

# Z.com

บริษัทหลักทรัพย์

## Morning Zstrategy

October 16, 2023



## Market Round Up

☉ SET Index ปิดที่ระดับ 1450.75 จุด -5.24 จุด (-0.36%) โดยมีมูลค่าการซื้อขายเบาบางลงมาอยู่ที่ 3.7 หมื่นลบ. ส่วนหนึ่งมาจากแรงขายก่อนวันหยุดยาวสุดสัปดาห์ของไทยเพื่อปิดความเสี่ยง ท่ามกลางประเด็นความรุนแรงที่เกิดขึ้นระหว่างอิสราเอลกับกลุ่มฮามาสอาจขยายวงกว้าง และสร้างความกังวลต่อการฟื้นตัวของเศรษฐกิจโลก ตลอดจนจรรยาบรรณตัวเลขเศรษฐกิจที่สำคัญ อาทิ ดัชนี CPI ของสหรัฐฯ ที่อาจมาสร้างความผันผวนต่อทิศทางดอกเบี้ยของ FED อย่างไรก็ตาม มีแรงเก็งกำไรในหุ้นกลุ่มธนาคารเข้ามาพยุงดัชนีได้บางส่วน เนื่องจากเป็นช่วงการ Review ผลประกอบการไตรมาส 3/66 สำหรับหุ้นที่กุดตันดัชนี 5 อันดับแรก ได้แก่ DELTA GULF JMT AOT และ OR

☉ นักลงทุนต่างชาติพลิกกลับมาเป็นผู้ขายสุทธิตามนักลงทุนรายย่อย ขณะที่นักลงทุนสถาบันและบัญชีบล.ยังเป็นผู้ซื้อสุทธิ





☉ ตลาดตราสารหนี้ไทย Yield Curve ปรับตัวลงประมาณ 2 – 4 bps. ในตราสารระยะยาว โดยนักลงทุนต่างชาติมีสถานะเป็น NET INFLOW 1,869 ลบ.

☉ ค่าเงินบาทเทียบสกุลดอลลาร์สหรัฐฯเมื่อวันศุกร์ที่ผ่านมาแข็งค่าต่อ โดยปิดที่ 36.20 บาท/ดอลลาร์สหรัฐฯ เทียบกับวันก่อนหน้าที่ 36.38 บาท/ดอลลาร์




### Thailand Indices

Index	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
SET Index	1450.75	-0.36%	0.86%	-5.51%	-2.90%	-13.06%
SET50 Index	890.26	-0.37%	1.52%	-5.42%	-3.42%	-11.44%
SET100 Index	1982.36	-0.44%	1.28%	-5.41%	-2.67%	-12.20%
MAI Index	432.31	-0.11%	-0.81%	-7.89%	-4.15%	-25.99%

### Market Turnover - SET

Investor type	Last	Cumulative				
		1-W	1-M	3-M	YTD	Trend
Foreign	MBaht (1,760)	2,854	(16,320)	(45,856)	(163,171)	
Institution	MBaht 1,895	2,489	2,198	12,170	56,849	
Proprietary	MBaht 199	(59)	(1,257)	6,844	(8)	
Retail Customer	MBaht (334)	(5,284)	15,380	26,842	106,330	

### SET50 Index Futures Turnover

Investor type	Last	Cumulative				
		1-W	1-M	3-M	YTD	Trend
Future, Foreign	MContracts (23,865)	6,212	(104,719)	(154,365)	(314,493)	
Future, Institution	MContracts 3,357	(8,006)	(13,877)	(4,497)	50,411	
Future, Retail Customer	MContracts 20,508	1,794	118,596	158,862	264,082	

Source: Aspen



## Market Outlook

⊕ คาค SET Index วันนี้ผันผวนแดนลบ หลังปัจจัยเสี่ยงภูมิรัฐศาสตร์จากประเด็นสงครามในตะวันออกกลางระหว่างอิสราเอล-ฮามาส เริ่มมีแนวโน้มขยายวงกว้าง หลังล่าสุดอิหร่านย้ำจุดยืนในการสนับสนุนฮามาสและการโจมตีของอิสราเอลยังไม่มีที่ท่าหยุดลง ส่งผลให้ Fund flow ไหลออกจากสินทรัพย์เสี่ยง (หุ้นลบ ทองคำบวก) นอกจากนี้สหรัฐฯได้มีการแบนบริษัทชิปปีงของรัสเซีย ซ้ำเติมความกังวลด้าน Supply น้ำมันดิบโลก ส่งผลให้ราคาน้ำมันดิบ WTI +5.8% มองเป็นบวกต่อหุ้นกลุ่มน้ำมัน-ปิโตรฯ เข้ามาช่วยจำกัด Downside ของดัชนีได้บางส่วน ส่วน Commodity อื่นๆ ราคาขยับ +9.98% เป็นโอกาสเข้าเก็งกำไรหุ้นกลุ่มผู้ส่งออกยางให้แนวรับดัชนี 1435 –1440 จุด แนวต้าน 1455 –1458 จุด

⊕ กลยุทธ์การลงทุน: เก็งกำไรหุ้นที่ได้ประโยชน์จากราคาน้ำมัน และหุ้นกลุ่มยาง

⊕ ประเด็นที่น่าจับตา: ความขัดแย้งระหว่างรัสเซีย-ยูเครน, สงครามอิสราเอล – ฮามาส - ชาติดาฮ์บ, ประเด็นการผิदनัดชำระหนี้ ของ Evergrande, ตัวเลขจ้างงานนอกภาคเกษตร, รายงานแนวโน้มพลังงานระยะสั้น EIA, ข้อเสนอปรับนโยบายเงินดิจิทัลวอลเล็ต

## Strategy Daily Pick

TOP	ได้ประโยชน์ราคาน้ำมันดิบปรับตัวขึ้นแรง
BCP	ได้ประโยชน์ราคาน้ำมันดิบปรับตัวขึ้นแรง
NER	ได้ประโยชน์ราคาขยับปรับตัวขึ้นแรง

## Fundamental Report

## Ztock Daily

MOSHI:	Support 55.00 – 55.75	Resistance 59.75 – 63.25
PJW:	Support 4.08 – 4.12	Resistance 4.24 – 4.44



## Corporate Watch

⊕ (+) RT ประสบความสำเร็จเจาะอุโมงค์ส่งน้ำช่วงแม่แตง-แม่จัด สัญญา 1 มูลค่า 2,814 ล้านบาท ระยะทาง 9 กิโลเมตร เรียบร้อยแล้ว พร้อมส่งมอบงานกรมชลประทาน Q3 งานเข้ามาต่อเนื่อง Backlog ทะลุ 1 หมื่นล้าน รั้งรายได้ถึงปี 72 #นสพ.ข่าวหุ้น

⊕ (+) NRF อดุลย ก.ล.ต.สหรัฐให้บริษัทลูก แคมบรู มาร์ท ควรรวมกิจการกับ Kairous Asia รุกธุรกิจร่วมทุน ประกาศเดินหน้าระดมทุนใน NASDAQ กลางปีหน้า ชี้หลังเข้าตลาดจะเข้าควรรวมกิจการต่อเนื่อง ดันเติบโตปีละ 30-50% ขณะที่ยอดขายเครื่องปรุงรสโดดเด่น บาทอ่อนค่าหนุน โรงงาน Plant-Base เดินเครื่องแล้ว ชูปีนี้ไวไฮ #นสพ.ทันหุ้น

⊕ (+) ILM วางแผนขยายสาขาปี 2567 เตรียมเปิด Index Living Mall เพิ่มเติม 2-3 สาขา และโครงการ LITTLE WALK เพิ่มอีก 2 แห่ง เล็งเพิ่มพื้นที่เช่าประมาณปีละ 5,000-8,000 ตารางเมตร #นสพ.ทันหุ้น

⊕ (+) NDR ส่งชกมีลุ้นคว้าออเดอร์อินเดียเพิ่ม ปักธงยอดขายปีนี้ที่ 1 พันล้านบาท ฟากผู้บริหาร "ชัยสิทธิ์ สัมฤทธิ์วณิชชา" เร่งกตต้นทุนหนุนมาร์จิ้นฟู ไชว์กำลังผลิต 80% พร้อมลุยส่งออก เดินหน้าแก้ไข "ETRAN" หวังบู๊ยกยอดคืน หลังตั้งสำรองด้อยค่า 50 ล้านบาท #นสพ.ทันหุ้น

⊕ (+) FTI ตั้งบ.ย่อยซื้อที่ดินใช้สร้างโรงงานผลิตสินค้าพร้อมทำธุรกิจเช่าโรงงาน-พื้นที่ Free Zone #InfoQuest

## Economy Watch

⊕ (0/+) เดินแผนปลูกท่องเที่ยวระลอกใหญ่ หลัง "วีซ่า-ฟรี" ลอดแรงแนักงานท่องเที่ยวจีน ยังไม่มาตามนัด เผยเฟส 2 เพิ่มประเทศวีซ่าฟรี ขยายวันพำนัก พร้อมของบฯ บูสเตอร์ชอต 600 ล้านบาท ดันตลาดช่วงไฮซีซั่น มั่นใจนักท่องเที่ยวต่างชาติปีนี้ถึง 28 ล้านคน รายได้รวม 2.4 ล้านล้านบาท #นสพ.ประชาชาติธุรกิจ

⊕ (0/+) โฆษกประจำสำนักนายกรัฐมนตรีเปิดเผยว่า ตัวเลขจากการทำอากาศยานไทยแสดงว่านักท่องเที่ยวจีนที่จองการเดินทางเข้ามาในประเทศไทย 6.5 แสนคน ก่อนเกิดเหตุการณ์ที่สยามพารากอน ยังคงยืนยันที่พัก และเที่ยวบินมาที่ไทยถึง 5.9 แสนคน ลดน้อยลงเพียง 9.2% ซึ่งถือว่าเป็นความเบี่ยงเบนที่อยู่ในเกณฑ์ปกติ จึงสะท้อนได้ว่านักท่องเที่ยวจีนยังคงมีความเชื่อมั่นที่จะมาเที่ยวเมืองไทยเช่นเดิมไม่เปลี่ยนแปลง #InfoQuest





## Global Watch

⊕ (0/-) ผลสำรวจของมหาวิทยาลัยมิชิแกนระบุว่า ดัชนีความเชื่อมั่นของผู้บริโภคสหรัฐปรับตัวลงสู่ระดับ 63 ในเดือนต.ค. ซึ่งเป็นระดับต่ำสุดนับตั้งแต่เดือนพ.ค. โดยลดลงจากระดับ 68.1 ในเดือนก.ย. และยังคงลดลงมากกว่าการคาดการณ์ของนักวิเคราะห์ซึ่งคาดว่าจะขยับลงแตะ 67.4 #InfoQuest

⊕ (0/-) (Delayed) ดัชนี CPI ทั่วไป (Headline CPI) ซึ่งรวมหมวดอาหารและพลังงาน ปรับตัวขึ้น 3.7% ในเดือนก.ย. เมื่อเทียบรายปี สูงกว่าที่นักวิเคราะห์คาดการณ์ที่ระดับ 3.6% จากระดับ 3.7% ในเดือนส.ค. #InfoQuest

⊕ (-) เจ้าหน้าที่ระดับสูงของอิสราเอล กล่าวหาว่า อิหร่านกำลังพยายามเปิดแนวรบที่สองทางตอนเหนือของอิสราเอลโดยการส่งอาวุธเข้าหรือผ่านซีเรีย ในขณะที่อิสราเอลยกระดับปฏิบัติการรุกตอบโต้ในฉนวนกาซาทางตอนใต้ #InfoQuest

⊕ (0/+) สหรัฐประกาศคว่ำบาตรบริษัทชิปปิง 2 แห่งเมื่อวานนี้ (12 ต.ค.) ซึ่งสหรัฐอ้างว่าจะเมิดเพดานราคาน้ำมันของกลุ่ม G7 โดยเพดานราคาน้ำมันดังกล่าวเป็นกลไกควบคุมซัพพลายน้ำมันจากรัสเซีย และเป็นช่องทางสกัดรายได้ของรัสเซียในการใช้ทำสงคราม กระทรวงการคลังสหรัฐ ระบุในแถลงการณ์ว่า มาตรการดังกล่าวมีขึ้นเพื่อ "ลดกำไรจากการค้าน้ำมันของรัฐบาลรัสเซีย" เพื่อตัดท่อน้ำมันเลี้ยงของรัสเซียในการทำสงครามกับยูเครน #InfoQuest

### Economic Calendar

Time	Currency	Event	Actual	Forecast	Last
Thursday, October 12, 2023					
1:00	USD	รายงานการประชุมของคณะกรรมการนโยบายการเงินของธนาคารกลางสหรัฐ (FOMC)			
19:30	USD	ดัชนีราคาผู้บริโภคพื้นฐาน (Core CPI) (เดือนต่อเดือน) (ก.ย.)	0.30%	0.30%	0.30%
19:30	USD	ดัชนีราคาผู้บริโภค (CPI) (ปีต่อปี) (ก.ย.)	3.70%	3.60%	3.70%
19:30	USD	ดัชนีราคาผู้บริโภค (CPI) (เดือนต่อเดือน) (ก.ย.)	0.40%	0.30%	0.60%
19:30	USD	จำนวนคนที่ยื่นขอรับสวัสดิการว่างงานครั้งแรก	209K	210K	209K
22:00	USD	สินค้าคงคลังน้ำมันดิบ	10.176M	0.492M	-2.224M
Tuesday, October 17, 2023					
19:30	USD	ดัชนียอดขายปลีกพื้นฐาน (Core Retail Sales) (เดือนต่อเดือน) (ก.ย.)		0.20%	0.60%
19:30	USD	ดัชนียอดขายปลีก (เดือนต่อเดือน) (ก.ย.)		0.30%	0.60%
Wednesday, October 18, 2023					
9:00	CNY	ดัชนีจีดีพี (GDP) ของจีน (ปีต่อปี) (ไตรมาส 3)		4.40%	6.30%
16:00	EUR	ดัชนีราคาผู้บริโภค (CPI) (ปีต่อปี) (ก.ย.)		4.30%	5.20%
19:30	USD	รายงานจำนวนใบอนุญาตก่อสร้าง (ก.ย.)	1.455M		1.541M
21:30	USD	สินค้าคงคลังน้ำมันดิบ			10.176M
Thursday, October 19, 2023					
19:30	USD	จำนวนคนที่ยื่นขอรับสวัสดิการว่างงานครั้งแรก		213K	209K
19:30	USD	ดัชนีภาคการผลิตจากธนาคารกลางรัฐฟิลาเดลเฟีย (ต.ค.)		(6.80)	(13.50)
23:00	USD	คำกล่าวของนายพาวเวลล์ (Powell) ประธานธนาคารกลางสหรัฐ			

Source: Investing.com



Global Indices

Index	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
Dow Jones	33670.29	0.12%	0.79%	-2.62%	-2.11%	1.58%
NASDAQ	13407.23	-1.23%	-0.18%	-2.94%	-5.17%	28.10%
S&P500	4327.78	-0.50%	0.45%	-3.13%	-4.04%	12.72%
JAPAN	32315.99	-0.55%	4.26%	-1.19%	-0.32%	23.84%
KOREA	2456.15	-0.95%	1.97%	-3.10%	-5.21%	9.83%
TAIWAN	16782.57	-0.26%	1.59%	1.21%	-1.63%	18.71%
HONG KONG	17813.45	-2.33%	1.87%	-1.09%	-7.94%	-9.95%
CHINA	3088.10	-0.64%	#VALUE!	-1.12%	-4.58%	-0.04%
PHILLIPINES	6266.34	0.05%	0.10%	1.91%	-4.75%	-4.57%
INDONESIA	6926.78	-0.12%	0.56%	-0.13%	1.71%	1.11%
VIETNAM	1154.73	0.27%	2.32%	-6.76%	-0.92%	14.66%
INDIA	66282.74	-0.19%	0.44%	-1.76%	1.10%	8.94%
RUSSIA	1034.11	0.75%	4.76%	0.34%	2.53%	6.54%
GERMANY	15186.66	-1.55%	-0.28%	-2.99%	-5.91%	9.07%
FRANCE	7003.53	-1.42%	-0.80%	-3.03%	-4.97%	8.18%

Source: Aspen

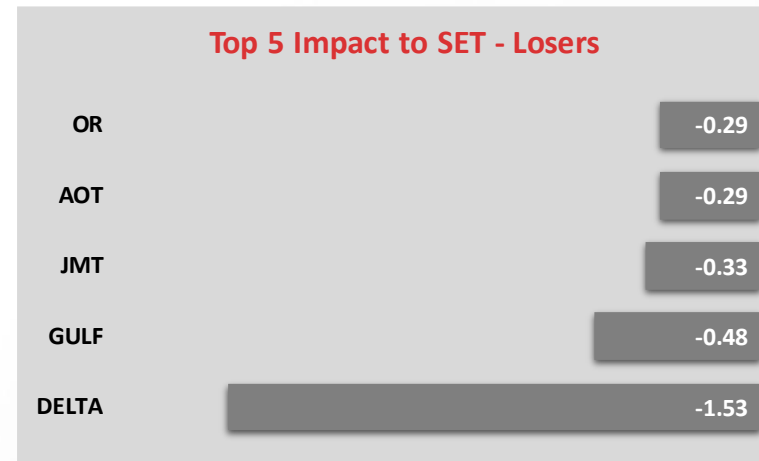
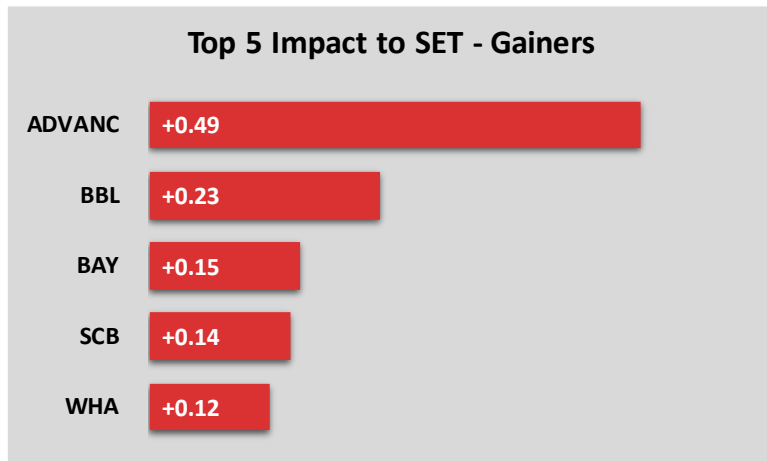
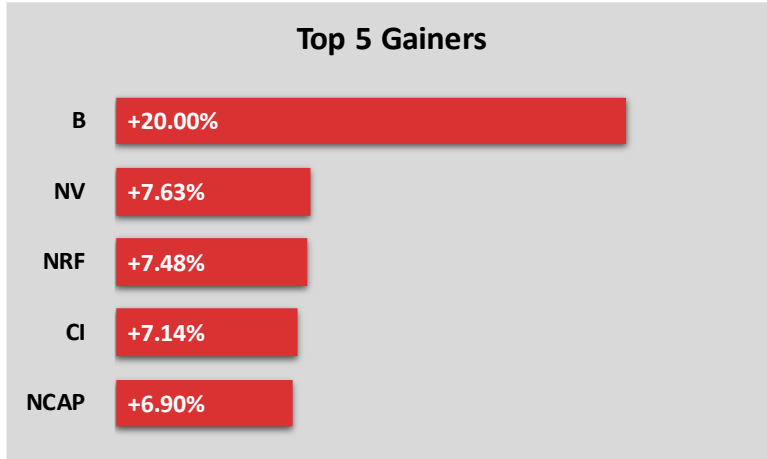
Commodity Price

Commodities	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
Crude WTI (\$/bbls)	87.69	5.77%	5.92%	-0.94%	14.05%	8.99%
Crude Brent (\$/bbls)	90.89	5.69%	7.46%	-1.08%	11.71%	5.80%
ICE Heating Oil Spot Month (\$/gallons)	3.21	5.48%	10.72%	-6.49%	23.07%	-2.40%
ICE RBOB Gasoline Spot (\$/gallons)	2.27	4.62%	3.33%	-17.28%	-15.45%	-8.71%
Newcastle Coal Spot Month (\$/tonnes)	143.85	0.84%	3.86%	-11.34%	12.38%	-63.08%
Baltic Dry Index	1,945.00	0.52%	0.83%	#####	#####	#####
CBOT Soybean Meal Spot (\$/S.tonnes)	390.70	-0.38%	5.08%	-1.36%	-7.33%	-18.35%
ICE Sugar No.11 Spot Month (\$/lbs)	27.03	2.58%	1.08%	1.85%	12.58%	34.88%
CBOT Rough Rice Spot Month (C./100weight)	15.97	0.22%	-0.41%	0.09%	5.03%	-11.28%
Gold Spot (\$/ounce)	1,932.40	3.41%	5.45%	1.28%	-1.40%	5.97%

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

