

Z.com

บริษัทหลักทรัพย์

Morning Zstrategy

October 3, 2023



Market Round Up

SET Index ปิดที่ระดับ 1469.46 จุด -1.97 จุด (-0.13%) โดยมีมูลค่าการซื้อขาย 4.5 หมื่นลบ. ดัชนีแกว่งตัวผันผวนระหว่างวันก่อนจะปิดในแดนลบ แม้จะมีแรงซื้อคืนในหุ้น DELTA หลังนักลงทุน Panic การ Big Lot ในวันศุกร์ที่ผ่านมา รวมทั้งมีแรงซื้อเก็งกำไรในหุ้นกลุ่มโรงพยาบาล และกลุ่มท่องเที่ยวจากการเข้าสู่ High Season นอกจากนี้หุ้นกลุ่มอิเล็กทรอนิกส์ยังปรับตัวขึ้นจากค่าเงินบาทที่อ่อนค่าแรงระหว่างวัน ขณะที่มีความขายในหุ้นกลุ่มธนาคารจากความกังวลหนี้เสียพุ่งหลังธนาคารพาณิชย์เริ่มมีการประกาศขึ้นดอกเบี้ย และหุ้นกลุ่มน้ำมัน-ปิโตรฯ ที่ปรับตัวลงตามราคาน้ำมันดิบ สำหรับหุ้นที่กดดัชนี 5 อันดับแรก ได้แก่ BAY PTT PTTGC TLI และ PTTEP

นักลงทุนต่างชาติและบัญชีบล.พลิกกลับมาเป็นผู้ขายสุทธิ สวนทางกับนักลงทุนรายย่อยและนักลงทุนสถาบันกลับข้างมาเป็นผู้ซื้อสุทธิ

ตลาดตราสารหนี้ไทย Yield Curve ปรับตัวลงประมาณ 2 – 5 bps. ในตราสารระยะยาว โดยนักลงทุนต่างชาติมีสถานะเป็น NET INFLOW 2,435 ลบ.

ค่าเงินบาทเทียบสกุลดอลลาร์สหรัฐฯวานนี้พลิกกลับมาอ่อนค่ารุนแรง โดยปิดที่ 36.94 บาท/ดอลลาร์สหรัฐฯ เทียบกับวันก่อนหน้าที่ 36.48 บาท/ดอลลาร์

Thailand Indices

Index	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
SET Index	1469.46	-0.13%	-2.51%	-5.89%	-2.24%	-11.94%
SET50 Index	901.06	0.20%	-2.43%	-5.85%	-1.98%	-10.36%
SET100 Index	2008.05	0.10%	-2.47%	-5.79%	-1.56%	-11.07%
MAI Index	444.24	-1.40%	-4.25%	-8.33%	-3.38%	-23.95%

Market Turnover - SET

Investor type	Last	Cumulative				Trend
		1-W	1-M	3-M	YTD	
Foreign	MBaht (670)	(1,032)	(21,605)	(50,701)	(157,840)	
Institution	MBaht 492	(1,623)	(4,121)	12,048	51,381	
Proprietary	MBaht (110)	(1,674)	2,197	8,982	1,613	
Retail Customer	MBaht 288	4,330	23,529	29,671	104,846	

SET50 Index Futures Turnover

Investor type	Last	Cumulative				Trend
		1-W	1-M	3-M	YTD	
Future, Foreign	MContracts 5,451	(76,805)	(183,534)	(118,393)	(311,271)	
Future, Institution	MContracts (1,854)	3,104	(7,910)	11,121	54,401	
Future, Retail Customer	MContracts (3,597)	73,701	191,444	107,272	256,870	

Source: Aspen



Market Outlook

⊕ คาด SET Index วันนี้ผันผวนแดนลบจากความกังวล Bond Yield สหรัฐฯ 10 ปี พุ่งขึ้นทำสถิติใหม่และยังมีแนวโน้มปรับตัวขึ้นต่อเนื่อง ซึ่งเป็นผลจากตัวเลขเศรษฐกิจสหรัฐฯยังออกมาแข็งแกร่งหนุนการคง/ขึ้นดอกเบี้ยของ FED ต่อไป ส่งผลให้ค่าเงินดอลลาร์แข็งค่า กดดันราคาน้ำมันดิบ WTI -2.2% เนื่องจากมีความกังวลด้าน Supply กลับมาเพิ่มขึ้นอยู่ก่อนแล้วเป็นลบต่อหุ้นกลุ่มน้ำมัน-ปิโตรฯ อย่างไรก็ตามยังมองเป็นบวกหุ้นกลุ่มสายการบินที่จะผ่อนคลายความกังวลต้นทุนน้ำมันลง นอกจากนี้ การแข็งค่าของดอลลาร์ส่งผลให้เงินบาทอ่อนค่าที่ระดับ 37 บาท/ดอลลาร์ในเช้านี้เป็นการอ่อนค่าที่สุดในรอบ 11 เดือน มองเป็นโอกาสเก็งกำไรในหุ้นกลุ่มส่งออก ให้แนวรับดัชนี 1455 – 1462 จุด แนวต้าน 1475 – 1480 จุด

⊕ กลยุทธ์การลงทุน: สะสมหุ้นกลุ่มส่งออกอาหารสัตว์เลี้ยง สายการบิน อิเล็กทรอนิกส์

⊕ ประเด็นที่น่าจับตา: ความขัดแย้งระหว่างรัสเซีย-ยูเครน, ประชุมคณะกรรมการ OPEC+, ประเด็นการผิมนัดชำระหนี้ของ Evergrande, ตัวเลขภาคแรงงานสหรัฐฯ (JOLTS / ตัวเลขจ้างงานภาคเอกชน / ตัวเลขผู้ขอรับสวัสดิการรายสัปดาห์ / ตัวเลขจ้างงานนอกภาคเกษตร), ประชุม ครม.

Strategy Daily Pick

ASIAN	ได้ประโยชน์บาทอ่อน / ตัวเลขส่งออกอาหารสัตว์ฟื้นตัว
AAV	High Season การท่องเที่ยว / น้ำมันลงเป็นบวก
HANA	ได้ประโยชน์บาทอ่อนสุดรอบ 11 เดือน

Fundamental Report

Ztock Daily

ECL:	Support 1.63 – 1.66	Resistance 1.74 – 1.82
NSL:	Support 22.50 – 22.70	Resistance 24.10 – 25.25



Corporate Watch

- ⊕ (+) GULF เดินเครื่องเชิงพาณิชย์โรงไฟฟ้า กัลฟ์ พีดี หน่วยที่ 2 กว่า 662.5 เมกะวัตต์ เรียบร้อยแล้ว หลังมี.ค. COD โรงไฟฟ้า GPD 1 #นสพ.ข่าวหุ้น
- ⊕ (+) RATCH เผยโครงการโรงไฟฟ้าพลังงานลมอีโควิน ขนาดกำลังผลิตติดตั้ง 29.7 เมกะวัตต์ ดำเนินงานโดยบริษัท อีโควิน เอ็นเนอร์จี้ คอร์ปอเรชั่น จำกัด ซึ่งบริษัทร่วมถือหุ้น ร้อยละ 51 ได้เริ่มเดินเครื่องผลิตกระแสไฟฟ้าเชิงพาณิชย์แล้ว เพื่อจำหน่ายให้กับ การไฟฟ้าเวียดนาม (Vietnam Electricity : EVN) ภายใต้สัญญาซื้อขายไฟฟ้า ระยะเวลา 20 ปี #นสพ.หุ้นหุ้น
- ⊕ (+) COCOCO ไฟเขียวลงทุนกว่า 384 ลบ.ขยายการผลิตน้ำมะพร้าวขวดเริ่มสร้าง รายได้ Q1/67 #InfoQuest
- ⊕ (+) STEC พร้อมควัก 1 พันลบ.ให้บ.ย่อยเข้าร่วมทุนให้เช่าอาคาร Data Center หวังรับงานก่อสร้าง #InfoQuest
- ⊕ (+) SENA เปิด 4 โครงการใหม่ Q4/66 โซนกรุงเทพตะวันออก-รามอินทราธิบดี มานด์ตักซื้อก่อนราคาขึ้น #InfoQuest
- ⊕ (+) PROS ส่งซึกครึ่งหลังสดีเสเร่งยื่นซองประมูล-จ่อเซ็นงานใหม่หนุน Backlog แต่ 1.9 พัน ลบ #InfoQuest



Economy Watch

- ⊕ (+/-) ศาลฯ นัดฟังคำสั่งหรือคำพิพากษา 4 บอร์ดกสทช.วันนี้ หัวหน้าระทบแผน แต่งตั้งเลขาธิการคนใหม่ 4 ต.ค. ส่วนดีลเอไอเอสควบ 3BB ยื้อกันไม่เลิก หมอให้ อยากร ให้พิจารณาทันที ตามเงื่อนไขภายใต้พ.ร.บ.กสทช.ปี 61 ไม่รอความเห็นที่ปรึกษาฯ ขณะที่บอร์ดหลายรายเห็นต่าง ขอประชุมนัดพิเศษ เกรงถูกครหาหากเกณฑ์ต่ำกว่าทูล ควบดีแทค #นสพ.ข่าวหุ้น
- ⊕ (0/-) เวลด์แบงก์ หั่น GDP ไทยปี 66 เหลือโต 3.4% จากมุมเดิมที่ 3.9% คาดว่า การส่งออกไทยปีนี้จะหดตัว -2.1% กดดัน อย่างไรก็ตาม เศรษฐกิจไทยโดยรวมยังได้ ท่องเที่ยว-บริโภคเอกชนหนุน #นสพ.ข่าวหุ้น
- ⊕ (0/+) รฟม.เร่งเครื่องขงข้อมูลระบบราง ลุยขง "สุริยะ" เร่งดัน 3 โปรเจกต์ รถไฟฟ้า สายสี "ส้ม-น้ำตาล-รถไฟฟ้าภูเก็ต" วงเงิน 2.2 แสนล้านบาท ให้เดินหน้าต่อพร้อมเสนอ ครม.ไฟเขียวต่อไป #นสพ.ไทยโพสต์
- ⊕ (0/+) เปิดเพิ่ม ครม.3 ต.ค.การรถไฟฯขอกู้เงินฯ 1.8 หมื่นล้าน - ขงรถไฟฯ 20 บาทตลอดสาย คลังเสนอตั้งคณะกรรมการเดินหน้าดิจิทัลวอลเล็ต หลายหน่วยงาน เสนอ ครม.บรรจุบขที่เกิน 1,000 ล้าน #นสพ.กรุงเทพธุรกิจ

Global Watch

⊕ (0/+) เฟด สาขาแอตแลนตาเปิดเผยว่า แบบจำลองคาดการณ์ GDPNow ล่าสุดแสดงให้เห็นว่า เศรษฐกิจสหรัฐขยายตัว 4.9% ในไตรมาส 3/2566 หลังจากมีการขยายตัว 2.0% และ 2.1% ในไตรมาส 1 และ 2 ตามลำดับ #InfoQuest

⊕ (0/-) นางมิเชล โบว์แมน หนึ่งในสมาชิกคณะผู้ว่าการเฟดแสดงความเห็นล่าสุดเมื่อวานนี้ว่า เธอยังคงสนับสนุนให้เฟดเดินหน้าปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ยต่อไป หากมีข้อมูลบ่งชี้ว่าเงินเฟ้อชะลอตัวช้าเกินไป #InfoQuest

⊕ (+/-) สถาบันจัดการด้านอุปทานของสหรัฐ (ISM) เปิดเผยว่า ดัชนีภาคการผลิตของสหรัฐปรับตัวขึ้นสู่ระดับ 49.0 ในเดือนก.ย. ซึ่งเป็นระดับสูงสุดนับตั้งแต่เดือนพ.ย. 2565 และสูงกว่าที่นักวิเคราะห์คาดการณ์ที่ระดับ 47.7 จากระดับ 47.6 ในเดือนส.ค. #InfoQuest

⊕ (+/-) ดัชนีผู้จัดการฝ่ายจัดซื้อ (PMI) ภาคการผลิตขั้นสุดท้ายของสหรัฐ ปรับตัวขึ้นสู่ระดับ 49.8 ในเดือนก.ย. จากระดับ 47.9 ในเดือนส.ค. และสูงกว่าตัวเลขเบื้องต้นที่ระดับ 48.9 อย่างไรก็ดี ดัชนียังคงปรับตัวต่ำกว่าระดับ 50 ซึ่งบ่งชี้ภาวะหดตัวของภาคการผลิตสหรัฐ โดยหดตัวเป็นเดือนที่ 10 ในรอบ 11 เดือน #InfoQuest

⊕ (0/-) รัฐมนตรีว่าการกระทรวงพลังงานของตุรกีเปิดเผยในวันนี้ (2 ต.ค.) ว่า ตุรกีจะส่งน้ำมันดิบมาต่อเป็นงานท่อส่งน้ำมันดิบจากอิรักอีกครั้งในสัปดาห์นี้ หลังจากระงับการใช้ท่อส่งน้ำมันดิบดังกล่าวไปเป็นเวลาราว 6 เดือน #InfoQuest

Economic Calendar

Time	Currency	Event	Actual	Forecast	Last
Monday, October 2, 2023					
21:00	USD	ดัชนี PMI ภาคการผลิตจากสถาบันไอเอสเอ็ม (ISM) (ก.ย.)	49.00	47.70	47.60
22:00	USD	คำกล่าวของนายพาวเวลล์ (Powell) ประธานธนาคารกลางสหรัฐ			
Tuesday, October 3, 2023					
21:00	USD	ตำแหน่งงานว่างเปิดใหม่จาก JOLTs (ส.ค.)		8.830M	8.827M
Wednesday, October 4, 2023					
19:15	USD	การเปลี่ยนแปลงในการจ้างงานภาคนอกภาคเกษตรกรรมจากเอดีพี (ADP) (ก.ย.)		160K	177K
20:45	USD	ดัชนีผู้จัดการฝ่ายจัดซื้อ (PMI) ภาคการบริการ (ก.ย.)	50.20	50.50	
21:00	USD	ดัชนี PMI ภาคการบริการจากสถาบันไอเอสเอ็ม (ISM) (ก.ย.)	53.60	54.50	
21:30	USD	สินค้าคงคลังน้ำมันดิบ			-2.170M
Thursday, October 5, 2023					
11:00	THB	ดัชนีราคาผู้บริโภคของไทย (ปีต่อปี) (ก.ย.)		0.60%	0.88%
19:30	USD	จำนวนคนที่ยื่นขอรับสวัสดิการว่างงานครั้งแรก		210K	204K
Friday, October 6, 2023					
19:30	USD	การจ้างงานนอกภาคการเกษตร (ก.ย.)		163K	187K
19:30	USD	อัตราการว่างงาน (ก.ย.)		3.70%	3.80%
Wednesday, October 11, 2023					
13:00	EUR	ดัชนีราคาผู้บริโภค (CPI) ของเยอรมนี (เดือนต่อเดือน) (ก.ย.)			0.30%
19:30	USD	ดัชนีราคาผู้ผลิต (PPI) (เดือนต่อเดือน) (ก.ย.)			0.70%

Source: Investing.com



Global Indices

Index	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
Dow Jones	33433.35	-0.22%	-1.69%	-4.03%	-2.83%	0.86%
NASDAQ	13307.77	0.67%	0.27%	-5.16%	-3.48%	27.15%
S&P500	4288.39	0.01%	-1.13%	-5.04%	-3.64%	11.69%
JAPAN	31759.88	-0.31%	-2.81%	-2.91%	-4.31%	21.71%
KOREA	2465.07	0.00%	-1.23%	-3.85%	-3.87%	10.22%
TAIWAN	16557.31	1.24%	0.64%	-0.53%	-2.12%	17.11%
HONG KONG	17809.66	0.00%	0.45%	-3.11%	-5.85%	-9.97%
CHINA	3110.48	0.00%	-0.16%	-0.73%	-2.86%	0.69%
PHILLIPINES	6304.53	-0.26%	2.13%	2.00%	-2.53%	-3.99%
INDONESIA	6961.46	0.31%	-0.53%	-0.23%	4.50%	1.62%
VIETNAM	1155.25	0.10%	0.18%	-5.62%	3.13%	14.71%
INDIA	65828.41	0.00%	-0.30%	0.67%	1.71%	8.20%
RUSSIA	992.18	-1.53%	-0.49%	-5.99%	0.94%	2.22%
GERMANY	15247.21	-0.91%	-1.03%	-3.74%	-5.58%	9.51%
FRANCE	7068.16	-0.94%	-0.78%	-3.13%	-4.49%	9.18%

Source: Aspen

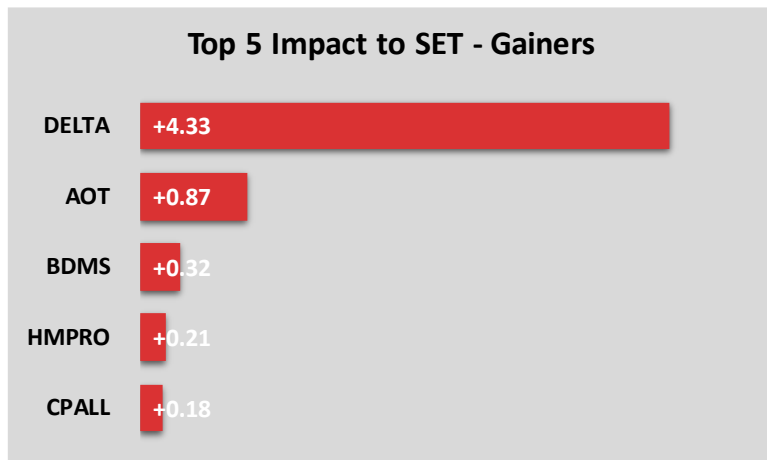
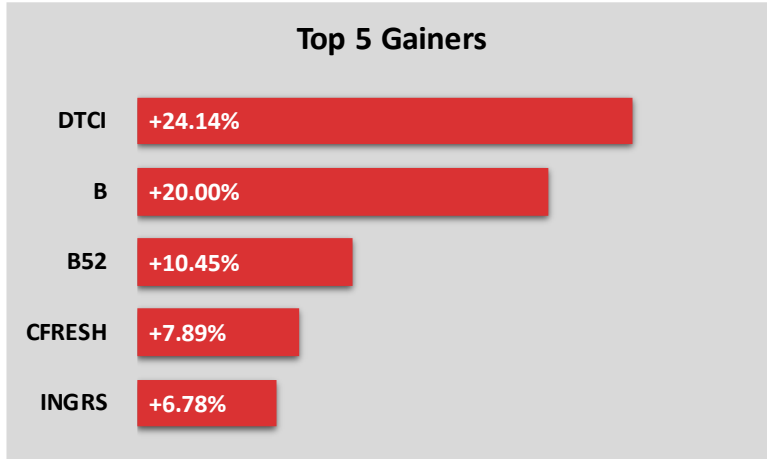
Commodity Price

Commodities	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
Crude WTI (\$/bbls)	88.82	-2.17%	-0.96%	3.82%	25.74%	10.39%
Crude Brent (\$/bbls)	90.71	-1.62%	-2.77%	2.44%	20.29%	5.59%
ICE Heating Oil Spot Month (\$/gallons)	3.22	-2.36%	-1.20%	3.80%	31.66%	-2.07%
ICE RBOB Gasoline Spot (\$/gallons)	2.41	0.50%	-5.19%	-6.91%	-5.23%	-2.78%
Newcastle Coal Spot Month (\$/tonnes)	154.50	-1.18%	-3.89%	-1.12%	3.21%	-60.34%
Baltic Dry Index	1,737.00	2.12%	7.62%	63.10%	59.21%	14.65%
CBOT Soybean Meal Spot (\$/S.tonnes)	368.20	-1.87%	-5.95%	-10.98%	-12.10%	-23.05%
ICE Sugar No.11 Spot Month (\$/lbs)	26.35	-0.49%	-0.87%	2.09%	15.62%	31.49%
CBOT Rough Rice Spot Month (C./100weight)	15.92	0.16%	0.22%	-4.39%	-13.97%	-11.56%
Gold Spot (\$/ounce)	1,827.78	-1.10%	-4.58%	-5.75%	-4.74%	0.23%

Source: Aspen



Market Insight



Disclaimer

The opinions and information presented in this report are those of the **GMO-Z com Securities (Thailand) Public Company Limited** Research Group. **GMO-Z com Securities (Thailand) Public Company Limited** Accepts no liability whatsoever for any loss arising from the use of this report or its contents. This report (in whole or in part) may not be reproduced or published without the express permission of **GMO-Z com Securities (Thailand) Public Company Limited**



Research Group

Sutthivit Tesanaboon, CISA

Fundamental Analyst

Sec No. 028533

(+66) 2 088 8158

sutthivit.t@zcomsec.com

Tanawin Pichatsiriporn

Fundamental Analyst

Sec No. 065325

(+66) 2 088 8156

tanawin.p@zcomsec.com

Z.com
บริษัทหลักทรัพย์



<http://trade.z.com/th>



[facebook.com/trade.z.com.th](https://www.facebook.com/trade.z.com.th)



@zcomsecurities

