

Z.com

บริษัทหลักทรัพย์

Morning Zstrategy

June 12, 2023



Market Round Up

SET Index ปิดที่ระดับ 1555.11 จุด -4.39 จุด (-0.28%) โดยมีมูลค่าการซื้อขาย 4.3 หมื่นลบ. ดัชนีแกว่งตัวในกรอบแคบและมีมูลค่าการซื้อขายลดลงหลังขาดปัจจัยใหม่ๆ หลังปรับตัวขึ้นแรงในวันก่อน โดยมีแรงขายทำกำไรในหุ้นที่ปรับตัวขึ้นวันก่อนขณะที่แรงซื้อเบาบางและจำกัด ทั้งนี้หุ้น JMT ปรับตัวขึ้นเด่นหลังรายงานการซื้อหนี้ด้วยคุณภาพมูลค่านี้กว่า 60,000 ลบ. ขณะที่หุ้น STARK ยังปรับตัวลงต่อเนื่องหลังมีข่าวสมาคมบลจ. เตรียมฟ้องทำให้นักลงทุนคาดหวังการเติบโตในระยะยาว สำหรับหุ้นที่ติดดัชนี 5 อันดับแรก ได้แก่ DELTA SCC CPN MINT และ EA

นักลงทุนต่างชาติพลิกกลับมาเป็นผู้ขายสุทธิตามนักลงทุนรายย่อย สวนทางกับนักลงทุนสถาบันและบัญชีบล.ที่ยังคงเป็นผู้ซื้อสุทธิ





ตลาดตราสารหนี้ไทย Yield Curve ปรับตัวขึ้นประมาณ 1 – 3 bps. โดยนักลงทุนต่างชาติมีสถานะเป็น NET OUTFLOW 282 ลบ.

ค่าเงินบาทเทียบสกุลดอลลาร์สหรัฐเมื่อวันศุกร์ที่ผ่านมาแข็งค่าต่อ โดยปิดที่ 34.57 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ เทียบกับวันก่อนหน้าที่ปิด 34.62 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ




Thailand Indices

Index	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
SET Index	1555.11	-0.28%	1.56%	-0.61%	-3.66%	-6.80%
SET50 Index	941.58	-0.46%	1.80%	-0.80%	-2.16%	-6.33%
SET100 Index	2096.69	-0.37%	1.81%	-0.92%	-3.19%	-7.14%
MAI Index	501.30	0.95%	2.98%	-0.27%	-11.23%	-14.18%

Market Turnover - SET

Investor type	Last	Cumulative				
		1-W	1-M	3-M	YTD	Trend
Foreign	MBaht (1,504)	844	(35,825)	(64,386)	(100,483)	
Institution	MBaht 1,352	3,375	23,467	40,617	39,146	
Proprietary	MBaht 435	35	(395)	(8,555)	(5,549)	
Retail Customer	MBaht (284)	(4,254)	12,753	32,324	66,886	

SET50 Index Futures Turnover

Investor type	Last	Cumulative				
		1-W	1-M	3-M	YTD	Trend
Future, Foreign	MContracts (20,343)	17,883	15,871	90,948	(165,634)	
Future, Institution	MContracts 3,364	(3,409)	(4,356)	9,027	42,485	
Future, Retail Customer	MContracts 16,979	(14,474)	(11,515)	(99,975)	123,149	

Source: Aspen



Market Outlook

⊕ คาด SET Index วันนี้ผันผวนบวก หลังล่าสุด กต.เตรียมประกาศรับรอง 500 ส.ส. ภายในเดือน มิ.ย. บ่งชี้ถึงความคืบหน้าในกระบวนการจัดตั้งรัฐบาล อย่างไรก็ตาม อาจมีกระแสหลักมาชะลอการไหลเข้าของ Fund flow บางส่วนจาก การรายงานตัวเลขดัชนี CPI สหรัฐฯ ในวันที่ 13 มิ.ย. และตามมาด้วยการประชุม FED ในวันที่ 14 มิ.ย. แม้การคาดการณ์ของตลาดจะให้น้ำหนักไปทางการคงอัตราดอกเบี้ย แต่ดัชนีได้ปรับตัวขึ้น สะท้อนประเด็นดังกล่าวไปบางส่วนแล้ว หากผลการประชุมออกมาไม่เป็นไปตามคาด จะส่งผลให้ดัชนีผันผวนลงแรง นอกจากนี้ ล่าสุดราคาน้ำมันดิบ WTI -1.57% หลังมีกระแสข่าว แคนาดาเพิ่มแท่นขุดเจาะน้ำมันหลังเหตุการณ์ไฟป่าในช่วงต้นปีคลี่คลายลง ส่งผลให้แนวโน้ม Supply น้ำมันดิบสูงขึ้น กดดันหุ้นกลุ่มน้ำมัน-ปิโตรฯ ด้านปัจจัยในประเทศ แบงก์ชาติรายงานอัตราการเข้าพักโรงแรมโดยเฉลี่ยอ่อนตัว เป็นลบหุ้นกลุ่มท่องเที่ยวโดยรวมให้แนวรับดัชนี 1546 – 1550 จุด แนวต้าน 1560 – 1567 จุด

⊕ กลยุทธ์การลงทุน: เก็งกำไรหุ้นในสายการบิน และสะสมหุ้น Big Cap รับ Fund Flow ไหลกลับ

⊕ ประเด็นที่น่าจับตา: ความขัดแย้งระหว่างรัสเซีย-ยูเครน, การแพร่ระบาดของ COVID สายพันธุ์ใหม่, ความคืบหน้าในการจัดตั้งรัฐบาลไทย, การประชุม FED ในวันที่ 13 – 14 มิ.ย. และตามด้วยถ้อยแถลงนโยบายของประธาน FED 22 มิ.ย., ดัชนี CPI และ PPI

สหรัฐฯ, ประชุม ECB, ดัชนีภาคการผลิตจีน

Strategy Daily Pick

AAV	ราคาน้ำมันดิบปรับลงเป็นบวก / กำไรฟื้นต่อเนื่อง 1 – 2 ปี
BEM	Valuation ไม่รวมสายสีส้มยังมี Upside
ADVANC	หุ้นเป้าหมาย Fund flow ไหลกลับ / ภาวะแข่งขันผ่อนคลาย

Fundamental Report

-

Ztock Daily

ERW:	Support 4.48 – 4.52	Resistance 4.84 – 4.96
STI:	Support 4.66 – 4.82	Resistance 5.00 – 5.75



Corporate Watch

- ⊕ (+) MAJOR ลุ้นจ่ายเงินปันผลพิเศษจากกำไรขายหุ้น MPIC รวบรวม 228 ล้านบาทบวกกับตั้งแต่ไตรมาส 2 เข้าช่วงไฮซีซั่น มีหนังสือฟอร์มยักษ์จ่อคิวเข้าฉายเพียง ๒ ชั่วโมง
- ⊕ (+) PTT ผนึก CATL อัดงบลงทุนกว่า 3.6 พันล้านบาท ตั้งโรงงานแบตเตอรี่ลิเทียมไอออน Cell-To-Pack ในไทย ขนาด 6 กิกะวัตต์ช่วงไตรมาส ๒ พร้อมเดินสายการผลิตภายในปี 67 วางเป้าสู่ผู้ผลิตแบตเตอรี่ครบวงจรในอาเซียน #นสพ.ข่าวหุ้น
- ⊕ (+) STEC เคาะใส่เงินเพิ่มทุนอีก 1.2 พันล้านบาท ตามสัดส่วนถือหุ้น 20% ลุยโครงการพัฒนาสนามบินอู่ตะเภาและเมืองการบินภาคตะวันออก 2.9 แสนล้านบาท พร้อมใช้เครื่องมือทางการเงิน ทั้งเงินกู้ เงินทุนหมุนเวียน มั่นใจโครงการคุ้มค่า เติบโตตามการพัฒนาพื้นที่ EEC รอผลตอบแทนระยะยาวจากเงินปันผล-กำไรจากเงินลงทุน #นสพ.ข่าวหุ้น
- ⊕ (+) TSE แยมดีลซื้อโรงไฟฟ้าไซลาร์ 2-3 แห่ง ต่อยอดกำลังการผลิต มองโอกาสคว้า "Private PPA" เพิ่ม พร้อมศึกษาโครงการต่างประเทศทั้งเวียดนาม ใต้หวัน รอเซ็น PPA ภาครัฐที่ชนะประมูล จำนวน 88 เมกะวัตต์ มั่นใจรายได้ทั้งปีแตะ 3 พันล้านบาท แกรมรายได้คาร์บอนเครดิตหนุน #นสพ.ทันหุ้น



Economy Watch

- ⊕ (0/-) คนไทยผ่อนต่อไม่ไหว แค่ 5 เดือน ไฟแนนซ์ยึดรถแล้ว 9 หมื่นคัน คาดทั้งปีพุ่ง 2.5 แสนคัน #นสพ.มติชน
- ⊕ (0/+) กทพ.ลุยโครงการทางด่วน สายเมืองใหม่-เกาะแก้ว-กะทู้ จ.ภูเก็ต 4.5 หมื่นล้านบาท คาดเสนอรัฐบาลขออนุมัติได้ภายในปี 66-67 สตาร์ทก่อสร้างปี 68 เปิดใช้งานปี 71 #นสพ.ข่าวหุ้น
- ⊕ (0/+) ททท. ประสานกระทรวงต่างประเทศผูก Visa Plus Streaming ลดขั้นตอนการออกวีซ่าจีนเที่ยวไทย ดันนักท่องเที่ยวต่างชาติเที่ยวไทยทั้งปีแตะกรอบบน 30 ล้านคน ชู 5 เดือนปริมาณนักท่องเที่ยวแตะ 10 ล้านคนแล้ว ผนึกพันธมิตร เพิ่มจุดท่องเที่ยว จัดกิจกรรมดึงดูดกระตุ้นไทยเที่ยวไทย ช่วงโลว์ซีซั่น #นสพ.ทันหุ้น
- ⊕ (0/+) สปสช. หารือ สธ. ใช้เทคโนโลยีลดภาระแพทย์ ทั้งเชื่อมต่อระบบลดเอกสาร จนถึงเทเลเมดิซีน #นสพ.ทันหุ้น
- ⊕ (0/+) กกต. เล็งประกาศรับรอง 500 ส.ส. ภายในมิถุนายน รอสอยทีหลัง เหตุทำไม่ทัน! #นสพ.มติชน
- ⊕ (0/-) ธนาคารแห่งประเทศไทย (ธปท.) เปิดเผยผลสำรวจดัชนีเชื่อมั่นผู้ประกอบการที่พักแรม ประจำเดือน พ.ค. 2566 จากผู้ประกอบการที่พักแรม 110 แห่ง ระหว่างวันที่ 10-25 พ.ค. 2566 ซึ่งจัดทำร่วมกับสมาคมโรงแรมไทย พบว่า อัตราการเข้าพักเฉลี่ยในเดือน พ.ค. 2566 อยู่ที่ 51% ลดลงจากเดือนก่อน #นสพ.ฐานเศรษฐกิจ

Global Watch

⊖ (-) เบเกอร์ ฮิวจ์ บริษัทบริการด้านน้ำมันของสหรัฐฯเปิดเผยในช่วงบ่ายวันศุกร์ว่า แคนาดาเพิ่มแท่นขุดเจาะน้ำมัน 34 แท่นในสัปดาห์นี้ แต่ระดับ 85 แท่น ขณะที่สหรัฐฯ เพิ่มแท่นขุดเจาะน้ำมันเพียง 1 แท่นแต่ 556 แท่นในสัปดาห์นี้ บรรดาบริษัทน้ำมันได้ ดำเนินการที่จะเริ่มการผลิตน้ำมันในรัฐแอลเบอร์ตาของแคนาดา หลังจากที่ปิดการผลิตน้ำมันราว 300,000 บาร์เรลต่อวันในช่วงต้นเดือนพ.ค.ท่ามกลางการเกิดภาวะไฟป่าในรัฐดังกล่าว #InfoQuest

⊖ (0/+) นักลงทุนรอดูข้อมูลเศรษฐกิจที่สำคัญของจีนในสัปดาห์นี้ เพื่อประเมินแนวโน้มเศรษฐกิจ หลังจากข้อมูลก่อนหน้านี้สะท้อนให้เห็นว่าเศรษฐกิจจีนชะลอตัวลงอย่างมาก และทำให้เกิดกระแสคาดการณ์เป็นวงกว้างว่าจีนจะออกมาตรการกระตุ้นเศรษฐกิจ #RYT9

⊖ (0/+) อังกฤษประกาศไม่เก็บภาษีลาภลอยน้ำมันและก๊าซ หากราคาลดต่ำกว่าที่กำหนด 6 เดือนติด#InfoQuest

⊖ (+/-) ผู้กำหนดนโยบายของธนาคารกลางสหรัฐฯ (เฟด) เตรียมที่จะยุติวงจรรักษาอัตราดอกเบี้ยเป็นครั้งแรก หลังจากเริ่มปรับขึ้นเมื่อ 15 เดือนที่แล้ว ท่ามกลางการเผชิญกับภาวะเศรษฐกิจที่กำลังฟื้นตัว และอัตราเงินเฟ้อที่ยังคงอยู่ในระดับสูง ในทางตรงกันข้าม ธนาคารกลางยุโรป (ECB) มีแนวโน้มจะปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ย โดยนักเศรษฐศาสตร์คาดการณ์ว่าจะมีการปรับขึ้นดอกเบี้ยติดต่อกัน 2 ไตรมาส #InfoQuest

Economic Calendar

Time	Currency	Event	Actual	Forecast	Last
Tuesday, June 13, 2023					
13:00	EUR	ดัชนีราคาผู้บริโภค (CPI) ของเยอรมนี (เดือนต่อเดือน) (พ.ค.)		-0.10%	-0.10%
19:30	USD	ดัชนีราคาผู้บริโภคพื้นฐาน (Core CPI) (เดือนต่อเดือน) (พ.ค.)		0.40%	0.40%
19:30	USD	ดัชนีราคาผู้บริโภค (CPI) (เดือนต่อเดือน) (พ.ค.)		0.30%	0.40%
19:30	USD	ดัชนีราคาผู้บริโภค (CPI) (ปีต่อปี) (พ.ค.)			4.90%
Wednesday, June 14, 2023					
13:00	GBP	GDP (เดือนต่อเดือน) (เม.ย.)		0.30%	-0.30%
19:30	USD	ดัชนีราคาผู้ผลิต (PPI) (เดือนต่อเดือน) (พ.ค.)		0.20%	0.20%
21:30	USD	สินค้าคงคลังน้ำมันดิบ			-0.451M
Thursday, June 15, 2023					
1:00	USD	การคาดการณ์เศรษฐกิจของคณะกรรมการนโยบายธนาคารกลางแห่งสหรัฐฯ			
1:00	USD	แถลงการณ์ของคณะกรรมการนโยบายการเงินธนาคารกลางสหรัฐฯ			
1:00	USD	การตัดสินใจเกี่ยวกับอัตราดอกเบี้ย		5.25%	5.25%
1:30	USD	การแถลงข่าวต่อสื่อมวลชนของคณะกรรมการกำหนดนโยบายการเงิน (FOMC) ของสหรัฐฯ			
5:45	NZD	ดัชนีจีดีพี (GDP) (ไตรมาสต่อไตรมาส) (ไตรมาส 1)		-0.10%	-0.60%
9:00	CNY	ดัชนีการผลิตภาคอุตสาหกรรมของจีน (ปีต่อปี) (พ.ค.)		4.10%	5.60%
19:15	EUR	อัตราดอกเบี้ยเงินฝากของสถาบันการเงินที่ฝากไว้กับธนาคารกลาง (มิ.ย.)		3.50%	3.25%
19:15	EUR	การตัดสินใจเกี่ยวกับอัตราดอกเบี้ย (มิ.ย.)		4.00%	3.75%
19:30	USD	ดัชนียอดขายปลีกพื้นฐาน (Core Retail Sales) (เดือนต่อเดือน) (พ.ค.)			0.40%

Source: Investing.com



Global Indices

Index	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
Dow Jones	33833.61	0.00%	0.21%	0.81%	4.89%	2.07%
NASDAQ	13238.52	0.00%	-0.02%	8.69%	16.76%	26.48%
S&P500	4293.93	0.00%	0.27%	4.24%	9.59%	11.84%
JAPAN	32265.17	1.97%	2.35%	10.34%	12.72%	23.65%
KOREA	2641.16	1.16%	1.53%	5.22%	9.18%	18.10%
TAIWAN	16886.40	0.91%	1.07%	7.37%	7.07%	19.44%
HONG KONG	19389.95	0.47%	2.32%	-2.40%	-2.69%	-1.98%
CHINA	3231.41	0.55%	0.04%	-3.76%	-1.36%	4.60%
PHILLIPINES	6507.15	-0.49%	-0.07%	-1.74%	-1.55%	-0.90%
INDONESIA	6694.02	0.42%	0.92%	-1.27%	-1.56%	-2.29%
VIETNAM	1107.53	0.56%	1.53%	5.10%	4.88%	9.97%
INDIA	62625.63	-0.35%	0.13%	1.40%	4.71%	2.93%
RUSSIA	1032.85	0.00%	-1.78%	1.33%	8.61%	6.41%
GERMANY	15957.60	-0.20%	-0.58%	0.01%	2.08%	14.61%
FRANCE	7204.97	-0.24%	-0.90%	-2.60%	-1.52%	11.29%

Source: Aspen

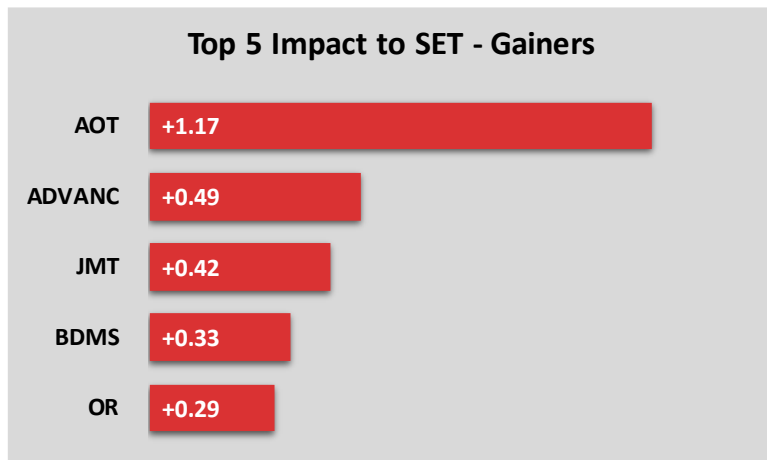
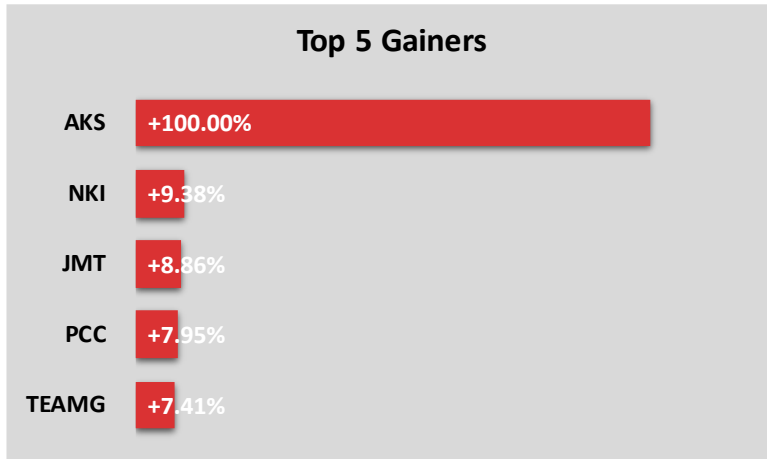
Commodity Price

Commodities	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
Crude WTI (\$/bbls)	71.56	0.38%	-0.25%	-2.92%	-5.49%	-11.06%
Crude Brent (\$/bbls)	76.25	0.38%	0.16%	-1.54%	-6.54%	-11.24%
ICE Heating Oil Spot Month (\$/gallons)	2.39	0.17%	1.57%	0.17%	-10.30%	-27.26%
ICE RBOB Gasoline Spot (\$/gallons)	2.62	0.38%	4.88%	5.77%	0.69%	5.72%
Newcastle Coal Spot Month (\$/tonnes)	136.25	0.00%	4.01%	-19.38%	-24.31%	-65.03%
Baltic Dry Index	1,040.00	0.00%	13.17%	-34.92%	-24.58%	-31.35%
CBOT Soybean Meal Spot (\$/S.tonnes)	405.80	0.47%	2.06%	-3.20%	-16.79%	-15.19%
ICE Sugar No.11 Spot Month (\$/lbs)	25.88	1.57%	4.65%	-1.18%	22.36%	29.14%
CBOT Rough Rice Spot Month (C./100weight)	18.64	-0.77%	5.79%	2.19%	14.36%	3.56%
Gold Spot (\$/ounce)	1,966.01	0.04%	0.95%	-3.34%	7.47%	7.81%

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

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

