงเป้าหมาย คือ มีปัญหาด้านการเมือง หรือ เศรษฐกิจยังโตช้า และจีน ยังไม่ฟื้น

การปรับ EPS ตลาดหุ้นสำคัญๆ ปี 2024

MSCI WORLD



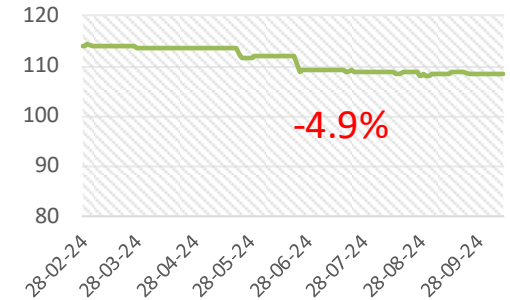
STXE 600 (EUR) Pr



US (s&p-500)



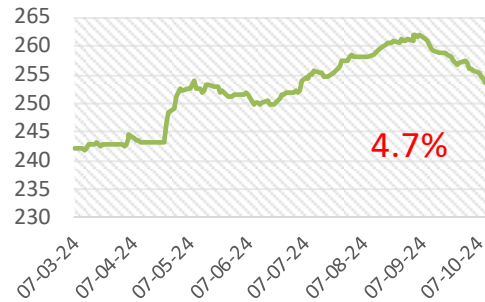
Malaysia



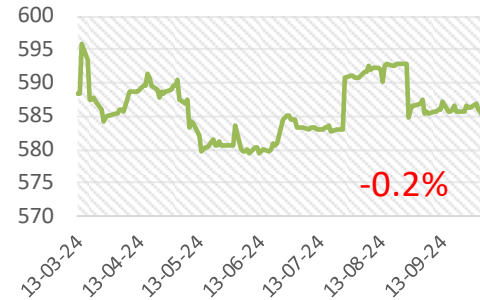
Thailand



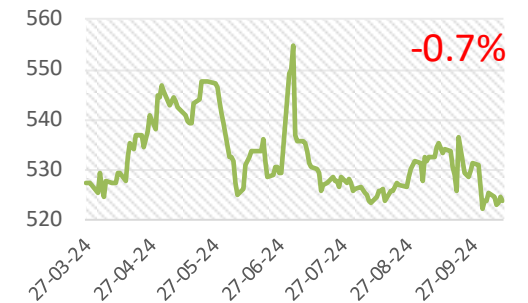
South Korea



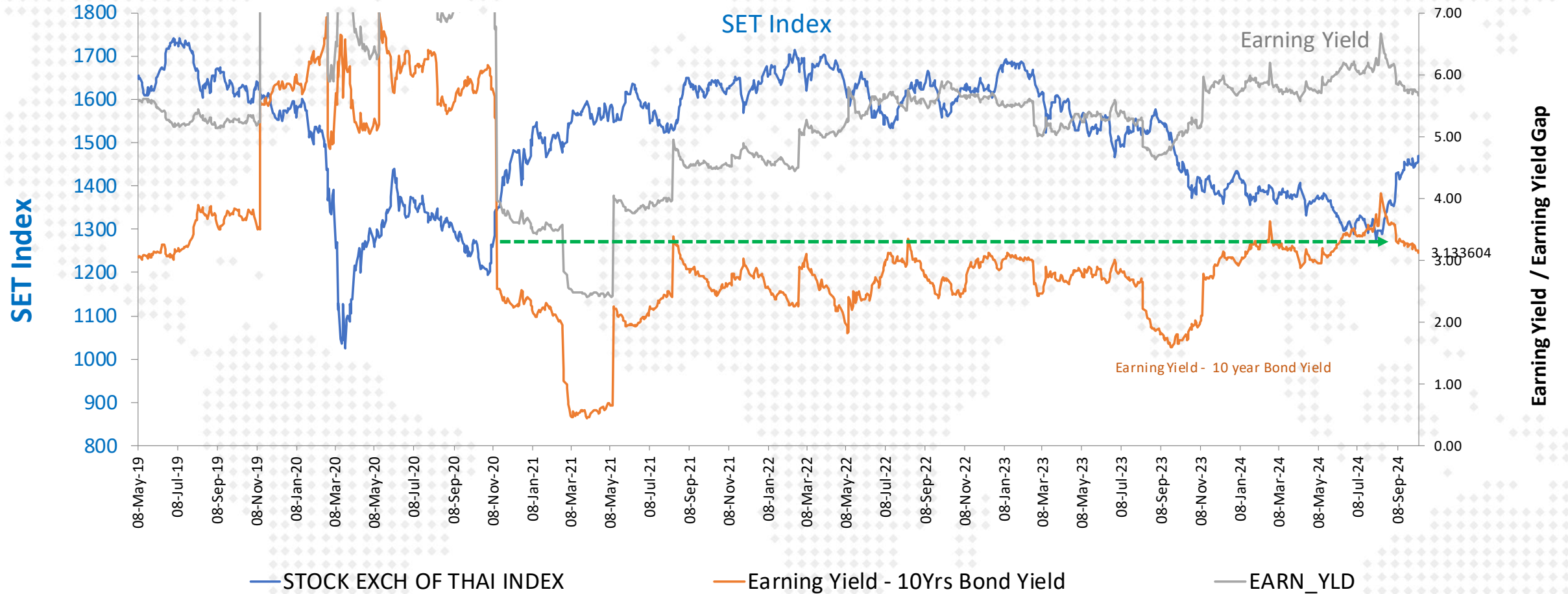
Philippine



Indonesia

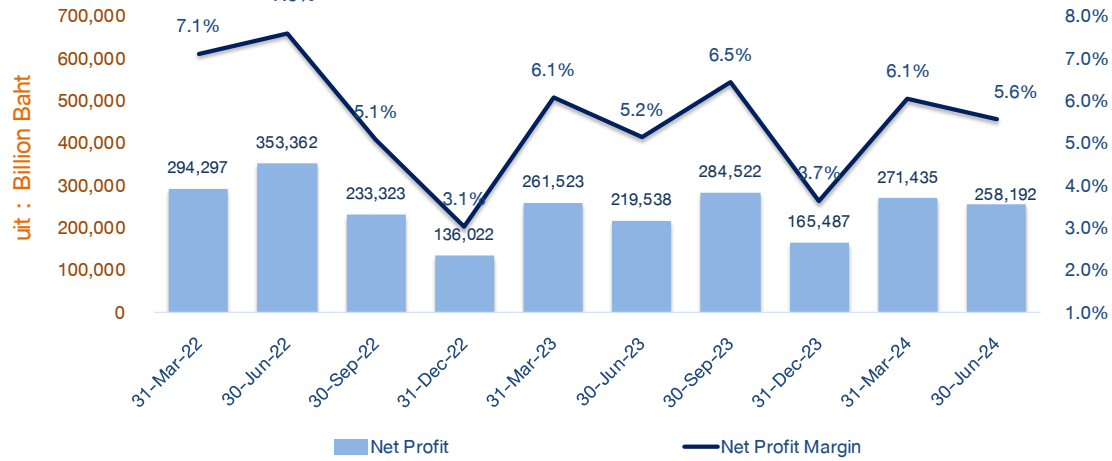


Thai Stock Market (Earning Yield Gap)

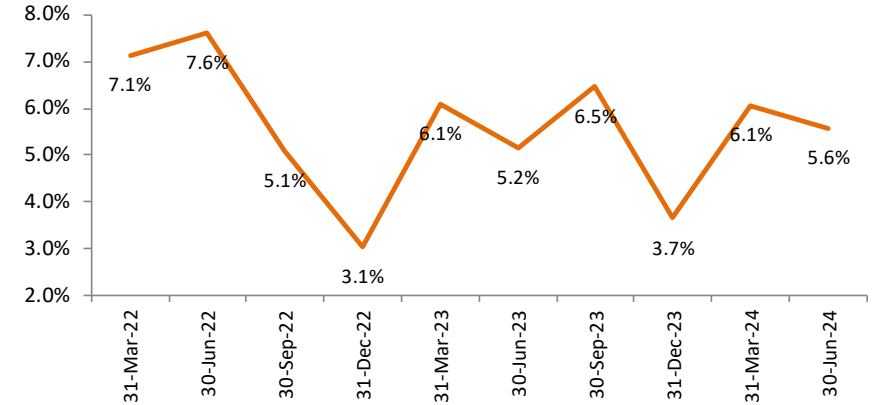


SET Profitability as of 2Q-2024

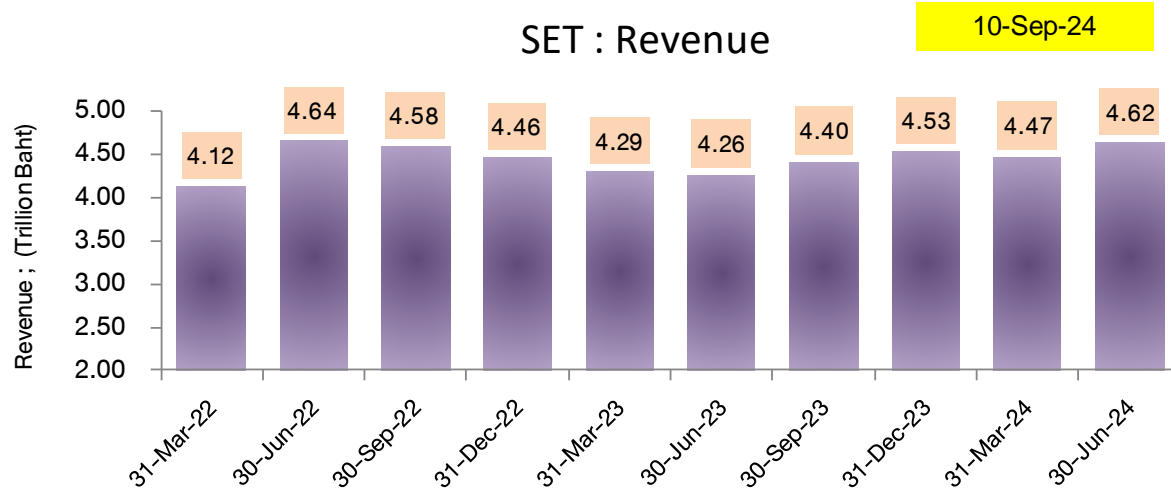
SET : Net Profit & Net Profit Margin



SET : Net Profit Margin

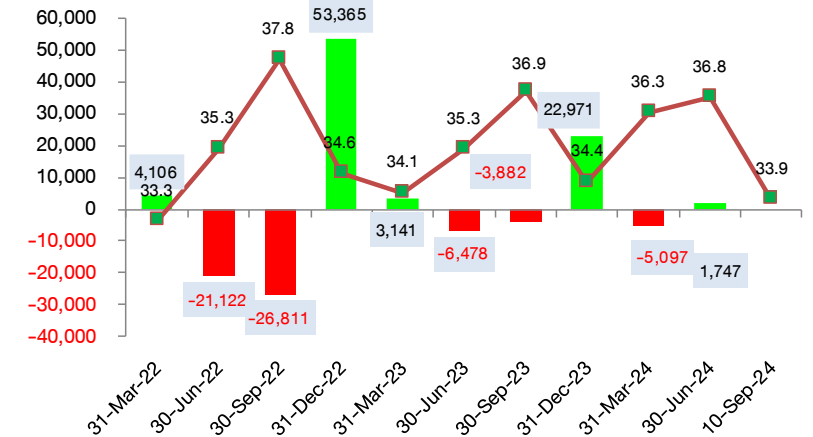


SET : Revenue



FX Gain/Loss บริษัทในตลาด

(ข้อมูลเบื้องต้นจาก Bloomberg)







Disclaimer: This report has been prepared by DAOL SECURITIES (THAILAND). The information herein has been obtained from sources believed to be reliable and accurate; however, DAOL SEC makes no representation as to the accuracy and completeness of such information. Information and opinions expressed herein are subject to change without notice. DAOL SEC has no intention to solicit investors to buy or sell any securities in this report. In addition, DAOL SEC does not guarantee returns nor price of the securities described in the report nor accept any liability for any loss or damage of any kind arising out of the use of such information or opinions in this report. Investors should study this report carefully in making decisions. All rights are reserved. This report may not be reproduced, distributed or published by any person in any manner for any purpose without the permission of DAOL SEC Investment in securities has risks. Investors are advised to consider carefully before making decisions.

DAOL SEC

DAOL SECURITIES (THAILAND) PCL
บริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน)

'DAOL, your lifetime financial partner'

 contactcenter@daol.co.th  02 351 1800 กด 1  www.daolsecurities.co.th

 [daol.th](https://www.facebook.com/daol.th)  DAOL Channel  @daolsec