

# Z.com

บริษัทหลักทรัพย์

## Morning Zstrategy

October 5, 2023



## Market Round Up

SET Index ปิดที่ระดับ 1451.25 จุด +3.95 จุด (+0.27%) โดยมีมูลค่าการซื้อขาย 5.1 หมื่นลบ. ดัชนีปรับตัวลงแรงในช่วงเปิดตลาดเช้าตามตลาดหุ้นสหรัฐฯที่ปรับตัวลงแรงในคืนก่อนหน้าจากความกังวลภาวะดอกเบี้ยขาขึ้นจะยาวนานกว่าคาดหลังมีการเผยตัวเลขภาคแรงงานแข็งแกร่งก่อนจะมีแรงซื้อกลับหนุนดัชนีรีบาวด์จาก Fund Flow ที่พลิกไหลกลับเข้ามาทั้งในตลาดหุ้นและตลาดอนุพันธ์หลังดัชนีปรับตัวลงมาแรงในวันก่อนจนเกิดสัญญาณ Oversold สำหรับหุ้นที่หนุนดัชนี 5 อันดับแรก ได้แก่ **BDMS PTTEP GULF CPALL และ SCB**

นักลงทุนต่างชาติพลิกกลับมาเป็นผู้ซื้อสุทธิตามนักลงทุนสถาบันและนักลงทุนรายย่อย สวนทางกับบัญชีบล.ที่ยังคงเป็นผู้ขายสุทธิ

ตลาดตราสารหนี้ไทย Yield Curve ปรับตัวขึ้นประมาณ 7 – 13 bps. ในตราสารระยะยาว โดยนักลงทุนต่างชาติมีสถานะเป็น NET OUTFLOW 3,050 ลบ.

ค่าเงินบาทเทียบสกุลดอลลาร์สหรัฐฯวานนี้พลิกกลับมาแข็งค่า โดยปิดที่ 36.88 บาท/ดอลลาร์สหรัฐฯ เทียบกับวันก่อนหน้าที่ 37.07 บาท/ดอลลาร์

### Thailand Indices

Index	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
SET Index	1451.25	0.27%	-3.07%	-6.29%	-4.23%	-13.03%
SET50 Index	886.30	0.07%	-3.64%	-6.56%	-4.50%	-11.83%
SET100 Index	1979.07	0.17%	-3.38%	-6.34%	-3.88%	-12.35%
MAI Index	440.58	1.06%	-2.94%	-8.15%	-5.98%	-24.58%

### Market Turnover - SET

Investor type	Last	Cumulative				
		1-W	1-M	3-M	YTD	Trend
Foreign	34	(6,706)	(25,579)	(52,854)	(162,247)	
Institution	281	305	(1,439)	9,416	52,010	
Proprietary	(918)	(1,369)	1,182	7,539	345	
Retail Customer	603	7,770	25,836	35,899	109,892	

### SET50 Index Futures Turnover

Investor type	Last	Cumulative				
		1-W	1-M	3-M	YTD	Trend
Future, Foreign	12,591	(61,709)	(148,862)	(118,419)	(311,448)	
Future, Institution	(1,388)	6,258	(6,531)	9,178	58,671	
Future, Retail Customer	(11,203)	55,451	155,393	109,241	252,777	

Source: Aspen



## Market Outlook

⊕ คาด SET Index วันนี้ผันผวน แม้มี Sentiment บวกจากการรีบาวด์ของตลาดหุ้นทั่วโลกจากการรายงานข้อมูลเศรษฐกิจสหรัฐฯที่พลิกเป็นลบ (ดัชนี PMI การจ้างงานภาคเอกชน) ฝอนคลายความกังวลประเด็นดอกเบี้ย ส่งผลให้ US 10-year bond yield อ่อนตัวลง อย่างไรก็ตาม ราคาน้ำมันดิบ WTI มีการปรับตัวลงอย่างรุนแรง -5.6% หลังการรายงานสต็อกน้ำมันดิบของ EIA เพิ่มขึ้นกว่าคาดการณ์ของตลาดหลายเท่า บ่งชี้ Demand ที่ซบเซา มากดดันหุ้นกลุ่มน้ำมัน-ปิโตรฯ และหักล้างปัจจัยบวกดังกล่าว อย่างไรก็ตาม ยังมองเป็นบวกต่อหุ้นที่มีต้นทุนอ้างอิงราคาน้ำมันและกำไรมีแนวโน้มเพิ่มขึ้นในช่วง 2H23 ต่อ ให้แนวรับดัชนี 1440 – 1445 จุด แนวต้าน 1460 – 1469 จุด

⊕ กลยุทธ์การลงทุน: สะสมหุ้นที่มีต้นทุนอิงราคาน้ำมัน หุ้นกลุ่มโรงพยาบาล

⊕ ประเด็นที่น่าจับตา: ความขัดแย้งระหว่างรัสเซีย-ยูเครน, ประเด็นการผิมนัดชำระหนี้ของ Evergrande, ตัวเลขภาคแรงงานสหรัฐฯ (ตัวเลขผู้ขอรับสวัสดิการรายสัปดาห์ / ตัวเลขจ้างงานนอกภาคเกษตร), ดัชนี PPI – CPI สหรัฐฯ, ดัชนี PPI – CPI ยุโรป

## Strategy Daily Pick

TOA	ได้ประโยชน์ราคาน้ำมันดิบลง
MENA	ได้ประโยชน์ราคาน้ำมันดิบลง / เตรียมชนส่งให้ CJ เพิ่มเติม
CHG	High Season ช่วงฤดูฝนหนุนยอดผู้ป่วย ดันกำไร 3Q23

## Fundamental Report

-

## Ztock Daily

MEGA:	Support 44.75 – 45.00	Resistance 46.25 – 47.50
RBF:	Support 10.90 – 11.10	Resistance 11.90 – 12.70



## Corporate Watch

⊖ (-) ADVANC บอร์ดกสทช.ตกเป็นเสียง ล่าสุดนัดประชุม 4 ต.ค. ล่มไม่เป็นท่า บอร์ดเสียงข้างมาก วอลท์เอาร์ท ปมขัดแย้งแต่งตั้งเลขาธิการคนใหม่ยากเกินเยียวยา ส่งผลกระทบต่อหุ้นแรงดีลควรวรวม AIS-3BB 3.2 หมิ่นล้านบาท ค้างเต็ง เลื่อนการพิจารณาไม่มีกำหนด ประชุมใหม่สัปดาห์หน้าต้องลุ้น #นสพ.ข่าวหุ้น

⊕ (+) EGCO ดีเดย์ 4 ต.ค. เปิดระบบขนส่งน้ำมันทางท่อไปยังภาคอีสานแล้ว ดันรายได้เพิ่มเฉลี่ยปีละ 1,400-2,500 ล้านบาท ป้อนกลุ่มบริษัทค้าปลีกน้ำมันทั่วอีสาน #นสพ.ข่าวหุ้น

⊕ (+) PRM ธุรกิจเรือขนส่งในประเทศเข้าสู่ไฮซีซั่น รวมกับเรือขนส่งปิโตรเคมีที่ให้บริการเพิ่มอีก 1 ลำ คาดมีกำไรพิเศษขายเรือ FSU 1 ลำ ประเมินกำไรสุทธิปี 66 แต่ 1.9 พันล้านบาท #นสพ.ข่าวหุ้น

⊕ (+) IMH เตรียมเปิดกระเป๋ารับทรัพย์ยอดบริการโรงพยาบาล IMH สีสลมเข้าไตรมาส 3/2566 เต็มที่ มั่นใจรายได้ปีนี้แตะ 800 ล้านบาทตามนัด แยมแผนเทกโอเวอร์ ปิดดีล รพ.แห่งใหม่ 1 แห่ง ชัดเจนปี 2567 พร้อมปักเป้าดันรายได้ชน 1.2 พันล้านบาท #นสพ.ทันหุ้น

⊕ (+) BCP กดปุ่มเปิดปั๊มก๊าซ LNG แห่งแรกในไทย เตรียมจับมือผู้ประกอบการขนส่งขยายทั้ง 4 ภาค #InfoQuest

## Economy Watch

⊕ (0/+) รพม.เร่งศึกษาเดินรถสายสีม่วงใต้แบบ PPP ชงบอร์ดปลายปีนี้ คาดเจรจา BEM คุ่มค่ากว่าเปิดประมูล #InfoQuest

⊕ (0/-) ภาคธุรกิจท่องเที่ยวมองเหตุยิงกลางห้างสยามพารากอนวานนี้ จนเป็นเหตุให้มีผู้เสียชีวิต 2 ราย เป็นนักท่องเที่ยวจีน และชาวเมียนมา ส่งผลกระทบต่อความเชื่อมั่นและภาคการท่องเที่ยวในระยะสั้น โดยคาดว่านักท่องเที่ยวต่างชาติจะหายไปราว 1 ล้านคน กระทบเป้าหมายทั้งปีที่คาดว่าจะมีนักท่องเที่ยว 29-30 ล้านคน สร้างความเสียหายทางเศรษฐกิจไม่ต่ำกว่า 50,000 ล้านบาท #InfoQuest





## Global Watch

⊕ (-/+) ADP เปิดเผยว่า การจ้างงานของภาคเอกชนสหรัฐเพิ่มขึ้นเพียง 89,000 ตำแหน่งในเดือนก.ย. ซึ่งต่ำกว่าที่นักวิเคราะห์คาดการณ์ไว้ที่ระดับ 160,000 ตำแหน่ง และต่ำกว่าตัวเลขการจ้างงานที่เพิ่มขึ้น 180,000 ตำแหน่งในเดือนส.ค. #InfoQuest

⊕ (0/+) กระทรวงพาณิชย์สหรัฐเปิดเผยว่า คำสั่งซื้อภาคโรงงานของสหรัฐพุ่งขึ้น 1.2% ในเดือนส.ค. สูงกว่าที่นักวิเคราะห์คาดว่าจะเพิ่มขึ้นเพียง 0.2% หลังจากลดลง 2.1% ในเดือนก.ค. #InfoQuest

⊕ (0/+) สถาบันจัดการด้านอุปทานของสหรัฐ (ISM) รายงานว่า ดัชนีภาคบริการของสหรัฐปรับตัวลงสู่ระดับ 53.6 ในเดือนก.ย. สอดคล้องกับตัวเลขคาดการณ์ของนักวิเคราะห์ จากระดับ 54.5 ในเดือนส.ค.#InfoQuest

⊕ (-) สำนักงานสารสนเทศด้านการพลังงานของรัฐบาลสหรัฐ (EIA) เปิดเผยว่า สต็อกน้ำมันเบนซินพุ่งขึ้น 6.5 ล้านบาร์เรลในสัปดาห์ที่แล้ว ซึ่งมากกว่าที่นักวิเคราะห์คาดว่าจะเพิ่มขึ้นเพียง 200,000 บาร์เรล #InfoQuest

⊕ (0/-) เอสแอนด์พี โกลบอลเปิดเผยว่า ดัชนีผู้จัดการฝ่ายจัดซื้อ (PMI) ภาคบริการขั้นสุดท้ายของสหรัฐ ลดลงสู่ระดับ 50.1 ในเดือนก.ย. ต่ำกว่าตัวเลขเบื้องต้นที่ระดับ 50.2 จากระดับ 50.5 ในเดือนส.ค. โดยดัชนี PMI โกลด์หลูระดับ 50 ซึ่งหากต่ำกว่าระดับดังกล่าวจะบ่งชี้ภาวะหดตัวในภาคบริการของสหรัฐ #InfoQuest

### Economic Calendar

Time	Currency	Event	Actual	Forecast	Last
Wednesday, October 4, 2023					
19:15	USD	การเปลี่ยนแปลงในการจ้างงานภาคเอกชนนอกภาคเกษตรกรรมจากเดีพี (ADP) (ก.ย.)	89K	153K	180K
20:45	USD	ดัชนีผู้จัดการฝ่ายจัดซื้อ (PMI) ภาคการบริการ (ก.ย.)	50.10	50.20	50.50
21:00	USD	ดัชนี PMI ภาคการบริการจากสถาบันไอเอสเอ็ม (ISM) (ก.ย.)	53.60	53.60	54.50
21:30	USD	สินค้าคงคลังน้ำมันดิบ	-2.224M	-0.446M	-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	การจ้างงานนอกภาคเกษตร (ก.ย.)		163K	187K
19:30	USD	อัตราว่างงาน (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%
Thursday, October 12, 2023					
19:30	USD	ดัชนีราคาผู้บริโภคพื้นฐาน (Core CPI) (เดือนต่อเดือน) (ก.ย.)			0.30%
19:30	USD	ดัชนีราคาผู้บริโภค (CPI) (ปีต่อปี) (ก.ย.)			3.70%
19:30	USD	ดัชนีราคาผู้บริโภค (CPI) (เดือนต่อเดือน) (ก.ย.)			0.60%
19:30	USD	จำนวนคนที่ยื่นขอรับสวัสดิการว่างงานครั้งแรก			

Source: Investing.com



Global Indices

Index	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
Dow Jones	33129.55	0.39%	-1.25%	-4.90%	-3.74%	-0.05%
NASDAQ	13236.01	1.35%	1.09%	-5.67%	-4.20%	26.46%
S&P500	4263.75	0.81%	-0.25%	-5.58%	-4.31%	11.05%
JAPAN	30526.88	-2.28%	-5.70%	-7.32%	-8.66%	16.99%
KOREA	2405.69	-2.41%	-2.41%	-6.92%	-7.23%	7.57%
TAIWAN	16273.38	-1.10%	-0.23%	-3.08%	-5.06%	15.11%
HONG KONG	17195.84	-0.78%	-2.36%	-8.75%	-11.43%	-13.07%
CHINA	3110.48	0.00%	0.10%	-2.10%	-4.16%	0.69%
PHILLIPINES	6298.20	-0.12%	-1.20%	1.34%	-3.32%	-4.08%
INDONESIA	6886.58	-0.78%	-0.74%	-1.57%	3.07%	0.52%
VIETNAM	1128.67	0.95%	-2.18%	-7.79%	-0.29%	12.07%
INDIA	65226.04	-0.44%	-1.35%	-0.61%	-0.39%	7.21%
RUSSIA	991.35	-0.24%	-0.79%	-6.78%	0.40%	2.14%
GERMANY	15099.92	0.10%	-0.77%	-4.58%	-5.86%	8.45%
FRANCE	6996.73	-0.00%	-1.06%	-3.88%	-5.06%	8.08%

Source: Aspen

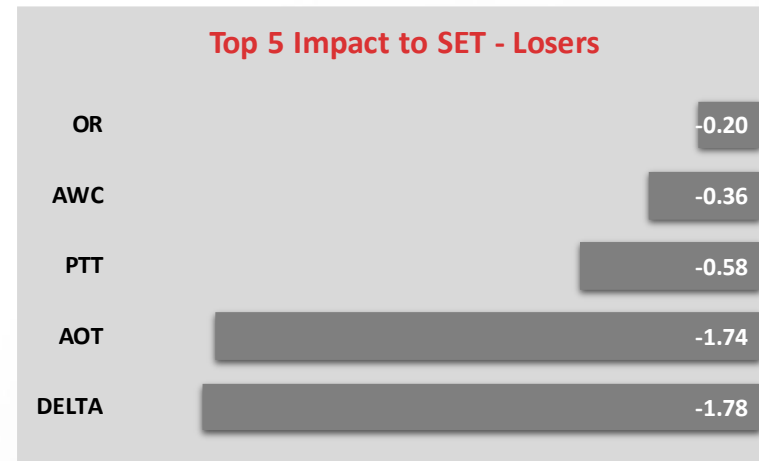
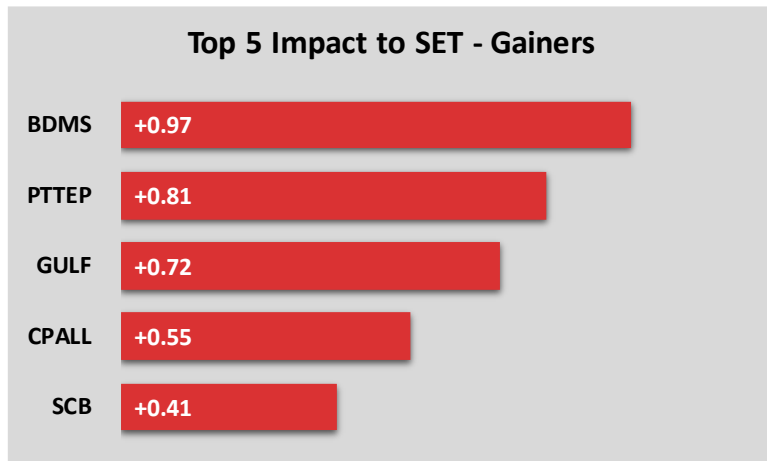
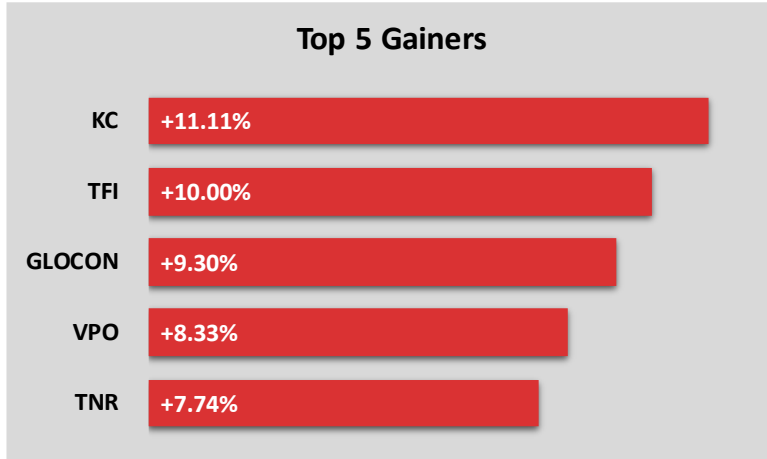
Commodity Price

Commodities	Last	%Change				
		1-D	1-W	1-M	3-M	YTD
Crude WTI (\$/bbls)	84.22	-5.61%	-10.10%	-1.99%	18.09%	4.67%
Crude Brent (\$/bbls)	85.81	-5.62%	-9.06%	-3.58%	12.54%	-0.12%
ICE Heating Oil Spot Month (\$/gallons)	3.02	-5.54%	-7.48%	-3.95%	23.64%	-8.30%
ICE RBOB Gasoline Spot (\$/gallons)	2.20	-6.86%	-13.80%	-15.56%	-12.71%	-11.41%
Newcastle Coal Spot Month (\$/tonnes)	144.65	-3.34%	-10.43%	-7.60%	1.05%	-62.87%
Baltic Dry Index	1,778.00	-0.11%	1.48%	64.17%	70.31%	17.36%
CBOT Soybean Meal Spot (\$/S.tonnes)	367.70	1.52%	-5.72%	-11.10%	-12.20%	-23.16%
ICE Sugar No.11 Spot Month (\$/lbs)	25.93	1.01%	-1.67%	0.46%	11.19%	29.39%
CBOT Rough Rice Spot Month (C./100weight)	15.67	-0.54%	-3.15%	-5.89%	-14.31%	-12.95%
Gold Spot (\$/ounce)	1,820.90	-0.09%	-2.88%	-6.06%	-5.40%	-0.15%

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

