

DAOL Daily Strategy

10 Oct 2024

ฝ่ายวิเคราะห์กลยุทธ์การลงทุนหลักทรัพย์

เบอร์โทรศัพท์ : 02-351-1801

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

“ DAOL เต็มหุ้นอีก 3 ตัวเข้าพอร์ต เก็งอิสราเอลไม่จัดหนักให้อิหร่าน ”

ประเด็นวิเคราะห์วันนี้

- ตลาดเริ่มซึมซับปัจจัยลบสงครามอิสราเอล-อิหร่าน
- Fed จะลดดอกเบี้ย 0.25% แต่ทำไมหุ้นขึ้น
- ตลาดจีน มีแรงขายทำกำไร 2 วันติดต่อกัน เรามองยังไ้
- เงินบาท กลับมาแข็ง สะท้อนปัจจัยบวกอะไร
- กลต.คุมเข้ม Naked Short ปรับหนัก ปรับจริง

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	5,002.5	(5.3)	-0.1	0.1	4.3	-0.7	25.5	09-Oct-24
	DJ Global	638.3	0.4	0.1	0.0	4.9	-0.5	27.2	09-Oct-24
	Bloomberg World Index	1,974.1	2.5	0.1	0.0	5.1	-0.4	27.8	09-Oct-24
	MSCI World	3,716.2	17.8	0.5	0.6	4.6	-0.2	28.7	09-Oct-24
	MSCI Emergin Market	1,148.3	(31.1)	-2.6	-0.7	8.0	-1.9	21.6	09-Oct-24
	MSCI Thailand	494.5	4.4	0.9	0.5	1.8	1.1	3.9	09-Oct-24
Americas	Dow Jones	42,512.0	159.3	0.4	1.0	4.1	0.4	26.5	09-Oct-24
	NASDAQ	18,291.6	153.8	0.8	0.6	8.3	0.6	35.7	09-Oct-24
	S&P 500	5,792.0	41.0	0.7	0.7	5.9	0.5	33.6	09-Oct-24
Europe	Stoxx Europe 600	520.1	1.5	0.3	0.7	2.4	-0.5	14.9	09-Oct-24
Euro Zone	Euro Stoxx 50	4,982.6	27.6	0.6	0.7	5.0	-0.4	18.5	09-Oct-24
France	CAC 40	7,560.1	18.7	0.2	0.5	2.1	-1.0	5.6	09-Oct-24
German	DAX	19,254.9	134.0	0.7	1.0	5.4	-0.4	24.8	09-Oct-24
UK	FTSE 100	8,243.7	(36.9)	-0.4	0.6	0.5	0.1	8.1	09-Oct-24
Asia-Pacific	MSCI AC Asia Pacific Index	191.1	(3.6)	-1.9	-0.5	6.2	-2.0	21.9	09-Oct-24
Thailand	SET Index	1,457.0	12.7	0.9	0.3	2.0	0.6	1.6	09-Oct-24
China	Shanghai SE Composit	3,258.9	171.3	5.5	-6.6	18.8	-2.3	6.0	09-Oct-24
China	Shenzhen CSI 300	3,956.0	252.3	6.3	-7.1	23.8	-1.5	8.2	09-Oct-24
Hong Kong	Hang Seng	20,637.2	(2099.6)	-9.2	-1.4	19.7	-2.3	16.8	09-Oct-24
Philippines	Philippines Stock Exchange	7,424.5	(43.4)	-0.6	-1.5	6.3	2.1	18.5	09-Oct-24
Indonesia	Jakarta SE Composite	7,501.3	5.2	0.1	-0.7	-3.4	-0.4	8.4	09-Oct-24
Japan	Nikkei	39,278.0	642.3	1.7	0.9	8.6	3.6	23.7	09-Oct-24
Singapore	Straits Times	3,595.7	6.5	0.2	0.6	2.4	0.3	12.4	09-Oct-24
South Korea	Korea Stock Exchange	2,594.4	24.7	1.0	0.7	3.0	0.0	8.4	08-Oct-24
Vietnam	Ho Chi Minh Stock Exchange	1,281.9	11.3	0.9	0.8	2.1	-0.5	12.1	09-Oct-24
India	BSE Sensex	81,467.1	(221.3)	-0.3	-0.2	-0.6	-3.4	23.3	09-Oct-24
Taiwan	Taiwan Weighted	22,659.1	356.4	1.6	0.2	7.6	2.0	37.2	09-Oct-24
Currency	USD Index Spot Rate	102.9	0.4	0.4	-0.0	1.2	2.1	-2.8	09-Oct-24
	USD-EUR	1.1	(0.0)	-0.3	0.0	-0.7	-1.8	3.2	09-Oct-24
	USD-GBP	1.3	(0.0)	-0.4	-0.0	-0.1	-2.3	6.4	09-Oct-24
	YEN-USD	149.3	0.6	0.4	0.1	-4.5	4.0	-0.3	09-Oct-24
	CNY-USD	7.1	0.1	1.0	-0.3	0.5	0.9	3.0	09-Oct-24
	THB-USD	33.5	0.2	0.7	0.0	0.4	3.4	9.2	09-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	0.1	2.5	-0.21	10.4	10.4	-19.2	09-Oct-24
(Government)	US: 5-Year Bond	3.9	0.1	3.0	-0.18	10.1	10.1	-15.3	09-Oct-24
	US: 10-Year Bond	4.1	0.1	2.7	-0.10	7.7	7.7	-12.6	09-Oct-24
	US: 30-Year Bond	4.3	0.1	2.1	-0.04	5.4	5.4	-10.2	09-Oct-24
	THAILAND: 2-Year Bond	2.2	0.0	1.7	0.61				09-Oct-24
	THAILAND: 5-Year Bond	2.3	0.1	2.3	0.84				09-Oct-24
	THAILAND: 10-Year Bond	2.6	0.0	1.4	-0.04				09-Oct-24
	THAILAND: 30-Year Bond	3.3	0.0	0.7	-0.39				09-Oct-24
Other	Bloomberg Commodity Index	99.4	(2.7)	-2.6	-0.7	5.5	-0.9	-4.2	09-Oct-24
	Crude Oil - WTI (spot month)	73.2	(1.1)	-1.5	0.2	11.7	7.4	-14.6	09-Oct-24
	Crude Oil - Brent	76.6	(1.5)	-1.9	0.3	11.0	6.7	-12.4	09-Oct-24
	Coal Newcatle (USD/Ton)	147.0	(2.6)	-1.7	-2.5	4.8	0.3	-5.3	09-Oct-24
	Baltic Dry Index	1,860.0	(81.0)	-4.2	-2.5	-4.2	-10.7	-6.2	08-Oct-24
	Rubber (TOCOM) Yen/Kg.	417.0	(9.2)	-2.2	0.3	15.7	-0.2	79.4	09-Oct-24
	Sugar Futures (USD / lb.)	22.0	(1.0)	-4.2	-2.0	15.3	-1.9	-8.3	09-Oct-24
	Copper (LME) USD/Ton	9,529.8	(266.6)	-2.7	-0.7	6.2	-1.7	18.5	09-Oct-24
	China Hot Rolled Steel	3,663.0	349.0	10.5	-2.6	21.1	-0.3	-4.7	09-Oct-24
	GOLD (spot)	2,607.8	(45.8)	-1.7	-0.0	3.6	-1.0	40.1	09-Oct-24
	Soybean Meal Futures	322.5	(8.0)	-2.4	-0.3	1.5	-6.3	-13.0	09-Oct-24
	Crude Palm Oil	4,343.0	(57.0)	-1.3	-2.3	6.6	5.3	19.9	09-Oct-24
	Corn	421.0	(3.8)	-0.9	0.0	10.9	-0.9	-13.3	09-Oct-24
	Bitcoin	60,393.3	(2027.0)	-3.2	0.2	5.1	-5.3	120.7	09-Oct-24
	Ethereum	2,354.5	(74.5)	-3.1	0.8	-0.2	-9.9	52.1	09-Oct-24
	ARKW Investments	85.3	1.0	1.2	0.2	11.9	0.2	55.9	09-Oct-24
	Global x Auto & Electric ETF	23.3	0.0	0.1	0.6	10.0	-0.7	1.7	09-Oct-24

SET Impact Gain	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
GULF	+3.0875	61.75↓	+3.25	5.56	589198	3586153
DELTA	+3.0300	110.50↑	+3.00	2.79	209062	2295426
INTUCH	+0.9100	102.00↓	+3.50	3.55	161599	1626592
TRUE	+0.5560	11.20↑	+0.20	1.82	516447	572155
ADVANC	+0.4800	270.00↓	+2.00	0.75	45047	1210508
BDMS	+0.3200	30.00	+0.25	0.84	540037	1616268
CPALL	+0.1800	65.50↓	+0.25	0.38	227220	1495664
TTB	+0.1570	1.89	+0.02	1.07	2054921	386855
BH	+0.1200	270.00↓	+2.00	0.75	27298	741086
BA	+0.1190	24.50↓	+0.70	2.94	82510	202570
GPSC	+0.1150	46.50	+0.50	1.09	84765	395660
KTB	+0.1130	21.00↓	+0.10	0.48	467650	980774
COCOCO	+0.1080	12.40↑	+0.90	7.83	455035	552634
AWC	+0.1032	3.72	+0.04	1.09	309035	114866
TLI	+0.0920	11.30↑	+0.10	0.89	282861	318353
CPN	+0.0900	67.25↓	+0.25	0.37	60639	408925
BGRIM	+0.0840	23.30↓	+0.40	1.75	242171	567041
CKP	+0.0660	3.80↑	+0.10	2.70	113162	42879
3BBIF	+0.0640	6.35	+0.10	1.60	36647	23120
COM7	+0.0475	25.75	+0.25	0.98	204094	525321
EA	+0.0450	8.90	+0.15	1.71	693728	615367
RATCH	+0.0450	32.50	+0.25	0.78	22836	74353
VIBHA	+0.0436	2.02↑	+0.04	2.02	61399	12233
AAV	+0.0416	2.64↓	+0.04	1.54	1143719	305741
JAS	+0.0414	2.64↑	+0.06	2.33	641649	168351
EGCO	+0.0400	121.00↓	+1.00	0.83	5757	69808
CHG	+0.0356	2.78↑	+0.04	1.46	245514	67695
BCT	+0.0350	73.00	+1.75	2.46	59	423
SAV	+0.0300	23.50	+0.60	2.62	21554	50186
TFMAMA	+0.0300	205.00	+1.00	0.49	21	428

mai Impact Gain	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
MASTER	+0.3750	46.25↑	+1.25	2.78	28108	127681
AIRA	+0.3120	1.49↓	+0.05	3.47	10	1
MEB	+0.1500	30.75↑	+0.50	1.65	1791	5407
BBIK	+0.1500	40.75↑	+0.75	1.88	3896	15763
PROEN	+0.1170	3.94↑	+0.30	8.24	213381	82066
TATG	+0.1040	1.80	+0.26	16.88	2318030	392099
LTS	+0.1000	11.40	+0.50	4.59	12970	14710
ADB	+0.0864	0.97	+0.12	14.12	78421	7743
ARIN	+0.0767	1.42↓	+0.13	10.08	364698	50772
MORE	+0.0709	0.07	+0.01	16.67	6797	41
KGEN	+0.0652	1.82	+0.04	2.25	75780	13748
TQR	+0.0575	6.95	+0.25	3.73	119	81
KLINIQ	+0.0550	34.50↑	+0.25	0.73	4535	15603
HEALTH	+0.0494	1.35↑	+0.13	10.66	371	50
KCC	+0.0488	3.10↑	+0.08	2.65	29109	9099
CHOW	+0.0474	2.62↑	+0.06	2.34	6607	1721
SENX	+0.0415	0.44	+0.01	2.33	2171	94
TMC	+0.0405	1.35	+0.09	7.14	125187	17751
EFORL	+0.0395	0.14	+0.01	7.69	4881	62
STOWER	+0.0365	0.09↑	+0.01	12.50	4288	34
TRP	+0.0350	9.45↑	+0.10	1.07	4646	4374
TIGER	+0.0315	0.83↑	+0.07	9.21	52349	4598
APP	+0.0308	1.87↑	+0.11	6.25	83128	16148
SEI	+0.0306	5.10↑	+0.18	3.66	54486	27371
EURO	+0.0300	5.50	+0.10	1.85	409	223
TPLAS	+0.0297	1.64↓	+0.11	7.19	8011	1325
BVG	+0.0264	3.24	+0.06	1.89	3413	1113
KOOL	+0.0244	0.41	+0.01	2.50	31559	1293
TRT	+0.0240	3.74↑	+0.08	2.19	2209	817
SELIC	+0.0240	3.24	+0.04	1.25	5181	1670

SET Impact Loss	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
PTTEP	-0.6400	133.00	-2.00	-1.48	135713	1803730
SCGP	-0.6125	28.25↓	-1.75	-5.83	200916	579859
AOT	-0.5750	63.75↓	-0.50	-0.78	92311	590591
PTT	-0.5750	33.50↓	-0.25	-0.74	154386	520232
GLOBAL	-0.2100	16.40↓	-0.50	-2.96	105577	173433
CPF	-0.2040	24.70↓	-0.30	-1.20	278691	693049
OR	-0.1940	16.70	-0.20	-1.18	45036	75439
WHA	-0.1800	5.65↓	-0.15	-2.59	1727521	980392
CBG	-0.1800	79.00↓	-2.25	-2.77	48147	384080
BANPU	-0.1620	6.75	-0.20	-2.88	1187316	805881
BJC	-0.1600	25.25↓	-0.50	-1.94	27562	69987
ITC	-0.1440	23.90↓	-0.60	-2.45	179038	426580
TOP	-0.1350	50.50↓	-0.75	-1.46	62474	316310
CRC	-0.1225	33.50	-0.25	-0.74	87440	293097
MINT	-0.1150	28.75	-0.25	-0.86	121274	347639
SCC	-0.1000	242.00↓	-1.00	-0.41	13802	335737
LH	-0.0960	6.00	-0.10	-1.64	456659	276078
IVL	-0.0900	24.00↓	-0.20	-0.83	190545	461756
PTTGC	-0.0900	28.75	-0.25	-0.86	146348	419412
BTG	-0.0800	23.10	-0.50	-2.12	32815	75794
BBL	-0.0750	155.00	-0.50	-0.32	41481	644348
OSP	-0.0720	22.40	-0.30	-1.32	119005	267496
BAM	-0.0650	9.20↓	-0.25	-2.65	94618	87714
BPCG	-0.0600	6.90↓	-0.25	-3.50	59869	42110
BSRC	-0.0560	8.05↓	-0.20	-2.42	12766	10309
BCP	-0.0550	36.75↑	-0.50	-1.34	86995	319351
APEX	-0.0522	0.01	-0.03	-75.00	93208	93
SKY	-0.0480	23.60	-0.80	-3.28	16897	40170
SPALI	-0.0480	20.10	-0.30	-1.47	41848	84661
TOA	-0.0480	19.10	-0.30	-1.55	15811	30184

mai Impact Loss	Impact	Trade	Change	%Chg	Volume	Value
BTC	-0.1067	0.51↓	-0.01	-1.92	99103	5057
ALPHAX	-0.0918	0.67	-0.01	-1.47	16445	1093
JPARK	-0.0800	7.15	-0.20	-2.72	81902	58968
MGI	-0.0630	14.30↓	-0.30	-2.05	7445	10727
TRV	-0.0576	2.24↓	-0.24	-9.68	6	1
BE8	-0.0520	20.00↓	-0.20	-0.99	9805	19734
SICT	-0.0470	5.45	-0.10	-1.80	14606	8111
XO	-0.0420	23.70↓	-0.10	-0.42	7910	18825
BOL	-0.0405	6.05	-0.05	-0.82	6002	3613
FSMART	-0.0370	5.90	-0.05	-0.84	2931	1752
CEYE	-0.0348	3.46↓	-0.12	-3.35	392	136
PSTC	-0.0342	0.55	-0.01	-1.79	86724	4777
24CS	-0.0336	4.20↓	-0.08	-1.87	27396	11590
SPVI	-0.0320	2.82↓	-0.08	-2.76	5345	1530
AF	-0.0316	0.70↓	-0.02	-2.78	144	10
SALEE	-0.0300	0.49↓	-0.02	-3.92	5264	260
NTSC	-0.0300	11.00↓	-0.30	-2.65	579	641
AUCT	-0.0270	9.30↓	-0.05	-0.53	1738	1624
LEO	-0.0256	4.00	-0.08	-1.96	3736	1497
TACC	-0.0240	4.84	-0.04	-0.82	25594	12453
WARRIX	-0.0236	3.52↓	-0.04	-1.12	8787	3111
UBA	-0.0177	1.00↓	-0.03	-2.91	4431	450
TVDH	-0.0173	0.19↓	-0.01	-5.00	178409	3556
TNDT	-0.0171	0.25	-0.01	-3.85	843	21
JUBILE	-0.0170	13.60↓	-0.10	-0.73	140	191
NAT	-0.0160	5.45	-0.05	-0.91	10554	5813
TNP	-0.0158	3.62↑	-0.02	-0.55	9906	3575
HL	-0.0135	8.10	-0.05	-0.61	447	363
CHIC	-0.0134	0.53↓	-0.01	-1.85	316	17
SGF	-0.0129	0.30↓	-0.01	-3.23	4054	125



SET	1456.97	+4.17	+0.29 %	Vol	Proj.	1456.96	4.16	0.29 %	16:45			
GAP:	SET Index											
B.Vol	Bid	Ask	O.Vol	Avg.	31.85	%Buy	52.99	%Sell	47.01			
				Open	1454.78	Volume	15482623U	%B-S	5.98			
				High	1460.33	Vol5D	14226803	Value	49313886			
				Low	1453.33	Mktcap	18022440	%Mcap	100.00			
				Prev	1452.80	BVPS	N/A	P/BV	1.37			
				%Swing	0.48	EPS	N/A	P/E	18.10			
%B_Vol	%	%	%O_Vol	Impact	+4.170	DPS	N/A	Yield(%)	3.11			
SET	1456.97	+4.17	+0.29 %	49313.89 MB	Gain	216	Lose	270	Unch	177	P/E	18.10

Date	Country	Event	Period	Surv(M)	Prior
7-Oct	TH	CPI YoY	Sep	0.7%	0.4%
	EC	Retail Sales YoY	Aug	1.1%	-0.1%
9-Oct	US	FOMC Meeting Minutes	Sep-18	--	--
10-Oct	US	CPI MoM	Sep	0.1%	0.2%
	US	CPI Ex Food and Energy MoM	Sep	0.2%	0.3%
	US	CPI YoY	Sep	2.3%	2.5%
	US	CPI Ex Food and Energy YoY	Sep	3.2%	3.2%
	US	Initial Jobless Claims	Oct-05	--	225k
11-Oct	US	PPI Final Demand YoY	Sep	1.7%	1.7%
	US	PPI Ex Food and Energy YoY	Sep	2.7%	2.4%
	US	U. of Mich. Sentiment	Oct P	69.81	70.10
	CH	FDI YTD YoY CNY	Sep	--	-31.5%
13-Oct	CH	PPI YoY	Sep	-2.5%	-1.8%
	CH	CPI YoY	Sep	0.6%	0.6%
14-Oct	CH	Exports YoY	Sep	--	8.7%
15-Oct	US	Empire Manufacturing	Oct	--	11.5
	CH	1-Yr Medium-Term Lending Facility Rate	Oct-25	--	2.0%
16-Oct	TH	BoT Benchmark Interest Rate	Oct-16	2.5%	2.5%
17-Oct	JN	Exports YoY	Sep	--	5.6%
	EC	CPI YoY	Sep F	--	2.2%
	EC	ECB Policy Rate Meeting	Oct-17		
	US	Retail Sales Advance MoM	Sep	0.37%	0.10%
	US	Initial Jobless Claims	Oct-12	--	--
18-Oct	CH	New Home Prices MoM	Sep	--	-0.73%
	CH	GDP YoY	3Q	--	4.70%
	CH	Retail Sales YoY	Sep	--	2.1%
	US	Housing Starts MoM	Sep	-0.3%	9.6%
	US	Building Permits MoM	Sep	-0.7%	4.9%

คาดดัชนีฯ มีแนวโน้มไปต่อ จับตาสถานการณ์ตะวันออกกลาง ที่อาจออกมาดี

10 Oct 24

- ตลาดหุ้นไทย ยังมีแรงไปต่อจากการ rotate หุ้ไปมา ขณะที่ GULF's family นำการขึ้นมาอย่างต่อเนื่อง สถานการณ์ตะวันออกกลาง เข้าจุดสำคัญ แต่เริ่มมีการพูดเรื่องการเจรจาหยุดยิง หากเกิดขึ้นได้จะเป็นบวกต่อตลาด วันนี้ เรายังมองว่า ดัชนีฯ จะเดินหน้าเข้าใกล้ 1470 จุด
- สถานการณ์ตะวันออกกลาง มีความเป็นไปได้สูงที่อิสราเอลจะโจมตีอิหร่าน แต่ข่าววันนี้ ตัวแทนของอิหร่านและอิสราเอล น่าจะมีการคุยกันโดยมีประเทศซาอุดี เป็นคนกลาง รวมทั้งผู้นำอิสราเอลและสหรัฐฯ มีการหารือกันด้วย ซึ่งนับเป็นสัญญาณที่ดี หากจบปัญหาลงได้ จะดีต่อตลาด
- เงินบาทกลับมาแข็งค่าอีกครั้ง วานนี้(9) เงินบาทปิดไปที่ 33.43 แข็งค่าขึ้น 0.10 บาท แม้ Dollar Index จะยับขึ้น เรายังมองเป็นสัญญาณบวกของตลาดหุ้น ว่าอาจมีเม็ดเงินใหม่ๆ กำลังไหลเข้าตลาดไทย
- จีน นักลงทุนยังขายทำกำไรเป็นวันที่สองหลังกลับมาเปิดทำการ เนื่องจาก ผิดหวังต่อมาตรการเศรษฐกิจ เรายังมองว่าตลาดหุ้นจีน จะเป็นแค่พักตัวเพราะขึ้นมาเร็ว ส่วนมาตรการเศรษฐกิจ ที่จะออกมา **คาดทางการจีน อาจรอดูสถานการณ์ตะวันออกกลาง หรือไม่ก็รอผลเลือกตั้งประธานาธิบดีสหรัฐฯ ก่อนที่จะออกมามาตรการชุดใหญ่ ก็เป็นไปได้**



คาดดัชนีฯ มีแนวโน้มไปต่อ จับตาสถานการณ์ตะวันออกกลาง ที่อาจออกมาดี

10 Oct 24

- รพท. รายงานหนี้ครัวเรือน Q2/67 ลดลง 3.5 หมื่นล้านบาทจากระดับ 90.9% เหลือ 89.6% ของ GDP (ลดลง 0.22%) หมวดที่ปรับเพิ่มขึ้นได้แก่ ครัวเรือนจำนำ ธุรกิจบริหารสินทรัพย์สถาบันการเงิน สหกรณ์ออมทรัพย์ และบริษัทประกัน
- ดัชนีความเชื่อมั่นท่องเที่ยวไทย Q3/67 ต่ำกว่า Q2/67 ปัจจัยจากช่วงโลว์ซีซั่น-กำลังซื้อลด-น้ำท่วม คาดดัชนีความเชื่อมั่น Q4/67 จะสูงกว่าปีก่อนรับานิสงส์ไฮซีซั่น ตั้งเป้าปี 68 นทท.แตะ 40 ล้านคน... เราคาดหลังฟื้นวิกฤตน้ำท่วมรัฐบาลจะทยอยออกมาตรการท่องเที่ยวกระตุ้นใช้จ่ายช่วงไฮซีซั่นมาออก เพื่อบรรลุเป้า GDP 2.7% ตามที่คลังคาดการณ์
- ส.อ.ท. กังวลสินค้านำเข้าจากจีนกระทบอุตสาหกรรมในไทย ปี 66 กระทบไป 22 อุตสาหกรรม และคาดปี 67 จะกระทบถึง 30 อุตสาหกรรม หากยังไม่มีมาตรการที่ชัดเจน โดยกระทบต่อมูลค่ามากจะเป็นอุตสาหกรรมเหล็ก เม็ดพลาสติก ปิโตรเคมี เครื่องจักร เป็นส่วนใหญ่ ส่วนน้อยจะเป็นพวกงอแงใช้ เสื้อผ้า ราคาถูก ซึ่งกระทบ SMEs มาก
- ก.ล.ต.เพิ่มโทษปรับสำหรับบล. เป็น 4 ระดับตามความรุนแรง จาก 3,000-30,000 บาทถึง 10 ล้านบาท และกรณี Naked Short Selling จะถูกปรับ 3 เท่าของกำไรที่ได้รับ แต่ไม่ต่ำกว่า 1 ล้านบาท
- Event สำคัญวันนี้ : ตัวเลขเงินเฟ้อผู้บริโภคของสหรัฐฯ(คาด 2.3% yoy; เดือนก่อน 2.5%)





9-Oct-24

FTSE Fixed Income Country Classification – September 2024 Semi-Annual Review Results Announcement

08 October 2024

The results of the September 2024 FTSE Fixed Income Country Classification Semi-Annual Review have been published and are available via the following link: [FTSE Fixed Income Country Classification – September 2024](#)

The FTSE Fixed Income Country Classification Framework assigns a Market Accessibility Level of '0', '1', or '2' to local currency fixed-rate nominal and inflation-linked government bond markets, based on an assessment of the practical level of accessibility for international investors. Market Accessibility Levels are incorporated into the index inclusion rules for the FTSE fixed income nominal and inflation-linked global government bond indices, including the World Government Bond Index (WGBI), FTSE Emerging Markets Government Bond Index (EMGBI), and the FTSE Frontier Emerging Markets Government Bond Index (FRNTEMGBI).

To ensure transparency, government bond markets that are under consideration for the potential reclassification of their Market Accessibility Level are placed on a Watch List. In March and September as part of the FTSE Fixed Income Country Classification process, markets which are on the Watch List for potential reclassification are reviewed, along with the Watch List composition and a formal assessment of market size and credit rating, for the purposes of benchmark inclusion.

Ahead of the publication of the announcement, FTSE Russell consults members of the FTSE regional fixed income advisory committees, the FTSE Russell Policy Advisory Board, and other stakeholders regarding Watch List status and other markets. Feedback received is considered, and any changes to Market Accessibility Levels are approved, at a meeting of the FTSE Russell Index Governance Board.

For further information on the FTSE Fixed Income Country Classification Framework, please click [here](#).

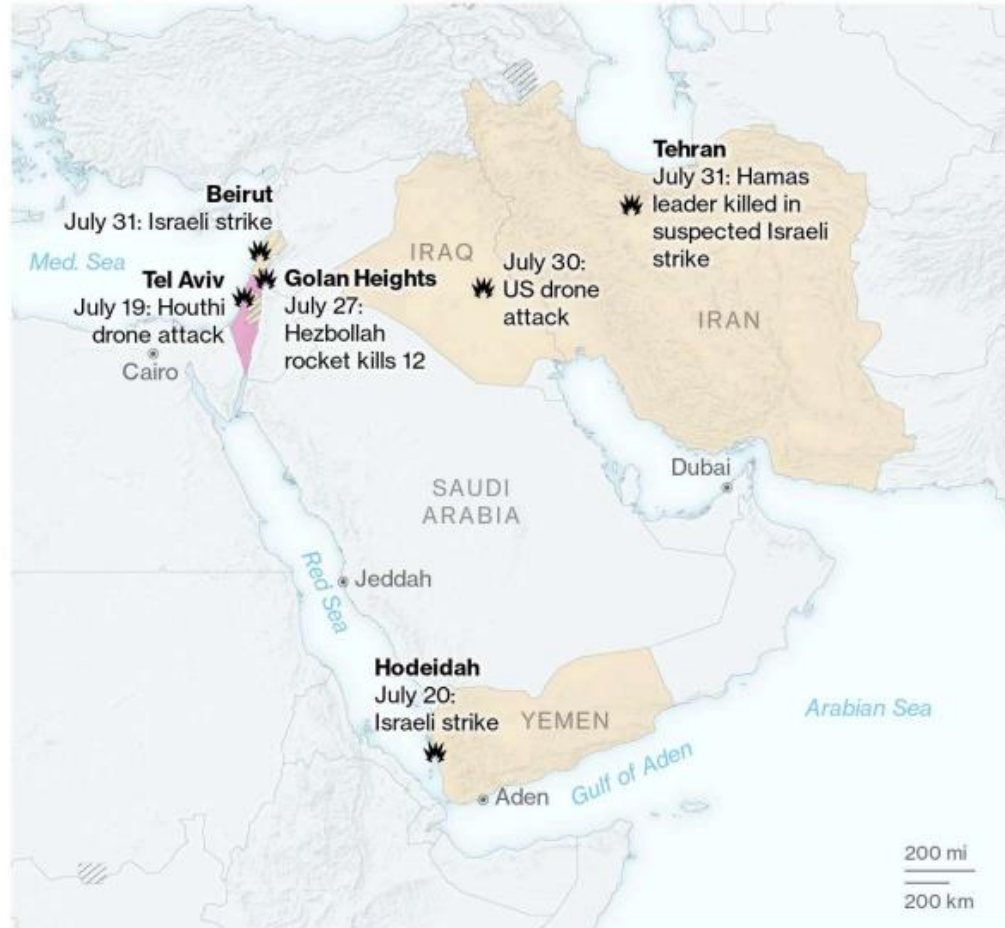
- FTSE RUSSELL ADDS SOUTH KOREA TO WGBI BOND INDEX
- FTSE RUSSELL ADDS INDIA TO EM BOND INDEX
- Fed's Collins Says Rate Cuts Should Be Careful, Data-Based

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>

#สถานการณ์ตะวันออกกลาง

[] 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.

[] Israeli authorities order over 400,000 Gazans to move south, expands military operations in north: UN

[] Israeli defense minister warns an attack on Iran would be 'lethal' and 'surprising'

[] Netanyahu and Biden to Speak as Israel's Iran Response Near



DAOL SEC



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

๑๒๓ สงครามกับการลงทุน

๑ ราคาทองคำสูงขึ้น
ดีต่อคนเล่นทอง , ลบต่อร้านทอง , ตัวเลขส่งออกทองของไทยเพิ่มขึ้น

ตลาดหุ้น , Fund Flow , ลบต่อการเดินทางระหว่างประเทศ
ความเสี่ยงในการลงทุน

เงินบาทอ่อน, ราคาสินค้านำเข้าสูงขึ้น , Fund Flow, ตลาดหุ้น

๒ ดอลลาร์แข็งค่า

ดีต่อหุ้นผู้ผลิตน้ำมัน , ลบต่อปิโตรเคมี + ปิมน้ำมัน + สายการบิน

๒ ราคาน้ำมัน+ supply Shortage



๑ เศรษฐกิจโลก

ตลาดหุ้น , Fund Flow

๑ รายได้ส่งออก

หุ้นส่งออก , เดิมเรือ , Logistics

๓ ต้นทุนการผลิตสูงขึ้น

หุ้นนำเข้า , ส่งออก(ราคาสินค้าแพงขึ้น) , ราคาน้ำมันในประเทศสูงขึ้น , ต้นทุนโลหะสูงขึ้น

ภาวะเงินเฟ้อ

๒ Fed ลดดอกเบี้ยช้าลง

ตลาดหุ้น , Fund Flow

๓ Foreign Outflow

จับ

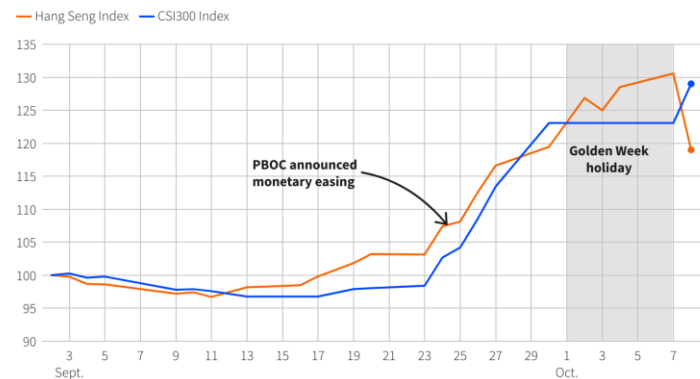
จีน นักลงทุนยังขายทำกำไรเป็นวันที่สองหลัง
กลับมาเปิดทำการ เนื่องจาก ผิดหวังต่อ
มาตรการเศรษฐกิจ เราคาดว่าตลาดหุ้นจีน
จะเป็นแค่พักตัวเพราะขึ้นมาเร็ว ส่วนมาตรการ
เศรษฐกิจ ที่จะออกมา คาดทางการจีน อาจรอดู
สถานการณ์ตะวันออกกลาง หรือไม่ก็รอผล
เลือกตั้งประธานาธิบดีสหรัฐฯ ก่อนที่จะออก
มาตรการชุดใหญ่ ก็เป็นไปได้



- เร่งการใช้จ่ายและมีแผนสนับสนุนกลุ่มที่มีรายได้น้อยและบัณฑิตจบใหม่
- มีแผนจะออกพันธบัตรรัฐบาลระยะยาวในปีหน้าเพื่อสนับสนุนโครงการสำคัญ
- นำงบการลงทุนกว่า 1 แสนล้านบาท (1.4 พันล้านดอลลาร์สหรัฐฯ) มาใช้ลงทุนในพื้นที่ยุทธศาสตร์สำคัญในปีนี้แทน ซึ่งเดิมตั้งไว้สำหรับปี 2568
- จะเร่งออกพันธบัตรชุดพิเศษสำหรับรัฐบาลท้องถิ่น เพื่อสนับสนุนเศรษฐกิจในระดับภูมิภาค
- พลิกดินจังหวัดต่างๆ ออกพันธบัตรพิเศษท้องถิ่นใหม่วงเงิน 2.9 แสนล้านบาท 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
- ให้ออกบัตรดอกเบี้ยต่ำจากธนาคารกลางจีน (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) 33.529 High on 10/14/22 38.334 Average 33.214 Low on 12/31/19 29.705 DXY Currency - Last Price (R2) 102.882 High on 09/27/22 114.106 Average 99.320 Low on 01/05/21 89.436

Hi: 114.106 Hi: 38.334

- 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



SET Index – Bond Yield 10 ปี ของไทย – ค่าเงินบาท

SET Index & Yields on Thai 10-year notes

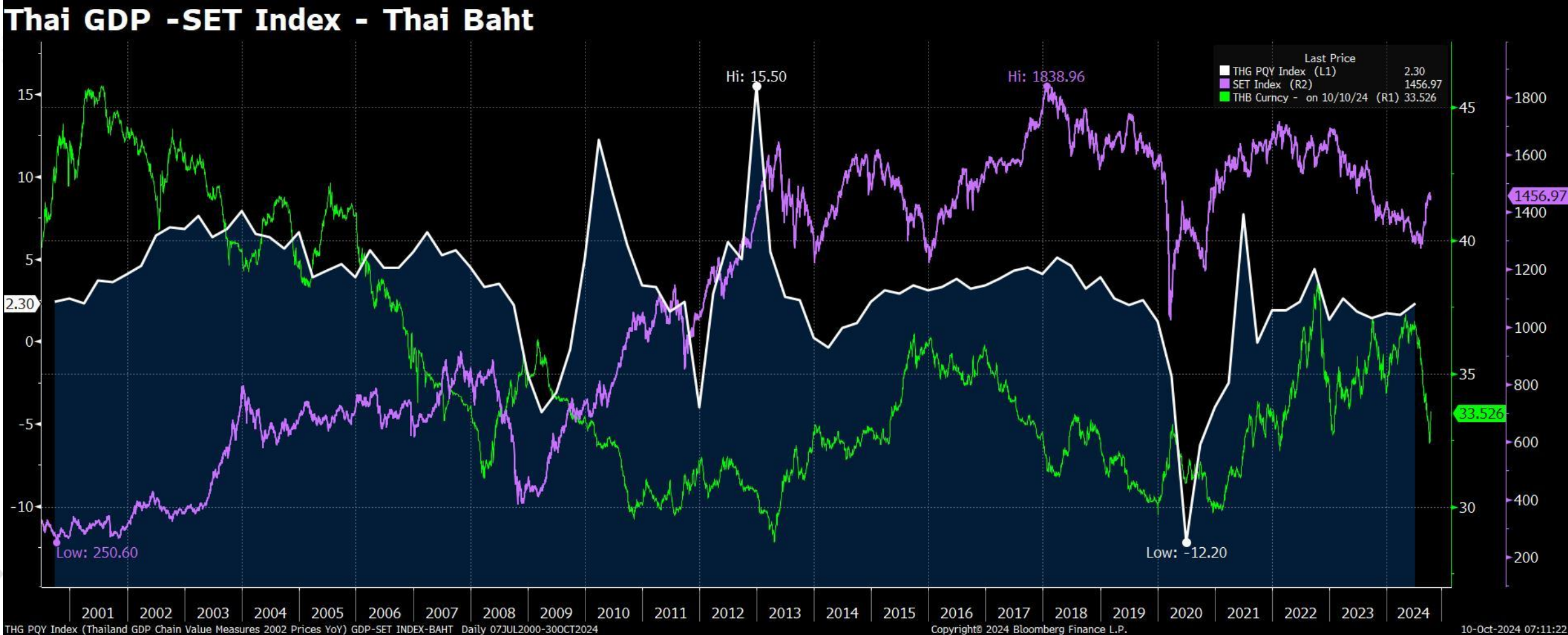


Source: Bloomberg

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

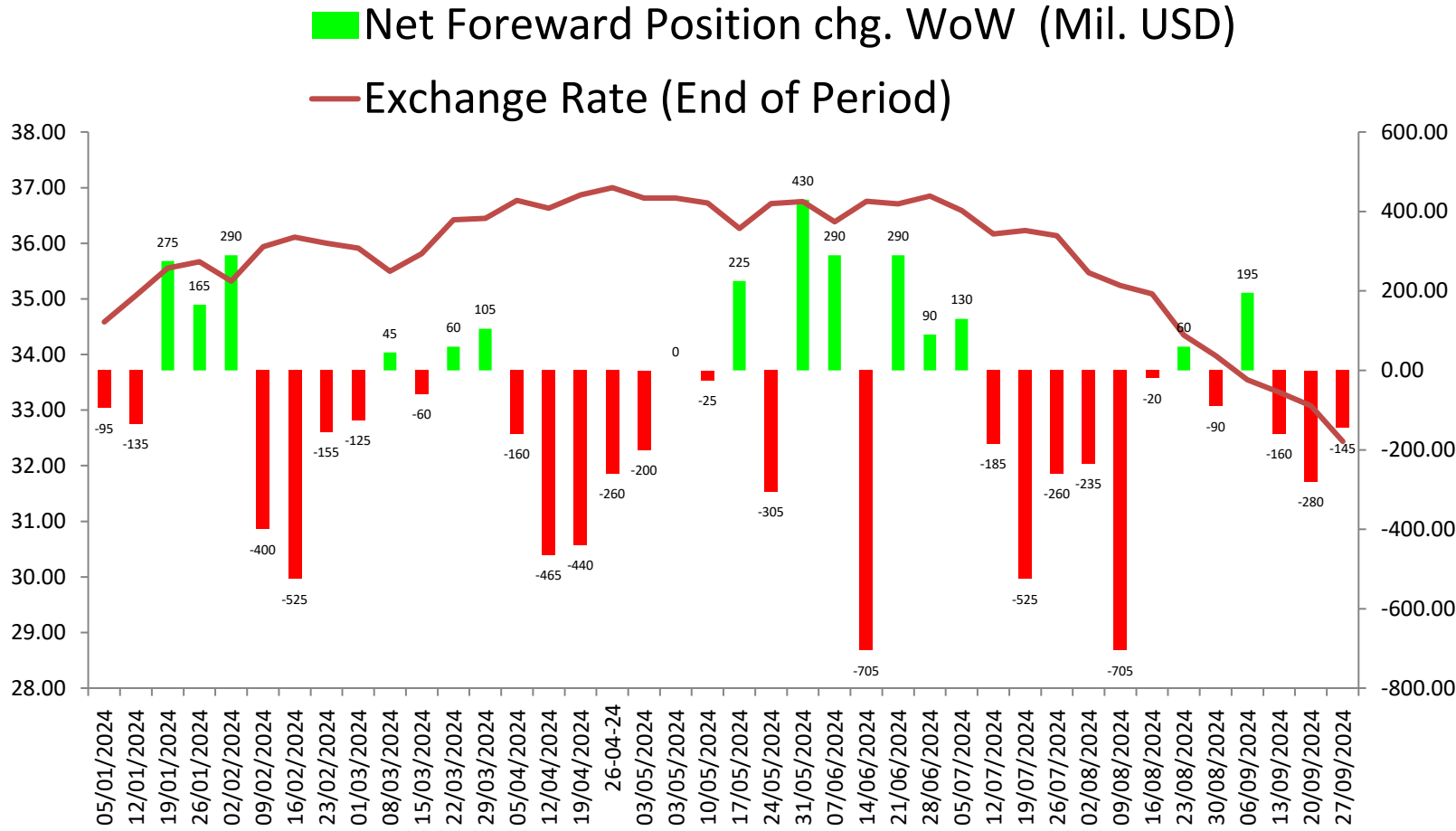
Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

10-Oct-2024 07:11:32



เงินทุนสำรองฯ สูงขึ้นต่อเนื่อง หนุนค่าเงินบาท ให้แข็งค่า





มีการพูดถึงการแทรกแซง
 ค่าเงินบาท ของ สปท. แต่จาก
 รูปด้านบน (แท่งแดง-เขียว) ซึ่ง
 เป็นตัวเลข Forward Position
 ของเงิน USD ที่ สปท. มี ภาวะ
 อยู่ กลับไม่ได้เพิ่มขึ้น แสดงว่า
 สปท. ไม่ได้แทรกแซงผ่าน
 ตลาด Swap หรืออาจซื้อ
 USD ทางการเงิน
 (Outright)..... อาจ
 ต้องดูตัวเลขสลิปค้าหน้าอีกที

ดัชนีค่าเงินบาท (NEER) ยังเพิ่มขึ้นน้อยกว่า ค่าเงินบาท

26-Sep-24

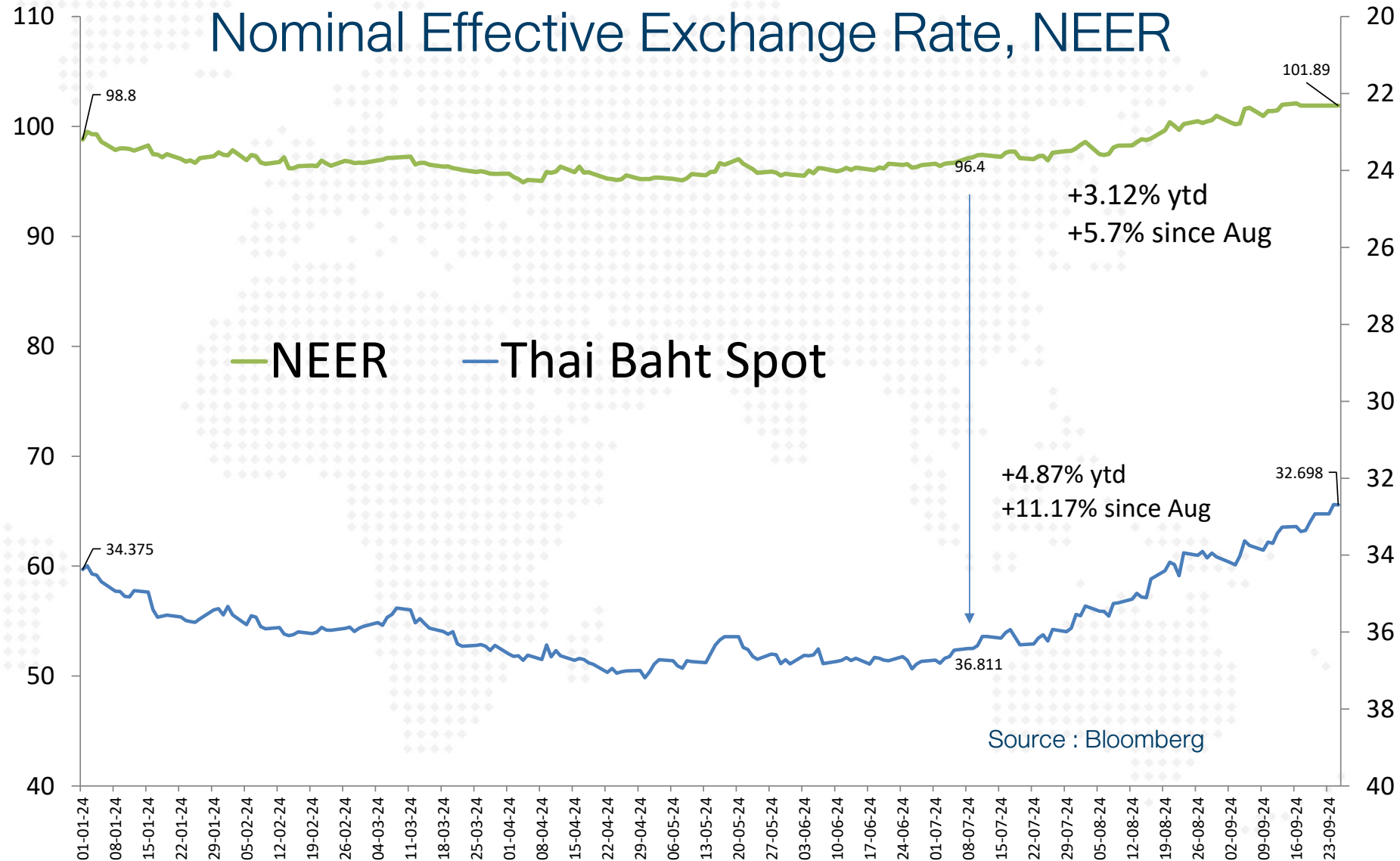
DAOL SEC

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 เงินบาทแข็งค่าขึ้นเทียบกับสกุลเงินของประเทศคู่ค้าและคู่แข่งของไทย สะท้อนว่าไทยเสียเปรียบด้านราคาโดยรวมเมื่อเทียบกับประเทศคู่ค้าและคู่แข่ง
- NEER คำนวณโดยเปรียบเทียบค่าเงินบาทกับค่าเงินของประเทศคู่ค้าและคู่แข่งของไทย 25 สกุลเงิน และนำมาเฉลี่ยแบบถ่วงน้ำหนักตามสัดส่วนการค้าระหว่างกัน
- REER คำนวณจาก NEER ปรับด้วยระดับราคาโดยเปรียบเทียบกับประเทศคู่ค้าและคู่แข่ง สะท้อนอำนาจซื้อที่แท้จริงและความสามารถในการผลิตสินค้าของประเทศ



Source : Bloomberg

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



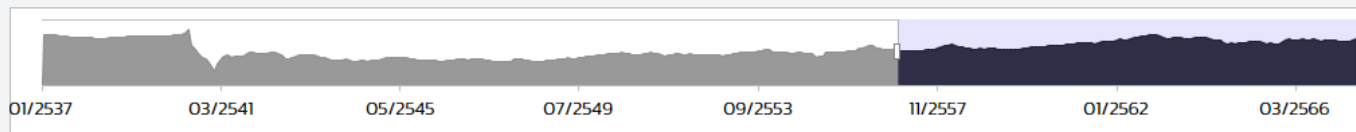
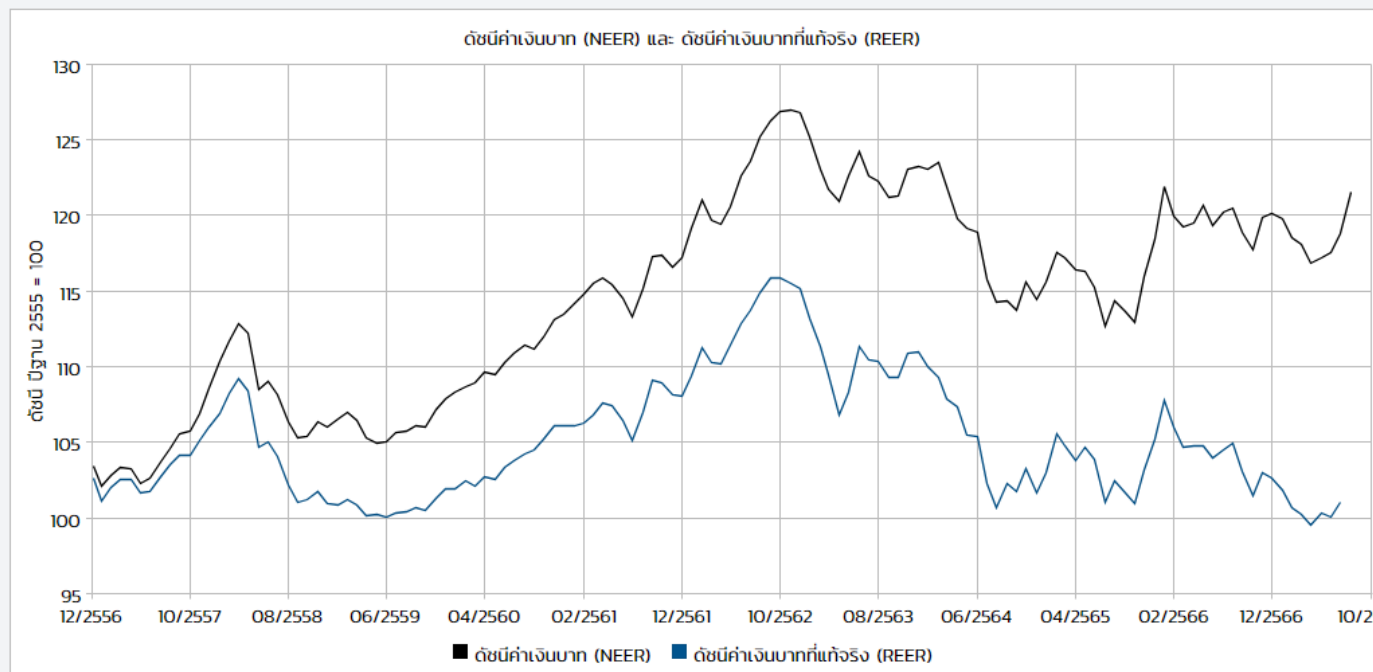
ธนาคารแห่งประเทศไทย
BANK OF THAILAND

หน้าแรก ข้อมูลสถิติ เกี่ยวกับ สปท. ติดต่อเรา ช่วยเหลือ / ร้องเรียน

ข้อมูล : ดัชนีค่าเงินบาท (NEER) และ ดัชนีค่าเงินบาทที่แท้จริง (REER)

ความถี่ ช่วงเวลา -

รูปแบบกราฟ ข้อมูลที่แสดง



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

Real Effective Exchange Rate, REER

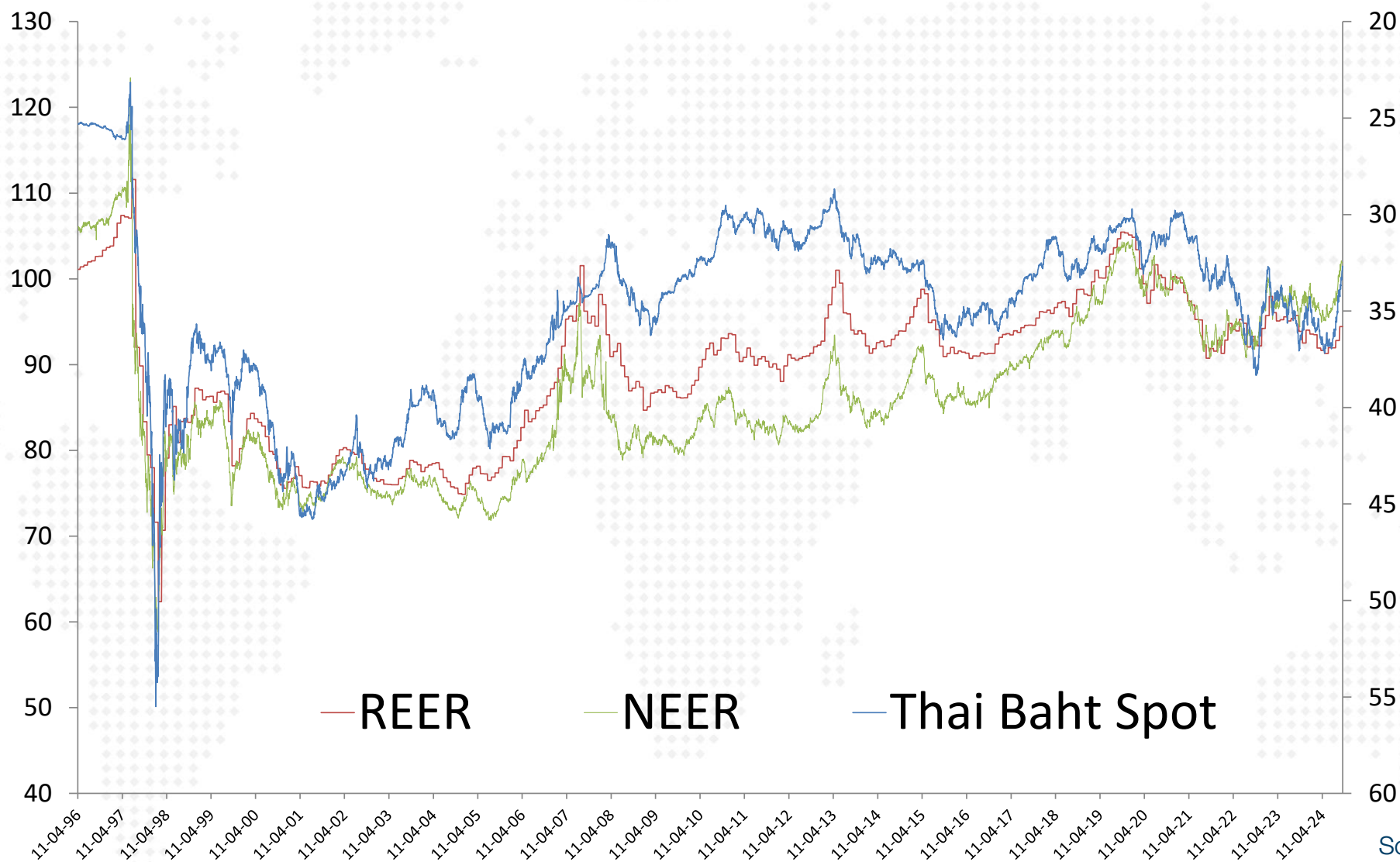
	REER	REER	REER	Index
YTD	3.1%	-2.6%	-2.5%	3.5%
	Thai	Indonesia	Phillipine	Thai

เงินบาทแข็งกว่าเงิน 2 สกุล เอเชีย

NEER & REER เทียบกับค่าเงินบาทในตลาด

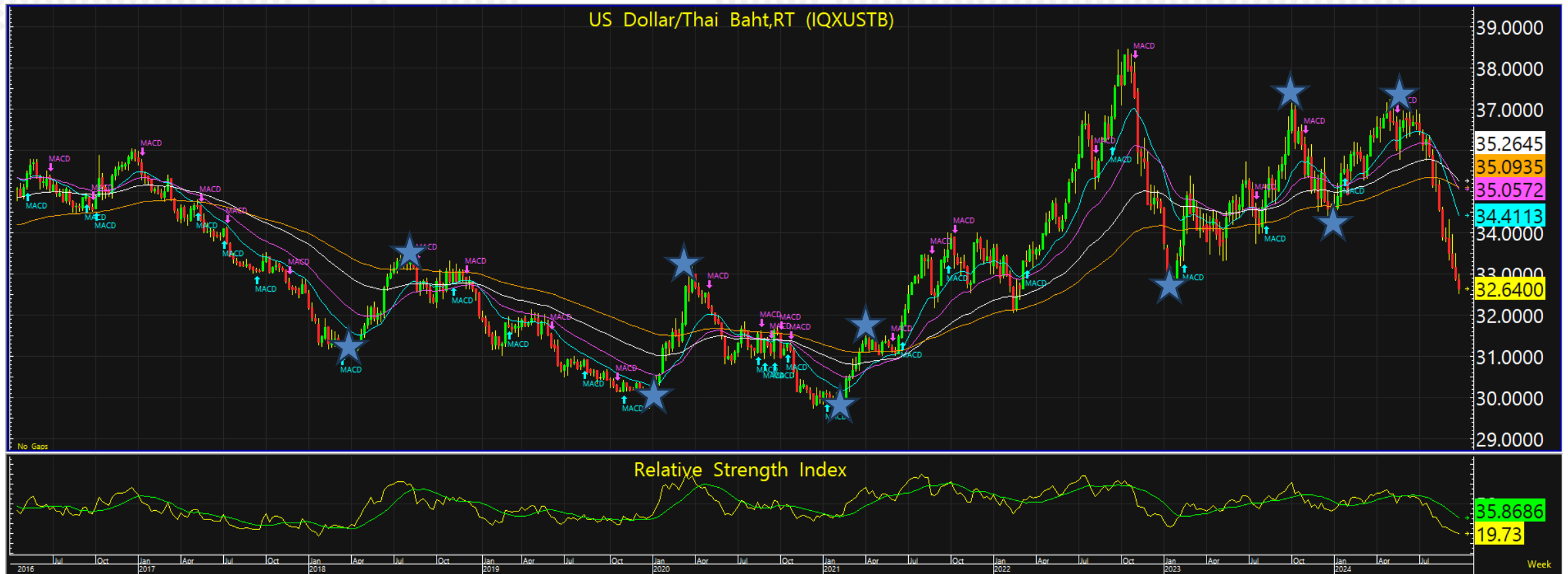
26-Sep-24

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

กำไรในตลาดหุ้น มักจะได้านิสงค์จากเงินบาท ที่แข็งค่า (FX gain กลุ่มน้ำมัน-ปิโตรเคมี-โรงไฟฟ้า) ตามสถิติ เงินบาทแข็ง ทุกๆ 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

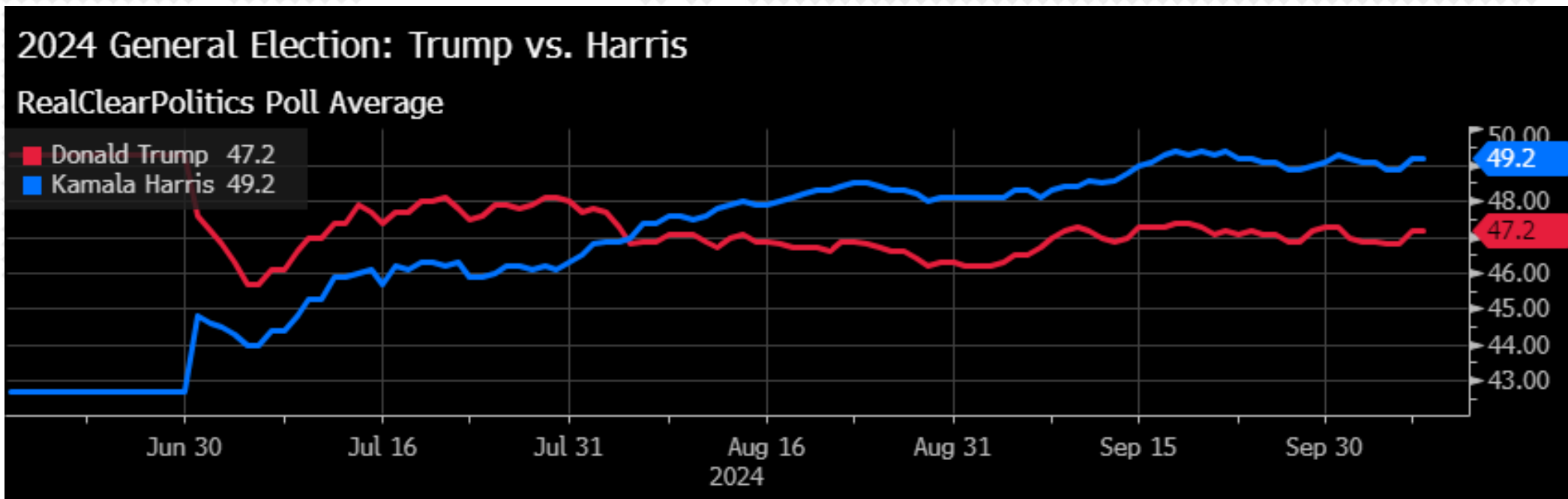
Source: Quotes compiled by Bloomberg

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%	80.3%	19.7%
12/18/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	1.5%	79.1%	19.4%	0.0%
1/29/2025	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	1.1%	59.6%	34.4%	4.9%	0.0%
3/19/2025	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.9%	47.9%	39.4%	10.8%	1.0%	0.0%
5/7/2025	0.0%	0.0%	0.0%	0.5%	26.6%	43.3%	23.7%	5.4%	0.4%	0.0%
6/18/2025	0.0%	0.0%	0.3%	15.7%	36.3%	31.9%	13.1%	2.5%	0.2%	0.0%
7/30/2025	0.0%	0.1%	5.7%	22.9%	34.8%	25.3%	9.4%	1.7%	0.1%	0.0%
9/17/2025	0.0%	2.0%	11.6%	27.0%	31.5%	19.8%	6.7%	1.2%	0.1%	0.0%
10/29/2025	0.5%	4.3%	15.3%	28.1%	28.8%	16.7%	5.4%	0.9%	0.1%	0.0%

โอกาสลด 0.25%





ข้อมูลการขายชอร์ตและข้อมูลการขายชอร์ตที่ยังไม่ได้ซื้อคืน

ข้อมูลการขายชอร์ต
ภาพรวมตลาด (SET และ mai)

วันที่	มูลค่าการขายชอร์ต (ล้านบาท)	% มูลค่าการขายชอร์ตเทียบกับมูลค่าการซื้อขายรวม
09 ต.ค. 2567	1,707.13	3.37%

ข้อมูลการขายชอร์ตที่ยังไม่ได้ซื้อคืน (Outstanding Short Positions) เป็นข้อมูลรายวันที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้รับรายงานจากสมาชิก ซึ่งสมาชิกจะปรับปรุงรายการเมื่อได้รับแจ้งข้อมูลการซื้อคืนหลักทรัพย์จากลูกค้าหรือเมื่อเกิน 60 วันนับจากวันที่ลูกค้าฯ

ข้อมูลรายหลักทรัพย์

ข้อมูลการขายชอร์ต วันที่ 09 ต.ค. 2567

ข้อมูลการขายชอร์ตที่ยังไม่ได้ซื้อคืน ณ วันที่ 09 ต.ค. 2567

หลักทรัพย์	ปริมาณการขายชอร์ต (หุ้น)			มูลค่าการขายชอร์ต (บาท)	% มูลค่าการขายชอร์ตเทียบกับมูลค่าการซื้อขายรวม	ปริมาณการขายชอร์ตที่ยังไม่ได้ซื้อคืน ณ สิ้นวัน (หุ้น)			ปริมาณการขายชอร์ตที่ยังไม่ได้ซื้อคืนของหลักทรัพย์ทั้งหมด/จำนวนหุ้นชำระแล้ว (%)
	Local	NVDR	ทั้งหมด			Local	NVDR	ทั้งหมด	
PTTEP	173,300	734,500	907,800	120,815,850	6.70%	762,600	40,548,600	41,311,200	1.04%
CPALL	342,400	1,258,100	1,600,500	105,513,400	7.05%	1,830,100	40,851,453	42,681,553	0.48%
KBANK	221,100	435,100	656,200	100,209,000	8.71%	1,519,900	14,677,600	16,197,500	0.68%
AOT	422,800	962,000	1,384,800	88,658,750	15.01%	16,460,800	111,228,100	127,688,900	0.89%
GULF	1,313,900	122,600	1,436,500	87,165,825	2.43%	3,883,800	37,394,000	41,277,800	0.35%
SCC	76,400	262,300	338,700	82,642,800	24.60%	2,929,077	10,244,150	13,173,227	1.10%
BBL	158,500	213,100	371,600	57,756,350	8.96%	6,006,600	3,481,000	9,487,600	0.50%
INTUCH	349,900	213,100	563,000	56,758,600	3.49%	1,189,500	12,161,800	13,351,300	0.42%
TOP	641,200	467,800	1,109,000	56,281,750	17.79%	4,464,000	48,300,307	52,764,307	2.36%
PTTGC	220,600	1,562,800	1,783,400	51,071,075	11.91%	8,885,900	49,783,200	58,669,100	1.30%
BDMS	1,217,200	452,900	1,670,100	50,077,925	3.10%	3,792,900	63,410,900	67,203,800	0.42%
CPN	123,400	588,900	712,300	48,201,250	11.73%	1,174,300	18,244,647	19,418,947	0.43%
CRC	437,100	733,300	1,170,400	39,359,500	13.43%	3,616,000	48,412,826	52,028,826	0.86%
ADVANC	134,700		134,700	36,232,400	2.98%	1,083,200	2,424,000	3,507,200	0.12%
DELTA	87,100	199,800	286,900	31,531,050	1.37%	5,351,000	38,315,666	43,666,666	0.35%
HMPRO	1,174,100	1,545,900	2,720,000	28,838,300	13.56%	20,356,100	135,453,900	155,810,000	1.18%
SCB	90,400	164,700	255,100	28,203,500	5.73%	5,795,900	11,637,300	17,433,200	0.52%
MINT	264,700	676,500	941,200	27,059,500	7.77%	7,154,600	72,563,932	79,718,532	1.41%
SCGP	407,500	521,200	928,700	27,000,325	4.66%	3,427,727	49,484,257	52,911,984	1.23%
WHA	3,755,900	779,800	4,535,700	25,814,120	2.63%	84,579,600	46,396,500	130,976,100	0.88%

วิเคราะห์การเมือง

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 กิตติพงษ์ อรุณพัฒน์พงศ์, นายพงษ์ศรัณย์ อัครชัยโสภณ, นายศุภกร คงสมจิตต์, นายฉัตริน จันทรหอม, 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

ลันพายุหมุนศก.ลูกแรก 3ล้านคนประเดิมรับเงิน มท.เ้มสกัตเจ้าหน้กวง
 คีอ้เตอนแก๊งคอสหลอก สปท.แจงจับตาคูค้บาค
 พร้อมโอนเงินหมื่นกลุ่มเปราะบาง-พิการ วันที่ 2 อิก 4.5 ล้านคน หลัง
 วันแรก 3.17 ล้านคนได้รับเรียบร้อย ย้าแบงกห้ามหักใช้หน้เดิม นายกขช้
 อัคฉิด 1.45 แสนล้านเข้าระบบ สร้งพายุหมุนทาง เศรษฐกิจลูกใหญ่ ลัน
 เดินหน้าเฟส 2-3 ดิจิทัลวอลเล็ต ส.ส.ปช.น.แเน'อั้งค้'จับเ้าคุดแบงกชาติ
 แก้บาคแจ็ง-เลิกโจมตี สปท.

โอนเงินสด 10,000 บาท
กลุ่มเปราะบางเข้าบัญชีพร้อมเพย์ วันไหน?

2567

- 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

ระดับที่ 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



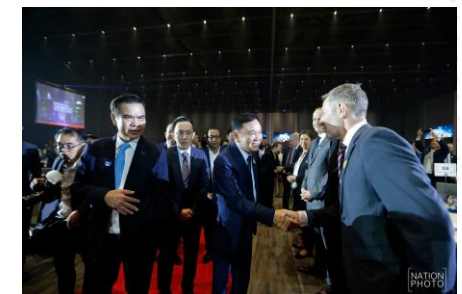
NATION GROUP
Dinner Talk
VISION FOR THAILAND
22 Thursday August 2024
17:30-21:00
@Paragon Hall, Floor 5, Siam Paragon
เต็มทุกที่นั่ง

“
ผมเนี่ยโดนเยอะที่สุด
เห็นพรรค เห็นสวรสค
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
ไม่ได้เรียงเงินล้าน
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 ประกอบรถพวงมาลัยขงวามาผลิตในไทย	
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 หมดสัญญาตกเป็นของรัฐ	
12	เอาธุรกิจใต้ดิน มาไว้บนดิน	
13	Off Shore Financial HUB	
14	โครงการ Land Bridge	

กองทุนวายุภักดิ์

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



<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.) “พีชีย” รองนายกฯ และรมว.คลัง เคาะระชังเปิดเทรดหน่วยลงทุนของกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง “ชวินดา” ผู้บริหาร บลจ.กรุงไทย (KTAM) ลั่น! เดินหน้าป็นผลตอบแทนให้นักลงทุนตามกรอบเป้าหมาย 3-9% ย้ำกองทุนฯ เน้นชีพพอร์ตนักลงทุนได้อย่างดีในช่วงตลาดขาลง ส่งชั้กช่วงดัชนีวูบเป็นจังหวะดีเข้าเก็บหุ้นคุณภาพ เพย 4 วันแรกเดือน ต.ค. นักลงทุนสถาบันลยซื้อหุ้นกว่า 1.4 หมื่นล้านบาท

ผู้สื่อข่าวรายงานว่า วันนี้ (7 ต.ค. 2567) กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง หน่วยลงทุนประเภท ก. (VAYU 1) จะเปิดการชื้อขายหน่วยลงทุนวันแรกในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลท.) เวลา 09.00-10.20 น. ณ หอประชุมศุภกรีย์ แก้วเจริญ ชั้น 3 ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย โดยมีนายพีชีย ชุนหวชิร 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 รุ่งสิริวัฒนภักดี กรรมการผู้จัดการ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน เอ็มเอฟซี จำกัด (มหาชน) หรือ MFC ในฐานะบริษัทจัดการกองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง

นางชวินดา หาญรัตนกุล กรรมการผู้จัดการ บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงไทย จำกัด (มหาชน) หรือ KTAM เปิดเพยกับ “ข่าวหุ้นธุรกิจ” ว่า กองทุนรวมวายุภักษ์ หนึ่ง (VAYU 1) เริ่มชื้อขายบนกระดานตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (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 (ชนิดผู้ถือหน่วยลงทุนประเภท ก.) (VAYUA)

มูลค่าหน่วยลงทุน ณ
09/10/2567

10.0073
หน่วย : ตามสกุลเงินของกองทุน

ข้อมูลทั่วไป

เอกสารเผยแพร่

NAV ย้อนหลัง

เปรียบเทียบกองทุน

Export File Excel 

วันที่ (วัน/เดือน/ปี)	มูลค่าทรัพย์สินสุทธิของกองทุน	NAV
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
- วันนี้จะซื้อต่ออีกมัย

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
บัญชีปล.	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. TRUE 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

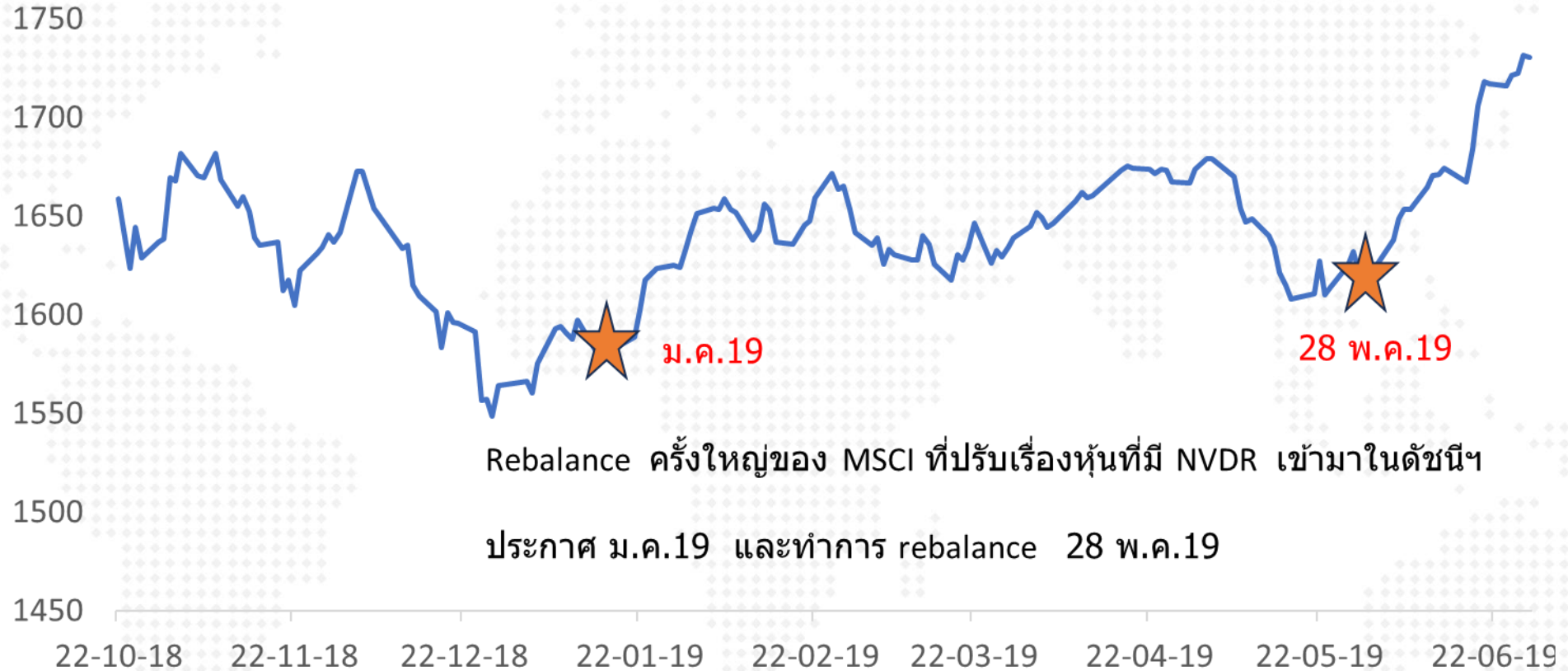
- **ซื้อ:** เสนอขายเพียงครั้งเดียว จากนั้นผู้ลงทุนสามารถซื้อขายหน่วยลงทุนได้ทุกวันทำการ
- **ขาย:** สามารถขายคืนได้ทุกวันทำการตลท. ตลอดระยะเวลา 10 ปี หากกองทุนจะระดมทุนหรือไม่ระดมทุนต่อ จะมีการแจ้งให้ผู้ถือหน่วยลงทุนทราบล่วงหน้า

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

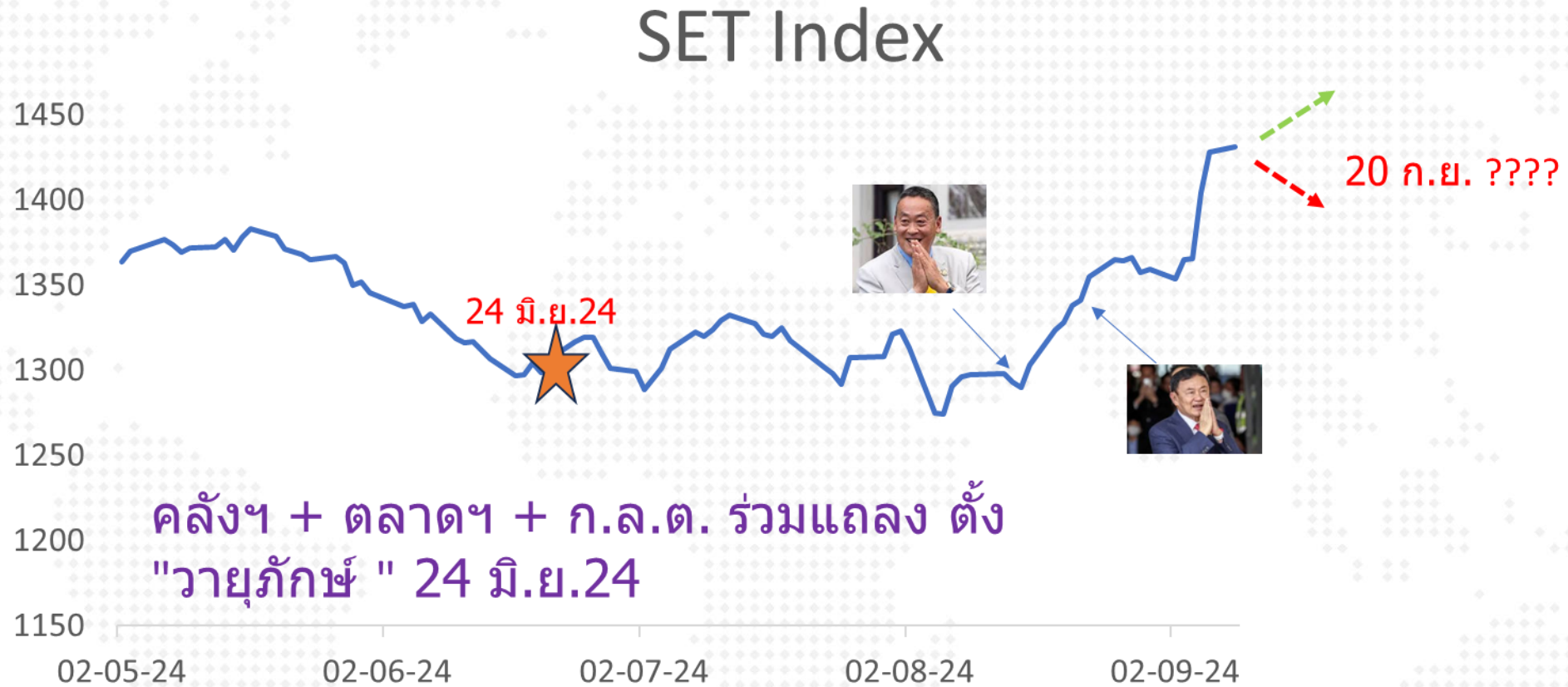
หมายเหตุ: (1) ค่าธรรมเนียม เช่น ค่าธรรมเนียมตามที่นายหน้าซื้อขายหลักทรัพย์กำหนด เป็นต้น

การไม่ได้รับความคุ้มครอง เงินลงทุนและผลตอบแทน ขั้นต่ำของผู้ถือหน่วยลงทุน ประเภท ก. กรณีที่ซื้อหรือ ขายหน่วยลงทุนในตลาดรอง

SET Index



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



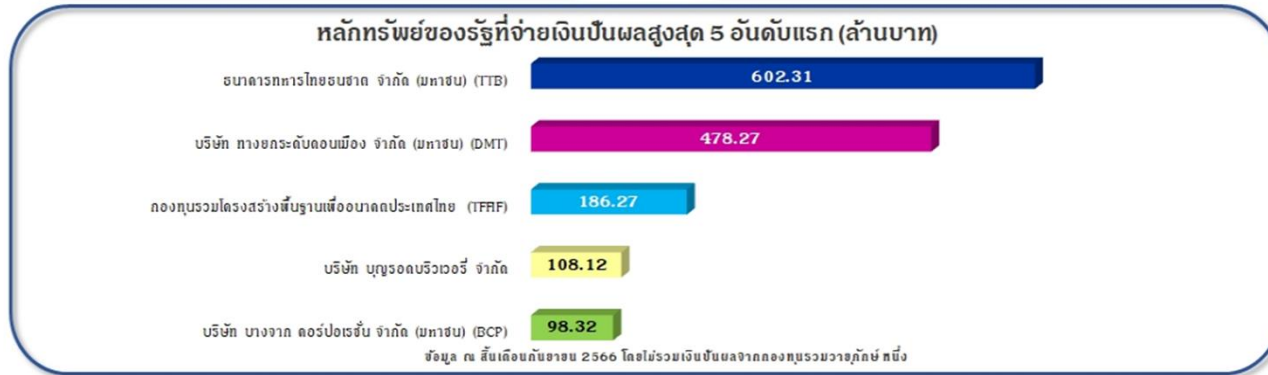
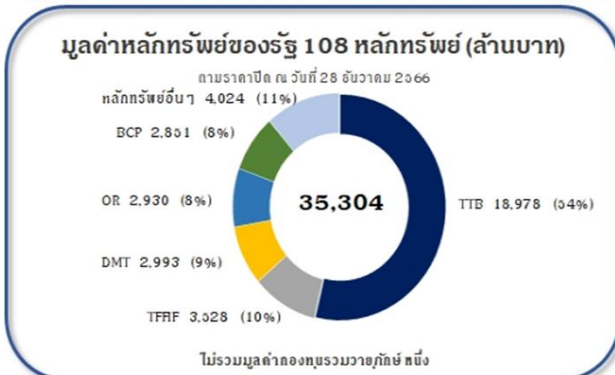
20 อันดับหุ้นกองทุนฯ วายุภักษ์ หนึ่ง

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. ทูร์ 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



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 การตัดสินใจขายหุ้นตัวใดออกไปหรือไม่จะต้องพิจารณาให้ถูกต้องตามหลักกรอบกฎหมายในหลักทรัพย์ที่ถือครองไว้แต่ละแห่ง 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

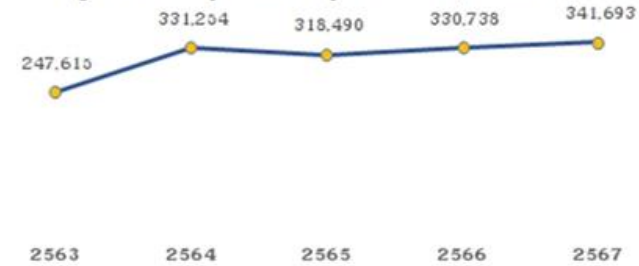
เปลี่ยนแปลงเพิ่มขึ้นร้อยละ 2.92% เมื่อเทียบกับสิ้นเดือนธันวาคม 2565

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

คาดการณ์กำไร 3Q-24 ของ SET

จำนวนบริษัท	3Q-24(f)	2Q-24	3Q-23	YoY	QoQ
111	189,582	201,215	209,748	-9.6%	-5.8%
คาดการณ์ SET	239,089	260,398	285,581	-16.3%	-8.2%

ประเมินกำไร 2Q-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	คาดการณ์วันสงบ
PTT	23,553	35,469	31,297	-24.7%	-33.6%	SET	98,240	90%	13-Nov-24
KBANK	12,005	12,653	11,282	6.4%	-5.1%	SET	46,065	83%	18-Oct-24
BBL	11,424	11,807	11,350	1%	-3.2%	SET	42,855	79%	18-Oct-24
KTB	10,688	11,195	10,282	3.9%	-4.5%	SET	40,493	81%	18-Oct-24
SCB	10,196	10,014	9,663	5.5%	1.8%	SET	41,336	76%	18-Oct-24
ADVANC	8,437	8,577	8,146	3.6%	-1.6%	SET	32,655	78%	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	7,009	144%	13-Nov-24
CPF	6,019	6,925	-1,811	n.m.	-13.1%	SET	14,267	99%	13-Nov-24
DELTA	5,737	6,565	5,429	5.7%	-12.6%	SET	21,661	77%	25-Oct-24
CPALL	5,578	6,239	4,424	26.1%	-10.6%	SET	23,254	78%	08-Nov-24
TTB	5,346	5,356	4,735	12.9%	-0.2%	SET	20,783	77%	18-Oct-24
AOT	4,208	4,563	3,432	22.6%	-7.8%	SET	19,633	74%	20-Nov-24
BDMS	4,204	3,335	3,890	8.1%	26.1%	SET	16,083	72%	12-Nov-24
CPN	4,178	4,556	4,162	0.4%	-8.3%	SET	16,571	78%	13-Nov-24
TOP	3,627	5,547	10,828	-66.5%	-34.6%	SET	15,333	98%	08-Nov-24
GULF	3,423	4,741	3,360	1.9%	-27.8%	SET	18,561	63%	08-Nov-24
MINT	2,579	2,823	2,144	20.3%	-8.7%	SET	8,017	82%	08-Nov-24
OR	2,505	2,536	5,170	-51.6%	-1.3%	SET	11,321	77%	12-Nov-24
IVL	2,242	-22,996	195	1,047.0%	n.m.	SET	5,580	-352%	14-Nov-24
CPAXT	2,098	2,176	1,677	25.1%	-3.6%	SET	10,691	63%	08-Nov-24
BH	2,094	1,932	1,954	7.1%	8.4%	SET	7,864	76%	07-Nov-24
SPALI	1,926	1,599	1,191	61.8%	20.5%	SET	5,850	71%	14-Nov-24
GPSC	1,894	1,429	1,790	5.9%	32.6%	SET	4,876	86%	06-Nov-24
KTC	1,861	1,826	1,857	0.3%	1.9%	SET	7,486	73%	18-Oct-24

คาดการณ์กำไร 3Q-24 ของหุ้นกลุ่มธนาคาร



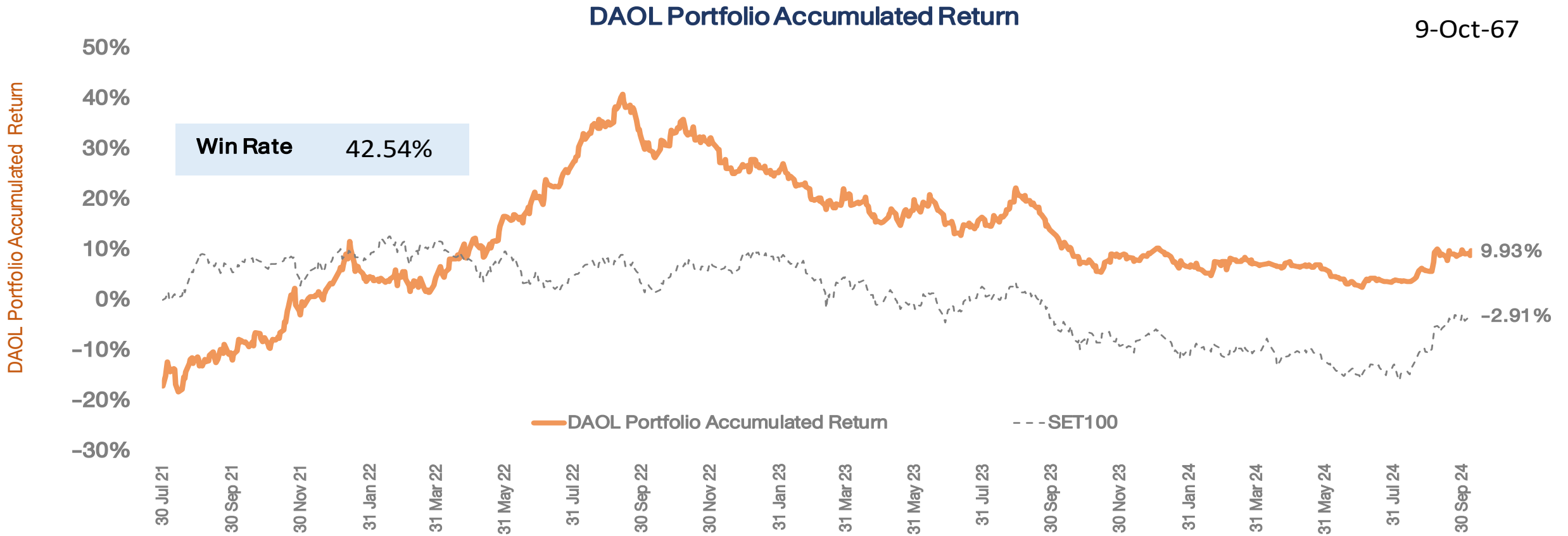
	NET_INCOME Net Income (Quarter)	NET_INCOME Net Income (Quarter)	NET_INCOME Net Income (Quarter)	NET_INCOME Net Income (Quarter)	NET_INCOME Net Income (Quarter)	NET_INCOME Net Income (Quarter)	NET_INCOME Net Income (Quarter)	NET_INCOME Net Income (Quarter)	Lastest Period	BEST_NET_INCOME BEst Net Income			
		4Q-22	1Q-23	2Q-23	3Q-23	4Q-23	1Q-24	2Q-24		3Q-24(f)	คาด	คาด	
									Last Actual	Estimate next Q	Forecast Period	QoQ	YoY
BBL	9,347	7,569	10,129	11,294	11,350	8,863	10,524	11,807	2024:S1	11,402	09/24 Q3	-3%	0%
KBANK	9,929	3,191	10,741	10,994	11,282	9,388	13,486	12,653	2024:S1	11,902	09/24 Q3	-6%	5%
KTB	8,170	8,109	10,067	10,156	10,282	6,111	11,078	11,195	2024:S1	10,631	09/24 Q3	-5%	3%
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	10,214	09/24 Q3	2%	6%
TTB	1,917	3,847	4,295	4,566	4,735	4,867	5,334	5,355	2024:Q2	5,324	09/24 Q3	-1%	12%
TISCO	1,798	1,809	1,793	1,854	1,874	1,780	1,733	1,753	2024:Q2	1,690	09/24 Q3	-4%	-10%
KKP	1,471	1,430	2,085	1,408	1,281	670	1,506	769	2024:Q2	898	09/24 Q3	17%	-30%
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		59,852			
								61,755	:สูตร รวมเฉพาะ				
										59,852	: เฉพาะที่มีคาดการณ์		
										2%	: yoy		
										-3%	: QoQ		

NPL / Provision ไตรมาสล่าสุด (2Q-24)

	Total Loans Reserve for Losses on Loans (Current Quarter)	Total Loans Reserve for Losses on Loans (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

กลยุทธ์ลงทุนโดย DAOL





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

Portfolio Performance

DAOL SEC

9/10/2024 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	61.75	228,513.78	10,176.73	4.66%
SISB	PROF	10%	35.25	3,091	108,952	35.25	108,951.86	-	0.00%
WHA	PROP	10%	5.75	18,948	108,952	5.65	107,057.04	(1,894.81)	-1.74%
SET						1456.97			
Total		40%			436,241		444,523	8,282	
CASH		60%					654,812		
Total Portfolio							1,099,335		9.93%



กลยุทธ์

- ตลาดหุ้นไทย มีแรงซื้อเข้ามาเรื่อยๆ อาจได้อานิสงค์จากการซื้อของกองทุนวายุภักษ์ด้วย หากดัชนีฯ ผ่าน 1470 จุดไปได้ จะยืนยันการปรับฐานจบ
กลยุทธ์ ภาพรวมเป็น “ถือ” ควรพร้อมหรือเลือกซื้อหุ้นที่แข็งแกร่งเหมือนตลาด หรือจะเป็นกลุ่มที่เป็น high dividend yield ก็ได้



Theme ลงทุน

- หากตลาดมีสัญญาณกลับตัว(ขึ้น) ด้วยเหตุผลใดก็ตาม หุ้น 3 ตัว ที่ควรมี **BDMS, SCB , AOT** และ **WHA**



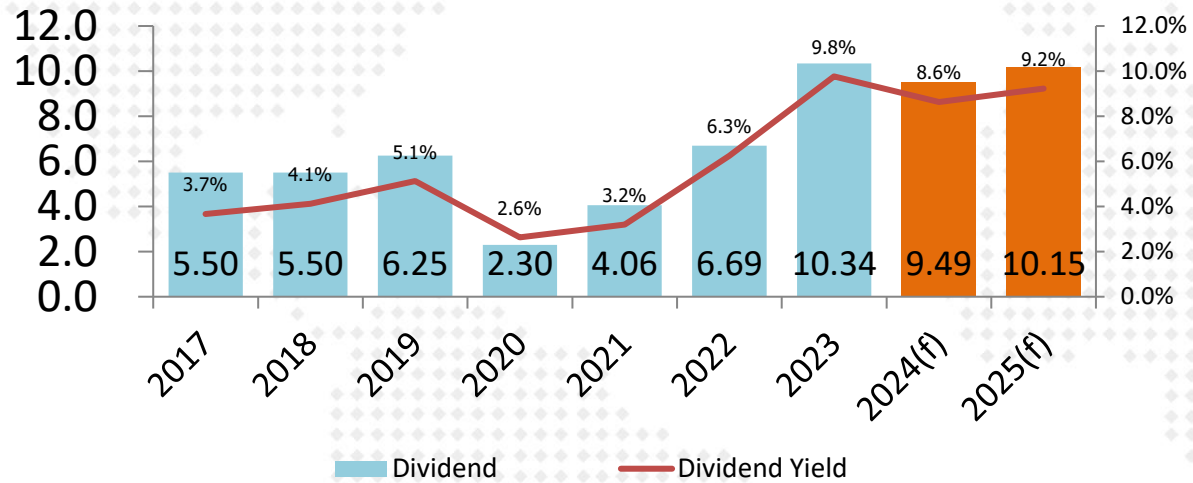
พอร์ตหุ้น DAOL

- พอร์ตหุ้นวันนี้ เรานำ **BDMS, TRUE*, CPALL** เข้ามาใหม่
- หุ้นในพอร์ตประกอบด้วย **BDMS(15%), TRUE*(10%), CPALL(15%), SISB(10%), WHA(10%), GULF(20%)**

source : Bloomberg

Dividend

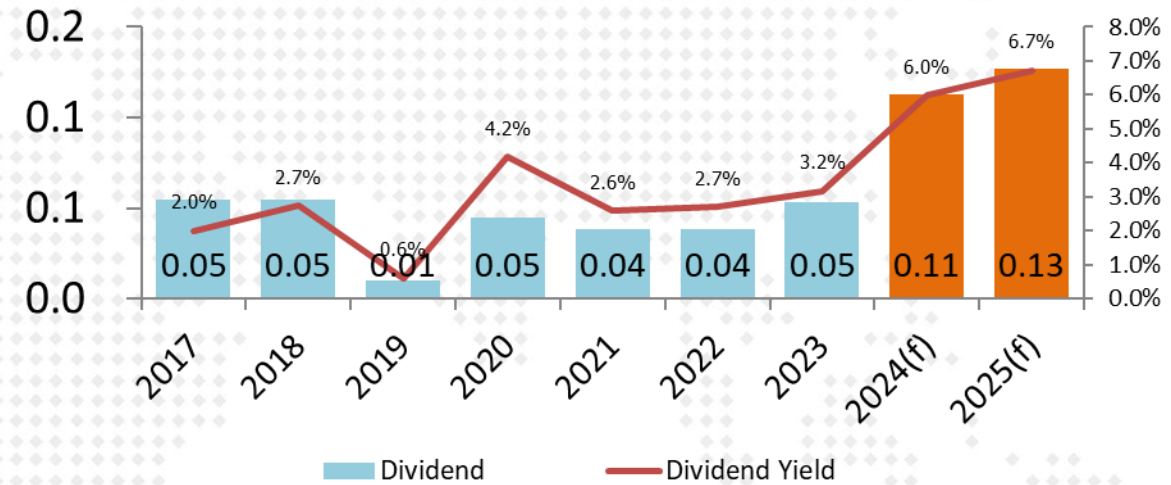
SCB

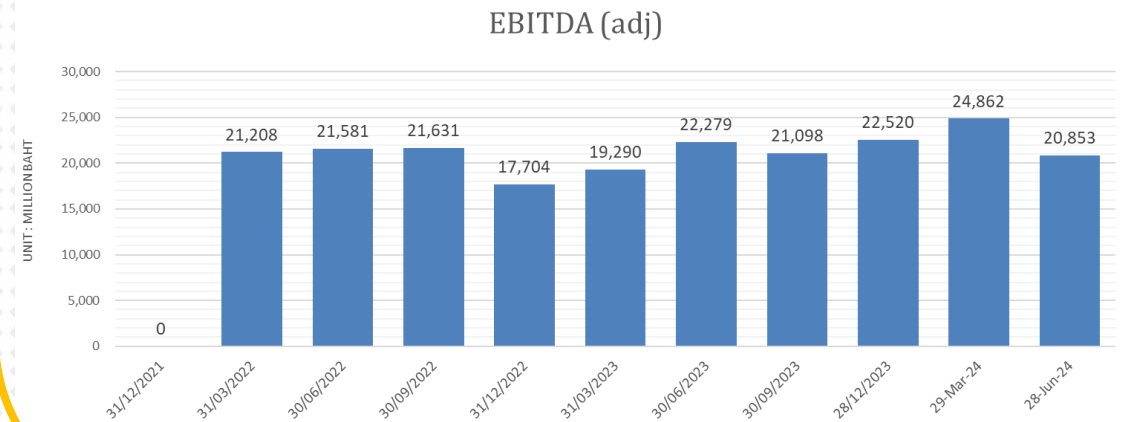
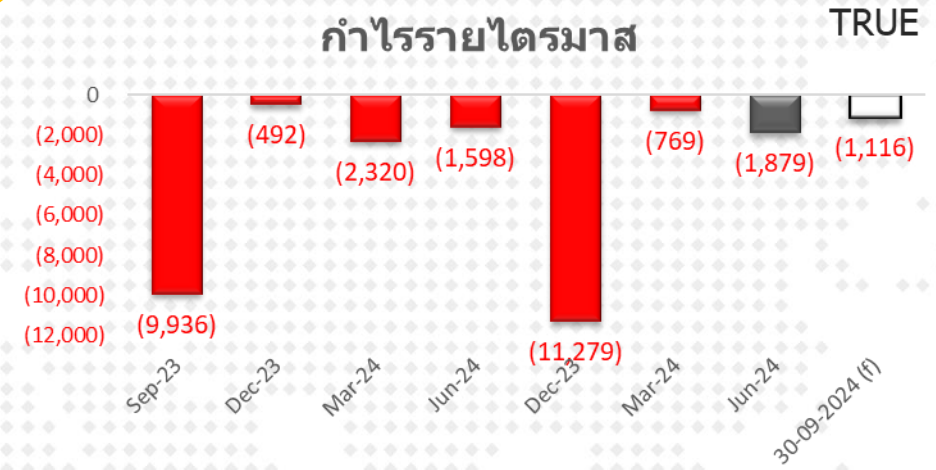
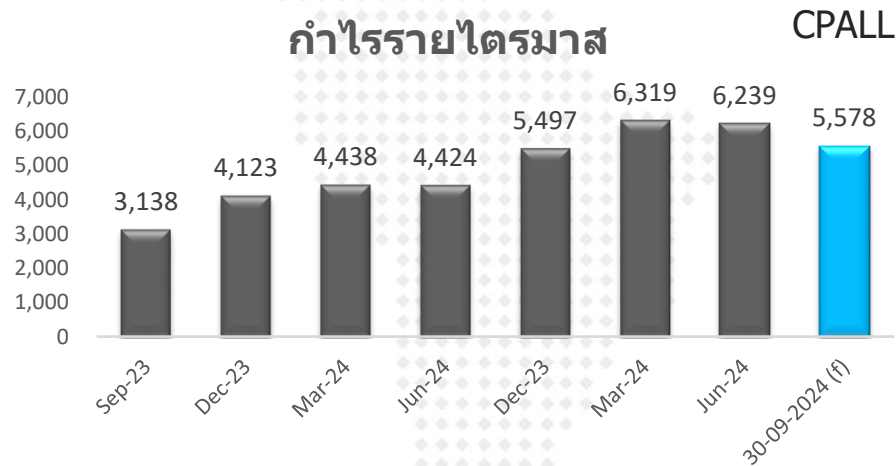


source : Bloomberg

Dividend

TTB







SET : แก่งตัวผันผวน

แนวรับ 1450-1453

แนวต้าน 1460-1464

SET50 Index Futures

S50Z24

BGRIM

ARIN

แนวรับ 23.00-23.30

แนวรับ 1.34-1.39

แนวต้าน 23.60-24.00

แนวต้าน 1.50-1.60

Cut Loss < 22.80

Cut Loss < 1.27

แนวโน้ม : แก่งผันผวนในเชิงบวก

กลยุทธ์

ไม่มีสถานะ: เปิด Long ช่วงย่อ

สถานะ Long : ปิด หากหลุด 917

สถานะ Short : ถือ หากหลุด 917

แนวรับ 920, 917, 914

แนวต้าน 925 928, 932

Analyst: Phannapa Kemasurat (Reg. no. 060110)

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



CASH BALANCE

DAOL SEC

10 October 2024

หลักทรัพย์ที่คาดว่าจะติด Cash Balance ตามเกณฑ์การ
คำนวณโดยใช้ข้อมูลวันที่ 4-9 ต.ค. 67

No.	Stock	PE (เท่า)	มูลค่าการซื้อขาย (บล.)	1-Week Turnover (%)
SET :	-	-	-	-
MAI :	-	-	-	-

หลักทรัพย์ที่ติด Cash Balance

หลักทรัพย์	เริ่มต้น – สิ้นสุด
-	-

เกณฑ์การคำนวณ Cash Balance

1. P/E > 40 เท่า
2. ปริมาณการซื้อขาย SET > 500 บล./สัปดาห์ // MAI > 400 บล./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) มีวัตถุประสงค์เพื่อนำเสนอและเผยแพร่วิเคราะห์ให้เป็นข้อมูลประกอบการตัดสินใจของนักลงทุนทั่วไป โดยจัดทำขึ้นบนพื้นฐานของข้อมูลที่ได้เปิดเผยต่อสาธารณชนอันเชื่อถือได้ และมีได้มีเจตนาเชิญชวนหรือชี้แนะให้ซื้อหรือขายหลักทรัพย์แต่อย่างใด ดังนั้น บริษัทหลักทรัพย์ เคทีบีเอสที จำกัด (มหาชน) จะไม่รับผิดชอบต่อความเสียหายใดๆ ที่เกิดขึ้นจากการใช้วิเคราะห์ฉบับนี้ทั้งทางตรงและทางอ้อม และขอให้นักลงทุนใช้ดุลพินิจพิจารณาอย่างรอบคอบก่อนการตัดสินใจลงทุน

Company Update

- (+) SAV (ซื้อ/เป้า 26.00 บาท) กำไร 3Q24E ยังเติบโต YoY จากเที่ยวบินเพิ่มขึ้น
- (+) SFLEX (ซื้อ/เป้า 4.80 บาท) กำไร 3Q24E จะทำ new high ต่อเนื่อง จากคำสั่งซื้อที่เพิ่มขึ้น
- (+) CPALL (ซื้อ/เป้า 84.00 บาท) 3Q24E โต YoY จากทุกธุรกิจ, ลดลง QoQ ตามปัจจัยฤดูกาล
- (-) SCGP (ซื้อ/ปรับเป้าลงเป็น 33.00 บาท) 3Q24E น่าจะเป็นจุดต่ำสุดของปี; คาดปริมาณขายพื้นที่ใน 4Q24E

Results Announcement

- 15 Oct: TISCO
- 18 Oct: KKP, TTB
- 21 Oct: BBL, KBANK, KTB, SCB



Fund Flow

เม็ดเงินนักลงทุนต่างชาติ
ไหลเข้าตลาดหุ้นใดในฝั่งเอเชีย ...?

เงินทุนสำรองฯ สูงขึ้นต่อเนื่อง หนุนค่าเงินบาท ให้แข็งค่า

Foreign reseve-SET Index



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 153.326



Source: Bloomberg, National Stock Exchanges

EMCFPROX Index (Bloomberg Emerging Markets Capital Flow Proxy Index) EM fund flow Daily 05NOV2018-30SEP2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

10-Oct-2024 07:11:49

Carrey Trade ของตลาด EM สูงขึ้น = ค่าเงิน EM แข็งค่าขึ้น

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

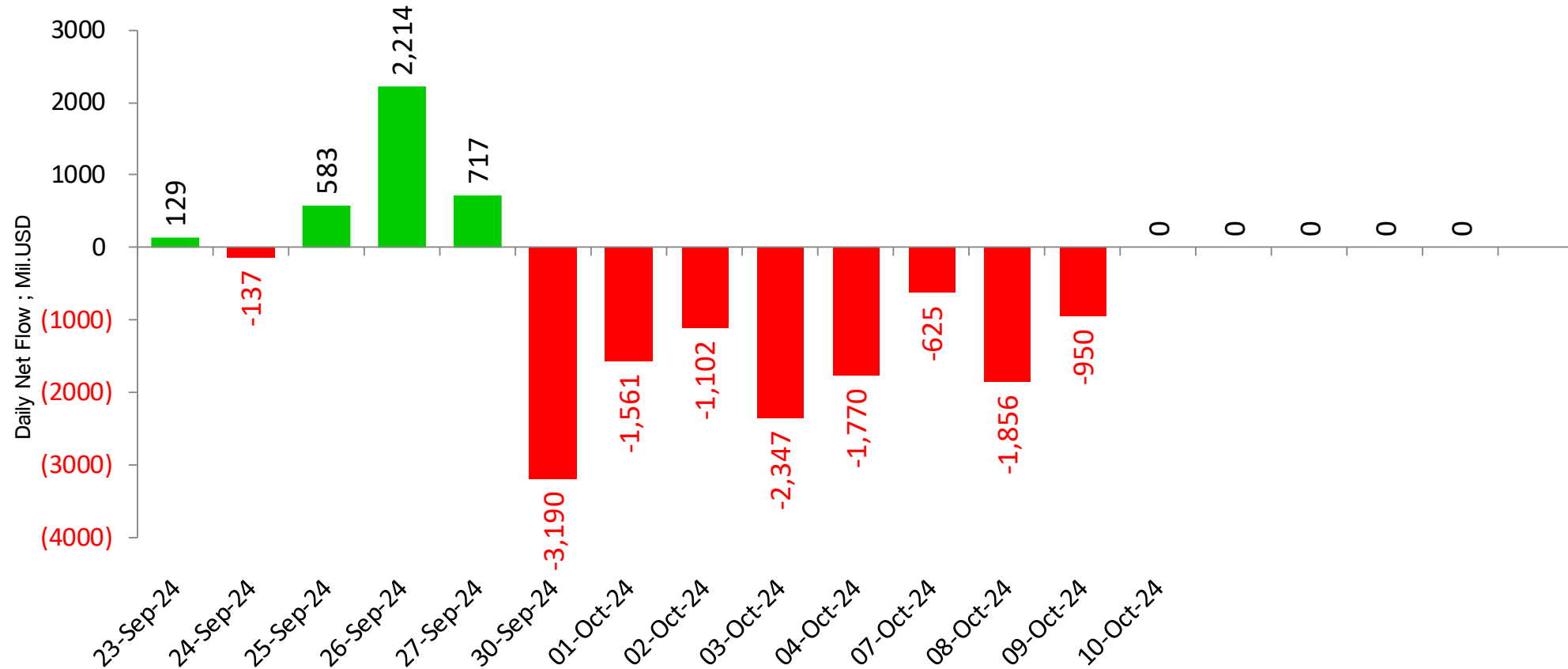


FXCTEM8 Index (Bloomberg Cumulative FX Carry Trade Index for 8 Emerging Market Currencies) EM - Carry Trade Daily 09SEP2019-09OCT2024

Copyright© 2024 Bloomberg Finance L.P.

10-Oct-2024 07:11:58

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

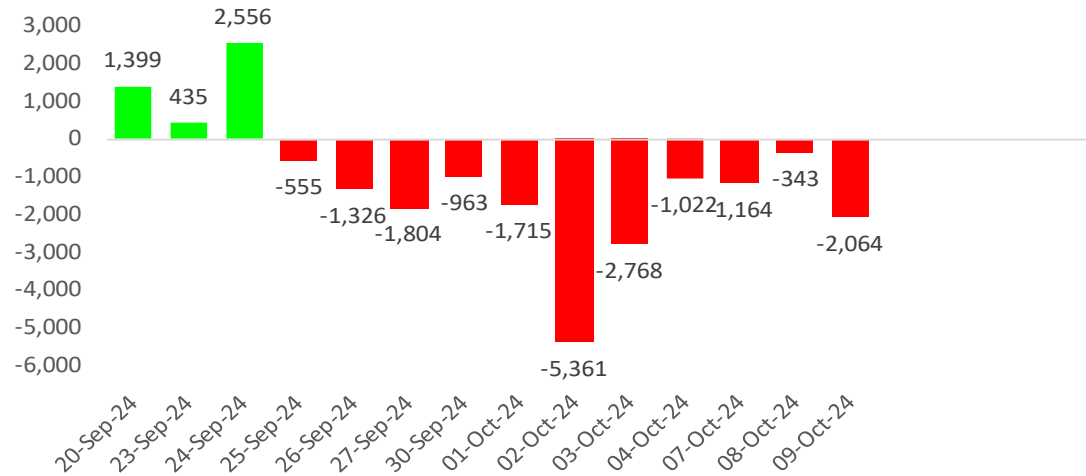
Foreign Net Position in Asia Stock Market

10-Oct-24

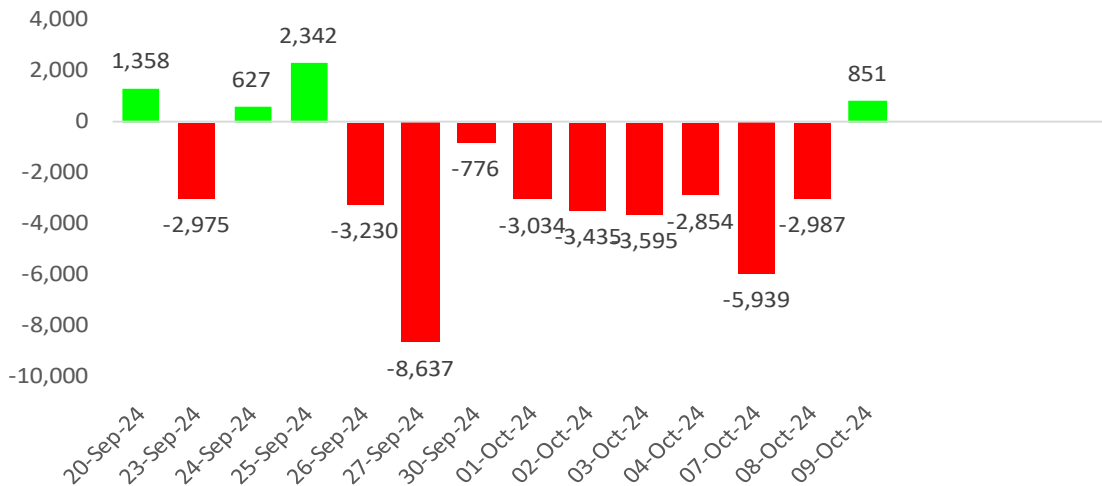
(USD mn)	Last Update	Daily	WTD	MTD	QTD	YTD	12M	YoY Lvl
China	30-Jun-24			-26,000	-14,623	-17,979	-92,253	
India	08-Oct-24	-641	-1,609	-5,226	-5,226	5,808	13,075	-7,159
Indonesia	09-Oct-24	-162	-223	-337	-337	2,912	2,902	4,011
Japan	04-Oct-24		6,182	6,182	-45,037	181	11,952	-19,891
Malaysia	09-Oct-24	16	-8	-209	-209	597	789	1,874
Philippines	08-Oct-24	8	31	65	65	87	56	899
South Korea	08-Oct-24	-348	-268	-424	-424	10,138	14,806	5,917
Sri Lanka	09-Oct-24	1	1	-1	-1	-20	-18	-67
Taiwan	09-Oct-24	195	-361	-1,238	-1,238	-14,579	-5,021	-4,584
Thailand	09-Oct-24	-62	-107	-437	-437	-3,017	-3,884	-845
Vietnam	09-Oct-24	-2	-19	-2	-2	-2,227	-2,728	-3,394

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

10-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	-14,437	16,691	-20,142	-90,565
Nov '24				
Dec '24				
2024	-110,007	20,544	-3,826	-3,405,244

Unit : Million Baht

หุ้นที่มูลค่าการถือครองของนักลงทุนต่างประเทศเพิ่ม/ลด มากที่สุด

09-Oct-24 : (เปรียบเทียบกับวันก่อน)

รวบรวมโดย DAOL Strategy

หุ้นที่มี % การถือสูงขึ้น

หุ้นที่มี % การถือลดลง

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)		เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
PTTEP	0.10%	528	KBANK	-0.06%	-217
ADVANC	0.05%	400	MINT	-0.12%	-195
BDMS	0.04%	190	INTUCH	-0.05%	-161
TOP	0.10%	113	BH	-0.04%	-86
AOT	0.01%	91	TTB	-0.04%	-73
COM7	0.10%	61	CCET	-0.13%	-55
CBG	0.07%	56	WHA	-0.06%	-51
NER	0.38%	36	RCL	-0.24%	-48
CPN	0.01%	30	VIBHA	-0.12%	-32
CHG	0.07%	21	RAM	-0.11%	-30

หมายเหตุ : มูลค่าเงินลงทุนที่เพิ่ม/ลด คำนวณจากจำนวนหุ้นที่เปลี่ยนแปลง โดยใช้ราคาปิดล่าสุด เพื่อเปรียบเทียบ (ไม่ใช่มูลค่าที่ลดลงจริงๆ)

source : Bloomberg , SETSMART , SET

WEEK

หุ้นที่มูลค่าการถือครองของนักลงทุนต่างประเทศเพิ่ม/ลด มากที่สุด

09-Oct-24 : (เปรียบเทียบกับสัปดาห์ก่อน)

รวบรวมโดย DAOL Strategy

หุ้นที่มี % การถือสูงขึ้น

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
PTTEP	0.08%	422
ADVANC	0.05%	400
AOT	0.03%	274
TOP	0.19%	215
CBG	0.15%	120
CPF	0.05%	102
CPAXT	0.03%	98
COM7	0.14%	85
SPALI	0.15%	59
AP	0.15%	47

หุ้นที่มี % การถือลดลง

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
BH	-0.26%	-561
KBANK	-0.15%	-543
INTUCH	-0.16%	-516
KTB	-0.11%	-322
AU	-3.15%	-258
BDMS	-0.05%	-238
HANA	-0.51%	-188
MINT	-0.09%	-146
PTT	-0.01%	-96
TTB	-0.05%	-92

หมายเหตุ : มูลค่าเงินลงทุนที่เพิ่ม/ลด คำนวณจากจำนวนหุ้นที่เปลี่ยนแปลง โดยใช้ราคาปิดล่าสุด เพื่อเปรียบเทียบ (ไม่ใช่มูลค่าที่ลดลงจริงๆ)

source : Bloomberg , SETSMART , SET

MONTH to DATE

หุ้นที่มูลค่าการถือครองของนักลงทุนต่างประเทศเพิ่ม/ลด มากที่สุด

09-Oct-24 : (เปรียบเทียบกับวันสุดท้ายของเดือนก่อน)

รวบรวมโดย DAOL Strategy

หุ้นที่มี % การถือสูงขึ้น

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
ADVANC	0.17%	1,359
TOP	0.35%	396
TLI	0.25%	322
CBG	0.30%	239
SPALI	0.55%	217
PTT	0.02%	192
CPF	0.07%	143
CPAXT	0.04%	131
COM7	0.18%	109
AP	0.28%	88

หุ้นที่มี % การถือลดลง

	เพิ่ม/ลด	มูลค่าเงินลงทุน * เพิ่ม/ลด (ล้านบาท)
SCB	-0.48%	-1,787
KBANK	-0.49%	-1,772
PTTEP	-0.26%	-1,372
SCCC	-2.53%	-1,229
INTUCH	-0.28%	-904
BH	-0.40%	-863
BBL	-0.27%	-801
AOT	-0.08%	-731
KTB	-0.22%	-645
HMPRO	-0.37%	-517

หมายเหตุ : มูลค่าเงินลงทุนที่เพิ่ม/ลด คำนวณจากจำนวนหุ้นที่เปลี่ยนแปลง โดยใช้ราคาปิดล่าสุด เพื่อเปรียบเทียบ (ไม่ใช่มูลค่าที่ลดลงจริงๆ)

source : Bloomberg , SETSMART , SET

Net Change

18 Jan 21 - Present

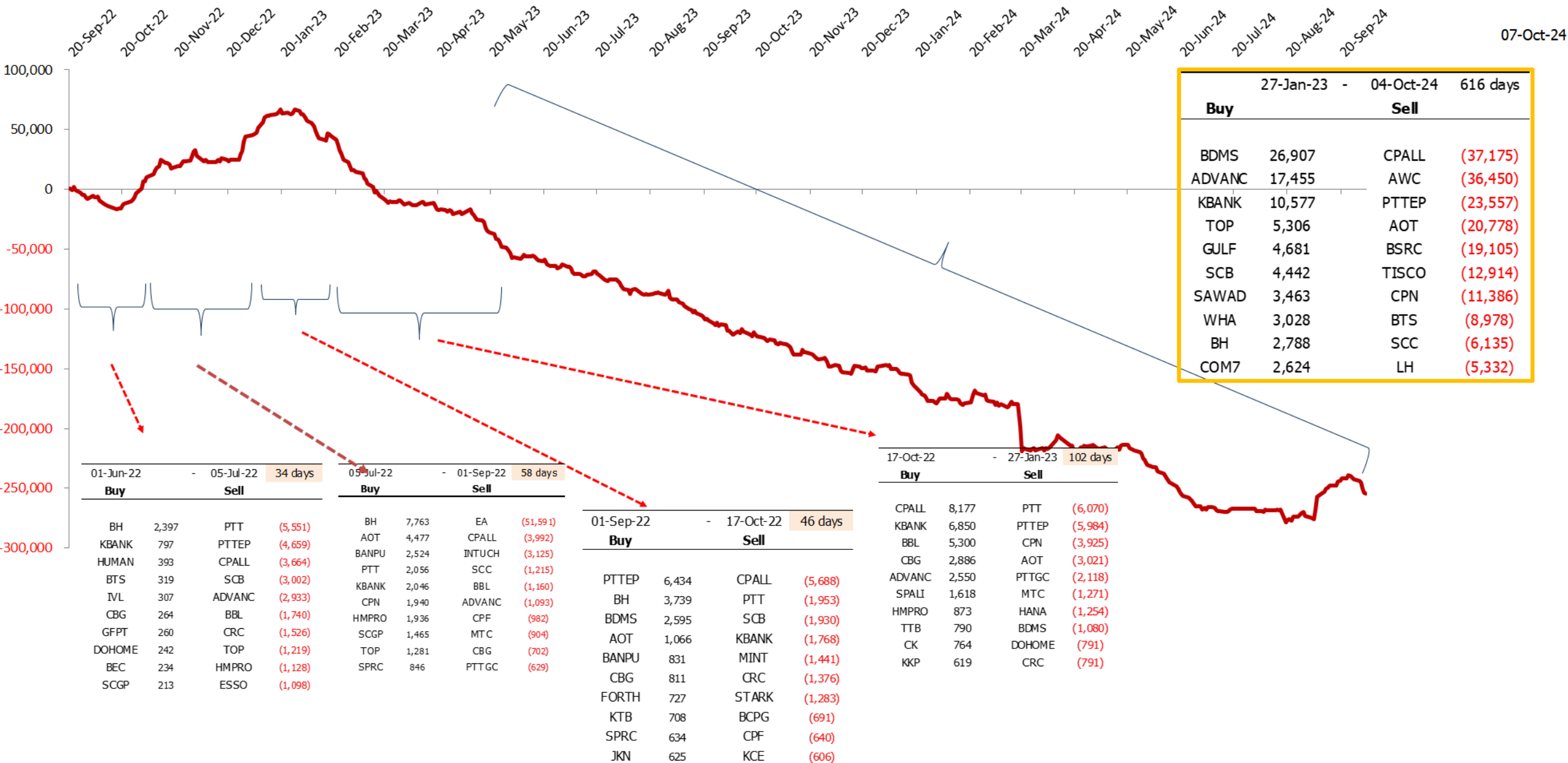
07-Oct-24

Net Buy		Net Sell	
BDMS	45,033	AOT	(38,261)
BH	34,421	AWC	(37,807)
ADVANC	20,244	CPALL	(29,751)
SCB	13,769	BSRC	(18,716)
KBANK	11,961	PTT	(17,825)
PTTEP	10,027	INTUCH	(13,992)
KTC	7,962	CPN	(12,405)
TOP	5,464	TTB	(11,911)
HUMAN	2,906	SCC	(11,200)
CK	2,818	CPF	(8,817)

นักลงทุนต่างประเทศได้ทยอยเข้าซื้อหุ้นไทย มาตั้งแต่ต้นปี 2021 ด้านขายมือ เป็นมูลค่าที่นักลงทุนกลุ่มนี้ เข้าซื้อ หรือขาย ตั้งแต่เวลานั้น มาจนถึงปัจจุบัน

Foreign Net (Equity) - Accumulate

Unit : Million Baht



	27-Jan-23	-	04-Oct-24	616 days
	Buy		Sell	
BDMS	26,907		CPALL	(37,175)
ADVANC	17,455		AWC	(36,450)
KBANK	10,577		PTTEP	(23,557)
TOP	5,306		AOT	(20,778)
GULF	4,681		BSRC	(19,105)
SCB	4,442		TISCO	(12,914)
SAWAD	3,463		CPN	(11,386)
WHA	3,028		BTS	(8,978)
BH	2,788		SCC	(6,135)
COM7	2,624		LH	(5,332)

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	8,177			PTT	(6,070)		
KBANK	6,850			PTTEP	(5,984)		
BBL	5,300			CPN	(3,925)		
CBG	2,886			AOT	(3,021)		
ADVANC	2,550			PTTGC	(2,118)		
SPALI	1,618			MTC	(1,271)		
HMPRO	873			HANA	(1,254)		
TTB	790			BDMS	(1,080)		
CK	764			DOHOME	(791)		
KKP	619			CRC	(791)		

	27-Jan-23	04-Oct-24	616 days
Buy		Sell	
BDMS	26,907	CPALL	(37,175)
ADVANC	17,455	AWC	(36,450)
KBANK	10,577	PTTEP	(23,557)
TOP	5,306	AOT	(20,778)
GULF	4,681	BSRC	(19,105)
SCB	4,442	TISCO	(12,914)
SAWAD	3,463	CPN	(11,386)
WHA	3,028	BTS	(8,978)
BH	2,788	SCC	(6,135)
COM7	2,624	LH	(5,332)



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	%		
DMT	11.70	0.21	1.18	10.09	Quarter	11.37
SCB	110.00	2.00	9.39	8.53	Semi-Anl	1,281.85
MC	11.90	0.40	0.97	8.11	Semi-Anl	22.88
SIRI	1.85	0.07	0.15	8.11	Semi-Anl	181.28
SPRC	7.05	0.25	0.56	7.99	Semi-Anl	146.74
TISCO	97.25	2.00	7.74	7.96	Semi-Anl	343.90
NER	5.10	0.05	0.40	7.75	Semi-Anl	34.76
TACC	4.82	0.20	0.36	7.37	Semi-Anl	14.87
ORI	4.90	0.30	0.35	7.12	Semi-Anl	42.89
QH	1.89	0.03	0.13	7.04	Semi-Anl	30.24
ICHI	15.90	0.50	1.12	7.03	Semi-Anl	74.31
LH	6.05	0.30	0.42	6.89	Semi-Anl	289.97
PTTEP	136.50	4.50	0.28	6.75	Semi-Anl	3,154.12
SC	2.96	0.05	0.20	6.72	Semi-Anl	45.33
PSH	8.95	0.15	0.60	6.67	Semi-Anl	10.35
SPALI	20.10	0.60	1.33	6.59	Semi-Anl	140.72

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	3.12	0.36	0.42	13.46	Annual	5.1
ROJNA	6.60	0.40	0.42	6.36	Annual	27.2
AP	9.90	0.70	0.63	6.35	Annual	137.9
ILINK	6.60	0.39	0.39	5.83	Annual	5.5
NETBAY	15.90	0.90	0.84	5.30	Annual	13.4
TEGH	3.34	0.10	0.18	5.24	Annual	38.2
TPS	3.14	0.18	0.16	5.10	Annual	6.4
KTB	20.70	0.87	1.00	4.83	Annual	2,035.41
TTA	5.90	0.18	0.26	4.41	Annual	71.60
THANI	2.10	0.02	0.09	4.29	Annual	13.18
BAM	9.20	0.38	0.38	4.14	Annual	194.08

High Dividend : Property Fund & REIT

07-Oct-24

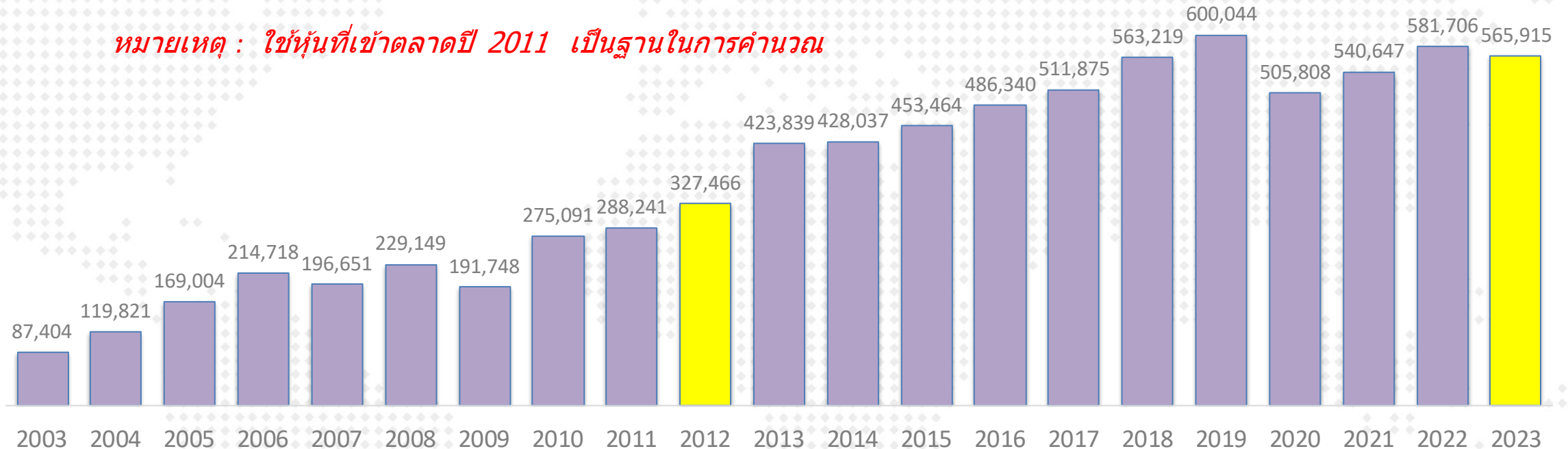
Stock	Last price	Last DPS	Est. DPS	div yield last	Frequency	5-day avg volume	Type
				year			
				(%)	(times)	Bt mn	
SPRIME	4.18	0.13	0.44	12.92	Quarter	1.33	Leasehold
GVREIT	6.65	0.20	0.78	11.78	Quarter	4.14	Leasehold
POPF	6.30	0.29	0.79	11.10	Quarter	1.24	Free&Leaseho
ALLY	5.40	0.13	0.00	10.87	Quarter	2.58	#N/A
DIF	9.30	0.22	0.96	9.65	Quarter	141.96	Freehold
BOFFICE	5.00	0.06	0.66	9.27	Quarter	4.03	Leasehold
INETREIT	8.80	0.20	0.00	9.11	Quarter	2.88	#N/A
WHAIR	6.30	0.14	0.53	8.70	Quarter	2.50	#N/A
LHHOTEL	13.60	0.31	1.33	8.63	Quarter	15.32	Free&Leaseho
CPNCG	6.25	0.02	0.91	8.52	Quarter	2.07	Leasehold
AIMIRT	11.00	0.14	0.89	7.89	Quarter	5.96	Freehold
DREIT	5.20	0.21	0.60	7.74	Semi-Anl	1.30	Leasehold
EGATIF	6.05	0.13	0.26	7.70	Quarter	2.01	n.a.
BAREIT	9.80	0.18	0.58	7.62	Quarter	2.82	#N/A
PROSPECT	8.60	0.22	0.22	7.47	Quarter	3.03	#N/A
WHART	10.60	0.19	0.77	7.30	Quarter	9.54	Leasehold

(update สัปดาห์ละหนึ่งครั้ง)

บริษัทในตลาดหุ้นไทย จ่ายเงินปันผลอย่างต่อเนื่อง

CAGR (2011-22) = 3.1 %

หมายเหตุ : ใช้หุ้นที่เข้าตลาดปี 2011 เป็นฐานในการคำนวณ



หมายเหตุ : ใช้หุ้นที่เข้าตลาดปี 2011 เป็นฐานในการคำนวณ

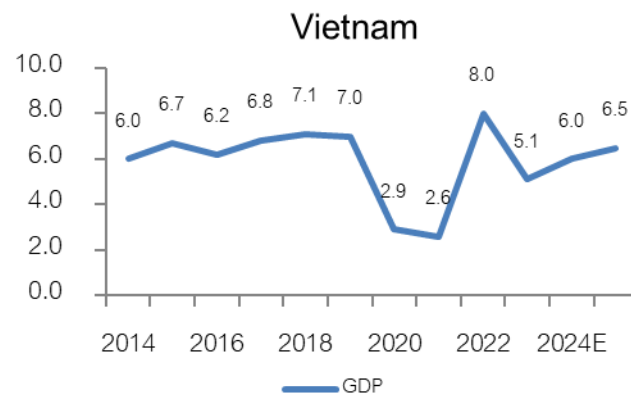
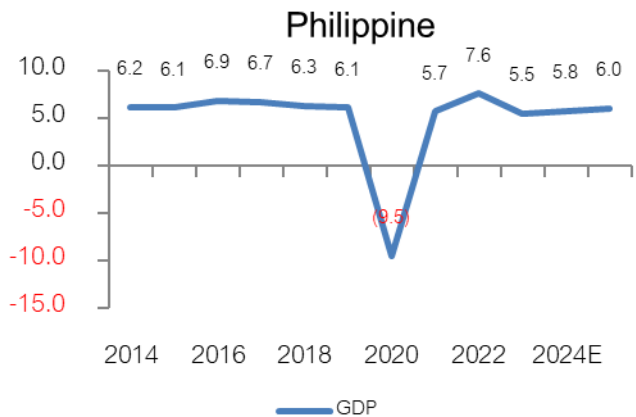
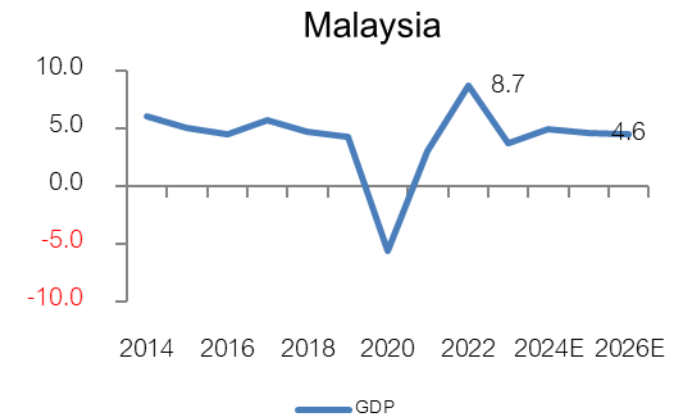
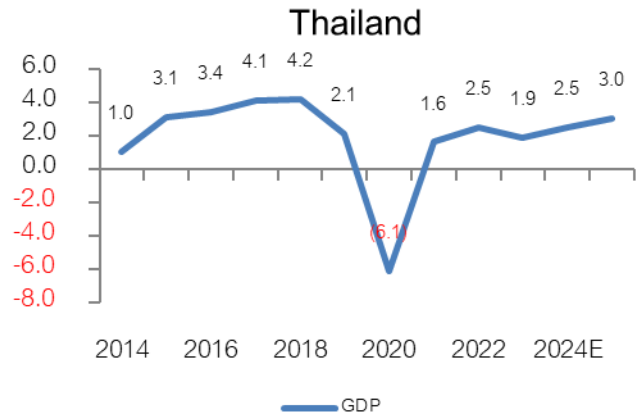
- ข้อมูล ณ ส.ค.2021 เงินปันผลที่จ่ายในปี 2023 คือ 5.6 แสบลบ. (ดึงข้อมูลจากงบกระแสเงินสด)
- นับตั้งแต่ปี 2012 เป็นต้นมา ทุกบริษัทรวมกัน มีการจ่ายเงินปันผลเพิ่มขึ้นในอัตราเฉลี่ย 3.1% ต่อปี

Market Indicators

Date	Country	Event	Period	Surv(M)	Prior
7-Oct	TH	CPI YoY	Sep	0.7%	0.4%
	EC	Retail Sales YoY	Aug	1.1%	-0.1%
9-Oct	US	FOMC Meeting Minutes	Sep-18	--	--
10-Oct	US	CPI MoM	Sep	0.1%	0.2%
	US	CPI Ex Food and Energy MoM	Sep	0.2%	0.3%
	US	CPI YoY	Sep	2.3%	2.5%
	US	CPI Ex Food and Energy YoY	Sep	3.2%	3.2%
	US	Initial Jobless Claims	Oct-05	--	225k
11-Oct	US	PPI Final Demand YoY	Sep	1.7%	1.7%
	US	PPI Ex Food and Energy YoY	Sep	2.7%	2.4%
	US	U. of Mich. Sentiment	Oct P	69.81	70.10
	CH	FDI YTD YoY CNY	Sep	--	-31.5%
13-Oct	CH	PPI YoY	Sep	-2.5%	-1.8%
	CH	CPI YoY	Sep	0.6%	0.6%
14-Oct	CH	Exports YoY	Sep	--	8.7%
15-Oct	US	Empire Manufacturing	Oct	--	11.5
	CH	1-Yr Medium-Term Lending Facility Rate	Oct-25	--	2.0%
16-Oct	TH	BoT Benchmark Interest Rate	Oct-16	2.5%	2.5%
17-Oct	JN	Exports YoY	Sep	--	5.6%
	EC	CPI YoY	Sep F	--	2.2%
	EC	ECB Policy Rate Meeting	Oct-17		
	US	Retail Sales Advance MoM	Sep	0.37%	0.10%
	US	Initial Jobless Claims	Oct-12	--	--
18-Oct	CH	New Home Prices MoM	Sep	--	-0.73%
	CH	GDP YoY	3Q	--	4.70%
	CH	Retail Sales YoY	Sep	--	2.1%
	US	Housing Starts MoM	Sep	-0.3%	9.6%
	US	Building Permits MoM	Sep	-0.7%	4.9%

GDP ของประเทศใน Asean

Source : Bloomberg
(18 Sep 24)

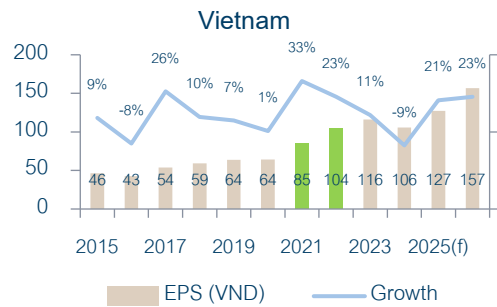
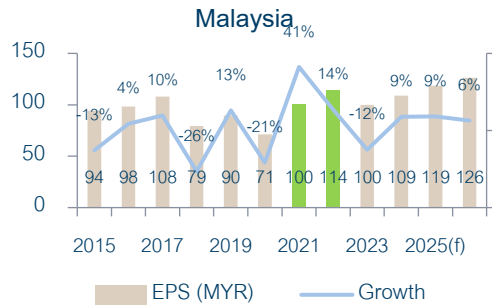
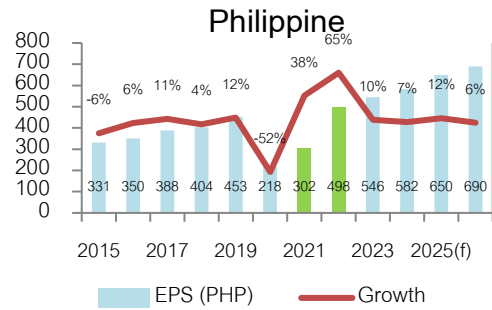
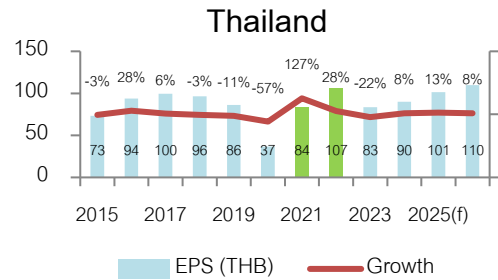


EPS (กำไรตลาด) ของประเทศใน Asean

Source : Bloomberg

(18 Sep 24)

Currency : Local Currency



EPS (กำไรตลาด) 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

GDP และตัวเลขเศรษฐกิจสำคัญ ประเทศในเอเชีย

18-Sep-24

Source : Bloomberg
(30 Sep 24)

Currency : Local Currency

THAILAND	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024E	2025E	2026E
GDP	1.0	3.1	3.4	4.1	4.2	2.1	(8.1)	1.6	2.5	1.9	2.5	3.0	3.1
Inflation	1.9	(0.9)	0.2	0.7	1.1	0.7	(0.8)	1.2	6.1	1.3	0.8	1.4	1.6
Current Account /GDP	2.9	6.9	10.5	9.6	5.6	7.0	4.2	(2.0)	(3.2)	1.9	2.0	3.1	3.4
Budget Deficit / GDP	(3.0)	(2.6)	(2.2)	(3.5)	(2.5)	(1.9)	(6.8)	(5.5)	(2.7)	(3.0)	(3.8)	(4.0)	(3.4)

INDONESIA	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024E	2025E	2026E
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	5.1
Inflation	6.4	6.4	3.5	3.8	3.2	2.8	2.0	1.6	4.2	3.7	2.8	2.8	2.7
Current Account /GDP	(3.1)	(2.0)	(1.8)	(1.6)	(2.9)	(2.7)	(0.4)	0.3	1.0	(0.2)	(0.7)	(1.0)	(1.1)
Budget Deficit / GDP	(2.1)	(2.6)	(2.5)	(2.5)	(1.8)	(2.2)	(6.4)	(4.6)	(3.7)	(2.0)	(2.5)	(2.8)	(2.8)

PHILIPPINES	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024E	2025E	2026E
GDP	6.2	6.1	6.9	6.7	6.3	6.1	(9.5)	5.7	7.6	5.5	5.8	6.0	6.1
Inflation	3.6	0.7	1.3	2.9	5.2	2.4	2.4	3.9	5.8	6.0	3.5	3.0	3.0
Current Account /GDP	3.8	2.5	0.2	(0.8)	(2.3)	(0.1)	3.6	(1.8)	(4.4)	(2.6)	(2.1)	(2.0)	(2.1)
Budget Deficit / GDP	(0.6)	(0.9)	(2.4)	(2.1)	(3.1)	(3.4)	(7.6)	(8.6)	(7.4)	(6.1)	(5.6)	(5.3)	(4.0)

VIETNAM	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024E	2025E	2026E
GDP	6.0	6.7	6.2	6.8	7.1	7.0	2.9	2.6	8.0	5.1	6.0	6.5	6.5
Inflation	4.1	0.6	2.7	3.5	3.5	2.8	3.2	1.8	3.2	3.3	3.8	3.5	3.7
Current Account /GDP	3.7	(0.9)	0.3	(0.6)	1.9	3.8	4.4	(2.2)	0.0	5.1	3.8	3.6	2.1
Budget Deficit / GDP								(5.2)	(4.5)	(4.1)	(3.6)	(3.3)	(2.9)

Malaysia	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024E	2025E	2026E
GDP	6.0	5.1	4.5	5.7	4.7	4.3	(5.6)	3.1	8.7	3.7	4.9	4.6	4.5
Inflation	3.2	2.1	2.1	3.8	1.0	0.7	(1.1)	2.5	3.4	2.5	2.3	2.6	2.3
Current Account /GDP	4.4	2.8	2.4	2.8	2.2	3.5	4.2	3.9	3.2	1.6	2.4	2.4	2.7
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)	(3.0)

China	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024E	2025E	2026E
GDP				6.9	6.7	6.0	2.2	8.4	3.0	5.2	4.8	4.5	4.2
Inflation				1.6	2.1	2.9	2.5	0.9	2.0	0.2	0.5	1.4	1.6
Current Account /GDP				1.5	0.2	0.7	1.7	2.0	2.5	1.8	1.3	1.2	1.0
Budget Deficit / GDP				(0.4)	(4.1)	(4.9)	(6.2)	(3.8)	(4.7)	(4.6)	(4.9)	(5.0)	(5.0)

India	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024E	2025E	2026E
GDP				8.3	6.8	6.5	3.9	(5.8)	9.7	7.0		6.9	6.6
Inflation				3.3	4.0	3.7	6.6	5.1	6.7	5.7		4.5	4.4
Current Account /GDP				(1.5)	(2.4)	(1.1)	1.3	(1.1)	(2.4)	(0.9)		(1.1)	(1.1)
Budget Deficit / GDP				(3.9)	(3.6)	(4.4)	(6.0)	(6.2)	(6.9)	(6.0)		(4.9)	(4.5)

US

	<u>2014</u>	<u>2015</u>	<u>2016</u>	<u>2017</u>	<u>2018</u>	<u>2019</u>	<u>2020</u>	<u>2021</u>	<u>2022</u>	Forecast <u>2023(F)</u>	Forecast <u>2024(F)</u>	Forecast <u>2025(F)</u>
Economic Activity												
Real GDP (YoY%)	2.4	2.4	1.6	2.3	2.9	2.3	-3.5	5.7	2.1	2.5	2.6	1.8
CPI (YoY%)	1.6	0.1	1.3	2.1	2.4	1.8	1.3	4.7	8.0	4.1	2.9	2.2
Core PCE (YoY%)	4.1	4.1	4.1	4.1	4.1	4.1	4.1	4.1	4.1	4.1	4.1	4.1
Unemployment (%)	3.6	3.6	3.6	3.6	3.6	3.6	3.6	3.6	3.6	3.6	3.6	3.6
External Balance												
Curr. Acct. (% of GDP)	-3.3	-3.3	-3.3	-3.3	-3.3	-3.3	-3.3	-3.3	-3.3	-3.3	-3.3	-3.3
Fiscal Balance												
Budget (% of GDP)	-6.5	-6.5	-6.5	-6.5	-6.5	-6.5	-6.5	-6.5	-6.5	-6.5	-6.5	-6.5
Interest Rates												
Central Bank Rate (%)	0.25	0.50	0.75	1.50	2.50	1.75	0.25	0.25	4.50	5.50	4.45	
3-Month Rate (%)	4.85	0.47	1.01	1.54	2.74	1.80	0.24	0.21	4.32	5.37	4.32	
2-Year Note (%)	0.58	0.94	1.14	1.76	2.92	1.62	0.17	0.58	4.28	4.58	3.50	
10-Year Note (%)	2.23	2.28	2.42	2.42	3.13	1.82	0.87	1.57	3.55	4.13	3.72	
Exchange Rates												
EURUSD	1.240	1.060	1.070	1.170	1.150	1.110	1.190	1.140	1.000	1.070	1.110	1.130

THAILAND

	<u>2014</u>	<u>2015</u>	<u>2016</u>	<u>2017</u>	<u>2018</u>	<u>2019</u>	<u>2020</u>	<u>2021</u>	<u>2022</u>	Forecast <u>2023(F)</u>	Forecast <u>2024(F)</u>	Forecast <u>2025(F)</u>
Economic Activity												
Real GDP (YoY%)	0.7	2.80	3.2	3.9	4.2	2.4	-6.7	1.1	3.2	2.4	2.5	3.0
CPI (YoY%)	1.9	-0.8	0.2	0.7	1.1	0.7	-0.9	1.2	6.1	1.3	0.7	1.4
Unemployment (%)	0.9	0.8	1.0	1.1	1.1	1.0	1.7	1.9	1.3	1.1	1.0	1.0
External Balance												
Curr. Acct. (% of GDP)	3.0	7.0	10.5	10.5	7.1	6.8	3.7	-2.3	-3.0	1.1	2.0	3.1
Fiscal Balance												
Budget (% of GDP)	-2.7	-2.3	-2.6	-3.0	-3.0	-2.8	-5.2	-6.7	-4.5	-3.4	-3.8	-4.0
Interest Rates												
Central Bank Rate (%)	1.95	1.50	1.50	1.50	1.70	1.25	0.45	0.50	1.30	2.50	2.40	2.05
3-Month Rate (%)	2.20	1.50	1.58	1.59	1.77	1.37	0.59	0.61	1.37	2.65	2.61	2.12
2-Year Note (%)	2.30	1.49	1.53	1.44	1.90	1.35	0.57	0.64	1.75	2.50	2.29	2.15
10-Year Note (%)	3.05	2.77	2.58	2.40	2.88	1.62	1.36	1.93	3.31	3.05	2.67	2.66
Exchange Rates												
USDTHB	32.80	36.20	35.70	33.35	33.00	30.40	30.45	33.15	37.00	35.000	33.400	32.400

Euro Area

	<u>2014</u>	<u>2015</u>	<u>2016</u>	<u>2017</u>	<u>2018</u>	<u>2019</u>	<u>2020</u>	<u>2021</u>	<u>2022</u>	Forecast <u>2023(F)</u>	Forecast <u>2024(F)</u>	Forecast <u>2025(F)</u>
Economic Activity												
Real GDP (YoY%)	0.9	1.5	1.7	2.5	1.8	1.2	-6.8	5.2	3.5	0.5	0.7	1.3
CPI (YoY%)	0.40	0.00	0.20	1.50	1.70	1.20	0.30	2.60	8.40	5.40	2.40	2.10
Unemployment (%)	11.60	10.90	10.10	9.10	8.20	7.60	8.00	7.70	6.70	6.50	6.50	6.55
External Balance												
Curr. Acct. (% of GDP)	2.4	3.0	3.2	3.1	3.3	2.8	2.1	2.7	0.4	2.2	2.6	2.5
Fiscal Balance												
Budget (% of GDP)	-2.6	-2.1	-1.9	-1.2	-0.7	-0.8	-9.3	-6.9	-3.7	-3.4	-3.1	-2.8
Interest Rates												
Central Bank Rate (%)	0.05	0.05	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2.50	4.50	3.35	2.45
3-Month Rate (%)	0.08	-0.14	-0.32	-0.33	-0.32	-0.42	-0.50	-0.54	2.23	3.96	3.15	2.31
2-Year Note (%)												
10-Year Note (%)												
Exchange Rates												
EURUSD	1.24	1.06	1.07	1.17	1.15	1.11	1.19	1.14	1.00	1.07	1.11	1.13

China

	<u>2014</u>	<u>2015</u>	<u>2016</u>	<u>2017</u>	<u>2018</u>	<u>2019</u>	<u>2020</u>	<u>2021</u>	<u>2022</u>	Forecast <u>2023(F)</u>	Forecast <u>2024(F)</u>	Forecast <u>2025(F)</u>
Economic Activity												
Real GDP (YoY%)	7.4	6.9	6.7	6.9	6.6	6.1	2.3	8.1	3.0	5.2	4.8	4.5
CPI (YoY%)	2.00	1.40	2.00	1.60	2.10	2.90	2.50	0.90	2.00	0.2	0.5	1.4
Unemployment (%)	4.10	4.10	4.10	4.00	3.80	3.60	3.81	4.40	5.60	5.2	5.2	5.1
External Balance												
Curr. Acct. (% of GDP)	2.8	2.8	2.4	1.4	0.3	1.2	1.5	2.1	2.3	1.8	1.3	1.2
Fiscal Balance												
Budget (% of GDP)	-2.1	-3.2	-3.1	-3.4	-4.1	-6.0	-7.0	-5.0	-8.0	-7.1	-4.9	-5.0
Interest Rates												
Central Bank Rate (%)	5.60	4.35	4.35	4.35	4.35	4.35	4.35	4.35	4.30	4.30	#N/A N/A	#N/A N/A
3-Month Rate (%)	#N/A N/A	#N/A N/A	2.96	4.81	3.05	2.82	2.96	2.55	2.57	2.43	1.87	1.62
2-Year Note (%)	3.45	2.65	2.30	3.20	2.83	2.69	2.95	2.47	2.30	2.35	1.52	1.43
10-Year Note (%)	3.67	3.17	2.95	3.89	3.41	3.20	3.26	2.91	2.80	2.64	2.06	2.08
Exchange Rates												
EURUSD	6.12	6.40	6.90	6.65	6.95	7.08	6.69	6.41	7.20	7.230	7.100	7.000

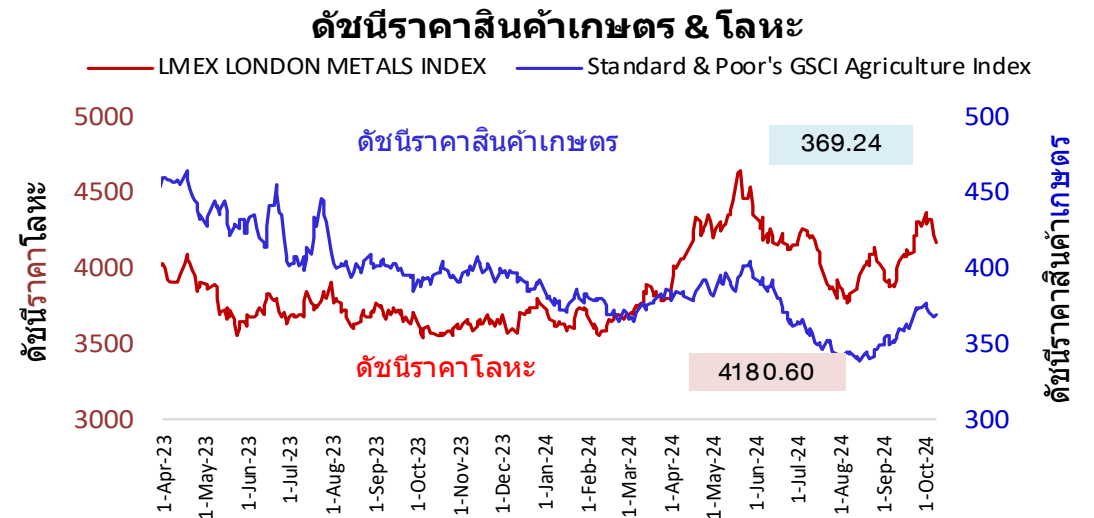
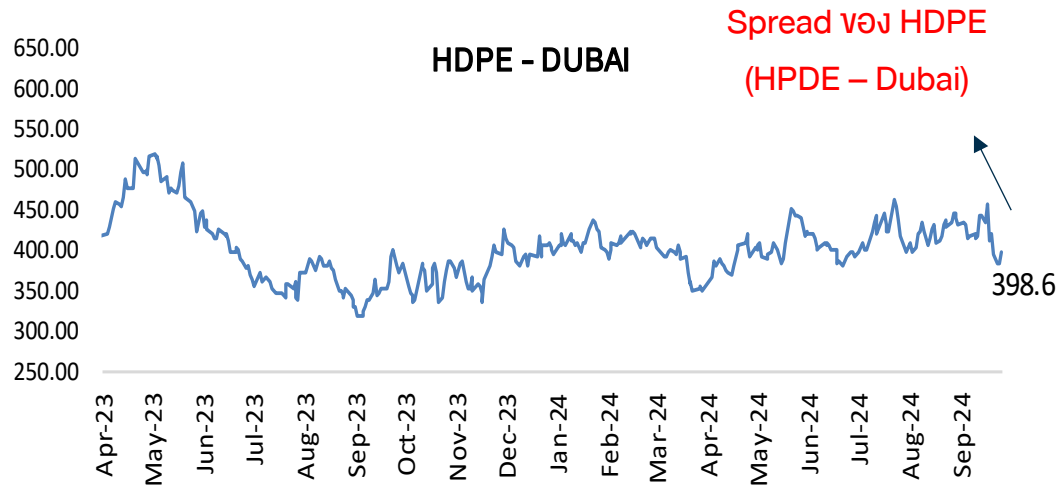
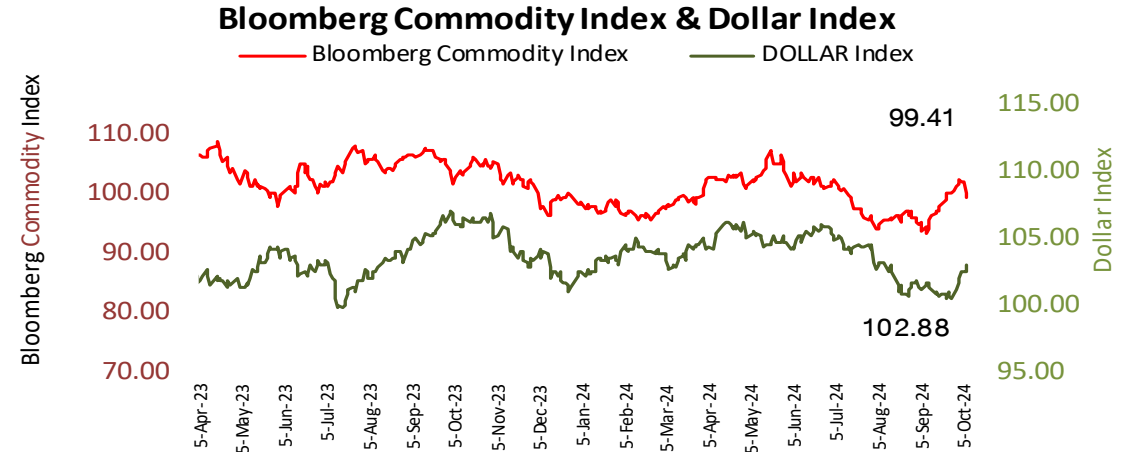
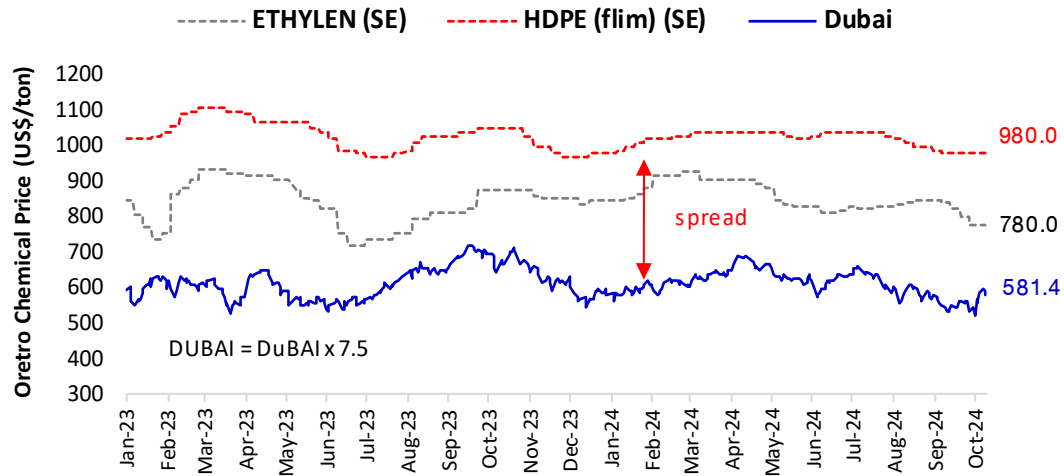
8 Oct 24

91) Bonds		92) Spreads		93) Curves										
Maturity		10 Year									Data Range		3 Months	
Region	↓ RMI	Security	Price	Chg	Yld	Chg	Yld	Low	Range	High	3M Chg			
								◆ Avg ● Now						
1) United States	☐	T 3 7/8 08/34	98-29	- 11	4.010	+4.3		3.618	◆ ●	4.296	-26.8			
2) United Kingdom	☐	UKT4 1/4 07/34	100.329c	-0.634	4.207	+7.9		3.757	◆ ●	4.207	+9.6			
3) Switzerland	☐	SWISS 0 06/34	96.452c	-0.507	0.373	+5.4		.291	◆ ●	.552	-15.4			
4) Sweden	☐	SGB2 1/4 05/35	100.964c	-0.586	2.147	+6.2		1.867	◆ ●	2.257	-9.2			
5) Spain	☐	SPGB 3.45 34	103.716c	-0.489	3.016	+5.6		2.828	◆ ●	3.353	-28.1			
6) Singapore	☐	SIGB 3 3/8 34	104.084	+0.000	2.883	+0.0		2.384	◆ ●	3.187	-29.4			
7) Portugal	☐	PGB2 7/8 10/34	100.979c	-0.379	2.762	+4.3		2.601	◆ ●	3.169	-35.4			
8) Norway	☐	NGB3 5/8 04/34	101.217c	-0.764	3.471	+9.4		3.189	◆ ●	3.698	-20.3			
9) New Zealand	☐	NZGB 4 1/4 34	99.574	-0.041	4.304	+0.5		4.051	◆ ●	4.636	-33.2			
10) Netherlands	■	NETHER2 1/2 34	99.619c	-0.399	2.544	+4.7		2.320	◆ ●	2.856	-27.5			
11) Japan	■	JGB 0.9 09/34	99.781	-0.045	0.924	+0.5		.775	◆ ●	1.076	-15.2			
12) Italy	☐	BTPS 3.85 35	102.668c	-0.549	3.570	+6.4		3.363	◆ ●	3.940	-31.6			
13) Israel	☐	ILGOV 4 03/35	94.174c	-0.736	4.980	+10.0		4.600	◆ ●	5.100	+6.0			
14) Ireland	☐	IRISH 2.6 34	100.033c	-0.486	2.596	+5.6		2.363	◆ ●	2.950	-27.8			
15) Iceland	☐	ICEGB 7 09/35	104.560	+0.000	6.410	+0.0								
16) Greece	☐	GGB3 3/8 06/34	101.345c	-0.503	3.210	+6.0		3.022	◆ ●	3.605	-33.7			
17) Germany	☐	DBR 2.6 08/34	103.028c	-0.403	2.253	+4.5		2.033	◆ ●	2.576	-28.3			
18) France	☐	FRTR 3 11/34	99.804c	-0.326	3.022	+3.8		2.814	◆ ●	3.239	-13.9			
19) Finland	☐	RFGB 3 09/34	101.981c	-0.400	2.769	+4.6		2.548	◆ ●	3.080	-24.9			
20) Denmark	☐	DGB2 1/4 11/33	100.919c	-0.364	2.138	+4.4		1.928	◆ ●	2.532	-34.7			
21) Canada	☐	CAN3 06/01/34	98.048c	-0.335	3.237	+4.1		2.865	◆ ●	3.487	-23.3			
22) Belgium	☐	BGB2.85 10/34	99.889c	-0.370	2.863	+4.3		2.644	◆ ●	3.152	-21.9			
23) Austria	☐	RAGB2.9 02/34	101.130c	-0.380	2.760	+4.6		2.531	◆ ●	3.068	-25.4			
24) Australia	■	ACGB 3 1/2 34	94.294	-0.977	4.193	+12.2		3.809	◆ ●	4.371	-16.2			

8 Oct 24

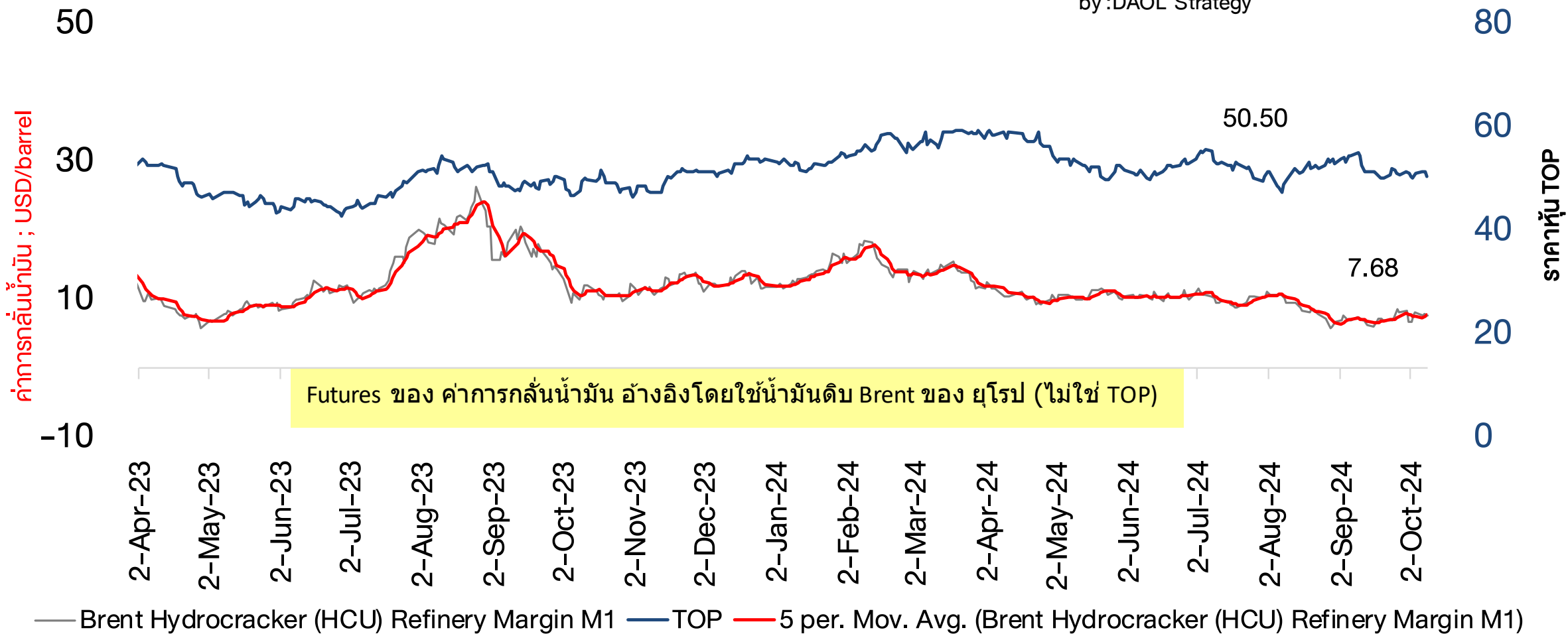
91) Bonds		92) Spreads		93) Curves								
Maturity	10 Year	Data Range										3 Months
Region	↓ RMI	Security	Price	Chg	Yld	Chg	Yld	Low	Range	High	3M Chg	
												◆ Avg ● Now
1) Thailand	☐	THAIGB 2.8 34	102.202	-0.002	2.541	+0.0		2.445	—●—	2.631	-8.9	
2) Taiwan	☐	TGB1 5/8 06/34	101.118	-0.357	1.500	+3.9						
3) South Korea	☐	KTB3 1/2 06/34	104.732	+0.000	3.068	+0.0		2.885	—●—	3.228	-13.9	
4) Singapore	☐	SIGB 3 3/8 34	104.084	+0.000	2.883	+0.0		2.384	—◆—	3.187	-29.4	
5) Philippines (US...)	☐	PHILIP6 3/8 34	112.810	-0.120	4.755	+1.4		4.543	—●—	5.105	-35.0	
6) Philippines	☐	RPGB 9 1/4 34						6.250	—◆—	6.812		
7) Pakistan	☐	PAKGB13 09/34	106.386	+0.000	11.886	+0.0		11.886	●—◆	14.124	-223.8	
8) New Zealand	☐	NZGB 4 1/4 34	99.574	-0.041	4.304	+0.5		4.051	—●—	4.636	-33.2	
9) Malaysia	☐	MGS 3.828 34	100.566	+0.010	3.758	-0.1		3.674	—●—	3.842		
10) Japan	☐	JGB 0.9 09/34	99.774	-0.052	0.925	+0.6		.775	—●—	1.076	-15.1	
11) Indonesia (USD)	☐	INDON 4.7 34	99.623	-0.105	4.750	+1.4		4.438	—●—	5.105	-35.5	
12) Indonesia	☐	INDOGB6 5/8 34	100.019	+0.000	6.621	+0.0		6.399	—●—	7.001	-36.8	
13) India	☐	IGB 7.1 04/34	101.732	+0.000	6.849	+0.0		6.715	—●—	6.984		
14) China	☐	CGB2.11 08/34	99.239	-0.620	2.196	+7.0		2.025	—◆—	2.279	-6.6	
15) Australia	☐	ACGB 3 1/2 34	94.289	-0.982	4.194	+12.3		3.809	—◆—	4.371	-16.2	

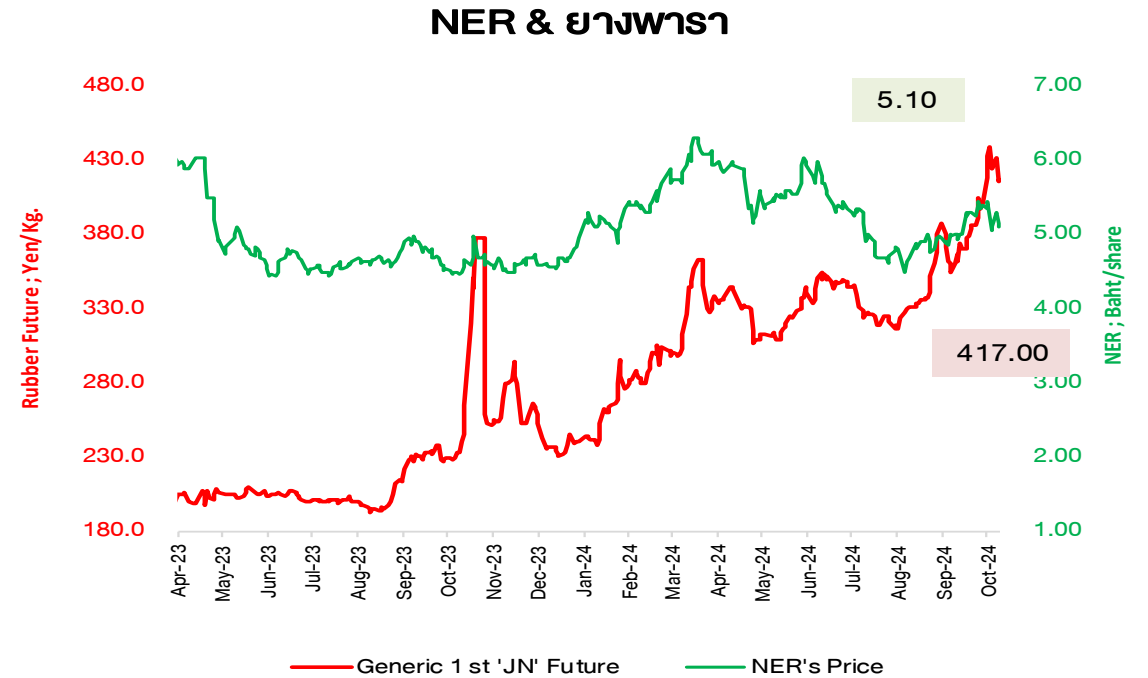
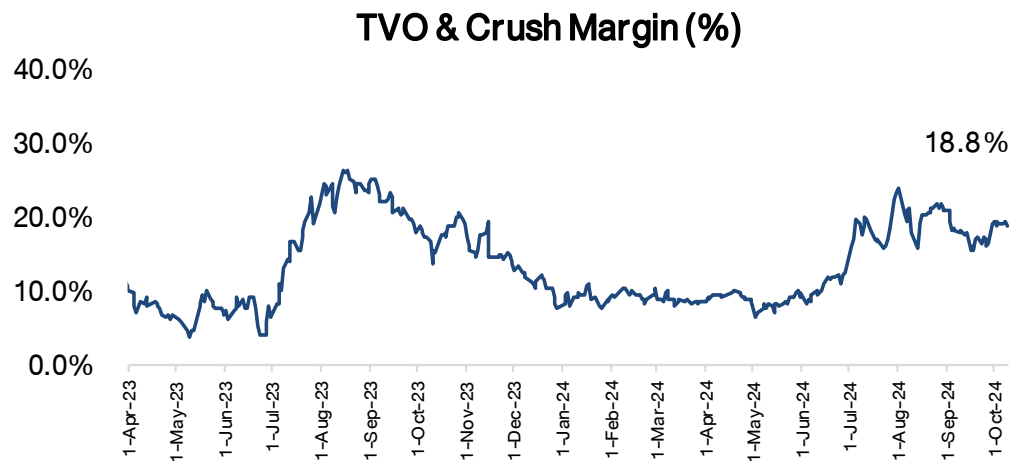
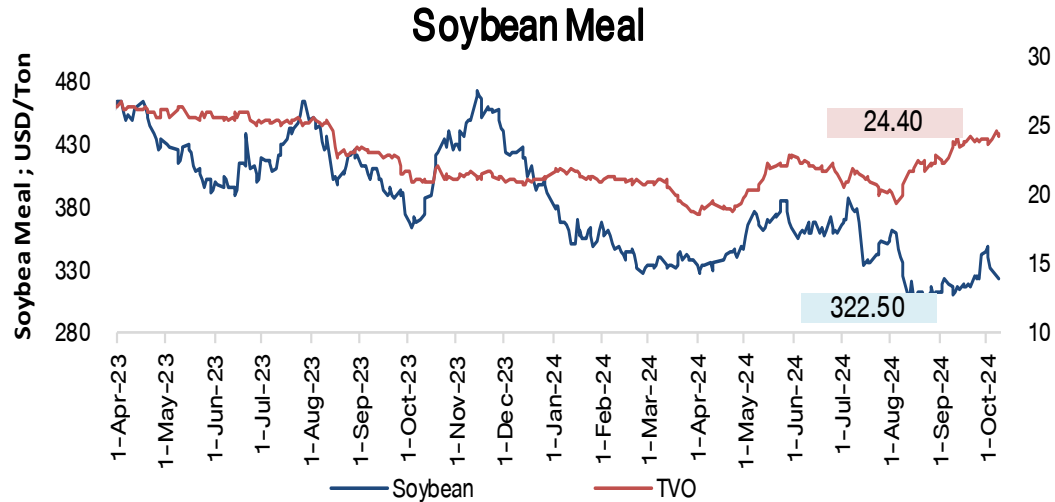
Spread ปีโตรเคมี และ ดัชนีราคาสินค้าโภคภัณฑ์



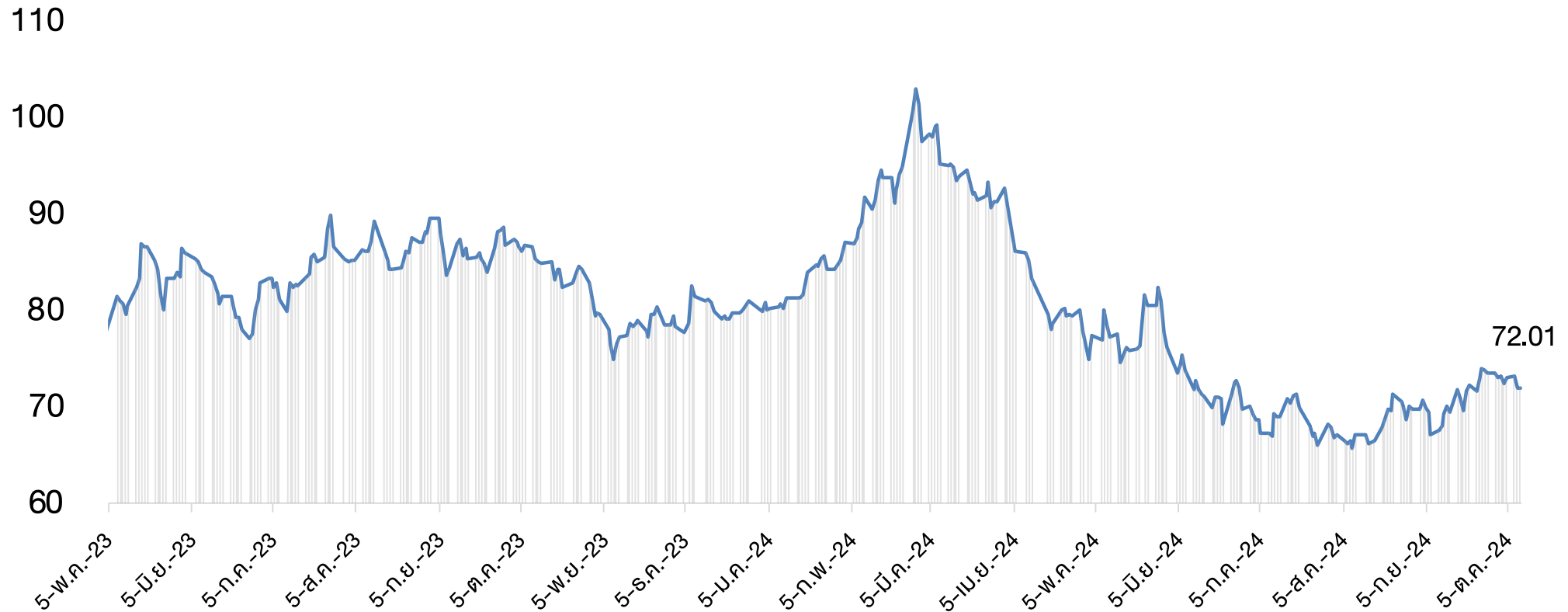
ราคาหุ้นโรงกลั่นน้ำมัน (TOP) กับค่าการกลั่นน้ำมัน

by : DAOL Strategy

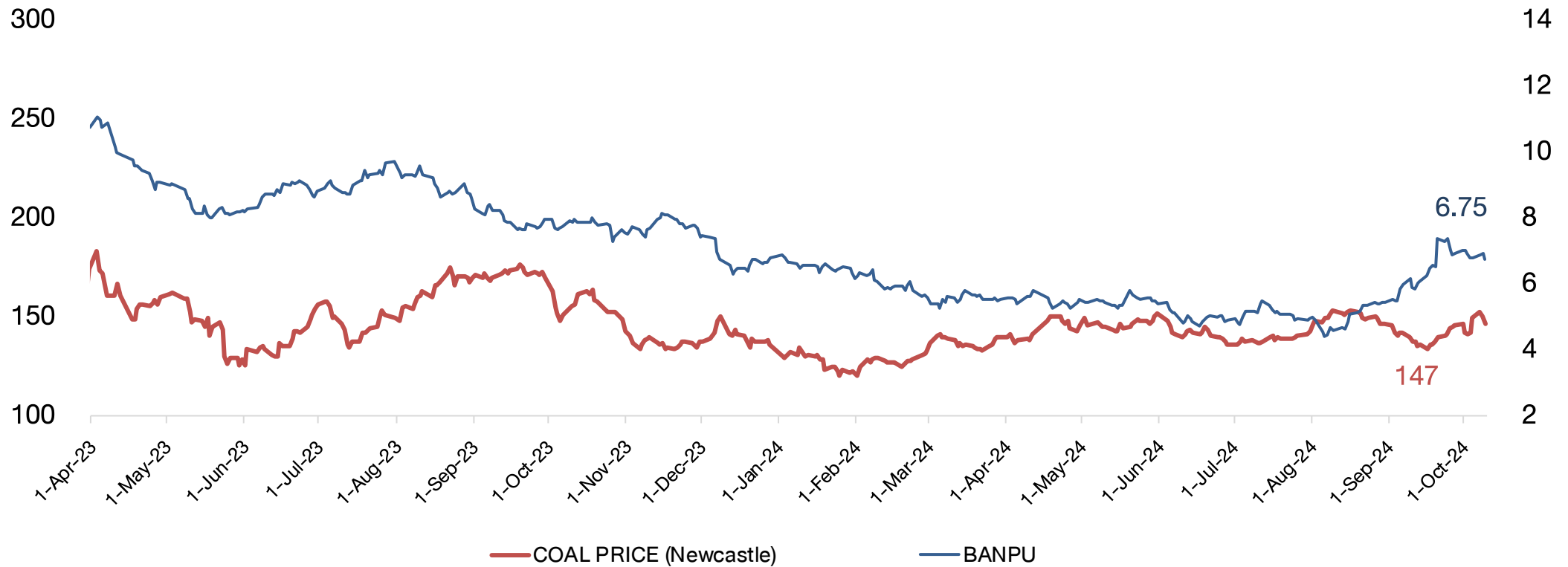




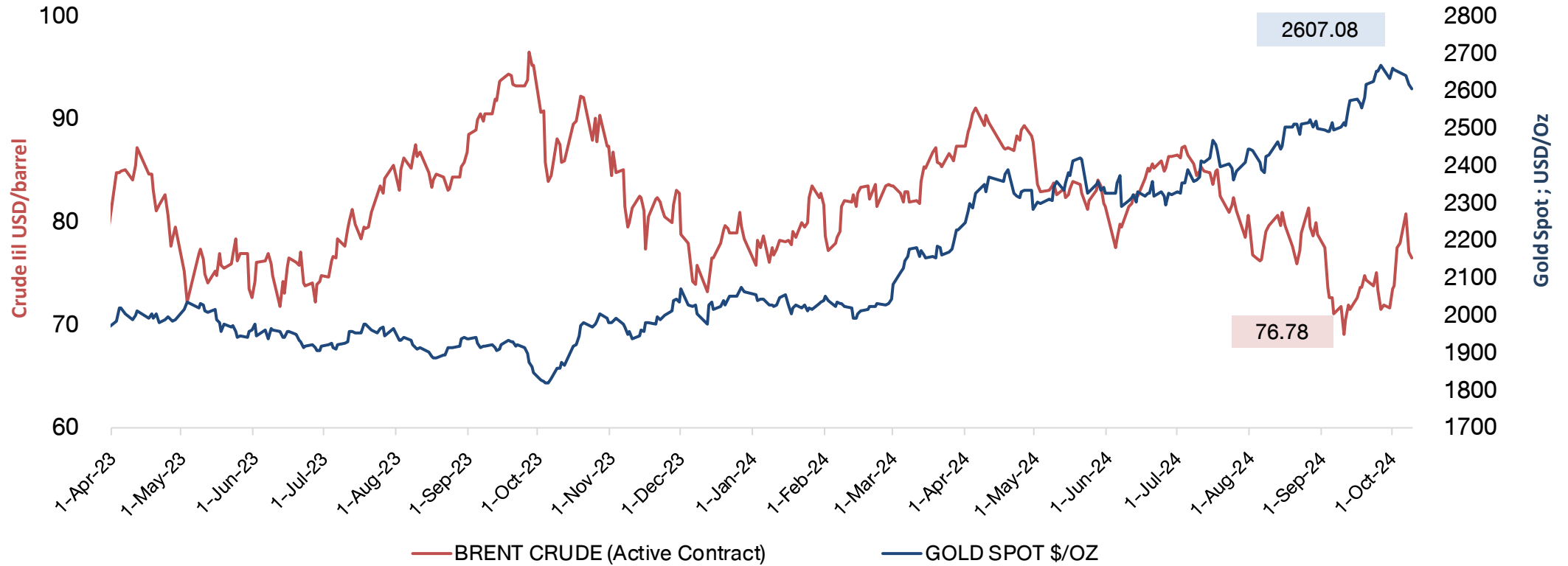
COTTON



COAL PRICE (Newcastle) & BANPU



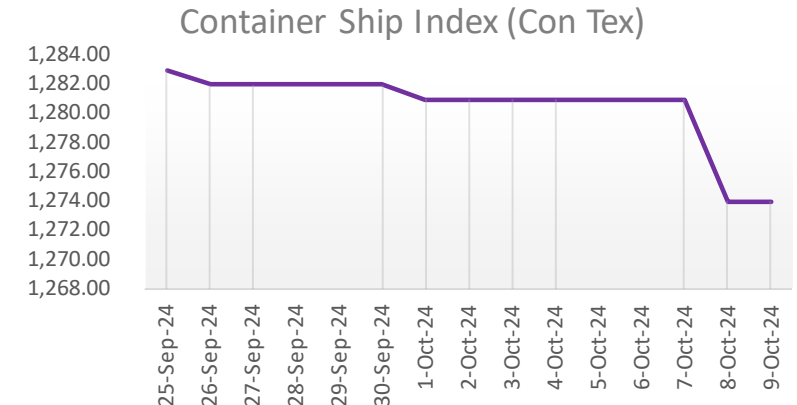
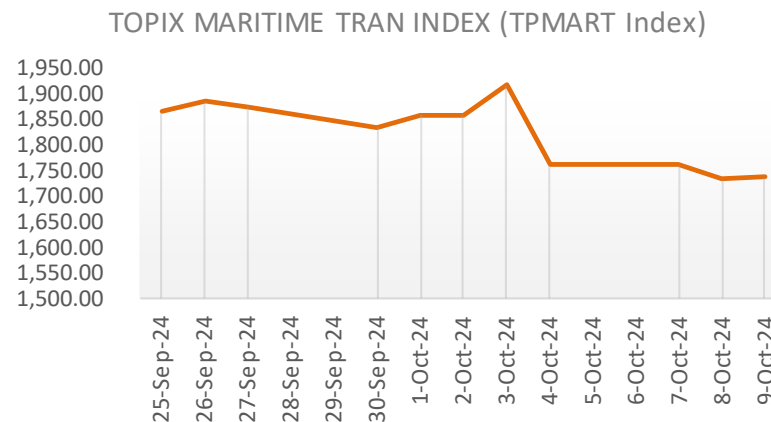
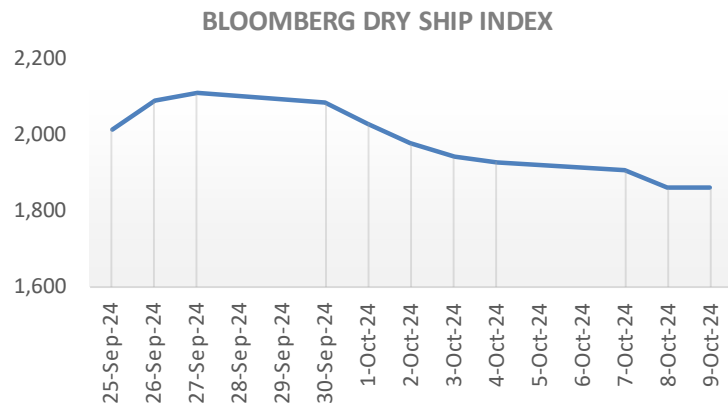
Brent Crude & Gold Price



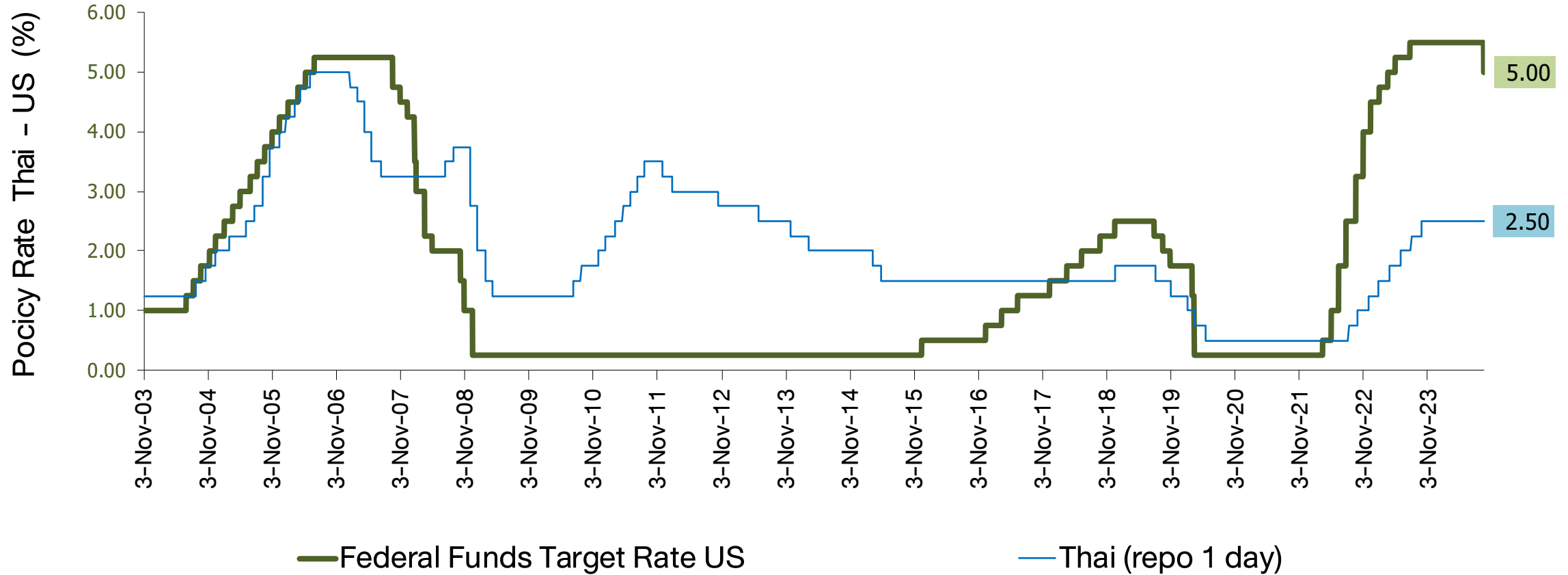
Shipping Index and Stock Performance

	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		PSL		RCL	
									TTA	Change	PSL	Change	RCL	Change
9-Oct-24	1,860.00	0.0%	1,860.00	0.0%	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	0.9%	2,110.00	0.9%	1,876.71	-0.5%	1,282.00	0.0%	6.35	2.4%	9.25	2.2%	26.25	2.9%
26-Sep-24	2,091.00	3.7%	2,091.00	3.7%	1,886.96	1.1%	1,282.00	-0.1%	6.20	-3.9%	9.05	-4.2%	25.50	-3.8%
25-Sep-24	2,016.00		2,016.00		1,867.17		1,283.00		6.45		9.45		26.50	

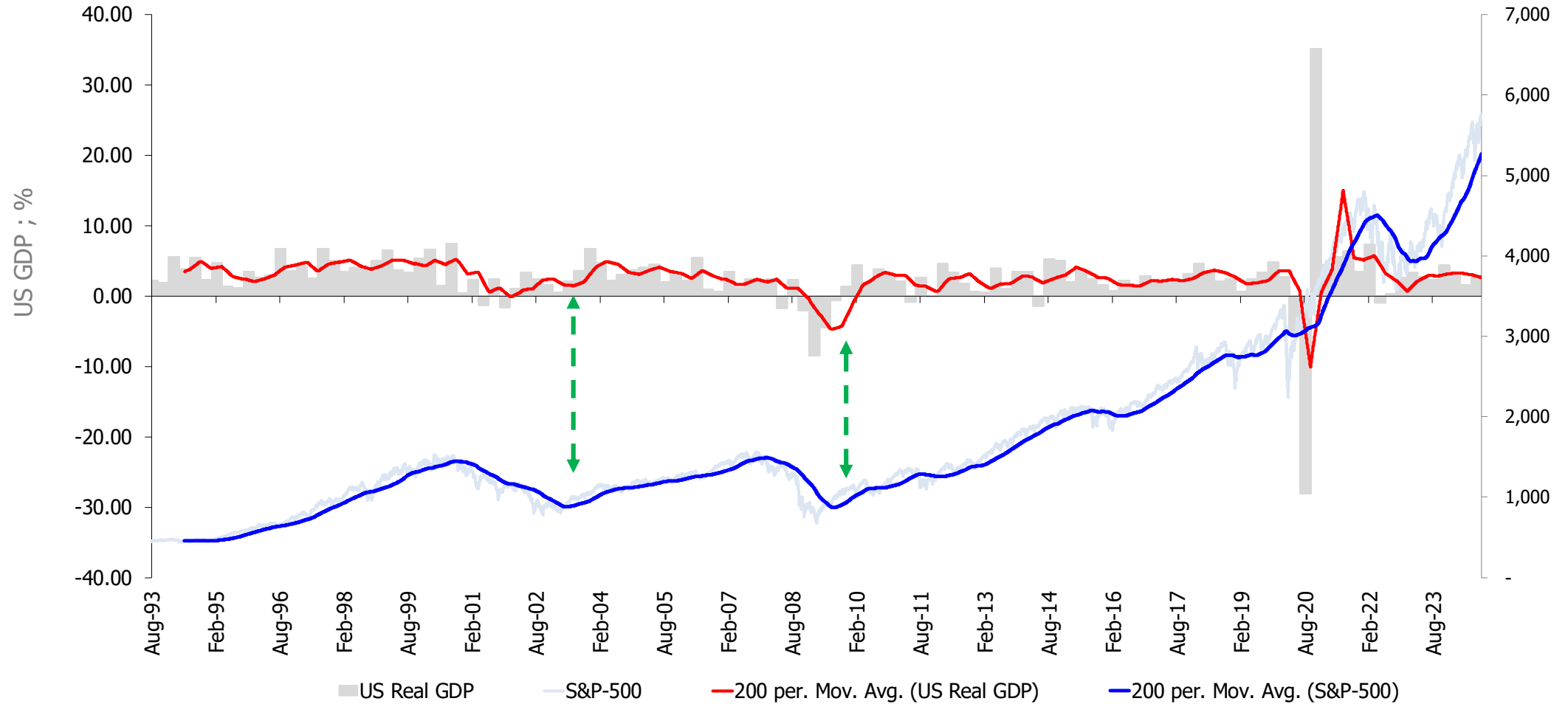
Remark : TTA and PSL are member of Bloomberg Dry Ships Index



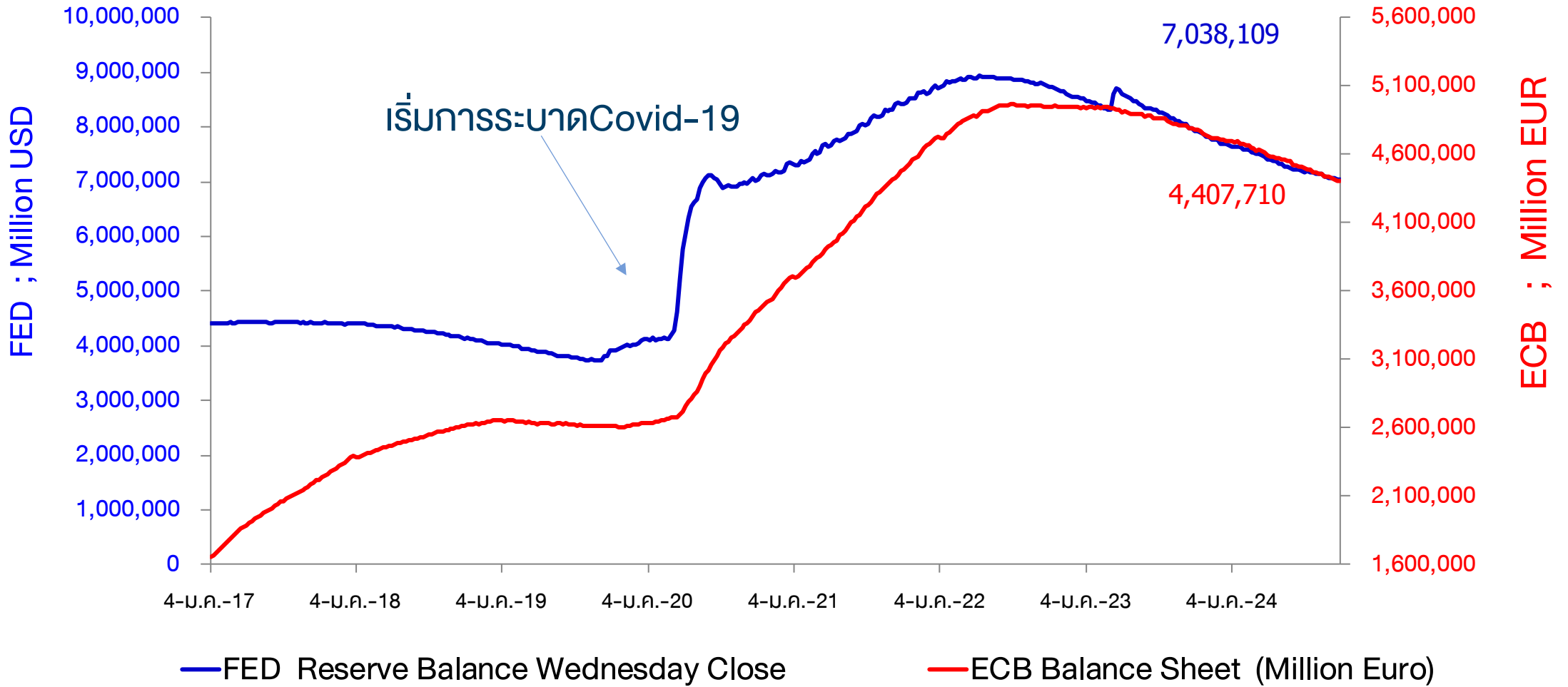
Federal Funds Rate & Thai Rate

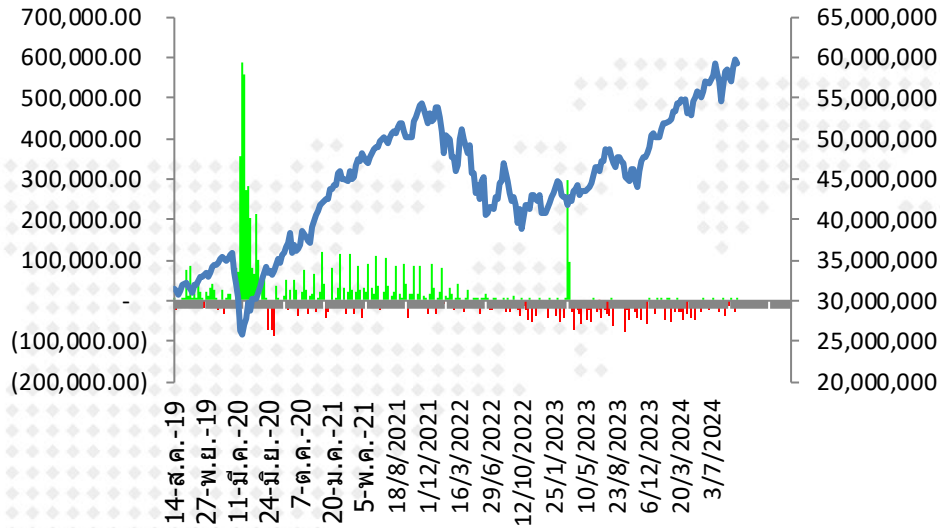


US Real GDP and S&P-500



Fed & ECB : Assets Purchase (QE Program)

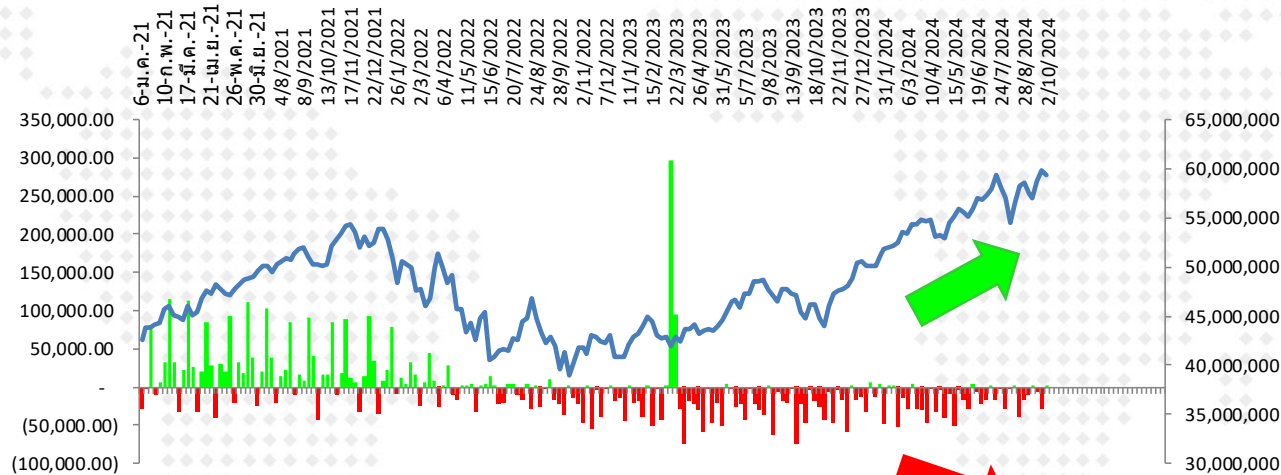




ตัวเลขการซื้อขายพันธบัตร
Fed (QE) รายสัปดาห์

■ FED Reserve Balance Wednesday Close

— Bloomberg United States Exchange Market Capitalization USD

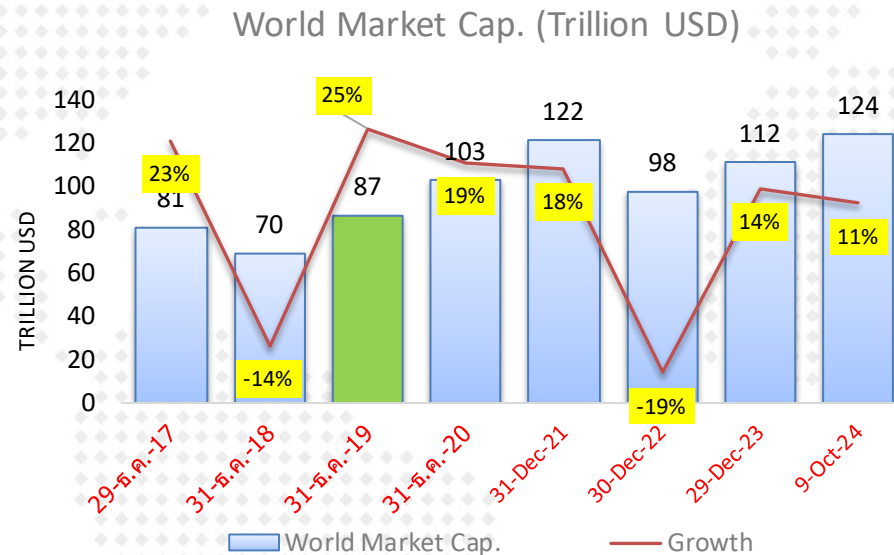


■ FED Reserve Balance Wednesday Close

— 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
(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
1.00	2/10/2024	7,038,109.0

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%
9-Oct-24	124,289,617	11%

หมายเหตุ : การอัดฉีดเงินเข้าระบบของธนาคารกลางต่าง มีส่วนให้ตลาดหุ้นปรับตัวสูงขึ้น ในช่วงปี 2020-2021

Market P/E (current & Forward)

05-Oct-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	1,629.97	15.04	15.01	13.81	4.13	6.65	04-Oct-24	04-Oct-24	มาเลเซีย
PSEI - PHILIPPINE SE IDX	PH	7,467.92	13.47	12.76	11.52	2.55	7.42	04-Oct-24	04-Oct-24	ฟิลิปปินส์
Straits Times Index STI	SI	3,589.13	13.08	11.72	11.16	4.89	7.64	04-Oct-24	04-Oct-24	สิงคโปร์
KOSPI INDEX	SK	2,569.71	13.21	10.04	8.10	1.91	7.57	04-Oct-24	04-Oct-24	เกาหลีใต้
TAIWAN TAIEX INDEX	TA	22,302.71	22.42	17.96	15.75	2.52	4.46	04-Oct-24	04-Oct-24	ไต้หวัน
STOCK EXCH OF THAI INDEX	TH	1,444.25	17.50	15.78	14.25	3.27	5.71	04-Oct-24	04-Oct-24	ไทย (SET)
THAI SET 50 INDEX	TH	917.34	17.37	16.67	14.97	2.98	5.76	04-Oct-24	04-Oct-24	ไทย (SET50)
SENSEX	IN	81,688.45	24.83	23.24	20.19	1.19	4.03	04-Oct-24	04-Oct-24	อินเดีย
JAKARTA COMPOSITE INDEX	ID	7,496.09	17.95	14.25	13.41	3.11	5.57	04-Oct-24	04-Oct-24	อินโดนีเซีย
HO CHI MINH STOCK INDEX	VN	1,270.60	15.64	11.95	10.01	1.81	6.39	04-Oct-24	04-Oct-24	เวียดนาม
SHANGHAI SE A SHARE INDX	CH	3,497.26	16.10	13.34	12.10	2.56	6.21	30-Sep-24	30-Sep-24	จีน (A-Shares)
SHANGHAI SE COMPOSITE	CH	3,336.50	16.10	13.34	12.10	2.57	6.21	30-Sep-24	30-Sep-24	จีน (Composite)
HANG SENG INDEX	HK	22,736.87	12.15	10.89	10.19	3.52	8.23	04-Oct-24	04-Oct-24	ฮ่องกง
DOW JONES INDUS. AVG	US	42,352.75	22.96	21.60	19.10	1.76	4.35	05-Oct-24	04-Oct-24	สหรัฐฯ (Dow Jones)
S&P 500 INDEX	US	5,751.07	26.24	24.22	20.92	1.29	3.81	05-Oct-24	04-Oct-24	สหรัฐฯ (S&P-500)
NASDAQ COMPOSITE	US	18,137.85	40.16	35.70	27.07	0.75	2.49	05-Oct-24	04-Oct-24	สหรัฐฯ (Nasdaq)
CAC 40 INDEX	FR	7,541.36	13.94	14.30	13.21	3.27	7.17	04-Oct-24	04-Oct-24	ฝรั่งเศส
DAX INDEX	GE	19,120.93	15.92	14.41	12.62	2.88	6.28	05-Oct-24	04-Oct-24	เยอรมัน
NIKKEI 225	JN	38,635.62	23.20	21.20	19.10	1.74	4.31	04-Oct-24	04-Oct-24	ญี่ปุ่น (Nikkei)
FTSEUROFIRST 300 INDEX	EC	2,052.00	15.38	14.66	13.67	3.24	6.50	04-Oct-24	04-Oct-24	ยุโรป (300 บริษัท)
Euro Stoxx 50 Pr	EC	4,954.94	14.31	14.38	13.33	3.16	6.99	04-Oct-24	04-Oct-24	ยุโรป (50 บริษัท)
STXE 600 (EUR) Pr	EC	518.56	15.49	14.64	13.43	3.27	6.45	04-Oct-24	04-Oct-24	ยุโรป (600 บริษัท)
MSCI WORLD	MULT	3,698.41	22.79	20.74	18.40	1.77	4.39	05-Oct-24	04-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	-1.2%	5.9%	-0.1%	16.4%	0.8%	18.8%	-0.6%	7.9%	-0.5%	12.1%	-1.1%	11.9%
1 month	2.9%	11.4%	7.8%	15.3%	10.3%	16.9%	3.2%	13.4%	6.0%	13.9%	4.6%	20.3%
3 month	4.0%	13.8%	8.2%	16.3%	10.5%	17.3%	3.3%	16.0%	12.5%	12.9%	-1.3%	23.1%
6 month	9.3%	11.5%	14.3%	14.6%	19.2%	15.7%	10.1%	13.5%	7.1%	12.0%	10.5%	19.6%
9 month	19.4%	10.7%	19.5%	13.6%	24.7%	14.9%	22.4%	12.7%	4.2%	11.2%	23.5%	18.3%
12 month	32.7%	10.6%	28.1%	13.6%	31.5%	14.9%	36.7%	12.6%	3.3%	11.8%	38.2%	17.8%
Month to date	-1.1%	4.7%	0.2%	17.0%	0.8%	19.4%	-1.1%	9.1%	-0.4%	13.9%	-1.5%	13.7%
Quarter to date	-1.1%	4.7%	0.2%	17.0%	0.8%	19.4%	-1.1%	9.1%	-0.4%	13.9%	-1.5%	13.7%
Year to date	17.4%	10.6%	17.1%	13.6%	22.2%	14.8%	20.8%	12.6%	5.2%	11.3%	20.0%	18.4%
2 ปี	24.3%	12.2%	18.7%	14.4%	20.6%	16.2%	26.5%	14.9%	-0.7%	11.3%	29.8%	20.0%
3 ปี	7.5%	14.3%	0.6%	15.8%	1.1%	17.3%	11.1%	17.6%	-0.5%	11.3%	8.0%	23.6%
4 ปี	12.4%	13.6%	4.6%	15.7%	4.1%	17.0%	16.0%	16.7%	7.0%	12.6%	13.7%	22.4%
5 ปี	12.4%	17.1%	6.0%	17.4%	6.8%	18.2%	16.2%	21.3%	0.9%	17.0%	18.8%	25.4%
10 ปี	9.4%	14.4%	4.1%	15.9%	5.5%	16.2%	13.3%	17.9%	2.3%	14.6%	16.0%	21.4%

Remark : Total Return วัดจากวันสุดท้ายเทียบกับวันแรกของช่วงเวลานั้นๆ

7-Oct-2024

Source : Bloomberg

SD* = Standard Deviation ปรึ้มเป็น Annualized

ตลาดหุ้นไทย อยู่ในภาวะซบเซา กินเวลานานที่สุดที่เคยมีมา



SET Index Target for 2024

11-Sep-24

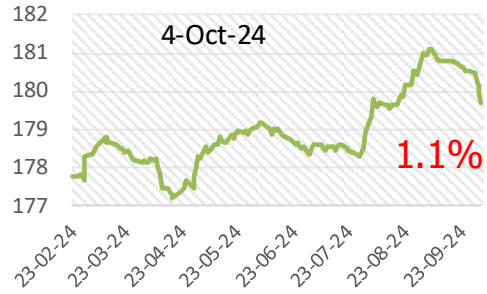
			SET TARGET			
			Worst	Base	Best	
			-0.25 SD	+0 SD	+0.25 SD	
	Net Profit	Net Profit Growth	EPS	16.62	17.28	17.95
Year 2020	453,584	-51%	41.8			
(Exclude THAI)	594,755	-35%	54.9			
Year 2021	1,016,531	124%	89.2			
Year 2022	1,001,815	-1.4%	84.0			
Year 2023	937,784	-6.4%	76.5			
Year 2024						
Base	1,061,657	13.2%	85.9		1542	
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						
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			
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						
Year 2026	1,289,059	7.9%	104.3		1733	
SET Profit for Year 2026 : Estimate Net Profit Growth = 7.9% (Bloomberg Survey ; 9 Sep 24) ; P/E=16.62x (-0.25SD)						

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

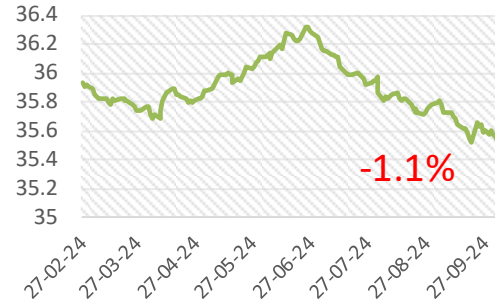
- กำไรของปี 2024 เราปรับขึ้น 5.2% จากประมาณการเดิม เป็น 1.061 ล้านล้านบาท EPS ปรับจาก 81.6 เป็น 85.9 บาท..... ดชนีสิ้นปี คาดจบที่ 1542 จุด
- ปี '25 คาดกำไรขยายตัว 12.5% อยู่ที่ 1.19 ล้านล้านบาท ; EPS 96.6 บาท/หุ้น ค่า Forward P/E อยู่ที่ 14.8x (1431จุด)
- เป้าหมายดัชนี ปี '25 ที่ 1670 จุด โดยใช้ P/E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

การปรับ EPS ตลาดหุ้นสำคัญๆ ปี 2024

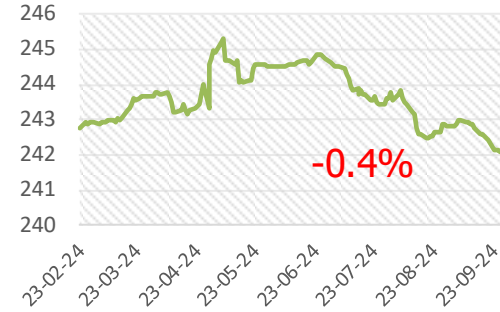
MSCI WORLD



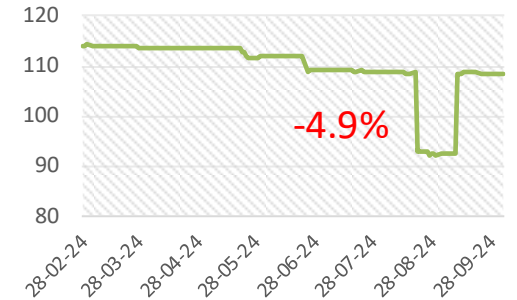
STXE 600 (EUR) Pr



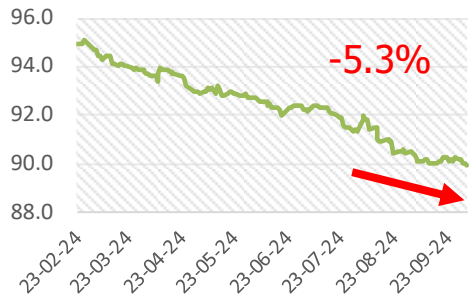
US (s&p-500)



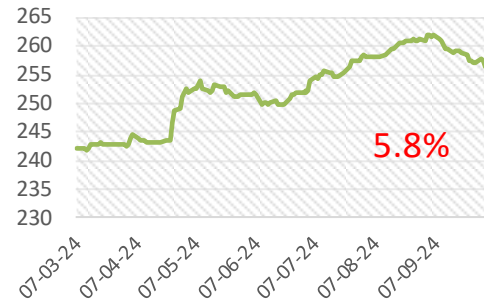
Malaysia



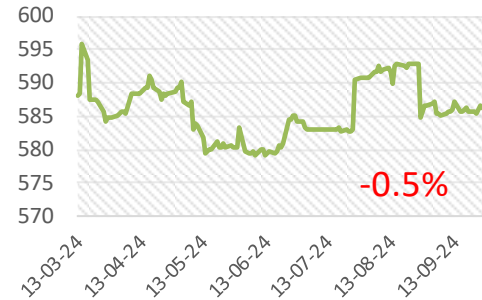
Thailand



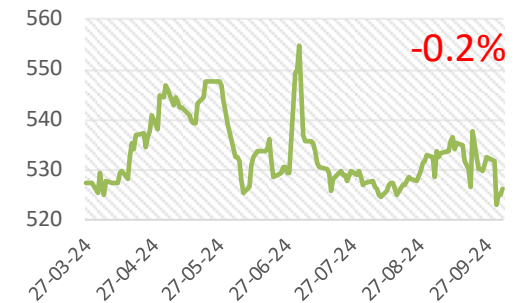
South Korea



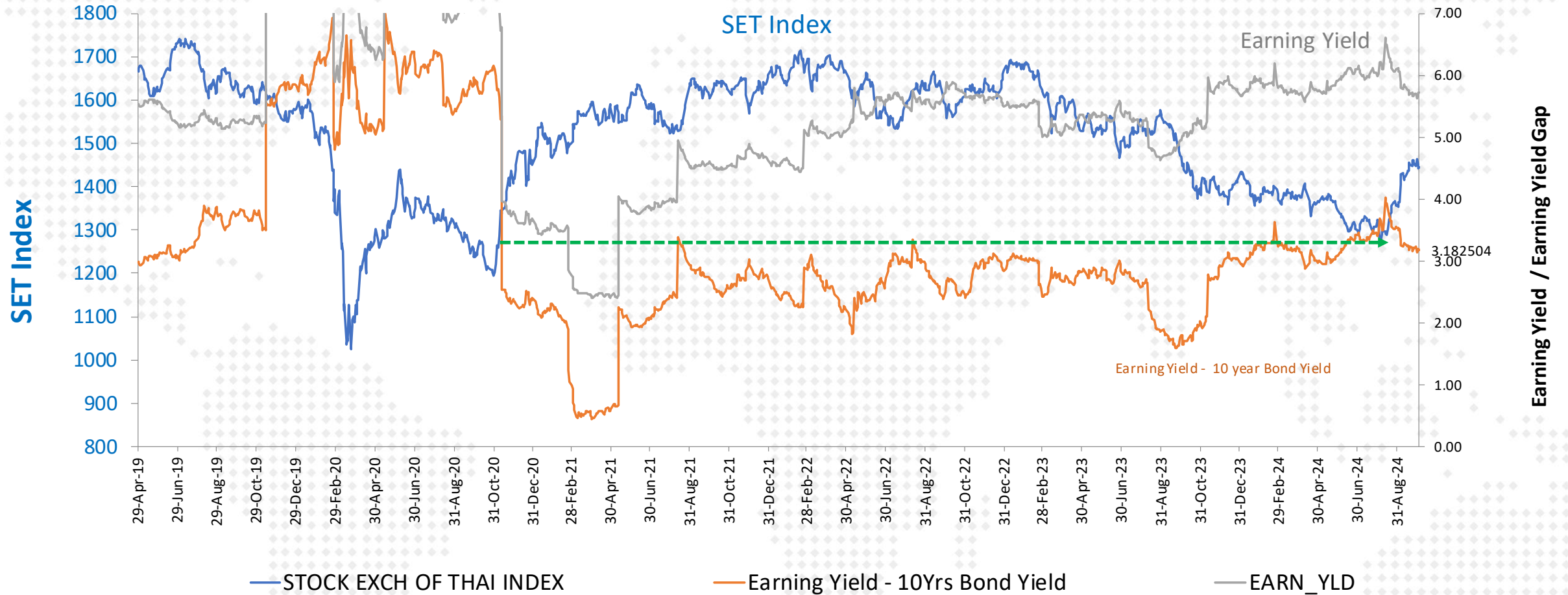
Philippine



Indonesia

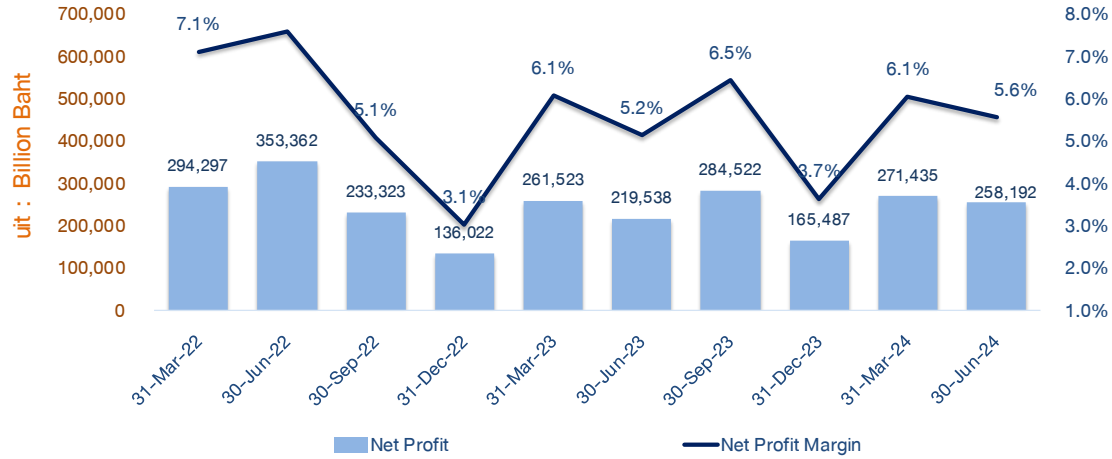


Thai Stock Market (Earning Yield Gap)

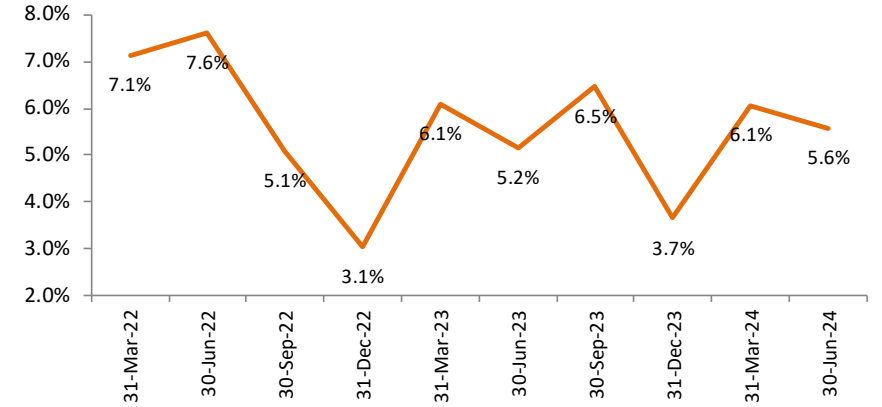


SET Profitability as of 2Q-2024

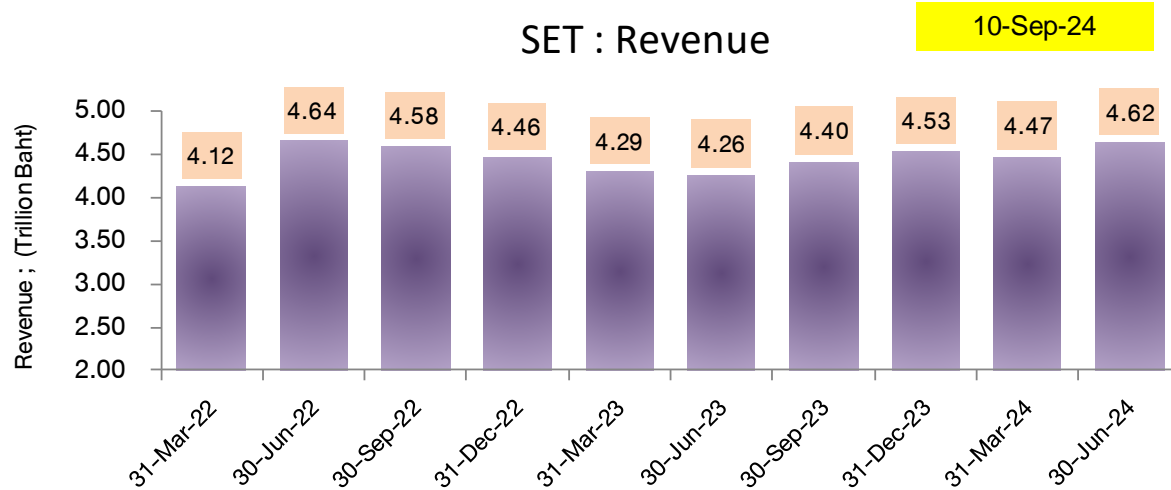
SET : Net Profit & Net Profit Margin



SET : Net Profit Margin

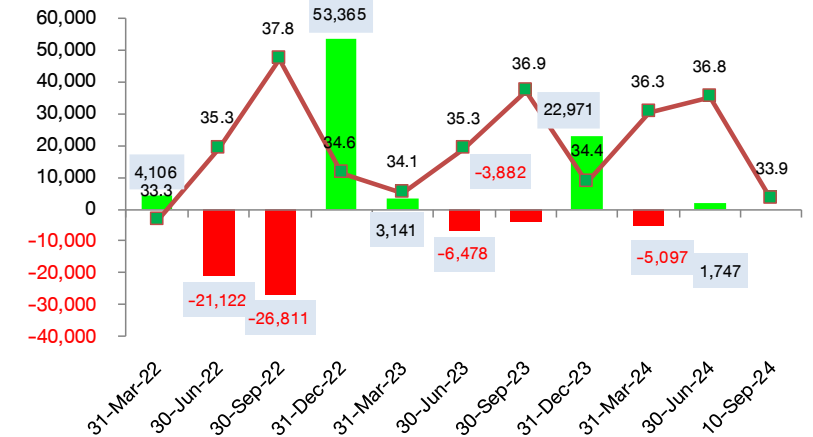


SET : Revenue



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