

Strategy

- **SETESG:** ส่วนผลการเปลี่ยนแปลงรายชื่อสมาชิกของดัชนี SETESG รอบใหม่มีรายละเอียดดังนี้
 - 1) หุ้นที่ถูกนำเข้าสู่ดัชนี SETESG ได้แก่ **BA, BCH, BRI, CK, ERW, HENG, III, ILM, JTS, KSL, LH, MC, NYT, RBF, SMPC, STEC, TCAP, TFG, TOG**
 - 2) หุ้นที่ถูกถอดออกจากดัชนี SETESG ได้แก่ **AAV, ASIAN, BJC, BKI, DELTA, EASTW, PM, SCCC, TKS, TMT, TPIPP, TSTH**
- **Our take:** ส่วนใหญ่เป็นไปตามที่เราคาดการณ์ไว้ โดยมีแค่ **NYT** กับ **TFG** ที่เข้ามาอยู่ในดัชนีโดยที่เราไม่ได้คาดไว้ และมี **BJC** หลุดออกจากดัชนีซึ่งเราไม่ได้คาดไว้เช่นกัน มองตัวหุ้นที่น่าสนใจที่ถูกนำเข้าสู่ดัชนี **SETESG** ในรอบนี้ และในเชิงพื้นฐานเราแนะนำ "ซื้อ" จะได้แก่ **BCH, ERW, LH** โดยมีราคาเป้าหมายที่ **23.20, 6.60, 9.90** บาทตามลำดับ ในทางกลับกัน มีมุมมองเชิงลบต่อ **BJC** จากการที่ตัวหุ้นหลุดออกจากดัชนี **SETESG** และไม่ได้ถูกนำเข้าสู่ดัชนี **SET50/SET100** ทั้งๆที่ดูเหมือนดลท.จะลดเกณฑ์ขั้นต่ำ Turnover ratio ลงมาแล้ว ซึ่งนั่นอาจแปลความได้ว่าตัวเลข Free-float ของ **BJC** ที่ดลท.ใช้ในการคำนวณนั้นอาจต่ำกว่าตัวเลข 20% ที่โชว์อยู่ในฐานข้อมูลของดลท. ณ เวลานี้

ณัฐชาติ เมฆมาสิน, CFA, FRM
เลขทะเบียนนักวิเคราะห์: 031379
nuttachart@trinitythai.com

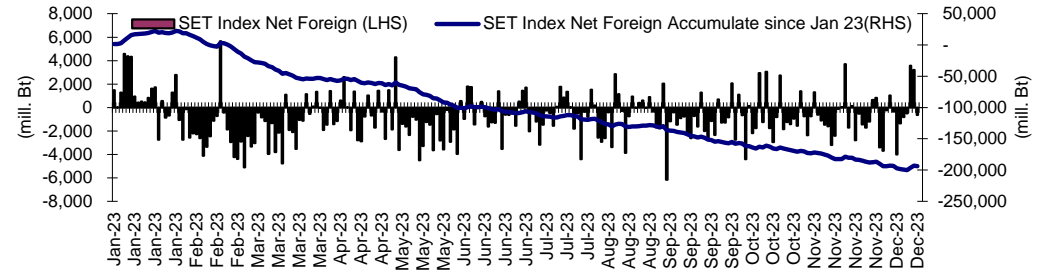
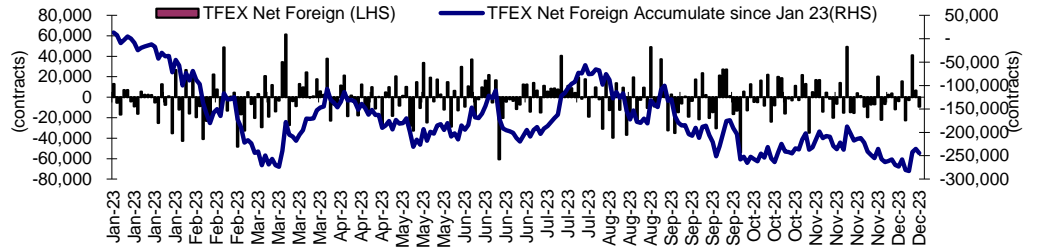
Fund Flow

Foreign Portfolio Investment in Equities (Asia ex. Japan)

	As at	Day	WTD Net	MTD Net	YTD Net
					Unit : US\$ mn
India	15-Dec	1,230.7	2,698.0	5,187.7	19,590.6
Indonesia	18-Dec	24.7	24.7	241.9	-608.5
Malaysia	15-Dec	40.7	30.8	-4.5	-574.2
Philippines	18-Dec	11.2	11.2	36.2	-845.2
South Korea	19-Dec	-85.7	101.3	1,494.0	8,562.0
Sri Lanka	18-Dec	0.1	0.1	0.5	14.7
Taiwan	18-Dec	-92.0	-92.0	1,800.7	3,372.5
Thailand	18-Dec	-19.1	-19.1	-6.8	-5,512.3
Vietnam	18-Dec	-22.9	-22.9	-299.6	-745.4

Source: Bloomberg

Net Foreign



Indicators to watch

	Last	Previous	% chg	1W Prior	1M Prior	Remark
VIX Index	12.56	12.28	2.3%	-0.6%	-6.3%	-
Ted Spread	0.24	0.25	-1.8%	-5.8%	-2.0%	+
U.S.Dollar Index	102.51	102.63	-0.1%	-1.4%	-1.8%	+
U.S.Bond Yield	3.94	3.91	0.7%	-7.8%	-11.4%	+
Emerging Asia Index (MXMS)	529.04	531.10	-0.4%	2.2%	0.8%	-

Source: Bloomberg, Aspen

บริษัทหลักทรัพย์ ตรีเน็ต จำกัด เลขที่ 1 อาคารพาร์ค สยาม ชั้น 22 และห้อง 2301 ชั้น 23 ถนนคอนแวนต์ แขวงสีลม เขตบางรัก กรุงเทพฯ 10500

รายงานฉบับนี้จัดทำขึ้นโดยข้อมูลเท่าที่ปรากฏและเชื่อว่าเป็นที่น่าเชื่อถือได้ แต่ไม่เป็นการยืนยันความถูกต้องและความสมบูรณ์ของข้อมูลนั้นๆ โดยบริษัทหลักทรัพย์ ตรีเน็ต จำกัด ผู้จัดทำของสงวนสิทธิ์ในการเปลี่ยนแปลงความเห็นหรือประมาณการต่างๆ ที่ปรากฏในรายงานฉบับนี้โดยไม่ต้องแจ้งล่วงหน้า รายงานฉบับนี้มีวัตถุประสงค์เพื่อใช้ประกอบการตัดสินใจของนักลงทุน โดยไม่ได้เป็นการย้ําหรือชักชวนให้นักลงทุนทำการซื้อหรือขายหลักทรัพย์ หรือตราสารทางการเงินใดๆ ที่ปรากฏในรายงาน