

DAOL Daily Strategy

27 Jun 2024

ฝ่ายวิเคราะห์กลยุทธ์การลงทุนหลักทรัพย์

เบอร์โทรศัพท์ : 02-351-1801

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

“ ThaiESG ไม่ช่วย จั๊น วายุกั๊กษ์ ช่วยตลาดได้มัย ”

ประเด็นวิเคราะห์วันนี้

- เดาใจคล้ายๆ วายุกั๊กษ์(reissue) จั๊กซอร์ตัวสำคัญ ของโครงการ “Digital wallet”
- ลุยกันต่อ โรงไฟฟ้า และ Data center
- เงินเยน ร่วงกระจาย หุ่นไทยตัวไหนเดือดร้อน
- สปท. คง GDP แต่ใส่ใน มันเป็นอย่างไบบ้าง กลุ่มกลุ่มไหนจะดี หรือจะร้าย

SET Impact Gain	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
GULF	0.9500	41.00↓	1.00	2.50	273082	1132145
AOT	0.8625	58.75↓	0.75	1.29	222037	1295360
TRUE	0.8370	8.75↓	0.30	3.55	1898859	1670537
PTT	0.5775	32.75↓	0.25	0.77	133013	435561
DELTA	0.5050	84.50↓	0.50	0.60	124469	1057379
ADVANC	0.2400	211.00↑	1.00	0.48	37036	780481
BH	0.1800	246.00↑	3.00	1.23	27862	683312
JTS	0.1650	61.25↑	2.75	4.70	7877	47217
TOP	0.1350	54.00↓	0.75	1.41	93001	498510
SPRC	0.1050	8.40↓	0.30	3.70	181241	150826
BBL	0.0750	133.00↓	0.50	0.38	65131	859171
CPF	0.0680	23.20↑	0.10	0.43	203212	467728
BTG	0.0640	22.20↓	0.40	1.83	17488	38708
BCH	0.0600	17.70↓	0.30	1.72	111510	196237
BCP	0.0550	38.50↓	0.50	1.32	53932	205088
KTIS	0.0496	3.16↑	0.16	5.33	164	52
TIDLOR	0.0480	19.10↓	0.20	1.06	66469	126677
RATCH	0.0450	27.25↓	0.25	0.93	11013	30013
RABBIT_P	0.0432	0.40	0.02	5.26	27317	1090
BSRC	0.0420	9.30	0.15	1.64	10127	9399
SPI	0.0375	67.00↑	0.75	1.13	374	2472
COCOCO	0.0360	13.40↑	0.30	2.29	119027	159489
RCL	0.0350	28.75↓	0.50	1.77	61890	173432
VIH	0.0325	9.95↑	0.65	6.99	111591	108841
DDD	0.0300	9.45	1.00	11.83	4855	4514
DOHOME	0.0260	10.40	0.10	0.97	30787	32015
TASCO	0.0260	16.10↑	0.20	1.26	18190	29112
TQM	0.0250	26.75↑	0.50	1.90	3542	9329
OSP	0.0240	23.30↑	0.10	0.43	71788	166617
SIS	0.0225	28.50↑	0.75	2.70	3827	10804

mai Impact Gain	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
AU	0.2765	7.60↑	0.35	4.83	11894	8876
TRP	0.2380	12.10↑	0.70	6.14	11195	13415
BTC	0.1798	0.53	0.02	3.92	134517	7024
KLINIQ	0.1575	44.75	0.75	1.70	12838	57159
LTS	0.1500	8.40	0.75	9.80	31182	25546
MEB	0.1450	31.00↑	0.50	1.64	5683	17403
KCC	0.0960	2.60↑	0.16	6.56	22599	6045
JPARK	0.0780	8.85↑	0.20	2.31	97751	83285
QTCG	0.0754	0.69	0.13	23.21	1752897	116739
AS	0.0702	3.12	0.06	1.96	76768	23863
SECURE	0.0700	16.00	0.70	4.58	6481	10308
PSTC	0.0668	0.51	0.02	4.08	206748	10469
BPS	0.0663	0.71↑	0.17	31.48	622018	41400
MTW	0.0650	1.57↑	0.10	6.80	71226	10971
AIRA	0.0609	1.86	0.01	0.54	903	142
SPVI	0.0546	2.70↑	0.14	5.47	4998	1352
NTSC	0.0500	12.40	0.50	4.20	1118	1355
TERA	0.0483	1.80	0.21	13.21	170266	31485
TITLE	0.0450	3.96	0.06	1.54	398	157
KUN	0.0432	1.49	0.06	4.20	748	109
APO	0.0429	1.50↑	0.13	9.49	102367	14950
ZIGA	0.0426	2.00	0.06	3.09	31042	6172
YUASA	0.0400	11.60↑	0.40	3.57	386	443
SWC	0.0384	3.48↓	0.08	2.35	156	55
PLT	0.0372	0.77↑	0.04	5.48	39840	2991
FSMART	0.0365	5.50↑	0.05	0.92	3948	2163
STOWER	0.0357	0.07	0.01	16.67	2979	19
JUBILE	0.0340	13.90↑	0.20	1.46	380	523
KJL	0.0330	6.65↑	0.15	2.31	1988	1302
MUD	0.0306	1.35	0.03	2.27	68	9

SET Impact Loss	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
CPAXT	-0.8500	27.75	-1.00	-3.48	81139	226366
CPN	-0.4500	56.00↓	-1.25	-2.18	75962	426686
MINT	-0.3450	30.50↓	-0.75	-2.40	85515	262435
AWC	-0.2590	3.52↓	-0.10	-2.76	771487	273347
GPSC	-0.2300	40.75↑	-1.00	-2.40	140353	580415
KBANK	-0.1900	126.50↓	-1.00	-0.78	70873	899027
CPALL	-0.1825	56.00	-0.25	-0.44	247290	1380809
IVL	-0.1350	20.50↑	-0.30	-1.44	173638	356078
SCB	-0.1350	106.00↓	-0.50	-0.47	76168	807834
BEM	-0.1240	7.65↓	-0.10	-1.29	372917	286269
CRC	-0.1225	31.00	-0.25	-0.80	98686	305441
KTB	-0.1130	17.00	-0.10	-0.58	106425	181442
KTC	-0.1050	42.00↓	-0.50	-1.18	37094	155980
SCC	-0.1000	227.00↓	-1.00	-0.44	15357	348397
OR	-0.0970	16.30↓	-0.10	-0.61	56266	92193
LH	-0.0970	6.00	-0.10	-1.64	490824	297390
ITC	-0.0960	23.40↓	-0.40	-1.68	77582	182932
EA	-0.0900	17.20	-0.30	-1.71	365058	640617
SCGP	-0.0875	34.00	-0.25	-0.73	22748	77363
BTS	-0.0848	4.66↓	-0.08	-1.69	463318	217271
CCET	-0.0840	3.96↓	-0.10	-2.46	407395	164101
GLOBAL	-0.0840	15.10	-0.20	-1.31	24597	37400
TTB	-0.0786	1.73↑	-0.01	-0.57	1854922	319745
STA	-0.0720	21.80↑	-0.60	-2.68	130706	286665
CK	-0.0700	21.00	-0.50	-2.33	23531	49456
M	-0.0700	31.00↓	-1.00	-3.12	23007	72192
PRINC	-0.0682	3.08↓	-0.22	-6.67	110171	34295
BJC	-0.0640	21.40↓	-0.20	-0.93	92343	198118
JAS	-0.0552	3.10↓	-0.08	-2.52	295564	92736
HMPRO	-0.0530	9.15	-0.05	-0.54	302505	276474

mai Impact Loss	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
MASTER	-0.1450	64.00	-0.50	-0.78	10345	66696
BBIK	-0.1425	29.50	-0.75	-2.48	6071	18082
MORE	-0.0692	0.05↓	-0.01	-16.67	12964	71
SPA	-0.0620	6.85	-0.05	-0.72	14310	9790
READY	-0.0480	7.10↓	-0.40	-5.33	275	198
BOL	-0.0395	6.95	-0.05	-0.71	2551	1783
NETBAY	-0.0380	17.70	-0.20	-1.12	3459	6157
PIMO	-0.0365	1.86	-0.05	-2.62	69172	12945
CFARM	-0.0336	1.41↓	-0.06	-4.08	561035	83571
24CS	-0.0328	3.32↓	-0.08	-2.35	41364	14009
ADD	-0.0330	4.68↓	-0.22	-4.49	773	363
NAT	-0.0320	5.00↑	-0.10	-1.96	13289	6735
PRI	-0.0310	10.40↑	-0.10	-0.95	4889	5061
AF	-0.0308	0.56	-0.02	-3.45	304	17
AUCT	-0.0265	9.80↓	-0.05	-0.51	4126	4071
BE8	-0.0260	16.90↓	-0.10	-0.59	5723	9754
TPL	-0.0255	1.19↑	-0.05	-4.03	271244	37040
ARROW	-0.0250	5.80	-0.10	-1.69	1243	728
KOOL	-0.0239	0.35↓	-0.01	-2.78	28314	995
ARIN	-0.0232	1.41↑	-0.04	-2.76	791	111
SICT	-0.0230	5.05	-0.05	-0.98	1489	749
PRAPAT	-0.0228	2.12↓	-0.06	-2.75	55270	11694
SRS	-0.0225	5.75	-0.15	-2.54	702	413
CHO	-0.0219	0.07↓	-0.01	-12.50	61623	432
TMW	-0.0200	62.25	-0.50	-0.80	189	1177
MGI	-0.0200	19.70↑	-0.10	-0.51	36636	73473
STP	-0.0200	14.00	-0.20	-1.41	412	575
TRV	-0.0184	2.28	-0.08	-3.39	18	4
TMC	-0.0176	1.39↑	-0.04	-2.80	1708	239
TNP	-0.0154	3.50	-0.02	-0.57	5637	1984



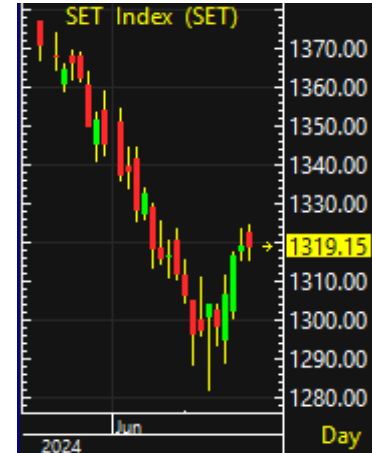
SET	1319.15	+0.01	+0.00%	Vol	Proj.	0.001319.14-100.00%	17:03
GAP:	B.Vol	Bid	Ask	O.Vol	Avg.	%Buy	%Sell
					42.10	53.18	46.82
					1322.72	Volume	8429078
					High	Vol5D	12219846
					Low	Mktcap	16325152
					1315.50	%B-S	6.36
					Prev	Value	35483900
					%Swing	EPS	N/A
					0.68	P/E	17.29
%B_Vol	%	%	%O_Vol	Impact	0.010	DPS	N/A
						Yield(%)	3.48
SET	1319.15	+0.01	+0.00%	35483.90 MB	Gain	243	Lose
						231	Unch
						187	P/E
							17.29

Date	Country	Event	Period	Surv(M)	Prior
25-Jun	TH	Car Sales	May	--	46,738
26-Jun	US	New Home Sales MoM	May	2.7%	-4.7%
27-Jun	JN	Retail Sales MoM	May	1.0%	1.2%
	CH	Industrial Profits YoY	May	--	4.0%
	EC	Consumer Confidence	Jun F	--	14.0
	US	GDP Annualized QoQ	1Q T	1.43%	1.30%
	US	Advance Goods Trade Balance	May	-\$95.24b	-\$99.4b
	US	Initial Jobless Claims	Jun-22	--	238k
	US	Pending Home Sales MoM	May	--	-7.7%
28-Jun	JN	Industrial Production YoY	May P	0.2%	-1.8%
	TH	Mfg Production Index ISIC NSA YoY	May	1.9%	3.4%
	TH	BoT : Thai's Economic Monthly Report	May	--	-\$40m
	US	PCE Deflator MoM	May	0.0%	0.3%
	US	PCE Deflator YoY	May	2.6%	2.7%
	US	PCE Core Deflator MoM	May	0.1%	0.2%
	US	PCE Core Deflator YoY	May	2.6%	2.8%
	US	U. of Mich. Sentiment	Jun F	--	65.6
	US	U. of Mich. 1 Yr Inflation	Jun F	--	3.3%
30-Jun	CH	Manufacturing PMI	Jun	49.57	49.50
1-Jul	TH	S&P Global Thailand PMI Mfg	Jun	--	50.30
	CH	Caixin China PMI Mfg	Jun	--	51.70
	US	ISM Manufacturing	Jun	--	48.70
2-Jul	EC	CPI Estimate YoY	Jun	--	2.6%
	EC	CPI MoM	Jun P	--	0.20%
3-Jul	US	ADP Employment Change	Jun	--	152k
	US	Initial Jobless Claims	Jun-29	--	--
	US	FOMC Meeting Minutes	Jun-12	--	--
5-Jul	TH	CPI YoY	Jun	--	1.54%
	EC	Retail Sales YoY	May	--	0.0%
	US	Change in Nonfarm Payrolls	Jun	200.00k	272k
	US	Unemployment Rate	Jun	--	4.0%
	US	Average Hourly Earnings MoM	Jun	--	0.4%

27 Jun 24

คาดดัชนีฯ บวกกรอบแคบๆ นักลงทุน ینگรอกกองทุนฯใหม่+มาตรการเศรษฐกิจ

- "Thai ESG" ยังไม่สามารถทำให้นักลงทุนเข้ามาลุยซื้อหุ้นได้(ในตอนนี้) ส่วนกองทุนวายุภักษ์ #3 อาจเป็นกระแสใหม่ๆ ที่นักลงทุนอาจให้ความสนใจ ถ้ารัฐบาลดันโครงการนี้ออกมาได้เรามองว่า การที่รัฐบาลมีกิจกรรมที่เกี่ยวข้องกับตลาดหุ้นมากในช่วงนี้จะประคองตลาดหุ้นไม่ให้ร่วงลงไปต่ำกว่า 1300 จุด อีก
- ตลาดต่างประเทศ แกว่งตัวแคบๆ ด้วยปัจจัยเฉพาะตลาด **ตลาดสหรัฐฯ** หุ้น Tech สลับบวกสลับลบ มีผลมาถึง หุ้นDELTA, HANA, KCE และนักลงทุนทั่วโลกรอดูสัญญาณเงินเฟ้อผ่าน ตัวเลข PCE ที่จะรายงานในวันพรุ่งนี้(28) คาดว่าจะลดลง 0.1% ตลาดยุโรป รอดูผลเลือกตั้งสภายุโรป ที่จะเริ่มช่วงวันหยุดนี้



27 Jun 24

คาดดัชนีฯ บวกกรอบแคบๆ นักลงทุน ระวังกองทุนฯใหม่+มาตรการเศรษฐกิจ

- ธปท. เผยสัญญาณเศรษฐกิจดีขึ้นจากแรงขับเคลื่อนหลักอุปสงค์ในประเทศ-การท่องเที่ยว เติบโตคงเป้า GDP ปี '67 ขยายตัวที่ 2.6% และปี '68 ที่ 3.0% มั่นใจเงินเฟ้อเข้ากรอบเป้าหมายตั้งแต่ Q4/67 คาดสูงกว่า 1% และคาดเงินเฟ้อปีนี้ขยายตัว 0.6% และปี '68 ที่ 1.3% เชื่อครึ่งปีหลังการส่งออกทยอยฟื้นตามอุปสงค์โลก ปีนี้คาดโต 1.8%
- ค่าเงินเยนดิ่งลงทะลุระดับ 160 เยน/ดอลลาร์ในวันนี้ แม้ทางการญี่ปุ่นออกโรงเตือนถึงผลกระทบเชิงตลาด
- Event สำคัญๆ วันนี้ : รายงาน GDP Q1(t) ของสหรัฐฯ คาด 1.43% QoQ (ครั้งก่อน 1.3%)

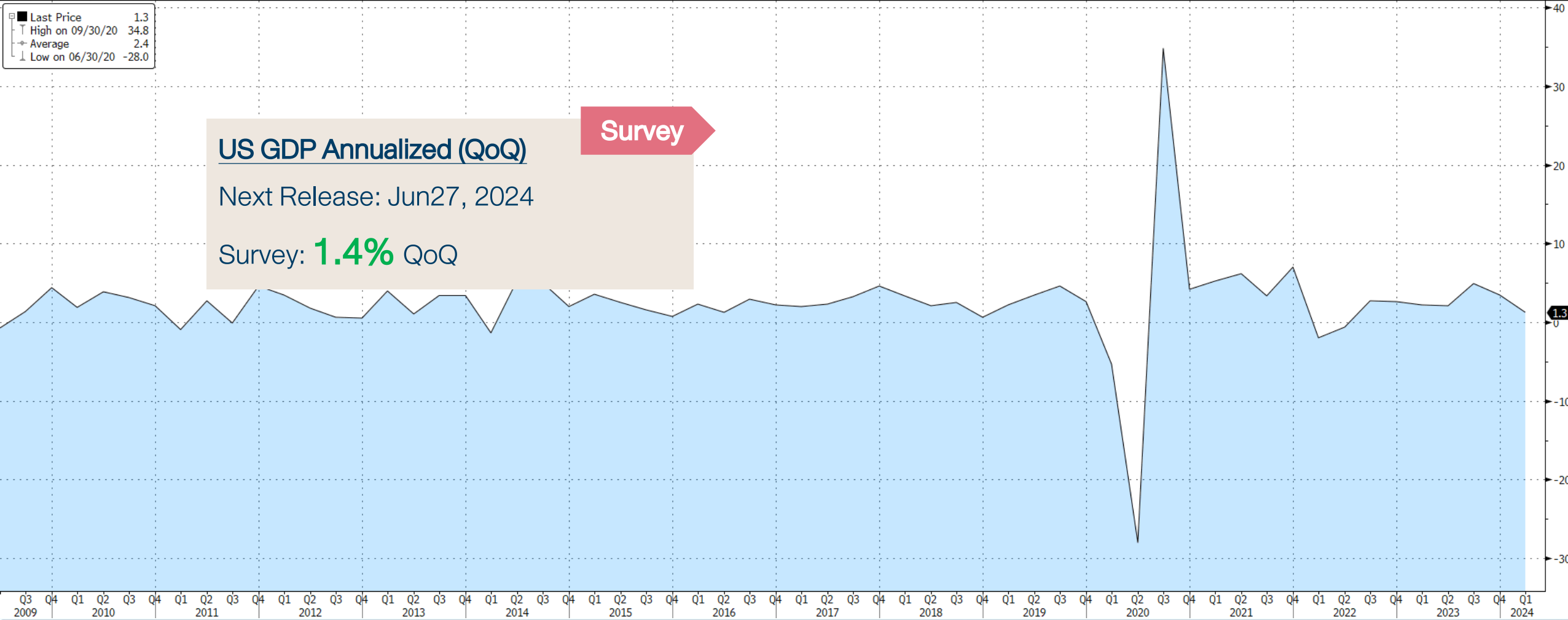


US GDP Annualized (QoQ)

GDP CQOQ 1.3% For 1Q S Next Release 27 Jun 19:30 Survey 1.4%
GDP US Chained Dollars QoQ SAAR Bureau of Economic Analysis

GDP CQOQ Index 94 Suggested Charts 96 Actions 97 Edit Line Chart

06/26/2009 - 03/31/2024 Last Px Local CCY Mov Avgs Key Events
1D 3D 1M 6M YTD 1Y 5Y Max Quarterly Table + Related Data Add Data Edit Chart



As of 27-Jun-24

CME FEDWATCH TOOL - CONDITIONAL MEETING PROBABILITIES									
MEETING DATE	325-350	350-375	375-400	400-425	425-450	450-475	475-500	500-525	525-550
7/31/2024				0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	11.4%	88.6%
9/18/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	6.6%	56.2%	37.2%
11/7/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	2.2%	23.0%	49.9%	24.9%
12/18/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	1.5%	16.9%	42.0%	32.2%	7.3%
1/29/2025	0.0%	0.0%	0.0%	0.8%	9.9%	30.5%	36.7%	18.7%	3.3%
3/19/2025	0.0%	0.0%	0.5%	6.3%	22.4%	34.3%	25.8%	9.4%	1.3%
4/30/2025	0.0%	0.2%	2.9%	13.0%	27.3%	30.8%	19.0%	6.1%	0.8%
6/18/2025	0.1%	1.8%	8.7%	21.2%	29.3%	24.0%	11.5%	3.0%	0.3%
7/30/2025	0.7%	4.3%	13.3%	24.2%	27.4%	19.5%	8.4%	2.0%	0.2%

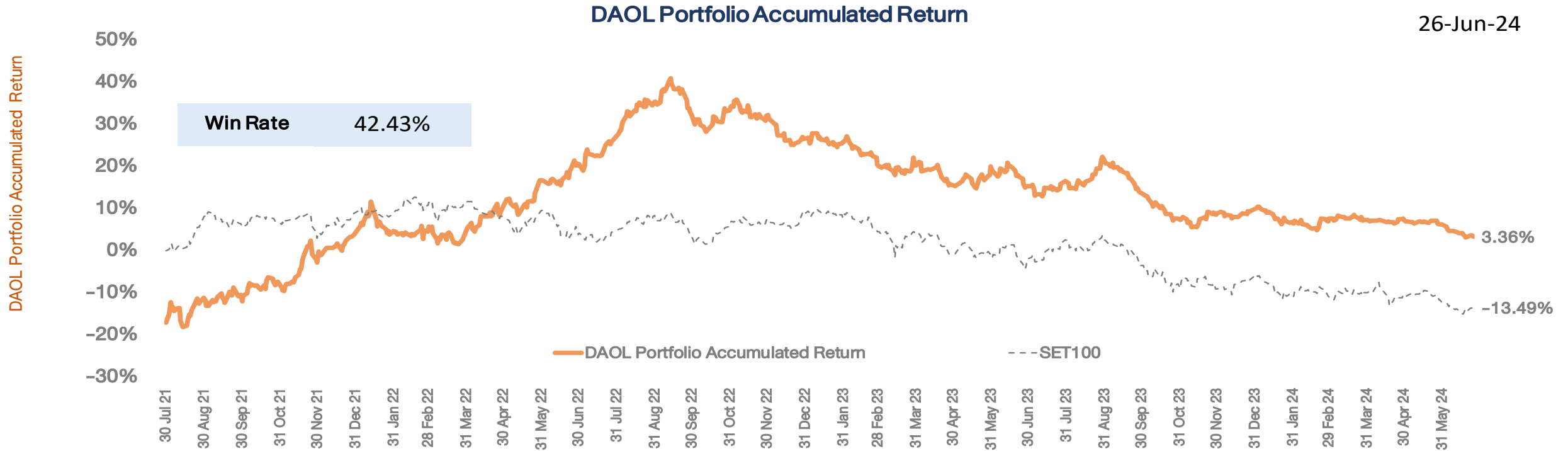
โอกาสที่ Fed
จะลดดอกเบี้ย

ก.ย. 63%

พ.ย. 75%

กลยุทธ์ลงทุนโดย DAOL





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

26/6/2024 0:00

Market Price

DAOL Portfolio	SECTOR	%Hold	Cost	Vol	Cost Value	CLOSE	Market Value	Gain/Loss	%Gain/Loss
CPAXT	COMM	10%	27.25	3,700	100,825	27.75	102,675.00	1,850.00	1.83%
AOT	TRANS	10%	59.00	1,700	100,300	58.75	99,875.00	(425.00)	-0.42%
SET						1319.15			
Total		20%			201,125		202,550	1,425	
CASH		80%					831,091		
Total Portfolio							1,033,641		3.36%



กลยุทธ์

- ดัชนีฯ ประคองตัวแถวๆ 1320-1330 จุดได้อยู่ แต่คงต้องดูเป็นวันๆ ไป **คำแนะนำ**เรายังเป็นสะสมหุ้นหรือถือต่อ ... จุดที่บอกว่า การ rebound รอบนี้ จบ คือ ลงไปต่ำกว่า 1310 จุด



พอร์ตหุ้น DAOL

- พอร์ตหุ้นวันนี้ ไม่มีการเปลี่ยนแปลง
- หุ้นในพอร์ต ประกอบด้วย AOT(10%), CPAXT(10%)



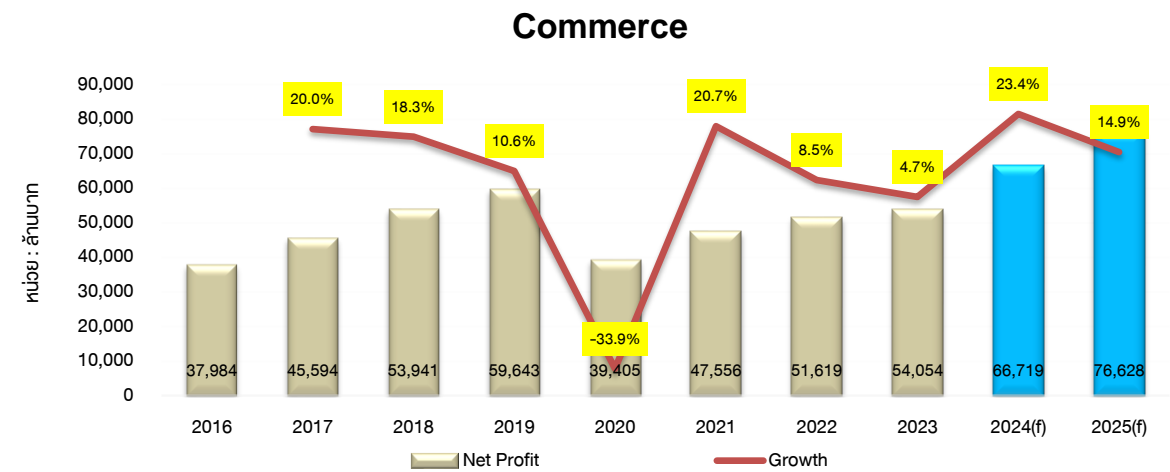
Theme ลงทุน

- นักลงทุนที่จะสะสมหุ้นที่เป็น high dividend โดยเรามีหุ้นให้เลือก 2 ตัว คือ **PTT** (คาดจ่ายเงินปันผลปีนี้ @2.0 บาท ; Dividend Yield 6.2%) และหุ้น **SCB** (คาดจ่ายเงินปันผลปีนี้ @6-9 บาท ; Dividend Yield 6-8%)
 - หุ้นใหญ่ ที่ถึงในเรื่องการตั้ง กองทุน ThaiESG 3 ตัว **CPALL, PTT, AOT** เรายังมองว่า มีโอกาสที่จะถูกซื้อได้ (เมื่อนักลงทุนกลับมาสนใจกองทุนฯ นี้อีกครั้ง)
 - ชุดของหุ้นที่แนะนำ 4+4 ตัว วันนี้ เรากอด **BA, CPAXT** ออก เหลือไว้เพียง **NER** และ **COM7** ที่ทรงราคายังดีอยู่ และเพิ่มหุ้นที่ราคาลงมาลึกๆ ที่มีโอกาสถูกกวกลับมาเล่นคือ **TIDLOR** และ **SAWAD**
- ←-----→
- หุ้นโรงไฟฟ้า ยังมีโอกาสเล่นต่อ จากกระแส Data Center โดยหุ้นที่ได้ประโยชน์มากที่สุด จะเป็น **GULF** จากข่าว กพช.อนุมัติ Direct PPA นำร่อง 2 พัน MW หวังตั้ง Data Center ปักหมุดในไทย และ **GULF** ประกาศร่วมมือกับ Google ให้บริการระบบ Cloud ในไทย

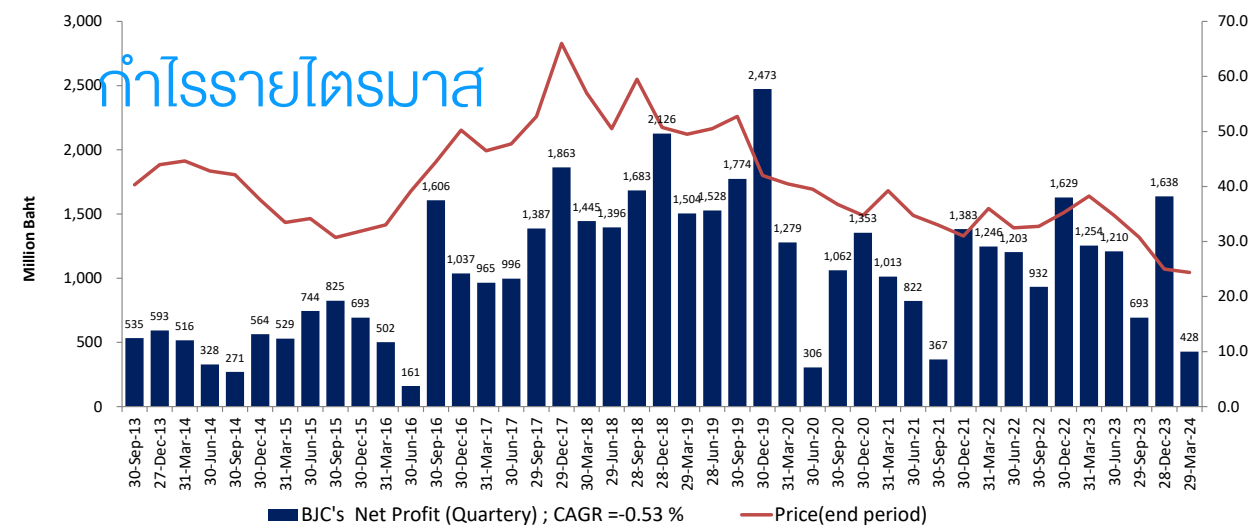
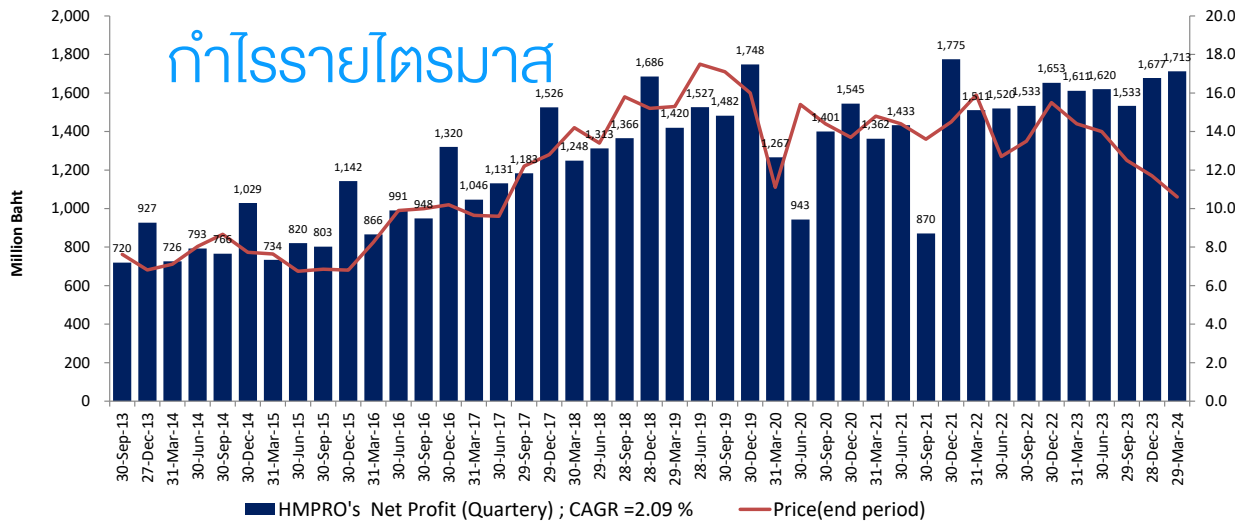
หุ้นกลุ่มค้าปลีก หลายตัวที่ขึ้นมามาก

Net Profit

Commerce	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024(f)	2025(f)
KAMART	264	282	360	261	133	293	327	661	734	886
RS	(102)	333	516	363	528	127	137	1,395	225	316
MC	843	346	306	407	446	486	644	0	724	829
ILM	0	494	543	596	421	453	659	726	788	883
SINGER	120	(10)	(81)	166	443	701	941	(3,210)	569	808
DOHOME	0	908	439	726	727	1,818	774	585	970	1,234
MEGA	795	1,113	1,206	1,139	1,393	1,947	2,242	1,993	2,458	2,612
COM7	407	609	891	1,216	1,491	2,630	3,038	2,857	3,013	3,356
GLOBAL	1,676	1,609	2,003	2,093	1,956	3,344	3,487	2,671	2,941	3,388
BJC	3,307	5,211	6,650	7,278	4,001	3,585	5,010	4,795	4,669	5,445
HIMPRO	4,125	4,886	5,613	6,177	5,155	5,441	6,217	6,442	6,963	7,641
CRC	4,461	3,728	8,624	10,633	46	59	7,175	8,016	8,982	10,338
CPAXT	5,413	6,178	5,942	6,245	6,563	13,687	7,697	8,640	10,776	12,474
CPALL	16,677	19,908	20,930	22,343	16,102	12,985	13,272	18,482	22,909	26,420



หุ้นกลุ่มค้าปลีก หลายตัวที่ขึ้นมามาก





TECHNICAL VIEW

27 June 2024 # 120

DAOL SEC

SET : เกว่งตัวผันผวนในรอบแคบ

แนวรับ 1310-1314 จุด

แนวต้าน 1324-1328

SET50 Index Futures

S50U24

MALEE

TEAM

แนวรับ 13.20-13.50

แนวต้าน 14.00-14.40

Cut Loss < 13.00

แนวรับ 4.66-4.76

แนวต้าน 4.90-5.00

Cut Loss < 4.60

แนวโน้ม: Sideway

กลยุทธ์

ไม่มีสถานะ: Trading 808-815

สถานะ: Long : ปิด หากหลุด 805

สถานะ: Short : ทิ้ง หากหลุด 805

แนวรับ 808, 805, 800

แนวต้าน 813, 815, 818

Analyst: Phannapa Kemasurat (Reg. no. 060110)

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



CASH BALANCE

DAOL SEC

27 มิถุนายน 2567

หลักทรัพย์ที่คาดว่าจะติด Cash Balance ตามเกณฑ์การ
คำนวณโดยใช้ข้อมูลวันที่ 21-26 มิ.ย. 67

No.	Stock	PE (เท่า)	มูลค่าซื้อขาย (ลบ.)	1-Week Turnover (%)
SET :	NRF	Negative PE	2,625	261%
	SABUY	Negative PE	709	90%
MAI :	-	-	-	-

หลักทรัพย์ที่ติด Cash Balance

หลักทรัพย์	เริ่มต้น – สิ้นสุด
*JPARK	26 มิ.ย. 67 – 16 ก.ค. 67

เกณฑ์การคำนวณ Cash Balance

1. P/E > 40 เท่า
2. ปริมาณการซื้อขาย SET > 500 ลบ./สัปดาห์ // MAI > 400 ลบ./สัปดาห์
3. 1 Week-Turnover > 40%

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**

Disclaimer บริษัทฯ รับผิดชอบการจัดทำขึ้นโดยบริษัทหลักทรัพย์ ดาโอ (ประเทศไทย) จำกัด (มหาชน) มีวัตถุประสงค์เพื่อนำเสนอและเผยแพร่บทวิเคราะห์ให้เป็นข้อมูลประกอบการตัดสินใจของนักลงทุนทั่วไป โดยจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของข้อมูลที่ได้เปิดเผยต่อสาธารณชนอันเชื่อถือได้ และมีได้มีเจตนาเชิญชวนหรือชี้แนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์แต่อย่างใด ดังนั้น บริษัทหลักทรัพย์ เคทีบีเอสที จำกัด (มหาชน) จะไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการใช้บทวิเคราะห์ฉบับนี้ทั้งทางตรงและทางอ้อม และขอให้นักลงทุนใช้ดุลพินิจพิจารณาอย่างรอบคอบก่อนการตัดสินใจลงทุน

News Comment

(0) AOT (ซื้อ/เป้า 76.00 บาท) AOT สเปนออฟ AOTGA เร่งขยายงาน 'กราวด์เซอร์วิส-คาร์โก้สุวรรณภูมิ'

Company Update

(+) CBG (ซื้อ/เป้า 85.00 บาท) โรงผลิตกระป๋องและบรรจุภัณฑ์ที่ทันสมัย ช่วยประหยัดต้นทุนการผลิต

Company Update

24-28 June: ประชุมกลุ่ม Euro

28 June: รปท.รายงานภาวะเศรษฐกิจไทย

“ ThaiESG ไม่ช่วย หนุน ภาวะถดถอย ช่วยตลาดได้มัย ”

ประเด็นวิเคราะห์วันนี้

- เดาใจคล้ายๆ ภาวะถดถอย(reissue) จั๊กจ็อกตัวสำคัญ ของโครงการ “Digital wallet”
- ลุยกั้นต่อ โรงไฟฟ้า และ Data center
- เงินเยน ร่วงกระจาย หุ่นไทยตัวไหนเดือดร้อน
- สปท. คง GDP แต่ใส่ใน มันเป็นอย่างไบบ้าง กลุ่มกลุ่มไหนจะดี หรือจะร้าย

กองทุนรวมวายุภักษ์
กองทุนเปิดจดทะเบียนใน SET

หน่วย ก
สำหรับผู้ลงทุนทั่วไป

- ได้รับผลตอบแทนตามจริง โดยมีขั้นต่ำต่อปี/ขั้นสูงสุดต่อปี เป็นเวลา 10 ปี
- ได้รับชำระคืนเงินลงทุนก่อนผู้ถือหน่วย ข ตามแนวชำระคืนเงินลงทุนที่มีลักษณะเป็น waterfall

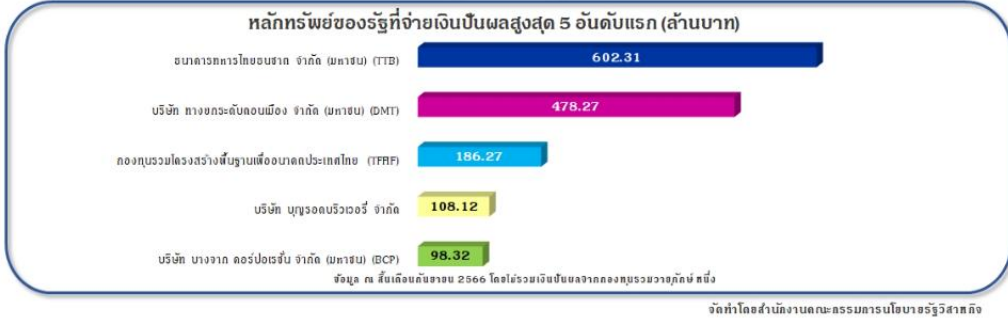
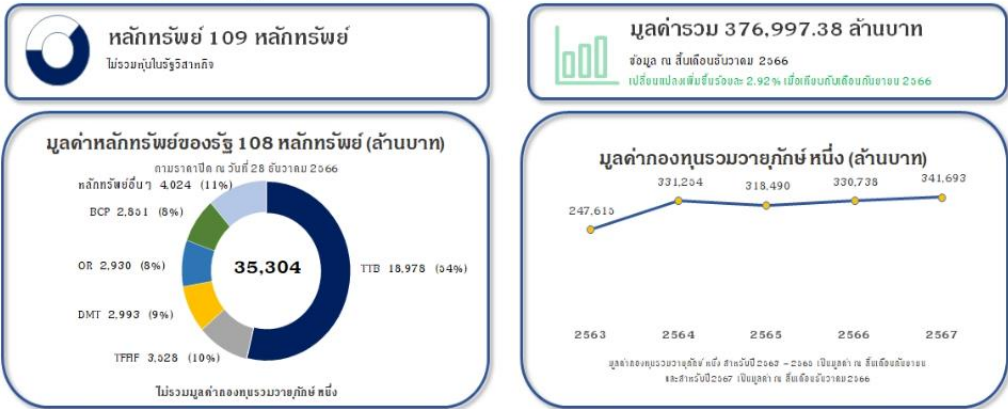
หน่วย ข
สำหรับกระทรวงการคลังและหน่วยงานอื่น

หุ้นที่กองทุนวายุภักษ์ ถืออยู่ ณ 31 ธ.ค.66

หลักทรัพย์	ชื่อบริษัท	มูลค่าตามราคาตลาด
PTT	บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)	124,188,028,250.00
SCB	บริษัท เอสซีบี เอกซ์ จำกัด (มหาชน)	83,241,609,200.00
TTB	ธนาคารทหารไทยธนชาต จำกัด (มหาชน)	16,779,523,421.05
BCP	บริษัท บางจาก คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	11,883,008,100.00
KTB	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	11,207,206,596.00
AOT	บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)	6,201,226,764.00
ADVANC	บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	5,577,138,700.00
GULF	บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน)	2,992,631,675.00
SCC	บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด (มหาชน)	2,986,988,400.00
BDMS	บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน)	2,951,412,300.00
KBANK	ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	2,491,789,500.00
BSRC	บริษัท บางจาก ศรีราชา จำกัด (มหาชน)	2,402,298,900.00
BBL	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	2,288,264,750.00
CPN	บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน)	2,193,254,000.00
CRC	บริษัท เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	1,799,945,100.00
MINT	บริษัท ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)	1,480,248,345.00
EA	บริษัท พลังงานบริสุทธิ์ จำกัด (มหาชน)	1,473,790,500.00
CPF	บริษัท เจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน)	1,459,231,760.00
BH	บริษัท โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ จำกัด (มหาชน)	1,390,186,200.00

- Saving
- Funding
- Confidence

หลักทรัพย์ของรัฐที่ถือครองโดยกระทรวงการคลัง ประจำไตรมาสที่ 1 ปีงบประมาณ 2567



จัดทำโดยสำนักงานคณะกรรมการนโยบายรัฐวิสาหกิจ

แจกเงินดิจิทัล 10,000 บาท

วงเงินโครงการ 5 แสนล้านบาท

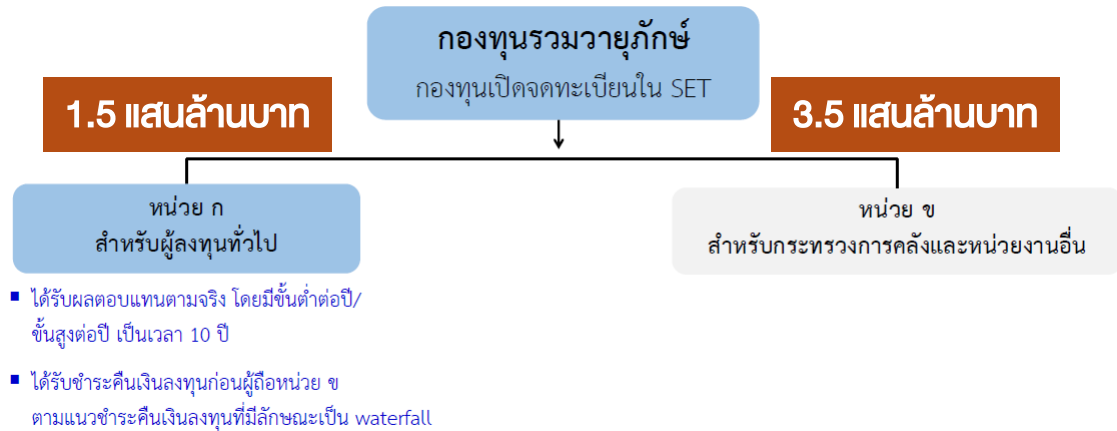
- งบฯ 68
- 152,700 ล้านบาท
- เงินจาก ม. 28 ของร.ก.ส.
- 172,300 ล้านบาท
- บริหารงบฯ 67
- 175,000 ล้านบาท

ได้รับสิทธิ์ 50 ล้านคน

แจกเงินช่วงไตรมาส 4 ปี 2567

ที่มา : บดีที่ประชุมคณะกรรมการนโยบายโครงการเงิน 10,000 บาท ผ่าน Digital Wallet ครั้งที่ 3/2567 (10 เม.ย. 67)

1 กองทุนรวมอายุเกษียณใหม่



**เบื้องต้นมีเบ็ดเงินลงทุนกองทุนรวมอายุเกษียณ หน่วยลงทุน v. อยู่จำนวน 3.5 แสนล้านบาท หากจำหน่ายกองทุนรวมอายุเกษียณใหม่แก่ผู้ลงทุนทั่วไป คาดวงเงินประมาณ 1.5 แสนล้านบาท จะทำให้รวมมีเงินลงทุน 2 กองนี้ราว 5 แสนล้านบาท

“คาดว่าจะได้ข้อสรุปภายในไตรมาส 3/2567 ใช้เวลาศึกษาและหารือไม่เกิน 2 เดือนก็สามารถสรุปเงื่อนไขใหม่ได้” นายพิชัยกล่าว

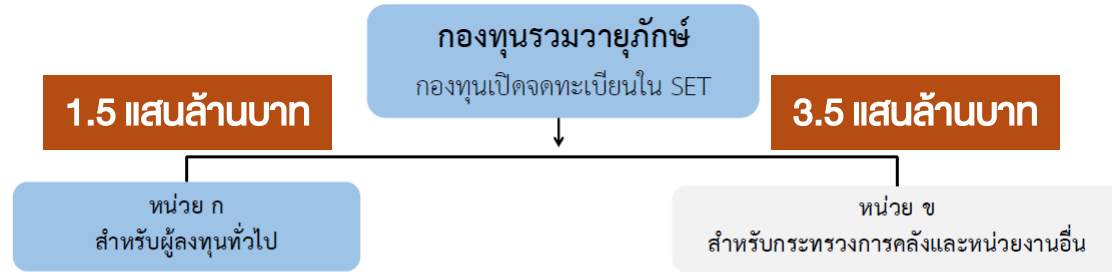
2 ThaiESG ใหม่ ปรับถือครองเหลือ 5 ปี

ThaiESG (ข้อเสนอ)

- ไม่เกิน 30% ของเงินได้พึงประเมิน และซื้อได้สูงสุดไม่เกิน $\leq 300,000$ บาท
- ระยะเวลาถือครอง 5 ปี (นับจากวันที่ซื้อ)
- นโยบายลงทุน > 80% NAV ดังนี้
 - (1) หุ้นใน SET/MAI โดดเด่นด้านสิ่งแวดล้อม (E) / ESG หรือเปิดเผยข้อมูลก๊าซเรือนกระจก หรือระดับการประเมิน cg rating ของ IOD และมีการเปิดเผยข้อมูลด้านบรรษัทภิบาล (G) ในระดับ และ รูปแบบ ที่ ก.ล.ต. กำหนด
 - (2) ESG Bond
 - (3) Green Token
 - (4) หุ้นไทยที่อยู่ในดัชนี ESG ที่ได้รับความเชื่อถือระดับสากล

**เตรียมเสนอภายใน 2 สัปดาห์ให้ ครม. อนุมัติ ซึ่งจะมีผลย้อนหลังถึงวันที่ 1 ม.ค. 2567

กองทุนรวมวายุภักษ์ ใหม่



- ได้รับผลตอบแทนตามจริง โดยมีขั้นต่ำต่อปี/ขั้นสูงสุดต่อปี เป็นเวลา 10 ปี
- ได้รับชำระคืนเงินลงทุนก่อนผู้ถือหน่วย ข ตามแนวชำระคืนเงินลงทุนที่มีลักษณะเป็น waterfall



20 อันดับหุ้นกองทุนฯ วายุภักษ์ หนึ่ง

หลักทรัพย์	ชื่อบริษัท	มูลค่าตามราคาตลาด
PTT	บริษัท ปตท. จำกัด (มหาชน)	124,188,028,250.00
SCB	บริษัท เอสซีบี เอกซ์ จำกัด (มหาชน)	83,241,609,200.00
TTB	ธนาคารทหารไทยธนชาติ จำกัด (มหาชน)	16,779,523,421.05
BCP	บริษัท บางจาก คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	11,883,008,100.00
KTB	ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน)	11,207,206,596.00
AOT	บริษัท ท่าอากาศยานไทย จำกัด (มหาชน)	6,201,226,764.00
ADVANC	บริษัท แอดวานซ์ อินโฟร์ เซอร์วิส จำกัด (มหาชน)	5,577,138,700.00
GULF	บริษัท กัลฟ์ เอ็นเนอร์จี ดีเวลลอปเม้นท์ จำกัด (มหาชน)	2,992,631,675.00
SCC	บริษัท ปูนซิเมนต์ไทย จำกัด (มหาชน)	2,986,988,400.00
BDMS	บริษัท กรุงเทพดุสิตเวชการ จำกัด (มหาชน)	2,951,412,300.00
KBANK	ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน)	2,491,789,500.00
BSRC	บริษัท บางจาก ศรีราชา จำกัด (มหาชน)	2,402,298,900.00
BBL	ธนาคารกรุงเทพ จำกัด (มหาชน)	2,288,264,750.00
CPN	บริษัท เซ็นทรัลพัฒนา จำกัด (มหาชน)	2,193,254,000.00
CRC	บริษัท เซ็นทรัล รีเทล คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน)	1,799,945,100.00
MINT	บริษัท โมเนออร์ อินเตอร์เนชั่นแนล จำกัด (มหาชน)	1,480,248,345.00
EA	บริษัท พลังงานบริสุทธิ์ จำกัด (มหาชน)	1,473,790,500.00
CPF	บริษัท เจริญโภคภัณฑ์อาหาร จำกัด (มหาชน)	1,459,231,760.00
BH	บริษัท โรงพยาบาลบำรุงราษฎร์ จำกัด (มหาชน)	1,390,186,200.00

หลักทรัพย์ของรัฐที่ถือครองโดยกระทรวงการคลัง ประจำปีไตรมาสที่ 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

หลักทรัพย์อื่น ๆ 4,024 (11%)

BCP 2,851 (8%)

OR 2,930 (8%)

DMT 2,993 (9%)

TFRF 3,528 (10%)

35,304

TTB 18,978 (54%)

ไม่รวมมูลค่าของทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

มูลค่ากองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง (ล้านบาท)

247,610 331,204 318,490 330,738 341,693

2563

2564

2565

2566

2567

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

หลักทรัพย์ของรัฐที่จ่ายเงินปันผลสูงสุด 5 อันดับแรก (ล้านบาท)

ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) (TTB)

602.31

บริษัท ทางยกระดับดอนเมือง จำกัด (มหาชน) (DMT)

478.27

กองทุนรวมโครงสร้างพื้นฐานเพื่ออนาคตประเทศไทย (TFRF)

186.27

บริษัท บุญรอดบริวเวอรี่ จำกัด

108.12

บริษัท บางจาก คอร์ปอเรชั่น จำกัด (มหาชน) (BCP)

98.32

ข้อมูล ณ สิ้นเดือนกันยายน 2566 โดยไม่รวมเงินปันผลจากกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

จัดทำโดยสำนักงานคณะกรรมการนโยบายรัฐวิสาหกิจ

สำนักวิจัยที่ทำงานให้กับกระทรวงการคลัง ออกมาระบุว่า ทางเลือกหนึ่งในการใช้งบประมาณ คือการขายหุ้นของรัฐวิสาหกิจนั้น จุลพันธ์ ยืนยันว่าไม่เกี่ยวและไม่เป็นความจริง จะไม่มีการลดสัดส่วนของผู้ถือหุ้นรัฐวิสาหกิจ พร้อมยืนยันว่าเป้าหมายของการใช้งบประมาณ ยังไม่มีความชัดเจน โดยจะใช้งบประมาณเป็นหลัก เนื่องจากขณะนี้มีความเลือกให้กับรัฐบาลหลายทางเลือก แต่จะใช้ทางเลือกที่ดีที่สุด

https://voicetv.co.th/read/as2d3L6tg#google_vignette

แจกเงินดิจิทัล
10,000 บาท

ได้รับสิทธิ์ 50 ล้านคน
แจกเงินช่วงไตรมาส 4 ปี 2567

วงเงินโครงการ 5 แสนล้านบาท
งบฯ 68
152,700 ล้านบาท

เงินจาก ม. 28 ของร.ก.ส.
บริหารงบฯ 67
172,300 ล้านบาท

บริหารงบฯ 67
175,000 ล้านบาท

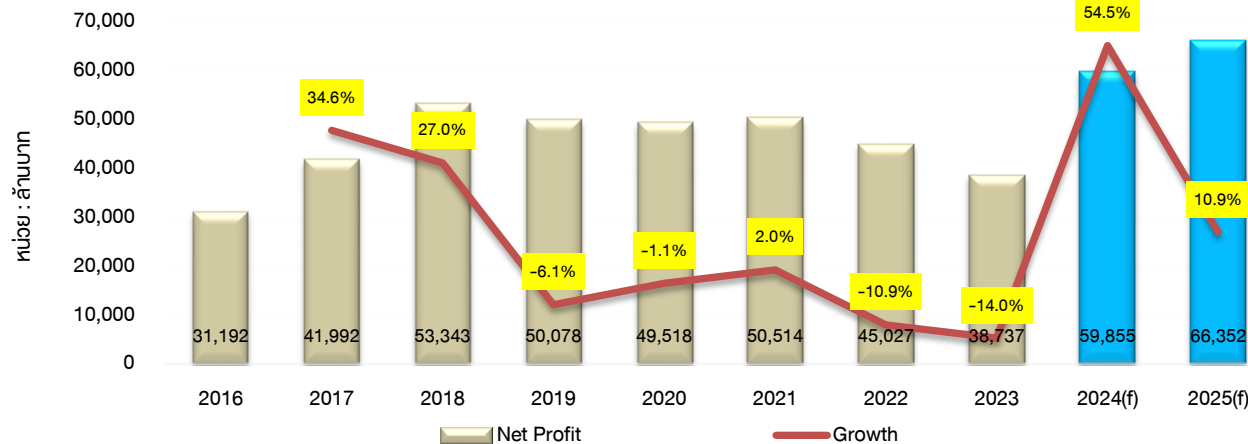
ที่มา : มติที่ประชุมคณะกรรมการนโยบายโครงการเติมเงิน 10,000 บาท ผ่าน Digital Wallet ครั้งที่ 3/2567 (10 เม.ย. 67)

- GULF จะได้ประโยชน์จากข่าว กพช. อนุมัติ Direct PPA นำร่อง 2 พัน MW หวังดึง Data Center ปักหมุดในไทย และ วานนี้ (25)
- GULF ประกาศร่วมมือกับ Google ให้บริการระบบ Cloud ในไทย
- กพช.ไฟเขียว Direct PPA นำร่องไม่เกิน 2,000 เมกะวัตต์ เจาะกลุ่ม Data Center ดึงดูดนักลงทุนทั่วโลก ชง กบง.กำหนดเงื่อนไขหลักเกณฑ์ภายในสิ้นปีนี้ คาดเริ่มนำร่องปีหน้า ย้ำค่าไฟต้องแข่งขันได้
- กกพ. อยู่ระหว่างติดตามสถานการณ์ราคาก๊าซธรรมชาติตลาดโลก และตัวแปรต่างๆ ทั้งปริมาณ ก๊าซ อัตราแลกเปลี่ยน การผลิตไฟฟ้าประเภทต่างๆ ให้ครบถ้วนรอบด้าน เพื่อประกอบการ พิจารณา อัตราค่าไฟฟ้าผันแปร(เอฟที) สำหรับคำนวณค่าไฟฟ้าเฉลี่ยที่เรียกเก็บจากประชาชนงวดสุดท้ายของปีในช่วงเดือนก.ย.-ธ.ค.2567 ซึ่งคาดว่าจะมีความชัดเจนประมาณต้นเดือนก.ค.นี้

Net Profit

ธุรกิจผลิตไฟฟ้า	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024(f)	2025(f)
ACE	0	334	547	815	1,508	1,506	1,282	1,073	1,369	2,006
BBGI	0	0	152	387	845	960	20	10	270	536
BCPG	1,541	1,774	2,219	1,801	1,912	2,011	2,630	1,104	954	1,074
BGRIM	1,380	2,127	1,863	2,331	2,175	2,276	(1,244)	1,885	2,307	2,682
BPP	4,138	4,155	3,813	2,969	3,702	3,127	5,739	5,319	3,801	4,272
CKP	55	159	599	769	405	2,179	2,436	1,462	1,829	2,097
EA	3,252	3,817	5,148	6,082	5,205	6,100	7,604	7,606	5,177	4,405
EGCO	8,321	11,818	21,073	13,059	8,733	4,104	2,683	(8,384)	9,491	9,170
GPSC	2,700	3,175	3,359	4,061	7,508	7,319	891	3,694	4,973	6,501
GULF	418	3,451	3,028	4,887	4,282	7,670	11,418	14,858	18,374	21,292
GUNKUL	538	639	1,090	2,147	3,412	2,229	3,011	1,474	1,628	1,828
RATCH	6,166	6,039	5,588	5,963	6,287	7,819	5,782	5,167	7,436	8,525
SPCG	2,314	2,524	2,614	2,669	2,732	2,479	2,320	1,838	683	401
WHAUP	369	1,981	2,252	2,137	813	736	454	1,631	1,564	1,564

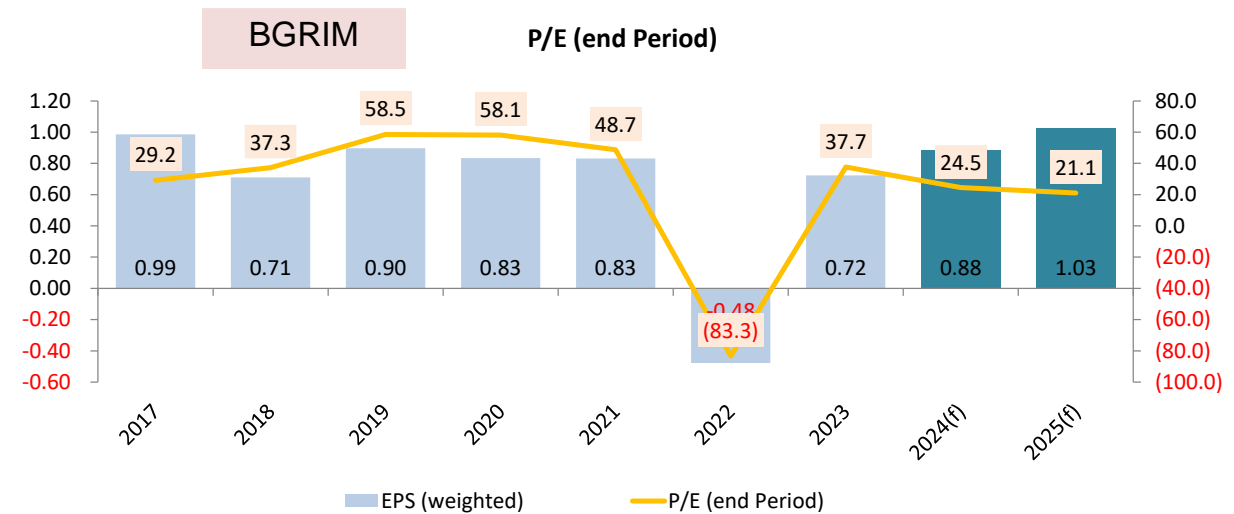
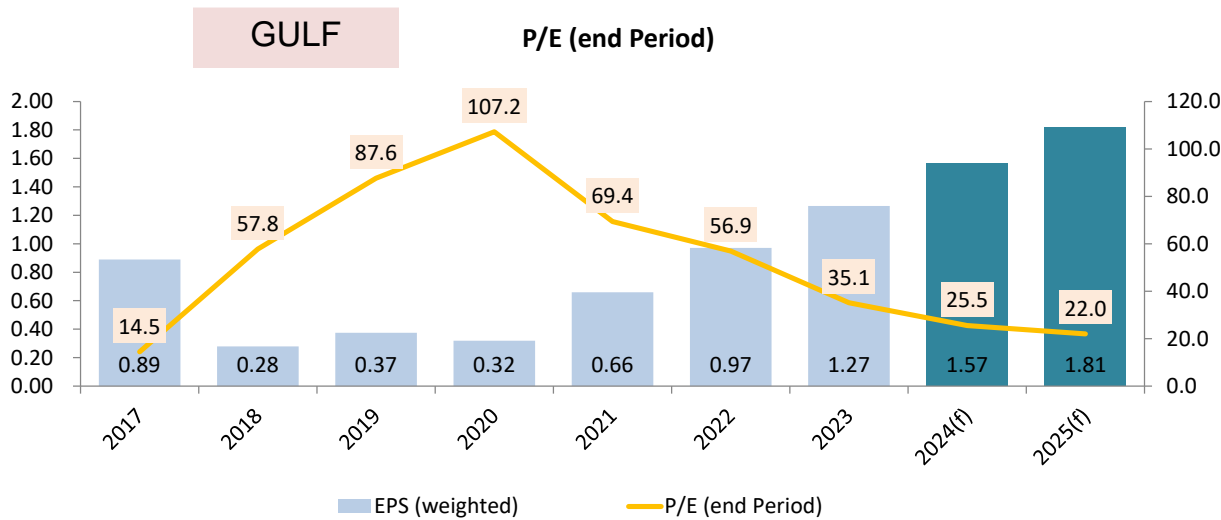
ธุรกิจผลิตไฟฟ้า



ธุรกิจผลิตไฟฟ้า



หุ้นโรงไฟฟ้า มีข่าวเยอะ: เอาจังไงดี



เงินเยน ร่วงกระจาย หุ่นไทยตัวไหนเดือดร้อน

MCS and GFPT stock Price & Thai Baht / 100 Yen



☰ เศรษฐกิจไทย



เศรษฐกิจไทยมีแนวโน้มขยายตัวโดยได้รับแรงส่งจากอุปสงค์ในประเทศที่สูงกว่าคาดในไตรมาสที่ 1 ภาคการท่องเที่ยวที่ขยายตัวต่อเนื่อง รวมทั้งการเบิกจ่ายภาครัฐที่กลับมาเร่งขึ้นหลังประกาศใช้ พ.ร.บ. งบประมาณฯ 2567 ขณะที่ต้องติดตามการส่งออกในปีนี้อย่างขยายตัวในระดับต่ำ

ประมาณการเศรษฐกิจ (ไม่รวมผลของ Digital Wallet)

ร้อยละต่อปี	2566*	2567	2568
อัตราการขยายตัวทางเศรษฐกิจ	1.9	2.6 (2.6)	3.0 (3.0)
อุปสงค์ในประเทศ	3.5	3.6 (3.1)	2.8 (3.1)
การบริโภคภาคเอกชน	7.1	4.2 (3.5)	2.5 (2.9)
การลงทุนภาคเอกชน	3.2	3.3 (3.3)	3.2 (3.2)
การอุปโภคภาครัฐ	-4.6	1.8 (1.8)	3.3 (3.3)
การลงทุนภาครัฐ	-4.6	3.6 (1.0)	2.6 (5.0)
ปริมาณการส่งออกสินค้าและบริการ	2.1	3.9 (4.2)	3.2 (3.3)
ปริมาณการนำเข้าสินค้าและบริการ	-2.3	4.9 (3.8)	2.9 (3.5)
ดุลบัญชีเดินสะพัด (พันล้านดอลลาร์ สรอ.)	7.0	13.0 (13.0)	17.5 (17.5)
มูลค่าการส่งออกสินค้า (ร้อยละต่อปี)	-1.7	1.8 (2.0)	2.6 (2.8)
มูลค่าการนำเข้าสินค้า (ร้อยละต่อปี)	-3.1	3.1 (2.5)	2.0 (3.0)
จำนวนนักท่องเที่ยวต่างประเทศ (ล้านคน)	28.2	35.5 (35.5)	39.5 (39.5)

หมายเหตุ: * ข้อมูลจริง

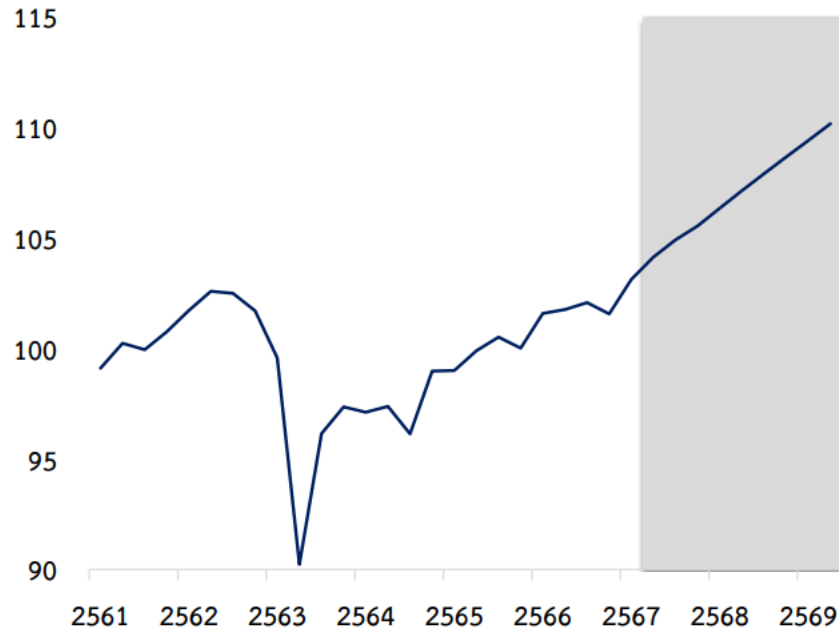
() ประมาณการเดิมในรายงานนโยบายการเงิน Q1-2567 (ไม่รวมผลของ Digital Wallet)

ที่มา: สำนักงานสภาพัฒนาการเศรษฐกิจและสังคมแห่งชาติ และประมาณการโดย รพท.

รพท. เผยสัญญาณเศรษฐกิจดีขึ้นจากแรงขับเคลื่อนหลักอุปสงค์ในประเทศ-การท่องเที่ยว เวย์ยังคงเป้า GDP ปี '67 ขยายตัวที่ 2.6% และปี '68 ที่ 3.0% มั่นใจเงินเฟ้อเข้ากรอบเป้าหมายตั้งแต่ Q4/67 คาดสูงกว่า 1% และคาดเงินเฟ้อปีนี้ขยายตัว 0.6% และปี '68 ที่ 1.3% เชื้อครึ่งปีหลังการส่งออกทยอยฟื้นตามอุปสงค์โลก ปีนี้คาดโต 1.8%

ผลิตภัณฑ์มวลรวมภายในประเทศที่แท้จริง (Real GDP)

ดัชนี (ปี 2561 = 100)





Timeline การเลือกตั้งสว. 2567



สว.ชุดปัจจุบัน 250 คน



- พิจารณาร่างกฎหมาย
- พิจารณาร่างแก้ไขรัฐธรรมนูญที่ต้องใช้การประชุมร่วมของสองสภา โดยนอกจากจะต้องใช้เสียงกึ่งหนึ่งแล้ว ในวาระที่หนึ่งและสาม ยังต้องใช้เสียงของ สว. อย่างน้อยหนึ่งในสามร่วมเห็นชอบด้วย
- ให้ความเห็นชอบบุคคลดำรงตำแหน่งองค์กรอิสระ: ตุลาการศาลรัฐธรรมนูญ กกต. ป.ป.ช. ตำแหน่งระดับสูงหน่วยงานรัฐ
- ลงมติเลือกนายกฯ
- ตรวจสอบฝ่ายบริหาร อภิปรายทั่วไป

สว.ชุดใหม่ 200 คน



- พิจารณาร่างกฎหมาย
- พิจารณาร่างแก้ไขรัฐธรรมนูญที่ต้องใช้การประชุมร่วมของสองสภา โดยนอกจากจะต้องใช้เสียงกึ่งหนึ่งแล้ว ในวาระที่หนึ่งและสาม ยังต้องใช้เสียงของ สว. อย่างน้อยหนึ่งในสามร่วมเห็นชอบด้วย
- ให้ความเห็นชอบบุคคลดำรงตำแหน่งองค์กรอิสระ: ตุลาการศาลรัฐธรรมนูญ กกต. ป.ป.ช. ตำแหน่งระดับสูงหน่วยงานรัฐ
- ตรวจสอบฝ่ายบริหาร อภิปรายทั่วไป
- ลงมติเลือกนายกฯ

รายชื่อหุ้นที่ไม่ได้อยู่ใน SET100 ที่สามารถ Short ได้

รายชื่อหลักทรัพย์ที่ขายชอร์ตได้ตามประกาศตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่อง กำหนดหลักทรัพย์ที่สามารถขายชอร์ตได้ พ.ศ. 2553

มีผลบังคับใช้ ตั้งแต่วันที่ 1 กรกฎาคม ถึง 31 ธันวาคม 2567

The list of Securities Eligible for Short Ref. Notification of the Stock Exchange of Thailand Re: Securities Eligible for Short Selling B.E. 2553 (2010)

Effective from July 1, 2024 to December 31, 2024

AIRA	BE8	GJS	M-CHAI	PCSGH	SAK	STANLY	UTP
AIT	BGC	HENG	MGC	PLAT	SAUCE	SUC	UVAN
AKR	BOL	HTC	MTI	PM	SAV	SYNEX	VIBHA
ALUCON	BRI	III	NOBLE	PSP	SCAP	TFMAMA	WARRIX
AMATAV	CHAYO	JR	NRF	PTL	SCI	TKC	
ASP	COCOCO	KCG	NTV	QTC	SGC	TMT	
ASW	DRT	KSL	NUSA	RAM	SKR	TNH	
AU	DUSIT	KTIS	NYT	RJH	SMPC	TOG	
AUCT	EKH	KYE	OHTL	S&J	SPC	TRP	
AYUD	FSMART	LALIN	PCC	SAFE	SPI	TSTH	



Fund Flow

เม็ดเงินนักลงทุนต่างชาติ
ไหลเข้าตลาดหุ้นใดในฝั่งเอเชีย ...?

SET Index & MSCI World Index (12 เดือนย้อนหลัง)

Return : SET Index-MSCI World Index (YTD)

12 M



Flow ตลาด EM (ทุก assets class) ปรับตัวลดลง

Emerging Market Fund Flow accumulate YTD

■ YTD outflows from key EM Asian exchanges 148.975



Source: Bloomberg, National Stock Exchanges

EMCFPROX Index (Bloomberg Emerging Markets Capital Flow Proxy Index) EM fund flow Daily 05NOV2018-30JUN2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

27-Jun-2024 07:18:16

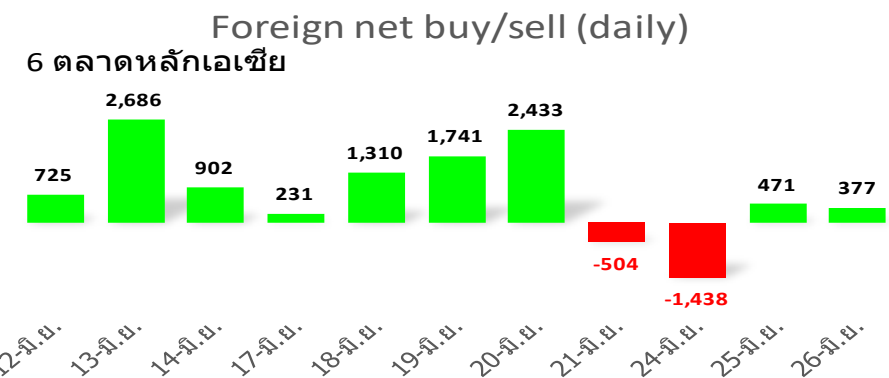
Flow ต่างชาติ ที่ไหลเข้า-ออก 6 ตลาดหลักเอเชีย

รวม 6 ตลาด

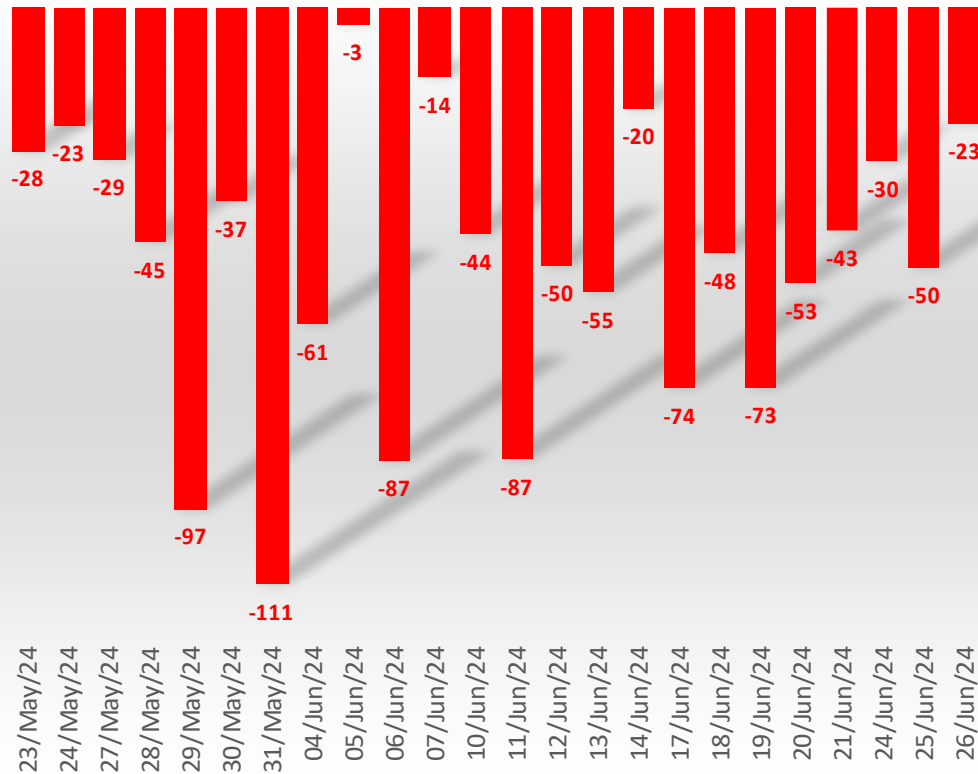
27/Jun/24

Country	Date	Daily	WTD	MTD	QTD	YTD	12M	YoY Lvl
Equity								
Asia (11)								
China	31MAR2024			4,960	-3,356	-3,356	-119,040	
India	25JUN2024	296	399	1,815	-2,305	-947	12,563	-6,822
Indonesia	26JUN2024	-19	464	343	-1,679	7	-1,436	-2,434
Japan	14JUN2024		508	-1,703	28,014	38,419	18,195	-29,722
Malaysia	25JUN2024	-16	-51	12	39	-148	217	1,528
Philippines	26JUN2024	1	-5	-109	-695	-533	-926	40
S. Korea	26JUN2024	231	-45	3,424	4,542	16,730	18,762	4,569
Sri Lanka	26JUN2024	0	1	-3	-4	-29	-19	-108
Taiwan	26JUN2024	-114	-1,935	2,031	-89	4,640	-405	-1,611
Thailand	26JUN2024	(22.5)	-102	-814	-1,161	-3,095	-5,415	-4,707
Vietnam	26JUN2024	-17	-60	-515	-1,227	-1,628	-2,382	-3,328

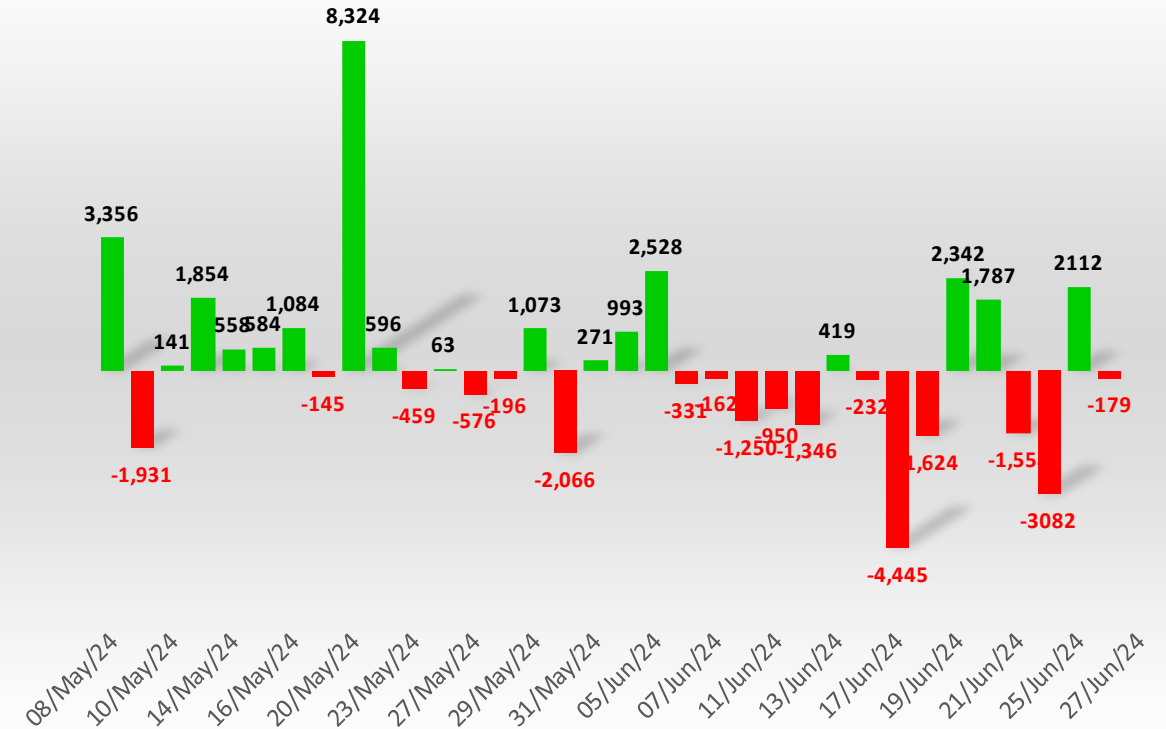
Remark : ตัวเลข Net position ของนักลงทุนต่างประเทศ ใน 6 ตลาดหุ้นเอเชีย ประกอบด้วย India-S.Korea-Taiwan-Vietnam-Philippines-Indonesia



Foreign Net Position (Thai Equity Market)



Foreign Net Position (Thai Bond Market)



หุ้นที่มูลค่าการถือครองของนักลงทุนต่างประเทศเพิ่ม/ลด มากที่สุด

26-Jun-24 : (เปรียบเทียบกับก่อน)

รวบรวมโดย DAOL Strategy

หุ้นที่มี % การถือสูงขึ้น

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
PTTEP	0.03%	171
TOP	0.12%	138
SCC	0.03%	70
KBANK	0.02%	64
HMPRO	0.05%	60
TIDLOR	0.11%	59
CRC	0.03%	58
CPN	0.02%	55
MINT	0.03%	46
SCB	0.01%	31

หุ้นที่มี % การถือลดลง

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
AOT	-0.11%	-888
EA	-1.04%	-680
MASTER	-2.54%	-495
BDMS	-0.05%	-194
QH	-0.29%	-59
MEGA	-0.16%	-52
BEM	-0.04%	-51
BCP	-0.07%	-38
GULF	-0.01%	-37
PTT	-0.00%	-34

หมายเหตุ : มูลค่าเงินลงทุนที่เพิ่ม/ลด คำนวณจากจำนวนหุ้นที่เปลี่ยนแปลง โดยใช้ราคาปิดล่าสุด เพื่อเปรียบเทียบ (ไม่ใช่มูลค่าที่ลดลงจริงๆ)

source : Bloomberg , SETSMART , SET

WEEK

หุ้นที่มูลค่าการถือครองของนักลงทุนต่างประเทศเพิ่ม/ลด มากที่สุด

26-Jun-24 : (เปรียบเทียบกับสัปดาห์ก่อน)

รวบรวมโดย DAOL Strategy

หุ้นที่มี % การถือสูงขึ้น

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
EA	7.00%	4,585
KCE	0.71%	356
TOP	0.25%	303
CPF	0.16%	301
CRC	0.14%	257
SAWAD	0.36%	193
PTTEP	0.03%	192
PLANB	0.54%	182
AMATA	0.52%	134
BGRIM	0.23%	131

หุ้นที่มี % การถือลดลง

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
AOT	-0.17%	-1,433
BDMS	-0.12%	-505
MASTER	-2.54%	-495
PTT	-0.03%	-276
CPALL	-0.05%	-261
BCP	-0.49%	-255
BH	-0.10%	-189
BBL	-0.06%	-148
DELTA	-0.01%	-146
SNNP	-0.86%	-115

หมายเหตุ : มูลค่าเงินลงทุนที่เพิ่ม/ลด คำนวณจากจำนวนหุ้นที่เปลี่ยนแปลง โดยใช้ราคาปิดล่าสุด เพื่อเปรียบเทียบ (ไม่ใช่มูลค่าที่ลดลงจริงๆ)

source : Bloomberg , SETSMART , SET

MONTH to DATE

หุ้นที่มูลค่าการถือครองของนักลงทุนต่างประเทศเพิ่ม/ลด มากที่สุด

26-Jun-24 : (เปรียบเทียบกับวันสุดท้ายของเดือนก่อน)

รวบรวมโดย DAOL Strategy

หุ้นที่มี % การถือสูงขึ้น

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
EA	7.17%	4,696
BKIH	10.91%	3,271
ADVANC	0.33%	2,090
TOP	1.17%	1,406
SCB	0.31%	1,099
DELTA	0.08%	887
KTB	0.32%	769
CPF	0.28%	547
TU	0.57%	403
KCE	0.72%	362

หุ้นที่มี % การถือลดลง

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
AOT	-0.78%	-6,537
BTS	-3.50%	-2,158
BDMS	-0.49%	-2,070
KBANK	-0.56%	-1,677
PTTEP	-0.18%	-1,117
PTT	-0.10%	-935
BH	-0.48%	-929
LH	-1.21%	-880
HMPRO	-0.59%	-713
PRM	-3.35%	-709

หมายเหตุ : มูลค่าเงินลงทุนที่เพิ่ม/ลด คำนวณจากจำนวนหุ้นที่เปลี่ยนแปลง โดยใช้ราคาปิดล่าสุด เพื่อเปรียบเทียบ (ไม่ใช่มูลค่าที่ลดลงจริงๆ)

source : Bloomberg , SETSMART , SET

Net Change

18 Jan 21 - Present

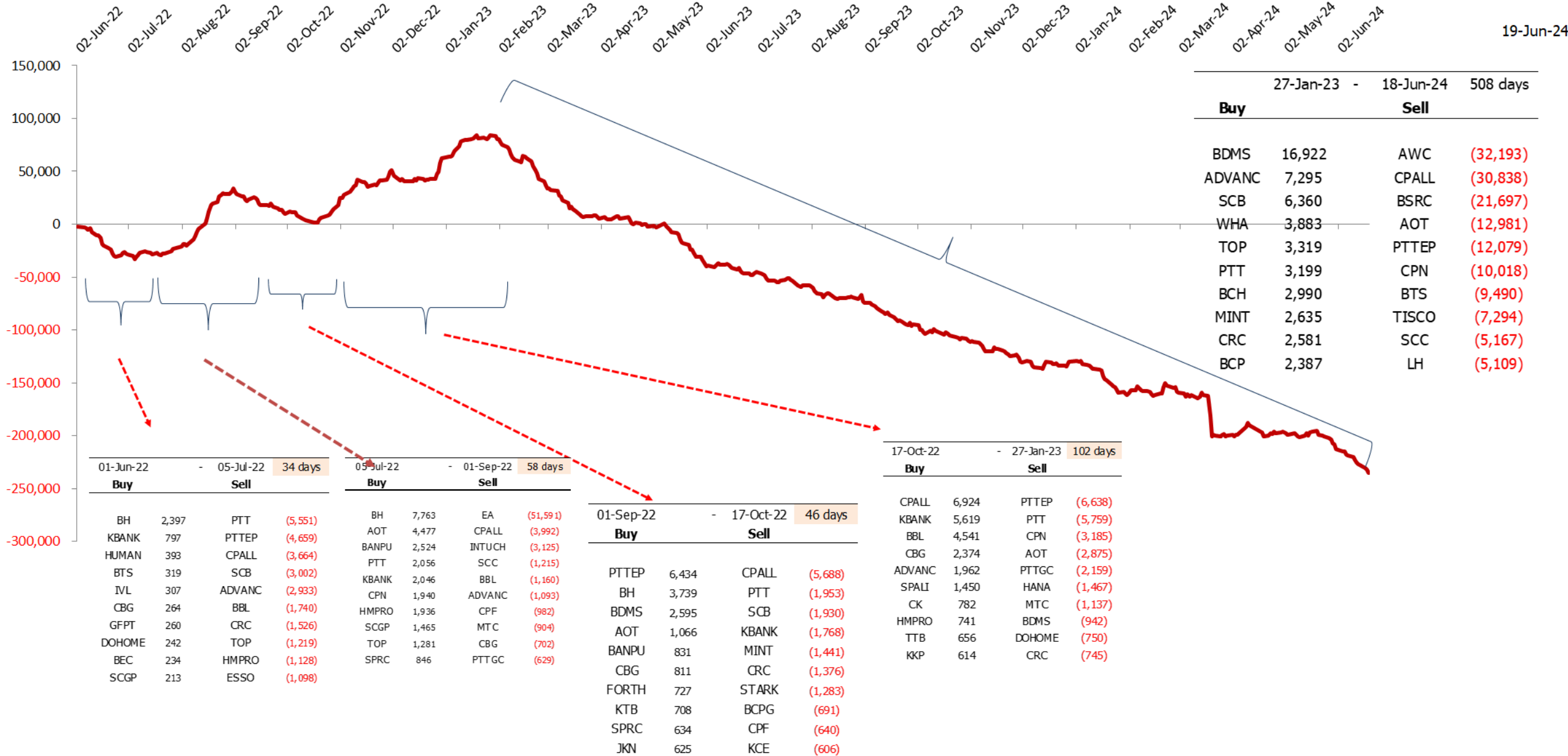
19-Jun-24

Net Buy		Net Sell	
BDMS	32,737	AWC	(33,451)
BH	29,892	AOT	(29,621)
PTTEP	25,175	CPALL	(24,553)
SCB	15,263	BSRC	(21,256)
ADVANC	9,441	PTT	(14,808)
KTC	7,800	INTUCH	(14,237)
BCP	4,493	CPN	(10,845)
CK	3,993	SCC	(9,853)
SCGP	3,622	TTB	(9,422)
TOP	3,482	BTS	(9,094)

นักลงทุนต่างประเทศได้ทยอยเข้าซื้อหุ้นไทย มาตั้งแต่ต้นปี 2021 ด้านขายมือ เป็นมูลค่าที่นักลงทุนกลุ่มนี้ เข้าซื้อ หรือขาย ตั้งแต่เวลานั้น มาจนถึงปัจจุบัน

Foreign Net (Equity) - Accumulate

Unit : Million Baht



	27-Jan-23	-	18-Jun-24	508 days
	Buy		Sell	

BDMS	16,922	AWC	(32,193)
ADVANC	7,295	CPALL	(30,838)
SCB	6,360	BSRC	(21,697)
WHA	3,883	AOT	(12,981)
TOP	3,319	PTTEP	(12,079)
PTT	3,199	CPN	(10,018)
BCH	2,990	BTS	(9,490)
MINT	2,635	TISCO	(7,294)
CRC	2,581	SCC	(5,167)
BCP	2,387	LH	(5,109)

01-Jun-22	-	05-Jul-22	34 days
Buy		Sell	

BH	2,397	PTT	(5,551)
KBANK	797	PTTEP	(4,659)
HUMAN	393	CPALL	(3,664)
BTS	319	SCB	(3,002)
IVL	307	ADVANC	(2,933)
CBG	264	BBL	(1,740)
GFPT	260	CRC	(1,526)
DOHOME	242	TOP	(1,219)
BEC	234	HMPRO	(1,128)
SCGP	213	ESSO	(1,098)

05-Jul-22	-	01-Sep-22	58 days
Buy		Sell	

BH	7,763	EA	(51,591)
AOT	4,477	CPALL	(3,992)
BANPU	2,524	INTUCH	(3,125)
PTT	2,056	SCC	(1,215)
KBANK	2,046	BBL	(1,160)
CPN	1,940	ADVANC	(1,093)
HMPRO	1,936	CPF	(982)
SCGP	1,465	MTC	(904)
TOP	1,281	CBG	(702)
SPRC	846	PTTGC	(629)

01-Sep-22	-	17-Oct-22	46 days
Buy		Sell	

PTTEP	6,434	CPALL	(5,688)
BH	3,739	PTT	(1,953)
BDMS	2,595	SCB	(1,930)
AOT	1,066	KBANK	(1,768)
BANPU	831	MINT	(1,441)
CBG	811	CRC	(1,376)
FORTH	727	STARK	(1,283)
KTB	708	BCPG	(691)
SPRC	634	CPF	(640)
JKN	625	KCE	(606)

17-Oct-22	-	27-Jan-23	102 days
Buy		Sell	

CPALL	6,924	PTTEP	(6,638)
KBANK	5,619	PTT	(5,759)
BBL	4,541	CPN	(3,185)
CBG	2,374	AOT	(2,875)
ADVANC	1,962	PTTGC	(2,159)
SPALI	1,450	HANA	(1,467)
CK	782	MTC	(1,137)
HMPRO	741	BDMS	(942)
TTB	656	DOHOME	(750)
KKP	614	CRC	(745)

27-Jan-23		-	18-Jun-24		508 days
Buy			Sell		
BDMS	16,922		AWC	(32,193)	
ADVANC	7,295		CPALL	(30,838)	
SCB	6,360		BSRC	(21,697)	
WHA	3,883		AOT	(12,981)	
TOP	3,319		PTTEP	(12,079)	
PTT	3,199		CPN	(10,018)	
BCH	2,990		BTS	(9,490)	
MINT	2,635		TISCO	(7,294)	
CRC	2,581		SCC	(5,167)	
BCP	2,387		LH	(5,109)	

US Gov. Bond Yield 2, 10, 30 Year

Bond Yield change to uptrend since mid of 2016



USGG2YR Index (US Generic Govt 2 Yr) US Bond Yield 2 - 30 yr. Daily 02DEC2022-26JUN2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

27-Jun-2024 07:18:30

SET Index & Yields on Thai 10-year notes



Source: Bloomberg

TBDC10Y Index (Thai Bond Dealing Centre 10 Year Index) Thai bond yield Daily 02DEC2022-26JUN2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

27-Jun-2024 07:18:49

ค่าเงินดอลลาร์กลับมาแข็งค่า (เงินบาทอ่อน)

DOLLAR INDEX & THAI BAHT



Commodity Index



สัญญาซื้อขายน้ำมันดิบ (Brent) สูงขึ้นเป็นสัปดาห์ที่สี่ติดต่อกัน

Brent & Net Position



Source: ICE, CFTC
CO1 Comdty (Generic 1st 'CO' Future) Brent net position Daily 05NOV2018-26JUN2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

27-Jun-2024 07:17:28

Brent Hydrocracker (HCU) Refinery Margin M1

(FBHCM1 Index) = Futures

■ Last Price 11.24 ↑ High on 06/22/22 35.78 → Average 8.81 ↓ Low on 05/29/20 -0.86



FBHCM1 Index (Brent HCU Margin M1) Brent Hydrocracker (HCU) Daily 05NOV2018-30JUL2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

27-Jun-2024 07:17:46

Coal Price - BANPU - ITMG

Coal price relate with Oil Price

■ XWA Comdty - Last Price 133.00

■ BANPU TB Equity - Last Price 5.05

■ ITMG IJ Equity - Last Price 23800



Russia Stock Market & Gas Price





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	%		
SAT	13.50	1.22	1.42	10.53	Semi-Anl	15.04
DMT	11.70	0.21	1.18	10.09	Quarter	13.81
SIRI	1.62	0.10	0.15	9.44	Semi-Anl	106.17
ORI	4.80	0.30	0.43	8.92	Semi-Anl	24.41
SCB	106.00	7.84	9.07	8.56	Semi-Anl	836.82
LH	5.95	0.30	0.49	8.17	Semi-Anl	494.75
MC	10.90	0.50	0.89	8.14	Semi-Anl	27.49
QH	1.86	0.10	0.15	8.06	Semi-Anl	36.36
TISCO	96.25	5.75	7.69	7.99	Irreg	339.06
TACC	4.68	0.19	0.37	7.91	Semi-Anl	14.41
AH	19.70	0.95	1.53	7.78	Semi-Anl	19.29
SC	2.90	0.16	0.22	7.48	Semi-Anl	16.67
SPALI	18.40	0.75	1.35	7.34	Semi-Anl	112.57
TPIPL	1.34	0.07	0.10	7.31	Semi-Anl	14.10
NER	5.40	0.29	0.39	7.28	Semi-Anl	35.24
SPRC	8.20		0.59	7.23	Semi-Anl	74.58

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	3.60	0.36	0.37	10.28	Annual	9.0
AP	8.25	0.70	0.68	8.25	Annual	192.1
STANLY	221.00	10.00	15.29	6.92	Annual	25.4
ROJNA	6.10	0.40	0.42	6.89	Annual	18.7
TEAMG	2.92		0.18	6.16	Annual	5.2
BAM	7.70	0.38	0.44	5.74	Annual	88.5
KTB	17.00	0.87	0.93	5.45	Annual	740.4
ILINK	6.35	0.39	0.33	5.12	Annual	8.36
THANI	2.16	0.02	0.11	5.09	Annual	11.63
NETBAY	17.80	0.90	0.83	4.66	Annual	5.56
SIS	27.50	1.05	1.24	4.51	Annual	27.09
WICE	6.05	0.24	0.27	4.38	Annual	7.42
TEGH	3.90	0.10	0.17	4.36	Annual	29.02
COM7	17.30	0.70	0.72	4.16	Annual	180.83
TLI	7.70	0.16	0.32	4.13	Annual	103.73
EKH	6.90	0.29	0.28	4.03	Annual	14.32

High Dividend : Property Fund & REIT

23-Jun-24

Stock	Last price	Last DPS	Est. DPS	div yield last	Frequency	5-day avg volume	Type
				year			
				(%)	(times)	Bt mn	
GVREIT	5.25	0.19	0.78	15.02	Quarter	7.54	Leasehold
ALLY	4.64	0.13	0.00	13.45	Quarter	2.36	#N/A
DIF	7.55	0.22	0.96	12.08	Quarter	85.74	Freehold
CPNREIT	10.10	0.36	0.85	11.54	Quarter	41.40	Leasehold
AIMCG	3.04	0.13	0.00	11.18	Quarter	1.42	#N/A
LHHOTEL	10.70	0.30	1.33	10.65	Quarter	14.16	Free&Leaseho
BOFFICE	4.48	0.15	0.66	10.56	Quarter	1.23	Leasehold
CPNCG	5.35	0.19	0.91	9.94	Quarter	2.29	Leasehold
WHAIR	5.65	0.14	0.53	9.70	Quarter	6.43	#N/A
WHART	8.10	0.19	0.77	9.55	Quarter	24.82	Leasehold
INETREIT	8.25	0.20	0.00	9.51	Quarter	2.62	#N/A
FTREIT	7.95	0.19	0.75	9.41	Quarter	13.92	Free&Leaseho
AIMIRT	10.50	0.29	0.89	9.03	Quarter	4.24	Freehold
DREIT	4.52	0.20	0.60	8.79	Semi-Anl	2.80	Leasehold
BAREIT	9.05	0.18	0.58	8.31	Quarter	3.24	#N/A
LPF	11.70	0.22	0.87	7.48	Quarter	11.00	#N/A

(update สัปดาห์ละหนึ่งครั้ง)

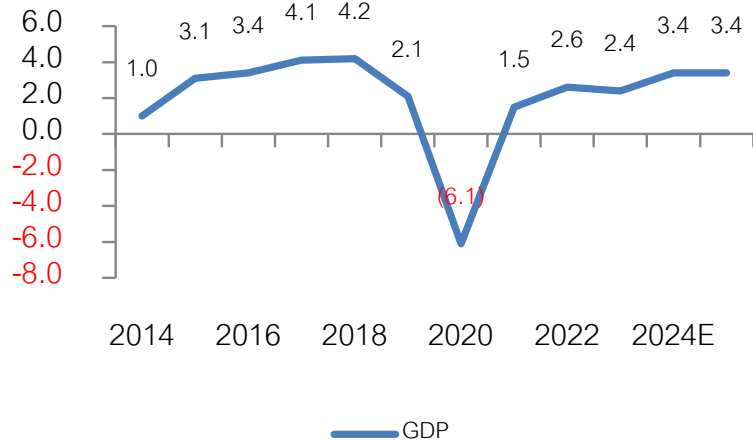
Market Indicators

Date	Country	Event	Period	Surv(M)	Prior
25-Jun	TH	Car Sales	May	--	46,738
26-Jun	US	New Home Sales MoM	May	2.7%	-4.7%
27-Jun	JN	Retail Sales MoM	May	1.0%	1.2%
	CH	Industrial Profits YoY	May	--	4.0%
	EC	Consumer Confidence	Jun F	--	14.0
	US	GDP Annualized QoQ	1Q T	1.43%	1.30%
	US	Advance Goods Trade Balance	May	-\$95.24b	-\$99.4b
	US	Initial Jobless Claims	Jun-22	--	238k
	US	Pending Home Sales MoM	May	--	-7.7%
28-Jun	JN	Industrial Production YoY	May P	0.2%	-1.8%
	TH	Mfg Production Index ISIC NSA YoY	May	1.9%	3.4%
	TH	BoT : Thai's Economic Monthly Report	May	--	-\$40m
	US	PCE Deflator MoM	May	0.0%	0.3%
	US	PCE Deflator YoY	May	2.6%	2.7%
	US	PCE Core Deflator MoM	May	0.1%	0.2%
	US	PCE Core Deflator YoY	May	2.6%	2.8%
	US	U. of Mich. Sentiment	Jun F	--	65.6
	US	U. of Mich. 1 Yr Inflation	Jun F	--	3.3%
30-Jun	CH	Manufacturing PMI	Jun	49.57	49.50
1-Jul	TH	S&P Global Thailand PMI Mfg	Jun	--	50.30
	CH	Caixin China PMI Mfg	Jun	--	51.70
	US	ISM Manufacturing	Jun	--	48.70
2-Jul	EC	CPI Estimate YoY	Jun	--	2.6%
	EC	CPI MoM	Jun P	--	0.20%
3-Jul	US	ADP Employment Change	Jun	--	152k
	US	Initial Jobless Claims	Jun-29	--	--
	US	FOMC Meeting Minutes	Jun-12	--	--
5-Jul	TH	CPI YoY	Jun	--	1.54%
	EC	Retail Sales YoY	May	--	0.0%
	US	Change in Nonfarm Payrolls	Jun	200.00k	272k
	US	Unemployment Rate	Jun	--	4.0%
	US	Average Hourly Earnings MoM	Jun	--	0.4%

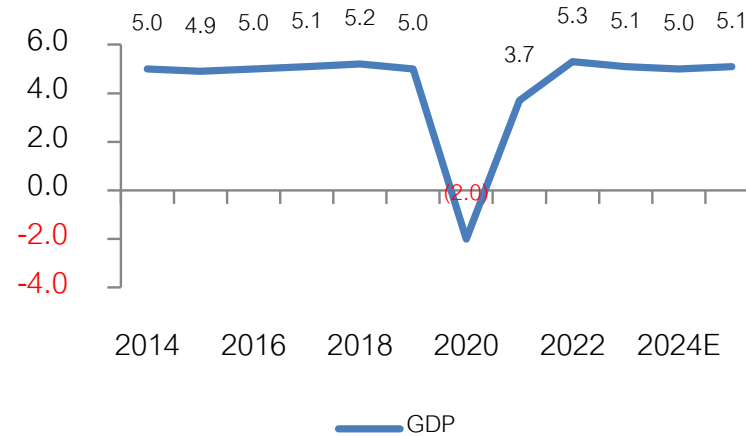
GDP ของประเทศใน Asean

Source : Bloomberg
(8 Feb 24)

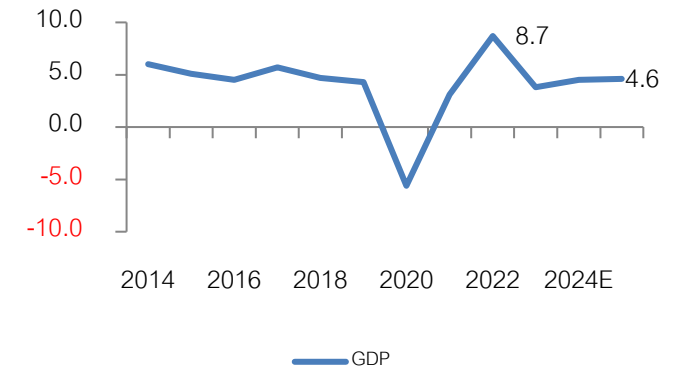
Thailand



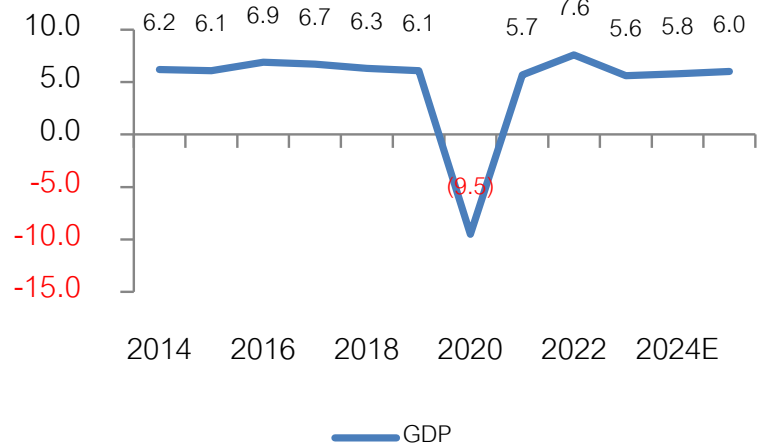
Indonesia



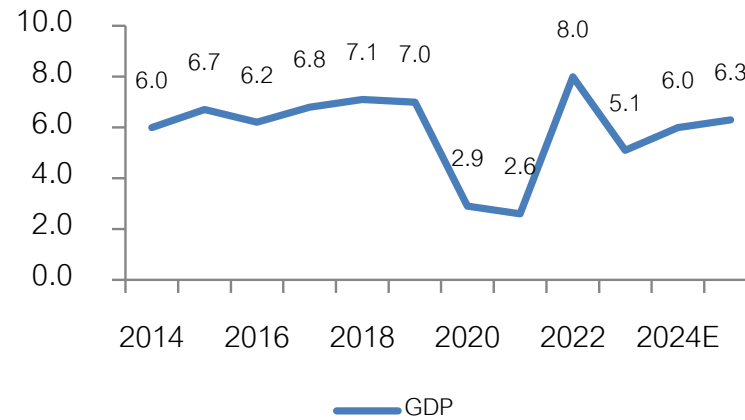
Malaysia



Philippine



Vietnam



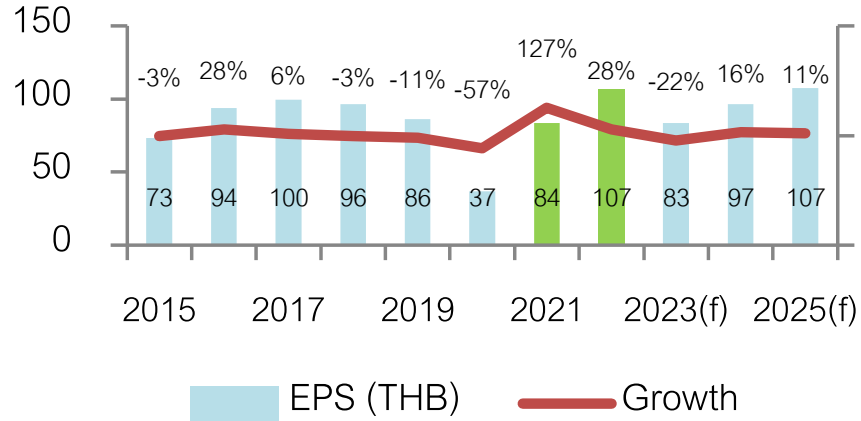
EPS (กำไรตลาด) ของประเทศใน Asean

Source : Bloomberg

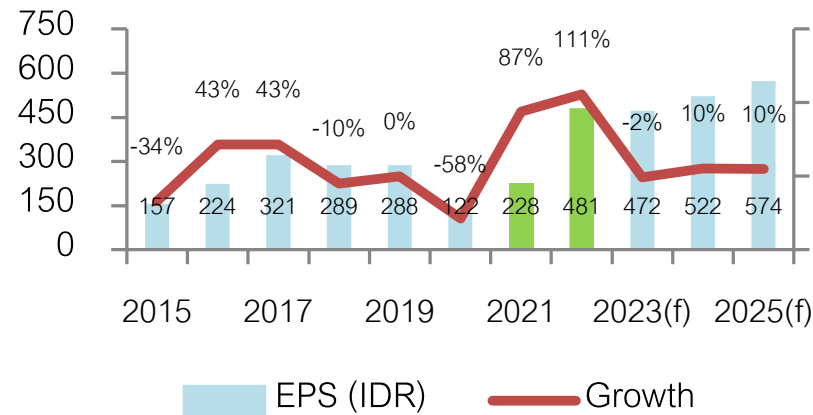
(8 Feb 24)

Currency : Local Currency

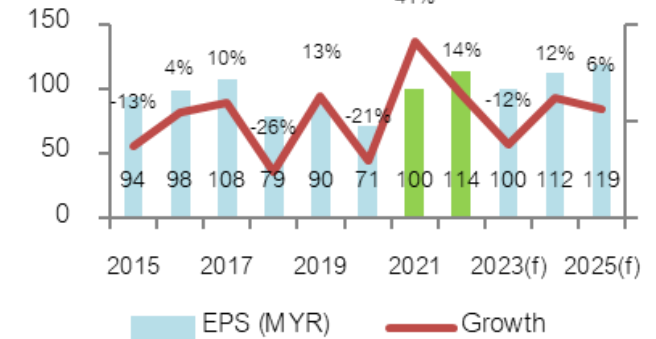
Thailand



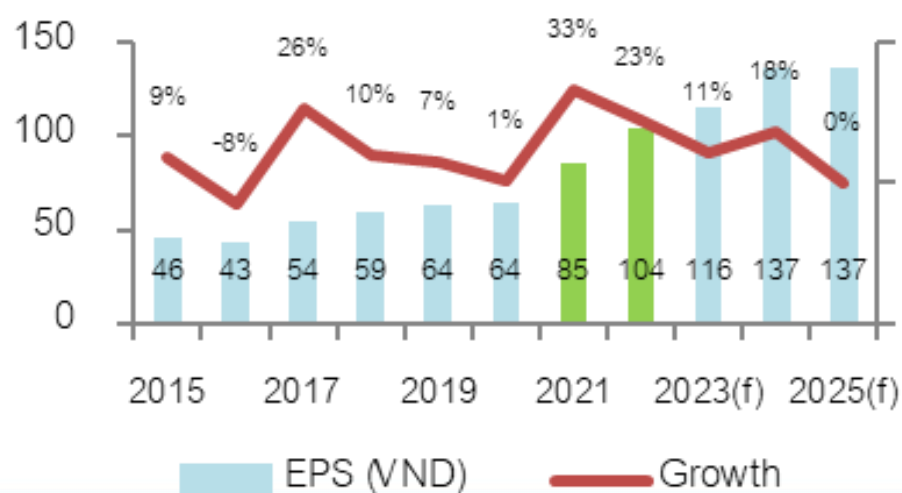
Indonesia



Malaysia



Vietnam



Philippine



THAILAND	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023E	2024E	2025E
GDP	1.0	3.1	3.4	4.1	4.2	2.1	(6.1)	1.5	2.6	2.4	3.4	3.4
Inflation	1.9	(0.9)	0.2	0.7	1.1	0.7	(0.8)	1.2	6.1	1.3	1.7	1.9
Current Account /GDP	2.9	6.9	10.5	9.6	5.6	7.0	4.2	(2.1)	(3.0)	1.0	2.6	3.6
Budget Deficit / GDP	(3.0)	(2.6)	(2.2)	(3.5)	(2.5)	(1.9)	(6.8)	(5.5)	(2.7)	(3.4)	(3.8)	(3.5)

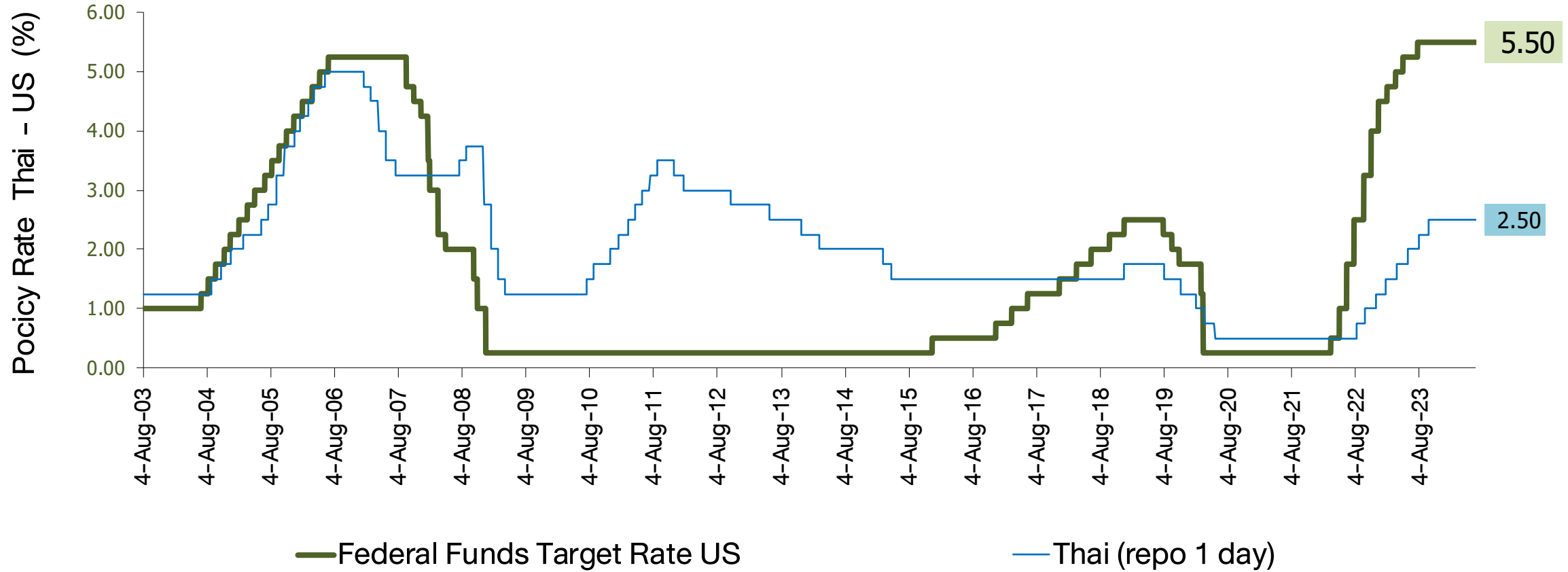
INDONESIA	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023E	2024E	2025E
GDP	5.0	4.9	5.0	5.1	5.2	5.0	(2.0)	3.7	5.3	5.1	5.0	5.1
Inflation	6.4	6.4	3.5	3.8	3.2	2.8	2.0	1.6	4.2	3.7	2.9	3.0
Current Account /GDP	(3.1)	(2.0)	(1.8)	(1.6)	(2.9)	(2.7)	(0.4)	0.3	1.0	0.2	(0.6)	1.0
Budget Deficit / GDP	(2.1)	(2.6)	(2.5)	(2.5)	(1.8)	(2.2)	(6.4)	(4.6)	(3.7)	(2.1)	(2.3)	(2.3)

PHILIPPINES	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023E	2024E	2025E
GDP	6.2	6.1	6.9	6.7	6.3	6.1	(9.5)	5.7	7.6	5.6	5.8	6.0
Inflation	3.6	0.7	1.3	2.9	5.2	2.4	2.4	3.9	5.8	6.0	3.6	3.3
Current Account /GDP	3.8	2.5	0.2	(0.8)	(2.3)	(0.1)	3.6	(1.8)	(4.4)	(3.3)	(2.9)	(2.5)
Budget Deficit / GDP	(0.6)	(0.9)	(2.4)	(2.1)	(3.1)	(3.4)	(7.6)	(8.6)	(7.4)	(6.2)	(5.4)	(4.5)

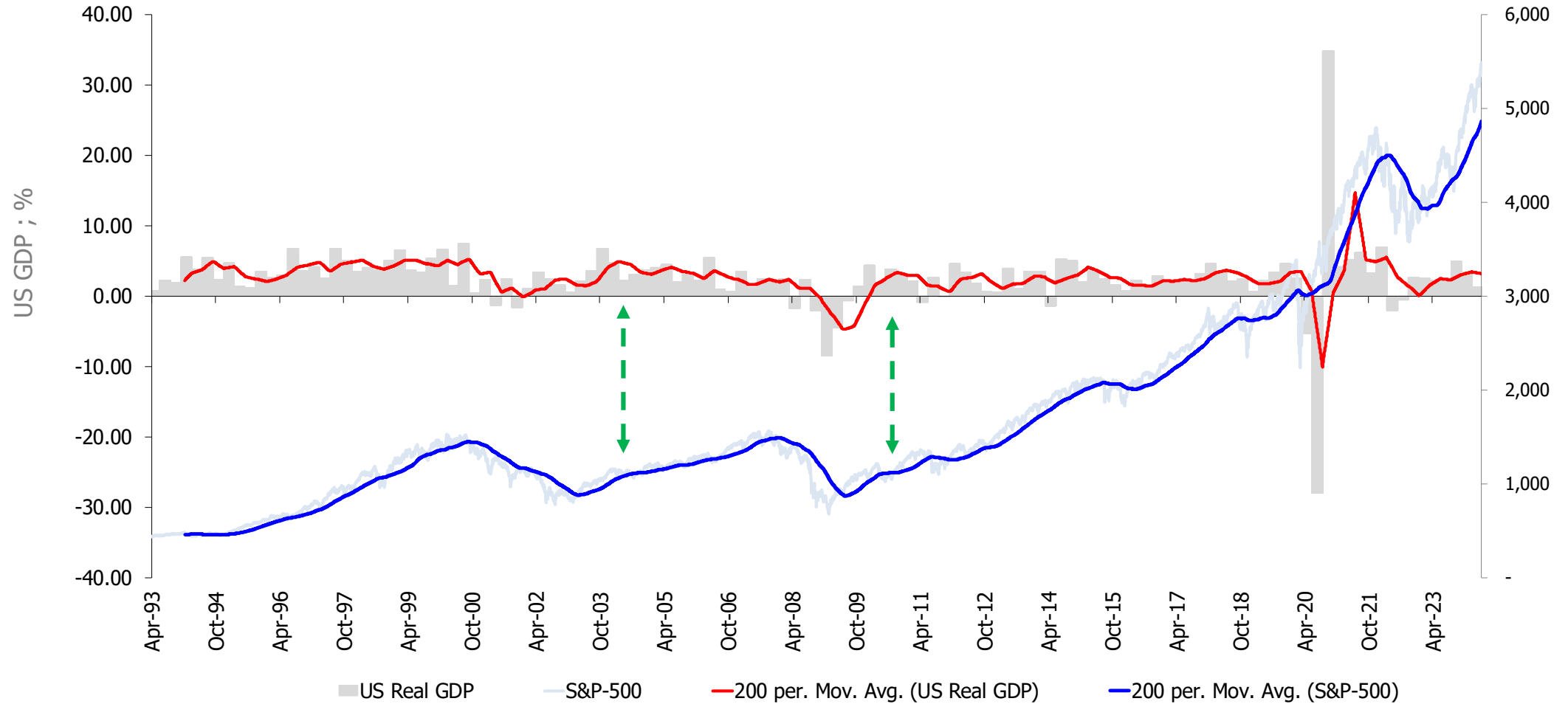
VIETNAM	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023E	2024E	2025E
GDP	6.0	6.7	6.2	6.8	7.1	7.0	2.9	2.6	8.0	5.1	6.0	6.3
Inflation	4.1	0.6	2.7	3.5	3.5	2.8	3.2	1.8	3.2	3.3	3.5	3.2
Current Account /GDP	3.7	(0.9)	0.3	(0.6)	1.9	3.8	4.4	(2.2)	(0.2)	2.0	3.2	3.0
Budget Deficit / GDP								(5.2)	(4.5)	(4.0)	(3.6)	(3.4)

Malaysia	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023E	2024E	2025E
GDP	6.0	5.1	4.5	5.7	4.7	4.3	(5.6)	3.1	8.7	3.8	4.5	4.6
Inflation	3.2	2.1	2.1	3.8	1.0	0.7	(1.1)	2.5	3.4	2.5	2.4	2.3
Current Account /GDP	4.4	2.8	2.4	2.8	2.2	3.5	4.2	3.9	3.1	2.1	2.4	2.9
Budget Deficit / GDP	(3.4)	(3.2)	(3.1)	(2.9)	(3.7)	(3.4)	(6.2)	(6.4)	(5.6)	(5.0)	(4.3)	(3.7)

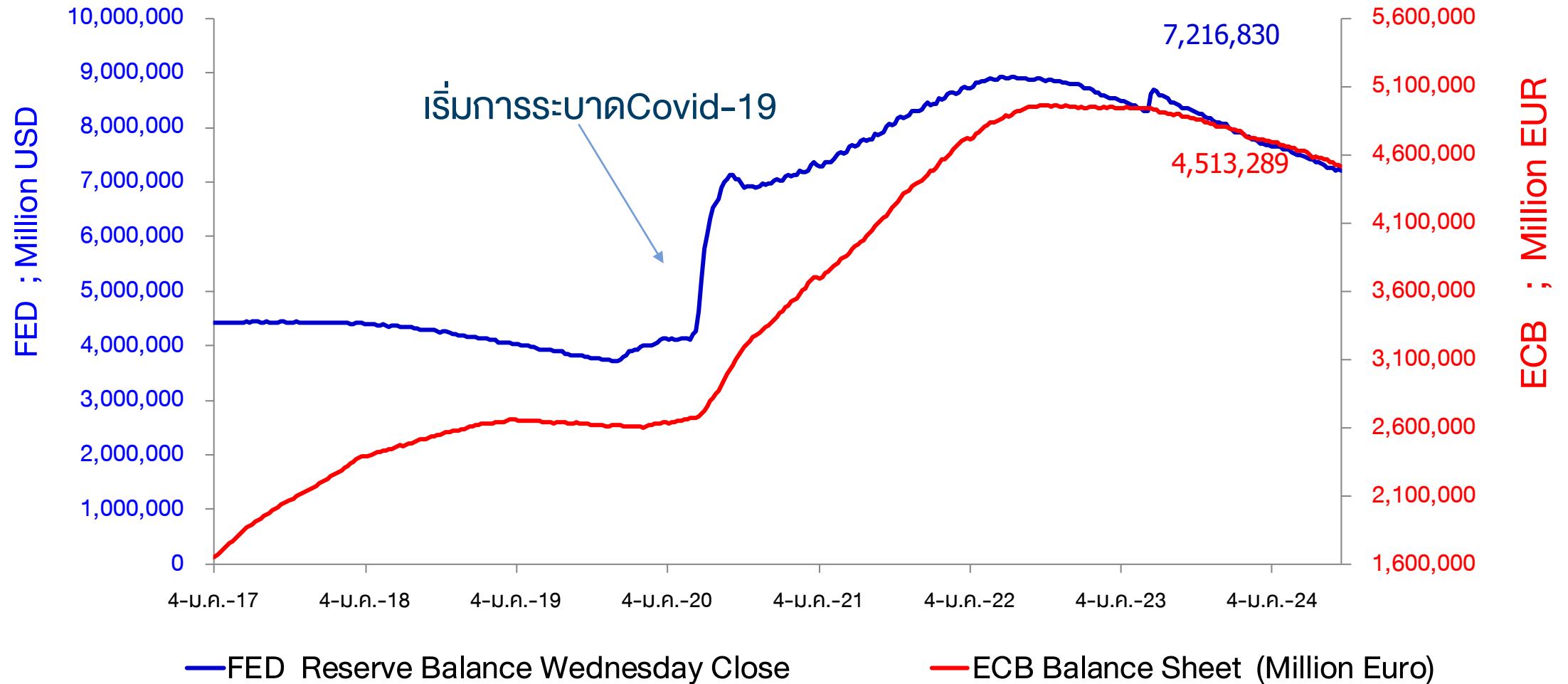
Federal Funds Rate & Thai Rate



US Real GDP and S&P-500



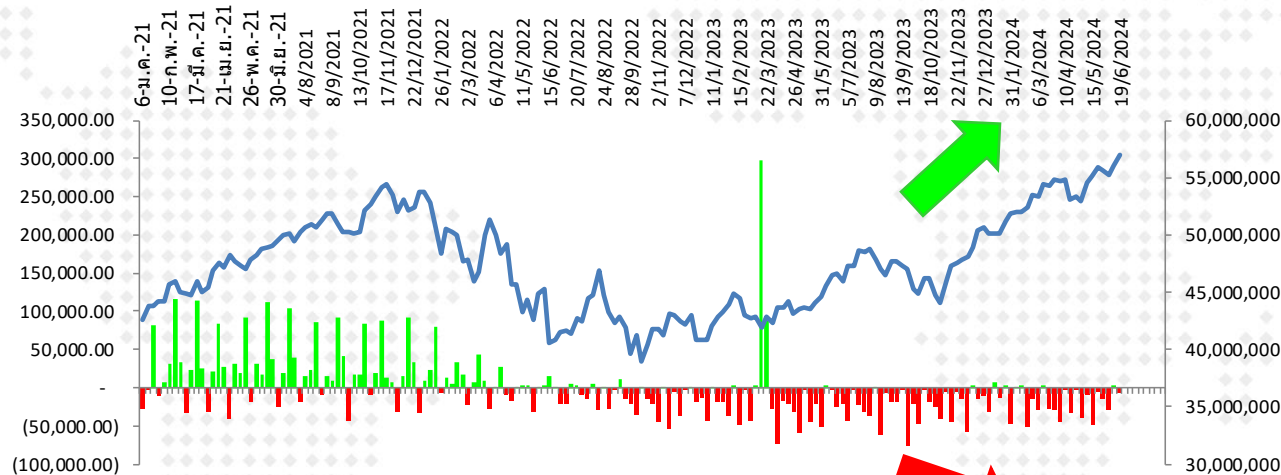
Fed & ECB : Assets Purchase (QE Program)





ตัวเลขการซื้อขายพันธบัตร
Fed (QE) รายสัปดาห์

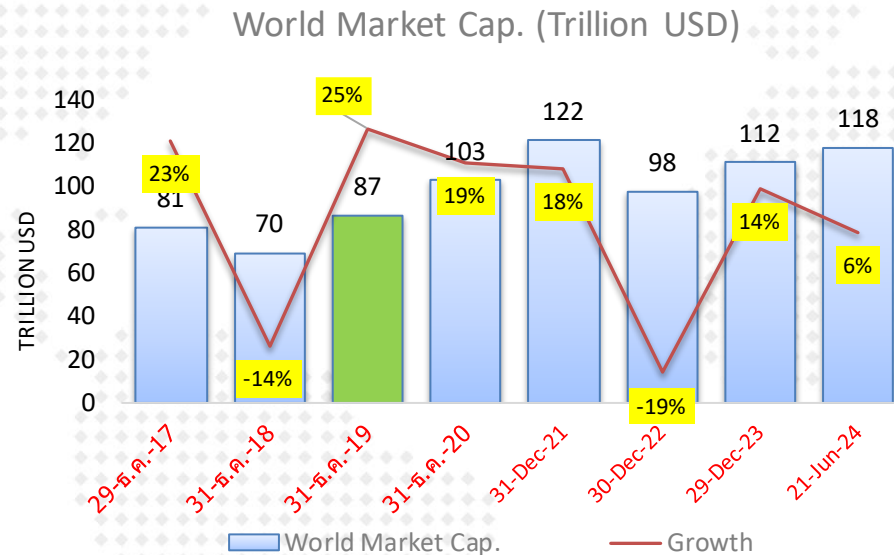
■ FED Reserve Balance Wednesday Close
— Bloomberg United States Exchange Market Capitalization USD



■ 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

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%
21-Jun-24	118,392,938	6%

หมายเหตุ : การอัดฉีดเงินเข้าระบบของธนาคารกลางต่าง มีส่วนให้ตลาดหุ้นปรับตัวสูงขึ้น ในช่วงปี 2020-2021

P/E ตลาดหุ้นสำคัญๆ

Market P/E (current & Forward)

23-Jun-24

Index Name	country	Index	P/E Ratio	P/E Ratio	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	1,590.37	15.06	14.17	13.14	4.08	6.64	21-Jun-24	Requesting D	มาเลเซีย
PSEI - PHILIPPINE SE IDX	PH	6,158.48	11.33	10.37	9.46	2.97	8.83	21-Jun-24	Requesting D	ฟิลิปปินส์
Straits Times Index STI	SI	3,306.02	12.09	10.76	10.21	5.03	8.27	21-Jun-24	Requesting D	สิงคโปร์
KOSPI INDEX	SK	2,784.26	16.45	11.11	8.81	2.00	6.08	21-Jun-24	Requesting D	เกาหลีใต้
TAIWAN TAIEX INDEX	TA	23,253.39	25.60	20.47	17.61	2.54	3.91	21-Jun-24	Requesting D	ไต้หวัน
STOCK EXCH OF THAI INDEX	TH	1,306.41	15.69	14.04	12.69	3.60	6.36	21-Jun-24	Requesting D	ไทย (SET)
THAI SET 50 INDEX	TH	808.74	16.15	14.81	13.16	3.38	6.19	21-Jun-24	Requesting D	ไทย (SET50)
SENSEX	IN	77,209.90	24.07	21.83	19.06	1.20	4.15	21-Jun-24	Requesting D	อินเดีย
JAKARTA COMPOSITE INDEX	ID	6,879.98	21.23	12.85	11.68	3.48	4.71	21-Jun-24	Requesting D	อินโดนีเซีย
HO CHI MINH STOCK INDEX	VN	1,282.02	16.10	11.14	9.32	1.65	6.21	21-Jun-24	Requesting D	เวียดนาม
SHANGHAI SE A SHARE INDX	CH	3,142.88	14.03	11.18	10.11	2.82	7.13	21-Jun-24	Requesting D	จีน (A-Shares)
SHANGHAI SE COMPOSITE	CH	2,998.14	14.03	11.18	10.12	2.83	7.13	21-Jun-24	Requesting D	จีน (Composite)
HANG SENG INDEX	HK	18,028.52	10.11	8.86	8.28	4.36	9.90	21-Jun-24	Requesting D	ฮ่องกง
DOW JONES INDUS. AVG	US	39,150.33	22.44	19.33	17.21	1.86	4.46	22-Jun-24	Requesting D	สหรัฐฯ (Dow Jones)
S&P 500 INDEX	US	5,464.62	25.60	22.64	19.69	1.33	3.91	22-Jun-24	Requesting D	สหรัฐฯ (S&P-500)
NASDAQ COMPOSITE	US	17,689.36	43.31	33.00	25.81	0.70	2.31	22-Jun-24	Requesting D	สหรัฐฯ (Nasdaq)
CAC 40 INDEX	FR	7,628.57	13.25	13.41	12.42	3.26	7.54	21-Jun-24	Requesting D	ฝรั่งเศส
DAX INDEX	GE	18,163.52	16.01	13.16	11.48	3.06	6.24	22-Jun-24	Requesting D	เยอรมัน
NIKKEI 225	JN	38,596.47	26.89	5.58	20.00	1.69	3.72	21-Jun-24	Requesting D	ญี่ปุ่น (Nikkei)
FTSEUROFIRST 300 INDEX	EC	2,044.58	15.48	14.37	13.34	3.26	6.46	21-Jun-24	Requesting D	ยุโรป (300 บริษัท)
Euro Stoxx 50 Pr	EC	4,907.30	14.21	13.74	12.70	3.20	7.04	21-Jun-24	Requesting D	ยุโรป (50 บริษัท)
STXE 600 (EUR) Pr	EC	515.11	15.49	14.24	13.13	3.28	6.46	21-Jun-24	Requesting D	ยุโรป (600 บริษัท)
MSCI WORLD	MULT	3,507.81	22.11	19.85	17.62	1.80	4.52	22-Jun-24	Requesting D	ตลาดหุ้นโลก (MSCI)

Source : Bloomberg

EPS ตลาดหุ้นสำคัญๆ

23-Jun-24

Trailing 12M Earnings per Share

General Estimated Earnings

Market	Trailing 12M Earnings per Share			General Estimated Earnings			Current Earnings Yield	FWD P/E	
	EPS 2019	EPS 2020	EPS 2021	Trailing 12M	2024(f)	2025(f)		(Current Year)	(Next Year)
มาเลเซีย	89.6	66.2	106.3	106.5	112.2	121.1	6.6	14.2	13.1
ฟิลิปปินส์	474.3	292.6	343.2	529.8	593.6	651.3	8.8	10.4	9.5
สิงคโปร์	228.6	153.0	181.6	314.7	313.9	323.9	8.3	10.5	10.2
เกาหลีใต้	135.2	109.2	245.0	170.7	250.7	316.2	6.1	11.1	8.8
ไต้หวัน	619.8	672.0	1,224.5	931.9	1,135.9	1,320.3	3.9	20.5	17.6
ไทย (SET)	78.4	45.8	74.9	76.7	91.2	102.9	6.4	14.3	12.7
ไทย (SET50)	53.7	33.7	49.5	47.1	54.5	61.4	6.2	14.8	13.2
อินเดีย	1,699.9	1,766.5	1,930.2	3,204.6	3,521.3	4,049.9	4.2	21.9	19.1
อินโดนีเซีย	298.9	181.5	245.1	179.9	535.4	589.2	4.7	12.9	11.7
เวียดนาม	60.7	53.1	82.9	83.5	115.1	137.5	6.2	11.1	9.3
จีน (A-Shares)	224.8	203.5	243.7	225.9	281.2	310.8	7.1	11.2	10.1
จีน (Composite)	215.4	195.4	231.2	215.5	268.3	296.4	7.1	11.2	10.1
ฮ่องกง	2,416.7	2,146.0	2,076.1	1,910.0	2,042.9	2,177.2	9.9	8.8	8.3
สหรัฐฯ (Dow Jones)	1,509.2	1,292.7	1,797.2	1,868.6	2,029.5	2,274.3	4.5	19.3	17.2
สหรัฐฯ (S&P-500)	163.6	142.8	198.3	228.1	244.8	277.5	3.9	22.3	19.7
สหรัฐฯ (Nasdaq)	316.1	306.9	438.5	466.0	538.9	685.8	2.3	32.8	25.8
ฝรั่งเศส	361.9	231.2	410.7	578.9	568.7	614.1	7.5	13.4	12.4
เยอรมัน	841.1	668.0	1,078.5	1,329.7	1,387.2	1,582.0	6.2	13.1	11.5
ญี่ปุ่น (Nikkei)	1,254.8	759.3	1,691.8	1,562.7	6,906.5	1,929.4	3.7	5.6	20.0
ยุโรป (300 บริษัท)	103.6	78.6	111.1	144.9	142.4	153.3	6.5	14.4	13.3
ยุโรป (50 บริษัท)	239.7	174.1	247.6	356.9	357.5	386.5	7.0	13.7	12.7
ยุโรป (600 บริษัท)	25.7	18.5	27.1	36.1	36.2	39.2	6.5	14.3	13.1
ตลาดหุ้นโลก (MSCI)	128.4	104.6	152.2	172.0	179.0	199.7	4.5	19.7	17.6

EPS : Growth Rate ตลาดหุ้นสำคัญๆ

23-Jun-24	EPS Growth	EPS Growth	EPS Growth	EPS Growth	EPS Growth
EPS Growth	2020	2021	Trailing 12M	2024(f)	2025(f)
มาเลเซีย	-26.1%	60.6%	0.2%	5.3%	7.9%
ฟิลิปปินส์	-38.3%	17.3%	54.4%	12.1%	9.7%
สิงคโปร์	-33.1%	18.7%	73.3%	-0.3%	3.2%
เกาหลีใต้	-19.2%	124.4%	-30.3%	46.9%	26.1%
ไต้หวัน	8.4%	82.2%	-23.9%	21.9%	16.2%
ไทย (SET)	-41.7%	63.6%	2.4%	19.0%	12.9%
ไทย (SET50)	-37.3%	47.0%	-4.8%	15.8%	12.6%
อินเดีย	3.9%	9.3%	66.0%	9.9%	15.0%
อินโดนีเซีย	-39.3%	35.1%	-26.6%	197.6%	10.0%
เวียดนาม	-12.5%	56.2%	0.6%	37.9%	19.5%
จีน (A-Shares)	-9.4%	19.7%	-7.3%	24.5%	10.5%
จีน (Composite)	-9.3%	18.4%	-6.8%	24.5%	10.5%
ฮ่องกง	-11.2%	-3.3%	-8.0%	7.0%	6.6%
สหรัฐฯ (Dow Jones)	-14.3%	39.0%	4.0%	8.6%	12.1%
สหรัฐฯ (S&P-500)	-12.7%	38.8%	15.1%	7.3%	13.3%
สหรัฐฯ (Nasdaq)	-2.9%	42.9%	6.3%	15.7%	27.3%
ฝรั่งเศส	-36.1%	77.7%	41.0%	-1.8%	8.0%
เยอรมัน	-20.6%	61.5%	23.3%	4.3%	14.0%
ญี่ปุ่น (Nikkei)	-39.5%	122.8%	-7.6%	342.0%	-72.1%
ยุโรป (300 บริษัท)	-24.1%	41.4%	30.4%	-1.8%	7.6%
ยุโรป (50 บริษัท)	-27.4%	42.3%	44.1%	0.2%	8.1%
ยุโรป (600 บริษัท)	-27.9%	46.2%	33.1%	0.5%	8.3%
ตลาดหุ้นโลก (MSCI)	-18.6%	45.6%	13.0%	4.1%	11.6%

ผลตอบแทนตลาดหุ้นไทย เทียบกับตลาดโลก

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	0.9%	5.0%	1.8%	9.5%	1.7%	10.6%	0.8%	7.0%	-0.6%	7.8%	0.2%	11.3%
1 month	1.2%	7.2%	-0.2%	14.0%	0.7%	15.5%	3.2%	8.0%	-5.8%	6.4%	5.6%	11.5%
3 month	4.0%	8.8%	7.0%	12.9%	9.6%	14.3%	5.1%	10.6%	-4.4%	10.5%	8.5%	15.0%
6 month	13.5%	8.8%	11.2%	12.2%	14.3%	13.7%	17.3%	10.9%	-5.2%	10.0%	20.4%	15.5%
9 month	20.6%	9.6%	14.7%	12.8%	16.3%	14.2%	25.7%	11.5%	-11.7%	11.3%	32.3%	15.8%
12 month	20.4%	9.6%	11.0%	12.7%	11.5%	14.1%	26.6%	11.3%	-12.8%	11.2%	30.7%	15.6%
Month to date	2.5%	6.5%	4.7%	14.2%	5.4%	15.4%	3.8%	6.6%	-3.5%	7.1%	5.9%	11.4%
Quarter to date	3.2%	9.0%	6.1%	12.9%	8.7%	14.2%	4.5%	10.9%	-4.7%	10.5%	8.4%	15.5%
Year to date	11.6%	8.9%	8.3%	12.2%	11.0%	13.7%	15.5%	10.9%	-6.3%	10.2%	18.5%	15.7%
2 ปี	19.4%	12.9%	7.4%	14.5%	6.7%	16.2%	24.0%	16.1%	-5.9%	10.9%	29.2%	21.0%
3 ปี	6.2%	14.0%	-4.5%	15.8%	-5.1%	17.3%	11.2%	17.3%	-4.1%	11.1%	9.0%	22.9%
4 ปี	13.0%	13.6%	4.9%	15.7%	4.3%	17.0%	17.1%	16.9%	1.5%	12.7%	16.4%	22.6%
5 ปี	10.8%	17.0%	3.3%	17.3%	3.8%	18.0%	15.0%	21.3%	-2.5%	16.9%	18.1%	25.2%
10 ปี	8.5%	14.3%	2.9%	15.8%	4.5%	16.0%	12.9%	17.8%	1.9%	14.5%	16.2%	21.1%

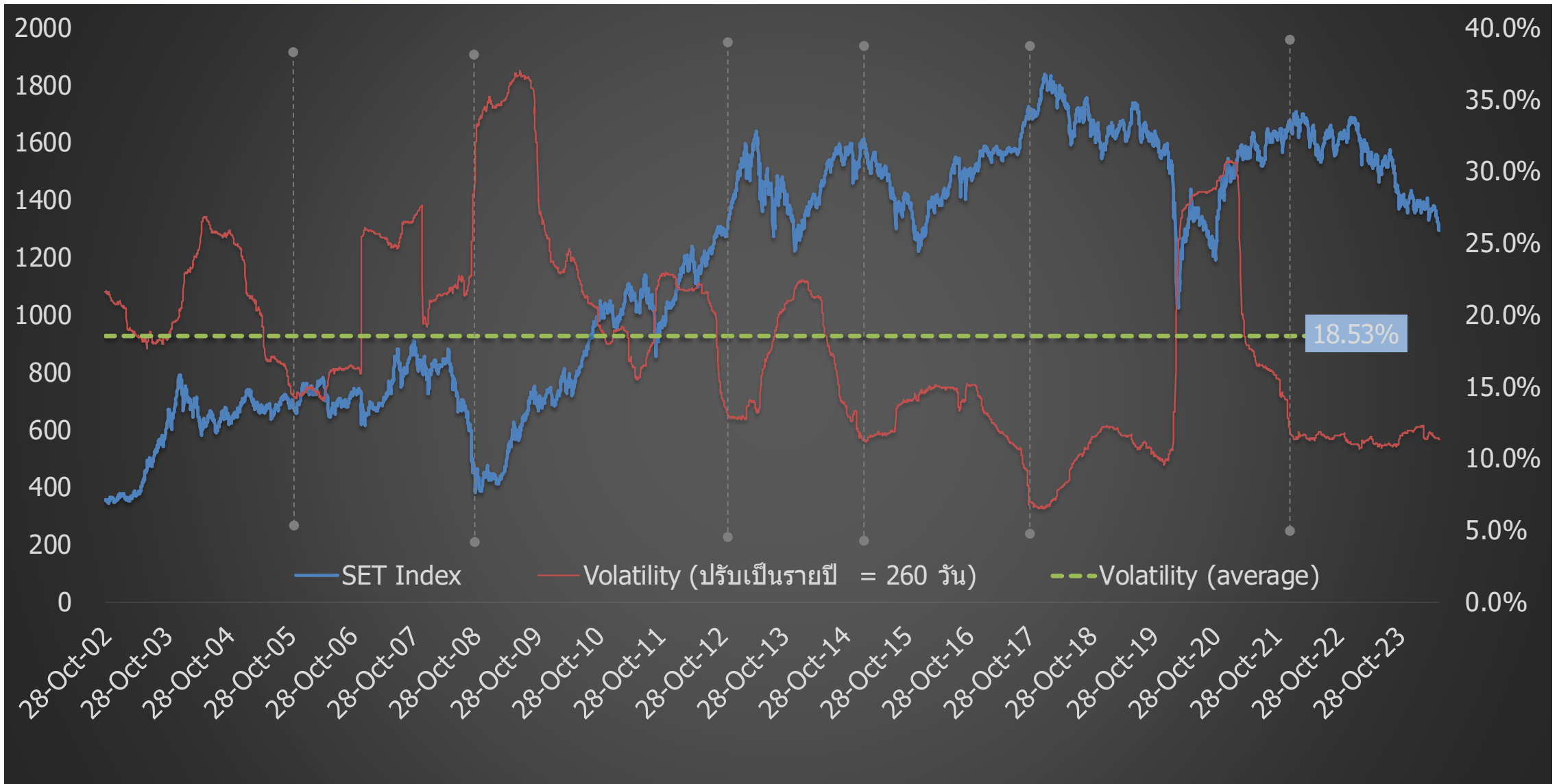
Remark : Total Return วัดจากวันสุดท้ายเทียบกับวันแรกของช่วงเวลานั้นๆ

23-Jun-2024

Source : Bloomberg

SD* = Standard Deviation ปรึ้มเป็น Annualized

ตลาดหุ้นไทย อยู่ในภาวะซบเซา กินเวลานานที่สุดที่เคยมีมา



SET Index Target for 2024

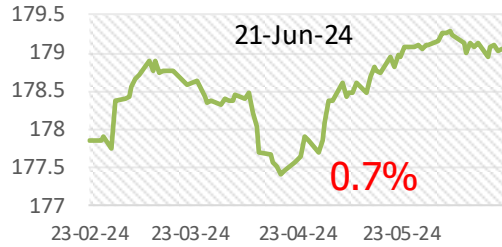
6-Jun-24

				SET TARGET		
				Worst	Base	Best
				-0.25 SD	+0.25 SD	+0.5 SD
	Net Profit	Net Profit Growth	EPS	16.64	17.96	18.62
Year 2022	1,001,815	-1.4%	84.0			
Year 2023	933,629	-6.8%	76.1			
Year 2024						
Best	1,026,929	10%	83.1		1493	
Base	1,008,256	8.0%	81.6	1358	1466	1520
Worst	961,575	3%	77.8		1398	
<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	1,110,886	10.2%	89.9		1555	
Year 2026	1,195,685	7.6%	96.7		1674	
<i>SET Profit for Year 2026 : Estimate Net Profit Growth = 7.3% (Bloomberg Survey ; 24 May 24) ; P/E=17.30x (Avg.)</i>						

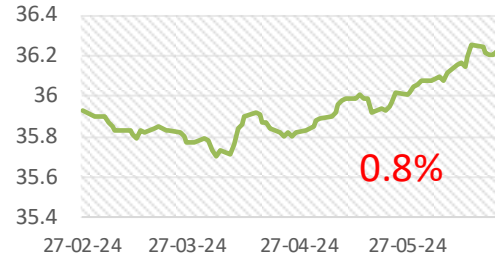
Remark : Year 2021-2025 Exclude "THAI", STARK

การปรับ EPS ตลาดหุ้นสำคัญๆ ปี 2024

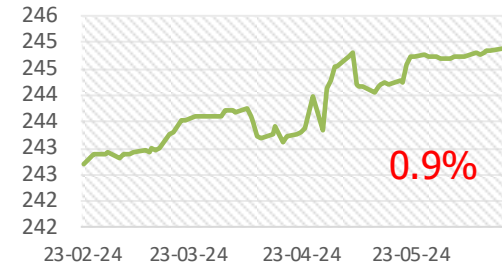
MSCI WORLD



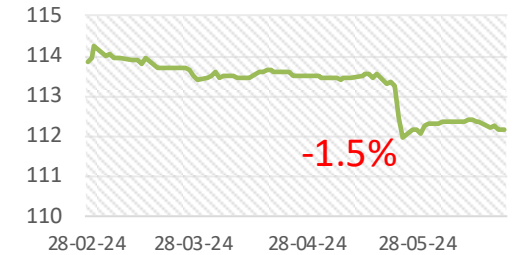
STXE 600 (EUR) Pr



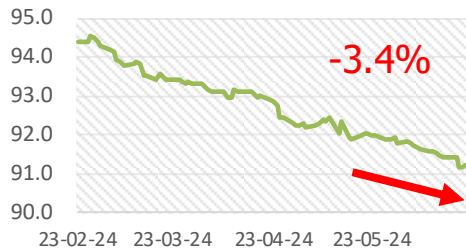
US (s&p-500)



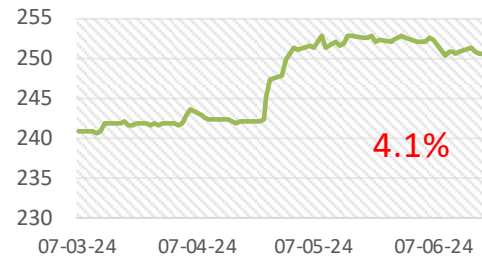
Malaysia



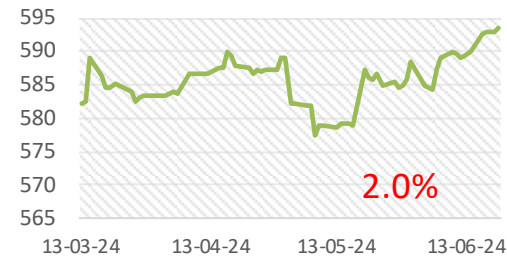
Thailand



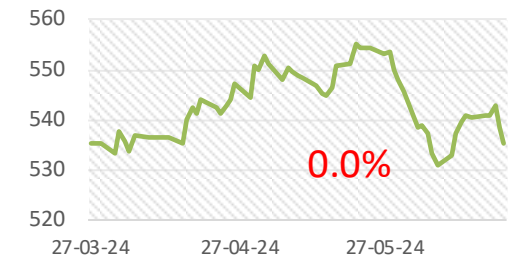
South Korea



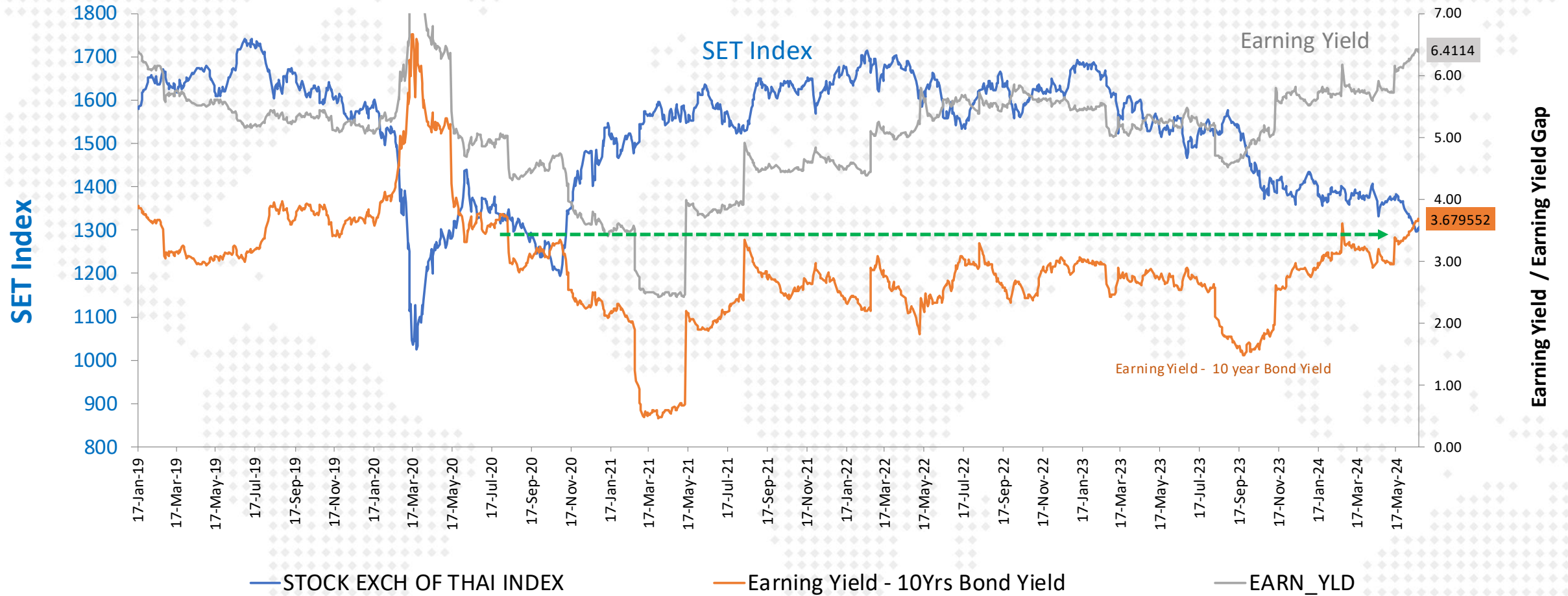
Philippine



Indonesia

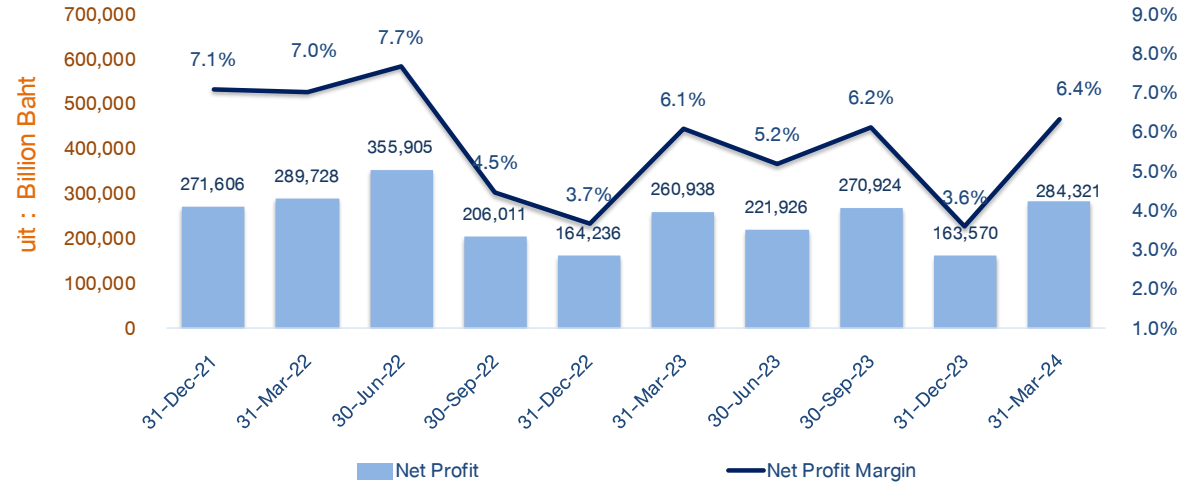


Thai Stock Market (Earning Yield Gap)

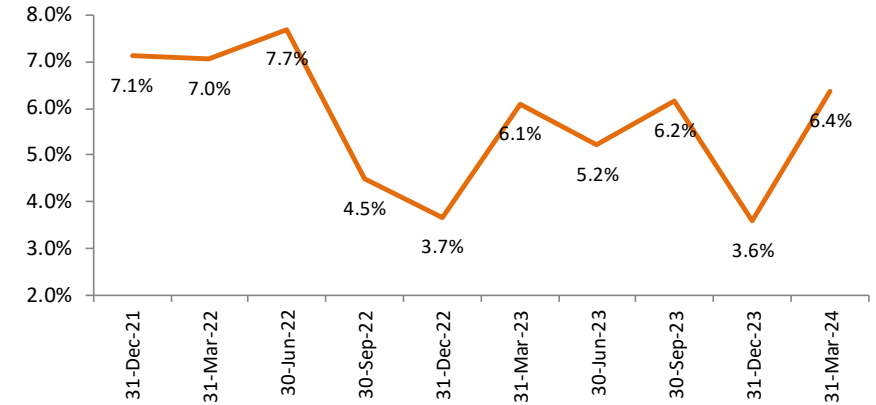


SET Profitability as of 1Q-2024

SET : Net Profit & Net Profit Margin

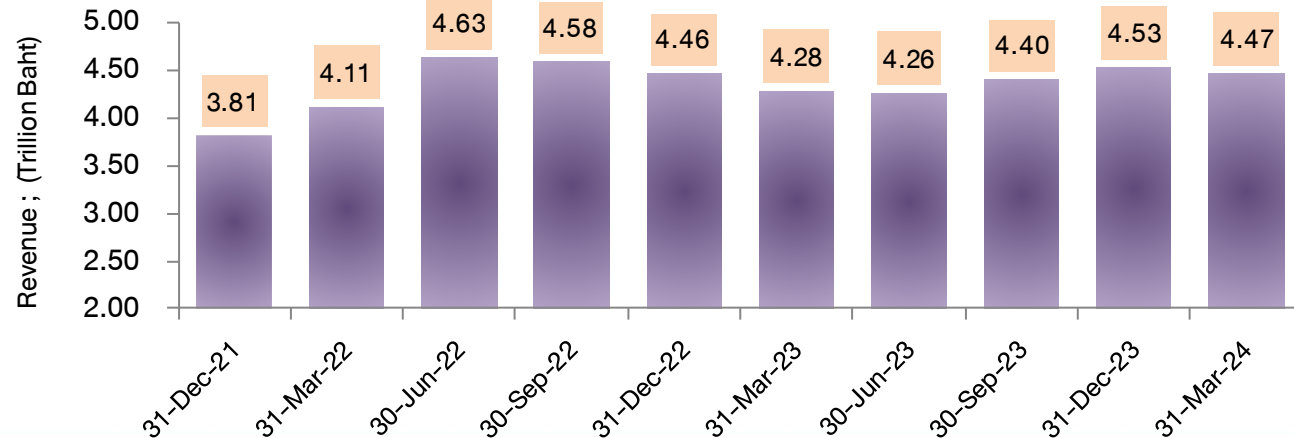


SET : Net Profit Margin



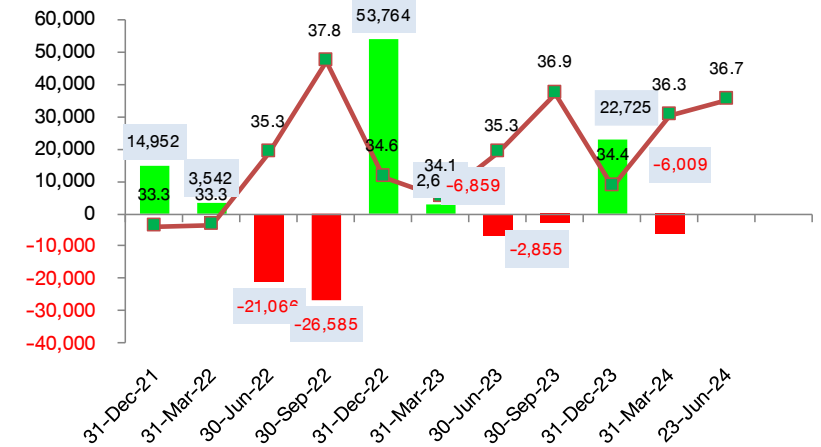
SET : Revenue

23-Jun-24



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](https://www.youtube.com/DAOLChannel)  [@daolsec](https://www.line.me/daolsec)