

Z.com

บริษัทหลักทรัพย์

Morning Zstrategy

May 29, 2023



Market Round Up

SET Index ปิดที่ระดับ 1530.84 จุด -4.58 จุด (-0.30%) โดยมีมูลค่าการซื้อขาย 3.9 หมื่นลบ. ดัชนีแกว่งตัวในกรอบแคบและยังคงมีมูลค่าการซื้อขายเบาบาง โดยนักลงทุนยังคงชะลอการลงทุนเพื่อรอความชัดเจนในการจัดตั้งรัฐบาลของพรรคก้าวไกล รวมทั้งประเด็นการขยายเขตแดนของสหรัฐให้ทันกำหนด 1 มิ.ย. นี้ ทั้งนี้มีแรงขายทำกำไรในหุ้นกลุ่มอิเล็กทรอนิกส์ และหุ้นกลุ่มธนาคารที่มีการปรับตัวขึ้นมาในช่วงก่อนหน้า ขณะที่มีแรงซื้อเข้ามามากในหุ้นกลุ่มค้าปลีก และหุ้นกลุ่มสื่อซึ่งคาดว่าจะได้ประโยชน์จากมาตรการขึ้นค่าแรงขั้นต่ำซึ่งจะช่วยหนุนยอดขายสินค้าและมีเม็ดเงินที่ใช้ในการโฆษณาสูงขึ้น สำหรับหุ้นที่ติดดัชนี 5 อันดับแรก ได้แก่ PTTEP DELTA PTT KBANK และ BDMS

นักลงทุนต่างชาติยังคงเป็นผู้ขายสุทธิหลัก สวนทางกับนักลงทุนรายย่อยที่เป็นผู้ซื้อสุทธิหลักตามเดิม





ตลาดตราสารหนี้ไทย Yield Curve เปลี่ยนแปลงเล็กน้อยประมาณ 1 – 2 bps. โดยนักลงทุนต่างชาติมีสถานะเป็น NET OUTFLOW 521 ลบ.

ค่าเงินบาทเทียบสกุลดอลลาร์สหรัฐวันศุกร์ที่ผ่านมายังคงอ่อนค่าต่อเนื่อง โดยปิดที่ 34.72 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ เทียบกับวันก่อนหน้าที่ปิด 34.69 บาท/ดอลลาร์สหรัฐ




Thailand Indices

Index	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
SET Index	1530.84	-0.30%	1.05%	-0.85%	-6.31%	-8.26%
SET50 Index	924.72	-0.45%	0.57%	-1.05%	-5.04%	-8.01%
SET100 Index	2058.31	-0.43%	0.69%	-1.25%	-6.14%	-8.84%
MAI Index	484.38	-0.12%	0.75%	-5.04%	-14.11%	-17.08%

Market Turnover - SET

Investor type	Last	Cumulative					Trend
		1-W	1-M	3-M	YTD		
Foreign	MBaht (3,567)	(12,189)	(30,925)	(73,321)	(92,711)		
Institution	MBaht 1,288	9,188	28,398	43,509	32,594		
Proprietary	MBaht (12)	442	(2,063)	(11,516)	(5,190)		
Retail Customer	MBaht 2,291	2,560	4,589	41,328	65,307		

SET50 Index Futures Turnover

Investor type	Last	Cumulative					Trend
		1-W	1-M	3-M	YTD		
Future, Foreign	MContracts (12,038)	22,910	(30,060)	29,044	(192,792)		
Future, Institution	MContracts 4,915	(4,376)	18,668	32,029	50,515		
Future, Retail Customer	MContracts 7,123	(18,534)	11,392	(61,073)	142,277		

Source: Aspen



Market Outlook

⊕ คาด SET Index วันนี้ปรับตัวขึ้นผันผวน จากปัจจัยบวกต่างประเทศประเด็นการผิ
 หนดชำระหนี้สหรัฐฯคลี่คลาย หลังผู้เจรจาทั้งสองฝ่าย (ปธน. และประธานสภาฯ) ออกมา
 ชี้แจงความคืบหน้า และเตรียมเข้าสู่การอนุมัติของสภา และลงนามโดย ปธน. นอกจากนี้
 รมว.คลังสหรัฐฯยังได้ขยายเส้นตายการลงนามไปเป็น 5 มิ.ย. ส่งผลให้บาทอ่อน เรามอง
 เป็นบวกหุ้นกลุ่มส่งออก และหุ้นกลุ่มอิเล็กทรอนิกส์ ด้านราคาน้ำมันดิบ WTI +1.2%
 จากผลบวกคืบหน้าเจรจาหนี้ คลายกังวลเศรษฐกิจ หนุนหุ้นกลุ่มน้ำมัน-ปิโตรฯ อย่างไรก็ตาม
 ตามปัจจัยในประเทศยังมีประเด็นที่น่ากังวลหลายอย่าง ทั้งความชัดเจนในการจัดตั้ง
 รัฐบาลใหม่ การต่อรองตำแหน่งประธานสภาฯระหว่าง 2 พรรคใหญ่ที่ยังไม่ลงตัว รวมทั้ง
 ความเห็นของวาที่ รมว.คลัง ไม่ได้มีทิศทางในการเอื้อต่อตลาดทุนมากนัก โดยรวมจะยัง
 Overhang และกดดัน Fund flow ต่อไป ให้แนวรับดัชนีวันนี้ 1520 – 1525 จุด แนวต้าน
 1540 – 1551 จุด

⊕ กลยุทธ์การลงทุน: ชื้อเก็งกำไรหุ้นกลุ่มส่งออก และหุ้นกลุ่มอิเล็กทรอนิกส์

⊕ ประเด็นที่น่าจับตา: ความขัดแย้งระหว่างรัสเซีย-ยูเครน, การแพร่ระบาดของ COVID
 สายพันธุ์ใหม่, ความคืบหน้าในการจัดตั้งรัฐบาลไทย, ตัวเลขส่งออกไทย เดือน เม.ย. ,
 ความคืบหน้าการขยายเขตแดนหนี้สหรัฐฯ , คำกล่าวของ Powell, ประชุม OPEC+, ดัชนี
 PMI จีน – สหรัฐฯ



Strategy Daily Pick

SVI	มี Sentiment บวกจากหุ้นเทคโนโลยีต่างประเทศ
KSL	ราคาน้ำตาลปรับตัวขึ้น / ได้ประโยชน์เงินบาทอ่อนค่า
TU	ได้ประโยชน์เงินบาทอ่อนค่า / ส่งออกมีโอกาสผ่านจุดต่ำสุด

Fundamental Report

-

Ztock Daily

BEYOND:	Support 15.20 – 15.40	Resistance 15.90 – 16.50
PROEN:	Support 5.65 – 5.80	Resistance 6.15 – 6.35

Corporate Watch

⊕ (+) TLI จ่อเข้าคำนวณดัชนี SET50 รอบครึ่งหลังปีนี้ ล่าสุดมาร์เก็ตแคป 140,000 ล้านบาท เผยดอกเบี้ยนโยบายยังขึ้น รายได้ลงทุนดีกว่าปี 65 ช่วยดันกำไรปีนี้แตะ 10,000 ล้านบาท จากสถิติหุ้นที่จะเข้า SET50 ให้ผลตอบแทน 6-7% ก่อนมีผลบังคับใช้ 1-2 เดือน #นสพ.ข่าวหุ้น

⊕ (+) HFT ลงทุนขยายไลน์ผลิตล้อรถมอเตอร์ไซค์ รับคำสั่งผลิตล้อรถมอเตอร์ไซค์ ล็อตใหญ่ ควบคุมตลาดล้อรถจักรยานไฟฟ้าจีน อยู่ระหว่างขอ มอก. รัฐบาลจีน คาดส่งสินค้าล็อตแรก Q3/2566 ปลื้มยอดขายสินค้ามารจีนสูงหนุนกำไรขั้นต้นทั้งปีโตดีกว่า คาด #นสพ.ทันหุ้น

⊕ (+) SSP แยมศึกษาลงทุนโรงไฟฟ้าใหม่ คาดว่าในช่วงครึ่งหลังปี 2566 สรุบได้อย่างน้อย 2 ดีล ขนาดกว่า 100 เมกะวัตต์ เตรียมงบ 3-4 พันล้านบาท รองรับการลงทุนในปีนี้ ด้านแนวโน้มไตรมาส 2/2566 คาดโตดีกว่าไตรมาสแรก หลังเข้าไฮซีซั่นแดนแดง #นสพ.ทันหุ้น

⊕ (+) GULF เผยบริษัทร่วมทุนกับ Binance ได้รับใบอนุญาตประกอบธุรกิจศูนย์ซื้อขายสินทรัพย์ดิจิทัล และธุรกิจนายหน้าจากกระทรวงการคลังเรียบร้อยแล้ว เตรียมเปิดให้บริการระบบการซื้อขาย กระเป๋าเงินโทเคนดิจิทัล (Digital token wallets) และกระเป๋าเงินคริปโทเคอร์เรนซี (Cryptocurrency wallets) ไตรมาส 4/2566 #นสพ.ทัน



Economy Watch

⊕ (0/+) รัฐบาลเวียดนามเร่งแผน PDP8 เริ่มประมูลไตรมาส 3/66 รองรับการใช้ไฟ เพิ่มจากภาคอุตสาหกรรมและครัวเรือนปีละ 10,000 เมกะวัตต์ ทั้งวินด์ฟาร์ม-โซลาร์ฟาร์ม รวมทั้ง LNG to Power #นสพ.ข่าวหุ้น

⊕ (0/+) กระทรวงเกษตรสหรัฐฯ (USDA) ได้อนุญาตให้ไทยสามารถส่งออกส้มโอสดด้วยวิธีการฉายรังสีเข้าสู่สหรัฐอเมริกาได้เป็นครั้งแรก โดยได้อนุญาตให้นำเข้าส้มโอจากประเทศไทย แบบไม่จำกัดพันธุ์ #InfoQuest

⊕ (0/-) ตลาดกัญชาระล่ำ หลังก้าวไกล MOU ผลักดันนำกัญชาเข้าไปอยู่ในบัญชียาเสพติด วิสาหกิจชุมชนกุ่มขมับหัวนกระทบหนัก เผยสภาพตลาดดีมานด์ล้นดูบ-ลักลอบนำเข้าจากประเทศเพื่อนบ้านเพียบทำราคาร่วงต่อเนื่อง ล่าสุดโบลด์เหลือแค่กิโลละ 400-500 บาท ร้านอาหาร-เครื่องดื่ม ททยอยถอดเมนูกัญชา #นสพ.ประชาชาติธุรกิจ

⊕ (-) ประชาชนจ่อกระทัก "ขุนคลัง" ออกกฎกระทรวงเลิกอุ้มดีเซลลิตรละ 5 บาทที่จะสิ้นสุด 21 ก.ค.แล้ว เหตุให้เกียรติรัฐบาลใหม่ตัดสินใจ เพราะต้องใช้งบประมาณและกระทบจัดเก็บรายได้ สกนช.เชื่อไม่ปรับรวดเดียว #นสพ.ไทยโพสต์

⊕ (+/-) "ก้าวไกล" นัดหมาย 30 พ.ค.นี้ หรือ 8 พรรคร่วมจัดตั้งรัฐบาล โดยมีกระแสข่าวออกมาว่าจะแบ่งเค้กจัดสรรโควตารัฐมนตรี ตามสัดส่วน 8.6 ส.ส. ต่อ 1 แก์อัฐมนตรี โดย "ก้าวไกล" คุมกระทรวงด้านมั่นคง-คลัง ขณะที่ "เพื่อไทย" คุมกระทรวงเศรษฐกิจ #นสพ.กรุงเทพธุรกิจ

Global Watch

⊕ (+) ประธานาธิบดีโจ ไบเดน และนายเควิน แมคคาร์ธี ประธานสภาผู้แทนราษฎร สหรัฐฯ ได้แสดงความเชื่อมั่นว่า สภาคองเกรสจะอนุมัติข้อตกลงการปรับเพิ่มเพดานหนี้ และส่งต่อให้ปธน.ไบเดนลงนามบังคับใช้เป็นกฎหมาย ซึ่งจะช่วยให้สหรัฐฯสามารถหลีกเลี่ยงการผิดนัดชำระหนี้ครั้งประวัติศาสตร์ หลังจากปธน.ไบเดนและนายแมคคาร์ธีได้บรรลุข้อตกลงเบื้องต้นในการปรับเพิ่มเพดานหนี้เมื่อช่วงเย็นวันเสาร์ที่ผ่านมา #InfoQuest

⊕ (0/+) นางเจนเน็ต เบลเลน รัฐมนตรีคลังสหรัฐฯได้กำหนดวัน X-date ใหม่ โดยระบุว่าวันที่ 5 มิ.ย.เป็นวันที่สมาชิกสภาคองเกรสจะต้องทำข้อตกลงในการเพิ่มเพดานหนี้ มิฉะนั้นรัฐบาลสหรัฐฯจะเผชิญกับการผิดนัดชำระหนี้ในวันดังกล่าว หลังจากที่ยกก่อนหน้านี้ นางเบลเลนระบุวัน X-date เป็นวันที่ 1 มิ.ย. #InfoQuest

⊕ (0/-) ดัชนี PCE พื้นฐาน ซึ่งไม่นับรวมหมวดอาหารและพลังงาน และเป็นมาตรวัดเงินเฟ้อที่ FED ให้ความสำคัญปรับตัวขึ้น 4.7% ในเดือนเม.ย. เมื่อเทียบ #InfoQuest

⊕ (0/-) FedWatch Tool ของ CME Group บ่งชี้ว่า นักลงทุนให้น้ำหนัก 60% ที่เฟดจะปรับขึ้นอัตราดอกเบี้ย 0.25% สู่ระดับ 5.25-5.50% ในการประชุมวันที่ 13-14 มิ.ย. #InfoQuest

⊖ (0) ตลาดหุ้นสหรัฐฯปิดทำการในวันจันทร์ เนื่องในวัน Memorial Day #InfoQuest

Economic Calendar

Time	Currency	Event	Actual	Forecast	Last
Friday, May 26, 2023					
19:30	USD	ยอดคำสั่งซื้อสินค้าคงทน (เดือนต่อเดือน) (เม.ย.)	-0.20%	0.00%	0.30%
19:30	USD	ดัชนีราคาด้านการบริโภคส่วนบุคคล (PCE Price Index) (เดือนต่อเดือน) (เม.ย.)	0.40%	0.30%	0.30%
Tuesday, May 30, 2023					
21:00	USD	รายงานความเชื่อมั่นผู้บริโภคจากซีบี (CB Consumer Confidence) (พ.ค.)		99.00	101.30
Wednesday, May 31, 2023					
8:30	CNY	ดัชนี PMI ภาคการผลิตของจีน (พ.ค.)		51.40	49.20
19:30	EUR	คำกล่าวของ ลาการ์ด (Lagarde) ประธานธนาคารกลางยุโรป			
Thursday, June 1, 2023					
8:45	CNY	ดัชนี PMI ภาคการผลิตของจีนจากสถาบัน Caixin (พ.ค.)		50.30	49.50
16:00	EUR	ดัชนีราคาผู้บริโภค (CPI) (ปีต่อปี) (พ.ค.)		7.00%	7.00%
16:30	EUR	คำกล่าวของ ลาการ์ด (Lagarde) ประธานธนาคารกลางยุโรป			
19:15	USD	การเปลี่ยนแปลงในการจ้างงานภาคนอกภาคเกษตรกรรมจากเอดีพี (ADP) (พ.ค.)		170K	296K
19:30	USD	จำนวนคนที่ยื่นขอรับสวัสดิการว่างงานครั้งแรก		235K	229K
21:00	USD	ดัชนี PMI ภาคการผลิตจากสถาบันไอเอสเอ็ม (ISM) (พ.ค.)		47.00	47.10
22:00	USD	สินค้าคงคลังน้ำมันดิบ			-12,456M
Friday, June 2, 2023					
19:30	USD	การจ้างงานนอกภาคเกษตร (พ.ค.)		180K	253K
19:30	USD	อัตราการว่างงาน (พ.ค.)		3.50%	3.40%

Source: Investing.com



Global Indices

Index	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
Dow Jones	33093.34	1.00%	-1.00%	-0.63%	0.84%	-0.16%
NASDAQ	12975.69	2.19%	2.51%	9.46%	13.87%	23.97%
S&P500	4205.45	1.30%	0.32%	3.68%	5.93%	9.53%
JAPAN	30916.31	0.37%	0.35%	8.80%	12.61%	18.48%
KOREA	2558.81	0.16%	0.83%	2.98%	5.58%	14.42%
TAIWAN	16505.05	1.31%	2.04%	7.35%	6.46%	16.75%
HONG KONG	18746.92	0.00%	-3.62%	-5.11%	-6.31%	-5.23%
CHINA	3212.50	0.35%	-2.16%	-1.58%	-1.67%	3.99%
PHILLIPINES	6530.20	-0.46%	-2.02%	-0.15%	-2.33%	-0.55%
INDONESIA	6687.00	-0.26%	-0.20%	-3.23%	-2.47%	-2.39%
VIETNAM	1063.76	-0.08%	-0.31%	2.21%	2.33%	5.63%
INDIA	62501.69	1.02%	1.25%	3.65%	5.11%	2.73%
RUSSIA	1055.63	1.46%	1.84%	4.41%	15.48%	8.76%
GERMANY	15983.97	1.20%	-1.79%	1.19%	4.88%	14.80%
FRANCE	7319.18	1.24%	-2.31%	-1.98%	1.62%	13.06%

Source: Aspen

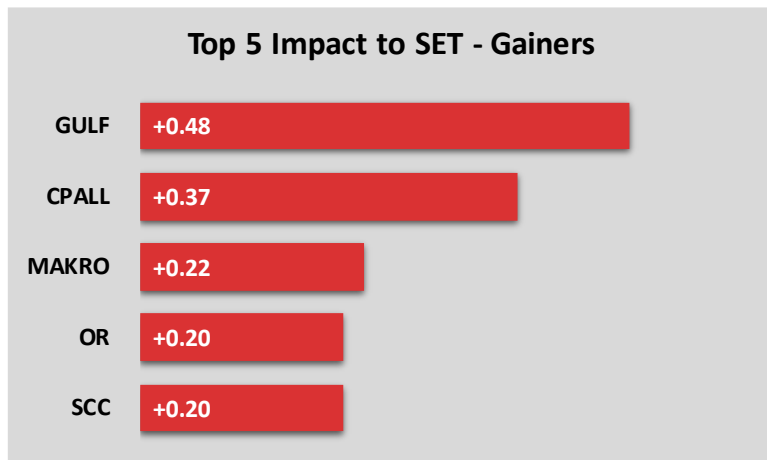
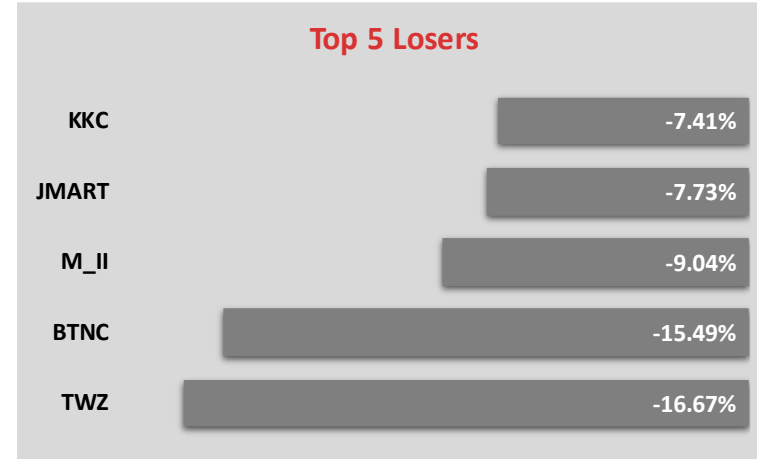
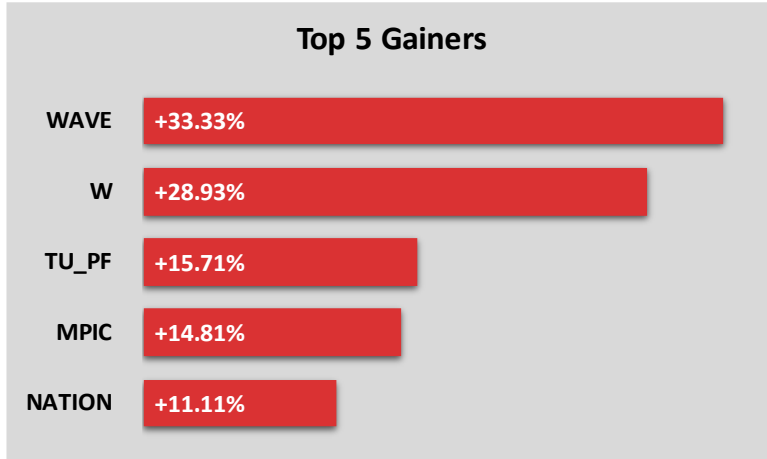
Commodity Price

Commodities	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
Crude WTI (\$/bbls)	72.67	1.17%	1.37%	-2.19%	-5.16%	-9.68%
Crude Brent (\$/bbls)	76.95	0.90%	1.81%	-0.99%	-7.09%	-10.43%
ICE Heating Oil Spot Month (\$/gallons)	2.36	0.38%	-0.30%	-0.59%	-15.44%	-28.44%
ICE RBOB Gasoline Spot (\$/gallons)	2.59	-3.10%	0.58%	3.10%	0.23%	4.43%
Newcastle Coal Spot Month (\$/tonnes)	140.65	0.11%	-13.31%	-26.03%	-31.14%	-63.90%
Baltic Dry Index	1,172.00	-3.54%	-15.32%	-23.70%	32.73%	-22.64%
CBOT Soybean Meal Spot (\$/S.tonnes)	403.20	1.36%	-1.47%	-5.62%	-19.07%	-15.74%
ICE Sugar No.11 Spot Month (\$/lbs)	25.37	2.17%	-1.59%	-1.59%	28.98%	26.60%
CBOT Rough Rice Spot Month (C./100weight)	17.08	2.86%	-0.38%	0.89%	1.64%	-5.11%
Gold Spot (\$/ounce)	1,946.13	0.27%	-1.58%	-2.13%	7.49%	6.72%

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

